

KODEX KRX300 레버리지 ETF (306950)

KODEX는 한국을 대표하는 ETF운용사인 삼성자산운용의 ETF 상품 브랜드입니다.

2022년 07월 31일 기준
준법감시인 승인필 202207-2ETFB2

KRX 300 지수를 추적대상 지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 추적대상지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수에 연동하도록 투자 신탁재산을 운용함을 목적으로 합니다.

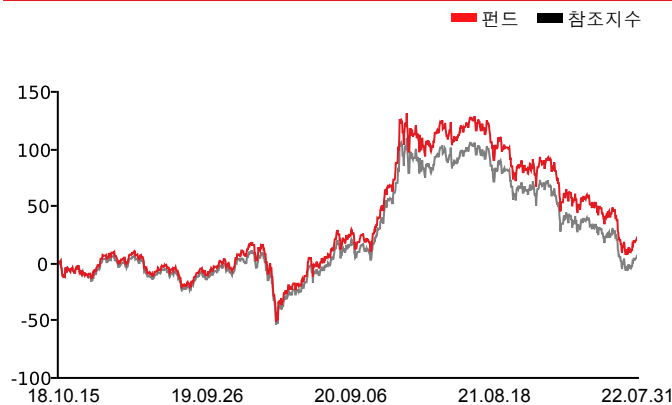
누적수익률(%)

	1개월	3개월	6개월	1년	설정후	연초이후
KODEX KRX300 레버리지	10.45	-17.89	-19.97	-42.35	22.84	-35.47
참조지수	10.74	-18.46	-20.61	-44.18	6.91	-36.06
참조지수 대비	-0.29	0.57	0.64	1.83	15.94	0.59

※ 분배금 재투자를 가정한 세전 수익률 기준입니다.

※ 참조지수는 기초지수의 일별 수익률의 일정 배수를 반영한 지수입니다.

수익률 그래프(%)



※ 분배금 재투자를 가정한 세전수익률 기준입니다.

※ 과거의 실적이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다.

상위 10종목(%)

KRX300	95.23
삼성전자	22.57
KODEX KRX300	19.36
SK하이닉스	4.30
NAVER	2.58
삼성SDI	2.28
현대차	2.13
LG화학	2.11
카카오	1.77
셀트리온	1.59

※ 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 투자대상자산의 종류 및 위험도를 감안하여 1등급으로 분류하였습니다.

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

지수소개

KRX300 지수는 한국거래소 유가증권시장 및 코스닥시장을 통합하여 300개의 우량 종목으로 구성된 한국 주식시장을 대표하는 지수입니다.

※ 정기변경: 연 2회(6월, 12월)

기본정보

펀드명	삼성 KODEX KRX300레버리지증권 ETF[주식-파생형]
기초지수	KRX300 (2018.03.26)
펀드순자산총액	122.84억원
1주당 NAV	12,284.29원
총 보수	연 0.64%(지정판매 0.05%, 집합투자 0.55%) (신탁 0.02%, 사무수탁 0.02%)
최초 설정일	2018.10.15
상장일	2018.10.16
배당	배당금 발생시 연1회
운용회사	삼성자산운용
사무수탁회사	한국에탁결제원
수탁은행	KEB하나은행
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	306950
ISIN코드	KR7306950007
블룸버그 Ticker	306950 KS <Eq>

투자분배금 지급현황

지급기준일	분배금액(원)
조회된 데이터가 없습니다.	

집합투자기구 및 금융투자회사의 의무고지사항

●단기금융 집합투자기구

장부가과 시가의 괴리가 $\pm 0.5\%$ 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 초기에 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.

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 필요 하다고 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.

※ 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.

KRX300 레버리지 ETF 투자위험

●거래상대방 및 신용위험

보유하고 있는 증권 및 단기금융상품 등을 발행한 회사가 신용등급의 하락 또는 부도 등과 같은 신용사건에 노출되는 경우 그 증권 및 단기금융상품 등의 가치가 하락할 수 있습니다.

●대차거래 불가능에 따른 위험

이 투자신탁은 대차거래를 통한 레버리지 전략을 추구하므로 대차거래가 불가능한 경우 투자전략의 지속적인 수행이 불가능해질 수 있으므로 이로 인해 보유 증권 매도에 따른 손실이 발생할 수 있으며 투자신탁이 해지될 수도 있습니다.

