



## 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：2023年4月21日～2023年10月20日

第106期 決算日：2023年5月22日 第107期 決算日：2023年6月20日

第108期 決算日：2023年7月20日 第109期 決算日：2023年8月21日

第110期 決算日：2023年9月20日 第111期 決算日：2023年10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111期末 2023.10.20

円ヘッジありコース 円ヘッジなしコース

|                   |        |         |
|-------------------|--------|---------|
| 基準価額              | 8,957円 | 12,774円 |
| 純資産総額             | 2百万円   | 10百万円   |
| 騰落率*<br>(当作成期)    | 0.6%   | 11.8%   |
| 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)

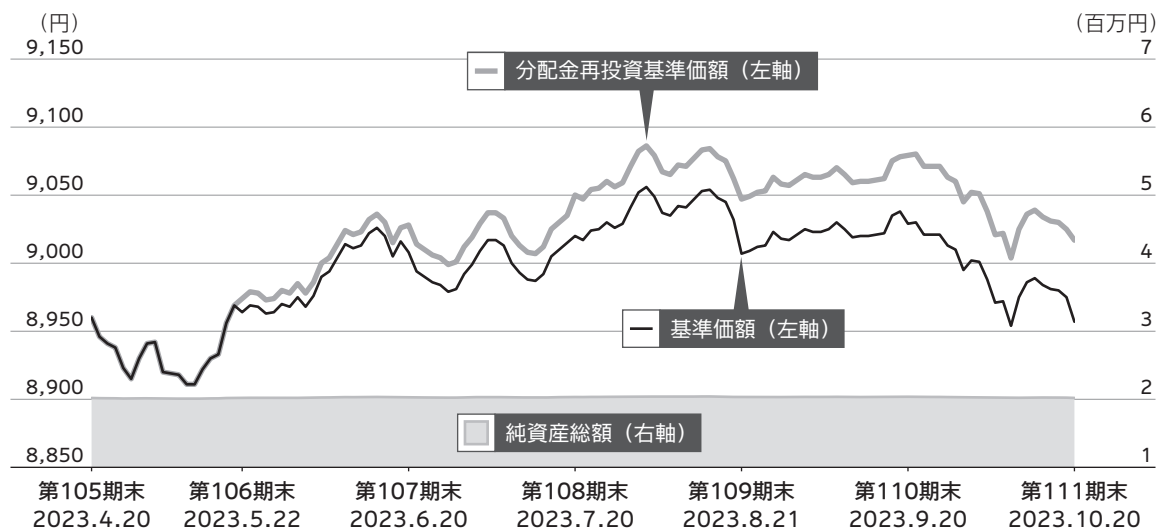


0120-69-5432

# 運用経過

## ● 基準価額の推移

### ☰ 円ヘッジありコース



基準価額の推移

第106期首

基準価額  
8,960円

騰落率

0.6%  
(分配金再投資)  
(基準価額ベース)

第111期末

基準価額  
8,957円  
(期中分配金)  
(合計60円)

- 分配金再投資基準価額の推移は、2023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。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 円ヘッジありコース

高位に組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）要因がマイナスに寄与したものの、インカム（利子）要因がプラスに寄与し、分配金再投資基準価額は上昇しました。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+12.7%となりました。

