



2023年5月16日

SOMPOアセットマネジメント株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第351号
加入協会：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
【本件に関するお問い合わせ】リテール営業部 0120-69-5432

< SOMPO好利回りCBファンド2023-06 > の設定

SOMPOアセットマネジメント株式会社は、2023年6月30日に以下2ファンドを設定しますので、お知らせいたします。

< SOMPO好利回りCBファンド2023-06（為替ヘッジあり・限定追加型） >

< SOMPO好利回りCBファンド2023-06（為替ヘッジなし・限定追加型） >

※上記を総称して「SOMPO好利回りCBファンド2023-06」ということがあります。

「SOMPO好利回りCBファンド2023-06」は、日本を含む先進国の転換社債（CB）に投資を行います。

CBは発行時に決められた転換価格で株式に転換できる権利が付与された社債で、利金が支払われるとともに満期時には額面金額で償還されます。

ファンドでは、株価が転換価格を下回るなど債券の性質が強く相対的に高い利回りとなっているCBに投資を行うとともに、原則として満期まで保有することで、インカム収益を確保しつつ安定したパフォーマンスの実現をめざします。

運用に際しては、債券アクティブ運用に強みを持つRBCグローバル・アセット・マネジメント（UK）リミテッドのノウハウを活用します。

● ファンドの目的

日本を含む先進国の転換社債を実質的な主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指します。

● ファンドの特色

1 主として、日本を含む先進国^{※1}の転換社債^{※2}に投資を行います。

※1 先進国の定義は、IMF(国際通貨基金)が定義する先進国・地域の全部または一部、その他、運用委託先であるRBCグローバル・アセット・マネジメント(UK)リミテッドがこれに準ずると判断する国・地域とします。

※2 株式等に転換できる権利のついた社債をいいます。

● 原則として、信託期間内に償還を迎える転換社債に投資し、償還日まで保有することを基本とします。ただし、信用リスク等の観点から、当該償還日前に、保有する転換社債を売却する場合や信託期間内に償還を迎えない転換社債に投資する場合があります。

また、組入れた転換社債がファンドの償還日以前に償還された場合、その償還金をもって、他の転換社債や普通社債、国債、短期金融商品等に再投資を行うことがあります。

・ プットオプション付転換社債については、オプションの権利行使日を転換社債の償還日とみなすことがあります。プットオプション付転換社債とは、通常の償還日とは別に、転換社債の保有者が満期前に償還を請求できる権利(プットオプション)が付与されているものをいいます。

● 転換社債の実質組入比率は、原則として高位を基本とします。ただし、信託期間の終了に近づいた時期においては、現金や、短期国債等の短期金融商品への投資比率が高まる場合があります。

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。

● 信用格付^{※3}が投資適格(BBB格相当)未満の銘柄への投資も行います。ただし、取得時において信用格付がBB-格相当未満の銘柄には投資を行いません。

※3 信用格付については、運用委託先であるRBCグローバル・アセット・マネジメント(UK)リミテッドにおける社内格付を使用する場合があります。

● 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。

ファンドの目的・特色

RBCグローバル・アセット・マネジメント(UK)リミテッドについて

2023年4月に、同じくカナダロイヤル銀行(RBC)傘下の英国の運用会社であったブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピーと事業統合を行い、RBCブルーベイ・アセット・マネジメントのブランド名で、事業展開を行っています。同社は、アクティブ運用を行うスペシャリストとして、先進国および新興国市場のクレジット債券運用に強みを持っており、その債券プラットフォームで運用される資産残高は、約695億米ドル(約9兆4,749億円)となっています。

(2023年2月末現在)

3

「為替ヘッジあり」と「為替ヘッジなし」があります。

為替ヘッジあり	原則として、対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減する運用を行います。
為替ヘッジなし	原則として、対円での為替ヘッジは行いません。 米ドル建て以外の転換社債に投資を行う場合は、原則として、対米ドルでの為替予約取引を行うため、米ドルと円との間の為替変動の影響を受けます。

4

当ファンドは限定追加型です。

購入のお申込みは2023年7月14日までの間に限定して受け付けます。

● 基準価額の変動要因

各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。**

● 各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。

<input checked="" type="checkbox"/> 価格変動リスク	<p>転換社債の価格は、転換の対象となる株式等の価格変動、発行体の財務状態等の変化、国内外の政治・経済情勢、市場金利動向等の影響を受けて変動します。また、発行体の株式の価格が転換価格に近いときまたは上回っているときに、当該株式の価格変動の影響を受けやすくなります。組入れている転換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。</p>
<input checked="" type="checkbox"/> 為替変動リスク	<p>● 為替ヘッジあり 原則として、外貨建資産に対して、対円での為替ヘッジを行います。全ての為替変動リスクを排除できるものではありません。また円金利よりも金利水準の高い通貨の為替ヘッジを行った場合、金利差に相当するヘッジコストが発生し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。</p> <p>● 為替ヘッジなし 外貨建資産の価格は、当該外貨と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。ただし、米ドル建て以外の転換社債に投資を行う場合は、原則として、対米ドルでの為替予約取引を行うため、米ドルと円との間の為替レートの変動の影響を受けることとなります。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。</p>
<input checked="" type="checkbox"/> 信用リスク	<p>転換社債の価格は、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。組入れている転換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。</p> <p>また、発行体の倒産や債務不履行等の場合は、転換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。</p>

