

投資家の皆様へ

T&Dアセットマネジメント株式会社

ロボット戦略 世界分散ファンド(愛称:資産の番人) 目論見書における記載の変更について

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

ロボット戦略 世界分散ファンド(愛称:資産の番人)(以下、「ファンド」といいます。)における 2023 年 5 月 20 日改訂の目論見書にて、下記の通り記載内容を変更いたしました。

なお、今回の記載内容の変更によって、「高度なテクノロジーに裏付けされた戦略に基づき、世界中の市場を対象として次世代型超分散ポートフォリオを構築する」との方針に変更はありません。また、投資家の皆様の負担が増えるものでもありません。

今後ともお引き立てを賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

① 投資対象市場数の表示

交付目論見書 1 ページ

【変更後】

投資対象市場について

ファンドは世界中の株価指数、債券・金利、通貨、コモディティ等を投資対象とし、多数の市場に幅広く分散して投資します。

株価指数 (先進国および新興国の 株価指数先物市場)	債券・金利* (先進国および新興国の 債券・金利先物市場)	通貨 (先進国および新興国の 通貨先物・通貨先渡市場)	コモディティ (コモディティ市場)
米国 ナスダック100 米国 S&P500 日本 日経225 日本 TOPIX 英国 FTSE 100 ドイツ DAX オーストラリア ASX SPI200 香港 ハンセン インド Nifty VIX(ボラティリティ・インデックス) 等	米国国債 日本国債 オーストラリア国債 英国国債 カナダ国債 ドイツ国債 フランス国債 イタリア国債 等	米ドル ユーロ 日本円 英ポンド オーストラリアドル ブラジルレアル メキシコペソ 中国元 インドルピー 等	ブルームバーグ商品指数 等

*債券・金利は長期・短期さまざまな年限に投資します。
上記はファンドの投資対象市場の例です。変更となる可能性もあります。また正式名称ではありません。

【変更前】

投資対象市場について

ファンドは世界中の株価指数、債券・金利、通貨、コモディティ等を投資対象とし、100以上の市場に幅広く分散して投資します。

株価指数 (先進国および新興国の 株価指数先物市場)	債券・金利* (先進国および新興国の 債券・金利先物市場)	通貨 (先進国および新興国の 通貨先物・通貨先渡市場)	コモディティ (コモディティ市場)
米国 ナスダック100 米国 S&P500 日本 日経225 日本 TOPIX 英国 FTSE 100 ドイツ DAX オーストラリア ASX SPI200 香港 ハンセン インド Nifty VIX(ボラティリティ・インデックス) 等	米国国債 日本国債 オーストラリア国債 英国国債 カナダ国債 ドイツ国債 フランス国債 イタリア国債 等	米ドル ユーロ 日本円 英ポンド オーストラリアドル ブラジルレアル メキシコペソ 中国元 インドルピー 等	ブルームバーグ商品指数 等

*債券・金利は長期・短期さまざまな年限に投資します。
上記はファンドの投資対象市場の例です。変更となる可能性もあります。また正式名称ではありません。

交付目論見書 3 ページ

【変更後】

**AHLの
“次世代型超分散ポートフォリオ”**

- ① 世界中の市場に分散投資
- ② 多数の投資対象市場
(株価指数、債券・金利、通貨、コモディティ等に分散)
- ③ 流動性の高い市場に限定
(先物市場や先渡市場に投資)
- ④ 売り建てを行うことが可能
(市場の下落局面も収益機会として捉えることが可能)
- ⑤ 市場環境に応じ自動的にリバランス
(コンピュータープログラムが利益確定や損切りを実施)

【変更前】

**AHLの
“次世代型超分散ポートフォリオ”**

- ① 世界中の市場に分散投資
- ② 100以上の投資対象市場
(株価指数、債券・金利、通貨、コモディティ等に分散)
- ③ 流動性の高い市場に限定
(先物市場や先渡市場に投資)
- ④ 売り建てを行うことが可能
(市場の下落局面も収益機会として捉えることが可能)
- ⑤ 市場環境に応じ自動的にリバランス
(コンピュータープログラムが利益確定や損切りを実施)

