国内債券＿様式第２号

平成29年　月　日

東京都職員共済組合　御中

国内債券アクティブ運用機関調査

(平成29年7月募集分)

|  |  |
| --- | --- |
| プロダクト名称 |  |

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
8. 直近３期の決算状況（連結）
9. 経営理念・経営方針
10. 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）
11. 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

※（6）と（9）については、【国内債券＿様式第３号】に記載

1. 組織図
2. 人員（運用及び顧客リレーション関連部門）
3. 国内債券アクティブ運用概要
4. 投資哲学
5. 各付加価値の源泉に対する想定収益とリスク量の配分

※【国内債券＿様式第３号】に記載

1. リターン・リスクの目標値（年率）
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、【国内債券＿様式第３号】に記載

1. 運用戦略
2. 内容
3. 想定売買回転率
4. デリバティブ等の使用について

※（1）から（3）については、【国内債券＿様式第３号】に記載

1. ベンチマークに対するアクティブウェイトの制限等
2. 運用体制（アクティブ運用部門）
3. 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

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）
2. アナリスト

　人数、平均経験年数

1. 当共済組合ファンドの責任者（予定）

　氏名、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）

※（1）～（4）については、【国内債券＿様式第３号】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26～28年度分）
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・コンプライアンス体制
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. 過去5年間（平成24年4月から現在まで）の行政処分
38. 処分期間
39. 行政処分を行った組織
40. 処分理由
41. 処分内容

※（3）に関して、「行政処分の有無」を【国内債券＿様式第３号】に記載

1. 当該プロダクトのセールスポイント
2. レポーティング

再委託先がある場合には、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、内容を記載してください。