

証券投資信託約款変更のお知らせ

このたび弊社では、以下の追加型証券投資信託につきまして、投資信託約款を変更（約款変更）することについて、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を実施いたしますのでお知らせいたします。

1. 対象となる証券投資信託の名称

ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>
（以下、それぞれを「各ファンド」といいます。）

2. 約款変更の内容

①投資対象とする外国投資信託証券の変更

各ファンドの主要投資対象をケイマン諸島籍外国投資信託「ダブルライン・ケイマン・ユニット・トラストーダブルライン・シラー・エンハンスト・ケープ・サブファンド」（以下「ダブルライン・ファンド（ケイマン）」）からルクセンブルク籍外国投資法人「ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）ーダブルライン・シラー・エンハンスト・ケープ クラス I」（以下「ダブルライン・ファンド（ルクセンブルク）」）に変更いたします。

②投資態度の変更

ダブルライン・ファンド（ケイマン）においては、トータル・リターン・スワップを活用することで、「シラー・バークレイズ・ケープ米国セクター指数」に連動する投資成果の獲得を図っておりましたが、ダブルライン・ファンド（ルクセンブルク）では「シラー・バークレイズ・ケープ米国セクターⅡ指数」に連動する投資成果の獲得を図ります。

③購入・換金申込受付不可日

「ニューヨークの銀行の休業日」、「ケイマン諸島の銀行の休業日」を購入・換金申込不可日から削除し、「ルクセンブルクの銀行の休業日」、「12月24日」を追加いたします。

④購入申込受付の中止または取消し

投資を行った投資信託証券の換金が停止した場合に加え、「投資を行う投資信託証券の申込が停止した場合においても、購入申込受付を中止および既に受付けた申込の受付を取消す場合がある旨」を追加いたします。

3. 約款変更の理由

各ファンドは2017年4月28日に設定し、信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行ってまいりました。しかしながら、各ファンドが主要投資対象とする外国投資信託「ダブルライン・ファンド（ケイマン）」の運用資産残高が僅少な状態が続いており、当該外国投資信託の投資顧問会社であるダブルライン・オルタナティブズ・エル・ピーが企図する分散効果が期待できるポートフォリオの構築が困難な状態となっております。そのため主要投資対象を同社が類似戦略にて運用を行う「ダブルライン・ファンド（ルクセンブルク）」に変更することで、各ファンドの運用の継続を図りたいと考えております。投資対象ファンドの変更に伴い、今後の運用に関しては、投資対象

ファンドの設立国の違いによるファンド規制の変更はありますが、基本的な運用方針には大きな影響はありません。約款変更適用日以降、投資対象ファンドの入れ替えには、一定期間かかる予定です。入れ替えに当たって、投資対象ファンドの組入資産の売買によるコスト等が発生する等の影響はありますが、運用の安定的な継続を図ること、およびダブルライン・ファンド（ルクセンブルク）の運用管理報酬が既存の投資対象ファンドよりも低いことから、受益者の皆さまにとって有利であると判断いたしました。

4. 約款変更までの日程について

- ・ 受益者および受益権口数の確定日 : 2020 年 10 月 26 日
- ・ 書面による議決権行使期限 : 2020 年 11 月 24 日
- ・ 書面決議の日 : 2020 年 11 月 25 日
- ・ 約款変更適用日 : 2020 年 12 月 4 日

5. 書面決議の手続きについて

各ファンドの約款変更に関する手続きは、2020 年 10 月 26 日現在の受益者に対して、書面決議にて賛否を問う方法により行います。

本決議は、各ファンドの議案に議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上の賛成をもって可決されます。その場合、約款変更の届出を行い、2020 年 12 月 4 日より適用します。

なお、各ファンドは、議決権の行使期間中および書面決議後も、通常どおり一部解約のお申し込みを受付けることにより公正な価格が一部解約金として受益者に支払われます。そのため、本議案に反対された受益者が、各ファンドの受託会社に対し、受益権の買取請求を行うことはできません。

以上

2020 年 10 月 26 日

東京都千代田区丸の内一丁目 8 番 2 号
アセットマネジメント One 株式会社