

2020년도 제2차 정보통신진흥기금 위험관리위원회 회의 결과

1. 회의 개요

- ① 명칭 : 2020년도 제2차 정보통신진흥기금 위험관리위원회
- ② 일자 : '20.05.04.(월) ~ 05.11.(월) <서면결의>
- ③ 안건 : 총 3건(보고3)
 - [보고] 2020년 제1차 위험관리위원회 회의결과
 - [보고] 2020년 1분기 리스크 모니터링 결과
 - [보고] 코로나 감염 확산에 따른 시장위험 대응현황

2. 논의 결과(요지)

☐ 보고안건 제2020-2-1호 : 보고접수

☐ 보고안건 제2020-2-2호 : 보고접수

① 안건 주요내용

- 운용성과 : '20년 1분기 운용수익률(연율) $\Delta 0.53\%$, 목표수익률(1.36%) 대비 $\Delta 1.89\%p$ 하회, BM($\Delta 0.96\%$) 대비 $0.43\%p$ 상회

자산유형	운용수익률 (A)	목표수익률 (B)	기준수익률 (C)	초과성과	
				목표대비(A-B)	기준대비(A-C)
단기자금	1.98	1.32	1.47	+0.66	+0.51
현금성	1.80	1.23	1.36	+0.57	+0.44
유동성	2.19	1.36	1.60	+0.83	+0.59
중장기자금	$\Delta 3.47$	2.04	$\Delta 3.49$	$\Delta 5.51$	+0.02
확정금리형	2.25	1.83	1.67	+0.42	+0.58
실적배당형	$\Delta 6.67$	2.79	$\Delta 6.39$	$\Delta 9.46$	$\Delta 0.28$
기금 전체	$\Delta 0.53$	1.36	$\Delta 0.96$	$\Delta 1.89$	+0.43

- 위험관리활동 : 시장위험 %VaR한도 소진율의 일시적 '위기'단계 진입 외 모모든 위험이(유동성, 시장, 신용)지표별 허용위험한도 내에서 관리됨

② 검토의견 요지

- 금융기관별 보유한도 관리 철저 요망

□ 보고안전 제2020-2-3호 : 보고접수

① 안전 주요내용

- 조기경보 현황
 - 2월 말부터 1개월 내 조기경보(40 이상)가 두 차례 발생(2.28., 3.13.)
- 스트레스 테스트 실시결과
 - 위험자산 비중, 극히 작아 유의미한 수준의 영향은 없음.
- 지분증권 손실한도 초과에 따른 관리계획
 - 코로나19 감염확산에 따른 증시 하락으로 중장기 주식형 상품 손실한도 초과, 정부 안정화 정책이 예상되므로 현행유지 및 회복기 추가 매입 검토

② 검토의견 요지

- 코로나 사태 종료시기 및 회복시기 불확실성 높으므로 국내주식 비중 확대 신중 필요