



交付運用報告書

グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）

円ヘッジありコース／円ヘッジなしコース

<愛称> ヘンリー毎月

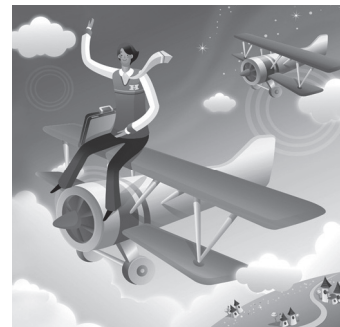
追加型投信／海外／債券

作成対象期間：2020年10月21日～2021年4月20日

第76期 決算日：2020年11月20日 第77期 決算日：2020年12月21日

第78期 決算日：2021年1月20日 第79期 決算日：2021年2月22日

第80期 決算日：2021年3月22日 第81期 決算日：2021年4月20日



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

当ファンドは、各国政府・企業等が発行する外貨建ての変動金利債券等を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目指します。当作成期もそれに沿った運用を行いました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。

第81期末 2021.4.20

|                   | 円ヘッジありコース | 円ヘッジなしコース |
|-------------------|-----------|-----------|
| 基準価額              | 9,614円    | 9,874円    |
| 純資産総額             | 7百万円      | 19百万円     |
| 騰落率*<br>(当作成期)    | 1.7%      | 5.0%      |
| 期中分配金合計<br>(当作成期) | 60円       | 60円       |

※ 騰落率は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

当ファンドは、投資信託約款において運用報告書（全体版）を電磁的方法によりご提供することを定めております。運用報告書（全体版）は下記の方法で閲覧いただけます。

なお、ご請求いただいた場合には交付いたしますので、販売会社までお問い合わせください。

▶ 運用報告書（全体版）の閲覧方法



<https://www.sompo-am.co.jp/>

にアクセス

「ファンド検索」等から当ファンドのページを表示して、閲覧またはダウンロードすることができます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル  
お問い合わせ先：リテール営業部

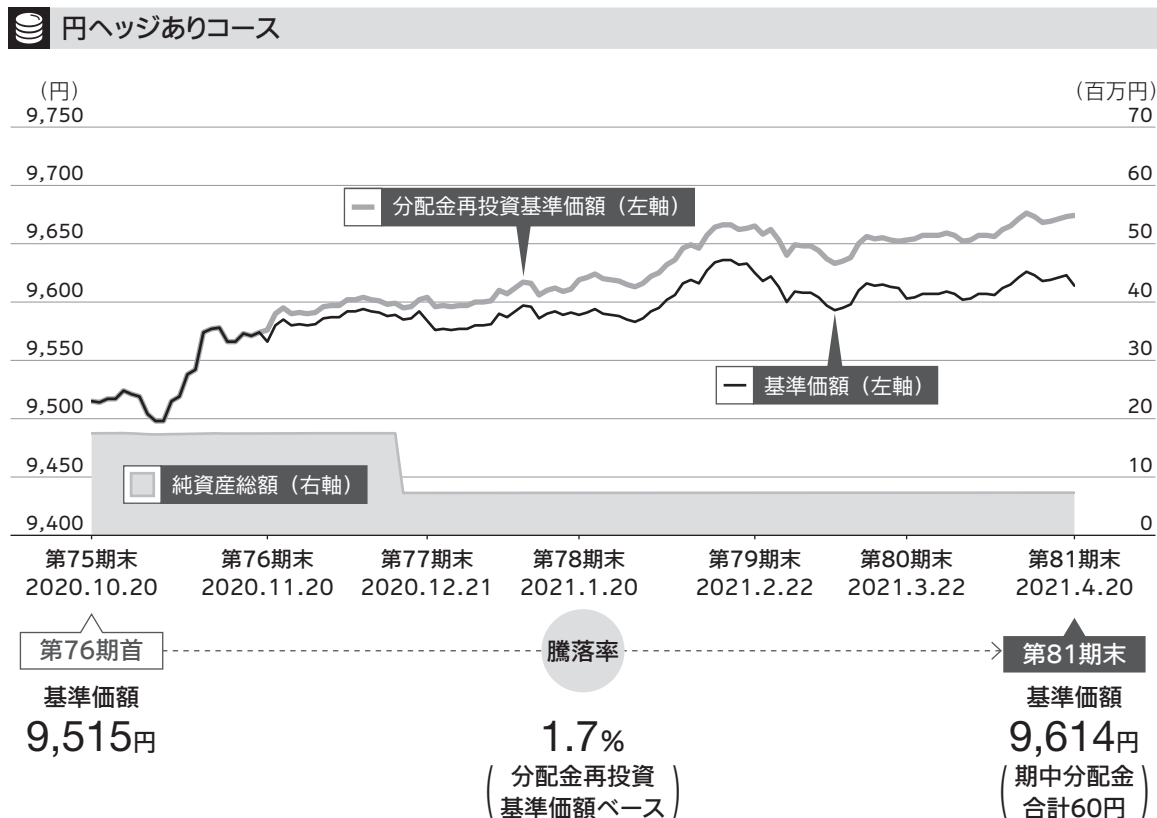
(受付時間 営業日の午前9時～午後5時)



