

# SOMPO好利回り CBファンド2023-09

(為替ヘッジあり・限定追加型) /  
(為替ヘッジなし・限定追加型)

追加型投信 / 内外 / その他資産 (転換社債)

作成対象期間: 2023年9月19日~2024年9月19日

第1期 決算日: 2024年9月19日



## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
当ファンドは、日本を含む先進国の転換社債に投資を行い、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。当作成期もそれに沿った運用を行いました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。

第1期末 2024.9.19

	為替ヘッジあり・ 限定追加型	為替ヘッジなし・ 限定追加型
基準価額	9,542円	10,103円
純資産総額	350百万円	1,184百万円
騰落率 <sup>※</sup>	△4.6%	1.0%
期中分配金合計	0円	0円

※ 騰落率は、収益分配金 (税引前) を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

当ファンドは、投資信託約款において運用報告書 (全体版) を電磁的方法によりご提供することを定めております。運用報告書 (全体版) は下記の方法で閲覧いただけます。

なお、ご請求いただいた場合には交付いたしますので、販売会社までお問い合わせください。

### ▶ 運用報告書 (全体版) の閲覧方法



<https://www.sompo-am.co.jp/>  
にアクセス

「ファンド検索」等から当ファンドのページを表示して、  
閲覧またはダウンロードすることができます。

### SOMPOアセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル  
お問い合わせ先: リテール営業部  
(受付時間 営業日の午前9時~午後5時)



0120-69-5432

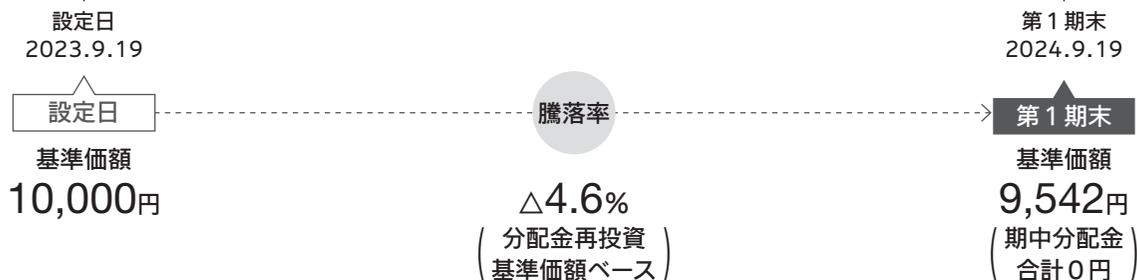
# 運用経過

## ● 基準価額の推移

 為替ヘッジあり・限定追加型



基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、設定時の基準価額（10,000円）をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、転換社債へ投資し、投資地域の分散をはかりながら、価格水準、発行企業の財務内容等を考慮しつつ、信用リスクと比較して相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を中心に投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 為替ヘッジあり・限定追加型

当期は、投資している好利回りC B マザーファンド 2023-09 の基準価額の上昇がプラス寄与となった一方、ドル円為替ヘッジに伴うヘッジコストなどがマイナス寄与となりました。

### 好利回りC B マザーファンド 2023-09

期中の騰落率は+2.4%となりました。

主要中央銀行による利上げ局面から利下げ時期を模索する展開となる中、株式市場は堅調な推移を見せ、これらを背景に保有する転換社債は堅調な推移となりました。また、ドル円相場は通期で下落となりマイナス寄与となりました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド    マザーファンド

## ● 基準価額の推移

### ☰ 為替ヘッジなし・限定追加型



設定日  
2023.9.19

第1期末  
2024.9.19

設定日

騰落率

第1期末

基準価額  
10,000円

1.0%  
(分配金再投資)  
(基準価額ベース)

基準価額  
10,103円  
(期中分配金)  
(合計0円)

- 分配金再投資基準価額の推移は、設定時の基準価額（10,000円）をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、転換社債へ投資し、投資地域の分散をはかりながら、価格水準、発行企業の財務内容等を考慮しつつ、信用リスクと比較して相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を中心に投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 為替ヘッジなし・限定追加型

