

# グローバル変動金利債券ファンド (愛称：ヘンリー) ＜ 円ヘッジありコース ＞

## 【 基準価額の変動要因分析 】

グローバル変動金利債券ファンド (円ヘッジありコース)	設定来 寄与度(円)	当月 寄与度(円)
変動金利債	+706	+16
うち利回り	+679	+13
うち価格変化等	+26	+3
固定金利債	+790	+26
うち利回り	+666	+6
うち価格変化等	+124	+20
為替ヘッジ コスト/プレミアム	▲584	▲15
信託報酬	▲444	▲5
その他	▲30	+1
基準価額の変動幅	+437	+24

変動金利債 うち利回り・・・変動金利債のクーポン収入などです。

変動金利債 うち価格変化等・・・変動金利債の債券価格変化等によるものです。変動金利債では金利の変動が主にクーポンで調整されるため、価格変化による影響は固定金利債と比較して小さい傾向があります。

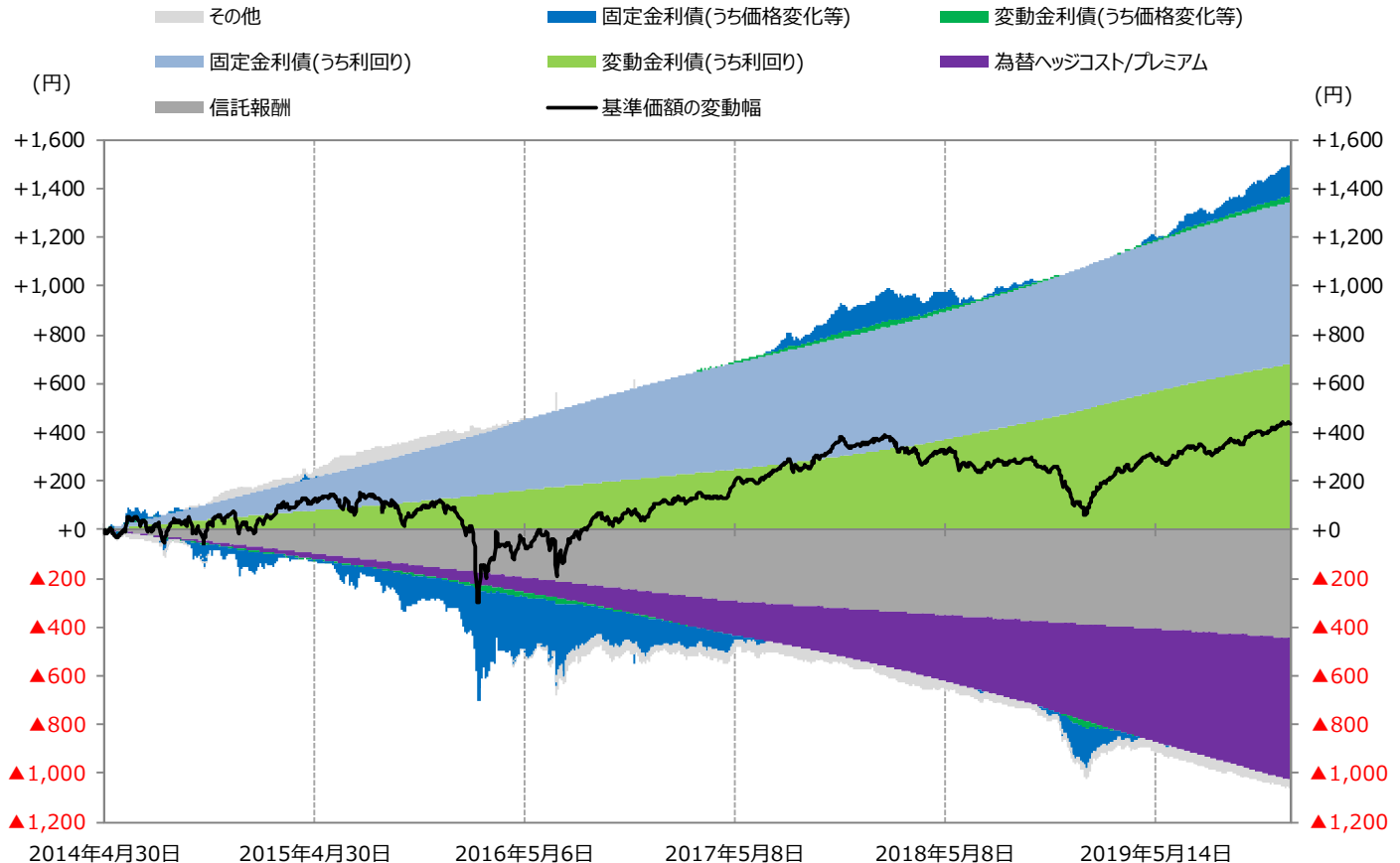
固定金利債 うち利回り・・・固定金利債のクーポン収入などです。

