

2024年5月17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

## ＜パークレイズ社債／ダウンサイド・プロテクト型世界株式戦略ファンド

### （早期償還条項付）2024-06＞の設定

SOMPOアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長：小嶋信弘）は、「パークレイズ社債／ダウンサイド・プロテクト型世界株式戦略ファンド（早期償還条項付）2024-06（以下「当ファンド」）」を2024年6月27日に設定いたします。

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米ドル建債券への投資を通じて、実質的に世界の株価指数に投資を行います。

米ドル建において、世界の株価指数の上昇によるリターンをめざす一方、世界の株価指数が下落した際の影響を抑制することをめざします。

株式投資をしたいが、株価の下落による影響は避けたい、というお考えのお客さまに、投資の選択肢としてご検討いただきたいファンドです。

#### 本件に関するお問合せ

SOMPOアセットマネジメント株式会社 リテール営業部 電話番号 0120-69-5432

受付時間：平日※の午前9時～午後5時 ※土曜、日曜、祝日、振替休日、国民の休日を除いた日

#### ＜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)	補足分類	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	為替ヘッジ	特殊型
単位型	内外	資産複合	特殊型 (条件付運用型)	債券 社債	年1回	グローバル (日本を含む)	なし	条件付運用型

※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。

## ● ファンドの目的

信託財産の中長期的な成長を図ることを目的とします。

## ● ファンドの特色

- 1 バークレイズ・バンク・ピーエルシーが発行する米ドル建債券(以下「米ドル建債券」といいます)を主要投資対象とし、世界株式インデックス※1の上昇リターンの獲得を目指すとともに、世界株式インデックス下落時の影響を抑制※2することを目指します。

※1 米ドル建債券の参照指数は、バークレイズ・世界株式指数RC15%です。(以下「世界株式インデックス」といいます)

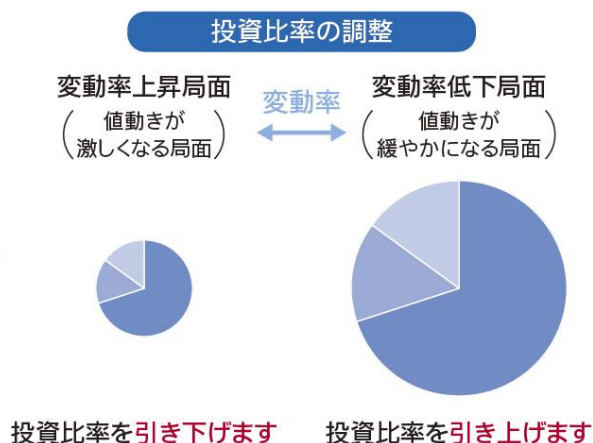
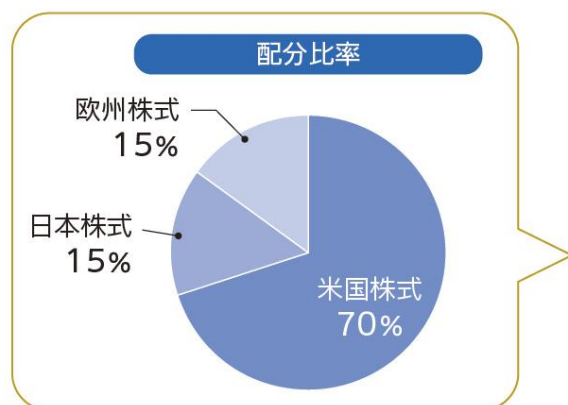
※2 世界株式インデックス下落時の影響を抑制することを目指しますが、為替変動による影響は抑制されません。

- 米ドル建債券の組入比率は高位を保つことを基本とします。また、原則として、米ドル建債券の満期日まで保有することを前提とし、銘柄入替えは行いません。
- 年2回の利払時のクーポンレート(利率)は、米ドル建債券の発行時における金利情勢等によって決定されます。利率は固定とし、ファンドの信託報酬等に充当します。

### 世界株式インデックスについて

- 世界株式インデックスは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーが提供する米ドルベースのインデックスで、米国・日本・欧州の株価指数先物取引を実質的な投資対象とします。
- 各資産の配分比率は、米国株式(S&P500先物)70%・日本株式(日経平均先物)15%、欧州株式(ユーロ・ストックス50先物)15%とします。

また、市場の変動が高まる局面では、インデックスの変動率(ボラティリティ)が年率15%となるように、全体の投資比率を機動的に引き下げます(全体の投資比率は最大100%となります)。なお、日本および欧州の株価指数先物取引の損益は日次で米ドルに換算します。



