

정정신고(보고)

2017년 9월 7일

1. 정정대상 공시서류 : 일괄신고서

삼성ELS인덱스증권투자신탁HE-1호[주식-파생형]

2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2014년 7월 18일

3. 정정 사유

- 결산에 따른 위험등급 분류기준 변경
- 위험등급 변경
- 재무정보 확정에 따른 정정 및 자료 업데이트

4. 정정사항

항목	정정 전	정정 후
표지	작성기준일 : 2016.9.2 투자위험등급 : 1등급(매우 높은 위험) 삼성자산운용주식회사(주)는 이 투자신탁의 투자 대상 자산의 종류 및 위험도를 감안하여 1등급으로 분류하였습니다. 이 투자위험 등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.	작성기준일 : 2017.08.30 투자위험등급 : 2등급(높은 위험) 삼성자산운용주식회사(주)는 이 투자신탁의 실제 수익률 변동성을 감안하여 2등급으로 분류하였습니다. 이 투자위험 등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.
요약정보		
I 집합투자기구의 개요	기타보수, 총보수·비용, 합성총보수·비용	기타보수, 총보수·비용, 합성총보수·비용 업데이트
II 집합투자기구의 투자정보	(1) 투자전략 3. 운용전문인력 4. 투자실적 (2) 주요 투자위험 및 위험관리 2. 투자위험 등급 분류 - 위 투자전략에 따른 투자위험에 노출되므로 이 투자신탁은 6등급 중 1등급에 해당되는 매우 높은 위험수준의 투자위험을 지니고 있습니다.__(이하 생략) ※ 이 위험등급은 삼성자산운용의 내부 기준에 따른 위험등급입니다. 판매회사는 판매회	(1) 투자전략 3. 운용전문인력 업데이트 4. 투자실적 업데이트 (2) 주요 투자위험 및 위험관리 2. 투자위험 등급 분류 - 위 투자전략에 따른 투자위험에 노출되므로 이 투자신탁은 6등급 중 2등급에 해당되는 높은 위험수준의 투자위험을 지니고 있습니다.__(이하 생략) <위험등급 기준표(연환산 표준편차 기준)> 주1) 실제 변동성은 매년 결산시점에 측정하

	<p>사별 특성을 반영하여 위험등급을 재분류 할 수 있습니다.</p> <p>* 설정 후 3년이 경과시 실제 수익률 변동성으로 등급분류 기준이 변경되면서 위험등급이 변동될 수 있습니다.</p>	<p>며, 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>주2) 이 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 실제 연환산 표준편차는 16.86% 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>
--	--	---

제2부. 집합투자기구에 관한 사항

<p>5. 운용전문인력</p>	<p>가. 운용전문인력 현황</p> <p>-</p>	<p>가. 운용전문인력 현황</p> <p>업데이트</p>
<p>10. 집합투자기구의 투자 위험</p>	<p>라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형</p> <p>- 위 투자전략에 따른 투자위험에 노출되므로 이 투자신탁은 6등급 중 1등급에 해당되는 매우 높은 위험수준의 투자위험을 지니고 있습니다. (이하 생략)</p> <div data-bbox="475 907 817 1131" data-label="Figure"> </div> <p style="text-align: center;">캡처2</p> <p><삼성자산운용(주) 자체 투자위험등급 기준> (표 생략)</p>	<p>라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형</p> <p>- 위 투자전략에 따른 투자위험에 노출되므로 이 투자신탁은 6등급 중 2등급에 해당되는 높은 위험수준의 투자위험을 지니고 있습니다. (이하 생략)</p> <div data-bbox="933 907 1276 1131" data-label="Figure"> </div> <p style="text-align: center;">캡처1</p> <p><위험등급 기준표(연환산 표준편차 기준)></p> <p>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>주2) 이 투자신탁의 위험등급 적용을 위해 산출한 실제 연환산 표준편차는 16.86% 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>13. 보수 및 수수료에 관한 사항</p>	<p>나. 집합투자기구에 부과되는 보수 및 비용</p> <p>(1) 투자신탁 관련 보수등</p> <p><1,000만원 투자시 투자자가 부담하게 되는 수수료></p>	<p>나. 집합투자기구에 부과되는 보수 및 비용</p> <p>(1) 투자신탁 관련 보수등 기타비용, 총보수 비용, 합성 총보수 비용, 증권거래비용 업데이트</p> <p><1,000만원 투자시 투자자가 부담하게 되는 수수료></p>

	료 및 보수·비용의 투자기간별 예시>	료 및 보수·비용의 투자기간별 예시> 업데이트
제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항		
1. 재무정보 2. 연도별 설정 및 환매 현황 3. 집합투자기구의 운용 실적	-	업데이트
제4부. 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항		
1. 집합투자업자에 관한 사항	라. 운용자산 규모 -	라. 운용자산 규모 업데이트