

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）／（為替ヘッジなし）

追加型投信／内外／資産複合



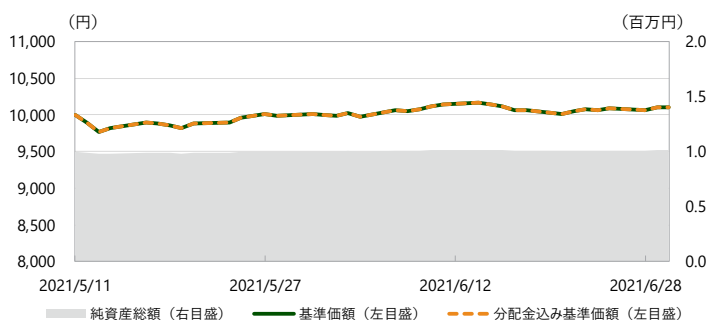
（為替ヘッジあり）

ファンド・データ

- 信託設定日 2021年5月11日
- 信託期間 2031年4月30日
- 決算日 3月、9月の各29日（休業日の場合は翌営業日）

基準価額	10,100 円
前月末基準価額	10,006 円
（月間騰落額）	（ 94 円）
純資産総額	1.0 百万円
マザーファンド組入比率	99.5 %
為替ヘッジ比率	99.0 %

基準価額・純資産総額の推移・収益率



ファンド

過去1ヵ月	0.9%
過去3ヵ月	-
過去6ヵ月	-
過去1年	-
過去3年	-
設定来	1.0%

※「基準価額」は信託報酬控除後のものです。信託報酬率は後記の「運用管理費用（信託報酬）」をご覧ください。
 ※「分配金込み基準価額」は、過去に支払われた分配金を非課税で再投資したものと計算しています。
 ※収益率は「分配金込み基準価額」より算出しており、実際の投資家利回りとは異なります。
 ※収益率は年率換算を行っていません。

分配金実績（課税前）※直近8期

-	-	設定来合計	0円
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		

※分配金は、1万口あたり。
 ※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、或いは分配金が支払われない場合があります。

基準価額の騰落要因分析

月間騰落額	94円
有価証券要因	109円
為替要因	-2円
信託報酬等	-13円
分配金	0円

※騰落要因分析は、委託会社独自の見解に基づいて試算した概算値であり、傾向を説明するための参考値です。
 ※各数値は四捨五入しているため、月間騰落額とは一致しない場合があります。

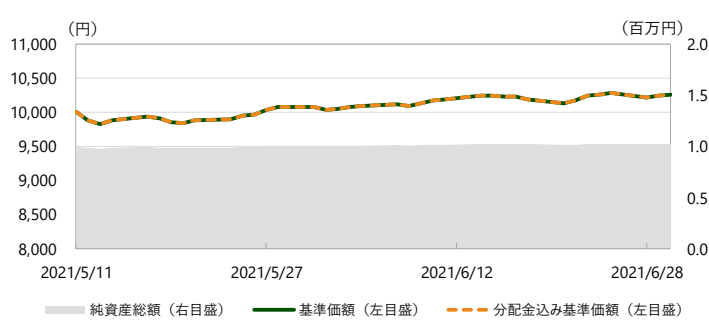
（為替ヘッジなし）

ファンド・データ

- 信託設定日 2021年5月11日
- 信託期間 2031年4月30日
- 決算日 3月、9月の各29日（休業日の場合は翌営業日）

基準価額	10,249 円
前月末基準価額	10,079 円
（月間騰落額）	（ 170 円）
純資産総額	1.0 百万円
マザーファンド組入比率	99.2 %
為替ヘッジ比率	- %

基準価額・純資産総額の推移・収益率



ファンド

過去1ヵ月	1.7%
過去3ヵ月	-
過去6ヵ月	-
過去1年	-
過去3年	-
設定来	2.5%

※「基準価額」は信託報酬控除後のものです。信託報酬率は後記の「運用管理費用（信託報酬）」をご覧ください。
 ※「分配金込み基準価額」は、過去に支払われた分配金を非課税で再投資したものと計算しています。
 ※収益率は「分配金込み基準価額」より算出しており、実際の投資家利回りとは異なります。
 ※収益率は年率換算を行っていません。

