

2019년도 제5차 정보통신진흥기금

위험관리위원회 회의 결과

1. 회의 개요

- ① 명칭 : 2019년도 제5차 정보통신진흥기금 위험관리위원회
- ② 일시 및 장소 : '19.12.3.(화) 08:00~11:00, 서울 중구 회의실(을지로)
- ③ 안건 : 총 2건(의결1, 보고1)
 - [의결] 2020년도 허용위험한도 설정
 - [보고] 유동성 커버리지 비율 도입 계획

2. 논의 결과(요지)

□ 의결안건 제2019-5-1호 : 원안의결

① 안건 주요내용

- 현행 허용위험한도의 적절성 분석 결과, 기금전체 허용위험한도를 조정할 필요는 적으나 중장기자금 한도는 상향 조정을 검토
 - 국고채 3년물 수익률이 1.46%까지 하락한 상황을 고려하여 목표 수익률을 상회하는 포트폴리오 구성을 위해 한도조정 필요

구 분	2020년	2019년	비고
전체자산	2% 이내	2% 이내	자산배분을 위한 제약조건
단기자산	0.1% 이내	0.1% 이내	
중장기자산	7.5% 이내	5% 이내	

② 검토의견 요지

- 상대적으로 위험보상비율이 높은 해외주식 비중을 늘리는 방안 검토 필요

□ 보고안전 제2019-5-1호 : 보고접수

① 안전 주요내용

- 시장 위기상황 하, 자산의 가치하락, 인출제한 등으로 인한 유동성 위험을 대비하여 유동성 커버리지 비율의 도입을 추진
 - 산 출 식 : 현금성자산/Max[적정유동성규모, 순현금유출액]
 - 측정주기 : 1개월
 - 관리기준 : 100% 이상

구분		정상단계	주의단계
유동성 위험	판단지표	유동성커버리지비율 100% 이상	유동성커버리지비율 100% 미만
	대응조치	적정한 수준으로 관리됨	본부장 보고 및 운용팀 통보

② 검토의견 요지

- 유용성 확인 후 정식 도입 검토