

2019年8月9日

受益者の皆さまへ

明治安田アセットマネジメント株式会社

ソシエテ・ジェネラル イタリア国債ユーロ円建リパッケージ債券
(為替参照利回り変動型) ファンド2019-08 <愛称:アズーリ201908>
投資対象債券の発行条件に関するお知らせ

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております単位型証券投資信託 ソシエテ・ジェネラル イタリア国債ユーロ円建リパッケージ債券 (為替参照利回り変動型) ファンド2019-08 が主要投資対象とするユーロ円建債券「イタリア国債ユーロ円建リパッケージ債券 (為替参照利回り変動型) II」につきまして、下記のとおり発行条件が決定しましたのでお知らせいたします。

今後とも、当社の投資信託に一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

敬具

記

イタリア国債ユーロ円建リパッケージ債券 (為替参照利回り変動型) II

発行会社	ソシエテ・ジェネラル・バンク・アンド・トラスト・エス・エイ
発行日	2019年8月20日
償還日	2025年5月23日
利払日	年1回(利払日は次頁参照)
発行価格 (円)	額面100円につき100円
償還価格 (円)	額面100円につき100円
クーポン基準日の米ドル円為替レート	105.915円

<p>利率（円払い）</p>	<p>①第1回目 第1回目の利金には固定利率が適用されます。 固定利率 年率 1.49%</p> <p>②第2回目以降 クーポン基準日※1の米ドル円為替レートと比較したクーポン判定日※2の米ドル円為替レート※3により次のとおりとなります。</p> <p style="text-align: center;">105.915円 以上の円安の場合：年率 0.86%</p> <p style="text-align: center;">105.915円 未満の円高の場合：年率 0.66%</p> <p>※1 クーポン基準日：2019年8月9日 ※2 クーポン判定日：各利払日の10営業日前の日 ※3 米ドル円為替レート：原則として午後3時（東京時間）における Bloomberg BFIX 米ドル円為替相場の仲値</p> <p>ご参考</p> <table border="1" data-bbox="512 813 1406 1099"> <thead> <tr> <th></th> <th>クーポン基準日</th> <th>クーポン判定日</th> <th>利払日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>第1回利払</td> <td style="text-align: center;">—</td> <td style="text-align: center;">—</td> <td>2020年6月4日</td> </tr> <tr> <td>第2回利払</td> <td rowspan="5" style="text-align: center;">2019年8月9日</td> <td>2021年5月19日</td> <td>2021年6月3日</td> </tr> <tr> <td>第3回利払</td> <td>2022年5月17日</td> <td>2022年6月1日</td> </tr> <tr> <td>第4回利払</td> <td>2023年5月16日</td> <td>2023年5月31日</td> </tr> <tr> <td>第5回利払</td> <td>2024年5月16日</td> <td>2024年5月31日</td> </tr> <tr> <td>第6回利払 （償還日）</td> <td>2025年5月9日</td> <td>2025年5月23日</td> </tr> </tbody> </table>		クーポン基準日	クーポン判定日	利払日	第1回利払	—	—	2020年6月4日	第2回利払	2019年8月9日	2021年5月19日	2021年6月3日	第3回利払	2022年5月17日	2022年6月1日	第4回利払	2023年5月16日	2023年5月31日	第5回利払	2024年5月16日	2024年5月31日	第6回利払 （償還日）	2025年5月9日	2025年5月23日
	クーポン基準日	クーポン判定日	利払日																						
第1回利払	—	—	2020年6月4日																						
第2回利払	2019年8月9日	2021年5月19日	2021年6月3日																						
第3回利払		2022年5月17日	2022年6月1日																						
第4回利払		2023年5月16日	2023年5月31日																						
第5回利払		2024年5月16日	2024年5月31日																						
第6回利払 （償還日）		2025年5月9日	2025年5月23日																						
<p>主要な関係法人</p>	<p><カストディアン> バンク・オブ・ニューヨーク・メロン（ルクセンブルグ）SA <ディスポーザル・エージェント> バンク・オブ・ニューヨーク・メロン（ロンドン支店） <スワップ・カウンターパーティ> ソシエテ・ジェネラル</p>																								
<p>その他</p>	<p>担保証券：イタリア国債 1.45% 2025年5月15日（ユーロ建て） イタリア国債もしくは当該ユーロ円建債券の発行体が債務不履行等となった場合には、早期償還されることとなります。</p>																								

※資金動向、市況動向等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

以上