

삼성KODEX 미국나스닥100데일리커버드콜OTM증권상장지수투자신탁[주식-파생형](펀드 코드: EE291)

투자 위험 등급 1등급(매우높은위험)					
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 위험도**를 감안하여 **1등급**으로 분류하였습니다.

집합투자증권은 『예금자보호법』에 따라 보호되지 않는 실적배당상품입니다.

해당 집합투자기구는 **주식, 주식 관련 파생상품, 주식 관련 집합투자증권**을 주된 투자대상으로 신탁재산의 **60% 이상**을 투자하며, 미국거래소에 상장된 주식 투자에 따른 **특정국가 집중투자위험**, 해외투자에 따른 **환율변동위험**, 기초지수 추중에 따른 **추적오차 발생위험**, 커버드콜 전략을 활용하여 운용함에 따른 **커버드콜 전략 위험 등이 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.**

이 요약정보는 삼성KODEX 미국나스닥100데일리커버드콜OTM증권상장지수투자신탁[주식-파생형]의 투자설명서의 내용 중 중요사항을 발췌·요약한 핵심정보를 담고 있습니다. 따라서 자세한 정보가 필요하신 경우에는 **동 집합투자증권을 매입하기 이전에 투자설명서를 반드시 참고하시기 바랍니다.**

[요약정보]

투자목적 및 투자전략	<p>- 주식, 주식 관련 파생상품, 주식 관련 집합투자증권을 주된 투자대상으로 신탁재산의 60% 이상을 투자하며, Nasdaq Indices에서 산출·발표하는 Nasdaq-100® Daily Covered Call 101 Index(Total Return, KRW)를 기초지수로 하여 1좌당 순자산가치의 변동률을 기초지수의 변동률과 유사하도록 투자신탁재산을 운용함을 목적으로 합니다.</p> <p>- 이 투자신탁은 기초자산을 매수하고 매수한 기초자산관련 콜옵션을 매도하는 커버드콜 전략의 집합투자기구입니다.</p> <p>[이 투자신탁의 목표 분배율, 분배주기, 분배재원]</p> <p>(1) 목표 분배율: 해당사항 없음(이 투자신탁은 목표분배율을 설정하고 있지 않습니다.)</p> <p>(2) 분배주기: 매 월</p> <p>(3) 분배재원: 주식배당, 옵션프리미엄</p> <p>* 분배금 지급을 위한 재원이 기초자산 매도 금액은 아니지만 빈번한 설정환매, 보유자산 매매, 결산 등 다양한 이유로 기초자산 매도금액의 일부가 분배 재원으로 활용될 수 있습니다.</p> <p>※ 다만, 상장 초기의 경우 보유 주식의 배당권리 부재로 월분배 불가능 가능성이 존재하며, 이후 배당재원이 부족할 경우 배당금이 줄거나 지급되지 않을 수 있으며 지급 방식이 변동될 수 있습니다.</p> <p>이 투자신탁은 외국통화표시자산에의 투자로 인해 발생하는 환율변동위험을 제거하기 위한 환헤지전략을 실시하지 않을 계획이므로 환율변동위험에 노출됩니다.</p>
-------------	--

분류	투자신탁, 증권(주식파생형), 개방형(중도환매가능), 추가형(추가납입가능), 상장지수투자신탁
----	---

투자비용	투자자가 부담하는 수수료, 총보수 및 비용					1,000만원 투자시 투자자가 부담하는 투자기간별 총보수·비용 예시 (단위 : 천원)					
	명칭	판매수수료	총보수	판매보수	동종유형 총보수	총보수·비용	1년	2년	3년	5년	10년
	삼성KODEX 미국나스닥100데일리커버드콜OTM증권상장지수투자신탁[주식-파생형]	없음	0.2500%	0.001%		0.3520%	35	71	109	191	434

