

2016年9月15日

ご投資家の皆様へ

BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社

世界スマート債券ファンド 円投資型 1306 及び 1310 月次レポートの訂正とお詫び

平素より格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、弊社が作成いたしましたケイマン籍「世界スマート債券ファンド 円投資型 1306 及び 1310」に関する月次レポートの記載内容に一部誤りがあることが判明いたしました。

皆様に大変ご迷惑をおかけしましたことを深くお詫び申し上げますとともに、以下の通り、訂正内容についてご報告申し上げます。

今後、再発防止に向けて適切な措置を取る所存でございます。何卒、ご理解と変わらぬご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<対象となるファンド>

ファンド名： 世界スマート債券ファンド 円投資型 1306 (以下 1306 と表記)
世界スマート債券ファンド 円投資型 1310 (以下 1310 と表記)

<対象となる月次レポートの基準日>

基準日： 2016年4月28日
基準日： 2016年5月31日
基準日： 2016年6月30日

<誤記載の概要>

対象となるファンドの上記各基準日の月次レポートに関しまして、掲載されている「平均最終利回り」及び「平均最終利回り (円ヘッジ)」の数値に誤りがあることが判明いたしました。

具体的には、2016年4月に実施した月次レポートに使用するデータの算出システム更新の際に、本来は「平均最終利回り」の集計対象ではない為替関連取引等を含む誤った算出方法に変更した為に、4月、5月、6月のレポートに誤った数値を記載していたものです。

つきましては副投資運用会社であるスタンディッシュ・メロン・アセット・マネジメントが、月次レポートに使用するデータの修正を行い、対象となる月次レポート (2016年4月、5月、6月) の、「平均最終利回り」及び平均最終利回りを基に算出する「平均最終利回り (円ヘッジ)」を訂正させていただきます (詳細は次葉をご参照願います)。

(以下、次葉)

<訂正させていただく内容>

各月報の2ページ目の下段に記載されている「ポートフォリオの主な特性」における「平均最終利回り」と「平均最終利回り（円ヘッジ）」を以下の通り訂正させていただきます（訂正内容は1306、1310共通です）。

（訂正前）

（訂正後）

月報の基準日： 2016年4月28日

組入銘柄数	162
平均クーポン	2.62%
平均最終利回り	2.06%
平均最終利回り(円ヘッジ)	1.58%
平均デュレーション	5.64年
平均残存年数	8.19年
平均格付	AA-

→

組入銘柄数	162
平均クーポン	2.62%
平均最終利回り	1.90%
平均最終利回り(円ヘッジ)	1.42%
平均デュレーション	5.64年
平均残存年数	8.19年
平均格付	AA-

月報の基準日： 2016年5月31日

組入銘柄数	162
平均クーポン	2.59%
平均最終利回り	2.16%
平均最終利回り(円ヘッジ)	1.64%
平均デュレーション	5.46年
平均残存年数	8.63年
平均格付	AA-

→

組入銘柄数	162
平均クーポン	2.59%
平均最終利回り	1.77%
平均最終利回り(円ヘッジ)	1.25%
平均デュレーション	5.46年
平均残存年数	8.63年
平均格付	AA-

月報の基準日： 2016年6月30日

組入銘柄数	170
平均クーポン	2.64%
平均最終利回り	2.08%
平均最終利回り(円ヘッジ)	1.56%
平均デュレーション	6.87年
平均残存年数	9.02年
平均格付	A+

→

組入銘柄数	170
平均クーポン	2.64%
平均最終利回り	1.68%
平均最終利回り(円ヘッジ)	1.16%
平均デュレーション	6.87年
平均残存年数	9.02年
平均格付	A+

<再発防止策>

今後、データの算出システムの変更や更新等が生じる場合には、事前に副投資運用会社であるスタンディッシュ・メロン・アセットマネジメントから弊社BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパンへ情報が的確に連携される体制を構築し、月次レポート掲載前に弊社によるデータの妥当性を検証、確認する体制を強化することで、再発防止に努めて参ります。

以上