

重要情報シート (個別商品編)

[使用開始日：20240217]

1 商品等の内容 当社は、組成会社等の委託を受け、お客さまに商品の販売の勧誘を行っています

| | |
|---------------------|--|
| 金融商品の名称・種類 | B NYメロン・米国株式ダイナミック戦略ファンド 愛称：亜米利加 |
| 組成会社（運用会社） | B NYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社 |
| 販売委託元 | B NYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社 |
| 金融商品の目的・機能 | 米国の製造業に関連した株式に投資を行うと同時に、米国の株価指数先物取引および為替先渡取引等を活用することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 商品組成に携わる事業者が想定する購入層 | この商品は中長期での資産形成を目的とし、元本割れリスクを許容する方で、商品に対する知識や投資経験がある、もしくは説明を受け商品性をご理解いただける方を想定しております。 |
| パッケージ化の有無 | パッケージ化商品ではありません。 |
| クーリング・オフの有無 | クーリング・オフ（契約日から一定期間、解除できる仕組み）の適用はありません。 |

| | |
|------------------------|--|
| 次のようなご質問があればお問い合わせください | <p>①あなたの会社が提供する商品のうち、この商品が、私の知識、経験、財産状況、ライフプラン、投資目的に照らして、ふさわしいという根拠は何か。</p> <p>②この商品を購入した場合、どのようなフォローアップを受けることができるのか。</p> <p>③この商品が複数の商品を組み合わせたものである場合、個々の商品購入と比べて、どのようなメリット・デメリットがあるのか。</p> |
|------------------------|--|

2 リスクと運用実績 本商品は、元本が保証されず、損失が生じるリスクがあります

| | |
|----------------|---|
| 損失が生じるリスクの内容 | <p>実質的な米国株式の組入比率の調整に関するリスク：デリバティブを用いて実質的な米国株式および米ドルの組入比率を-50%～+150%でコントロールするため、実質投資割合が純資産総額を超える場合があり、投資判断と反対方向に市場が動いた場合には、想定以上に損失による影響を受ける場合があります。また、実質的な投資割合が-50%の場合は、米国株式市場全体が上昇しても基準価額が下落する場合があります。</p> <p>為替変動リスク：為替相場の変動による影響を受けます。</p> <p>価格変動リスク：運用資産の市場価格の変動による影響を受けます。</p> <p>株式の発行企業の信用リスク：投資先などの破綻や債務不履行による影響を受けます。</p> <p>流動性リスク：保有する有価証券を希望する時期や価格で売買できない影響を受ける可能性があります。</p> <p>デリバティブ取引のリスク：デリバティブの運用には、ヘッジする商品とヘッジされるべき資産との間の相関性や流動性を欠く可能性や証拠金を積むことによる影響を受けます。</p> |
| [参考] 過去1年間の収益率 | 5.0%（2023年12月末時点） |
| [参考] 過去5年間の収益率 | 平均 10.2% 最低-22.0%（2022年12月） 最高 60.1%（2021年12月）（設定日が2018年5月17日のため、2019年5月～2023年12月の各月末における直近1年間の数字） |

詳細は契約締結前交付書面【交付目論見書】の「投資リスク」、「運用実績」の項目に記載しています。

| | |
|------------------------|---|
| 次のようなご質問があればお問い合わせください | <p>④上記のリスクについて、私が理解できるように説明してほしい。</p> <p>⑤相対的にリスクが低い類似商品はあるのか。あればその商品について説明してほしい。</p> |
|------------------------|---|

3 費用 本商品の購入又は保有等には、費用が発生します

| | | | |
|------------------------------|--|--------------------|--|
| 購入時に支払う費用 (販売手数料など) | 購入時手数料（販売手数料）の額は購入金額に応じて、以下の手数料率を乗じて得た額とします。 | | ※オンライントレード（インターネット取引）にてご注文いただいた場合の手数料は、目論見書補完書面をご確認ください。 |
| | 購入代金 | 手数料率 | |
| | 5000万円未満 | 3.3000%（税抜 3.000%） | |
| | 5000万円以上 2億円未満 | 2.2000%（税抜 2.000%） | |
| | 2億円以上 3億円未満 | 1.1000%（税抜 1.000%） | |
| | 3億円以上 5億円未満 | 0.5500%（税抜 0.500%） | |
| | 5億円以上 | なし | |
| 継続的に支払う費用 (信託報酬など) | 実質的に負担する運用管理費用は年 2.035%（税込）です。その他費用・手数料等が実費でファンドから支払われます。これらは事前に料率、上限等を表示することはできません。 | | |
| 売却（解約）時に支払う費用 (信託財産留保額など) | 0.3% | | |
| 運用成果に応じた費用 (成功報酬など) | ありません | | |

上記以外に生ずる費用を含めて、詳細は契約締結前交付書面【交付目論見書】の「手続・手数料等」の項目に記載しています。

(裏面も必ずご確認ください)

次のご質問があれば
お問い合わせください

⑥私がこの商品に〇〇万円を投資したら、それぞれのコストが実際にいくらかかるのか説明してほしい。
⑦費用がより安い類似商品はあるか。あればその商品について説明してほしい。

4 換金・解約の条件 本商品を換金・解約する場合、一定の不利益を被ることがあります

換金・解約の条件

この商品の償還期限は2028年5月17日です。但し、期間更新や繰上償還の場合があります。
換金時手数料はありません。換金時に信託財産留保額として、「換金申込受付日の翌営業日の基準価額×0.3%」をご負担いただきます。
当ファンドの解約申込不可日には解約の申込みができません。
信託財産の資金管理を円滑に行うため、委託会社の判断により、大口のご換金の場合には制限を設けさせていただく場合があります。
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の換金の申込みの受け付けを中止する場合があります。

詳細は契約締結前交付書面【交付目論見書】の「手続・手数料等」の項目に記載しています。

次のご質問があれば
お問い合わせください

⑧私がこの商品を換金・解約するとき、具体的にどのような制限や不利益があるのかについて説明してほしい。

5 当社の利益とお客さまの利益が反する可能性

利益相反の可能性

当社がお客さまにこの商品を販売した場合、当社は、お客さまが支払う信託報酬のうち、組成会社から年率0.99%（税抜0.90%）の手料をいただきます。これはお客さまの口座管理や各種報告書等の情報提供に係る対価です。
当社は、この商品の組成会社等との間で資本関係等の特別な関係はありません。
当社の営業職員に対する業績評価上、この投資信託の販売が他の投資信託の販売より高く評価されるような場合はありません。

利益相反の内容とその対処方法については、弊社ホームページをご参照ください。

https://www.tokaitokyo.co.jp/policy/adverse_interest.html



次のご質問があれば
お問い合わせください

⑨あなたの会社が高手数料が高い商品など、私の利益よりあなたの会社やあなたの利益を優先した商品を私に薦めていないか。私の利益よりあなたの会社やあなたの利益を優先する可能性がある場合、あなたの会社では、どのような対策をとっているのか。

