



SOMPOアセットマネジメント

安心・安全・健康のテーマパーク

投資信託説明書(交付目論見書)

使用開始日: 2024年9月19日

# 米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド

愛称: プレミアム5

追加型投信 / 海外 / 株式



ご購入に際しては、本書の内容を  
十分にお読みください。

- 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。
- ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)を含む詳細な情報は右記の委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードすることができます。また、本書には信託約款の主な内容が含まれておりますが、信託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。
- ファンドの販売会社、ファンドの基準価額等については、右記の照会先までお問い合わせください。

委託会社 ファンドの運用の指図を行う者

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

<照会先>

ホームページ: <https://www.sompo-am.co.jp/>

電話番号: 0120-69-5432

(受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

受託会社 ファンドの財産の保管及び管理を行う者

三菱UFJ信託銀行株式会社

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
追加型	海外	株式	その他資産 (投資信託証券 (資産複合(スワップ取引(株式オプション取引)、 債券 一般)))	年1回	北米	ファンド・オブ・ファンズ	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。

#### 委託会社の情報

委託会社名	SOMPOアセットマネジメント株式会社
設立年月日	1986年2月25日
資本金	1,550百万円
運用する投資信託財産の合計純資産総額	2,295,952百万円

(2024年6月末現在)

- この投資信託説明書(交付目論見書)により行う「米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド」の受益権の募集については、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2023年11月15日に関東財務局長に提出し、2023年12月1日にその効力が発生しております。
- 当ファンドは、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する手続きを行います。
- 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき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。なお、販売会社に投資信託説明書(請求目論見書)をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。



## ご投資家のみなさまへ

当ファンドはS&P500指数を原資産とした上場プット・オプションを売却することで、プレミアムの獲得を目指すファンドです。

原則として、満期日までの期間が5営業日以内のプット・オプションを複数売り建てることで権利行使価格を分散します。また、権利行使価格を米国株式市場の相場変動に合わせて調整することで、株価の下落により損失を被るリスクの低減を目指します。

ファンドの運用にあたっては、フランスの大手金融機関である、ソシエテ・ジェネラル・グループのノウハウを活用します。

当ファンドは伝統的な株式や債券とは異なる値動きの特性を持つため、株式や債券等と併せ持つことでリスク分散を図りたいとお考えのお客さまや、株式市場の変動が大きいタイミングにおいてもプレミアムによるリターンを期待したいお客さまに、投資の選択肢としてご検討いただきたいファンドです。

SOMPOアセットマネジメント



# ファンドの目的・特色

## ● 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 「米国株式プレミアムキャリー戦略」のパフォーマンスを享受することで、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

● ファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。

・「米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド(適格機関投資家私募)」および「SOMPOMANEERPOOLMAZEFUND」を主要投資対象とします。原則として、「米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド(適格機関投資家私募)」への投資比率を高位に保ちます。

・「米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド(適格機関投資家私募)」においては、ソシエテ・ジェネラルが提供する「米国株式プレミアムキャリー戦略」のリターン(損益)を享受する担保付スワップ取引※を行います。なお、担保付スワップ取引とは別に、わが国の短期公社債等に投資します。

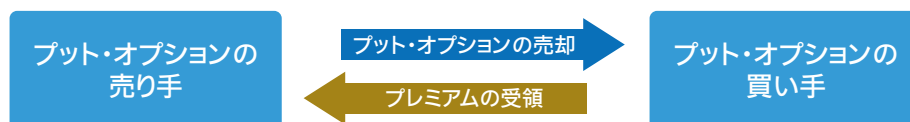
※担保付スワップ取引とは、実際に対象資産を保有していなくとも、相手方(主に金融機関)に対して金利等を支払う代わりに、対象資産のパフォーマンスを受け取るスワップ契約を締結することで、実質的に投資を行っているのと同等の投資効果を享受できる取引のことです。

### 「米国株式プレミアムキャリー戦略」について

● S&P500指数を原資産とした上場プット・オプションを売却することにより、プレミアム(オプション料)を受領し、安定的に収益を獲得することを目指します。

<プット・オプションの売却とは>

- プット・オプションとは、特定の価格(権利行使価格と呼ばれます)で原資産(対象資産)を「売る権利」です。
- オプション取引は、資産そのものではなく、権利を売買することが特徴です。
- プット・オプションの売り手は、対価としてプレミアム(オプション料)を受け取ります。
- ただし、プット・オプションの満期日に、原資産価格が権利行使価格を下回った場合、プット・オプションの売り手において、損失が発生します。

