

【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日に、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へ移行いたしました。

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(Investment Book of Record)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実施したものです。

■本件移行による主な影響等について

【ABORベースからIBORベースへの変更】

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)ベースへと移行いたしました。

	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

【リスク管理等にかかる変更】

従前、リスク管理はBarra等、要因分析は独自ツールで計測してきましたが、移行後はAladdinにてリスク管理等を実施いたします。Aladdinでは、ファンドのリスク分析、パフォーマンス分析がリアルタイムで行われる為、リスク状況の変化を迅速に把握することが可能となるほか、イベント分析等の機能も備えており、より高度なリスク管理・分析が可能です。

【その他】

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につきまして検討を実施しております。変更を実施させていただくプロダクトに関しましては、別途ご報告をさせていただきます。