

2023년도 제4차 방송통신발전기금 위험관리·성과평가위원회 결과

1. 회의 개요

- ① 명칭 : 2023년도 제4차 방송통신발전기금 위험관리·성과평가위원회
- ② 일시 : 2023. 10. 30.(월) 오후 4시
- ③ 안건 : 총 5건(보고 5건)
 - 2023년도 제3차 위험관리·성과평가위원회 결과보고
 - 2023년도 3분기 자산운용 위험관리·성과평가 결과
 - 중장기자산(해외, 대체) 투자 다각화 검토
 - 직접운용 및 위탁운용 간 비용·효익 분석
 - 위기상황분석(스트레스 테스트) 결과 보고

2. 논의 결과(요지)

□ 보고안건 제1호 : 보고 접수

- ① 안건 주요내용 : 2023년도 제3차 위험관리·성과평가위원회 결과보고
 - 안건 및 회의결과

안건 번호		안건명	회의 결과
보고	제2023-3-1호	2023년 제2차 위험관리·성과평가위원회 후속조치 결과	보고 접수
보고	제2023-3-2호	2023년 상반기 자산운용 위험관리·성과평가 결과	보고 접수

② 검토의견 요지

- 의견 없음

□ 보고안전 제2호 : 보고 접수

① 안전 주요내용 : 2023년도 3분기 자산운용 위험관리·성과평가 결과

○ (운용규모) '23년도 3분기 운용말잔은 1,244억원이며, 평잔은 1,675억원

○ (운용성과) 운용수익률은 3.42%(목표대비 -0.37%p, 기준대비 -0.27%p)

(단위: 억원, %, %p)

구분	운용 규모		운용 수익률 (A)	목표 수익률 (B)	기준 수익률 (C)	초과 성과	
	말잔	평잔				목표 대비 (A-B)	기준 대비 (A-C)
단기자금	1,173	1,598	3.30	3.76	3.64	-0.46	-0.34
중장기자금	71	77	5.49	4.35	4.32	+1.14	+1.17
기금 전체	1,244	1,675	3.42	3.79	3.68	-0.37	-0.27

○ (위험관리) 연 초 이후 자금운용 관련 위험은 모두 한도 내에서 관리되고 있음

② 검토의견 요지

- 편입자산 점검을 강화하고, 금리추세를 모니터링하며 채권형(국내) 상품의 적절한 듀레이션 및 투자비중 관리 필요

□ 보고안전 제3호 : 보고 접수

① 안전 주요내용 : 중장기자산(해외, 대체) 투자 다각화 검토

② 검토의견 요지

- 기금의 현황을 고려할 때 중장기자산 투자가나 해외·대체투자는 시기상조이나, 미래 대비를 위한 지속적인 검토 필요

□ 보고안전 제4호 : 보고 접수

① 안전 주요내용 : 직접운용 및 위탁운용 간 비용·효익 분석

② 검토의견 요지

- 분석 결과와 같이 확정금리형은 직접운용, 실적배당형은 위탁운용하는 것이 타당

□ 보고안전 제5호 : 보고 접수

① 안전 주요내용 : 위기상황분석(스트레스 테스트) 결과 보고

② 검토의견 요지

- 위기 상황을 타당하게 설정하여 스트레스 테스트를 시행하였으며, 시장위험도 적절하게 관리되고 있음