

낙동강수계관리기금 2분기

금융자산운용수익률 산출

(2015.1.1~2015.6.30)

2015. 7

1. 개요

❖ 연중 자산운용평잔 요약표 및 월간수익률

단위 : 백만원, %

분류	연중 단기자산 운용평잔			연중 중장기자산 운용평잔	연중 전체자산 운용평잔
	현금성	유동성	소계		
금액(투자폴 포함)	5,856	4,219	10,075	-	10,075
비중	58.12	41.88	100.00	0.00	100.00
투자폴 위탁금액	4,333	-	4,333	-	4,333
투자폴 위탁비중	73.99	0.00	43.01	0.00	43.01

단위 : %

	1월	2월	3월	4월	5월	6월	7월	8월	9월	10월	11월	12월
현금성	0.12	0.12	0.15	0.09	0.08	0.09	-	-	-	-	-	-
유동성	0.18	0.16	0.13	0.15	0.15	0.14	-	-	-	-	-	-
단기	0.15	0.14	0.16	0.13	0.13	0.13	-	-	-	-	-	-
중장기	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
전체	0.15	0.14	0.16	0.13	0.13	0.13	-	-	-	-	-	-

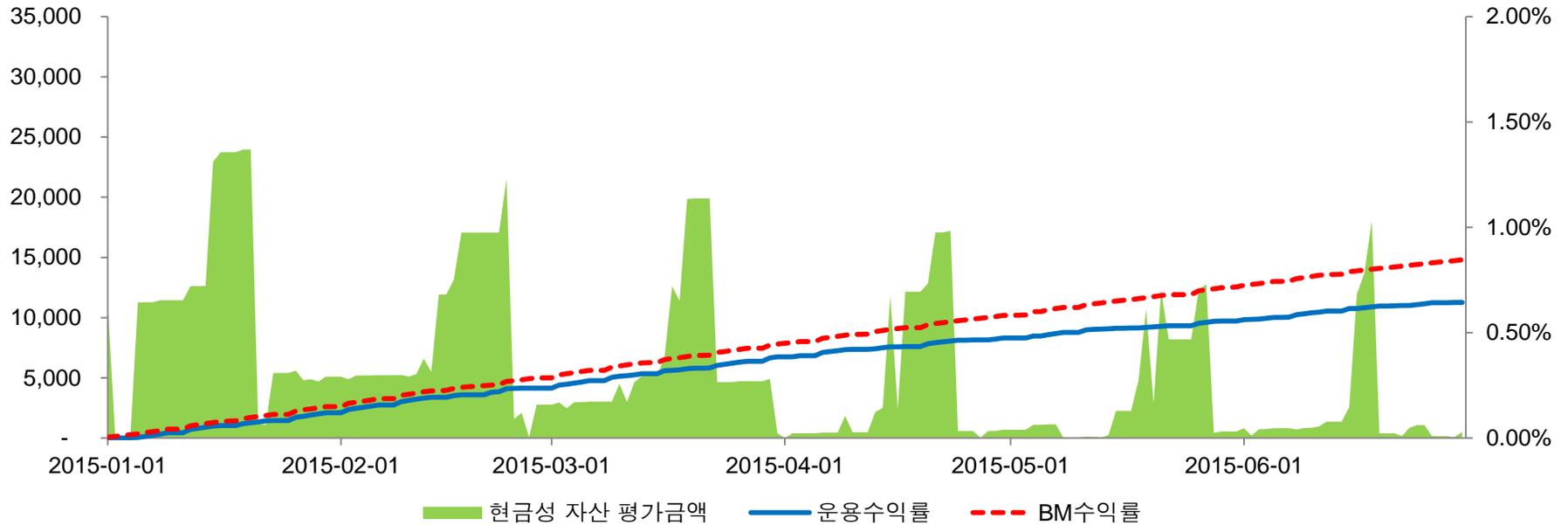
2. 운용자산별 기준수익률

❖ 운용자산별 기준수익률

운용상품 구분		투자자산별 기준수익률	제공기관		
직접투자	현금성자금	MMDA 평균수익률	한국은행		
	확정금리형	유동성자금	6개월 미만	CD(91일물) 유통수익률	한국은행
			1년 미만	정기예금 6개월~1년 미만 평균금리	한국은행
		중장기자금	정기예금 1~2년 미만 평균금리	한국은행	
	실적배당형	현금성자금	MMF 업계 평균수익률	연기금투자플	
		채권	채권종류 및 잔존만기별 채권지수	시중채권평가기관	
간접투자		간접투자 상품의 기준수익률	운용금융기관		

