Stay Ahead™

낙동강수계관리기금
2019년 4분기 금융자산운용수익률 산출

2020.01.14

자산운용 요약표

[평잔 및 월간수익률]

분류	단기 운용평잔			중장기 운용평잔	전체 운용평잔
	현금성	유동성	계		
평잔(연기금투자풀 포함)	13,479	-	13,479	-	13,479
비중	100.00	-	100.00	-	100.00
연기금투자풀 위탁금액	13,384	-	13,384	-	13,384
연기금투자풀 위탁비중	99.29	-	99.29	-	99.29

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	0.15	0.15	0.13	0.13	0.12	0.13
유동성	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
단기	0.16	0.16	0.15	0.16	0.16	0.14	0.15	0.15	0.13	0.13	0.12	0.13
중장기	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
전체	0.16	0.16	0.15	0.16	0.16	0.14	0.15	0.15	0.13	0.13	0.12	0.13

단위 : %

[운용자산별 기준수익률]

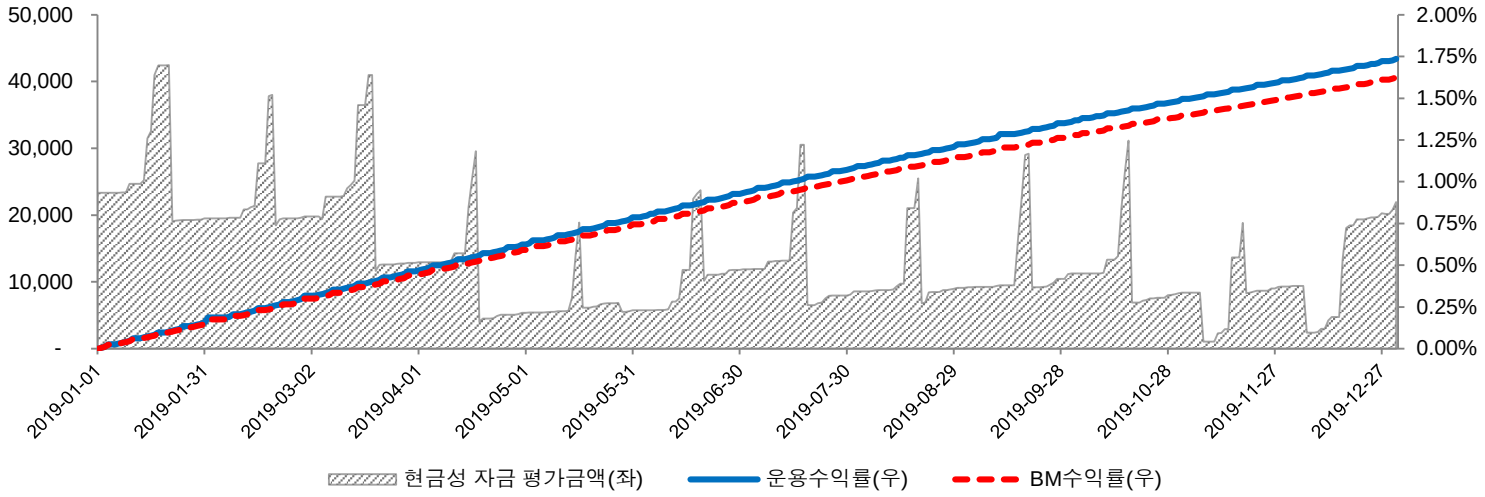
상품 구분				기준수익률	제공기관
단기자금	현금성자금	확정금리형		MMDA 평균수익률	한국은행
		실적배당형		MMF 업계평균수익률	펀드평가사
	유동성자금	확정금리형	3개월~6개월	6개월 미만 정기예금 가중평균 수신금리	한국은행
			6개월~1년	6개월 이상 1년 미만 정기예금 가중평균 수신금리	
		실적배당형		국고채 3개월~1년	채권평가사
중장기자금	확정금리형			1년~2년 미만 정기예금 가중평균 수신금리	한국은행
	채권형			국고채 1년~2년	채권평가사
	주식형			KOSPI	한국거래소

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 직·간접적인 책임을 지지 않습니다. 운용보고서는 장소에 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.

