

MHAM日本債券インデックスファンド (ファンドラップ)

追加型投信/国内/債券/インデックス型

2020年8月31日現在

運用状況

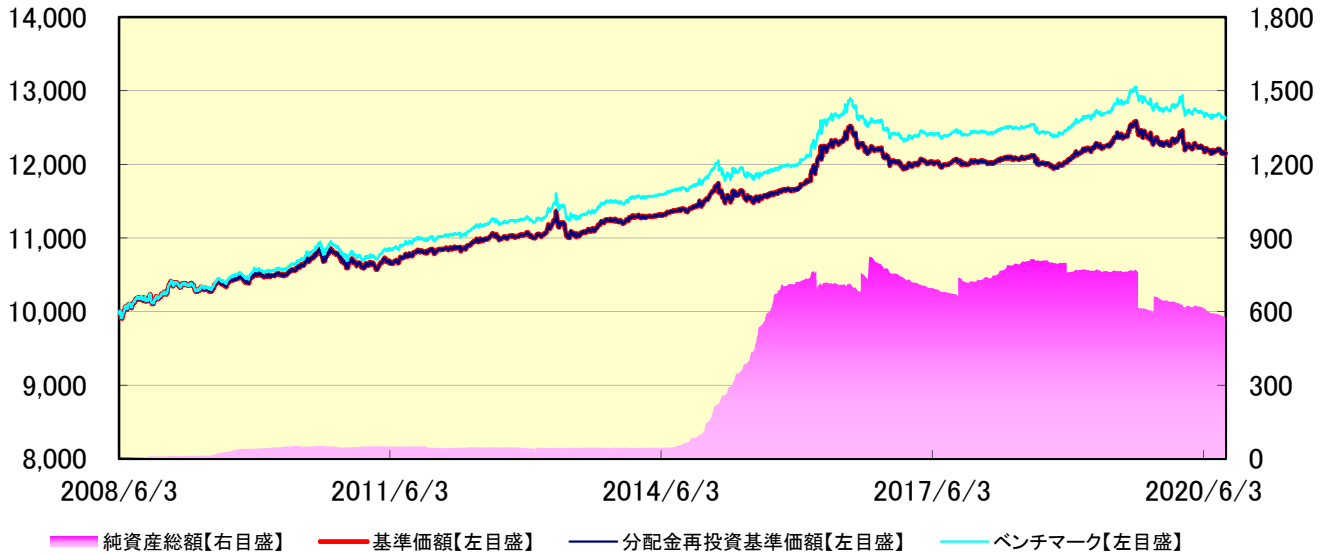
設定日	2008年6月3日	信託期間	無期限	決算日	原則5月8日
当初設定元本	1百万円				

基準日	2020年8月31日	前月末比	基準価額は、10,000口当たりです。		
基準価額	12,149円	-60円	設定来高値	12,587円	2019年9月4日
純資産総額	57,870百万円	-995百万円	設定来安値	9,904円	2008年6月13日

◆運用実績 - ファンドの基準価額とベンチマーク、純資産総額の推移 -

(円) (期間: 2008年6月3日 ~ 2020年8月31日) ベンチマーク: NOMURA-BPI総合

(億円)



- ・基準価額および分配金再投資基準価額は、信託報酬控除後の値です。
- ・分配金再投資基準価額は、決算時に収益分配があった場合にその分配金(税引前)を再投資したものととして算出した収益率に基づきます。
- ・基準価額、分配金再投資基準価額およびベンチマークは、2008年6月3日の当ファンドの基準価額(10,000円)に合わせて指数化しております。

◆期間別騰落率

	ファンド	ベンチマーク
1カ月	-0.5%	-0.5%
3カ月	-0.6%	-0.5%
6カ月	-2.3%	-2.2%
1年	-3.3%	-3.1%
3年	0.8%	1.4%
5年	4.8%	6.0%
10年	12.4%	15.9%
設定来	21.5%	26.3%

ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額より算出して
おり、実際の投資家利回りとは異なります。

ベンチマーク: NOMURA-BPI総合

(ご参考)ベンチマークとの比較(設定来)

トラッキングエラー 0.22%

◆分配等実績 (分配金は10,000口当たり、税引前)

