

2024年4月

受益者の皆様へ

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

**「BNYメロン・日本株式ファンド 市場リスク管理型」
信託終了（繰上償還）予定に関するお知らせ**

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。
平素は格別のお引立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

ご投資いただいております弊社の投資信託「BNYメロン・日本株式ファンド 市場リスク管理型」につきまして、下記の通り信託終了（以下「繰上償還」といいます。）を予定しておりますので、お知らせいたします。

この繰上償還につきましては、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を実施いたします。

つきましては、本書面および添付「書面決議参考書類」をご覧のうえ、議決権を行使いただきますよう、お願い申し上げます。

なお、繰上償還に賛成いただける場合には、下記「3」に記載の通り、お手続きの必要はございません。

何卒、ご理解を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

記

1. 書面決議に関する議案

追加型証券投資信託「BNYメロン・日本株式ファンド 市場リスク管理型」について、2024年5月31日をもって繰上償還する件（議決権行使書面において「本議案」といいます。）

繰上償還の理由

当ファンドは、2013年12月24日の設定以来、運用の基本方針に基づき信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行ってまいりましたが、2024年2月29日現在の受益権口数は、約9.4億口と信託約款に定める繰上償還の基準となる10億口を下回る状況です。今後、運用の基本方針に則った運用の継続が困難となることが懸念されるため、信託を終了し、お預かりした資産をお返しすることが受益者の皆様にとって有利であると判断いたしました。

2. 書面決議の手続きおよび日程

- | | |
|------------------------------|--------------|
| ① 受益者の確定日 | 2024年4月16日 |
| ② 書面による議決権の行使期限 | 2024年5月14日まで |
| ③ 書面決議の日
(繰上償還の可否が決定される日) | 2024年5月15日 |
| ④ 繰上償還予定日 | 2024年5月31日 |

書面による議決権の行使は、2024年4月16日時点の受益者（2024年4月15日までに購入のお申込みをされた方）を対象としております。

本書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の賛成をもって可決されます。この場合、予定通り2024年5月31日をもって繰上償還いたします。なお、解約のお申込み受付は2024年5月29日までとなります。

また、上記の議決権口数による賛成を得られず本書面決議が否決された場合は、繰上償還の手続きは行いません。この場合、繰上償還を行わない旨を本書面決議の日以降、速やかに受益者の皆様にお知らせいたします。

3. 書面決議の方法について

同封の「議決権行使書面」に、繰上償還について賛成または反対される旨等をご記入のうえ、返信用封筒にてご送付ください。「議決権行使書面」は2024年5月14日弊社到着分までを有効とさせていただきます。

なお、本書面決議におきまして議決権を行使されない場合（議決権行使書面を返送いただかない場合）は、信託約款の規定に基づき、賛成するものとさせていただきますので、繰上償還に賛成いただける場合は、返送の必要はございません。

