

2024年5月21日

受益者の皆さまへ

アセットマネジメント One 株式会社

「DLIBJ公社債オープン（短期コース）」
投資信託約款変更実施決定のお知らせ

拝啓 時下ますますご清祥のこととお慶び申し上げます。
平素は格別のお引き立てを賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、弊社ファンド「DLIBJ公社債オープン（短期コース）」の投資信託約款変更につきましては、2024年4月5日付公告（電子公告）および同日付の書面にて受益者の皆さまへ投資信託約款変更に関するお知らせを行い、2024年5月20日まで受益者の皆さまから異議申立を受け付けました。

この結果、異議申立期間中に異議申立のあった受益者の皆さまの受益権口数の合計が、基準日である2024年4月5日時点での受益権総口数の2分の1を超えませんでしたので、投資信託約款変更を実施し、2024年6月22日より適用させていただきます。

受益者の皆さまのご愛顧に心から感謝を申し上げますとともに、今後とも変わらぬお引き立てを賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

2024年4月5日

受益者の皆さまへ

アセットマネジメントOne株式会社

「DLIBJ公社債オープン（短期コース）」

投資信託約款変更（予定）のお知らせ

拝啓 時下ますますご清祥のこととお慶び申し上げます。

平素は格別のご高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、このたび、弊社の追加型証券投資信託「DLIBJ公社債オープン（短期コース）」（以下「当ファンド」といいます。）につきまして、投資信託約款の変更（以下「約款変更」といいます。）をさせていただく予定といたしましたので、お知らせ申し上げます。

この約款変更は、改正前の「投資信託及び投資法人に関する法律」および信託約款の規定に従い、異議申立て手続きをもって決定されます。2024年4月5日時点の当ファンドの受益者の皆さまのうち、約款変更についてご異議のある方は、書面によりその旨をお申し出ください。

約款変更は、ご異議を申し立てられた受益者さまの受益権口数が、2024年4月5日の受益権総口数の2分の1を超えない場合に可決されます。

■ 必要なお手続きについて

当ファンドの約款変更にご異議がある場合：

「異議申立て」を行ってください。

4ページの「約款変更にご異議のある場合のお手続き」をご参照いただき、書面をご郵送ください。

約款変更にご同意いただける場合、お手続きは必要ありません。

本件につきご不明な点がございましたら、以下までお問い合わせください。
なお、お客さまの口座内容等に関するご照会は、お申込みされました販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

〔コールセンター〕0120-104-694 受付時間：営業日の午前9時～午後5時

敬具

1. 約款変更の内容と理由

<内容>

当ファンドのポートフォリオのデュレーション調整について、デュレーションがマイナスとなる調整等を行うことができるという規定を削除するとともに、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を、「価格変動、金利変動および為替変動等により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的」に限定する変更を行います。

また、一般事業債等の組入銘柄の格付基準を見直し、以下の通り変更します。

変更前：格付業者 2 社（R&I または JCR）による発行体格付（長期優先債務格付）が BBB- 以上の債券

変更後：格付業者 4 社（R&I、JCR、Moody's または S&P）による銘柄格付（銘柄格付がない場合は発行体格付）が BBB-（または Baa3）以上の債券

※変更の詳細は添付資料をご覧ください。

<理由>

当ファンドは 1999 年 12 月 14 日に設定され、主として国内の公社債に投資し、中長期的な観点でリスクの軽減に努めながら信託財産の成長をはかるとともに、ベンチマーク（NOMURA-BPI 国債・短期（1-3））を上回る運用成果の実現をめざしてまいりました。

今般、上記の運用成果の実現および基準価額の防衛等リスク管理の観点から、当ファンドにおけるデリバティブ取引の利用について再検討し、デュレーションがマイナスとなるような調整は必要ではないとの判断に至りました。このため、ポートフォリオのデュレーション調整等について一部変更を行うとともに、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を明確にします。これにより、2024 年 1 月から開始された少額投資非課税制度（NISA）の特定非課税管理勘定（成長投資枠）における「デリバティブ取引に係る権利に対する投資」の要件も充足することとなります。