6 租税の概要 NISA、iDeCoの対象か否かもご確認ください

分配時における所得税および地方税は、配当所得として普通分配金に対して20.315%課税されます。
換金（解約）時および償還時における所得税および地方税は、譲渡所得として換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して20.315%課税されます。
なお、法人の場合は上記とは異なります。

| NISA、iDeCoでの取扱い | NISA（成長投資枠） | NISA（つみたて投資枠） | iDeCo |
|-----------------|-------------|---------------|-------|
| | × | × | × |

詳細は契約締結前交付書面【交付目論見書】の「手続・手数料等」の項目に記載しています。

7 その他参考情報

販売会社（当社）が作成した「契約締結前交付書面」

<http://www2.tokaitokyo.co.jp/sub/pdf/mokuromisho/20180517.pdf>

組成会社が作成した「目論見書」



契約締結にあたっての注意事項等をまとめた「契約締結前交付書面」、金融商品の内容等を記した「目論見書」については、ご希望があれば、紙でお渡しします。

本重要情報シート（個別商品編）は、東海東京証券がお客さまに商品をご説明するために作成したものです。当社の業務委託先金融商品仲介業者等の勧誘の際に、商品についてご質問等がある場合は、当該金融商品仲介業者等の所属営業員へご確認ください。

追加型投信／海外／株式・株価指数先物取引／特殊型（派生商品型）

BNYメロン・米国株式ダイナミック戦略ファンド

愛称: 亜米利加



| 商品分類 | | | | 属性区分 | | | | | | |
|---------|--------|---------------|-------|---|------|--------|-----------|-------|-------|--|
| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） | 特殊型 | 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ | 特殊型 | |
| 追加型 | 海外 | 株式・株価指数先物取引 | 派生商品型 | 資産複合（その他資産（投資信託証券（株式：一般）、株価指数先物取引）資産配分変更型 | 年1回 | 北米 | ファミリーファンド | なし | 派生商品型 | |

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

投資信託説明書（請求目論見書）は、委託会社のホームページで閲覧・ダウンロードすることができます。また、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、請求を行った場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。

本書には、信託約款の主な内容が含まれていますが、信託約款の全文は投資信託説明書（請求目論見書）に添付されています。ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき、事前に受益者の意向を確認する手続きを行います。

投資信託の財産は、信託法（平成18年法律第108号）に基づき、受託会社において分別管理されています。

ファンドに関する詳細は、下記の照会先までお問い合わせください。

- この投資信託説明書（交付目論見書）により行う「BNYメロン・米国株式ダイナミック戦略ファンド」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を2024年2月16日に関東財務局長に提出しており、2024年2月17日にその届出の効力が発生しております。

委託会社：ファンドの運用の指図を行う者

BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

- 金融商品取引業者：関東財務局長（金商）第406号
- 設立年月日：1998年11月6日
- 資本金の額：7億9,500万円（2023年12月末現在）
- 運用する投資信託財産の合計純資産総額：8,948億円（2023年12月末現在）

委託会社の照会先

電話番号（代表） **03-6756-4600**（営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ <https://www.bnymellonam.jp/>

受託会社：ファンドの財産の保管及び管理を行う者

三井住友信託銀行株式会社

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。



BNY MELLON
INVESTMENT MANAGEMENT

ファンドの目的

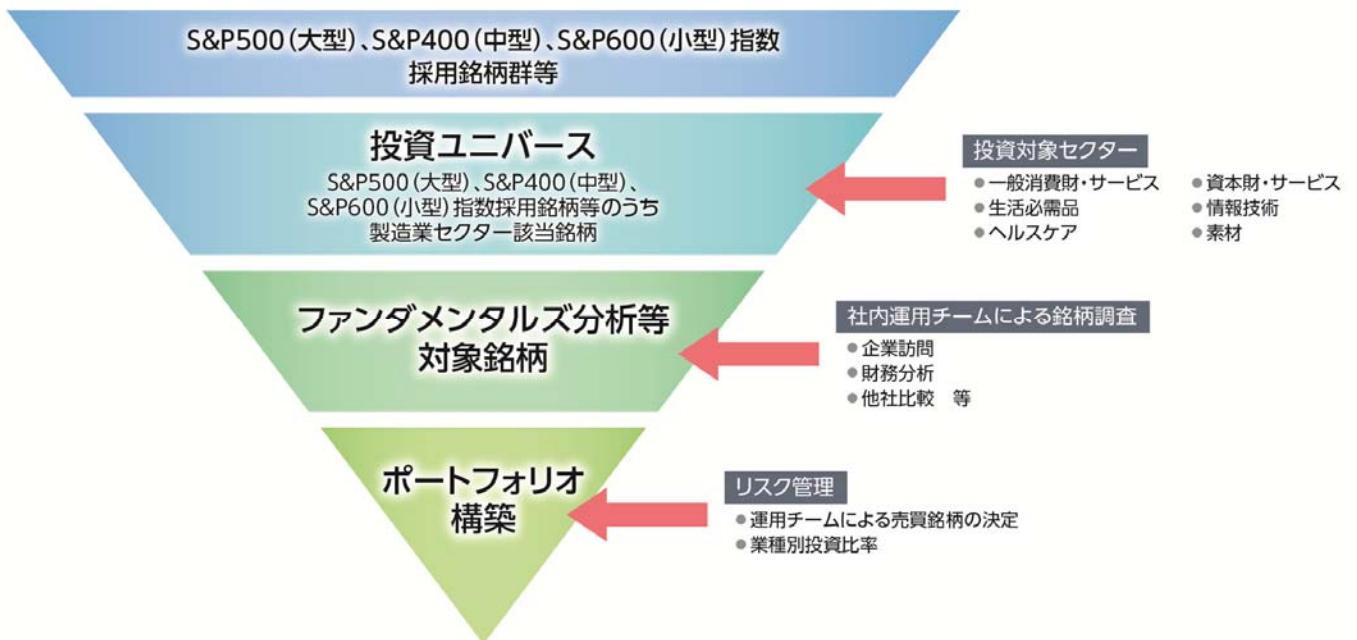
米国製造業株式マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券に投資を行うと同時に、米国の株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」ということがあります。）および為替先渡取引等を活用することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ファンドの特色

- 1 マザーファンドの受益証券への投資を通じて、米国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式の中から、主として米国の製造業に関連した株式に実質的に投資することで、中長期的な信託財産の成長を図ることを目指して運用を行います。

