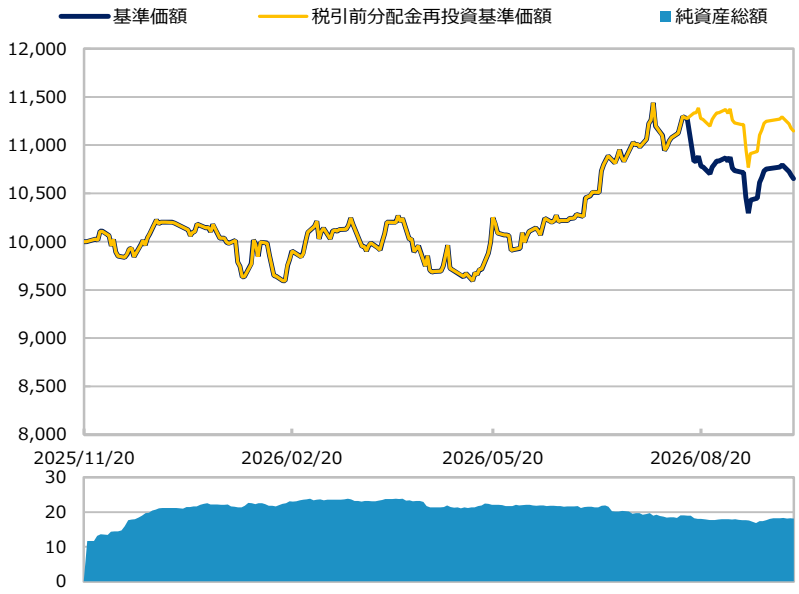
世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

ファンド設定日：2025年11月21日　　日経新聞掲載名：世クロ年４無

基準価額・純資産総額の推移（円・億円）



■ グラフは過去の実績を示したものであり将来の成果をお約束するものではありません。
■ 基準価額は信託報酬控除後です。信託報酬は後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

基準価額・純資産総額

	当月末	前月比
基準価額（円）	10,654	-215
純資産総額（百万円）	1,817	+20

■ 基準価額は10,000口当たりの金額です。

騰落率（税引前分配金再投資）（%）

	基準日	ファンド
１カ月	2026/08/31	-2.0
３カ月	2026/06/30	6.6
６カ月	2026/03/31	12.4
１年		
３年		
設定来	2025/11/21	11.5

■ ファンドの騰落率は税引前分配金を再投資した場合の数値です。
■ ファンド購入時には購入時手数料、換金時には税金等の費用がかかる場合があります。
■ 騰落率は実際の投資家利回りとは異なります。

最近の分配実績（税引前）（円）

期	決算日	分配金
第1期	2026/02/16	0
第2期	2026/05/18	0
第3期	2026/08/17	500
設定来累計		500

※ 分配金は10,000口当たりの金額です。過去の実績を示したものであり、将来の分配をお約束するものではありません。

資産構成比率（%）

	当月末	前月比
組入投資信託	96.7	-0.0
マネー・ファンド	0.1	-0.0
現金等	3.2	+0.0
合計	100.0	0.0

※ 組入投資信託の正式名称は「AQR ルクス ファンズ - AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド（クラス B - JPY アンヘッジド）」です。
※ マネー・ファンドの正式名称は「マネー・トラスト・マザーファンド」です。

運用概況

当月末の基準価額は、10,654円（前月比-215円）となりました。
また、税引前分配金を再投資した場合の月間騰落率は、-2.0%となりました。

※ この資料の各グラフ・表に記載されている数値は、表示桁未満がある場合は四捨五入して表示しています。
※ この資料に記載されている構成比を示す比率は、注記がある場合を除き全てファンドの純資産総額を100%として計算した値です。

