

2022年7月7日

受益者のみなさま

東京海上アセットマネジメント株式会社

「東京海上・宇宙関連株式ファンド(為替ヘッジなし/為替ヘッジあり)」
＜運用委託先変更のお知らせ＞

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。

「東京海上・宇宙関連株式ファンド(為替ヘッジなし/為替ヘッジあり)」(以下、当ファンド)において、宇宙関連企業の株式等の運用の指図に関する権限を委託していた「アリアンツ・グローバル・インベスターズU.S.LLC」(以下、アリアンツGI米国法人)の担当運用チームは、2022年7月25日に「ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー」(以下、ヴォヤIM)に移管されます。

本件に関して、弊社は、移管先のヴォヤIMおよび移管後の運用体制などについて調査を行い、問題ない旨確認いたしました。詳細は、以下をご参照ください。

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。

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

■運用チーム移管の背景について

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年間の公募投信の運用の禁止という処分が下されました。

※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は、一切不正に関与していないことが明らかにされています。また、同グループは、当ファンドの運用チームとは関係ありません。

本件を踏まえ、アリアンツ GI 米国法人の運用チームと運用資産は、以前より米国内の提携について協議していたヴォヤ IM に移管されることが合意され、当ファンドの運用の指図に関する権限の委託先もアリアンツ GI 米国法人からヴォヤ IM に移管されることとなりました。

■ヴォヤ IM および今後の運用体制について

この度、弊社は、ヴォヤ IM および移管後の運用体制などについて調査を実施しました。今回の調査で、弊社は、当ファンドの運用チームが同社に移管された後も、運用体制、運用方針、運用プロセスに重大な変更はなく、メンバーも変わらずにこれまでと同様の運用環境で運用の継続性が十分確保されることを確認いたしました。また、経営状態や法令順守体制、リスク管理体制も同社の体制は他社比でも問題のない水準にあると評価しております。以上の様に、弊社では、ヴォヤ IM は当ファンドの委託先として相応しい会社であると判断しております。

■ヴォヤ IM について

運用拠点：米国カリフォルニア州サンフランシスコ

- ・ヴォヤIMは、米国の金融会社であるヴォヤ・ファイナンシャルの傘下にある米国の資産運用会社であり、債券運用や複合資産の運用に強みを持ちます。
- ・当ファンドを担当する運用チームは、航空宇宙や情報技術関連等の株式運用戦略について豊富な経験を有します。

以 上