

# ブラックロック・ワールド債券ファンド（為替ヘッジあり）

〈この資料は確定拠出年金制度の加入者及び運用指図者のみなさま向けに作成した資料です。〉

2021年3月31日現在

◆ ファンドの特色

元本確保型の商品ではありません

- ・ 主な投資対象……ワールド・ボンド・マザーファンド（為替ヘッジあり）受益権への投資を通じて、世界主要国の国債等（国債、政府機関債、国際機関債）を中心に公社債に投資します。為替に関しては、原則として円に対する為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。
- ・ ベンチマーク……FTSE世界国債インデックス（円ヘッジ円ベース）
- ・ 目標とする運用成果……ベンチマークを上回る投資成果を目指します。

◆ 基準価額、純資産総額

基準価額	11,231円
純資産総額	1.5億円

◆ 資産構成

債券	97.6%
債券先物（金利先物含む）	-28.7%
債券実質	68.9%
キャッシュ等	31.1%

※比率はベビーファンドの実質組入比率です。

◆ 為替ヘッジ\*

為替ヘッジ比率	99.6%
---------	-------

※比率は円の実質為替組入比率です。

◆ ポートフォリオ・プロフィール

	ファンド	ベンチマーク
残存年数	16.33年	9.67年
デュレーション	11.35年	8.55年
最終利回り	0.88%	0.55%

※組入債券全体を100として算出、マザーファンドベース

◆ 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ヶ月間	6ヶ月間	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）	-3.11%	-3.18%	-1.30%	1.06%	0.03%	1.62%	0.70%
ベンチマーク収益率	-3.15%	-3.28%	-2.12%	2.04%	1.06%	2.71%	2.11%
差異	0.04%	0.10%	0.82%	-0.98%	-1.02%	-1.10%	-1.41%
ファンドリスク（分配金再投資）	1.35%	1.03%	3.35%	3.37%	3.16%	2.90%	2.97%
ベンチマークリスク	1.42%	1.06%	3.36%	3.49%	3.29%	3.06%	2.96%

※ファンド（分配金再投資）の収益率とは、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入（再投資）した場合の収益率です。

※収益率は、運用期間が1年以上のものに関しては年率換算しております。

◆ 地域別構成比(%)\*

国名	ベンチマーク	債券	通貨
米国	36.9	0.2	0.1
カナダ	1.7	2.0	0.0
メキシコ	0.7	1.0	0.0
日本	16.9	16.6	99.6
オーストラリア	1.8	2.2	0.0
シンガポール	0.4	0.3	0.0
マレーシア	0.4	-	-
ユーロ通貨圏	34.1	42.1	0.2
オーストリア	1.3	1.5	-
ベルギー	2.0	2.4	-
フィンランド	0.5	0.6	-
フランス	8.8	9.1	-
ドイツ	6.3	11.6	-
アイルランド	0.7	0.8	-
イタリア	8.0	8.6	-
オランダ	1.6	1.7	-
スペイン	5.0	6.0	-
非ユーロ通貨圏	6.9	4.4	0.1
英国	5.4	3.2	0.1
デンマーク	0.4	0.3	0.0
スウェーデン	0.3	0.2	0.0
ポーランド	0.5	0.6	0.0
ノルウェー	0.2	0.1	0.0
イスラエル	0.4	-	-
キャッシュ等	-	31.2	-
合計	100.0	100.0	100.0

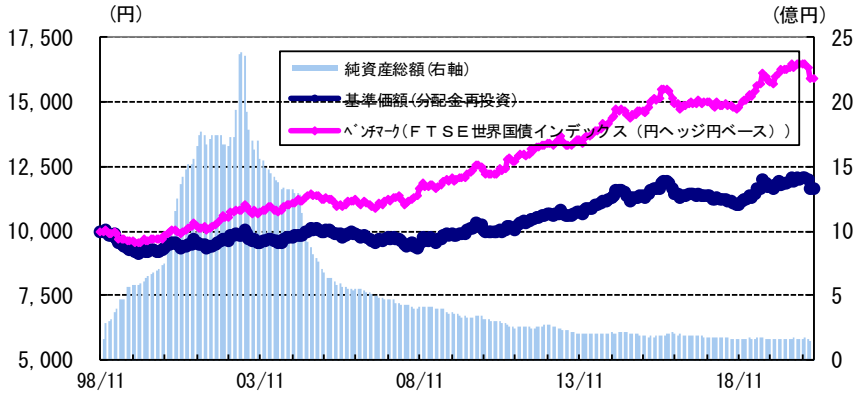
※ベンチマークはFTSE世界国債インデックス2021年4月の構成比率

※債券は発行国ベース、債券先物と金利先物を含みます。

※通貨は実質為替組入比率で表示し、「日本」は、キャッシュ等を含みます。

\* 比率は対純資産総額、マザーファンドベース

◆ 基準価額の推移グラフ



※ベンチマークは設定日前日を10,000とした指数値を使用しています。基準価額については、課税前の分配金を再投資したものと計算し指数化しておりますので、実際の基準価額とは異なります。

◆ 債券組入れ上位10銘柄(%)\*

銘柄数：280

順位	銘柄名	比率
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.125% 2022/02/28	7.7
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.125% 2022/06/30	6.8
3	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0% 2021/06/11	3.4
4	130 20年国債	3.2
5	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.25% 2026/12/01	2.0
6	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 1% 2027/05/25	1.8
7	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.25% 2024/07/30	1.7
8	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.5% 2041/4/25	1.7
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.25% 2024/08/31	1.6
10	133 5年国債	1.5

◆ 債券残存年数別

構成比(%)\*

残存年数	ウェイト
1年未満	15.7%
1~3年	15.5%
3~7年	21.2%
7~10年	10.9%
10年以上	34.3%

◆ 過去1ヶ月間のパフォーマンス分析

ファンド	0.03%
FTSE世界国債インデックス（円ヘッジ円ベース）	0.03%
差	0.00%

当月、当ファンドのパフォーマンスはベンチマークとほぼ同水準となりました。

■ 当資料は、金融商品取引法（昭和23年法第25号）に基づく開示資料ではありません。■ 「ブラックロック・ワールド債券ファンド（為替ヘッジあり）」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。■ 当資料は、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、株式など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、元金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、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■ 当資料は、ブラックロック・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。■ FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている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。