

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

ESG分類

ESG投信ではありません

本商品は元本確保型の商品ではありません

1. 投資方針

■ファンドの目的

投資信託財産の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。

・今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、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。

・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リスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

※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、バンクローン、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。

・各資産及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、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、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、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで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。

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及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予め定めているものでもありません。従って、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。

④当ファンドの運用目的・リスク許容度の特徴は以下のとおりです。

	「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
分散投資コア戦略ファンドS 愛称:コアラップS	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「24. 基準価額の主な変動要因等」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。

・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。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

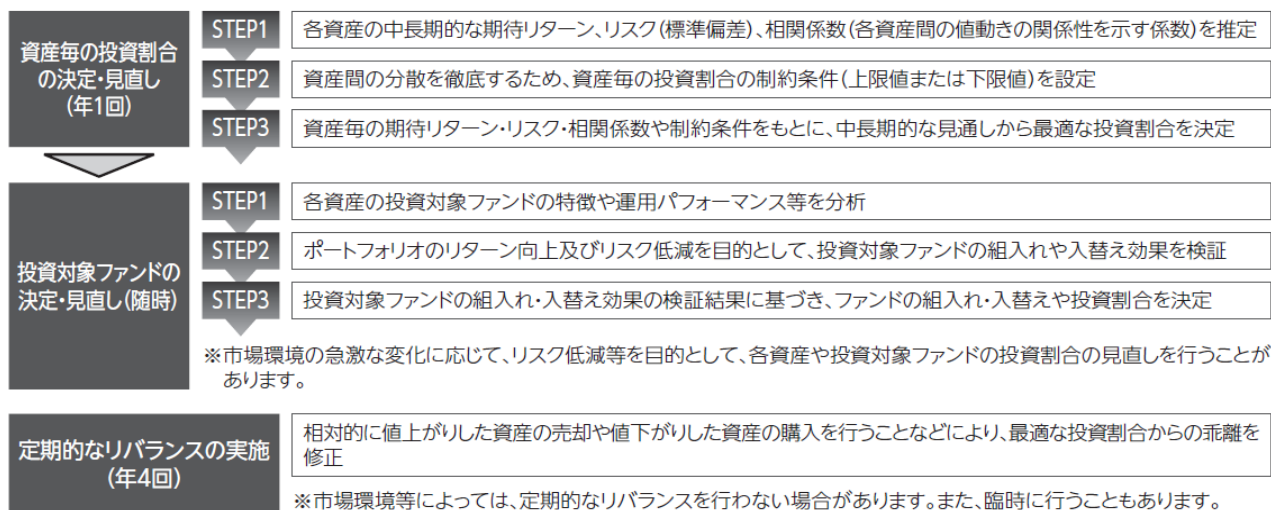
■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

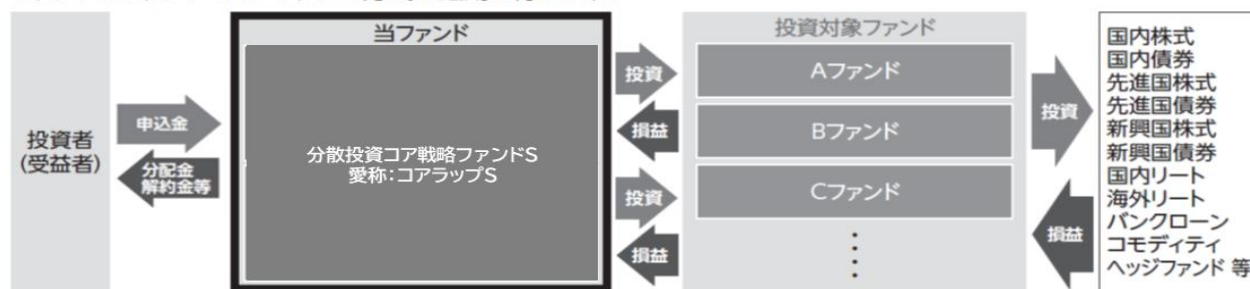
ポートフォリオ構築プロセス



※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、「2. 主要投資対象」をご参照ください。

※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。

- 当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- 「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。
- 当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。
- 投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類: 追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