当期は、投資している好利回りC B マザーファンド2023-09の基準価額が上昇したことにより、当ファンドの基準価額も上昇しました。

### 好利回りC B マザーファンド2023-09

期中の騰落率は+2.4%となりました。

主要中央銀行による利上げ局面から利下げ時期を模索する展開となる中、株式市場は堅調な推移を見せ、これらを背景に保有する転換社債は堅調な推移となりました。また、ドル円相場は通期で下落となりマイナス寄与となりました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド    マザーファンド

## ● 1万口当たりの費用明細

### 為替ヘッジあり・限定追加型

項目	第1期 2023.9.19~2024.9.19		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	111円	1.136%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は9,744円です。
( 投信会社 )	( 64 )	( 0.662 )	ファンドの運用の対価
( 販売会社 )	( 43 )	( 0.441 )	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
( 受託会社 )	( 3 )	( 0.033 )	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	4	0.042	(b) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
( 保管費用 )	( 2 )	( 0.024 )	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用
( 監査費用 )	( 1 )	( 0.013 )	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
( その他 )	( 0 )	( 0.005 )	信託事務の処理にかかるその他の費用等
<b>合計</b>	<b>115</b>	<b>1.178</b>	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

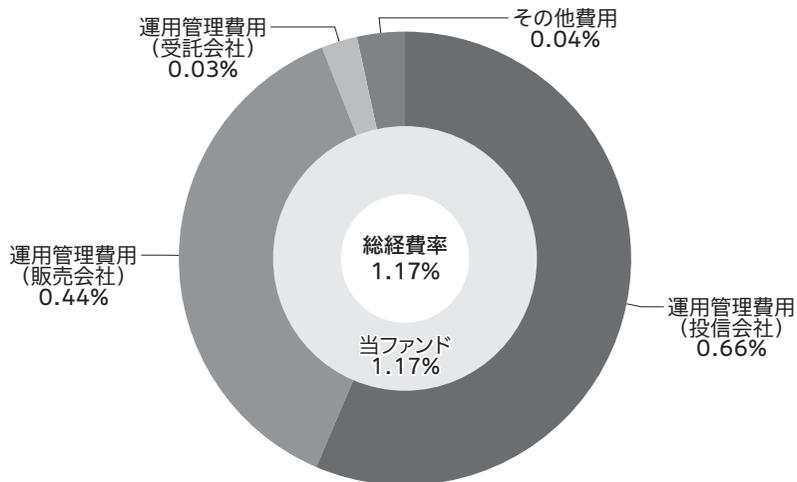
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

### ○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.17%**です。



1  
万  
口  
当  
た  
り  
の  
費  
用  
明  
細

注1. 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

注2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

注3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

注5. 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。



## 為替ヘッジなし・限定追加型

項目	第1期 2023.9.19~2024.9.19		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	117円	1.136%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,298円です。
(  投信会社)	( 68)	(0.662)	ファンドの運用の対価
(  販売会社)	( 45)	(0.441)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(  受託会社)	(  3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	4	0.039	(b) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
(  保管費用)	(  2)	(0.023)	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用
(  監査費用)	(  1)	(0.013)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
(  その他)	(  0)	(0.003)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
<b>合計</b>	<b>121</b>	<b>1.175</b>	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

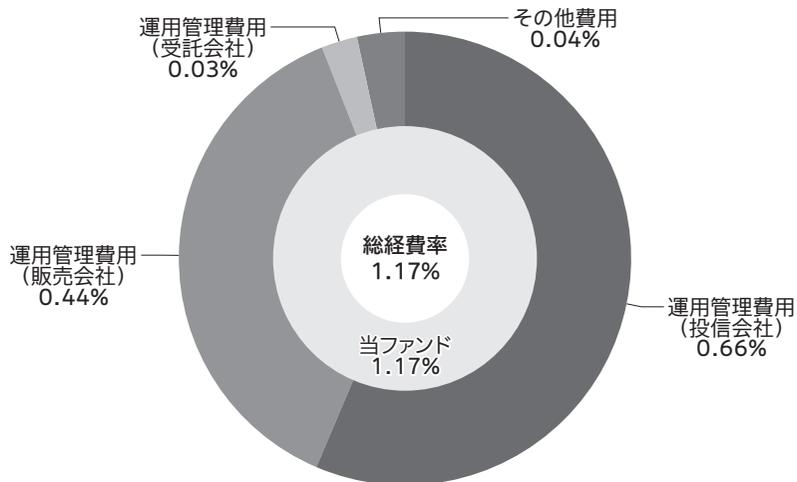
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.17%**です。



