경영유의사항 공개

1. 금융회사명 : 알파자산운용㈜

2. 제재조치일 : 2020. 1. 22.

3. 제재조치내용

제재대상	제재내용
기관	경영유의사항 1건

4. 제재대상사실

(1) 유동화증권의 기초자산별 리스크 관리 강화

알파자산운용㈜은 단기금융집합투자기구(이하 "MMF")를 운용하면서 MMF에 편입한 유동화증권*의 기초자산별 편입액 및 편입비중, 신용위험 등을 체계적으로 관리하고 있지 않아 신용집중위험에 노출되어 있으므로,

* 「상법」상 주식회사 또는 유한회사 등의 형태로 설립된 명목상 회사(SPC)가 유동화계획을 등록하지 아니하고 자산유동화를 목적으로 발행한 기업어음증권(ABCP) 및 전자단기사채(ABSTB) 등 포함

유동화증권의 기초자산별로 신용집중위험에 대한 관리가 필요한 경우 기초자산별로 적절한 투자(잔여)한도를 부여하는 한편, 편입액 및 편입비중 등 투자현황을 파악하고, 신용위험 및 유동성위험 등 투자위험을 측정하여 적절히 관리할 수 있는 체계를 마련할 필요가 있음