

Contact: 広報担当(マーケティング部)
Tel: 03-5411-3790
E-mail: Tokyo-RIJ@russell.com

ラッセル・インベストメント株式会社
東京都港区赤坂 7-3-37 プラス・カナダ
www.russell.com

発信日: 2008年3月19日

ラッセルが日本株式ファンドの外部委託先運用会社を変更 ファンネックス・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 日本株式マザーファンド」(「ラッセル 日本株式ファンド I」)、「ラッセル 日本株式マルチ・マネージャー・ファンド」【愛称:匠の輪】、「ラッセル グローバル・バランス・ファンド(安定型/安定・成長型/成長型)」【愛称:ライフポイント】、および「ラッセル 日本株式マルチ・マネージャー・ファンド(確定拠出年金向け)」の主要投資対象)において、2008年3月19日付で運用会社構成を一部変更し、マーケット・オリエンテッド(市場)型の運用会社として、ファンネックス・アセット・マネジメント株式会社(以下「ファンネックス」)を採用いたしました。当ファンドは、「グロース(成長)型」2社、「バリュー(割安)型」3社、「マーケット・オリエンテッド(市場)型」1社の計6社^{*1}体制で運用してまいります。(下表参照)

ファンネックスは、ラッセル・インベストメント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。今回の運用会社の変更は、ファンドの運用会社構成に対する確信度を高め、より安定した超過収益の獲得を目的としています。変更と同時に、各運用会社への配分比率を調整することで、ファンド全体のバランスを保ちます。

ファンネックスは、日本株式に特化したブティック型の運用会社で、経験豊富で優秀なポートフォリオ・マネージャーと優れたアナリストからなるチームが運用を行います。同社は、短期の市場トレンドや将来中長期的に市場をけん引する投資テーマを見極め、詳細な企業リサーチを基に投資銘柄を選定します。当ファンドで採用する他の運用会社と異なる投資プロセスを採ることから、相互に補完性が認められ、更なる分散効果が期待できます。ファンネックスの採用により、超過収益源泉の拡大・多様化を図ることで、多様な市場環境において高く安定した超過収益の獲得を目指します。

以上の理由から、同社の採用がファンドのパフォーマンス向上に資するものと考え、運用会社構成の変更を決定致しました。

ラッセル・インベストメントは、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 日本株式マザーファンド」の外部委託先運用会社構成＞

運用会社	運用スタイル	目標配分比率
JP モルガン・アセット・マネジメント	グロース(成長)型	21%
ピクテ投信投資顧問	グロース(成長)型	12%
ソシエテ・ジェネラル・アセット・マネジメント・ インターナショナル	バリュー(割安)型	19%
T&Dアセットマネジメント	バリュー(割安)型	12%
アライアンス・バーンスタイン	バリュー(割安)型	18%
ファンネックス・アセット・マネジメント	マーケット・オリエンテッド(市場)型	18%

※1 ラッセル・インベストメント内の関連会社を除く外部委託先運用会社の数を指しています。

※2 2006年12月末現在。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。

ラッセル・インベストメントについて

ラッセル・インベストメントは、今日世界 44 カ国において、年金、金融機関および個人投資家など様々な投資家の皆様を対象に総合的な資産運用ソリューションを提供しています。グローバルに行う運用会社調査をもとに、世界最高水準の運用会社へのアクセスを提供することに強みがあり、資産運用、オルタナティブ投資、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、株式インデックスの開発など幅広く業務を行っています。現在当グループが提供するファンドの運用資産総額は約 25 兆円^{*}、また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^{**}となっています。グループの創立は 1936 年。米国ワシントン州タコマを本拠地とし、アムステルダム、オークランド、サンフランシスコ、シドニー、シンガポール、東京、トロント、ニューヨーク、パリ、香港、メルボルン、ヨハネスブルグ、ロンドンに主要拠点を擁しています。米国最大手の個人生命保険会社であるノースウェスタン・ミューチュアル・ライフ・インシュアランスの子会社です。

日本においては 1986 年に東京オフィスを開業。現在、ラッセル・インベストメント株式会社を通じて各種サービスを提供しています。詳しくは、www.russell.com/jpii をご覧ください。

(* 2007年12月末現在 ** 2006年9月末現在、グループ合算)

Copyright ©2008. Russell Investments. All rights reserved. ラッセル・インベストメント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」、「ラッセル・インベストメント」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。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。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。