マザーファンドの運用プロセス

- ◆運用チームは、S&P500(大型)、S&P400(中型)、S&P600(小型)指数採用銘柄等のうち、製造業セクター*に該当する銘柄群を抽出します。
 - ◆ポートフォリオマネージャーは、企業訪問や財務分析等に基づいた社内運用チームからの情報を基に投資対象銘柄の絞り込みを行い、最終的にファンダメンタルズが強固で、事業の伸びが期待できる銘柄を選定します。
- * 当ファンドにおける製造業セクターとは、一般消費財・サービス、生活必需品、ヘルスケア、資本財・サービス、情報技術、素材を指します。



※上記は当資料作成時点のものであり、今後、予告なしに変更される場合があります。
出所：ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシー

- 2 マザーファンドの運用にあたっては、BNYメロン・グループ傘下の資産運用会社であるニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシーに委託します。

ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシー

ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシーは、BNYメロン・グループ傘下の運用会社グループであるニュートン・インベストメント・マネジメントの北米拠点です。ニュートン・インベストメント・マネジメントは、グローバルな株式、債券、マルチアセット等の多岐にわたる資産クラスの運用スペシャリストです。

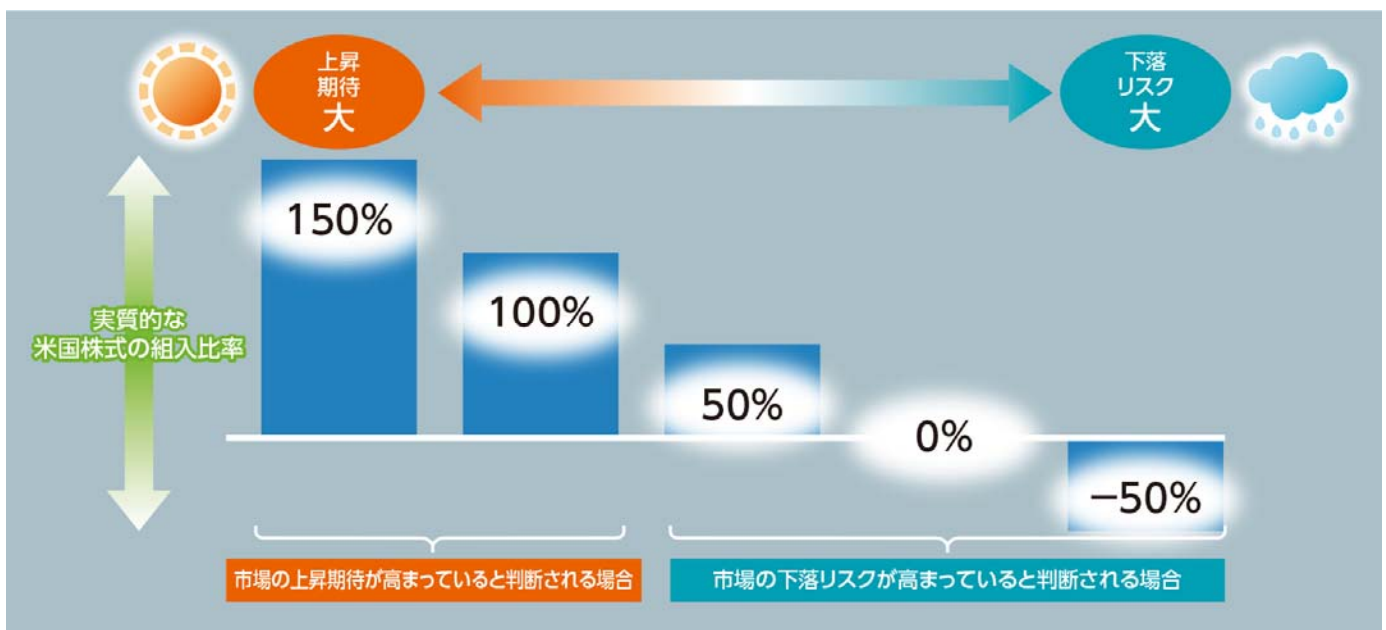
本社：米国ボストン

3 米国の株式市場および円に対する米ドルの為替レートの上昇、下落それぞれの局面においてリターンを最大化することを目指し、株価指数先物取引および為替先渡取引等を用いて実質的な米国株式の組入比率を調整します。

- 実質的な米国株式の組入比率は、通常、純資産総額の-50%~+150%の範囲内でコントロールすることを原則とします。
- 実質的な米国株式の組入比率とは、マザーファンドを通じた米国株式組入比率に対し、株価指数先物取引および為替先渡取引等を活用して調整した米国株式および米ドルの投資割合をいいます。
- 株価指数先物取引および為替先渡取引等を活用するため、実質投資割合が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

主な投資対象と運用の仕組み

- ◆主として米国の製造業に関連した株式に実質的に投資することで、中長期的な信託財産の成長を図ることを目指して運用を行います。
- ◆株式市場のリスク選好度を分析し、**株価指数先物取引および為替先渡取引等を用い実質的な米国株式の組入比率を150%、100%、50%、0%、-50%の5段階の比率を目安に調整**することでリターンの追求を行います。



※上記は実質的な米国株式の組入比率の変動の仕組みをご理解いただくために作成したイメージ図です。マザーファンドと株価指数先物の上昇/下落の方向が必ずしも同一とは限らないため、上記の実質的な米国株式の組入比率に関わらず、想定されるリターンが得られない可能性があります。

※実質的な米国株式の組入比率の目安となる数値は将来変更される可能性があります。

各組入比率における当ファンドへの影響

- ◆ 株式市場の上昇期待が高まっていると判断される局面では、実質的な米国株式の組入比率を最大150%に引き上げることで、株式市場を上回るリターンを獲得、また、下落リスクが高まっていると判断される局面では、実質的な米国株式の組入比率を引き下げること、下落リスクを抑制することを目指します。
- ◆ 更に下落リスクが高いと判断される局面では、実質的な米国株式の組入比率を-50%に調整することで、下落局面でもプラスのリターンを獲得することを目指します。

当ファンドへの影響（イメージ）

※現物の米国株式と株価指数先物の上昇/下落の方向が同一であった場合

| 実質的な米国株式の組入比率 | 株式部分からの影響 | | 為替部分からの影響 | |
|---------------|--|--|--|--|
| | 株式市場が上昇した場合 | 株式市場が下落した場合 | 米ドルが上昇した場合 (円安米ドル高) | 米ドルが下落した場合 (円高米ドル安) |
| 150% | 市場を上回る上昇インパクト (概ね市場の1.5倍) | 市場を上回る下落インパクト (概ね市場の1.5倍) | 為替市場を上回る円安による 上昇インパクト(概ね市場の1.5倍) | 為替市場を上回る円高による 下落インパクト(概ね市場の1.5倍) |
| 100% | 市場と同程度の上昇インパクト | 市場と同程度の下落インパクト | 為替市場と同程度の 円安による上昇インパクト | 為替市場と同程度の 円高による下落インパクト |
| 50% | 市場の半分程度の上昇インパクト | 市場の半分程度の下落インパクト | 為替市場の半分程度の上昇インパクト | 為替市場の半分程度の上昇インパクト |
| 0% | 市場は上昇するものの 株式部分からの上昇・下落インパクトは 概ねなし | 市場は下落するものの 株式部分からの上昇・下落インパクトは 概ねなし | 円安米ドル高でも 為替部分からの上昇・下落インパクトは 概ねなし | 円高米ドル安でも 為替部分からの上昇・下落インパクトは 概ねなし |
| -50% | 市場は上昇するものの 上昇率の半分程度の上昇インパクト | 市場は下落するものの 下落率の半分程度の上昇インパクト | 円安米ドル高でも 米ドル上昇率の半分程度の上昇インパクト | 円高米ドル安でも 米ドル下落率の半分程度の上昇インパクト |