3. 현금성 자산

❖ 현금성 자산 평가금액 추이 및 운용성과



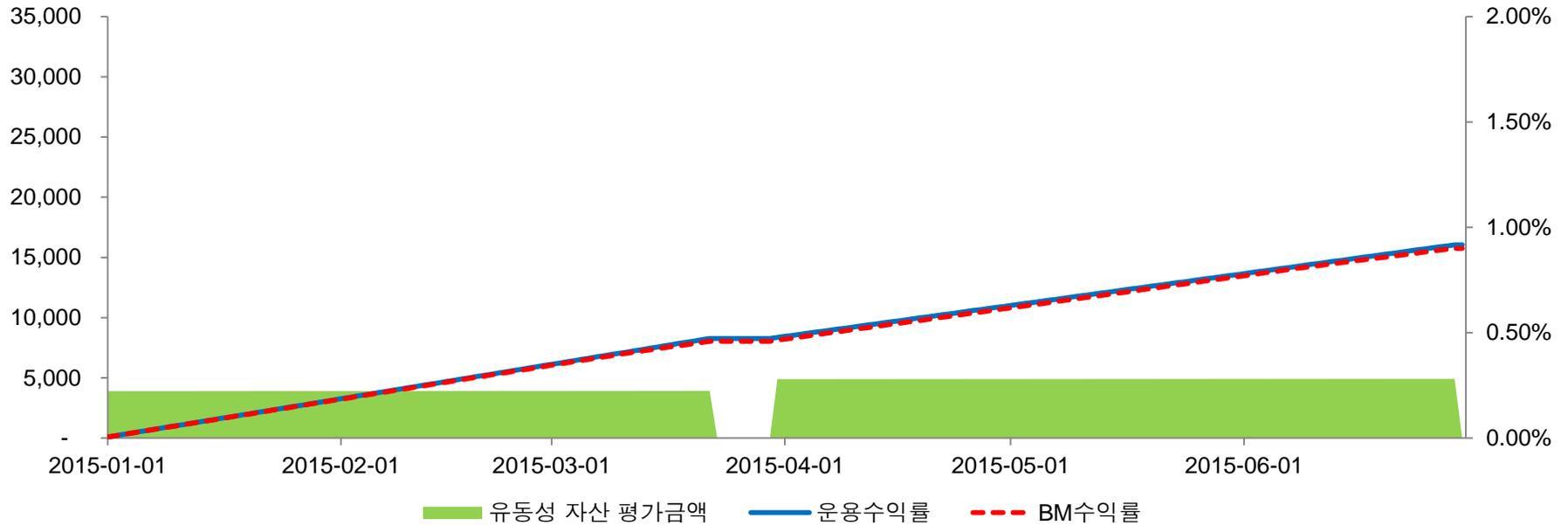
단위 : 백만원, %

분류	운용일수	기간평잔	운용수익률	BM수익률	초과수익률	IR	SR
MMDA	181	1,523	0.07(0.14)	0.69(1.39)	-0.61	-40.28	
실적배당형	168	4,333	0.77(1.68)	0.84(1.83)	-0.07	-4.20	-
합계	181	5,856	0.64(1.30)	0.85(1.71)	-0.20	-11.50	

- IPS 기준으로 분류한 성과단위에 대하여 시간가중수익률을 계산하며, 평가액 기준의 평잔을 계산합니다. (괄호 안의 값이 연율화된 수익률입니다.)
- SR은 연율화된 값이며, SR은 실적배당형 위험자산에 대해서만 구합니다. (단, MMF, MMDA 등은 SR 계산 시 제외합니다.)
- 제시된 값은 계산방법과 평가관점에 따라 달라질 수 있습니다.