なお、返信用封筒をご使用にならない場合には、以下の宛先へご送付ください。

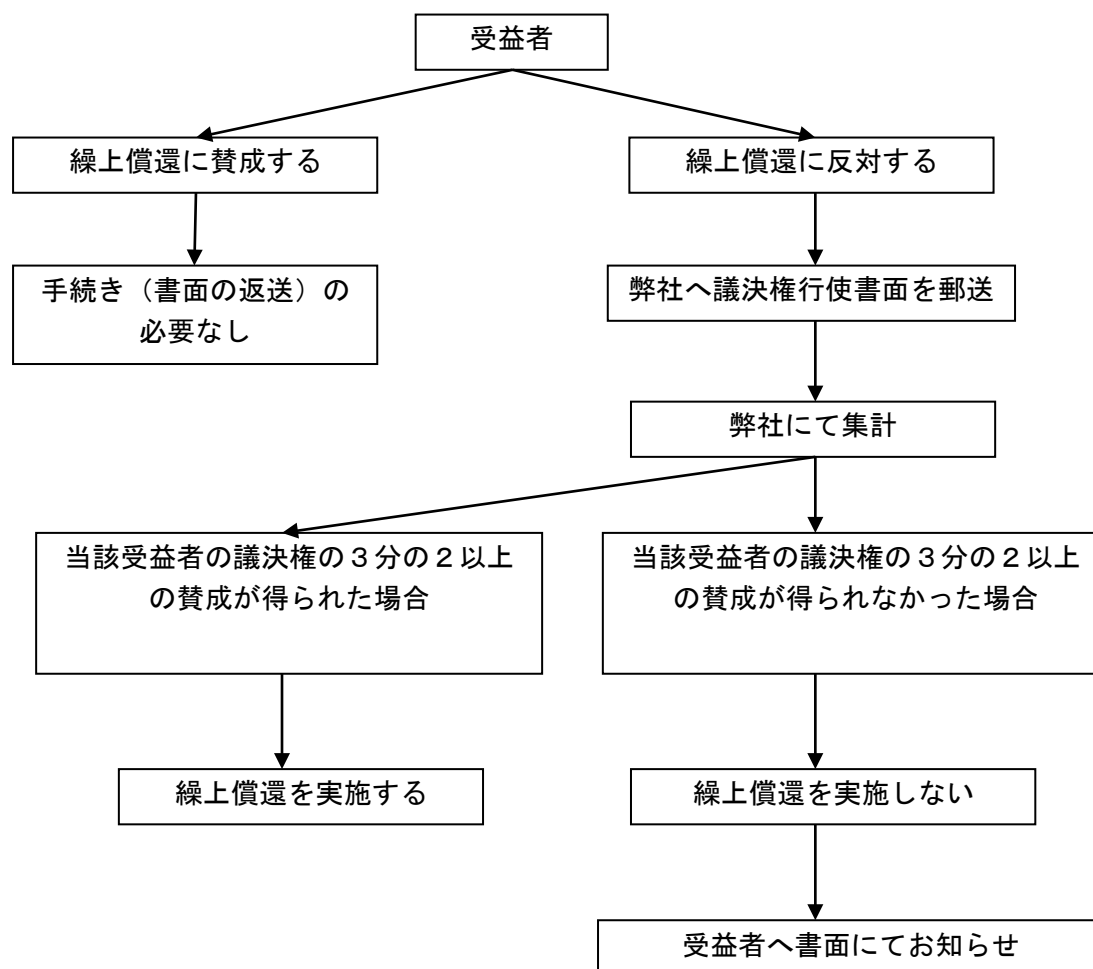
【送付先】〒100-0005 東京都千代田区丸の内1-8-3 丸の内トラストタワー本館
BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社
議決権行使書面受付窓口 宛

（返信用封筒は、料金受取人払専用のため、上記とは別の郵便番号となっています。）

【議決権行使書面についての注意事項】

- ・「議決権行使書面」に賛否の記載がない場合は、賛成するものとさせていただきます。
- ・同一の受益者の方がこの繰上償還について、重複して議決権を行使された場合で、議決権の行使の内容が異なるときは、すべての議決権に関して無効とさせていただきますのでご了承ください。
- ・議決権の行使に伴い、弊社が取得する受益者の方に関する個人情報（議決権行使書面等に記載された一切の個人情報を含みます。）は、書面決議に関する事務のために必要な範囲でのみ利用し、他の目的には使用いたしません。弊社はその個人情報を必要な範囲で販売会社と共有いたしますので、ご了承ください。

4. 書面決議手続きの流れ



5. 反対者の受益権買取請求の不適用について

当ファンドは、議決権の行使期間中および書面決議後も、通常通り換金のお申込みを受け付けているため、反対受益者による買取請求は行いません。

線上償還に反対された受益者の方で、線上償還前に換金を希望される方は、2024年5月29日までに通常の換金手続による換金をご利用ください。

6. 線上償還が決定した場合における償還までの運用について

運用状況等により、償還日まで基準価額は変動します。線上償還が決定した場合、償還準備のため組み入れ有価証券を売却することにより、書面決議日から償還までの期間においては運用の基本方針に則った運用ができなくなることがある点にご留意ください。

