

2018年8月3日

## 「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 商品スキーム等に関する特許出願について

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、2018年7月31日に新規設定いたしました「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」）の運用にあたり用いた商品スキーム等実現のための手段に関して、特許法第36条に基づき下記の通り特許を出願いたしましたのでお知らせいたします。

当ファンドは、①満期償還時に円建てでの元本確保をめざすことと、②国際分散投資戦略によるリターンの獲得をめざすこと、の両方を同時に追求する商品として設定されました。

上記運用目的を達成するため、当ファンドでは様々な工夫を施しており、この一連の商品スキーム等実現のための手段が本件特許の対象となります。

AM-Oneはこれからも、資産運用のプロフェッショナルとして投資技術の開発や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。

### 記

1. 出願日 : 2018年8月3日
2. 出願番号 : 特願 2018-146952
3. 出願人 : アセットマネジメントOne株式会社

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】※当ファンドは募集期間が終了しているため、購入はできません。

【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。

### 【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。

## 【ご注意事項】

- ・ 当資料は、アセットマネジメント One 株式会社が作成したものです。
- ・ 当資料は情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。
- ・ 投資信託は、債券等の値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります）に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、投資者の皆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。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。
- ・ 当資料における内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。
- ・ 投資信託は
  1. 預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
  2. 購入金額については元本保証及び利回り保証のいずれもありません。
  3. 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

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もありません。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