様式第2号【資産管理用】

平成30年○月○日

全国市町村職員共済組合連合会　宛

○○株式会社

オルタナティブ資産に係る

資産管理機関調査

Ⅰ　資産管理のスキーム

１．資産管理スキームの概要

２．契約、役割分担及び責任関係

（１）契約関係

（２）役割分担及び責任関係

Ⅱ　組織概要（受託者）

　１．会社概要

（１）会社名

（２）住所

（３）代表者

（４）資本金

（５）株主

（６）直近3期の決算状況（単独・連結）【別紙】

（７）経営戦略、経営計画

（８）資産管理上の最終責任者氏名及び役職

（９）過去3年の信託財産残高の推移【別紙】

※（６）と（９）については、所定の別紙に記載

２．組織図

（１）社内組織図

（２）グループ組織図（親会社、子会社、グループ会社、アウトソース先、サブカストディ、システムベンダー、業務委託先等を明記）

３．人員体制【別紙】

※所定の別紙に記載

４．リスク管理・コンプライアンス体制（資産管理及び顧客リレーション関連

部門）

1. リスク管理体制
   1. 体制図
   2. リスク管理項目と管理内容及び頻度
   3. オペレーショナルリスク管理体制

・事務リスク管理

・イベントリスク管理

・情報管理

④その他のリスク管理体制

（２）コンプライアンス体制

①コンプライアンスに係る組織体制

②コンプライアンス項目と遵守状況の確認頻度

（３）内部検査及び外部監査体制

（４）過去5年間の行政処分

①処分の有無

②処分期間

③行政処分を行った組織

④処分理由

⑤処分内容

Ⅲ　組織概要（再信託受託者等）

　１．会社概要

（１）会社名

（２）住所

（３）代表者

（４）資本金

（５）株主

（６）直近3期の決算状況（単独・連結）【別紙】

（７）経営戦略、経営計画

（８）資産管理上の最終責任者氏名及び役職

（９）過去3年の信託財産残高の推移【別紙】

※（６）と（９）については、所定の別紙に記載

２．組織図

（１）社内組織図

（２）グループ組織図（親会社、子会社、グループ会社、アウトソース先、サブカストディ、システムベンダー、業務委託先等を明記）

３．人員体制【別紙】

※所定の別紙に記載

４．リスク管理・コンプライアンス体制（資産管理及び顧客リレーション関連

部門）

（１）リスク管理体制

①体制図

②リスク管理項目と管理内容及び頻度

③オペレーショナルリスク管理体制

・事務リスク管理

・イベントリスク管理

・情報管理

④その他のリスク管理体制

（２）コンプライアンス体制

①コンプライアンスに係る組織体制

②コンプライアンス項目と遵守状況の確認頻度

（３）内部検査及び外部監査体制

（４）過去5年間の行政処分

①処分の有無

②処分期間

③行政処分を行った組織

④処分理由

⑤処分内容

Ⅳ　業務体制（オルタナティブ資産管理実務を行う組織における体制）

１．業務体制の概要

（１）担当役員の履歴・経歴

（２）体制拡充・人員採用の方針及び計画（出向・転籍含む）

（３）人事異動の方針・計画

（４）人材育成の方針及び具体的な施策・計画

（５）連合会とのコミュニケーション体制

２．運用機関、ＧＰ、アドミニストレーターとの連携

（１）連携のための取り組み、概要及びスキーム

（２）資産管理について、効率化・強化を図った点

３．オルタナティブ資産に係る支払・利息・配当収入の対応

（１）担当部署の概要（専任部署の有無、体制）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 部署名 |  | |
| 役職員数 | 正社員 | （ﾌﾟﾛﾊﾟｰ）　　　（出向者） |
| 派遣社員 |  |
| 平均経験年数 |  | |

（２）担当メンバー（氏名、役職、主な担当業務、在籍年数、経験年数）

（３）支払（キャピタルコール）、利息、配当収入の徴収についての処理概要

（４）モニター方法

４．オルタナティブ資産に係る決済

（１）担当部署の概要（専任部署の有無、体制）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 部署名 |  | |
| 役職員数 | 正社員 | （ﾌﾟﾛﾊﾟｰ）　　　（出向者） |
| 派遣社員 |  |
| 平均経験年数 |  | |

（２）担当メンバー（氏名、役職、主な担当業務、在籍年数、経験年数）

（３）決済についての処理概要

（４）モニター方法

５．オルタナティブ資産に係るドキュメンテーション

（１）担当部署の概要（専任部署の有無、体制）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 部署名 |  | |
| 役職員数 | 正社員 | （ﾌﾟﾛﾊﾟｰ）　　　（出向者） |
| 派遣社員 |  |
| 平均経験年数 |  | |

（２）担当メンバー（氏名、役職、主な担当業務、在籍年数、経験年数）

（３）ドキュメンテーション・プロセス

６．オルタナティブ資産に係るキャッシュマネジメント

（１）担当部署の概要（専任部署の有無、体制）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 部署名 |  | |
| 役職員数 | 正社員 | （ﾌﾟﾛﾊﾟｰ）　　　（出向者） |
| 派遣社員 |  |
| 平均経験年数 |  | |

（２）担当メンバー（氏名、役職、主な担当業務、在籍年数、経験年数）

（３）キャッシュマネジメントサービスの概要

①提供商品（円貨、外貨）

②各商品のカウンターパーティリスクの所在

③カウンターパーティリスクの管理方法

（４）キャッシュフロー予測情報の運用機関への提供の有無について

７．オルタナティブ資産に係るバリュエーション確認方法

（１）バリュエーションの正当性確認

（２）バリュエーションの妥当性確認

８．外国為替

（１）担当部署の概要（専任部署の有無、体制）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 部署名 |  | |
| 役職員数 | 正社員 | （ﾌﾟﾛﾊﾟｰ）　　　（出向者） |
| 派遣社員 |  |
| 平均経験年数 |  | |

（２）担当メンバー（氏名、役職、主な担当業務、在籍年数、経験年数）

（３）為替取引のプロセスの概要

（４）内部で取引可能な通貨リスト

（５）公正な価格の担保方法（市場外取引の約定時間のチェック等）

（６）フェイルへの対応

（７）為替オーバーレイを行う場合のマネージャーへの情報提供方法

９．オルタナティブ資産に関するシステム

（１）担当部署の概要（専任部署の有無、体制）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 部署名 |  | |
| 役職員数 | 正社員 | （ﾌﾟﾛﾊﾟｰ）　　　（出向者） |
| 派遣社員 |  |
| 平均経験年数 |  | |

（２）担当メンバー（氏名、役職、主な担当業務、在籍年数、経験年数）

（３）現在のシステム概要

1. 基幹システム（名称、導入日、システム概要、投資額）
2. 管理対象資産（名称、導入日、システム概要、投資額）

（４）資産管理に係るハードウェアとその処理能力に対する見解

（５）非常時、災害時のバックアップ、復旧体制

（６）情報漏洩防止のための対策

（７）ＭＲＫ対応への取り組み

１０．オルタナティブ資産に関する付加価値サービス

（１）モニタリングサービス（リスク分析）

（２）その他

Ⅴ　報酬体系

※不動産、インフラ、ＰＥで異なる場合はそれぞれ記載。

１．信託報酬（報酬テーブルがある場合はテーブルを記載のこと）

２．カストディーフィー

３．トランザクションフィー

４．コールブローキング手数料

５．その他（できるだけ詳細に記載）

以上