また、当該変更に合わせて、投資ユニバースの拡大による収益機会の増加を目的として、一般事業債等の組入銘柄の格付基準を見直すものです。

上記の変更は、重大な約款変更該当すると考えていることから、信託約款の規定に基づき異議申立の手続きをとることといたしました。

2. 手続きの日程と概要

| | | |
|------------------------|---------------------------|--------------------|
| 公告日 | 2024年4月5日 | 本手続きの対象となる受益者の確定日 |
| 異議申立期間 | 2024年4月5日～ 2024年5月20日 | ご異議のある受益者の異議申立受付期間 |
| 約款変更実施判定日 | 2024年5月21日 | 約款変更の可否決定日 |
| 異議申立受益者の 買取請求期間(予定) | 2024年5月29日～ 2024年6月17日 | 異議申立てされた受益者の買取請求期間 |
| 約款変更適用日(予定) | 2024年6月22日 | 可決した場合の約款変更予定日 |

- ※ 公告はアセットマネジメントOne株式会社のホームページに掲載します（電子公告）。
（ホームページ：<https://www.am-one.co.jp/>）
なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。
- ※ 書面による異議申立てについては、2024年4月5日現在の受益者の皆さまを対象としております。2024年4月6日以降に取得された受益権口数（2024年4月5日以降に取得申込みをされた受益権口数）は本件の対象とはなりません。ご了承ください。

3. 書面による異議申立ての方法

【約款変更にご異議のある場合】 ⇒ 次ページのお手続きが必要です。

※当ファンドの約款変更に同意いただける場合は、特に必要なお手続きはございません。

【約款変更にご異議のある場合のお手続き】

当ファンドの約款変更にご異議のある受益者の皆さまは、「書面」（官製はがき、封書等の書式自由）に以下の「書面にご記入いただく内容」をご記入のうえ、アセットマネジメントOne 株式会社にご郵送ください。

なお、2024年5月20日までにアセットマネジメントOne 株式会社に到着した分を有効とさせていただきます。

書面にご記入いただく内容

- | | |
|-------------------|-----------------|
| a. ファンド名 | b. 住所又は所在地 |
| c. 氏名又は法人名（署名・捺印） | d. 電話番号（日中連絡先） |
| e. 保有口数 | f. 取扱販売会社、取引店 |
| g. 口座番号 | h. 約款変更にご異議のある旨 |

＜ご記入にあたってのご注意事項＞

- ・当ファンドの異議申立てに関し、複数の販売会社・支店等で口座をお持ちですべての保有口数で異議申立てをされる方は、保有する販売会社名、取引店名、口座番号、保有口数をそれぞれご記入ください。

書面宛先

〒100-0005 東京都千代田区丸の内 1-8-2 鉄鋼ビルディング
アセットマネジメントOne 株式会社
商品開発グループ ディスクロージャーチーム
異議申立て受付係

＜ご送付いただいた異議申立て書面の取り扱い＞

- ・ご記入内容に不備がある場合などには、異議申立てをお受けできなくなる場合がありますのでご注意ください。保有口数をご不明な場合は、その旨をご記入ください。なお、受益者の皆さまの権利保護の観点から、販売会社またはアセットマネジメントOne 株式会社から確認のご連絡を差し上げることがありますのでご了承ください。
- ・受益者の皆さまの個人情報はアセットマネジメントOne 株式会社のホームページに掲載している「個人情報保護に関する事項 お客さまの個人情報保護に関するプライバシーポリシー」に則って取り扱い、異議申立てに関する事務を処理する目的以外には使用いたしません。また、取得した個人情報は必要な範囲で弊社および販売会社において共有いたします。

