

【ご案内】標準スタイルミックス変更について

■標準スタイルミックスの変更について

国内株式および外国株式のパフォーマンスの向上を目的に標準スタイルミックスの変更を予定しております。

<変更時期>

2019年2月とし、具体的な日付については弊社一任とさせていただきます

<変更内容>

国内株式において、パッシブのウェイトを5%減少し、「ESGパッシブ」に配分
外国株式において、先進国リサーチ型の組入れを終了し、全額「オールカントリー」に配分

【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%	25%	25%	±10%	
	ESGパッシブ	K19	-	-	-	5%	5%	±5%	
	リサーチ	グロース型	K42	25%	25%	±10%	25%	25%	±10%
		バリュ・コア型	K41	20%	20%	±10%	20%	20%	±10%
	クオンツ	バリュー型	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	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	20%	20%	±10%	25%	25%	±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

■標準スタイルミックスに新規組入れ予定のK19の商品概要書

商品名称	年投(株)K19(MSCIジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数連動型)
資産種別	国内株式
アクティブ/ パッシブ区分	パッシブ
運用者	三井住友信託銀行
外部運用委託先	三井住友信託銀行は、三井住友トラスト・アセットマネジメントに運用を委託する。同社は弊社の利害関係人である。
運用スタイル	MSCIジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数連動型(完全法)
ベンチマーク	MSCIジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込_GROSS_円ベース)
投資対象	【現物】ベンチマーク採用銘柄(採用予定/近時に採用実績のある銘柄を含む)。なお、銘柄とは、当該銘柄のベンチマークにおける国別分類以外の市場での上場銘柄、ETF及び預託証券等で代替証券として合理的と判断したものを含む。 【派生商品】上場株式指数先物取引
運用目標	ベンチマークに追随する収益を目指す。
主要なリスク管理	トラッキングエラー上限:0.30%
商品内容	ベンチマークとの連動性を高めたファンド
最低投資金額	【新規】1口に相当する金額【追投時】1口に相当する金額
解約単位	1口に相当する金額
解約日制限、 申込制限	原則なし。ただし、やむをえない場合は受託者判断で解約制限を付加することがある。
信託財産留保金率	0.02%
デリバティブ取引 の利用目的	ヘッジ目的に限る
レンドイング	無
その他	弊社が三井住友トラスト・アセットマネジメントに支払う報酬については、信託財産からは引き落とさない。また、報酬計算について事前に示すことはできない。