



11月27日より購入申込の受付を開始



T&D保険グループのT&Dアセットマネジメント株式会社(東京都港区、代表取締役社長: 田中 義久)は、2023年12月14日に「USプレミアム・インカムファンド」を設定いたします。

ファンドの特色

- 特別目的会社ハープ・イシュー・ピーエルシーが発行する円建パフォーマンス・リンク債券(以下「担保付円建債券」ということがあります。)への投資を通じて、実質的に米国株式プレミアム戦略のパフォーマンスからの安定的なリターンを獲得を目指します。
- 米国株式プレミアム戦略は、米国の株価指数であるS&P500指数(以下「参照指数」ということがあります。)を原資産としたプットオプション(期間は約1週間、権利行使価格はプットオプション構築時の参照指数値の97%)を売却することで、参照指数の下落による損失を低減しつつプレミアムの獲得を目指す戦略です。
- 担保付円建債券の組入比率は、高位とすることを基本とします。
- 「USプレミアム・インカムファンド(年1回決算型)」と「USプレミアム・インカムファンド(年4回決算型)」の2つのファンドから決算頻度の違いに応じてお選びいただけます。

資金動向や市況動向等によっては、上記のような運用が行われない場合があります。

設定日	: 2023年12月14日(木)
購入申込受付開始日	: 2023年11月27日(月)
取扱販売会社	: 香川証券株式会社



お申込みメモ

購入時	購入の 申込期間	当初申込期間: 2023年11月27日から 2023年12月13日まで 継続申込期間: 2023年12月14日以降
	購入単位	販売会社が定める単位 (当初元本1口 = 1円) 詳しくは販売会社にお問い合わせください。
	購入価額	当初申込期間: 1口当たり1円 継続申込期間: 購入申込受付日の翌営業日 の基準価額
換金時	換金単位	1口以上1口単位で販売会社が定める単位
	換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額
	換金代金	原則として換金申込受付日から起算して7営業 日目からお支払いします。
申込締切時間		当初申込期間: 当初申込期間の最終日 (2023年12月13日)の午後3時までに販売会 社が受付けたものを申込受付分とします。 継続申込期間: 原則として午後3時までに販 売会社が受付けたものを当日の申込分とします。
信託期間		2033年11月25日まで (2023年12月14日設定)
決算日		(USプレミアム・インカムファンド(年1回決算型)) 11月25日(休業日の場合は翌営業日) 初回決算日は2024年11月25日です。 (USプレミアム・インカムファンド(年4回決算型)) 2月、5月、8月、11月の各25日(休業日の場 合は翌営業日) 初回決算日は2024年2月26日です。
収益分配		毎決算時に収益分配方針に基づいて収益の分 配を行います。 販売会社との契約によっては税引後無手数料で 再投資が可能です。 ただし、必ず分配を行うものではありません。
課税関係		課税上は、株式投資信託として取扱われます。 公募株式投資信託は、税法上、少額投資非 課税制度(NISA)および未成年者少額投資 非課税制度(ジュニアNISA)の適用対象であ り、2024年1月1日以降は、一定の要件を満 たした場合にNISAの適用対象となります。なお、 ファンドについては、2024年1月1日以降NISA の適用対象ではありません。詳しくは、販売会社 にお問い合わせください。 配当控除の適用はありません。
申込不可日		下記のいずれかに該当する日には、購入・換金 の申込はできません。 ・ニューヨーク証券取引所の休業日 ・シカゴオプション取引所の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日

ファンドの費用

◆ 投資者が直接的に負担する費用

購入時 手数料	購入価額に、 3.3% (税抜3.0%) を 上限 として販売会社が個別に定める率 を乗じて得た額とします。 詳しくは販売会社にお問い合わせくださ い。
信託 財産 留保額	ありません。

◆ 投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理 費用 (信託 報酬)	毎日、ファンドの純資産総額に 年1.243% (税抜1.13%) の率を 乗じて得た額とします。
その他の 費用・ 手数料	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託財産にかかる監査費用および 当該監査費用にかかる消費税等に 相当する金額は、受益者の負担とし、 信託財産中から支弁します。 ・ 証券取引に伴う手数料、組入資産 の保管に要する費用等は、信託財 産中から支弁します。 これらの費用・手数料については、運用 状況等により変動するものであり、事前 に料率・上限額等を示すことができませ ん。 <ul style="list-style-type: none"> ・ 投資対象とする担保付円建債券の 価格は、年率0.15%程度の管理費 用等が差引かれています。

上記の費用の合計額については、投資者がファンドを保有される
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。



投資リスク

ファンドの基準価額は、投資を行っている有価証券等の値動きによる影響を受けませんが、これらの運用による損益は全て投資者に帰属します。

したがって、ファンドは投資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。なお、ファンドは預貯金とは異なります。

ファンドの基準価額の変動要因となる主なリスクは次の通りです。

<p>価格変動リスク および 為替変動リスク</p>	<p>株式の価格は、発行企業の業績や財務状況、市場・経済の状況等を反映して変動します。投資対象である担保付円建債券の裏付となるスワップ取引では、株価に関連した参照指数を原資産としたプットオプションの売却（米国株式プレミアム戦略）を行い、オプション料（プレミアム）収入を受取る一方、約1週間における参照指数の価格が想定した率を超えて下落した場合は損失が発生しますので、基準価額が値下がりする要因となります。当戦略の日々の損益部分（米ドルベース）に対する日々の米ドル円の為替変動によっても評価額が変動します。</p>
<p>スワップ取引に伴うリスク</p>	<p>投資対象である担保付円建債券の裏付となるスワップ取引では、取引の相手方から担保を受取ることで信用リスクの低減を図りますが、相手方の倒産や契約不履行、スワップ価格の著しい下落等、その他不測の事態が生じた場合には運用の継続は困難となり将来の投資成果を享受することはできず、また、担保を処分する際に想定した価格で処分できない可能性があることから損失を被る場合があります。投資対象の担保付円建債券は、スワップ取引の相手方が現実に取引するオプション取引については、何らの権利も有しておりません。</p>

※基準価額の変動要因（リスク）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。
- 分配金に関する留意点
 - ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
 - ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
 - ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
- 大量の解約・換金申込を受付け短期間で解約資金を準備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、投資する有価証券の価格が下落し、基準価額が変動する要因となります。また、換金申込の受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

ご留意いただきたい事項

- 当資料はT&Dアセットマネジメントが投資家の皆様への情報提供を目的として作成したものであり、投資勧誘を目的としたものではありません。当資料に記載した情報は、当資料作成時点におけるものであり、将来の投資成果等を保証するものではありません。
- 投資信託はリスクを含む商品であり、株式および公社債等値動きのある有価証券（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、運用実績は市場環境等により変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。これら運用による損益は全て投資者に帰属します。
- 投資信託は預貯金や保険契約と異なり、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。また、登録金融機関でご購入いただいた場合、投資者保護基金の支払対象とはなりません。
- 購入のお申込みにあたっては、投資信託説明書（交付目論見書）をお渡ししますので、必ず内容をご確認の上、ご自身でご判断いただきますようお願いいたします。投資信託説明書（交付目論見書）は販売会社にてご入手いただけます。

★本件に関するお問い合わせ★

T&Dアセットマネジメント株式会社 投信営業部

電話番号：03-6722-4810（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

インターネットホームページ：<https://www.tdasasset.co.jp/>