1  
万  
口  
当  
た  
り  
の  
費  
用  
明  
細

注1. 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

注2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

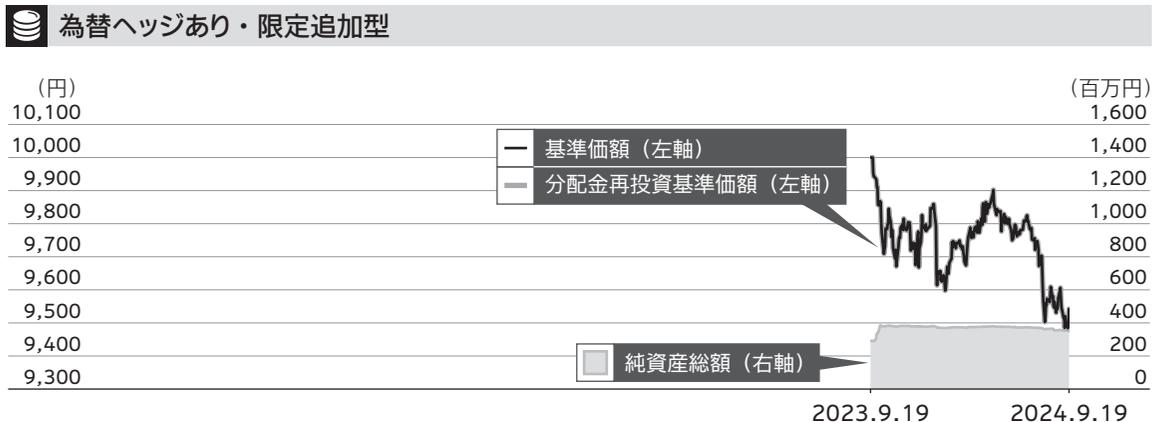
注3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

注5. 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ● 最近5年間の基準価額等の推移

2019.9.19～2024.9.19



- 分配金再投資基準価額の推移は、設定時の基準価額（10,000円）をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、転換社債へ投資し、投資地域の分散をはかりながら、価格水準、発行企業の財務内容等を考慮しつつ、信用リスクと比較して相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を中心に投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

決算日		2023.9.19 設定時	2024.9.19 決算日
基準価額	(円)	10,000	9,542
期中分配金合計（税引前）	(円)	—	0
分配金再投資 基準価額騰落率	(%)	—	△ 4.6
純資産総額	(百万円)	291	350

2019.9.19~2024.9.19

 為替ヘッジなし・限定追加型



- 分配金再投資基準価額の推移は、設定時の基準価額（10,000円）をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、転換社債へ投資し、投資地域の分散をはかりながら、価格水準、発行企業の財務内容等を考慮しつつ、信用リスクと比較して相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を中心に投資します。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

最近5年間の基準価額等の推移

決算日		2023.9.19 設定時	2024.9.19 決算日
基準価額	(円)	10,000	10,103
期中分配金合計（税引前）	(円)	—	0
分配金再投資 基準価額騰落率	(%)	—	1.0
純資産総額	(百万円)	877	1,184

