

정정신고(보고)

2025년 11월 12일

1. 정정대상 공시서류 : 일괄신고서

삼성타겟리스크OCIO솔루션1안정형증권투자신탁[혼합-재간접형]

2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2022.10.04

3. 정정 사유

- 정기 결산으로 인한 갱신 (위험등급 분류기준 변경(투자대상자산 → 97.5% Var) 및 위험등급(4 → 5등급) 변동, 재무정보 확정)

4. 정정요구 · 명령 관련 여부 : 아니오

5. 정정사항

항 목		정 정 전	정 정 후				
표지	투자위험등급 : 4등급(보통 위험) 삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 투자대상 자산의 종류 및 위험도를 감안하여 4등급으로 분류하였습니다.	투자위험등급 : 5등급(낮은 위험) 삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 일간 수익률의 최대손실예상액을 감안하여 5등급으로 분류하였습니다.					
요약정보							
투자비용 투자실적 추이 운용전문 인력	—	업데이트					
제2부. 집합투자기구에 관한 사항							
2. 집합투자기구의 연혁	(신 설)	<table><tr><th>변경시행일</th><th>변경사항</th></tr><tr><td>2025.11.19</td><td>투자위험등급 변경(4등급(보통 위험) → 5등급(낮은 위험))</td></tr></table>		변경시행일	변경사항	2025.11.19	투자위험등급 변경(4등급(보통 위험) → 5등급(낮은 위험))
변경시행일	변경사항						
2025.11.19	투자위험등급 변경(4등급(보통 위험) → 5등급(낮은 위험))						
5. 운용전문인력	—	업데이트					
10. 집합투자기구의 투자위험	라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 — 이 투자신탁은 설정 후 3년이 경과되지 않아 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 투자위험 등급을 산정하였습니다. 설정 후 3년이 경과시 일간	라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형 — 이 투자신탁은 설정 후 3년이 경과하였으므로 일간 수익률의 최대손실예상액(이하 '97.5% VaR')을 감안하여 투자위험 등급을 산정하였습니다. 추후 매 결					

항 목	정 정 전	정 정 후
	<p>수익률의 최대손실예상액(이하 '97.5% VaR')으로 등급분류 기준이 변경되면서 위험등급이 변동 될 수 있습니다.</p> <p>- 이 투자신탁은 6등급 중 4등급에 해당되는 보통 위험 수준의 투자위험을 지니고 있습니다.</p> <p>(표 생략)</p> <p><상성자산운용주식회사 자체 투자위험등급 기준> (표 생략)</p> <p>주1) "고위험자산"은 주식, 상품, REITs, 투기등급채권(BB+등급 이하), 파생상품 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산입니다.</p> <p>주2) "중위험자산"은 채권(BBB-등급 이상), CP(A3등급 이상), 담보부 대출 및 대출채권 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산입니다.</p> <p>주3) "저위험자산"은 국공채, 지방채, 회사채(A-등급 이상), CP(A2-등급 이상), 현금성 자산 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산입니다.</p> <p>주4) 해외투자펀드는 국내펀드 분류기준을 준용하되 환헤지여부, 투자국가 등을 고려하여 필요시 위험등급을 조정합니다.</p> <p>주5) 위에 명시되지 않은 펀드의 위험 등급은 투자대상, 손실가능성 등을 고려하여 내부 심의위원회에서 정합니다.</p> <p>주6) 설정 후 3년이 경과시 일간 수익률의 최대손실 예상액으로 등급분류 기준이 변경되면서 위험등급이 변동될 수 있습니다.</p> <p>주7) 일간 수익률의 최대손실예상액은 매년 결산시점에 측정하며, 해당 결산일 기준 과거 3년 일간수익률에서 2.5%에 해당하는 손실률(신뢰구간 97.5%)의 절대값에 연환산 보정계수($\sqrt{250}$)를 곱해 산출하여 등급 기준표상의 상한치를 비교합니다. (종류형 집합투자기구인 경우 해당 운용펀드의 수익률을 기준으로 산정)</p> <p>주8) 상기 분류기준 이외에 투자전략, 신용위험, 유동성위험, 외화표시집합투자기구, 레버리지/인버스, 고난도금융투자상품 해당여부 및 환변동성 노출여부에 따라 위험등급을 상향하여 적용할 수 있습니다.</p> <p>주9) 이 투자위험등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.</p>	<p>산 시마다 97.5% VaR을 다시 측정하게 되며, 이 경우 투자위험 등급이 변동될 수 있습니다.</p> <p>- 이 투자신탁은 6등급 중 5등급에 해당되는 낮은 위험 수준의 투자위험을 지니고 있습니다.</p> <p>(표 생략)</p> <p><시장위험등급 기준표> (표 생략)</p> <p>주1) 일간 수익률의 최대손실예상액은 매년 결산시점에 측정하며, 해당 결산일 기준 과거 3년 일간 수익률에서 2.5%에 해당하는 손실률(신뢰수준 97.5%)의 절대값에 연환산 보정계수($\sqrt{250}$)를 곱해 산출하여 등급 기준표상의 상한치를 비교합니다. (종류형 집합투자기구인 경우 해당 운용펀드의 수익률을 기준으로 산정)</p> <p>주2) 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 97.5% VaR은 6.7% 입니다.</p> <p>주3) 이 투자위험등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.</p> <p>주4) 상기 분류기준 이외에 투자전략, 신용위험, 유동성위험, 외화표시집합투자기구, 레버리지/인버스, 고난도 금융투자상품 해당여부 및 환변동성 노출여부에 따라 위험등급을 상향하여 적용할 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	라. 운용자산규모 -	라. 운용자산규모 업데이트