



あい・パワーファンド

追加型投信 / 内外 / その他資産(通貨) / 特殊型(絶対収益追求型)

愛称: i パワー

あいグローバル・アセット・マネジメント株式会社

詳しくは「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。お申込の詳細については、販売会社にお問合わせのうえ、ご確認ください。

弊社は、この度の証券取引等監視委員会による勧告を真摯に受け止め、1月30日(土)より当ファンドの運用財産についてのより詳細な状況を確認できるまでの間、投資家保護の観点から、①新規の設定の申込受付ならびに②解約の申込受付を中止しています。



ファンドの  
目的・特色

主に先進国通貨の外国為替証拠金取引に実質的に投資を行い、安定的な収益の確保および信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

- ファンド・オブ・ファンズ形式で運用し、[Spectra SPC - Powerfund JP Segregated Portfolio] および [ユナイテッド日本債券ベビーファンド(適格機関投資家向け)] を投資対象とします。
- 原則として、実質的に投資する外貨建資産の為替ヘッジは行いません。

運用実績

ファンドの概況	
基準価額*1	10,567 円
純資産総額	6,775 百万円
設定日	2019年4月23日
信託期間	原則として2029年5月17日まで
決算日*2	毎年5月、11月の各17日

ファンドの内訳	比率*3
Spectra SPC - Powerfund JP Segregated Portfolio	97.9%
ユナイテッド日本債券ベビーファンド(適格機関投資家向け)	1.5%
現金等	0.6%
合計	100.0%

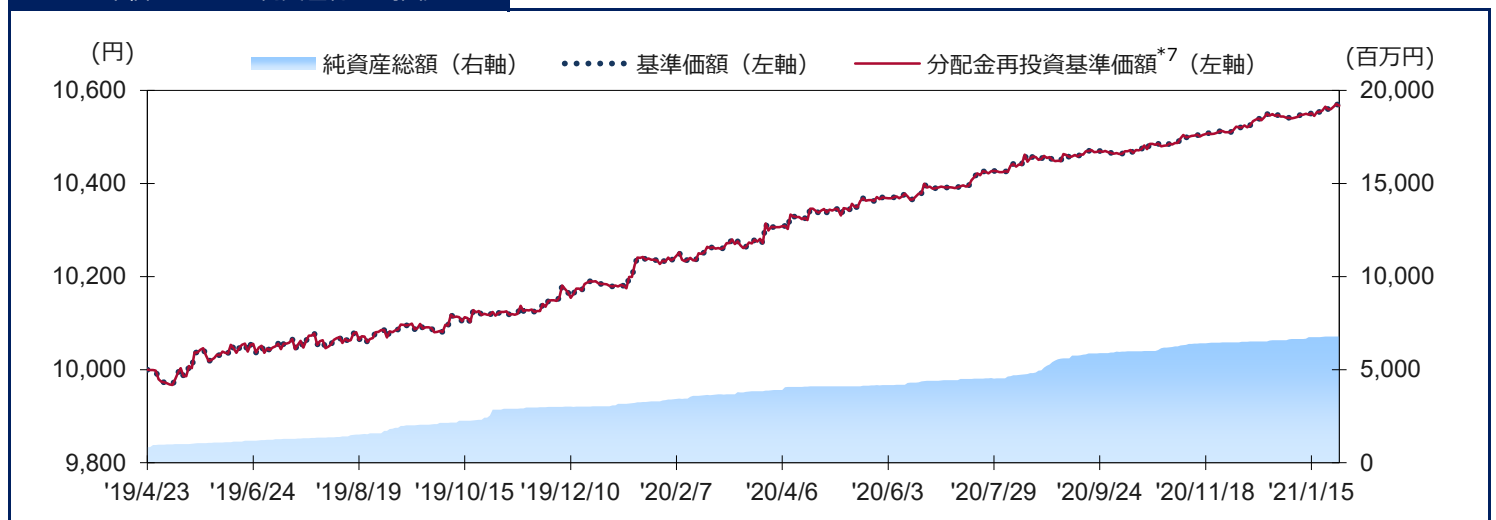
期間収益率*4	
1ヶ月	0.25%
3ヶ月	0.79%
6ヶ月	1.37%
1年	3.25%
3年	-
設定来	5.67%

