

# 낙동강수계관리기금 2019년 2분기 금융자산운용수익률 산출

2019.7.03

자산운용 요약표

[평잔 및 월간수익률]

분류	단기 운용평잔			증장기 운용평잔	전체 운용평잔
	현금성	유동성	계		
평잔(연기금투자플 포함)	16,059	-	16,059	-	16,059
비중	100.00	-	100.00	-	100.00
연기금투자플 위탁금액	15,972	-	15,972	-	15,972
연기금투자플 위탁비중	99.46	-	99.46	-	99.46

단위 : 백만원 , %

	1월	2월	3월	4월	5월	6월	7월	8월	9월	10월	11월	12월
현금성	0.16	0.16	0.15	0.16	0.16	0.14	-	-	-	-	-	-
유동성	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
단기	0.16	0.16	0.15	0.16	0.16	0.14	-	-	-	-	-	-
증장기	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
전체	0.16	0.16	0.15	0.16	0.16	0.14	-	-	-	-	-	-

단위 : %

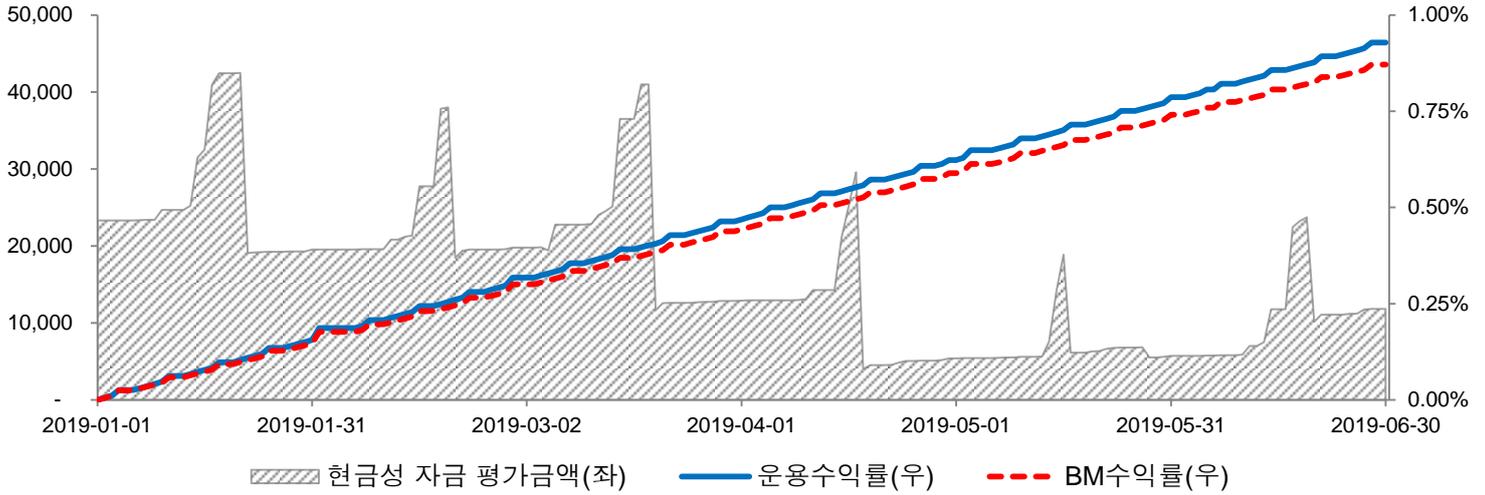
[운용자산별 기준수익률]

상품 구분		기준수익률		제공기관	
단기자금	현금성자금	확정금리형	MMDA 평균수익률	한국은행	
		실적배당형	MMF 업계평균수익률	펀드평가사	
	유동성자금	확정금리형	3개월~6개월	6개월 미만 정기예금 가중평균 수신금리	한국은행
			6개월~1년	6개월 이상 1년 미만 정기예금 가중평균 수신금리	
		실적배당형	국고채 3개월~1년	채권평가사	
증장기자금		확정금리형	1년~2년 미만 정기예금 가중평균 수신금리	한국은행	
		채권형	국고채 1년~2년	채권평가사	
		주식형	KOSPI	한국거래소	

