

2024年3月

受益者の皆さまへ

SOMPOアセットマネジメント株式会社

「米国株式自動配分戦略ファンド」 信託約款の変更(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。
平素は弊社の投資信託をご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。

さて、弊社では、「米国株式自動配分戦略ファンド」(以下「当ファンド」といいます。)につ
きまして、信託約款の変更を予定しておりますのでご案内申し上げます。
信託約款の変更内容、手続き等につきましては、後掲する詳細をご参照ください。

なお、今般の信託約款の変更賛成いただける場合、特別なお手続きは必要ありません。

賛成いただけない方のみ、後掲「5. 書面決議にあたっての議決権行使の方法」をご確認のう
え、お手続きください。

何卒、ご理解を賜りますよう、宜しくお願ひ申し上げます。

敬具

[本件に関するお問い合わせ先]

SOMPOアセットマネジメント株式会社 リテール営業部
電話番号 0120-69-5432 (受付時間: 平日*の午前9時~午後5時)
※土曜、日曜、祝日、振替休日、国民の休日、年末年始(12/31~1/3)を除いた日

*お客さまの個別のお取引内容については、お取引先の販売会社へお問い合わせください。

1. 変更理由

今般、当ファンドの主な投資対象である国内籍投資信託「米国株式自動配分戦略ファンド(適格機関投資家向け)」(以下、「国内籍投資信託」といいます。)の運用を行うパークレイズ投信投資顧問株式会社より、商品性の向上等を目的に、投資対象に「担保付パフォーマンス連動債券(米ドル建て)」を追加する等、主な投資対象の変更を含む約款変更手続きの通知を受けました。弊社では、当該変更が既存受益者の利益に資すると判断し、当ファンドの信託約款についても、同内容に対応する約款変更を行う方針といたしました。

2. 変更内容

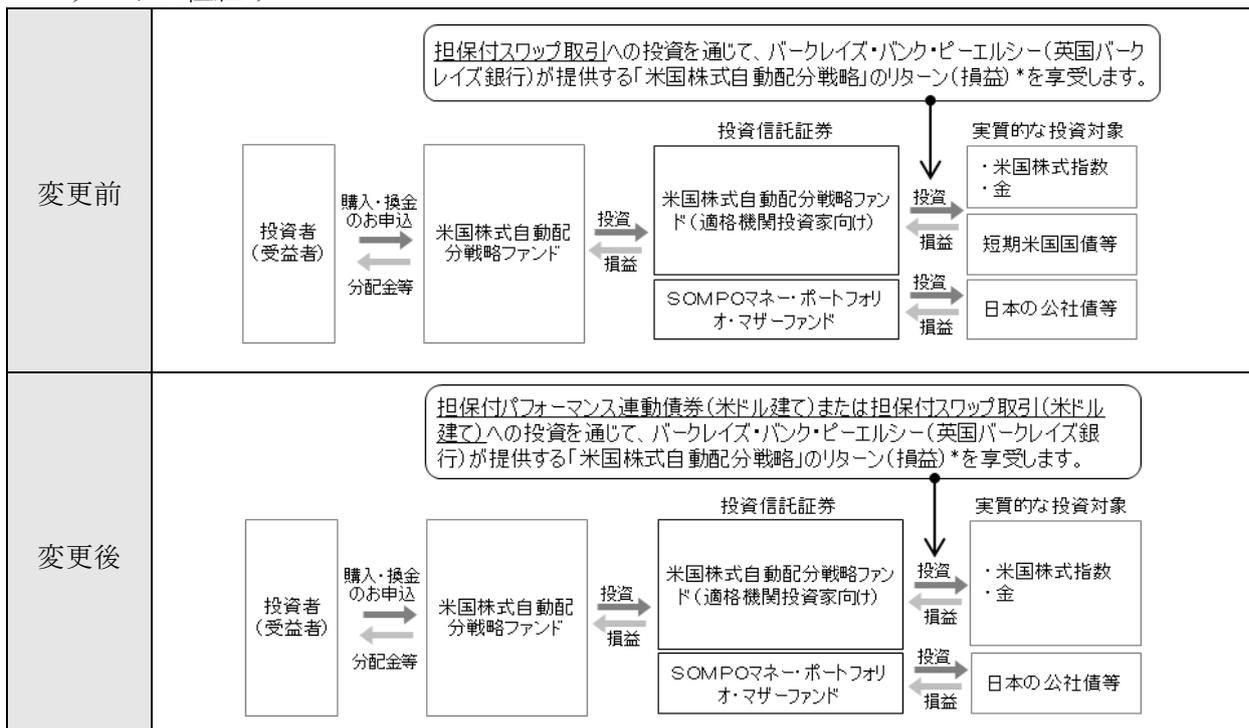
当ファンドの主な投資対象である国内籍投資信託の投資対象の変更に伴い、当ファンドの信託約款における「運用の基本方針」に以下下線部の記載を追加します。

