2022-06-28

글로벌 멀티에셋 운용을 위한 해외 위탁 운용사 (SMA) 선정 공고

중소기업중앙회 노란우산공제 글로벌 멀티에셋 위탁 운용을 위한 해외 자산운용사를 선정하오니 아래 기재된 사항을 참고하시어 지원해 주시기 바랍니다.

1. 기본 사항

- 계약 형태: Separately Managed Account (SMA)
- 계약 규모: $150mn ~ $200mn
- 목표 계약일 / 운용 시작일: '22.4분기 경
- 계약 기간: 기본 2년. 이후 협의에 따른 연장

2. 운용 목표

- 목표 수익률: 연율 4.5% 이상 (원화 기준)
- 목표 위험도: 별도 협의
- 운용 전략: 적극적 자산배분 조정을 통한 절대수익 달성 전략

[포트폴리오 구성 방향]

자산군	목표 비중	주 투자 수단
글로벌 채권	50% ± 20%	현물 채권, 파생상품 및 수익증권 (ETF 포함)*
글로벌 주식	15% ± 10%	현물 주식, 파생상품 및 수익증권 (ETF 포함)*
대체**	35% ± 15%	대체전략 수익증권***

* 수익증권 (ETF 포함): 일간 단위 투명성 (하위자산 공개)이 제공되는 경우에 한함

** 대체: 주로 비유동사모자산 (Illiquid private assets)을 의미하며, private debt, 부동산, 인프라에 주로 투자. 단 필요시 유동성 관리 및 전술적 자산배분 목적으로 그 외 대체자산 및 유동적 대체전략도 투자 가능

*** 대체전략 수익증권: 개방형 수익증권이 기본으로, 최장 분기 단위 환매 허용 (그 외 환매조건 및 폐쇄형 수익증권은 별도 협의 후 제한적으로 허용 가능)

3. 서비스 등 기타 요구사항

- 보고

주기	제출일	주요 요구사항*
주간	매주 첫 영업일 오전 중 (한국시각 기준)	● 포지션 및 성과분해 (전 주 목요일 종가기준) ● 매니저 주간 코멘터리 (시황 및 성과)
월간	1. 매월 8일 까지 (한국시각 기준)	매니저 익월 운용 계획 (빠른 일정 감안, 공식 보고서 내용과 일치하지 않아도 됨)

	2. 협의	운용사 자체 공식 보고서 (내용 협의)
분기	협의	운용사 자체 공식 보고서 (내용 협의)

* 보고서는 영문과 한글 제공이 기본임

- 교육: 분기 최소 1회 (온라인 혹은 대면)
- 기타: 상기 외 추가 요구 사항 있을 수 있음 (예. 운용보고 컨퍼런스콜 등)

4. 지원 대상

- 상기 기재한 운용 전략 ("적극적 자산배분 조정을 통한 절대수익 달성 전략")과 유사한 전략 운용 역량 및 Track record 보유한 글로벌 운용사
- 상기 기재한 자산군을 포함하는 TAA (Tactical Asset Allocation) 자문 제공 가능한 글로벌 운용사
- 투자자의 요청/문의사항에 신속한 회신이 가능한 글로벌 운용사
- 한국어 지원 인력이 충분한 글로벌 운용사

5. SMA 운용사 선정 관련 향후 일정

일정		목표 시기*	세부 사항
정량 평가 (1차 평가)	지원 의향 제시 및 정량 자료 제출	~'22.7.6	엑셀 정량 평가 Template 별도 제공
	평가 결과 회신	~'22.7.18	개별 연락
제안서 발표 (2 차 평가)	제안서 제출	~'22.8.5	제안서 양식 및 항목 별도 공지 (국/영문 병기 혹은 한글 요약본 제출)
	제안서 발표	~'22.8.19	원격발표. 한국어 중심 발표 선호 (통역 비선호)
	평가 결과 회신	~'22.8.26	개별 연락
현지 실사 및 최종 선정		~'22.9.30	

* 모두 한국 시각 17:00 기준임. 불가피한 경우 일정 변경될 수 있음

6. 지원 방법, 연락처 및 유의사항

- 지원하고자 하는 운용사는 당사 이메일(mirae_multiasset@miraeasset.com)로 의사 표시 부탁드립니다.
- 1차 정량 자료 제출을 위한 액셀 양식은 지원 의사 표시 시 송부 드리겠으며 동 공고문에는 첨부되지 않았습니다. 혹은 지원 의사 결정 전에 정량 자료를 미리 검토 하고자 하는 운용사 역시 편의를 위해 요청시 제공 드리겠습니다. 정량 자료 제출은 '22.7.6일 17:00 (한국시각 기준)까지입니다.
- 제안서는 2차 평가 대상 운용사에 한해 요청 드릴 예정입니다.
- 연락처
  - 이메일: mirae_multiasset@miraeasset.com
  - 전화번호: +82.2.3774.1538 / +82.2.3774.5928
  - 담당: 미래에셋자산운용 대체솔루션운용본부 김승범 본부장 / 권은정 팀장