- (주1) 구체적인 투자비용은 투자설명서' 제2부. 집합투자기구에 관한 사항 중 13. 보수 및 수수료에 관한 사항'을 참고하시기 바랍니다.
- (주2) '**동종유형 총보수**'는 한국금융투자협회에서 공시하는 동종유형 집합투자기구 전체의 평균 총보수비용을 의미합니다.
- (주3) '1,000만원 투자시 투자자가 부담하는 투자기간별 총비용 예시'는 투자자가 1,000만원을 투자했을 경우 향후 투자기간별 지불하게 되는 총비용 (판매수수료 + 총보수비용)을 의미합니다. 선취판매수수료 및 총보수·비용은 일정하고, 이익금은 모두 제투자하며, 연간 투자수익률은 5%로 가정하되, 기타비용(증권거래 비용 및 금융비용 제외)의 변동, 보수의 인상 또는 이하 여부 등에 따라 실제 부담하게 되는 보수 및 비용이 달라질 수 있습니다.

투자실적 추이 (연평균 수익률)	명칭	최초설정일	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일 이후
			25/05/01~26/04/30				
	삼성KODEX 미국나스닥100데일리커버드콜OTM증권상장지수투자신탁[주식-파생형]	2024-10-16	39.26				22.67
	비교지수(%)	2024-10-16	38.69				21.17
	수익률 변동성(%)	2024-10-16	10.83				13.98

**투자실적
추이
(연평균
수익률)**

- 비교지수 : Nasdaq-100 Daily Covered Call 101 Index(Total Return, KRW) x 100%(비교지수 성과에는 투자신탁에 부과되는 보수 및 비용이 반영되지 않음)
- 연평균 수익률은 해당 기간동안의 누적수익률을 기하평균방식으로 계산한 것으로 집합투자기구 총비용 지급후 해당기간동안의 세전평균 수익률을 나타내는 수치입니다.
- 수익률 변동성(표준편차)은 해당기간 펀드의 연환산 구간수익률이 평균수익률에서 통상적으로 얼마만큼 등락했는지를 보여주는 수치로서, 변동성이 높을수록 수익률 등락이 빈번해 펀드의 손실위험이 높다는 것을 의미합니다.

**운용전문
인력**

성명	생년	직위	운용현황		동종집합투자기구 연평균 수익률(과생형)				운용 경력년수
			집합투자 기구 수	운용규모	운용역		운용사		
					최근1년	최근2년	최근1년	최근2년	
이준재	1991	책임(VP)	20개	108,414억원	25.33%	28.47%	17.23%	20.34%	4년 6개월

- 상기인은 이 투자신탁의 투자전략 수립 및 투자의사결정 등에 주도적·핵심적 역할을 수행하는 운용전문인력입니다.
- 운용중인 다른 집합투자기구 중 성과보수가 약정된 집합투자기구 : 해당사항없음
- 위의 집합투자기구 수에는 모자형투자신탁의 모투자신탁은 포함되어 있지 않습니다.
- 운용전문인력의 최근 과거 3년 이내에 운용한 집합투자기구의 명칭, 집합투자재산의 규모와 수익률 등은 금융투자협회 홈페이지(www.kofia.or.kr)에서 확인할 수 있습니다.
- 동종집합투자기구 연평균 수익률은 해당 집합투자업자가 분류한 동일 유형 집합투자기구의 평균운용성과이며, 해당 운용전문인력의 평균운용성과는 해당 회사근무기간 중 운용한 성과를 의미합니다.
- '운용경력년수'는 해당 운용전문인력이 과거 집합투자기구를 운용한 기간을 모두 합산한 기간입니다.

[업무수탁사 운용전문인력]

해의 운용전문인력

펀드매니저	Junwoo Park (2026. 5.15 기준)
과거 운용경력	- (2021 ~ present) Samsung Asset Management (New York), Inc.

