

(為替ヘッジあり)(限定追加型)/(為替ヘッジなし)(限定追加型) 追加型投信/内外/その他資産(転換社債)

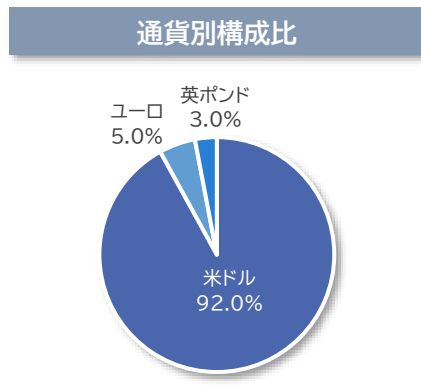
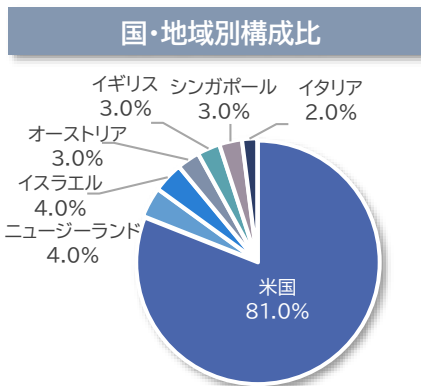
## 2023年9月27日時点のモデルポートフォリオの状況のご案内

以下は、当ファンド運用開始前の2023年9月22日時点において、当ファンドと同様の運用方針に基づき構築されたモデルポートフォリオを基に9月27日の市場データで集計したものです。

**実際のポートフォリオの状況を表すものではありません。**

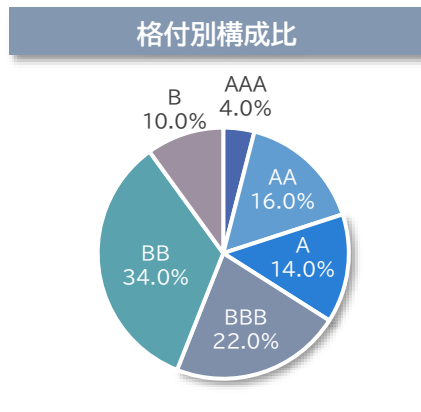
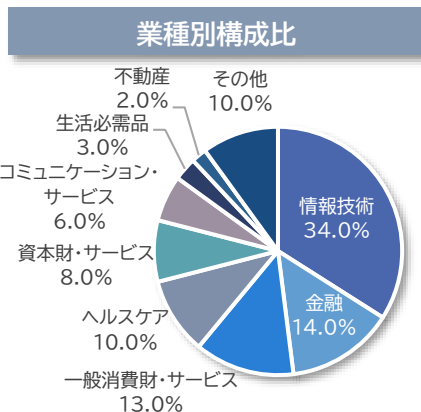
**また、当ファンドの将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。**

特性値	
構成銘柄数	33銘柄
平均格付	BBB
最終利回り	8.30%(*※)
平均残存年数	2.66年
株価連動率 (平均デルタ)	18.8%



### 株価連動率の水準別構成比率

株価連動率の水準	構成比率
25%未満	70.0%
25%以上～50%未満	28.0%
50%以上	2.0%



(\*※)組み入れたCBは、当ファンドの信託期間内に順次償還を迎えるため、上記の利回りは当ファンドを信託期間終了まで保有した場合の運用利回りを示すものではありません。その他モデルポートフォリオの特性値に関する補足事項等については、裏面をご確認ください。

※業種はGICS(世界産業分類基準)セクター分類です。 ※格付はアビバ・インバスターズによる自社格付です。(業種分類が不明なものは「その他」に分類しています) (詳細は裏面をご覧ください)

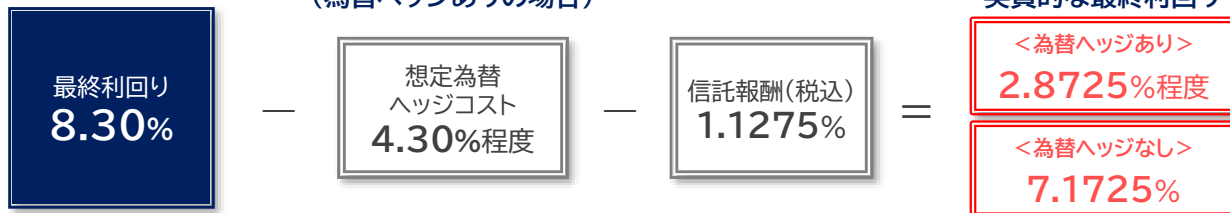
出所:ブルームバーグ、アビバ・インバスターズのデータを基に東京海上アセットマネジメント作成

## (ご参考) 各種コスト控除後の実質的な最終利回りのイメージ

※当ファンド運用開始前の2023年9月22日時点において当ファンドと同様の運用方針に基づき構築されたモデルポートフォリオの構成銘柄および投資比率を基に、9月27日の市場データで集計したものです。**実質的な最終利回りは、あくまでも参考情報のご提供を目的として作成したものであり、当ファンドの実際の実質的な最終利回りとは異なります。**

※当ファンドの購入時には購入時手数料がかかるほか、保有中は信託報酬に加えその他の費用・手数料がかかります。また、当ファンドの償還前に換金した場合には信託財産留保額がかかるほか、税金などがかかる場合があります。くわしくは裏面および投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

(為替ヘッジありの場合)