●파생상품 투자위험

파생상품은 작은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대 효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 훨씬 높은 위험에 노출될 수 있습니다.

●레버리지 투자방법 상이 위험

이 투자신탁은 주식, 집합투자증권, 환매조건부 증권, 채권, 증권의 차입 및 파생상품 등을 활용하여 순자산보다 더 큰 주식투자비중을 유지하는 투자신탁으로서 일간 주식 시장 성과의 양(陽)의 2배수를 추구합니다. 동 전략을 추구하는 과정에서 주식시장의 변동성에 따라서 빈번한 선물거래가 이뤄지거나 현물주식거래가 이뤄질 수 있어서 일반적인 투자신탁보다 더 높은 매매회전율을 보일 수 있습니다. 그리고 장중에 주식 시장의 변동성이 확대될 경우에는 레버리지 비율이 더 확대되거나 감소할 수 있습니다. 일반적으로는 주가가 상승할 경우에는 레버리지 비율이 감소하고 주가가 하락할 경우에는 레버리지 비율이 증가하므로 추가하락시 더 큰 하락 폭을 유지할 수 있습니다. 그러므로, 변동성이 커지는 시점에는 상대적으로 더 큰 손실을 볼 수 있으며 경우에 따라서는 레버리지 비율이 극단적으로 감소하거나 증가할 수 있습니다.

●지수산출방식의 대폭 변경 또는 중단 위험

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

●추적오차 발생위험

이 투자신탁은 KRX300 지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하는 것을 목적으로 하고 있으나, 투자신탁 보수, 위탁매매수수료 등 관련 비용의 지출 등 현실적 제한으로 인하여 기초지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수와 동일한 수익률이 실현되지 아니할 가능성이 있으며, 추적오차가 크게 발생할 수 있습니다. 따라서 이 투자신탁의 수익률과 기초지수의 일간 변동률의 양(陽)의 2배수가 동일할 것을 전제로 하는 투자는 당해 추적오차로 인하여 예상하지 못한 손실을 실현할 수도 있습니다.

●투자신탁 변동에 따른 위험

투자신탁의 규모가 환매 등에 의해 일정 규모 이하로 작아지는 경우, 원활한 분산 투자가 불가능해 질 수도 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.

●레버리지 투자위험

이 투자신탁은 주식, 집합투자증권, 환매조건부 채권, 채권의 차입 및 파생상품 등을 활용하여 순자산보다 더 큰 주식투자비중을 유지하는 투자신탁으로 KRX300 지수의 변동에 따라 그 투자성과가 더 큰 폭으로 변동하는 특성을 가지고 있습니다. 그러므로, KRX300 지수가 지속적으로 하락할 경우에는 더 큰 손실을 볼 수 있고 KRX300 지수가 큰 폭의 변동성을 보이면서 움직이는 경우에는 지수의 성과조차 추적하지 못 할 수 있습니다. 또한, 파생상품을 이용하여 레버리지 투자를 완성하므로 파생상품의 내재 변동성 및 민감도에 따라 다른 수익이 실현될 수도 있으며 투자한 파생상품과 관련 증권 또는 지수 등과 불완전 상관관계로 손실이 발생할 수 있습니다. 아울러, KRX300 지수의 기대수익과 변동성 등의 시장상황에 대한 이해와 재무적인 사전지식에 기반하여 투자를 결정하여야 하며 이런 사전적인 검토에도 불구하고 기대와는 다른 수익을 실현할 수 있습니다.

●레버리지 복리효과에 의한 위험

이 투자신탁은 파생상품을 활용하여 KRX300 지수 일간변동률의 양(陽)의 2배를 일간 단위로만 추구(상승할 경우에도 2배, 하락할 경우에도 2배를 추구)하는 투자신탁으로 투자기간, 시장평균성과, 변동성, 왜도 및 첨도 등에 따라서 투자자는 결과적으로 양(陽)의 2배를 확보하지 못하고, 경우에 따라서는 지수의 성과에 크게 미치지 못하는 결과를 맞을 수 있습니다.

●개인수익자의 투자자금 회수 곤란 위험

개인수익자는 보유 수익증권을 증권시장에서 매도하는 방법으로만 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 개인 수익자가 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.

