

기획예산처 보도자료

보도협조일 : 2004. 2. 27. (금) 朝刊

자료배포일 : 2004. 2. 26 (목)

배포부서 : 공보관실 (☎ 3480-7723~4)

생산부서 : 기금정책국 기금제도과(☎3480-7967~70) 과장 정홍상 사무관 오상우

연기금투자품의 투자상품 다양화, 고객인 기금에 대한 자문서비스 강화 등 투자품 운영방식 개선

- 기획예산처는 2.26(木)일 투자품운영위원회(위원장 : 변양균 기획예산처 차관)를 열어 개별 연기금이 투자할 수 있는 투자상품을 다양화하고 중소형 기금들에 대한 자문서비스를 강화하는 등 연기금투자품 운영방식을 더욱 발전시키기로 의결하였음

※ 연기금투자품은 지난 '01.12월 도입된 이후 연기금의 대표적인 자산운용수단으로 정착되어 가고 있음

- 2.23일 현재 48개 기금에서 2.8조원을 예탁받아 운영중이며
- 수익률 측면에서 업계 평균을 지속적으로 상회하는 투자 성과를 보이고 있음 (별첨 참조)

- 연기금투자품 운영개선방안의 주요내용은 다음과 같음

- ① 기금의 개별적인 투자수요를 충족할 수 있도록 새로운 투자상품을 개발·운영할 계획임
 - 외국환평형기금 등 대규모 자금을 초단기로 운영하고 있는 기금들을 위해 Call로 주로 운용되는 MMF를 신설
 - 환매제한기간이 1년 이상인 채권형 펀드를 신설하여 장기 예탁 수요를 충족

<별첨 1> 연기금투자신폴 현황

□ 자금예탁 현황

- '04. 2. 23. 현재 투자신폴 예탁규모는 2.8조원 수준이며,
예탁기금 수는 48개 (대상기금 수 : 55개)

< 투자신폴 예탁규모 추이 >

구 분	'01.12말	'02.12말	'03.12말	'04.2.23 (억좌)
MMF	3,920	20,435	13,098	6,152
채권형	3,256	17,705	15,637	9,888
혼합형	500	2,345	770	771
주식형	-	-	48	48
ELF	-	-	2,159	2,159
예탁규모	7,676	40,485	31,712	28,469
(예탁기금수)	(19)	(44)	(47)	(48)

□ 운용 성과

- 각 펀드별로 업계 평균수준을 상회하는 높은 수익율을
지속적으로 실현

< 각 펀드별 운용수익율 현황 >

구 분	투자신폴	업계평균	(04.2.23일 현재, %) 업계평균 대비
MMF	3.96	3.89	+0.07%p
채권형	4.56	3.73	+0.83%p
혼합형	16.21	8.59	+7.62%p
주식형	47.23	44.27	+2.96%p

* 설정후 연환산수익률

<별첨 2> 연기금투자상품 운영 개선 세부방안

I. 검토 배경

□ 연기금 투자상품은 지난 '01.12월 도입된 이후 연기금의 대표적인 자산운용수단으로 정착되어 가고 있음

○ 총 55개 연기금의 대부분인 48개 기금이 참여

	'01말	'02말	'03말	'04.2 (개)
참여기금수	19	44	47	48

○ 운용규모는 변동이 있으나 최근 3조원 수준 유지

	'01말	'02말	'03말	'04.2.23 (억원)
운용규모	7,676	40,485	31,734	28,469

□ 그러나 고객인 기금의 다양한 투자수요 충족, 투자자문서비스 제공, 리스크 관리 측면에서 개선 필요성도 지적되어 왔음

○ 이에 따라 기획예산처에서는 '04.1~2월 중 연기금 투자상품 관계기관 회의를 3회 개최하여 의견 수렴

- '04.1.28 : 연기금투자상품 위탁기금 회의 (11개 기금 관계자 참석)
- '04.2.5 : 연기금투자상품 하위운용사 회의 (8개 투신사 참여)
- '04.2.6 : 연기금투자상품 주요운영사 회의 (주건운용사, 판매사 등 참여)

○ 의견 수렴결과를 바탕으로 관련 전문가, 주요 운영사 등과 협의하여 제도개선 방안 마련

- 연기금투자상품 운영에 있어 주건운용사 권한을 강화
- 연기금투자상품 상품 다양화 및 기금에 대한 서비스 강화
- 리스크 관리 체계 강화