4. 約款変更の実施の判定

約款変更については、2024年5月21日に異議申立ての口数を集計し、実施するか否かを判定いたします。

＜約款変更を実施する場合＞

当ファンドの約款変更に対し、ご異議を申し立てられた受益者の方の受益権口数が、2024年4月5日現在の当該信託約款にかかる受益権総口数の2分の1を超えない場合は、2024年6月22日に、当ファンドの約款変更を行います。

＜約款変更を実施しない場合＞

当ファンドの約款変更に対し、ご異議を申し立てられた受益者の方の受益権口数が、2024年4月5日現在の当該信託約款にかかる受益権総口数の2分の1を超えた場合には、当ファンドの約款変更は行いません。

この場合、約款変更を行わない旨を、速やかに公告し、かつ、当ファンドの信託約款にかかる知られたる受益者の皆さまに対して書面を交付いたします。

※異議申立ての結果は、2024年5月21日（約款変更実施判定日）以降、アセットマネジメントOne株式会社のホームページ (<https://www.am-one.co.jp/>) およびコールセンター（電話：0120-104-694【営業日の午前9時～午後5時】）にてご確認ください。

5. ご異議をお申立ての受益者の方の買取請求に関する手続きについて

約款変更をすることとなった場合、ご異議を申し立てられた受益者の方は、保有する受益権について、当ファンドを購入された販売会社等を通じて、受託会社（みずほ信託銀行株式会社）に対し、受益権にかかる信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

買取請求期間（受託受理日）は、2024年5月29日から2024年6月17日までとなります。

買取請求を行った場合の買取価額は、受託会社が買取請求書を受理した日の基準価額から、当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した額となります。なお、受益者が受領する買取代金からは、振込手数料（税込み）および買取計算書送付のための郵送料（税込み）が差し引かれます。また、買取代金の受領までには、通常のご換金請求よりも日数を要する場合があります。買取代金の収益の税務の取扱いに関しては、法令に則した適正な申告（確定申告）等のお手続きを受益者さまご自身で行っていただく必要がございます。

買取請求に関する書類は、異議申立期間終了後、ご異議を申し立てられた受益者の方に、あらためてアセットマネジメントOne株式会社よりご送付いたします。

この買取請求手続きは、受益者の皆さまのご判断によるもので、必ず行わなければならないものではありません。販売会社では、通常通り当ファンドの換金（解約）のお申込みを受け付けます。

以上

投資信託約款の変更の案

追加型証券投資信託 DLIBJ 公社債オープン（短期コース）

| (新) | (旧) |
|---|--|
| <p>運用の基本方針</p> <p>2. 運用方法</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① (略)</p> <p>② (略)</p> <p>③各リスクについての考え方は、以下の通りです。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金利リスク：次のように対応します。 <ul style="list-style-type: none"> a. ポートフォリオのデュレーションは、原則として0年～3年程度の範囲で調整します。 b. デュレーションの調整には債券先物、債券オプション、金利スワップ、金利先物、公社債の空売り等を活用します。 ・一般事業債等の信用リスク：次のように対応します。 <ul style="list-style-type: none"> a. 一般事業債等の組入れ時において、格付け機関（*）による格付け（銘柄格付け。銘柄格付けがない場合は発行体格付け）がBBB-（またはBaa3）以上の債券を投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> （*）格付投資情報センター（R&I）、日本格付研究所（JCR）、Moody's、またはS&Pによる格付けを基準とします。 b. 格付けがBBB（またはBaa）の債券組入上限は、原則としてポートフォリオの50%程度とします。 ・為替リスク：外貨建資産への投資を | <p>運用の基本方針</p> <p>2. 運用方法</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① (略)</p> <p>② (略)</p> <p>③各リスクについての考え方は、以下の通りです。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金利リスク：次のように対応します。 <ul style="list-style-type: none"> a. ポートフォリオのデュレーションは、原則として0年～3年程度の範囲で調整します。<u>ただし、基準価額の防衛等リスク管理の観点から、デュレーションがマイナスとなるような調整を行う場合があります。</u>なお、デュレーションの水準によっては、信託財産の純資産総額に対する実質組入比率がマイナスになる場合があります。 b. デュレーションの調整には債券先物、債券オプション、金利スワップ、金利先物、公社債の空売り等を活用します。 ・一般事業債等の信用リスク：次のように対応します。 <ul style="list-style-type: none"> a. 一般事業債等の組入れ時において、格付け機関（*）による発行体格付け（長期優先債務格付け）がBBB-以上の債券を投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> （*）格付投資情報センター（R&I）または日本格付研究所（JCR）による格付けを基準とします。 b. 格付けがBBBの債券組入上限は、原則としてポートフォリオの50%程度とします。 ・為替リスク：外貨建資産への投資を |