② 外国投資信託の運用報酬等の表示

交付目論見書 5 ページ

【変更後】

運用報酬	運用報酬：「日本円クラス(ヘッジ付)」の純資産総額に対して年率1.0%以内 成功報酬：「日本円クラス(ヘッジ付)」の成功報酬計上前の純資産総額がハイ・ウォーター・マークを上回った場合、その超過部分に対して15%以内
管理報酬	「マン・AHL・アルファ・コア・オルタナティブ」の純資産総額に対して年率0.2%以内 当該報酬には、管理事務代行報酬、保管報酬、登録および名義書換事務代行報酬等が含まれます。その他、管理会社報酬、監査費用、取引費用、弁護士費用等がかかります。

【変更前】

運用報酬	運用報酬：「日本円クラス(ヘッジ付)」の純資産総額に対して年1.0% 成功報酬：「日本円クラス(ヘッジ付)」の成功報酬計上前の純資産総額がハイ・ウォーター・マークを上回った場合、その超過部分に対して15%
管理報酬	「マン・AHL・アルファ・コア・オルタナティブ」の純資産総額に対して上限年0.2% 当該報酬には、管理事務代行報酬、保管報酬、登録および名義書換事務代行報酬等が含まれます。その他、管理会社報酬、監査費用、取引費用、弁護士費用等がかかります。

交付目論見書 12 ページ

【変更後】

投資対象とする 外国投資信託	<基本報酬> ・運用報酬 投資対象である外国投資信託において、外国投資信託の純資産総額に対して年率1.0%以内の運用報酬がかかります。 マン・AHL・アルファ・コア・オルタナティブの純資産総額に対して年率0.2%以内の管理報酬がかかります。 <成功報酬> 外国投資信託の純資産総額(基本報酬控除後、成功報酬計上前)がハイ・ウォーター・マークを上回った場合、その超過部分に対して15%以内の成功報酬がかかります。当該報酬は計算期間を通じて毎日計上され、年1回支払われます。 *ハイ・ウォーター・マークは外国投資信託の当初設定元または直近の決算日(最終営業日)において外国投資信託に成功報酬が発生した場合の成功報酬控除後の純資産総額となり、成功報酬計算期間を通じて毎日計算されます。計算期間内に外国投資信託に追加投資があった場合には当該追加投資金額分に応じて上昇し、解約があった場合には当該解約金額分に応じて減少します。 外国投資信託の信託報酬は、外国投資信託の運用の対価、運用財産の管理等の対価です。詳しくは、表紙記載の委託会社の照会先にお問い合わせください。
	年率2.212%(税抜2.12%)以内+成功報酬 ファンドが投資対象とする外国投資信託の信託報酬を加味して受益者が実質的に負担する信託報酬率について算出したものです。
実質的な負担	

【変更前】

投資対象とする 外国投資信託	<基本報酬> ・運用報酬 投資対象である外国投資信託において、外国投資信託の純資産総額に対して年1.0%の運用報酬がかかります。 ・管理報酬 マン・AHL・アルファ・コア・オルタナティブの純資産総額に対して、上限年0.2%程度の管理報酬がかかります。 <成功報酬> 外国投資信託の純資産総額(基本報酬控除後、成功報酬計上前)がハイ・ウォーター・マークを上回った場合、その超過部分に対して15%の成功報酬がかかります。当該報酬は計算期間を通じて毎日計上され、年1回支払われます。 *ハイ・ウォーター・マークは外国投資信託の当初設定元または直近の決算日(最終営業日)において外国投資信託に成功報酬が発生した場合の成功報酬控除後の純資産総額となり、成功報酬計算期間を通じて毎日計算されます。計算期間内に外国投資信託に追加投資があった場合には当該追加投資金額分に応じて上昇し、解約があった場合には当該解約金額分に応じて減少します。 外国投資信託の信託報酬は、外国投資信託の運用の対価、運用財産の管理等の対価です。
	年2.212%(税抜2.12%)程度+成功報酬 ファンドが投資対象とする外国投資信託の信託報酬を加味して受益者が実質的に負担する信託報酬率について算出したものです。
実質的な負担	

<本件に関するお問い合わせ先>

T&Dアセットマネジメント株式会社

電話:03-6722-4810 (投信営業部)

受付時間:営業日の午前9時～午後5時