

外国株式アクティブ運用に係るマネジャー・エントリー制について

独立行政法人 勤労者退職金共済機構

今般、勤労者退職金共済機構（以下「当機構」という。）では、外国株式アクティブ運用に係るマネジャー・エントリー制による運用受託機関の公募を実施します。

マネジャー・エントリー制とは、様々な運用機関から運用プロダクトについて随時登録（エントリー）を受け付けるとともに、必要に応じて評価・選定を行うための制度です。つきましては、エントリーを希望する運用機関は、下記の要領に従い、ご応募くださいますようお願いいたします。

記

1.募集対象商品

(1) 対象資産・運用スタイル

外国株式アクティブ運用※

※未公開株式投資、ヘッジファンド等は対象外

(2) ベンチマーク

M S C I K O K U S A I（円ベース、配当込み、GROSS）※

※なお、上記に関わらず、ベンチマークを設けない運用も募集します（ただし参照ベンチマーク必須）。

(3) その他

時価総額以外のファクターに着目し、システムティックなルールに基づいて行う外国株式運用（いわゆるスマートベータ）も含みます。

2.応募資格

応募資格は、別紙「運用機関の応募資格について」をご覧ください。

なお、再委託による運用プロダクトについては、再委託元の運用機関（申込みをする運用機関）と再委託先の運用機関の双方が、応募資格を満たしていることを応募の要件とします。

3.エントリーの方法

(1) エントリー申込み

- ① エントリーを希望する運用機関は、以下に記載のエントリー専用メールアドレス宛に、件名を「**外国株式エントリー希望【運用機関名】**」としたうえで、メール本文に下記内容を記載し、当機構に送信をお願いします。

(ア) 会社名

(イ) 担当部署・担当者名

(ウ) 連絡先電話番号・メールアドレス

(エ) エントリーする運用プロダクトの名称及びベンチマーク（複数応募可、同一メール内に記載可）

- ② 当機構から、「外国株式アクティブ運用に係るマネジャー・エントリー制について（申込書）」を運用機関の連絡用メールアドレス宛に送信します。

上記メール受信後、（申込書）※1 に必要事項を記入のうえ、運用プロダクト説明資料※2 を添付し、以下に記載のエントリー専用メールアドレス宛に、件名を「**外国株式エントリー申込書【運用機関名】**」としたうえで、当機構に送信をお願いします。

エントリー資格・要件を満たしていないと判断した場合や、（申込書）に不備があると判断した場合、当機構から運用機関の連絡用メールアドレス宛にその旨を連絡します。

※1（申込書）については、応募プロダクト毎に1枚作成いただきご提出をお願いします。

※2 日本語で作成された標準的な運用プロダクト説明資料（標準ピッチブック等、記載内容およびファイル形式は不問とします）をご提出ください。ファイル名は「**外国株式_運用機関名(プロダクト名)**」としてください。

エントリー専用メールアドレス: unyo-entry×taisyokukin.jp

※迷惑メール防止のため、メールアドレスの一部を変えています。「×」を「@」に置き換えて送信ください。

独立行政法人 勤労者退職金共済機構

資産運用部 運用企画課 宛て

(2) eVestment への登録

当機構のマネジャー・エントリー制度支援業務の委託先である eVestment への登録をお願いします。

登録操作方法の詳細に関する照会につきましても、eVestment 宛てメールにてご確認ください。

メール宛先 : evestmentsupport×nasdaq.com

※迷惑メール防止のため、メールアドレスの一部を変えています。「×」を「@」に置き換えて送信ください。

(3) 受付期間、エントリー期限

受付は随時行います。また、エントリー期限は設けません。

(4) エントリーの完了

エントリーは、eVestment にプロダクト情報の登録が完了した時点で登録完了となります。

提出いただいた資料に不備がある場合等には、当機構から運用機関の連絡先メールアドレスにその旨を連絡しますが、登録完了の通知は行いません。

(5) その他

複数プロダクトを複数回に分けて、エントリーいただいても差し支えございません。

4. エントリー後の対応

(1) 情報の更新

毎年3月、6月、9月、12月末時点を基準として、基準月の翌月末までに月次収益率をeVestment上で更新してください。なお、収益率以外の登録情報に変更があった場合も適宜更新してください。

このほか、当機構が依頼した場合には、随時依頼した情報を更新してください。

(2) ヒアリング、追加情報の提出

エントリーされた運用プロダクトについて、必要に応じてヒアリングを行う場合があります。

また、標準的な運用プロダクト説明資料に加え、当機構から追加情報の提出を依頼することがあります。

なお、運用機関からの申し出による商品説明等は、原則お受けしないものとしますので、予めご了承ください。

(3) 評価・選定結果の通知

エントリーされた運用プロダクトの評価については、当機構の評価基準と照らし合わせ、定量評価と定性評価を合わせて複合的に実施し、運用プロダクトの選定を行う場合、当機構から当該運用機関に対してその旨を通知します。

なお、個別の運用プロダクトの評価や選定経過、選定スケジュール等に関するお問い合わせにはお答えしかねますので、予めご了承ください。

(4) エントリーの取消し、変更および解除

運用機関は、エントリー後、当機構に申し出ること随時エントリーを取り消すことができます。また、エントリーした運用プロダクトの募集を終了するなど投資が可能ではなくなった場合は、速やかに当機構エントリー専用メールアドレス宛ご連絡のうえ、当該エントリーを取り消してください。運用責任者の退職等、運用における重要事項あるいは行政処分など経営上の重要事項に変更があった場合も、速やかに当機構エントリー専用メールアドレス宛ご連絡ください。

その際、件名を「**外国株式エントリー（取消し 又は 変更）【運用機関名】**」としてください。

なお、項番4（1）に基づく情報の更新が正当な理由なく3ヶ月以上滞った場合または登録した連絡先担当者に連絡が取れなくなった場合には、当機構は確認の連絡等を行うことなくエントリーを解除することがあります。

5. その他

マネジャー・エントリー制への登録は、将来の契約を約束するものではなく、マネジャー・エントリー制への申込み時期やエントリー期間の長短は、評価・選定に何ら影響を与えるものではありません。

当機構は、当該実施方法について必要に応じて随時に見直す場合がありますので、予めご了承ください。

6. 問合せ

お問い合わせは、項番3（1）②に記載のエントリー専用メールアドレスまでメールにてお願いいたします。

その際、件名を「**外国株式エントリー（照会）【運用機関名】**」としてください。

また、お電話等でのお問い合わせには対応し兼ねますので、よろしくお願いいたします。

別紙 運用機関の応募資格について

1. 金融商品取引法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」という。）がある場合は、再委託先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. コンプライアンス体制が整備されており、過去5年においても運用業務に関して重大な不祥事を起こしていないこと（再委託先においても同様とする）。

以下、応募商品について

1. 投資哲学及び運用プロセスに合理性があり一貫していること。
2. 運用体制が整備されていること。運用をサポートするシステム、分析ツールが充実していること。
3. 十分な運用実績があること。
4. 原則として、単独運用（直投）であること。
5. 日本語による各種報告・説明が可能なこと。