

KODEX 200선물인버스2X ETF (252670)

KODEX는 한국을 대표하는 ETF 운용사인 삼성자산운용의 ETF 상품 브랜드입니다.

2022년 06월 30일 기준
준법감시인 승인필 202206-2ETF70

F-KOSPI200지수를 기초지수로 하여 1좌당 순 자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 음(陰)의 2배수로 연동하도록 투자신탁재산을 운용함을 그 운용목적으로 합니다.

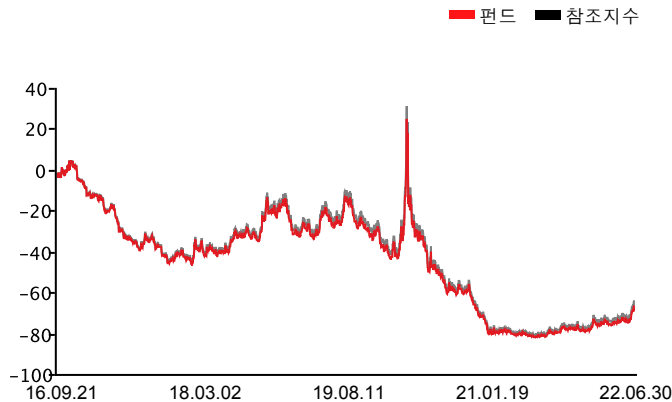
누적수익률 (%)

	1개월	3개월	6개월	1년	설정후	연초이후
KODEX 200선물인버스2X	30.51	37.23	54.59	80.55	-66.59	54.59
참조지수	30.93	37.87	55.75	83.55	-64.10	55.75
참조지수 대비	-0.43	-0.64	-1.16	-3.00	-2.49	-1.16

※ 분배금 재투자를 가정한 세전 수익률 기준입니다.

※ 참조지수는 기초지수의 일별 수익률의 일정 배수를 반영한 지수입니다.

수익률 그래프 (%)



※ 분배금 재투자를 가정한 세전 수익률 기준입니다.

※ 과거의 실적이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다.

기초지수 구성 현황 (%)

코스피200 F 202209	100.00
-----------------	--------

포트폴리오 구성 종목 (%)

KODEX 인버스	18.81
코스피200 F 202209	-180.85

※ 포트폴리오 구성종목은 PDF구성내역에 기초한 것으로 실제 보유내역과 다를 수 있습니다.

투자 위험 등급 : 1(매우 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 투자대상 자산의 종류 및 위험도를 감안하여 1등급으로 분류하였습니다.

펀드의 위험 등급은 운용실적, 시장 상황 등에 따라 변경될 수 있다는 점을 유의하여 투자편안을 하시기 바랍니다.

지수소개

코스피 200 선물지수(F-KOSPI 200)는 KOSPI 200 선물시장에 상장된 최근월종목의 가격과 동일하게 연동하는 지수로서 2009년 8월 17일부터 산출·발표하고 있습니다.

※ 정기변경: 연 4회(3월, 6월, 9월, 12월)

기본정보

펀드명	삼성 KODEX200선물인버스2X증권 ETF[주식-파생형]
기초지수	F-KOSPI200 지수
펀드순자산총액	20,873.35억원
1주당 NAV	3,341.34원
총 보수	연 0.64%(지정판매 0.02%, 집합투자 0.58%) (신탁 0.02%, 사무수탁 0.02%)
최초 설정일	2016.09.21
상장일	2016.09.22
배당	배당금 발생 시 분기별
운용회사	삼성자산운용
사무수탁회사	한국에탁결제원
수탁은행	국민은행
환매수수료	해당사항 없음
환매방법	유가증권 시장을 통한 매도, 지정참가회사를 통한 해지에 의한 환매

※ 증권거래비용 등이 추가로 발생할 수 있습니다.

거래정보

거래소	한국거래소
표시통화	원
거래단위	1주
설정단위	100,000주
거래소코드	252670
ISIN코드	KR7252670005
블룸버그 Ticker	252670 KS <Eq>

투자분배금 지급현황

지급기준일	분배금액(원)
조회된 데이터가 없습니다.	