**투자자
유의사항**

- 집합투자증권은 『예금자보호법』에 따라 보호되지 않는 실적배당상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 가하여 주시기 바랍니다.
- 금융위원회가 투자설명서의 기재사항이 진실 또는 정확하다는 것을 인정하거나 그 증권의 가치를 보증 또는 승인하지 아니함을 유의하시기 바랍니다.
- 간이투자설명서보다 자세한 내용이 필요하시어 투자설명서의 교부를 요청하시면 귀하의 집합투자증권 매입 이전까지 교부 하오니 참고하시기 바랍니다.
- 간이투자설명서는 증권신고서 효력발생일까지 기재사항 중 일부가 변경될 수 있으며, 개방형 집합투자증권인 경우 효력발생일 이후에도 변경될 수 있습니다.
- 이 집합투자증권의 투자위험등급을 확인하시고, 귀하의 투자 경력이나 투자성향에 적합한 상품인지 신중한 투자결정을 하시기 바랍니다.
- 증권신고서, 투자설명서상 기재된 투자전략에 따른 투자목적 또는 성과목표는 반드시 실현된다는 보장은 없습니다. 또한 과거의 투자실적이 장래에도 실현된다는 보장은 없습니다.
- 집합투자기구가 설정 후 1년이 경과하였음에도 설정액이 50억원 미만(소규모펀드)인 경우 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란하거나 임의해지 될수 있으니, 투자 시 소규모펀드 여부를 확인 하시기 바라며 소규모펀드 해당여부는 금융투자협회, 판매회사, 자산운용사 홈페이지에서 확인할 수 있습니다.

**주요투자
위험**

구분	투자위험의 주요내용
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.
시장위험 및 개별위험	투자신탁재산을 Nasdaq-100 Daily Covered Call 101 지수구성종목 등에 주로 투자함으로써 증권의 가격 변동, 이자율 등 기타 거시경제지표의 변화 등에 따른 위험에 노출됩니다. 또한, 투자신탁재산의 가치는 투자대상 집합투자증권과 파생상품이 투자하는 발행회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화에 따라 급격히 변동될 수 있으며 이에 따른 투자원금의 손실이 발생할 수 있습니다.
상장폐지위험	유가증권시장 상장규정 제116조의 상장폐지기준에 해당하거나 그 밖에 공익실현과 투자자 보호를 위하여 ETF의 상장폐지가 필요하다고 거래소가 인정하는 경우에는 관련규정에 의하여 당해 ETF를 상장폐지해야 하므로 상장폐지위험에 노출될 수 있습니다.