| (新) | (旧) |
|---|---|
| <p>行った場合は為替フルヘッジとし、原則として為替リスクはとりません。</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>⑥ 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>(3) 投資制限</p> <p>①～⑦ (略)</p> <p>⑧ <u>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</u></p> <p>⑨ <u>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</u></p> <p>(削除)</p> <p>⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> | <p>行った場合は為替フルヘッジとし、原則として為替リスクはとりません。</p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ (略)</p> <p>⑥ <u>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）ならびに金利先渡取引を行うことができます。</u></p> <p>(3) 投資制限</p> <p>①～⑦ (略)</p> <p>⑧ <u>有価証券先物取引等は、約款第20条の運用指図に基づいて行います。</u></p> <p>⑨ <u>スワップ取引は、約款第21条の運用指図に基づいて行います。</u></p> <p>⑩ <u>金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の運用指図に基づいて行います。</u></p> <p>⑪ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> |
| <p><先物取引等の運用指図></p> <p>第20条 委託者は、<u>信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるも</u></p> | <p><先物取引等の運用指図></p> <p>第20条 委託者は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法</p> |

| (新) | (旧) |
|---|--|
| <p>のをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)<u>および外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引ならびに有価証券店頭オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ハに掲げるものをいいます。)、有価証券店頭指数等オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ニに掲げるものをいいます。)</u>を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)</p> <p>1. <u>先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。</u></p> <p>2. <u>先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第15条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。</u></p> <p>3. <u>コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額</u></p> | <p>第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)<u>および外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引ならびに有価証券店頭オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ハに掲げるものをいいます。)、有価証券店頭指数等オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ニに掲げるものをいいます。)</u>を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)</p> |

| (新) | (旧) |
|--|---|
| <p><u>が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。</u></p> <p>②委託者は、<u>信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。</u></p> <p>1. <u>先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。</u></p> <p>2. <u>先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。</u></p> <p>3. <u>コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。</u></p> <p>③委託者は、<u>信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。</u></p> <p>1. <u>先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第 15 条第 2 項第 1</u></p> | <p>②委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。</p> <p>③委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。</p> |