2. 主要投資対象

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。

●全ての資産及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2025年1月31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	運用の基本方針等
国内株式インデックス マザーファンド	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。
日本株式最小分散 インデックス マザーファンド	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 日本株最小分散 インデックス(配当込み) ^{*2} に連動する投資成果を目指 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。
国内債券インデックス マザーファンド	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	わが国の公社債	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、 NOMURA-BPI総合 ^{*3} と連動する投資成果を目標とし て運用を行います。
外国債券インデックス マザーファンド (為替ヘッジあり)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	日本を除く世界の主 要国の公社債	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を 中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日 本、円ヘッジ・円ベース) ^{*4} と連動する投資成果を目標と して運用を行います。
外国株式インデックス マザーファンド	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) ^{*5} に連動する投資 成果を目標として運用を行います。
外国株式最小分散 インデックス マザーファンド	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	わが国を除く世界の 主要国の株式	この投資信託は、主としてわが国を除く世界の主要国の 株式に投資し、MSCIコクサイ最小分散インデックス(JPY) (配当込み、円換算ベース) ^{*6} に連動する投資成果を目指 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。
外国債券インデックス マザーファンド	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	日本を除く世界の主 要国の公社債	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を 中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日 本、円ベース) ^{*7} と連動する投資成果を目標として運用 を行います。
新興国株式インデックス マザーファンド	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) ^{*8} に連動する投資成果を目標として運用を行 います。
新興国債券インデックス マザーファンド	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	新興国の債券	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資 し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマ ージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円 換算ベース) ^{*9} に連動する投資成果を目標として運用を 行います。
J-REITインデックス マザーファンド	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) ^{*10} 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。
グローバルREIT インデックス マザーファンド	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) ^{*11} 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。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

投資対象ファンド	運用会社	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針等
グローバル・コモディティ (米ドル建て) マザーファンド	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ク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、ブルームバーク商品指数(円換算ベース) ^{*12} と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	金現物に投資する上 場投資信託証券	この投資信託は、主として金現物に投資する上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース) ^{*13} に連動する投資成果を目指します。
HFリターン・ターゲット・ マザーファンド (為替ヘッジあり)	三井住友トラスト・ アセットマネジメント 株式会社	日本国債、国内外の 上場投資信託証券、 国内外の株価指数 先物取引、債券先物 取引、為替予約取引	この投資信託は、主として日本国債及び国内外の上場投資信託証券に投資し、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を組み合わせることで、HFRI総合指数(円ヘッジ・円ベース) ^{*14} の騰落率と概ね同程度の投資成果を目指します。
GBCAマザーファンド (ミドルリスク型)	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。
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド (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 MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド (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、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券[Man AHL Diversified (Cayman) Ltd](主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券。なお、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。)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。
マルチ・ストラテジー・ ファンド (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	わが国を含む世界の 株式及び債券	この投資信託は、主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び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。
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	日本の公社債及び為 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。
Franklin K2 Athena Risk Premia Enhanced SP I(acc)JPY	(投資顧問会社) Franklin Advisers, Inc.	日本の国債を含む株 式、債券、デリバティ ブ、通貨等の幅広い 資産	この投資信託は、株式市場と比べて低いボラティリティ及び伝統的なアセットクラスに対して低い相関性を維持しつつ、中長期的に資産価値を向上させることを目指します。
Neuberger Berman Event Driven Fund JPY I Accumulating Class - Hedged	(管理会社) Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited	日本を含む世界の株 式等を原資産とした トータル・リターン・ス ワップ及び米国国債 等	この投資信託は、主としてトータル・リターン・スワップを通じて、日本を含む世界の株式等の買建及び売建を組み合わせたマーケット・ニュートラル型のイベントドリブン戦略により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。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称：コアラップS》

投資信託協会分類：追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

- ※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く網羅するとともに、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に係る標準又は商標は、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に係る標準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 日本株最小分散インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本の株式市場に上場する日本株を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、指数値の変動幅を一定の制約条件下で最小化することを目指します。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。MSCI 日本株最小分散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 日本株最小分散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。
- ※3「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。
- ※4「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドの sponsor ではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対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。
- ※5「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、当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。
- ※6「MSCIコクサイ最小分散インデックス(JPY)」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に上場する銘柄を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、対円の為替変動を含めた指数値の変動幅を、一定の制約条件下で最小化することを目指します。「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、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ最小分散インデックス(JPY)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コクサイ最小分散インデックス(JPY)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。
- ※7「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドの sponsor ではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対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。
- ※8「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、当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。
- ※9「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド」とは、新興国の現地通貨建て債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する標準・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ※10「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。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、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、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数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。
- ※11「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当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当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を負いません。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称：コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など流動性のある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