## 2

米ドル建債券への投資を通じて、約5年後の満期償還時における償還益の獲得を目指します。

● 満期償還時における償還益は、以下2つの収益の合計値にて決定されます。

### (1) 固定償還益

米ドル建債券の発行時元本に、ファンドの設定時に決定した固定料率\*を乗じた額。

### (2) パフォーマンス連動収益

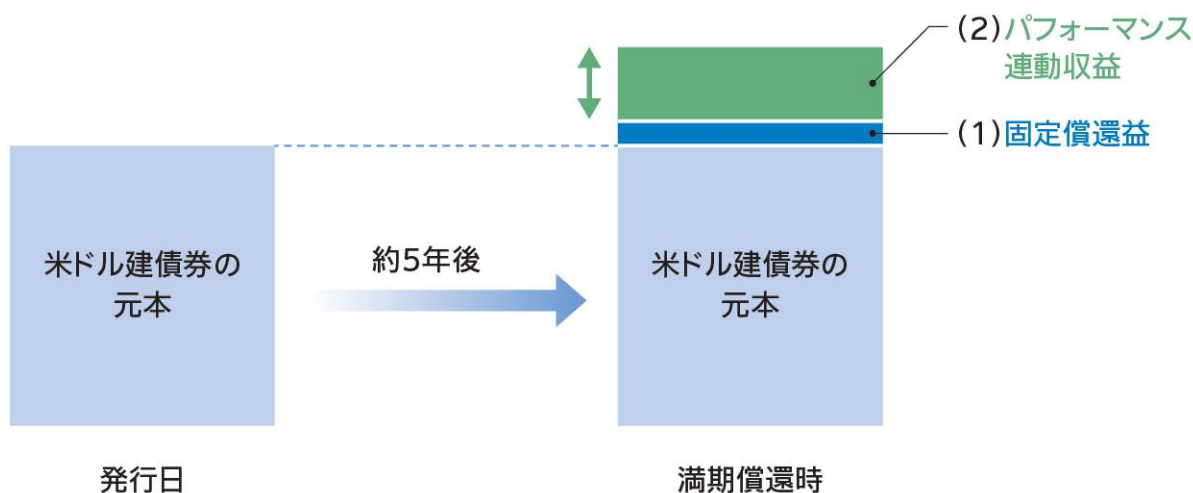
米ドル建債券の満期償還時における世界株式インデックスの累積収益率に、ファンドの設定時に決定した連動率\*を乗じた額。

