

受益者の皆さまへ

シュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社

公募投資信託の流動性リスクモニタリングにおける流動性階層分類について

弊社の一般社団法人投資信託協会の「投資信託の運用に関する規則」第2条の4に基づいて定める流動性リスクモニタリングにおいて、基本的には当該協会規則に規定される流動性リスクに基づく階層分類の分類方法を用いて管理を行っております。

データの制約上、当該協会規則に規定される階層分類の分類方法とは異なる、弊社グローバル体制の流動性リスク管理プロセスに準じた以下の階層分類を採用しているファンドがございます。

<対象ファンド>

- シュローダー・ツーシグマ・ダイバーシファイド・ファンド

流動性階層	階層 1	階層 2	階層 3	階層 4
階層区分	3 営業日以内に 売却可能	4 営業日以上 5 営業日以内に 売却可能	6 営業日以上 10 営業日以内に 売却可能	11 営業日以上 を要する

※保有資産の分類においては、著しいマーケットインパクトを伴わずに売却・現金化するのに要すると考えられる日数を保守的に推定しております。