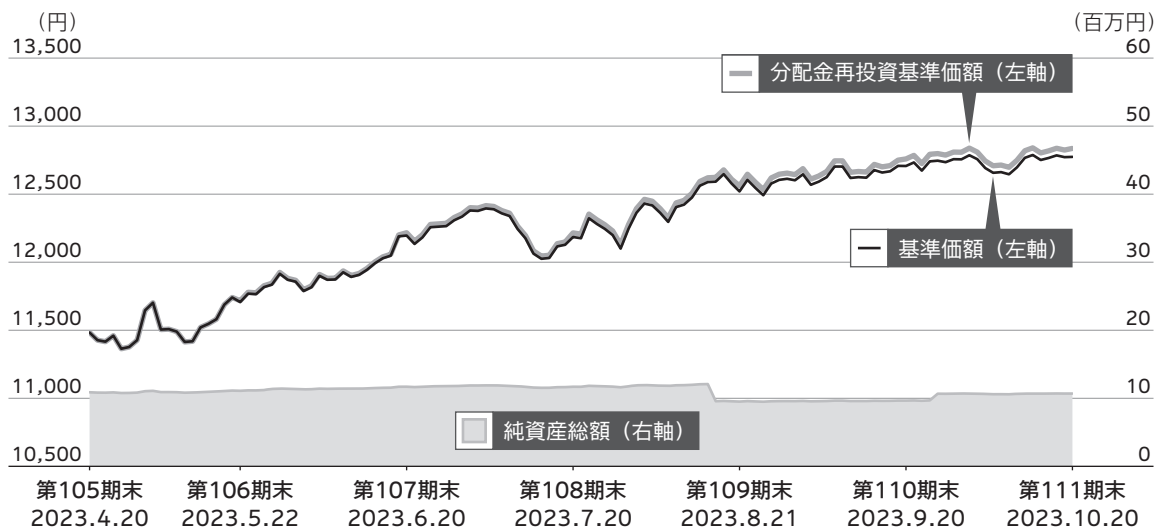
保有する債券のキャピタル（価格変動）要因がマイナスに寄与したものの、インカム（利子）要因がプラスに寄与したことに加え、為替において保有通貨である米ドル、ユーロ、英ポンドが対円で上昇したことなどがプラスに寄与しました。

- 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



- 分配金再投資基準価額の推移は、2023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。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 円ヘッジなしコース

高位に組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）要因がマイナスに寄与したものの、インカム（利子）要因がプラスに寄与したことに加え、為替において保有通貨である米ドル、ユーロ、英ポンドが対円で上昇したことがプラスに寄与し、分配金再投資基準価額は上昇しました。

### 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+12.7%となりました。

保有する債券のキャピタル（価格変動）要因がマイナスに寄与したものの、インカム（利子）要因がプラスに寄与したことに加え、為替において保有通貨である米ドル、ユーロ、英ポンドが対円で上昇したことなどが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106期～第111期<br>2023.4.21～2023.10.20 |              | 項目の概要                                                                                           |
|-----------|-------------------------------------|--------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | 金額                                  | 比率           |                                                                                                 |
| (a) 信託報酬  | 40円                                 | 0.445%       | (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8,994円です。 |
| ( 投信会社 )  | ( 16 )                              | ( 0.176 )    | ファンドの運用の対価                                                                                      |
| ( 販売会社 )  | ( 22 )                              | ( 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                                   | 0.016        | (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 )                               | ( 0.013 )    | 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 )  | ( 0 )                               | ( 0.003 )    | 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 )                               | ( 0.000 )    | 信託事務の処理にかかるその他の費用等                                                                              |
| <b>合計</b> | <b>41</b>                           | <b>0.461</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。

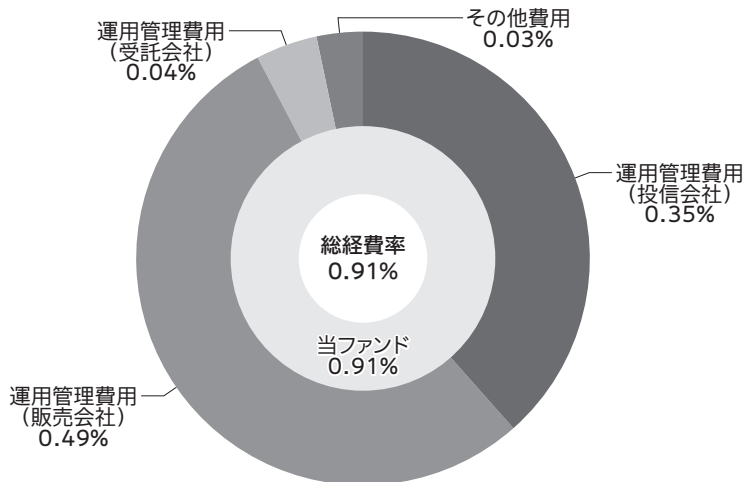
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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0.91%**です。