알려드립니다

■ 2010년 7월 1일부터 본펀드의 보유기간 중 발생한 이익에 대하여 배당 소득세가 적용됩니다.

■ KODEX 200선물인버스2X ETF는 일간 단위로만 기초지수의 수익률을 음(陰)의 2배수로 추구하는 것이므로 투자기간 전체에 대해서 누적하여 음(陰)의 2배수를 추구할 수 있다는 것을 의미하지 않습니다. 그러므로, 이 투자신탁은 일반적인 주식투자보다 높은 위험을 감내할 수 있고 동시에 주식시장의 변동성 등 재무적인 지식을 보유한 투자자에게 적합한 고위험 상품입니다.

집합투자기구 및 금융투자회사의 의무고지사항

●단기금융 집합투자기구

장부가와 시가의 괴리가 ±0.5%이상일 경우 기준가격 적용기준이 달라질 수 있습니다.

●파생상품관련 집합투자기구

신탁재산으로 편입된 장외파생상품 발행회사의 부도, 파산 등의 사유로 계약조건을 이행하지 못하는 경우 원금의 전부 혹은 상당부분의 손실이 발생할 수 있습니다.

●부동산 집합투자기구

사업미승인 및 시공사나 건설사 부도 등으로 투자 손실이 발생할 수 있습니다.

●해외에 투자하는 집합투자기구

해외에 투자하는 집합투자기구의 경우 투자대상 국가의 시장 정치 및 경제상황 등에 따른 위험으로 자산가치의 손실이 발생할 수 있습니다.

●월지급식 금융상품인 경우

(이익금 분배방식) 본 상품(서비스)은 투자(운용) 결과에 따라 월지급액이 변동될 수 있으며, 이익금을 초과하여 분배하는 경우 투자원금이 감소할 수 있습니다.
(일정금액 지급방식) 본 상품(서비스)은 투자(운용) 결과 이익금이 사전에 정한 월지급액 보다 적을 경우 투자원금에서 지급되므로 투자원금이 감소 될 수 있으며, 투자성과가 장기간 부진할 경우 월지급이 조기에 중단 될 수 있습니다.

●외화증권에 투자·운용되는 금융투자상품

환율변동시 자산 가치가 변동되거나 손실을 볼 수 있습니다.

●과세 관련사항

과세율이나 과세기준이 변동될 수 있으며, 과세율 등이 납세자의 상황에 따라 달라질 수 있습니다.

●운용실적에 따라 손익이 결정되는 금융투자상품

운용결과에 따라 손실이 발생할 수 있고, 그 손실은 고객에게 귀속됩니다.

※ 상기 투자위험은 작성시점 현재 중요하다고 판단되는 위험을 기재한 것이므로 향후 운용과정 등에서 예측되지 아니하는 위험이 추가적으로 발생할 수 있습니다.

본 자료는 펀드의 단순 정보제공을 위해 작성된 것으로서, 본 펀드의 투자광고 및 투자권유를 위해 작성된 자료가 아닙니다. 따라서 본 자료는 삼성자산운용 홈페이지 게시 외에는 본 펀드에 가입하지 않은 고객에게 투자광고 또는 투자권유의 목적으로 제시되거나 제공될 수 없습니다. 본 자료는 신뢰할 만한 정보를 토대로 작성된 것이나 그 정확성이나 완전성에 대해 삼성자산운용은 어떠한 보장도 하지 않습니다. 집합투자증권은 예금자보호법에 따라 예금보험공사가 보호하지 않습니다. 집합투자증권은 자산가격 변동, 환율변동, 신용등급 하락 등에 따른 원금 손실(0~100%)이 발생할 수 있으며, 원금손실 발생 시 투자자에게 귀속됩니다. 투자자는 집합투자증권에 대하여 금융상품판매업자로부터 충분한 설명을 받을 권리가 있으며, 투자 전 (간이)투자설명서 및 집합투자규약을 반드시 읽어보시기 바랍니다. 과거의 실적이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다.