固定金利債 うち価格変化等・・・固定金利債の債券価格変化等によるものです。固定金利債では金利の変動が主に債券価格で調整されるため、価格変化による影響は変動金利債と比較して大きい傾向があります。

為替ヘッジコスト/プレミアム・・・為替ヘッジに伴うコスト/プレミアムです。現在は全体でコスト要因になっています。

信託報酬・・・現在は年率0.561%(税込)を日割りでご負担頂いています。

## 【 基準価額の変動要因分析：グローバル変動金利債券ファンド(円ヘッジありコース) 】



・出所： Bloomberg等より作成

・期間： 2014年4月30日 ～ 2019年12月30日

※当資料の変動要因分析値は簡便法に基づく概算値であり、実際の基準価額の変動要因を正確に説明するものではありません。あくまで傾向を知るための参考値としてご覧ください。また、計算式や分類等は過去に遡って予告なく変更される場合があります。

※表示桁未満の四捨五入等の関係で各寄与度の数値の合計が変動幅の数値と合わないことがあります。

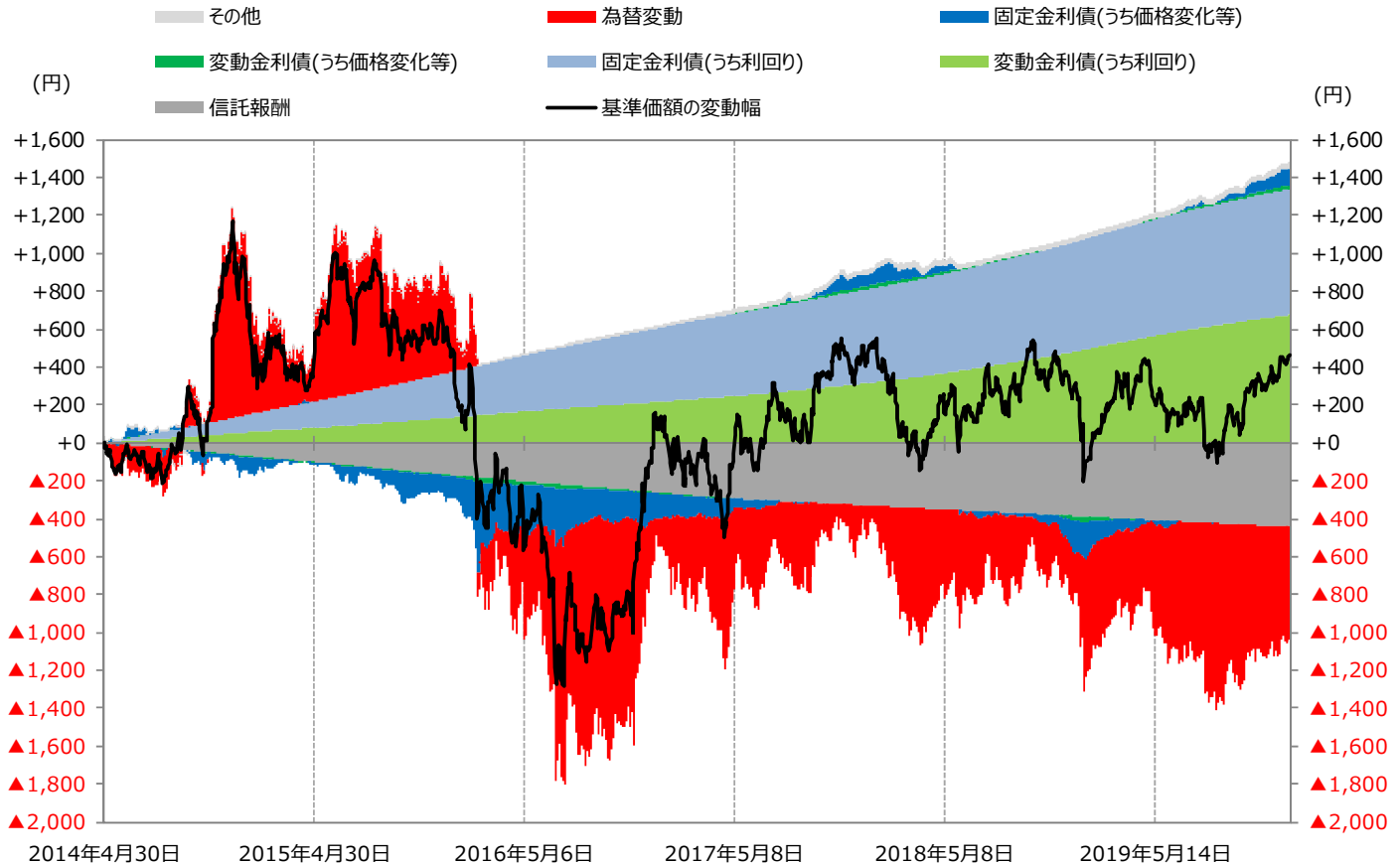
※過去のデータに基づいて作成したものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

