

삼성KODEX S&P500선물증권상장지수투자신탁[주식-파생형](H)(펀드 코드: B2984)

투자 위험 등급 2등급(높은 위험)					
1	2	3	4	5	6
매우 높은 위험	높은 위험	다소 높은 위험	보통 위험	낮은 위험	매우 낮은 위험

삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 **실제 수익률 변동성**을 감안하여 **2등급**으로 분류하였습니다.

집합투자증권은 『예금자보호법』에 따라 **예금보험공사가 보호하지 않는 실적배당상품**입니다.

해당 집합투자기구는 **해외주식 및 해외주식관련 장내파생상품**을 주된 투자대상으로 하고 신탁재산의 **60% 이상**을 투자하되, 신탁재산의 10%를 초과하여 위험회피 외의 목적으로 파생상품에 투자하여 해외주식 및 파생상품 투자에 따른 **환율변동위험, 파생상품투자위험**, 기초지수를 추종하는 전략에 따른 **추적오차 발생위험 등이 있으므로 투자에 신중**을 기하여 주시기 바랍니다.

이 요약정보는 삼성KODEX S&P500선물증권상장지수투자신탁[주식-파생형](H)의 투자설명서의 내용 중 중요사항을 발해·요약한 핵심정보를 담고 있습니다. 따라서 자세한 정보가 필요하신 경우에는 **동 집합투자증권을 매입하기 이전에 투자설명서를 반드시 참고하시기 바랍니다.**

[요약정보]

투자목적 및 투자전략 이 투자신탁은 해외주식 및 해외주식관련 장내파생상품을 주된 투자대상으로 하고, 신탁재산의 60% 이상 투자하되, 신탁재산의 10%를 초과하여 위험회피 외의 목적으로 파생상품에 투자하여 1과당 순자산가치의 변동률을 기초지수인 S&P500 Futures Total Return지수의 변동률과 유사하도록 투자신탁재산을 운용합니다.

분류 투자신탁, 증권(주식파생형), 개방형(중도환매가능), 추가형(추가납입가능), 상장지수투자신탁

명칭	투자자가 부담하는 수수료, 총보수 및 비용				1,000만원 투자시 투자자가 부담하는 투자기간별 총보수·비용 예시 (단위: 천원)					
	판매수수료	총보수	판매보수	동종유형 총보수	총 보수·비용	1년	2년	3년	5년	10년
삼성KODEX S&P500선물증권상장지수투자신탁[주식-파생형](H)	없음	0.250%	0.020%		0.306%	31	62	95	166	377

- (주1) 구체적인 투자비용은 '투자설명서' 제2부, 집합투자기구에 관한 사항 중 13. 보수 및 수수료에 관한 사항'을 참고하시기 바랍니다.
- (주2) '**동종유형 총보수**'는 한국금융투자협회에서 공시하는 동종유형 집합투자기구 전체의 평균 총보수비용을 의미합니다.
- (주3) '1,000만원 투자시 투자자가 부담하는 투자기간별 총비용 예시'는 투자자가 1,000만원을 투자했을 경우 향후 투자기간별 지불하게 되는 총비용 (판매수수료 + 총보수비용)을 의미합니다. 선취판매수수료 및 총보수·비용은 일정하고, 이익금은 모두 제투자하며, 연간 투자수익률은 5%로 가정하되, 기타비용(증권거래 비용 및 금융비용 제외)의 변동, 보수의 인상 또는 이하 여부 등에 따라 실제 부담하게 되는 보수 및 비용이 달라질 수 있습니다.

명칭	최초설정일	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일 이후
		20/05/12~21/05/11	19/05/12~21/05/11	18/05/12~21/05/11	16/05/12~21/05/11	
삼성KODEX S&P500선물증권상장지수투자신탁[주식-파생형](H)	2015-05-27	43.76	20.87	15.59	15.18	12.41
비교지수(%)	2015-05-27	44.61	22.42	17.19	16.71	13.81
수익률 변동성(%)	2015-05-27	16.64	23.63	21.30	17.97	17.98

- 비교지수 : S&P500 Futures Total Return Index*100(비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음)
- 연평균 수익률은 해당 기간동안의 누적수익률을 기하평균방식으로 계산한 것으로 집합투자기구 총비용 지급후 해당기간동안의 세전평균 수익률을 나타내는 수치입니다.
- 수익률 변동성(표준편차)은 해당기간 펀드의 연환산 중간수익률이 평균수익률에서 통상적으로 얼마만큼 등락했는지를 보여주는 수치로서, 변동성이 높을수록 수익률 등락이 빈번해 펀드의 손실위험이 높다는 것을 의미합니다.