●누적수익률과 괴리 위험

이 투자신탁은 KRX300 지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하여 투자신탁재산을 운용함을 그 운용목적으로 합니다. 이는 일간단위로 기초지수가 오를 경우에도 양(陽)의 2배수를 추구하고 떨어질 때에도 양(陽)의 2배수를 추구하는 것이므로 투자기간 전체에 대해서 누적하여 양(陽)의 2배수를 추구할 수 있다는 것을 의미하지 않습니다.

●파생상품 롤오버(Roll-Over) 위험

이 투자신탁은 KRX300 지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하는 것을 목적으로 하며, 그 목적을 달성하기 위하여 주식, KRX300 지수를 기초지수로 하는 집합투자증권, 주가지수 선물의 매수 등을 이용할 계획입니다. 다만, 선물은 현물과는 달리 만기일이 있기 때문에 차기(次期) 선물로 재투자하여야 하는데 재투자가격이 만기일의 만기상환금액과 일치하지 않을 위험(이를 롤오버(Roll over)위험이라 합니다)이 발생할 수 있습니다. 이러한 이유 등으로 투자목적이 달성되지 아니할 위험이 있습니다.

KRX300 레버리지 ETF 투자위험

●레버리지 불가능 위험

이 투자신탁은 주식, KRX300 지수를 기초지수로 하는 집합투자증권, KRX300 지수 관련 파생상품 및 현금성 자산 등으로 포트폴리오를 구성할 예정이며 증권의 차입 및 판매조건부 매도 등 기타 효율적인 방법을 통하여 레버리지 전략을 달성할 예정입니다. 다만, 급격한 시장 변동, 자금시장의 유동성 악화 및 기타 레버리지 전략을 수행할 수 없는 다양한 상황이 도래하는 경우 투자목적 달성을 하지 못할 수 있습니다.

●ETF손익구조 오차 위험

이 투자신탁은 KRX300 지수의 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하여 투자신탁 재산을 운용함을 목적으로 하고 있으므로, 시간이 경과함에 따라 투자신탁에 영향을 주는 다양한 요인에 의해 누적적으로는 KRX300 지수 누적수익률의 양(陽)의 2배수를 추적하지 못할 수 있습니다. 즉, 일시적으로 또는 지속적으로 이 투자신탁과 KRX300 지수의 누적수익률간의 음(陰)의 상관관계가 나타날 수도 있습니다.

●대차거래 비자발적 중단 위험

현행 대차거래 관행은 대여자가 상환을 요청할 경우 12시 이전인 경우 T+2일, 12시 이후인 경우 T+3 시점에 차입자는 상환 요구에 응해야 합니다. Roll-Over할 대여자를 못 찾는 경우 대차거래가 비자발적으로 중단될 위험 존재하며 이로 인해 손실이 발생할 수 있으며 투자신탁이 해지될 수도 있습니다.

●환매조건부 매도거래 금리 상승 위험

환매조건부 매도는 일정 기간마다 그 시점의 시장금리에 연동하여 결정됩니다. 따라서, 시장금리가 상승하면 조달비용 상승으로 펀드 투자수익률이 하락하게 될 수 있습니다.

●주식등 가격변동 위험

이 투자신탁은 증권시장에 상장되어 거래되는 주식 등에 주로 투자하기 때문에 동 주식의 가격변동으로 인한 손실위험에 노출됩니다. 또한, 투자신탁재산의 가치는 투자 대상종목 발행회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화에 따라 급격히 변동될 수 있습니다.

●손익구조 오차위험

이 투자신탁은 KRX300 지수 일간변동률의 양(逆)의 2배수와 동일한 수익률을 실현함을 목적으로 하며, 그 목적을 달성하기 위하여 KRX300 선물을 매수할 계획입니다. 그러나 동 선물가격의 변동폭이 KRX300 지수가격의 변동폭과 일치하지 않을 위험(이를 현선물 Spread 위험이라 합니다)이 있기 때문에 투자신탁의 수익률이 추가지수 수익률과 정확히 양(逆)의 2배수 관계에 있지 않을 수 있습니다.

