# auAMレバレッジ・ハンセン・中国ファンド（円コース）

追加型投信/海外/株式/特殊型（ブル・ベア型）

設定日：2025年8月22日

au アセットマネジメント

月次レポート
2026年9月末時点

当資料の内容は過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

## ファンドの運用実績

### 基準価額推移

設定日（'25/8/22）～'26/9末

※「基準価額」は信託報酬控除後のものです。信託報酬は後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

※ 参考指数は、2025年8月22日のHang Seng Index (Net Total Return Index)を10,000として指数化したものです。参考のため掲載しております。

※「分配金再投資基準価額」は、分配が行われた場合に、当該分配金（税引前）を決算日にファンドへ再投資したものとして計算しています。なお、分配金実績がない場合の「分配金再投資基準価額」は、「基準価額」と同一となります。

### ファンドの現況

| | '26年9月末 | 前月末 | 前月末比 |
|---|---|---|---|
| 基準価額 | 8,904円 | 9,794円 | -890円 |
| 純資産総額＊ | 0.1億円 | 0.1億円 | -0.0億円 |

＊四捨五入の関係で金額が一致しない場合があります。

### ファンドの騰落率

| 期間 | 騰落率 |
|---|---|
| 1ヵ月 | -9.1% |
| 3ヵ月 | 11.4% |
| 6ヵ月 | -5.0% |
| 1年 | -20.7% |
| 3年 | - |
| 5年 | - |
| 10年 | - |
| 設定来 | -11.0% |

※ファンドの騰落率は分配金再投資基準価額を元に計算しています。騰落率は実際の投資家利回りとは異なります。

### 分配金の実績

| 決算期(年/月) | 分配金 |
|---|---|
| 第1期('26/8) | 0円 |
| 第2期('27/8) | - |
| 第3期('28/8) | - |
| 第4期('29/8) | - |
| 第5期('30/8) | - |
| 第6期('31/8) | - |
| 設定来 | - |

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。
あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

### 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。小数点第2位を四捨五入して表示しています。

| 主な組入資産 | 比率 |
|---|---|
| auAM レバレッジ・ハンセン・中国マザーファンド | 96.1% |
| コール・ローンなど | 3.9% |

| 主な組入資産（マザーファンド） | |
|---|---|
| 株価指数先物 / HANG SENG IDX FUT | 217.7% |
| コール・ローン、差入委託証拠金など | 100.0% |
| 為替予約 / 香港ドル | 10.7% |

# ファンドの目的と特色

## ファンドの目的

auAMレバレッジ・ハンセン・中国マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を高位に組み入れることにより、純資産総額の2倍程度のハンセン指数先物を買い建てるとともに、為替変動リスクを低減するために為替予約取引等により為替ヘッジを行います。これにより、純資産総額の2倍程度のハンセン指数のリターン獲得を目指して運用を行います。

## ファンドの特色

ハンセン指数先物（香港ドル建て）を活用して日々のレバレッジが2倍程度となるように運用を行います。また、為替変動リスクを低減するため為替予約取引等により為替ヘッジを行います。

## ハンセン指数について

ハンセン指数とは、香港証券取引所に上場している50社以上の株式で構成される株価指数です。指数の計算方法は時価総額加重平均方式です。ハンセン・データ・サービシズ・リミテッドからのライセンスに基づき、ハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドが公表・算出しています。

ハンセン指数は、ハンセン・データ・サービシズ・リミテッド(Hang Seng Data Services Limited:以下"HSDS")からのライセンスに基づき、ハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッド(Hang Seng Indexes Company Limited:以下"HSIL")が公表・算出しています。ハンセン指数の名称および標章は、HSDSの所有物です。

HSILおよびHSDSは、auアセットマネジメント株式会社が、auAMレバレッジ・ハンセン・中国ファンド(香港ドルコース)／auAMレバレッジ・ハンセン・中国ファンド(円コース)(以下"当ファンド")に関連して、ハンセン指数を使用および参照することを許諾しています。ただし、HSILおよびHSDSは、ハンセン指数やその算出方法、および関連情報の正確性または完全性、ハンセン指数またはその構成銘柄またはデータ等の特定目的への適合性および適切性、いかなる目的のためであれ、ハンセン指数またはその構成銘柄またはデータの使用により得られる結果について、いかなる保証も表明も行いません。またこれらに関して、いかなる黙示的な保証も認められません。

ハンセン指数の算出方法、その関連する算出式、構成銘柄、ファクター等は、HSILが事前の通知なく変更または修正する場合があります。適用法令の許容する限りにおいて、HSILおよびHSDSは、auアセットマネジメント株式会社が当ファンドに関連して、ハンセン指数を使用または参照すること、HSILによるハンセン指数の算出に関する不正確性、記載漏れ、不完全性、ハンセン指数の算出に使用される第三者提供情報の不正確性、記載漏れ、不完全性、これらに起因して当ファンドの販売会社、投資家、その他関係者が直接的または間接的に被る経済的その他の損失について、一切の責任を負いません。また、当ファンドの販売会社、投資家、その他関係者は、これらに関連してHSILおよびHSDSに対して、いかなる請求、訴訟または法的手続きも提起することはできません。したがって、当ファンドの販売会社、投資家、その他関係者は、本ディスクレーマーを十分理解した上で当ファンドを取り扱い、HSILおよびHSDSに一切依拠してはなりません。なお本ディスクレーマーは、いかなる販売会社、投資家、その他関係者との契約または準契約関係を生じさせるものではなく、そのように解釈されることもありません。