設定来年率実績*4		
収益率	ボラティリティ*5	シャープ・レシオ*6
3.27%	1.22%	2.72

**ボラティリティについて**  
価格変動の度合いを示す数値で、一般に、価格変動が大きければ高くなり、逆に価格変動が小さければ低くなります。

**シャープ・レシオについて**  
投資効率の度合いを示す数値で、低いリスク(ボラティリティ)で高い投資リターンを得た場合は数値が大きくなります。

基準価額\*1および純資産総額の推移



\*1 基準価額は信託報酬(組入ファンド分を含め年率概算4.166%(税抜3.960%)程度)控除後の値です。 \*2 決算日が休業日の場合は翌営業日となります。 \*3 四捨五入の影響により比率の合計は一致しない場合があります。 \*4 期間収益率および設定来年率実績は、税引前分配金を再投資したものと仮定して算出しております。 \*5 ボラティリティは、日次の分配金再投資基準価額を基に算出しております。 \*6 シャープ・レシオの算出に際し、無担保コール翌日物を無リスク資産として採用しています。 \*7 分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと仮定して算出しております。

当資料は、あいグローバル・アセット・マネジメントが作成した販売用資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。当資料中の過去の運用成績、運用内容は将来の運用成果、運用内容を保証あるいは示唆するものではありません。投資した資産価値の増減は全て受益者の皆様に帰属します。投資に関する最終決定は必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。



あい・パワーファンド

追加型投信 / 内外 / その他資産(通貨) / 特殊型(絶対収益追求型)

愛称: i パワー

あいグローバル・アセット・マネジメント株式会社

詳しくは「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。お申込の詳細については、販売会社にお問合わせのうえ、ご確認ください。

弊社は、この度の証券取引等監視委員会による勧告を真摯に受け止め、1月30日(土)より当ファンドの運用財産についてのより詳細な状況を確認できるまでの間、投資家保護の観点から、①新規の設定の申込受付ならびに②解約の申込受付を中止しています。

運用実績

月間収益率 (%)

	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年間
2019年	-	-	-	-0.02	0.20	0.18	0.10	0.39	-0.04	0.35	0.33	0.31	1.80
2020年	0.53	0.28	0.43	0.36	0.21	0.26	0.30	0.23	0.17	0.17	0.25	0.29	3.55
2021年	0.25												0.25
月間収益率	最高		0.53%				上昇月数 / 運用月数				20ヶ月 / 22ヶ月		
	最低		-0.04%										

分配実績\*8

設定来合計	0円	
第1期	2019年11月18日	0円
第2期	2020年05月18日	0円
第3期	2020年11月17日	0円

実績報酬のハイ・ウォーター・マーク\*9

第3計算期末まで	10,356円
第4計算期末まで	10,501円

ハイ・ウォーター・マーク (以下「HWM」) について

- 当該実績報酬は、計算期間を通じて毎日、前営業日の基準価額(1万口あたり)がHWMを上回った場合、当該基準価額から当該HWMを控除して得た額に22.0%(税抜20.0%)の率を乗じて得た額に、計算日における受益権総口数を10,000で除して得た額を乗じて得た額を計上します。

$$\text{実績報酬} = (\text{前営業日の基準価額} - \text{HWM}) \times 22.0\%$$

- HWMの算出

設定日から第1計算期末まで		10,000円(1万口あたり)	
上記後の 毎計算期末	前営業日の基準価額が その時点のHWMを	上回った場合	翌日以降のHWMは、当期末前営業日基準価額から当期分配金額を差引いた水準に変更されます。
		上回らなかった場合	HWMは、変更されません。

- 当該実績報酬は、毎計算期末または信託終了のとき、当該基準価額がHWMを超えている場合に限り、信託財産中から委託会社へ支弁するものとします。
- 期中に一部解約が行われた場合、当該一部解約口数に相当する分の実績報酬は、上述の基準価額の水準に係わらず支払われます。