구분	투자위험의 주요내용	
주식 등 가격변동 위험	이 투자신탁은 미국 증권시장에 상장되어 거래되는 주식 등에 주로 투자하기 때문에 동 주식의 가격변동으로 인한 손실위험에 노출됩니다. 또한, 투자신탁재산의 가치는 투자대상종목 발행회사의 영업환경, 재무상황 및 신용상태의 악화에 따라 급격히 변동될 수 있습니다.	
환율변동 위험	이 투자신탁은 해외투자자로서 환율변동 위험 제거를 위한 환헷지 전략은 기본적으로 실시하지 않을 계획이므로 이후 환율변동으로 인한 급격한 신탁재산 가치변동을 조래할 수 있습니다. 심지어 투자신탁에서 투자한 증권의 가격상승으로 인한 수익이 발생하더라도 통화의 가치가 더 크게 하락할 경우 오히려 투자원본의 손실을 초래할 수도 있으며, 투자증권의 가격하락으로 손실이 발생할 경우에도 해당 통화가치의 하락이 펀드의 손실폭을 더 확대시킬 수도 있습니다.	
추적오차 발생 위험	이 투자신탁은 기초지수와 동일한 수익률을 실현함을 그 투자목적으로 하고 있으나, 투자신탁보수, 위탁매매수수료 등 관련 비용의 지출, 지수 구성종목 변경에 따른 매매시 시장 충격, 거래정지 등으로 인한 미체결, 환율변동 등 현실적 제한, 이 투자신탁의 기초지수 관련 파생상품 등에 투자 등으로 인하여 기초지수와 동일한 수익률이 실현되지 아니할 가능성이 있습니다. 또한, 송금 및 거래비용이 누적되어 지수 추적오차가 더 많이 발생할 수 있습니다. 따라서 이 투자신탁의 수익률과 기초지수의 수익률이 동일할 것을 전제로 하는 투자는, 당해 추적오차로 인하여 예상하지 못한 손실을 실현할 수도 있습니다.	
특정국가 집중투자 위험	이 투자신탁은 특정국가(미국)의 주식에 주로 투자하기 때문에 특정국가의 시장, 정치 및 경제상황 등에 따른 위험에 더 많이 노출이 되어 있으며, 이는 일반적으로 글로벌주식시장 전체에 투자하는 글로벌 주식형 투자신탁보다 더 높은 위험을 부담할 가능성이 높습니다.	
장외파생상품 관련 위험	이 투자신탁은 거래소와 같은 공개장외가 아닌 장외시장에서 거래가 이루어지는 장외파생상품에 투자할 수 있습니다. 상대적으로 정부의 규제나 감독이 엄격하지 않은 장외시장에서 거래가 이루어짐으로써 거래소의 정산이행보증과 같이 장내거래 참여들에 게 제공되는 보호가 제공되지 않습니다. 따라서 장외파생상품에 투자시에는 거래상대방이 파산하거나 신용위기를 경험하는 경우 투자자금 전액회수가 불가능할 수도 있는 위험에 노출됩니다. 또한 거래상대방의 영업환경, 재무상황, 부도처리 및 신용상태의 악화에 따라 투자원금의 전부 또는 일부 손실이 발생할 수 있는 신용위험에 노출되어 있습니다. 이 경우 투자원금 손실과 더불어 투자신탁이 충도에 해지될 수 있습니다. 또한 거래상대방이 신용위험에 과도하게 노출되었다고 판단되었을시 거래상대방의 교체 또는 변경을 용이하게 하고자 하는 노력에도 불구하고 신용위험에 따른 투자손실의 위험에 노출됩니다.	
옵션 시장의 변동성 노출 위험	기초자산과 옵션을 결합한 전략을 수행함에 따라 옵션 거래량 제한 등 옵션 시장의 변동성에 노출될 수 있습니다.	
월 분배금 지급에 따른 위험	이 투자신탁은 월분배 상품으로 커버드콜(콜옵션 매도 프리미엄)과 기초지수(나스닥 100) 주식에서 발생하는 배당금을 재원으로 분배금이 지급 됩니다. 다만, 본 투자신탁에서 지급하는 월지급액은 기초지수 변동성에 의해 옵션 프리미엄의 수준이 달라짐에 따라 투자자가 실제 수령하는 월수령액은 매월 변동할 가능성이 높으며 분배금이 지급되지 않을 수도 있음에 유의하시기 바랍니다. 분배금은 분배 재원 상황 등 기타 사유에 따라 분배금이 줄거나 지급되지 않을 수 있으며 매월 지급 방식에서 수시로 지급 방식이 변동될 수 있습니다. 또한 투자기간 중 수령한 분배금과 보유하고 있는 투자신탁의 평가금액을 모두 합산하더라도 투자금액 대비하여 손실이 발생할 수 있으며, 결산시점에 연간 1회 분배하는 것에 비해 월간 분배로 인해 세제상 불리할 수 있습니다.	
커버드콜 전략 위험	기초자산과 옵션 상품 등이 결합된 전략을 사용하는 집합투자기구의 경우 기초자산을 매수 후 보유하는 전략을 사용하는 일반적인 집합투자기구에 비해 순의구조가 상이 합니다. 특히 이 투자신탁은 커버드콜(기초자산 매수 및 관련 콜옵션 매도) 전략을 구사하는 상장지수투자신탁으로 콜옵션 매도에 따라 기초자산 가격 상승 대비 수익은 제한될 수 있고, 기초자산 가격 하락시 옵션 프리미엄 수취로 하락폭을 일부 만회할 수 있으나 하락폭 확대시 손실(원금 손실)이 발생할 수 있으며 동 전략이 무조건적인 수익을 보장하지 않습니다.	
매입 방법	개인투자자 : 장내 매수 법인투자자 : 장내 매수, 설정 청구	환매 방법 개인투자자 : 장내 매도 법인투자자 : 장내 매도, 환매 청구
환매 수수료	없음	
기준가	산정방법	당일에 공고되는 기준가격은 그 직전일의 재무상태표상에 계산된 투자신탁의 자산총액에서 부채총액을 차감한 금액(이하 "순자산총액"이라 한다)을 직전일의 수익증권 총 좌수로 나누어 1좌 단위로 4사5입하여 원미만 둘째 자리까지 계산합니다. 이 투자신탁의 기준가격은 1좌당 가격으로 공고합니다.
	공시장소	판매회사 또는 지정참가회사 영업점, 집합투자업자(http://www.samsungfund.com) · 판매회사 또는 지정참가회사 · 한국금융투자협회(www.kofia.or.kr), 증권시장 인터넷홈페이지

