

삼성 인덱스프리미엄30 증권투자회사[채권혼합]

| 펀드 수익률 (기준일 : 2025.01.23 / 설정일 : 2002.02.05)

3개월 수익률

-0.58%

1년 수익률

1.93%

설정 이후 수익률

142.55%

| 펀드매니저의 한마디

고수익성, 가치주,
소형주에 비중을 높여 투자

펀드 수익률

(기준일: 2025.01.23)



기간 수익률

(단위: %)

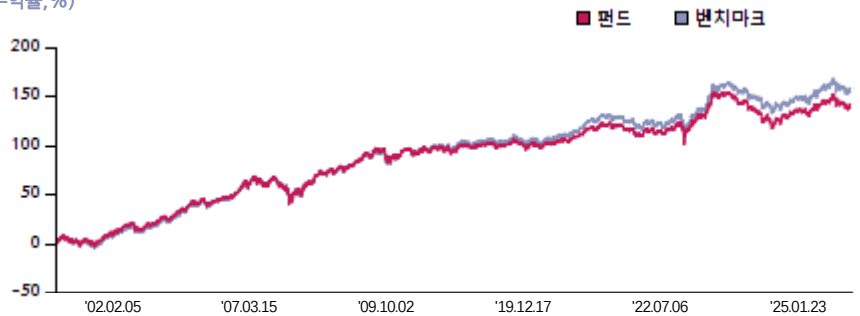
구분	1개월	3개월	6개월	1년	3년	설정 이후
Class A	1.25	-0.58	-2.77	1.93	0.34	142.55
비교지수(벤치마크)	1.27	-0.36	-2.42	2.92	2.25	159.05
초과수익률	-0.02	-0.22	-0.35	-0.99	-1.91	-16.50

※ Class A 기준

※ 비교지수 : KAP 양도성예금증서(CD) 금리지수*70.00% + KOSPI200*30.00%

전체 수익률

(수익률, %)



운용 경과

(기준일: 2025.01.23)

벤치마크지수 대비 하회한 성과를 기록

지난 3개월 동안 펀드의 누적수익률은 -0.58%를 기록하여 같은 기간 동안 -0.36%의 수익률을 기록한 비교 지수 대비 하회한 성과를 기록 하였습니다. 중소형주가 대형주 대비 강세를 보였고 스타일별로는 성장주가 가치주 대비 아웃퍼폼 했습니다. 10월 주식시장은 경기 둔화에 대한 우려감이 부각되었으나, 밸류에이션 매력도가 주가지수의 하단을 지지하며 약보합을 기록했습니다. 특히, 고려아연이 경영권 분쟁으로 높은 변동성을 보였습니다. 11월 주식시장은 트럼프 전 대통령의 미국 대선 승리에 따라 한국 시장은 약세를 면치 못했고, 업종별 차별화가 두드러졌습니다. 12월은 기업이익 하향 조정세가 지속되는 가운데 3일 계엄령 사태 이후 급락했으며, 탄핵소추안 가결 전후로 주식시장은 빠르게 반등하며 지수 낙폭이 축소하였습니다.

운용 계획

(기준일: 2025.01.23)

고수익성, 가치주, 소형주에 비중을 높여 투자

본 펀드는 수익성이 높은 종목군, 순자산대비 가치가 저평가된 종목군 및 상대적으로 시가총액 규모가 작은 종목군에 비중을 높여 운용하고 있습니다. 이러한 종목군에 대한 비중확대는 장기적으로 시장대비 초과성과를 이루기 위한 핵심요인이라는 믿음으로 지속적으로 유지해 나갈 예정입니다. 종목군의 변화에 따른 매매 발생시에는 비용을 최소화할 수 있는 매매시점과 매매기법으로 대응해 나갈 예정입니다. 또한, 블랙딜, 기업공개, 기업분할, 자사주 매수 등의 기업 이벤트 발생 시에는 적절한 대응을 병행하여 초과수익을 추구할 계획입니다. 운용과정에서 과도한 수익추구에 따른 지나친 위험을 감수하기보다는 적절한 위험수준 내에서 수익을 얻기 위해 노력하겠습니다.

