

【ご案内】 外国株式E92の運用スタイル変更について

■外国株式E92の運用スタイル変更について

年投(外)E92(グローバル・リサーチ型(非適年))(以下、「E92」と同一の運用スタイルである「年投(外)E41(グローバル・リサーチ型)」につきまして、2019年2月に標準スタイルミックスへの組入れを終了するとともに、2019年3月末をもって、アバディーン・スタンダード・インベストメンツ社と三井住友トラスト・アセットマネジメント社の投資助言契約が終了することとなりました。

これにより、E92でグローバル・リサーチ型の運用スタイルを維持することが困難となることから、E92と同様にMSCI KOKUSAIをベンチマークとする、年投(外)E42(グローバル・クオンツ型)(以下、「E42」と同一の運用スタイルにスタイル変更することと致しました。

【実施時期】

グローバル・クオンツ型への運用スタイル変更の時期につきましては、2019年3月を予定しています。

【グローバル・クオンツ型について】

スタイル変更後のE92と同一の運用スタイル(グローバル・クオンツ型)であるE42は、弊社の標準スタイルミックスに組入れている旗艦ファンドです。

株式投資における主要なファクターに着目して運用する計量アプローチのファンドで、複数のファクターに分散を効かせたポートフォリオ構築を行います。具体的には、理論株価モデル(資産性、収益性、成長性)と短期モメンタム戦略(センチメント、モメンタム、益利回り変化幅)を組み合わせます。

商品概要につきましては、本頁右側の商品概要書をご参照ください。

■外国株式E92の運用スタイル変更後の商品概要書

商品名称	年投(外)E92(グローバル・クオンツ型(非適年))
資産種別	外国株式
アクティブ/ パッシブ区分	アクティブ
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	グローバル・クオンツ型
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI(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)及びベンチマーク非採用銘柄でクレジット、時価総額等の観点から投資可能かつベンチマーク採用銘柄に準ずると判断したもの。なお、銘柄とは、上場銘柄に加え、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、為替先物取引
運用目標	中長期的にベンチマークを上回るリターンを目指す。 目標超過収益率:1.5%
主要なリスク管理	トラッキングエラー上限:4.0%
商品内容	ファイナンス理論に基づく理論株価モデルと短期モメンタム戦略をメインとした計量的アプローチを軸に、その組合せを計量的にコントロールすることで超過収益を追求する。ファクターウェイトコントロールにあたっては非合理的期待インデックス(IREX:弊社独自開発指標/登録商標)も加味することで付加価値を高める。
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	0.09%
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。