| 자산운용보고서 |

운용기간 : 2026.05.21 ~ 2026.08.20

Samsung Financial Networks

삼성 KRX300인덱스 증권투자신탁[주식-파생형]

펀드 수익률 (기준일 : 2026.08.20 / 설정일 : 2018.02.21)

3개월 수익률	1년 수익률	설정 이후 수익률
-4.71%	143.9%	257.99%

펀드매니저의 한마디

고수익성, 가치주,
소형주에 비중을 높여 투자

삼성자산운용

펀드 수익률

(기준일: 2026.08.20)

[초과수익률]
-0.02%

기간 수익률

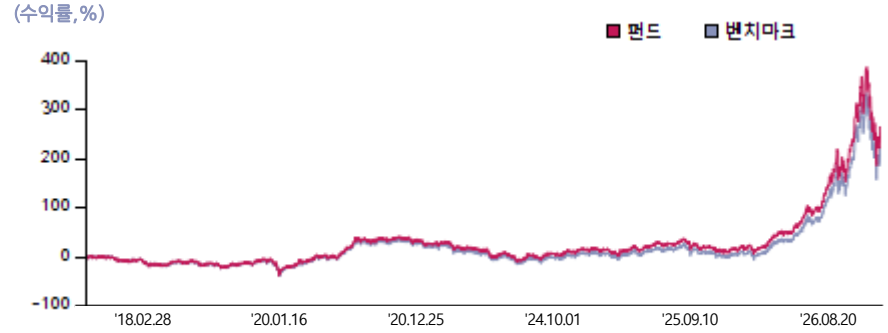
(단위:%)

구 분	1개월	3개월	6개월	1년	3년	설정 이후
Class A	5.11	-4.71	22.70	143.90	220.42	257.99
비교지수(벤치마크)	5.16	-4.69	22.18	142.77	208.05	219.46
초과수익률	-0.05	-0.02	+0.52	+1.13	+12.37	+38.53

※ Class A 기준

※ 비교지수 : KRX 300*100.00%

전체 수익률



운용 현황

(기준일: 2026.08.20)

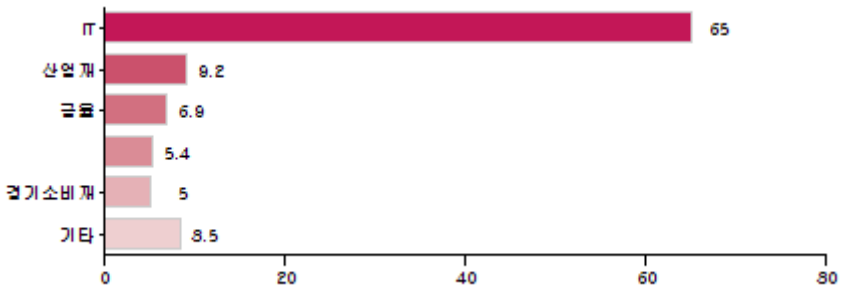
보유종목 10종목

(단위:%)

종목명	업종	비중
삼성전자	IT	23.2
SK하이닉스	IT	17.2
SK스퀘어		1.9
삼성전기	IT	1.4
현대차	경기소비재	1.0

종목명	업종	비중
KB금융	금융	0.9
신한지주	금융	0.8
한화에어로스페이스	산업재	0.7
삼성물산	산업재	0.7
두산에너빌리티	산업재	0.6

투자비중



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

투자비중 증감현황

(단위,%)

종목명	전기비율	당기비율	증감
삼성전기	1.13	1.43	0.3
신한지주	0.68	0.77	0.1
NAVER	0.46	0.56	0.1
알테오젠	0.24	0.33	0.1
셀트리온	0.50	0.56	0.1

[비중이 가장 많이 늘어난 종목 5개(지난 3개월)]

(단위,%)

종목명	전기비율	당기비율	증감
SK하이닉스	18.17	17.22	-1.0
현대차	1.53	1.05	-0.5
삼성전자	23.49	23.23	-0.3
두산에너빌리	0.80	0.61	-0.2
HD현대중공업	0.48	0.30	-0.2

[비중이 가장 많이 줄어든 종목 5개(지난 3개월)]

운용 경과

(기준일: 2026.08.20)

