

ちばぎんコア投資ファンド(安定型/成長型)

愛称: **ちばぎんラップ・ファンド**

追加型投信/内外/資産複合



- 本書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。
- 本書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は投資信託説明書(請求目論見書)に掲載されております。
- ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

照会先



ちばぎんアセットマネジメント

ホームページ:

<http://www.chibagin-am.co.jp/>

サポートダイヤル:

03-5638-1451 (受付時間:営業日の午前9時~午後5時)

■ 委託会社 (ファンドの運用の指図を行う者)

ちばぎん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443号

設立年月日:1986年3月31日

資本金:2億円

運用する投資信託財産の合計純資産総額:1,279億円

(資本金、運用純資産総額は2024年1月31日現在)

■ 受託会社 (ファンドの財産の保管及び管理を行う者)

三井住友信託銀行株式会社

商品分類

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
追加型投信	内外	資産複合

属性区分

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
その他資産 (注)	年1回	グローバル (日本を含む)	ファンド・オブ・ファンズ	あり (部分ヘッジ)

(注)投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、その他資産(バンクローン、デリバティブ、為替予約取引等))資産配分変更型)

※商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ<https://www.toushin.or.jp/>をご覧ください。

※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。

この目論見書により行うちばぎんコア投資ファンド(安定型)およびちばぎんコア投資ファンド(成長型)の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年4月10日に関東財務局長に提出しており、2024年4月11日にその届出の効力が生じております。

ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

投資信託説明書(請求目論見書)については、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。その際、投資者は自ら請求したことを記録しておいてください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ファンドの特色

1 | 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

2 | オルタナティブ運用の効果的な組み入れにより、短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
- 具体的には、市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド^{※1}等に投資し、オルタナティブ運用^{※2}を行います。

※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用して市場環境にかかわらず収益を追求するファンドなどを指します。

※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3 | 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- 各資産および各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産および各投資対象ファンドへの投資割合は定期的に見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券等へ投資したうえで、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。
- 投資対象ファンドの選定、各資産および各投資対象ファンドへの投資割合の決定は、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行います。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産およびファンドを限定していません。また、それらへの投資割合もあらかじめ決めていません。したがって、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

ファンドの目的・特色

ファンドの特色

4 | 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への 投資割合の合計 ^{※3}	運用の特徴
ちばぎんコア投資ファンド(安定型) ^{※4} 愛称:ちばぎんラップ・ファンド(安定型)	原則50%未満	安定性を重視
ちばぎんコア投資ファンド(成長型) 愛称:ちばぎんラップ・ファンド(成長型)	原則75%未満	安定性と収益性の バランスを重視

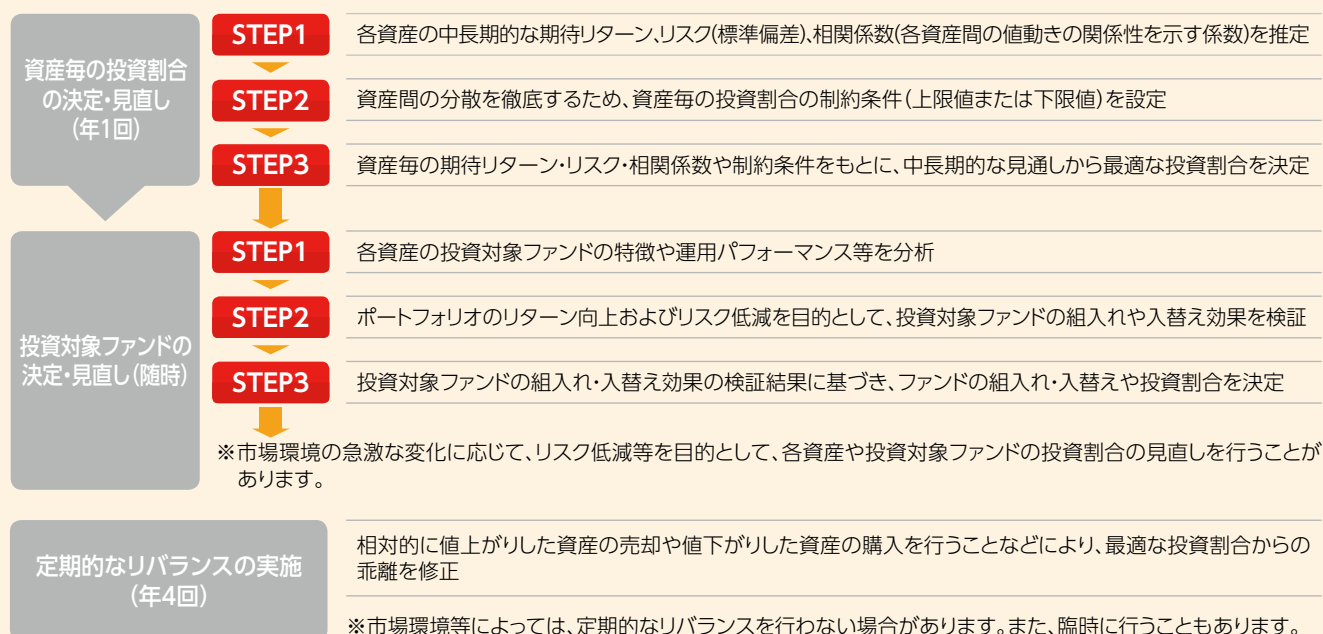
※3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「投資リスク」の「ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

