

**자산보관·관리보고서**

이 보고서는 집합투자기구재산을 보관·관리하는 신탁업자가 집합투자재산이 적정하게 운용되었는지 여부 등에 관하여 확인한 내용을 투자자에게 제공하기 위해 “자본시장과 금융투자업에 관한 법률” 제 248 조제 1 항에 따라 작성되었습니다.

신탁업자명 : 홍콩상하이은행 서울지점  
 문의가능 전화번호 : 02-2004-0065/6955-1004

**1. 집합투자기구의 개요**

- 가. 집합투자기구 명칭: 삼성KODEX 테슬라밸류체인 FactSet 증권상장지수투자신탁[주식-파생형]
- 나. 집합투자기구 분류: 증권집합투자기구(주식파생형)
- 다. 보관·관리기간: 2023.06.05 - 2023.12.31
- 라. 집합투자업자: 삼성자산운용(주)
- 마. 투자매매업자, 투자중개업자: 신한투자증권(주), 한국투자증권, 미래에셋증권, 메리츠증권, NH투자증권, 삼성증권, 키움증권

**2. 집합투자계약의 주요 변경사항**

| 변경일자       | 변경사유                             | 주요 변경내용   |  |
|------------|----------------------------------|---|--|
|            |                                  | 변경전   | 변경후  |
| 2023.06.22 | 자본시장법 시행령 개정사항 반영 제23조(수익증권의 환매) | 7항 본문의 규정에도 불구하고 다른 각호에서 정하는 사유가 발생하는 경우 집합투자업자는 그 정하는 바에 따라 환매자산을 달리 지급할 수 있다. 1. 투자신탁재산에 증권으로 지급하기 곤란한 자산을 보유하고 있는 경우: 집합투자업자 또는 신탁업자는 당해 자산을 금전으로 환산하여 환매에 응할 수 있다. 이 경우 당해 자산의 평가는 환매청구일로부터 제2영업일에 증가를 기준으로 한다. 2. 투자신탁재산에 환매자산으로 지급하여야 할 금전이 부족할 경우: 집합투자업자 또는 신탁업자는 금전에 갈음하여 증권으로 지급할 수 있다. 이 경우 당해 증권 평가는 환매청구일로부터 제2영업일에 증가를 기준으로 한다. | 8항 본문의 규정에도 불구하고 다른 각호에서 정하는 사유가 발생하는 경우 투자신탁재산에 환매자산으로 지급하여야 할 금전이 부족할 경우 집합투자업자 또는 신탁업자는 금전에 갈음하여 증권으로 환매자산을 지급할 수 있다. 이 경우 당해 증권 평가는 환매청구일로부터 제2영업일에 증가를 기준으로 한다. |

\* 자세한 변경사항은 <http://dart.fss.or.kr>을 통해서 찾아 보실 수 있습니다.

**3. 투자운용인력의 변경**

- 해당사항 없음

**4. 집합투자자총회의 결의내용**

- 해당사항 없음

**5. 이해관계인과의 거래의 적격여부를 확인한 경우의 그 내용**

- 해당사항 없음

**6. 회계감사인의 선임·해임에 관한 사항**

- 해당사항 없음

**7. 법 제247조 제5항 각호의 사항 확인**

- 투자설명서가 법령 및 집합투자계약에 부합하는지의 여부
  - 부합함
  - 자산운용보고서의 작성이 적정한지 여부
    - 적정함
    - 위험관리방법의 작성이 적정한지 여부
      - 해당사항 없음
    - 집합투자재산의 평가가 공정한지 여부
      - 공정함
      - 집합투자재산의 평가결과에 따라 기준가격이 적정하게 산출되었는지 여부
        - 적정함
      - 집합투자업자의 운용지시가 법, 집합투자신탁 또는 투자설명서에 위반된 경우 신탁업자의 시정요구 및 이에 대한 집합투자업자의 이행명세
        - 해당사항 없음
      - 집합투자재산 명세서와 신탁업자가 보관·관리 중인 집합투자재산의 내역이 일치하는지 여부
        - 일치함
      - 집합투자재산별로 미리 정해진 자산배분명세에 따라 매매결과를 공정하게 배분되었는지의 여부
        - 본 항목은 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행령 제269조 제 1항 제1호에 의거하여 집합투자업자가 운용하는 전체 집합투자기구의 집합투자재산을 보관·관리하는 신탁업자가 둘 이상인 경우에는 해당 신탁업자의 확인사항이 아님
      - 집합투자증권의 추가발행 시 기존 투자자의 이익을 해칠 염려가 없는지 여부
        - 해당사항 없음

**8. 그 밖에 투자자 보호에 필요한 사항**

- 이 투자신탁은 실적배당상품으로 은행예금과는 달리 예금보험공사의 보호를 받지 못함에 따라 투자원리금 전액이 보장 또는 보호되지 않습니다.
- 이 투자신탁의 운용 및 투자 등에 관련하여 보다 자세한 사항은 해당 집합투자업자 홈페이지를 이용할 수 있습니다.