[우정사업본부 공고 제2018-120호]

2018년도 우체국예금 국내주식 위탁운용사 선정 공고

2018년도 우체국예금 국내주식 위탁운용사 선정계획을 아래와 같이 공고합니다.

1. 선정개요

구 분	주식형 거래기관
선정기관 수	4개 기관
지원자격	「3. 지원자격 및 유의사항」 참조
평가기준	「4. 선정기준」 참조
제안서 접수기간	2018. 10. 24.(수) ~ 11. 07.(수) 18:00까지
최종선정일	2018. 11. 30. (금) 예정
Pool 유효기간	선정시점으로부터 1년* 까지

* 신규 자금위탁의 유효기간으로 유효기간 경과시 Pool 제외 및 자금 미집행

2. 선정유형 및 선정기관 수

유 형		선정기관 수
주식형	사회책임형	4

※ 평가결과에 따라 선정기관 수는 변경 가능

3. 지원자격 및 유의사항

가. 지원자격

1) 「자본시장과 금융투자업에 관한 법률」 제8조에 의한 국내 및 외국계 금융투자업자 (단, 외국계의 경우 운용조직이 국내에 있는 내국법인)

2) 선정공고일 현재 우체국 거래제한 조치대상에 포함되지 않는 기관

3) 2018년 9월말 현재 60%이상 주식으로 운용되는 펀드의 설정액이 500억원 이상인 기관

4) 2018년도 해당 운용유형 거래기관에 포함되지 않은 거래기관

ㅇ '17년 성과부진 등으로 탈락(전액회수)된 거래기관은 동일 운용유형에 지원 불가

나. 유형별 세부 지원 자격

ㅇ '18. 9월말 현재 평가대상 요건을 충족하는 펀드를 운용 중인 기관

유형	평가대상 펀드
사회책임형	ㅇ 평가기간 내 운용평잔(설정액 기준)은 100억원 이상이고 운용기간은 1년 이상인 동일 운용유형 펀드 ㅇ 운용기간 평균 주식편입비 60% 이상(파생상품 제외) **※ 단, (중소형주 + 코스닥) 평균 비중 50% 미만** **ㅇ 투자설명서 또는 투자지침에 사회책임 또는 이와 유사한 투자전략을 명시한 펀드**

다. 유의사항

ㅇ 주식형 설정액은 기준일 현재 금융투자협회 기준 국내AUM(운용자산규모)으로 함

ㅇ 대상 일임펀드의 실적 인정범위 : 우정사업본부 펀드평가사가 공인할 수 있는 운용실적이 인정되는 일임펀드

- 단, 해당 유형 동일 일임기관 일임펀드 전체를 제출하여야 하며, 제출 누락시 해당유형 일임펀드 전체를 평가에서 제외

ㅇ 투자일임펀드는 우정사업본부의 요구에 따라 일별 데이터 송부가 가능한 수탁기관(담당자, 연락처 등)을 명시하여야 함

ㅇ 일임펀드의 경우, 수익자 동의서를 반드시 제출

ㅇ 종류형펀드 및 모자펀드의 평가대상 펀드는 운용펀드 및 모펀드 기준이며, 운용성과는 각 클래스펀드 및 자펀드 기준임

ㅇ 유형별 평가대상 시 제외펀드

- L/T(long term)본부 운용펀드, 스팟형, 자사주펀드, 해외투자펀드, 벤처 또는 CRC펀드, 전환형 또는 목표달성형, 해당운용사가 운용하지 않는 'OEM'펀드, 시장지수ETF, 구조화시스템펀드(ELF포함), 물펀드 등의 테마펀드, 특정 그룹주 펀드, 자산배분형 펀드

4. 선정기준

ㅇ 정량평가(80%) 및 정성평가(20%) 후 선정된 예비운용사를 대상으로 현장실사를 통하여 최종 선정

가. 정량평가

ㅇ 평가기간 : '15. 10. 01. ~ '18. 09. 30. (1년 단위로 3구간으로 분류)

ㅇ 평가기준

운용성과(80%)				경영안정성(5%)	운용규모 및 인력(15%)	합계
1구간 (15.10~16.09)	2구간 (16.10~17.09)	3구간 (17.10~18.09)	운용기간			
15%	22.5%	37.5%	5%	5%	15%	100%

- 특정 구간의 운용실적이 없는 경우, 동일 운용유형에 지원한 모든 운용사의 평균수익률 적용
- 동일 운용유형 평균수익률이 없는 경우 기준수익률(BM) 적용

