민간연기금투자풀 인덱스주식형 개별운용사 유니버스 선정을 위한 제안 요청서

2020. 3. 30.

한국투자신탁운용

민간연기금투자풀 개별운용사
인덱스주식형 유니버스 선정 개요

1. 선정 관련 내용

□ 유니버스 정의

○ 민간연기금투자풀 통합집합투자기구(Fund of Funds)의 효율적 운용을 위해 사전에 구성하는 유형별 개별운용사 풀(Pool)

□ 선정 유형 및 유니버스 운용사 수

○ 인덱스주식형

□ 지위 유지기간 : 3년 (2020. 4. 7 ~ 2023. 4. 6)

○ 동 기간 동안 성과부진, 매니저 교체 및 중대과실 등으로 기금운용에 제약이 발생될 수 있다고 주간운용사가 판단할 경우에 지위유지 기간 중에도 그 지위가 박탈될 수 있음

○ 주간운용사의 결정에 따라 지위 유지기간은 추후 변경될 수 있음

□ 선정 방법

○ 유형별로 제출된 제안서 및 자료를 바탕으로 정량평가와 정성(서면)평가를 종합하여 선정

○ 정성평가는 사내외 전문가들로 구성된 선정위원회를 통해 평가 수행하며 서면평가로만 진행

□ 선정 기준

○ 정량평가(60%) + 정성(서면)평가(40%)

※ 스튜어드십 코드 참여 운용사로 등록된 경우, 최종 평가 점수에서 2%pt 범위 내에서 가산점 부여

정량평가		정성평가	
평가항목	비중	평가항목	비중 인덱스주식형
- 재무안정성	5%	- 운용조직 및 인력	20%
- 인적자원	20%	- 운용전략	45%
- 운용자산	25%	- 내부통제시스템	10%
- 운용성과	50%	- 위험관리	25%

2. 향후 추진일정

□ 개별운용사 선정일정은 다음과 같음. 단, 다음의 일정은 실무 선정 작업 진행 사정에 따라 일부 조정될 수 있음

○ **제안요청 공고 및 제안자료 접수 : 3.30(월) ~ 4.1(수)**
- 평가자료 제출 시한 : 2020년 4월 1일(수) 오후 5시

○ **평가 : 4.2(목)~4.3(금)**

○ **선정결과 발표 : 4.3(금)**

□ 선정결과는 해당 운용사로 개별 통보 예정

유니버스 제안 참여 요령

1. 신청방법 및 유의사항

□ 신청 방법

○ 금융투자협회(www.kofia.or.kr) 웹사이트 공지사항에서 제안자료(지원서 및 평가자료) 양식을 다운로드 받음

○ 제공된 양식에 따라 운용사의 제안자료 작성

- 파일명은 회사이름을 사용하여 수정

예) 회사명_정량평가기초자료.xls, 지원유형명_회사명_정성평가.ppt

□ 제안자료 작성 시 유의사항

○ 제안서의 기재사항에서 중대한 허위사실이나 오류가 발견되는 경우, 선정대상에서 제외하고 선정된 이후에도 취소할 수 있음

2. 제안자료 제출 시 유의사항

□ 지원 유형별 제출 자료 및 부수

① 정량 평가자료

제출서류	서면	저장매체	비고
지원서 (소정양식)	운용사별로 1부 제출	CD-R 또는 USB	-
개인정보 수집, 이용 및 제3자 제공동의서 (각사 자체 양식)			-
최소영업자본액 (소정양식)	-		-
운용자산총액 (소정양식)			국내 주식형만 해당, 공사모 펀드 및 일임 포함
공동이력서 (소정양식)			

② 정성 평가자료

제출서류	서면	저장매체	비고
정성평가 자료	7부 제출	CD-R 또는 USB 주1)	-

주1) 정량평가 자료와 정성평가 자료를 1장의 CD-R 또는 USB에 담을 것

※ 자료 제출 후 필요 시 추가 자료를 요청할 수 있음

※ 서면 제출서류 : 지원서, 개인 정보 수집 등 동의서, 정성평가 자료 7부

□ 제출방법

○ 제출 자료는 2020년 4월 1일(수) 오후 5시까지 당사로 방문제출 또는 우편제출(도착일시 기준)

○ 제출하여 접수된 자료는 반환하지 않으며 수정 및 보완 불가

주 소 : 서울시 영등포구 여의대로 24, 전경련회관 8층
한국투자신탁운용 민간투자풀운영본부
(우편번호 150-745)

문의처 : 문의사항은 지정된 이메일로 접수하시기 바라며 검토 후
답변 드리겠습니다.
(메일주소 : sim.pool@kim.co.kr)
*지원 희망회사는 2020.3.31.(화) 오후 12시까지 상기메일로 지원예정 통보 요망