【想定為替ヘッジコストについて】

想定為替ヘッジコストは、2023年9月22日時点におけるモデルポートフォリオの構成銘柄の通貨(米ドル、ユーロ、英ポンド)について、同月27日時点における為替ブローカーによる対円為替予約取引の提示値を、通貨別構成比で加重平均した想定値です。実際のヘッジコストとは異なります。

**※実際の為替ヘッジコストは、当ファンドの設定後の資金動向等によって変動し、当初期待された水準とは異なる場合があります。**

## モデルポートフォリオについて

【平均格付および構成銘柄の格付について】●モデルポートフォリオの平均格付は、2023年9月22日時点の当該ポートフォリオにおける組入資産に関する信用格付(アビバ・インベスターズが独自に判断した自社格付であり、信用格付会社等による格付ではありません)を加重平均したものです。また、当該平均格付は、モデルポートフォリオ自体の信用格付ではありません。●アビバ・インベスターズによる自社格付の定義では、BBB格以上を投資適格と位置付けています。なお、当ファンドは信用格付が投資適格未満(BBB格相当未満)の銘柄にも投資を行います。●アビバ・インベスターズによる自社格付は、継続的に見直しを行っています。したがって、当ファンドの信託期間における組入資産に関する格付構成および平均格付の変更頻度は、信用格付会社等による格付の変更頻度と比較して相対的に高くなる可能性があります。

【利回りについて】利回りは、モデルポートフォリオを構成する各CBを株式に転換せず、償還日(プットオプション付きCBの場合はオプションの権利行使日)まで保有した場合の利回りを加重平均して算出しています。

※組み入れたCBは、当ファンドの信託期間内に順次償還を迎えるため、当資料に記載の利回りは当ファンドを信託期間終了まで保有した場合の運用利回りを示すものではありません。

【平均残存年数について】モデルポートフォリオを構成する各CBの残存年数を構成比率で加重平均したものです。プットオプション付きCBの場合はオプションの権利行使日を償還日として残存年数を算出しています。

【株価連動率(平均デルタ)について】モデルポートフォリオを構成する各CBの株価連動率(デルタ)を構成比率で加重平均したものです。

## 投資リスク

詳しくは「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

<基準価額の変動要因> ■投資する有価証券等の値動きにより基準価額は変動します。したがって、**投資元本は保証されているものではなく、投資元本を割り込むことがあります。**■**運用による損益は、全て投資者に帰属します。**■投資信託は**預貯金や保険と異なります。**■当ファンドの主なリスクには価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等があります。

<その他の留意点> ●ファンドは、原則として信託期間に合わせた期間固定の為替ヘッジを行います。為替ヘッジの取引相手の信用リスクが高まったと判断される場合等には、当該為替ヘッジ取引を解消し、改めて為替ヘッジ取引を行うことがあります。その場合、為替ヘッジにかかるコストが変動し、設定当初想定以上の水準になる可能性があります。●ファンドは信託期間内に償還を迎えるCB等に投資を行い、償還まで保有することを基本とします。信託期間中にファンドを換金した場合には、CB等を満期まで保有することにより定期的に受け取ることができる利子を受け取れないこと、額面を下回る価格で売却せざるを得ないことがあり、換金価額が投資元本を下回る場合があります。

## ファンドの費用

詳しくは「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

ファンドは限定追加型の投資信託です。購入のお申込みは、2023年10月20日までの間に限定して受け付けます。

※購入可能な期間については、投資信託説明書(交付目論見書)をご確認ください。

### 投資者が直接的に負担する費用(購入時・換金時)

購入時手数料 購入価額に**2.75%(税抜2.5%)**の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。  
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 換金申込受付日の翌営業日の基準価額の**0.5%**

### 投資者が信託財産で間接的に負担する費用(保有時)

運用管理費用(信託報酬) ファンドの純資産総額に対し、**年率1.1275%(税抜1.025%)**をかけた額

その他の費用・手数料  
以下の費用・手数料等がファンドから支払われます。  
●監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用 ファンドの純資産総額に年率0.011%(税込)をかけた額(上限年99万円)を日々計上し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了の時にファンドから支払われます。  
●組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料 ●資産を外国で保管する場合にかかる費用 ●信託事務等にかかる諸費用  
※監査にかかる費用を除く上記の費用・手数料等は、取引等により変動するため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

※上記の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、事前に表示することができません。

## 一般的な留意事項

●当資料は、東京海上アセットマネジメントが作成した販売補助資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。お申込みに当たっては必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。投資信託説明書(交付目論見書)は販売会社までご請求ください。●当資料の内容は作成日時時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。●当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成しておりますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。当資料に掲載された図表等の内容は、将来の運用成果や市場環境の変動等を示唆・保証するものではありません。●投資信託は、値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には、この他に為替変動リスクもあります)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。●投資信託は金融機関の預金とは異なり元本が保証されているものではありません。委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。●投資信託は、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。●投資信託は、預金および保険契約ではありません。また、預金保険や保険契約者保護機構の対象ではありません。●登録金融機関から購入した投資信託は投資者保護基金の補償対象ではありません。

【お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご確認ください。】【課税上は株式投資信託として取り扱われます。】

■お申込み、投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は



商号等：東洋証券株式会社  
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第121号  
加入協会：日本証券業協会  
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

■設定・運用は

東京海上アセットマネジメント株式会社

商号等：東京海上アセットマネジメント株式会社  
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第361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