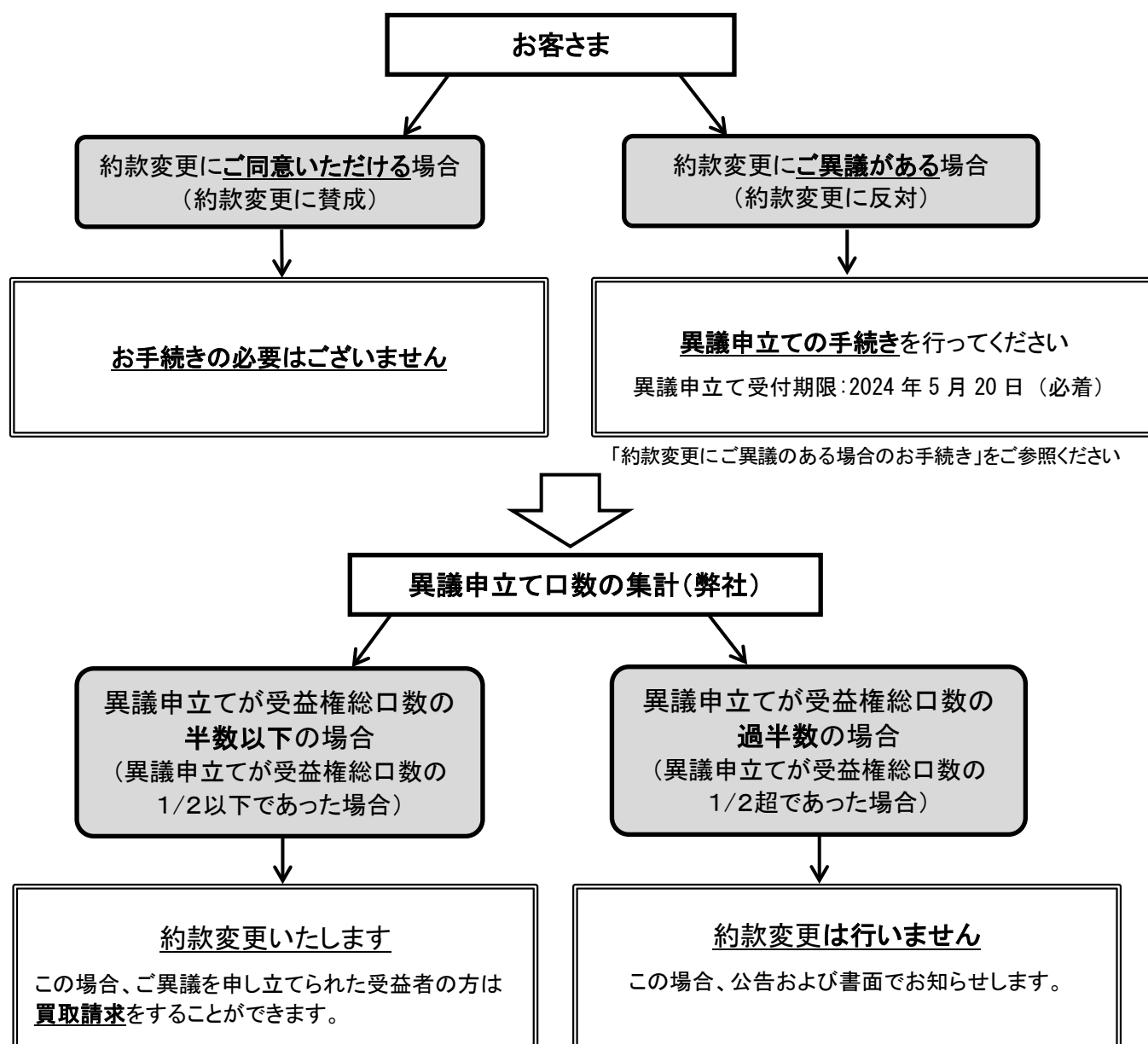
| (新) | (旧) |
|--|--|
| <p><u>号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。</u></p> <p>2. <u>先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに第15条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。</u></p> <p>3. <u>コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本条で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。</u></p> | |
| <p><u><スワップ取引の運用指図></u> 第21条 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった</p> | <p><u><スワップ取引の運用指図></u> 第21条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本</p> |

| (新) | (旧) |
|---|--|
| <p>受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。</p> <p>②（略）</p> <p>③ <u>スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないもの</u>とします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の<u>想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するもの</u>とします。</p> <p>④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。</p> <p>⑤ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。</p> | <p>を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。</p> <p>②（略） （新設）</p> <p>③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。</p> <p>④ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。</p> |
| <p><金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図></p> <p>第22条 委託者は、信託財産に属する資産の<u>価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うこと</u>の指図をすることができます。</p> <p>②（略）</p> <p>③ <u>金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額を超えないもの</u>とします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の<u>想定元本の総額が</u></p> | <p><金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図></p> <p>第22条 委託者は、信託財産に属する資産の<u>効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うこと</u>の指図をすることができます。</p> <p>②（略） （新設）</p> |

