

# バークレイズ社債／インカム戦略ファンド2023-07

愛称：フライトインカム2023-07

単位型投信／内外／資産複合／特殊型（条件付運用型）



ファンドは特化型運用を行います。

## ～ 固定クーポン決定のお知らせ ～

「バークレイズ社債／インカム戦略ファンド2023-07」は2023年7月27日に設定され運用を開始いたしました。設定直後からポートフォリオの構築を進め、当ファンドの固定クーポン(信託報酬0.407%控除後)は**1.003%**となりました。

### ポートフォリオの概況(期間：約4年5ヵ月)

#### 【円建債券の発行体】

出所：バークレイズ銀行

銘柄名	国	発行体格付け	クーポン
バークレイズ銀行	英国	A+	0.83%

#### 【CDS取引の参照銘柄】

銘柄名	国	発行体格付け	手数料収入合計
JPEルガン・チェース・アンド・カンパニー	米国	A-	0.58%
モルガン・スタンレー	米国	A-	
バンク・オブ・アメリカ	米国	A-	

固定クーポン	1.41%
--------	-------

信託報酬0.407%控除後

**1.003%**

※発行体格付けは、ムーディーズ、S&P、フィッチ、R&I、JCRの格付けのうち最も低いものを採用しています。

当ファンドは、主として債券等の値動きのある証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元本が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が生じ、投資元本を割り込むことがあります。



SOMPOアセットマネジメント

安心・安全・健康のテーマパーク

# ファンドの主なリスクと留意点①

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

ファンドの基準価額は、組み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へ帰属いたします。したがって、投資者の皆様の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。

- 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。

価格変動リスク	公社債の価格は、国内外の政治・経済情勢、金融政策等の影響を受けて変動します。一般に、金利が上昇すると、公社債の価格は下落します。組み入れている公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。
信用リスク	公社債の価格は、発行体の財務状態、経営、業績等の悪化及びそれらに関する外部評価の悪化等により下落することがあります。組み入れている公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。 また、発行体の倒産や債務不履行等の場合は、公社債の価値がなくなることもあり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。 なお、円建債券が組み入れるCDS取引の参照銘柄に経営破綻や債務不履行等のクレジットイベントが発生した場合等は、その影響を大きく受け、基準価額が大きく下落する可能性があります。
流動性リスク	国内外の政治・経済情勢の急変、天災地変、発行体の財務状態の悪化等により、有価証券等の取引量が減少することがあります。この場合、ファンドにとって最適な時期や価格で、有価証券等を売買できないことがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。 また、取引量の著しい減少や取引停止の場合には、有価証券等の売買ができなかったり、想定外に不利な価格での売買となり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。
銘柄集中投資のリスク	当ファンドはパークレイズ・バンク・ピーエルシーが発行する複数の円建債券に集中投資を行います。またそれぞれの円建債券が組み入れるCDS取引の参照銘柄についても、集中投資を行います。そのため円建債券の発行体が債務不履行等となった場合や、円建債券が組み入れるCDS取引の参照銘柄に経営破綻や債務不履行等のクレジットイベントが発生した場合等には、大きな損失が発生することがあります。
早期償還リスク	円建債券の発行体が債務不履行等となった場合、円建債券が組み入れるCDS取引の参照銘柄に経営破綻や債務不履行等のクレジットイベントが発生した場合等は、円建債券の資金化を行い繰上償還します。その場合、円建債券は時価で換金されるため元本の確保ができず、ファンドの償還価額も投資元本を下回る可能性があります。

## ファンドの主なリスクと留意点②

### 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。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める特化型運用を行うため、当該規則に定める一の者に対するエクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率には制限を設けません。なお、当ファンドにおいては、パークレイズ・バンク・ピーエルシーが発行する円建債券を主要投資対象とします。

[パークレイズ社債／インカム戦略ファンド2023-07]（以下「当ファンド」といいます。）は、SOMPOアセットマネジメント株式会社が設定及び運用を行います。パークレイズ・バンク・ピーエルシー及びその関連会社（以下「パークレイズ」と総称します。）は、当ファンドの設定又は運用に関与しておらず、当ファンドの設定又は運用に関して何ら責任又は義務を負いません。パークレイズは、当ファンドの受益者その他の第三者に対し、パークレイズ社債その他の有価証券等に対する投資の適否又は当ファンドに対する投資の適否について、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証も行わず、当ファンドの投資について何ら責任を負いません。

# お客さまにご負担いただく手数料等について／ 委託会社、その他関係法人

[当ファンドの購入申込期間は終了しています。]

## 投資者が直接的に負担する費用

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。

購入時 手数料	購入価額に <u>1.65%（税抜1.5%）</u> 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	換金請求受付日の翌営業日の基準価額に <u>0.3%</u> を乗じた額です。

## 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 <u>年率0.407%（税抜0.37%）</u> 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か月終了日および毎計算期末、ならびに換金時または信託終了のときに、ファンドから支払われます。 【運用管理費用（信託報酬）の配分】 <table border="1"><tr><td>委託会社</td><td>年率0.14%（税抜）</td></tr><tr><td>販売会社</td><td>年率0.20%（税抜）</td></tr><tr><td>受託会社</td><td>年率0.03%（税抜）</td></tr></table>	委託会社	年率0.14%（税抜）	販売会社	年率0.20%（税抜）	受託会社	年率0.03%（税抜）
委託会社	年率0.14%（税抜）						
販売会社	年率0.20%（税抜）						
受託会社	年率0.03%（税抜）						
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。						

- 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。

## 委託会社、その他関係法人

委託会社	<b>SOMPOアセットマネジメント株式会社</b> 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： <a href="https://www.sompo-am.co.jp/">https://www.sompo-am.co.jp/</a>
受託会社	<b>野村信託銀行株式会社</b> 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、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、販売会社にて行います。

[当ファンドの購入申込期間は終了しています。]

## バークレイズ社債／インカム戦略ファンド2023-07

■販売会社（順不同、○は加入協会を表す）

2023年8月1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
中銀証券株式会社	金融商品取引業者	中国財務局長(金商)第6号	○				
ひろぎん証券株式会社	金融商品取引業者	中国財務局長(金商)第20号	○				
西日本シティIT証券株式会社	金融商品取引業者	福岡財務支局長(金商)第75号	○				
大熊本証券株式会社	金融商品取引業者	九州財務局長(金商)第1号	○				
株式会社中国銀行	登録金融機関	中国財務局長(登金)第2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。

当資料はSOMPPO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。