

外国株式運用に係る運用受託機関の募集について

本機構では、以下の要領により中退共資産及び林退共資産の運用に係る運用受託機関を募集する。

1. 募集対象

- (1) 「MSCI KOKUSAI (円ベース、配当込み、GROSS)」をベンチマークとする外国株式アクティブ運用 (以下「外国株式アクティブ運用」という)。
- (2) 時価総額以外のファクターに着目し、システムティックなルールに基づいて行う外国株式運用 (いわゆるスマートベータ、以下「外国株式スマートベータ運用」という)。※

※ファクターやルールを意図的に変更する(固定化されていない)プロダクトについては、(1)の外国株式アクティブ運用として取り扱う。

- ・ (1)、(2)ともに「MSCI KOKUSAI (円ベース、配当込み、GROSS)」以外のインデックスをベンチマークとするもの、日本を含むもの、ベンチマークなしのものでも応募可とする。但し、長期的なパフォーマンス評価については「MSCI KOKUSAI (円ベース、配当込み、GROSS)」を基準として実施する。
- ・ (1)、(2)ともにフルインベストメントを原則とする。
- ・ (1)、(2)ともにヘッジ目的以外でデリバティブを利用するプロダクト、信用取引を利用するプロダクトは対象外とする。

2. 応募資格

- (1) 金融商品取引法に基づく投資運用業としての登録を行っている投資運用業者または金融庁の事業認可を受けている運用機関(信託銀行、生命保険会社)であること。
実質的投資判断を行う他の法人(以下「再委託先」という。)がある場合は、再委託先の運用拠点のある国の監督当局から必要な認可等を受けていること、又は当該国の法令等に基づく登録・届出を行っていること。(再々委託は不可)
- (2) 会社経営(業績面、財務面等)に問題がなく、安定していること。

- ① 業績が良好で財務状態が健全であること。(直近本決算年度において債務超過でない、直近本決算年度から遡って3年連続経常赤字でないこと等)
- ② 国内外における年金運用資産残高(2018年3月末時点)(注1)がグループ全体(注2)で1,000億円以上であること。

(注1) 投資顧問会社は投資一任契約のみが対象。

(注2) 連結財務諸表原則に基づく連結財務諸表を提出する会社、子会社及び関連会社から構成される企業グループであって、応募運用機関を含む。

- (3) コンプライアンス体制が整備されており、過去5年においても運用業務に関して重大な不祥事を起こしていないこと。
- (4) 再委託先においても(2)から(3)について同様とする。

以下、応募商品について

- (5) 投資哲学及び運用プロセスに合理性があり一貫していること。
- (6) 運用体制が整備されていること。
 - ・応募ファンドの運用スタッフの平均経験年数5年以上、平均勤続年数3年以上であること。
 - ・運用をサポートするシステム、分析ツールが充実していること。
- (7) 応募ファンドについては以下の要件を満たし、かつ運用実績が良好であること。

外国株式アクティブ運用、外国株式スマートベータ運用ともに

- ・応募ファンドと同一のコンポジットの運用実績が5年以上(2018年3月末時点)あり、かつ当該コンポジットの2018年3月末時点の運用資産残高が100億円以上あること。
- (8) 単独運用(直投)であること。
- (9) 日本語による各種報告・説明が可能なこと。

3. 応募手続き

- (1) 応募は1運用機関につき、外国株式アクティブ運用が最大2プロダクト、外国株式スマートベータ運用が1プロダクトの、計3プロダクトまでとする。
※外国株式アクティブ運用について2プロダクトを応募する場合は、運用戦略が異なる

るものであることを条件とする。(同一戦略で、リスク・リターン水準が異なるだけのものは不可)

(2) 現在採用されている受託機関(プロダクト)も、引き続き受託を希望する場合は今回の募集に応募するものとする。(当該プロダクトも(1)の外国株式アクティブ運用の応募件数に含める。)

(3) 応募を希望する運用機関は、4.の調査関係書類等を、平成31年3月5日(火)16時まで7.の受付先に紙媒体および電子媒体で提出するものとする。(必着、郵送時も同じ)

※応募する運用機関は、応募の3営業日前までに7.受付先のE-mailアドレスまで連絡を入れること。なお、件名欄(Subject)は【「運用受託機関の募集」への応募について(会社名)】とし、メール本文に、①提出方法(持参・郵送)、②提出予定日、③担当者名、④担当者連絡先、⑤応募プロダクト数、を記載すること。

