

平成29年7月11日

国内株式資産区分のアクティブ運用に係る運用委託先の公募について

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に係る運用委託先を募集します。

1 募集内容

(1) 募集対象

◎ T O P I X（配当込）をベンチマークとする国内株式アクティブ運用

※ 但し、“ベンチマークとする”とは、パフォーマンス比較やリスク計測において比較対象にするという意味であり、T O P I X（配当込）をベンチマークとする運用のみならず、他の指数をベンチマークとする運用やベンチマークを設けない運用についても、「厚生年金保険給付積立金の管理及び運用に係る基本方針」（当共済組合HP参照）、「経過的長期給付積立金の管理及び運用に係る基本方針」（当共済組合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応募可とします。また、デリバティブについては上場デリバティブ等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 プロダクトまでとします。

(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となります。（リスク・リターン水準が異なるだけのものは不可）

(注3) エンハンスド運用ではなく、アクティブ運用プロダクト。

(注4) 応募状況により、採用を見送る場合があります。

(注5) 当共済組合HP参照：

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

(2) 運用額

1ファンドにつき100億円程度（原則）。

（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）

(3) 運用開始時期

平成 29年 10月 1日を予定。（変更する場合があります）

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、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) 国内外における平成29年3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3年以上あること(平成29年3月末時点)。

(5) 法令遵守体制に問題がなく、過去5年間においても金融監督官庁(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っては、下表に記載の格付機関のうち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って、長期格付に限る。)を得ており、かつ、格付機関のいずれからもBB格以下の格付を得ていないこと。

(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とっては、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

○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 29年 7月 28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 29 年 7月 26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 選考等

本共済組合において、提出資料をもとに書類審査による第1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。

第1次選考を通過した運用機関に対しては、8月上旬に連絡し、別途ヒアリング資料の提出(提出期限は8月中旬)を依頼し、ヒアリングを8月中・下旬に行います。

最終的な運用委託先決定は、8月末を予定(変更する場合があります)。