

平成 25 年 11 月 11 日

受益者の皆様へ

DIAMアセットマネジメント株式会社

追加型証券投資信託「DIAM資産形成ファンド（隔月決算型）」

投資対象マザーファンドの投資信託約款の変更予定のお知らせ

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。

また、平素は格別のお引立てを賜わり、厚く御礼申し上げます。

さて、弊社では追加型証券投資信託「DIAM資産形成ファンド（隔月決算型）」（以下「ファンド」といいます）の投資対象である親投資信託「国内債券アクティブ・マザーファンド」につきまして、運用の基本方針（投資態度）に関する投資信託約款の変更を行う予定ですので、通知申し上げます。

詳細につきましては次ページ以降の内容をご確認ください。

なお、今般の投資信託約款の変更についてご異議が無い場合は、特にお手続きの必要はございません。

何卒ご理解のほど、よろしくお願い申し上げます。

敬具

## 1. 投資信託約款変更（予定）の投資信託の名称

「国内債券アクティブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）

## 2. マザーファンドの投資信託約款の変更の内容

以下の内容を変更することといたします。（下線部が変更箇所です）

変更後	変更前
運用の基本方針 2. 運用方法 （2）投資態度 ③各リスクについての考え方は、以下の通りです。 ・金利リスク：次のように対応します。 a. <u>ポートフォリオのデュレーションは、原則として1年～ベンチマークのデュレーション+3年程度の範囲で調整します。</u> ただし、基準価額の防衛等リスク管理の観点から、デュレーションがマイナスとなるような調整を行う場合があります。なお、デュレーションの水準によっては、信託財産の純資産総額に対する実質組入比率がマイナスになる場合があります。 （以下 略）	運用の基本方針 2. 運用方法 （2）投資態度 ③各リスクについての考え方は、以下の通りです。 ・金利リスク：次のように対応します。 a. <u>ポートフォリオのデュレーションは、原則として1年～8年程度の範囲で調整します。</u> ただし、基準価額の防衛等リスク管理の観点から、デュレーションがマイナスとなるような調整を行う場合があります。なお、デュレーションの水準によっては、信託財産の純資産総額に対する実質組入比率がマイナスになる場合があります。 （以下 略）

## 3. マザーファンドの投資信託約款の変更の理由

当マザーファンドは、「NOMURA-BPI総合<sup>※1</sup>」をベンチマークとして運用しております。マザーファンドのデュレーション<sup>※2</sup>については当マザーファンドの運用が開始された2006年当時のベンチマークのデュレーションが5年程度であったことから、+3年程度を上限として運用することを想定し、「1年～8年程度の範囲」としておりました。

しかしながら、近年、超長期債の起債の増加に伴いベンチマークのデュレーションが長期化しており、足元は7.5年程度まで伸びております。

現在の約款上の記載のままでは、マザーファンドの当初の運用コンセプト通りの運用が困難になると考え、上記の変更を行うことといたしました。

※1 NOMURA-BPI 総合は、日本の債券市場全体の動向を反映する投資収益指数（パフォーマンス指数）です。当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※2 デュレーションとは、「金利変動に対する債券価格の変動性」を意味するもので、デュレーションが長いほど金利変動に対する感応度が高くなります。

## 4. マザーファンドの投資信託約款の変更手続きおよび変更予定日程

①公告日（電子公告 <sup>※</sup> ）	平成 25 年 11 月 11 日
②異議申立期間	平成 25 年 11 月 11 日から平成 25 年 12 月 20 日まで
③買取請求期間	平成 26 年 1 月 8 日から平成 26 年 1 月 27 日まで
④投資信託約款の変更実施予定日	平成 26 年 2 月 7 日

※ 当マザーファンドの公告は電子公告の方法により行い、当社のホームページ上（<http://www.diam.co.jp/>）に掲載します。

## 5. 異議申立に係る手続きについて

公告日（平成 25 年 11 月 11 日）現在の当ファンドの受益者（平成 25 年 11 月 7 日までに取得のお申込をなされた方）で、「2. マザーファンドの投資信託約款の変更の内容」に記載された投資信託約款の変更にご異議のある受益者の方は、異議申立期間中に、自己の保有される口数について D I A M アセットマネジメント株式会社に対して書面をもって異議を申し立てることができます。

異議申立期間中に異議申立をされた受益者の受益権口数（当マザーファンドを投資対象とする全てのファンド（当ファンドを含む）の受益者のうち、上記期間中に異議申立をされた受益者の受益権口数を当マザーファンドにおける実質的な受益権の口数に換算させていただきます。以下同じ。）の合計が、公告日におけるマザーファンドの信託約款に係る受益権総口数の 2 分の 1 を超えないときは、平成 26 年 1 月 7 日に投資信託約款の変更の届出を行い、平成 26 年 2 月 7 日より適用いたします。なお、この場合、投資信託約款の変更を行う旨を D I A M アセットマネジメント株式会社のホームページにてお知らせします。

また、異議申立をされた受益者の受益権口数の合計が、公告日におけるマザーファンドの信託約款に係る受益権総口数の 2 分の 1 を超えた場合は、投資信託約款の変更を行いません。この場合、投資信託約款の変更を行わない旨およびその理由を、異議申立期間終了後、速やかに電子公告の方法により公告し、これらの事項を記載した書面を受益者の皆様に送付いたします。