본 자료는 투자참고 자료로서 정보제공을 위해 작성되었으며 펀드판매를 권유하기 위한 목적으로 사용될 수 없습니다. 투자참고 자료로 신뢰할 수 있다고 판단되는 각종 자료와 통계 자료를 이용하여 작성된 것이나, 자료의 내용이 향후 결과에 대한 보증이 될 수 없습니다. 따라서, 본 자료를 참고한 일체의 투자행위에 대한 최종적인 판단은 투자자에게 있으며, 당사는 그 결과에 대해 적·간접적인 책임을 지지 않습니다. 운용보고서는 정소에 따라 제공되지 않을 수도 있으며 투자자는 이 사실에 대해 알고 주의를 기울일 필요가 있습니다. 집합투자상품은 예금자보호법에 의해 보호되지 않으며, 운용결과에 따른 이익 또는 손실이 투자자에게 귀속됩니다. 가입하시기 전에 투자대상, 환매방법 및 보수 등에 관하여 투자설명서를 반드시 읽어보시기 바랍니다. 과거의 실적이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다. 해외투자상품에의 투자는 환율 변동시 자산가치가 변동되어 손실이 발생할 수 있습니다.

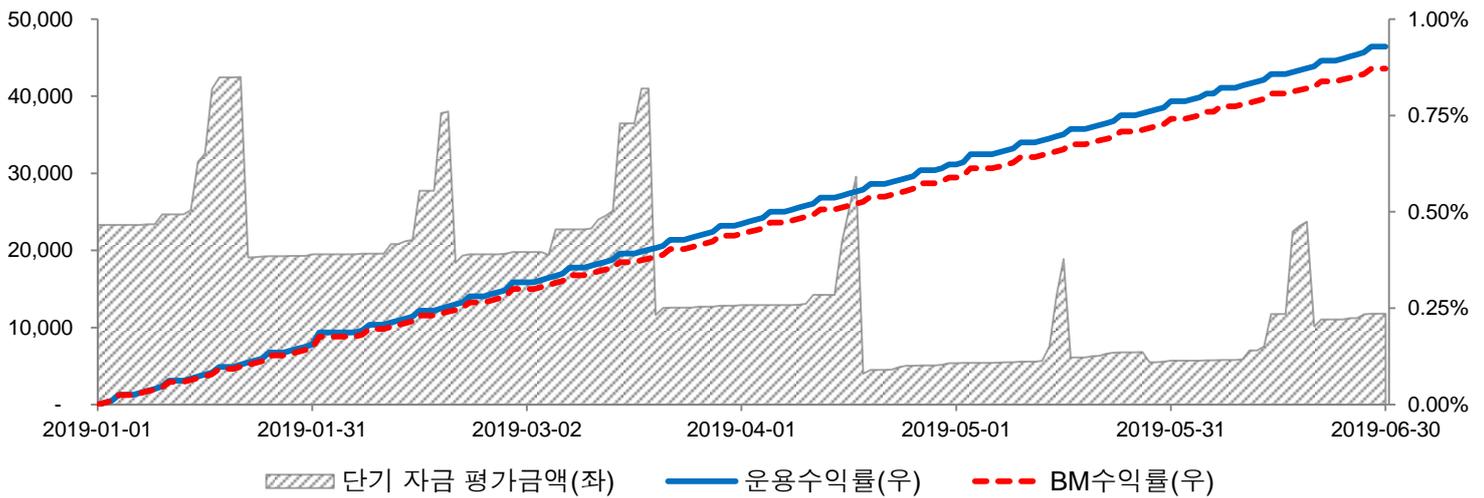
자산운용 수익률

[현금성]



	운용상품	운용일수	기간평잔	운용수익률	기준수익률	초과수익률	IR	SR
현금성	MMDA	181	87	0.03(0.07)	0.23(0.46)	-0.20	-5.87	-
	MMF	181	15,972	0.93(1.89)	0.88(1.77)	0.06	0.65	
	계	181	16,059	0.93(1.88)	0.87(1.76)	0.06	0.65	

