

## 2019년도 우정사업본부 국내채권 위탁운용사 선정 공고

2019년도 우정사업본부 우체국예금 국내채권 위탁운용자산 거래 기관 선정계획을 아래와 같이 공고합니다.

2019. 1. 31.

우정사업본부장

### 1. 선정개요

구분	주요 내용
선정기관 수	회사채형 4개 기관*
지원자격	「세부 선정계획」 참조
평가기준	「세부 선정계획」 참조
제안서 접수기간	2019. 1. 31.(목) ~ 2. 15.(금) 16:00까지
최종선정일	2019. 3. 11.(예정)
Pool 유효기간	선정시점으로부터 1년 까지

※ 평가결과에 따라 선정기관 수는 변경 가능

### 2. 지원자격 및 유의사항

#### 가. 지원자격(아래 요건을 모두 충족하는 기관)

- ① 금융위원회에 투자일입 업무를 등록한 자산운용사
  - ② 선정공고일 현재 우체국예금 거래제한 조치대상에 포함되지 않는 기관
  - ③ '18년 12월말 현재 60%이상 채권으로 운용되는 펀드의 설정액이 1,000억 원 이상인 기관
  - ④ '19년 해당 운용유형 거래기관에 포함되지 않은 기관
- \* '18년도 성과부진 등으로 탈락된 거래기관은 동일 운용유형에 지원불가(타 운용유형 지원가능)
- ⑤ 크레딧 애널리스트가 1명 이상 있는 기관
  - ⑥ '18. 12월말 현재 평가대상 요건을 충족하는 펀드를 운용 중인 기관

## ○ 평가대상 펀드

- ① 평가기간 중 운용평잔(설정액 기준)은 100억원 이상이고 운용기간은 1년 이상인 채권형 펀드
  - \* 절대수익 추구 등 단기로 운용되는 펀드 제외
  - \* 예금자금 펀드 중 운용유형 전환 등에 따른 경우에는 연결하여 기존 운용기간을 산정
- ② 펀드 평균 듀레이션이 1~5년 사이에서 운용된 펀드
- ③ 일반사채 및 금융회사채(일반은행채 제외)의 평균 편입비율 40% 이상인 펀드
  - \* 국공채 운용능력 보다는 회사채 운용능력을 평가

## 나. 유의사항

- 채권형 설정액은 기준일 현재 금융투자협회 기준 국내 운용자산 규모로 함
- 대상 투자일임의 실적 인정범위 : 우정사업본부 펀드평가사가 공인할 수 있는 운용실적이 인정되는 투자일임
  - 단, 해당 유형 투자일임 전체를 제출하여야 하며, 제출 누락시 해당유형 투자일임 전체를 평가에서 제외
- 투자일임은 우정사업본부의 요구에 따라 일별 데이터 송부가 가능한 수탁기관(담당자, 연락처 등)을 명시하여야 함
- 종류형펀드 및 모자펀드의 평가대상 펀드는 운용펀드 및 모펀드 기준이며, 운용성과는 각 클래스펀드 및 자펀드 기준임
- 평가 제외펀드
  - 매칭형 펀드, 해외투자 펀드, 지수ETF 및 구조화시스템 펀드(ELF 포함), 채권시장안정 펀드 등 우본 자금운용 성격과 상이한 펀드

### 3. 선정기준

- 정량평가(80%)와 정성평가(20%) 결과를 합산하여 예비운용사를 선정하고 현장 실사 후 최종 선정

#### 가. 정량평가

- 평가기간 : '16. 1. 1. ~ '18. 12. 31. (1년 단위로 3구간으로 분류)
- 평가기준

경영안정성 (5)	운용성과(80)				운용규모 (7)	운용인력 (8)	합계
	위험조정수익률 · 성과의 일관성			운용기간			
	1구간	2구간	3구간				
5%	15%	22.5%	37.5%	5%	7%	8%	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
경영안정성(5)	○ 자기자본비율	2
	○ 자기자본순이익률	1
	○ 당기순이익 추세	1
	○ 채권형 설정잔액 대비 기관 운용자금 비율	1
운용성과(80)	○ 위험조정수익률	50
	○ 성과의 일관성	25
	○ 운용기간	5
운용규모(7)	○ 전체 설정액	2
	○ 채권형 설정액	3
	○ 채권형의 금융채 및 회사채 매수규모	1
	○ 채권형의 금융채 및 회사채 종목수(발행사수 기준)	1
운용인력(8)	○ 운용역 전체 인원수	3
	○ 크레딧 애널리스트 인원수	3
	○ 채권형 펀드 전담운용인력의 업계운용경력	1
	○ 채권형 펀드 전담운용인력의 현보직 근무경력	1