分配金実績（課税前）※直近8期

-	-	設定来合計	0円
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		
-	-		

※分配金は、1万口あたり。
 ※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、或いは分配金が支払われない場合があります。

基準価額の騰落要因分析

月間騰落額	170円
有価証券要因	109円
為替要因	74円
信託報酬等	-13円
分配金	0円

※騰落要因分析は、委託会社独自の見解に基づいて試算した概算値であり、傾向を説明するための参考値です。
 ※各数値は四捨五入しているため、月間騰落額とは一致しない場合があります。

■本資料はパインブリッジ・インベストメンツ株式会社によって作成された販売用資料です。お申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）等をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ずお受取のうえ内容を十分にお読みください。最終的な投資判断は、お客様ご自身でなさるようお願いいたします。■当ファンドの基準価額は、同ファンドに組入られている有価証券等の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆様に帰属します。したがって投資信託は預金と異なり、元本および利回りの保証はありません。■本資料の情報は信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について保証するものではありません。過去の実績に関する数値は、将来の運用成果等をお約束するものではありません。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客様が負います。■本資料は情報の提供を目的とするものであり、個別銘柄の売却、購入等の行為を推奨するものではありません。

パインブリッジ・デ일리・ミックス・オープン（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）
追加型投信／内外／資産複合



組入状況 ※データはマザーファンドの状況です。

資産構成

上場投信	60.0%
現金等	40.0%
合計	100.0%

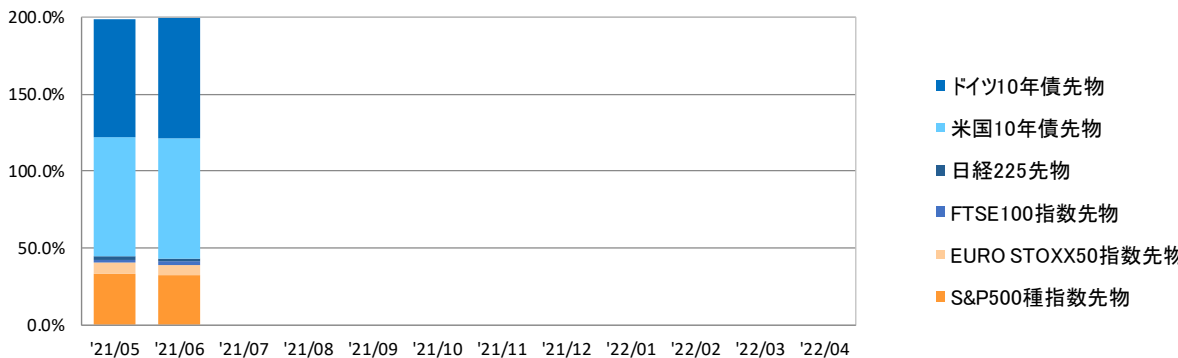
※ファンドの資産構成は約定ベースです。
※米国短期債に投資する上場投信を組み入れています。
※『現金等』は、未収利息等および先物評価損益を含んでいます。

資産配分割合

資産クラス	投資対象	配分割合	
		前月末	当月末
株式	米国 S&P500種指数先物	33.43%	32.50%
	欧州 EURO STOXX50指数先物	6.70%	6.55%
	英国 FTSE100指数先物	2.18%	2.14%
	日本 日経225先物	2.13%	2.12%
債券	米国 米国10年債先物	77.35%	78.23%
	欧州 ドイツ10年債先物	77.28%	77.80%
合計		199.07%	199.34%

