

삼성당신을위한 삼성그룹밸류인덱스 증권자1[주식]

| 펀드 수익률 (기준일 : 2024.02.28 / 설정일 : 2009.05.29)

3개월 수익률

2.27%

1년 수익률

0.65%

설정 이후 수익률

79.22%

| 펀드매니저의 한마디

삼성그룹밸류인덱스를
잘 추종하도록 운용

펀드 수익률

(기준일: 2024.02.28)



기간 수익률

(단위:%)

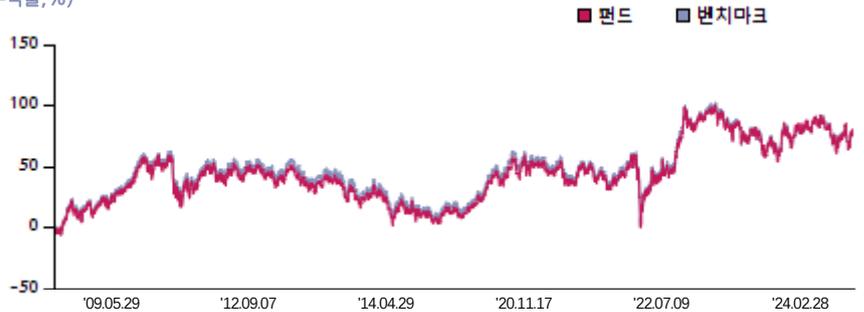
구분	1개월	3개월	6개월	1년	3년	설정 이후
Class A	7.14	2.27	-1.58	0.65	-1.25	79.22
비교지수(벤치마크)	7.20	1.48	-2.20	0.57	-1.97	78.89
초과수익률	-0.06	+0.79	+0.62	+0.08	+0.72	+0.33

※ Class A 기준

※ 비교지수 : WISE삼성그룹밸류인덱스*95.00% + CALL*5.00%

전체 수익률

(수익률,%)



운용 현황

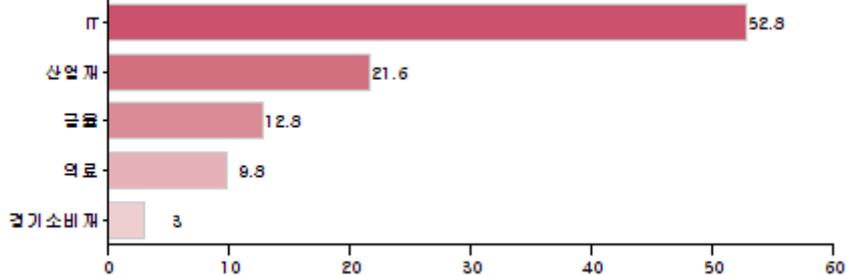
(기준일: 2024.02.28)

보유종목 10종목

(단위:%)

종목명	업종	비중	종목명	업종	비중
삼성전자	IT	19.2	삼성중공업	산업재	3.7
삼성SDI	IT	13.9	삼성생명	금융	3.6
삼성물산	산업재	8.3	삼성증권	금융	3.5
삼성바이오로직스	의료	7.6	에스원	산업재	2.4
삼성전기	IT	6.6	삼성화재	금융	2.4

투자비중



※ 본 그래프는 기준일 현재 편입되어 있는 주식의 업종별 비중을 나타냅니다.

투자비중 증감현황

(단위,%)

종목명	전기비율	당기비율	증감
삼성물산	5.65	8.50	2.9
삼성생명	2.46	3.72	1.3
삼성바이오로	6.56	7.70	1.1
삼성엔지니어	1.89	2.39	0.5
삼성증권	3.48	3.76	0.3

[비중이 가장 많이 늘어난 종목 5개(지난 3개월)]

(단위,%)

종목명	전기비율	당기비율	증감
삼성전기	8.51	6.70	-1.8
삼성SDI	15.85	14.07	-1.8
삼성전자	20.49	19.40	-1.1
제일기획	1.26	1.07	-0.2
삼성에스디에	1.44	1.38	-0.1

[비중이 가장 많이 줄어든 종목 5개(지난 3개월)]

운용 경과

(기준일: 2024.02.28)