- ※12「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.)及び、その関係会社と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当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)及び「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.)及び、その関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)のサービスマークであり、当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・シー及びその関係会社(以下「UBS」と総称します。)のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及び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又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。
- ※13金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)とはLBMA金価格(円ヘッジベース)です(2025年1月31日現在)。LBMA金価格の正式名称はLBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格(米ドル建て)を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会(London Bullion Market Association)の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。
- ※14 HFRI総合指数(円ヘッジ・円ベース)(HFRI Weighted Composite Index JPY)は、HFRI Fund Weighted Composite Index の日本円ヘッジバージョンであり、Hedge Fund Research, Inc. (以下「HFR」) が月次為替予約のコストを適用して算出します。HFRI Fund Weighted Composite Indexは、HFRのデータベースに登録されたヘッジファンドを対象とするグローバルな等加重インデックスです。データベースへの登録条件は、①運用会社がHFRからの質問項目に回答すること、②5,000万米ドル以上の運用資産残高を有するか、12か月間以上の運用実績と1,000万米ドル以上の運用資産残高を有すること、③毎月、手数料控除後の米ドルベースのパフォーマンスと運用資産残高をHFRIに対して報告することとなっています。なお、ファンド・オブ・ヘッジファンズは対象としていません。「HFRI Weighted Composite Index JPY」及び「HFRI」は、Hedge Fund Research, Inc. (以下「HFR」) の商標です。その使用については、ライセンス契約に基づいてHFRから三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社、その関連会社、又はそれらの金融商品とは一切関係ありません。HFRIは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社のいかなる金融商品の組成にも関与しておらず、それらの金融商品への投資を支持、承認、推奨するものではありません。また、それらの当該金融商品に関連するいかなる種類又は性質の損害に対しても責任を負いません。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

3. 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。

4. ベンチマーク

当ファンドにはベンチマーク及び参考指数ともありません。

5. 信託設定日

2013年3月29日

6. 信託期間

無期限

7. 償還条項

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10億口を下回ることとなった場合
- ・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

8. 決算日

毎年7月10日(休業日の場合は翌営業日)

9. 信託報酬

●純資産総額に対して年率0.935%(税抜0.85%)を乗じて得た額

■内訳

委託会社:年率0.495%(税抜0.45%)

販売会社:年率0.385%(税抜0.35%)

受託会社:年率0.055%(税抜0.05%)

(投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合)

マザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率※を乗じて得た額

※2025年4月10日現在、合計で49.5%(税抜45%)以内とし、その配分は委託会社29.7%(税抜27%)、受託会社19.8%(税抜18%)です。(品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。)

●投資対象とする投資信託証券

純資産総額に対して年率0.0%～0.49146%程度(税抜0.0%～0.4645%程度)

●実質的な負担

純資産総額に対して年率0.935%～1.42646%程度(税抜0.85%～1.3145%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っては、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。※品貸料の額は運用状況等によって変動するため、品貸料及び品貸料に対する信託報酬の額については、「投資対象とする投資信託証券」及び「実質的な負担」では考慮しておりません。

10. 信託報酬以外のコスト

有価証券の売買・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をその都度、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を日々、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を含みます。)。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。

※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、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

11. お申込単位

1円以上1円単位

12. お申込価額

ご購入約定日の基準価額

13. お申込手数料

ありません。

14. ご解約価額

ご売却約定日の基準価額

15. 信託財産留保額

ありません。

16. 収益分配

年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。分配金は、自動的に再投資されます。

17. 申込不可日

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、及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。また、確定拠出年金制度上、取得申込・解約請求ができない場合がありますので運営管理機関にお問い合わせください。

18. 課税関係

確定拠出年金制度上、運用益は非課税となります。

19. 損失の可能性

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。従って、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及び損失は、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。

20. セーフティーネットの有無

投資信託は預貯金や保険契約とは異なり預金保険機構及び保険契約者保護機構等の保護の対象ではありません。また、証券会社以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。

21. 持分の計算方法

解約価額×保有口数

注:解約価額が10,000口あたりで表示されている場合は10,000で除してください。

22. 委託会社

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
(信託財産の運用指図等を行います。)

23. 受託会社

三井住友信託銀行株式会社
(信託財産の保管・管理を行います。)

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

24. 基準価額の主な変動要因等

■株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及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、バンクローン等の価格は、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、バンクローン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及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、物価変動及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、バンクローン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、リート及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、又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

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。

■カントリーリスク

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、又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。

■資産等の選定・配分に係るリスク

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。

■ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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に影響を受け、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。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。

分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》

投資信託協会分類:追加型投信／内外／資産複合

本商品は元本確保型の商品ではありません

■仕組み債券に係るリスク

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及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。

■ブローカーの信用リスク

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又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。

■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。

※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》

●ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当する必要がある場合や組入資産の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、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

●確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

※各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。

■「分散投資コア戦略ファンドS《愛称:コアラップS》」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。

■当資料は、確定拠出年金法第24条及び関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。

■投資信託は、株式など値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本及び運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。