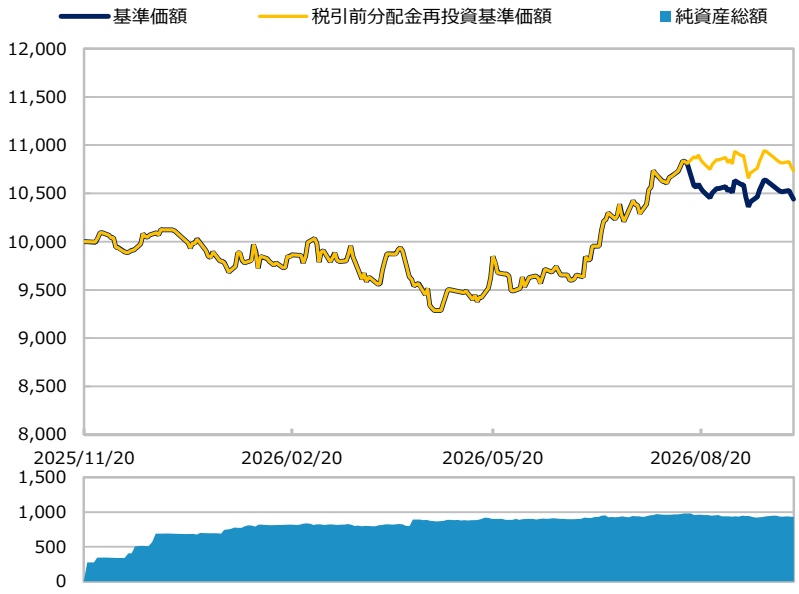
SMBC 三井住友DSアセットマネジメント

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

ファンド設定日：2025年11月21日　　日経新聞掲載名：世クロ年４有

基準価額・純資産総額の推移（円・百万円）



■ グラフは過去の実績を示したものであり将来の成果をお約束するものではありません。
■ 基準価額は信託報酬控除後です。信託報酬は後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

基準価額・純資産総額

	当月末	前月比
基準価額（円）	10,440	-131
純資産総額（百万円）	929	-12

■ 基準価額は10,000口当たりの金額です。

騰落率（税引前分配金再投資）（%）

	基準日	ファンド
１カ月	2026/08/31	-1.2
３カ月	2026/06/30	9.1
６カ月	2026/03/31	12.2
１年		
３年		
設定来	2025/11/21	7.4

■ ファンドの騰落率は税引前分配金を再投資した場合の数値です。
■ ファンド購入時には購入時手数料、換金時には税金等の費用がかかる場合があります。
■ 騰落率は実際の投資家利回りとは異なります。

最近の分配実績（税引前）（円）

期	決算日	分配金
第1期	2026/02/16	0
第2期	2026/05/18	0
第3期	2026/08/17	300
設定来累計		300

※ 分配金は10,000口当たりの金額です。過去の実績を示したものであり、将来の分配をお約束するものではありません。

資産構成比率（%）

	当月末	前月比
組入投資信託	96.8	+0.0
マネー・ファンド	0.0	+0.0
現金等	3.2	-0.0
合計	100.0	0.0

※ 組入投資信託の正式名称は「AQR ルクス ファンズ - AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド（クラス A - JPY ヘッジド）」です。
※ マネー・ファンドの正式名称は「マネー・トラスト・マザーファンド」です。

運用概況

当月末の基準価額は、10,440円（前月比-131円）となりました。
また、税引前分配金を再投資した場合の月間騰落率は、-1.2%となりました。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

※ このページは「AQR ルクス ファンズ - AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド」について、AQRキャピタル・マネジメント,エルエルシーから提供を受けたデータおよび情報を基に記載しています。

騰落率（経費控除前）（%）

	当月	当四半期	年初来
ファンド騰落率	-0.2	12.1	12.7
参考指標騰落率	-0.2	1.4	7.8
超過収益率	0.1	10.7	4.9
（ファクター別内訳）			
低リスク	-1.8	3.5	-3.8
高クオリティ	1.0	4.9	7.7
その他	0.8	2.2	1.0

※ 上記は「AQR ルクス ファンズ - AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド」の現地基準日におけるアメリカドルベースの経費控除前の騰落率です。
※ 参考指標は「ICE BofA 3ヵ月米国国債インデックス（USD）」と「MSCI World Net Total Return Index hedged to USD」を50%ずつ組み合わせたものです。
※ ファクター別内訳は超過収益率をファクター別の寄与度に分解したものです。

地域別構成比率（%）

	ロング	ショート	ネット
欧州	56.3	32.4	23.9
米国	186.8	111.1	75.7
カナダ	12.3	8.1	4.2
アジア（日本を除く）	2.5	2.3	0.2
日本	47.1	25.4	21.6
オセアニア	6.0	4.1	2.0
合計	310.9	183.4	127.6

ポートフォリオ特性値

	ロング	ショート
組入銘柄数	2,345	1,972
ベータ値（市場感応度）	0.7	0.9
DEレシオ（倍）	0.8	1.0
ROE（5年）（%）	14.5	13.8
PER（倍）	21.7	22.0
PBR（倍）	2.8	2.4

