

BAMワールド・ボンド&カレンシー・ファンド(1年決算型) (愛称)ウインドミル1年

元本確保型の商品ではありません

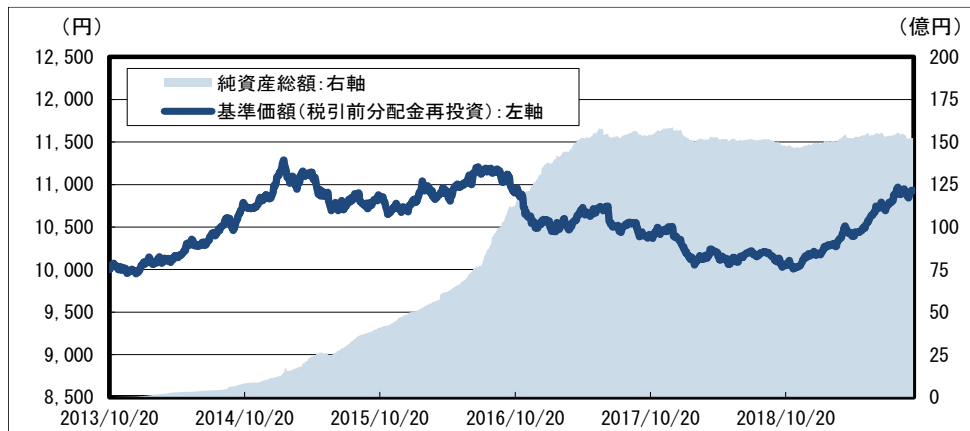
◆ファンドの特色

- ・主な投資対象 ……世界の公社債(投資適格債)
- ・ベンチマーク ……当ファンドにベンチマークはありません
- ・目標とする運用成果 ……インカム・ゲインの確保とともに信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います

◆基準価額、純資産総額

基準価額	10,932円
純資産総額	152億円

◆基準価額の推移グラフ



◆資産構成

債券現物	95.8%
現金等	4.2%
合計	100.0%

債券先物	-29.3%
------	--------

◆ポートフォリオプロフィール

修正デュレーション	6.1年
直接利回り	4.4%
最終利回り	2.0%

※上記は、マザーファンドの値です。現金等は考慮していません。※金利変動リスクの管理のため、債券先物等を含みます。この場合、修正デュレーションは債券先物等を含めて計算しています。

◆ファンド(分配金再投資)とベンチマークの収益率とリスク(標準偏差)

	3か月間	6か月間	1年間	3年間	5年間	10年間	設定来
ファンド収益率(分配金再投資)	2.00%	3.97%	7.95%	-0.55%	0.62%	—	1.39%
ベンチマーク収益率	—	—	—	—	—	—	—
差	—	—	—	—	—	—	—
ファンドリスク(分配金再投資)	—	—	2.80%	3.69%	3.78%	—	3.72%
ベンチマークリスク	—	—	—	—	—	—	—

※収益率は、期間が1年以上の場合は年率、期間が1年未満のものについては年率換算していません。
※ファンド(分配金再投資)の収益率は、当ファンド決算時に分配金があった場合の分配金を再購入(再投資)し、算出しています。
※収益率・リスクともに月次の収益率より算出しています。設定日が月中の場合、設定日が属する月は含んでいません。

◆種類別構成比率

	比率
国債	35.7%
地方債	41.8%
国際機関債等※1	13.1%
社債	5.2%
現金等	4.2%

◆通貨別構成比率

	比率
日本円※2	91.8%
米ドル	3.7%
カナダ・ドル	1.4%
豪ドル	2.1%
ニュージーランド・ドル	1.6%
ユーロ	-5.0%
英ポンド	-0.1%
スイス・フラン	0.0%
ポーランド・ズロチ	2.2%
メキシコ・ペソ	4.6%
南アフリカ・ランド	0.0%
ノルウェー・クローネ	5.5%
スウェーデン・クローナ	-1.8%
デンマーク・クローネ	-6.0%
その他	0.0%

◆債券現物組入上位10銘柄 (債券現物組入れ銘柄数:82銘柄)

