

2024年3月29日

三菱UFJ信託銀行株式会社

国内籍投資信託ファンドに対する有価証券貸付サービスの提供開始について

- 投資信託ファンドに、信託銀行の有価証券貸付サービスを提供する本邦初の取組み -

三菱UFJ信託銀行株式会社（取締役社長：^{ながしま いわお}長島 巖、以下 三菱UFJ信託銀行）は、国内籍の投資信託ファンド（以下 国内籍投信）に対する有価証券貸付サービスを本邦で初めて開始いたします。第一弾として、SBIアセットマネジメント株式会社（以下 SBIアセットマネジメント）を投信委託会社とする「SBI・V・S&P500 インデックス・ファンド」に提供いたします。

1. 有価証券貸付取引について

有価証券貸付取引は、機関投資家、年金や投資信託ファンドが保有している株式等を証券会社等に貸し付けることで貸借料を受けとり、パフォーマンス向上/追加収益獲得につなげるために、海外では広く利用されている仕組みです。

2. 国内籍投信に対する有価証券貸付サービスの提供について

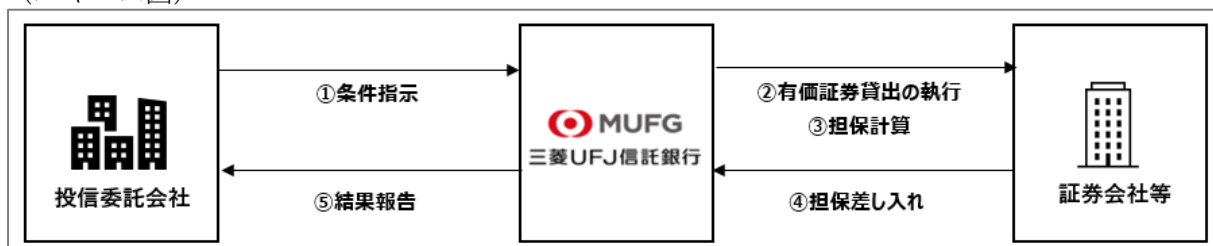
有価証券貸付取引は、海外の投資信託では広く利用されている一方、日本の投資信託では、投信委託会社側での有価証券貸付機能に係るシステム構築/人員配置等の負荷が高いこともあり、国内株式に投資する一部のETFのみで実施される等、限定的に利用されておりました。

上記解消のため、三菱UFJ信託銀行は、機関投資家のお客様等へ提供している有価証券貸付サービスを、投資信託ファンドにも提供を開始します。三菱UFJ信託銀行がレンディング・エージェントに就任し、投信委託会社様からの条件提示に従い、証券会社等に対する有価証券貸付、担保授受・日々の値洗いをを行います。国内籍投信の有価証券貸付取引のエージェントに国内の信託銀行が就任するのは本邦初です。なお、今後、他の国内籍投信へも対象を広げていく方針です。

3. 有価証券貸付取引で期待される効果

今回の有価証券貸付サービスの提供により、有価証券貸付機能を保有されていない投信委託会社の設定する投資信託のファンド及び投資家に対して、追加収益の機会を提供することが可能となります。また、有価証券貸付サービスの提供にあたっては、担保評価額が100%以上となるように貸出を実行し、日次で時価評価の値洗いを実施し不足する場合は追加差し入れを要請して担保を十分に確保するなどの対応を行うことで、適切なリスクコントロールを実施いたします。

(スキーム図)



弊社は今後も、日本の資産運用業界における受益者利益の向上に努めてまいります。

以上