

平成 28 年 12 月 28 日

## ヘッジ付き外国債券アクティブ運用に係る運用受託機関の募集について

全国市町村職員共済組合連合会

本連合会では、以下の要領によりヘッジ付き外国債券アクティブ運用に係る運用受託機関を募集します。

### 1 募集対象

- (1) 以下のインデックスをベンチマークとするアクティブファンド
    - ・「シティ世界国債インデックス（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）インデックス（円ヘッジ・円ベース）」
  - (2) (1)以外のインデックスをベンチマークとするアクティブファンド
  - (3) ノンベンチマークのファンド
- ※いずれも各積立金の管理及び運用に係る基本方針に則った運用

(注) 応募は 1 社につき (1)～(3)までの合計で 2 プロダクトまでとします。日本（又は日本円）を含むプロダクトは可とします。非投資適格債券を含むプロダクト、地域特化型のプロダクトは不可とします。為替はフルヘッジです。

### 2 応募資格

- (1) 「金融商品取引法」（昭和 23 年法律第 25 号）に基づく金融商品取引業者としての登録を受けており、投資運用業を行うことができること。  
実質的投資判断を行う他の法人（以下「再委託先等」という。）がある場合は、再委託先等の運用拠点のある国の監督当局から必要な認可等を受けていること、又は、当該国の法令等に基づく登録・届出を行っていること。（再々委託は不可）
- (2) 経営上の問題（債務超過、3 年連続経常赤字等）がないこと。
- (3) 国内外における平成 28 年 9 月末現在の年金運用資産残高（投資一任契約、単独運用指定信託契約）がグループ\*全体で 1,000 億円以上であること。  
\* 連結財務諸表原則に基づく連結財務諸表を提出する会社、子会社及び関連会社をいう。
- (4) 応募プロダクトと同一のコンポジットの運用実績が、原則として 5 年以上あること（平成 28 年 9 月末時点）。ただし、運用実績が 5 年に満たない場合でも、クオンツ運用等で合理的な理由がある場合にはシミュレーションデータにより 5 年間の運用実績を作成することで応募を可とするが、応募時点で実運用が開始されているものに限る。

- (5) 法令遵守体制に問題がなく、過去5年においても著しい不祥事がないこと。
- (6) 再委託先等においても(2)から(5)について同様とする。

### 3 提出書類

#### (1) 資格要件確認書類

① 上記の2応募資格(1)を満たしていることが確認できる書類

(再委託先等の運用拠点のある国における当局からの免許取得、当局への登録・届出状況を示す書類を添付すること)

② 直近過去3年度の連結及び単独の財務諸表並びに監査証明書の写し

※ 上記①及び②は、現在、本連合会との間で信託契約又は投資一任契約を締結している者にあつては、提出を省略できるものとします。

※ 再委託先等の財務諸表等の提出が困難な場合には、再委託先等の経営上の問題(債務超過、3年連続経常赤字等)がないことを示す一定の証拠能力のある文書等を提出してください。

(2) 応募申込書(様式第1号【ヘッジ付き外国債券アクティブ用】)

(3) 運用機関の組織概要、受託実績、運用体制等に係る概要を記載した書類(再委託先等についても記載)(様式第2号【ヘッジ付き外国債券アクティブ用】)

(4) 運用報酬率を記載した書面(様式第3号【ヘッジ付き外国債券アクティブ用】)

(5) 応募プロダクトの運用実績に関する書類(様式第4号【ヘッジ付き外国債券アクティブ用】)

### 4 提出先及び提出期限等

#### (1) 提出先

〒102-0084 東京都千代田区二番町2番地

全国市町村職員共済組合連合会 財務部 運用管理課

● 担当：山川(ヤマカワ)、山下(ヤマシタ)

● 電話：03-5210-4602

● E-mail：[unyoukanri@shichousonren.or.jp](mailto:unyoukanri@shichousonren.or.jp)

※ お問い合わせは、原則上記 E-mail にお願いします。

(12月29日～1月3日：連合会年末年始休暇)

件名は「ヘッジ外債公募質問(運用機関名)」としてください。

運用機関名は略称で構いません。

(2) 提出方法

- ・ 次表のとおり、書面及びCD-Rにて提出してください。
- ・ 持参もしくは郵送（書留）により提出してください。

提出書類		書面	CD-R	備考
3(1)	資格要件 確認書類	運用機関ごとに 各1部	不要	
3(2)	様式第1号	プロダクトごとに 各7部	要	書面は、 <u>1部のみ押印</u> し、残り6部はその写し。 CD-R提出分に押印は不要。
3(3)	様式第2号	プロダクトごとに 各7部	要	
3(4)	様式第3号	プロダクトごとに 各1部	不要	書面は、 <u>封緘して提出してください</u> 。
3(5)	様式第4号	プロダクトごとに 各7部	要	

※3(2)、3(3)及び3(5)の書面は、それぞれ各1部を1セットにまとめて提出してください。3(4)の書面は、複数プロダクトまとめて封緘して結構です。  
※CD-Rにて提出する書面のファイルフォーマットは変更しないでください。

(3) 提出期限

平成29年1月18日（水）12時

※不足書類、記入漏れ等により再提出をする場合も上記期限内とします。  
応募される運用機関は、1月13日（金）までに件名を「ヘッジ外債公募応募連絡（運用機関名）」としてE-mailにて応募予定のプロダクト数も含めてご連絡ください（運用機関名は略称で構いません）。  
提出期限最終日は混雑が予想されるため、応募書類の準備が整い次第、早めにご提出ください。

## 5 選考

本連合会において、提出書類をもとに書類審査による一次選考を実施し、その結果を後日文書でお知らせします。ただし、不採用の理由は通知しません。

なお、提出書類に不正なデータが含まれる場合や不正な方法を用いて審査に臨んだ運用機関は失格とします。

一次選考を通過した運用機関に対しては、別途、ヒアリング資料の提出依頼及びヒアリングのご案内等を行います。