

弊社ファンドにおけるクレディ・スイス・グループの保有状況について



2023年3月17日
ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

スイスの大手金融機関「クレディ・スイス・グループ」については、従来よりその経営を不安視する声がありましたが、筆頭株主が追加出資に否定的な姿勢を示したと報じられたこと等を受け、2023年3月15日（現地時間）に同社の発行する銘柄の価格が大幅に下落しました。

この事態を受け、スイス金融市場監査局（FINMA）とスイス国立銀行（中央銀行）は共同声明で、中央銀行が必要に応じ、同社に流動性を供給することを表明、翌16日にクレディ・スイス・グループは中央銀行から最大で500億スイスフランを調達する意向であると発表しました。

以下、弊社が設定する国内籍公募投資信託におけるクレディ・スイス・グループが発行する銘柄の保有状況についてご報告申し上げます。

【図表】クレディ・スイス・グループが発行する銘柄を保有している弊社国内籍公募投資信託一覧

※組入比率は小数点第2位を四捨五入

ファンド名	組入比率	時点	備考
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）円コース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ユーロコース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）豪ドルコース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）南アフリカランドコース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジルリアルコース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）資源国通貨コース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）メキシコペソコース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 欧州ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）トルコリラコース（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 通貨選択型エマーシング・ソブリン・ボンド・ファンド 豪ドルコース（毎月分配型） 愛称：通貨セレクト 豪ドル	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 通貨選択型エマーシング・ソブリン・ボンド・ファンド ブラジルリアルコース（毎月分配型） 愛称：通貨セレクト ブラジルリアル	0.0%	2023/3/13	※1
DWS 通貨選択型エマーシング・ソブリン・ボンド・ファンド 円コース（毎月分配型） 愛称：通貨セレクト 円	0.0%	2023/3/13	※1

当資料は、投資家の方を対象にした情報提供を目的としたものであり、特定の投資商品の推奨や投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は、信頼できる情報をもとにドイチェ・アセット・マネジメント株式会社が作成しておりますが、正確性・完全性について当社が責任を負うものではありません。当資料記載の情報等は、作成時点のものであり、市場の環境やその他の状況によって予告なく変更することがあります。当資料に記載されている個別の銘柄・企業名については、あくまでも参考として記載したものであり、その銘柄・企業の株式等の売買を推奨するものではありません。

【図表】クレディ・スイス・グループが発行する銘柄を保有している弊社国内籍公募投資信託一覧

※組入比率は小数点第2位を四捨五入

ファンド名	組入比率	時点	備考
DWS ロシア・ルーブル債券投信（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※2
DWS ロシア・ルーブル債券投信（年2回決算型）	0.0%	2023/3/13	※2
DWS ブラジル・リアル債券ファンド（毎月分配型）	0.0%	2023/3/13	※3
DWS ブラジル・リアル債券ファンド（年1回決算型）	0.0%	2023/3/13	※3
ドイツE・ETFアロケーション・ファンド（安定型）（愛称:ブラチナラップ）	0.1%	※4	
ドイツE・ETFアロケーション・ファンド（成長型）（愛称:ブラチナラップ）	0.0%	※4	
ドイツE・ETFバランス・ファンド（愛称:ブラチナコア）	0.1%	※4	
DWS コモディティ戦略ファンド（年1回決算型）Aコース（為替ヘッジあり）	0.3%	2023/3/13	※5
DWS コモディティ戦略ファンド（年1回決算型）Bコース（為替ヘッジなし）	0.3%	2023/3/13	※5

- ※1： DWS フォルゾーゲ・ゲルトマルクト（ルクセンブルグ籍外国投資信託）が保有。なお、DWS フォルゾーゲ・ゲルトマルクトの主な投資対象はユーロ建の短期金融商品等。
- ※2： DWS ロシア・ルーブル債券投信・マザーファンドにおける組入比率（DWS フォルゾーゲ・ゲルトマルクト（ルクセンブルグ籍外国投資信託）が保有。なお、DWS フォルゾーゲ・ゲルトマルクトの主な投資対象はユーロ建の短期金融商品等）。
- ※3： DWS ブラジル・リアル債券マザーファンドにおける組入比率（DWS フォルゾーゲ・ゲルトマルクト（ルクセンブルグ籍外国投資信託）が保有。なお、DWS フォルゾーゲ・ゲルトマルクトの主な投資対象はユーロ建の短期金融商品等）。
- ※4： 保有するETF（上場投資信託）で投資。保有比率の計算のもととなる保有ETFにおけるクレディ・スイス・グループの組入比率は2023年3月10日時点。なお一部のETFにおいては直近（2023年3月15日時点）で取得可能な値を基に計算。
- ※5： DWS インベスト エンハンスト・コモディティ・ストラテジー（ルクセンブルグ籍外国投資法人）が債券運用戦略（デリバティブ取引のために活用した証拠金以外の現金等について、デュレーションの短い国債や社債等に投資）において保有。

ご留意事項

●投資信託に係るリスクについて

投資信託は、主に国内外の株式や公社債等の値動きのある証券を投資対象とし投資元本が保証されていないため、当該資産の市場における取引価格の変動や為替の変動等により投資一単位当たりの価値が変動します。したがってお客様のご投資された金額を下回ることもあります。

また、投資信託は、個別の投資信託毎に投資対象資産の種類や投資制限、取引市場、投資対象国等が異なることから、リスクの内容や性質が異なりますので、ご購入に際しては、事前に最新の投資信託説明書（交付目論見書）や契約締結前交付書面の内容をご確認の上、ご自身で判断して下さい。

●投資信託に係る費用について

【お申込みいただくお客様には以下の費用をご負担いただきます。】

- 購入時に直接ご負担いただく費用・・・購入時手数料 上限3.85%（税抜3.50%）
- 換金時に直接ご負担いただく費用・・・信託財産留保額 上限0.5%
- 投資信託の保有期間中に間接的にご負担いただく費用・・・運用管理費用（信託報酬） 上限2.068%（税抜1.88%）
- その他費用・・・上記以外に保有期間等に応じてご負担いただく費用があります。
投資信託説明書（交付目論見書）、契約締結前交付書面等でご確認下さい。

《ご注意》

上記に記載しているリスクや費用項目につきましては、一般的な投資信託を想定しております。費用の料率につきましては、ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社が運用するすべての投資信託のうち、徴収するそれぞれの費用における最高の料率を記載しております。投資信託の運用による損益は、すべて受益者に帰属します。投資信託は、金融機関の預貯金と異なり、元本及び利息の保証はありません。投資信託は、預金または保険契約ではないため、預金保険及び保険契約者保護機構の保護の対象にはなりません。登録金融機関を通じてご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象とはなりません。投資信託に係るリスクや費用は、それぞれの投資信託により異なりますので、ご購入に際しては、事前に最新の投資信託説明書（交付目論見書）や契約締結前交付書面の内容をご確認の上、ご自身で判断して下さい。

なお、当社では投資信託の直接の販売は行っておりませんので、実際のお申込みにあたっては、各投資信託取扱の販売会社にお問合せ下さい。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第359号
加入協会：日本証券業協会、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