

---

# 【ご案内】 Barraのリスク分析モデルの変更について

---

## ■ Barraのリスク分析モデルの変更について

国内債券、並びに一部外国債券ポートフォリオのリスク分析を行っております。Barraモデルにつきまして、これまで使用しておりましたモデルのサービス提供が2021年3月末をもって終了したことから、4月末算出値より新たなBarraモデルを使用する方針です。

新たなBarraモデルは従来使用していたモデルをアップグレードしたもので、従来のリスク計測項目に新たな項目が追加されたものです。

本変更に伴い、リスク管理項目として算出する推定TE値が今までと異なることがあります。

なお、モデルの変更に伴うファンドのリスク管理項目である目標リスク、TE上限値等の変更はございません。

## ■ 対象ファンド

リスク管理項目として、TEについて上限値等を定める国内債券ファンドと外国債券ファンドが対象となります。

なお、外国債券ファンドのうち、ブルームバーグバークレイズインデックスをベンチマークとするファンドは、Bloomberg社のPORT+ツールを使用し算出しているため対象外です。