

平成31年2月5日

国内株式アクティブ運用（ESG）に係る運用受託機関の募集について

東京都職員共済組合

本共済組合では、以下の要領により国内株式運用区分のアクティブ運用（ESG）に係る運用受託機関を募集します。

1 募集内容

(1) 運用プロダクト

国内株式においてESGをテーマとしたアクティブ運用

(2) ベンチマーク

パフォーマンス評価やリスク計測に使用する政策ベンチマークは TOPIX（配当込）となりますが、実際の運用におけるマネージャー・ベンチマークについては、当共済の「管理及び運用に係る基本方針」（当共済 HP 参照）及び「運用ガイドライン」（別紙参照）に準拠した戦略であれば、TOPIX（配当込）以外での指数の運用等についても応募可とする。

(3) 運用額

1ファンドにつき30～50億円程度

（但し、運用戦略によっては、少ないロットのオファーをすることがあります。）

(4) 運用開始時期

未定

(注1) 応募は1社につき2プロダクトまでとしますが、再委託先等が異なる場合には、再委託先等ごとに、2プロダクトまでとする。

(注2) 複数プロダクトを応募する場合は、運用戦略が異なるものであることが条件。

（リスク・リターン水準が異なるだけのものは不可）

(注3) デリバティブについては上場デリバティブを使うことは可としますが、OTCデリバティブを用いることは不可。（フルインベストメントが原則）

(注4) エンハンスト運用ではなく、アクティブ運用プロダクトとする。

(注5) 当共済 HP 参照：

<https://www.kyosai.metro.tokyo.jp/outline/shikin/houshin/houshin.php>

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、又は「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」(昭和18年法律第43号)に基づく認可を受けていること。

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) 国内外における直近3月末現在の年金運用資産残高(投資一任契約及び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、原則として平成30年12月末時点で3年以上あること。ただし、運用実績が3年に満たない場合でも、クオンツ運用等の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3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年において金融監督官庁(日本では金融庁)からの行政処分を受けていないこと。

- (6) 運用と併せて資産管理を行う運用機関にあつては、下記の格付機関のうち2社以上の格付機関からBBB格以上の格付(依頼格付による発行体格付であつて、長期格付に限る。)を得ており、かつ、格付機関のいずれからでもBB格以下の格付を得ていないこと。

《格付機関》

- ・株式会社格付投資情報センター
- ・株式会社日本格付研究所
- ・ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク

- ・S&Pグローバル・レーティング
- ・フィッチレーティングスリミテッド

(7) 再委託先等においても(2)から(6)について同様とします。

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、本共済組合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(国内株式__様式第1号)

(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)(国内株式__様式第2号、国内株式__様式第3号)

(4) 運用報酬率を記載した書面(国内株式__様式第4号)

(5) 応募プロダクトの運用実績に関する書類(国内株式__様式第5号)

4 提出先及び提出期限等

(1) 提出先

〒162-0052

東京都新宿区戸山三丁目17番1号 東京都戸山庁舎

東京都職員共済組合事務局 管理部 財務課 資金運用担当

○ 担当：福地(フクチ)、三木(ミキ)

○ 電話：03-3232-4712

○ E-mail：S9000060@section.metro.tokyo.jp

※ お問い合わせは、原則上記 E-mail 宛にお願いします。

(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	
3(1)	応募資格確認書類	運用機関毎に 各1部	不要	
3(2)	国内株式__様式第1号		要	書面は、1部のみ押印し、残り 6部はその写し。 CD-R 提出分に押印は不要。
3(3)	国内株式__様式第2号 国内株式__様式第3号		要	書面は、1部のみ押印し、残り 6部はその写し。 CD-R 提出分に押印は不要。
3(4)	国内株式__様式第4号		不要	書面は、 <u>封緘して提出してくだ さい。</u>
3(5)	国内株式__様式第5号		要	書面は、1部のみ押印し、残り 6部はその写し。 CD-R 提出分に押印は不要。

※ 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。

※ 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31年3月1日（金）午後5時（必着）

- ※ 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、応募の意向を平成31年2月27日（水）までにメールで連絡してください。（メールの件名に「国内株式応募（御社名）」と記載のこと）
- ※ 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、早めに提出してください。

5 選考

本共済組合において、提出資料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、不採用理由は通知いたしません。

なお、提出資料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、ヒアリングのご案内及びヒアリング資料の提出依頼等をします。

6 その他

今回の募集につきましては、運用プロダクトの内容が複雑かつ広範囲な分野に及ぶ可能性があることから、ヒアリングや運用開始等の時期は未定とさせていただきます。

また、採用については、本共済組合の運用ニーズや条件等に合致する運用プロダクトが見出せない場合には、採用自体を見送る可能性もあるので、ご了承ください。

以上