

ステートストリート・ゴールドファンド(為替ヘッジあり)

投資信託協会分類: 追加型投資信託/海外/その他資産(商品)

本商品は元本確保型の商品ではありません

1.投資方針

運用はファンド・オブ・ファンズ方式により行い、主として金現物拠出型上場外国信託「SPDR®(スパイダー) ゴールド・シェア」への投資を行うと共に、その投資金額相当額の米ドルについて原則として為替ヘッジを行うことにより、金地金価格を示す「LBMA午後金価格(1トロイオンス当たり/米ドルベース)」の円ヘッジベースの動向を反映する投資成果の獲得を目指します。

2.主要投資対象

金現物拠出型上場外国信託「SPDR®(スパイダー) ゴールド・シェア」(以下、SPDRゴールドETF)および短期国債マザーファンド(以下、マザーファンド)受益証券

3.主な投資制限

(1) SPDRゴールドETFおよびマザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません(2) 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。

4.ベンチマーク

「LBMA午後金価格(1トロイオンス当たり/米ドルベース)」の円ヘッジベースを参考指数とします。

5.信託設定日

2012年11月8日

6.信託期間

無期限

7.償還条項

受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

なお、主要投資対象とする外国信託が存続しないこととなった場合や組入ができなくなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

8.決算日

毎年8月20日(ただし休日の場合は翌営業日)

9.信託報酬

純資産総額に対し年率0.495%(税抜0.45%)
内訳は以下の通りです。
委託会社:0.11%(税抜0.10%)、販売会社:0.352%(税抜0.32%)、受託会社:0.033%(税抜0.03%)

10.信託報酬以外のコスト

主要投資対象とするSPDRゴールドETFにおいて、信託管理報酬等として純資産総額に対し年率0.40%を乗じて得た額が控除されます。また、以下の費用等がファンドから支払われます。これらの費用等は、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。

・組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料
・監査費用・信託財産に関する租税・信託事務の処理に要する諸費用等

11.お申込単位

1口の整数倍

12.お申込価額

購入申込受付日の翌営業日の基準価額

13.お申込手数料

ありません。

14.ご解約価額

換金申込受付日の翌営業日の基準価額

15.信託財産留保額

ありません。

16.収益分配

年1回の決算時(原則として8月20日)に収益分配方針に基づき収益分配を行います。分配金は、自動的に再投資されます。

17.お申込不可日等

取引所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(投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等)による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)があるときは、委託会社の判断により、購入・換金の申込受付の中止および取消しを行う場合があります。また、確定拠出年金制度上、取得の申込みまたは一部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は運用益は非課税となります。

■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。■「ステートストリート・ゴールドファンド(為替ヘッジあり)」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年法律第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条およ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、値動きのある有価証券等(外貨建資産は為替ヘッジにより為替リスクは低減されますがその影響を完全に排除できるものではありません。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本およ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、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて運営管理機関によって作成されましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。

ステートストリート・ゴールドファンド(為替ヘッジあり)

投資信託協会分類:追加型投資信託/海外/その他資産(商品)

本商品は元本確保型の商品ではありません

19. 損失の可能性

当ファンドは、主として後述する要因等により基準価額が大きく変動する場合があります。その運用成果(損益)はすべて投資者の皆さまに帰属します。したがって、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。

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・貯金保険・保険契約者保護機構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:基準価額・解約価額が10,000口あたりで表示されている場合は10,000で除して下さい。

22. 委託会社

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(信託財産の運用指図、受益権の発行等を行います。)

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。)
再信託受託会社:株式会社日本カストディ銀行

24. 基準価額の主な変動要因等

1. 金地金価格変動リスク

一般に、金地金の指標価格は金の需給関係や為替、金利の変動など様々な要因により大きく変動します。また、組入れている金現物拠出型上場外国信託は、金地金の指標価格の変動等の影響を受けて変動します。このため、当ファンドはその影響を受け、組入れている金現物拠出型上場外国信託の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

2. 流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければならない状況においては、売却価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスクなどがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

3. 為替変動リスク

当ファンドは、投資金額相当額の米ドルについて原則として為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図りますが、為替リスクを完全に排除できるものではありません。また、為替ヘッジを行うにあたり、ヘッジコストがかかります。

ヘッジコストとは、為替ヘッジに伴う経費を指し、一般的に日本(円)と投資対象国(ヘッジ対象通貨)の短期金利差に相当します。日本(円)よりも投資対象国(ヘッジ対象通貨)の短期金利が高い場合、この金利差分がヘッジコストとして収益の低下要因となります。

4. ファンド・オブ・ファンズ方式のリスク

当ファンドの信託期間終了前に、主要投資対象とする金現物拠出型上場外国信託が存続しないこととなった場合や組入ができなくなった場合には当ファンドは繰上償還となります。

また、投資対象が上場投資信託の場合は、上記の流動性リスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

5. その他の留意点

当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。

当ファンドは、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、換金の申込みの受け付け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。

6. リスクの管理体制

運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

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。

■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。■「ステートストリート・ゴールドファンド(為替ヘッジあり)」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年法律第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条およ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、値動きのある有価証券等(外貨建資産は為替ヘッジにより為替リスクは低減されますがその影響を完全に排除できるものではありません。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本およ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、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて運営管理機関によって作成されましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。