# グローバル変動金利債券ファンド (愛称：ヘンリー) ＜ 円ヘッジなしコース ＞

## 【 基準価額の変動要因分析 】

グローバル変動金利債券ファンド (円ヘッジなしコース)	設定来 寄与度(円)	当月 寄与度(円)	
変動金利債	+699	+16	変動金利債 うち利回り・・・変動金利債のクーポン収入などです。
うち利回り	+676	+13	変動金利債 うち価格変化等・・・変動金利債の債券価格変化等によるものです。変動金利債では金利の変動が主にクーポンで調整されるため、価格変化による影響は固定金利債と比較して小さい傾向があります。
うち価格変化等	+23	+3	
固定金利債	+752	+26	固定金利債 うち利回り・・・固定金利債のクーポン収入などです。
うち利回り	+664	+6	固定金利債 うち価格変化等・・・固定金利債の債券価格変化等によるものです。固定金利債では金利の変動が主に債券価格で調整されるため、価格変化による影響は変動金利債と比較して大きい傾向があります。
うち価格変化等	+88	+20	
為替変動	▲569	+43	為替変動・・・為替変動によるものです(円安がプラス要因、円高がマイナス要因となります)。
信託報酬	▲444	▲5	信託報酬・・・現在は年率0.561%(税込)を日割りでご負担頂いています。
その他	+28	▲1	
基準価額の変動幅	+466	+80	

