確定拠出年金向け説明資料

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドＢコース（成長型／為替ヘッジなし）

資産運用業協会分類：追加型投信／内外／債券

本商品は元本確保型の商品ではありません

1. 投資方針

信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行ないます。

ファンドの特色

- キャピタル・グローバル・ハイインカム債券マザーファンド（為替ヘッジなし）受益証券（以下「マザーファンド」ということがあります。）への投資を通じて、内外の投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）に投資を行ない、実質的に世界各国の非投資適格格付けの社債およびエマージング債券（以下「ハイ・インカム債券」ということがあります。）等へ分散投資をすることで、信託財産の中長期的な成長を目指します。

・投資対象ファンド

- ルクセンブルク籍円建外国投資信託証券「キャピタル・グループ・グローバル・ハイ・インカム・オポチュニティーズ（LUX）（クラスC）」（以下「GHIO（クラスC）」ということがあります。）・・・世界各国のハイ・インカム債券等に投資を行ないます。
- 追加型証券投資信託「日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）」・・・わが国の短期債券等に投資を行ないます。

※実質投資割合は、「GHIO（クラスC）」を高位に維持することを基本とします。

・投資形態 ファンド･オブ･ファンズ

当ファンドは、対円での為替ヘッジを目的とした為替取引を行なわない「GHIO（クラスC）」に実質的に投資します。また、成長型ファンドです。年２回（毎年３月20日および９月20日（休業日の場合は翌営業日））決算し、分配方針に基づき分配を行ないます。

ルクセンブルク籍円建外国投資信託証券の運用の特色は以下のとおりです。

- 世界各国の非投資適格格付け*の社債およびエマージング債券を主要投資対象とします。

＊複数の格付けが付与されている場合は、低い方の格付けを基準とします。

主として世界各国のハイ・インカム債券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指します。

- キャピタル・グループのグローバルな調査力・運用力を活用します。
- 複数のポートフォリオ・マネジャーが運用に携わることによって、投資対象やアイデアの分散を図り、安定的かつ継続的に運用成果の獲得を目指します。
- 「GHIO（クラスC）」は、原則として対円での為替ヘッジを目的とした為替取引を行ないません。

2. 主要投資対象

マザーファンド

※マザーファンドが主要投資対象とする「GHIO（クラスC）」は、世界各国のハイ・インカム債券を主要投資対象とします。

3. 主な投資制限

マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。投資信託証券への実質投資割合（マザーファンドへの投資を介した投資の割合をいいます。）には、制限を設けません。株式への直接投資は、行ないません。外貨建資産への直接投資は、行ないません。デリバティブの直接利用は、行ないません。

※マザーファンドが主要投資対象とする「GHIO（クラスC）」は、原則として非投資適格格付けの社債およびエマージング債券以外への投資は、純資産総額の50%以下とする主な投資制限があります。

4. ベンチマーク

ありません。

5. 信託設定日

2022年12月15日

6. 信託期間

無期限

7. 償還条項

受益権総口数が50億口または純資産総額が50億円を下回った場合等には、繰上償還となる場合があります。

8. 決算日

毎年３月と９月の各20日（休業日の場合は翌営業日）

9. 信託報酬

信託報酬の総額：計算期間を通じて毎日、純資産総額に対して年率1.232%（税抜1.12%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

内訳：委託会社　年率0.55%（税抜）
販売会社　年率0.55%（税抜）
受託会社　年率0.02%（税抜）

当ファンドは他の投資信託証券を実質的な投資対象としており、投資対象ファンドにおける所定の信託報酬を含めて受益者が実質的に負担する信託報酬の概算は、次のとおりです。なお、投資対象ファンドの実質組入比率は運用状況に応じて変動するため、受益者が実質的に負担する実際の信託報酬の率および上限額は事前に表示することができません。

実質的な負担：年率1.239%程度（税込）

10. 信託報酬以外のコスト

法定開示にかかる費用：監査および法定書類の作成・印刷等費用は、日々の信託財産の純資産総額に年率0.05%（税込）の率を乗じて得た額の合計額を超えないものとします。

資産管理費用（カストディーフィー）：保管銀行との契約により適正な価格が計上されます。

資金の借入に伴う借入金の利息および有価証券の借入に伴う品借料：借入先との契約により適正な価格が計上されます。

受託会社による資金の立替に伴う利息：受託会社との交渉により適正な価格が計上されます。

有価証券等の売買委託手数料等：投資対象ファンドの運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限等を記載することができません。

投資対象とする外国投資信託のファンド管理費用：ファンド運用会社が、契約先との適正な価格設定により、当該ファンドから適切な費用の支払いを受けます。

■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。■「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドＢコース（成長型／為替ヘッジなし）」の受益権の募集については、キャピタル・インターナショナル株式会社は、金融商品取引法（昭和23年法第25号）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、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、株式等の値動きのある有価証券等（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。従って、投資者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。当ファンドの運用による損益は全て投資者に帰属します。