※ DEレシオは負債資本倍率、ROEは自己資本利益率、PERは株価収益率、PBRは株価純資産倍率を指します。

業種別構成比率（%）

	ロング	ショート	ネット
エネルギー	13.4	5.9	7.6
素材	16.8	13.3	3.6
資本財・サービス	60.1	39.8	20.3
一般消費財・サービス	32.0	22.0	10.0
生活必需品	19.1	9.7	9.4
ヘルスケア	29.3	19.9	9.4
金融	46.6	26.2	20.4
情報技術	57.7	29.5	28.2
コミュニケーション・サービス	15.2	6.8	8.5
公益事業	13.4	4.6	8.9
不動産	7.3	5.7	1.5
合計	310.9	183.4	127.6

※ 業種はGICS（世界産業分類基準）による分類です。

※ ロングはロングポジション（買建て）、ショートはショートポジション（売建て）を指します。
※ ネットはロングポジションからショートポジションを差し引いたものです。
※ このページに記載されている構成比を示す比率は、「AQR ルクスファンズ-AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド」の純資産総額を100%として計算した値です。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

※ このページは「AQR ルクス ファンズ - AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド」について、AQRキャピタル・マネジメント,エルエルシーから提供を受けたデータおよび情報を基に記載しています。

ファンドマネージャーコメント

＜市場動向＞

米国株式市場は小幅に下落しました。中東情勢への懸念が残る中、原油価格上昇によるインフレ懸念や債券市場の需給懸念などから長期金利が上昇したことが、株式市場の上値を抑えました。一方で、IT関連企業を中心に企業業績見通しの上方修正が続いたことが下支えの材料となりました。金融政策としては、中旬のFOMC（米連邦公開市場委員会）では約3年ぶりとなる利上げが実施されました。

欧州株式市場は下落しました。中東情勢の不透明感と原油価格や長期金利の上昇が下押し圧力となりました。企業業績に対する見方も米国ほど強いものとはなりませんでした。

（為替）米ドル/円は下落しました。上旬は日銀の利上げペース加速観測などから円高が進みました。その後、FOMCで利上げが決定され、更に年内の追加利上げが示唆されたことなどから米ドル高となりましたが、月末にかけては日米財務相協議を受けた為替介入への警戒から円高となりました。

ユーロ/円は下落しました。上旬は日本政府・日銀による為替介入への警戒や日銀の利上げ観測を背景に円高が進みました。その後、ECB（欧州中央銀行）の年内追加利上げ観測などからユーロ高となる場面もありましたが、月末にかけては為替介入への警戒から再び円高となりました。

＜運用状況＞

当月の基準価額は「為替ヘッジなし」、「為替ヘッジあり」ともに下落しました。

参考指標も下落しましたが、組入ファンドの参考指標に対する超過収益率はプラスとなりました。

地域別では、主に米国、カナダでプラス寄与、欧州でマイナス寄与しました。

セクター別では、情報技術、素材、エネルギーでプラス寄与、コミュニケーション・サービス、公益事業、金融でマイナス寄与しました。

「低リスク」ファクター戦略（低リスク銘柄をロングし、高リスク銘柄をショート）はマイナス寄与しました。

地域別では、米国、欧州、カナダ、オーストラリアでマイナス寄与しました。

セクター別では、ほとんどのセクターでマイナス寄与となり、主に情報技術、金融、資本財・サービスでマイナス寄与しました。

「高クオリティ」ファクター戦略（高クオリティ銘柄をロングし、低クオリティ銘柄をショート）はプラス寄与しました。

地域別では、カナダ、米国、アジア（日本を除く）でプラス寄与、欧州でマイナス寄与しました。

※ 作成時点のものであり、将来の市場環境の変動等をお約束するものではありません。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　作成基準日：2026年09月30日

※ このページは「AQR ルクス ファンズ - AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド」について、AQRキャピタル・マネジメント,エルエルシーから提供を受けたデータおよび情報を基に記載しています。

ファンドマネージャーコメント

セクター別では、一般消費財・サービス、資本財・サービスでプラス寄与、コミュニケーション・サービス、素材でマイナス寄与しました。

「その他」ファクター戦略（低リスク、高クオリティ以外のファクターを用いたロングショート）はプラス寄与しました。

地域別では、米国、アジア（日本を除く）、カナダでプラス寄与しました。

セクター別では、資本財・サービス、情報技術、一般消費財・サービスでプラス寄与、金融でマイナス寄与しました。

※ 作成時点のものであり、将来の市場環境の変動等をお約束するものではありません。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

