様式第２号【国内株式スマートベータ用】

平成27年　月　日

全国市町村職員共済組合連合会　御中

国内株式スマートベータ運用機関調査

(平成27年9月募集分)

|  |  |
| --- | --- |
| ﾌﾟﾛﾀﾞｸﾄ  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

※再委託先等がある場合は、再委託先等についても記載ください

1. 人員（運用及び顧客リレーション関連部門）

※再委託先等がある場合は、再委託先等についても記載ください

1. 運用戦略概要
2. 投資哲学
3. 運用戦略
4. インデックス名称
5. 内容
6. TOPIXに対する超過収益率、トラッキングエラーの目標値（年率）
7. 戦略の目的
8. 付加価値の源泉

※ファクターが長期的にプレミアムを生む理由

1. インデックスのメソドロジー

※詳細に記載ください

1. インデックス構築プロセス
2. 投資ユニバース
3. 銘柄選択とウェイトの決定ルール
4. 制約条件
5. 想定銘柄数
6. リバランス基準と頻度
7. 想定売買回転率（年率）
8. 指数値の算出方法と指数値情報の提供方法

1. パッシブ運用概要
2. 運用体制（国内株式パッシブ運用部門）
3. 運用担当者【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（過去5年）【別紙】
2. 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）～（3）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. ポートフォリオ構築
3. 手法
4. ポートフォリオ構築プロセス
5. 信用リスク懸念銘柄への対応
6. スクリーニング体制の有無　　あり・なし
7. スクリーニングの有無による提示報酬料率への影響　　あり・なし
8. 投資不適格基準

① 考え方

② 基準

1. 売却基準

① 考え方

② 基準

1. 上場廃止懸念銘柄に対する対応
2. ベンチマーク指数変更時の対応（過去の実績）
3. 売買執行
4. 売買執行プロセス
5. 専任トレーダー制の有無とその考え方
6. トレーディングシステム
7. 最良執行のための手法
8. ブローカー選定方法
9. 執行内容の評価・コスト管理等
10. リスク管理・コンプライアンス態勢
11. リスク管理項目と管理内容及び頻度
12. コンプライアンスチェック
13. コンプライアンスにかかる組織体制
14. コンプライアンス項目と遵守状況の確認頻度
15. 日本版スチュワードシップ・コードへの対応
16. スチュワードシップ活動の取り組み方針
17. 議決権行使

① 基本方針

② ガイドライン

③ 体制・プロセス

④ 行使実績（2014年度）

1. 投資先企業との対話

① 基本方針

② 取り組み状況

1. 当該プロダクトのセールスポイント
2. 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、内容を記載してください。