## 【 基準価額の変動要因分析：グローバル変動金利債券ファンド(円ヘッジなしコース) 】



・出所： Bloomberg等より作成

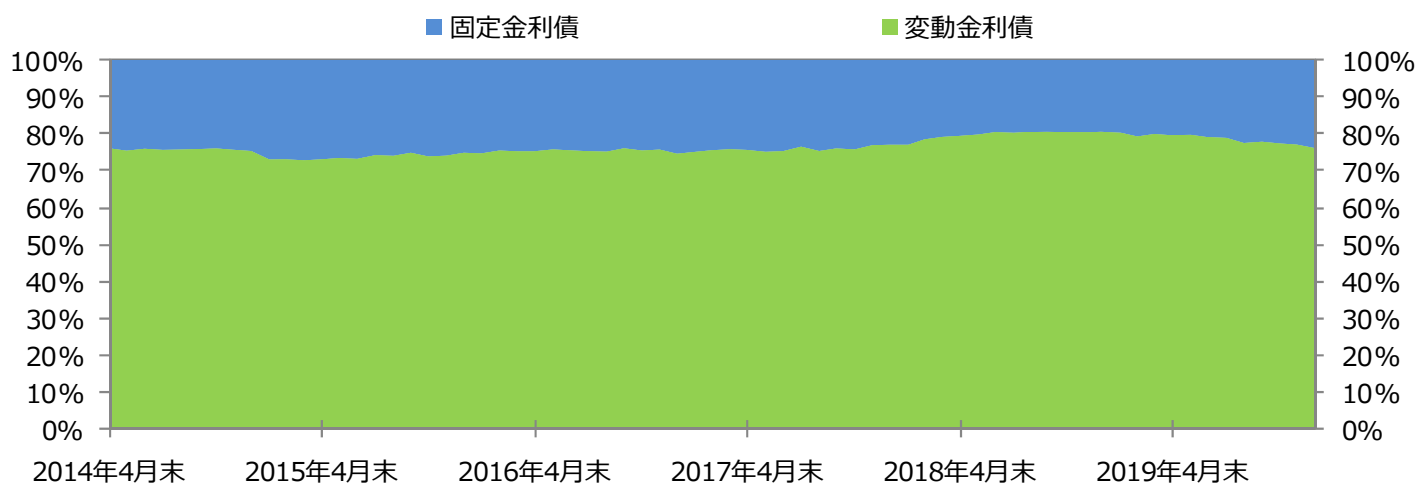
・期間： 2014年4月30日 ～ 2019年12月30日

※当資料の変動要因分析値は簡便法に基づく概算値であり、実際の基準価額の変動要因を正確に説明するものではありません。あくまで傾向を知るための参考値としてご覧ください。また、計算式や分類等は過去に遡って予告なく変更される場合があります。