[단기]



	운용일수	기간평잔	운용수익률	기준수익률	초과수익률	IR	SR
단기	181	16,059	0.93(1.88)	0.87(1.76)	0.06	0.65	-

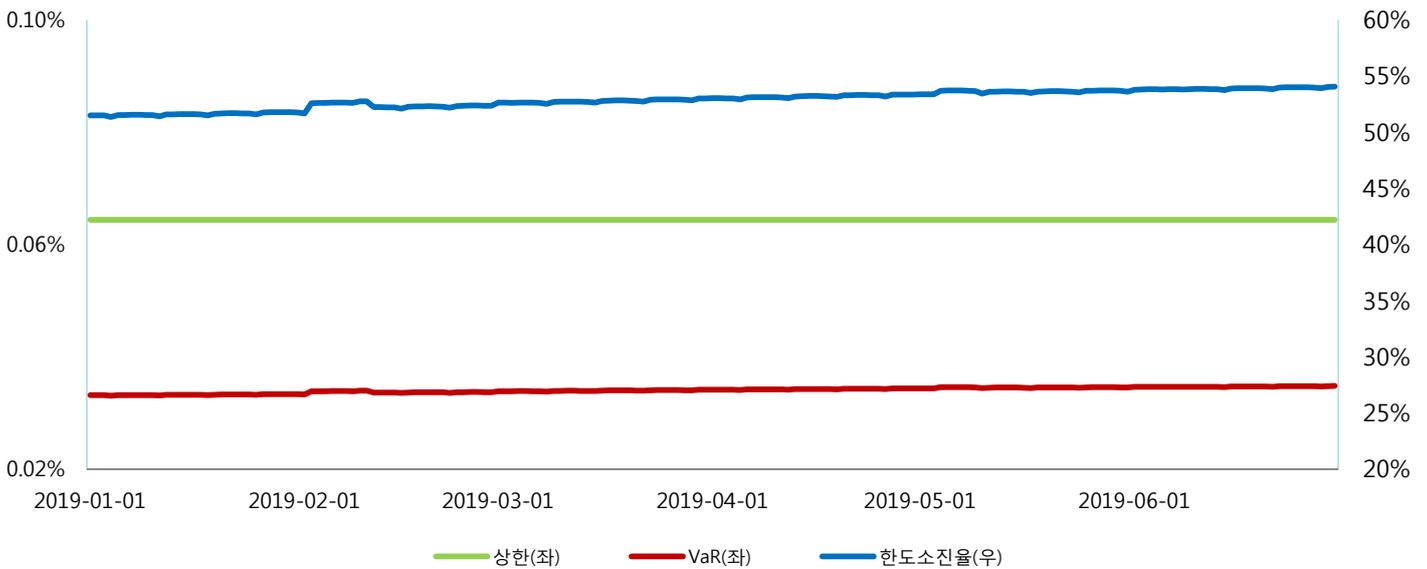
※ 평가액 기준의 평잔을 계산하며 시간가중수익률을 계산(괄호안은 연환산 값), 단위는 백만원 / % 입니다.

※ SR은 실적배당형 위험자산에 대해서만 산출되며 모든 제시된 값은 계산방법과 평가관점에 따라 달라질 수 있습니다.

본 자료는 투자참고 자료로서 정보제공을 위해 작성되었으며 펀드판매를 권유하기 위한 목적으로 사용될 수 없습니다. 투자참고 자료로 신뢰할 수 있다고 판단되는 각종 자료와 통계 자료를 이용하여 작성된 것이나, 자료의 내용이 향후 결과에 대한 보증이 될 수 없습니다. 따라서, 본 자료를 참고한 일체의 투자행위에 대한 최종적인 판단은 투자자에게 있으며, 당사는 그 결과에 대해 적-간접적인 책임을 지지 않습니다. 운용보고서는 정소에 따라 제공되지 않을 수도 있으며 투자자는 이 사실에 대해 알고 주의를 기울일 필요가 있습니다. 집합투자상품은 예금자보호법에 의해 보호되지 않으며, 운용결과에 따른 이익 또는 손실이 투자자에게 귀속됩니다. 가입하시기 전에 투자대상, 환매방법 및 보수 등에 관하여 투자설명서를 반드시 읽어보시기 바랍니다. 과거의 실적이 미래의 수익을 보장하는 것은 아닙니다. 해외투자상품에의 투자는 환율 변동시 자산가치가 변동되어 손실이 발생할 수 있습니다.