벤치마크지수 대비 상회한 성과를 기록

지난 3개월 동안 펀드의 누적수익률은 2.27%를 기록하여 같은 기간 동안 1.48%의 수익률을 기록한 비교 지수 대비 상회하였습니다. 대형주가 중소형주 대비 강세를 보였고 스타일별로는 가치주가 성장주 대비 아웃퍼폼했습니다. 12월은 디스인플레이션 기조 속 글로벌 긴축 사이클 종료 기대가 겹치며 투자심리가 개선되었습니다. 2024년 1월 들어 연준 금리인하에 대한 불확실성, 지정학적 리스크, 그리고 4분기 국내 기업들의 어닝쇼크 등으로 주가는 약세를 보였습니다. 1월 FOMC는 기존 예상대로 금리는 동결했으나, 파월 의장의 기자회견은 다소 덜 비둘기파적 색채를 보였습니다. 중화권 증시 약세 또한 부정적으로 작용하였습니다. 2월은 기업 밸류업 프로그램 기대에 저PBR 종목 급등하며 지수 상승을 견인하였습니다. 또한 현금흐름이 양호해 자사주 소각 여력이 충분하고 적극적으로 주주환원 할 수 있는 대형주 부각되었습니다.

운용 계획

(기준일: 2024.02.28)

삼성그룹밸류인덱스를 잘 추종하도록 운용

펀드는 비교 지수인 삼성그룹밸류인덱스를 충실히 추종하는 한편 기회 발생시 초과 수익 확보하도록 운용할 예정입니다. 과도한 수익 추구에 따른 지나친 위험을 감수하기보다는 적절한 위험수준 내에서 초과수익을 얻기 위해 지속적으로 노력하겠습니다. 인덱스 펀드를 통한 장기투자가 효율적이고 합리적인 투자라는 믿음을 가지고 투자자분들께 좋은 투자 성과를 돌려드리기 위해 최선의 노력을 다하겠습니다. 저희 삼성자산운용 운용담당자들은 투자자분들께 좋은 투자 성과를 돌려드리기 위해 항상 최선의 노력을 다하겠습니다.

펀드매니저 서민웅 배상

1 펀드 개요

● 기본정보

펀드의 기본정보를 확인하실 수 있습니다

운용기간	2023.11.29 ~ 2024.02.28	
자산운용회사	삼성자산운용	
펀드재산 보관회사	하나은행	
펀드 종류	투자신탁, 증권(주식형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	
최초설정일	2009.05.29	
위험등급	2등급(높은위험)	
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
삼성당신을위한삼성그룹밸류인덱스증권모투자신탁[주식]		92692
삼성당신을위한삼성그룹밸류인덱스증권자투자신탁제1호[주식]		92669

● 재산현황

펀드의 당기와 전기 재산현황 및 기준가격을 비교할 수 있습니다.

(단위: 억원, 억좌)

항목	전기말	당기말	증감률(%)
자산 총액 (A)	485.43	489.39	0.8
부채 총액 (B)	0.56894158	1.06590828	87.4
순자산총액(C=A-B)	484.86	488.33	0.7
발행 수익증권 총 수(D)	413.06	405.51	-1.8
기준가격* (E=C/D*1000)	1,173.82원	1,204.24원	2.6

(단위: 원)

종류(Class)별 기준가격 현황

종류	전기말	당기말	증감률(%)
Class A	1,148.01	1,174.07	2.3
Class C-P	1,169.77	1,195.58	2.2
Class C-Pe	1,183.54	1,211.13	2.3
Class C1	1,038.72	1,060.20	2.1
Class C2	1,058.34	1,080.63	2.1
Class C3	1,075.60	1,098.61	2.1
Class C4	1,171.86	1,197.32	2.2
Class C5	1,177.10	1,202.93	2.2
Class Ce	1,119.59	1,144.44	2.2
Class Cw	1,238.37	1,268.69	2.4
Class S	1,280.31	1,310.61	2.4
Class S-P	1,187.62	1,215.84	2.4
Class 적립식	1,100.34	1,124.49	2.2

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

2 운용 현황

(기준일 : 2024.02.28)

● 상세 기간 수익률

각 기간별 펀드의 수익률을 확인할 수 있습니다.