※上記はイメージ図です。マザーファンドと株価指数先物の上昇/下落の方向が必ずしも同一とは限らないため、上記の実質的な米国株式の組入比率に関わらず、想定される株式部分からのリターンが得られない可能性があります。また、当ファンドでは為替先渡取引等を用いて実質的な米ドルの組入比率の調整も行います。米国株式市場と円に対する米ドルの為替レートの上昇/下落の方向は必ずしも同一とは限りません。当ファンドの運用成果が上記の通りになることをお約束するものではありません。

4 実質的な米国株式の組入比率の調整にあたっては、日興グローバルラップ株式会社より投資助言を受けます。

- 当ファンドでは、日興グローバルラップ株式会社が開発した独自のリスク指標(US RAI*)を用いて、米国株式市場の変動のリスクを日々、算出します。その上で、現在の状況で最適と判断する実質的な米国株式の組入比率を選定します。

*US RAI(US Risk Appetite Index: 米国・リスク・アペタイト・インデックス)とは？

US RAIとは、投資家のリスク選好度を測るために世界各国の様々な金融データ(VIX指数、ハイイールド債の動きなど)にニュースセンチメント(※)を独自の手法で組み合わせて算出したもので、米国株式市場でのリスク態度の状態を示したものです。

※米国のマクロ経済・市場動向等に関するニュースを解析したセンチメントデータを、日興グローバルラップ株式会社が独自の方法で指数化したものです。

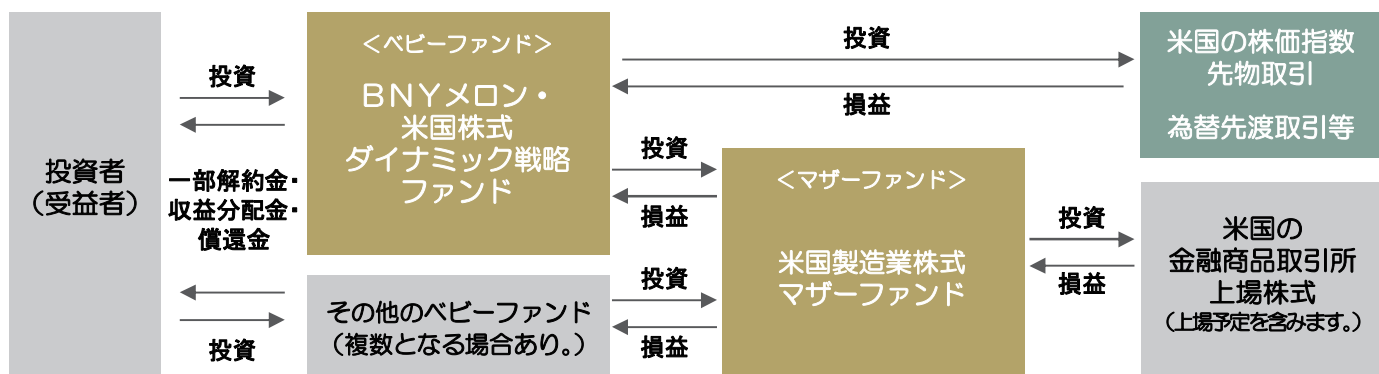
市況動向、資金動向その他の要因等によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

ファンドの仕組み

「ファミリーファンド方式」について

当ファンドは、一部ファミリーファンド方式で運用します。

ファミリーファンド方式とは、投資者(受益者)からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用をマザーファンドにおいて行う仕組みです。



主な投資制限

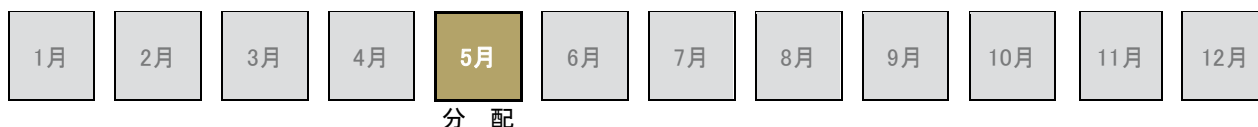
| | |
|-----------|---|
| 株式 | 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 |
| 同一銘柄の株式 | 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |
| 外貨建資産 | 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 |
| 投資信託証券 | マザーファンドの受益証券を除く投資信託証券(上場投資信託証券を除く。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 |
| デリバティブの利用 | 信託約款の規定の範囲で行うことができます。 |

収益分配方針

毎決算時(原則として、毎年5月17日、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- ・分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価益を含みます。)の全額とします。
- ・収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。



※上記は収益分配のイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

市況動向、資金動向その他の要因等によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

基準価額の変動要因（主な投資リスク）

当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の製造業に関連した株式への投資と同時にデリバティブを活用しますので、組入れた有価証券等の値動き（外貨建資産には為替変動もあります。）により、当ファンドの基準価額は大きく変動することがあります。

当ファンドは、元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により解約・償還金額が投資元本を下回り、損失を被る可能性があります。運用により信託財産に生じた利益または損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドは、預貯金とは異なります。預金保険または保険契約者保護機構の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。

