『2017년도 2분기』

석면피해구제기금 여유자금 위험·성과관리 결과

1. 2017년도 2분기 여유자금 운용현황

■ 개 요

○ 운용기간(평가기간) : 2017년 1월 1일~2017년 6월 30일(181일)

○ 운용기간 평잔 : 37,670백만 원

○ 운용수익률 : 1.59%, 기준(BM)수익률 1.69% 대비 0.10%p 하회

※ 운용 및 기준 수익률 제공 : KG제로인(연기금투자풀 펀드평가사) PFMS

※ 운용수익률 산출 : 한국채권연구원

■ 운용자산별 운용규모(평잔) 및 운용수익률

○ '17년 2분기 총 운용규모(평잔 기준) : 37,670백만 원

- 단기자금 1,643백만 원(4.4%), 중장기자금 36,027백만 원(95.6%)

○ '17년 2분기 총 수익률 : 1.59%

- 단기자금 1.37%, 중장기자금 1.62%

(단위 : 백만 원, %)

분 류		예치상품	운용일수	기간평잔	운용비중	운용수익률
단기자금	현금성	MMF	181	1,643	4.4	1.37
	소계		**181**	**1,643**	**4.4**	**1.37**
중장기자금	채권형	국공채형 제2호	181	22,447	59.6	1.59
		국공채형 제10호	181	13,047	34.6	1.63
		신성장동력	181	533	1.4	1.90
	소계		**181**	**36,027**	**95.6**	**1.62**
계			**181**	**37,670**	**100.0**	**1.59**

※ 운용수익률 : 연율화된 수익률

2. 2017년도 2분기 여유자금 운용성과

■ 목표수익률 대비 운용수익률

○ ‘17년 2분기 목표수익률 대비 총 운용수익률 : 0.01%p↑

- 기준 대비 단기자금 상회(0.06%p↑), 중장기자금 상회(0.02%p↑)

(단위 : %)

분 류	운용수익률(A)	목표수익률(B)	차이(A-B)
단기자금	1.37	1.31	0.06
중장기자금	1.62	1.60	0.02
전체자금	**1.59**	**1.58**	**0.01**

※ 운용수익률 : 연율화 된 수익률

■ 기준(BM)수익률 대비 운용수익률

○ ‘17년 2분기 기준수익률 대비 총 운용수익률 : 0.10%p↓

- 기준 대비 단기자금 상회(0.06%p↑), 중장기자금 하회(0.10%p↓)

(단위 : %)

분 류	운용수익률(A)	기준수익률(B)	차이(A-B)
단기자금	1.37	1.31	0.06
중장기자금	1.62	1.72	-0.10
전체자금	**1.59**	**1.69**	**-0.10**

※ 운용수익률 : 연율화 된 수익률

■ 위험대비 성과

○ ‘17년 2분기 위험성과지표인 정보비율(IR) -0.01

- 단기자금 정보비율(IR) 0.13, 중장기 자금 정보비율(IR) -0.01

- 중장기자금위험조정수익률인 샤프비율(SR) 0.13

분 류	IR[1]	SR[2]
단기자금	0.13	-
중장기자금	-0.01	0.13
전체자금	**-0.01**	**-**

※ IR과 SR은 연율화된 값, SR은 실적배당형 위험자산에 대해서만 구함(단, MMF는 SR 계산시 제외)

1) 정보비율(IR): 초과수익률을 추적오차로 나눈 값이며, 정보비율이 높으면 펀드성과가 우수하다고 할 수 있음
2) 샤프비율(SR): 펀드의 위험 1단위에 대한 초과수익의 정도, 즉, 1이라는 위험을 부담하는 대신 얻은 대가