※4 「安定型」とは元本保証等を意味するものではなく、「成長型」と比較して安定的な運用を目指すファンドであることを意味しています。

- 市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ポートフォリオ構築プロセス

- 投資対象ファンドの選定、各資産および各投資対象ファンドへの投資割合の決定は、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「追加的記載事項」をご参照ください。

? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※ 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

〈ご参考情報〉

コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

ヘッジファンド

裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド*などがあります。

※ 特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

投資リスク

基準価額の変動要因

- 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。
- 信託財産に生じた利益および損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスク

債券等の価格は、一般的に金利低下(上昇)した場合は値上がり(値下がり)します。なお、債券等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動および将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況(不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等)、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リートおよびリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

商品(コモディティ)の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国(産出国)の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、またはそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

流動性リスク	<p>時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。</p>
カントリーリスク	<p>投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、またはそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。</p>
資産等の選定・配分に係るリスク	<p>ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。</p>
ヘッジファンドの運用手法に係るリスク	<p>投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。</p>
仕組み債券に係るリスク	<p>投資対象ファンドにおいては、特定の対象(指数やファンド等)の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等およびそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり(1社の場合もあります)、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。</p>
ブローカーの信用リスク	<p>投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部または相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があり、ファンドが大きな影響を被る可能性があります。</p>

投資リスク

有価証券の貸付等に係るリスク

投資対象ファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

ESGの投資リスク

一部の投資対象ファンドにおいては、ESGを投資対象選定の主要な要素としており、ESG評価が相対的に高い企業の発行する有価証券を選別して組み入れます。ESG評価と短期的な有価証券の値動きには必ずしも関連性があるわけではありません。また、ESG評価がファンドの収益源となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合もあります。

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- 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、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小さかった場合も同様です。
- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 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性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や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

リスクの管理体制

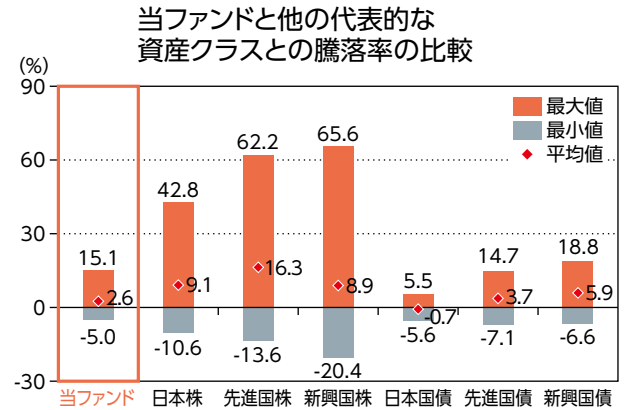
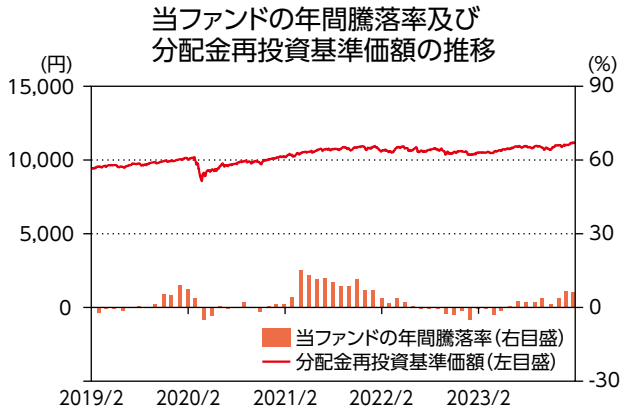
委託会社におけるリスク管理体制

- 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、緊急時対応策の策定・検証などを行います。
- 取締役会等は、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、監督します。
- コンプライアンス部が、運用パフォーマンスおよび運用に係るリスクのモニタリングを行い、モニタリング結果を投資信託委員会に報告します。
- コンプライアンス部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性を評価・検証し、結果を社長に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の点検を行います。

