

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: 삼성KODEX레버리지증권상장지수투자신탁[주식-파생형]
- 나. 집합투자기구 분류: 증권집합투자기구(주식-파생형)
- 다. 보관 • 관리기간: 2016.01.01 - 2016.12.31
- 라. 집합투자업자: 삼성자산운용 (주)
- 마. 투자매매업자, 투자중개업자: 신한금융투자, 한국투자증권, 대신증권, 미래에셋대우, 유진투자증권, 메리츠종합금융증권, NH투자증권, KB증권 (구현대), SK증권, 삼성증권, 동부증권, KB증권 (구케이비투자), 크레디트스위스증권, 골드만삭스증권, 하이투자증권, 미래에셋증권, 키움증권, 리딩투자증권, 하나금융투자

2. 집합투자계약의 주요 변경사항

변경일자	변경사유	주요 변경내용	
		변경전	변경후
2016.02.18	법개정등 반영 제34조	(추가)	②채권의 신용등급이 제 1항제 1 호에서 정한 신용등급 미만으로 하락한 경우(~)신탁업자와 협의하여 유예기간 연장 등 필요한 조치를 결정 하여야 한다.
2016.08.17	법개정 사항반영 제36조	(추가)	단, 법 제 234 조에 따른 상장지수집합투자기구의 (~) 투자하는 날을 기준으로 한다.
2016.09.28	환매 조건부 매수추가 제34조	(추 가) 3. 투자신탁재산으로 보유하는 증권의 대여	3. 환매조건부매수 (증권을 일정기간 후에 환매도할 것을 조건으로 매수하는 경우를 말한다.)

* 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

PUBLIC_HSS FS SEL

6. 회계감사인의 선임 • 해임에 관한 사항

변경전				변경일	변경후			
회계감사인명	계약기간	감사보수	계약방법		회계감사인명	계약기간	감사보수	계약방법
안진회계법인	1년	550만원	서면계약	-	-	-	-	-

*모자형집합투자기구의 경우, 위에 명기된 회계감사인보수 금액은 모집합투자기구 및 자집합투자기구에서 지급되는 보수 금액 모두를 포함하는 금액입니다.

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
- 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.