

平成14年10月2日

各位

資産管理サービス信託銀行株式会社
住友信託銀行株式会社
大和信託銀行株式会社
三井アセット信託銀行株式会社
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

「ユニバース評価サービス」の開始について

資産管理サービス信託銀行（社長：小寺 正之）、住友信託銀行（社長：高橋 温）、大和信託銀行（社長：黒石 輯）、三井アセット信託銀行（社長：田辺 和夫）、日本トラスティ・サービス信託銀行（社長：松田 良一）の5社（以下、「情報統合各社」という）は、平成14年8月より「ユニバース評価サービス」の提供を開始いたしました。

共同データベースを構築することにより、広範囲なデータ蓄積が可能となることから、お客様の利便性がより高まると考え、みずほ信託銀行（社長：津田 弘通）を加えた6社は、日本版TUCS（Trust Universe Comparison Service）の実現に向けて合意し、準備を進めてまいりました。

情報統合各社では準備を進めるにあたり、平成14年4月より「ユニバース運営協議会」を発足させ、資産管理・情報統合に関するノウハウを結集したシステムの共同開発を行っており、今般、サービス開始に至ったものです。

ユニバース評価サービスとは、お客様の運用実績に関するデータを、資産規模、制度別等一定の属性により分類した母集団（ユニバース）ごとに、運用成果を集計し、母集団とお客様との比較に関する情報を提供するものです。

一般に、年金資産の運用では、お客様より提示されたTOPIXなどの市場インデックスに基づく評価が行われていますが、「ユニバース評価サービス」ではこれらの評価方法に加え、複数の母集団の分布情報を提供するもので、より効率的な資産運用方法を検討するための新たな判断基準（ベンチマーク）としてご活用いただくことが可能です。

具体的な例としては、内外株式の投資比率が同レベルである母集団における運用成果を、平均の収益率（コンポジットリターン）、順位（パーセンタイル）、分布状況を表すグラフ（四分位グラフ）等を用い、各種の統計値と共にご提供するものなどがあり、お客様は相対的な位置や分布状況を把握することができます。

「ユニバース評価サービス」では情報統合で利用するデータのうち、ユニバース評価に必要なデータを、お客様・運用機関の匿名性に十分配慮した上で収集し、ユニバースデータ

を作成します。

情報統合各社では、共同で運営するシステムに蓄積され、還元されるユニバースデータを元に情報統合サービスの一環として、月次・電子媒体でのユニバース評価レポートをご提供しますので、速やかな意思決定にご活用頂けます。

最近、各運用機関の運用状況を束ねてレポートする日本版マスター・トラストとしての情報統合のニーズが高まっており、更なる付加価値としてユニバース評価サービスを開始するもので、共同事業のメリットを活かし、豊富なデータを元にお客様の利便性を向上してまいります。

サービス開始にあたっては、300を超えるプラン数、2600を超えるファンド数、金額ベースで13兆円程度のデータベースとなっており、十分な規模でのスタートを切ることができました。