※ファンドの配分割合は純資産総額に対する比率です。

資産配分割合の推移（設定日月末以降）



対象指数の騰落率

資産クラス	対象指数	騰落率（現地通貨ベース）			
		過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年
株式	米国 S&P500種指数	2.09%	-	-	-
	欧州 EURO STOXX50指数	0.91%	-	-	-
	英国 FTSE100指数	0.92%	-	-	-
	日本 日経平均株価	▲0.24%	-	-	-
債券	米国 バークレイズ・米国10年債先物指数	0.25%	-	-	-
	欧州 バークレイズ・ドイツ10年債先物指数	0.34%	-	-	-

■本資料はパインブリッジ・インベストメンツ株式会社によって作成された販売用資料です。お申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）等をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ずお受取のうえ内容を十分にお読みください。最終的な投資判断は、お客様ご自身でなさるようお願いいたします。■当ファンドの基準価額は、同ファンドに組入られている有価証券等の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆様へ帰属します。したがって投資信託は預金と異なり、元本および利回りの保証はありません。■本資料の情報は信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について保証するものではありません。過去の実績に関する数値は、将来の運用成果等をお約束するものではありません。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客様が負います。■本資料は情報の提供を目的とするものであり、個別銘柄の売却、購入等の行為を推奨するものではありません。

パインブリッジ・デ일리・ミックス・オープン（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）

追加型投信／内外／資産複合



運用状況のご報告

＜市場概況＞

株式市場は、前半は新型コロナウイルスのワクチン接種加速に伴う経済活動正常化期待等が好感されました。月半ばにはインフレ率や長期金利の上昇、変異ウイルスの感染拡大等が嫌気されましたが、下旬は主要国の経済指標改善や長期金利低下等を好感し再び上昇しました。債券市場は、月半ばに米国の早期利上げ観測の高まり等が嫌気されましたが、インフレ加速は一時的との見方の再燃や感染拡大に伴う一部地域での行動規制再強化等を受け再び上昇基調となりました。

＜運用状況＞

為替については、前月末対比で円安米国ドル高で推移しました。組入先物については、米国株、欧州株、英国株、欧州債券、米国債券がプラス寄与した一方、日本株がマイナス寄与となりました。当月のボラティリティは株式、債券ともに小幅に低下しました。こうした市場のボラティリティを受けて、配分比率の見直しを行なった結果、株式、債券への配分比率は前月末対比でほぼ横ばいとなりました。

＜今後の投資戦略＞

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）の買建てを行い信託財産の中長期的な成長を目指します。

■本資料はパインブリッジ・インベストメンツ株式会社によって作成された販売用資料です。お申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）等をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ずお受取のうえ内容を十分にお読みください。最終的な投資判断は、お客様ご自身でなさるようお願いいたします。■当ファンドの基準価額は、同ファンドに組入られている有価証券等の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆様へ帰属します。したがって投資信託は預金と異なり、元本および利回りの保証はありません。■本資料の情報は信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について保証するものではありません。過去の実績に関する数値は、将来の運用成果等をお約束するものではありません。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客様が負います。■本資料は情報の提供を目的とするものであり、個別銘柄の売却、購入等の行為を推奨するものではありません。

パインブリッジ・デ일리・ミックス・オープン（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）

追加型投信／内外／資産複合



ファンドの特色

1. 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数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。

2. 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。

3. 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。

4. 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。

5. 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。

6. 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い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。

リスクおよび留意点

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

当ファンドの主要投資対象である株価指数先物取引や債券先物取引の価格は、一般に、経済・社会情勢、株価変動、金利変動、市場の需給等の影響を受け変動します。組入資産の価格の下落は、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、当ファンドでは先物取引を活用し、レバレッジを利用した運用を行うため、先物取引の対象となる指数における比較的小さな値動きに対しても、大きな損失が発生する場合があります。

② 為替変動リスク

外貨建資産への投資には、為替変動リスクを伴います。一般に外国為替相場は、金利変動、政治・経済情勢、需給その他の様々な要因により変動します。この影響を受け外貨建資産の価格が変動し、基準価額が下落することがあります。当ファンドには、為替変動リスクを低減するため為替ヘッジを行う（為替ヘッジあり）と為替ヘッジを行わない（為替ヘッジなし）があり、それぞれの持つリスクが異なります。