\*8 分配実績は直近3期分を記載しております。 \*9 ハイ・ウォーター・マークは直近2期分を掲載しております。



あい・パワーファンド

追加型投信 / 内外 / その他資産(通貨) / 特殊型(絶対収益追求型)

愛称: i パワー

あいグローバル・アセット・マネジメント株式会社

詳しくは「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。お申込の詳細については、販売会社にお問合わせのうえ、ご確認ください。

弊社は、この度の証券取引等監視委員会による勧告を真摯に受け止め、1月30日(土)より当ファンドの運用財産についてのより詳細な状況を確認できるまでの間、投資家保護の観点から、①新規の設定の申込受付ならびに②解約の申込受付を中止しています。

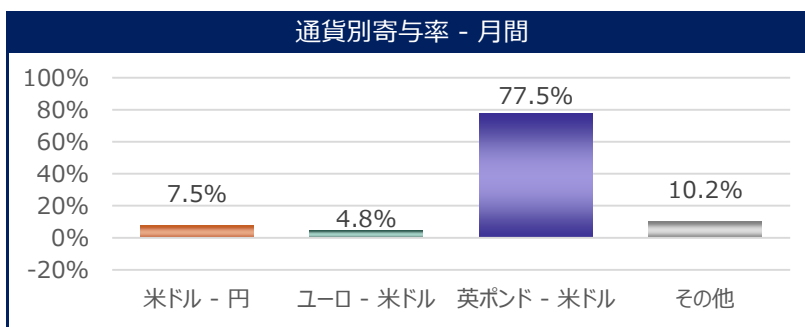
運用状況

Spectra SPC - Powerfund JP Segregated Portfolio

2021年1月29日現在

パフォーマンス分析		
月間収益率		0.54 %
過去1年間の収益率		6.94 %
設定来収益率	累積	12.82 %
	年率*1	7.43 %
設定来ボラティリティ*1		1.21 %
設定来シャープ・レシオ*2		6.17
月次収益率	最高	1.00 %
	最低	-0.09 %
月次上昇月数 / 運用月数		21ヶ月 / 22ヶ月

純資産総額 17,138 百万円



ボラティリティについて  
シャープ・レシオについて

価格変動の度合いを示す数値で、一般に、価格変動が大きければ高くなり、逆に価格変動が小さければ低くなります。投資効率の度合いを示す数値で、低いリスク(ボラティリティ)で高い投資リターンを得た場合は数値が大きくなります。

通貨別寄与率 (%) - 月次推移 過去2年

	2020年	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
米ドル - 円	7.7	-0.9	60.5	16.3	19.0	2.4	-2.9	32.6	13.9	24.1	16.6	9.7	
ユーロ - 米ドル	1.5	-4.7	-17.1	-6.9	22.0	-3.7	5.7	7.4	0.9	17.8	-2.1	4.4	
英ポンド - 米ドル	27.6	31.7	33.7	37.8	38.5	42.9	49.5	58.7	34.8	37.7	47.6	75.5	
その他	63.2	73.9	22.9	52.9	20.5	58.4	47.6	1.3	50.4	20.4	37.9	10.4	
	2021年	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
米ドル - 円	7.5												
ユーロ - 米ドル	4.8												
英ポンド - 米ドル	77.5												
その他	10.2												

出所: STI Financial Group

ユニテッド日本債券ベビーファンド (適格機関投資家向け)

2021年1月29日現在

基準価額*3	10,002 円
月間収益率*4	-0.24%
組入銘柄数	7銘柄

組入上位5銘柄	銘柄名	比率*5
1	第358回利付国債(10年) 2030年3月償還	41.3%
2	第127回利付国債(20年) 2031年3月償還	19.4%
3	第145回利付国債(20年) 2033年6月償還	9.7%
4	第130回利付国債(20年) 2031年9月償還	9.7%
5	第87回利付国債(20年) 2026年3月償還	9.2%