決算期	日付	分配金	決算期	日付	分配金	
第1期	2009/05/08	0円				
第2期	2010/05/10	0円				
第3期	2011/05/09	0円				
第4期	2012/05/08	0円				
第5期	2013/05/08	0円				
第6期	2014/05/08	0円				
第7期	2015/05/08	0円				
第8期	2016/05/09	0円				
第9期	2017/05/08	0円				
第10期	2018/05/08	0円				
第11期	2019/05/08	0円				
第12期	2020/05/08	0円				
					設定来分配金累計額	0円

設定来高値および設定来安値にて、各々、同一の基準価額が複数存在する場合、直近の日付を表示しています。
運用実績および分配実績は、過去の実績を示したものであり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。
当資料の作成において、投資信託説明書(交付目論見書)に記載する運用実績とは作成基準が異なる場合があります。
そのため、両者の表記内容が一致しないことがあります。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「投資信託ご購入の注意」、「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

資産組入状況・運用コメント

◆ポートフォリオの状況

国内債現物	99.4%
国内債先物	0.0%
その他資産	0.6%

その他資産は、100%から国内債現物・国内債先物の組入比率の合計を差し引いたものです。

国内債現物組入銘柄数	423銘柄
------------	-------

◆ファンドとベンチマークの属性比較

種別	ファンド	ベンチマーク	差分
国債	85.2%	83.5%	1.7%
地方債	5.4%	6.3%	-0.9%
政府保証債	2.3%	2.3%	0.0%
金融債	0.2%	0.4%	-0.2%
事業債	3.1%	5.6%	-2.5%
円建外債	0.2%	0.5%	-0.2%
その他	3.6%	1.5%	2.1%
修正デュレーション	9.47	9.26	0.21

上記のファンドの属性は、債券ポートフォリオ(公社債部分)の値を表示しています。

上記の修正デュレーションは、国内債先物も含めた、ファンド全体の値を表示しています。

修正デュレーションは債券価格の金利変動に対する感応度を示す指標です。この値が大きいかほど、金利が変化した場合の債券の価格変動が大きくなります。

◆公社債の残存期間別組入比率

残存年数	比率
1年未満	0.0%
1年以上3年未満	17.8%
3年以上7年未満	27.5%
7年以上10年未満	15.4%
10年以上	38.7%

◆公社債の格付別組入比率

格付け	比率
AAA	1.2%
AA	91.5%
A	1.8%
BBB以下	0.0%
無格付け	4.9%

格付けは、R&Iの格付けを採用しています。

◆公社債組入上位10銘柄の組入比率

順位	銘柄名	クーポン	償還日	比率
1	329回 利付国庫債券(10年)	0.800%	2023/06/20	1.2%
2	135回 利付国庫債券(5年)	0.100%	2023/03/20	1.1%
3	332回 利付国庫債券(10年)	0.600%	2023/12/20	1.1%
4	134回 利付国庫債券(5年)	0.100%	2022/12/20	1.1%
5	339回 利付国庫債券(10年)	0.400%	2025/06/20	1.0%
6	335回 利付国庫債券(10年)	0.500%	2024/09/20	1.0%
7	133回 利付国庫債券(5年)	0.100%	2022/09/20	1.0%
8	341回 利付国庫債券(10年)	0.300%	2025/12/20	1.0%
9	320回 利付国庫債券(10年)	1.000%	2021/12/20	1.0%
10	338回 利付国庫債券(10年)	0.400%	2025/03/20	0.9%

表の組入比率は、純資産総額に対する比率を表示しています。

◆投資環境/運用概況など

8月の『国内債券市場(10年国債)』は下落(金利は上昇)しました。金利は、月初にかけて方向感を欠く展開となったものの、中旬から下旬にかけては、米金利の上昇や安倍首相の辞任報道などを受けて上昇しました。前月末に0.010%だった国内長期金利は、0.045%で月末を迎えました。

◆今後の市場環境の見通し

大型経済対策に伴う国債増発による需給悪化懸念は、金利の上昇要因とみられます。もっとも、新型コロナウイルス感染症の影響に伴う国内景気の低迷長期化への懸念や、日銀の国債買い入れなどが金利の低下要因と考えられ、金利は低位での推移を予想します。なお国内では8月28日、安倍首相が辞任を表明しました。後任については、9月中にも選出される見込みです。ただし、新型コロナウイルスの感染収束が見えない中で、大規模な財政・金融緩和策の継続性は維持されるとみられます。

◆お知らせ

今月のお知らせはありません。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「投資信託ご購入の注意」、「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

