

平成 25 年 1 月 22 日

各 位

会社名 株式会社 新生銀行  
代表者名 代表取締役社長 当麻 茂樹  
(コード番号 : 8303 東証第一部)

## 金融機関向け私募投資信託業務の強化について ～外国国債を主な投資対象とする第一号私募投資信託を販売～

当行は、金融機関に対するアセットマネジメント業務強化の一環として、私募投資信託業務を本格的に展開いたします。その第一弾として、米国のラッセル・インベストメント グループの日本法人であるラッセル・インベストメント株式会社(東京都港区、代表取締役社長兼 CEO ブルース・W・フラム、以下「ラッセル」と連携し、ラッセルが外国国債を対象として運用する私募投資信託の金融機関向け販売を開始いたしました。

今回販売する商品は、追加型証券投資信託「新生・ラッセル インテリジェント・ガバメント・ボンド・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)」(以下、「当ファンド」)で、平成 25 年 1 月 16 日に 40 億円で運用を開始しました。当ファンドは、日本を除く世界各国・地域の国債・政府債を主な投資対象とすることにより、日本の国債利回りを安定的に上回る投資成果を目指すことを運用の基本方針としています。

金融機関の私募投資信託などに対する運用ニーズは平成 20 年 9 月のリーマン・ショックに伴う世界的な金融危機の影響や自己資本比率規制強化の影響などを受けて一旦後退していましたが、一方で、運用対象が日本国債に偏るなどの課題が生じています。近時は市場環境が回復する中で、流動性や透明性を備え、リスク対比での期待リターンが適正な商品に対する金融機関の運用ニーズが再度高まりつつあります。このため、当行では、自身の投資およびリスク管理に関するノウハウや金融債販売などで培った幅広いリレーションを活かし、地域金融機関や保険会社などの大手金融機関に対する運用商品提供能力を強化することとしたものです。

当ファンドの主な特徴は、以下の通りです。

1. 当ファンドは、投資適格水準の格付を有し、財務状況の良好な国の国債・政府債に分散投資します。
2. 投資する国債・政府債の平均デュレーションを 5 年程度と市場平均よりもやや短く設定し、金利変動リスクを抑えながら、同程度のデュレーションの日本国債を上回る利回りを獲得することを目指します。
3. 当ファンドによる運用では、自己資本比率規制上の想定リスクウェイトを低水準に抑えることができ、ポートフォリオ全体のリスクを抑制することを指向する金融機関のニーズに沿った設計となっています。
4. ファンドの申込・換金を日次で可能にしてファンドの流動性を確保しながら、運用状況に関するレポートを提供することで、投資家が求める透明性を確保します。
5. 当ファンドへの投資を通じて多数の国債・政府債に対するエクスポージャーを取ることが可能になることから、日本国債以外への投資の幅を広める機会を提供するものとなります。

当行では、今後も順次、新ファンドを投入し、金融機関へのソリューション提供能力を強化してまいります。

以 上