과세	구분	과세의 주요내용	
	집합투자기구	집합투자기구 단계에서는 별도의 소득과세 부담이 없는 것이 원칙 입니다.	
	수익자	거주자와 일반법인이 받는 집합투자기구로부터의 과세 이익에 대해서는 15.4%(지방소득세 포함) 세율로 원천징수 됩니다. 단, 연간 금융소득합계액이 기준금액을 초과하는 경우에는 기준금액을 초과하는 금액을 다른 종합소득과 합산하여 개인소득세율로 종합과세 됩니다. ※ 세계혜택계좌 등 투자자의 과세에 관한 사항은 투자설명서 제2부, 14. 이익 배분 및 과세에 관한 사항을 참고하시기 바랍니다.	
전환절차 및 방법	1. 이연관매보수(CDSC) 적용기준 및 내용 - 해당사항없음 2. 전환형 구조 - 해당사항 없음		
집합투자업자	삼성자산운용주식회사 (대표전화:1533-0300) [업무수탁사 : 삼성자산운용(뉴욕)] [업무위탁범위 : 운용업무/운용지시업무/조사분석업무/매매주문업무 등을 포함하는 기타 업무]		
모집기간	2024년 10월 13일부터 모집을 개시하며 모집개시일 이후 특별한 사정이 없는 한 계속하여 모집할 수 있습니다.	모집·매출 총액	추가로 설정할 수 있는 수익증권의 총좌수는 10조좌입니다.
효력발생일	2026. 5.15	존속기간	해당사항 없음
판매회사	집합투자업자(http://www.samsungfund.com) 및 금융투자협회(www.kofia.or.kr) 홈페이지 참조		
참조	집합투자업자의 사업목적, 요약 재무정보에 관한 사항은 투자설명서 제4부, 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항을 참조하시기 바랍니다.		
[집합투자기구 공시 정보 안내] <ul style="list-style-type: none"> ● 증권신고서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr) ● 투자설명서 : 금융감독원 전자공시시스템(dart.fss.or.kr), 한국금융투자협회(dis.kofia.or.kr) 집합투자업자(http://www.samsungfund.com) 및 판매회사 홈페이지 ● 정기보고서(영업보고서, 결산서류) : 금융감독원 홈페이지(www.fss.or.kr) 및 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) ● 자산운용보고서 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(http://www.samsungfund.com) ● 수시공시 : 한국금융투자협회 전자공시시스템(dis.kofia.or.kr) 및 집합투자업자 홈페이지(http://www.samsungfund.com) 			

