様式第２号【ヘッジ付き外国債券アクティブ用】

平成29年　月　日

全国市町村職員共済組合連合会　御中

ヘッジ付き外国債券アクティブ運用機関調査

(平成28年12月募集分)

|  |  |
| --- | --- |
| 運用機関名 |  |
| 再委託先等 |  |
| プロダクト名称 |  |
| ベンチマーク等（※） |  | シティ世界国債（除く日本、円ヘッジ、円ベース） |
|  | ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（除く日本円、円ヘッジ、円ベース） |
|  | その他のベンチマーク |
|  | ベンチマーク設定なし |

* 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。
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

※上位5株主の社名及び株式保有比率について記載

1. 直近3期の決算状況（連結）【別紙】
2. 経営理念・経営方針
3. 運用上の最終責任者氏名及び役職
4. 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】
5. 過去5年間（平成23年4月から現在まで）の行政処分
6. 処分理由
7. 処分機関・内容
8. 処分を踏まえた改善内容・顛末

※再委託先等がある場合は、再委託先等についても記載

※（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

1. 人員（運用及び顧客リレーション関連部門）

※部署及び人数を記載

※再委託先等がある場合は、再委託先等についても記載

1. ヘッジ付き外国債券アクティブ運用概要
2. 投資哲学
3. 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【別紙】
2. 内容
3. 想定売買回転率
4. ベンチマークに対するアクティブウェイトの制限等

※（1）～（3）については、所定の別紙に記載

1. 運用体制（ヘッジ付き外国債券アクティブ運用部門）
2. 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（過去5年）【別紙】
2. アナリスト・エコノミスト等【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. 応募プロダクトに携わる人員の増減【別紙】
2. 主要運用関係者略歴【別紙】

氏名、部署/役割、略歴、経験年数、在籍年数、資格等

※（1）～（6）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25年4月～平成28年9月、年度別に）
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（投資対象とする債券種別・商品や格付も具体的に記載）
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

(6)投資不適格銘柄への対応

1. 考え方
2. 売却基準
3. 定量分析ツール（内容と利用方法）
4. 売買執行
5. 売買執行プロセス
6. 専任トレーダー制の有無とその考え方
7. トレーディングシステム
8. 最良執行のための手法
9. ブローカー選定方法
10. 執行内容の評価・コスト管理等
11. リスク管理・コンプライアンス態勢
12. リスク管理項目と管理内容及び頻度
13. コンプライアンスチェック
14. コンプライアンスにかかる組織体制
15. コンプライアンス項目と遵守状況の確認頻度

1. 当該プロダクトのセールスポイント等
2. 収益を獲得する上でのポイント（独自性・差別化できる点）
3. 運用体制の強み（体制図等も活用）、人材育成・組織運営の注力ポイント
4. 平成17(2005)年度以降の運用実績

（表やグラフを活用し、年度毎の自己評価も記述）

1. 金利上昇期・低下期に発揮・期待される特性
2. ヘッジコストを考慮した収益最大化やコスト抑制に向けた取り組み、ヘッジコストのモニタリング手法等
3. 実績向上への工夫・取り組み（強化・改善してきた点）
4. 当該プロダクトの位置付け、残高管理方針（戦略全体及びセパレートアカウントにおける上下限についての考え方）
5. レポーティング
6. 連合会とのコミュニケーション体制等
7. 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。