BNYメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンド
愛称：臨機応変

追加型投信／国内／株式・株価指数先物取引／特殊型（派生商品型）

2023年5月25日

株式組入比率の臨時変更について

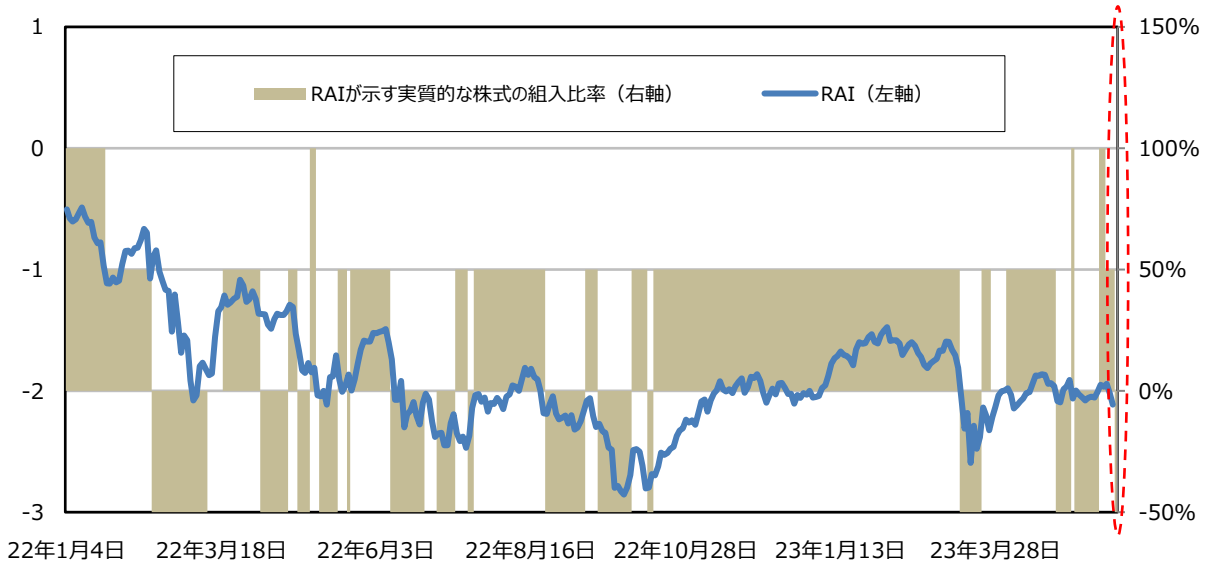
平素は「BNYメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンド（愛称：臨機応変）」をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、当ファンドは実質的な株式組入比率の臨時変更を行いましたのでご報告致します。

BNYメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンド（愛称：臨機応変）
2023年5月25日時点の実質的な株式組入比率の変更

実質的な株式組入比率		
50%	→	-50%

（ご参考）RAIおよび実質的な株式組入比率の推移
（2022年1月4日～2023年5月25日）



■当資料は、ＢＮＹメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社が作成した資料です。■当資料は信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の正確性･完全性について保証するものではありません。■当資料に掲載されている記載事項は、特に断りのない限り当資料作成時点のものであり、事前の連絡なしに今後変更されることがあります。■当資料中のグラフ、数値等は過去のものまたはシミュレーションの結果であり、将来の運用成果等をお約束するものではありません。■当ファンドに生じた損益は、すべて受益者の皆様に帰属します。■当ファンドのご購入に際しては、販売会社よりお渡しします投資信託説明書（交付目論見書）の内容を必ずご確認のうえ、お客様ご自身でご判断ください。

BNYメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンド
愛称：臨機応変

追加型投信／国内／株式・株価指数先物取引／特殊型（派生商品型）

ファンドの特色

- 主として、わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）の中から、ボトムアップ・アプローチによる個別企業の調査等を通じて、企業の成長性と株価の割安性の両方を考慮した銘柄に投資を行います。
- 株式市場の上昇、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、株価指数先物取引を用いて実質的な株式組入比率を調整します。
  - 実質的な株式組入比率は、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。株価指数先物取引を活用するため、実質投資割合が信託財産の純資産総額を超える場合があります。
- 当ファンドの運用にあたっては、ニュートン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社に運用の指図に関する権限を委託します。
- 実質的な株式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。

※資金動向および市況動向等により、上記のような運用ができない場合があります。

投資リスク

当ファンドは、主としてわが国の株式への投資を行う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。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、委託会社の判断と反対方向に株式市場が動いた場合、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、株式市場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。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。

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1.914%（税抜 1.74%） 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1.914%（税抜 1.74%）	≪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0.85%（税抜）	信託財産の運用指図（投資顧問会社による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0.85%（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0.04%（税抜）	信託財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
	当ファンドの投資顧問会社および投資助言会社への報酬 委託会社の受取る報酬には、当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。 ・投資顧問報酬＝信託財産の日々の純資産総額×年率0.462%（税抜 0.42%） ・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%）	
その他費用・手数料	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、先物・オプション取引等に要する費用等が、信託財産より支払われます。 ◆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。	

※購入価額とは購入申込受付日の基準価額です。ファンドの基準価額は1万口当たりで表示しています。
※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。
※詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）をご覧下さい。

BNYメロン・日本株式ダイナミック戦略ファンド
愛称：臨機応変
追加型投信／国内／株式・株価指数先物取引／特殊型（派生商品型）

委託会社、その他関係法人

委託会社　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（信託財産の運用指図等）
金融商品取引業者：関東財務局長（金商）第406号
加入協会：一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会、
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

投資顧問会社　ニュートン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社
（運用の指図に関する権限の委託を受けての運用指図）

投資助言会社　日興グローバルラップ株式会社（運用に関する投資助言）

受託会社　三菱UFJ信託銀行株式会社（信託財産の保管・管理業務等）

販売会社　（募集・販売の取扱い等）　販売会社のご照会先は、以下をご参照ください。

お申込み、投資信託説明書（交付目論見書）のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください。

金融商品取引業者名		登録番号	日本証券業協会	一般社団法人日本投資顧問業協会	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
池田泉州TT証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長（金商）第370号	○			
auカブコム証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第61号	○	○	○	○
株式会社SBI証券	金融商品取引業者	関東財務局長（金商)第44号	○		○	○
株式会社SBI新生銀行（委託金融商品取引業者株式会社SBI証券）	登録金融機関	関東財務局長（登金）第10号	○		○	
十六TT証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長（金商）第188号	○			
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	○		○	○
とちぎんTT証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第32号	○			
西日本シティTT証券株式会社	金融商品取引業者	福岡財務支局長（金商）第75号	○			
浜銀TT証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第1977号	○			
ほくほくTT証券株式会社	金融商品取引業者	北陸財務局長（金商）第24号	○			
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○
ワイエム証券株式会社	金融商品取引業者	中国財務局長(金商)第8号	○			