(단위: %)

	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
운용펀드 (비교지수*)	2.59 (1.48)	-0.95 (-2.20)	-2.91 (-4.10)	1.93 (0.57)	5.91 (3.23)	2.59 (-1.97)	26.76 (16.99)
비교지수대비성과	+1.11	+1.25	+1.19	+1.36	+2.68	+4.56	+9.77

종류(Class)별 현황

	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
Class A	2.27	-1.58	-3.84	0.65	3.29	-1.25	18.95
Class C	2.18	-1.75	-4.10	0.28	2.54	-2.30	16.94
Class C-P	2.21	-1.70	-4.02	0.40	2.78	-1.99	17.48
Class C-Pe	2.33	-1.46	-3.67	0.89	3.78	-0.53	20.39
Class Ce	2.22	-1.67	-3.99	0.45	2.88	-1.84	17.77
Class Cw	2.45	-1.23	-3.33	1.35	4.73	0.86	-
Class S	2.37	-1.39	-3.56	1.03	4.06	-0.11	21.24
Class S-P	2.38	-1.37	-3.54	1.07	4.15	0.01	21.48
Class 적립식	2.19	-1.72	-4.06	0.35	2.68	-2.13	17.18

* 비교지수 : WISE삼성그룹밸류인덱스*95.00% + CALL*5.00%

* C클래스(C1, C2, C3, C4, C5)의 수익률은 각 클래스별 순자산에 가중평균하여 산출합니다. 따라서 본 보고서에 표기된 수익률은 고객님의 수익률과 다를 수 있습니다. 고객님의 정확한 수익률은 가입하신 판매사를 통해 확인하시기 바랍니다.

● 연도별 수익률

과거 3년의 연간 수익률을 확인할 수 있습니다.

(단위: %)

	2021년	2022년	2023년
운용펀드 (비교지수*)	2.64 (0.43)	-9.40 (-10.60)	12.07 (10.71)
비교지수대비성과	+2.21	+1.20	+1.36

* 비교지수 : WISE삼성그룹밸류인덱스*95.00% + CALL*5.00%

● 추적오차

펀드 수익률이 비교지수에서 얼마나 벗어났는지 확인할 수 있습니다.

(단위: %)

기간	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
추적오차	2.12	1.59	1.19

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

3 자산 현황 (기준일 : 2024.02.28)

● 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		부동산	특별자산		단기 대출 및 예금	기타	자산 총액
	주식	채권	어음	집합 투자증권	장내	장외		실물	기타			
KRW (1.0)	380.37 (77.7)	-	-	86.18 (17.6)	(0.0)	-	-	-	-	14.85 (3.0)	8.00 (1.6)	489.39 (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	19.2	128,053	9,373.5	한국	IT	
삼성SDI	13.9	17,865	6,815.5	한국	IT	AAO
삼성물산	8.3	26,076	4,060.0	한국	산업재	
삼성바이오로직스	7.6	4,666	3,737.5	한국	의료	
삼성전기	6.6	23,174	3,228.1	한국	IT	

▶ 집합투자증권

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량	평가금액	국가	업종	비고
KODEX 삼성그룹밸류	11.0	610,497	5,390.7	한국		
KODEX 삼성그룹	6.6	348,694	3,227.2	한국		

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량	평가금액	국가	업종	비고
예금	3.0	1,485	1,484.7	한국		

▶ 기타

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량(취득 가)	평가금액	국가	업종	비고
KODEX 삼성그룹	0.2	90	89.7	한국		
삼성전자	0.2	74	74.2	한국	IT	
삼성SDI	0.1	54	54.3	한국	IT	AAO
삼성물산	0.1	31	30.8	한국	산업재	
삼성바이오로직스	0.1	30	29.7	한국	의료	

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	
서민웅	책임펀드매니저*	59	7,902.1	-	-	2119001713
책임펀드 매니저 주요 운용경력	2016년 12월 ~ 2021년 04월 신한금융투자 2021년 05월 ~ 現 삼성자산운용 인덱스퀀트운용팀					

* '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 ~ 2022-11-01	유서훈
2022-11-02 ~ 현 재	서민웅

5 비용 현황

(전기 : 2023.08.29 ~ 2023.11.28 / 당기 : 2023.11.29 ~ 2024.02.28)

● 총보수 비용비율(연환산)

(단위 : %)

	구 분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
		총보수비용 비율	중개수수료 비율	합성총보수 비용비율	중개수수료 비율
Class ALL	전기	1.36	-	1.38	0.02
	당기	1.36	-	1.38	0.01

