

お客さま各位

アセットマネジメントOne株式会社

対象ファンドにおける機動的配分戦略(日次戦略)[※]の 一部変更に関するお知らせ

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。

平素は弊社の投資信託に格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、ご愛顧いただいております下記の対象ファンドにつきまして、機動的配分戦略(日次戦略)[※]における資産配分に関するルールを変更いたしますのでお知らせいたします。

本変更については、各対象ファンドにおける現在の信託約款で規定された範囲内の変更であるため、ファンドの目的や運用の基本方針を変更するものではありません。

また、受益者のみなさまへ特段のお手続きを求める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、今後とも弊社投資信託をご愛顧の程、よろしくお願い申し上げます。

※ 機動的配分戦略(日次戦略)：相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、安定資産、リスク性資産、現金等の比率を調整することで基準価額の下落の抑制をめざす戦略。

敬具

記

1. 対象ファンド

- ・ 投資のソムリエ
- ・ 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)
- ・ 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)
- ・ 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)
- ・ 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)
- ・ 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)
- ・ 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)
- ・ 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)
- ・ 投資のソムリエ<DC年金>
- ・ 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型
- ・ リスク抑制世界8資産バランスファンド
- ・ リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)
- ・ 世界8資産リスク分散バランスファンド(目標払出し型)

2. 変更の概要

- 資産配分ルールの変更

安定資産、リスク性資産の価格下落局面で現金等を積極的に活用することで、より安定的な運用を目指します。

	局面	投資行動	資産構成
1	リスク性資産の価格下落局面	リスク性資産を売却して現金等へ	安定資産と現金等
2	安定資産の価格下落局面	安定資産を売却して現金等へ	リスク性資産と現金等
3	安定資産、リスク性資産の価格下落局面	両資産を売却して現金等へ	現金等

*詳細につきましては別添の目論見書新旧対照イメージをご参照ください。

3. 適用日(予定)

2022年10月12日

4. 変更の背景

対象ファンドで用いております運用戦略は、過去大きな市場変動を乗り越え、おかげさまで多くの投資家さまのご支持を集めております。しかしながら昨今では、米国等における金融政策正常化の進展や、ロシアによるウクライナに対する軍事進攻といった地政学リスクの発生等により、金融市場が不安定化し金利が急騰する等、従来では無かった局面が頻発しております。

こうした不安定な環境下、対象ファンドにおいては機動的配分戦略(日次戦略)を一部変更し、安定資産、リスク性資産の価格下落局面では現金等を積極的に活用することで、受益者のみなさまのためより安定的な運用の実現を目指したいと考えております。

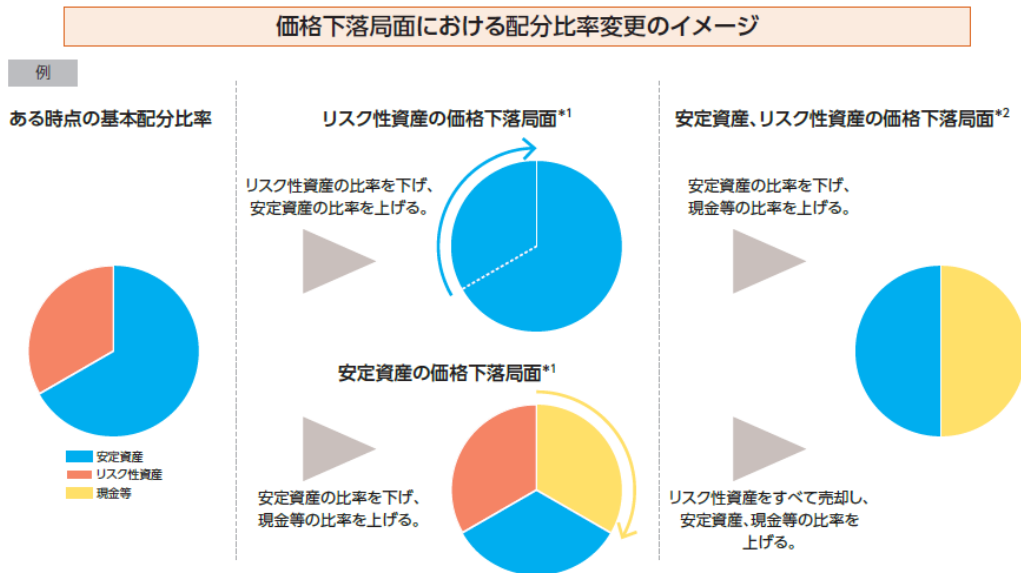
5. 受益者のみなさまが行うお手続き

本変更に関し、受益者のみなさまが関わるお手続きはございません。

以上

<ご参考> 交付目論見書「機動的配分戦略(日次戦略)」新旧対照イメージ

<変更前>



*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。

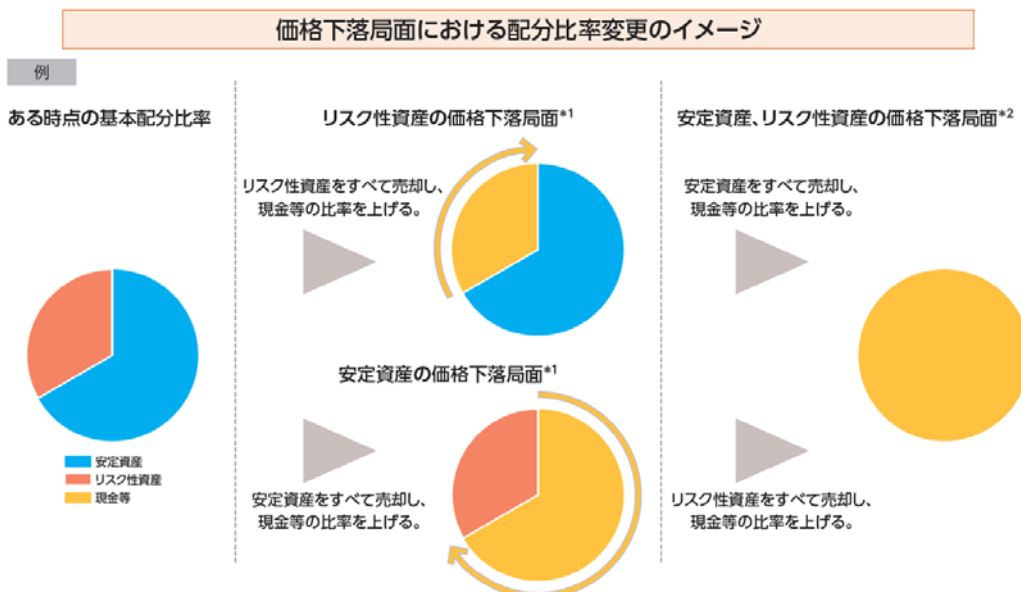
*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産をすべて売却し、基本配分比率の8資産の合計額のうち半分を現金等に入れ替えます。

※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合があります。

※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

<変更後>



*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。

*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産および安定資産をすべて売却し、現金等に入れ替えます。

※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合があります。

※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。