

「世界株式・クオンツ・ロングショートファンド」の新規設定について

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社（所在地：東京都港区、代表取締役社長 兼 CEO：荻原亘、以下「当社」）は、11月21日に、追加型投信「世界株式・クオンツ・ロングショートファンド」（為替ヘッジなし/年1回決算型）／（為替ヘッジあり/年1回決算型）／（為替ヘッジなし/年4回決算型）／（為替ヘッジあり/年4回決算型）を新規設定しましたのでお知らせします。

■ 「世界株式・クオンツ・ロングショートファンド」の特色

1. 世界の先進国・地域の上場株式を対象としたロングショート運用を行います。
 - ・「ロングポジション」と「ショートポジション」における組入銘柄は、競争力・収益性、市場連動性等に着目して選定します。
 - ・「ロングポジション」と「ショートポジション」の構築においては、デリバティブ取引を活用します。
2. 世界の株式市場に対するポートフォリオの市場連動性を抑えつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。
 - ・「ロングポジション」と「ショートポジション」の合計（ネットポジション）における市場連動性が、世界の株式市場に対して半分程度となることを目指してポートフォリオを構築します。
 - ・「ロングポジション」と「ショートポジション」の総額（グロスポジション）が、最大で信託財産の純資産総額の7倍程度となる場合があります。
 - ・米ドル以外の通貨建ての資産等に投資する場合は、原則として、実質的に米ドル建てとなるように為替取引を行います。
3. 実質的な運用はクオンツ運用に強みのある AQR キャピタル・マネジメントが行います。
 - ・投資対象とする外国投資信託の運用は、AQR キャピタル・マネジメント、エルエルシーが行います。
4. 為替ヘッジなし/年1回決算型、為替ヘッジあり/年1回決算型、為替ヘッジなし/年4回決算型、為替ヘッジあり/年4回決算型の4つのファンドがあります。
※販売会社によってすべてのファンドを取り扱わない場合があります（詳しくは販売会社にお問い合わせください）。

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし/年1回決算型）の詳細はこちら

<https://www.smd-am.co.jp/fund/202002/>

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジあり/年1回決算型）の詳細はこちら

<https://www.smd-am.co.jp/fund/202102/>

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジなし/年4回決算型）の詳細はこちら

<https://www.smd-am.co.jp/fund/202202/>

世界株式・クオンツ・ロングショートファンド（為替ヘッジあり/年4回決算型）の詳細はこちら

<https://www.smd-am.co.jp/fund/202302/>

2025年11月21日

当社は引き続き、「Quality of Life に貢献する最高の資産運用会社へ。」という経営理念のもと、お客さまの資産形成に貢献してまいります。

重要な注意事項

- 当資料は、三井住友 DS アセットマネジメントが作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。当ファンド以外の特定の投資信託・生命保険・株式・債券等の売買等を推奨するものではありません。
- 当ファンドの取得のお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書（交付目論見書）および契約締結前交付書面等の内容をご確認の上、ご自身でご判断ください。投資信託説明書（交付目論見書）、契約締結前交付書面等は販売会社にご請求ください。また、当資料に投資信託の説明書（交付目論見書）と異なる内容が存在した場合は、最新の投資信託説明書（交付目論見書）が優先します。
- 当資料に基づいて取られた投資行動の結果については、当社は責任を負いません。
- 投資信託は、値動きのある証券（外国証券には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、リスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動します。したがって元本や利回りが保証されているものではありません。
- 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の場合、投資者保護基金の支払対象とはなりません。
- 当資料の内容は本資料作成日現在のものであり、将来予告なく変更されることがあります。
- 当資料は三井住友 DS アセットマネジメントが、信頼性が高いと判断した情報等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。

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

住所：〒105-6426 東京都港区虎ノ門 1-17-1 虎ノ門ヒルズビジネスタワー 26 階

HP：<https://www.smd-am.co.jp/>

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 399 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

【本件に関するお問い合わせ先】

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

サステナビリティ推進部 広報・ブランディングチーム E-Mail：pr@smd-am.co.jp

永澤（03-6205-1862）／三牧（03-6205-1735）／藤山（03-6205-0347）