## ● 投資環境

### ○ 転換社債市場

2023年9月から10月にかけては、米国金利の上昇、中国の経済減速懸念、原油高によるインフレ再上昇懸念、中東地域の地政学リスクに対する懸念などを背景に転換社債（以下、CB）市場は下落基調となりました。11月から12月は、米国の金融政策の転換に対する期待が高まったことなどから米国金利は低下し、CB市場は上昇基調となりました。2024年に入り、1月はFRB（米連邦準備理事会）高官が早期の利下げ織り込みを牽制する発言を行ったことなどを受けて米国金利は上昇し、CB市場は下落しました。2月から3月は、引き続き米国金利が重石となったものの、主要株式市場は堅調な推移となり、CB市場は上昇しました。4月はインフレ再燃の可能性を背景に米国金利が上昇する中でCB市場は下落しましたが、5月以降は利下げ期待が再び強まる中、8月上旬に一時的に株式市場の急落局面があったものの、期末にかけて主要株式市場は堅調に推移し、CB市場も堅調な推移となりました。

### ○ 為替市場（ドル円相場）

2023年10月にかけて米国の金融引き締め長期化観測などを背景に、円安ドル高が進行しました。その後、11月から12月にかけて、米国の利下げ期待が高まったことから円高ドル安局面となりました。2024年1月以降、引き続き日米金利差が主な材料となり、日銀の金融政策正常化観測が醸成される一方、米国の利下げ先送り観測が台頭する中、円安ドル高が進行しました。4月末、5月初めに為替介入が実行され、一時的に円高局面もありましたが、6月末から7月上旬にかけては、1ドル160円を超えた水準となりました。7月中旬以降は、米国の利下げ期待が高まったことや日銀の金融政策決定会合での追加利上げなどが材料となり、円高ドル安が加速しました。

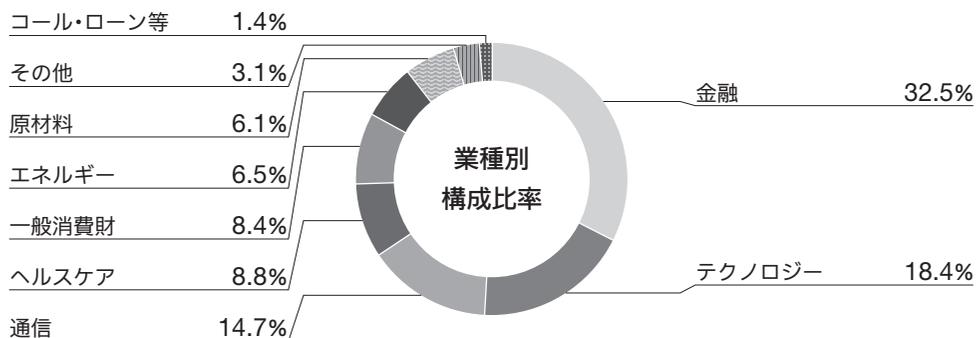
## ● 当該投資信託のポートフォリオ

### 為替ヘッジあり・限定追加型／為替ヘッジなし・限定追加型

両ファンドともに、期を通して好利回りCBマザーファンド2023-09の組入比率を高位に維持しました。為替ヘッジあり・限定追加型では、為替変動リスクを回避するために、原則としてドル円為替のフルヘッジを行っています。

## 📊 好利回りCBマザーファンド2023-09

期を通して転換社債の組入比率を高位に維持しました。国別では、米国、欧州など先進国企業の転換社債に分散したポートフォリオを構築しました（期末において33銘柄保有）。通貨別では、米ドル建て転換社債が中心で、その他はユーロ建てなどとなります。米ドル建て以外の転換社債についてはドルヘッジを実行し、実質的な運用通貨を米ドルとしたポートフォリオ運用を行いました。



注1. 比率は、第1期末における純資産総額に対する割合。

注2. 端数処理の関係上、構成比合計が100%とならない場合があります。

注3. 業種はBloombergセクターを使用しています。

## ● 当該投資信託のベンチマークとの差異

### 📊 為替ヘッジあり・限定追加型 / 為替ヘッジなし・限定追加型

各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む先進国の転換社債に投資を行い、投資地域の分散をはかりながら、価格水準、発行企業の財務内容等を考慮しつつ、信用リスクと比較して相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を中心に投資するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 分配金

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

### 為替ヘッジあり・限定追加型

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	第1期 2023.9.19~2024.9.19
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	0

