

【ご案内】 ファンド併合について(実施報告)/FTSE世界国債インデックス構成国の見直しについて

■ ファンド併合について(実施報告)

被併合ファンドの年投(外)E59(アジア・アクティブ型)について、同一の運用スタイルである併合先ファンドの年投(外)E45(アジア・アクティブ型)とファンド併合を行いましたのでご報告いたします。

1. 併合対象ファンド

資産	外国株式
被併合ファンド	E59 (アジア・アクティブ型)
併合ファンド	E45 (アジア・アクティブ型)

2. 実施時期

時価基準日	2022年3月7日
併合日	2022年3月10日

3. 異動金額

併合先ファンドへの移管金額	1,964,221,379 円
被併合ファンドの受益者への交付金額	2,561,459 円

- ・被併合ファンドE59で保有する資産は、適正時価でE45へ移管しました。
- ・2022年2月末基準のファンド時価総額
E59: 約21億円、E45: 約206億円

■ FTSE世界国債インデックスの構成国の見直しについて

FTSE Russell社では、「市場アクセシビリティ・レベル」、「市場規模」、「信用格付け」の3つのインデックス基準に基づき、定期的にインデックス構成国の見直しを行っています。

同社は2022年3月の見直しにおいて、ニュージーランドがインデックス採用基準を全て満たしたと判断し、ニュージーランド国債を2022年11月よりFTSE世界国債インデックスへ追加する予定であることを発表しました。

【組入れ時期(予定)】

2022年11月インデックス(2022年10月末)

【組入れ比率】

2022年2月末時点に基づく弊社概算では、FTSE世界国債(除く日本)インデックスへの組入れ比率は0.23%程度と想定されます。

※現在、当インデックスには中国国債が毎月段階的に組入れられているため、上記数値は時点によって変動します。

<ご参考>

●採用基準

以下の3つの採用条件を満たす場合

- ①市場アクセシビリティ・レベルが最上位の2であること
- ②市場の額面総額合計が500億米ドル、400億ユーロ、5兆円を上回ること
- ③発行体の自国通貨建て長期債務の格付けが、S&P社とムーディーズ社の双方でA-/A3以上であること(但し③については、9月の年次レビュー時と変更適用時の両時点で条件を満たす必要あり)

●市場アクセシビリティ・レベル

市場アクセシビリティ・レベルは、「市場、マクロ経済、規制環境」「外国為替市場の構造」「債券市場の構造」「グローバル決済およびカस्टディ」の4つの側面で判定し、「2、1、0」の3段階で評価。