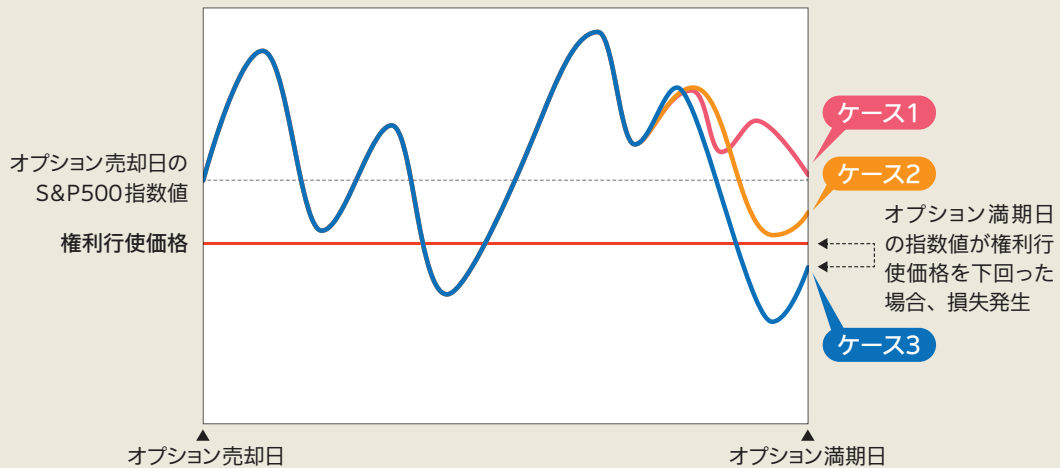


# ファンドの目的・特色

## 「米国株式プレミアムキャリー戦略」について

- 満期日や権利行使価格が異なる上場プット・オプションを常に複数売り建てることで、リスクの分散と安定的な収益獲得を図ります。
  - ▶ 売却するプット・オプションの満期日までの期間は、原則として5営業日以内とします。
    - 満期日までの期間が5営業日以内かつ権利行使される確率が低い権利行使価格の上場プット・オプションが相対的に割高で取引されることを想定し、この条件のオプションを売却することにより、効率的なプレミアムの獲得を目指します。
  - ▶ 権利行使価格は相場のリスク度に合わせて調整します。
    - 当戦略は上場プット・オプションを売却しますが、その権利行使価格については、相場が大きく動くと予測された際は低く設定し、安定相場が予測された際は高めに設定します。相場のリスク度に合わせて権利行使価格を調整することで、株価下落による損失を生じにくくすることを目指します。
- 投資効率を高めるため、オプションの名目上の元本(想定元本)の合計は、「米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド(適格機関投資家私募)」の純資産総額の概ね2倍とします。そのため当戦略の損益は、オプションの名目上の元本(想定元本)の合計が純資産総額と同額であった場合との比較で概ね2倍となります。

S&P500指数のオプション満期日までの値動きのイメージ



- |      |                                 |   |  |
|------|---------------------------------|---|--|
| ケース1 | S&P500指数が変わらず<br>または上昇した場合      | ▶ | ● プレミアム分の利益  |
| ケース2 | S&P500指数が下落したが、<br>権利行使価格以上の場合  | ▶ | ● プレミアム分の利益  |
| ケース3 | S&P500指数が<br>権利行使価格未満になった<br>場合 | ▶ | ● プレミアム分の利益<br>● 権利行使価格を下回る部分の<br>(オプション満期日の指数値-権利行使価格)オプション損失 |

※オプションの損益判定は、オプション満期時のS&P500指数の値を参照しますが、満期日前であっても、S&P500指数が下落する局面では、オプション取引に評価損が発生し、基準価額が下落する可能性があります。

上記はあくまでイメージであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

# ファンドの目的・特色

## ソシエテ・ジェネラルについて

- ・ソシエテ・ジェネラル・グループは、総資産15,540億ユーロ(約244兆1,644億円)の欧州最大級の金融グループです。世界65カ国に126,000名を超える社員を擁しています。
- ・投資銀行業務、グローバルファイナンスおよびグローバルマーケットを軸とするソシエテ・ジェネラルの戦略に沿って事業を展開しており、アジア太平洋地域のみならず、グローバルネットワークを通じてお客さまに付加価値の高いソリューションを提供しています。

(2023年12月末現在)