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106期～第111期<br>2023.4.21～2023.10.20 |              | 項目の概要                                                                                            |
|-----------|-------------------------------------|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | 金額                                  | 比率           |                                                                                                  |
| (a) 信託報酬  | 54円                                 | 0.445%       | (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12,218円です。 |
| ( 投信会社 )  | (22)                                | (0.176)      | ファンドの運用の対価                                                                                       |
| ( 販売会社 )  | (30)                                | (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 )  | ( 3 )                               | (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 | 3                                   | 0.021        | (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 )                               | (0.012)      | 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 )                               | (0.002)      | 信託事務の処理にかかるその他の費用等                                                                               |
| <b>合計</b> | <b>57</b>                           | <b>0.466</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。

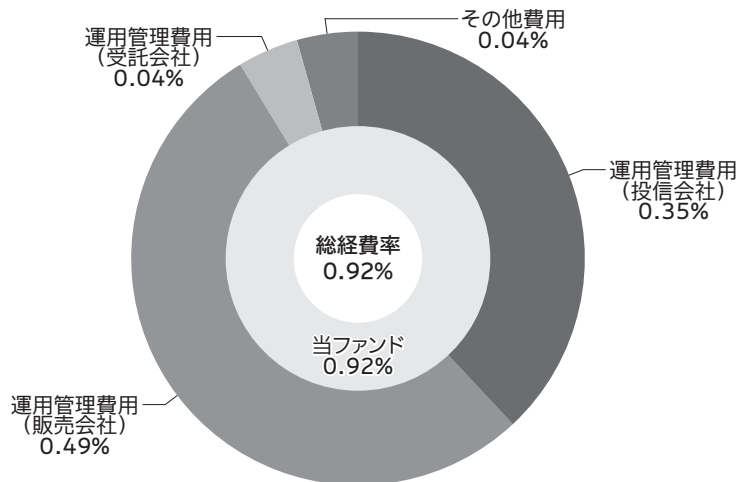
注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