以下の事項は、マザーファンドのリスクも含まれます。

| | |
|--------------------------------|--|
| <p>実質的な米国株式の組入比率の調整に関するリスク</p> | <p>当ファンドは、市場の状況により、デリバティブ（株価指数先物取引、為替先渡取引等）を用いて実質的な株式および米ドルの組入比率を調整し、純資産総額の-50%~+150%の範囲内でコントロールすることを原則とします。</p> <p>当ファンドの実質的な現物株式部分の運用は、米国の製造業に関連した銘柄にアクティブに投資するものであり、実質的な株式組入比率の調整にあたっては、S&P500先物等を用います。したがって、当ファンドの基準価額は、米国の株式市場全体の値動きまたは意図した実質株式組入比率を反映した動きとはならないことがあります。実質投資割合は信託財産の純資産総額を超える場合があります。委託会社の判断と反対方向に米国の株式市場および円に対する米ドルの為替レートが動いた場合、想定以上に損失が膨らむことがあります。また、実質的な株式組入比率が-50%の場合は、米国の株式市場全体が上昇しても当ファンドの基準価額は下落することがあります。</p> |
| <p>為替変動リスク</p> | <p>為替変動リスクは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価額が変動するリスクのことをいいます。外貨建資産を保有する場合、当該通貨と円の為替変動の影響を受け、損失が生じることがあります。</p> <p>当ファンドは、実質株式組入比率に相当する米ドルの組入を行いますので、当ファンドの基準価額は、為替レートの変動による影響を受けることになります。米国株式市場と円に対する米ドルの為替レートの上昇/下落の方向は必ずしも同一とは限りません。したがって、米国株式市場の値動きと基準価額は必ずしも同一方向に動くとは限りません。</p> <p>米ドルの組入比率が+150%の場合は、円に対する米ドルの為替レートの変動の影響を大きく受けることとなります。</p> <p>また、為替先渡取引等に関しては、コストが発生する場合があります。基準価額の変動要因となる場合があります。</p> |
| <p>価格変動リスク</p> | <p>株式の価格動向は、個々の企業の活動や、国内および国際的な政治・経済情勢の影響を受けます。そのため、当ファンドの投資成果は、株式の価格変動があった場合、元本欠損を含む重大な損失が生じる場合があります。</p> |
| <p>株式の発行企業の信用リスク</p> | <p>当ファンドは、実質的に株式への投資を行うため、株式発行企業の信用リスクを伴います。株式発行企業の経営・財務状況の悪化等に伴う株価の下落により、当ファンドの基準価額が下落し元本欠損が生じるおそれがあります。発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金がほとんど回収できなくなることがあります。</p> |
| <p>流動性リスク</p> | <p>流動性リスクは、有価証券等を売却あるいは購入しようとする際に、買い需要がなく希望する時期に希望する価格で売却することが不可能となることあるいは売り供給がなく希望する時期に希望する価格で購入することが不可能となること等のリスクのことをいいます。市場規模や取引量が小さい市場に投資する場合、また市場環境の急変等があった場合、流動性の状況によって期待される価格で売買できないことがあり基準価額の変動要因となります。</p> |
| <p>デリバティブ取引のリスク</p> | <p>当ファンドは、有価証券および金利関連のデリバティブに投資することがあります。デリバティブの運用には、ヘッジする商品とヘッジされるべき資産との間の相関性や流動性を欠く可能性、証拠金を積むことによるリスク等様々なリスクが伴います。実際の価格変動が見通しと異なった場合に、当ファンドが損失を被るリスクを伴います。</p> |

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

| | |
|---------------|---|
| クーリング・オフ | 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。 |
| 流動性リスクにかかる留意点 | 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。 |
| 収益分配金にかかる留意点 | <ul style="list-style-type: none">・ 収益分配金は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の利子・配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。したがって、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間中におけるファンドの収益率を示すものではありません。・ 受益者のファンドの購入価額によっては、収益分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりの方が小さかった場合も同様です。・ 収益分配金は、ファンドの純資産から支払われますので、収益分配金の支払後の純資産は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に収益分配金の支払を行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比較して下落することになります。 |

リスクの管理体制

ファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門における日々のモニタリングに加えて、運用部門から独立した組織体制においても行っています。

[投資政策委員会]

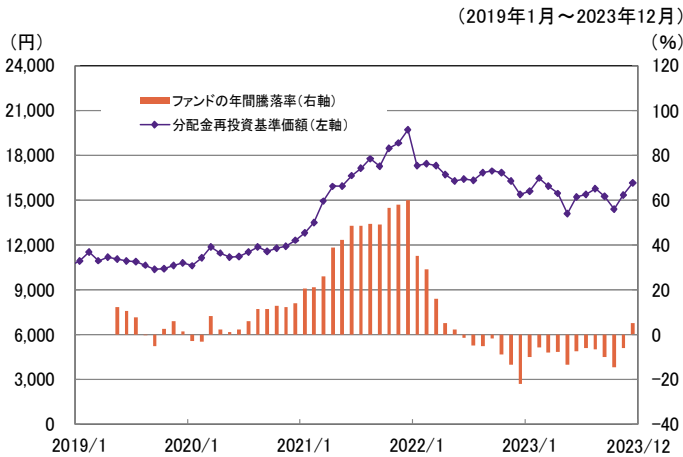
ファンドの運用計画案の審議、運用実績の評価、流動性リスク管理の報告、運用に関する法令および内部規則の遵守状況の確認、最良執行に関する方針の策定および確認を行います。

[コンプライアンス・リスク管理委員会]

コンプライアンスおよびリスク管理に関わる事項等の審議・決定を行い、委託会社の法令遵守・リスク管理として必要な内部管理態勢を確保します。

参考情報

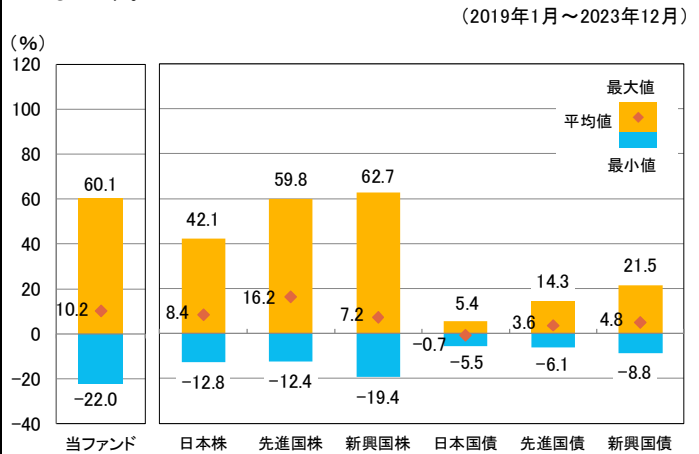
当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



- * 年間騰落率は、2019年5月～2023年12月(当ファンドの設定日は、2018年5月17日です。)の各月末における直近1年間の騰落率を示しています。
- * 年間騰落率は、税引き前収益分配金を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。また、分配金再投資基準価額は、税引き前収益分配金を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと代表的な資産クラス*との騰落率の比較

グラフは、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- * グラフは、2019年1月～2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。
- なお、当ファンドについては、設定日が2018年5月17日のため、2019年5月～2023年12月の数値であり、単純な比較はできません。
- 当ファンドについては、税引き前収益分配金を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