3. 정량 및 정성 평가 항목 및 내용

□ 정량평가

○ 정량 평가항목 및 세부내용

항 목	인덱스주식형
재무안정성 (5%)	· 자기자본비율 · 총자산순이익률
인적자원 (20%)	· 담당부서 운용인력의 평균 운용경력 · 담당부서 운용인력 1인당 운용순자산 · 담당부서 운용역 수
운용자산 (25%)	· 해당유형 순자산 규모
운용성과 (50%)	· %순위(I.R.)(50%) · BM 대비성과(50%)

○ 평가 방법 및 자료 작성 시 참고사항

1. 재무안정성(5%)
- 금융감독원 및 금융투자협회 공시 기준(지원회사는 작성할 필요 없음)

2. 인적자원(20%)
- 운용인력 및 운용경력은 지원회사에서 제출한 평가 자료에 의거 산정

3. 운용자산(25%)

- 제로인의 분류에 따른 해당유형 순자산 규모 기준(지원회사는 작성할 필요 없음)

4. 운용성과(50%)

- 최근 분기말 기준 3년간의 성과 자료로 산정
- 제로인의 분류에 따른 지원 회사별 해당 유형 성과 산정

○ 운용성과 평가 대상 선정 기준

· 평가대상

- 인덱스주식형 : 공모 펀드(평가사 자료)

· 적용사항

- 선정일 직전 분기말 기준 과거 3년 동안 최소 1년 이상 운용한 펀드
- 운용평잔 50억 이상, 공모형 클래스 펀드는 클래스 합계 기준으로 평잔 계산
- 국내주식형만 해당되며, 공모펀드만 해당
- 제외대상 펀드 : 모펀드, 클래스모펀드, 롱숏펀드, 해외투자펀드, ETF, 자사주펀드, 그룹주펀드, 자산배분형펀드, 테마/섹터펀드, 분할매수펀드, 구조화시스템펀드(ELF포함), 벤처 또는 CRC펀드, 목표전환형펀드

유형	분류 기준
인덱스주식형	주식 편입비(파생상품 포함) 60% 이상 펀드로서 - 코스피, KOSPI200 지수를 추종하거나 복제하되 플러스 알파를 추구 - 또는, 펀드 평가회사의 분류에 따라 주식시장 성과와 관련이 있는 펀드

□ 정성평가

○ 정성평가 자료(서면 및 파일제출) : 파워포인트 자료로 폰트나 마스터 등은 자유 형식(표지 포함 35page 이내)

(1) 인덱스주식형

○ 운용사 개요

- 연혁, 자본금 및 주주구성(최근 변동내역 포함), 조직구성(인원수 포함), 경영

진(근속연수 및 업계경력 포함), 총 운용자산 현황, 경영상 주요 변동 예정사항 등 포함

○ 평가항목 및 세부내용

항목	세부내용
운용조직 및 인력 (20%)	- 인덱스 주식형 담당매니저의 세부이력(감독원 징계사항 포함) - 담당 매니저의 인덱스 주식형 운용현황(운용펀드, 운용규모, 수익률) - 매니저 보상시스템 체계 및 공정성 - 매니저 교체사유 발생 시 인력대체(백업) 시스템
운용전략 (45%)	- 전사 운용철학 및 인덱스 주식부문 운용철학 - 운용철학과 실제 펀드운용과의 정합성 - 투자의사결정프로세스 및 포트폴리오 구성 체계 - 업계 Peer펀드 대비 초과수익 달성을 위한 특화된 운용전략 (Enhanced Index 및 Quant 운용전략에 대해 각각 작성) - 인덱스 주식운용 지원시스템 상세 소개 및 시스템 관리 현황
내부통제 시스템 (10%)	- 내부통제시스템 체계(사전예방 및 사후통제 절차, 컴플라이언스 위반 시 조치기준, 지원시스템 등) - 내부통제 담당조직 인력별 상세이력 및 담당 업무 - 컴플라이언스의 독립적 수행 및 권한 체계 - 과거 3년간 분쟁 및 소송 내역 세부사항 - 과거 3년간 감독기관 징계 내역 세부사항
위험관리 (25%)	- 리스크관리 기준, 운용 가이드라인 등 위험관리 관련 규정 체계 - 리스크관리 프로세스 및 지원시스템 (인덱스주식형 리스크 관리 중점) - 리스크관리 담당조직 인력별 상세이력 및 담당업무 - 인덱스 주식운용 관련 위기상황 및 대처 실제 사례

□ **자료작성 기준일: 2019년 12월 31일**

끝.