벤치마크지수 대비 하회한 성과를 기록

지난 3개월 동안 펀드의 누적수익률은 -4.71%를 기록하여 같은 기간 동안 -4.69%의 수익률을 기록한 비교 지수 대비 하회한 성과를 기록하였습니다. 국내증시는 이란 전쟁 관련 우려 완화, AI 인프라 사이클 기대감에 가파른 상승세를 이어갔습니다. 반도체와 IT하드웨어 등 대형주가 증시 상승을 주도했습니다. 다만 급등세에 따른 상승 피로감이 높아진 가운데 AI 투자 관련 불확실성, 메모리 비용 부담 우려가 높아지며 증시는 차익실현, 레버리지 청산이 맞물리며 가파른 급락세로 전환했습니다. 7월말부터 증시 반등세가 나타났으나, 단기간 급락에 따른 투심 훼손과 고금리 우려 등이 증시 반등폭을 제한했습니다.

운용 계획

(기준일: 2026.08.20)

고수익성, 가치주, 소형주에 비중을 높여 투자

본 펀드는 수익성이 높은 종목군, 순자산대비 가치가 저평가된 종목군 및 상대적으로 시가총액 규모가 작은 종목군에 비중을 높여 운용하고 있습니다. 이러한 종목군에 대한 비중확대는 장기적으로 시장대비 초과성과를 이루기 위한 핵심요인이라는 믿음으로 지속적으로 유지해 나갈 예정입니다. 종목군의 변화에 따른 매매 발생시에는 비용을 최소화할 수 있는 매매시점과 매매기법으로 대응해 나갈 예정입니다. 또한, 블럭딜, 기업공개, 기업분할, 자사주 매수 등의 기업 이벤트 발생 시에는 적절한 대응을 병행하여 초과수익을 추구할 계획입니다. 운용과정에서 과도한 수익추구에 따른 지나친 위험을 감수하기보다는 적절한 위험수준 내에서 수익을 얻기 위해 노력하겠습니다.

펀드매니저 서민웅 배상

1 펀드 개요

● 기본정보

펀드의 기본정보를 확인하실 수 있습니다

운용기간	2026.05.21 ~ 2026.08.20
자산운용회사	삼성자산운용
펀드재산 보관회사	하나은행
펀드 종류	투자신탁,증권(주식파생형),개방형,추가형,종류형
최초설정일	2018.02.21
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
레버리지(차입 등) 한도	-

펀드명	금융투자협회 펀드코드
삼성KRX300인덱스증권투자신탁[주식-파생형]	C3934

● 재산현황

펀드의 당기와 전기 재산현황 및 기준가격을 비교할 수 있습니다.

(단위 : 억원, 억좌)

항목	전기말	당기말	증감률(%)
자산 총액 (A)	163.45	159.54	-2.4
부채 총액 (B)	2.27	0.96	-57.8
순자산총액(C=A-B)	161.18	158.58	-1.6
발행 수익증권 총 수(D)	45.24	46.62	3.0
기준가격※ (E=C/D*1000)	3,562.96원	3,401.76원	-4.5

(단위:원)

종류(Class)별 기준가격 현황

종류	전기말	당기말	증감률(%)
Class A	3,477.38	3,313.47	-4.7
Class Ae	3,545.26	3,381.09	-4.6
Class C	3,526.18	3,356.80	-4.8
Class C-P	3,511.83	3,344.07	-4.8
Class C-Pe	3,461.28	3,299.98	-4.7
Class Ce	3,616.29	3,447.32	-4.7
Class Cp(퇴직연금)	3,333.33	3,333.33	0.0
Class Cpe(퇴직연금)	3,549.64	3,385.06	-4.6
Class S	3,581.22	3,415.48	-4.6
Class S-P	3,512.62	3,350.61	-4.6

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

종류(Class)별 분배금 내역

종류	분배금 지급금액(백만원)
조회된 데이터가 없습니다.	

2 운용 현황 (기준일 : 2026.08.20)

● 상세 기간 수익률

각 기간별 펀드의 수익률을 확인할 수 있습니다.