※メ切以降の応募、応募書類等の不着については理由の如何を問わず受け付けない。

4. 調査関係書類の内容、提出方法

応募に際しては下記の資料を提出するものとする。

(1) 調査関係書類 (所定様式)

- ① 外国株式アクティブ プロダクト概要 (サマリー) 【応募プロダクト①】
- ② 外国株式アクティブ運用機関調査回答書 (調査票) 【応募プロダクト①】
- ③ 外国株式アクティブ プロダクト概要 (サマリー) 【応募プロダクト②】 ※
- ④ 外国株式アクティブ運用機関調査回答書 (調査票) 【応募プロダクト②】 ※
- ⑤ 外国株式スマートベータ運用プロダクト概要 (サマリー)
- ⑥ 外国株式スマートベータ運用機関調査回答書 (調査票)

※③④は、外国株式アクティブ運用について、2つプロダクトを応募する場合のみ。

(2) 添付資料

- ① 会社概要・パンフレット等 (任意)
- ② 当該プロダクトの標準ピッチブック (任意)

(3) 提出方法

・次表のとおり、書面および電子媒体 (CD-R 又は DVD-R) にて提出のこと。

提出書類		書面	電子媒体	備考
4 (1)	調査関係書類※ ①外国株式アクティブプロダクト概要 (サマリー) 【応募プロダクト①】 ②外国株式アクティブ運用機関調査回答書 (調査票) 【応募プロダクト①】 ③外国株式アクティブプロダクト概要 (サマリー) 【応募プロダクト②】 ④外国株式アクティブ運用機関調査回答書 (調査票) 【応募プロダクト②】 ⑤外国株式スマートベータプロダクト概要 (サマリー) ⑥外国株式スマートベータ運用機関調査回答書 (調査票)	各 6 部	要	書面は正本 1 部のみ押印し、残り 5 部はその写し。 電子媒体は 1 枚。 <u>※応募するプロダクトに応じて、必要なもののみ提出する事。</u>
4 (2)	添付資料 ①会社概要・パンフレット等 ②当該プロダクトの標準ピッチブック	各 6 部	要 ※①はデータ格納が可能なもののみ	任意提出 ※①は内外債券アクティブ運用、または国内株式アクティブ運用に応募し、その際に提出しているものと同じである場合は不要

- ・書面は、4 (1) および 4 (2) を併せて 1 セットとし、6 セットに仕分けして提出のこと。
- ・持参もしくは郵送 (書留) により提出のこと。

- ・ 4 (1) 調査関係書類の書面は A 4 サイズ、片面印刷に統一し、応募するプロダクト毎にプロダクト概要 (サマリー)、運用機関調査回答書 (調査票) をそれぞれ、ダブルクリップで左上を一箇所綴じたうえで、二つをまとめてダブルクリップで一箇所綴じること。
- ・ 電子媒体に格納する調査関係書類のファイル名は、それぞれのファイル名の後ろに (会社名) と入れること。
 例「外国株式アクティブ運用プロダクト概要【応募プロダクト①】(株式会社●●) .xlsx」
- ・ 提出後の調査関係書類は返却しない。
- ・ 選考過程で、2. 応募資格 (1) 及び (2) ①を満たしていることが確認できる書

類の提出を求める。

- ・提出書類に不正なデータが含まれる場合や虚偽または著しく誤解を与える記載を行った場合、不正な方法を用いて審査に臨んだ運用機関は失格とする。
- ・提出して頂いた資料、個人情報については機構限りとし、運用受託機関の審査以外の目的で利用しない。

5. 調査関係書類提出後の予定

- ・提出された調査関係書類をもとに書類審査による第1次選考を実施し、その結果を後日応募運用機関全社に書面で通知する。ただし、不採用の理由は通知しない。
- ・第1次選考を通過した運用機関に対しては、別途、第2次選考（面接）の案内を行う。
- ・最終審査の結果、採用なしとなる場合もあるのでその旨留意のこと。

6. 質問の受付等

- ・質問は、7. の受付先にてE-mailで受付ける。（E-mail以外の問合せは受付けない）
- ・件名欄（Subject）は【「運用受託機関の募集」に関する問合せ（会社名）】とすること。
- ・応募方法以外の照会やプレゼンテーション等は一切受けない。

7. 受付先

〒170-8055

東京都豊島区東池袋1丁目24番1号

独立行政法人 勤労者退職金共済機構

資産運用部 資産運用第一課 担当 須田、加藤

E-mail unyo2@taisyokukin.jp

※調査関係書類等を持参する場合は、18F 資産運用部入口のインターフォンにて、資産運用第一課（内 3622）を呼び出しのこと。