## 나. 정성평가

○ 정량평가 결과 선정된 기관\*을 대상으로 제안서 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
<b>1. 운용전략</b>	<b>50</b>	
○ 운용철학	10	운용관련 철학, 도덕성 및 평판 등 평가
○ 운용전략의 실효성	20	시장환경, 설정 자산배분 방법, 포트폴리오구성 등 운용프로세스에 대한 평가
○ 포트폴리오 관리의 효율성	20	종목선정 등 포트폴리오 관리를 위한 세부전략 및 타당성 평가
<b>2. 운용의 전문성</b>	<b>35</b>	
○ 운용역의 운용경험 등 전문성	20	운용경험, 경력 등 평판 평가
○ 리서치 역량	15	리서치 조직 및 역량 평가
<b>3. 위험관리방안</b>	<b>15</b>	
○ 리스크 관리 체계	8	위험관리방안의 합리성, 시스템과의 연계성 등 평가
○ 컴플라이언스 관리 체계	7	컴플라이언스 절차 및 기준의 합리성, 실현가능성, 시스템과의 연계성 등 평가
<b>합계</b>	<b>100</b>	

## 다. 예비운용사 선정 및 현장실사

○ 정량평가 및 정성평가를 합산하여 평점 합계가 높은 순으로 예비 운용사 선정

- 평가결과가 동점인 경우에는 정성평가 평점, 정량평가 평점, 운용성과 평점 순으로 합

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

## 4. 주요일정

구분	일정	내용
공고 및 접수	1. 31 ~ 2. 15	○ (공고) 우체국자금운용 홈페이지, 금융투자 협회 등 ○ (자료제출) 별도양식 제출
정량평가	2. 18 ~ 3. 1	○ 평가 및 검증
정성평가	3. 5	○ 제안서 구술(프리젠테이션) 평가 실시
현장실사	3. 7 ~ 3. 8	○ 예비운용사 대상 현장실사 - 기존 다른 유형 내 운용중인 경우 실사 대상 제외 가능 * <b>허위사실 발견 시 제외조치</b>
최종선정	3. 11.(예정)	○ 최종선정 및 선정결과 홈페이지 공고

※ '19. 2. 15.(금) 16:00 이후 1차 제안서 접수 불가

※ 상기 일정은 진행상황에 따라 변동 될 수 있음

## 5. 지원방법

### 가. 제출자료

○ 제안서(첨부 1) 및 서약서(첨부 2)

○ 정량평가용 펀드 관련 데이터(별첨)

\* 펀드 관련 데이터는 제로인(<http://zeroin.funddoctor.co.kr/service/mic>) 공지사항 참조

### 나. 제출방법

○ 모든 제출자료는 우정사업본부 자금운용 홈페이지에 업로드

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

○ 제안서 및 서약서는 각 1부씩 인쇄물로 예금증권운용과 담당자에게 제출

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

○ 펀드관련 데이터는 우정사업본부 자금운용 홈페이지에 업로드 후 펀드평가사((주)KG제로인)에 제출

## 다. 기타

- 제출 내용이 사실과 다르거나 중대한 오류 등의 허위사실 기재 시 평가대상에서 제외하며 선정이후에도 선정을 취소함
- 제출된 모든 자료(서류)는 일체 반환하지 않음

## 라. 문의처

- 우정사업본부 예금증권운용과 : 박진한 주무관 (044-200-8527)
- 펀드평가사 : (주)KG제로인 정희석 차장(02-769-9985)  
서지민 대리(02-769-9127)

## 제안서 요청내용 및 제안방법

1. 본 제안서 요청의 목적은 우정사업본부가 국내채권에 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. 12월말 기준)
- ◇ 최근 2년간 금융감독원 등 감독당국으로부터 받은 조치사항 내역('17.1월~'18.12월)
- ◇ 인력현황(자격증 소지자)

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

<첨부 2>

## 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 허위 기재 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)