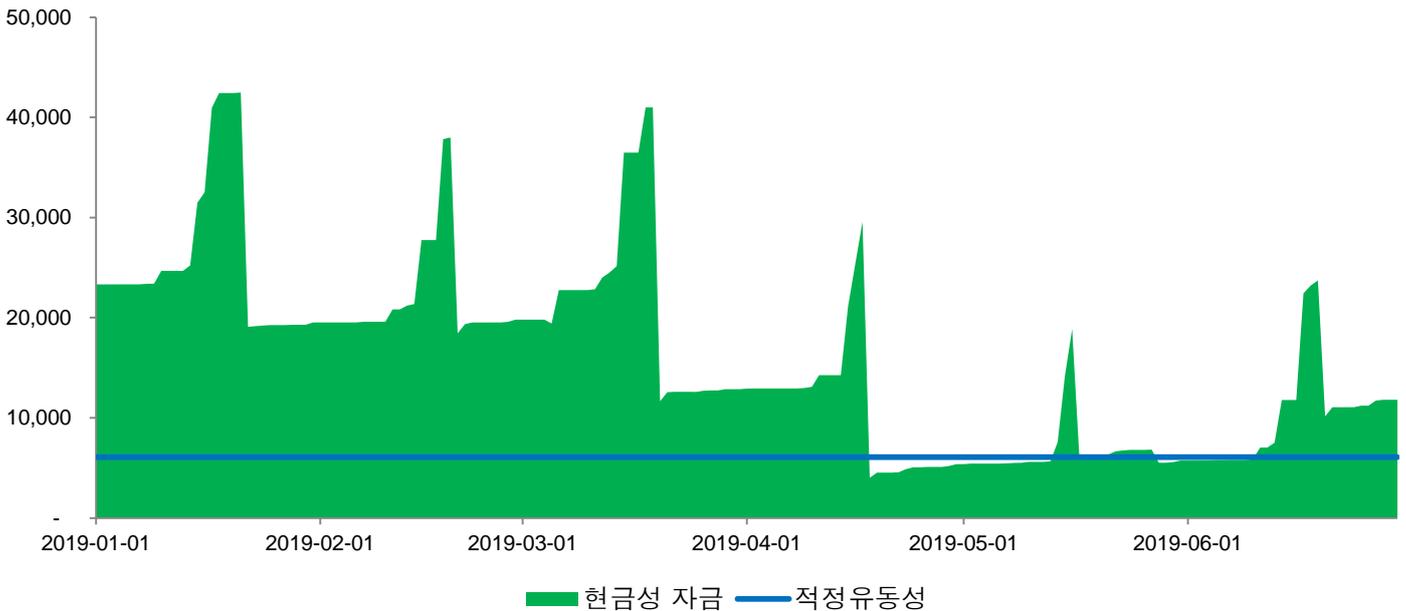
위험관리

[시장위험관리]



※ 2019년 2분기 %VaR는 평균 0.033%를 기록하였으며 허용한도(0.064%)에 대한 소진율은 평균 46%를 기록함.

[유동성위험관리]



※ 2019년 2분기의 경우 일부 구간 적정유동성 이하로 관리되었음. 이는 기금의 조기집행 이슈 등이 발생으로 인한 미달

Stay Ahead™

삼성자산운용 주식회사

06620 서울특별시 서초구 서초대로74길 11

대표전화 : 02-3774-7600 콜센터 : 080-377-4777(상담시간안내 : 평일 오전 8시~오후 5시)

삼성자산운용

