

パッシ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、一般の中小企業退職金共済業務、清酒製造業退職金共済業務、及び林業退職金共済業務に係る業務上の余裕金の運用における運用受託機関を募集する。

1. 募集対象

- (1) 「NOMURA-BPI 総合」をベンチマークとする国内債券パッシブ運用
- (2) 「TOPIX (配当込み)」をベンチマークとする国内株式パッシブ運用
- (3) 「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パッシブ運用 (注1)

(注1) 当該インデックスをベンチマークとする外国債券パッシブ運用プロダクトでは
2. 応募資格を満たすものが無い場合に限り、「FTSE 世界国債インデックス (日本を除く、円ベース)」をベンチマークとするパッシブ運用プロダクトに、円ヘッジのシミュレーションを行った形での応募を可とする。(その場合も、2. 応募資格を満たしていることが必要。)

- (4) 「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パッシブ運用

※ 契約形態は投資一任契約を前提とする。

※ (3) については、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、円ベース)」をベンチマークとするヘッジなし外国債券パッシブ運用プロダクトのデータ等についても、調査関係書類の該当部分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「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づく認可を受けている金融機関であること。

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。（原則として、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 国内における年金運用資産残高(2020年3月末時点)^(注1)がグループ全体^(注2)で2兆円以上であること。

(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、応募プロダクトについて

(5) パッシブ運用の体制が整備されていること。

- ・応募プロダクトの運用スタッフの平均経験年数5年以上、かつ平均勤続年数3年以上（2020年8月末時点）であること。
- ・運用をサポートするシステム、ツールが充実していること。

(6) 応募プロダクトの対象資産のパッシブ運用の国内における年金運用資産残高(2020年3月末時点)^(注1)がグループ全体^(注2)で2,000億円以上あること、かつ、応募プロダクトと同一のコンポジットの運用実績が10年以上（2020年3月末時点）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。

(7) 受託した場合は単独運用（直投）で運用を行うこと。

(8) 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、1. 募集対象の(1)～(4)各1プロダクトまで(計4プロダクトまで)とする。

(2) 本機構に現在採用されているパッシブ運用受託機関(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。(当該プロダクトも応募件数に含める。)

※ 但し、契約形態が投資一任契約での運用受託となることを前提として応募のこと。

(3) 応募を希望する運用機関は、応募資格を満たしていることを確認のうえ、以下の通り7. 受付先のE-mailアドレスまで連絡を入れること。

・ 件名欄 (Subject) は【「運用受託機関応募希望の件」(会社名)】とする。

・ メール本文に①～③の必要事項を記載する。

① 貴社窓口担当者名、② 担当者連絡先 (電話及びE-mail)、③ 応募予定の資産クラス

当方より、貴社窓口担当者宛てE-mailにて、4. の調査関係書類ファイル一式を添付のうえ返信する。

(4) 応募する運用機関は、調査関係書類等を、令和2年10月20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。(期限厳守、郵送時と同じ))

※ 応募する運用機関は、調査関係書類等の提出日の3営業日前までに、以下の通り7. 受付先のE-mailアドレスまで連絡を入れること。

・ 件名欄 (Subject) は【「運用受託機関応募の件」(会社名)】とする。

・ メール本文に④～⑥の必要事項を記載する。

④ 応募する資産クラス、⑤ 提出予定日、⑥ 提出方法(持参・郵送)

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 パッシブ運用受託機関 調査回答書 (調査票) 【共通】
- ② 国内債券パッシブ運用 調査回答書 (調査票) 【資産別】
- ③ 国内債券パッシブ運用 調査回答書 (データ編)
- ④ 国内株式パッシブ運用 調査回答書 (調査票) 【資産別】
- ⑤ 国内株式パッシブ運用 調査回答書 (データ編)
- ⑥ 外国債券パッシブ運用 調査回答書 (調査票) 【資産別】
- ⑦ 外国債券パッシブ運用 調査回答書 (データ編)
- ⑧ 外国株式パッシブ運用 調査回答書 (調査票) 【資産別】

⑨ 外国株式パッシブ運用 調査回答書（データ編）

※ ②～⑨は応募するプロダクトのみ提出。

※ 各資産の「パッシブ運用調査回答書（調査票）【資産別】」を作成する際には、「[資産別] パッシブ運用 調査回答書（調査票）.xlsx」の様式（ファイル）を使用すること。

(2) 添付資料

- ① 会社概要・パンフレット等 （任意）
- ② 定期運用報告書等のサンプル

(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※ 【共通】 ・パッシブ運用受託機関 調査回答書（調査票） 【資産別】 ・[資産名]パッシブ運用 調査回答書（調査票） ・[資産名]パッシブ運用 調査回答書（データ編）	各 8 部	要	書面は正本 1 部のみ押印し、残り 7 部はその写し。 電子媒体は 1 枚。 ※資産毎のものは、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。
4 (2)	添付資料 ①会社概要・パンフレット等 ②定期運用報告書等のサンプル	各 8 部	要 ※①はデータ格納が可能なもののみ	①は任意提出。 ②は運用状況や要因分析の見せ方がわかるもの。

・書面は、4 (1) および 4 (2) を併せて 1 セットとし、8 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、片面印刷に統一すること。

・パッシブ運用受託機関調査回答書（調査票）【共通】については、ダブルクリップで左上を一箇所綴じること。

資産別の調査票については、応募するプロダクト毎に「[資産名]パッシブ運用調査回答書（調査票）【資産別】」、「[資産名]パッシブ運用 調査回答書（データ編）」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「パッシブ運用受託機関 調査回答書（調査票）【共通】（株式会社●●）.xlsx」
「国内債券パッシブ運用 調査回答書（調査票）【資産別】（株式会社●●）.xlsx」
「国内債券パッシブ運用 調査回答書（データ編）（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られることがある。
- ・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を実施し、通過した運用機関に対しては追って連絡を行う。

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【「パッシブ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@taisyo2okin.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。