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## 為替ヘッジなし・限定追加型

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	第1期 2023.9.19~2024.9.19
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	104

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## ● 今後の運用方針

### 為替ヘッジあり・限定追加型

引き続き、好利回りC B マザーファンド2023-09への投資を通じ、主として先進国の転換社債の中から、相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。また、為替変動リスクを回避するために、原則として為替のフルヘッジを行います。

### 為替ヘッジなし・限定追加型

引き続き、好利回りC B マザーファンド2023-09への投資を通じ、主として先進国の転換社債の中から、相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。

### 好利回りC B マザーファンド2023-09

好利回りC B（転換社債）は、国債に比べて高い利回りや下値抵抗力の特性を有しており、トータルリターン観点から魅力的な資産クラスであると考えます。ポートフォリオ運営においては、投資地域の分散をはかりながら、価格水準、発行企業の財務内容等を考慮しつつ、信用リスクと比較して相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を中心に投資する方針です。また、米ドル建て以外の転換社債についてはドルヘッジを実行し、実質的な運用通貨を米ドルとしたポートフォリオ運用を行います。

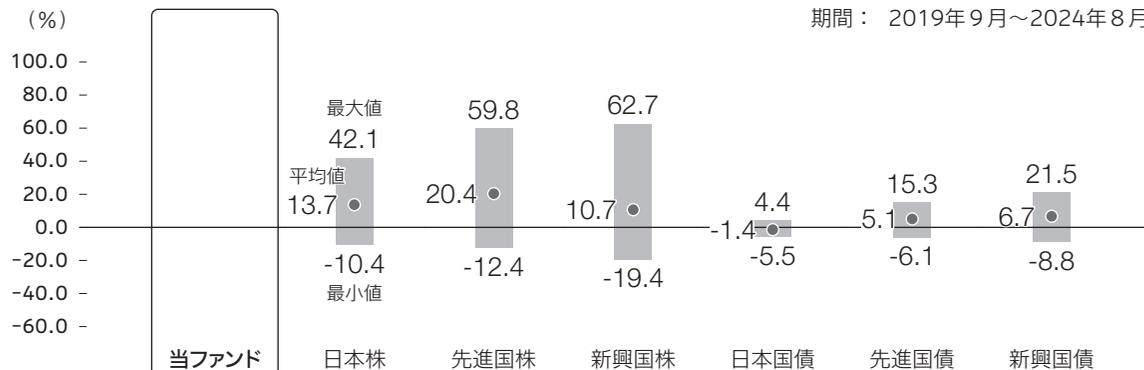
## ● 当該投資信託の概要

商品分類	追加型投信／内外／その他資産（転換社債）
信託期間	2023年9月19日から2027年12月22日まで
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を図ることを目的とします。
主要投資対象	 SOMPO好利回りCBファンド2023-09（為替ヘッジあり・限定追加型） ／（為替ヘッジなし・限定追加型） 好利回りCBマザーファンド2023-09受益証券  好利回りCBマザーファンド2023-09 日本を含む先進国の転換社債
運用方法	① 主として、日本を含む先進国の転換社債に投資を行います。 ② 転換社債への投資にあたっては、投資地域の分散をはかりながら、価格水準、発行企業の財務内容等を考慮しつつ、信用リスクと比較して相対的に最終利回りが高いと判断する銘柄を中心に投資します。 ③ マザーファンドにおける転換社債等の運用指図に関する権限をRBCグローバル・アセット・マネジメント（UK）リミテッドに委託します。 ④ 「為替ヘッジあり」と「為替ヘッジなし」があります。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ① 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。 ② 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。

