

【ご案内】国内株式のリスク分析モデルの変更について/ファンド併合について(実施報告)

■ 国内株式のリスク分析モデルの変更について

国内株式のポートフォリオのリスク分析に使用していますBarraリスク分析モデルの仕様が、変更されることとなりましたのでご案内いたします。

今回の変更では、リスクを計測する項目が増加しておりますが、項目を増やす際、各項目の計測に使用していたインデックスも変更となっているため、算出される数値は同じリスク測定項目でも今までと異なることがあります。

【現行】	【変更後】※
ボラティリティ	ベータ レジデュアル・ボラティリティ
企業規模	サイズ サイズ非線形
日経225採用指標	日経225採用指標
売買活況度	流動性
財務レバレッジ	財務レバレッジ
企業成長度	グロース
海外経済感応度	海外経済感応度 マクロ感応度
金利感応度	
モーメンタム 株価対企業価値	モーメンタム バリュー 益回り 利益クオリティ マネージメント センチメント インダストリー・モーメンタム 長期リバーサル 短期リバーサル プロスペクト
東証2部採用指標 東証外採用指標	

※レーダーチャートの項目も上記に変更となります

■ ファンド併合について(実施報告)

被併合ファンドの国内株式K03(RUSSELL/NOMURA Prime Index 連動型 レンディング有)について運用スタイルを併合先ファンドの国内株式K01(TOPIX 連動型 レンディング有)と共通化した上で、両ファンドの併合を行いましたのでご報告いたします。

1. 併合対象ファンド

資産	国内株式
被併合ファンド	K03 RUSSELL/NOMURA Prime Index 連動型(レンディング有)
併合ファンド	K01 TOPIX 連動型(レンディング有)

2. 実施時期

時価基準日	2016年4月18日
併合日	2016年4月22日

3. 異動金額

併合先ファンドへの移管金額	4,000,147,712 円
被併合ファンドの受益者への交付金額	5,892 円

- ・被併合ファンドで保有する資産は、適正時価で移管しました
- ・2016年4月18日基準のファンド時価総額 K01:6,875億円、K03:40億円

実施日：2016年10月1日以降のリスク分析より適用