

2020년 자산운용본부 내부감사 결과

□ 감사개요 및 결과

- 감사기간 : '20.2.3~3.3 (감사대상기간 : '18.1월~현재)
- 감사범위 : 자산운용 및 리스크관리, 투자 사후관리 등 업무 전반
- 처분사항 : 신분상처분 7건(주의5, 경고2), 행정상처분 7건(개선2, 권고5)

□ 감사 지적 및 조치 요구사항

No	관계부서	제 목	주요지적 및 조치 요구사항	
1	기획조정실	리스크관리부서의 독립성 강화	○ 리스크관리 독립성을 위해 별도 편제필요	권고
2	금융투자부 실물투자부 기업투자부	해외투자 현장실사 부적정 이행	○ 현장실사 체크리스트 현실성 부족, 출장 변경사항 사후 보고 누락 ○ 현장실사 대상 기관 선정사유 미보고 등	주의(2) 개선
3	금융투자부	위탁운용사 거래한도 미설정	○ 주식 및 채권 위탁운용사 거래한도 미설정	개선
4	금융투자부	해외주식 펀드 운용사의 회의록 등 미관리	○ 위탁운용사 수시보고서 징구 외 별도 회의·수시미팅에 대한 기록물 관리 미흡	권고
5	실물투자부 기업투자부	대체투자 사전 및 사후관리 소홀	○ 투자실사기준에 따른 사후현장실사 미실시 ○ 심사보고서 일부사항 누락 등	주의(2)
6	기업투자부	대체투자 안건 처리 일부 부적정	○ 대체투자 안건처리 일부 부적정	주의
7	금융투자부	위탁투자 기관선정 심사평가표 관리 소홀	○ 위탁투자(주식,채권) 정성평가 심사표 사후 작성	경고
8	금융투자부 실물투자부 기업투자부	업무매뉴얼 마련 위한 문서 관리 체계화 및 업무지식 내재화	○ 문서 보존체계 마련 및 체계화 필요 ○ 대체투자 제안서 검토단계 문서화 미관리	권고
9	금융투자부	해외현장실사 부적정 이행, 지적생산물 부적정한 사적 이용 및 외부강의 등 개최	○ 방문대상 사전 미보고 및 변경누락 ○ 개인 출간서적 내 사전승인 없는 업무정보 포함 등 부적정한 활용 등	경고
10	투자전략실 금융투자부 리스크관리부	유동성리스크 관리 강화	○ 현금성자산 비중 관리 미흡 등 유동성 위험 노출 등 유동성관리 체계 보완 필요 ○ 단기자금 운용방향 개선	권고
11	투자전략실	금융 및 대체투자 현장실사 기준 개정	○ 현장실사 예외 사유의 구체적 내용 적시 필요	권고