

平成 28 年 6 月 15 日

各 位

三菱UFJ信託銀行株式会社

台湾元大投信、及びスイス STOXX 社との業務提携に向けた合意について

～台湾市場におけるインデックスビジネス展開に関する協働～

三菱 UFJ 信託銀行株式会社(取締役社長 池谷 幹男)は、台湾最大手の資産運用会社である元大(ユアンタ)投信*1(元大證券投資信託股份有限公司)及び世界有数のインデックス開発・提供会社である STOXX(ストックス)社*2 との 3 社間で、台湾市場におけるインデックスビジネスに関する協働について合意書(MOU)を締結することとなりましたので、お知らせいたします。

1. 背景

(1) 弊社のインデックスビジネスに関する取り組みについて

- ・ 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)をはじめとしたインデックスへの連動を目指す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単純に連動する従来型ではなく、「スマートベータインデックス」と呼ばれる、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てより高い運用効率の実現を目指すインデックスによる運用が、成長・拡大しています。
- ・ 弊社は昨年5月、STOXX 社と協働し、スマートベータインデックスを共同開発し、国内外の資産運用会社へ提供するインデックスビジネスに参入しています。
- ・ STOXX 社との協働開始以降、「iSTOXX MUTB」シリーズというネーミングで複数のインデックスを開発し、関連運用商品を年金などのお客さまに提供しています。直近では、「iSTOXX MUTB Japan 積極投資企業 200 インデックス」を開発し、今月 29 日に三菱 UFJ 国際投信株式会社の組成による当該インデックスへの連動を目指す ETF(上場投資信託)※が東京証券取引所に新たに上場する予定です。

※名称は「MAXIS JAPAN 設備・人材積極投資企業 200 上場投信(愛称:前向き日本)」

(2) 台湾の資産運用市場について

- ・ 台湾の資産運用市場は、例えば、投資信託残高では日本の 1 割程度(約 8.7 兆円)ですが、近年、インデックス運用型商品の市場規模が拡大しており、今後高い成長が期待されています。
- ・ 元大投信は、その台湾の資産運用市場において受託残高、顧客数をはじめ各指標で業界首位を誇り突出したプレゼンスを有しています。

2. 本件の狙い・概要

- ・ 海外市場におけるインデックスビジネス拡大の一環として、台湾市場の開拓を目指し、弊社、元大投信及び STOXX 社の 3 社による協働について検討を進めて参りました。
- ・ 本協働により、台湾市場において、①元大投信が有する商品開発力及び販売チャネルを活用し、共同開発したインデックス運用型商品の残高拡大、②弊社の知名度向上を目指します。
- ・ 具体的な協働内容につきましては、今後 3 社間で協議し、別途正式契約を締結する予定です。

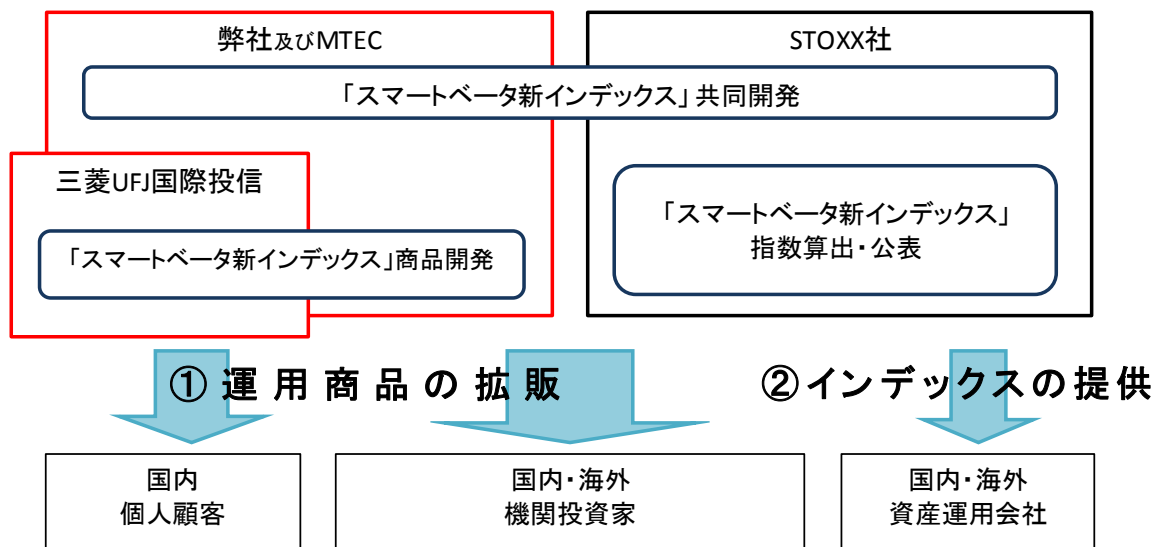
三菱 UFJ 信託銀行は、国内の資産運用で培った商品開発力と、STOXX 社のインデックス算出・管理ノウハウの融合により、国内外のお客さまの多様な資産運用ニーズにお応えして参ります。

【ご参考 1: 弊社インデックスビジネスの概要について】

STOXX 社とスマートベータインデックスを共同で開発し、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販売拡大を目指すとともに、②国内外の資産運用会社へのインデックス提供を目指します。

具体的な協働内容といたしましては、弊社が三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC。金融工学専門の研究機関である弊社子会社) *3 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、主に国内での当該投資商品の組成・販売を担当しています。STOXX 社はインデックスを算出・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います。

<イメージ図>



【ご参考 2: 元大投信・STOXX 社・MTEC の概要について】

<*1 元大投信(元大証券投資信託股份有限公司)の概要>

- ・1992年(平成4年)設立の投資信託・投資顧問会社。本社台北。
- ・台湾・元大フィナンシャルグループの子会社(72.2%)。
- ・台湾における投信運用残高、ETF運用残高、および顧客数の何れにおいても業界首位。

<*2 STOXX 社の概要>

- ・1997年(平成9年)設立のインデックス開発・提供の専門会社。本社チューリッヒ。
- ・ドイツ証券取引所の100%子会社。
- ・欧州におけるインデックスビジネスやETFシェアはトップクラス。

<*3 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信託銀行の100%子会社。