0120-69-5432

# 運用経過

## ● 基準価額の推移



基準価額の推移

- 分配金再投資基準価額の推移は、2020年10月20日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、各国政府・企業等が発行する外貨建て（米ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建て、スイスフラン建て）の変動金利債券を主要投資対象とするファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 円ヘッジありコース

高位に組み入れていたマザーファンドの債券のキャピタル（価格変動）要因、インカム（利子）要因がプラスに寄与しました。なお、対円で為替ヘッジを行っていたため、為替の動きによる影響は限定的となりました。

### グローバル変動金利債券マザーファンド

期中の騰落率は+5.6%となりました。

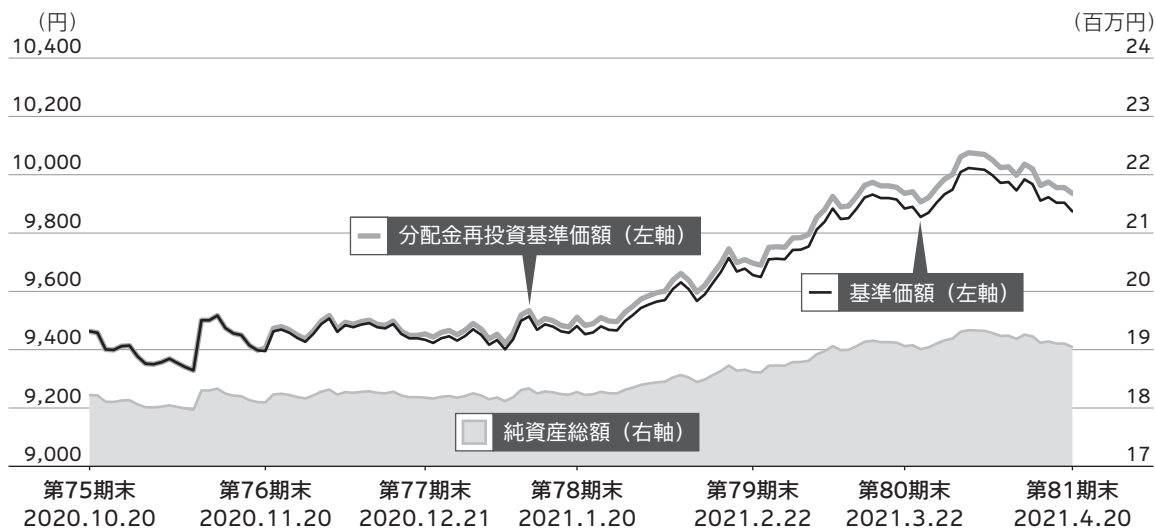
保有する債券のキャピタル（価格変動）要因、インカム（利子）要因がプラスに寄与しました。加えて、為替において米ドル、ユーロ、英ポンドが対円で上昇したことなどもプラスに寄与しました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド  マザーファンド

## ● 基準価額の推移

### 円ヘッジなしコース



基準価額の推移

第76期首

基準価額  
9,463円

騰落率

5.0%  
( 分配金再投資 )  
( 基準価額ベース )

第81期末

基準価額  
9,874円  
( 期中分配金 )  
( 合計60円 )

- 分配金再投資基準価額の推移は、2020年10月20日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、各国政府・企業等が発行する外貨建て（米ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建て、スイスフラン建て）の変動金利債券を主要投資対象とするファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 円ヘッジなしコース

高位に組み入れていたマザーファンドの債券のキャピタル（価格変動）要因、インカム（利子）要因がプラスに寄与しました。また、為替において米ドル、ユーロ、英ポンドが対円で上昇したことなどもプラスに寄与しました。

### グローバル変動金利債券マザーファンド

期中の騰落率は+5.6%となりました。

保有する債券のキャピタル（価格変動）要因、インカム（利子）要因がプラスに寄与しました。加えて、為替において米ドル、ユーロ、英ポンドが対円で上昇したことなどもプラスに寄与しました。

- 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド    マザーファンド

## ● 1万口当たりの費用明細

### 円ヘッジありコース

| 項目        | 第76期～第81期<br>2020.10.21～2021.4.20 |              | 項目の概要   |
|-----------|-----------------------------------|--------------|---|
|           | 金額                                | 比率           |   |
| (a) 信託報酬  | 43円                               | 0.444%       | (a) 信託報酬 = 各期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{各期の日数}}{\text{年間の日数}}$<br>期中の平均基準価額は9,576円です。 |
| ( 投信会社 )  | ( 17 )                            | ( 0.176 )    | ファンドの運用の対価  |
| ( 販売会社 )  | ( 24 )                            | ( 0.247 )    | 購入後の情報提供、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等の対価   |
| ( 受託会社 )  | ( 2 )                             | ( 0.022 )    | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価  |
| (b) その他費用 | 1                                 | 0.013        | (b) その他費用 = $\frac{\text{各期中のその他費用}}{\text{各期中の平均受益権口数}}$                                       |
| ( 保管費用 )  | ( 1 )                             | ( 0.006 )    | 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用  |
| ( 監査費用 )  | ( 1 )                             | ( 0.006 )    | 監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用   |
| ( その他 )   | ( 0 )                             | ( 0.001 )    | 信託事務の処理にかかるその他の費用等  |
| <b>合計</b> | <b>44</b>                         | <b>0.457</b> |   |