## S&P500指数について

S&P500指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している米国の代表的な株価指数です。ニューヨーク証券取引所、NASDAQに上場している銘柄から代表的な大型株500銘柄の株価を基に算出される時価総額加重平均型株価指数です。世界の機関投資家の運用実績を測定するベンチマークとして幅広く利用されています。

2

為替変動リスクは限定的です。

- 実質組入外貨建資産は、担保付スワップ取引における「米国株式プレミアムキャリー戦略」のリターン(損益)部分等のみとなるため、為替変動リスクは限定されます。

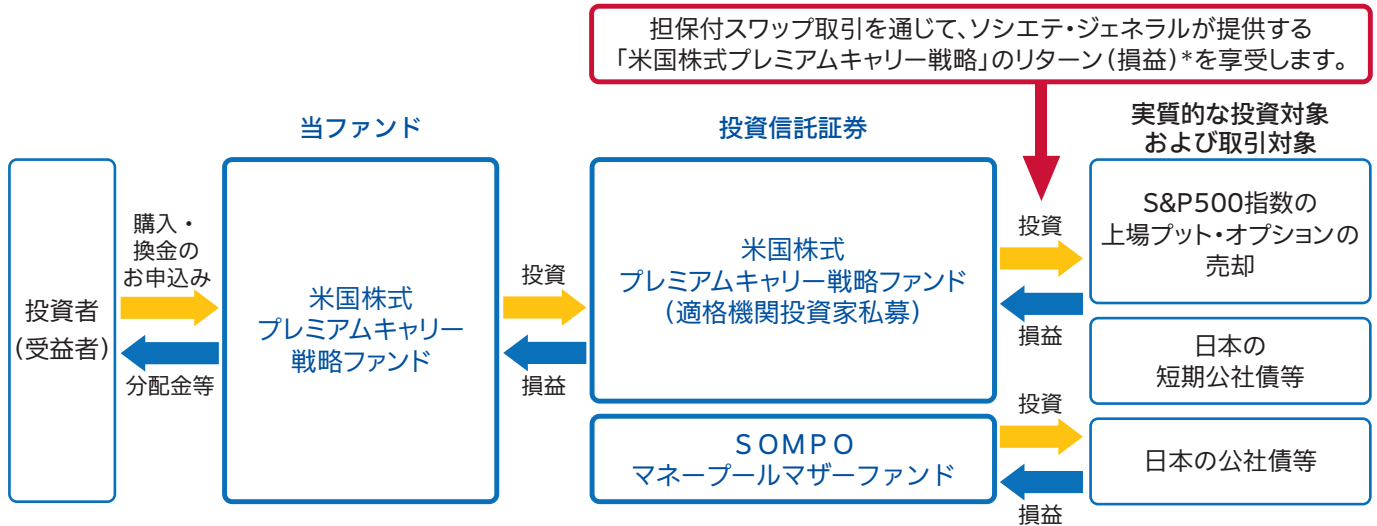
資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

# ファンドの目的・特色

## ファンドの仕組み

当ファンドは、「ファンド・オブ・ファンズ」です。

「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券等の有価証券に直接投資するのではなく、主として複数の他の投資信託(ファンド)を組入れることにより運用を行います。



\*リターン(損益)につきましては、「米国株式プレミアムキャリー戦略」に関する費用等を控除したものととなります。

## 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。
- 外貨建資産への実質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。
- 株式への直接投資は行いません。
- 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。

## 分配方針

- 毎決算時(原則として12月21日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。
- 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。
  - 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
  - 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※ 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。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