(信託約款の変更内容は、後掲「別紙：<ご参考> 信託約款新旧対照表」をご参照ください。)

運用の基本方針	
2. 運用方針	
(2) 投資態度	
①	主として別に定める投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長を目指します。
②	原則として、別に定める投資信託証券のうち国内籍投資信託 [※] への投資比率は高位を維持することを基本とします。
③	<u>別に定める投資信託証券のうち国内籍投資信託は担保付パフォーマンス連動債券(米ドル建て)への投資および担保付スワップ取引(米ドル建て)への投資のいずれかの運用方法、または双方を組み合わせた運用方法により、米国株式自動配分戦略のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。選択する運用方法、運用方法の組み合わせは、効率性等を勘案の上、決定します。</u>
	(略)

※国内籍投資信託とは「米国株式自動配分戦略ファンド(適格機関投資家向け)」を指します。

<ファンドの仕組み>



<ご参考>国内籍投資信託における変更内容

■主な投資対象

変更前	オンバランスでは米ドル建ての短期金融資産等を、オフバランスでは担保付スワップ取引（米ドル建て）（以下「スワップ取引」）を主要取引対象とします。 なお、運用目標を達成するために委託者が必要と認める場合は、代替資産としてETF、先物、リパッケージ債等に投資する場合があります。
変更後	オンバランスでは担保付パフォーマンス連動債券（米ドル建て）（以下、「連動債券」といいます。）および米ドル建ての短期金融資産等を、オフバランスでは担保付スワップ取引（米ドル建て）（以下「スワップ取引」）を主要取引対象とします。 なお、運用目標を達成するために委託者が必要と認める場合は、代替資産としてETF、先物、リパッケージ債等に投資する場合があります。

■運用の基本方針

変更前	<ul style="list-style-type: none"> スワップ取引への投資を通じて、<u>バークレイズ・バンク・ピーエルシー（英国バークレイズ銀行）が提供する「米国株式自動配分戦略」のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。</u> (略) 原則として、<u>信託財産の純資産総額に対するスワップ取引の想定元本の比率を高位に保ちます。</u> 現金部分は、主に米ドル建ての短期金融資産（短期米国国債等）に投資します。<u>現金部分の運用パフォーマンスは基準価額と「米国株式自動配分戦略」のパフォーマンスの乖離要因のひとつとなります。</u> (略)
変更後	<ul style="list-style-type: none"> <u>連動債券への投資およびスワップ取引への投資のいずれかの運用方法、または双方を組み合わせた運用方法により、バークレイズ・バンク・ピーエルシー（英国バークレイズ銀行）が提供する「米国株式自動配分戦略」のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。選択する運用方法、運用方法の組み合わせは、効率性等を勘案の上、決定します。</u> (略) 原則として、<u>連動債券の投資金額とスワップ取引の想定元本の合計が当ファンドの信託財産の100%程度となるように調整を行います。</u> (略)

■主な投資制限

変更前	<ul style="list-style-type: none"> <u>デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</u> (略)
変更後	<ul style="list-style-type: none"> <u>デリバティブは、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに米国株式自動配分戦略の投資対象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> (略)

■信託報酬等

変更前	純資産総額に対して年率0.231%（税抜0.21%） （略）
変更後	純資産総額に対して年率0.154%（税抜0.14%） （略）

3. その他の変更内容

前掲2.の変更に関する書面決議が可決された場合には、当ファンドを新NISA制度の「成長投資枠」の要件に適合させるため、信託期間の延長に関する信託約款の変更を合わせて行う予定です。こちらは今回の書面決議の対象となる議案には含まれません。