ただし、当該累積収益率がマイナスの場合、パフォーマンス連動収益はゼロとなります。

\* 固定料率、連動率の水準は委託会社ホームページにて2024年7月1日以降に公開いたします。

連動率は100%以上をめざしますが、当ファンド設定時の市場環境等によっては100%未満となる場合があります。

## 米ドル建債券の満期償還時における償還益イメージ

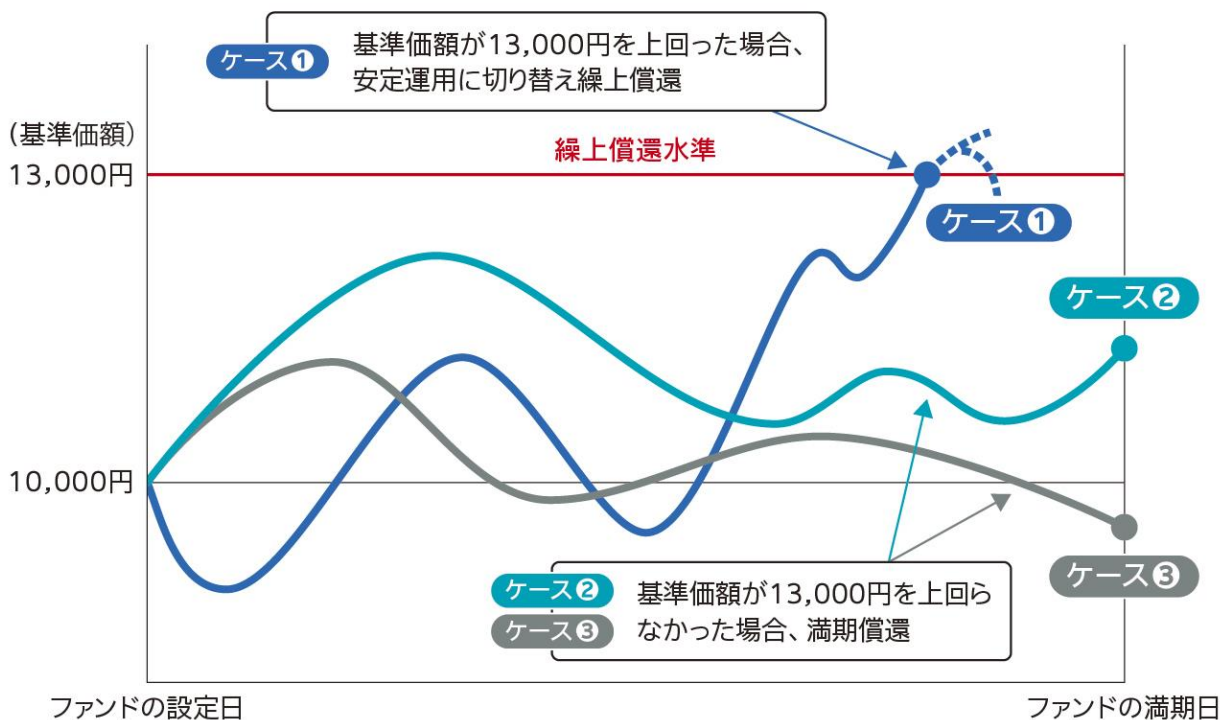


※上記は米ドル建債券の満期償還時における償還益をイメージしたものであり、米ドル建債券の発行体が債務不履行等となった場合等により早期償還となる場合とは異なります。

3

ファンドの基準価額<sup>※1</sup>が13,000円以上となった場合には、米ドル建債券を売却し、円建ての短期公社債等に投資を行うことにより安定運用<sup>※2</sup>に切り替え、繰上償還します。

償還イメージ



※1 1万口あたりの基準価額とし、設定来の1万口あたりの収益分配金(税引前)累計額を含みます。

※2 安定運用開始以降も基準価額は繰上償還日まで市況動向等の影響を受けるため、基準価額・償還価額が13,000円を下回ることがあります。

※3 上記はイメージであり、すべてを説明するものではありません。

基準価額・償還価額が13,000円以上となることを示唆・保証するものではありません。

4

米ドル建債券の発行体が債務不履行等となった場合、米ドル建債券の資金化を行い、ファンドは繰上償還します。

※当ファンドの償還価額が投資元本を下回ることがあります。

5

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

## 投資対象とする米ドル建債券について

発行体：バークレイズ・バンク・ピーエルシー

満期日：2029年7月12日

利払日：年2回(毎年1月12日、7月12日)

・初回利払日：2025年1月12日 ・最終利払日：2029年7月12日

### I. バークレイズについて

バークレイズは、英国を本拠とし、世界中で個人向け銀行業務や各種支払いサービスを提供するほか、フルサービスの法人向け銀行業務および投資銀行業務を提供する金融機関です。

### II. バークレイズ・バンク・ピーエルシーについて

バークレイズ・バンク・ピーエルシーは、持ち株会社バークレイズ・ピーエルシーの完全子会社です。バークレイズ・バンク・ピーエルシーの主要な事業は“コーポレート・アンド・インベストメント・バンク”および“コンシューマー・カード・アンド・ペイメント”により構成されます。

- ・コーポレート・アンド・インベストメント・バンク

ホールセール・バンキング商品およびサービスを法人および機関投資家に対して提供しています。

- ・コンシューマー・カード・アンド・ペイメント

独自ブランドおよび提携ブランドによる消費者向けクレジットカード、貸付の提供、プライベートバンク事業、投資サービスおよび資産管理サービス等の提供を行っています。

### III. バークレイズ・バンク・ピーエルシーの格付け

格付投資情報センター(R&I):A+ (2024年2月末時点)

※発行体格付けを使用

ファンドは特化型運用を行います。

特化型運用ファンドとは、一般社団法人投資信託協会規則に定められたものであり、支配的な銘柄\*が存在するファンドをいいます。

※支配的な銘柄とは、寄与度(投資対象候補銘柄の時価総額に占める一発行体あたりの時価総額の構成割合、またはベンチマークにおける一発行体あたりの構成割合。以下同じ。)が10%を超える、または超える可能性が高いものをいいます。

- ・ファンドは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーが発行する米ドル建債券に集中投資を行うため、当該銘柄の発行体に経営破たんや経営・財務状況の悪化などが生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ● 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。

● 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"/> 銘柄集中投資のリスク	当ファンドはバークレイズ・バンク・ピーエルシーが発行する米ドル建債券(以下「米ドル建債券」といいます)に集中投資を行うため、米ドル建債券の発行体の影響を大きく受けます。したがって、多数の銘柄に分散投資するファンドと比べて基準価額の変動が大きくなる場合があります。また、米ドル建債券の価格が大幅もしくは継続的に下落した場合には、ファンドの基準価額が大幅もしくは継続的に下落し、大きな損失が発生することがあります。
<input checked="" type="checkbox"/> 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。 当ファンドが投資する米ドル建債券の価格は、世界株式インデックスの収益率の影響を受けます。世界株式インデックスの収益率は、株価指数先物取引の価格変動の影響を受けます。株価指数先物取引の価格は、先物市場の需給により変動するほか、国内外の政治・経済情勢、市況等、対象となる指数を構成する株式の価格の影響を受けます。世界株式インデックスを構成する株価指数先物取引の資産配分比率が収益の源泉となる場合もありますが、配分比率が高い資産の価格が下落した場合等には、世界株式インデックスの収益率が下落する要因となります。世界株式インデックスの下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。
<input checked="" type="checkbox"/> 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。
<input checked="" type="checkbox"/> 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。