# ファンドの目的・特色

## 追加的記載事項

### 主要投資対象の投資信託証券の概要

名 称	米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド(適格機関投資家私募)
形 態	国内籍私募投資信託(円建て)
主 な 投 資 対 象	オンバランスではわが国の短期公社債等を主要投資対象とし、オフバランスでは担保付スワップ取引(円建て)(以下「スワップ取引」)を主要取引対象とします。
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>スワップ取引への投資を通じて、ソシエテ・ジェネラルが提供する米国株式プレミアムキャリー戦略のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。</li> <li>米国株式プレミアムキャリー戦略は、S&amp;P500指数の上場プット・オプションを売却し、安定したオプション・プレミアムの獲得を目指します。売却するプット・オプションの満期は1～5営業日までの超短期で、権利行使価格はマーケット環境に応じて設定します。投資効率を高めるため、米国株式プレミアムキャリー戦略で用いられるオプションの想定元本は、概ね純資産総額の2倍となります。</li> <li>原則として、信託財産の純資産総額に対する参照戦略のエクスポージャーを高位に保ちます。</li> <li>主としてわが国の短期公社債等を中心に投資を行い、コール・ローン等にも投資を行います。</li> <li>市場動向や資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主 な 投 資 制 限	<ul style="list-style-type: none"> <li>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</li> <li>外貨建資産(外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。)への直接投資は行いません。</li> <li>株式への直接投資は行いません。</li> <li>投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会の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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</li> </ul>
決 算 日	原則、毎年12月10日
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%を乗じた額
信 託 報 酬 等	<p>純資産総額に対して年率0.165%(税抜0.15%)</p> <p>※上記の信託報酬等は、本書類作成日現在のものであり、今後変更となる場合があります。また、上記のほか、以下の費用がかかります。</p> <p>&lt;信託事務の諸費用&gt;</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>組入る有価証券等の売買に要する費用および保管費用等、資金の借入れを行った場合の当該借入金の利息、投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する費用等ならびに受託者の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。</li> <li>前記①の費用等に加え、以下に掲げる費用は受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁することができます。 <ol style="list-style-type: none"> <li>投資信託振替制度に係る費用</li> <li>投資信託約款および運用報告書等の作成、印刷、交付等に要する費用</li> <li>この信託の受益者に対して行う公告に要する費用ならびに投資信託約款の変更または投資信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、届出等に要する費用</li> <li>この信託の設定および運営・管理に関し、特定資産の価格調査、法務・税務等につき要する費用</li> <li>店頭デリバティブ取引等に係る担保管理等に要する費用</li> <li>投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用</li> </ol> </li> </ol> <p>なお、前記1.から6.に掲げる費用を総称して以下「諸費用」といいます。</p>



# ファンドの目的・特色

信託報酬等	<p>「諸費用」に関しては、投資信託財産の純資産総額に年0.110% (税抜0.10%) を乗じて得た額を上限とします。(本費用については、投資信託財産の規模などを考慮し、信託の設定時または期中に、上限、固定率または固定金額を合理的に計算された範囲内で変更することが出来るものです。)</p> <p>&lt;参照戦略指数に係る費用&gt;</p> <p>当ファンドで活用するスワップ取引では、間接的に参照戦略における戦略複製コストおよび執行コスト等を負担することになります。</p> <p>ただし、当該コストは運用状況により変動するものであり、事前に上限等を表示することはできません。</p>
申込・解約手数料	ありません。
委託会社	ソシエテ・ジェネラル・オスマン・マネジメント株式会社

※ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

名称	SOMPOマネープールマザーファンド
形態	国内籍親投資信託(円建て)
運用の基本方針	わが国の公社債等(残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券)に投資を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資は行いません。</li> <li>・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。</li> </ul>
設定日	2018年10月26日
信託期間	無期限
決算日	原則として、毎年10月18日
信託報酬等	ありません。
申込・解約手数料	ありません。
委託会社	SOMPOアセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

# 投資リスク

## ● 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。

● 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。

<input checked="" type="checkbox"/> 価格変動リスク	<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>当ファンドで用いる「米国株式プレミアムキャリー戦略」においては、S&amp;P500指数を原資産としたプット・オプションの売却を行い、プレミアム(オプション料)を受け取ります。ただし、オプションの満期日におけるS&amp;P500指数が権利行使価格未満になった場合は損失が発生しますので、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、満期日前であってもS&amp;P500指数が下落する局面では、オプション取引に評価損が発生し、基準価額が下落する可能性があります。</p>
<input checked="" type="checkbox"/> レバレッジリスク	<p>当ファンドで用いる「米国株式プレミアムキャリー戦略」においては、オプションの想定元本の合計が当ファンドの投資対象とする投資信託証券の純資産総額に対して概ね2倍となるようプット・オプションの売建てを行います。そのため、S&amp;P500指数が急激に下落し、権利行使価格を下回る場合には、当ファンドの基準価額が大きく下落する可能性があります。</p>
<input checked="" type="checkbox"/> 信用リスク	<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では、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、当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>
<input checked="" type="checkbox"/> 流動性リスク	<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>当ファンドが投資対象とする投資信託証券は担保付スワップ取引を活用します。市場環境の急変や「米国株式プレミアムキャリー戦略」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>

