

上場投資信託の信託証書変更のお知らせ

令和 2 年 8 月 28 日

各 位

管理会社名 ステート・ストリート・グローバル・
 アドバイザーズ・シンガポール・
 リミテッド
 (管理会社コード 13494)

代表者の ディレクター

役職・氏名 オン・ホイ・ヤオ

東京都千代田区大手町一丁目

代理人の 1 番 2 号大手門タワー

居所又は住所 西村あさひ法律事務所

代理人の

役職・氏名 弁護士 伊東 啓

連絡先 西村あさひ法律事務所

担当者氏名 弁護士 藤澤 美緒子

電話番号 03-6250-6200

当社が管理会社となっている ABF 汎アジア債券インデックス・ファンド (銘柄コード: 1349) (以下「本信託」といいます。) につきまして、マネージャーとしての当社と、受託者としての HSBC インスティテューショナル・トラスト・サービシーズ(シンガポール)リミテッドは、第 6 変更証書 (本信託の 2005 年 6 月 21 日付信託証書 (その後の変更を含み、以下「本信託証書」といいます。)) を修正し書き換えるもの) を締結いたしました。

第 6 変更証書による変更は、本信託に適用される有価証券の貸付取引の上限および担保要件の変更の組み込み、ならびに、香港証券取引所による取引規定の変更に平仄を合わせるため「営業日」「香港営業日」の定義の更新および対応する「非常事態」の定義の追加を行うためのものです。

第 6 変更証書は、2020 年 8 月 17 日より発効しております。

別紙 本信託証書の新旧対照表 (和訳)

以 上

本信託証書の新旧対照表（和訳）

第 6 変更証書の改訂後の条文 (2020 年 8 月 17 日より有効)	本信託証書の改訂前の条文
<p>1.1 文脈上別段の解釈が要求されない限り、以下の用語または表現はそれぞれ以下で与えられた意味を有するものとする。</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p>「営業日」とは、シンガポールおよび香港で商業銀行が営業し、(i)香港証券取引所が通常取引を行っており(香港証券取引所における取引が、平日の通常終業時前に終了することが予定されている日を除く。)、かつ(ii)パン・アジア指数が集計され、公表される日をいう。ただし、香港証券取引所が当該日の取引を正式に開始した後かつ香港証券取引所が当該日の取引を正式に終了する前のいかなるときにおいて、台風警報シグナル 8 以上、「黒色」暴風雨警報(もしくは本受託者が事実上これに類似すると判断する警報もしくはシグナル)または非常事態(本信託証書に定義される。)の宣言が、香港で発令されている日(または本マネージャーおよび本受託者が随時決定するその他の日)を除く。</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p>「非常事態」とは、深刻な公共交通機関の混乱、重大な洪水、大規模な地滑り、大規模な停電その他の有事に起因して、台風警報シグナル 8 以前にまたは台風警報シグナル 3 もしくはそれ以下に替えて香港のいずれかの政府当局により宣言される「非常事態」の発生をいう。</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p>「香港営業日」とは、香港証券取引所が通常取引を行っている日をいう(香港証券取引所における取引が、平日の通常終業時前に終了することが予定されている日を除く。)。ただし、香港証券取引所が当該日の取引を正式に開始した後かつ香港証券取引所が当該日の取引を正式に終了する前のいかなるときにおいて、台風警報シグナル 8 以上、「黒色」暴風雨警報(もしくは本受託者が事実上これに類似すると判断する警報もしくはシグナル)または非常事態(本信託証書に定義される。)の宣言が、香港で発令されている日(または本マネージャーおよび本受託者が随時決定するその</p>	<p>1.1 文脈上別段の解釈が要求されない限り、以下の用語または表現はそれぞれ以下で与えられた意味を有するものとする。</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p>「営業日」とは、シンガポールおよび香港で商業銀行が営業し、(i)香港証券取引所が通常取引を行っており(香港証券取引所における取引が、平日の通常終業時前に終了することが予定されている日を除く。)、かつ(ii)パン・アジア指数が集計され、公表される日をいう。ただし、香港証券取引所が当該日の取引を正式に開始した後かつ香港証券取引所が当該日の取引を正式に終了する前のいかなるときにおいて、台風警報シグナル 8 以上または「黒色」暴風雨警報(または本受託者が事実上これに類似すると判断する警報もしくはシグナル)が、香港で発令されている日(または本マネージャーおよび本受託者が随時決定するその他の日)を除く。</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p style="text-align: center;">(中略)</p> <p>「香港営業日」とは、香港証券取引所が通常取引を行っている日をいう(香港証券取引所における取引が、平日の通常終業時前に終了することが予定されている日を除く。)。ただし、香港証券取引所が当該日の取引を正式に開始した後かつ香港証券取引所が当該日の取引を正式に終了する前のいかなるときにおいて、台風警報シグナル 8 以上または「黒色」暴風雨警報(または本受託者が事実上これに類似すると判断する警報もしくはシグナル)が、香港で発令されている日(または本マネージャーおよび本受託者が随時決定するその他の日)を除く。</p>

第 6 変更証書の改訂後の条文 (2020 年 8 月 17 日より有効)	本信託証書の改訂前の条文
他の日)を除く。 (中略)	(中略)
15.8.12 当該償還が本信託によって現金または短期金融商品により全額満たされることが可能な場合を除き、償還が当該有価証券について未払いの総額に対して行われる場合(これにより当該現金または短期金融商品の金額が、第 15.19.1 号および第 15.19.2 号の目的において、デリバティブ商品 の取引 に起因する将来のもしくは偶発的なコミットメントをカバーするために分離されなかった場合)に、何らかの有価証券を保有すること。	15.8.12 当該償還が本信託によって現金または短期金融商品により全額満たされることが可能な場合を除き、償還が当該有価証券について未払いの総額に対して行われる場合(これにより当該現金または短期金融商品の金額が、第 15.19.1 号および第 15.19.2 号の目的において、デリバティブ商品に起因する将来のもしくは偶発的なコミットメントをカバーするために分離されなかった場合)に、何らかの有価証券を保有すること。
15.16.1 かかる 1 ないし複数の貸付の総額が、本信託の本評価額(かかる貸付から得た資産を含む。)の <u>30%</u> を超えないものとする。	15.16.1 かかる 1 ないし複数の貸付の総額が、本信託の本評価額(かかる貸付から得た資産を含む。)の <u>10%</u> を超えないものとする。
15.16.3 投資ガイドライン規約に従い、貸付に関して取得される担保が十分であるものとし、かかる担保の評価額がいかなる場合においても貸し付けられた指数構成銘柄および非指数構成銘柄の本評価額の <u>100%を超える</u> ものとし、かかる担保が、(i)現金、(ii)指数構成銘柄、(iii)非指数構成銘柄および/または(iv)本受託者により承認されたその他の高品質の現金同等投資から構成され、残存期間が 366 日を超えないものであること。	15.16.3 投資ガイドライン規約に従い、貸付に関して取得される担保が十分であるものとし、かかる担保の評価額がいかなる場合においても貸し付けられた指数構成銘柄および非指数構成銘柄の本評価額の <u>100%を下回らな</u> いものとし、かかる担保が、(i)現金、(ii)指数構成銘柄、(iii)非指数構成銘柄および/または(iv)本受託者により承認されたその他の高品質の現金同等投資から構成され、残存期間が 366 日を超えないものであること。

以 上