ファンドの特色

※ 各ファンドの略称として、それぞれ以下のようにいうことがあります。
世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし/年4回決算型）：（為替ヘッジなし）
世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジあり/年4回決算型）：（為替ヘッジあり）

1. 世界の先進国・地域＊1の上場株式を対象としたロングショート運用＊2を行います。
●「ロングポジション」と「ショートポジション」における組入銘柄は、競争力・収益性、市場連動性等に着目して選定します。
●「ロングポジション」と「ショートポジション」の構築においては、デリバティブ取引を活用します。

＊1 先進国・地域とは
当ファンドではMSCI Inc.が算出するMSCIワールド・インデックス構成国を主な投資対象国としますが、それ以外の国・地域にも投資する場合があります。

＊2 ロングショート運用とは
一般的には、相対的に割安とみられる銘柄を買い建てる一方、割高とみられる銘柄を売り建てて、投資対象市場全体の上昇・下落にかかわらず、投資収益の獲得を目指す運用です。買建てをロングポジション、売建てをショートポジションといいます。

2. 世界の株式市場に対するポートフォリオの市場連動性を抑え、信託財産の中長期的な成長を目指します。
●「ロングポジション」と「ショートポジション」の合計（ネットポジション）における市場連動性が、世界の株式市場に対して半分程度となることを目指してポートフォリオを構築します。
●「ロングポジション」と「ショートポジション」の総額（グロスポジション）が、最大で信託財産の純資産総額の7倍程度となる場合があります。
●米ドル以外の通貨建ての資産等に投資する場合は、原則として、実質的に米ドル建てとなるように為替取引を行います。
※上記は2026年5月末時点のものであり、今後市場環境の変化等によって変更となる場合があります。

3. 実質的な運用はクオンツ運用＊3に強みのあるAQRキャピタル・マネジメントが行います。
●投資対象とする外国投資信託の運用は、AQRキャピタル・マネジメント,エルエルシーが行います。

＊3 クオンツ運用とは
高度な数学的手法・モデルをベースに分析した結果に基づく運用手法です。機械的な投資が主体的となり、ヒューマンエラーなどが起きにくいとされています。

4. 対円での為替ヘッジの有無により、（為替ヘッジなし）と（為替ヘッジあり）の2つのファンドからお選びいただけます。
（為替ヘッジなし）
●実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
●基準価額は為替変動の影響を受けます。
（為替ヘッジあり）
●実質組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。
●対円での為替ヘッジを行う際、円の短期金利がヘッジ対象通貨の短期金利を下回っている場合、その金利差に相当する為替ヘッジコストがかかります。短期金利の変動等により、為替ヘッジコストも変動します。
※販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※ 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。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　作成基準日：2026年09月30日

投資リスク

基準価額の変動要因

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者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。
●運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。
●投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。
●当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

■ 株式市場リスク

【株価の下落は、基準価額の下落要因です】
内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、株価が下落し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。

■ 派生商品リスク

【市場動向とポジションの方向性の不一致は、基準価額の下落要因です】
各種派生商品（先物取引、オプション取引、スワップ取引等）の価格は、その基礎となる原資産の価格変動および市場動向等により変動し、取引の種類によっては原資産の価格変動以上の値動きをすることがあり、ファンドの基準価額に影響を及ぼします。買い建てた派生商品（ロング・ポジション）の価格が下落した場合、あるいは売り建てた派生商品（ショート・ポジション）の価格が上昇した場合には、基準価額が下落する要因となります。
取引所を介さずに相対で取引する派生商品においては、取引相手の倒産等により契約が履行されず損失を被り、基準価額が下落する場合があります。
派生商品では、一般的に少額の証拠金・担保金等を差し入れることで、より大きな金額の取引を行いますが、当ファンドが投資対象とする外国投資信託は、派生商品を積極的に活用し、買建ておよび売建てを行うとともに、レバレッジ取引を行うため、買建総額および売建総額の合計が信託財産の純資産総額の100%を超えることが想定されます。したがって、株式等の価格変動の影響を大きく受け、ファンドの基準価額の変動が大きくなることや、株式市場全体の動きと比べて異なる動きをすることがあります。また、買い建てた派生商品（ロング・ポジション）の価格が下落し、かつ売り建てた派生商品（ショート・ポジション）の価格が上昇すると、ファンドの基準価額の下落幅は想定より大きくなる場合があります。当ファンドが投資対象とする外国投資信託は、買建てと売建てを組み合わせて、市場連動性を調整する運用を行うため、市場が想定と異なる動きをした場合、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