ファンドの特色(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)は、わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

1. NOMURA-BPI総合[※]の動きに連動する投資成果を目指します。

◆わが国の公社債を主要投資対象とします。

※NOMURA-BPI総合とは、野村証券株式会社が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。銘柄種類別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準に基づいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。

NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

2. 公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。

◆運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

◆「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行います。

*資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資リスクと費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

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、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさま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異なります。

金利変動リスク

一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。

信用リスク

当ファンドが投資する公社債等の発行体が、財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、またはその可能性が高まった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

流動性リスク

規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却(または購入)することができない可能性があり、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

当ファンドへの投資に伴う主な費用は信託報酬などです。

費用の詳細につきましては、当資料中の「ファンドの費用」および投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

収益分配金に関する留意事項

- ・投資信託の分配金は、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、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。
- ・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、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、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部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、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

その他の留意事項

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「投資信託ご購入の注意」、「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

お申込みメモ(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

購入単位	販売会社が定める単位(当初元本1口=1円)
購入価額	購入申込受付日の基準価額(基準価額は1万口当たりで表示しています。)
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の基準価額
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として営業日の午後2時までに販売会社が受付けたものを当日分のお申込みとします。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。
購入・換金申込受付の中止および取消し	取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消すことがあります。
信託期間	無期限(2008年6月3日設定)
繰上償還	次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)することがあります。 ・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。 ・やむを得ない事情が発生したとき。 ・信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。
決算日	毎年5月8日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1回の毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。 ※お申込コースには、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。詳細は販売会社までお問い合わせください。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 ※原則、収益分配金の普通分配金ならびに換金時の値上がり益および償還時の償還差益に対して課税されます。 ※税法が改正された場合等には、上記内容が変更となることがあります。
その他	当ファンドは、ラップ口座にかかる契約に基づいて、ラップ口座の資金を運用するためのファンドです。したがって、当ファンドのお申込みは、販売会社にラップ口座を開設した投資者 [※] 等に限ります。 ※販売会社にSMA(セパレートリー・マネージド・アカウント)にかかる契約に基づくSMA口座を開設した投資者を含む場合があります。

ファンドの費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

<p>下記の手数料等の合計額、その上限額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。 ※税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となることがあります。</p>	
<p>●投資者が直接的に負担する費用</p>	
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
<p>●投資者が信託財産で間接的に負担する費用</p>	
運用管理費用(信託報酬)	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.209%(税抜0.19%)</p> <p>※運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、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ファンドから支払われます。</p>
その他の費用・手数料	<p>その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・組入価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料 ・信託事務の処理に要する諸費用 ・外国での資産の保管等に要する費用 ・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用等 <p>監査費用は毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、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、その他の費用等はその都度ファンドから支払われます。</p> <p>※これらの費用等は、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。</p>

当資料はファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。後述の「投資信託ご購入の注意」、「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

投資信託ご購入の注意

投資信託は、

- ① 預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ② 購入金額については元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ③ 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

当資料のお取扱いについてのご注意

- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成した販売用資料です。
- お申込みに際しては、販売会社からお渡しする投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
- 投資信託は、主に国内外の株式、公社債および不動産投資信託などの値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替リスクもあります)に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、投資者の皆さま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。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。
- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また掲載データは過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 当資料における内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

◆ファンドの関係法人 ◆

<委託会社>アセットマネジメントOne株式会社
 [ファンドの運用の指図を行う者]
 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第324号
 加入協会: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
 <受託会社>みずほ信託銀行株式会社
 [ファンドの財産の保管および管理を行う者]
 <販売会社>販売会社一覧をご覧ください

◆委託会社の照会先 ◆

アセットマネジメントOne株式会社
 コールセンター 0120-104-694
 (受付時間:営業日の午前9時~午後5時)
 ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

販売会社(お申込み、投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください)

○印は協会への加入を意味します。

2020年9月8日現在

商号	登録番号等	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
みずほ証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第94号	○	○	○	○	

●その他にもお取扱いを行っている販売会社がある場合があります。

また、上記の販売会社は今後変更となる場合があるため、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

<備考欄について>

※1 新規募集の取扱いおよび販売業務を行っておりません。

※2 備考欄に記載されている日付からのお取扱いとなりますのでご注意ください。

※3 備考欄に記載されている日付からお取扱いを行いませんのでご注意ください。

(原則、金融機関コード順)