

平成30年4月23日

独立行政法人 勤労者退職金共済機構
資産運用部

調査関係書類記載要領

【調査関係書類の記載方法について】

1. ご提出いただく所定様式の調査関係書類は、「プロダクト概要(サマリー)」と「運用機関調査回答書(調査票)」の2種類(ファイル)です。
各々の正本1部ずつについては、表紙の所定の箇所に捺印してください。
2. 各記載項目について、本記載要領に加えて、各項目のコメント部、及び脚注を参照して回答してください。
3. ファイルのセルに色がついた箇所を記入していただくようになっています。赤字部分は指示コメントや記入例ですので、それらを参照していただき、削除のうえ回答を記入してください。
4. 運用実績データや各種計数等のデータ入力部分以外は、コメント文字の大きさや位置等を適宜調整していただいで結構です。
5. コメント記載欄に記入するコメントが無い場合には、特に指定がなければ、空白にせず「なし」と記入してください。(記入漏れと区別するため)
6. 脚注等で特に指定がなければ、基準時点は2018年3月末として記入してください。(それ以外の基準で作成する場合は、その旨を記載してください)
7. 今後、大幅な変更を予定している項目については、変更予定日、及び変更後の状況等も併せて記載してください。(書ける範囲で結構です)
8. 「プロダクト概要(サマリー)」と「運用機関調査回答書(調査票)」のExcelファイルについては、各シートのシート見出しの()内に貴社名を入れてください。

例) プロダクト概要①(貴社名)

様式1-1-1(貴社名)

国内債券アクティブ プロダクト概要(サマリー)

【1】

記載項目	記載上の注意事項
運用機関名、運用再委託先、プロダクト名	
運用開始年月	・調査票の2.(1)応募プロダクトの概要の④運用開始年月と同じ。
運用ベンチマーク	・応募プロダクトがベンチマークとしている指標を記載。
目標超過収益率	
目標リスク (TE)	・指標を明確に記載。 (例) 推定TE目標値：●%～●% 実績TE：上限●% (管理値)
キャパシティ	・応募プロダクトへの資金流入により、当該運用がソフトクローズになるような運用受託残高上限のイメージ。(あれば)
最低投資金額	・応募プロダクトについて、1ファンドとして受託可能な下限金額
国内債券アクティブ運用プロダクトの受託残高	・調査票の1.(2)業況の②受託資産残高、件数の推移の〈アセットクラス別〉に記載する国内債券アクティブの残高(2018/3/31)を記載。
うち応募プロダクトの受託残高	・上記の残高のうち、応募プロダクトと同一戦略のファンドの総受託残高。(海外受託分も含む) 「同一戦略」とは、「応募プロダクトと同じ運用組織、運用プロセスによる運用で、類似のリスク・リターン特性を持つもの」とします。

【2】

記載項目	記載上の注意事項
プロダクトの概要、投資哲学等	・調査票で詳しく記載していただきますので、こちらには簡潔に記入してください。

【3】

記載項目	記載上の注意事項
超過収益源泉の割合イメージ (%)	・超過収益源泉が6つ以上ある場合には、行を挿入していただいて結構です。

【4】

記載項目	記載上の注意事項
応募プロダクトについて、運用制約があった場合の対応（可否）、考え方等	

【5】

記載項目	記載上の注意事項
超過収益率、要因分析	
実績TE（年率）、情報レシオ	
推定TE、保有銘柄数	<ul style="list-style-type: none"> 各年度末の数字を記載。
売買回転率	<ul style="list-style-type: none"> 計算方法は、$\{(売約定金額 + 買約定金額) \div 2\} \div 時価平均残高$（未収収益、評価損益を含む）とする。 それ以外の計算方法による場合は、特記事項欄に内容を記載。
応募プロダクト受託残高	<ul style="list-style-type: none"> 【1】うち応募プロダクトの受託残高と同じ。 各年度末の数字を記載。
応募プロダクト顧客数	<ul style="list-style-type: none"> 上記の応募プロダクト受託残高に対応する顧客数。 原則としてファンド数でなく、顧客数ベースで計上。合同口は顧客数を数え、1顧客から複数ファンドを受託している場合は1件として数えてください。 （そうでない場合は特記事項に内容を記載のこと。） 各年度末の数字を記載。

