

【ご案内】 標準スタイルミックス変更(実施報告)について / ファンド併合について

■標準スタイルミックスの変更について

運用パフォーマンスの向上を目指し、標準スタイルミックスにつき、下記の変更を実施し、2018年6月12日より適用を開始しました。

<変更内容>

外国株式について、「先進国リサーチ型」のウェイトを5%減らし、「オールカントリー」に配分

【標準スタイルミックス変更対照表】

資産	スタイル		ファンド 名称	変更前			変更後		
				中心値	目標値	レンジ	中心値	目標値	レンジ
国内 債券	パッシブ		S01/02	30%	30%	±15%	30%	30%	±15%
	収益源泉分散型		S41	70%	70%	±15%	70%	70%	±15%
国内 株式	パッシブ		K01/02	30%	30%	±15%	30%	30%	±15%
	リサーチ	グロース型	K42	25%	25%	±10%	25%	25%	±10%
		バリュ・コア型	K41	20%	20%	±10%	20%	20%	±10%
	クオンツ	バリュー型	K43	15%	15%	±10%	15%	15%	±10%
		市場型	K45	10%	10%	±10%	10%	10%	±10%
外国 債券	パッシブ		B01/02	30%	30%	±15%	30%	30%	±15%
	グローバル・アクティブ		B41	70%	70%	±15%	70%	70%	±15%
外国 株式	パッシブ		E01/02	45%	45%	±15%	45%	45%	±15%
	先進国	リサーチ型	E41	10%	10%	±10%	5%	5%	±5%
		クオンツ型	E42	25%	25%	±10%	25%	25%	±10%
	EM	アジア	E45	5%	5%	±5%	5%	5%	±5%
	オールカントリー		E56	15%	15%	±10%	20%	20%	±10%

目標値: リバランス時の目標値

レンジ: 中心値からの乖離の許容幅

■ファンド併合について

年投(株)K04(FTSE GWA Japan Index連動型)について、運用残高の減少が続く、ファンド運営に必要な運用資産額の維持が困難になることから、TOPIX連動型/レンディング有への運用スタイル変更を予定しています。ファンド規模の拡大による運営コスト低下等を図るため、同スタイルの年投(株)K01(TOPIX連動型/レンディング有)とのファンド併合を実施させていただきます。

併合対象ファンド		
ファンド名称	運用残高	
閉鎖ファンド (被併合)	年投(株)K04(FTSE GWA Japan Index連動型)	約44億円
存続ファンド (併合)	年投(株)K01(TOPIX連動型/レンディング有)	約5,780億円

※運用残高: 2018年6月末時点

※被併合ファンドK04で保有する資産は、適正時価でK01に移管します。

【実施時期】

ファンド併合の実施につきましては、2018年8月7日を予定しています。