・（為替ヘッジあり）：原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りますが、為替ヘッジを行うにあたり、ヘッジ対象通貨と円との金利差相当分のヘッジコストがかかります。金利差の縮小はヘッジコストの減少要因に、拡大はヘッジコストの増加要因になります。なお、ヘッジコストは需給要因等により変動することもあります。

・（為替ヘッジなし）：原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を直接的に受けます。

③ 金利変動リスク

当ファンドでは実質的に、債券先物取引や米国短期国債に投資を行いますが、金利変動により先物価格や債券価格は変動します。一般に、金利が上昇した場合には債券価格は下落し、基準価額を下落させる要因となります。

④ 信用リスク

有価証券等の発行体の財務状況や信用状況の悪化等の影響を受け、基準価額が下落することがあります。

■本資料はパインブリッジ・インベストメンツ株式会社によって作成された販売用資料です。お申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）等をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ずお受取のうえ内容を十分にお読みください。最終的な投資判断は、お客様ご自身でなさるようお願いいたします。■当ファンドの基準価額は、同ファンドに組入れられている有価証券等の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆様に帰属します。したがって投資信託は預金と異なり、元本および利回りの保証はありません。■本資料の情報は信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について保証するものではありません。過去の実績に関する数値は、将来の運用成果等をお約束するものではありません。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客様が負います。■本資料は情報の提供を目的とするものであり、個別銘柄の売却、購入等の行為を推奨するものではありません。

パインブリッジ・デ일리・ミックス・オープン（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）

追加型投信／内外／資産複合



⑤流動性リスク

有価証券等を売買しようとする場合に、需給状況等により、希望する時期および価格で売買できないリスクをいいます。この影響を受け、基準価額が下落することがあります。

⑥特定資産への集中投資リスク

当ファンドでは、株価指数先物取引や債券先物取引等に集中して投資するため、当該資産の価格変動の影響を大きく受けまます。したがって、幅広い業種に分散投資するファンドと比較して、基準価額の変動が大きくなる場合があります。

⑦デリバティブリスク

金融契約に基づくデリバティブとよばれる金融派生商品を用いることがあり、その価値は基礎となる原資産価値などに依存し、またそれらによって変動します。デリバティブ取引を利用して純資産規模を上回る取引を行う場合、デリバティブの価値は、種類によっては、基礎となる原資産の価値以上に変動することがあります。また、デリバティブ取引の相手方の債務不履行により損失が発生することがあり、この場合には基準価額が下落する要因となります。先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物価格の下落により損失が発生し、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割り込むことがあります。

⑧レバレッジリスク

当ファンドでは株価指数先物取引や債券先物取引等を積極的に用いてレバレッジ取引を行います。したがって、株式や債券等の価格変動の影響を大きく受け、基準価額の変動が大きくなることが想定されます。

⑨資産配分リスク

当ファンドでは、資産構成比率を調整します。固定比率で投資する場合と比較して、組入比率の調整は当ファンドの収益性を高める場合がある一方、収益率の低い資産への配分が比較的大きい場合もしくは収益率の高い資産への配分が比較的小さい場合、収益性を悪化させる場合もあります。

※収益分配金に関する留意点

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて行う場合があります。したがって、収益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唆するものではありません。また、投資者の個別元本の状況によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。なお、収益分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金の支払いは純資産総額の減少につながり、基準価額の下落要因となります。計算期間中の運用収益を超えて分配を行った場合、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。

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。

- ・S&P500種指数は、スタンダード・アンド・プアーズ社が公表している指数で、その知的財産権はスタンダード・アンド・プアーズ社およびその許諾者に帰属します。
- ・EURO STOXX50指数は、STOXX社が公表している指数で、その知的財産権はSTOXX社およびその許諾者に帰属します。
- ・FTSE100指数は、FTSE社が公表している指数で、その知的財産権はFTSE社およびその許諾者に帰属します。
- ・日経平均株価は、株式会社日本経済新聞社が公表している指数で、その知的財産権は株式会社日本経済新聞社に帰属します。
- ・パークレイズ・米国10年国債先物指数は、パークレイズ・バンク・ピーエルシーの投資銀行部門であるパークレイズ社が開発、算出、公表をおこなう指数であり、米国10年国債先物のパフォーマンスをあらわします。
- ・パークレイズ・ドイツ10年国債先物指数は、パークレイズ・バンク・ピーエルシーの投資銀行部門であるパークレイズ社が開発、算出、公表をおこなう指数であり、ドイツ10年国債先物のパフォーマンスをあらわします。当該インデックスに関する知的財産権およびその他の一切の権利はパークレイズ社に帰属します。