【債務不履行の発生等は、基準価額の下落要因です】
ファンドが投資している有価証券や金融商品において債務不履行が発生あるいは懸念される場合、またはその発行体が経営不安や倒産等に陥った場合には、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

■ 為替変動リスク

（為替ヘッジなし）
【円高は基準価額の下落要因です】
外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。
（為替ヘッジあり）
【為替ヘッジにより、円高が基準価額に与える影響は限定的です】
外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けますが、原則として対円での為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

投資リスク

■ カントリーリスク

【投資国の政治・経済等の不安定化は、基準価額の下落要因です】
海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券等の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

■ 流動性リスク

【市場規模の縮小・取引量の低下により、不利な条件での取引を余儀なくされることは、基準価額の下落要因です】
有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等に、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

その他の留意点

〔分配金に関する留意事項〕

○ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、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。

○ 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、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、分配金の一部または全部が、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、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。

● 当ファンドが投資対象とする外国投資信託は、デリバティブ取引を使用する場合があるため、当該取引の相手方の信用リスク等の影響を受け、倒産や契約不履行等により当初契約通りの取引を実行できずに損失を被り、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

● ファンドは、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、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

〔AQRの免責条項〕

AQR （またはAQRの関連会社、AQRもしくはAQRの関連会社が管理または助言する各投資ファンドまたは商品（総称して「AQR」といいます。））は、金融商品取引法に基づいて登録されておらず、今後も登録されることはありません。また、AQR デルファイ・ロング-ショート・エクイティ・ファンド（以下「投資対象ファンド」といいます。）も金融商品取引法に基づいて登録されておらず、今後も登録されることはありません。AQRと三井住友DSアセットマネジメント株式会社 （またはその投資ファンドまたは商品） は、関連会社ではありません。AQRのロゴ、AQRの名称および概要の使用は、投資または提案された取引の適合性に関するAQRまたはAQRに代わっての推奨を構成するものではなく、したがって、当資料は、投資対象ファンドへの投資の申込みまたは勧誘を構成するものではありません。AQRまたは投資対象ファンドへの言及は、AQR、投資対象ファンド、またはその他のAQR商品への投資の申込みまたは勧誘と解釈されるべきではありません。世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし/年4回決算型）および世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジあり/年4回決算型）（以下「当ファンド」といいます。）に投資している各投資家は、当ファンドの単独の投資家であり、投資対象ファンドに対して直接的な利害関係または権利を有しておらず、AQRは三井住友DSアセットマネジメント株式会社に対しても、その投資家に対しても義務または責任を負うものではありません。AQRおよび投資対象ファンドは、いかなる立場においても、当ファンドのスポンサーまたはマネージャーではなく、当資料の内容について責任を負うものではありません。AQRおよび投資対象ファンドはいずれも当資料を作成しておらず、AQRおよび投資対象ファンドはいずれも当資料の内容を承認しておらず、また承認する機会も与えられておりません。AQRおよび投資対象ファンドは、ここに含まれる情報の公正性、正確性、妥当性または完全性に関して、明示的または黙示的を問わず、いかなる表明または保証も行わず、それぞれがこの点に関する責任または義務を明示的に否認いたします。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　作成基準日：2026年09月30日

お申込みメモ
購入単位
お申込みの販売会社にお問い合わせください。
購入価額
購入申込受付日の翌々営業日の基準価額
購入代金
販売会社の定める期日までにお支払いください。
換金単位
お申込みの販売会社にお問い合わせください。
換金価額
換金申込受付日の翌々営業日の基準価額
換金代金
原則として、換金申込受付日から起算して9営業日目からお支払いします。
信託期間
2035年11月20日まで（2025年11月21日設定）
決算日
毎年2月、5月、8月、11月の16日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配
年4回決算を行い、分配方針に基づき分配を行います。（委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。） 分配金受取りコース：原則として、分配金は税金を差し引いた後、決算日から起算して5営業日目までにお支払いいたします。 分配金自動再投資コース：原則として、分配金は税金を差し引いた後、無手数料で再投資いたします。 ※販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。
課税関係
●課税上は株式投資信託として取り扱われます。 ●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限りNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。 ●当ファンドは、NISAの対象ではありません。 ●配当控除および益金不算入制度の適用はありません。
お申込不可日
申込受付日または申込受付日の翌営業日が以下のいずれかに当たる場合には、購入・換金のお申込みを受け付けません。 ●ニューヨークの取引所の休業日 ●ニューヨークの銀行の休業日 ●ルクセンブルグの銀行の休業日（半休日を含む）
スイッチング
販売会社によっては、以下のファンドの間でスイッチングを取り扱う場合があります。 ●世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし/年1回決算型） ●世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジあり/年1回決算型） ●世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし/年4回決算型） ●世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジあり/年4回決算型） また、販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