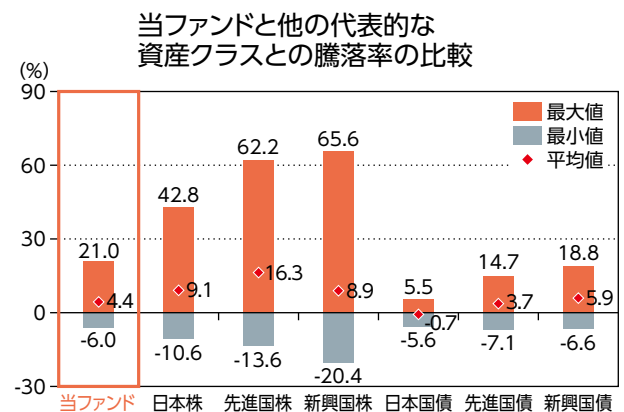
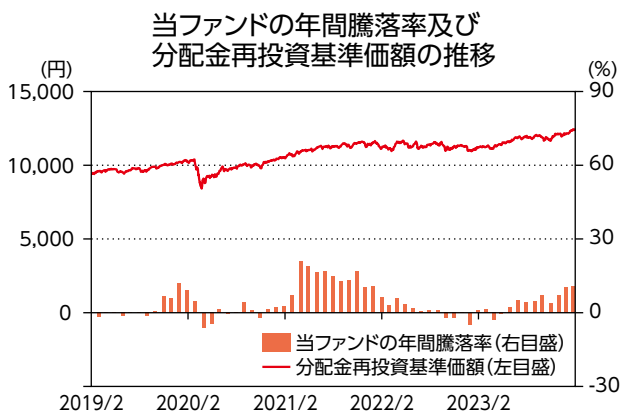
※上記は、2024年1月末現在のリスク管理体制です。リスク管理体制は変更されることがあります。

[参考情報]

ちばぎんコア投資ファンド(安定型)



ちばぎんコア投資ファンド(成長型)



- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

- *2019年2月～2024年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

投資リスク

各資産クラスの指数

日本株…Morningstar 日本株式指数
先進国株…Morningstar 先進国株式指数(除く日本)
新興国株…Morningstar 新興国株式指数
日本国債…Morningstar 日本国債指数
先進国債…Morningstar グローバル国債指数(除く日本)
新興国債…Morningstar 新興国ソブリン債指数

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。各指数は、すべて利子・配当込みのグロス・リターン指数です。

各指数の概要

- ・日本株…Morningstar 日本株式指数は、Morningstar,Incが発表している配当込み株価指数で、日本に上場する株式で構成されています。
- ・先進国株…Morningstar 先進国株式指数(除く日本)は、Morningstar,Incが発表している配当込み株価指数で、日本を除く世界の先進国に上場する株式で構成されています。
- ・新興国株…Morningstar 新興国株式指数は、Morningstar,Incが発表している配当込み株価指数で、世界の新興国に上場する株式で構成されています。
- ・日本国債…Morningstar 日本国債指数は、Morningstar,Incが発表している債券指数で、日本の国債で構成されています。
- ・先進国債…Morningstar グローバル国債指数(除く日本)は、Morningstar,Incが発表している債券指数で、日本を除く主要先進国の政府や政府系機関により発行された債券で構成されています。
- ・新興国債…Morningstar 新興国ソブリン債指数は、Morningstar,Incが発表している債券指数で、新興国の政府や政府系機関により発行された米ドル建て債券で構成されています。

〈重要事項〉

当ファンドは、Morningstar,Inc.、またはモーニングスター・ジャパン株式会社を含むMorningstar,Inc.の関連会社(これらの法人全てを総称して「Morningstarグループ」と言います)が組成、推薦、販売または宣伝するものではありません。Morningstarグループは、投資信託への一般的な投資の当否、特に当ファンドに投資することの当否、または当ファンドが投資対象とする市場の一般的な騰落率と連動するMorningstarのインデックス(以下「Morningstarインデックス」と言います)の能力について、当ファンドの受益者または公衆に対し、明示または黙示を問わず、いかなる表明保証も行いません。本ファンドとの関連においては、ちばぎんアセットマネジメント株式会社(以下、「委託会社」と言います)とMorningstarグループとの唯一の関係は、Morningstarのサービスマークおよびサービス名並びに特定のMorningstarインデックスの使用の許諾であり、Morningstarインデックスは、Morningstarグループが委託会社または当ファンドとは無関係に判断、構成、算定しています。Morningstarグループは、Morningstarインデックスの判断、構成または算定を行うにあたり、委託会社または当ファンドの受益者のニーズを考慮する義務を負いません。Morningstarグループは、当ファンドの基準価額および設定金額あるいは当ファンドの設定あるいは販売の時期の決定、または当ファンドの解約時の基準価額算出式の決定あるいは計算について責任を負わず、また関与しておりません。Morningstarグループは、当ファンドの運営管理、マーケティングまたは売買取引に関連していかなる義務も責任も負いません。