※表示桁未満の四捨五入等の関係で各寄与度の数値の合計が変動幅の数値と合わないことがあります。

※過去のデータに基づいて作成したものであり、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。

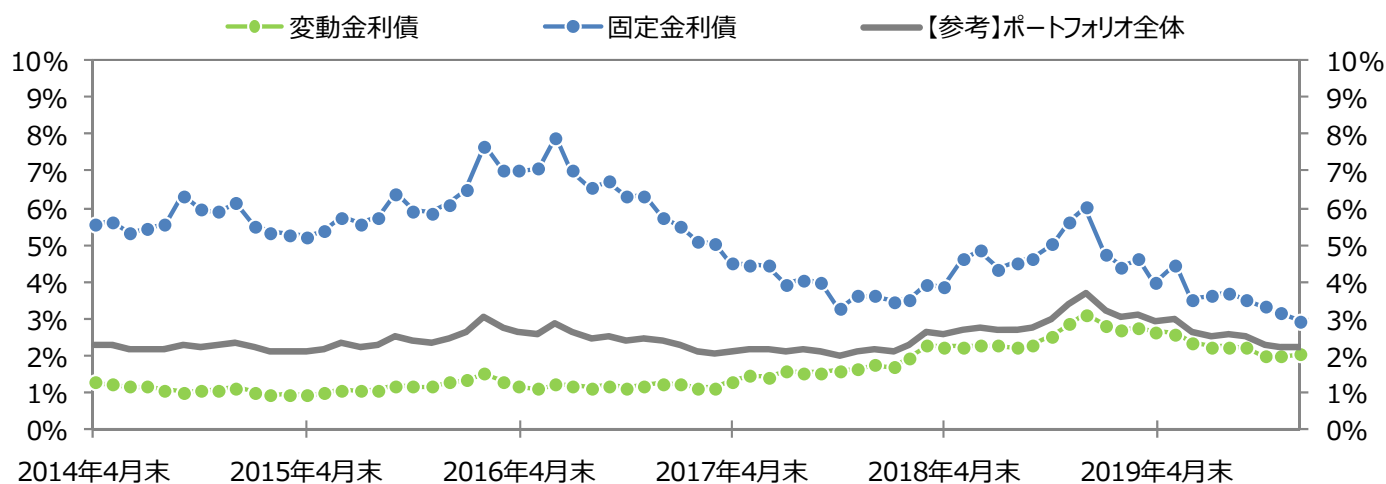
【 保有比率の推移 】



・期間：2014年4月末 ～ 2019年12月末

※組み入れマザーファンドベースです。マザーファンドのキャッシュ等を控除して計算しているため、月報の数字とは異なります。

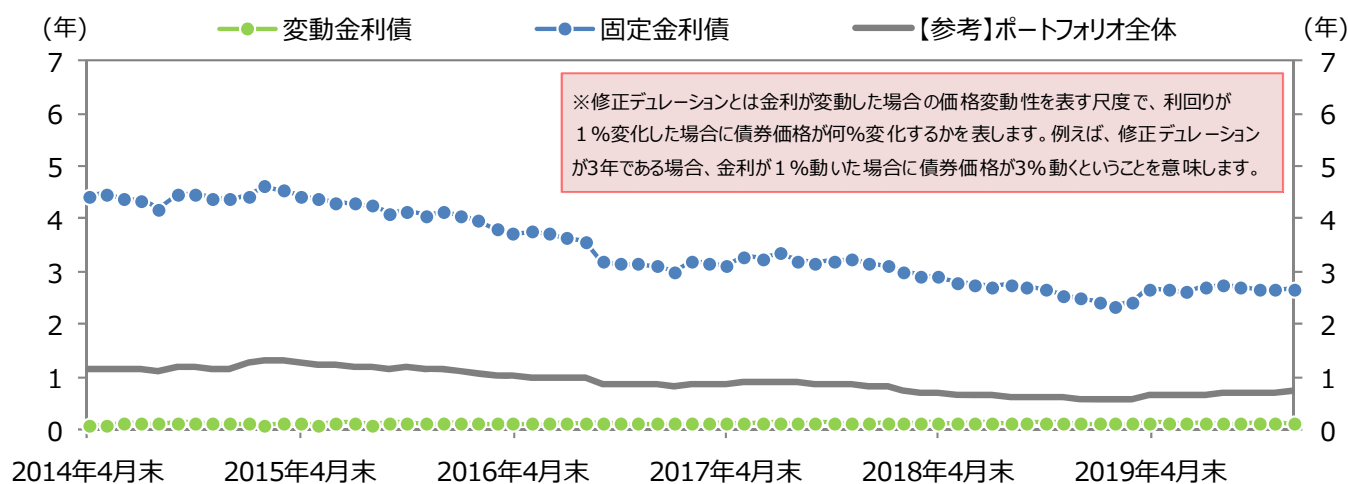
【 平均最終利回りの推移 】



・期間：2014年4月末 ～ 2019年12月末

※組み入れマザーファンドベースです。

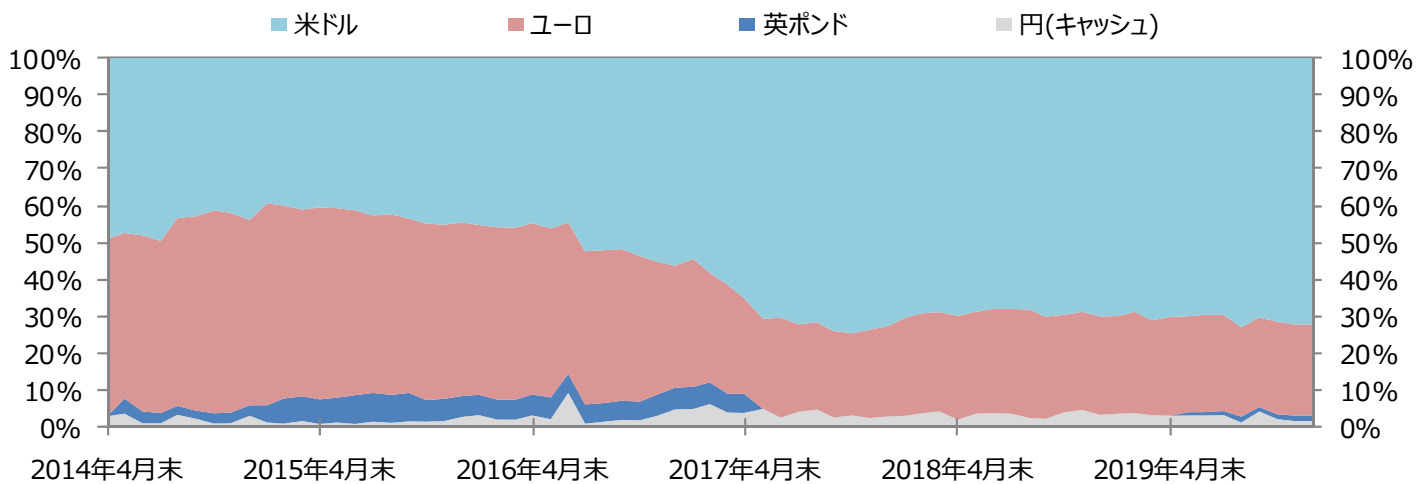
【 修正デュレーションの推移 】



・期間：2014年4月末 ～ 2019年12月末

※組み入れマザーファンドベースです。

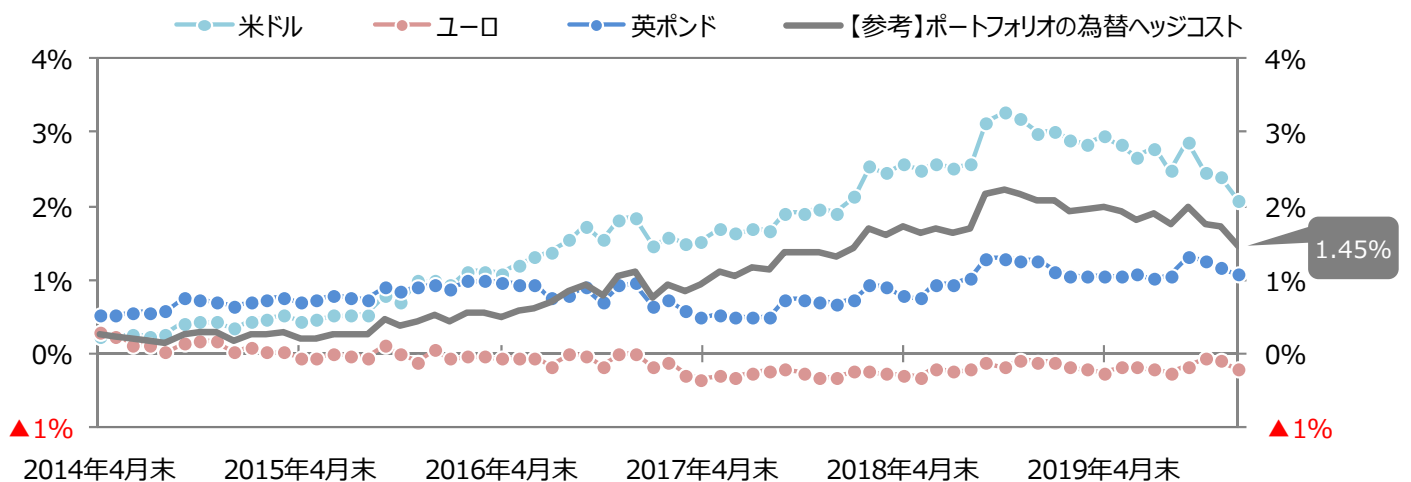
【 通貨別保有比率の推移 】



・期間：2014年4月末 ～ 2019年12月末

※組み入れマザーファンドベースです。直近月末の比率は速報値であるため、月報と異なる場合があります。

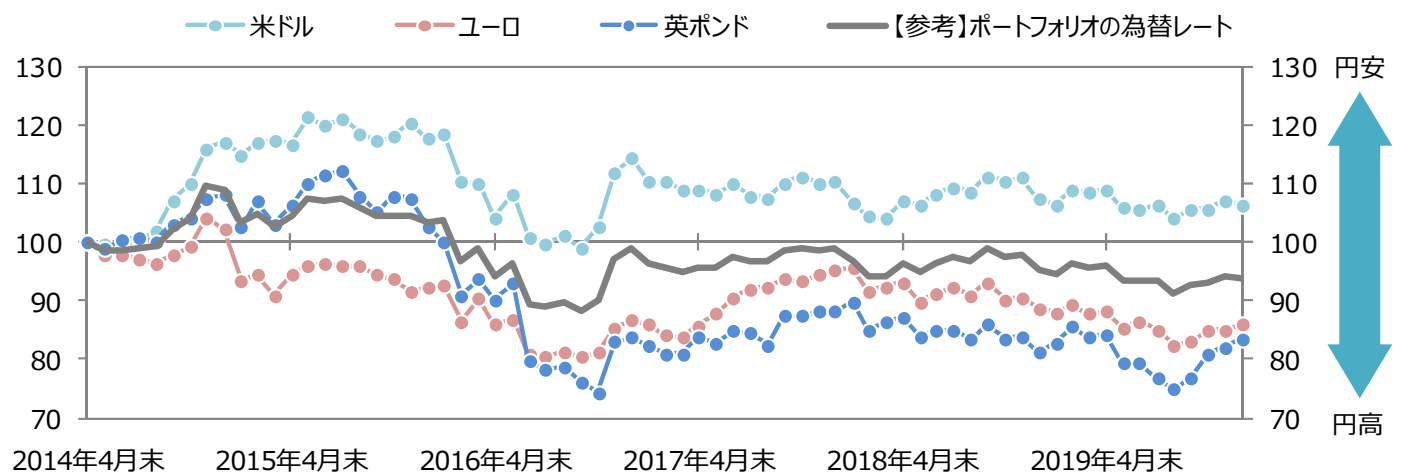
【 為替ヘッジコスト(年率)の推移 】



・期間：2014年4月末 ～ 2019年12月末

※直近月末のポートフォリオの為替ヘッジコストは速報値ベースです。ヘッジコストは3ヶ月フォワードレートなどに基づいて算出しています。

【 対円為替レートの推移 】



・期間：2014年4月末 ～ 2019年12月末

※2014年4月末 = 100として指数化しています。直近月末のポートフォリオの為替レートは速報値ベースです。

※上記は当資料作成時点での情報を基に作成した速報値ベースの実績です。将来の運用成果を保証するものではありません。

