

【ご案内】 標準スタイルミックス変更について / 訴訟の状況について

■標準スタイルミックスの変更について

運用パフォーマンスの向上を目指し、標準スタイルミックスにつき、下記の変更を実施する予定です。これらの変更は、2018年5月～6月に適用開始する予定です。

<変更内容>

外国株式について、「先進国リサーチ型」のウェイトを5%減少し、「オールカントリー」に配分する

【標準スタイルミックス変更対照表】

| 資産 | スタイル | ファンド 名称 | 変更前 | | | 変更後 | | | |
|----------|-------------|------------|-----|-----|------|------|-----|------|------|
| | | | 中心値 | 目標値 | レンジ | 中心値 | 目標値 | レンジ | |
| 国内 債券 | パッシブ | S01/02 | 30% | 30% | ±15% | 30% | 30% | ±15% | |
| | 収益源泉分散型 | S41 | 70% | 70% | ±15% | 70% | 70% | ±15% | |
| 国内 株式 | パッシブ | K01/02 | 30% | 30% | ±15% | 30% | 30% | ±15% | |
| | リサーチ | グロース型 | K42 | 25% | 25% | ±10% | 25% | 25% | ±10% |
| | | バリュースコア型 | K41 | 20% | 20% | ±10% | 20% | 20% | ±10% |
| | クオンツ | バリュースコア型 | K43 | 15% | 15% | ±10% | 15% | 15% | ±10% |
| 市場型 | | K45 | 10% | 10% | ±10% | 10% | 10% | ±10% | |
| 外国 債券 | パッシブ | B01/02 | 30% | 30% | ±15% | 30% | 30% | ±15% | |
| | グローバル・アクティブ | B41 | 70% | 70% | ±15% | 70% | 70% | ±15% | |
| 外国 株式 | パッシブ | E01/02 | 45% | 45% | ±15% | 45% | 45% | ±15% | |
| | 先進国 | リサーチ型 | E41 | 10% | 10% | ±10% | 5% | 5% | ±5% |
| | | クオンツ型 | E42 | 25% | 25% | ±10% | 25% | 25% | ±10% |
| | EM | アジア | E45 | 5% | 5% | ±5% | 5% | 5% | ±5% |
| | オールカントリー | E56 | 15% | 15% | ±10% | 20% | 20% | ±10% | |

目標値: リバランス時の目標値

レンジ: 中心値からの乖離の許容幅

■米国における返還請求訴訟について

年金投資基金信託(年投口)の投資先であるTribune Companyの債権者等より、同社が米国において2007年に実施した公開買付にかかる売却代金の取得者(当社年投口を含みます)に対し、2011年に返還請求訴訟が提起されており、現在応訴中です。応訴対応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。

【対象ファンド】

- 「外国株式 E01 MSCI-kokusai連動型/レンディング有」
- 「外国株式 E02 MSCI-kokusai連動型/レンディング無」
- 「外国株式 E04 FTSE GWA KAIGAI Index連動型/レンディング無」
- 「外国株式 E91 MSCI-kokusai連動型/レンディング有(非適年)」