Morningstarグループは、Morningstarインデックスまたはそれに含まれるデータの正確性および/または完全性を保証せず、また、Morningstarグループは、その誤謬、脱漏、中断についていかなる責任も負いません。Morningstarグループは、委託会社、当ファンドの受益者もしくはユーザー、またはその他の人もしくは法人が、Morningstarインデックスまたはそれに含まれるデータを使用して得る結果について、明示または黙示を問わず、いかなる保証も行いません。Morningstarグループは、Morningstarインデックスまたはそれに含まれるデータについて明示または黙示の保証を行わず、また商品性あるいは特定目的または使用への適合性に関する一切の保証を明確に否認します。上記のいずれも制限することなく、いかなる場合であれ、Morningstarグループは、特別損害、懲罰的損害、間接損害または結果損害(逸失利益を含む)について、例えこれらの損害の可能性を告知されていたとしても責任を負いません。

運用実績

設定日：2015年7月31日
作成基準日：2024年1月31日

ちばぎんコア投資ファンド(安定型)

■ 基準価額・純資産の推移



基準価額	11,158円
純資産総額	13.63億円

※上記グラフは設定日から作成基準日までを表示しております。

■ 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:20円

決算期	2019年7月	2020年7月	2021年7月	2022年7月	2023年7月
分配金	0円	0円	20円	0円	0円

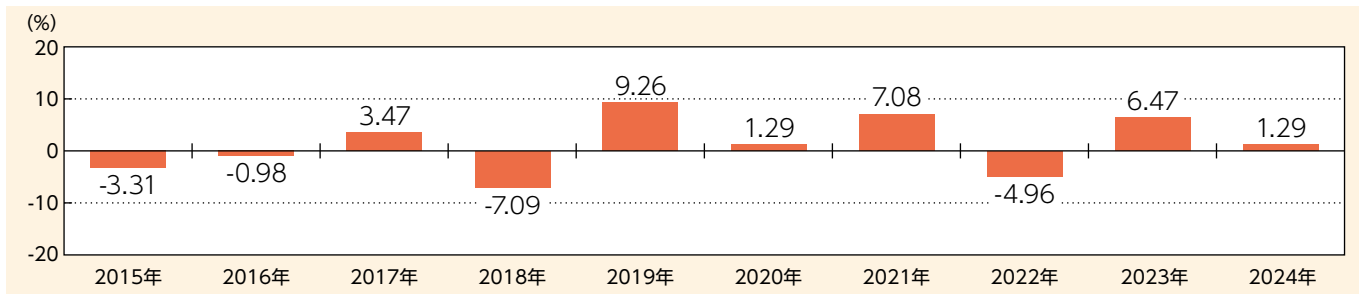
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。
※直近5期分の分配実績です。

■ 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率(%)
マニュアルFOfs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	8.8
明治安田FOfs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	7.3
SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	7.3
FOFs用国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	6.8
FOFs用世界債券総合インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	6.5
ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)	5.8
FOFs用J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	4.9
FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	4.9
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	3.2
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	3.2

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

■ 年間収益率の推移(暦年ベース)



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出しております。
※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

運用実績

設定日：2015年7月31日
作成基準日：2024年1月31日

ちばぎんコア投資ファンド(成長型)