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

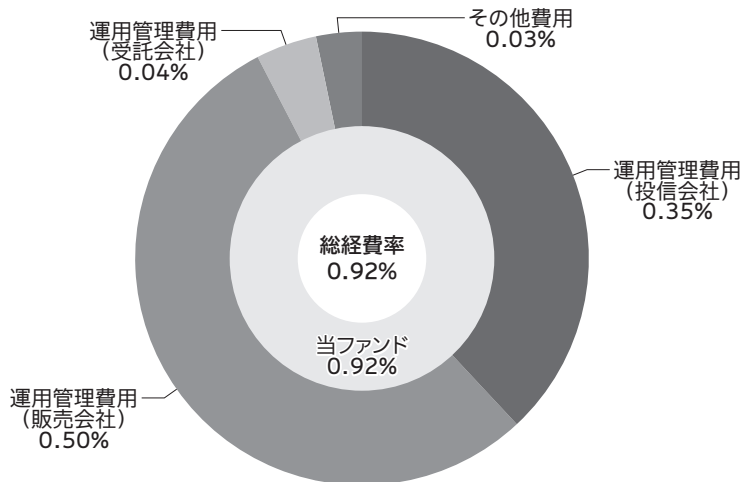
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.92%**です。



1万口当たりの費用明細

注1. 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

注2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

注3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

注5. 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 円ヘッジなしコース

| 項目        | 第76期～第81期<br>2020.10.21～2021.4.20 |              | 項目の概要   |
|-----------|-----------------------------------|--------------|---|
|           | 金額                                | 比率           |   |
| (a) 信託報酬  | 43円                               | 0.444%       | (a) 信託報酬 = 各期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{各期の日数}}{\text{年間の日数}}$<br>期中の平均基準価額は9,578円です。 |
| ( 投信会社 )  | ( 17 )                            | ( 0.176 )    | ファンドの運用の対価  |
| ( 販売会社 )  | ( 24 )                            | ( 0.247 )    | 購入後の情報提供、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等の対価   |
| ( 受託会社 )  | ( 2 )                             | ( 0.022 )    | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価  |
| (b) その他費用 | 1                                 | 0.015        | (b) その他費用 = $\frac{\text{各期中のその他費用}}{\text{各期中の平均受益権口数}}$                                       |
| ( 保管費用 )  | ( 1 )                             | ( 0.007 )    | 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用  |
| ( 監査費用 )  | ( 1 )                             | ( 0.007 )    | 監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用   |
| ( その他 )   | ( 0 )                             | ( 0.001 )    | 信託事務の処理にかかるその他の費用等  |
| <b>合計</b> | <b>44</b>                         | <b>0.459</b> |   |

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

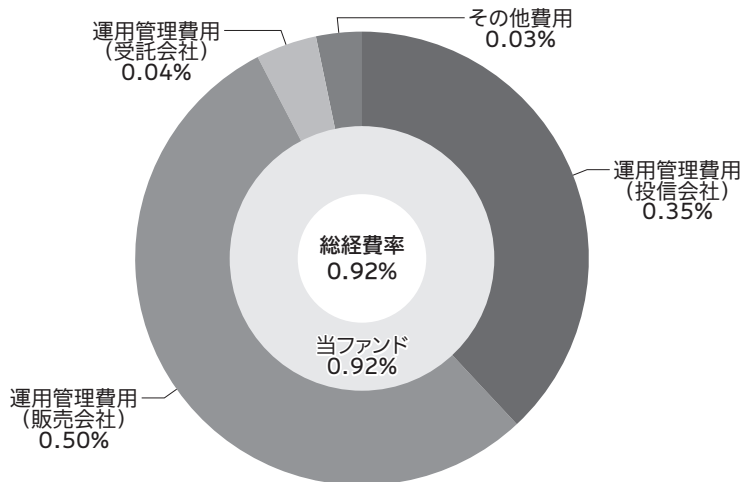
注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.92%**です。



