

2021年9月10日

受益者のみなさまへ

りそなアセットマネジメント株式会社

りそなラップ型ファンド（安定型）／（安定成長型）／（成長型） 投資信託約款変更（予定）に関するお知らせ

拝啓 時下ますますご清栄のこととお慶び申し上げます。また、平素は格別のご高配を賜り厚く御礼申し上げます。

この度、ご投資いただいております「りそなラップ型ファンド(安定型)／(安定成長型)／(成長型)」につきまして、投資信託の約款変更(中長期的な運用収益目標における円短期金利の変更)を予定しておりますので、お知らせいたします。

なお、本変更は、ファンドの基本的な性格を変更させるものではなく、重大な約款変更等には該当しないため、受益者のみなさまのお手続きは不要です。

今後も信託財産の成長を目指して運用を行ってまいりますので、引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

記

1. 投資信託約款の変更を行う追加型証券投資信託

- ・りそなラップ型ファンド(安定型)『愛称:R246(安定型)』
 - ・りそなラップ型ファンド(安定成長型)『愛称:R246(安定成長型)』
 - ・りそなラップ型ファンド(成長型)『愛称:R246(成長型)』
- ※以下、上記の追加型証券投資信託を合わせて、「本ファンド」といいます。

2. 予定している投資信託約款の変更内容

運用の基本方針(2.運用方法)の中で、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標に記載している円短期金利の指標について、「3カ月円LIBOR」から「無担保コールO/N物レート(確報)」に変更します。

なお、変更内容の詳細については、別紙をご覧ください。

3. 変更理由

本ファンドは、「円短期金利+2%」、「円短期金利+4%」、「円短期金利+6%」という3つの目標リターンを明示している目標リターン明示型のファンドであり、円短期金利は「3ヵ月円LIBOR^{※1}」を用いています。今般、LIBORを監督している英国金融行為規制機構(FCA)より2021年12月末をもってLIBORの公表を停止するとの発表があり、運用収益目標における円短期金利について見直しが必要となりました。

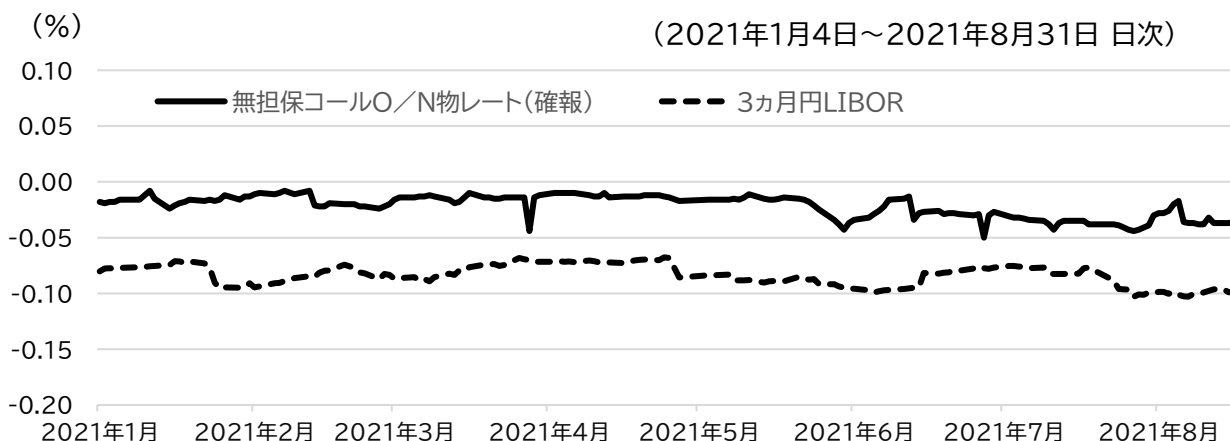
これに伴い、日本銀行が算出・公表し、本国において広く使用されている「無担保コールO/N物レート(確報)^{※2}」を円短期金利の代替指標として採用するものです。

※1:ロンドン銀行間取引金利のことで、インターコンチネンタル取引所(ICE)が、毎営業日算出・公表しています。短期金利の代表的な指標の一つです。

※2:無担保コールO/N物レート(確報)とは、コール市場における無担保での資金貸借のうち、約定日に資金の受払を行い、翌営業日を返済期日とするものにかかる金利のことで、日本銀行が毎営業日算出・公表しています。短期金利の代表的な指標です。

<ご参考>

過去の「無担保コールO/N物レート(確報)」と「3ヵ月円LIBOR」の推移



出所:ブルームバーグのデータをもとに、りそなアセットマネジメント作成

4. 変更予定日

2021年10月26日

5. 本ファンドへの影響

本変更は、円短期金利指標の公表停止のための代替指標への変更であり、ファンドの基本的な性格を変更させるものではなく、運用に与える影響はございません。また、重大な約款変更等には該当しないため、受益者のみなさまのお手続きは不要です。

以上

<別紙 証券投資信託約款変更 新旧対照表(各ファンド)>

各ファンドともに下表をご参照ください。

新	旧
運用の基本方針	運用の基本方針
<p>2. 運用方法</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① (略)</p> <p>②各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標(円短期金利※1+○^(注)%※2(年率))の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。</p> <p>※1 <u>無担保コールO/N物レート(確報)</u>です。</p> <p>※2 信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。</p> <p>(後略)</p>	<p>2. 運用方法</p> <p>(2) 投資態度</p> <p>① (略)</p> <p>②各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標(円短期金利※1+○^(注)%※2(年率))の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。</p> <p>※1 <u>3ヵ月円LIBOR</u>です。</p> <p>※2 信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。</p> <p>(後略)</p>

(注)各ファンドの運用収益目標は、リソナラップ型ファンド(安定型)は「円短期金利+2%(年率)」、リソナラップ型ファンド(安定成長型)は「円短期金利+4%(年率)」、リソナラップ型ファンド(成長型)は「円短期金利+6%(年率)」となります。