\*1 設定来収益率(年率)およびボラティリティは、運用会社、事務管理代行会社から提供された日次のデータを基に当社が算出しております。また、【あい・パワーファンド】の月末基準価額に反映されるデータを、当該算出における月末データとしています。\*2 シャープ・レシオの算出に際し、無担保コール翌日物を無リスク資産として採用しています。\*3 基準価額は信託報酬(0.220%(税抜0.200%))控除後の値です。\*4 収益率は、税引前分配金を再投資したものと仮定して算出しております。\*5 比率は、【ユニテッド日本債券ベビーファンド】の純資産総額に対するものです。

当資料は、あいグローバル・アセット・マネジメントが作成した販売用資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。当資料中の過去の運用成績、運用内容は将来の運用成果、運用内容を保証するものではありません。投資した資産価値の増減は全て受益者の皆様に帰属します。投資に関する最終決定は必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。



詳しくは「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。お申込の詳細については、販売会社にお問合わせのうえ、ご確認ください。

弊社は、この度の証券取引等監視委員会による勧告を真摯に受け止め、1月30日(土)より当ファンドの運用財産についてのより詳細な状況を確認できるまでの間、投資家保護の観点から、①新規の設定の申込受付ならびに②解約の申込受付を中止しています。

## 投資リスク

### 基準価額の変動要因

- 当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて相場変動のある外国為替証拠金取引などに実質的に投資しますので、当ファンドの基準価額は変動します。
- したがって、**受益者の皆様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、投資元本を割込むことがあります。**
- **信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。**
- **投資信託は預貯金と異なります。**

システム運用に係るリスク	当ファンドは、基本的にシステムによる自動取引で運用を行っています。そのため、当該システムやコンピューター・ネットワークに係る不具合、障害あるいは事故等が発生すると、一時的にファンドの運用方針に基づく運用ができなくなる可能性があり、当ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
取引執行リスク	市場の状況あるいは注文の内容によっては、市場で表示される売りまたは買いの提示価格とは異なる価格で約定が成立する場合があります。これにより収益機会を成立させる条件が失われ、想定していた収益機会を逸する可能性、あるいは損失が発生する場合があります。
裁定取引に伴うリスク	スポット裁定取引戦略においては、同一投資対象の売りと買い両方の取引を同時に同単位で成立させることを基本としますが、市場の状況等によっては売りまたは買いのいずれかの取引のみが成立する場合や、売りと買いの約定単位が異なる場合があります。これにより収益機会を成立させる条件が失われ、想定していた収益機会を逸する可能性、あるいは損失が発生する可能性があります。
ブローカーの信用リスク	取引先ブローカーの信用状況が悪化することにより、売買取引、決済、あるいは預託金返還等が困難になる可能性があります。その場合、想定していた取引を行うことが出来ず、損失が発生し、基準価額の下落要因となることがあります。
為替変動リスク	一般的に、外国為替相場が円高となった場合には、実質的に保有する外貨建資産に為替差損（円換算した評価額が減少すること）が発生することにより、ファンドの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	投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、またはそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。
レバレッジ・リスク	証拠金取引では、少額の投資資金（証拠金）を差入れることによりその何倍もの取引を行うことが可能です。一般的に、証拠金額に比した取引額（レバレッジ）を大きくすれば、相場の変動が小幅であっても、利益または損失が短期間に大きくなる可能性が高まります。
利益相反リスク	当ファンドが投資する投資信託証券（以下「当対象ファンド」）の運用会社およびその関連会社（以下「運用会社等」）は、当対象ファンドに係る以外の事業活動に従事し、当対象ファンドの顧客以外の顧客（以下「他顧客」）の口座を管理することができます。この場合に、他顧客のために行われる取引が、当対象ファンドの投資対象資産の価格等に影響を与え、当対象ファンドのパフォーマンスに悪影響を及ぼす可能性があります。また、当該運用会社等は、当対象ファンドのそれに類する、あるいは異なる運用戦略および業務サービスを、当対象ファンド以外のファンド等に提供することができます。その結果、運用会社等は、運用時間、業務および機能を全顧客間に配分する場合に利益相反となる可能性があります。 また、当ファンドの委託会社の関連会社は、当対象ファンドの運用に係る業務サービスを提供することができます。

※ 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。

当資料は、あいグローバル・アセット・マネジメントが作成した販売用資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。当資料中の過去の運用成績、運用内容は将来の運用成果、運用内容を保証あるいは示唆するものではありません。投資した資産価値の増減は全て受益者の皆様に帰属します。投資に関する最終決定は必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。