【세부 평가 기준】

평가항목	세부기준	배점
운용성과(80)	o 위험조정수익률 o 성과의 일관성 o 운용기간	50 25 5
경영안정성(5)	o 자기자본비율 o 자기자본순이익률 o 당기순이익 추세 o 주식형 설정잔액 대비 기관 운용자금 비율	2 1 1 1
운용규모 및 인력(15)	o 주식형 수탁규모 o 최근 3년 주식형 펀드 설정액 추세 o 주식형 운용역 당 운용규모 o 주식형 펀드 운용역 전체 인력 수 o 주식형 펀드 전담운용인력의 업계 운용경력 o 주식형 전담운용인력의 현보직 근무 경력 o 최근 1년간 주식형 펀드 운용인력의 이직률	2 2 2 3 2 2 2

나. 정성평가

○ 정량평가 결과 선정된 기관*을 대상으로 제안서 구술평가(프리젠테이션) 실시

* 정성평가 대상 운용사 수 : 최종 선정할 운용사의 2배수

○ 평가기준 : 운용전략(50%), 운용의 전문성(35%), 위험관리 방안(15%)

【세부 평가 기준】

평가항목	배점	평가방법
1. 운용전략	50	
o 운용철학	10	운용관련 철학, 도덕성 및 평판 등 평가
o 운용전략의 실효성	20	시장환경, 설정 자산배분 방법, 포트폴리오구성 등 운용프로세스에 대한 평가
o 포트폴리오 관리의 효율성	20	종목선정 등 포트폴리오 관리를 위한 세부전략 및 타당성 평가

2. 운용의 전문성	**35**	
o 운용역의 운용경험 등 전문성	20	운용경험, 경력 등 평판 평가
o 리서치 역량	15	리서치 조직 및 역량 평가
3. 위험관리방안	**15**	
o 리스크 관리 체계	8	위험관리방안의 합리성, 시스템과의 연계성 등 평가
o 컴플라이언스 관리 체계	7	컴플라이언스 절차 및 기준의/ 합리성 실현가능성, 시스템과의 연계성 등 평가
합계	**100**	

다. 예비운용사 선정 및 현장실사

○ 정량평가 및 정성평가를 합산하여 평점 합계가 높은 순으로 예비운용사 선정

○ 예비운용사를 대상으로 정량평가 및 정성평가 시 제안한 내용 확인 및 현장실사를 통해 최종 선정

【현장실사 주요 점검 사항】

항 목	주 요 확 인 사 항
Ⅰ. 경영안정성	○ 최근 경영상의 중요한 변화사항
Ⅱ. 운용규모 및 조직·인력	○ 총 설정액 및 주식형 설정액 확인 ○ 일임자산 운용내역 확인
	○ 인력수, 조직도/업무분장, 매니저 선정·관리 및 보상체계 등 확인 ○ 최근 1년 이직률 내역 확인
Ⅲ. 투자프로세스	○ 의사결정체계, 인력별 역할 및 책임, 리서치, 종목선정과정, 피드백 여부 등 확인
Ⅳ. 투자시스템	○ 자산운용(매매포함), 리서치, 성과분석 등 제반 운용 관련 시스템 일체 및 실제 활용도를 직접 현장 확인
Ⅴ. 리스크관리/ 컴플라이언스	○ 제반 규정(지침), 회의록(자료) 및 조치사례 등으로 실제 기능 수행 확인 ○ 리스크관리 및 컴플라이언스 관련 전산시스템 일체 직접 현장 확인

5. 주요일정

구분	일정	내용
1. 공고 및 접수	‘18.10.24.~ 11.07.	ㅇ (공고) 우체국자금운용 홈페이지, 금융투자협회 등 ㅇ (자료제출) 별도양식 제출
2. 정량평가	‘18.11.08.~11.23.	ㅇ 평가 및 결과 타당성 검증 *** 정량평가 결과 발표(‘18.11.26.예정)**
3. 정성평가	‘18.11.27.(예정)	ㅇ 제안서 구술(프리젠테이션) 평가 실시
4. 현장실사	‘18.11.29.(예정)	ㅇ 예비운용사 대상 현장실사 - 기존 다른 유형 내 운용중인 경우 실사 대상 제외 가능 *** 허위사실 발견 시 제외조치**
5. 최종선정	‘18.11.30.(예정)	ㅇ 최종선정 및 선정결과 홈페이지 공고

※ 상기 일정은 사정에 따라 변경 가능

6. 계약사항

ㅇ 계약기간은 계약체결일로부터 1년으로 함

- 다만, 계약기간 종료일까지 우체국의 계약해지 의사표시가 없는 경우 자동 연장됨

※ 운용성과, 시장상황, 위탁자산의 효율적 관리를 위해 필요한 경우 계약 해지 가능

7. 지원방법

가. 제출자료

ㅇ 제안서(별첨 1) 및 서약서(별첨2)