(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。

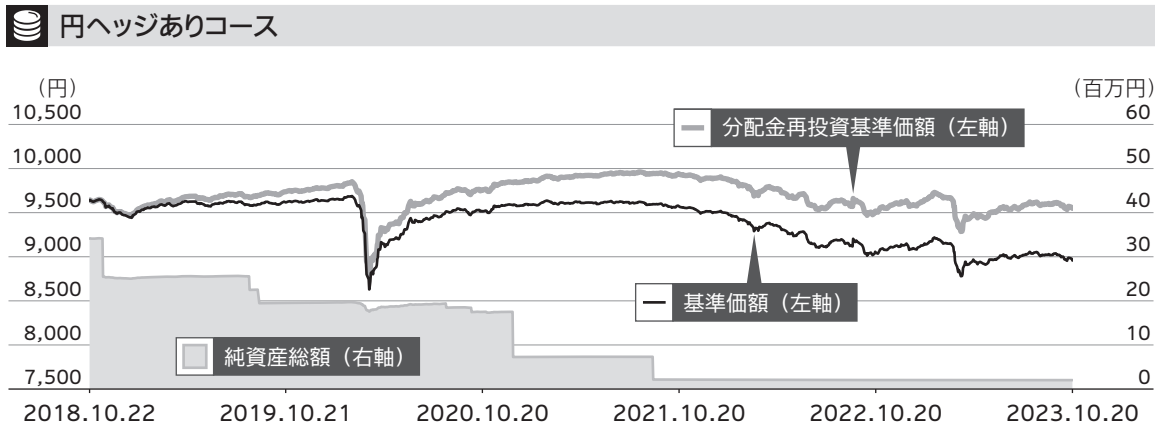
注3. 各比率は、年率換算した値です。

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

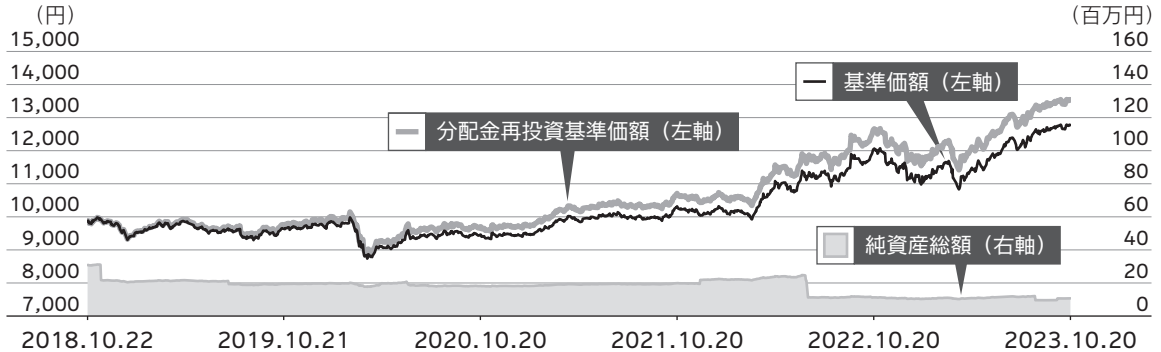
2018.10.22～2023.10.20



- 分配金再投資基準価額の推移は、2018年10月22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                   | 2018.10.22<br>決算日 | 2019.10.21<br>決算日 | 2020.10.20<br>決算日 | 2021.10.20<br>決算日 | 2022.10.20<br>決算日 | 2023.10.20<br>決算日 |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (円)              | 9,639             | 9,616             | 9,515             | 9,570             | 9,048             | 8,957             |
| 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 (%) | —                 | 1.0               | 0.2               | 1.8               | △ 4.2             | 0.3               |
| 純資産総額 (百万円)           | 34                | 19                | 17                | 2                 | 2                 | 2                 |

2018.10.22~2023.10.20


**円ヘッジなしコース**


- 分配金再投資基準価額の推移は、2018年10月22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                   | 2018.10.22<br>決算日 | 2019.10.21<br>決算日 | 2020.10.20<br>決算日 | 2021.10.20<br>決算日 | 2022.10.20<br>決算日 | 2023.10.20<br>決算日 |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (円)              | 9,868             | 9,639             | 9,463             | 10,317            | 12,048            | 12,774            |
| 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 (%) | —                 | △ 1.1             | △ 0.6             | 10.4              | 18.1              | 7.1               |
| 純資産総額 (百万円)           | 30                | 19                | 18                | 19                | 11                | 10                |

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、ほぼ横ばいとなりました。期初から2023年5月中頃にかけては、米国で一部の地方銀行株が急落したことや、ユーロ圏諸国の中央銀行総裁から利上げに前向きな発言が相次ぎ、リスク回避姿勢が強まる中で弱含みの展開となりました。8月中頃にかけては、米国で連邦債務上限の引き上げを巡り大統領と下院議長が原則合意に達したことや、物価指数の伸びが予想を下回ったこと、オランダの中央銀行総裁がECB（欧州中央銀行）の利上げについて利上げ休止の可能性を示唆したことなどを受け、リスク選好姿勢が強まる中で上昇しました。期末にかけては、米国で金融引き締めにも前向きなスタンスが示されたことや、ECBの理事が、追加利上げの可能性を示唆したことなどから、株式市場が下落しリスク回避姿勢が強まる中で軟調な展開となりました。為替市場では、米ドル、ユーロ、英ポンドは対円で上昇しました。

