

公募要領

1. 件名

株式アクティブ運用に係る運用受託機関の募集について（米国株式）

2. 概要

本公募要領は、国立研究開発法人科学技術振興機構（以下、「機構」という。）が行う株式アクティブ運用に係る運用受託機関の募集について必要な要件を定めるものである。

3. 募集対象商品

（1）対象資産・運用スタイル

米国株式を主要な投資対象とする株式アクティブ運用。

なお、運用手法・運用スタイルは問わない。

（2）ベンチマーク

・MSCI USA

・その他各々提案する商品に応じたベンチマーク

（上記インデックスと投資対象を同一とする類似のものも検討可能）

4. エントリー方法

様々な運用手法の情報収集を迅速に行い、より柔軟に運用機関の選定を行うことを目的に、マネジャー・エントリー制を活用して公募を行う。エントリーを希望する者は、マネジャー・エントリー制度支援業務の委託先であるeVestment, a part of Nasdaq（以下、「eVestment」という。）にプロダクト情報を過去5年分登録すること。登録項目についてはエントリーシートのエントリー要領を参照すること。また、登録方法に関する質問先は10.（1）に指定する連絡先とする。なお、本エントリーは応募期限を定めず、随時エントリー可能とする。審査は機構の必要に応じて実施するが、初回の審査は日本時間の令和5年6月16日17時までにeVestmentの登録を完了したものを優先して審査対象とする。コンプライアンス上、登録できない必須項目がある場合は、例外として別途資料としての提出を認める場合がある。その場合の提出方法についてはeVestmentに確認すること。

なお、マネジャー・エントリー制への申し込みは、将来の契約を約束するものではなく、申込み時期やエントリー期間の長短が評価に何ら影響を与えるものでもない。

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る。新たなエン

トリー方法については機構の指示に従うこと。

5. 応募（エントリー）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。登録金融機関として投資運用業を行う信託兼営金融機関を含む。
- (2) 財務状況が健全であること。(債務超過、3 年連続経常赤字等がないこと。)
- (3) 応募商品と同一のコンポジットの運用実績が原則として 5 年以上 (注 1) あり、かつ当該コンポジットの直近の運用資産残高が 1,000 億円以上(注 2) あること。
- (4) 法令遵守態勢に問題がなく、過去 3 年においても著しい不祥事がないこと。
- (5) 原則として、責任投資原則 (P R I) に署名していること。
- (6) 原則として、日本版スチュワードシップコードを受け入れていること (注 3)。

(注 1) 運用期間が 5 年に満たない場合でも、クオンツ運用等で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 5 年間運用実績を作成することで応募することが可能とするが、エントリー時点で実運用が開始されていること。

(注 2) 運用を再委託する場合は、再委託先においても 5. (1) ^(注 4) から 5. (6) までを満たすこと。ただし、5. (3) は再委託先が満たしていればよい。

(注 3) 運用拠点が国外にあり、所在国で日本版スチュワードシップコードと同様の基準に準拠している場合は、この限りではない。

(注 4) 運用拠点が国外にある場合は、所在国の監督当局から同等の認可等を受けていること。

6. eVestment への提出書類

(1) エントリーシート

エントリーシートはプロダクト毎に 1 ファイル作成し、10. (1) のメールアドレスに電子データにて提出すること。なお、エントリーシートの表紙にある応募内容には、「米国株式アクティブ運用に係る運用受託機関の募集」と記入すること。

(注 5) エントリーシートのファイル名は、「米株 A_エントリーシート (応募者名)」とすること。

(2) 留意事項

エントリーシートを提出する際は以下留意すること。

- ① メールの件名は「JST_米株公募_運用会社名」とする。
- ② 複数のエントリーシートをまとめて送付する場合は、メールの本文にエントリーシートの数を明記すること。

7. エントリー情報の更新

エントリー商品のグローバル投資パフォーマンス基準に基づくパフォーマンス

(eVestmentの登録必須項目)は、少なくとも四半期毎で更新すること。その他の応募情報(eVestmentの登録必須項目及びエントリーシート別紙1から別紙5)についても変更の都度、更新すること。なお、エントリーシート記載内容に変更・更新がある場合は、連絡すること。連絡は、10.(1)に記載のメールアドレスに行うこと。

8. エントリーの取り消し・解除

(1) 取り消し

応募者は、機構に申し出ることで随時エントリーを取り消すことが可能とする。

(2) 解除

機構は、以下の場合、事前の警告や確認の連絡等を行うことなくエントリーを解除する場合がある。

- ①パフォーマンス情報の更新が正当な理由なく6ヶ月以上滞った場合
- ②投資判断の最終責任者及びエントリー商品の実質担当ファンドマネージャーの退職等の運用における重要事項あるいは行政処分等の経営上の重要事項について、速やかな連絡が無かった場合
- ③提出した営業スタッフ(機構担当)に連絡が取れなくなった場合

9. 質問状、ミーティング等

当機構より、エントリー商品について質問状の提出およびミーティングの依頼することがある。なお、選考状況に係る質問は受けない。

10. 連絡先

(1) 登録内容及び方法について

eVestment

E-mail: JST@evestment.com

電話(マネジャー・エントリー): 03-6264-9236, +852-6291-9525(Hong Kong),
+852 5200 5139 (Hong Kong)

電話(データ登録): 03-4578-4405, 03-6264-9238, +852-6291-9525(Hong Kong),
03-6264-9236, +852 5200 5139 (Hong Kong)

(2) その他

国立研究開発法人科学技術振興機構

E-mail: daigaku-fund-koubo-equity@jst.go.jp

以上