

**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 : 02-2004-8936/0991

**1. 집합투자기구의 개요**

- 가. 집합투자기구 명칭: 삼성KODEX10년국채선물증권상장지수투자신탁[채권-파생형]
- 나. 집합투자기구 분류: 증권집합투자기구(채권-파생형)
- 다. 보관 · 관리기간: 2017.01.01 - 2017.12.31
- 라. 집합투자업자: 삼성자산운용 (주)
- 마. 투자매매업자, 투자중개업자: 메리츠종합금융증권, KB증권, 삼성증권, KB증권(구케이비)

**2. 집합투자규약의 주요 변경사항**

변경일자	변경사유	주요 변경내용	
		변경전	변경후
2017. 05.15	문구 명확화 제34조	(추가)	3. 환매조건부매수 (증권을 일정기간 후에 환매도할 것을 조건으로 매수하는 경우를 말한다. 이하 같다)
	법개정에 따른 운용 제한정정 제36조	나. 지방채 증권_중화인민공화국이 발행한 채권, 주택저당채권유동화회사법 또는 한국주택금융공사법에 따른 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권(주택저당채권유동화회사법에 의한 주택저당채권유동화회사, (~) 투자하는 경우	나. 지방채 증권_중화인민공화국이 발행한 채권, (삭제) 한국주택금융공사법에 따른 주택저당채권담보부채권 또는 주택저당증권((삭제)(~) 투자하는 경우
2017. 05.25	투자한도 정정 제35조	1. 채권에의 투자는 투자신탁 자산총액의 100 분의 60 이상으로 한다.	1. 채권에의 투자는 채권을 기초자산으로 하는 장내파생상품 거래에 따른 위험평가액과 합산하여 투자신탁 자산총액의 100 분의 60 이상으로 한다.
2017. 08.29	설정환매 주기변경 제3조	11. “결제일” 이라 함은(~)환매를 요구한 날(T 일)로부터 제 3 영업일(T+2 영업일)을 말한다.	(삭제)
	오기정정 제32조	③집합투자업자는 (~)경우에는 금융감	③집합투자업자는(~) 경우에는 금융위원회

	독원장의 승인을(~)의 승인을(~)연기할 수 있다.	연기할 수 있다.
--	------------------------------	-----------

\* 자세한 변경사항은 <http://dart.fss.or.kr> 을 통해서 찾아 보실수 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 집합투자규약에 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, 집합투자신탁규약 또는 투자설명서에 위반된 경우 신탁업자의 시정요구 및 이에 대한 집합투자업자의 이행명세  
- 해당사항 없음
- 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.