

2022年2月

投資家のみなさまへ

アセットマネジメント One 株式会社

世界高配当株セレクト(目標払出し型)

<毎月決算・為替ヘッジなしコース> <毎月決算・為替ヘッジありコース>
<年2回決算・為替ヘッジなしコース> <年2回決算・為替ヘッジありコース>
信託期間の延長と担保管理体制の一部変更について

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、厚く御礼申し上げます。

さて、ご愛顧いただいております「世界高配当株セレクト(目標払出し型)」(以下、「当ファンド」といいます。)につきまして、下記の通り、一部コースにおける信託期間の延長と、当ファンドが投資する外国投資信託における担保管理体制の一部変更を行いましたのでお知らせいたします。信託期間の延長に関しては当ファンドの目論見書の記載内容改訂および信託約款の軽微変更を、担保管理体制の一部変更に関しては目論見書の記載内容を一部改訂いたしました。

なお、本変更による当ファンドの実質的な運用内容に変更はなく、受益者のみなさまへ特段のお手続きを求めものではありません。

本変更の趣旨についてご理解賜りますとともに、今後とも弊社ファンドをお引き立ていただきますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

記

1. 対象ファンド

- ・世界高配当株セレクト(目標払出し型) 毎月決算・為替ヘッジなしコース
- ・世界高配当株セレクト(目標払出し型) 毎月決算・為替ヘッジありコース
- ・世界高配当株セレクト(目標払出し型) 年2回決算・為替ヘッジなしコース
- ・世界高配当株セレクト(目標払出し型) 年2回決算・為替ヘッジありコース

2. 変更内容

① 信託期間の延長

当ファンドは、信託約款の規定に基づき2022年11月25日に信託期間が終了する予定です。当ファンドの「年2回決算・為替ヘッジなしコース」「年2回決算・為替ヘッジありコース」については、現在の規定に基づき信託期間終了を迎える予定ですが、「毎月決算・為替ヘッジなしコース」「毎月決算・為替ヘッジありコース」については、信託約款を2022年2月26日付で変更し、信託期間終了日を2022年11月25日から2027年11月25日といたしました。

このたびの信託期間の延長は、当ファンドにおける各コースの状況等に鑑み、上記2コースについては投資機会を継続して提供することが投資家のみなさまの利益に資すると判断したことによるものです。

② 外国投資信託における担保管理体制の一部変更

当ファンドでは、外国投資信託における担保付スワップ取引により、高配当株戦略指数に実質的に投資を行っておりますが、当該スワップ取引に係る担保保管会社をザ バンク オブ ニューヨーク メロンから、2月26日以降はファンドの保管銀行である米国みずほ銀行に変更しております。

この度の変更は、昨今の国際的な証拠金規制が強化される中、当ファンドにおける取引においても担保管理体制を国際的に標準的な枠組みに合わせるものです。

また、この度の変更により、2月26日に改版いたしました目論見書(P11「投資リスク」)に記載されております「カウンターパーティ・リスク」の本文の一部を変更しております。

本変更による当ファンドの実質的な運用内容に変更はなく、受益者のみなさまへ特段のお手続きを求めものではございません。

変更前	変更後
<p>各コースの投資対象である外国投資信託は、スワップ取引の相手方（カウンターパーティ）となるドイツ銀行ロンドン支店（以下「ドイツ銀行」といいます。）に保有資産の大部分を証拠金として差し入れることで、高配当株戦略指数の投資損益をドイツ銀行から提供されます。外国投資信託は、ドイツ銀行が取引する高配当株戦略指数にかかる株式や為替予約取引について、何ら直接の権利を有しません。ドイツ銀行は、証拠金とほぼ同額の有価証券などを担保保管会社（ザ バンク オブ ニューヨーク メロン）に自己名義で預け入れ、自らが倒産などに陥った場合に当該有価証券などの管理権を移譲する担保契約を外国投資信託と事前に締結します。ドイツ銀行が倒産した場合、運用の継続が困難となり将来の投資成果を享受することができなくなるほか、担保が不足する場合や担保を処分する際に想定した価格で処分できない場合などがあることから、損失を被り、各コースの基準価額が下落する可能性があります。</p>	<p>各コースの投資対象である外国投資信託は、スワップ取引の相手方（カウンターパーティ）となるドイツ銀行ロンドン支店（以下「ドイツ銀行」といいます。）に保有資産の大部分を証拠金として差し入れることで、高配当株戦略指数の投資損益をドイツ銀行から提供されます。外国投資信託は、ドイツ銀行が取引する高配当株戦略指数にかかる株式や為替予約取引について、何ら直接の権利を有しません。ドイツ銀行は、証拠金とほぼ同額の 現金を担保として外国投資信託に差し入れます。ドイツ銀行が倒産などに陥った場合は当該担保をもって外国投資信託の債権保全を図りますが、担保が不足したり、運用の継続が困難となり将来の投資成果を享受できなくなる場合などがあることから、損失を被り、各コースの基準価額が下落する可能性があります。</p>

以上

- 本件に関してご不明な点は、下記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 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

※お客さまの残高などお取引に関するお問い合わせは、お取引いただいている販売会社までお願いいたします。