

자산운용보고서

KTB법인MMF제1호[국공채]

(운영기간 : 2019년01월03일 ~ 2019년02월02일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(1개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

KTB자산운용(주)

서울시 영등포구 여의대로 66 KTB빌딩 13층
(전화 02-788-8400, <http://www.i-ktb.com/>)

목 차

- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용인력 현황
 - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
 - ▶ 투자운용인력 변경내역
- 5 비용현황
 - ▶ 보수 및 비용지급 현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전을
 - ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이
- 7 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항
 - ▶ 고유재산 투자에 관한 사항

공지사항

1. 이 보고서는 자본시장법에 의해 KTB법인MMF제1호[국공채]의 자산운용회사인 KTB자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 한국증권금융의 확인을 받아 각 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

2. 본 펀드는 2019년 1월 31일 투자설명서가 변경되었습니다

19.01.31 : 비교지수의 변경 (국고채3개월지수*100% → CALL 지수*100%)

부책임용전문인력 추가(박성호 운용역)

3. 투자자의 계좌별 수익률 정보는 판매회사의 HTS나 인터넷 뱅킹 등을 통해 조회할 수 있습니다.

4. 고객님의 가입하신 펀드는 "자본시장과 금융투자업에 관한 법률(현행 법률)"의 적용을 받습니다.

각종 보고서 확인 : KTB자산운용(주) <http://www.i-ktb.com/>
한국금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

자본시장과 금융투자업에 관한 법률

위험등급 : 6등급

펀드 명칭		금융투자협회 펀드코드	
KTB법인MMF제1호[국공채]		CE698	
펀드의 종류	단기금융(MMF), 추가형, 일반형	최초설정일	2018.12.03
운용기간	2019.01.03 ~ 2019.02.02	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	KTB자산운용	펀드재산보관회사	한국증권금융
판매회사	DB금융투자, IBK투자증권, KB증권, KTB투자증권, NH선물, SK증권, 리딩투자증권, 메리츠종합금융증권, 부국증권, 비엔케이투자증권, 삼성증권, 신영증권, 신한금융투자, 유안타증권, 유진투자증권, 이베스트투자증권, 케이프투자증권, 코리아에셋투자증권, 토러스투자증권, 하나금융투자, 하이투자증권, 한국투자증권, 한양증권, 현대차투자증권, 흥국증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 유동성이 높고 위험이 적은 단기금융상품을 범시행령 제94조제2항제4호에서 규정하는 주된 투자대상자산으로 하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 다만, 집합투자규약 제17조의 규정에 따른 단기금융상품 가운데 국공채를 주된 투자대상자산으로 합니다.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
KTB법인MMF제1호[국공채]	자산 총액 (A)	410,869	815,986	98.60
	부채 총액 (B)	26	14,107	53717.94
	순자산총액 (C=A-B)	410,843	801,880	95.18
	발행 수익증권 총 수 (D)	410,191	799,368	94.88
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,001.59	1,003.14	0.15

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다. 증감률은 전기에 결산이 있었던 경우 분배금지급 후 기준가격 대비 계산한 값입니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

본 펀드는 안정적인 이자수익을 창출하여 고객의 단기여유자금 운용에 적합하도록 가중평균잔존만기 75일 이내에서 국고채, 통안증권, 특수채 및 은행채 등에 투자하여 포트폴리오를 구축하여 관리하고 있습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

시가평가금리의 등락에 따른 기준가격의 변동성이 증대되는 것을 방지하기 위해서 채권 및 기타 시가평가성 자산의 경우에는 건별잔존만기가 가급적 6개월을 넘지 않도록 관리하고 있고, 시가평가로 인한 기준가격의 급격한 하락을 방지하기 위해서는 장부가와 시가와의 평가손익을 적정수준에서 유지하도록 관리하고 있습니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
KTB법인MMF제1호[국공채] (비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)				

주) 비교지수(벤치마크) : Call지수(KIS) x 100%

※ 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

▶ **손익현황**

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	0	165	221	0	0	0	0	0	0	84	-26	444
당기	0	328	618	0	0	0	0	0	0	557	-92	1,410