【6】

記載項目	記載上の注意事項
要因分析項目の説明	

【7】

記載項目	記載上の注意事項
過去に大きなドローダウンや、受託額の大幅な変動があった場合の説明	

【8】

記載項目	記載上の注意事項
種別、格付、残存年数ごとのウェイト	

【9】

記載項目	記載上の注意事項
月次運用実績データ（収益率）	・コンポジット又は代表ファンドのデータを記載。 いずれを選んだかを、(i) 掲載ファンドの内容にて説明。
月次運用実績データ（推定TE、平均クーポン、平均残存期間、修正デュレーション、最終利回り）	・同上
(i) 掲載ファンドの内容	・指定の各事項について必ず記載してください。
(ii) 掲載ファンドの基本的な運用条件	・投資対象、格付け基準については必ず言及してください。
(iii) シミュレーションデータが含まれる場合	
(iv) その他特記事項	

【10】

記載項目	記載上の注意事項
固定利付国債、地方債、政府保証債を除く全ての債券の保有状況	・利付国債以外の国債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABS、その他(デリバティブを含む)の保有銘柄を記載。(物価連動国債も該当します。) ・【9】に掲載した月次運用実績データが代表ファンドのものである場合、ここに掲載するファンドも同一のものであるのが望ましい。

国内債券アクティブ 運用機関調査回答書(調査票)

1.(1)会社概要 (様式1-1-1) (様式1-1-2)

記載項目	記載上の注意事項
①会社名	
②所在地	
③代表者	
④役員数、従業員数	
⑤設立年月日	
⑥登録・許認可	
⑦資本金	・基準時点も記載。
⑧主要株主	
⑨会社沿革	
⑩経営理念	
⑪企業グループ全体の一覧表	・グループの全体像と其中での貴社の位置づけがわかるように記載。

1.(2)業況 (様式1-2)

記載項目	記載上の注意事項
①業績 (過去5年度の決算状況(連結))	・確定した直近決算期から過去5年度の数字を記載。(2017年度決算の数字が未確定で記載できない場合は、2016年度以前の5年度分の記載で可)
②受託資産残高、件数の推移	・件数は顧客数を記載。

1.(3)組織図 (様式1-3)

記載項目	記載上の注意事項
会社組織の全体像及び各組織の人数	・特に応募プロダクトの運用部門の位置づけがわかるように記載。

1.(4)運用スタッフ (様式1-4)

記載項目	記載上の注意事項
①運用の最終責任者	・貴社のチーフ・インベストメント・オフィサーを記載。 (応募プロダクトの運用チーフということではない)
②人数の推移、平均経験年数、平均勤続年数	

③人材育成に関する考え方、体制	
④評価体系、給与体系等で工夫している点（定着率を向上させるための施策）	

1. (5) 資金運用業務に関する行政処分の状況（様式1-5）

記載項目	記載上の注意事項
過去10年（平成20年4月以降）の行政処分の有無	
過去10年（平成20年4月以降）の運用業務に係る訴訟の有無	

2. (1) 応募プログラムの概要（様式2-1）

記載項目	記載上の注意事項
①実質的投資判断を行う再委託先	
②プログラム名・スタイル	
③投資哲学	・ 超過収益獲得の根拠となる投資哲学を、できる限り理論的・実証的背景を踏まえて説明するのが望ましい。
④運用開始年月	・ 応募プログラムの運用開始年月を記載。 （運用業務開始や運用再委託開始の年月ではない）
⑤運用目標	・ 定量的な指標を記載。
⑥超過収益の源泉	

2. (2) 運用体制（様式2-2）

記載項目	記載上の注意事項
①応募プログラムの運用担当部署、調査担当部署	
②応募プログラムの運用担当者、調査担当者の状況	
③応募プログラムの運用担当者、調査担当者の状況の経歴書	

2. (3) 運用プロセス（様式2-3-1）（様式2-3-2）

記載項目	記載上の注意事項
①応募プログラムの運用に係る意思決定プロセスのフローチャート	・ 他ファイルの貼り付け可。 ・ 記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。（複数ページに渡って結構です。）
②意思決定プロセスに係わる機関	・ 同上。
③応募プログラムのポートフォリオ構築までの各段階におけるプロセス	・ 同上。

2.(4) 運用のモニタリング(ミドルオフィス体制) (様式2-4)

記載項目	記載上の注意事項
①応募プロダクトに係る運用のモニタリング体制	<ul style="list-style-type: none"> ・フロントオフィス(運用部門)とミドルオフィス(評価・分析部門)が分離されているか説明してください。 ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)
②モニタリングの内容、目的、ツールと方法、頻度等	<ul style="list-style-type: none"> ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)
③運用状況の分析・評価、運用部門へのフィードバック	<ul style="list-style-type: none"> ・フロントオフィスとミドルオフィス間のチェック体制について説明してください。 ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)

