

## ポートフォリオ構築のお知らせ

世界株式インデックス戦略ファンド（資産成長型／償還条項付）2023-07、愛称：ベスト・エントリー 2023-07（以下、当ファンド）は、2023年7月31日に設定され、運用を開始いたしました。本レポートでは、2023年8月2日時点の当ファンドと投資対象ファンドである世界株式インデックス戦略ファンド2023-08（適格機関投資家向け）の運用状況についてご紹介いたします。

## ＜ 当ファンドの運用状況 ＞

(2023年8月2日時点)

基準価額	
資産成長型	10,013円
償還条項付	10,013円

基準価額は信託報酬控除後です。

投資対象ファンド	純資産比
資産成長型	96.69%
償還条項付	97.01%

投資対象ファンドは世界株式インデックス戦略ファンド2023-08（適格機関投資家向け）です。当ファンドはSOMP Oマネープールマザーファンドとコール・ローン等も保有しています。

## ＜ 世界株式インデックス戦略ファンド2023-08（適格機関投資家向け）の運用状況 ＞

(2023年8月2日時点、データは2023年8月1日時点)

構成比率	純資産比
米10年国債	95.86%*
(ご参考)米10年国債	2033年5月15日償還
コール・ローン等	4.14%
世界株式インデックス	100.75%*
(ご参考)世界株式インデックス	366.03ポイント

世界株式インデックスはバークレイズ・世界株式指数RC15%です

ルックバック・オプション取引のオプション・プレミアム	11.30%
----------------------------	--------

ポートフォリオの状況	
残存期間	9.79年
修正デュレーション	8.14年
直接利回り	3.56%
最終利回り	4.03%

コール・ローン等を除いて算出しています。

通貨別構成比率	純資産比
米ドル	99.49%

日本円を0.51%保有しています。

当ファンドは、ルックバック・オプション取引と担保付スワップ取引を活用して、ファンド設定後1年間における世界株式インデックス(米ドルベース)の最安値をエントリー・ポイント(基準値)として計算したリターンの獲得を目指します。世界株式インデックス連動部分は、原則として米10年国債の満期に合わせて取引を終了する予定です。

\* 設定後は原則としてリバランスを行わないため、投資効果が当ファンドの投資対象である世界株式インデックス戦略ファンド2023-08（適格機関投資家向け）の純資産総額に対して約200%となる訳ではありません。

担保付スワップ取引とは、実際に対象資産を保有してはなくても、相手方(主に金融機関)に対してポジション構築コスト等を支払う代わりに、対象資産のパフォーマンスを受け取るスワップ 契約を締結することで、実質的に投資を行っているのと同様の投資効果を楽しむことができる取引のことです。

# 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。

<p>価格変動 リスク</p>	<p>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。組入れている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。</p> <p>当ファンドは、設定後1年間はルックバック・オプション取引を利用します。世界株式インデックスの最安値を基準値として計算した設定日の1年後までの世界株式インデックスの上昇率（金利や為替等の影響を受けます）が、ルックバック・オプション取引のオプション・プレミアムの水準を下回る場合は、ルックバック・オプション取引を行わない場合との比較で、基準価額が下落する要因となります。</p> <p>当ファンドが投資信託証券を通じて組入れる公社債の価格は、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。</p> <p>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。</p>
<p>為替変動 リスク</p>	<p>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。</p> <p>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>
<p>信用 リスク</p>	<p>当ファンドが投資信託証券を通じて行う担保付スワップ取引は、取引の相手方の信用リスク等の影響を受けます。当該取引の相手方の倒産や契約不履行等により当初契約通りの取引が実行されない場合には、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> <p>株式や公社債の価格は、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。実質的に組入れている株式や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。</p> <p>また発行体の倒産や債務不履行等の場合は、株式や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。</p>
<p>流動性 リスク</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドは投資信託証券を通じて、担保付スワップ取引を活用します。市場環境の急変や「当初1年間最安値指数値参照型・世界株式インデックス戦略」のパフォーマンス算出がなされない等の理由により、当ファンドが投資信託証券を通じて行う担保付スワップ取引が当該戦略のパフォーマンスと連動することが困難となった場合には、当ファンドの基準価額が下落する場合があります。</p>

