

News Release

ラッセル・インベストメント・グループ

発信日: 2007年6月15日

ラッセルが日本債券マルチ・マネージャー・ファンドの運用会社に 興銀第一ライフ・アセットマネジメントを採用

ラッセル・インベストメント証券投信投資顧問株式会社(本社:東京都港区)は、同社が設定・運用管理しているファミリーファンド方式によるマルチ・マネージャー・ファンドの「ラッセル 日本債券マザーファンド」において、2007年6月12日付けで運用会社構成を一部変更し、広範囲型の運用会社として興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」)を採用いたしました。今回の変更により当ファンドは、金利戦略型 2社、広範囲型 1社、クレジット/セクター戦略型 1社、収益源泉拡張型 1社の計 5社^{※1}体制で運用してまいります。(下表参照)

DIAMは、ラッセル・インベストメント・グループの運用会社調査チームが高い評価を与えている運用会社です。DIAMの運用は、金利戦略型とクレジット/セクター戦略型の両方の手法を用いる広範囲型であり、両戦略において安定した超過収益の獲得を目指します。

DIAMは、現採用運用機関である金利戦略担当のフィッシャー・フランシス・トリーズ・アンド・ワッツ株式会社やブラックロック・ジャパン株式会社、クレジット/セクター戦略を担当している住信アセットマネジメント株式会社及び、コアプラス運用担当のピムコジャパン株式会社と異なった運用スタイルやスキルを持っております。これらの各社を組み合わせることで、いずれの戦略においても相互補完性の高い運用会社構成の実現を目指しています。

DIAMは、マクロ経済、金融政策等、債券市場全般に対する高い見識を持った日本債券専任の充実したポートフォリオマネージャーチームを、経験豊富かつ大規模のクレジットアナリストチームがサポートしており、広範囲で超過収益獲得を期待できる極めて優秀な運用機関です。ラッセルが高く評価するこのポートフォリオ・マネージャーが行う広範囲型運用によって、従来以上に安定した超過収益の獲得を目指してまいります。

ラッセル・インベストメント・グループは、継続的な運用会社調査の一環として年間約 8,000 の運用プロダクト^{※2}をモニターしています。その中から約 200 のプロダクトが、現在当グループのマルチ・マネージャー・ファンドに採用されています。こうした運用委託先を組み合わせることにより、リスク分散されたポートフォリオを構築します。今回の変更は、ラッセルによる継続的な運用会社調査および資本市場調査の結果に基づくもので、マルチ・マネージャー・ファンドならではの特徴の一つです。ラッセルのマルチ・マネージャー・ファンドでは、今後も市場や状況の変化等に応じて、適切な運用会社構成の変更を実施してまいります。

<「ラッセル 日本債券マザーファンド」の外部委託運用会社構成>

運用会社	運用スタイル	目標配分比率
フィッシャー・フランシス・トリーズ・アンド・ワッツ	金利戦略型	31%
ブラックロック・ジャパン	金利戦略型	30%
興銀第一ライフ・アセットマネジメント	広範囲型	16%
住信アセットマネジメント	クレジット/セクター戦略型	19%
ピムコ ジャパン	収益源泉拡張型	4%

※1 ラッセル・インベストメント・グループ内の関連会社を除く外部運用委託先の数を指しています。

※2 個々の運用会社の運用手法を指し、運用会社によっては複数所有しているところもあります。

また、同日付で「ラッセル 日本株式マザーファンド」においてバリュー型運用を担当しているアライアンス・バーンスタインの契約主体を、米国法人(アライアンス・バーンスタイン・エル・ピー)から、日本法人(アライアンス・バーンスタイン株式会社)および香港法人(アライアンス・バーンスタイン・香港・リミテッド)に変更いたしました。なお、運用プロセス、運用体制等に変更はございません。

ラッセル・インベストメント・グループについて

ラッセル・インベストメント・グループは、「マルチ・マネージャー運用のグローバル・リーダー」として今日世界 44 カ国で総合的な資産運用ソリューションを提供しています。ラッセルが提供するサービスは、グローバルな運用会社調査をベースに、資産運用サービス、オルタナティブ投資サービス、確定拠出年金サービス、資産運用コンサルティング、売買執行管理サービス、ラッセル・グローバル株インデックス、Russell 1000[®]、Russell 2000[®]、Russell 3000[®]、Russell/Nomura 日本株インデックス等のインデックスの開発など多岐にわたります。ラッセル・インベストメント・グループの創立は 1936 年。現在当グループが提供する資産運用コンサルティング・サービスの対象資産総額は約 224 兆円^{*}、またマルチ・マネージャー運用の資産総額は約 24 兆円^{**}となっています。なお、1999 年よりノースウェスタン・ミューチュアルが当グループの親会社となっています。

