

平成 28 年 2 月

投資家の皆さまへ

アムンディ・ジャパン株式会社

「アムンディ・資産分散ファンド（愛称：ドリーム・チーム）」 信託終了（繰上償還）予定のお知らせ

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。また、平素より格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、このたび、追加型証券投資信託「アムンディ・資産分散ファンド（愛称：ドリーム・チーム）」（以下、「ファンド」といいます）につきまして、平成 18 年 9 月 29 日の設定以来、受益者の皆さまの長期的な資産運用の一助となるべく運用を行ってまいりましたが、平成 26 年 12 月 1 日に改正、実施された投資信託等の運用に関する規則の「分散投資規制」*について、弊社で検討を重ねた結果、当該規則の適用期限である平成 31 年 11 月 30 日までの間にファンドが規則を遵守できる可能性が低いと判断し、投資信託約款の「信託契約の解約」の規定に基づき、平成 28 年 4 月 22 日付にて信託終了（繰上償還）を予定しておりますので、お知らせいたします。

* 金融商品取引業等に関する内閣府令第 130 条第 1 項第 8 号の 2 に基づき、一般社団法人投資信託協会規則「投資信託等の運用に関する規則」第 17 条の 2 に定める「信用リスク集中投資回避のための投資制限」において、“一のもの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投資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 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないもの”とあります。

ファンドは、マザーファンドの主な投資対象ファンドである Lyxor Diversified Assets Subfund においてパフォーマンス・スワップ取引を行っております。当該スワップ取引の相手方であるソシエテ ジェネラルに対するデリバティブ等エクスポージャーの比率はほぼ 100%で、10%という制限比率を大きく上回っており、今後、当該規則を遵守してファンドの運用を継続することが非常に困難であると判断いたしました。

なお、法令に基づき、平成 28 年 2 月 5 日から平成 28 年 3 月 7 日までの期間、上記の信託終了（繰上償還）に対する異議申立てを受付けておりますが、平成 28 年 2 月 3 日までにファンドの取得をお申込みになり、これに伴い取得した受益権が対象となります。それ以降に取得した受益権については異議申立ての対象とはなりません。また、異議申立ての受益権口数の合計が、平成 28 年 2 月 5 日現在の受益権総口数の 2 分の 1 を超えた場合は、信託終了（繰上償還）を行いません。

敬具

記

■信託終了（繰上償還）に係る異議申立ての手続きおよび日程

- | | |
|----------------|---------------------------------|
| ①法定公告日 | 平成 28 年 2 月 5 日 日本経済新聞の朝刊に掲載 |
| ②異議申立期間 | 平成 28 年 2 月 5 日～平成 28 年 3 月 7 日 |
| ③信託終了（繰上償還）予定日 | 平成 28 年 4 月 22 日 |

ファンドへのご投資にあたりましては、上記の事情を十分ご認識のうえ、ご判断いただきますようお願い申し上げます。

以上