펀드매니저

이재열

배상

1 펀드 개요

● 기본정보

펀드의 기본정보를 확인하실 수 있습니다

운용기간	2024.10.24 ~ 2025.01.23
자산운용회사	삼성자산운용
펀드재산 보관회사	국민은행(유)삼성투신
펀드 종류	투자회사, 증권(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형
최초설정일	2002.02.05
위험등급	4등급(보통위험)
고난도 펀드 여부	해당사항 없음
일반사무관리회사	삼성자산운용
존속기간	별도의 종료일 없음
판매회사	※ 판매사확인은 아래 홈페이지에서 확인가능합니다. 삼성자산운용주식회사 http://www.samsungfund.com / 1533-0300 금융투자협회 http://dis.fundservice.net
펀드명	금융투자협회 펀드코드
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합]	33682
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합](A)	15319
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합](C)	15320
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합](Ce)	15322
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합](Cw)	15321
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합](S)	AP348

● 재산현황

펀드의 당기와 전기 재산현황 및 기준가격을 비교할 수 있습니다.

(단위: 억원, 억좌)

항목	전기말	당기말	증감률(%)
자산 총액 (A)	49.20	48.74	-0.9
부채 총액 (B)	0.16535141	0.10612341	-35.8
순자산총액(C=A-B)	49.03	48.63	-0.8
발행 수익증권 총 수(D)	49.97	49.79	-0.3
기준가격※ (E=C/D*1000)	981.19원	976.58원	-0.5

(단위: 원)

종류(Class)별 기준가격 현황			
종류	전기말	당기말	증감률(%)
Class A	964.70	959.09	-0.6
Class C	932.62	925.11	-0.8
Class Ce	948.54	941.96	-0.7
Class S	955.99	949.86	-0.6

※ 기준가격이란 투자자가 펀드를 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

● 분배금 내역

분배금 내역				
분배금 지급일	분배금 지급금액(백만원)	분배금 수탁고(백만원)	기준가격(원)	
			분배금 지급전	분배금 지급후
2025.01.24	0	4,968	976.67	976.67

종류(Class)별 분배금 내역

종류 분배금 지급금액(백만원)

조회된 데이터가 없습니다.

2 운용 현황

(기준일: 2025.01.23)

● 상세 기간 수익률

각 기간별 펀드의 수익률을 확인할 수 있습니다.

(단위: %)

	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
운용펀드 (비교지수*)	-0.47 (-0.36)	-2.55 (-2.42)	0.02 (0.32)	2.39 (2.92)	6.52 (6.84)	1.71 (2.25)	11.01 (11.81)
비교지수대비성과	-0.11	-0.13	-0.30	-0.53	-0.32	-0.54	-0.80

종류(Class)별 현황

	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
Class A	-0.58	-2.77	-0.32	1.93	5.56	0.34	8.54
Class C	-0.81	-3.21	-0.99	1.02	3.68	-2.34	3.78
Class Ce	-0.69	-2.99	-0.65	1.47	4.62	-1.01	6.12
Class S	-0.64	-2.88	-0.50	1.69	5.06	-0.38	7.22

* 비교지수: KAP 양도성예금증서(CD) 금리지수*70.00% + KOSPI200*30.00%

● 연도별 수익률

과거 3년의 연간 수익률을 확인할 수 있습니다.

(단위: %)

	2022년	2023년	2024년
운용펀드 (비교지수*)	-8.85 (-7.90)	8.94 (8.32)	-1.03 (-0.59)
비교지수대비성과	-0.95	+0.61	-0.45

* 비교지수: KAP 양도성예금증서(CD) 금리지수*70.00% + KOSPI200*30.00%

● 추적오차

펀드 수익률이 비교지수에서 얼마나 벗어났는지 확인할 수 있습니다.

(단위: %)

기간	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
추적오차	0.46	0.48	0.42

주) 추적오차란 일정기간 동안 인덱스펀드가 추종하는 특정 비교지수의 변동을 얼마나 충실히 따라갔는지를 보여주는 지표로서, 비교지수 수익률 대비 해당 인덱스펀드 일간 초과수익률의 표준편차로 기재합니다. 추적오차의 수치가 적을수록 해당 기간 동안 인덱스펀드가 비교지수와 유사하게 움직였음을 의미합니다.