# 投資リスク

## 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。

## ● 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(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。

## ● 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。

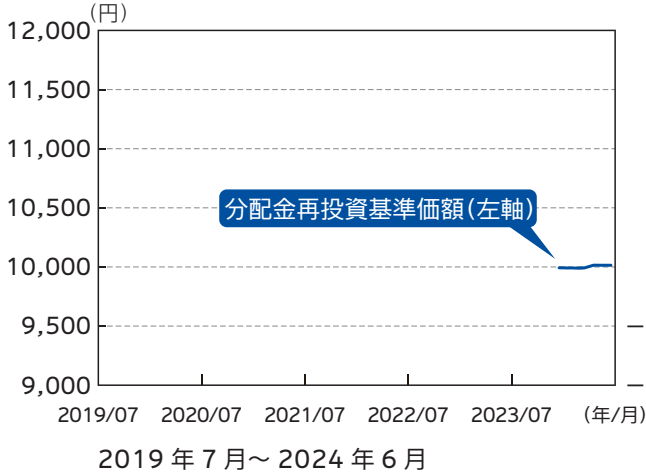
また、委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策等を策定しています。流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢については、担当役員が監督し、管理状況およびその有効性等については、定期的に社内委員会に報告されます。

# 投資リスク

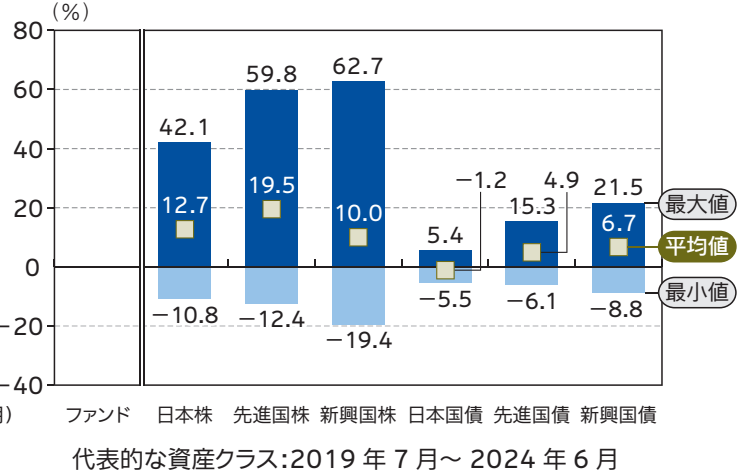
## 参考情報

### ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較



- 資料作成時において、ファンドの運用期間が1年未満のため、ファンドの年間騰落率を記載しておりません。
- 上記は、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および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および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。

- 上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。
- 「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期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、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと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。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 代表的な資産クラスの指数

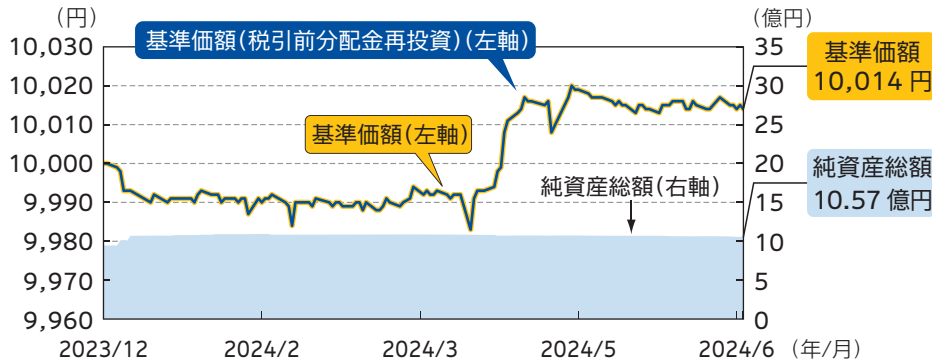
<b>日本株:東証株価指数(TOPIX) (配当込み)</b> 日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。	<b>先進国株:MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)</b> MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。
<b>新興国株: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)</b> MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に円換算しています。なお、MSCI Index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。	<b>日本国債:NOMURA-BPI 国債</b> 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発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、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ます。
<b>先進国債:FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)</b> FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。	<b>新興国債: J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバースィファイド (円ベース)</b> J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバースィファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

# 運用実績

基準日：2024年6月28日

## 基準価額・純資産の推移 2023/12/21~2024/06/28



- 基準価額 (税引前分配金再投資) は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。
- 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## 分配の推移

