

2018年12月3日

受益者の皆さまへ

三井住友アセットマネジメント株式会社

信用リスク集中回避のための投資制限にかかる対応について

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

下記ファンドにおきまして、一般社団法人投資信託協会の定める「投資信託等の運用に関する規則」第17条の2「信用リスク集中回避のための投資制限」に規定される「株式等エクスポージャー」の純資産総額に対する比率（※）が、一時的に基準値（10%）を超過しましたので、同規定に従い、基準値内へ収まるよう調整を実施、完了したことをお知らせいたします。

（※）同一発行体等の信用リスク等にさらされている資産の割合

同協会「投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する規則」第19条の2の規定に従い、下記の通り開示いたします。

記

該当ファンド：グローイング・フロンティア株式ファンド

対象発行体等	超過確認日（抵触日・比率）	基準値	調整終了確認日
National Bank of Kuwait	2018年8月14日 (7月31日時点 10.48%)	10%	2018年9月14日

以上



(ご参考)「一般社団法人 投資信託協会 定款・諸規則集」より抜粋

「投資信託等の運用に関する規則」

(信用リスク集中回避のための投資制限) 第 17 条の 2

金商業等府令第 130 条第 1 項第 8 号の 2 に定める信用リスクを適正に管理する方法としてあらかじめ金融商品取引業者等が定めた合理的な方法は、一の者に係るエクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率が次に掲げる区分(※)ごとにそれぞれ 10%、合計で 20%を超えることのないように運用すること、及び価格、金利、通貨若しくは投資信託財産の純資産総額の変動等により当該比率を超えることとなった場合に、超えることとなった日から 1 ヶ月以内に当該比率以内となるよう調整を行い、通常に対応で 1 ヶ月以内に調整を行うことが困難な場合には、その事跡を明確にした上で、できる限り速やかに当該比率以内に調整を行う方法とする。ただし、証券投資信託の設定当初、解約及び償還への対応並びに投資環境等の運用上やむを得ない事情があるときは、この限りでない。

※ (1) 株式等エクスポージャー (2) 債券等エクスポージャー (3) デリバティブ等エクスポージャー

※部分については、当社が注記したものです。

「投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する規則」

(信用リスク集中回避のための投資制限を超えた場合の開示) 第 19 条の 2

委託会社は、運用規則第 17 条の 2 第 1 項に定めるエクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率が同条同項各号に掲げる区分ごとにそれぞれ 10%、合計で 20% (以下「基準比率」という。) を超えることとなった場合 (中略) には、同条同項に定める調整が終了した後 3 ヶ月以内に、基準比率を超え、その後調整が終了した旨を当該委託会社のホームページその他の方法により開示するものとする。