3 자산 현황 (기준일 : 2025.01.23)

● 자산구성현황

아래표를 통하여 자산구성 및 통화별 금액의 구성비율을 확인하실 수 있습니다.

※ 자펀드인 경우 자산구성현황은 모펀드 투자비율을 감안하여 산출 (단위 : 억원, %)

통화별 구분 (기준 환율)	증권				파생상품		부동 산	특별자산		단기 대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자증권	장내	장외		실물	기타			
KRW (1.0)	10.54 (21.6)	27.50 (56.4)	-	3.54 (7.3)	(0.0)	-	-	-	-	7.01 (14.4)	0.14 (0.3)	48.74 (100.0)

※ () : 구성비중 %

● 주요 자산보유 현황

펀드자산 총액에서 상위 10종목, 자산총액(파생상품의 경우 위험평가액)의 5%를 초과하는 종목이거나 발행주식 총수의 1%를 초과하는 종목(해외주식 제외)을 나타냅니다. 보다 상세한 투자대상 자산 내역은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기 영업보고서 및 결산보고서에서 참고하실 수 있습니다. 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이 할 수 있습니다.

▶ 주식

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량	평가금액	국가	업종	비고
삼성전자	5.0	4,506	242.0	한국	IT	
SK하이닉스	2.4	536	117.7	한국	IT	AA0
KB금융	0.6	318	28.2	한국	금융	AAA
현대차	0.6	131	27.4	한국	경기소비재	AAA
NAVER	0.5	126	25.8	한국	IT	BBB0

▶ 채권

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	액면가액	평가금액	발행일 (상환일)	보증 기관	신용 등급
국고03625-2509(23-8)	29.3	1,400	1,427.5	23.09.10 (25.09.10)		
국고04250-2512(22-13)	14.6	700	713.3	22.12.10 (25.12.10)		
국고03250-2603(24-3)	6.3	300	305.7	24.03.10 (26.03.10)		
국고03375-2503(23-3)	6.2	300	304.0	23.03.10 (25.03.10)		

▶ 집합투자증권

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량	평가금액	국가	업종	비고
KODEX 200	7.3	10,497	353.6	한국		

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량	평가금액	국가	업종	비고
예금	14.4	701	700.9	한국		

▶ 기타

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량(취득 가)	평가금액	국가	업종	비고
KODEX 200	0.2	10	9.7	한국		

4 투자운용전문인력 현황

● 운용전문인력

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회 등록번호
		펀드 개수	운용 규모	펀드 개수	운용 규모	
이재열	책임펀드매니저*	7	3,367.4	-	-	2109000935
이경원	펀드매니저	31	14,953.2	-	-	2115001411
책임펀드 매니저 주요 운용경력	2011년 01월 ~ 2012년 11월 삼성자산운용 펀트운용팀 2012년 12월 ~ 2023년 11월 삼성자산운용 주식운용본부 2023년 12월 ~ 現 삼성자산운용 인덱스펀트운용팀					

* '책임펀드매니저'란 펀드매니저 중 투자 전략수립 및 의사결정에 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 인력

※ 펀드매니저 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

● 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2020-04-21 ~ 현 재	이재열

5 비용 현황

(전기 : 2024.07.24 ~ 2024.10.23 / 당기 : 2024.10.24 ~ 2025.01.23)

● 총보수 비용비율(연환산)

(단위 : %)

	총보수 비용비율(A)		중개수수료 비율(B)		합계(A+B)	
	전기	당기	전기	당기	전기	당기
Class ALL	1.27	1.28	0.02	0.02	1.29	1.29

종류(Class)별 현황

	Class A		Class C		Class Ce		Class S
총보수 비용비율(A)	0.45	0.45	0.02	0.02	0.47	0.47	
중개수수료 비율(B)	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	
합계(A+B)	0.47	0.47	0.04	0.04	0.49	0.49	

* 총보수 비용비율(Total Expense Ratio)이란 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

** 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈비율로 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

● 보수 및 비용 지급현황(분기별)

(단위 : 백만원, %)

