

【ご案内】 三井住友トラスト・アセットマネジメントにおける運用プラットフォーム移行について

■運用プラットフォーム移行の概要と背景

弊社年金投資基金信託(合同口)の運用委託先である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(以下、同社)は、2026年3月16日をもって、銘柄の発注・約定およびリスク管理等に用いる運用プラットフォームをBlackRock Financial Management, Inc.が提供するAladdinへ移行することを予定しております。なお、Aladdinへの移行に伴い、同社がポートフォリオ管理に使用する時価評価基準が従来のABOR(Accounting Book of Record)ベースから、IBOR(Investment Book of Record)ベースへと移行することとなります。Aladdinは、グローバルで広く採用されている運用管理プラットフォームであり、リアルタイム性・透明性・一貫性の高い投資判断支援を可能とするIBORベースのデータ管理を特徴としています。Aladdinの導入により、同社のファンドマネージャーおよびトレーダーが、より迅速かつ正確な投資判断を行えるようになることを目的としています。

【ABORとIBORの違い】

	ABOR	IBOR
用途	会計・報告用	投資判断・運用管理用
データの性質	確定済みの取引・時価情報	最新の取引・ポジション情報
更新頻度	日次確定ベース	リアルタイム更新

■本件移行により想定される影響ならびに弊社の対応方針

同社における運用プラットフォームのAladdinへの移行による個別プロダクトごとの影響については現在調査中のため、影響が生じる場合には別途ご報告をさせていただきます。

また、Aladdinへの移行に伴い運用報告書における要因分析・リスク分析等の算出基準等の変更も検討を実施しております。変更を実施させていただく場合には別途ご報告をさせていただきます。