

SOMPOスイッチ NASDAQ100レバレッジ2.5倍

追加型投信／海外／株式



～チェスシグナル（投資環境局面を判断するシグナル）のお知らせ～

「SOMPOスイッチ NASDAQ100レバレッジ2.5倍」（以下、当ファンド）は2022年5月9日に設定され、運用を開始いたしました。当ファンドの2022年5月9日時点のチェスシグナル（投資環境局面を判断するシグナル）をご報告いたします。

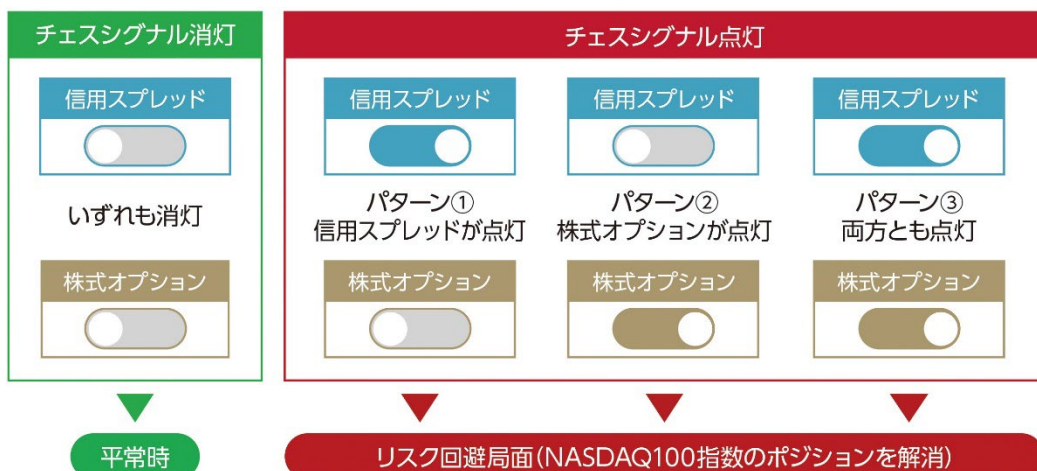
当ファンドは「SOMPOスイッチ戦略（NASDAQ100）」のリターンを享受する円建債券を主要投資対象とし、平常時はNASDAQ100指数（米ドルベース）に2.5倍程度のレバレッジをかけたリターンの獲得を目指し、市場の下振れリスクが高まったと判断した場合は機動的にNASDAQ100指数のポジションを解消し、市場下落の影響を抑える運用を行います。

当ファンドにおける投資環境局面の判断（2022年5月9日時点）

チェスシグナル点灯（リスク回避局面）

・信用スプレッド（上乗せ金利）が拡大し、基準値を超えたためチェスシグナルが点灯しました。

【投資環境局面の判断イメージ】



信用スプレッド、株式オプションのシグナルが点灯した場合、リスク回避局面と判断し、NASDAQ100指数のポジションを解消します。

上記は当ファンドの運用戦略をご理解いただくためのイメージ図です。

当戦略が効果的に機能しない場合には、市場全体の価格低下の影響を抑制できないことや、市場全体の価格上昇による収益を獲得できないことがあります。

当戦略が効果的に機能しない例

- ◆ シグナル点灯により、NASDAQ100指数のポジションを解消したタイミングで市場が上昇した場合。
- ◆ シグナル消灯し、NASDAQ100指数に2.5倍程度のレバレッジをかけたタイミングで市場が下落した場合。
- ◆ 市場が急騰、急落した場合において、シグナルの点灯/消灯が追いつかない場合。

※ 上記の例はあくまでも一例であり、投資環境により上記以外の要因が考えられます。
※ 併せて、投資信託説明書（交付目論見書）の追加的記載事項をご確認ください。

※ 上記の運用方針は当資料作成時点のものであり、将来の投資成果及び市場環境の変動等を示唆あるいは保証するものではありません。



当ファンドの主なリスクと留意点

くわしくは、投資信託説明書（交付目論見書）にて必ずご確認ください。

基準価額の変動要因

当ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動き等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属いたします。したがって、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金とは異なります。

