

2022年3月7日

受益者の皆さまへ

キャピタル アセットマネジメント株式会社

オーケストラ ファンド（安定コース／成長コース）におけるウクライナ・ロシア情勢の影響（続報）

オーケストラ ファンド（安定コース／成長コース）における組入ファンドのロシア関連証券・通貨について、直近の保有状況をご報告いたします。

【保有状況】（2022年2月28日 現地引け値）

安定コースと成長コースで組入れています「ノムラ・ファンズ・アイルランド - グローバル・ダイナミック・ボンド・ファンド I JPY ヘッジクラス」にてロシア国債を2.5%程度（7銘柄、時価ベース）保有しています。

通貨（ルーブル）は、対米ドルにて概ねフル・ヘッジをかけています。ヘッジの取引相手は欧州の大手銀行との報告を野村アセットマネジメント株式会社（運用会社）より受けています。

なお両コースで組入れています「マン・アンブレラ・SICAV-マン・AH・アルファコア・オルタナティブ 日本円クラス（ヘッジ付）」では、以前ロシア関連証券・通貨を保有していましたが、現地2月28日現在では保有していないことを確認しました。

【影響度】（3月4日 現在）

- * 安定コース：純資産総額の0.6%程度。
- * 成長コース：純資産総額の0.4%程度。

【今後の対応】

助言会社である「しさん設計」とも協議を重ねた上、今後もリスク資産の保有状況や投資方針を確認しつつ、現状では組入ファンドの変更は行わず継続保有といたします。

今後ともオーケストラ ファンドをご愛顧いただけますよう、よろしくお願い申し上げます。

以上

<投資信託に関するご注意>

■ 投資信託に係わるリスクについて

投資信託は、主に国内外の株式や公社債等の値動きのある証券を投資対象としております。当該資産の市場における取引価格や為替レートの変動等により基準価額は影響を受けるため、損失が生じる可能性があります。したがって、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。

また、ファンドは預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではなく、信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。第一種金融商品取引業者以外の金融機関は投資者保護基金に加入しておりません。購入の申込みにあたりましては「投資信託説明書（交付目論見書）」を予めあるいは同時にお渡しますので、必ず内容をご確認いただき、ご自身でご判断ください。

■ 投資信託に係わる費用について

①お申込時に直接ご負担いただく費用 申込み手数料： 上限 3.3%(税抜 3.0%)

②ご解約時に直接ご負担いただく費用 信託財産留保額： 0.1%

③投資信託の保有期間中に間接的にご負担いただく費用

信託報酬： 年 1.375% (税抜き 1.25%)

投資対象とする投資信託証券： 年 0.825%~1.025%程度 (税込)

実質的な負担：年 2.2%~2.4%±0.2%程度 (税込)

※投資対象ファンドの実際の組入れ状況により変動します。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がかかる場合があります。

④その他費用

有価証券等の取引に伴う手数料（売買委託手数料、保管手数料等）、監査費用、
信託財産に関する租税、信託事務の処理等に要する諸費用等

※詳しくは各商品の「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

※リスクについては一般的な投資信託を想定しています。また、費用の料率等につきましては、キャピタル アセットマネジメントが運用する投資信託のうちでの上限や範囲を示しております。投資信託に係わるリスクや費用は商品ごとに異なりますので、ご投資をされる際には、事前に「投資信託 説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

<当資料に関するご注意>

■ 本資料におけるデータ・分析等は過去の実績に基づくものであり、将来の市場環境の変動等を保証、示唆するものではありません。

■ 本資料はキャピタル アセットマネジメント株式会社が、信頼性が高いと判断した情報等に基づいて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。

■ 本資料に記載されたキャピタル アセットマネジメント株式会社の見解や見通しは本資料作成時点のものであり、市場環境等の変化により、予告なく変更する場合があります。

キャピタル 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 383 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