投資リスク

✓ 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。

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が小さかった場合も同様です。
- マザーファンドに投資する別のベビーファンドの追加設定・解約等により、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

リスクの管理体制

委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に対する取組方針に基づき、運用担当部から独立した部署及び社内委員会において運用に関する各種リスク管理を行います。

また、委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策等を策定しています。流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢については、担当役員が監督し、管理状況およびその有効性等については、定期的に社内委員会に報告されます。

お申込みメモ

購入の申込期間	<p>当初申込期間 2023年6月1日から2023年6月29日まで</p> <p>継続申込期間 2023年6月30日から2023年7月14日まで</p> <p>※2023年7月15日以降のお申込みは受付できません。</p>
購入単位	<p>販売会社が定める単位</p> <p>※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。</p>
購入価額	<p>当初申込期間 1口あたり1円</p> <p>継続申込期間 購入申込受付日の翌営業日の基準価額</p>
購入代金	販売会社が定める日までにお支払いください。
設定の中止	S O M P O 好利回り C B ファンド 2 0 2 3 - 0 6 の合計募集金額が10億円を下回った場合、または下回ることが予想される場合には、委託会社の判断により、ファンドの設定を中止する場合があります。
換金単位	<p>販売会社が定める単位</p> <p>※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。</p>
換金価額	換金請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した額
換金代金	<p>換金請求受付日から起算して、原則として7営業日目からお支払いします。</p> <p>換金の申込金額が多額であると判断した場合、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に低下した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、換金代金の支払いを延期する場合があります。</p>
申込不可日	<ul style="list-style-type: none"> ・ ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行の休業日 ・ 12月24日
申込締切時間	原則として午後3時まで(販売会社により異なる場合がありますので、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。)
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求を制限する場合があります。
購入・換金申込受付の中止及び取消し	委託会社は、購入・換金の申込金額が多額であると判断した場合、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に低下した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したときは、購入・換金の受付を中止すること、および既に受付けた当該申込みの受付を取り消すことができるものとします。

手続・手数料等

信託期間	2027年12月22日まで(設定日 2023年6月30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	各ファンドの受益権の残存口数が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。
決算日	原則、6月27日(休業日の場合は翌営業日) ※初回決算日は、2024年6月27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。
信託金の限度額	各ファンド500億円
公告	委託会社のホームページ(https://www.sompo-am.co.jp/)に掲載します。
運用報告書	原則、毎決算時及び償還時に、交付運用報告書を作成し、あらかじめお申し出いただいたご住所に販売会社を通じて交付します。
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。

ファンドの費用・税金

ファンドの費用

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。	販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価
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 0.5% 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)	各ファンドの日々の純資産総額に対して 年率1.133%(税抜1.03%) 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、各ファンドから支払われます。	運用管理費用(信託報酬) = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率
	委託会社 年率0.60%(税抜)	ファンドの運用の対価
	販売会社 年率0.40%(税抜)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口屋内でのファンドの管理等の対価
	受託会社 年率0.03%(税抜)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価
<small>※委託会社の報酬には、マザーファンドの運用指図に関する権限を委託したRBCグローバル・アセット・マネジメント(UK)リミテッドへの投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬の額は、各ファンドの信託財産に属するマザーファンドの時価総額に当該計算期間を通じ、毎日、年率0.35%を乗じた額とします。〔ファンドの運用の対価〕</small>		
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。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 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 ・ マザーファンドの換金に伴う信託財産留保額 ・ 信託財産に関する租税 等 <small>※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。</small>	<ul style="list-style-type: none"> ・ 監査費用： 監査法人に支払うファンド監査にかかる費用 ・ 売買委託手数料： 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 ・ 保管費用： 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

●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。

手続・手数料等

税金

- 税金は表に記載の時期に適用されます。
- 以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税及び地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時 及び償還時	所得税及び地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時及び償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

※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)」をご利用の場合
毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※法人の場合は上記とは異なります。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は2023年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

商品分類・属性区分

	商品分類			属性区分				
	単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
為替ヘッジあり	追加型	内外	その他 資産 (転換社債)	その他資産 (投資信託証券 (転換社債))	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)
為替ヘッジなし								なし

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

商品分類及び属性区分の定義につきましては、

一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

委託会社、その他の関係法人の概況

- 委託会社 : 信託財産の運用指図等を行います。
S O M P O アセットマネジメント株式会社
- 受託会社 : 信託財産の保管・管理等を行います。
三菱 U F J 信託銀行株式会社
(再信託受託会社 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- 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、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。
大熊本証券株式会社
株式会社あおぞら銀行

ご注意事項

- 当資料は、ニュースリリースとして S O M P O アセットマネジメント株式会社が作成した資料です。したがって、勧誘を目的としたものではありません。また、法令に基づく開示書類ではありません。
- 当資料に記載されている各事項は、作成時点のものであり、予告なしに変更する場合があります。
- 投資信託は、主として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、元金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、投資元金を割り込むことがあります。また、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。
- 投資信託の取得のお申込みにあたっては、販売会社から投資信託説明書（交付目論見書）を予め、または同時にお渡しいたしますので、必ずお受け取りいただき、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を十分にお読みいただいた上、ご自身でご判断ください。なお、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。