1万口当たりの費用明細

注1. 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

注2. 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

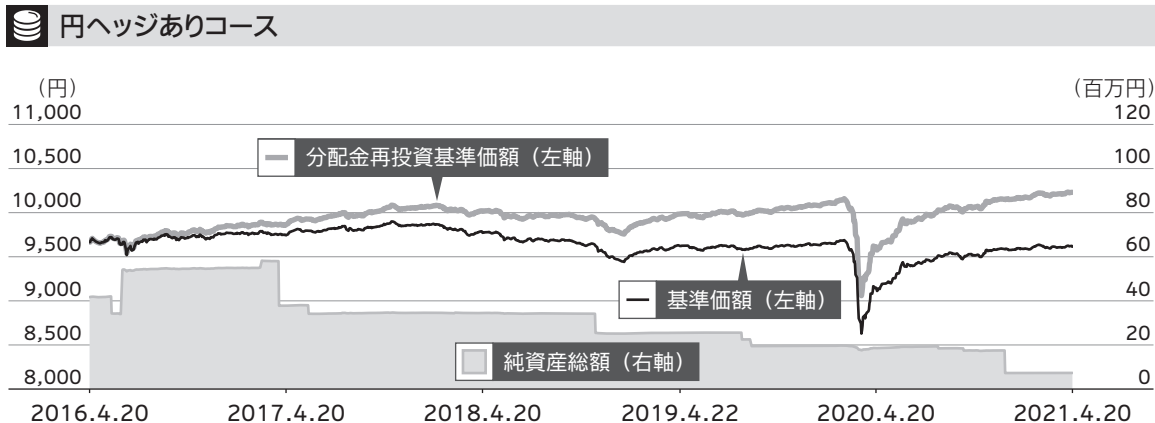
注3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

注5. 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ● 最近5年間の基準価額等の推移

2016.4.20～2021.4.20

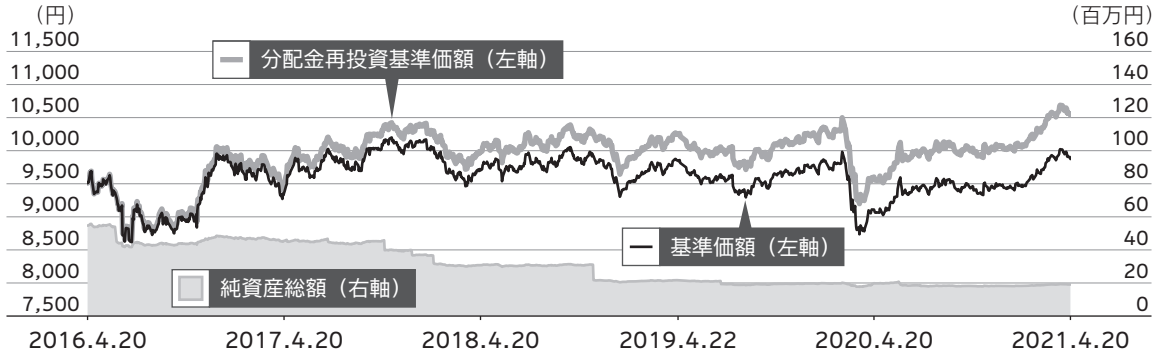


- 分配金再投資基準価額の推移は、2016年4月20日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、各国政府・企業等が発行する外貨建て（米ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建て、スイスフラン建て）の変動金利債券を主要投資対象とするファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

| 決算日               |       | 2016.4.20<br>決算日 | 2017.4.20<br>決算日 | 2018.4.20<br>決算日 | 2019.4.22<br>決算日 | 2020.4.20<br>決算日 | 2021.4.20<br>決算日 |
|-------------------|-------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 基準価額              | (円)   | 9,665            | 9,743            | 9,772            | 9,622            | 9,149            | 9,614            |
| 期中分配金合計（税引前）      | (円)   | —                | 120              | 120              | 120              | 120              | 120              |
| 分配金再投資<br>基準価額騰落率 | (%)   | —                | 2.1              | 1.5              | △ 0.3            | △ 3.7            | 6.4              |
| 純資産総額             | (百万円) | 41               | 37               | 34               | 25               | 18               | 7                |

最近5年間の基準価額等の推移

2016.4.20～2021.4.20


 円ヘッジなしコース


- 分配金再投資基準価額の推移は、2016年4月20日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、各国政府・企業等が発行する外貨建て（米ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建て、スイスフラン建て）の変動金利債券を主要投資対象とするファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

| 決算日                   | 2016.4.20<br>決算日 | 2017.4.20<br>決算日 | 2018.4.20<br>決算日 | 2019.4.22<br>決算日 | 2020.4.20<br>決算日 | 2021.4.20<br>決算日 |
|-----------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 基準価額 (円)              | 9,509            | 9,359            | 9,703            | 9,849            | 9,110            | 9,874            |
| 期中分配金合計（税引前）(円)       | —                | 145              | 120              | 120              | 120              | 120              |
| 分配金再投資<br>基準価額騰落率 (%) | —                | △ 0.0            | 4.9              | 2.8              | △ 6.3            | 9.8              |
| 純資産総額 (百万円)           | 54               | 45               | 30               | 21               | 19               | 19               |

最近5年間の基準価額等の推移

## ● 投資環境

当期のグローバル変動金利債券市場は上昇しました。新型コロナウイルスの感染問題に対応して導入された都市封鎖策などにより低迷した景気が緩やかに回復する中、2020年12月以降、一部先進国で新型コロナウイルス向けのワクチン接種が開始されました。このような市場環境下、世界的に株式市場は総じて上昇したことから、グローバル変動金利債券市場も上昇しました。為替市場では、米国経済に対する景気回復期待が高まり、米国金利が上昇したことなどをを受けて米ドルは対円で上昇しました。また、ユーロや英ポンドも対円で上昇しました。