■ 基準価額・純資産の推移



基準価額	12,404円
純資産総額	14.51億円

※上記グラフは設定日から作成基準日までを表示しております。

■ 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:20円

決算期	2019年7月	2020年7月	2021年7月	2022年7月	2023年7月
分配金	0円	0円	20円	0円	0円

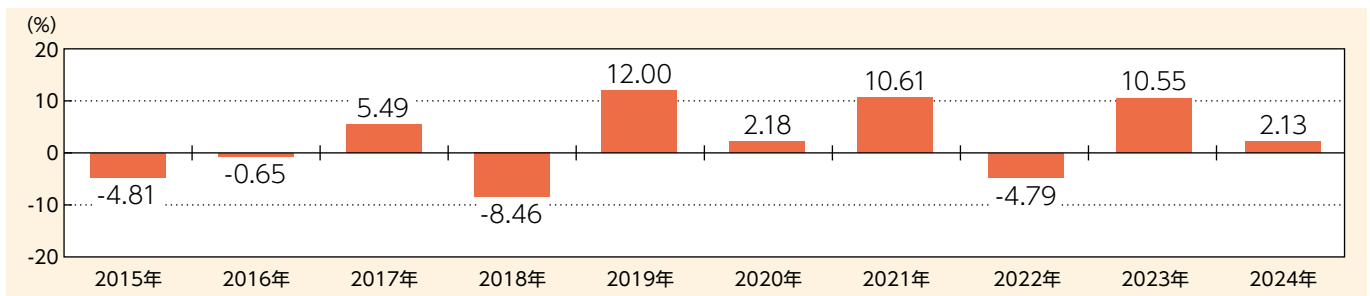
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。
※直近5期分の分配実績です。

■ 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率(%)
FOFs用世界債券総合インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	9.9
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	9.6
ウエスタン・グローバル債券ファンド (適格機関投資家専用)	4.9
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド (適格機関投資家専用)	4.9
FOFs用グローバルREITインデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	4.9
FOFs用J-REITインデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	4.8
FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	4.8
マニライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド (適格機関投資家専用)	4.1
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド (適格機関投資家専用)	3.4
SMDAM日本債券ファンド (適格機関投資家専用)	3.4

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

■ 年間収益率の推移(暦年ベース)



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出しております。
※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

手続・手数料等

お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位とします。「[分配金再投資コース]」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。詳しくは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とします。 (基準価額は1万口当たりで表示しています。)
購入代金	販売会社が定める期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とします。 詳しくは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とします。
換金代金	原則として、換金申込受付日から起算して7営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として、販売会社の営業日の午後3時までとします。
購入の申込期間	2024年4月11日から2024年10月10日までとします。 ※上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。
購入・換金 申込受付不可日	申込日当日が次のいずれかの場合は、購入・換金のお申込みを受付けないものとします。 ニューヨーク証券取引所の休業日 ロンドン証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行休業日 ロンドンの銀行休業日
換金制限	ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
購入・換金申込受付の 中止及び取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた購入・換金のお申込みの取消しを行うことがあります。
信託期間	無期限(2015年7月31日設定)
繰上償還	次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させることができます。 ● 受益権の口数が30億口を下回るようになった場合 ● ファンドを償還することが受益者のために有利であると認める場合 ● やむを得ない事情が発生した場合
決算日	毎年7月10日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。 「[分配金受取りコース]」と「[分配金再投資コース]」の2つの申込方法があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
信託金の限度額	3,000億円
公告	原則、 http://www.chibagin-am.co.jp/ に電子公告を掲載します。
運用報告書	毎決算時および償還時に交付運用報告書および運用報告書(全体版)を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。
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。 なお、配当控除あるいは益金不算入制度の適用はありません。
スイッチング	「ちばぎんコア投資ファンド」を構成する各ファンド間でスイッチングができます。 スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。 (販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。)

手続・手数料等

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	購入申込受付日の翌々営業日の基準価額に 3.3% (税抜3.0%) を上限 として販売会社が定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。 購入時手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社にお支払いいただくものです。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)	<p>純資産総額に対して年率1.386% (税抜1.26%)を乗じて得た額とします。 信託期間を通じて毎日計算し、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。 信託報酬=運用期間中の基準価額×信託報酬率</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>支払先</th> <th>内 訳</th> <th>主な役務</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.869% (税抜0.79%)</td> <td>委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.462% (税抜0.42%)</td> <td>交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.055% (税抜0.05%)</td> <td>運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価</td> </tr> </tbody> </table>	支払先	内 訳	主な役務	委託会社	年率0.869% (税抜0.79%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価	販売会社	年率0.462% (税抜0.42%)	交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価	受託会社	年率0.055% (税抜0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
	支払先	内 訳	主な役務										
	委託会社	年率0.869% (税抜0.79%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価										
	販売会社	年率0.462% (税抜0.42%)	交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価										
受託会社	年率0.055% (税抜0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価											
投資対象とする投資信託証券	純資産総額に対して年率0.19609%～0.51190%程度 (税抜0.17827%～0.48472%程度) ※投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価												
実質的な負担	純資産総額に対して 年率1.58209%～1.89790%程度 (税抜1.43827%～1.74472%程度) ※この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入れ状況等により変動します。なお、投資対象ファンドにより別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。												
その他の費用・手数料	<p>有価証券等の売買・保管、信託事務に係る諸費用、投資対象ファンドの売買に伴う信託財産留保額等はその都度、監査費用、ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用等は日々、ファンドが負担します (投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。)。これらの費用は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p> <p>有価証券等の売買・保管に係る費用は、有価証券等の売買・保管にあたり、売買仲介人・保管機関に支払う手数料 信託事務に係る諸費用は、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息等 ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンドおよびファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬 (成功報酬を含みます。) 等 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用</p>												