(단위 : %)

	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
운용펀드	-4.52	23.12	85.21	145.48	186.32	227.05	187.59
(비교지수*)	(-4.69)	(22.18)	(83.51)	(142.77)	(175.55)	(208.05)	(157.98)
비교지수대비성과	+0.17	+0.94	+1.70	+2.71	+10.77	+19.00	+29.61

종류(Class)별 현황

	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근1년	최근2년	최근3년	최근5년
Class A	-4.71	22.70	84.31	143.90	182.49	220.42	177.79
Class Ae	-4.63	22.88	84.69	144.58	184.14	223.27	182.00
Class C	-4.80	22.50	83.89	143.16	180.71	217.34	173.26
Class C-P	-4.78	22.56	84.02	143.38	181.24	218.25	174.60
Class C-Pe	-4.66	22.82	84.55	144.33	183.55	222.25	180.49
Class Ce	-4.67	22.78	84.48	144.19	183.22	221.69	179.67
Class Cp(퇴직연금)	0.00	25.00	100.00	150.00	141.15	173.42	136.88
Class Cpe(퇴직연금)	-4.64	22.87	84.67	144.53	184.03	223.09	181.73
Class S	-4.63	22.89	84.72	144.61	184.22	223.40	182.17
Class S-P	-4.61	22.93	84.79	144.74	184.54	223.96	182.99

* 비교지수 : KRX 300*100.00%

● 연도별 수익률

과거 3년의 연간 수익률을 확인할 수 있습니다.

(단위 : %)

	2023년	2024년	2025년
운용펀드	27.90	-9.42	90.07
(비교지수*)	(25.60)	(-11.20)	(86.17)
비교지수대비성과	+2.30	+1.78	+3.90

* 비교지수 : KRX 300*100.00%

● 추적오차

펀드 수익률이 비교지수에서 얼마나 벗어났는지 확인할 수 있습니다.

(단위 : %)

기간	최근 3개월	최근 6개월	최근 1년
추적오차	1.56	1.72	1.3

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

3 자산 현황 (기준일 : 2026.08.20)

● 자산구성현황

아래표를 통하여 자산구성 및 통화별 금액의 구성비중을 확인하실 수 있습니다.

※ 자펀드인 경우 자산구성현황은 모펀드 투자비중을 감안하여 산출

(단위 : 억원, %)

통화별 구분 (기준 환율)	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물	기타			
KRW (1.0)	111.87 (70.1)	-	-	27.34 (17.1)	19.53 (12.2)	-	-	-	-	19.03 (11.9)	1.30 (0.8)	159.54 (100.0)

※ ( ) :구성비중 %

※ 장내 장외 파생상품 상세 계약현황은 아래를 참고 바랍니다.

● 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 분기영업보고서 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	23.2	13,657	3,701.0	한국	IT	
SK하이닉스	17.2	1,625	2,747.9	한국	IT	AA+
SK스퀘어	1.9	270	303.2	한국		
삼성전기	1.4	163	227.5	한국	IT	
현대차	1.1	400	167.0	한국	경기소비재	AAA
KB금융	0.9	901	144.2	한국	금융	AAA
신한지주	0.8	1,212	122.5	한국	금융	AAA
한화에어로스페이스	0.7	96	112.0	한국	산업재	AA0
삼성물산	0.7	285	106.6	한국	산업재	
두산에너빌리티	0.6	1,272	96.5	한국	산업재	A-

▶ 집합투자증권

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량	평가금액	국가	업종	비고
KODEX KRX300	15.9	52,910	2,541.0	한국		
KODEX 200액티브	1.2	5,982	186.8	한국		
KODEX 코스닥150	0.0	450	6.6	한국		

▶ 장내파생상품

(단위 : 백만원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
코스피200 F 202609	매수	7	1,894	
코스닥150 F 202609	매수	4	59	

※국내 위탁증거금(원화) 0백만원 입니다.

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량	평가금액	국가	업종	비고
예금	11.9	1,903	1,902.7	한국		

▶ 기타

(단위 : %, 주, 백만원)

종목명	비중	수량(취득가)	평가금액	국가	업종	비고
코스피200 F 202609	0.7	116	115.5	한국		
코스닥150 F 202609	0.0	2	1.8	한국		

4 투자운용전문인력 현황

● 운용전문인력

(단위 : 개, 억원)

성 명	직위	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회 등록번호
		펀드 개수	운용 규모	펀드 개수	운용 규모	
서민웅	책임펀드매니저*	67	11,250.2	-	-	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
2022-01-06 ~ 현 재	서민웅

5 비용 현황 (전기 : 2026.02.21 ~ 2026.05.20 / 당기 : 2026.05.21 ~ 2026.08.20)