	銘柄名	クーポン	満期	通貨	国名	比率
1	オーストラリア・クィーンズランド州財務公社債	6.500%	2033/3/14	豪ドル	オーストラリア	7.8%
2	ニュージーランド地方自治体資金調達機関債	4.500%	2027/4/15	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド	6.0%
3	オーストラリア・ニューサウス・ウェールズ州財務公社債	6.000%	2030/5/1	豪ドル	オーストラリア	5.4%
4	ニュージーランド地方自治体資金調達機関債	5.500%	2023/4/15	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド	3.7%
5	スペイン国債	5.750%	2032/7/30	ユーロ	スペイン	3.5%
6	スペイン国債	5.150%	2044/10/31	ユーロ	スペイン	3.4%
7	欧州投資銀行債	5.625%	2032/6/7	英ポンド	国際機関	3.2%
8	欧州投資銀行債	6.000%	2028/12/7	英ポンド	国際機関	2.8%
9	オーストラリア・ビクトリア州財務公社債	5.500%	2026/11/17	豪ドル	オーストラリア	2.8%
10	カナダ・ケベック州政府債	5.750%	2036/12/1	カナダ・ドル	カナダ	2.6%

◆債券通貨別構成比率

	比率
米ドル	19.5%
豪ドル	15.9%
ニュージーランド・ドル	13.5%
ユーロ	12.6%
カナダ・ドル	11.7%
英ポンド	9.1%
メキシコ・ペソ	6.9%
ノルウェー・クローネ	2.7%
ポーランド・ズロチ	2.1%
スウェーデン・クローナ	1.3%
デンマーク・クローネ	0.3%
現金等	4.2%

※現物債券のみの数値です。比率はマザーファンドの対純資産総額比です。合計が100%を超える場合があります。
※現金等には、未収・未払い項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。
※1:国際機関債等には公社債が含まれる場合があります。※2:日本円には、為替評価損益が含まれます。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、株式や公社債等値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。■当資料は、ペアリングス・ジャパン株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。

BAMワールド・ボンド&カレンシー・ファンド(1年決算型)
(愛称)ウインドミル1年

リターン実績(%)

設定日: 2013年10月21日

	リターン		リターン		リターン		リターン
2019年9月	-0.06	2016年9月	-0.61				
2019年8月	1.42	2016年8月	-0.04				
2019年7月	0.63	2016年7月	0.44				
2019年6月	1.47	2016年6月	1.23				
2019年5月	1.12	2016年5月	1.47				
2019年4月	-0.66	2016年4月	-0.39				
2019年3月	2.12	2016年3月	-0.63				
2019年2月	0.56	2016年2月	1.28				
2019年1月	0.67	2016年1月	1.10				
2018年12月	1.06	2015年12月	-0.31				
2018年11月	-0.30	2015年11月	-0.65				
2018年10月	-0.32	2015年10月	0.11				
2018年9月	-0.60	2015年9月	-0.04				
2018年8月	0.20	2015年8月	0.03				
2018年7月	-0.03	2015年7月	0.48				
2018年6月	0.36	2015年6月	-1.44				
2018年5月	0.11	2015年5月	-1.23				
2018年4月	-1.15	2015年4月	-0.64				
2018年3月	0.99	2015年3月	0.06				
2018年2月	-0.10	2015年2月	-1.33				
2018年1月	-2.26	2015年1月	3.77				
2017年12月	-0.75	2014年12月	0.18				
2017年11月	0.36	2014年11月	0.83				
2017年10月	0.27	2014年10月	1.25				
2017年9月	-1.46	2014年9月	0.00				
2017年8月	0.94	2014年8月	1.79				
2017年7月	-1.07	2014年7月	0.83				
2017年6月	-1.38	2014年6月	-0.33				
2017年5月	0.44	2014年5月	1.93				
2017年4月	0.79	2014年4月	0.38				
2017年3月	-0.03	2014年3月	-0.08				
2017年2月	1.18	2014年2月	0.25				
2017年1月	-1.06	2014年1月	1.61				
2016年12月	-0.50	2013年12月	-0.64				
2016年11月	-2.13	2013年11月	-0.63				
2016年10月	-2.29						

※リターンは基準価額(税引前分配金再投資)の月次リターンを掲載しています。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、株式や公社債等値動きのある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、購入者に帰属します。■当資料は、ペアリングス・ジャパン株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。

Date Complied(東京): 2019年10月7日(M20194Q03)