■本資料はパインブリッジ・インベストメンツ株式会社によって作成された販売用資料です。お申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）等をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ずお受取のうえ内容を十分にお読みください。最終的な投資判断は、お客様ご自身でなさるようお願いいたします。■当ファンドの基準価額は、同ファンドに組入られている有価証券等の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆様へ帰属します。したがって投資信託は預金と異なり、元本および利回りの保証はありません。■本資料の情報は信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について保証するものではありません。過去の実績に関する数値は、将来の運用成果等をお約束するものではありません。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客様が負います。■本資料は情報の提供を目的とするものであり、個別銘柄の売却、購入等の行為を推奨するものではありません。

パインブリッジ・デ일리・ミックス・オープン（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）

追加型投信／内外／資産複合



お申込みメモ

- 信託設定日 2021年5月11日
- 信託期間 2031年4月30日まで
- 購入単位 販売会社が定める単位
- 購入価額 購入申込受付日の翌営業日の基準価額
- 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5営業日目からお支払いします。
- 申込受付中止日 ロンドンまたはニューヨークの銀行休業日、あるいはロンドン証券取引所またはニューヨーク証券取引所の休業日のいずれかと同じ日付の場合
- 収益分配 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))に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配します。
ただし、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。
- 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および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。益金不算入制度・配当控除の適用はありません。

※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。

お客さまには以下の費用をご負担いただきます。

投資信託には、ご購入・ご換金時に直接ご負担いただく費用と信託財産から間接的にご負担いただく費用の合計額がかかります。

■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%(税抜年1.38%)を乗じて得た額とします。
- その他の費用・手数料: 有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の保管費用等が、その都度信託財産から支払われます。これらは運用状況等により変動するため、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が、信託財産の純資産総額の年率0.11%(税抜年0.1%)を上限として日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払われます。

※ファンドの費用の合計額については、保有期間など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。

投資信託に関する留意点

- 投資信託をご購入の際は投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください。投資信託説明書(交付目論見書)は、販売会社の本支店等にご用意しています。
- 投資信託は元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- 投資した資産価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客さまが負うことになります。
- 投資信託は預金ではありません。
- 投資信託は預金保険の対象ではありません。
- 証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。

委託会社、その他関係法人

- 委託会社: 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
- 受託会社: 三井住友信託銀行株式会社
- 販売会社: 三井住友信託銀行株式会社
登録金融機関 関東財務局長(登金)第649号
加入協会/日本証券業協会、一般社団法人日本投資顧問業協会、
一般社団法人金融先物取引業協会

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 [https:// www.pinebridge.co.jp/](https://www.pinebridge.co.jp/) TEL: 03-5208-5858(営業日の9:00~17:00)

■本資料はパインブリッジ・インベストメンツ株式会社によって作成された販売用資料です。お申込みの際には、投資信託説明書(交付目論見書)等をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ずお受取のうえ内容を十分にお読みください。最終的な投資判断は、お客様ご自身でなさるようお願いいたします。■当ファンドの基準価額は、同ファンドに組入れられている有価証券等の値動きの影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者の皆様に帰属します。したがって投資信託は預金と異なり、元本および利回りの保証はありません。■本資料の情報は信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について保証するものではありません。過去の実績に関する数値は、将来の運用成果等をお約束するものではありません。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客さまが負います。■本資料は情報の提供を目的とするものであり、個別銘柄の売却、購入等の行為を推奨するものではありません。