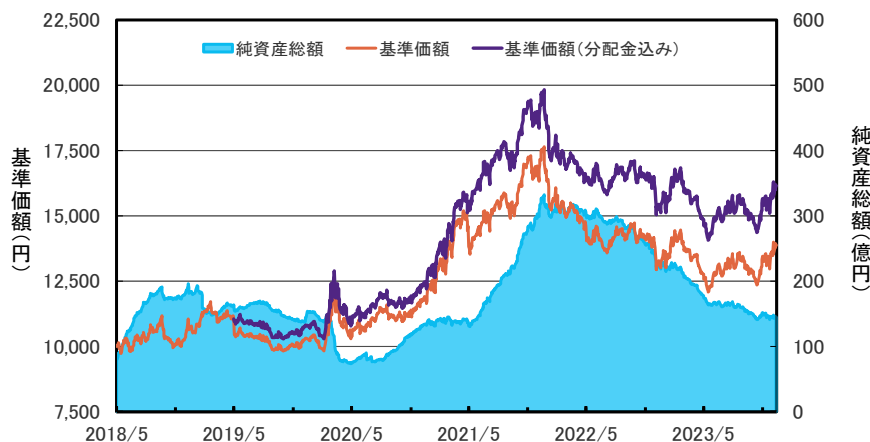
※ 各資産クラスの指数

- 日本株** 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という) が算出・公表している、日本の株式を対象として算出した株価指数で、配当を考慮したものです。
- 先進国株** MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込み、円ベース)
MSCI Inc. が算出・公表している、日本を除く先進国の株式を対象として算出されたグローバルな株価指数で、配当を考慮したものです。
- 新興国株** MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
MSCI Inc. が算出・公表している、世界の新興国の株式を対象として算出された株価指数で、配当を考慮したものです。
- 日本国債** NOMURA-BPI 国債
野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が算出・公表している、日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。
- 先進国債** FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース)
FTSE Fixed Income LLC が算出・公表している債券インデックスで、日本を除く世界の主要国の国債の価格と利息収入を合わせた総合投資収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。
- 新興国債** JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)
J.P.Morgan Securities LLC が算出・公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした、時価総額ベースの指数です。

TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、JPXに帰属します。
MSCIインデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。
NOMURA-BPIに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。
FTSE世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。
JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

上記各指数の騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。
株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。
また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

基準価額・純資産総額の推移 (設定日(2018年5月17日)～2023年12月29日)



2023年12月29日現在

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 13,881円 |
| 純資産総額 | 144.9億円 |

分配の推移 (1万口当たり、税引き前)

| | |
|----------|--------|
| 2019年 5月 | 500円 |
| 2020年 5月 | 0円 |
| 2021年 5月 | 1,000円 |
| 2022年 5月 | 500円 |
| 2023年 5月 | 0円 |
| 設定来累計 | 2,000円 |

(注1) 基準価額、基準価額(分配金込み)は、1万口当たり運用管理費用(信託報酬)控除後です。
 (注2) 基準価額(分配金込み)は、税引き前収益分配金を分配時に再投資したもとして計算しています。

主要な資産の状況

| | 銘柄名 | 国/地域 | 種類 | 投資比率(%) |
|---|-------------------|------|-----------|---------|
| 1 | 米国製造業株式マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 70.04 |
| 2 | S&P500 EMINI (買建) | アメリカ | 株価指数先物取引 | 81.57 |

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。以下同じ。
 (注2) 先物取引について、売建の投資比率は△(マイナス)で表示しております。

米国製造業株式マザーファンド

組入上位10銘柄

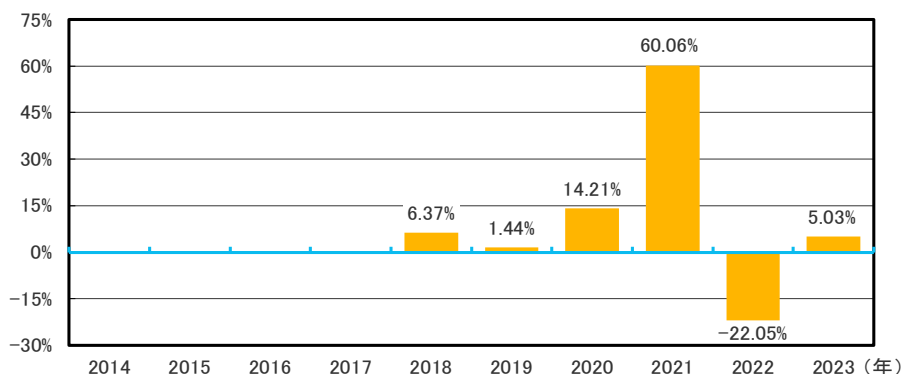
| | 銘柄名 | 国/地域 | 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|-------------------------------|------|----|------------------------|---------|
| 1 | DANAHER CORP | アメリカ | 株式 | ヘルスケア機器・サービス | 5.17 |
| 2 | ILLUMINA INC | アメリカ | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 5.14 |
| 3 | INGERSOLL-RAND INC | アメリカ | 株式 | 資本財 | 5.01 |
| 4 | AMETEK, INC. | アメリカ | 株式 | 資本財 | 4.97 |
| 5 | CARRIER GLOBAL CORP | アメリカ | 株式 | 素材 | 4.14 |
| 6 | DEXCOM INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア機器・サービス | 3.84 |
| 7 | ABBVIE INC | アメリカ | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 3.71 |
| 8 | BOSTON SCIENTIFIC CORPORATION | アメリカ | 株式 | ヘルスケア機器・サービス | 3.70 |
| 9 | HUBBELL INCORPORATED | アメリカ | 株式 | 資本財 | 3.46 |
| 10 | PACIFIC BIOSCIENCES OF CALIF | アメリカ | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 3.40 |

種類別および業種別組入比率

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|---------------------|------------------------|---------|
| 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 28.71 |
| | 資本財 | 22.42 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 20.77 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.19 |
| | 商業・専門サービス | 5.61 |
| | 運輸 | 4.90 |
| | ソフトウェア・サービス | 4.76 |
| | 素材 | 4.14 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1.51 |
| 合計 | | 100.00 |

(注) 小数点第三位以下を四捨五入しており、合計値が100%にならないことがあります。

年間収益率の推移 (暦年ベース)



(注1) ファンドの収益率は、税引き前収益分配金を分配時に再投資したもとして計算しています。2018年は設定日(5月17日)から年末までの収益率です。
 (注2) 当ファンドにはベンチマークはありません。

- 運用実績等について、別途月次等で開示している場合があります。この場合、委託会社のホームページで閲覧することができます。
- 運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

