

정 정 신 고 (보 고)

2024년 5월 29일

1. 정정대상 공시서류 : 일괄신고서
삼성당신을위한삼성그룹밸류인덱스증권자투자신탁제1호[주식]
2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2009년 4월 29일
3. 정정 내용 :
 - BM 변경, 모투자신탁 BM변경
 - 정기 결산으로 인한 갱신(위험등급 분류기준 개편안(97.5% VaR) 반영, 재무정보 확정)
 - 기업공시서식 개정 반영
4. 정정요구 · 명령 관련 여부 : 아니오
5. 정정사항

| 항 목 | 정 정 전 | 정 정 후 | | | | |
|--------------------|--|--|-------|------|------------|--------------|
| 요약정보 | | | | | | |
| 투자비용 | - | 업데이트 | | | | |
| 투자실적 추이 | - 비교지수 : WISE삼성그룹밸류인덱스*95% + 콜금리*5% (비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음) | 업데이트 비교지수 : WISE삼성그룹밸류인덱스*100%(비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음)(상기의 비교지수는 2024년 6월 5일자로 변경되었으며, 2024년 6월 5일 이전의비교지수 수익률은 변경 전 비교지수를 기준으로 작성되었습니다. 변경 전 비교지수는WISE삼성그룹밸류인덱스*95% +콜금리*5% 입니다.) | | | | |
| 운용전문인력 | - | 업데이트 | | | | |
| 제2부. 집합투자기구에 관한 사항 | | | | | | |
| 2. 집합투자 기구의 연혁 | (추 가) | <table><tr><td>변경시행일</td><td>변경사항</td></tr><tr><td>2024. 6. 5</td><td>BM 변경, 모투자신탁</td></tr></table> | 변경시행일 | 변경사항 | 2024. 6. 5 | BM 변경, 모투자신탁 |
| | | 변경시행일 | 변경사항 | | | |
| 2024. 6. 5 | BM 변경, 모투자신탁 | | | | | |

| 항 목 | 정 정 전 | 정 정 후 | | | | | | | | |
|---------------------------------|---|---|--------|--|--------------------------------|--|--|---------|-------------|---------|
| | | | 탁 BM변경 | | | | | | | |
| 5. 운용전문인력 | - | 업데이트 | | | | | | | | |
| 9. 집합투자기구의 투자전략, 투자방침 및 수익 구조 | 가. 투자 전략 및 위험 관리 (2) 이 투자신탁의 성과 비교 등을 위해 아래와 같은 비교지수를 사용하고 있으며, 집합투자업자는 ____ 비교지수로서 적합하지 않는 상황이 발생할 것으로 판단되는 경우 다른 지수로 변경할 수 있습니다. 이 경우 이 투자신탁의 등록사항을 변경한 후 법령에서 정한 절차(수시공시 등)에 따라 공시될 예정입니다. · 비교지수: WISE삼성그룹밸류인덱스*95% +콜금리*5% | 가. 투자 전략 및 위험 관리 (2) 이 투자신탁의 성과 비교 등을 위해 아래와 같은 비교지수를 사용하고 있으며, 집합투자업자는 ____ 비교지수로서 적합하지 않는 상황이 발생할 것으로 판단되는 경우 다른 지수로 변경할 수 있습니다. 이 경우 이 투자신탁의 등록사항을 변경한 후 법령에서 정한 절차(수시공시 등)에 따라 공시될 예정입니다. · 비교지수: WISE삼성그룹밸류인덱스*100% | | | | | | | | |
| 10. 집합투자기구의 투자위험 | 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 - 이 투자신탁은 설정 후 3년이 경과하였으므로 실제 수익률 변동성을 감안하여 투자위험 등급을 산정하였습니다. 추후 매 결산 시마다 수익률 변동성을 다시 측정하게 되며, 이 경우 투자위험 등급이 변동될 수 있습니다. · 주2) 이 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 실제 연환산 표준편차는 16.78%입니다. | 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 - 이 투자신탁은 설정 후 3년이 경과하였으므로 일간 수익률의 최대손실예상액(97.5% VaR 모형 사용)을 감안하여 투자위험 등급을 산정하였습니다. 추후 매 결산 시마다 일간 수익률의 최대손실 예상액을 다시 측정하게 되며, 이 경우 투자위험 등급이 변동될 수 있습니다. 주2) 이 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 97.5% VaR는 34.84%입니다. | | | | | | | | |
| 11. 매입, 환매, 전환 절차 및 기준가격 적용 기준 | 나. 환매 (추 가) | 나. 환매 (9) 환매 가능 여부 및 수수료 부과에 관한 사항 이 투자신탁은 중도환매를 허용하는 투자신탁입니다. <table><tr><td colspan="3">수익증권의 중도환매 및 수수료 부과에 따른 3단계 구분</td></tr><tr><td>중도환매 불가</td><td>중도환매시 비용 발생</td><td>중도환매 가능</td></tr></table> | | | 수익증권의 중도환매 및 수수료 부과에 따른 3단계 구분 | | | 중도환매 불가 | 중도환매시 비용 발생 | 중도환매 가능 |
| 수익증권의 중도환매 및 수수료 부과에 따른 3단계 구분 | | | | | | | | | | |
| 중도환매 불가 | 중도환매시 비용 발생 | 중도환매 가능 | | | | | | | | |
| 13. 보수 및 수수료에 관한 사항 | - | 업데이트 | | | | | | | | |
| 제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항 | | | | | | | | | | |
| 1. 재무정보 2.연도별설정 및 환매 현황 | - | 업데이트 | | | | | | | | |
| 3. 집합투자기구의 운용실적 | 주1) 비교지수 : WISE삼성그룹밸류인덱스*95% +콜금리*5% | 주1) 비교지수 : WISE삼성그룹밸류인덱스*100% (상기의 비교지수는 2024년 6월 5일자로 변경되었으며, 2024년 6월 5일 이전의 비교지수 수익률은 변경 전 비교지수를 기준으로 작성되었습니다. 변경 전 비교지수는WISE삼성그룹밸류인덱스*95% + 콜금리*5% 입니다.) | | | | | | | | |
| 제4부. 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항 | | | | | | | | | | |
| 1. 집합투자업자에 관한 사항 | 라. 운용자산 규모 - | 라. 운용자산 규모 업데이트 | | | | | | | | |