※投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495% (税抜0.45%) を乗じて得たものとします。

※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、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示していません。

※FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用) において有価証券の貸付の指図を実質的に行った場合、品賃料が収益として計上され、品賃料に55% (税抜50%) 未満の率を乗じて得た額が信託報酬として支払われます。ただし、品賃料の額は運用状況等によって変動するため、品賃料および品賃料に対する信託報酬の額については、上記「投資対象とする投資信託証券」および「実質的な負担」では考慮していません。

(ご参考)

● FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS (適格機関投資家専用)

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
 - 円建債券の連動対象となるPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬(Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%)、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
- これらの費用等はすべて、今後、変更となる場合があります。

● FOFs用米国株式LSファンドS (適格機関投資家専用)

実質的に投資対象とする米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- 米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
 - マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
 - 米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
- これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

● FOFs用グローバル・コモディティ(米ドル建て)・ファンドS (適格機関投資家専用)

実質的に投資対象とする米ドル建て債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- 米ドル建て債券の評価額に対して年率上限1%程度(投資比率による加重平均)の発行・管理手数料等がかかります。
 - ETF、ETN、米ドル建てMMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
- これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

● FOFs用コモディティLSアルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- 円建債券の評価額に対して年率上限1%程度(投資比率による加重平均)の発行・管理手数料等がかかります。
 - 円建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
- これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

● FOFs用米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS (適格機関投資家専用)

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- 円建債券の評価額に対して年率上限0.5%程度(投資比率による加重平均)の発行・管理手数料等がかかります。
 - 円建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
- これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

《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	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して 20.315%

※上記税率は2024年1月31日現在のものです。

※外貨建資産への投資により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。

※法人の場合は上記とは異なります。

※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。

追加的記載事項

投資対象としている投資信託証券の概要は以下の通りです。

- 全ての資産および投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- 投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は2024年1月31日((★)のファンドに関しては2024年3月18日、(★★)のファンドに関しては2024年4月4日、(★★★)のファンドに関しては2024年4月11日)現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

投資対象ファンド	運用会社	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
FOFs用国内株式 インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用) (★★★)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	わが国の取引所に 上場されている株式	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)(配当込み) ^{*1} と連動する投資成果を目標として運用を行います。
FOFs用日本株式 ESGセレクト・リーダーズ・ インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	わが国の金融商品 取引所等に上場して いる株式	この投資信託は、主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み) ^{*2} に連動する投資成果を目指します。
FOFs用日本株式 エクセレント・フォーカスS (適格機関投資家専用) (★★)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	わが国の株式	この投資信託は、わが国の株式を主要投資対象とし、個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、長期的にベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)(配当込み) ^{*1} に対する超過リターンを目指して運用を行います。
国内株式 アクティブバリューファンド (適格機関投資家専用)	日興アセットマネジメント 株式会社	わが国の金融商品 取引所上場株式	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体(TOPIX(東証株価指数)(配当込み) ^{*1})の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行います。
日本長期成長株 集中投資ファンド (適格機関投資家専用)	ゴールドマン・サックス・ アセット・マネジメント 株式会社	日本の上場株式 (これに準ずるものを 含みます。)	この投資信託は、主として日本の上場株式(これに準ずるものを含みます。)に投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
FOFs用国内株式 EVIバリューファンド (適格機関投資家専用)	三井住友DS アセットマネジメント 株式会社	日本の株式	この投資信託は、日本の株式を主要投資対象とし、中長期的にTOPIX(東証株価指数、配当込み) ^{*3} を上回る投資成果を目指して運用を行います。
SMDAM 日本グロース株ファンド (適格機関投資家専用)(★)	三井住友DS アセットマネジメント 株式会社	日本の株式	この投資信託は、日本の株式を主要投資対象とし、GARP(Growth at a Reasonable Price)戦略に基づき、アクティブ運用することにより中長期的にベンチマークであるTOPIX(東証株価指数、配当込み) ^{*3} を上回る投資成果を目指し、信託財産の成長を目指して運用を行います。
マニユライフFOFs用 日本債券ストラテジック ファンド (適格機関投資家専用)	マニユライフ・ インベストメント・ マネジメント 株式会社	わが国の公社債	ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的にNOMURA-BPI総合 ^{*4} を上回る運用を目指し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
明治安田FOFs用 日本債券アクティブ戦略 ファンド (適格機関投資家専用)	明治安田 アセットマネジメント 株式会社	邦貨建ての国債、政府 保証債、地方債、利付 金融債、社債等	この投資信託は、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合 ^{*5} を中長期的に上回る投資成果を目指し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