ファンドの初回決算日は2024年12月23日のため、記載すべき該当事項はありません。

## 主要な資産の状況

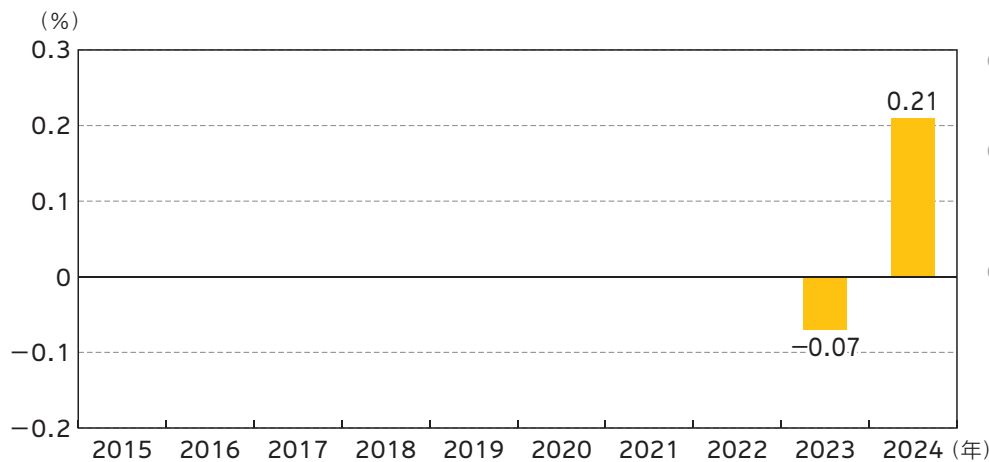
### ● 米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド

資産別構成	
資産の種類	純資産比
米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド(適格機関投資家私募)	97.67%
SOMPOマネープールマザーファンド	0.95%
コール・ローン等	1.38%
合計	100.00%

### 組入上位 10 銘柄

	銘柄名	種類	純資産比
1	米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド(適格機関投資家私募)	投資信託受益証券	97.67%
2	SOMPOマネープールマザーファンド	親投資信託受益証券	0.95%
	組入銘柄数	2 銘柄	

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



- ファンドの年間収益率は基準価額 (税引前分配金再投資) を使用して計算しています。
- 2023年は設定日(2023年12月21日)から年末、2024年は年初から基準日までの収益率です。
- 当ファンドはベンチマークを設定していません。

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用実績は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値は四捨五入して表示している場合、合計が 100% とならないことがあります。

# 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 ※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	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、主要投資対象とする投資信託証券の解約および換金の停止(解約申込が一部受付となった場合を含みます。)ならびに基準価額算出の中止、取引所における取引の停止等※その他やむを得ない事情により、有価証券の売却(主要投資対象とする投資信託証券の解約または換金を含みます。)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。 ※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等をいいます。以下同じ。
申込不可日	<申込日もしくは申込日の翌営業日が以下の日に該当する場合> ・シカゴ・オプション取引所(CBOE)の休業日(半日休業日を含む) ・ニューヨークの銀行の休業日 <申込日の翌営業日の翌日(土曜日・日曜日を除く)が以下の日に該当する場合> ・東京の銀行の休業日
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。
購入の申込期間	2023年12月21日から2025年3月21日まで ※申込期間は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。
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および取消し	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、主要投資対象とする投資信託証券の申込み・解約および換金の停止(申込み・解約が一部受付となった場合を含みます。)ならびに基準価額算出の中止、取引所における取引の停止等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。
信託期間	2033年12月16日まで(設定日 2023年12月21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。

# 手続・手数料等

繰上償還	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。なお、主要投資対象とする投資信託証券のいずれかが存続しないこととなった場合には、繰上償還となります。
決算日	原則、12 月 21 日(休業日の場合は翌営業日) ※初回決算日は、2024 年 12 月 23 日
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	3,000 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>

# 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)	ファンドの日々の純資産総額に対して <b>年率 1.1495% (税抜 1.045%)</b> 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、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 <b>0.415% (税抜)</b>	ファンドの運用の対価
	販売会社 年率 <b>0.60% (税抜)</b>	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 <b>0.03% (税抜)</b>	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価
投資対象とする投資信託証券の信託報酬等	<b>年率 0.165% (税抜 0.15%)</b> ※上記の信託報酬等は、本書類作成日現在のものであり、今後変更となる場合があります。また、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。	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)	ファンドの純資産総額に対して <b>概ね 1.3145% (税込・年率)程度</b> となります。 ※ファンドの運用管理費用(信託報酬)年率 1.1495% (税抜 1.045%) に投資対象とする投資信託証券の信託報酬等(年率 0.165%) 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。	
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。 ・ 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 ※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。	・ 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%

※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6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。

(当該ページは目論見書の内容ではございません。)

## MEMO

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

(当該ページは目論見書の内容ではございません。)

## MEMO

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

