

【ご案内】MSCI指数の構成国の変更について/共同訴訟の状況について

■MSCI指数の構成国の変更について

●パキスタン

2017年5月の指数定例見直し時に、パキスタンの分類がフロンティア市場から新興国市場(MSCI Emerging Markets)へ変更されました。MSCIは、「経済発展基準」「市場性規模・流動性基準」「市場アクセス」の3つの基準に基づき市場分類を実施しています。新興国市場に分類されるためには、3つの基準のうち「市場性規模・流動性基準」「市場アクセス」で一定の基準を満たしていることが求められています。

【変更理由】

取引所統合や投資家保護の法整備の進展が見られ、新興国分類としての基準に達したこと。

各ベンチマークにおけるパキスタンの組入れ比率は以下の通りです。

| ベンチマーク名 | 組入れ比率※ | 左記をベンチマークとしているファンド |
|-----------------------------|--------|---|
| MSCI AC ASIA (ex Japan) | 0.15% | 年投(外)E45(アジア・アクティブ型) 年投(外)E46(アジア・リサーチ(銘柄集中)型) |
| MSCI Emerging Markets | 0.13% | 年投(外)E06(MSCI EM連動型/レンディング有) 年投(外)E07(MSCI EM連動型/レンディング無) |
| MSCI AC WORLD (ex Japan) | 0.02% | 年投(総)E05 (MSCI ACWI ex Japan連動型/レンディング有) |
| MSCI AC WORLD | 0.01% | 年投(総)E11(MSCI ACWI 連動型) 年投(総)E56(オールカントリー型) 年投(総)E57 (ウエリントン・グローバル・オポチュニティーズ) マン・ニューズミス・グローバル株式アルファ |

※組入れ比率は2017年6月末時点

●中国A株

2017年5月の指数定例見直し時に、新興国株に分類することが決定されました。実際の組入れは、2018年5月と2018年8月の2回に分けて行われる予定です。

【変更理由】

中国A株を含む指数連動型金融商品を取扱う場合の上海、深圳取引所による事前認可制度の緩和を評価したもの。

■株式会社東芝に対する共同訴訟の状況について

2015年4月に発覚いたしました東芝社の有価証券報告書虚偽記載事案に関し、弊社の年金投資基金信託(年投口)が被った損害の回復を求め、2017年3月31日に同社に対して損害賠償請求訴訟を提起いたしました。現在、東京地方裁判所において審理中です。訴訟遂行の状況につきましては、必要に応じ適宜ご報告申し上げます。

【損害賠償請求額】

弊社年投口合計約13億円(共同原告合計約141億円)

【訴訟対象ファンド等】

「国内株式 K01 TOPIX連動型/レンディング有」
「国内株式 K02 TOPIX連動型/レンディング無」
「国内株式 K04 FTSE GWA Japan Index 連動型」
「国内株式 K05 S&P Japan 500連動型」
「国内株式 K11 MSCI Japan 連動型/レンディング有」
「国内株式 K12 MSCI 日本株 最小分散指数連動型/レンディング無」
「国内株式 K13 JPX日経400連動型/レンディング無」
「国内株式 K43 クオンツ・バリュア(ストック)型」
「国内株式 K44 クオンツ・バリュア(フロー)型」

【被告】

株式会社東芝

【原告】

日本トラスティ・サービス信託銀行
(その他、資産管理サービス信託銀行、日本マスタートラスト信託銀行・三菱UFJ信託銀行など)

(原信託)

三井住友信託銀行、りそな銀行、みずほ信託銀行、三菱UFJ信託銀行など