投資対象ファンド	運用会社	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
ニッセイ国内債券 アクティブプラス(FOFs用) (適格機関投資家専用)	ニッセイ アセットマネジメント 株式会社	内外の公社債および 内外の国債先物取引 や円金利スワップ等 のデリバティブ取引	この投資信託は、主として内外の公社債への投資を行う とともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等の デリバティブ取引を活用することで、ベンチマークである NOMURA-BPI(総合)指数 ^{*6} を中長期的に上回る投資 成果の獲得を目指します。
SMDAM日本債券ファンド (適格機関投資家専用)	三井住友DS アセットマネジメント 株式会社	わが国の公社債	この投資信託は、デュレーション・コントロールを重視した アクティブ運用により中長期的にNOMURA-BPI総合 指数 ^{*7} を上回る投資成果を目指して運用を行います。
FOFs用外国株式 インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	原則として、 MSCIコクサイ・イン デックス(配当込み、 円換算ベース)を構成 している国の株式	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の 動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース) ^{*8} に連動する投資成果を目標と して運用を行います。
FOFs用外国株式 ESGリーダーズ・ インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	わが国を除く世界主要 国の金融商品取引所等 に上場している株式 (預託証券(DR)を含み ます。)	この投資信託は、主としてわが国を除く世界主要国の金融 商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIコクサイ ESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース) ^{*9} に連動 する投資成果を目指します。
グローバル株式 コンセントレイト・ファンド (適格機関投資家専用)	モルガン・スタンレー・ インベストメント・ マネジメント 株式会社	日本を含む世界各国 の株式	主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資 信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を 行うことを基本とします。
ブランディワイン・ グローバル株式ファンド (適格機関投資家専用)	フランクリン・ テンプルトン・ ジャパン株式会社	日本を含む世界各国の 金融商品取引所に上場 している株式および 不動産投資信託を 含む投資信託証券	この投資信託は、MSCIオール・カントリー・ワールド・ インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース) ^{*10} を ベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を 目指します。
ニッセイ/サンダース・ グローバルバリュー 株式ファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	ニッセイ アセットマネジメント 株式会社	日本を除く世界各国 の株式等	MSCI KOKUSAI Index(円換算ベース・配当込・税引 後) ^{*11} をベンチマークとし、実質的に日本を除く世界各 国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な 成長を目指します。
世界エクイティ・ファンド (適格機関投資家向け)	日興アセットマネジメント 株式会社	日本を含む世界の金融 商品取引所上場株式 (預託証券を含みます。)	主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場され ている株式(預託証券を含みます。)に分散投資を行い、 中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	(投資顧問会社) キャピタル・リサーチ・ アンド・マネジメント・ カンパニー	世界各国の株式	主として世界各国の金融商品取引所(これに準ずるものを 含みます。)に上場され、またはその他の規制ある市場で 取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期 的な成長を目標とします。

追加的記載事項

投資対象ファンド	運用会社	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
FOFs用世界債券総合 インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	ベンチマークである ブルームバーグ・ グローバル総合(日本 円除く)インデックス (円換算ベース) ^{*12} を 構成する通貨建ての 債券等	この投資信託は、主としてベンチマークを構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用を行います。
フィデリティ 外国債券アクティブ・ セレクト・ファンド (適格機関投資家専用)	フィデリティ投信 株式会社	世界各国の投資適格 債券(除く日本円)	この投資信託は、世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
FOFs用新興国株式 インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	取引所に上場されて いる新興国の株式	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース) ^{*13} に連動する投資成果を目標として運用を行います。
ウエスタン・ グローバル債券ファンド (適格機関投資家専用)	フランクリン・ テンプレートン・ ジャパン株式会社	日本を除く世界の 公社債	この投資信託は、主に日本を除く世界の公社債に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
FOFs用J-REIT インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	わが国の取引所に上場 している不動産投資 信託証券	この投資信託は、わが国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数(配当込み) ^{*14} の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
FOFs用グローバルREIT インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	日本を除く世界各国 の取引所に上場して いる不動産投資信託 証券ならびに取引所 に準ずる市場で取引 されている不動産投資 信託証券	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース) ^{*15} の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
FOFs用 グローバル・コモディティ (米ドル建て)・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	米ドル建て債券	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券に投資を行い、世界の様々な商品(コモディティ)市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数(円換算ベース) ^{*16} と概ね連動する投資成果を目指して運用を行います。
FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	日興アセットマネジメント 株式会社	金地金価格への連動を 目指す上場投資信託 証券等	この投資信託は、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、金地金価格への連動を目指す投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長を目指して運用を行います。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund — クラスS-JPY	(投資顧問会社) RBC Global Asset Management (UK) Limited	わが国を含む世界の 投資適格債券	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引および為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。