	구분		전기		당기	
			금액	비율(%)*	금액	비율(%)*
운용펀드	자산운용회사		4.86	0.10	4.86	0.10
	판매 회사	A	-	-	-	-
		C	9.81	0.23	9.83	0.23
		Ce	0.17	0.11	0.17	0.11
		S	0.00	0.06	0.00	0.06
	펀드재산보관회사		0.24	0.01	0.24	0.01
	일반사무관리회사		0.36	0.01	0.36	0.01
	보수 합계		15.46	0.32	15.48	0.32
	기타비용		0.03	0.00	0.03	0.00
	증권거래 비용	단순 매매 중개 수수료	0.16	0.00	0.15	0.00
		조사분석 업무등 서비스 수수료	0.04	0.00	0.04	0.00
		합계	0.20	0.00	0.19	0.00
	증권거래세		0.02	0.00	0.09	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 유가증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 보수 및 증권거래비용은 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 없음

6 투자자산 매매내역

● 매매주식규모 및 회전율

매매회전율이높을 경우 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

(단위 : 주, 억원, %)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
2,094	1.14	1,375	0.51	4.9	18.8

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

● 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

펀드명	'24.04.24 ~ '24.07.23	'24.07.24 ~ '24.10.23	'24.10.24 ~ '25.01.23
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합]	5.4	1.1	4.9

7 동일한(해당) 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

해당 펀드가 동일한 집합투자업자가 운용하는 다른 펀드에 투자하는 경우(재간접구조 등) 아래와 같이 투자대상 집합투자기구명과 펀드의 보유 비중 등을 기재한다.

(단위 : 주, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100 (%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
삼성KODEX200증권상장지수투자신탁[주식]	170,050,000	10,497	0.01

8 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

● 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

(주식 투자)주식 및 파생상품 등에 투자함으로써 투자대상자산의 가격 변동, 이자율 등 기타 거시경제지표의 변화에 따른 시장 위험, 투자대상종목 발행회사의 재무상황 및 신용상태의 악화에 따른 신용 위험, 유동성 위험 등
(채권 투자) 채권 및 파생상품 등에 투자함으로써 투자대상자산의 가격 변동, 이자율 등 기타 거시경제지표의 변화에 따른 시장 위험, 투자대상종목 발행회사의 재무상황 및 신용상태의 악화에 따른 신용 위험, 유동성 위험 등
(지수추종 투자) 추종하는 지수와의 수익률 괴리 폭 확대 가능, 지수 구성 종목 변경에 따른 매매시 시장 충격, 미체결, 거래정지, 환율 변동 등에 따른 추적오차 발생 위험, 지수의 산출방식 변경, 지수관리회사의 사정 또는 기타 피지 못할 사정으로 인한 지수 발표 중단 등에 따른 지수 관련 위험 등

● 주요 위험 관리 방안

법규 상 한도, 투자자별 가이드라인 및 내부 위험관리지침 상 제약사항에 대한 일간 컴플라이언스 모니터링, 내규 및 내부 위원회 의결에 따른 위험한도 설정, 주기적 사후 모니터링(성과, 자산건전성 및 이슈발생 가능성 등) 및 내부 위원회 보고

● 자전거래 현황

(단위 : 백만원)

자전거래 규모	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
매도금액	0	0	0	0
매수금액	0	0	0	0

● 주요 비상대응계획

운용부서의 이슈 발생가능성 상시 모니터링, 이슈사항 발견시 내부통제부서와 협의 후 중대사안의 경우 내부 위원회 보고 및 판매사/투자자 고지

공지사항

- 고객님이 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률의 적용을 받습니다.
- 주요 공시사항은 금융투자협회 전자공시 및 당사 홈페이지에서 확인 가능합니다.
 - 삼성자산운용 <http://www.samsungfund.com> / 콜센터 : 080-377-4777
 - 금융투자협회 dis.fundservice.net
- 이 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의해
삼성인덱스프리미엄30증권투자회사[채권혼합] 의
 자산운용사인 삼성자산운용이 작성하여 판매사를 통해 고객님들께 제공됩니다.
- 투자자의 계좌별 수익률정보는 판매회사의 홈페이지인시스템(HTS)이나 인터넷 뱅킹 등을 통해 조회할 수 있습니다.