StayAhead™ 삼성자산운용 SAMSUNG

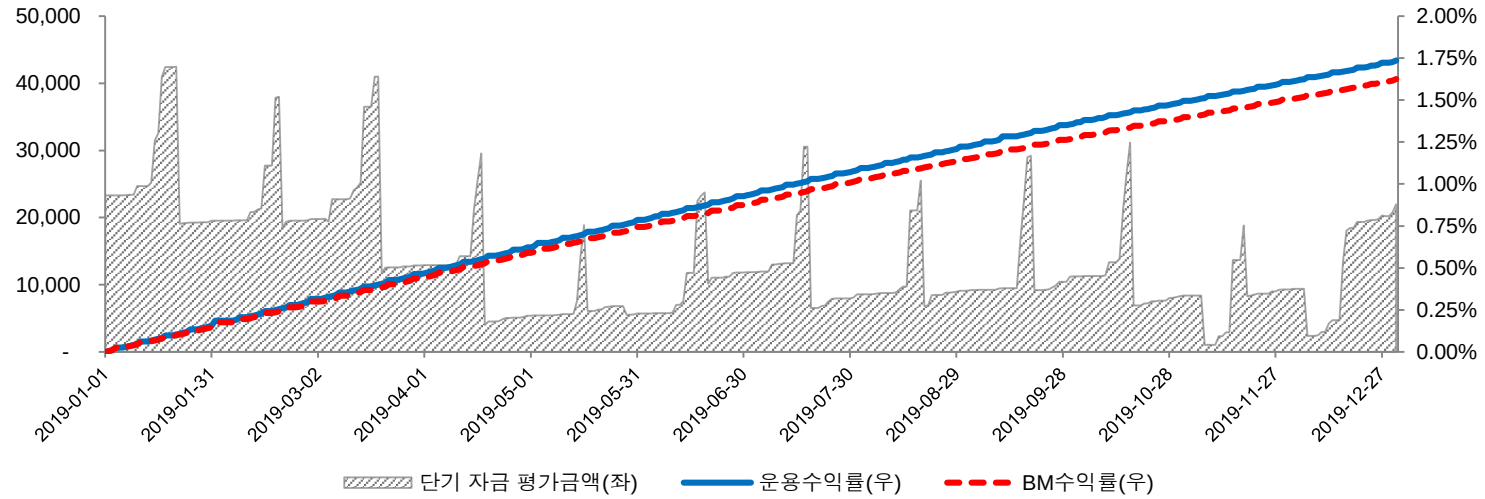
자산운용 수익률

[현금성]



	운용상품	운용일수	기간평잔	운용수익률	기준수익률	초과수익률	IR	SR
현금성	MMDA	365	95	0.07	1.02	-0.95	-5.88	-
	MMF	365	13,384	1.75	1.63	0.12	0.65	
	계	365	13,479	1.74	1.62	0.12	0.61	

[단기]



	운용일수	기간평잔	운용수익률	기준수익률	초과수익률	IR	SR
단기	365	13,479	1.74	1.62	0.12	0.61	-

※ 본 자료는 기금에서 제공해주신 자료를 토대로 작성되었습니다.

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

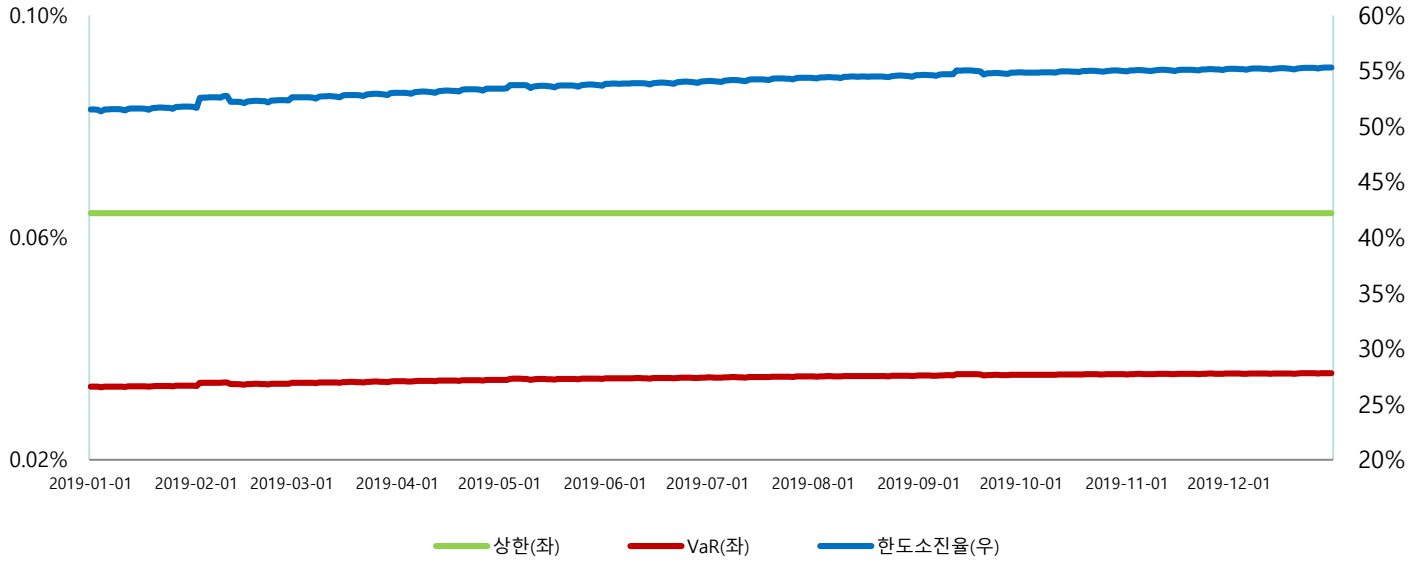
※ SR은 실적배당형 위험자산에 대해서만 산출되며 모든 제시된 값은 계산방법과 평가관점에 따라 달라질 수 있습니다.

