様式第２号【外国株式アクティブ用】

平成27年　月　日

全国市町村職員共済組合連合会　御中

外国株式アクティブ運用機関調査

(平成27年8月募集分)

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 運用機関名 |  | | | | | |
| プロダクト  名称 | ＊ | | | | | |
| ベンチマーク |  | MSCI  ACWI ex.Japan |  | MSCI  KOKUSAI |  | MSCI  EMERGING |

* 該当するベンチマークの左側の欄に丸印の記入をお願いします。

**＊MSCI KOKUSAIをベンチマークとするプロダクトの場合**

同様の運用戦略でMSCI ACWI ex.Japanをベンチマークとするプロダクトにも別途応募する場合は、以下にそのプロダクトの名称を記入してください。

|  |  |
| --- | --- |
| (MSCI ACWI ex.Japan)  プロダクト名称 |  |

1. 組織概要
2. 会社概要
3. 会社名
4. 住所
5. 代表者
6. 資本金
7. 株主
8. 直近３期の決算状況（連結）【別紙】
9. 経営理念・経営方針
10. 運用上の最終責任者氏名及び役職
11. 過去3年の顧客類型別・商品別残高及びファンド数の推移【別紙】
12. 過去5年間（平成22年4月から現在まで）の行政処分
13. 処分期間
14. 行政処分を行った組織
15. 処分理由
16. 処分内容

※（6）と（9）については、所定の別紙に記載

※（10）に関して、「行政処分の有無」を所定の別紙に記載

1. 組織図
2. 人員（運用及び顧客リレーション関連部門）
3. 外国株式アクティブ運用概要
4. 投資哲学
5. 付加価値の源泉及び想定するウェイト【別紙】

※ 所定の別紙に記載

1. リターン・リスクの目標値（年率）【別紙】
2. 超過収益率
3. トラッキングエラーの水準　　①中心値　②上限値
4. インフォメーションレシオ

※（1）～（3）については、所定の別紙に記載

1. 運用戦略
2. 内容【別紙】
3. 想定売買回転率【別紙】

※（1）と（2）については、所定の別紙に記載

1. ベンチマークに対するアクティブウェイトの制限等
2. 運用体制（外国株式アクティブ運用部門）
3. ファンドマネジャー【別紙】

　人数、平均経験年数、１人あたり平均ファンド数

1. 当該プロダクト担当ファンドマネジャーの変遷（平成22年度から現在まで）【別紙】
2. アナリスト【別紙】

　人数、平均経験年数

1. 連合会ファンド責任者（予定）【別紙】

　氏名、経験年数、担当ファンド数

※（1）～（4）については、所定の別紙に記載

1. 人材評価及び育成に対する考え方（インセンティブ向上策等含め）
2. 意思決定プロセス
3. リサーチ
4. 情報収集体制（現在の体制と情報ソース拡充に向けた取組み等）
5. ユニバース分類
6. リサーチ活動
7. 調査項目、分析手法
8. 情報収集活動、評価・分析活動（具体的に）
9. 評価・分析情報の共有化、運用部門へのフィードバック
10. 活動実績（平成24～26年度）
11. 推奨銘柄リスト・レーティングの決定方法
12. アナリストの分担（ローテーションの考え方等含め）
13. ポートフォリオ構築
14. ポートフォリオ構築プロセス
15. 投資ユニバース
16. 投資銘柄の決定
17. 投資比率の決定
18. リバランス基準
19. 考え方
20. 購入、売却の基準
21. 投資不適格銘柄への対応
22. 考え方
23. 売却基準
24. 定量分析ツール（内容と利用方法）
25. 売買執行
26. 売買執行プロセス
27. 専任トレーダー制の有無とその考え方
28. トレーディングシステム
29. 最良執行のための手法
30. ブローカー選定方法
31. 執行内容の評価・コスト管理等
32. リスク管理・コンプライアンス体制
33. リスク管理項目と管理内容及び頻度
34. コンプライアンスチェック
35. コンプライアンスにかかる組織体制
36. コンプライアンス項目と遵守状況の確認頻度
37. 議決権行使
38. 外国株式の議決権行使対応の可否と実績
39. 議決権行使対応の可否　　　　　　　　　　　　　 　　 　可・否
40. 過去5年（平成22年4月から現在まで）の実績の有無 　あり・なし

「あり」の場合、対象国について記載してください。

＜対象国＞　○○、△△

1. 議決権行使を行うことによる提示報酬料率への影響　　　あり・なし
2. 基本方針
3. ガイドライン
4. 体制・プロセス
5. 当該プロダクトのセールスポイント
6. レポーティング

再委託先等がある場合には、情報開示制限等、秘密保持契約の有無

あり・なし

　　　「あり」の場合、内容を記載して下さい。