日本においては 1986 年に東京オフィスを開設。現在、ラッセル・インベストメント証券投信投資顧問株式会社を通じて、個人および機関投資家を対象にマルチ・マネージャー・ファンドの提供、企業年金などを対象に投資一任サービスや資産運用コンサルティング・サービスの提供をしています。

詳しくは、www.russell.com をご覧ください。

(※ 2006 年 9 月末現在 ※※ 2007 年 3 月末現在、グループ合算)

ラッセル・インベストメント・グループの「マルチ・マネージャー・ファンド」について

ラッセル・インベストメント・グループは、1980 年に米国において「マルチ・マネージャー・ファンド」の提供を開始しました。ラッセルの強みは、世界最大級の運用会社調査チームが行う運用会社の調査・評価にあり、現在世界 27 カ国で運用会社を定性・定量両面から綿密に分析・評価し、優秀な運用会社を発掘しています。ラッセルの「マルチ・マネージャー・ファンド」は、運用スタイル毎に優れていると判断される運用会社を厳選しそれらをバランスよく組み合わせることによりリスク低減を図り、中長期的に安定した超過収益を目指します。また、継続的な運用会社のモニタリングを通じて、運用能力などに変化があった場合には必要に応じてファンドで採用する運用会社の変更や追加等を行うことにより、常に最適と判断される運用会社の構成を目指します。

お問い合わせ先： **ラッセル・インベストメント・グループ**
 ラッセル・インベストメント証券投信投資顧問株式会社
 企画・広報部門
 電話：03-5411-3167

ラッセル・インベストメント・グループは世界中の拠点を通じて事業を展開しています。

「ラッセル・インベストメント・グループ」及び「ラッセル」は、フランク・ラッセル・カンパニー及びその子会社等の総称です。

当資料は、当社が信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、その情報の正確性や完全性についてこれを保証するものではありません。

当社による事前の書面による許可がない限り、資料の全部または一部の複製、転用、配布はいかなる形式においてもご遠慮下さい。

当資料は、一般的な情報の提供を目的としており、特定の運用商品の推奨等の投資勧誘を目的としたものではありません。

また、証券取引法に基づく開示資料ではありません。

◎当資料に関してご留意いただきたい事項

- 当資料はラッセル・インベストメント証券投信投資顧問株式会社が一般的な情報の提供を目的として作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
- 当資料でご紹介するサービスには、投資信託が含まれます。投資信託は、元金が保証されているものではありません。また、投資信託には手数料等の諸費用がかかります。後述の『投資信託にかかる主な留意事項』をお読みください。
- 当資料は、当社が信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、その情報の正確性や完全性についてこれを保証するものではありません。
- 当資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。
- 当資料中「ラッセル・インベストメント・グループ」および「ラッセル」は、フランク・ラッセル・カンパニーおよびその子会社等の総称です。
- ラッセルによる事前の書面による許可がない限り、資料の全部または一部の複製、転用、配布はいかなる形式においてもご遠慮ください。

◎投資信託にかかる主な留意事項

- 投資信託は、株式および公社債等値動きのある証券に投資しますので、組入株式や組入公社債等の価格の下落ならびにそれらの発行会社の倒産または財務状況の悪化等の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、これらに加え外貨建資産を保有する場合、外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、基準価額が下落し損失を被ることがあります。したがって、元金が保証されているものではありません。投資した資産の価値の減少を含むリスクは投資信託をご購入のお客様が負います。
- リスクは上記に限定されるものではありません。投資信託の取得のお申し込みにあたっては、必ず当該商品の投資信託説明書(目論見書)を販売会社でお受け取りになり、「投資リスクおよび留意点」等、内容をご確認の上、ご自身でご判断ください。
- 投資信託には、「お申込み時」、「ご換金時」、「保有期間中」にご負担いただく手数料等の諸費用が発生します。費用は投資信託によって異なります。詳しくは、当社までお問い合わせください。
- 投資信託は、預金、保険契約とは異なり、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- 金融商品取引業者以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。

ラッセル・インベストメント証券投信投資顧問株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第196号

加入協会 日本証券業協会、(社)投資信託協会、(社)日本証券投資顧問協会