### ○異議申立の方法について

予定しております投資信託約款の変更に対し、ご異議が無い場合は特にお手続きは必要ございません。

予定しております投資信託約款の変更に対してご異議のある受益者は、以下の内容を書面にご記入の上、平成 25 年 12 月 20 日までに D I A M アセットマネジメント株式会社宛にご送付ください。平成 25 年 12 月 20 日までに D I A M アセットマネジメント株式会社に到着したものを有効とさせていただきますのでご了承ください。

(1) 宛先 〒100-0005 東京都千代田区丸の内 3-3-1 新東京ビルディング 5 階  
D I A M アセットマネジメント株式会社  
商品企画部内 投資信託約款変更に関する異議申立受付窓口

(2) ご記入いただく内容

- ①住所または所在地
- ②氏名または社名（署名、捺印）
- ③電話番号（日中連絡先）
- ④ファンド名
- ⑤販売会社の名称、取扱部支店名、口座番号
- ⑥投資信託約款を変更することについて反対する旨  
（例：「上記受益権について、投資信託約款の変更に関する異議を申し立てます。」）

- ※ 当ファンドに関し、複数の販売会社で口座をお持ちの方、同一販売会社であっても複数口座をお持ちの方は、保有する全ての販売会社、取扱部支店名、口座番号をご記入ください。
- ※ このお知らせは、公告日現在、「D I A M 資産形成ファンド（隔月決算型）」の受益権を有する受益者にお送りしています。
- ※ 受益者の取引情報につきましては、D I A M アセットマネジメント株式会社では持ち合わせておりません。お取引情報につきましては、販売会社までお問い合わせいただきますよう、お願い申し上げます。
- ※ 取扱部支店名や口座番号が欠落している場合や、お名前およびご住所が販売会社へご登録されているものと異なる場合等、異議申立の書面の記入内容に不備等がある場合には、ご異議のお申し立てが無効となる場合がありますのでご注意ください。
- ※ 異議申立された受益者の受益権口数の確認のため、販売会社に対して口数等の確認を行います。

なお、その際、必要がある場合にはご本人様ご確認のための書類等をご提出いただくことがあります。

- ※ ご異議のお申出にあたり、お客様に関する情報を販売会社、受託銀行（再信託受託会社を含みます。）および委託会社（D I A Mアセットマネジメント株式会社）が共有することにご同意いただいたことといたします。なお、本手続きに伴い取得した個人情報（異議申立および買取請求に関する事務）を処理するために利用いたします。

## 6. 異議申立をされた受益者の買取請求手続きについて

異議申立をされた受益者の受益権口数の合計が、公告日（平成 25 年 11 月 11 日）におけるマザーファンドの信託約款に係る受益権総口数の 2 分の 1 を超えず、投資信託約款の変更が行われることとなった場合には、異議申立をされた受益者は、以下の手続きにより保有する受益権について、信託財産による買い取りを請求することができます。

- ① 買取請求受付期間 平成 26 年 1 月 8 日から平成 26 年 1 月 27 日まで
- ② D I A Mアセットマネジメント株式会社より異議申立の受益者に対し「買取請求のご案内」発送
- ③ 買取請求必要書類のご記入
- ④ 買取請求必要書類を販売会社の取扱部支店へご提出
- ⑤ 販売会社およびD I A Mアセットマネジメント株式会社を経由し、受託銀行（みずほ信託銀行株式会社）での買取請求必要書類の受理
- ⑥ 当該信託財産による買い取りの実行
- ⑦ 受託銀行（みずほ信託銀行株式会社）からご指定銀行口座へのお受取金額のお振り込み

※ ご異議を申し立てられた受益者が必ず買取請求しなければならないわけではございません。

※ 異議申立期間中、買取請求受付期間中ともに、通常通り、当ファンドのご解約のお申込みを受け付けます。ただし、上記の買取請求を行った受益権については、解約のお申込みを行うことはできなくなりますのでご注意ください。

※ 上記の買取請求は、投資信託約款の変更に対しご異議を申し立てられた受益者が、「平成 19 年 9 月 30 日の改正前の投資信託及び投資法人に関する法律」第 30 条の 2 に基づいて受託銀行（みずほ信託銀行株式会社）に対して行うものであり、販売会社に対して行うものではありません。

※ 買取価額は、当該受益権が有すべき公正な価額となります。本件においては、原則として受託銀行（みずほ信託銀行株式会社）が買取請求必要書類を受理した日（上記⑤）の解約価額となります。なお、買取請求必要書類を販売会社の取扱部支店へご提出された日と受託銀行（みずほ信託銀行株式会社）が受理する日は異なる場合があります。

※ 受益者ご自身での納税手続きが必要になる場合がありますので、ご注意ください。

※ お受取金額は、上記買取価額から振込手数料および買取計算書郵送費用（郵便料金、簡易書留手数料）を差し引いた金額となります。また、このような諸般の手続きが必要となるため、お受取金額のお支払いまでには、通常の解約請求よりも日数を要する場合があります。

※ 買取請求された受益権に質権等の第三者による権利が設定されている場合等、受託銀行（みずほ信託銀行株式会社）の知り得ない事由が存在する場合において、買取代金のご指定口座への振込により、当該第三者の利益を損ねる場合があっても、受託銀行（みずほ信託銀行株式会社）およびD I A Mアセットマネジメント株式会社は一切責任を負いませんのでご承知おきください。

以上

本状に関しましてご不明な点がございましたら、下記までお問い合わせください。  
D I A Mアセットマネジメント株式会社  
コールセンター：0120-506-860（営業日の午前 9 時から午後 5 時まで）