詳しくは「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。お申込の詳細については、販売会社にお問合わせのうえ、ご確認ください。

弊社は、この度の証券取引等監視委員会による勧告を真摯に受け止め、1月30日(土)より当ファンドの運用財産についてのより詳細な状況を確認できるまでの間、投資家保護の観点から、①新規の設定の申込受付ならびに②解約の申込受付を中止しています。

## 投資リスク

### その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドが主要投資対象とする指定投資信託証券の一部は、外部の運用会社が運用しており、当該運用会社の業務または財産の状況の変化、運用担当者の交代、その他の理由により、運用に支障が出る場合があります。  
また、指定投資信託証券の見直しは、パフォーマンスの一層の向上を目指すものではありませんが、指定投資信託証券の入替や組入比率の変更が、結果としてファンドの基準価額下落の原因となる場合があります。
- 一部解約金の支払資金を手当するために、当ファンドが投資する投資信託証券において、組入れている資産等を大量に売却あるいは反対売買する場合があります。この場合、市場規模や市場動向によっては、組入資産等を当初期待された価格で売却あるいは反対売買できないことがあり、当ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- 換金請求額が多額な場合、解約制限が設けられている「Spectra SPC - Powerfund JP Segregated Portfolio」において解約請求の受付が中止・取消または延期された場合には、換金のお申込の受付を中止すること、既に受付けた換金のお申込の受付・約定を取消すこと、および換金代金の支払を延期することがあります。また、金融商品取引所等における取引の停止、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、購入・換金（解約）の受付を中止すること、および既に受付けた購入・換金（解約）申込の受付を取消す場合があります。
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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を超えて支払われる場合があるため、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。また、投資者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払戻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。

当資料は、あいグローバル・アセット・マネジメントが作成した販売用資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。当資料中の過去の運用成績、運用内容は将来の運用成果、運用内容を保証あるいは示唆するものではありません。投資した資産価値の増減は全て受益者の皆様に帰属します。投資に関する最終決定は必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。



あい・パワーファンド

追加型投信 / 内外 / その他資産(通貨) / 特殊型(絶対収益追求型)

愛称: i パワー

あいグローバル・アセット・マネジメント株式会社

詳しくは「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。お申込の詳細については、販売会社にお問合わせのうえ、ご確認ください。

弊社は、この度の証券取引等監視委員会による勧告を真摯に受け止め、1月30日(土)より当ファンドの運用財産についてのより詳細な状況を確認できるまでの間、投資家保護の観点から、①新規の設定の申込受付ならびに②解約の申込受付を中止しています。

お申込メモ

購入・換金 申込の受付	原則として、毎営業日に購入および換金(解約)お申込の受付を行い、午後3時までに販売会社が受付けた分を当日のお申込分とします。ただし、以下の条件に該当する日においては購入および換金(解約)のお申込ができません。 ● 香港もしくはケイマンの銀行休業日
購入単位	販売会社が定める単位
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額(1万口あたりで表示しています。)
信託期間	原則として2029年5月17日までです。
決算日	毎年5月、11月の各17日(休業日の場合は翌営業日。)
収益分配	年2回の決算時に、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。
換金単位	1口単位(販売会社により異なる場合があります。)
換金価額	換金(解約)申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた額とします。
換金代金支払日	原則として換金(解約)申込受付日から起算して8営業日目からお支払します。
課税関係	課税上は、株式投資信託として取扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。 配当控除の適用はありません。 詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

ファンドに係る費用等(お客様には以下の費用をご負担いただきます。)