종류(Class)별 현황

종류	구 분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
		총보수비용 비율	중개수수료 비율	합성총보수 비용비율	중개수수료 비율
Class A	전기	1.27	-	1.29	0.02
	당기	1.27	-	1.29	0.01
Class C-P	전기	1.52	-	1.54	0.02
	당기	1.52	-	1.54	0.01
Class C-Pe	전기	1.03	-	1.05	0.02
	당기	1.03	-	1.05	0.01
Class C1	전기	2.07	-	2.09	0.01
	당기	2.07	-	2.09	0.01
Class C2	전기	1.92	-	1.94	0.02
	당기	1.92	-	1.94	0.01
Class C3	전기	1.79	-	1.81	0.02
	당기	1.79	-	1.81	0.01
Class C4	전기	1.66	-	1.68	0.01
	당기	1.66	-	1.68	0.01
Class C5	전기	1.57	-	1.59	0.02
	당기	1.57	-	1.59	0.01
Class Ce	전기	1.47	-	1.49	0.02
	당기	1.47	-	1.49	0.01
Class Cw	전기	0.57	-	0.59	0.02
	당기	0.57	-	0.59	0.01
Class S	전기	0.89	-	0.91	0.01
	당기	0.89	-	0.91	0.01
Class S-P	전기	0.85	-	0.87	0.01
	당기	0.85	-	0.87	0.01

	구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
		총보수비용 비율	중개수수료 비율	합성총보수 비용비율	중개수수료 비율
Class 적립식	전기	1.57	-	1.59	0.02
	당기	1.57	-	1.59	0.01

* 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 나눈 비율로 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	65.56	0.14	65.81	0.14	
	판매 회사	A	47.89	0.18	47.90	0.18
		C-P	1.60	0.24	1.63	0.24
		C-Pe	2.18	0.12	2.16	0.12
		C1	0.49	0.38	0.44	0.38
		C2	1.47	0.34	1.59	0.34
		C3	1.19	0.31	1.04	0.31
		C4	0.21	0.27	0.40	0.27
		C5	9.60	0.25	9.69	0.25
		Ce	23.87	0.23	24.06	0.23
		Cw	-	-	-	-
		S	0.19	0.08	0.19	0.08
		S-P	0.18	0.07	0.19	0.07
		적립식	6.35	0.25	6.35	0.25
		펀드재산보관회사	3.64	0.01	3.66	0.01
일반사무관리회사	-	-	-	-		
보수 합계	164.40	0.34	165.12	0.34		
기타비용	0.26	0.00	0.26	0.00		
증권거래 비용	단순 매매 중개 수수료	1.56	0.00	1.44	0.00	
	조사분석 업무등 서비스 수수료	0.27	0.00	0.26	0.00	
	합계	1.83	0.00	1.70	0.00	

	구분	전기		당기	
		금액	비율(%)*	금액	비율(%)*
운용펀드	증권거래세	4.49	0.01	4.06	0.01

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 : 없음

6 투자자산 매매내역

● 매매주식규모 및 회전을

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

(단위 : 주, 억원, %)

펀드명	매수		매도		매매회전율	
	수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
삼성당신에위험삼성그룹밸류인덱스 증권모 [주식]	21,036	19.63	27,846	20.8	5.5	22.0

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

● 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

펀드명	'23.05.29 ~ '23.08.28	'23.08.29 ~ '23.11.28	'23.11.29 ~ '24.02.28
삼성당신에위험삼성그룹 밸류인덱스증권모[주식]	9.6	6.0	5.5

6 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, %)

집합투자기구명	발행총수(A)	투자대상 집합투자증권 보유비중 (=A/B*100 (%))	
		투자대상 보유수(B)	보유비중 (%)
삼성당신에위험삼성그룹밸류인덱스증권모투자신탁[주식]	41,537,232,759	41,537,232,759	100.00

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 약화에 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 피치 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

● 자전거래 현황

(단위 : 백만원)

자전거래 규모	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
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

1. 고객님의 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률의 적용을 받습니다.
2. 주요 공지사항은 금융투자협회 전자공시 및 당사 홈페이지에서 확인 가능합니다.
 - 삼성자산운용 <http://www.samsungfund.com> / 콜센터 : 080-377-4777
 - 금융투자협회 dis.fundservice.net
3. 이 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률에 의해 **삼성당신을위한삼성그룹밸류인덱스증권자1[주식]** 의 자산운용사인 삼성자산운용이 작성하여 판매사를 통해 고객님들께 제공됩니다.
4. 투자자의 계좌별 수익률정보는 판매회사의 홈트레이딩시스템(HTS)이나 인터넷 뱅킹 등을 통해 조회할 수 있습니다.