様式第２号【国内株式アクティブ用】

令和6年　月　日

全国市町村職員共済組合連合会　御中

国内株式アクティブ運用機関調査

(令和6年7月募集分)

|  |  |
| --- | --- |
| ﾌﾟﾛﾀﾞｸﾄ  名称 |  |
| 運用  機関名 |  |

1. 組織概要
2. 会社概要
3. 会社名【様式第2-1号】
4. 住所【様式第2-1号】
5. 代表者【様式第2-1号】
6. 資本金【様式第2-1号】
7. 株主【様式第2-1号】

※上位5株主の社名及び株式保有比率について記載

1. 経営理念・経営方針【様式第2-1号】
2. 運用上の最終責任者氏名及び役職【様式第2-1号】
3. 責任投資原則（PRIへの署名状況）【様式第2-1号】
4. 直近期の決算状況（連結）【様式第2-2号】
5. 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【様式第2-3号】
6. 過去5年間（平成31年4月から現在まで）の行政処分【様式第2-4号】
7. 処分期間
8. 行政処分を行った組織
9. 処分理由
10. 処分内容
11. 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してください

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してください

1. 国内株式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【様式第2-5号】

※　所定の別紙に記載

1. リターン・リスクの目標値（年率）【様式第2-5号】
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

※　所定の別紙に記載

1. 運用戦略【様式第2-5号】
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

※　所定の別紙に記載

1. 運用体制
2. ファンドマネジャー【様式第2-6号】

　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）【様式第2-6号】
2. アナリスト【様式第2-6号】

　人数、平均経験年数

1. 連合会ファンド責任者（予定）【様式第2-6号】

　氏名、経験年数、担当ファンド数

1. 主要運用関係者略歴【様式第2-6号】

氏名、部署/役割、略歴、経験年数、在籍年数、資格等

※（1）～（5）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（令和3～5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（上場廃止懸念銘柄含む）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・コンプライアンス態勢
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. 日本版スチュワードシップ・コードへの対応
38. スチュワードシップ活動の取り組み方針
39. 議決権行使

① 基本方針

② ガイドライン（掲載URL含む）

③ 体制・プロセス

④ 行使実績（掲載URL含む）

1. 投資先企業との対話

① 基本方針

② 取り組み状況

③ 報告状況（例：サステナブリティレポートにて事例報告）

1. 当該プロダクトのセールスポイント
2. 当該プロダクトにおける地方創生・地域活性化について

（1）地方創生・地域活性化への考え方

（2）地方創生・地域活性化をどのように運用プロセスへ反映させているか。

（3）地方創生・地域活性化に関連する、どのような銘柄を想定しているか。

（銘柄と理由について記載ください。）

1. 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。