책임투자 관련 위탁운용사 선정 기준 및 현황, 성과평가 기준

□ 책임투자 관련 국내주식 위탁운용사 선정기준(´20년말 기준)

평 가 항 목	제안서심사			구술심사			배점	평가방법
	정량	정성	소계	정량	정성	소계	합계	
Ⅰ. 경영안정성	**5점**		**5점**				**5점**	
1. 자기자본/자본금	1.5점							최근 재무제표 기준 상대평가
2. 자기자본이익률	1.5점							최근 재무제표 기준 상대평가
3. 금융감독원 조치 (회사, CEO, CIO 등)	2점							금융감독원 조치 횟수
Ⅱ. 운용조직 및 인력		**15점**	**15점**		**10점**	**10점**	**25점**	
1. 담당매니저의 전문성		10점			5점			담당매니저의 전문성과 우수성 등
2. 운용조직의 안정성		5점			5점			운용 인력의 안정성과 우수성 등
Ⅲ. 운용성과	**17점**		**17점**				**17점**	
1. BM지수대비 초과수익률	8점							초과수익률 상대평가
2. 위험조정수익률(IR)	5점							IR 상대평가
3. 운용규모	2점							운용규모 상대평가
4. 운용기간	2점							운용기간 상대평가
Ⅳ. 운용전략 및 프로세스		**15점**	**15점**		**25점**	**25점**	**40점**	
1. 전략 및 투자의사결정체계		10점			20점			전략·포트폴리오·투자프로세스의 합리성, CIO, 운용역간 역할관계의 적정성 등
2. 리서치체계		5점			5점			투자전략을 수행하기 위한 내외부자원 활용의 적정성 등
Ⅴ. 위험관리	**3점**		**3점**		**5점**	**5점**	**8점**	
1. 리스크관리 체계	1.5점				2.5점			위험관리기준, 권한, 수행 프로세스, 전산화 정도 등
2. 컴플라이언스 체계	1.5점				2.5점			컴플라이언스기준, 권한, 수행 프로세스, 전산화정도 등
Ⅵ. 제안수수료	**5점**		**5점**				**5점**	
소계	**30점**	**30점**	**60점**	**0점**	**40점**	**40점**	**100점**	
기타. 스튜어드십코드							**2점**	**스튜어드십코드 도입시 가점**
1. 스튜어드십코드 도입							1점	스튜어드십코드 도입 및 등록
2. 세부 운용 지침							1점	스튜어드십코드 세부 운용 지침

※ 책임투자형 선정시 책임투자 운용프로세스 등 유형 특성을 고려하여 평가

□ 책임투자 관련 위탁운용사 현황(´20년말 기준)

○ NH-Amundi자산운용, 교보악사자산운용, 마이다스에셋자산운용, 미래에셋자산운용, 브이아이자산운용, 신한BNP파리바자산운용, 한국투자신탁운용, 한화자산운용, 현대인베스트먼트자산운용
(가,나,다 순)

□ 책임투자형 펀드 성과평가 기준(´20년말 기준)

○ BM : NPS-FnGuide 책임투자지수

○ 책임투자형은 국내주식 위탁유형의 하나로서 위탁운용에 공통으로 적용되는 평가기준이 적용되며, 책임투자형의 유형 특성을 고려하여

- 위탁운용 매니저의 책임투자 관련 전문성 및 도덕성
- 책임투자 관련 투자전략, 프로세스의 우수성
- 책임투자형의 투자지침 준수여부 등을 고려하여 평가에 반영