ETF 기본위험

●시장위험 및 개별위험

투자신탁재산을 주식, 채권, 집합투자증권 및 파생상품 등에 투자함으로써 투자대상 자산의 가격 변동, 이자율 등 기타 거시 경제지표의 변화에 따른 위험에 노출 됩니다. 또한, 투자신탁재산의 가치는 투자대상종목 발행회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화에 따라 급격히 변동될 수 있습니다.

●상장폐지위험

유가증권시장 상장규정 제116조의 상장폐지기준에 해당되거나 공익과 투자자보호를 위하여 증권시장이 이 투자신탁의 수익증권 상장폐지가 필요하다고 인정하는 경우 이 투자신탁은 상장폐지하여야 합니다. 투자자는 상장폐지 전에 매도 청산하거나, 상장폐지 시점의 NAV 기준으로 분배받게 됩니다.

●시장거래에 따른 순자산가치와의 괴리 위험

이 투자신탁은 한국거래소에 상장되어 거래되며 시장가격으로 유통시장을 통해 매매됩니다. 이 투자신탁의 시장 가격은 순자산가치(NAV) 및 유통시장의 수요와 공급에 따라 변동됩니다. 따라서, 이 투자신탁의 시장가격은 이 투자신탁에 수요와 공급으로 인해 NAV보다 높게 또는 낮게 형성될 수 있습니다.

●유동성 위험

투자신탁재산에서 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자하는 경우 투자대상 종목의 유동성부족에 따라 환금성에 제약이 발생할 수 있으며, 이는 투자신탁재산의 가치하락을 초래할 수 있습니다.

●투자신탁 소규모의 위험

투자신탁의 설정금액이 소액이거나, 환매 등에 의해 투자신탁의 규모가 일정 규모 이하로 작아지는 경우, 분산투자 등 원활한 펀드 운용에 장애가 발생할 수 있습니다. 특히, 특정 지수를 추종하는 인덱스펀드는 인덱스 바스켓의 구성이 어려워 지수의 추적이 곤란하거나 추적오차가 발생할 수 있습니다.

●환매연기위험

투자신탁재산의 매각이 불가능하여 사실상 환매에 응할 수 없거나 환매에 응하는 것이 수익자의 이익을 해할 우려가 있는 경우 또는 이에 준하는 경우로서 금융위가 인정하는 경우에는 수익증권의 환매가 연기될 수 있습니다. 환매가 연기되는 사유에 대해서는 투자설명서 "제2부의 11. 매입, 환매, 전환절차 및 기준가격 적용기준"을 참고하여 주시기 바랍니다.

●투자신탁 해지위험

투자신탁이 최초로 설정한 후 1년이 되는 날에 원본액이 50억원 미만인 경우, 최초로 설정하고 1년이 지난 후 1개월간 계속하여 투자신탁의 원본액이 50억원 미만인 경우 및 수익증권 전부의 환매청구가 있는 경우 집합투자업자는 투자자의 사전 동의 없이 투자신탁을 해지 또는 해산할 수 있습니다.

200선물인버스2X ETF 투자위험

●개인수익자의 투자자금 회수 곤란 위험

개인수익자는 보유 수익증권을 증권시장에서 매도하는 방법뿐만 아니라 현금화가 가능합니다. 즉, 개인투자자는 보유 수익증권을 판매회사 또는 지정참가회사에 환매신청할 수 없습니다. 이는 개인투자자가 부담하여야 할 과세표준을 확인할 수 없는 한계에서 기인한 것입니다. 따라서, 증권시장에서 이 투자신탁 수익증권의 거래가 부족하여 개인수익자가 원하는 가격에 원하는 수량을 매도하지 못할 경우에는 그 개인수익자가 보유한 이 투자신탁 수익증권의 현금화가 어려워질 수도 있으며, 이로 인하여 기대하지 아니한 손실이 발생할 수도 있습니다.

