

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、投資信託約款の変更（約款変更）することについて、異議申立て手続き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

DLIBJ公社債オープン（短期コース）

DLIBJ公社債オープン（中期コース）

（以下、それぞれを「短期コース」、「中期コース」、または総称して「各ファンド」といいます。）

2. 約款変更の内容

各ファンドのポートフォリオのデュレーション調整について、デュレーションがマイナスとなる調整等を行うことができるという規定を削除するとともに、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を、「価格変動、金利変動および為替変動等により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的」に限定する変更を行います。

また、一般事業債等の組入銘柄の格付基準を見直し、以下の通り変更します。

変更前：格付業者2社（R&I または JCR）による発行体格付（長期優先債務格付）がBBB-以上の債券

変更後：格付業者4社（R&I、JCR、Moody's または S&P）による銘柄格付（銘柄格付がない場合は発行体格付）がBBB-（またはBaa3）以上の債券

3. 約款変更の理由

各ファンドは1999年12月14日に設定され、主として国内の公社債に投資し、中長期的な観点でリスクの軽減に努めながら信託財産の成長をはかるとともに、ベンチマーク（短期コースは「NOMURA-BPI国債・短期（1-3）」、中期コースは「NOMURA-BPI総合」）を上回る運用成果の実現をめざしてまいりました。

今般、上記の運用成果の実現および基準価額の防衛等リスク管理の観点から、各ファンドにおけるデリバティブ取引の利用について再検討し、デュレーションがマイナスとなるような調整は必要ではないとの判断に至りました。このため、ポートフォリオのデュレーション調整等について一部変更を行うとともに、デリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を明確にします。これにより、2024年1月から開始された少額投資非課税制度（NISA）の特定非課税管理勘定（成長投資枠）における「デリバティブ取引に係る権利に対する投資」の要件も充足することとなります。

また、当該変更に合わせて、投資ユニバースの拡大による収益機会の増加を目的として、一般事業債等の組入銘柄の格付基準を見直すものです。

上記の変更は、重大な約款変更該当すると考えていることから、信託約款の規定に基づき異議申立ての手続きをとることといたしました。

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 : 2024年4月5日
- ・ 異議申立期間 : 2024年4月5日～2024年5月20日
- ・ 約款変更の可否判断日 : 2024年5月21日
- ・ 買取請求期間 : 2024年5月29日～2024年6月17日
- ・ 約款変更適用日（予定） : 2024年6月22日

5. 異議申立て手続きについて

2024年4月5日現在の受益者で、上記の約款変更についてご異議のある方は、2024年4月5日から2024年5月20日までに、各ファンドの委託者である弊社に対し書面によりその旨をお申し出ください。

上記期間中に異議申立てされた受益者の受益権の口数が、2024年4月5日時点の受益権総口数の2分の1を超えない場合は、約款変更の届出を行い、2024年6月22日より適用します。

この場合、異議申立てをされた受益者は、買取請求期間中に、自己に帰属する受益権を当該受益権が有すべき公正な価額（受託会社が買取請求書を受理した日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額）で、各ファンドの受託会社に対し、当該受益権に係る投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

以上

2024年4月5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