

平成 27 年 5 月 7 日

各 位

三菱UFJ信託銀行株式会社

スイス STOXX 社との協働によるインデックスビジネスへの参入について

～スマートベータ商品を共同開発し全世界で提供～

三菱UFJ信託銀行株式会社(取締役社長 若林辰雄)は、ドイツ証券取引所の子会社でインデックス開発・提供ビジネスにおいて世界有数の STOXX(ストック)社*1 と、スマートベータインデックスの共同開発や、国内外の資産運用会社への提供を協働して行う合意書(MOU)を締結し、新たにインデックスビジネスに参入することいたしました。

1. 背景

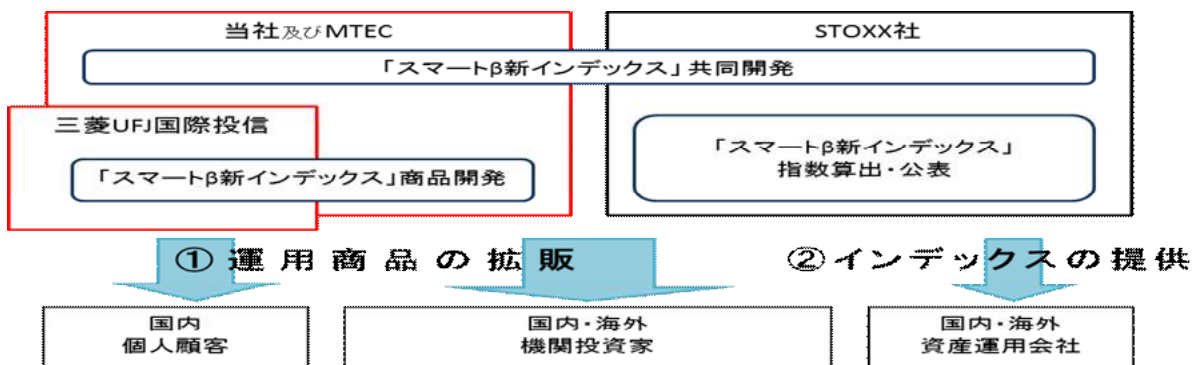
資産運用市場では、近年、個別銘柄を選択するアクティブ運用に比べ、TOPIX(東証株価指数)等に連動投資するインデックス運用の割合が拡大しています。中でも、上場全銘柄の時価総額への単純連動等の従来型ではなく、銘柄選択や加重方法に投資理論に基づく付加価値を加え、高い運用効率の実現を目指す「スマートベータ」と呼ばれるインデックスでの運用が急速に成長・拡大しています。

2. 本件の狙い・概要

当社は、既に金融工学専門の研究機関である子会社の三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)*2と開発したスマートベータ型運用商品を企業年金等に提供してきておりますが、今般更に、STOXX社との共同で開発したインデックスを公表・商品化し、①国内外の機関投資家や投信開発・販売を通じた個人投資家への拡販を目指すと共に、②インデックスの開発・提供の対価としての手数料の取り込みを図ってまいります。

具体的には、当社が MTEC とともに国内外の株式を対象としたスマートベータインデックスを複数開発し、国内での当該投資商品の組成・販売を担当します。STOXX社は指数算出・公表するとともに、主に海外の機関投資家や資産運用会社へのマーケティングを担ってまいります。

【本件イメージ図】



三菱UFJ信託銀行は、国内の年金運用で培った開発力と、STOXX社のインデックス算出・管理ノウハウの融合によりインデックスビジネスに参入し、国内外のお客さまのグローバルな資産運用ニーズにお応えしてまいります。

以 上

<ご参考>

【*1 STOXX 社の概要】

- ・1997年(平成9年)設立の指数開発・提供の専業会社。本社チューリッヒ。
- ・株主はドイツ証券取引所(50%)を筆頭に、スイス証券取引所(50%)で構成される。
- ・本年1月現在で、7,100以上の指数を算出し公表。
- ・欧州における指数ビジネスやETFシェアはトップクラス。

【*2 MTEC の概要】

- ・昭和63年に国内初の金融工学に特化した研究機関として設立。従業員数38名。
- ・三菱UFJ信託銀行グループの100%子会社。