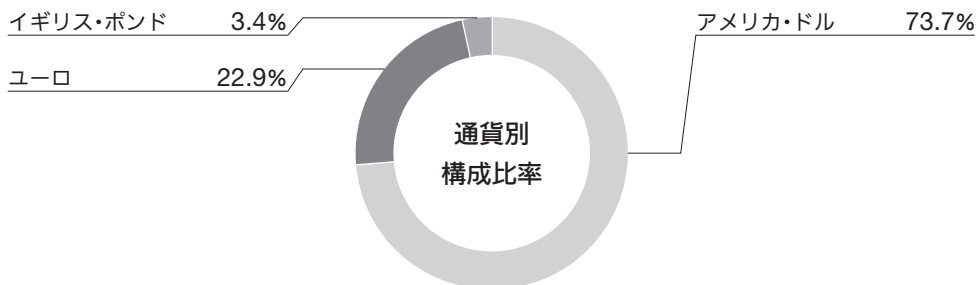
## ● 当該投資信託のポートフォリオ

### 円ヘッジありコース／円ヘッジなしコース

各ファンドの運用については、両コースともに、グローバル変動金利債券マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。円ヘッジありコースでは、対円で為替ヘッジを行っております。

## グローバル変動金利債券マザーファンド

先進国の優良企業が発行する変動金利債券を中心に、一部固定金利債券の組入れによるポートフォリオを維持しました。投資対象とする債券は、取得時においては発行体格付けが投資適格の債券で、通貨は米ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建てのものとし、発行体の分散を図りました。ファンドの資金流入に対しては、その時点で投資魅力度の高い銘柄の組入れを図り、債券組入比率は高位を保ちました。ポートフォリオのデュレーションは1.5年未満とし、金利上昇リスクを抑制しました。



注1. 比率は、第81期末における組入債券評価額に対する割合。

注2. 端数処理の関係上、構成比合計が100%とならない場合があります。

## ● 当該投資信託のベンチマークとの差異

### 円ヘッジありコース／円ヘッジなしコース

各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、各国政府・企業等が発行する外貨建て（米ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建て、スイスフラン建て）の変動金利債券を主要投資対象とするファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 分配金

決算期毎にインカム収入<sup>※</sup>を中心に分配を行うことを目指すファンドです。

※ インカム収入とは、債券の利子収入等をいいます。

- ・ ファンドに蓄積された過去の運用成果（分配原資）を加味する場合があります。
- ・ 投資対象資産や為替の値動き等により基準価額が下落した場合でも、原則として、インカム収入相当については、分配を行います。

### 円ヘッジありコース

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、1万口当たり合計60円の分配を行いました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

#### 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税引前)

| 項目        | 第76期                          | 第77期                          | 第78期                         | 第79期                        | 第80期                        | 第81期                        |
|-----------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|           | 2020.10.21<br>}<br>2020.11.20 | 2020.11.21<br>}<br>2020.12.21 | 2020.12.22<br>}<br>2021.1.20 | 2021.1.21<br>}<br>2021.2.22 | 2021.2.23<br>}<br>2021.3.22 | 2021.3.23<br>}<br>2021.4.20 |
| 当期分配金     | 10                            | 10                            | 10                           | 10                          | 10                          | 10                          |
| (対基準価額比率) | 0.104%                        | 0.104%                        | 0.104%                       | 0.104%                      | 0.104%                      | 0.104%                      |
| 当期の収益     | 10                            | 9                             | 10                           | 10                          | 8                           | 10                          |
| 当期の収益以外   | —                             | 0                             | —                            | —                           | 1                           | —                           |
| 翌期繰越分配対象額 | 507                           | 507                           | 507                          | 513                         | 512                         | 514                         |

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## 円ヘッジなしコース

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、1万口当たり合計60円の分配を行いました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

### 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税引前)

| 項目        | 第76期                          | 第77期                          | 第78期                         | 第79期                        | 第80期                        | 第81期                        |
|-----------|-------------------------------|-------------------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|           | 2020.10.21<br>}<br>2020.11.20 | 2020.11.21<br>}<br>2020.12.21 | 2020.12.22<br>}<br>2021.1.20 | 2021.1.21<br>}<br>2021.2.22 | 2021.2.23<br>}<br>2021.3.22 | 2021.3.23<br>}<br>2021.4.20 |
| 当期分配金     | 10                            | 10                            | 10                           | 10                          | 10                          | 10                          |
| (対基準価額比率) | 0.106%                        | 0.106%                        | 0.105%                       | 0.103%                      | 0.101%                      | 0.101%                      |
| 当期の収益     | 9                             | 10                            | 10                           | 10                          | 10                          | 9                           |
| 当期の収益以外   | 0                             | —                             | —                            | —                           | —                           | 0                           |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,749                         | 1,754                         | 1,758                        | 1,765                       | 1,770                       | 1,770                       |

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## ● 今後の運用方針

### 円ヘッジありコース

グローバル変動金利債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指します。原則として対円で為替ヘッジを行います。

### 円ヘッジなしコース



グローバル変動金利債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指します。原則として為替ヘッジを行いません。