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3.30%（税抜き3.00%）を上限として、販売会社毎に定める手数料率を乗じた額です。詳しくは販売会社に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）
ファンドの純資産総額に年1.133%（税抜き1.03%）の率を乗じた額です。
※投資対象とする投資信託の運用管理費用および成功報酬を含めた場合、年2.143%（税抜き2.04%）程度＊1＋投資対象とする投資信託の成功報酬＊1となります。
＊1　投資対象とする投資信託の運用管理費用は、料率が把握できる費用の合計であり、上記以外の費用がかかる場合があります。また、年間最低報酬額や取引ごとにかかる費用等が定められている場合があるため、純資産総額の規模や取引頻度等によっては、上記の料率を上回る場合があります。投資対象とする投資信託の成功報酬（参考指標＊2に対する超過パフォーマンスの20%（日次））については、投資信託説明書（交付目論見書）の「ファンドの目的・特色」の「追加的記載事項」をご覧ください。
＊2　クラス B - JPY アンヘッジド：「ICE BofA 3ヵ月米国国債インデックス（USD）」と「MSCI World Net Total Return Index hedged in USD」をともに円換算し、50%ずつ組み合わせたもの
クラス A - JPY ヘッジド：「TONA（無担保コール翌日物金利（JPY））」と「MSCI World Net Total Return Index hedged in JPY」を50%ずつ組み合わせたもの
上記の料率は、2026年5月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

○ その他の費用・手数料
以下のその他の費用・手数料について信託財産からご負担いただきます。
●監査法人等に支払われるファンドの監査費用
●有価証券の売買時に発生する売買委託手数料
●資産を外国で保管する場合の費用　　等
※上記の費用等については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※ 上記の手数料等の合計額については、保有期間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

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）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%

※ 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。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。
※ 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。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

委託会社・その他の関係法人等

委託会社	ファンドの運用の指図等を行います。 三井住友DS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399号 加入協会　　：　一般社団法人資産運用業協会、一般社団法人第二種金融商品取引業協会 ホームページ　：　https://www.smd-am.co.jp コールセンター　：　0120－88－2976　［受付時間］午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）
受託会社	ファンドの財産の保管および管理等を行います。 株式会社ＳＭＢＣ信託銀行
販売会社	ファンドの募集の取扱い及び解約お申込の受付等を行います。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし／年４回決算型）／（為替ヘッジあり／年４回決算型）

追加型投信／内外／株式／特殊型(ロング・ショート型)　　作成基準日：2026年09月30日

販売会社

販売会社名		登録番号	日本証券業協会	一般社団法人金融商品取引業協会	一般社団法人資産運用業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人日本STO協会	備考
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第2336号	○	○	○	○	○	

当資料のご利用にあたっての注意事項

- 当資料は、三井住友DSアセットマネジメントが作成した販売用資料であり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
- 当資料の内容は作成基準日現在のものであり、将来予告なく変更されることがあります。また、将来に関し述べられた運用方針・市場見通しも変更されることがあります。当資料は三井住友DSアセットマネジメントが信頼性が高いと判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。
- 当資料にインデックス・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- 投資信託は、値動きのある証券（外国証券には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、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。したがって元本や利回りが保証されているものではありません。
- 投資信託は、預貯金や保険契約と異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また登録金融機関でご購入の場合、投資者保護基金の支払対象とはなりません。
- 当ファンドの取得のお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書（交付目論見書）および契約締結前交付書面等の内容をご確認の上、ご自身でご判断ください。投資信託説明書（交付目論見書）、契約締結前交付書面等は販売会社にご請求ください。また、当資料に投資信託説明書（交付目論見書）と異なる内容が存在した場合は、最新の投資信託説明書（交付目論見書）が優先します。