

제안 요청서

1. 본 제안서의 요청 목적은 공무원연금 기금의 해외투자 위탁운용사 선정을 위한 평가용으로 활용하기 위한 것입니다. 위탁운용을 희망하는 기관은 아래의 요청 내용에 따라 제안서를 작성하여 제출해 주시길 바랍니다.
 2. 위탁운용 제안서는 **총 50 페이지 이내에서 PPT를 활용하여 작성**하며, 서약서 등 첨부서류 일체 (USB포함)와 함께 공문형식으로 제출하여 주시길 바랍니다.
- ※ 제출하는 모든 자료의 적절성 및 정확성에 대한 책임은 제안서를 제출하는 운용사에 있으며, 제출기한 마감 전까지 공단과 펀드평가사에 문의하여 정확한 자료 제출 요망

<제출 필요서류>

가. 제안서 제출 공문(공고명 명시 必): 1부

나. 위탁운용 제안서 : 3부

- ① 회사 개요
- ② 재무 현황
- ③ 소유구조 및 경영 현황
- ④ 감독기관 징계사항
- ⑤ 운용인력 및 조직 전문성
- ⑥ 투자 의사결정 체계 및 리서치 역량
- ⑦ 포트폴리오 구성 방안
- ⑧ 리스크 관리 체계 및 컴플라이언스
- ⑨ 지식공유 등 고객서비스

다. 기타 제출서류 : 「공고문 붙임1」 제출서류 목록 참조

3. 항목별 질문 등에 대한 귀사의 답변 자료는 위탁운용사 선정 평가용으로 활용됨을 주지하시고, 각 항목에서 요구하고 있는 사항을 **간단 명료**하게 사실에 근거하여 **빠짐없이 작성**하여 주시길 바랍니다.

[제안서 작성 항목 및 작성 순서]

◆ 기준일을 별도로 명시하지 않은 경우에는 2022년 11월말 기준으로 작성 ◆

① 회사 개요

1. 회 사 명 :
2. 설립일자 :
3. 대표이사 : (취임일자 기재)
4. 자 본 금 : 원
5. 회사 조직도 (운용 및 리스크 관련 부서는 인력구성 등 상세히 작성)
6. 임직원수 : 명 (2022.11.30.기준)
7. 전체 운용자산 규모 : 원 (2022.11.30.기준)
8. 해외채권형 펀드 운용자산 규모 : 원 (2022.11.30.기준)
9. 위탁운용 관련 연락처
 - 가. 제안서 작성 담당자(1인) : 성명/부서/직책/전화번호/E-Mail
 - 나. 위탁운용 담당자(1인) : 성명/부서/직책/전화번호/E-Mail
 - 다. 마케팅 담당자(1인) : 성명/부서/직책/전화번호/E-Mail

② 재무 현황

『금융투자협회 공시 기준에 준하여 작성』

1. 자본총계 : 억원
2. 총 자 산 : 억원
3. 순 이 익 : 억원 (기준시점 최근 1년)
4. 최근 3년간 자기자본 비율 및 자기자본이익률 추이 (단위 : %)

유 형	2019년말	2020년말	2021년말
자기자본비율			
자기자본이익률			

5. 최근 3년 전체 운용자산 및 해외채권형 펀드 수탁고 추이 (단위 : 억원)

유 형	2020년 11월말		2021년 11월말		2022년 11월말	
	잔 고	연 평 잔	잔 고	연 평 잔	잔 고	연 평 잔
전체 운용자산						
해외채권형 펀드 운용자산						

주1) 해외채권형 펀드 : 해외채권형(해외채권, 해외채권ETF, 공모펀드) 자산 비중이 60% 이상인 펀드

③ 소유구조 및 경영 현황

1. 귀사의 소유구조 및 출자관계 현황

가. 소유구조 현황 (주주구성 및 지분율)

나. 자회사 및 출자관계 사항 (5% 이상 출자관계 사항)

다. CEO와 최대주주와의 관계

* CEO와 최대주주가 다른 경우 최대주주의 상세 프로필

** 제안서 제출일 현재 변동사항 있을 시 변동 후 현황 및 변동내역도 기재

라. 귀사 및 귀사 최대주주의 현재 진행 중인 소송내역

2. 경영방침 및 경영 현황

가. 회사의 비전이나 목표, 단기 및 장기 계획 등 경영방침

나. 회사의 주요 이슈 등 경영 현황

④ 감독기관 징계사항

본 공고의 투자유형과 관련하여 최근 3년간 운용사 및 매니저가 금융감독원 등 감독기관으로부터 받은 문책사항 및 조치 내역 (주의, 경고 등 징계항목 구분하여 명시)