### グローバル変動金利債券マザーファンド

引き続き、綿密なクレジット分析による選別的な投資により、先進国の優良企業が発行する変動金利債券を中心に、一部固定金利債券の組入れによるポートフォリオを維持していきます。

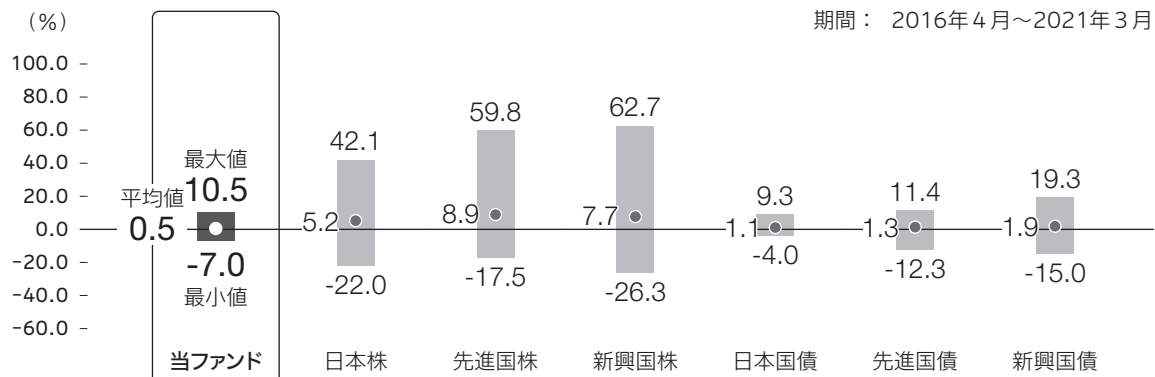


## ● 当該投資信託の概要

|        |  |
|--------|--|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／債券  |
| 信託期間   | 2014年7月18日から2024年4月19日まで   |
| 運用方針   | 信託財産の成長を図ることを目的とします。   |
| 主要投資対象 | <p> <b>グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）</b><br/>円ヘッジありコース／円ヘッジなしコース<br/>グローバル変動金利債券マザーファンド受益証券</p> <p> <b>グローバル変動金利債券マザーファンド</b><br/>各国政府・企業等が発行する外貨建ての変動金利債券等</p> |
| 運用方法   | <p>① 主として各国政府・企業等が発行する外貨建て（米ドル建て、ユーロ建て、英ポンド建て、スイスフラン建て）の変動金利債券等に分散投資を行います。マザーファンドにおける、債券の運用指図に関する権限を、ユニオン バンケール プリヴェ ユービーピー エスエーに委託します。</p> <p>② 「円ヘッジありコース」と「円ヘッジなしコース」があります。</p>   |
| 分配方針   | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>① 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>② 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>   |

## ● 代表的な資産クラスとの騰落率の比較

### 円ヘッジありコース



\* 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

### \* 各資産クラスの指数

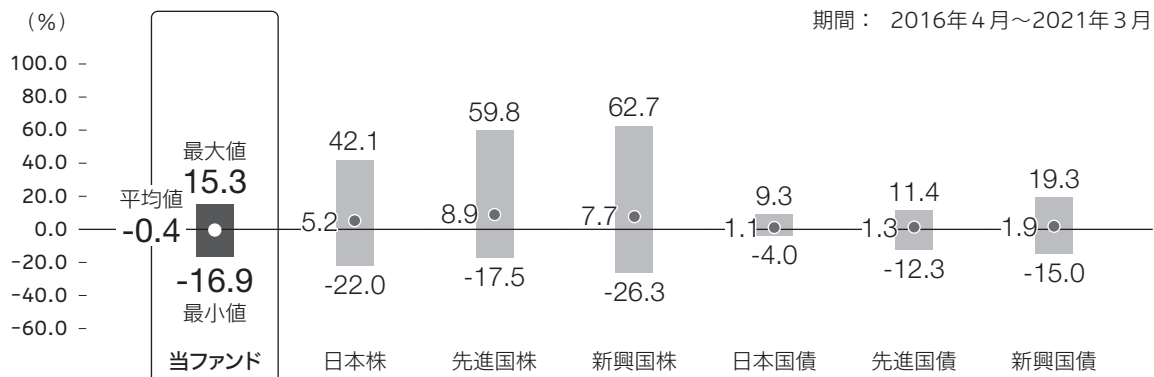
|      |                                       |
|------|---------------------------------------|
| 日本株  | 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)                 |
| 先進国株 | MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)           |
| 新興国株 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース) |
| 日本国債 | NOMURA-BPI国債                          |
| 先進国債 | FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)      |
| 新興国債 | JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)   |

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

- 当ファンドについては、分配金（税引前）再投資基準価額の騰落率です。
- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 上記の騰落率は直近月末から60ヶ月遡った算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

指数に関する詳細は23～24ページをご参照ください。

## 円ヘッジなしコース



\* 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

### \* 各資産クラスの指数

|      |                                       |
|------|---------------------------------------|
| 日本株  | 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)                 |
| 先進国株 | MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)           |
| 新興国株 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース) |
| 日本国債 | NOMURA-BPI国債                          |
| 先進国債 | FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)      |
| 新興国債 | JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)   |