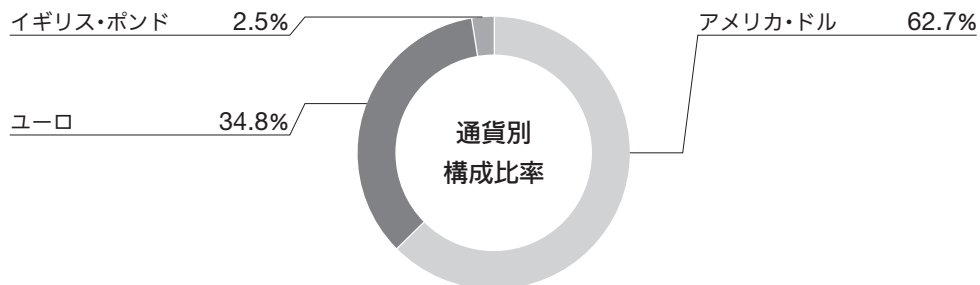
## ● 当該投資信託のポートフォリオ

### 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111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、次表の通りと致しました。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106期                       | 第107期                       | 第108期                       | 第109期                       | 第110期                       | 第111期                        |
|-----------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------|
|           | 2023.4.21<br>}<br>2023.5.22 | 2023.5.23<br>}<br>2023.6.20 | 2023.6.21<br>}<br>2023.7.20 | 2023.7.21<br>}<br>2023.8.21 | 2023.8.22<br>}<br>2023.9.20 | 2023.9.21<br>}<br>2023.10.20 |
| 当期分配金     | 10                          | 10                          | 10                          | 10                          | 10                          | 10                           |
| (対基準価額比率) | 0.111%                      | 0.111%                      | 0.111%                      | 0.111%                      | 0.111%                      | 0.112%                       |
| 当期の収益     | 10                          | 10                          | 10                          | 10                          | 10                          | 10                           |
| 当期の収益以外   | —                           | —                           | —                           | —                           | —                           | —                            |
| 翌期繰越分配対象額 | 707                         | 733                         | 758                         | 784                         | 809                         | 835                          |

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、次表の通りと致しました。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106期<br>2023.4.21<br>}<br>2023.5.22 | 第107期<br>2023.5.23<br>}<br>2023.6.20 | 第108期<br>2023.6.21<br>}<br>2023.7.20 | 第109期<br>2023.7.21<br>}<br>2023.8.21 | 第110期<br>2023.8.22<br>}<br>2023.9.20 | 第111期<br>2023.9.21<br>}<br>2023.10.20 |
|-----------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期分配金     | 10                                   | 10                                   | 10                                   | 10                                   | 10                                   | 10                                    |
| (対基準価額比率) | 0.085%                               | 0.082%                               | 0.082%                               | 0.080%                               | 0.079%                               | 0.078%                                |
| 当期の収益     | 10                                   | 10                                   | 10                                   | 10                                   | 10                                   | 10                                    |
| 当期の収益以外   | —                                    | —                                    | —                                    | —                                    | —                                    | —                                     |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,099                                | 3,140                                | 3,176                                | 3,372                                | 3,560                                | 3,625                                 |

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。



## ● お知らせ

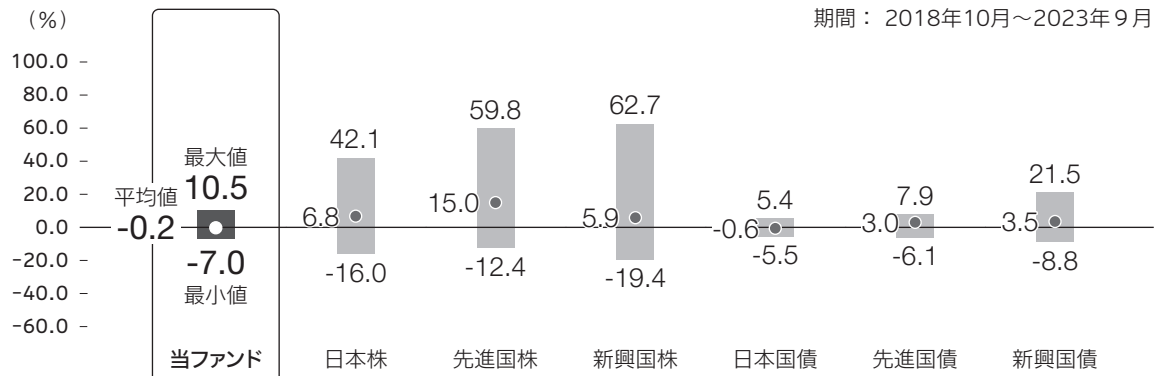
信託期間を5年間延長し、信託期間終了日を2024年4月19日から2029年4月19日に変更するため、投資信託約款に所要の変更を致しました（2023年7月20日）。

## ● 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2029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 |  グローバル変動金利債券ファンド（毎月分配型）<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<br> グローバル変動金利債券マザーファンド<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 |
| 運用方法   | 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。<br>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。                                                                                                                        |
| 分配方針   | 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。<br>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。<br>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。                                                                                                                                            |