| (新) | (旧) |
|--|--|
| <p><u>ヘッジ対象金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。</u></p> <p>④ <u>為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下本項において同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。</u></p> <p>⑤ <u>金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。</u></p> <p>⑥ <u>委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。</u></p> | <p>(新設)</p> <p>③ <u>金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。</u></p> <p>④ <u>委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。</u></p> |
| <p><外国為替予約取引の指図および範囲> 第29条 <u>委託者は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。</u></p> <p>(削除)</p> | <p><外国為替予約取引の指図および範囲> 第29条 <u>委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。</u></p> <p>② <u>前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避</u></p> |

| (新) | (旧) |
|------|---|
| (削除) | <p><u>するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。</u></p> <p>③ <u>前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。</u></p> |

<ご参考①> お手続きの流れ



※ 約款変更にかかる異議申立ての結果は、2024年5月21日以降、アセットマネジメントOne株式会社のホームページ (<https://www.am-one.co.jp/>) およびコールセンター (電話: 0120-104-694【営業日の午前9時～午後5時】) にてご確認いただけます。

異議申立てをされたお客さまは、受託会社に対し買取請求を行うことができますが、この買取請求手続きは、法令・信託約款の規定に基づく権利であり、必ず行わなければならないものではありません。異議申立期間中・買取請求期間中ともに、販売会社において通常通り当ファンドのご換金(解約)のお申込みを受け付けます。

<ご参考②> 約款変更に関するQ & A

Q1:なぜ、約款変更を行うのですか？

当ファンドにおけるデリバティブ取引の利用について再検討し、デュレーションがマイナスとなるような調整は必要ではないとの判断に至りました。このため、ポートフォリオのデュレーション調整等について一部変更を行うとともに、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を明確にします。これにより、2024年1月から開始された少額投資非課税制度(NISA)の特定非課税管理勘定(成長投資枠)における「デリバティブ取引に係る権利に対する投資」の要件も充足することとなります。

また、当該変更に合わせて、投資ユニバースの拡大による収益機会の増加を目的として、一般事業債等の組入銘柄の格付基準を見直すものです。

上記の変更は、重大な約款変更該当すると考えていることから、信託約款の規定に基づき異議申立の手続きをとることといたします。

Q2:約款変更の手続きに対して、受益者として何をしなければならないのですか？

約款変更にご同意いただける場合は、お手続きの必要はございません。

約款変更にご異議のある場合は、お手続きが必要です。4ページの「約款変更にご異議のある場合のお手続き」をご参照の上、お手続きください。

Q3:約款変更を実施するか否かは、どのように決定されますか？

異議申立て手続きにより決定します。ご異議を申し立てされた受益者の受益権口数の合計が、異議申立てすることができる受益者の受益権総口数の2分の1を超えない場合は可決され、受益権総口数の2分の1を超えた場合は否決となります。

Q4:異議申立て(約款変更するか否か)の結果は、どのようにすれば知ることができますか？

異議申立て手続きの結果は、2024年5月21日(約款変更実施判定日)以降、アセットマネジメントOne株式会社のホームページまたはコールセンターにてご確認いただけます。

ホームページ：<https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：電話 0120-104-694 (営業日の午前9時～午後5時)

Q5:約款変更の実施が決定された場合、どのようになりますか？

約款変更適用日より、約款変更の内容での運用が行われます。また、ご異議を申し立てられた受益者の皆さまには「買取請求のご案内」をお送りしますが、必ず買取請求をしなければならないわけではなく、通常の換金(解約)のお申込みも可能です。

Q6:約款変更が実施されないこととなった場合、どのようになりますか？

異議申立て手続きにより約款変更が否決された場合には、当ファンドの約款変更は行いません。

Q7:ファンドを売却することは可能ですか？

約款変更の可否に関わらず、売却はいつでも可能です。

その他、ご不明な点がございましたら、以下までお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社のコールセンター(電話:0120-104-694)【営業日の午前9時～午後5時】