確定拠出年金向け説明資料

キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドＢコース（成長型／為替ヘッジなし）

資産運用業協会分類：追加型投信／内外／債券

本商品は元本確保型の商品ではありません

11. お申込単位
１円以上１円単位

12. お申込価額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額

13. お申込手数料
ありません。

14. ご解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額

15. 信託財産留保額
ありません。

16. 収益分配
年２回（３月と９月の各 20 日）の決算時に原則として、分配方針に基づき分配を行ないます。ただし、委託会社の判断により収益分配を行なわないことがあります。分配金は、自動的に再投資されます。

17. お申込不可日等
ルクセンブルクの銀行の休業日を含むマザーファンドが投資する投資対象ファンドが定める非営業日に当たる日です。なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、１日１件 10 億円を超える換金は行なえません。また、信託財産の残高規模、市場の流動性の状況等によっては、委託会社は、換金制限を設ける場合がある他、取引所等における取引の停止等、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、取得申込・解約請求の受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込・解約請求の受付を取消すことがあります。なお、確定拠出年金制度上、取得申込・解約請求ができない場合がありますので、運営管理機関にお問い合わせください。

18. 課税関係
確定拠出年金制度上、運用益は非課税となります。

19. 損失の可能性
当ファンドの基準価額は、後述の基準価額の変動要因等により、下落する場合があります。従って、投資者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。当ファンドの運用による損益は全て投資者に帰属します。

20. セーフティーネットの有無
投資信託は、預貯金や保険契約とは異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。

21. 持分の計算方法
基準価額×保有口数
※基準価額が 10,000 口当たりで表示されている場合は 10,000 で除してください。

22. 委託会社
キャピタル・インターナショナル株式会社
※信託財産の運用指図等を行ないます。

23. 受託会社
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社
※信託財産の保管・管理等を行ないます。

24. 基準価額の変動要因
価格変動リスク：当ファンドが実質的に投資を行なう債券等の価格は、政治・経済・社会情勢、債券等の発行体の業績や信用度、金利の変動、市場の需給関係等を反映して変動します。債券等には債務不履行等となるリスクもあります。当ファンドが実質的に投資している債券等の価格が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落し投資元本を割り込むことがあります。なお、非投資適格格付けの債券については、投資適格格付けの債券と比較して、価格が大きく変動する可能性や債務不履行等が生じるリスクが高いと想定されます。

為替変動リスク：当ファンドが実質的に投資する「GHIO（クラスC）」は、原則として対円での為替ヘッジを目的とした為替取引を行なわないため、為替変動リスクがあります。新興国通貨の為替相場は短期間に大幅に変動することがあり、先進国通貨と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。これら為替変動の影響は、基準価額の下落要因となり、投資元本を割り込むことがあります。

金利変動リスク：当ファンドが実質的に投資を行なう債券等の価格は市場金利の変動により変動することがあり、これに伴い基準価額が下落することがあります。経済環境にもよりますが、一般的に債券等は金利が上昇した場合には価格が下落し、金利が低下した場合には価格が上昇する傾向にあり、基準価額の変動要因となります。ただし、その価格変動は経済情勢や企業業績動向等により異なり、また債券の場合には残存期間・発行条件等によっても異なります。

信用リスク：債券等の発行体が経営不安、倒産、債務不履行となるおそれがある場合、または実際に債務不履行となった場合等には、当ファンドは実質的に保有する有価証券等の価格変動によって重大な損失を被ることがあります。

デリバティブに関するリスク：当ファンドが実質的に投資する外国投資信託証券は、デリバティブとよばれる金融派生商品を売買することがあります。当該商品の取引相手の業績悪化（倒産に至る場合も含みます。）等の影響により、予め定められた条件で取引が履行されない、取引の決済の際に反対売買ができない場合等には、ファンドの資産価値が減少し、当ファンドの基準価額の下落要因となることがあります。

流動性リスク：有価証券等を売却あるいは購入しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行なうことができない場合には、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となり、基準価額の下落要因となることがあります。

カントリーリスク：投資対象としている国や地域において、政治・経済・社会情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合等には、予想外に基準価額が下落したり、運用方針に沿った運用が困難となったりする場合があります。特に新興国や地域では、政情に起因する諸問題が有価証券や通貨に及ぼす影響が先進国と比較して大きくなることがあります。

※基準価額の変動要因は、上記の各リスクに限定されるものではありません。

■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。■「キャピタル・グローバル・ハイインカム債券ファンドＢコース（成長型／為替ヘッジなし）」の受益権の募集については、キャピタル・インターナショナル株式会社は、金融商品取引法（昭和 23 年法第 25 号）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、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、株式等の値動きのある有価証券等（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。従って、投資者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。当ファンドの運用による損益は全て投資者に帰属します。