4 | 手続・手数料等

お申込みメモ

| | |
|---------------------------|---|
| 購入単位 | 販売会社が定める単位 収益分配金を再投資する場合は1口の整数倍とします。 ※「一般コース」および「自動継続投資コース」があります。詳しくは、販売会社までお問い合わせください。 |
| 購入価額 | 購入申込受付日の翌営業日の基準価額 ※ファンドの基準価額は1万口当たりで表示しています。 |
| 購入代金 | 販売会社が定める期日までにお支払いください。 |
| 換金単位 | 販売会社が定める単位 |
| 換金価額 | 換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額 |
| 換金代金 | 原則として換金申込受付日から起算して6営業日目より、申込みの販売会社でお支払いします。 |
| 購入・換金 申込不可日 | 以下のいずれかの日に該当する場合はお申込みできません。 ・ニューヨークの証券取引所の休場日 ・ニューヨークの銀行の休業日 ・委託会社が別途定める日 |
| 申込締切時間 | 営業日の午後3時までに販売会社が受付けた分を当日の申込み分とします。 |
| 購入の申込期間 | 2024年2月17日～2024年8月16日 ※申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。 |
| 換金制限 | 信託財産の資金管理を円滑に行うため、委託会社の判断により、大口のご換金の場合には制限を設けさせていただく場合があります。 |
| 購入・換金 申込受付中止 および取消し | 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の購入・換金の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた申込みの受け付けを取消す場合があります。 |
| 信託期間 | 2028年5月17日まで(当初信託設定日:2018年5月17日) ※委託会社は、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、信託期間を延長することができます。 |
| 繰上償還 | 受益権の総口数が10億口を下回るようになった場合等には、繰上償還することがあります。 |
| 決算日 | 毎年5月17日(休業日の場合は翌営業日) |
| 収益分配 | 毎決算時に、収益分配方針に基づき分配を行います。 分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。 ※「自動継続投資コース」の場合、収益分配金は税引き後再投資されます。 |
| 信託金の限度額 | 3,000億円 |
| 公告 | 日本経済新聞に掲載します。 |
| 運用報告書 | 毎決算後および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて知っている受益者に交付します。 |
| 課税関係 | 課税上は、株式投資信託として取扱われます。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA(少額投資非課税制度)の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの対象ではありません。 配当控除の適用はありません。 |

ファンドの費用・税金

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

| | | |
|---------|--|--|
| 購入時手数料 | 購入価額× 上限3.85%(税抜 3.5%) (手数料率は販売会社が定めます。) ※自動継続投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合は、申込手数料はかかりません。 | 《当該手数料を対価とする役務の内容》 販売会社による商品および関連する投資環境の説明・情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等 |
| 信託財産留保額 | 換金申込受付日の翌営業日の基準価額× 0.3% | |

投資者が信託財産で間接的に負担する費用

| | | |
|------------------|---|--|
| 運用管理費用 (信託報酬) | 運用管理費用の総額＝信託財産の日々の純資産総額× 年率2.035%(税抜 1.85%) 運用管理費用は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支払われますが、日々費用として計上されており、日々の基準価額は運用管理費用控除後となります。 運用管理費用の配分は、以下のとおりです。 | |
| 合計 | 年率2.035% (税抜 1.85%) | 《当該運用管理費用を対価とする役務の内容》 |
| (委託会社) | 年率0.90%(税抜) | 信託財産の運用指図(投資顧問会社によるマザーファンドの運用指図および投資助言会社による運用に関する投資助言を含む)、法定開示書類の作成、基準価額の算出等 |
| (販売会社) | 年率0.90%(税抜) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| (受託会社) | 年率0.05%(税抜) | 信託財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| その他費用・ 手数料 | <p>マザーファンドの投資顧問会社および当ファンドの投資助言会社への報酬</p> <p>委託会社の受取る報酬には、マザーファンドにおいて運用の指図権限を委託している投資顧問会社への投資顧問報酬および当ファンドにおいて運用に関する投資助言を受けている投資助言会社への投資助言報酬が含まれます。</p> <p>投資顧問報酬＝信託財産に属する当該マザーファンドの受益証券の日々の時価総額×年率0.33%</p> <p>投資助言報酬＝信託財産の日々の純資産総額×年率0.165%(税抜 0.15%)</p> <p>監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用、目論見書・運用報告書等法定開示書類の印刷、交付および提出にかかる費用、その他の管理、運営にかかる費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、マザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、先物・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管費用等が、信託財産より支払われます。</p> <p>◆その他費用・手数料については、資産規模および運用状況等により変動しますので、料率、上限額等を表示することができません。</p> | |

※上記費用の総額につきましては、投資者の皆様の保有される期間等により異なりますので、表示することができません。

税金

- ・税金は表に記載の時期に適用されます。
- ・以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

| 時 期 | 項 目 | 税 金 |
|-------------------|-----------------------|---|
| 分 配 時 | 所得税、復興特別所得税 および地方税 | 配当所得として課税 普通分配金に対して20.315% |
| 換金(解約)時 および償還時 | 所得税、復興特別所得税 および地方税 | 譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315% |

※上記は、2024年1月末現在のものです。
 ※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
 ※法人の場合は、上記とは異なります。
 ※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家にご確認されることをお勧めします。



BNY MELLON
INVESTMENT MANAGEMENT

目論見書補完書面（投資信託）

（この書面は、金融商品取引法第37条の3の規定によりお渡しするものです。）

この書面及び目論見書の内容をよくお読みください。

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドに係る金融商品取引契約の概要

当社は、ファンドの販売会社として、募集の取扱い及び販売等に関する事務を行います。

当社が行う金融商品取引業の内容及び方法の概要

当社が行う金融商品取引業は、主に金融商品取引法第28条第1項の規定に基づく第一種金融商品取引業であり、当社においてファンドのお取引や保護預けを行われる場合は、以下によります。

- ・ お取引にあたっては、保護預り口座、振替決済口座又は外国証券取引口座の開設が必要となります。
- ・ お取引のご注文をいただいたときは、原則として、あらかじめ当該ご注文に係る代金の全部又は一部（前受金等）をお預けいただいた上で、ご注文をお受けいたします。
- ・ 前受金等を全額お預けいただいていない場合、当社との間で合意した日までに、ご注文に係る代金又は有価証券をお預けいただけます。
- ・ ご注文いただいたお取引が成立した場合（法令に定める場合を除きます。）には、取引報告書をお客様にお渡しいたします（郵送又は電磁的方法による場合を含みます。）。

当ファンドの販売会社の概要

| | |
|----------|--|
| 商号等 | 東海東京証券株式会社 金融商品取引業者 東海財務局長(金商)第140号 |
| 本店所在地 | 〒450-6212 愛知県名古屋市中村区名駅四丁目7番1号 |
| 加入協会 | 日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会、 一般社団法人第二種金融商品取引業協会、一般社団法人日本投資顧問業協会、 一般社団法人日本STO協会 |
| 指定紛争解決機関 | 特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター |
| 資本金 | 60億円 |
| 主な事業 | 金融商品取引業 |
| 設立年月 | 2008年10月8日 |
| 連絡先 | お取引のある本支店等又は カスタマーサポートセンター（0120-746-104）にご連絡ください。 |

