

「ゴールドマン・サックス社債／国際分散投資戦略ファンド 2018-07」の新規設定について

アセットマネジメントOne株式会社（東京都千代田区、取締役社長 菅野 暁）は、投資家の長期資産形成をサポートすることを目的として、2018年7月31日に「ゴールドマン・サックス社債／国際分散投資戦略ファンド2018-07」（以下、当ファンド）を新規設定します。

当ファンドは、①円建てで10年後の投資元本の確保と、②国際分散投資戦略の収益獲得をめざすファンドです。具体的には、ゴールドマン・サックスが発行する円建債券^{*1}（以下、ゴールドマン・サックス社債）に高位に投資^{*2}し、設定日から約10年後の満期償還時の当ファンドの償還価額^{*3}について、元本確保をめざします。さらに、国際分散投資戦略の収益により決定されるゴールドマン・サックス社債の利金を獲得することをめざします^{*4}。

投資元本の確保をめざしたいというニーズの中、当ファンドは約10年後の満期償還時に円建てでの元本確保と、国際分散投資により安定した収益の獲得をめざす仕組みとなっており、長期投資が可能な資金をお持ちである幅広い投資家の方々にご案内させて頂きたいファンドです。

AM-Oneはこれからも、投資機会の発掘を続け、個人投資家の資産形成に資する運用サービスのご提供に努めてまいります。

^{*1} ゴールドマン・サックス・ファイナンス・コーポ・インターナショナルが発行し、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクによる保証が付されます。

^{*2} 満期まで保有することを前提とし、原則として銘柄入替は行いません。

^{*3} ファンドは、信託期間約10年の単位型投資信託です。

^{*4} ファンドは、ゴールドマン・サックス社債のみに投資する特化型ファンドであることからゴールドマン・サックスの信用リスクを負います。

投資する債券の発行体等が債務不履行となった場合等には、元本確保できない場合があります。信託期間中にファンドを解約した場合やファンドが繰上償還された場合等には、解約価額や償還価額が元本を下回る場合があります。

以上

ゴールドマン・サックス社債／国際分散投資戦略ファンド2018-07

単位型投信／内外／資産複合／特殊型（条件付運用型）

【ファンドの費用】

【ご購入時】

購入時手数料：購入価額に 1.08%（税抜 1.0%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額。

【ご換金時】信託財産留保額：換金申込受付日の翌営業日の基準価額に 0.3%の率を乗じて得た額

【信託財産中（信託財産から間接的にご負担いただきます）】運用管理費用（信託報酬）：運用管理費用は、以下の①と②の合計額とします。

① 基本報酬額

ファンドの日々の信託財産の元本総額に対して年率 0.3132%（税抜 0.29%）以内*

*有価証券届出書提出日（2018年6月25日）現在：年率 0.3132%（税抜 0.29%）

② 成功報酬額

委託会社は、基本報酬額に加えて、以下を成功報酬額として受領します。

ゴールドマン・サックス社債の実績連動クーポンに対して 10.8%（税抜 10.0%）を乗じた額を原則として利金支払日*の2営業日前に計上し、毎決算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

*利金支払日：毎年8月3日（ただし、東京の銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当した場合は、翌営業日）

その他の費用・手数料：組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、外国での資産の保管等に要する費用、監査費用等が信託財産から支払われます。

※その他の費用・手数料については定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

※税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となることがあります。

※上記手数料等の合計額等については、購入金額や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。詳細については、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

【ファンドの投資リスク】

当ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさま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異なります。

基準価額の変動要因

■価格変動リスク ■信用リスク ■銘柄集中リスク ■流動性リスク ■早期償還リスク

※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。金利の変動は、公社債等の価格に影響を及ぼします。金利の上昇は、一般に公社債の価格を下落させ、基準価額が下落する要因となります。当ファンドでは、国際分散投資戦略が実績連動クーポンの算出の基準となります。国際分散投資戦略は内外の株価指数先物および債券先物を実質的な投資対象とし、資産配分を行います。配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等には、国際分散投資戦略の収益率が下落する要因となります。有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドは特定の債券（単一銘柄）を組み入れ、原則として銘柄入替えを行わない方針です。当該債券へのリスクが顕在化した場合、多数の銘柄に分散投資を行う投資信託の場合と比較し、大きな影響を被り、基準価額が著しく下落する要因となります。当ファンドが投資する円建て債券は、市場混乱等があった場合、発行体等の信用状況が著しく悪化した場合等には流動性が著しく低下し、売却価格が一般的に想定される価格と乖離することにより、想定以上にファンドの基準価額が下落し、損失を被る可能性があります。当ファンドは、満期償還時点において受益者の投資元本の確保をめざしますが、主要投資対象とする債券が債務不履行（デフォルト）となった場合、または法令あるいは税制の変更等により早期償還となる場合、当該債券の資金化後に繰上償還を行います。その場合、当該債券は時価で換金されるため元本の確保ができず、ファンドの償還価額も投資元本を下回る可能性があります。

ゴールドマン・サックス社債／国際分散投資戦略ファンド 2018-07（以下「当ファンド」）は、アセットマネジメント One 株式会社（以下「アセットマネジメント One」）が設定・運用を行います。「ゴールドマン・サックス」は、Goldman Sachs & Co. LLC（以下「使用許諾者」）の日本およびその他の国において登録された商標です。アセットマネジメント One およびその関連会社は、使用許諾者またはその関連会社・関係会社（以下「ゴールドマン・サックス」と総称）との間に資本関係はありません。ゴールドマン・サックスは、当ファンドの設定または販売に何らの責任も有しておらず、当ファンドの設定または販売にこれまで関与したことはありません。ゴールドマン・サックスは、当ファンドの受益者または公衆に対し、有価証券一般もしくは当ファンドへの投資の適否、当ファンドが一般市場もしくは指数実績を追跡する能力の有無もしくは投資リターンを提供する能力の有無に関して、明示的か黙示的かを問わず、いかなる表明または保証も行っておりません。使用許諾者とアセットマネジメント One の関係は、当ファンドに関する使用許諾者の商標の使用許諾に限られます。

【アセットマネジメント One について】

アセットマネジメント One 株式会社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社（以下、総称して「統合4社」）が統合し、2016年10月1日に発足した資産運用会社です。「投資顧問事業」と「投資信託事業」の双方の事業領域における運用資産残高は約57兆円とアジアトップクラスの規模を誇ります。

統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、資産運用のプロフェッショナルとして、グローバル運用リサーチ体制に支えられた伝統的資産のアクティブ運用や金融工学を駆使した最先端の運用戦略等、個人投資家や機関投資家の多様な運用ニーズに対し、最高水準のソリューションの提供をめざします。

HP : <http://www.am-one.co.jp/>

※運用資産残高は2018年3月末時点。

商号等 / アセットマネジメント One 株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第324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