【우정사업본부 공고 제2018-16호】

2018년도 우체국예금 국내주식 ETF 위탁운용사 선정 공고

2018년도 우체국예금 국내주식 ETF 위탁운용사 선정계획을 아래와 같이 공고합니다.

1. 선정개요

구 분	주 요 내 용
선정기관 수	ETF형 4개 기관
지원자격	「3. 지원자격 및 유의사항」 참조
평가기준	「4. 선정기준」 참조
제안서 접수기간	2018. 02. 21.(수) ~ 03. 05.(월) 18:00까지
최종선정일	2018. 03. 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	ETF형	4

※ 평가결과에 따라 선정기관 수는 변경 가능

3. 지원자격

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 1월말 현재 60%이상 주식으로 운용되는 펀드의 설정액이 500억원 이상인 기관

4) 2018년 1월말 현재 한국거래소 시장에 시장지수형 ETF를 상장하고, 운용중인 기관

5) 2018년 1월말 현재 주식형 ETF펀드 수탁고 200억원 이상인 기관

6) 2018년 1월말 현재 평가대상 요건을 충족하는 펀드를 운용 중인 기관

〈평가대상 펀드〉

유형	평가대상 펀드
ETF형	ㅇ 평가기간 내 운용평잔(설정액 기준)은 100억원 이상이고 운용기간은 2년 이상인 지수추종(KOSPI, KOSPI200) 상장지수 펀드

주) 재간접 ETF 펀드, EMP펀드, 기관펀드 제외

나. 유의사항

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

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

4. 선정기준

ㅇ 정량평가(50%) 및 정성평가(50%) 후 선정된 예비운용사를 대상으로 현장실사를 통하여 최종 선정

가. 정량평가

○ 평가기간 : ‘15. 01. 31. ~ ‘18. 01 31.

○ 평가기준

운용성과(‘15.01 ~ ‘18.01)	경영 안정성	운용규모 및 인력	운용보수	합계
20%	10%	50%	20%	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(20)	o 위험조정수익률	20
경영안정성(10)	o 자기자본비율 o 자기자본순이익률 o 당기순이익 추세	4 3 3
운용규모 및 인력(50)	o ETF펀드[1] 설정액 o ETF펀드 설정액 추세 o 주식형 ETF펀드 운용역 전체 인력 수 o 주식형 ETF펀드 전담운용인력의 업계 운용경력 o ETF펀드 전담운용인력의 현보직 근무경력	10 10 10 10 10
운용보수 (20)	o ETF 일임보수	20

주1) 국내 주식형 ETF 유형 펀드(재간접, 섹터, 테마, 시장지수, EMP 등).
단, 포트폴리오 내 ETF 비중 60% 이상인 펀드

나. 정성평가

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

* 정성평가 대상 운용사 수 : 최종 선정할 운용사의 2배수

○ 평가기준 : 운용전략(40%), 운용의 전문성(35%), 위험관리 방안(15%), 제안보수의 적정성(10%)

【세부 평가 기준】

평가항목	배점	평가방법
1. 운용전략	**40**	
o 운용철학	10	운용관련 철학, 도덕성 및 평판 등 평가
o 운용전략의 실효성	15	시장환경, 설정 자산배분 방법, 포트폴리오구성 등 운용프로세스에 대한 평가
o 포트폴리오 관리의 효율성	15	- 종목선정 등 포트폴리오 관리를 위한 세부전략 및 타당성 평가 - 리서치 및 배분모델 - 리서치체계 및 ETF 자산배분 모델 실효성
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. 위험관리 방안	**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
4. 보수의 적정성	**10**	
o 제안보수의 적정성	10	제안 운용 보수의 적정성 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	내 용
1. 공고 및 접수	'18.02.21.~03.05.	○ (공고) 우체국자금운용 홈페이지, 금융투자 협회 등 ○ (자료제출) 별도양식 제출
2. 정량평가	'18.03.06.~03.20.	○ 평가 및 결과 타당성 검증 *** 정량평가 결과 발표('18.03.21.예정)**
3. 정성평가	'18.03.26.(예정)	○ 제안서 구술(프리젠테이션) 평가 실시
3. 현장실사	'18.03.29.(예정)	○ 예비운용사 대상 현장실사 - 기존 다른 유형 내 운용중인 경우 실사 대상 제외 가능 *** 허위사실 발견 시 제외조치**
4. 최종선정	'18.03.30.(예정)	○ 최종선정 및 선정결과 홈페이지 공고

※ 상기 일정은 사정에 따라 변경 가능

6. 계약사항

○ 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), 서약서(별첨2) 및 일임보수 제안서(별첨3)

ㅇ 정량평가용 펀드 관련 데이터(별첨 4)

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)

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

2018년 2월 21일

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 이외외 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(ETF 자산배분 모델 실효성 및 리서치체계), 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 1월말 현재)
◇ 최근 2년간 금융감독원 등 감독당국으로부터 받은 조치사항 내역(2016. 01. 31.~최근일)
◇ 인력현황(자격증 소지자)

3. 제안서 등 제출자료는 위탁운용사 선정 심사용으로 사용됨을 주지하시고, 각 해당항목에서 요구하고 있는 사항을 간단 명료하면서도 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)

<별첨3>

일임보수 제안서

일임보수를 다음과 같이 제안하며, 향후 제안내용에 변동이 없음을 서약합니다.

(단위 : bp)

운용사	제안 일임보수

년 월 일

xxxxxx주식회사

대표이사 (인)

※ 제출시 유의사항

1. 일임보수율은 0.5～10bp 이내에서 기재하여 제출해 주십시오
   (법인인감 날인 및 밀봉하여 다른 서류와 구분 제출, 0.5bp 단위로 기재)
2. 보수는 제안 기관들이 제시한 평균보수 및 시장평균 보수수준 등을 고려하여 협상 후 최종계약