※ 법인수익자의 경우 보유 수익증권을 증권시장에서 매도하거나 이 투자신탁 수익증권을 설정단위 또는 그 정배수로 판매회사 또는 지정참가회사에 환매 신청할 경우에는 판매회사 또는 지정참가회사에서 환매가 가능합니다.

●지수산출방식의 대폭 변경 또는 중단 위험

이 투자신탁이 추적하는 기초지수를 관리하는 지수관리회사의 사정으로 그 지수의 산출방식이 대폭 변경되어 집합투자업자의 최선의 노력에도 불구하고 기존의 투자 전략으로 더 이상 그 지수를 추적할 수 없는 상황이 발생하거나, 지수관리회사의 사정 또는 기타 피치 못할 사정으로 인하여 지수의 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.

●투자대상 집합투자 증권과 기초지수의 괴리에 따른 위험

이 투자신탁은 KOSPI200지수 선물을 활용하여 산출하는 F-KOSPI200지수를 기초 지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 음(陽)의 2배수로 연동하는 목적을 달성하기 위해 KOSPI200지수를 추종하는 집합투자증권을 활용합니다. 따라서 이 투자신탁이 활용하는 집합투자증권의 일간변동률과 기초지수 일간변동률간에 차이가 발생하는 경우, 이 투자신탁의 1좌당 순자산가치의 일간변동률과 기초지수 일간변동률의 음(陰)의 2배수(-2배수)한 값 간의 괴리가 발생할 수 있습니다. 이러한 경우가 지속되는 경우, 복리로 누적된 오차로 인해 그 괴리가 더욱 확대될 수 있으며, 이로 인해 이 투자신탁의 투자목적 달성이 불가능할 수 있습니다.

●시장거래에 따른 순자산가치와의 괴리위험

이 투자신탁은 한국거래소에 상장되어 거래되며 시장가격으로 유통시장을 통해 매매됩니다. 이 투자신탁의 시장 가격은 순자산가치(NAV) 및 유통시장의 수요와 공급에 따라 변동됩니다. 따라서, 이 투자신탁의 시장가격은 이 투자신탁의 수요와 공급으로 인해 NAV보다 높게 또는 낮게 형성될 수 있습니다.

●파생상품 롤오버(Roll-Over)위험

이 투자신탁은 F-KOSPI200지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 음(陰)의 2배수로 연동하는 것을 목적으로 하며, 그 목적을 달성하기 위하여 주가지수선물의 매도, 주가지수선물 옵션을 이용한 합성선물 매도를 이용할 계획입니다. 다만, 선물 또는 옵션은 현물과는 달리 만기일이 있기 때문에 차기(次期) 선물 또는 옵션으로 다시 재투자하여야 하는데 재투자가격이 만기일의 만기상한 금액과 일치하지 않을 위험(이를 롤오버(Roll over) 위험이라 합니다)이 있습니다. 이러한 이유 등으로 투자목적이 달성되지 아니할 위험이 있습니다.

본 자료는 펀드의 단순 정보제공을 위해 작성된 것으로서, 본 펀드의 투자광고 및 투자권유를 위해 작성된 자료가 아닙니다. 따라서 본 자료는 삼성자산운용 홈페이지 게시 외에는 본 펀드에 가입하지 않은 고객에게 투자광고 또는 투자권유의 목적으로 제시되거나 제공될 수 없습니다. 본 자료는 신뢰할 만한 정보를 토대로 작성된 것이나 그 정확성이나 완전성에 대해 삼성자산운용은 어떠한 보장도 하지 않습니다. 집합투자증권은 예금자보호법에 따라 예금보험공사가 보호하지 않습니다. 집합투자증권은 자산가격 변동, 환율변동, 신용등급 하락 등에 따른 원금 손실(0~100%)이 발생할 수 있으며, 원금손실 발생 시 투자자에게 귀속됩니다. 투자자는 집합투자증권에 대하여 금융상품판매업자로부터 충분한 설명을 받을 권리가 있으며, 투자 전 (간이)투자설명서 및 집합투자규약을 반드시 읽어보시기 바랍니다. 과거의 실적이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다.