以上

<本件に関するお問い合わせ先>

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
お問合せ窓口 業務第二部 電話番号（代表）03-6756-4600
（受付時間）営業日の午前9時～午後5時

※お客様の個別のお取引内容については、お取引先の販売会社へお問い合わせください。

書面決議参考書類

1. 投資信託契約の解約の理由および相当性に関する事項

追加型証券投資信託「BNYメロン・日本株式ファンド 市場リスク管理型」は、2013年12月24日の設定以来、運用の基本方針に基づき信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行ってまいりましたが、2024年2月29日現在の受益権口数は、約9.4億口と信託約款に定める信託終了（繰上償還）の基準となる10億口を下回る状況です。今後、運用の基本方針に則った運用の継続が困難となることが懸念されるため、信託を終了し、お預かりした資産をお返しすることが受益者の皆様にとって有利であると判断いたしました。

2. 投資信託契約の解約がその効力を生ずる日

2024年5月31日

3. 投資信託契約の解約の中止に関する条件を定めるときは、その条件

当該書面決議において、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる賛成を得られない場合には、信託契約の解約（繰上償還）は中止されます。

4. 投資信託契約の解約に関する事項について受益者の不利益となる事実

該当事項はありません。

5. 直前に作成された財産状況開示資料等

次頁をご覧ください。

6. 財産状況開示資料等を作成した後に、重要な投資信託財産に属する財産の処分、重大な信託財産責任負担債務の負担その他の投資信託財産の状況に重要な影響を与える事象が生じたときは、その内容

該当事項はありません。

5. 直前に作成された財産状況開示資料等

追加型証券投資信託「BNYメロン・日本株式ファンド 市場リスク管理型」

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2023年1月16日現在)	第10期 (2024年1月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	59,869,850	30,009,238
株式	1,137,168,100	1,072,449,290
投資信託受益証券	48,282,450	64,172,040
派生商品評価勘定	11,610,000	-
未収入金	28,436,040	4,050,694
未収配当金	2,080,400	797,650
流動資産合計	1,287,446,840	1,171,478,912
資産合計	1,287,446,840	1,171,478,912
負債の部		
流動負債		
前受金	8,190,000	-
未払金	24,575,122	4,400,134
未払解約金	1,922,984	3,305,857
未払受託者報酬	309,845	252,430
未払委託者報酬	12,393,720	10,097,063
その他未払費用	670,583	642,962
流動負債合計	48,062,254	18,698,446
負債合計	48,062,254	18,698,446
純資産の部		
元本等		
元本	1,220,884,050	966,921,751
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	18,500,536	185,858,715
(分配準備積立金)	7,463,356	80,747,278
元本等合計	1,239,384,586	1,152,780,466
純資産合計	1,239,384,586	1,152,780,466
負債純資産合計	1,287,446,840	1,171,478,912

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 (自 2022年1月15日 至 2023年1月16日)	第10期 (自 2023年1月17日 至 2024年1月15日)
営業収益		
受取配当金	26,797,804	23,222,644
有価証券売買等損益	△129,658,352	324,277,367
派生商品取引等損益	△19,718,489	△137,301,463
その他収益	195	129
営業収益合計	△122,578,842	210,198,677
営業費用		
受託者報酬	660,253	515,088
委託者報酬	26,409,954	20,603,216
その他費用	1,417,960	1,329,927
営業費用合計	28,488,167	22,448,231
営業利益又は営業損失(△)	△151,067,009	187,750,446
経常利益又は経常損失(△)	△151,067,009	187,750,446
当期純利益又は当期純損失(△)	△151,067,009	187,750,446
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 又は一部解約に伴う当期純損失金額の分 配額(△)	△29,382,653	17,189,780
期首剰余金又は期首欠損金(△)	189,445,631	18,500,536
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,866,705	716,563
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	2,866,705	716,563
剰余金減少額又は欠損金増加額	52,127,444	3,919,050
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	52,127,444	3,919,050
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	18,500,536	185,858,715