

2020年3月18日

BNYメロン・リアル・リターン・ファンド(SMA向け)(ヘッジなし)
2020年3月17日における基準価額変動について

BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社

2020年3月17日、BNYメロン・リアル・リターン・ファンド(SMA向け)(ヘッジなし)の基準価額が前日比5%以上下落いたしましたので、ご報告申し上げます。

2020年3月17日のBNYメロン・リアル・リターン・ファンド(SMA向け)(ヘッジなし)の基準価額は8,990円となり、前日比-612円、-6.37%となりました。今回の基準価額の変動の主な理由は、以下の通りです。

3月17日の基準価額は海外の株式市場の急落などを受けて大きく下落しました。基準価額算出の基準となる3月16日の外国株式市場は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて各国政府が渡航制限強化を図る中、15日には米連邦準備理事会(FRB)が緊急追加利下げを実施するなど主要中央銀行が緊急の金融緩和策を実施したものの、経済への打撃は避けられないとの見方が優勢になったことなどから大きく下落しました。

今後の展開につきましては、引き続き慎重に注視して参る所存です。

主要指数等の動き

| | 2020/03/13 | 2020/03/16 | 変化率 |
|--|------------|------------|-------|
| MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込、米ドルベース) | 946.31 | 859.91 | -9.1% |
| FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース) | 1,035.27 | 1,036.28 | +0.1% |
| ICE BofA (バンク・オブ・アメリカ)メリルリンチ適格社債インデックス(米ドルベース) | 321.04 | 319.95 | -0.3% |

出所：Bloomberg

基準価額算出時使用レート (TTM)

| | 2020/03/16 | 2020/03/17 | 変化率 |
|---------|------------|------------|-------|
| 米ドル(対円) | 106.91 | 106.60 | -0.3% |

●当資料は、ファンドの運用状況に関する情報提供を目的にBNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社が作成したものです。●資料に記載の運用実績に関するグラフ、図表、数値その他いかなる内容も過去のものであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。●ファンドに生じた利益及び損失は、すべて受益者に帰属します。

<ファンドのリスク>

当ファンドは、国内外の投資信託証券を主要投資対象としていますので、投資する投資信託証券の基準価額の変動により、当ファンドの基準価額は大きく変動することがあります。当ファンドは、元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により解約・償還金額が投資元本を下回り、損失を被る可能性があります。運用により信託財産に生じた利益または損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドは、預貯金とは異なります。預金保険または保険契約者保護機構の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。

当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「価格変動リスク」、「金利変動リスク」、「信用リスク」、「商品市況変動リスク」、「リート(不動産投信)の価格変動リスク」、「カントリー・リスク」、「流動性リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」などがあります。

※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「投資リスク」をご覧ください。

<お客様にご負担いただく費用>

お客様には以下の費用をご負担いただきます。

■ 直接ご負担いただく費用

- 購入時手数料:ありません。
- 信託財産留保額:換金申込受付日の翌営業日の基準価額×**0.3%**

■ 間接的にご負担いただく費用

- 当該ファンドの運用管理費用(信託報酬)

信託財産の日々の純資産総額×**年率 0.451%(税抜 0.41%)**

運用管理費用は、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、信託財産中から支払われますが、日々費用として計上されており、日々の基準価額は運用管理費用控除後となります。

- 投資対象とする投資信託証券の管理報酬等

・BNYメロン・グローバル・リアル・リターン・ファンド(USD Xクラス)

・・・信託財産に属する当該ファンドの日々の純資産総額×年率 0.525%程度

・マネーポートフォリオ・ファンド(適格機関投資家専用)

・・・信託財産に属する当該ファンドの日々の純資産総額×年率 0.033%(税抜 0.03%)
～0.165%(税抜 0.15%)

- 実質的な負担

年率 0.976%程度(概算)

※実際の実質的な負担は、投資信託証券の組入状況等に応じて変動します。

- その他費用・手数料

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用、目論見書等の作成、印刷および交費用ならびに公告費用等、その他の管理、運営にかかる費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が、信託財産より支払われます。

(注)この他に、投資対象とする投資信託証券においても、上記費用に類する費用がかかります。

◆その他費用・手数料については、資産規模および運用状況等により変動しますので、料率、上限額等を表示することができません

※上記費用の総額につきましては、投資家の皆様の保有される期間等により異なりますので、表示することができません。

※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「手続・手数料等」をご覧ください。

● 設定・運用は

BNY メロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社

金融商品取引業者:関東財務局長(金商)第 406 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

/ 一般社団法人 第二種金融商品取引業協会

BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社は、2020年4月1日をもって商号を「BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社」に変更する予定です。

●当資料は、ファンドの運用状況に関する情報提供を目的にBNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社が作成したものです。●当資料に記載の運用実績に関するグラフ、図表、数値その他いかなる内容も過去のものであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。●ファンドに生じた利益及び損失は、すべて受益者に帰属します。