### 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ある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。
- ファンドの基準価額<sup>※1</sup>が13,000円以上となった場合には、米ドル建債券を売却し、円建ての短期公社債等に投資を行うことにより安定運用<sup>※2</sup>に切り替え、繰上償還します。その場合、可能な限りすみやかに繰上償還を行うことを目指しますが、信託事務処理の状況等によっては、繰上償還までに日数がかかる場合があります。

※1 1万口あたりの基準価額とし、設定来の1万口あたりの収益分配金(税引前)累計額を含みます。

※2 安定運用開始以降も基準価額は繰上償還日まで市況動向等の影響を受けるため、基準価額・償還価額が13,000円を下回る場合があります。

## 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	2024年6月3日から2024年6月26日まで
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	1口あたり1円
購入代金	販売会社が定める日までにお支払いください。
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々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	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。 換金の申込金額が多額であると判断した場合、この信託が主要投資対象とする米ドル建債券の換金ができない場合、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。
換金申込不可日	<申込日の翌営業日が以下のいずれかの日に該当する場合> ●シカゴ・マーカントイル取引所の休業日 ●ユーレックス取引所の休業日 ●大阪取引所の休業日
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。) ※2024年11月5日以降は、原則として午後3時30分までとなる予定です。
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。
換金申込受付の中止および取消し	換金の申込金額が多額であると判断した場合、この信託が主要投資対象とする米ドル建債券の換金ができない場合、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、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。
信託期間	2029年8月3日まで(設定日 2024年6月27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	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。 主要投資対象とする米ドル建債券の発行体が債務不履行等となった場合、または米ドル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。 また、基準価額*が13,000円以上となった場合には繰上償還します。 ※1万口あたりの基準価額とし、設定来の1万口あたりの収益分配金(税引前)累計額を含みます。



決 算 日	原則、8月3日(休業日の場合は翌営業日) ※初回決算日は、2025年8月4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。
信託金の限度額	500億円
公 告	委託会社のホームページ ( <a href="https://www.sompo-am.co.jp/">https://www.sompo-am.co.jp/</a> ) 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	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 課税上は株式投資信託として取扱われます。</li> <li>● 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」の適用対象となりますが、当ファンドはNISAの対象ではありません。</li> <li>● 配当控除、益金不算入制度の適用はありません。</li> </ul>

## ● 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 <b>3.3%(税抜3.0%)を上限</b> 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々営業日の基準価額に <b>0.3%</b> 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 )	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して<b>年率0.913%(税抜0.83%)</b>を乗じた額です。</p> <p>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、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。</p>	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0.30%(税抜)	ファンドの運用の対価
	販売会社	年率0.50%(税抜)	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	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

<p>その他の費用・手数料</p>	<p>以下の費用・手数料等が、ファンドから支払われます。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 監査費用</li> <li>・ 売買委託手数料</li> <li>・ 外国における資産の保管等に要する費用</li> <li>・ 信託財産に関する租税 等</li> </ul> <p>※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。</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 監査費用： 監査法人に支払うファンド監査にかかる費用</li> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
-------------------	--	--

●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。

## 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	<p>配当所得として課税</p> <p>収益分配金に対して 20.315%</p>
換金(解約)時 及び償還時	所得税及び地方税	<p>譲渡所得として課税</p> <p>換金(解約)時及び償還時の差益(譲渡益)に対して 20.315%</p>

※当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」の対象ではありません。

※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2024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。

### <委託会社・その他関係法人の概況>

委託会社 : 信託財産の運用指図等を行います。

SOMPO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。

株式会社 SMBC 信託銀行

(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

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等を行います。

あかつき証券株式会社

おきぎん証券株式会社

香川証券株式会社

大熊本証券株式会社

中銀証券株式会社

西日本シティ TT 証券株式会社

むさし証券株式会社

## <ご注意事項>

当資料は、ニュースリリースとしてSOMPO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にご帰属いたします。

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。

[パークレイズ社債／ダウンサイド・プロテクト型世界株式戦略ファンド(早期償還条項付)2024-06](以下「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、ファンドの設定又は運用に関与しておらず、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、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、ファンドの投資について何ら責任を負いません。