5 운용인력 및 조직 전문성

1. 해외채권 운용 인력 및 리스크관리 인력 현황

순번	소속팀	이름	직급	업무구분 (담당업무)	해당업무 경력(월)	현직경력 (월)	경력 유무	경력 업무	관련자격증

- 주1) 명시된 인력의 경력과 업무내역은 추가적인 자료 요청과 현장실사 등에 의해 검증
- 주2) 다른 업무를 겸직하는 경우 겸직업무를 표시하며, 평가 시 겸직인력에 대한 적절성 여부는 공단과 펀드평가사가 협의
- 주3) 운용인력 범위(해외채권 운용인력 限) : 해외채권 운용, 리서치, 트레이더
- 주4) 리스크관리 인력 범위(전체) : 컴플라이언스, 리스크
- 주5) 업무구분 : 운용, 리서치, 트레이더, 컴플라이언스, 리스크, 기타
- 주6) 담당업무 : 해외채권, 해외주식, 해외총괄, 리스크, 컴플라이언스, 기타

2. 해외채권 운용 인력 및 리스크관리 인력의 상세 프로필

- 가. 공단 담당예정인 운용 매니저 및 리스크관리 인력의 상세 프로필
- 나. 상기 운용 매니저의 경력 및 본 공고 투자유형과 유사한 펀드의 최근 3년간 운용성과

펀드명	설정일	해지일	운용 기간	설정액	최근1년 수익률			최근3년 수익률			BM	환헷지 비율
					운용	BM	초과	운용	BM	초과		

- 주1) 본 공고의 투자유형과 유사한 정도에 따라 우선 기재 요망
- 주2) 1년 이상 경과한 펀드를 대상으로 하며, 최근 1년 수익률과 3년 수익률 표시

3. 해외채권 관련 운용부서의 최근 3년간 인력변동 내역

순번	이름	입사일	퇴사일	업무분장	사유

4. 운용인력 관리 및 성과보상에 관한 사항

- 가. 펀드매니저 이직 시 귀사의 대응 방안, 지속적인 유지 및 확보 방안
- 나. 매니저에 대한 성과보상 체계 등이 내부규정이나 방침에 명확히 설정되어 있어 직원들이 사전에 인식하고 있는지 여부 (성과보상 체계의 구축 및 시행시기 명시)

다. 운용성과 측정시스템의 구축 여부 및 운용성과에 대해 정기적인 평가 보고체계가 마련되어 있는지 여부

5. 해외채권형 펀드를 운용하면서 최근 3년간 표창이나 포상을 받은 내역

⑥ 투자 의사결정 체계 및 리서치 역량

1. 운용 철학 및 운용스타일

가. 포트폴리오 구성 등 운용에 실질적 영향을 미치는 CIO의 운용 철학 및 운용 스타일
나. 책임투자과 관련 스튜어드십 코드 및 ESG 관련 정책에 대한 방향성

2. 투자 의사결정 체계

가. 투자 의사결정 프로세스 흐름도 (역할 및 책임 명시)
나. 운용역과 애널리스트와의 상호 관계, 역할 및 책임
다. 투자종목 선정 및 관리기준
라. 투자종목 편출입 시 의사결정 과정
마. 의사결정 과정에서 담당 운용역 개인 또는 Team Approach 중 어떤 쪽을 우선시 하는지와 Team Approach로 할 경우 최종 의사결정에 대한 설명
바. 투자 의사결정 과정 중 자사만이 갖고 있는 특징과 장·단점

3. 리서치 역량 및 네트워크

가. 리서치 업무분장 (애널리스트의 역할 및 권한 등)
나. 글로벌 금융시장 리서치 시스템 및 글로벌 네트워크 현황

⑦ 포트폴리오 구성 방안 (※ 최대한 구체적으로 작성)

1. 해외채권 EMP 운용계획

가. 벤치마크 수준의 성과 달성을 위해 해외채권 ETF 및 해외국채(A-등급 이상)를 활용한 포트폴리오 구성 방안 2가지(비용 최소화 등) 이상 제시 必

나. 구성된 포트폴리오에 대한 성과 시뮬레이션 분석(과거 1년, 3년)

다. 섹터·만기별 비중 등 포트폴리오 분석

라. 환위험 헤지 프로세스

2. 기타 고려사항

가. 유동성은 고려하지 않으며, 전액 투자하는 형태로 포트폴리오 구성

나. 예상비용 총액(지원사 제안 운용보수 제외, 단위 bp)을 명기

⑧ 리스크 관리 체계 및 컴플라이언스

1. 리스크 관리와 컴플라이언스 전담조직 및 인력 현황

2. 내부 리스크 관리 방법 및 과정의 규정화 내역

– 컴플라이언스 위반 시 내부보고 체계 및 대응 등

3. 운용과정의 투명성 확보를 위한 내부 통제제도 및 규정의 명문화 내역

4. 해외투자 관련 리스크 관리 방안

– Tracking error 관리 정책 및 위험허용 범위를 초과하는 경우 리스크 관리 부서에서의 조치사항 및 실제 사례

⑨ 지식공유 등 고객서비스

1. 해외법인 또는 전략적 제휴기관을 통한 교육 및 벤치마킹 제공 여부

2. 공단의 자산운용 역량 강화 및 수익 개선을 위해 제공 가능한 서비스