ㅇ 정량평가용 펀드 관련 데이터(별첨 3)

※ 펀드 관련 데이터는 제로인(http://zeroin.funddoctor.co.kr/service/mic) 공지사항 참조

나. 제출방법

ㅇ 모든 제출자료는 우정사업본부 자금운용 홈페이지에 업로드

※ 업로드 방법 : 자금운용 홈페이지(http://www.koreapostasset.go.kr) →「자산운용관련 자료」폴더 →「거래기관 접수」

ㅇ 제안서 및 서약서는 각 1부씩 인쇄물로 예금증권운용과 담당자에게 제출

※ 인쇄물 제출방법 : 직접 또는 우편(세종시 도움5로 19, 정부세종청사 8동, 우정사업본부)

다. 기타

ㅇ 제출 내용이 사실과 다르거나 중대한 오류 등의 허위사실 기재 시 평가대상에서 제외하며

ㅇ 최종 선정 이후에라도 운용사의 제안서 또는 구술내용에 허위 또는 중대한 은폐 사실이 있는 것으로 확인된 경우에는 해당 운용사의 선정 취소 및 모든 운용유형의 위탁자금을 회수하고 선정 시점으로부터 향후 2년간 신규 거래기관에 지원하는 것을 제한함

ㅇ 제출된 모든 자료(서류)는 일체 반환하지 않음

라. 문의처

ㅇ 우정사업본부 예금증권운용과 : 김정민 주무관 (044-200-8523)

ㅇ KG제로인 컨설팅사업부 : 정희석 차장 (02-769-9985)

붙임 1. 제안서 요청내용 및 제안방법 1부.
2. 서약서 1부. 끝.

2018년 10월 24일

우 정 사 업 본 부 장

<별첨1>

제안서 요청내용 및 제안방법

1. 본 제안서 요청의 목적은 우정사업본부가 국내주식에 투자할 목적으로 우체국 금융자산을 외부운용사에 위탁하여 운용함에 있어 위탁운용사 선정에 필요한 심사용으로 사용하기 위한 것입니다. 위탁운용을 희망하는 회사는 본 요청 내용을 숙지하여 위탁투자 제안서(Proposal) 내용으로 작성하시어 제출하여 주시기 바랍니다.

2. 위탁투자 제안서는 항목 순으로 작성하시고 제안서 이외의 추가 제출서류를 첨부하여 서약서를 포함한 공문으로 제출하여 주시기 바랍니다.
   [인감날인된 제출공문 및 서약서, 위탁투자 제안서를 파일형태로 자금운용홈페이지에 업로드하고 인쇄물은 별도제출 바람]
   * 양식은 자유양식임

○ 제안서 제출 공문 및 서약서 (기관별 각 1부)

◇ 제안서 제출 공문
◇ 서약서 (양식참조)

○ 위탁투자 제안서(운용사별 각 1부, 20페이지 이내 작성)

Ⅰ. 회사개요, Ⅱ. 소유구조 및 경영현황, Ⅲ. 운용현황 및 운용성과, Ⅳ. 운용조직 및 인력, Ⅴ. 투자프로세스 및 리서치과정, Ⅵ. 리스크관리 및 컴플라이언스체계, Ⅶ. 우정사업본부 위탁운용 관련 운용이력

※ 제안서는 1장당 2페이지를 인쇄

○ 추가 제출서류(운용사별 각 1부)

◇ 투자일임업 등록(허가)증 사본(금융감독위원회)
◇ 신탁재산 부실현황('18 2월말 현재)
◇ 최근 2년간 금융감독원 등 감독당국으로부터 받은 조치사항 내역(2016. 02. 28.~최근일)
◇ 인력현황(자격증 소지자)

3. 제안서 등 제출자료는 위탁운용사 선정 심사용으로 사용됨을 주지하시고, 각 해당항목에서 요구하고 있는 사항을 간단명료하면서도 사실과 다름없이 기재하여 주시기 바랍니다.

<별첨2>

서 약 서

본인은 제안서를 제출함에 있어 제반 통계자료와 기술내용을 사실에 근거하여 정확하게 작성했고 제안이 실현가능성 있는 타당한 계획이며, 사실과 다른 내용이나 고의적인 오류를 포함하지 않았음을 확인합니다.

따라서 만일 중대한 사실의 누락이나 오류 및 허위기재 등이 있는 경우 선정대상에서 배제되거나 선정이 취소될 수 있음을 확인하며, 이와 관련하여 기지급 받은 위탁운용보수가 있을 경우 이를 반환할 것임을 서약합니다.

년 월 일

xxxxxx주식회사

대표이사 (인)