

2023年5月

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## ベンチマーク等の「配当込み指数」への変更について

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。

平素は弊社の投資信託に格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(取締役社長:菱田 賀夫、以下「弊社」)はこの度、お客様本位でわかりやすい情報開示を行うために、弊社が設定・運用するファンドで採用しているベンチマークおよび参考指数(以降、ベンチマーク等)を「配当を含まない指数」(以下「配当除く指数」)から「配当を含む指数」(以下「配当込み指数」)に変更させていただくことに致しました。詳細は下記をご参照ください。

本件変更に伴うファンドの運用方針および運用プロセスに関する実質的な変更はございません。また、本件変更に関しまして、受益者のみなさまのお手続きは不要です。

本件変更の趣旨についてご理解賜りますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧の程、よろしくお願い申し上げます。

敬具

### 記

#### 1. 変更対象ファンド

株式・リート等に投資するファンド

※バランス型ファンドを含みます。詳細は別紙をご参照下さい。

#### 2. 変更内容

(1)別紙記載のファンドのベンチマーク等を「配当除く指数」から「配当込み指数」に変更します。

変更にあたって、ファンドによっては約款変更を行いますが、重大な約款変更には該当しません。

(2)外貨建て資産にかかるベンチマーク等の円換算方法をファンドの基準価額計算方法※に合わせて、必要に応じて当社が円換算します。

※ファンドの基準価額計算方法:

基準価額計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価した有価証券(ベンチマークの場合、外貨建て指数値)等を、当該計算日の対顧客電信売相場の仲値(TTM)によって評価します。

(3)その他一部のベンチマーク等の名称について、表記統一のため指数名称を変更します。

### 3. 対象ファンド

別紙一覧表をご覧ください。

### 4. 対象文書

約款、目論見書、運用報告書、月次レポート、販売用資料等

### 5. 変更時期

2023 年半ば頃を目処に約款変更を実施する予定です。

各種開示資料の記載変更は、約款変更実施後に作成するタイミングで順次行うため、変更時期はそれぞれ異なります。

### 6. 変更理由

弊社では、株式を投資対象とするファンドのベンチマーク等について、配当金を考慮する「配当込み指数」に加え、一部のファンドでは配当金を考慮しない「配当除く指数」を採用していました。これは、投資家の皆様が普段メディア等で接している指数が主として「配当除く指数」であったことや、ファンド設定当時「配当込み指数」が公表されていないケースがあったこと等が主な理由です。

一方、ファンドの運用に際しては投資している資産から配当金を受け取るため、「配当除く指数」をベンチマーク等としている場合、ファンドとベンチマーク等のパフォーマンスにおいて配当金相当分の差が生じていました。

このような状況を踏まえ、弊社は今般運用の成果を検証する指標であるベンチマーク等について、ファンドの運用成果により近い「配当込み指数」に統一する約款変更等を実施し、より投資家本位で分かりやすい情報開示を目指すものです。

以上

## ○対象ファンド一覧

## ① ベンチマークに配当除く指数が使用されている公募ファンド※

ファンド名
日本株式インデックスファンド
外国株式インデックスファンド
DC日本株式インデックスファンド
DC外国株式インデックスファンド
DC日本株式インデックスファンドL
DC日本株式インデックスファンドA
DC外国株式インデックスファンドL
DC日本株式エクセレント・フォーカス
社会的責任ファンド
SMTAMダウ・ジョーンズ インデックスファンド
日経225インデックスファンド
外国株式インデックスe
インデックスコレクション(外国株式)
SMTAMダウ・ジョーンズ インデックスファンド(為替ヘッジあり)
キャッシュフロー経営評価オープン
SRI・ジャパン・オープン
エマージング株式オープン
日本株式SRIファンド
SMT TOPIXインデックス・オープン
SMT グローバル株式インデックス・オープン
SMT 新興国株式インデックス・オープン
SMT 日経225インデックス・オープン
SMT アジア新興国株式インデックス・オープン
日本株式インデックス・オープン
外国株式インデックス・オープン
DC日本株式インデックス・オープン
DC外国株式インデックス・オープン
DCファンダメンタル・バリュー ファンド
DCグッドカンパニー(社会的責任投資)
DC日本株式インデックス・オープンS
DC新興国株式インデックス・オープン
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)

ファンド名
SMT ダウ・ジョーンズ インデックス・オープン
SMTAM NYダウインデックスオープン
日経225インデックスe
My SMT 日経225インデックス(ノーロード)
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)
SMTAM NYダウインデックスオープン(為替ヘッジあり)
My SMT ダウ・ジョーンズ・インデックス(ノーロード)
SMT ETFカーボン・エフィシエント日本株

※円換算方法の変更も併せて実施するファンドを含みます。

② 参考指数に配当除く指数が使用されている公募ファンド※

ファンド名
DC日産株ファンド
日本株配当オープン
ジャパン・グロース・ファンド
次世代ファンド
中小型株式オープン
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)
ニュー配当利回り株オープン
アジア・オセアニア配当利回り株オープン
SBI資産設計オープン(資産成長型)
SBI資産設計オープン(分配型)
中小型株式オープン(SMA専用)
欧州成長株式ファンド
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)
DCターゲット・イヤー ファンド2055
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド(SMA専用)

※円換算方法の変更や組入れファンドのベンチマーク等の変更を併せて実施するファンドを含みます。

③ ①、②を除き、組入れファンドのベンチマーク等に配当除く指数が使用されている公募ファンド※

ファンド名
3資産バランスオープン
世界経済インデックスファンド
DCマイセレクション25

ファンド名
DCマイセクション50
DCマイセクション75
DCマイセクションS25
DCマイセクションS50
DCマイセクションS75
DCターゲット・イヤー ファンド2025
DCターゲット・イヤー ファンド2035
DCターゲット・イヤー ファンド2045
DC世界経済インデックスファンド
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)
SMT インデックスバランス・オープン
SMT 世界経済インデックス・オープン
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)
SMT 8資産インデックスバランス・オープン
グローバル経済コア
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060
10資産分散投資ファンド

※組入れファンドの円換算方法の変更を実施するファンドを含みます。

- ④ 従来から配当込み指数を使用しているが、円換算方法の変更やベンチマーク等表記の統一等を実施する公募ファンド

ファンド名
DCバランスファンド30
DCバランスファンド50
DCバランスファンド70
グローバル・インデックス・バランス・ファンド
日本株式インデックスe
インデックスコレクション(国内株式)
インデックスコレクション(バランス株式30)

ファンド名
インデックスコレクション(バランス株式50)
インデックスコレクション(バランス株式70)
SMT グローバルREITインデックス・オープン
DC リサーチ・グロース ファンド
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)
インバウンド関連日本株ファンド
SMT 米国株配当貴族インデックス・オープン
SMT 欧州株配当貴族インデックス・オープン
SMT 日経アジア300インベストアブルインデックス・オープン
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド
日本株式エクセレント・フォーカスファンド
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)

※上記は作成時点の内容であり、今後変更となる場合があります。

以上