● 총보수 비용비율(연환산)

(단위 : %)

	총보수 비용비율(A)		중개수수료 비율(B)		합계(A+B)	
	전기	당기	전기	당기	전기	당기
Class ALL	0.50	0.49	0.04	0.05	0.54	0.54
종류(Class)별 현황						
Class A	0.71	0.71	0.00	0.00	0.71	0.71
Class Ae	0.40	0.40	0.00	0.00	0.40	0.40
Class C	1.05	1.05	0.00	0.00	1.05	1.05
Class C-P	0.95	0.95	0.00	0.00	0.95	0.95
Class C-Pe	0.51	0.51	0.00	0.00	0.51	0.51
Class Ce	0.57	0.57	0.00	0.00	0.57	0.57
Class Cp	-	-	0.00	-	0.00	0.00
Class Cpe(퇴직연금)	0.42	0.42	0.00	0.00	0.42	0.42
Class S	0.39	0.39	0.00	0.00	0.39	0.39
Class S-P	0.33	0.33	0.00	0.00	0.33	0.33

* 총보수 비용비율(Total Expense Ratio)이란 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액 (보수 · 비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수 · 비용수준을 나타냅니다.

** 매매·중개수수료 비율이란 매매 · 중개수수료를 순자산 연평잔액(보수 · 비용 차감전 기준)으로 나눈비율로 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		3.03	0.00	3.89	0.00
	판매회사	A	2.07	0.00	2.35	0.00
		Ae	0.53	0.00	0.64	0.00
		C	0.58	0.00	0.43	0.00
		C-P	0.25	0.00	0.34	0.00
		C-Pe	3.65	0.00	4.75	0.00
		Ce	1.24	0.00	1.89	0.00
		Cp(퇴직연금)		-		-
		Cpe(퇴직연금)	4.73	0.00	6.15	0.00
		S	0.10	0.00	0.11	0.00
		S-P	0.22	0.00	0.27	0.00
	펀드재산보관회사		0.34	0.00	0.43	0.00
	일반사무관리회사		-	-	-	-
	보수 합계		16.76	0.00	21.27	0.00
	기타비용		0.02	0.00	0.02	0.00
	증권거래비용	단순매매 중개수수료	1.11	0.00	1.90	0.00
		조사분석업무등 서비스 수수료	0.23	0.00	0.15	0.00
		합계	1.34	0.00	2.05	0.00
	증권거래세		0.09	0.00	0.66	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율
** 기타비용이란 회계감사비용, 유가증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 보수 및 증권거래비용은 제외한 것입니다.
※ 성과보수내역 : 없음

6 투자자산 매매내역

● 매매주식규모 및 회전율

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

(단위 : 주, 억원, %)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
4,496	1.91	3,475	3.3	2.7	10.6

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

●최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

펀드명	'25.11.21 ~ '26.02.20	'26.02.21 ~ '26.05.20	'26.05.21 ~ '26.08.20
KRX300인덱스증권투자신탁[주식-파생형]	2.3	0.4	2.7

7 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, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=A/B*100 (%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
삼성 KODEX200 액티브증권상장지수투자신탁[주식-파생형]	34,600,000	5,982	0.02
삼성KODEX KRX300증권상장지수투자신탁[주식]	1,500,000	52,910	3.53
삼성KODEX코스닥150증권상장지수투자신탁[주식]	354,250,000	450	0.00

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 악화에 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	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000
매수금액	0.000000	0.000000	0.000000	0.000000

● 주요 비상대응계획

운용부서의 이슈 발생가능성 상시 모니터링. 이슈사항 발견시 내부통제부서와 협의 후 중대사안의 경우 내부 위원회 보고 및 판매사/투자자 고지

공지사항

1. 고객님이 가입하신 펀드는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률의 적용을 받습니다.
2. 주요 공시사항은 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
   삼성KRX300인덱스증권투자신탁[주식-파생형] 의
   자산운용사인 삼성자산운용이 작성하여
   신탁업자인 하나은행의 확인을 받아
   판매사를 통해 고객님들께 제공됩니다.
4. 투자자의 계좌별 수익률정보는 판매회사의 홈트레이딩시스템(HTS)이나 인터넷 뱅킹 등을 통해 조회할 수 있습니다.