

【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月6日提出
【ファンド名】	日興グローバル・ボンド&カレンシー・ロング・ショート 2004-09
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 佐谷戸 淳一
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【提出理由】

「日興グローバル・ボンド&カレンシー・ロング・ショート 2004-09」（以下、当ファンドといいます。）および投資対象である「グローバル・ボンド&カレンシー・ロング・ショート・マザーファンド」（以下、投資対象マザーファンドといいます。）につきまして、2021年12月末に円LIBORの公表が停止されることに伴ない運用の基本方針などに変更がありますので、金融商品取引法第24条の5第4項および特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第3号の規定に基づき、本臨時報告書を提出するものです。

2【報告内容】

イ 変更の内容についての概要

ベンチマークの変更について

投資対象マザーファンドについて、現在、運用におけるベンチマークを「1ヵ月円LIBOR金利」としております。このたび、2021年12月末に円LIBORの公表が停止されることに伴ない、当該ベンチマークを「1ヵ月東京ターム物リスク・フリー・レート」（以下、1ヵ月TORFといいます。）に変更いたします。

成功報酬の計算において参照する金利指標の変更について

当ファンドの成功報酬の計算において利用する累積ベンチマークにつき、参照する金利指標を「1ヵ月円LIBOR」から「1ヵ月TORF」に変更いたします。

変更前	成功報酬 = 累積ベンチマーク超過額 ¹ × 20% 1) 累積ベンチマーク超過額 = 基準価額（成功報酬控除前） - 1ヵ月円LIBOR累積ベンチマーク ² 2) 1ヵ月円LIBOR累積ベンチマーク = 採用計算基準価額 × 1ヵ月円LIBOR指数（1ヵ月円LIBORを参照）
変更後	成功報酬 = 累積ベンチマーク超過額 ¹ × 20% 1) 累積ベンチマーク超過額 = 基準価額（成功報酬控除前） - 円短期金利累積ベンチマーク ² 2) 円短期金利累積ベンチマーク = 採用計算基準価額 × 円短期金利指数（1ヵ月TORFを参照）

変更実施日（2021年11月23日）を含む2021年7月27日から2022年1月24日までの計算期間（以下、対象計算期間といいます。）における累積ベンチマークの計算について、補足説明いたします。

・対象計算期間における「採用計算基準価額」について、2021年11月23日以降も変更前の規定に基づいて定義されます。

・対象計算期間における「円短期金利指数」について、2021年11月23日以降の計算において利用する2021年11月22日までの値は、「1ヵ月円LIBOR」を参照する変更前の規定に基づいて定義されます。

ロ 当該変更の年月日

2021年11月23日