2.(5) デリバティブの利用 (様式2-5)

記載項目	記載上の注意事項
①応募プロダクトで利用するデリバティブの種類、利用目的、基準・条件等	<ul style="list-style-type: none"> ・顧客からの運用制約等は考慮せず、通常の前提とした記載で結構です。(通常の利用の仕方)

2.(6) 特記事項 (様式2-6)

記載項目	記載上の注意事項
①応募プロダクトの特徴	<ul style="list-style-type: none"> ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)
②投資・解約条件など特殊な条件や制約等	<ul style="list-style-type: none"> ・同上。

3.(1) リスク管理体制 (様式3-1)

記載項目	記載上の注意事項
①担当する部署、体制	<ul style="list-style-type: none"> ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)
②主要な管理項目と具体的な内容、頻度	<ul style="list-style-type: none"> ・リスク認識及びリスク管理の方法(重視するリスク管理指標、目標数値の設定、リスク分析、モニタリング方法等)について説明してください。 ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)

③利用するツールやシステム対応	<ul style="list-style-type: none"> ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。（複数ページに渡って結構です。）
④市場急変時の対応、緊急事態発生時における業務継続計画（BCP）等	<ul style="list-style-type: none"> ・同上
⑤運用再委託がある場合は、再委託の管理・監督等	<ul style="list-style-type: none"> ・同上

3.(2)トレーディング体制（様式3-2）

記載項目	記載上の注意事項
①担当する部署、体制	<ul style="list-style-type: none"> ・専任トレーダー数、運用フロントとの役割分担等について示してください。 ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。（複数ページに渡って結構です。）
②トレーディングシステム	<ul style="list-style-type: none"> ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。（複数ページに渡って結構です。）
③証券会社の選定基準、発注基準（ソフトダラーとの関連）	<ul style="list-style-type: none"> ・同上。
④最良執行、取引コスト抑制等への取り組み	<ul style="list-style-type: none"> ・トレーディングについて工夫している点について説明してください。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。（複数ページに渡って結構です。）

3.(3)事務処理体制（様式3-3）

記載項目	記載上の注意事項
①担当する部署、体制	<ul style="list-style-type: none"> ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。（複数ページに渡って結構です。）
②バックオフィスのシステム	<ul style="list-style-type: none"> ・ファンドデータを処理・管理する基幹システムをはじめ、売買、保有状況、パフォーマンス等に係る、貴社の主なシステムインフラについて説明してください。
③事務正確化への取り組み等	

3.(4)ディスクロージャー体制（様式3-4）

記載項目	記載上の注意事項
①情報開示やレポーティング、顧客とのコミュニケーションの体制・内容等	<ul style="list-style-type: none"> ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。（複数ページに渡って結構です。）
②アカウントビリティーに対する取り組み（定期運用状況報告への対応を含む）	<ul style="list-style-type: none"> ・同上。
③再委託先との情報開示制限やコミュニケーション方法等	<ul style="list-style-type: none"> ・同上

3.(5)コンプライアンス・監査体制 (様式3-5)

記載項目	記載上の注意事項
①担当する部署、体制	<ul style="list-style-type: none"> ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)
②社内規定の整備、コンプライアンス遵守への取組み、事故発生時における対応	<ul style="list-style-type: none"> ・同上。
③利益相反の防止、情報管理	<ul style="list-style-type: none"> ・同上。
④監査の状況(内部監査、外部監査)	<ul style="list-style-type: none"> ・同上。

3.(6)運用報酬率表 (様式3-6)

記載項目	記載上の注意事項
契約種類	<ul style="list-style-type: none"> ・複数提示可。 (例) 投資一任契約と単独運用指定包括信託 その場合には、契約種類ごとに報酬率テーブルを作成してください。
報酬率テーブル	<ul style="list-style-type: none"> ・応募プロダクトについて、複数の契約種類を提示する場合は、契約種類ごとに(様式3-6)を作成のうえ、右上の(様式3-6)を(様式3-6-①)(様式3-6-②)のように枝番をつけたものに書き換えてください。その場合は、シート見出しも同様に書き換えてください。
受託条件等	<ul style="list-style-type: none"> ・例えば、最低受託金額等。

3.(7)成功報酬体系について (様式3-7)

記載項目	記載上の注意事項
①成功報酬体系の有無	
②具体的な体系や条件	<ul style="list-style-type: none"> ・他ファイルの貼り付け可。 ・記入欄が不足する場合は、行の挿入等を行って適宜枠を延ばしてください。(複数ページに渡って結構です。)
③応募プロダクトで成功報酬体系を希望するか否か、その理由	

以上