●시장변동성 상승에 따른 복리 효과 상승 위험

이 투자신탁은 일간 단위로만 기초지수 일간변동률의 음(陽)의 2배수를 추구하기 때문에 연속적으로 2영업일 이상 보유한 경우 투자신탁의 일간변동률만큼 투자기간 동안의 수익률이 복리(複利)로 계산됩니다. 특히, 시장 변동성이 높아지는 경우, 복리 효과로 인해 장기 투자수익률은 기초지수 일간변동률의 음(陽)의 2배수의 누적수익률보다 축소될 수 있습니다. 이러한 현상은 변동성이 증가할수록 더욱 확연하게 나타납니다. 따라서, 2영업일 이상의 투자신탁 수익률은 기초지수의 성과뿐만 아니라, 기초지수의 변동성, 기타 투자신탁 운용에 소요되는 비용, 투자대상자산으로부터의 배당 및 투자기간 등이 반영되어 산출될 수 있습니다.

●인버스 투자위험

인버스 펀드는 지수를 역(逆)으로 추적하여 상승장에서 손실이 발생할 수 있습니다.

●F-KOSPI200지수와 양(陽)의 상관관계 발생 위험

이 투자신탁은 F-KOSPI200지수의 일간 변동률의 음의 2배수로 연동하여 투자신탁 재산을 운용함을 목적으로 하고 있으므로, 시간이 경과함에 따라 투자신탁에 영향을 주는 다양한 요인에 의해 누적적으로는 F-KOSPI200지수 누적수익률의 음(陰)의 2배수를 추적하지 못할 수 있습니다. 즉, 일시적으로 또는 지속적으로 이 투자신탁과 F-KOSPI200지수의 누적수익률간의 양의 상관관계가 나타날 수도 있습니다.

●추적오차 발생위험

이 투자신탁은 F-KOSPI200지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 음(陰)의 2배수(-2배수)로 연동하는 것을 목적으로 하고 있으나, 투자신탁 보수, 위탁매매수수료 등 관련 비용의 지출 등 현실적 제한으로 인하여 기초지수의 일간 변동률의 음의 2배수와 동일한 수익률이 실현되지 아니할 가능성이 있으며, 추적오차가 크게 발생할 수 있습니다. 따라서 이 투자신탁의 수익률과 기초지수의 일간변동률의 음의 2배수가 동일할 것을 전제로 하는 투자는 당해 추적오차로 인하여 예상하지 못한 손실을 실현할 수도 있습니다.

●거래소 동시호가 거래의 위험

본 투자신탁이 한국거래소에 상장되어 거래될 때 투자자가 시초가 혹은 종가로 거래하고자 하는 경우 각 거래시간대의 동시호가 동안에는 유동성 공급자가 유동성 공급이 제한되어 적절한 가격에 거래가 되지 않을 위험에 노출되어 있습니다.

●누적수익률과 괴리 위험

이 투자신탁은 KOSPI200지수선물의 가격 수준을 종합적으로 표시하는 F-KOSPI200지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수의 일간변동률의 음(陰)의 2배수로 연동하여 투자신탁재산을 운용함을 그 운용 목적으로 합니다. 이는 일간 단위로만 기초지수의 수익률을 음(陰)의 2배수로 추구하는 것이므로 투자기간 전체에 대해서 누적하여 음(陰)의 2배수를 추구할 수 있다는 것을 의미하지 않습니다.

●지수 관련 위험

투자신탁이 추종하는 지수가 더 이상 존재하지 아니하거나, 산출방식 또는 구성종목이 중대하게 변경되는 경우 또는 지수가 정상적으로 발표되지 못할 수 있는 위험을 가지고 있습니다. 이 경우 투자신탁에서 추구하는 운용전략이 변경되거나, 투자신탁이 해지될 수 있습니다.