- 当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

※基準価額の変動要因は、以下に限定されるものではありません。

レバレッジリスク	当ファンドが用いるSOMPOスイッチ戦略（NASDAQ100）においては、レバレッジ（平常時は信託財産の純資産総額に対して2.5倍程度）がかかります。NASDAQ市場が下落した場合には、レバレッジがない場合に比べて、多額の損失が発生する場合があります。この場合、指数の値動き以上に基準価額が大きく変動します。
価格変動リスク	当ファンドが主要投資対象とする円建債券の価格は株価指数の変動に影響を受けます。株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、市況等の影響を受けて変動します。株式の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。
運用戦略に関するリスク	当ファンドが用いるSOMPOスイッチ戦略（NASDAQ100）においては、投資環境局面を判断するシグナルを活用し、保有する株価指数のポジションを機動的に変更することにより、株式市場の下落時のリスクを低減し、上昇時のリターン獲得を目指します。しかし、株式市場が想定外に変動した場合等は、SOMPOスイッチ戦略（NASDAQ100）が効果的に機能しないことがあり、市場の下落リスクの低減や市場の上昇時のリターンの獲得ができない場合があります。
為替変動リスク	外貨建資産の価格は、当該外貨と日本円との間の為替レートの変動の影響を受けて変動します。為替レートは、各国の政治・経済情勢、外国為替市場の需給、金利変動その他の要因により、短期間に大幅に変動することがあります。当該外貨の為替レートが、円高になった場合は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。なお、当ファンドの為替変動リスクの影響を受けるのは担保付スワップ取引におけるリターン（損益）部分等のみ限定されます。

その他の留意点

- クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用はありません。
- 大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、ファンドの基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込の受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、収益分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、収益分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

お申込みメモ

くわしくは、投資信託説明書（交付目論見書）にて必ずご確認ください。

購入の申込期間	2022年5月9日から2023年7月19日まで ※申込期間は上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。
購入単位	販売会社が定める単位 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額
換金単位	販売会社が定める単位 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
換金価額	換金請求受付日の翌営業日の基準価額
換金代金	換金請求受付日から起算して、原則として8営業日目からお支払いします。
申込不可日	<ul style="list-style-type: none"> <購入・換金の申込日当日が以下のいずれかの日に該当する場合> <ul style="list-style-type: none"> ・ニューヨーク証券取引所の休業日 ・ロンドン、パリの銀行の休業日 <購入・換金の申込日翌日（土曜日、日曜日を除く）が以下のいずれかの日に該当する場合> <ul style="list-style-type: none"> ・ロンドン、パリの銀行の休業日 ・12月24日 ※上記休業日は、半日休業日を含みます。 <その他> 一部解約金の支払い等に支障をきたすおそれがあるとして委託会社が定める日
信託期間	2032年5月31日まで（設定日 2022年5月9日） ※委託会社は、信託約款の規定に基づき、信託期間を延長することができます。
繰上償還	委託会社は、受益権の口数が10億口を下回っているとき、繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、繰上償還させることがあります。その他、主要投資対象とする円建債券の発行体が債務不履行等となった場合、または円建債券が法令もしくは税制の変更等により早期償還となる場合には、繰上償還させます。
決算日	原則、4月20日（休業日の場合は翌営業日） ※初回決算日は、2023年4月20日です。
収益分配	毎決算時（年1回）、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。 ※ 分配金を受取る一般コースと、分配金を再投資する自動けいぞく投資コースがあります。販売会社によっては、どちらか一方のみのお取扱いとなる場合があります。各コースのお取扱いにつきましては、販売会社までお問い合わせください。 ※ 分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

お客様にご負担いただく手数料等について

投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入価額に 3.3%（税抜3.0%） を上限として販売会社が定めた手数料率を乗じた額です。 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
信託財産留保額	ありません。

投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用（信託報酬）	ファンドの日々の純資産総額に対して 年率0.759%（税抜0.690%） を乗じた額です。 運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、ファンドから支払われます。
その他の費用・手数料	以下の費用・手数料等が、ファンドから支払われます。 ・監査費用 ・売買委託手数料 ・外国における資産の保管等に要する費用 ・信託財産に関する租税 等 ※上記の費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。その他 ・円建債券が執行する取引コストや維持管理コストが間接的にかかります。