## ファンドの主なリスクと留意点 くわしくは、投資信託説明書(交付目論見書)にて必ずご確認ください。

### [ 基準価額の変動要因 ]

各ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動き等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様へ帰属いたします。したがって、投資者の皆様の投資元本は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。また、投資信託は預貯金とは異なります。

各ファンドの主なリスクは以下の通りです。 ※基準価額の変動要因は、以下に限定されるものではありません。

#### 価格変動リスク

公社債の価格は、国内外の政治・経済情勢、金融政策等の影響を受けて変動します。一般に、変動金利債券の場合は、金利上昇や金利低下にかかわらず、価格が安定して推移する傾向があります(固定金利債券は、金利上昇時に価格が下落し、金利低下時には価格は上昇します)。組入れている公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、元利金の弁済順位が低い社債(劣後債、優先出資証券等)については、発行体の経営状況等が著しく悪化した場合、基準価額が一般の社債よりも大きく下落する可能性があります。

なお、エマージング債券については、政治・経済情勢、制度変更等の影響を受けやすく、流動性が低いこと等から、価格がより大きく変動することがあります。

#### 信用リスク

公社債の価格は、発行体の財務状態、経営、業績等の悪化およびそれらに関する外部評価の悪化等により下落することがあります。組入れている公社債の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、発行体の倒産や債務不履行等の場合は、公社債の価値がなくなることもあり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

#### 流動性リスク

国内外の政治・経済情勢の急変、天災地変、発行体の財務状態の悪化等により、有価証券等の取引量が減少することがあります。この場合、ファンドにとって最適な時期や価格で、有価証券等を売買できないことがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、取引量の著しい減少や取引停止の場合には、有価証券等の売買ができなかったり、想定外に不利な価格での売買となり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

#### 為替変動リスク

##### 円ヘッジありコース

原則として、外貨建資産に対して、為替ヘッジを行います。全ての為替変動リスクを排除できるものではありません。また円金利よりも金利水準の高い通貨の為替ヘッジを行った場合、金利差に相当するヘッジコストが発生し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

##### 円ヘッジなしコース

外貨建資産の価格は、当該外貨と日本円との間の為替レートの変動の影響を受けて変動します。為替レートは、各国の政治・経済情勢、外国為替市場の需給、金利変動その他の要因により、短期間に大幅に変動することがあります。当該外貨の為替レートが、円高になった場合は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

### [ その他の留意点 ]

- ◆ クーリングオフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用はありません。
- ◆ 収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。収益分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、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。また、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すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、収益分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、収益分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。
- ◆ マザーファンドに投資する別のベビーファンドの追加設定・解約等により、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を受ける場合があります。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## お申込みメモ

