

# 정 정 신 고 (보 고)

2020년 8월 5일

## 1. 정정대상 공시서류 : 일괄신고서

삼성KOSPI200인버스인덱스증권투자신탁 제1호[채권-파생형]

## 2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2009년 4월 17일

## 3. 정정사유 :

- 정기 결산으로 인한 갱신(위험등급 및 표준편차 변동, 재무정보 확정)
- 전자증권 및 시행령 개정사항 반영(파생상품 위험평가액 한도 100%→>200%)

## 4. 정정사항

항 목	정 정 전	정 정 후	
표지	투자 위험 등급: <b>3등급(다소 높은 위험)</b> 삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 실제 수익률 변동성을 감안하여 <b>3등급</b> 으로분류하였습니다.	투자 위험 등급: <b>2등급(높은 위험)</b> 삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 실제 수익률 변동성을 감안하여 <b>2등급</b> 으로분류하였습니다.	
요약정보			
투자비용	-	업데이트	
투자실적 추이	-	업데이트	
운용전문인력	-	업데이트	
제2부. 집합투자기구에 관한 사항			
2. 집합투자기구의 연혁	(추 가)	변경시행일	변경 사항
		2020.8.12	시행령 개정사항 반영(파생상품 위험평가액 한도 변경)
5. 운용전문인력	-	업데이트	
8. 집합투자기구의	가. 투자 대상 (신 설)	가. 투자 대상 집합투자업자는 투자신탁재산을 다음의 투자대상	

