경영유의사항 공개안

1. 금융회사명 : 보고펀드자산운용㈜

2. 제재조치일 : 2024. 7. 12.

3. 제재조치내용

조치대상	조치내용
기관	경영유의사항 1건

4. 조치대상사실

가. 경영유의사항

(1) 리스크관리지표 구체화 등 집합투자재산 리스크관리 강화

보고펀드자산운용㈜의 위험관리규정 등에 따르면 위험관리실무위원회는 위험관리의 전반적인 통제와 정책을 수립해야하고, 각 부문 운용본부장은 정기적으로 위험관리실무위원회에 펀드의 운용현황 및 리스크관리 지표를 보고하여 리스크관리가 실효성 있게 이루어질 수 있도록 운영하여야 한다.

한편, 보고펀드자산운용㈜이 운용 중인 펀드의 대부분('23.12월말 기준 168개 중 149개)은 해외자산에 투자하고 있어, 환위험관리가 핵심적인 위험요소 중 하나이므로 이에 대응하는 구체적인 위험관리방안 등을 내규에 마련하여야 한다.

하지만 보고펀드자산운용㈜은 검사대상기간(2019..2.28~2024.2.29) 중 제16기 1차 위험관리실무위원회 등 5회 동안 위험관리실무위원회를 개최하면서, 환헷지 및 환위험 관리방안 등 핵심 위험요인에 대한 관리방안을 마련하여 보고하고 있지 않은 것으로 확인되었다*.

* 예를 들면 환헷지운용역 적격성에 대한 정의 및 전문성 관리방안, 적정 환헷지비율 산정사유 및 초과(미달)시의 대응방안 등이 마련되어 있지 아니함

<조치할 사항>

따라서, 보고펀드자산운용㈜ 운용본부장 등은 해외자산에 투자하는 펀드별 위험요소 등을 고려한 구체적인 리스크관리지표(예, 해외 운용사(Sponsor 등), 환헷지비율 등)을 설정하고 관련 현황을 리스크관리위원회에 정기적으로 보고하는 등 리스크관리의 실효성을 제고하고,

환헷지 운용역에 대한 연수·교육 등을 통해 전문 역량을 확충하는 한편, 환헷지 업무절차 체계화, 환위험관리 및 대응방안 내규화 등을 통해 환리스크 관리를 강화하시기 바랍니다.