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

- 当ファンドについては、分配金（税引前）再投資基準価額の騰落率です。
- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 上記の騰落率は直近月末から60ヶ月遡った算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

指数に関する詳細は23～24ページをご参照ください。

# 当該投資信託のデータ

## 円ヘッジありコース

### ● 当該投資信託の組入資産の内容

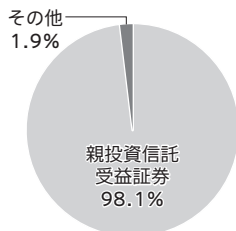
※ 組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

#### 組入ファンド

|                    | 第81期末<br>2021.4.20 |
|--------------------|--------------------|
| グローバル変動金利債券マザーファンド | 98.1%              |

注. 比率は第81期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

#### 資産別配分



#### 国別配分



#### 通貨別配分



注. 比率は第81期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

### ● 純資産等

| 項目             | 第76期末<br>2020.11.20 | 第77期末<br>2020.12.21 | 第78期末<br>2021.1.20 | 第79期末<br>2021.2.22 | 第80期末<br>2021.3.22 | 第81期末<br>2021.4.20 |
|----------------|---------------------|---------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 純資産総額          | 17,446,918円         | 7,266,935円          | 7,275,051円         | 7,306,517円         | 7,294,209円         | 7,307,362円         |
| 受益権総口数         | 18,239,041口         | 7,582,273口          | 7,586,887口         | 7,591,503口         | 7,596,103口         | 7,600,718口         |
| 1万口当たり<br>基準価額 | 9,566円              | 9,584円              | 9,589円             | 9,625円             | 9,603円             | 9,614円             |

※ 当作成期間（第76期～第81期）中における追加設定元本額は49,122円、同解約元本額は10,827,971円です。

## 円ヘッジなしコース

### ● 当該投資信託の組入資産の内容

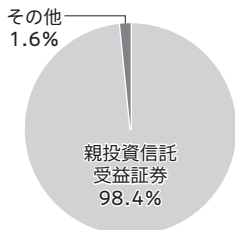
※ 組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

#### 組入ファンド

|                    | 第81期末<br>2021.4.20 |
|--------------------|--------------------|
| グローバル変動金利債券マザーファンド | 98.4%              |

注. 比率は第81期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

#### 資産別配分



#### 国別配分



#### 通貨別配分



注. 比率は第81期末における純資産総額に対する評価額の割合です。

### ● 純資産等

| 項目             | 第76期末<br>2020.11.20 | 第77期末<br>2020.12.21 | 第78期末<br>2021.1.20 | 第79期末<br>2021.2.22 | 第80期末<br>2021.3.22 | 第81期末<br>2021.4.20 |
|----------------|---------------------|---------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 純資産総額          | 18,096,627円         | 18,177,502円         | 18,273,645円        | 18,615,198円        | 19,060,779円        | 19,045,680円        |
| 受益権総口数         | 19,261,259口         | 19,267,121口         | 19,272,965口        | 19,278,786口        | 19,284,508口        | 19,289,372口        |
| 1万口当たり<br>基準価額 | 9,395円              | 9,434円              | 9,481円             | 9,656円             | 9,884円             | 9,874円             |

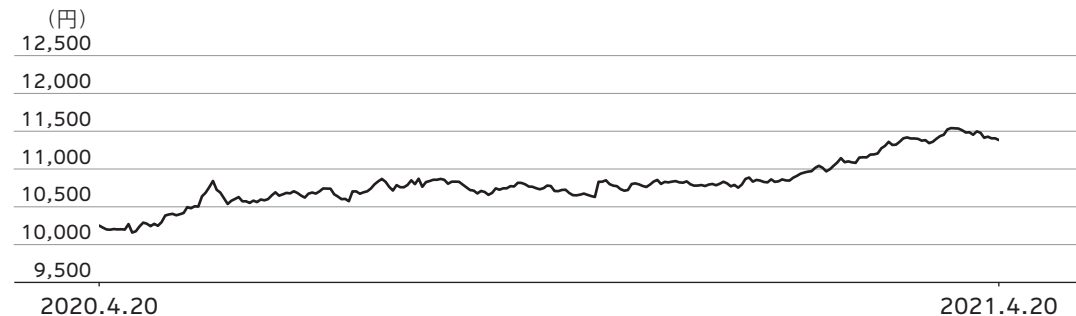
※ 当作成期間（第76期～第81期）中における追加設定元本額は33,927円、同解約元本額は0円です。

## ● 組入上位ファンドの概要

※ 組入ファンドの計算期間の詳細な運用経過等に関する詳細な情報については、運用報告書（全体版）に記載されています。

### グローバル変動金利債券マザーファンド

#### 基準価額の推移



#### 1万口当たりの費用明細

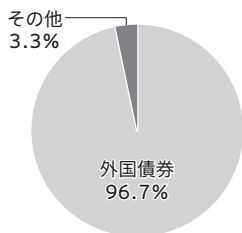
| 項目     | 2020.4.21～2021.4.20 |         |
|--------|---------------------|---------|
|        | 金額                  | 比率      |
| その他費用  | 2円                  | 0.017%  |
| (保管費用) | (2)                 | (0.014) |
| (その他)  | (0)                 | (0.003) |
| 合計     | 2                   | 0.017   |

