

【ご案内】年金投資基金信託(合同口)における受益権決済期間の短縮について

弊社では、年金投資基金信託(合同口)における受益権の決済期間を短縮いたします。

<決済期間短縮化の内容>

◆受益権決済期間

原則、受益権約定日(T)から国内1営業日後(T+1)に売買資金の受渡を行います(従来はT+2)
*1営業日の数え方は国内営業日ベース

◆対象とする合同口

原則、全ての合同口(内外債券、内外株式、その他)を対象とします(対象としない合同口(T+1化しない合同口)は下表ご参照)

◆変更時期

2019年10月10日(木)を受益権約定日とする取引から変更いたします

【変更前の合同口受益権決済スケジュール】

	○月1日 (T-1)	○月2日 (T)	○月3日 (T+1)	○月4日 (T+2)
従来	受益権 基準価格 適用日	受益権 約定日		受益権 受渡日

【変更後のスケジュール】

	○月1日 (T-1)	○月2日 (T)	○月3日 (T+1)
変更後 (10/10~)	受益権 基準価格 適用日	受益権 約定日	受益権 受渡日

現物証券等	t	t+1	t+2
	約定日		受渡日

*受益権約定日を「T」、現物証券等の約定日を「t」とする

*合同口の受益権受渡日と、合同口内で保有する現物証券等の受渡日は、原則T+1=t+2で一致します。

*現物証券等の決済が、やむを得ない事情により合同口受益権の受渡日に間に合わない場合には、資産管理会社(カストディアン)が不足資金を立て替えることがあり、手数料(カストディフィー)が発生する場合があります。当該手数料については合同口より支払います。

今回の対象としない合同口(T+1化しない合同口)

合同口名称		理由
外国債券	B24(ブルームバーグ・バークレイズ米国投資適格社債インデックス(為替フルヘッジ)連動型)	トータル・リターン・スワップ取引が2営業日後(T+2)の受渡のため
	B43(Wellington・エマージング米ドル建債券ダイバーシファイド(為替フルヘッジ)型)	合同口の投資対象が投資信託
	B44(Wellington・エマージング現地通貨建債券ダイバーシファイド型)	
	B45(Wellington・エマージング米ドル建債券(為替フルヘッジ)型)	
外国株式	E45(アジア・アクティブ型)	アジア諸国では為替の受渡し(円キャッシュ化)が間に合わない国が多い
	E55(アジア・リージョナル・グロース型)	
	E49(MFS・グローバル・グロース型)	合同口の投資対象が投資信託
	E50(MFS・グローバル・バリュー型)	
	E48(インテック・グローバル・コア型)	
	E57(ウエリントン グローバル・オポチュニティーズ)	外部運用機関に運用を再委託
E58(ニューメリック・グローバル・コア型)		
オルタナ	L04(SMTAM・J-REIT)	合同口の投資対象が投資信託
	L07(FRM Div 2)	
国内債券	S59/S60/S61/S62(劣後債(クローズド)型)	持ち切り型(原則、中途解約不可)