## いちよし証券でお申込みの場合

購入単位	1万円以上1円単位(分配金受取コース)
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額
換金単位	1円単位
換金価額	換金請求受付日の翌営業日の基準価額
換金代金	換金請求受付日から起算して、原則として6営業日目からお支払いします。
申込不可日	ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、お申込みを受付けません。
信託期間	2024年4月19日まで(設定日 2014年4月30日) ※委託会社は、信託約款の規定に基づき、信託期間を延長することができます。
決算日	原則、4月20日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	毎決算時(年1回)、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。 ※分配金を受取る一般コースと、分配金を再投資する自動けいぞく投資コースがあります。販売会社によっては、どちらか一方のみのお取扱いとなる場合があります。各コースのお取扱いにつきましては、販売会社までお問い合わせください。 ※分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
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「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(ニーサ)」の適用対象です。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

その他の項目につきましては、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

## お客さまにご負担いただく手数料等について

## いちよし証券でお申込みの場合

くわしくは、投資信託説明書(交付目論見書)にて必ずご確認ください。

購入時手数料	お申込金額(手数料・税込)に応じて以下に定める手数料率を購入金額に乘じた金額となります。 1億円未満: <b>0.54%*1(税抜0.50%)</b> 1億円以上: <b>0.27%*2(税抜0.25%)</b> *消費税率が10%になった場合は、*1が0.55%、*2が0.275%となります。
信託財産留保額	ありません。
運用管理費用(信託報酬)	各ファンドの日々の純資産総額に対して <b>年率0.5508%*(税抜0.51%)</b> を乗じた額です。 運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、各ファンドから支払われます。 *消費税率が10%になった場合は、0.561%となります。
その他の費用・手数料	以下の費用・手数料等が、ファンドから支払われます。 ・監査費用 ・売買委託手数料 ・外国における資産の保管等に要する費用 ・信託財産に関する租税等 ※上記の費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

当該手数料等の合計額については、投資者の皆さまがファンドを保有される期間、売買金額等に応じて異なりますので、表示することができません。

## ファンドの委託会社およびその他関係法人の概況

委託会社	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者(登録番号:関東財務局長(金商)第351号)であり、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に加入しています。 信託財産の運用指図等を行います。 電話:0120-69-5432(受付時間:営業日の午前9時から午後5時) ホームページ・アドレス: <a href="https://www.sjnk-am.co.jp/">https://www.sjnk-am.co.jp/</a>
受託会社	みずほ信託銀行株式会社(再信託受託会社:資産管理サービス信託銀行株式会社) 信託財産の保管・管理等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
販売会社	いちよし証券株式会社 受益権の募集の取扱、販売、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金の再投資ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払等を行います。投資信託説明書(交付目論見書)の提供は、販売会社において行います。

## グローバル変動金利債券ファンド円ヘッジあり・円ヘッジなしコース（愛称 ヘンリー）

■ 販売会社（順不同、○は加入協会を表す）

2020年1月6日 現在

販売会社名	区分	登録番号	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	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会	備考
いちよし証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第24号	○	○			

## &lt;備考欄の表示について&gt;

- ※ 1 記載の日付より新規お取扱いを開始します。
- ※ 2 記載の日付以降の新規お取扱いを行いません。
- ※ 3 新規のお取扱いを行っていません。

## &lt;ご留意事項&gt;

- ・上記掲載の販売会社は、今後変更となる場合があります。
- ・上記掲載以外の販売会社において、お取扱いを行っている場合があります。
- ・詳細は販売会社または委託会社までお問い合わせください。

当資料は損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社（以下、弊社）により作成された情報提供資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。投資信託は金融機関の預金と異なり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、分配金の保証はありません。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。投資信託は、預金や保険契約と異なり、預金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外の登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。当資料は弊社が信頼できると判断した各種情報に基づいて作成されておりますが、その正確性や完全性を保証するものではありません。当資料に記載された意見等は予告なしに変更する場合があります。また、将来の市場環境の変動等により、当該運用方針が変更される場合があります。投資信託の設定・運用は委託会社が行います。お申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめまたは同時にお渡ししますので、詳細をご確認の上、お客さま自身でご判断ください。なお、お客さまへの投資信託説明書（交付目論見書）の提供は、販売会社において行います。