●시장변동성 상승에 따른 복리 효과 상승 위험

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

●투자대상 집합투자 증권과 기초지수의 괴리에 따른 위험

이 투자신탁은 KRX300 지수를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 기초지수 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하는 목적을 달성 하기 위해 KRX300 지수를 추종하는 집합투자증권에 투자합니다. 이 투자신탁이 투자한 집합투자증권의 일간변동률과 기초지수 일간변동률간에 차이가 발생하는 경우, 이 투자신탁의 1좌당 순자산가치의 일간변동률과 기초지수 일간변동률의 2배수한 값과 괴리가 발생할 수 있습니다. 이러한 경우가 지속 되는 경우, 복리로 누적된 오차로 인해 그 괴리가 더욱 확대될 수 있으며, 이로 인해 이 투자신탁의 투자목적 달성을 하지 못할 수 있습니다.

●레버리지 전략 달성을 위한 포트폴리오 편입비 미달 또는 초과 위험

이 투자신탁은 KRX300 지수 관련 현물 바스켓, KRX300을 기초지수로 하는 집합투자 증권, KRX300 지수 관련 파생상품 등으로 포트폴리오를 구성하여, 이 투자신탁의 1좌당 순자산가치의 일간변동률을 KRX300 지수 일간변동률의 양(陽)의 2배수로 연동하는 목적을 달성하고자 합니다. 다만, 주식시장이 급등락하거나, 자금시장의 유동성 악화 및 다양한 환경변화 등이 발생하는 경우, 투자자산의 가치 변동 또는 기초지수와 수익률 괴리 등이 발생할 수 있으며 이로 인해 레버리지 전략 달성을 위한 목표 포트폴리오 편입비 수준에 미달하거나 초과할 수 있습니다. 특히, KRX300 지수와 KRX300 지수 선물가격이 괴리가 발생하거나 이 투자신탁이 투자하는 집합투자증권과 KRX300 지수의 일간변동률이 괴리가 발생하거나 또는 이러한 현상이 복합적으로 발생하는 경우 당초 목표한 포트폴리오 편입비 수준을 하회하거나 초과할 수 있으며 이로 인해 이 투자 신탁의 투자목적 달성을 하지 못할 수 있습니다.

●신규 상장 파생상품 유동성 저하에 따른 위험

이 투자신탁은 KRX300 지수 선물을 편입하여 기초지수인 KRX300 지수 일간변동률의 양(陽)의 2배수에 연동하는 포트폴리오를 구성할 수 있습니다. 그런데, KRX300 지수 선물은 다른 선물계약과 마찬가지로 상장 및 거래 초기에 시장 유동성이 부족한 현상이 발생할 수 있으며, 이러한 기초지수 선물의 저 유동성 현상은 본 투자신탁의 장중 가격 괴리율을 확대시키는 요인으로 작용할 수 있습니다. 또한 선물 유동성 저하로 인하여 선물 가격 변동이 기초지수 변동을 충분히 반영하지 못할 수 있으며, 이로 인해 본 투자 신탁의 일간 수익률이 기초지수의 일간 변동폭의 2배를 추종하지 못할 수 있습니다.

●환매조건부 매도 불가능에 따른 위험

이 투자신탁은 환매조건부 매도를 통한 레버리지 전략을 추구하므로 환매조건부 매도가 불가능한 경우 투자전략의 지속적인 수행이 불가능해질 수 있으므로 이로 인해 보유 증권 매도에 따른 손실이 발생할 수 있으며 투자신탁이 해지될 수도 있습니다.

●순자산가치 변동위험

환매청구일과 환매일이 다르기 때문에 환매청구일로부터 환매일까지의 투자신탁재산의 가치변동에 따른 위험에 노출됩니다.

●기준가격 산정오류의 위험

이 투자신탁의 기준가격을 산정함에 있어서 일반사무관리회사, 판매회사 등 관련 기관의 잘못된 업무처리로 인하여 오류가 발생할 수 있으며, 이러한 오류가 법에서 정한 오차 범위를 초과하지 않는 경우에는 투자자 보호를 위한 별도의 조치를 취하지 아니할 수 있습니다. 따라서 기준 가격 산정 오류가 이러한 오차범위 이내에서 발생한 경우 당해 투자신탁을 청약하거나 환매한 투자자, 기존투자자들 사이에 서로 다른 경제적 가치를 수령할 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.