## ● 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

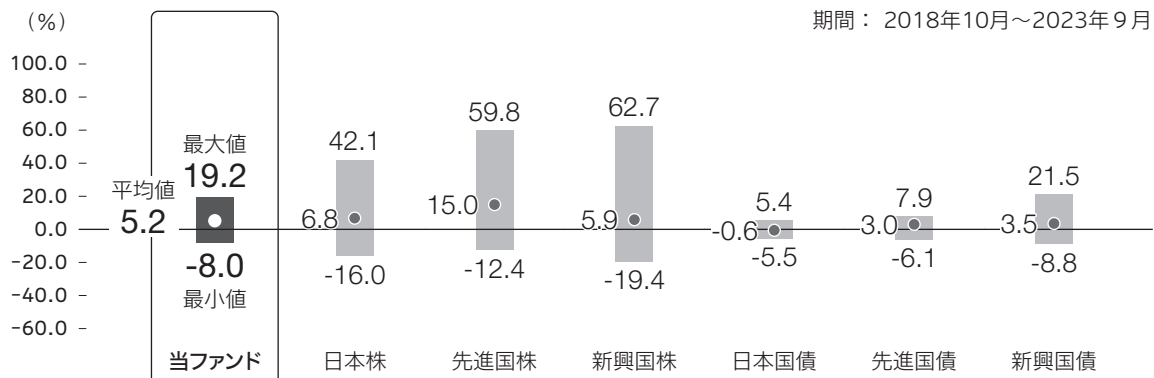
|      |                                       |
|------|---------------------------------------|
| 日本株  | 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)                 |
| 先進国株 | MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)           |
| 新興国株 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース) |
| 日本国債 | NOMURA-BPI国債                          |
| 先進国債 | 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

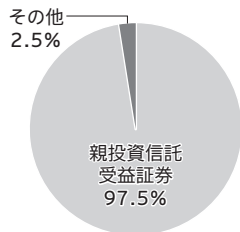
※ 組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

#### 組入ファンド

|                    | 第111期末<br>2023.10.20 |
|--------------------|----------------------|
| グローバル変動金利債券マザーファンド | 97.5%                |

注. 比率は第111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111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106期末<br>2023.5.22 | 第107期末<br>2023.6.20 | 第108期末<br>2023.7.20 | 第109期末<br>2023.8.21 | 第110期末<br>2023.9.20 | 第111期末<br>2023.10.20 |
|----------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|----------------------|
| 純資産総額          | 2,020,540円          | 2,030,542円          | 2,033,550円          | 2,030,764円          | 2,036,055円          | 2,019,891円           |
| 受益権総口数         | 2,253,940口          | 2,254,183口          | 2,254,425口          | 2,254,667口          | 2,254,910口          | 2,255,153口           |
| 1万口当たり<br>基準価額 | 8,964円              | 9,008円              | 9,020円              | 9,007円              | 9,029円              | 8,957円               |

※ 当作成期間（第106期～第111期）中における追加設定元本額は1,457円、同解約元本額は0円です。

当該投資信託の組入資産の内容／純資産等

## 円ヘッジなしコース

### ● 当該投資信託の組入資産の内容

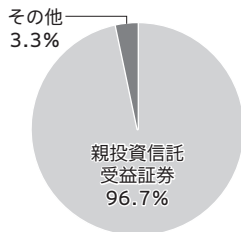
※ 組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

#### 組入ファンド

|                    | 第111期末<br>2023.10.20 |
|--------------------|----------------------|
| グローバル変動金利債券マザーファンド | 96.7%                |

注. 比率は第111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111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106期末<br>2023.5.22 | 第107期末<br>2023.6.20 | 第108期末<br>2023.7.20 | 第109期末<br>2023.8.21 | 第110期末<br>2023.9.20 | 第111期末<br>2023.10.20 |
|----------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|----------------------|
| 純資産総額          | 11,099,748円         | 11,701,397円         | 11,695,734円         | 9,515,758円          | 9,661,117円          | 10,695,421円          |
| 受益権総口数         | 9,481,551口          | 9,594,641口          | 9,598,151口          | 7,600,604口          | 7,602,752口          | 8,372,843口           |
| 1万円当たり<br>基準価額 | 11,707円             | 12,196円             | 12,185円             | 12,520円             | 12,707円             | 12,774円              |