■ 当該手数料等の合計額については、投資者の皆様がファンドを保有される期間、売買金額等に応じて異なりますので、表示することができません。

ファンドの委託会社およびその他の関係法人の概況

委託会社	S O M P Oアセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者（登録番号：関東財務局長（金商）第351号）であり、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に加入しています。信託財産の運用指図等を行います。 電話：0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時から午後5時） ホームページ・アドレス：https://www.sompo-am.co.jp/
受託会社	みずほ信託銀行株式会社 信託財産の保管等を行います。
販売会社	受益権の募集の取扱、販売、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金の再投資ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払等を行います。投資信託説明書（交付目論見書）の提供は、販売会社において行います。

S O M P Oスイッチ NASDAQ 100 レバレッジ2.5倍

■販売会社（順不同、○は加入協会を表す）

2022年5月10日 現在

販売会社名	区分	登録番号	日本証券 業協会	一般社団 法人日本 投資顧問 業協会	一般社団 法人金融 先物取引 業協会	一般社団 法人第二 種金融商 品取引業 協会	備考
株式会社 S B I 証券	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第44号	○		○	○	

<備考欄の表示について>

- ※ 1 記載の日付より新規お取扱いを開始します。
- ※ 2 記載の日付以降の新規お取扱いを行いません。
- ※ 3 新規のお取扱いを行っていません。

<ご留意事項>

- ・上記掲載の販売会社は、今後変更となる場合があります。
- ・上記掲載以外の販売会社において、お取扱いを行っている場合があります。
- ・詳細は販売会社または委託会社までお問い合わせください。

当ファンドは、Nasdaq, Inc.またはその関連会社（以下、Nasdaq, Inc.およびその関連会社を「Nasdaq社」と総称します。）によって、支援、推奨、販売または販売促進されるものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの合法性、適合性、または当ファンドに関する記述および開示の正確性もしくは妥当性について認定するものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資の妥当性、およびNASDAQ-100 Indexの株式市場全般のパフォーマンスへの追従可能性について明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行いません。Nasdaq社とS O M P Oアセットマネジメント株式会社の関係は、Nasdaq®、NASDAQ-100 Indexの登録商標およびNasdaq社の一定の商号について使用を許諾すること、ならびにS O M P Oアセットマネジメント株式会社または当ファンドとは無関係にNasdaqが決定、構築および算出を行うNASDAQ-100 Indexの使用を許諾することに限られます。Nasdaqは、NASDAQ-100 Indexの決定、構築および算出に関し、S O M P Oアセットマネジメント株式会社または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。Nasdaq社は、当ファンドの発行の時期、価格もしくは数量の決定について、または当ファンドを換金する際の算式の決定もしくは計算について責任を負わず、また関与していません。Nasdaq社は、当ファンドの管理、マーケティングまたは取引に関して責任を負いません。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Indexとそれに含まれるデータの正確性および中断のない算出を保証しません。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Indexまたはそれに含まれるデータの利用により、S O M P Oアセットマネジメント株式会社や当ファンドの保有者、その他いかなる個人または団体に生じた結果についても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行いません。Nasdaq社は、明示的か黙示的かを問わず何らの保証も行わず、かつ、NASDAQ-100 Index®またはそれに含まれるデータの利用に関する、商品性または特定の目的もしくは使用への適合性については、いかなる保証も明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、Nasdaq社は、いかなる逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的損失について、たとえ当該損失の可能性について通知されていたとしても、一切の責任を負いません。

当資料はS O M P Oアセットマネジメント株式会社（以下、弊社）により作成された情報提供資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。投資信託は金融機関の預金と異なりリスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動します。したがって、元本、分配金の保証はありません。信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。投資信託は、預金や保険契約と異なり、預金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外の登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。当資料は弊社が信頼できると判断した各種情報に基づいて作成されておりますが、その正確性や完全性を保証するものではありません。当資料に記載された意見等は予告なしに変更する場合があります。また、将来の市場環境の変動等により、当該運用方針が変更される場合があります。投資信託の設定・運用は委託会社が行います。お申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめまたは同時にお渡しますので、詳細をご確認の上、お客さま自身でご判断ください。なお、お客さまへの投資信託説明書（交付目論見書）の提供は、販売会社において行います。