

東京海上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」についてのお知らせ

平素は弊社投資信託商品に格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

弊社が設定・運用しております以下の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「デリバティブ等エクスポージャー」が、基準比率である10%を超過することとなったため、同条の規定にしたがって基準比率以内となるよう調整を行いました。

同協会の定める「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「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」の規定に基づき、ここにお知らせいたします。

記

対象ファンド 東京海上 Rogge 世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)
ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)

銘柄等	超過日	調整終了日
直物為替先渡取引 (NDF) の純資産総額に対する評価益	2022年6月22日	2022年7月6日

以上