期中の平均基準価額は10,768円です。

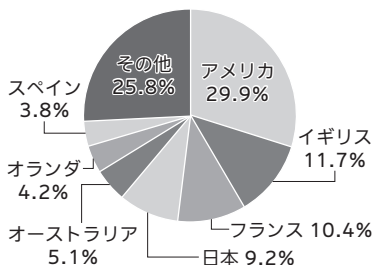
## 組入上位10銘柄

|       | 銘柄名                     | 業種/種別等 | 通貨      | 国(地域)   | 比率   |
|-------|-------------------------|--------|---------|---------|------|
| 1     | MS FRN 230508           | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ    | 3.6% |
| 2     | JPM CHASE FRN 230723    | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ    | 2.8% |
| 3     | WELLS FARGO FRN 221031  | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ    | 2.3% |
| 4     | AMEX FRN 230703         | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ    | 2.1% |
| 5     | CITIGROUP FRN 250701    | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ    | 2.0% |
| 6     | WBC FRN 240226          | 社債券    | アメリカ・ドル | オーストラリア | 1.9% |
| 7     | BONYMellon FRN 221030   | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ    | 1.9% |
| 8     | MITSUB UFJ FIN F 230726 | 社債券    | アメリカ・ドル | 日本      | 1.9% |
| 9     | SANTAN 7.5 240208       | 社債券    | アメリカ・ドル | スペイン    | 1.9% |
| 10    | LLOYDS BK FRN 240621    | 社債券    | ユーロ     | イギリス    | 1.8% |
| 組入銘柄数 |                         |        | 88銘柄    |         |      |

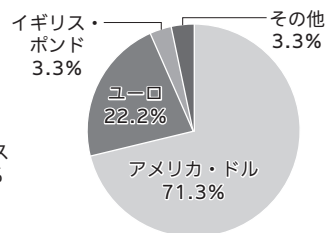
## 資産別配分



## 国別配分



## 通貨別配分



注1. 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものです。

注2. 1万口当たりの費用明細は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。なお、費用項目については前記（1万口当たりの費用明細の項目の概要）をご参照ください。

注3. 組入上位10銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日（2021年4月20日）現在のものです。

注4. 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## ● 指数に関して

### 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数について

#### ■ 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

#### ■ MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

#### ■ MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

#### ■ NOMURA-BPI国債

野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。



---

**■ FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）**

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

**■ JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ベース）**

J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

ホームページにて当ファンドの詳細をご案内しております。

グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）  コース

検索

それぞれのコースをご入力下さい。

円ヘッジあり

<https://www.sompo-am.co.jp/fund/0963/price.html>

グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型） 円ヘッジありコース  
（愛称：ヘンリー毎月）

日本経済新聞掲載名：ヘンリー毎月  
コースを選択してください

| 交                      | 運                          | 休                        |
|------------------------|----------------------------|--------------------------|
| 交付目論見書<br>(2021.01.19) | 交付運用報告書<br>(2021.03.23)    | 海外休業日（申込不可日）<br>2021年    |
| 請求目論見書<br>(2021.01.19) | 運用報告書（全体版）<br>(2021.03.23) | 分配金のお知らせ<br>(2021.03.23) |
| 販売用資料<br>(2021.01.19)  | 最新月次レポート<br>(2021.03.31)   |                          |

円ヘッジなし

<https://www.sompo-am.co.jp/fund/0964/price.html>

グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型） 円ヘッジなしコース  
（愛称：ヘンリー毎月）

日本経済新聞掲載名：ヘンリー毎月  
コースを選択してください

| 交                      | 運                          | 休                        |
|------------------------|----------------------------|--------------------------|
| 交付目論見書<br>(2021.01.19) | 交付運用報告書<br>(2021.03.23)    | 海外休業日（申込不可日）<br>2021年    |
| 請求目論見書<br>(2021.01.19) | 運用報告書（全体版）<br>(2021.03.23) | 分配金のお知らせ<br>(2021.03.23) |
| 販売用資料<br>(2021.01.19)  | 最新月次レポート<br>(2021.03.31)   |                          |

各書類の最新版をご確認いただけます。

交

交付目論見書

当ファンド購入に際して投資判断に必要な重要事項をご説明しております。

運交

交付運用報告書

当ファンドの運用状況について重要な事項をご説明しております。

休

海外休業日  
（申込不可日）

購入・換金の申込不可日をご案内しております。

請

請求目論見書

交付目論見書より詳細な当ファンドの情報をご説明しております。

運全

運用報告書（全体版）

交付運用報告書より詳細な運用状況をご説明しております。

i

分配金のお知らせ

決算期の分配金の推移についてお知らせいたします。

販

販売用資料

目論見書を補完する内容をご説明しております。交付目論見書と併せてご覧ください。

月

最新月次レポート

当ファンドの運用状況を月次でご説明しております。

本報告書作成時点のものを掲載しております。