国内株式＿様式第２号

平成３１年　月　　日

東京都職員共済組合　御中

国内株式アクティブ（ESG）運用機関調査

（平成３１年２月募集分）

|  |  |
| --- | --- |
| ﾌﾟﾛﾀﾞｸﾄ  名称 |  |

Ⅰ．組織概要

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（連結）

（７）経営理念・経営方針

（８）運用上の最終責任者氏名、役職及び略歴

（経歴・投資判断歴・保有資格を含む）

（９）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

（10）過去５年の行政処分

① 処分期間

② 行政処分を行った組織

③ 処分理由

④ 処分内容

※（６）と（９）については、【国内株式＿様式第３号】に記載

※（10）に関して、「行政処分の有無」を【国内株式＿様式第３号】に記載

２．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

３．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

Ⅱ．国内株式アクティブ運用概要

１．投資哲学

２．各付加価値の源泉に対する想定収益とリスク量の配分

※【国内株式＿様式第３号】に記載

３．リターン・リスクの目標値（年率）

（１）超過収益率

（２）トラッキングエラーの水準　　①中心値　②上限値

（３）インフォメーションレシオ

※（１）～（３）については、【国内株式＿様式第３号】に記載

４．運用戦略

（１）内容

（２）想定売買回転率

（３）ベンチマークに対するアクティブウェイトの制限等

（４）デリバティブ等の使用

※（１）～（４）については、【国内株式＿様式第３号】に記載

５．バリュー／グロース銘柄に分類する際の基準

６．運用体制

（１）ファンドマネジャー

人数、平均経験年数、１人あたり平均ファンド数

（２）当該プロダクト担当ファンドマネジャーの変遷

（３）アナリスト

人数、平均経験年数

（４）当共済組合ファンドの運用責任者（予定）

氏名、運用経験年数、担当ファンド数、略歴（経歴・保有資格・　　　　主な運用戦略歴等）

（５）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）

※（１）～（４）については、【国内株式＿様式第３号】に記載

７．意思決定プロセス

８．リサーチ

（１）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）

（２）ユニバース分類

（３）リサーチ活動

① 調査項目、分析手法

② 情報収集活動、評価・分析活動（具体的に）

③ 評価・分析情報の共有化、運用部門へのフィードバック

（４）活動実績（平成２８～３０年度）

スモールミーティング等のリスト（相手方の役職を含む）

推奨銘柄リスト・レーティングの決定方法

（５）アナリストの分担（ローテーションの考え方等含め）

９．ポートフォリオ構築

（１）ポートフォリオ構築プロセス

（２）投資ユニバース

（３）投資銘柄の決定

（４）投資比率の決定

（５）リバランス基準

① 考え方

② 購入、売却の基準

（６）投資不適格銘柄（上場廃止懸念銘柄含む）への対応

① 考え方

② 売却基準

③ 外部ベンダー等の信用情報等の利用状況

10．定量分析ツール（内容と利用方法）

11．売買執行

（１）売買執行プロセス

① 専任トレーダー制の有無とその考え方

② トレーディングシステム

（２）最良執行のための手法

（３）ブローカー選定方法

（４）執行内容の評価・コスト管理等

12．リスク管理・コンプライアンス態勢

（１）リスク管理項目と管理内容及び頻度

（２）コンプライアンスチェック

① コンプライアンスにかかる組織体制

② コンプライアンス項目と遵守状況の確認頻度

13．日本版スチュワードシップ・コードへの対応

（１）スチュワードシップ活動の取り組み方針

（２）利益相反に対する考え方（御社グループ企業への投資スタンス等）

（３）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

⑤ 外部ベンダーサービスの利用状況

（４）投資先企業との対話

① 基本方針

② 当該プロダクトにおけるエンゲージメントの取組状況

14．当該プロダクトのセールスポイント

15．レポーティング

再委託先等がある場合には、情報開示制限や秘密保持契約等の有無

あり・なし

　　　「あり」の場合、内容を記載して下さい。