

外国債券アクティブ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

「FTSE 世界国債インデックス(日本を除く、円ヘッジ・円ベース)」をベンチマークとする外国債券アクティブ運用

- ・他のインデックスをベンチマークとした戦略、日本を含むプロダクトでも応募可とする。但し、パフォーマンス評価については、FTSE 世界国債インデックス(日本を除く、円ヘッジ・円ベース)を基準として実施する。
- ・地域特化型プロダクト、非投資適格債券を含むプロダクト、ヘッジ目的以外にデリバティブを多用するプロダクトは対象外とする。
- ・今回はヘッジ付き外国債券プロダクトの募集を行うものであるが、参考として「FTSE 世界国債インデックス(日本を除く、ヘッジなし・円ベース)」をベンチマークとするヘッジなし外国債券アクティブ運用プロダクトの情報やデータ等についても調査関係書類に記載のうえ提出のこと。

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(平成30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。
 - ・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(平成30年3月末時点)あり、かつ当該コンポジットの直近の運用資産残高(平成30年3月末時点)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) ヘッジ付き外国債券アクティブ運用の応募は、1運用機関につき1プロダクトまでとする。

また、ヘッジなし外国債券アクティブ運用については、ヘッジ有無以外はヘッジ付きの応募プロダクトと同じ戦略のもの、ヘッジ有無以外もヘッジ付きの応募プロダクトと異なる戦略のもの、いずれか1プロダクトを提示のこと。
- (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。

- (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 30 年 7 月 20 日 (金) 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、郵送時と同じ)

※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

- ① 外国債券アクティブ プロダクト概要(サマリー) (所定様式)
- ② 外国債券アクティブ(ヘッジ付き)運用機関調査回答書(調査票) (所定様式)
- ③ 外国債券アクティブ(ヘッジなし)運用機関調査回答書(調査票) (所定様式)

※①～③の作成パターンは別添「調査関係書類作成パターン」を参照。

(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外国債券アクティブ プロダクト概要 (サマリー) ②外国債券アクティブ(ヘ ッジ付き)運用機関調査 回答書(調査票) ③外国債券アクティブ (ヘッジなし)運用機関 調査回答書(調査票)	各 12 部	要	書面は正本 1 部のみ押 印し、残り 11 部はその 写し。 電子媒体は 1 枚。
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 12 部	要 ※①はデータ格 納が可能なも ののみ	任意提出 ※①は国内債券アクティブ 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、12 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A4サイズ、片面印刷に統一し、①プロダクト概要 (サマリー)、②外国債券アクティブ (ヘッジ付き) 運用機関調査回答書 (調査票)、並びに③外国債券アクティブ (ヘッジなし) 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、①、②、③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、①、②、③をそれぞれ「プロダクト概要 (会社名)」、「(ヘッジ付き) 調査回答書 (会社名)」、「(ヘッジなし) 調査回答書 (会社名)」とすること。
- ・ 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以外の問合せは受けけない)
- ・ 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@taisvyokukin.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。