■信託期間

変更前	2033年2月24日まで ※委託会社は、信託約款の規定に基づき、信託期間を延長することができます。
変更後	無期限

※前掲2.の約款変更を行わない場合は、3.の約款変更も行いません。

4. 今後の手続きと日程

内容	日程	詳細
受益者の確定	2024年3月18日	左記時点の受益者が対象となります。
書面による 議決権行使の期限	2024年4月22日	2024年4月22日まで、書面により議決権を行使することができます。 ※詳細は後掲「5. 書面決議にあたっての議決権行使の方法」をご参照ください。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; text-align: center;">信託約款の変更に賛成いただける場合、 特別な手続きは必要ございません。</div>
書面による決議の日	2024年4月23日	期限までに受付けた議決権行使口数を集計します。 議決権を行使することができる <u>受益者の議決権の3分の2以上の賛成により可決</u> されます。 上記の議決権口数による賛成を得られず、本書面決議が否決された場合は、信託約款の変更は行いません。 この場合、速やかに受益者の皆さまにお知らせいたします。書面決議の結果は、弊社ホームページで閲覧いただけます。
信託約款変更適用日	2024年5月25日	約款変更が正式決定した場合、変更内容の適用を開始いたします。

5. 書面決議にあたっての議決権行使の方法

(1) 本信託約款の変更に賛成いただける場合

特別な手続きは必要ございません。

※受益者が議決権を行使しない場合（「議決権行使書面」を郵送しない場合）は、書面決議について賛成するものとさせていただきます。

(2) 本信託約款の変更に反対される場合

本書面および添付の「書面決議参考書類」等をご確認いただき、同封の「議決権行使書面」に必要事項をご記入のうえ、書面による議決権行使の期限（2024年4月22日）までに、弊社までご郵送ください。

<締切日> 2024年4月22日弊社必着（2024年4月23日以降の到着分は無効となります。）

<宛 先>（同封の返信用封筒をご利用ください。）

〒103-0027 東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル
SOMPOアセットマネジメント株式会社
投資信託業務部ディスクロージャーグループ

(3) ご注意事項

- ・受益者が、議決権を行使しない（「議決権行使書面」を委託会社へ送付しない）場合は、前掲1.の信託約款の変更（以下「議案」といいます。）について賛成するものとさせていただきますので、賛成いただける場合にはお手続きの必要はございません。
- ・本議案についての賛否の欄に記載がない議決権行使書面をご送付された場合には、本議案について賛成するものとさせていただきます。
- ・同一の受益者の方が同一の議案について、重複して議決権を行使された場合で、議決権の行使の内容が異なるときは、全ての議決権を無効とさせていただきますのでご了承ください。
- ・議決権を行使することができる受益者の受益権口数を確認するため、取扱販売会社に対して口数の確認を行います。その際、必要がある場合にはご本人確認のための書類をご提出いただくことがあります。
- ・信託約款の変更の決議に反対されたか否かにかかわらず、取扱販売会社において、平常通りご換金のお申込みを受付けます。

6. 反対受益者の買取請求手続き

ファンドは、議決権の行使期間中および書面決議後も、平常通りご換金のお申込みを受付けているため、反対受益者による買取請求は行いません。

個人情報の取扱いについて

書面決議にあたり、お客さまに関する情報を販売会社、受託銀行および委託会社（弊社）が共有することにご同意いただいたこととします。なお、本手続きにともない取得した個人情報は書面決議のためだけに利用いたします。

以上

別紙：＜ご参考＞ 信託約款新旧対照表

予定している信託約款変更の内容は、以下の通りです。

【追加型証券投資信託 米国株式自動配分戦略ファンド】

変更後	変更前
<p>運用の基本方針</p> <p>2. 運用方針</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>(略)</p> <p>③ <u>別に定める投資信託証券のうち国内籍投資信託は担保付パフォーマンス連動債券(米ドル建て)への投資および担保付スワップ取引(米ドル建て)への投資のいずれかの運用方法、または双方を組み合わせた運用方法により、米国株式自動配分戦略のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。選択する運用方法、運用方法の組み合わせは、効率性等を勘案の上、決定します。</u></p> <p>④ (略)</p> <p>⑤ 資金動向、市況動向、その他特殊な状況等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>	<p>運用の基本方針</p> <p>2. 運用方針</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>(略)</p> <p>(新設)</p> <p>③ (略)</p> <p>④ 資金動向、市況動向、<u>残存信託期間</u>その他特殊な状況等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
<p>【信託期間】</p> <p>第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から<u>第40条第1項および第2項、第42条第1項、第43条第1項および第45条第2項の規定による信託終了の日</u>までとします。</p>	<p>【信託期間】</p> <p>第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から<u>2033年2月24日</u>までとします。</p>
<p>第47条 <u>＜削除＞</u></p>	<p>【<u>信託期間の延長</u>】</p> <p>第47条 <u>委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。</u></p>