성명	생년	직위	운용현황		동종집합투자기구 연평균 수익률(과생형)				운용 경력년수
			집합투자 기구 수	운용규모	운용역		운용사		
					최근1년	최근2년	최근1년	최근2년	
이태규	1987	책임(Associate)	16개	9,404억원	19.47%	17.32%	50.55%	27.88%	0년 11개월

**운용전문
인력**

- 상기업은 이 투자신탁의 투자전략 수립 및 투자사결정 등에 주도적·핵심적 역할을 수행하는 운용전문인력입니다.
- 운용중인 다른 집합투자기구 중 성과보수가 약정된 집합투자기구 : 해당사항없음
- 위의 집합투자기구 수에는 모자형투자신탁의 모투자신탁은 포함되어 있지 않습니다.
- 운용전문인력의 최근 과거 3년 이내에 운용한 집합투자기구의 명칭, 집합투자계산의 규모와 수익률 등은 금융투자협회 홈페이지(www.kofia.or.kr)에서 확인할 수 있습니다.
- 동종집합투자기구 연평균 수익률은 해당 집합투자업자가 분류한 동일 유형 집합투자기구의 평균운용성과이며, 해당 운용전문인력의 평균운용성과는 해당 회사 근무기간 중 운용한 성과를 의미합니다.
- '운용경력년수'는 해당 운용전문인력이 과거 집합투자기구를 운용한 기간을 모두 합산한 기간입니다.

**투자자
유의사항**

- 집합투자증권은 『예금자보호법』에 따라 예금보험공사가 보호하지 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 가하여 주시기 바랍니다.
- 금융위원회가 투자설명서의 기재사항이 진실 또는 정확하다는 것을 인정하거나 그 증권의 가치를 보증 또는 승인하지 아니함을 유의하시기 바랍니다.
- 간이투자설명서보다 자세한 내용이 필요하시어 투자설명서의 교부를 요청하시면 귀하의 집합투자증권 매입 이전까지 교부하오니 참고하시기 바랍니다.
- 간이투자설명서는 증권신고서 효력발생일까지 기재사항 중 일부가 변경될 수 있으며, 개방형 집합투자증권인 경우 효력발생일 이후에도 변경될 수 있습니다.
- 이 집합투자증권의 투자위험등급을 확인하시고, 귀하의 투자 경력이나 투자성향에 적합한 상품인지 신중한 투자결정을 하시기 바랍니다.
- 증권신고서, 투자설명서상 기재된 투자전략에 따른 투자목적 또는 성과목표는 반드시 실현된다는 보장은 없습니다. 또한 과거의 투자실적이 장래에도 실현된다는 보장은 없습니다.
- 집합투자기구가 설정 후 1년이 경과하였음에도 설정액이 50억원 미만(소규모펀드)인 경우 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하거나 임의해지될 수 있으니, 투자 시 소규모펀드 여부를 확인하시기 바라며 소규모펀드 해당여부는 금융투자협회, 판매회사, 자산운용사 홈페이지에서 확인할 수 있습니다.


**주요투자
위험**

구분	투자위험의 주요내용
환율변동위험	이 투자신탁은 통화관련 파생상품 거래(이중 통화간 교차 헷지, 기타 상관관계가 높은 통화를 활용한 헷지를 포함)를 통해 환위험을 회피하는 것을 목표로 하고, 미 실현 손익에 대해서는 주기적으로 환 헷지 비율을 조정하여 최대한 환 위험을 회피하고자 합니다. 그러나 관련 시장 규모, 거래비용, 투자수단의 유용성, 시장간의 시차, 관련 시장의 교란 및 전세계 거시 경제적인 기타 변수등에 따라 환 위험을 회피하기 곤란한 경우에는 일부 또는 전체에 대하여 환 위험에 노출될 수 있습니다. 또한 환헷지를 하는 경우에도 투자신탁 설정·해지의 반복, 가격변동, 최소 환헷지거래규모 등으로 인하여, 이 투자신탁에서 투자하는 외화자산의 환위험에 대하여 100% 헷지를 하는 것은 불가능하기 때문에 투자신탁 순자산액±일정 범위에서 환헷지가 이루어집니다. 이에 따라 환헷지를 하는 경우에도 투자신탁 순자산액에 미달되거나 초과되는 부분은 환율변동위험에 노출됩니다.
차익거래 불가능위험	해외 지수를 추적대상지수로 하는 증권상장지수투자신탁은 한국거래소와 해외 증권거래소의 영업일이 일치하지 않을 경우 결제기간의 차이로 인해 차익거래가 불가능하며 아울러 한국거래소의 개장시간과 해외 증권거래소의 개장시간의 차이로 인해 한국거래소의 개장시간임에도 불구하고 해외 증권거래소가 개장되지 않은 경우가 발생하며 이 시간대에는 차익거래가 불가능합니다.
가격산출 중단 위험	이 투자신탁이 추적하는 기초가격의 산출이 중단되어 집합투자업자의 최선의 노력에도 불구하고 기존의 투자전략으로 더 이상 그 기초가격을 추적할 수 없는 상황이 발생하거나, 기초가격 발표기관의 사정 또는 기타 피치 못할 사정으로 인하여 가격의 발표가 중단되는 경우에는 그로 인하여 이 투자신탁의 운용이 중단되고, 상장 폐지 및 이 투자신탁의 전부해지가 발생할 수도 있습니다. 이러한 경우가 발생할 때에는 이로 인하여 수익자는 기대하지 아니한 손실이 발생할 수도 있습니다.
ETF 거래가격과 순자산가치(NAV)와의 괴리 위험	한국거래소에 상장되어 있는 ETF의 경우 경쟁매매를 통해 ETF의 거래가격이 결정되기 때문에 1좌당 거래가격이 1좌당 NAV에 비해 높거나 낮은 수준에서 거래될 수 있습니다. 이로 인해 투자자는 1좌당 NAV와 일치하지 않는 ETF를 매수 또는 매도할 수 있으며 이러한 거래로 인해 손실이 발생할 수 있습니다.
Total Return투자 위험	이 투자신탁의 기초지수는 S&P 500 Index 관련 Futures의 롤링효과(Rolling Effect)가 감안되는 Total Return 지수이며 Total Return은 투자신탁 성과에 영향을 주게 됩니다. 따라서, 실제 운용환경 및 각 시장환경에 따라 초과적인 비용(Rolling Cost)이 발생할 수 있으며 단기적으로 급격한 신탁재산 가치변동을 초래할 수 있습니다. 그리고, 선물시장에서 원물물의 가격이 최근원물보다 가격이 높은 Contango상황이 지속될 경우 Rolling Effect는 지속적으로 (-)의 손실을 발생시킬 수 있고 시장 국면이 지속적으로 변경되는 국면에서는 손실폭이 커질 수도 있습니다. 극단적으로는 현물가격은 상승하였으나, 파생상품의 성과는 손실이 발생할 수도 있고, 반대로 현물가격은 하락하였으나 파생상품의 성과는 이익이 발생하는 상반된 손익을 실현할 수도 있습니다. 그러나, 이러한 Rolling Effect는 사전적으로 결정되지 않으며 선물시장 원물별 가격 곡선(Curve)가 높은 변동성을 보임에 따라 사후적으로 결정되는 경향이 높습니다.

