

【ご案内】 標準スタイルミックス変更について(実施報告)

■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、2019年2月に標準スタイルミックスの変更を実施しました。

<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を実施したESGパッシブ(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	ベンチマークに追従する収益を目指す。
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
レンディング	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。