※ 当作成期間（第106期～第111期）中における追加設定元本額は895,981円、同解約元本額は2,001,062円です。

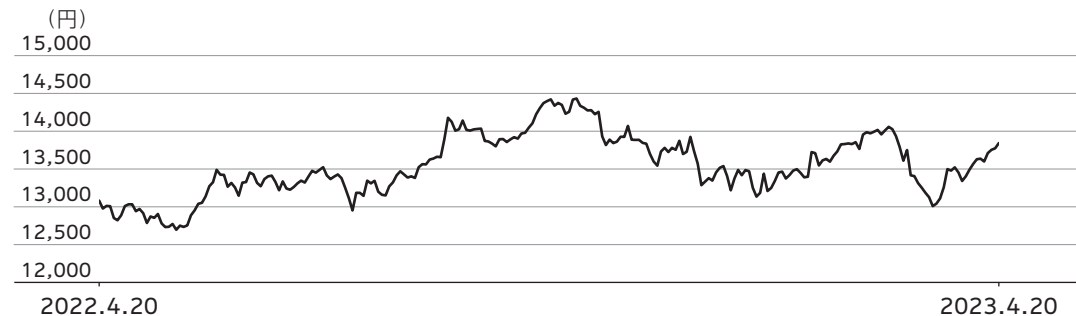
当該投資信託の組入資産の内容／純資産等

## ● 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

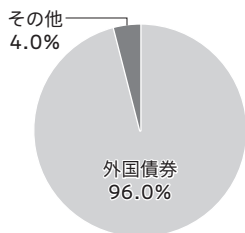
| 項目     | 2022.4.21～2023.4.20 |         |
|--------|---------------------|---------|
|        | 金額                  | 比率      |
| その他費用  | 3円                  | 0.025%  |
| (保管費用) | (3)                 | (0.023) |
| (その他)  | (0)                 | (0.002) |
| 合計     | 3                   | 0.025   |

期中の平均基準価額は13,544円です。

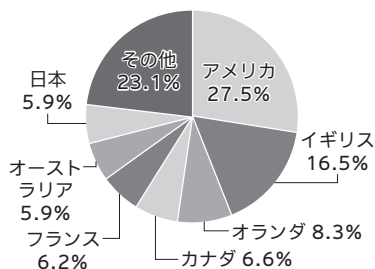
## 組入上位10銘柄

| 銘柄名                    | 業種/種別等 | 通貨      | 国(地域)  | 比率   |
|------------------------|--------|---------|--------|------|
| 1 MS FRN 250218        | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ   | 3.5% |
| 2 TD BANK FRN 250120   | 社債券    | ユーロ     | カナダ    | 3.3% |
| 3 CITIGROUP FRN 250701 | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ   | 3.0% |
| 4 WFC FRN 250425       | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ   | 3.0% |
| 5 JPM FRN 250224       | 社債券    | アメリカ・ドル | アメリカ   | 3.0% |
| 6 BAC FRN 250922       | 社債券    | ユーロ     | アメリカ   | 2.9% |
| 7 STANLN FRN 250330    | 社債券    | アメリカ・ドル | イギリス   | 2.7% |
| 8 SWEDA FRN 250404     | 社債券    | アメリカ・ドル | スウェーデン | 2.7% |
| 9 NWG FRN 250322       | 社債券    | アメリカ・ドル | イギリス   | 2.4% |
| 10 MIZUHO FRN 250522   | 社債券    | アメリカ・ドル | 日本     | 2.4% |
| 組入銘柄数                  |        | 63銘柄    |        |      |

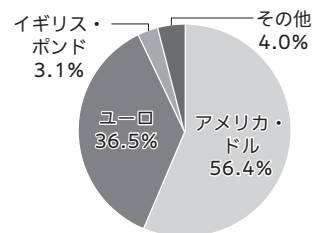
## 資産別配分



## 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（2023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）

日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

#### ■ 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、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。

#### ■ 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、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。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円換算しています。なお、MSCI Index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。

#### ■ NOMURA-BPI国債

野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社に帰属します。

#### ■ 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、日本を除く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指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### ■ 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、公表している、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。なお、JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、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>



円ヘッジなし

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



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。

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。