

# 정 정 신 고 (보 고)

2026년 9월 9일

1. 정정대상 공시서류 : 일괄신고서

삼성달러표시MMF법인 제1호(USD)

2. 정정대상 공시서류의 최초제출일 : 2023. 06. 26

3. 정정 사유

- 정기 결산으로 인한 갱신(위험등급 분류기준 변경(투자대상자산 → 97.5% VaR), 재무정보 확정)

4. 정정요구 · 명령 관련 여부 : 아니오

5. 정정사항

| 항 목                       | 정 정 전                                                                                                                                                                                | 정 정 후                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 표지                        | 삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 투자대상 자산의 종류 및 위험도를 감안하여 6등급으로 분류하였습니다.                                                                                                                           | 삼성자산운용주식회사는 이 투자신탁의 일간 수익률의 최대손실예상액을 감안하여 6등급으로 분류하였습니다.                                                                                                                                                                                                                                            |
| 요약정보                      |                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 투자비용<br>투자실적 추이<br>운용전문인력 | -                                                                                                                                                                                    | 업데이트                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 제2부. 집합투자기구에 관한 사항        |                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 5. 운용전문인력                 | -                                                                                                                                                                                    | 업데이트                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 10. 집합투자기구의 투자위험          | 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형<br>- 이 투자신탁은 설정 후 3년이 경과되지 않아 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 투자위험등급을 산정하였습니다. 설정 후 3년이 경과시 주7)일간 수익률의 최대손실예상액(이하 '97.5% VaR')으로 등급분류 기준이 변경되면서 위험등급이 변동 될 수 있습니다. | 라. 이 집합투자기구에 적합한 투자자 유형<br>- 이 투자신탁은 설정 후 3년이 경과하였으므로 주1)일간 수익률의 최대손실예상액(이하 '97.5% VaR')을 감안하여 투자위험 등급을 산정하였습니다. 추후 매 결산 시마다 97.5% VaR을 다시 측정하게 되며, 이 경우 투자위험 등급이 변동될 수 있습니다.<br>- 과거 3년 일간 수익률로 산출한 97.5% VaR는 0 % 이며, 이는 <시장위험등급 기준표> 기준 위험 등급 부여시 6등급에 해당합니다. 본 펀드는 외화 표시집합투자기구로 수익구조 등이 특수하여 위험 |

| 항 목                                             | 정 정 전                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 정 정 후                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                 | <p>&lt;삼성자산운용주식회사 자체 투자위험등급 기준&gt;<br/>(표 내용 생략)<br/>주1) "고위험자산"은 주식, 상품, REITs, 투기등급채권(BB+등급 이하), 파생상품 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산입니다.<br/>주2) "중위험자산"은 채권(BBB-등급 이상), CP(A3등급 이상), 담보부 대출 및 대출채권 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산입니다.<br/>주3) "저위험자산"은 국공채, 지방채, 회사채(A-등급 이상), CP(A2-등급 이상), 현금성 자산 및 이와 유사한 수준의 위험을 갖는 자산입니다.<br/>주4) 해외투자펀드는 국내펀드 분류기준을 준용하되 환헤지여부, 투자국가 등을 고려하여 필요시 위험등급을 조정합니다.<br/>주5) 위에 명시되지 않은 펀드의 위험 등급은 투자대상, 손실가능성 등을 고려하여 내부 심의위원회에서 정합니다.<br/>주6) 설정 후 3년이 경과시 일간 수익률의 최대손실예상액으로 등급분류 기준이 변경되면서 위험등급이 변동될 수 있습니다.<br/>주7) 일간 수익률의 최대손실예상액은 매년 결산시점에 측정하며, 해당 결산일 기준 과거 3년 일간 수익률에서 2.5%에 해당하는 손실률(신뢰구간 97.5%)의 절대값에 연환산 보정계수(<math>\sqrt{250}</math>)를 곱해 산출하여 등급 기준표상의 상한치를 비교합니다.<br/>(종류형 집합투자기구인 경우 해당 운용펀드의 수익률을 기준으로 산정)<br/>주8) 상기 분류기준 이외에 투자전략, 신용위험, 유동성위험, 외화표시집합투자기구, 레버리지/인버스, 고난도금융투자상품 해당여부 및 환변동성 노출여부에 따라 위험등급을 상향하여 적용할 수 있습니다<br/>주9) 이 투자위험등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.</p> | <p>등급 상향 조정 대상펀드에 해당되나, 집합투자재산의 전부를 단기금융상품에 투자하는 단기금융집합투자기구(MMF)로 그 위험성이 크지 않다고 판단되어 6등급을 부여하였습니다.</p> <p>&lt;시장위험등급 기준표&gt;<br/>(표 내용 생략)<br/>주1) 일간 수익률의 최대손실예상액은 매년 결산시점에 측정하며, 해당 결산일 기준 과거 3년 일간 수익률에서 2.5%에 해당하는 손실률(신뢰구간 97.5%)의 절대값에 연환산 보정계수(<math>\sqrt{250}</math>)를 곱해 산출하여 등급 기준표상의 상한치를 비교합니다.<br/>(종류형 집합투자기구인 경우 해당 운용펀드의 수익률을 기준으로 산정)<br/>주2) 이 투자위험등급은 집합투자업자가 분류한 것으로 판매회사의 분류 등급과는 상이할 수 있습니다.<br/>주3) 상기 분류기준 이외에 투자전략, 신용위험, 유동성위험, 외화표시집합투자기구, 레버리지/인버스, 고난도 금융투자상품 해당여부 및 환변동성 노출여부에 따라 위험등급을 상향하여 적용할 수 있습니다.</p> |
| 13. 보수 및 수수료에 관한 사항                             | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 업데이트                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 제3부. 집합투자기구의 재무 및 운용실적 등에 관한 사항                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1. 재무정보<br>2. 연도별 설정 및 환매 현황<br>3. 집합투자기구의 운용실적 | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 업데이트                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 제4부. 집합투자기구 관련 회사에 관한 사항                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1. 집합투자업자                                       | 라. 운용자산 규모                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 라. 운용자산 규모                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

| 항 목     | 정 정 전 | 정 정 후 |
|---------|-------|-------|
| 에 관한 사항 | -     | 업데이트  |