항 목	정 정 전	정 정 후																				
투자대상	<table><tr><td>투자대상</td><td>투자대상 세부설명</td></tr><tr><td>장내파생상품</td><td>법 제5조제2항에 의한 장내파생상품 *이 투자신탁에서 투자하는 다른 파생상품을 포함하여 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 100 이하가 되도록 함</td></tr><tr><td>집합투자증권</td><td>법 제110조에 의하여 신탁업자가 발행한 수익증권, 법제9조제21항에서 규정한 집합투자증권, 수익증권 또는 집합투자증권과 동일하거나 유사한 것으로서 외국 통화로 표시되어 외국에서 발행 또는 창설되거나 유통되는 것</td></tr></table> <p>※ 위의 1),2),3),4)의 투자의 합(양도성 예금증서는 제외)의 합은 투자신탁 자산총액의 100분의 50을 초과하여야 함. 다만, 투자신탁의 최초 설정일로부터 1개월간은 투자비율을 적용하지 아니함.</p> <p>나. 투자 제한</p> <table><tr><td>구분</td><td>투자제한의 내용</td></tr><tr><td>파생상품매매</td><td>파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 100을 초과하여 투자하는 행위</td></tr></table>	투자대상	투자대상 세부설명	장내파생상품	법 제5조제2항에 의한 장내파생상품 *이 투자신탁에서 투자하는 다른 파생상품을 포함하여 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 100 이하가 되도록 함	집합투자증권	법 제110조에 의하여 신탁업자가 발행한 수익증권, 법제9조제21항에서 규정한 집합투자증권, 수익증권 또는 집합투자증권과 동일하거나 유사한 것으로서 외국 통화로 표시되어 외국에서 발행 또는 창설되거나 유통되는 것	구분	투자제한의 내용	파생상품매매	파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 100을 초과하여 투자하는 행위	<p>(투자대상 중 자본시장법 제4조에 따른 증권에 대하여는 그 증권에 표시될 수 있거나 표시되어야 할 권리가 전자증권법에 따라 전자등록된 경우 해당 권리를 포함한다. 이하 같다) 및 투자 방법으로 운용합니다.</p> <table><tr><td>투자대상</td><td>투자대상 세부설명</td></tr><tr><td>장내파생상품</td><td>법 제5조제2항에 의한 장내파생상품 *이 투자신탁에서 투자하는 다른 파생상품을 포함하여 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 200 이하가 되도록 함</td></tr><tr><td>집합투자증권</td><td>법 제110조에 의하여 신탁업자가 발행한 수익증권(금전 신탁계약에 의한 수익권이 표시된 수익증권을 말한다. 이하 같다), 법 제9조제21항에서 규정한 집합투자증권(주식에 투자하지 않는 것에 한함)</td></tr></table> <p>(삭 제)</p> <p>나. 투자 제한</p> <table><tr><td>구분</td><td>투자제한의 내용</td></tr><tr><td>파생상품매매</td><td>파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 200을 초과하여 투자하는 행위</td></tr></table>	투자대상	투자대상 세부설명	장내파생상품	법 제5조제2항에 의한 장내파생상품 *이 투자신탁에서 투자하는 다른 파생상품을 포함하여 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 200 이하가 되도록 함	집합투자증권	법 제110조에 의하여 신탁업자가 발행한 수익증권(금전 신탁계약에 의한 수익권이 표시된 수익증권을 말한다. 이하 같다), 법 제9조제21항에서 규정한 집합투자증권(주식에 투자하지 않는 것에 한함)	구분	투자제한의 내용	파생상품매매	파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 200을 초과하여 투자하는 행위
투자대상	투자대상 세부설명																					
장내파생상품	법 제5조제2항에 의한 장내파생상품 *이 투자신탁에서 투자하는 다른 파생상품을 포함하여 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 100 이하가 되도록 함																					
집합투자증권	법 제110조에 의하여 신탁업자가 발행한 수익증권, 법제9조제21항에서 규정한 집합투자증권, 수익증권 또는 집합투자증권과 동일하거나 유사한 것으로서 외국 통화로 표시되어 외국에서 발행 또는 창설되거나 유통되는 것																					
구분	투자제한의 내용																					
파생상품매매	파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 100을 초과하여 투자하는 행위																					
투자대상	투자대상 세부설명																					
장내파생상품	법 제5조제2항에 의한 장내파생상품 *이 투자신탁에서 투자하는 다른 파생상품을 포함하여 파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 200 이하가 되도록 함																					
집합투자증권	법 제110조에 의하여 신탁업자가 발행한 수익증권(금전 신탁계약에 의한 수익권이 표시된 수익증권을 말한다. 이하 같다), 법 제9조제21항에서 규정한 집합투자증권(주식에 투자하지 않는 것에 한함)																					
구분	투자제한의 내용																					
파생상품매매	파생상품 매매에 따른 위험평가액이 이 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 뺀 금액의 100분의 200을 초과하여 투자하는 행위																					
10. 집합투자기구의 투자위험	<p>라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 - 이 투자신탁은 6등급 중 3등급에 해당되는 <b>다소높은 위험</b> 수준의 투자위험을 지니고 있습니다.</p> <div><p>[투자위험등급구분]</p><p>1등급 : 매우낮은위험 2등급 : 낮은위험 3등급 : 다소낮은위험 4등급 : 보통위험 5등급 : 낮은위험 6등급 : 매우낮은위험</p><p style="text-align: center;">6등급 중 3등급</p></div> <p>&lt;위험등급 기준표(연환산 표준편차 기준)&gt; 주1) 실제 변동성은 매년 결산시점에 측정하며, 해당 결산일 기준 이전 3년(156주)간 펀드의 주간 수익률의 연환산 표준편차와 동급 기준표상의 표준편차 상한치를 비교합니다. (종류형 집합투자기구인 경우 해당 운용펀드의 수익률을 기준으로 산정)</p>	<p>라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 - 이 투자신탁은 6등급 중 2등급에 해당되는 <b>높은 위험</b> 수준의 투자위험을 지니고 있습니다.</p> <div><p>[투자위험등급구분]</p><p>1등급 : 매우낮은위험 2등급 : 낮은위험 3등급 : 다소낮은위험 4등급 : 보통위험 5등급 : 낮은위험 6등급 : 매우낮은위험</p><p style="text-align: center;">6등급 중 2등급</p></div> <p>&lt;위험등급 기준표(연환산 표준편차 기준)&gt; 주1) 실제 변동성은 매년 결산시점에 측정하며, 해당 결산일 기준 이전 3년(156주)간 펀드의 주간 수익률의 연환산 표준편차와 동급 기준표상의 표준편차 상한치를 비교합니다. (종류형 집합투자기구인 경우 해당 운용펀드의 수익률을 기준으로 산정)</p>																				

항 목	정 정 전	정 정 후
	<p>주2) 이 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 실제 연환산 표준편차는 11.75% 입니다.</p> <p>주3) 추후 매 결산시마다 변동성을 재측정하게 되며 이 경우 투자위험등급이 변동될 수 있습니다.</p> <p>주4) 이 투자위험등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.</p>	<p>당 운용펀드의 수익률을 기준으로 산정)</p> <p>주2) 이 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 실제 연환산 표준편차는 20.62% 입니다.</p> <p>주3) 추후 매 결산시마다 변동성을 재측정하게 되며 이 경우 투자위험등급이 변동될 수 있습니다.</p> <p>주4) 이 투자위험등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.</p>
13. 보수 및 수수료에 관한 사항	-	업데이트
제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항		
1. 재무정보 2. 연도별 설정 및 판매 현황 3. 집합투자기구의 운용실적	-	업데이트
제4부. 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항		
1. 집합투자업자에 관한 사항	<p>라. 운용자산 규모</p> <p>-</p>	<p>라. 운용자산 규모</p> <p>업데이트</p>