

2021年9月28日

関係各位

野村アセットマネジメント株式会社

一者による基準価額算出を採用したパイロットファンドの設定について

野村アセットマネジメント株式会社(CEO兼代表取締役社長:小池広靖、以下「当社」)は、三菱UFJ信託銀行株式会社(取締役社長:長島巖)およびその再信託銀行である日本マスタートラスト信託銀行株式会社(代表取締役社長:向原敏和)と連携し、「運用と計算の分離」を図った一者による基準価額算出(以下「一者計算」)[※]を採用したパイロットファンド(以下「本ファンド」)を設定し、本日より試験的運用を開始します。

日本の投資信託業の高度化が求められている中で、長年の商慣行として行われてきた、国内籍投資信託における二者による基準価額算出が業務運営の合理化・効率化の障壁の一つとなっている可能性を指摘されてきました。本ファンドは、基準価額算出に関して、受託者を計算者とする一者計算のスキームを試験的に運用することで、その課題と実現可能性を検証することを目的としています。

また、一者計算のスキームは画一的なものではないため、すべての受益者の利益に資するべく、今後も本ファンド以外にも多様な計算スキームの検討や評価を行っていきます。

当社は今後も、運用の高度化を推進していくとともに、お客様のニーズに沿った商品を提供していきます。

[※] 従来、国内籍投資信託における基準価額算出は、正確性と安定性を確保することを目的として、委託会社と受託者の二者によって計算・照合されてきました。一者計算は、「基準価額算出の正確性に対する責任は委託会社にある」との前提のもと、基準価額算出にかかる業務を、委託会社が第三者に委託することで合理化・効率化を図るとともに、「運用と計算」を分離することによる基準価額の透明性向上を目的としています。

以上