**매입
방법
환매
수수료**

개인투자자 : 장내 매수 법인투자자 : 장내 매수, 설정 청구	환매 방법	개인투자자 : 장내 매도 법인투자자 : 장내 매도, 환매 청구
없음		

기준가	산정방법	당일에 공고되는 기준가격은 그 직전일의 대차대조표상에 계산된 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 차감한 금액(이하 "순자산총액"이라 한다)을 직전일의 수익증권 총 좌수로 나누어 1좌 단위로 4사5입하여 원미만 둘째 자리까지 계산합니다. 이 투자신탁의 기준가격은 1좌당 가격으로 공고합니다.
	공시장소	판매회사 또는 지정참가회사 영업점, 집합투자업자(http://www.samsungfund.com)·판매회사 또는 지정참가회사·한국금융투자협회(www.kofia.or.kr), 증권시장 인터넷홈페이지
과세	구분	과세의 주요내용
	집합투자기구	집합투자기구 단계에서는 별도의 소득과세 부담이 없는 것이 원칙 입니다.
	수익자	거주자와 일반법인이 받는 집합투자기구로부터의 과세 이익에 대해서는 15.4%(지방소득세 포함) 세율로 원천징수 됩니다. 단, 연간 금융소득합계액이 기준금액을 초과하는 경우에는 기준금액을 초과하는 금액을 다른 종합소득과 합산하여 개인소득세율로 종합과세 됩니다. * 세계혜택계좌 등 투자자의 과세에 관한 사항은 투자설명서 제2부, 14. 이익 배분 및 과세에 관한 사항을 참고하시기 바랍니다.
전환절차 및 방법	1. 이연판매보수(CDSC) 적용기준 및 내용 - 해당사항없음 2. 전환형 구조 - 해당사항 없음	
집합투자업자	삼성자산운용주식회사 (대표전화:02-3774-7600, 콜센터:080-377-4777)	
모집기간	2015년 5월 18일부터 모집을 개시하며 모집개시일 이후 특별한 사정이 없는 한 계속하여 모집할 수 있습니다.	모집·매출 총액 10조좌
효력발생일	2021. 5. 18	존속기간 해당사항 없음
판매회사	집합투자업자(http://www.samsungfund.com) 및 금융투자협회(www.kofia.or.kr) 홈페이지 참조	
참조	집합투자업자의 사업목적, 요약 재무정보에 관한 사항은 투자설명서 제4부, 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항을 참조하시기 바랍니다.	

[집합투자기구 공시 정보 안내] ● 증권신고서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr) ● 투자설명서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr), 한국금융투자협회(dis.kofia.or.kr) 집합투자업자(http://www.samsungfund.com) 및 판매회사 홈페이지 ● 정기보고서(영업보고서, 결산서류) : 금융감독원 홈페이지(www.fss.or.kr) 및 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) ● 자산운용보고서 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(http://www.samsungfund.com) ● 수시공시 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(http://www.samsungfund.com)		
---	--	---