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 직·간접적인 책임을 지지 않습니다. 운용보고서는 장소에 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.

StayAhead™ 삼성자산운용 SAMSUNG

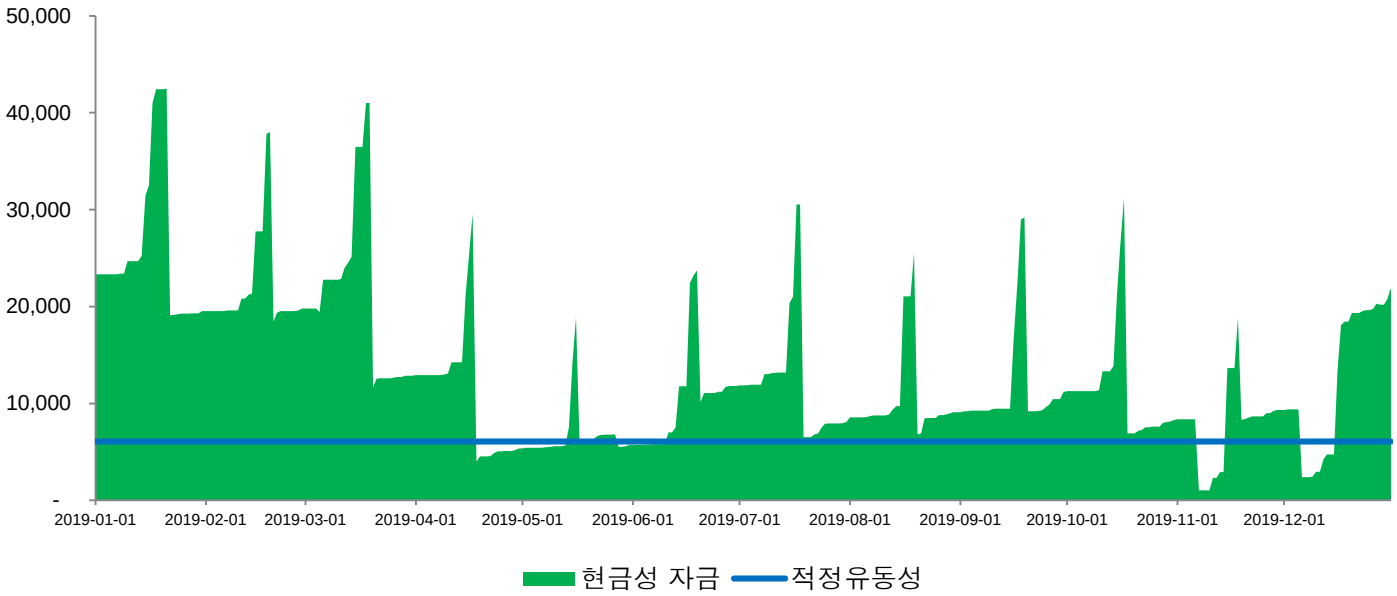
위험관리

[시장위험관리]



※ 2019년 4분기까지 %VaR는 평균 0.035%를 기록하였으며 허용한도(0.064%)에 대한 소진율은 평균 54%를 기록함.

[유동성위험관리]



※ 2019년 4분기의 경우 11.7~11.14(8일), 12.06~12.14(10일) 구간이 적정유동성 이하로 관리되었음.

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 직·간접적인 책임을 지지 않습니다. 운용보고서는 장소에 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.

StayAhead™ 삼성자산운용 SAMSUNG

Stay Ahead™

삼성자산운용 주식회사
06620 서울특별시 서초구 서초대로74길 11
대표전화 : 02-3774-7600 콜센터 : 080-377-4777(상담시간안내 : 평일 오전 8시~오후 5시)

삼성자산운용 SAMSUNG