

受益者の皆様へ

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

弊社投資信託の基準価額下落について

9月28日のグローバル債券市場は、イングランド銀行(BOE)が長期国債を無制限に買い入れる市場介入を発表したことを背景に、英国を中心に世界的に債券利回りが大幅に低下(債券価格は上昇)しました。

これまでは米連邦公開市場委員会(FOMC)にて示されたインフレへの対峙姿勢により米連邦準備制度理事会(FRB)のタカ派的な姿勢の継続が確認されたほか、減税案を含む大型経済対策を受けた英国の財政悪化懸念が台頭しBOEによるインフレ加速に伴う大幅利上げ実施の可能性が意識されたこと等を背景として世界的に債券利回りは上昇基調で推移してきましたが、9月28日に反転し大幅低下しました。

このような環境下において、当ファンドでは8月末時点の投資対象国の長短金利差のランキングに応じて決定された国別配分投資比率に従い、英国や米国のショートポジションを構築しておりましたが、両国を中心に債券利回りが大幅に低下したことが影響し、基準価額は下落しました。

基準価額及び騰落率(前日比5%以上変動のファンド)

2022年9月29日基準

| ファンド名 | 基準価額 | 前営業日比 | 騰落率 |
|-----------------------------|--------|-------|--------|
| 国債ロング・ショート2.5戦略ファンド(年2回決算型) | 7,705円 | -431円 | -5.30% |

○本資料は金融商品取引法上及び投信法上の開示書類ではありません。

○本資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社が当ファンドの情報提供を目的として作成したものであり、投資の勧誘を目的とするものではありません。

○本資料中の過去の運用実績に関するグラフ・数値等は将来の成果をお約束するものではありません。また、市場概況等は本資料作成時点の弊社の見解であり、将来の動向や結果を保証するものではありません。

○本資料の内容は作成日現在のものであり、将来予告なく変更することがあります。

○本資料の著作権は当社にあります。外部第三者への開示、転載、複写などにつきましてはこれを固く禁じます。

Copyright 2022 State Street Corporation

Tracking Number : 3125483.4.1.APAC.RTL

Expiry Date : 12/31/2022

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

関東財務局長(金商)第345号

加入協会：一般社団法人日本投資顧問業協会、一般社団法人投資信託協会、日本証券業協会