

2022年6月3日

受益者のみなさま

三菱UFJ国際投信株式会社

弊社ファンド運用委託先の運用チーム移管について

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。

平素は弊社の投資信託に格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

先日ご連絡させていただきましたアリアンツ・グローバル・インベスターズ（以下、アリアンツ GI）の米国法人であるアリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシー（以下、アリアンツ GI 米国法人）が運用チームを移管する件に関し、現時点での下記対象ファンドに関する弊社の見解につきご報告させていただきます。

本件の趣旨についてご理解賜りますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧の程、よろしくお願い申し上げます。

敬具

記

【対象ファンド】

- ・サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり）
- ・サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし）
- ・サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり） 予想分配金提示型
- ・サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし） 予想分配金提示型

【運用チーム移管の背景】

2020年のコロナショックにおいて、アリアンツ GI 米国法人に所属するストラクチャード・プロダクト・グループの運用するヘッジファンドが大幅な損失を計上いたしました。米国当局が調査したところ、同グループでは過少なリスク説明や実態と相違したパフォーマンスの報告などの不正行為が行われていたことが判明いたしました。その結果、2022年5月17日に米国当局からアリアンツ GI 米国法人に対し、10年間の公募投資信託の運用の禁止という処分が下されました。ただし、少なくとも2022年7月26日までは処分の猶予が認められています。

一方で、以前より米国内の提携について協議していたヴォヤ・インベストメント・マネジメント（以下、ヴォヤ IM）へ運用チームを移管し、これまでの運用を継続することを関係当事者間で暫定合意に至りました。なお、不正を働いたストラクチャード・プロダクト・グループ以外の運用チーム（対象ファンドの運用チームを含む）は、不正に一切関与していないことが明らかにされています。

【移管先のヴォヤ IM について】

対象ファンドの運用チームの移管先であるヴォヤ IM の所属するヴォヤ・ファイナンシャルは、米国において 40 年以上の運用実績を持つニューヨーク証券取引所に上場する運用会社です。

元々はオランダ発祥の総合金融機関である ING グループが 1970 年代半ばに米国ウィスコンシン州国民生命保険会社の過半数を買収した生命保険事業を源流とし、同社の米国での退職、投資管理、保険事業部門から 2013 年に新会社として独立した会社です。

2022 年 3 月末時点の運用資産は、約 2,540 億米ドル（約 31 兆円）です。

【本件に関する弊社の見解について】

■現状の運用体制について（アリアンツ GI 米国法人における運用）

- ・ 前述のストラクチャード・プロダクト・グループにおける 3 名以外のアリアンツ GI およびアリアンツ GI 米国法人の関係者が不正に関与していなかったことが米司法省と米国証券取引委員会の調査で判明しています。そのため対象ファンドを含め、当該ヘッジファンド関連以外の運営についてアリアンツ GI およびアリアンツ GI 米国法人に問題は無かったと判断しております。
- ・ 定期的な調査を通じて、アリアンツ GI 米国法人の運用体制・内部管理体制を弊社で確認しておりますが、同社の体制は他社比でも問題の無い水準にあると評価しております。

■運用チーム移管後の運用体制について（ヴォヤ IM における運用）

- ・ 現在の運用チームがヴォヤ IM に移り、運用を継続する予定となっております。移管先のヴォヤ IM については既に調査を開始しており、経営状態やリスク管理体制、法令順守体制について調査するため、ヴォヤ IM に質問状への回答を請求中です。また、ヴォヤ IM について過去 5 年間で重大な違反事項に関する開示が無い点は確認済みです。質問状への回答が届き次第詳細を調査予定ですが、現段階では親会社のヴォヤ・ファイナンシャルが上場運用会社であることから、懸念事項が出てくる可能性は低いと判断しております。

【今後の対応方針】

運用チームの移管は 7 月 26 日までに行われる予定です。今後の決定事項につきましては、弊社ホームページにてお知らせいたします。なお、今回の運用チームの移管に関しまして、受益者のみなさまのお手続きは不要です。

以上

- ・ 本お知らせに関するお問い合わせ
三菱UFJ国際投信 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034
【受付時間／9：00～17：00（土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）】
- ・ 受益者さまの個別のお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社の本支店へお問い合わせください。