投資対象ファンド	運用会社	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
FOFs用ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	ゴールドマン・サック ス・インターナショナル によって設立された 海外籍特別目的会社 の発行する円建債券	この投資信託は、主として円建債券への投資を通じて、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券 Pictet TR - Diversified Alpha(世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルグ籍投資信託証券)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。
FOFs用米国株式 LSファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	UBS AG ロンドン支 店が組成を取りまと めた海外籍特別目的 会社の発行する米ド ル建債券	この投資信託は、米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建(ロングポジション)と売建(ショートポジション)を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略により、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。この投資信託におけるマーケット・ニュートラル戦略による運用は、Two Sigmaグループの運用会社が計量モデルを活用することで運用します。
FOFs用コモディティLS アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	ブルームバーグ商品 指数 ^{※17} の騰落率とブ ルームバーグ商品 フォワード指数の騰落 率の差に基づいて償 還価格が決定される 円建債券	この投資信託は、円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とブルームバーグ商品フォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
FOFs用米国株式 インtraday・トレンド 戦略ファンドS (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	円建債券	この投資信託は、円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
FOFs用 GBCAファンドS (ミドルリスク型) (適格機関投資家専用)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	日本の円建短期公社債 等、先進国の債券先物 取引及び世界主要通貨 の為替予約取引	この投資信託は、主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ 戦略ファンド (適格機関投資家専用)	野村アセットマネジメント 株式会社	わが国の株式および 株価指数先物取引の 売建て	この投資信託は、わが国の株式に投資を行うとともに、TOPIX(東証株価指数)を対象とする株価指数先物取引の売建てにより、投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行います。
ウエスタン・カレンシー・ アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	フランクリン・ テンプレートン・ジャ パン株式会社	日本の公社債および 為替予約取引等	この投資信託は、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
MA Hedge Fund Strategies Limited	UBS Asset Management (Americas) LLC	世界各国(日本を含 みます。)の企業の株 式	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業の案件成立前の株価の差異(スプレッド)を捉え、収益を積み上げることを目指して運用を行います。

追加的記載事項

- ※ 1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※ 2 「MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、親指数(MSCIジャパンIMI)構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。当ファンドは、MSCI Inc.(以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。
- ※ 3 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)に帰属します。JPXは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、JPXは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。
- ※ 4 「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

- ※ 5 「NOMURA-BPI総合」は、日本国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の知的財産です。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。
- ※ 6 「NOMURA-BPI(総合)指数」とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。
- ※ 7 「NOMURA-BPI総合指数」とは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する日本の債券市場の動向を的確に表すための市場指数です。日本の債券市場のベンチマークに多く利用されています。NOMURA-BPI総合指数に関する一切の知的財産権その他の一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しております。また、同社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。
- ※ 8 「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※ 9 「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。
- ※ 10 「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、ドルベース)をもとに、委託者が独自に円換算したものです。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc.に帰属します。MSCI Inc.では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

追加的記載事項

- ※11 「MSCI KOKUSAI Index (配当込・税引後)」は、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。
- ※12 「ブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス」とは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行うインデックスであり、円建て債券を除く世界の投資適格債券市場を示すインデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。Bloomberg®及びブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
- ※13 「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。MSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※14 「東証REIT指数」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。同指数の指数値および同指数に係る標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウおよび同指数に係る標章または商標に関する全ての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※15 「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。
- ※16 「ブルームバーグ商品指数」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)およびその関係会社(総称して、「ブルームバーグ」)とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー(UBS Securities LLC)の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算した指数です。ブルームバーグ商品指数(Bloomberg Commodity IndexSM)および「ブルームバーグ(Bloomberg®)」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)およびその関係会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数(Bloomberg Commodity IndexSM)は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー(UBS Securities LLC)の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社(以下「UBS」と総称します。)のいずれも、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数(Bloomberg Commodity IndexSM)に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

※17 「ブルームバーグ商品指数」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)およびその関係会社(総称して、「ブルームバーグ」)とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー(UBS Securities LLC)の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。ブルームバーグ商品指数(Bloomberg Commodity IndexSM)および「ブルームバーグ(Bloomberg[®])」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)およびその関係会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数(Bloomberg Commodity IndexSM)は、ブルームバーグとUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー(UBS Securities LLC)の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社(以下「UBS」と総称します。)のいずれも、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数(Bloomberg Commodity IndexSM)に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