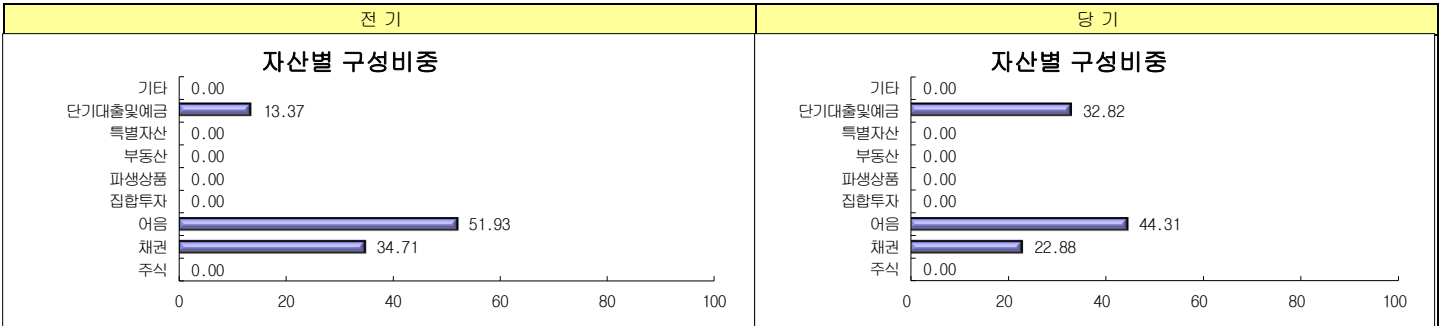
3. 자산현황

▶ **자산구성현황**

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	186,690	361,524	0	0	0	0	0	0	267,771	0	815,986
(1.00)	(0.00)	(22.88)	(44.31)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(32.82)	(0.00)	(100.00)
합계	0	186,690	361,524	0	0	0	0	0	0	267,771	0	815,986

* () : 구성 비중



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

구분	구분	종목명	비중	구분	구분	종목명	비중
1	단기상품	REPO매수(20190201)	6.94	6	단기상품	REPO매수(20190201)	2.81
2	단기상품	REPO매수(20190201)	3.68	7	채권	전자단기사채(중소기업진흥공단 20190131-21-7(E))	2.45
3	채권	신한은행22-08-할-6M-B	3.68	8	채권	전자단기사채(한국가스공사 20181206-98-7(E))	2.45
4	채권	통안DC019-0327-0910	3.67	9	채권	전자단기사채(한국가스공사 20190130-54-76(E))	2.44
5	단기상품	REPO매수(20190201)	2.92	10	단기상품	REPO매수(20190201)	2.34

※ 보다 상세한 투자대상자산 내용은 한국금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다. (인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 한국금융투자협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▼ **각 자산별 보유종목 내역**

▶ **채권**

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
신한은행22-08-할-6M-B	30,000	29,991	대한민국	KRW	2018-08-09	2019-02-09		AAA	3.68
통안DC019-0327-0910	30,000	29,924	대한민국	KRW	2018-12-26	2019-03-27		N/A	3.67
전자단기사채(중소기업진흥공단 20190131-21-7(E))	20,000	19,981	대한민국	KRW	2019-01-31	2019-02-21		A1	2.45
전자단기사채(한국가스공사 20181206-98-7(E))	20,000	19,959	대한민국	KRW	2018-12-06	2019-03-14		A1	2.45
전자단기사채(한국가스공사 20190130-54-76(E))	20,000	19,948	대한민국	KRW	2019-01-30	2019-03-25		A1	2.44

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ **단기대출 및 예금**

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
REPO매수	동양투신운용	2019-02-01	56,606	1.95		대한민국	KRW
REPO매수	KB자산운용	2019-02-01	30,003	1.95		대한민국	KRW
REPO매수	교보약사자산운용	2019-02-01	23,803	1.95		대한민국	KRW
REPO매수	교보약사자산운용	2019-02-01	22,902	1.95		대한민국	KRW
REPO매수	한국투자신탁운용	2019-02-01	19,102	1.95		대한민국	KRW

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
		펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
우형진	상무	55	20,761	1	68	2109000418
박성호	과장	3	1,459	0	0	2114000163

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함

▶ 투자운용인력 변경내역

성명	변경유형	변경일자	운용기간
우형진	신규	2018-12-03	2018.12.03~현재
박성호	신규	2019-01-31	2019.01.31~현재

5. 비용 현황

▶ 보수 및 비용지급 현황

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기		
	금액	비율	금액	비율	
자산운용사	8	0.00	26	0.00	
판매회사	12	0.00	39	0.00	
펀드재산보관회사(신탁업자)	2	0.00	8	0.00	
일반사무관리회사	2	0.00	5	0.00	
보수합계	23	0.01	78	0.01	
기타비용**	1	0.00	3	0.00	
매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	2	0.00	11	0.00
	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
	합계	2	0.00	11	0.00
증권거래세	0	0.00	0	0.00	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 없음 ※ 발행분담금내역 : 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
		당기	0.11	0.01
KTB법인MMF제1호[국공채]		0.10	0.01	0.12

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

-해당사항 없음-

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

-해당사항 없음-

7. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

▶ 고유재산 투자에 관한 사항

(단위 : 백만원, %)

펀드명칭	KTB법인MMF제1호[국공채]	
투자금액	수익률	
3,000	0.31%	

● 투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매) 될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.