## ● 代表的な資産クラスとの騰落率の比較

### ☰ 為替ヘッジあり・限定追加型

期間： 2019年9月～2024年8月



① 資料作成時において、当ファンドの運用期間が1年未満のため、当ファンドの年間騰落率を記載しておりません。

\* 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、代表的な資産クラスについて表示したものです。

\* 各資産クラスの指数

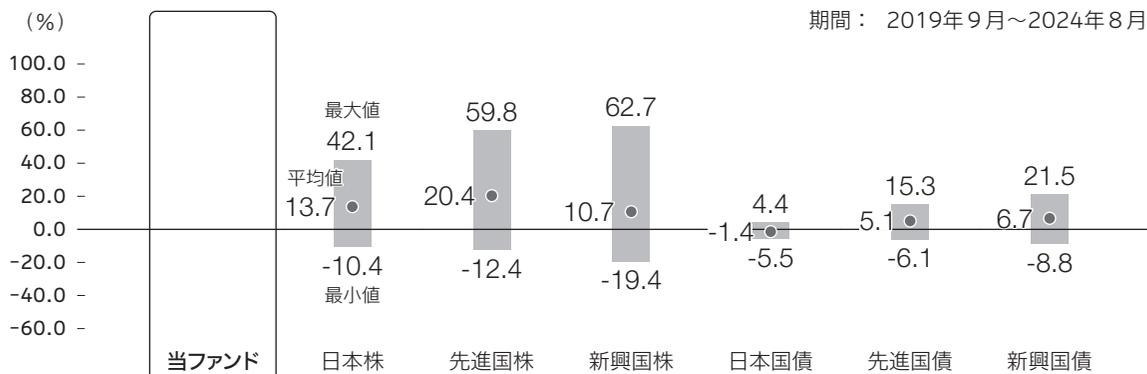
日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)
日本国債	NOMURA-BPI国債
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 上記の騰落率は直近月末から60ヶ月遡った算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

指数に関する詳細は23ページをご参照ください。

## 為替ヘッジなし・限定追加型



代表的な資産クラスとの騰落率の比較

① 資料作成時において、当ファンドの運用期間が1年未満のため、当ファンドの年間騰落率を記載しておりません。

\* 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、代表的な資産クラスについて表示したものです。

\* 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)
日本国債	NOMURA-BPI国債
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 上記の騰落率は直近月末から60ヶ月遡った算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

指数に関する詳細は23ページをご参照ください。

# 当該投資信託のデータ

☰ 為替ヘッジあり・限定追加型

## ● 当該投資信託の組入資産の内容

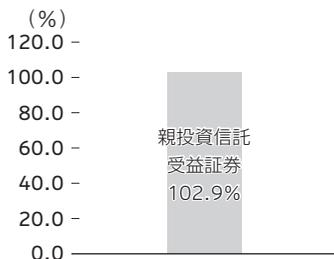
※ 組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

### 組入ファンド

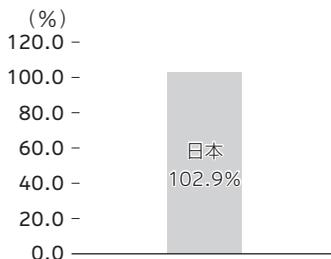
	第1期末 2024.9.19
好利回りC B マザーファンド2023-09	102.9%

注. 比率は第1期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

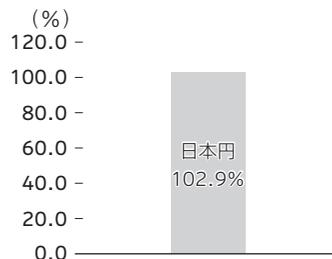
### 資産別配分



### 国別配分



### 通貨別配分



注. 比率は第1期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

## ● 純資産等

項目	第1期末 2024.9.19
純資産総額	350,570,127円
受益権総口数	367,404,219口
1万口当たり基準価額	9,542円

※ 当期中における追加設定元本額は98,469,618円、同解約元本額は22,527,789円です。



為替ヘッジなし・限定追加型

## ● 当該投資信託の組入資産の内容

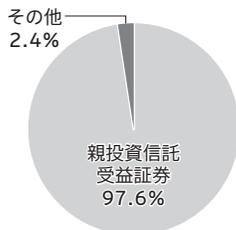
※ 組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

