

## パインブリッジ・デیلیー・ミックス・オープン（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし） 新規設定のお知らせ

当社は、2021年5月11日（火）に「パインブリッジ・デیلیー・ミックス・オープン（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）」を新規設定いたしますので、お知らせいたします。

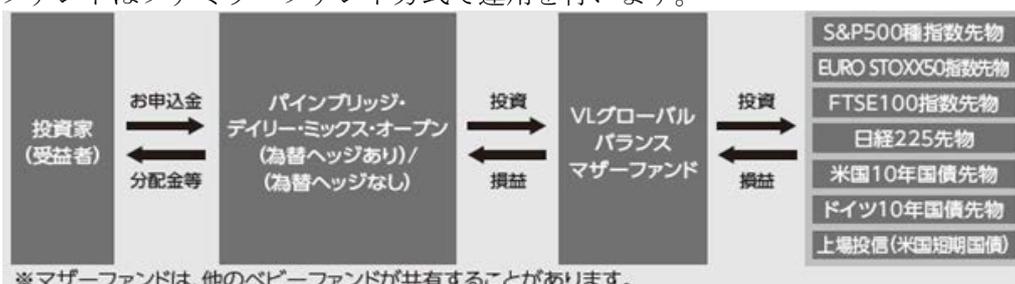
### <ファンドの特色>

- マザーファンドへの投資を通じて、リスク・パリティ戦略に基づき、ファンド全体のボラティリティを一定水準（20%程度）以下に維持しつつ、先進国株式の株価指数先物取引（S&P500種指数先物、EURO STOXX50 指数先物、FTSE100 指数先物、日経225 先物）と先進国債券の債券先物取引（米国10年国債先物、ドイツ10年国債先物）の買建てを行い、参照指数の中長期的な動きが概ね反映される投資成果を目指します。

※リスク・パリティ戦略とは、ポートフォリオが投資対象とする各資産の配分を固定化せず、ポートフォリオ全体のリスク量（価格変動率）が均等になるように、各資産のリスク量を随時評価し資産配分をする運用手法です。

※参照指数は、先進国株式の株価指と先進国債券の債券指数の構成比率をリスク・パリティ戦略に基づき日々算出し、そのリターンで合成した指数（円換算）です。

- 当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。



※ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を主としてマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う、複数のファンドを合同運用する仕組みをいいます。

- マザーファンドにおいては、株価指数先物取引と債券先物取引の買建て額の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度が上限となるように調整を行います。また、株価指数先物取引と債券先物取引の買建て額の構成比については、リスク・パリティ戦略に基づき、調整を行います。
- マザーファンドにおいては、委託会社の判断において、S&P500種指数のプット・オプションの買建てを行う場合があります。ただし、買建て額は、原則として、信託財産の純資産総額の2倍を上回らないものとします。
- マザーファンドにおいては、先物取引以外の部分については、主として米国短期国債に投資する上場投資信託証券に投資を行います。  
※先物取引を活用する場合、少額の投資金額で運用を行うことができます。そのため、これらの取引に利用しない金額分について主として投資を行う米国短期国債の上場投資信託証券は、相対的に高い投資割合となる場合があります。
- マザーファンドにおいて、米ドル以外の通貨建資産および通貨については、原則として、当該通貨売り米ドル買いの為替取引を行うことにより、実質的に米ドル建ての資産に投資しているのと同様の為替変動効果を目指します。
- 実質組入れの外貨建資産については、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行って為替変動リスクの低減を図る（為替ヘッジあり）と、対日本円での為替変動リスクについては原則として為替ヘッジを行わない（為替ヘッジなし）があります。
- 原則として、年2回（3月29日および9月29日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。なお、将来の分配金が保証されているものではなく、分配対象額が少額の場合等、分配を行わないこともあります。

※第1期の決算は2021年9月29日（水）となります。

## <ファンドの概要>

ファンド名	パインブリッジ・デイリー・ミックス・オープン（為替ヘッジあり） パインブリッジ・デイリー・ミックス・オープン（為替ヘッジなし）
商品分類	追加型／内外／資産複合
購入の申込期間	当初申込期間：2021年5月10日（月） 継続申込期間：2021年5月11日（火）から2022年6月28日（火）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って更新されます。
設定日	2021年5月11日（火）
信託期間	2031年4月30日（水）までの約10年
販売会社	委託会社の指定する金融商品取引業者および登録金融機関
基本方針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
投資対象	VLグローバルバランスマザーファンドを主要投資対象とします。
決算日	年2回（3月および9月の各29日、休業日の場合は翌営業日） なお、初回の決算日は、2021年9月29日（水）とします。
収益分配方針	毎決算時に、以下の方針に基づいて分配を行います。 ① 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する利子・配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額をいいます。）の全額とします。 ② 分配金額は、分配原資の範囲内で、基準価額水準、市況動向、運用状況等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 ③ 分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いします。
購入価額	当初申込期間：1口当たり1円とします。 継続申込期間：購入申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
購入単位	販売会社が定める単位

## <ファンドにかかる手数料等について>

### ■購入時に直接ご負担いただく費用

- 購入時手数料：購入申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間は1口当たり1円）に3.3%（税抜3.0%）の率を乗じて得た額を上限として、販売会社が独自に定めるものとします。

### ■換金時に直接ご負担いただく費用

- 換金時手数料： かかりません。
- 信託財産留保額： かかりません。

### ■投資信託の保有期間中に間接的にご負担いただく費用

- 運用管理費用（信託報酬）：信託財産の純資産総額に年1.518%（税抜1.38%）の率を乗じて得た額とします。
- その他費用：有価証券売買時の売買委託手数料、資産を海外で保管する場合の保管費用等（運用状況等により変動するものであり、事前に料率・上限額等を示すことはできません。）  
当ファンドの監査費用や印刷等費用（信託財産の純資産総額の年率0.11%（税抜年0.1%）を上限とします。）

※ 費用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、表示することはできません。詳しくは、販売会社または委託会社までお問い合わせください。

## <ファンドのリスク>

当ファンドは、主としてマザーファンドへの投資を通じて、株価指数先物取引や債券先物取引等の値動きのある資産等を投資対象としているため、基準価額は変動します。また、外貨建資産には為替変動リスクもあります。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、元本が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。これらの運用による損益は、すべて投資者の皆様には帰属しますので、お申込みにあたりましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえ、お申込みください。当ファンドが有する主なリスク要因は、以下の通りです。

- ① 価格変動リスク
- ② 為替変動リスク
- ③ 金利変動リスク
- ④ 信用リスク
- ⑤ 流動性リスク
- ⑥ 特定資産への集中投資リスク
- ⑦ デリバティブリスク
- ⑧ レバレッジリスク
- ⑨ 資産配分リスク

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。詳しくは「投資信託説明書（交付目論見書）」等をご確認ください。

**お問い合わせは・・・パインブリッジ・インベストメンツ株式会社**

**金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第307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、**

**一般社団法人第二種金融商品取引業協会**

**<https://www.pinebridge.co.jp/>**

**TEL : 03-5208-5858** (営業日の9:00~17:00)