## 追加的記載事項

日々の基準価額の値動きは、ハンセン指数先物（香港ドル建て）の日々の値動きの2倍程度となることを目指しますが、主として次のような要因があるため、目標とする投資成果を達成することを運用上お約束できるものではありません。

- 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- 株価指数先物売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する終値の不一致
- 株価指数先物取引のロールオーバーに伴う限月間の価格差
- 各種取引の最低取引単位の影響
- 各種取引の流動性低下時における売買対応の影響

## 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。）

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割り込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。

### 基準価額の主な変動要因

※変動要因は下記に限定されるものではありません。

- 株価指数先物取引の利用に伴うリスク
- 価格変動リスク・信用リスク（先物の価格変動・公社債の価格変動・信用リスク）
- 為替変動リスク
- カントリー・リスク
- その他（解約申込みに伴うリスク等）
- 当ファンドの戦略に関するリスク

### その他の留意点

・当ファンドのお取引に関しては、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。

・流動性リスクに関する事項
当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、 一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

・当ファンドは、マザーファンドを通じてレバレッジ運用を行なうにあたり先物取引を利用するため、借入金利に相当する負担があります。そのため、長期に保有する場合、金利負担が累積されます。

・この商品は、レバレッジ倍率に比した高リスク商品であり、初心者向けの商品ではありません。
同種の商品に対する知識や投資経験があり、もしくは説明を受け商品性をご理解いただける投資家を主に念頭において組成しています。長期に保有する場合、対象資産の値動きに比べて基準価額が大幅に値下がりすることがあるため、そのことについてご理解いただける方に適しています。
最も適している想定顧客層は、積極性重視を投資目的とした、資産形成層（40代以下）およびシニア層（50代、60代、70代）で、余裕資金がある方を想定しています。

## 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。）

### 投資者が直接的に負担する費用

| | 料率等 | 費用の内容 |
|---|---|---|
| 購入時手数料 | 2.2%（税抜2.0%）を上限として販売会社が別に定める率 | 購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、事務手続き等の対価です。 |
| 信託財産留保額 | ありません。 | - |

### 投資者が直接的に負担する費用

| | 料率等 | 費用の内容 |
|---|---|---|
| 運用管理費用（信託報酬） | 純資産総額に対して年率0.4334%（税抜0.394%）を乗じて得た額とします。 | |
| 委託会社 | 年率0.2332%（税抜0.212%） | ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価です。 |
| 販売会社 | 年率0.1782%（税抜0.162%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価です。 |
| 受託会社 | 年率0.022%（税抜0.02%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価です。 |
| その他の費用・手数料 | 監査報酬、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費用等を信託財産でご負担いただきます。<br>なお、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ができません。 | |

※購入時手数料等については、詳しくは販売会社にお問合せください。
※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、表示することができません。
※詳しくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「手続・手数料等」をご覧ください。

## お申し込みメモ（詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。）

| | |
|---|---|
| 購入単位 | 最低単位を1円単位または1口単位として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（1万口当たり） |
| 換金単位 | 最低単位を1口単位として販売会社が定める単位 |
| 換金価額 | 換金申込受付日の翌営業日の基準価額（1万口当たり） |
| 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 | 以下のいずれかに該当する日には、購入・換金のお申込みの受付を行いません。<br>①香港証券取引所の休業日<br>②「委託者の休業日かつ香港証券取引所が休業日でない日」の前営業日<br>③上記①②の他、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託者が定める日 |
| 信託期間 | 無期限（2025年８月22日設定） |
| 決算日 | 毎年８月21日（休業日の場合は翌営業日） |

## 当資料のご利用にあたっての注意事項等

●当資料は、auアセットマネジメント株式会社がファンドの運用状況等をお知らせするために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。ファンドの取得の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）の内容を必ずご確認の上、ご自身でご判断ください。●投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割り込むことがあります。●信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。●投資信託は預貯金とは異なります。●投資信託は、預金や保険契約と異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護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とはなりません。●当資料の記載内容は過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。●当資料は、税金、手数料等を考慮しておりませんので、投資者の実質的な投資成果を示すものではありません。●当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。●当資料中に示された情報等は、基準日時点のものであり、事前の連絡なしに変更されることがあります。●分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。●当資料の写真やイラストはイメージとして掲載するものです。●ファンド名称のauAMはauアセットマネジメントの略称です。

## 委託会社、その他の関係法人の概要

### 委託会社（ファンドの運用の指図を行う者）

au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3062号
加入協会：一般社団法人資産運用業協会

### 受託会社（ファンドの財産の保管および管理を行う者）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
＜再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社＞

### 販売会社（募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求受付ならびに収益分配金、償還金および一部解約代金の支払い等を行う者）

下記の販売会社一覧をご覧ください。

販売会社一覧

| 商号（50音順） | 登録番号 | 加入協会 ① | ② | ③ | ④ |
|---|---|---|---|---|---|
| 株式会社イオン銀行（委託金融証券取引業者 マネックス証券株式会社） | 関東財務局長（登金）第633号 | ○ | | | |
| 株式会社SBI証券 | 関東財務局長（金商）第44号 | ○ | | ○ | ○ |
| 株式会社SBI新生銀行（委託金融証券取引業者 マネックス証券株式会社） | 関東財務局長（登金）第10号 | ○ | | ○ | |
| 松井証券株式会社 | 関東財務局長（金商）第164号 | ○ | | ○ | |
| マネックス証券株式会社 | 関東財務局長（金商）第165号 | ○ | ○ | ○ | ○ |
| 楽天証券株式会社 | 関東財務局長（金商）第195号 | ○ | ○ | ○ | ○ |

①日本証券業協会
②一般社団法人資産運用業協会
③一般社団法人金融先物取引業協会
④一般社団法人第二種金融商品取引業協会