東海東京証券からのお知らせ

投資信託のご購入時にご負担いただく費用について

投資信託のご購入に際して、購入時手数料(販売手数料)をご負担いただく場合があります。

購入時手数料率(販売手数料率)は、同一の投資信託を購入する場合でも、購入する口数(金額)によって異なる場合があります。

<購入時手数料(販売手数料)の例>

(例1) 口数指定で購入する投資信託の場合

当社における購入時手数料は、約定金額(購入口数×約定日の基準価額)に、手数料率(3.30%(税抜3.0%))を乗じて次のように計算します。

購入時手数料=購入口数×基準価額×3.30%(税抜3.0%)

例えば、基準価額10,000円の時に100口購入いただく場合(当初1口=1万円の場合)は、

購入時手数料=100口×10,000円×3.30%=33,000円となり、合計1,033,000円お支払いいただくこととなります。

(例2) 金額指定で購入する投資信託の場合

当社における購入時手数料は、約定金額(購入口数×約定日の基準価額)に、次の手数料率を乗じた額とします。

購入時手数料率：3.30%(税抜3.0%)

例えば、100万円の金額指定で購入いただく場合、指定金額(お支払いいただく金額)の100万円の中から購入時手数料(税込)をいただきますので、100万円全額が当該投資信託の購入金額となるものではありません。

(例3) 約定金額指定で購入する投資信託の場合

当社における購入時手数料は、約定金額(購入口数×約定日の基準価格)に、次の手数料を乗じた額をします。

購入時手数料率：3.30%(税抜3.0%)

例えば、100万円の約定金額指定で購入いただく場合、指定金額の100万円に加えて購入時手数料(税込)をいただきます。

購入時手数料=1,000,000円×3.30%=33,000円

となり、合計1,033,000円お支払いいただくこととなります。

※(例1)、(例2)、(例3)において記載している購入時手数料は、手数料計算の一例として記載しているものです。購入時手数料率は投資信託により異なります。また、同一の投資信託を購入する場合でも、購入する口数(金額)によって異なる場合があります。

※口数指定や金額指定による購入の可否は、投資信託の銘柄ごとに異なり、いずれか一方の取扱いができない場合があります。

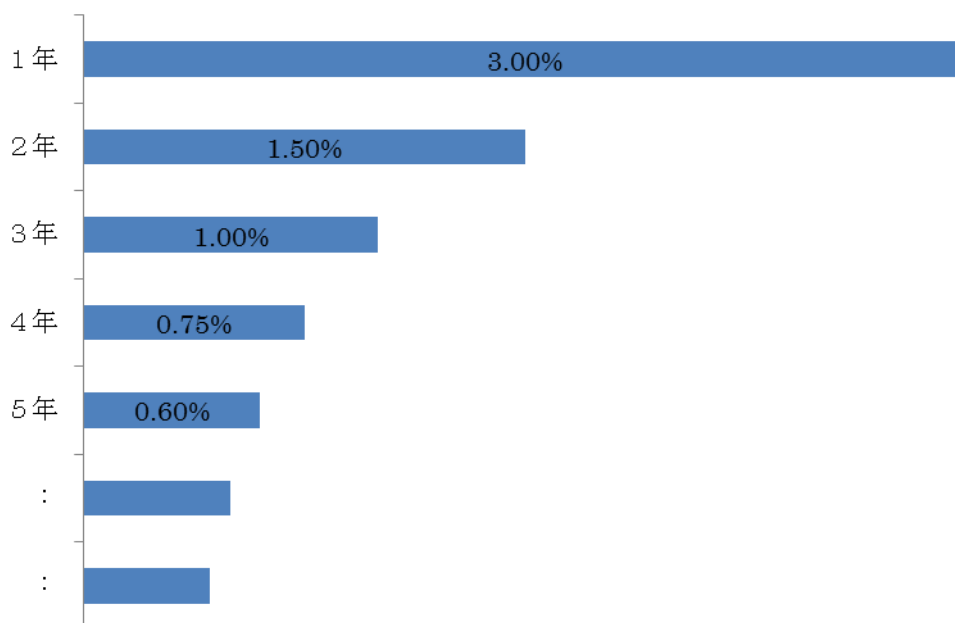
購入時手数料に関するご説明

■投資信託の購入時手数料(販売手数料)は購入時に負担いただくものですが、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率はしだいに減っていきます。

例えば、購入時手数料(販売手数料)が3%(税抜)の場合

【保有期間】

【1年あたりのご負担率(税抜)】



※投資信託によっては、購入時手数料(販売手数料)を頂戴せず、解約時に保有期間に応じた解約手数料をお支払いいただく場合があります。その場合も、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率はしだいに減っていきます。

※上記の図の手数料率や保有期間は例示です。

実際にお買付いただく投資信託の手数料率や残存期間については目論見書や補完書面でご確認ください。投資信託をご購入いただいた場合には、上記の、購入時手数料(販売手数料)のほか、信託報酬やその他費用等をご負担いただきます。

また、投資信託の種類に応じて、信託財産留保額等をご負担いただく場合があります。

実際の手数料率等の詳細は投資信託説明書(交付目論見書)又は目論見書補完書面でご確認ください。

<リスクと諸費用等について>

投資信託は、主に国内外の株式や債券等を投資対象としますので、組入株式の価格の下落や、発行会社の信用状況の悪化等の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資を行う場合は、為替の変動により損失を被ることがあります。投資信託をご購入の際には、銘柄ごとに設定された販売手数料、信託財産留保額及び信託報酬等の諸経費等をご負担いただきます。詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

当社の概要

商号等 東海東京証券株式会社 金融商品取引業者 東海財務局長(金商)第140号

加入協会 日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会、一般社団法人第二種金融商品取引業協会、一般社団法人日本投資顧問業協会、一般社団法人日本STO協会

BNYメロン・米国株式ダイナミック戦略ファンド
購入時手数料について

①購入時手数料

購入時手数料(販売手数料)の額は購入金額に応じて、以下の手数料率を乗じて得た額とします。

購入金額 = お申込口数 × 基準価額 + 購入時手数料(販売手数料)

| 購入金額 | 手数料率 |
|---------------|--------------------|
| 5000万円未満 | 3.3000% (税抜3.000%) |
| 5000万円以上2億円未満 | 2.2000% (税抜2.000%) |
| 2億円以上3億円未満 | 1.1000% (税抜1.000%) |
| 3億円以上5億円未満 | 0.5500% (税抜0.500%) |
| 5億円以上 | なし |

②購入単位

一般コース: 1万円(口)以上1円(口)単位
自動けいぞく投資コース: 1万円以上1円単位

③特記事項

※オンライントレード(インターネット取引)にてご注文いただいた場合は、上記の購入時手数料が20%割引となります。

東海東京証券株式会社