### 組入ファンド

	第1期末 2024.9.19
好利回りC B マザーファンド2023-09	97.6%

注. 比率は第1期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

### 資産別配分



### 国別配分



### 通貨別配分



注. 比率は第1期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

## ● 純資産等

項目	第1期末 2024.9.19
純資産総額	1,184,638,681円
受益権総口数	1,172,606,194口
1万口当たり基準価額	10,103円

※ 当期中における追加設定元本額は360,497,902円、同解約元本額は65,726,487円です。

当該投資信託の組入資産の内容／純資産等

## ● 組入上位ファンドの概要

※ 組入ファンドの計算期間の詳細な運用経過等に関する詳細な情報については、運用報告書（全体版）に記載されています。

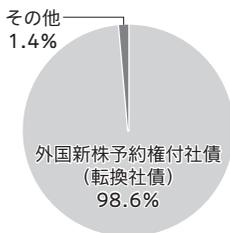


組入上位ファンドの概要

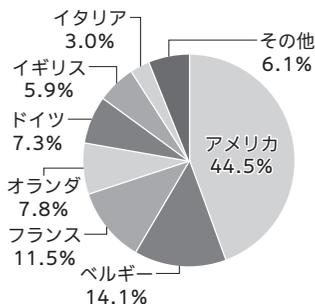
## 組入上位10銘柄

銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
1 DIGITALOCEAN 0.0 CB	新株予約権付社債(転換社債)	アメリカ・ドル	アメリカ	6.2%
2 SNAP 0.0 CB	新株予約権付社債(転換社債)	アメリカ・ドル	アメリカ	6.2%
3 UMICORE 0.0 CB	新株予約権付社債(転換社債)	ユーロ	ベルギー	6.1%
4 JUST EAT TAKEAWAY 0.0 CB	新株予約権付社債(転換社債)	ユーロ	オランダ	6.0%
5 SAGERPAR 0.0 CB	新株予約権付社債(転換社債)	ユーロ	ベルギー	6.0%
6 SMWHLN 1.625 CB	新株予約権付社債(転換社債)	イギリス・ポンド	イギリス	5.9%
7 EURONET 0.75 CB	新株予約権付社債(転換社債)	アメリカ・ドル	アメリカ	5.8%
8 TELADOC HEALTH 1.25 CB	新株予約権付社債(転換社債)	アメリカ・ドル	アメリカ	5.8%
9 WORLDLINE 0.0 CB	新株予約権付社債(転換社債)	ユーロ	フランス	5.5%
10 RAG-STIFTUNG 0.0 CB	新株予約権付社債(転換社債)	ユーロ	ドイツ	5.2%
組入銘柄数		33銘柄		

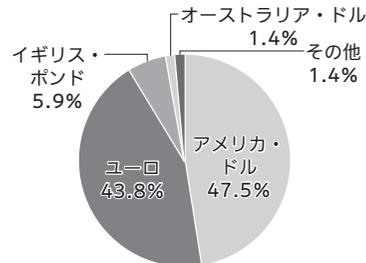
## 資産別配分



## 国別配分



## 通貨別配分



注1. 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものです。

注2. 1万口当たりの費用明細は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。なお、費用項目については前記(1万口当たりの費用明細の項目の概要)をご参照ください。

注3. 組入上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日(2024年9月19日)現在のものです。

注4. 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## ● 指数に関して

### 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

#### ■ 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

#### ■ MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

#### ■ MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに委託会社が独自に円換算しています。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

#### ■ NOMURA-BPI国債

野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社に帰属します。

#### ■ FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### ■ JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ベース）

J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

ホームページにて当ファンドの詳細をご案内しております。

SOMPO好利回りCBファンド2023-09  コース

検索

それぞれのコースをご入力下さい。

為替ヘッジあり・限定追加型

<https://www.sompo-am.co.jp/fund/7148/price.html>



為替ヘッジなし・限定追加型

<https://www.sompo-am.co.jp/fund/7149/price.html>



各書類の最新版をご確認いただけます。

月

最新月次レポート

当ファンドの運用状況を月次  
で説明しております。

休

海外休業日  
(申込不可日)

購入・換金の申込不可日をご案内しております。

本報告書作成時点のものを掲載しております。