# 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。

## 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。

### （償還条項付のみ）

- 当ファンドは、2024年8月1日以降、基準価額（1万口当たりの基準価額とし、支払済みの収益分配金（税引前）を含みません。）が15,000円以上となった場合は、円建ての短期公社債等に投資を行うことによる安定運用※に順次切り替え、繰上償還を行います。繰上償還となった際には、可能な限りすみやかに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。

※安定運用開始以降も繰上償還日までは、基準価額は市況動向等の影響を受けるため、基準価額が15,000円を下回る場合があります。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等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は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

# お客様にご負担いただく手数料等について（大和証券でお申込みの場合）

当ファンドの購入申込期間は終了しています。

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。

## ■ 投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入金額に右記の購入時手数料率を乗じて得た額とします。 購入金額：購入価額（1万口当たり1万円）×購入口数	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	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 換金請求受付日が2023年7月31日から2024年7月31日まで： 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。</li> <li>● 換金請求受付日が2024年8月1日以降：ありません。</li> </ul>	-

## 購入時手数料率

購入金額	手数料率
2,000万円未満	<b>3.30%（税抜3.0%）</b>
2,000万円以上 5,000万円未満	<b>2.20%（税抜2.0%）</b>
5,000万円以上 1億円未満	<b>1.65%（税抜1.5%）</b>
1億円以上5億円未満	<b>1.10%（税抜1.0%）</b>
5億円以上	<b>0.55%（税抜0.5%）</b>

## （ご参考）

口数指定で購入する場合	金額指定で購入する場合
<p>例えば、基準価額10,000円の時に10万口ご購入いただく場合は、次のように計算します。</p> <p>購入金額 = (10,000円 / 1万口) × 10万口 = 10万円</p> <p>購入時手数料 = 購入金額 (10万円) × 3.30% (税込) = 3,300円</p> <p>となり、購入金額に購入時手数料を加えた合計額10万3,300円をお支払いいただくこととなります。</p>	<p>購入金額に購入時手数料を加えた合計額が指定金額（お支払いいただく金額）となるよう購入口数を計算します。</p> <p>例えば、10万円の金額指定で購入する場合、指定金額の10万円の中から購入時手数料（税込）をいただきますので、10万円全額が当該投資信託の購入金額とはなりません。</p>

※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問い合わせください。

## ■ 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1.188%（税抜1.08%）</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。</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
投資対象とする投資信託証券の信託報酬等	<p><b>年率0.231%（税抜0.21%）</b></p> <p>※上記のほか、投資信託証券の設立・開示に関する費用等（監査費用、弁護士費用等）、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がかかります。</p>	投資対象とする投資信託証券の運用の対価、管理報酬等
実質的な運用管理費用（信託報酬）	<p>ファンドの純資産総額に対して<b>概ね1.419%（税込・年率）程度</b>となります。</p> <p>※ファンドの運用管理費用（信託報酬）年率1.188%（税抜1.08%）に投資対象とする投資信託証券の信託報酬等（年率0.231%）を加算しております。投資信託証券の組入状況等によって、ファンドにおける、実質的に負担する運用管理費用（信託報酬）は変動します。</p>	-
その他の費用・手数料	<p>以下の費用・手数料等が、ファンドから支払われます。</p> <p>・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</p> <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。



# ファンドの委託会社およびその他の関係法人の概況

当ファンドの購入申込期間は終了しています。

委託会社	<p><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：https://www.sompo-am.co.jp/</p>
受託会社	<p><b>三菱UFJ信託銀行株式会社</b>                  信託財産の保管等を行います。</p>
販売会社	<p><b>大和証券株式会社</b>                  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、販売会社において行います。</p>

投資信託説明書（交付目論見書）のご提供・お申込みは

**大和証券**

Daiwa Securities

大和証券株式会社  
 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第108号  
 加入協会：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  
 一般社団法人日本STO協会

設定・運用は



**SOMPOアセットマネジメント**

安心・安全・健康のテーマパーク

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

当資料はSOMPOアセットマネジメント株式会社（以下、弊社）により作成された受益者様向け資料であり、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。