投資者が直接的に負担する費用	購入時手数料	購入申込受付日の翌営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た額に、 <b>3.30%(税抜3.00%)</b> を上限として販売会社が定める料率を乗じて得た額とします。
	信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に申込口数を乗じて得た額に、 <b>1.00%</b> の率を乗じて得た額とします。
投資者が信託財産で間接的に負担する費用	実質的な信託報酬	純資産総額に対して <b>年率概算4.166%(税抜3.960%)</b> 程度(当ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬等を含めた値です。)
	実績報酬	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 運用の実績に応じて実績報酬が発生します。</li> <li>● 当該実績報酬は、計算期間を通じて毎日、前営業日の基準価額(1万口あたり)がハイ・ウォーター・マークを上回った場合、当該基準価額から当該ハイ・ウォーター・マークを控除して得た額に22.0%(税抜20.0%)の率を乗じて得た額に、計算日における受益権総口数を10,000で除して得た額を乗じて得た額を計上します。</li> <li>● 当該実績報酬は、毎計算期末または信託終了のとき、基準価額がハイ・ウォーター・マークを超えている場合に限り、信託財産中から委託会社に支弁するものとします。</li> </ul>
投資者が信託財産で間接的に負担する費用	その他の費用・手数料	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 組入価証券取引に伴う手数料(売買委託手数料、保管手数料等)</li> <li>● 信託財産に関する租税</li> <li>● 計理およびこれに付随する業務に係る費用</li> <li>● 目論見書等の作成および交付に係る費用</li> <li>● 運用報告書の作成および交付に係る費用</li> <li>● 公告に係る費用</li> <li>● 法律顧問および税務顧問に係る報酬および費用等</li> </ul> <p>その他に、ファンドの監査費用が信託財産から支払われます。 なお、投資対象の投資信託証券においても同様の費用がかかり、当該投資信託証券の信託財産から支払われます。 ※ 監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。 ※ これらの費用等は、運用状況等により変動するため、一部を除き料率、上限等をあらかじめ表示することが出来ません。</p>
		これらの費用の内、当ファンドの信託事務の処理等に要する諸費用の信託財産での負担は、その純資産額に対して年率0.200%を上限とします。

当資料は、あいグローバル・アセット・マネジメントが作成した販売用資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。当資料中の過去の運用成績、運用内容は将来の運用成果、運用内容を保証あるいは示唆するものではありません。投資した資産価値の増減は全て受益者の皆様に帰属します。投資に関する最終決定は必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。



詳しくは「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。お申込の詳細については、販売会社にお問合わせのうえ、ご確認ください。

弊社は、この度の証券取引等監視委員会による勧告を真摯に受け止め、1月30日(土)より当ファンドの運用財産についてのより詳細な状況を確認できるまでの間、投資家保護の観点から、①新規の設定の申込受付ならびに②解約の申込受付を中止しています。

### 委託会社およびその他の関係法人

委託会社	あいグローバル・アセット・マネジメント株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第414号 一般社団法人 投資信託協会 会員 一般社団法人 日本投資顧問業協会 会員 一般社団法人 第二種金融商品取引業協会 会員 信託財産の運用指図を行います。
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社 信託財産の管理業務等を行います。
販売会社	受益権の募集の取扱・販売を行い、投資信託説明書（交付目論見書）・運用報告書の交付、信託契約の解約（換金）に関する事務、収益分配金の支払、収益分配金の再投資および償還金の支払に関する事務等を行います。

委託会社の電話番号 03-6230-9011（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

委託会社のインターネット・ホームページ [www.igam.co.jp/](http://www.igam.co.jp/)

### 販売会社一覧（順不同）

金融商品取引業者名		登録番号	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
あい証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長 (金商) 第236号	●		●	●
あかつき証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長 (金商) 第67号	●	●	●	
アーク証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長 (金商) 第1号	●			
F P L証券株式会社	金融商品取引業者	北海道財務局長 (金商) 第45号	●	●		
山和証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長 (金商) 第190号	●			
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長 (金商) 第195号	●	●	●	●

※加入している金融商品取引業協会を●で表示しています。上記の表は、あいグローバル・アセット・マネジメントが基準日時点で知りうる信頼性が高いと判断した情報等から細心の注意を払い作成したものです。その正確性、完全性を保証するものではありません。

当資料は、あいグローバル・アセット・マネジメントが作成した販売用資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。当資料中の過去の運用成績、運用内容は将来の運用成果、運用内容を保証あるいは示唆するものではありません。投資した資産価値の増減は全て受益者の皆様に帰属します。投資に関する最終決定は必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。