4. 유동성 자산

❖ 유동성 자산 평가금액 추이 및 운용성과



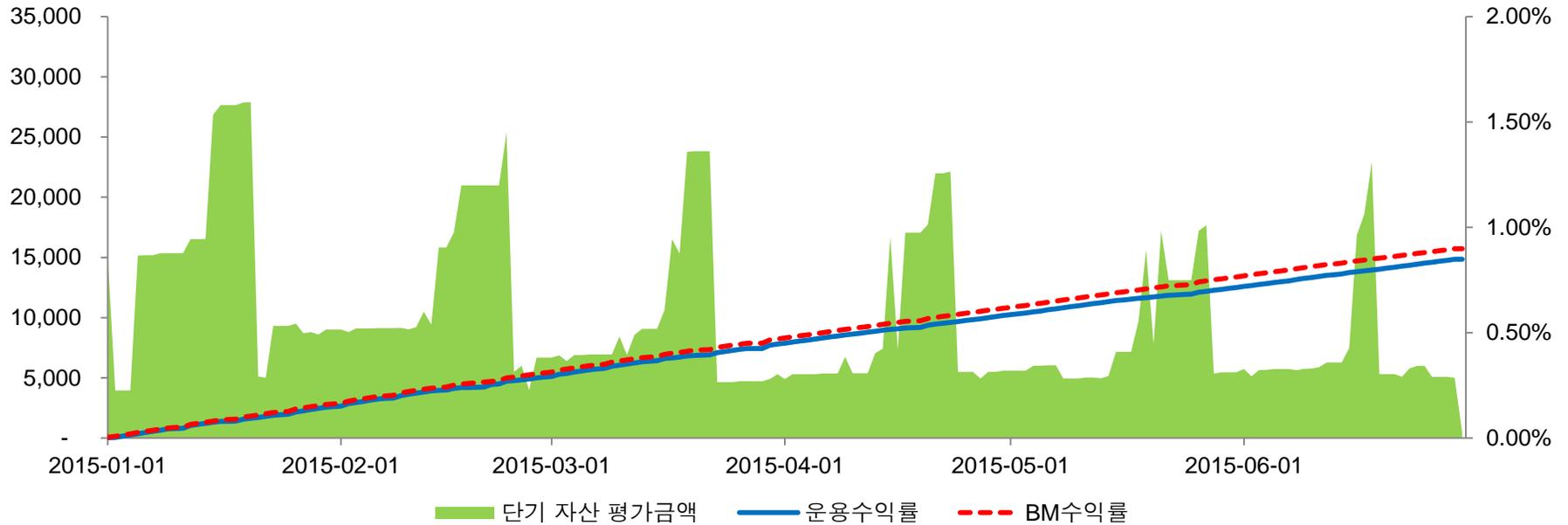
단위 : 백만원, %

분류	운용일수	기간평잔	운용수익률	BM수익률	초과수익률	IR	SR
확정금리형 6개월 미만	172	4,220	0.92(1.96)	0.90(1.92)	0.02	8.96	-
합계	172	4,220	0.92(1.96)	0.90(1.92)	0.02	8.96	-

- IPS 기준으로 분류한 성과단위에 대하여 시간가중수익률을 계산하며, 평가액 기준의 평잔을 계산합니다. (괄호 안의 값이 연율화된 수익률입니다.)
- SR은 연율화된 값이며, SR은 실적배당형 위험자산에 대해서만 구합니다. (단, MMF, MMDA 등은 SR 계산 시 제외합니다.)
- 제시된 값은 계산방법과 평가관점에 따라 달라질 수 있습니다.

5. 단기 자산

❖ 단기 자산 평가금액 추이 및 운용성과



분류	운용일수	기간평잔	운용수익률	BM수익률	초과수익률	IR	SR
단기	181	10,075	0.85(1.72)	0.90(1.82)	-0.05	-5.53	-

- IPS 기준으로 분류한 성과단위에 대하여 시간가중수익률을 계산하며, 평가액 기준의 평잔을 계산합니다. (괄호 안의 값이 연율화된 수익률입니다.)
- SR은 연율화된 값이며, SR은 실적배당형 위험자산에 대해서만 구합니다. (단, MMF, MMDA 등은 SR 계산 시 제외합니다.)
- 제시된 값은 계산방법과 평가관점에 따라 달라질 수 있습니다.

6. 요청자료

❖ 직접 및 위탁운용

단위 : 백만원, %

	분류	운용일수	기간평잔	운용수익률	BM수익률	초과수익률
	MMDA	181	1,523	0.07(0.14)	0.69(1.39)	-0.61
직접	정기예금	172	4,220	0.92(1.96)	0.90(1.92)	0.02
	계	181	5,743	0.80(1.61)	0.89(1.80)	-0.09
위탁	실적배당형	168	4,333	0.77(1.68)	0.84(1.83)	-0.07

- IPS 기준으로 분류한 성과단위에 대하여 시간가중수익률을 계산하며, 평가액 기준의 평잔을 계산합니다. (괄호 안의 값이 연평잔, 연율화된 수익률입니다.)
- SR은 연율화된 값이며, SR은 실적배당형 위험자산에 대해서만 구합니다. (단, MMF, MMDA 등은 SR 계산 시 제외합니다.)
- 제시된 값은 계산방법과 평가관점에 따라 달라질 수 있습니다.

E N D