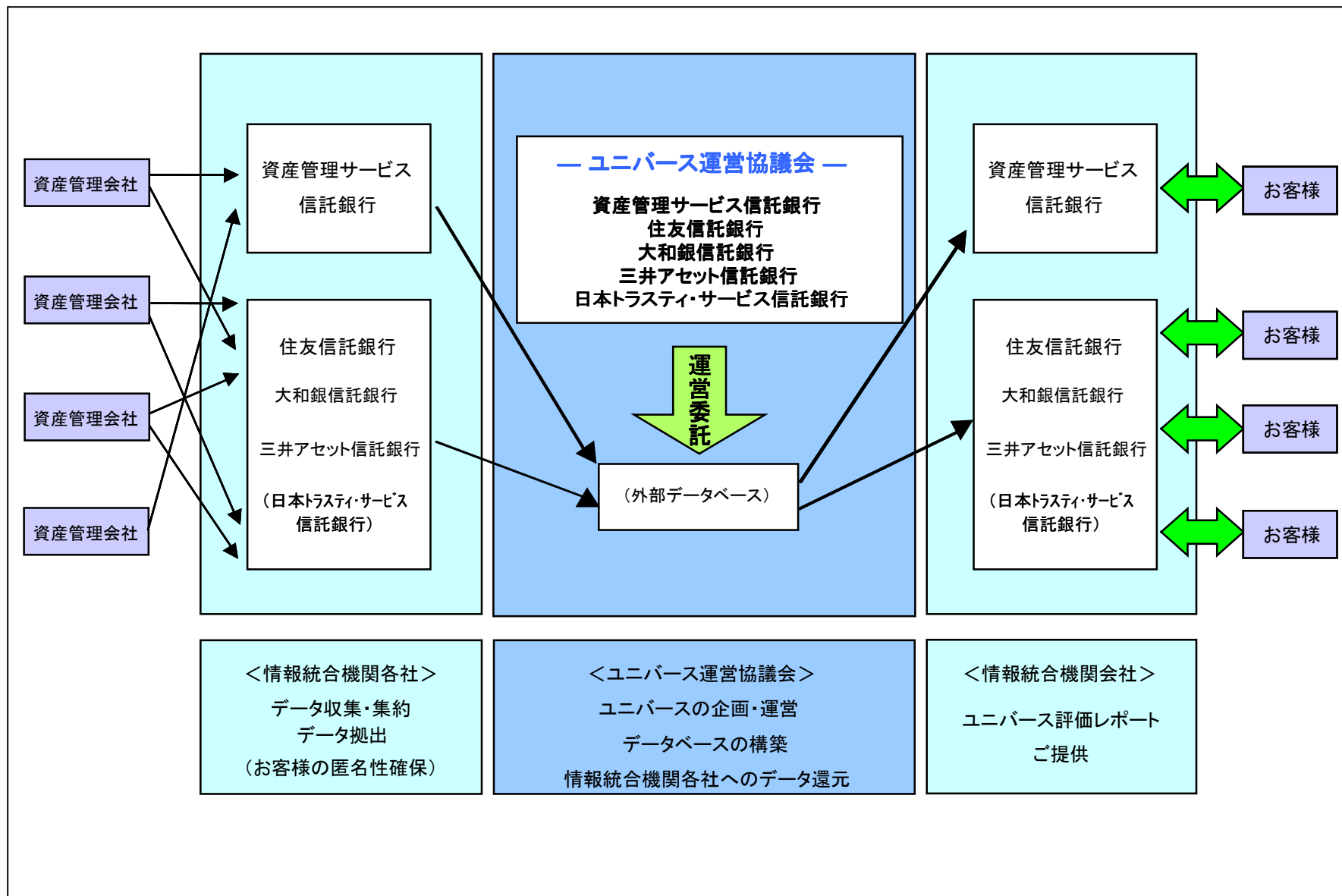
年金資産の管理に関する重要性は増しており、新たな判断基準をご提供する本サービスへの注目は高く、ご利用いただけるお客様は更に拡大するものと考えております。

今後とも、「ユニバース運営協議会」が中心となり、本サービスを基盤としたナショナルインフラを構築することで、企業年金制度の更なる発展に寄与していきたいと考えています。

参考資料1：ユニバース評価サービスの運営スキーム

参考資料2：ユニバース評価サービスでご提供するユニバースの種類

参考資料 1 : 運営スキーム



ユニバースの種類

全体

制度別

- ・厚年
- ・適年
- ・厚・適以外

設立形態別

- ・単体・連合
- ・総合

規模別

- ・規模大(500億以上)
- ・規模中(100億以上 500億未満)
- ・規模小(100億未満)

成熟度別

- ・成熟度(25%未満)
- ・成熟度(50%未満)
- ・成熟度(75%未満)
- ・成熟度(100%未満)
- ・成熟度(100%以上)

運用スタイル別

- ・国内債券アクティブ
- ・国内債券パッシブ
- ・国内株式アクティブ
- ・国内株式パッシブ
- ・外国債券アクティブ
- ・外国債券パッシブ
- ・外国株式アクティブ
- ・外国株式パッシブ

資産配分パターン別

- ・国内債券特化型
- ・外国債券特化型
- ・内外債券特化型
- ・国内株式特化型
- ・外国株式特化型
- ・内外株式特化型
- ・バランス型ハイリスク
- ・バランス型ミドルリスク
- ・バランス型ローリスク

リスク度別

- ・ハイリスク
- ・ミドルリスク
- ・ローリスク