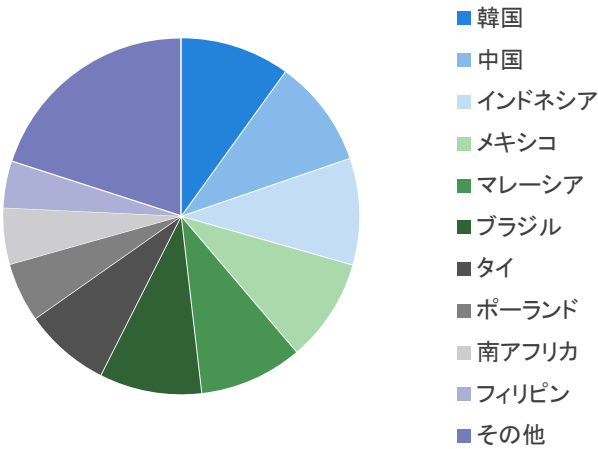


上場インデックスファンド新興国債券（1566）
＜上場新興国債（愛称） 追加型投信/海外/債券/ETF/インデックス型＞

＜投資方針＞

当ファンドは、主として別に定める投資信託証券の一部またはすべてに投資を行ない、信託財産の1口あたりの純資産額の変動率を、円換算したブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの変動率に一致させることをめざして運用を行ないます。

組入国別アロケーション



ファンド情報

設定日	2012年1月30日
上場日	2012年3月30日
上場市場	東京証券取引所
信託期間	無期限
売買単位	1口
組入銘柄数	321 銘柄
決算日	年6回(奇数月各10日)
Bloombergコード	1566 jp equity
iNAVコード	1566JP1V index
連動対象指数コード	EML1TRUU index
運用状況	
純資産総額	190 億円
基準価額(1口当たり)	49,632 円
信託報酬率	0.450%
	(税込0.495%)

資産構成

国債	97.82%
現金・その他資産	2.18%

※ 当ファンドの投資状況です。

ファンドの騰落率

累積騰落率	分配金込み基準価額	ベンチマーク
年初来	4.32%	4.52%
1ヵ月	0.43%	0.64%
3ヵ月	4.32%	4.52%
6ヵ月	8.96%	8.47%
1年間	18.07%	18.09%
上場来	72.62%	100.51%
年間騰落率		
2023	19.14%	19.04%
2022	2.51%	3.64%
2021	1.42%	2.54%
2020	-1.74%	-0.73%
2019	9.61%	10.93%

※分配金込み基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものです。

分配金実績

分配金実績	分配金(1口当たり)
2024年3月10日	382円00銭
2024年1月10日	398円00銭
2023年11月10日	384円00銭
2023年9月10日	385円00銭
2023年7月10日	369円00銭

組入上位銘柄

組入上位銘柄	通貨	クーポン	償還日	比率
CHINA GOVERNMENT BOND	CNH	3.22%	2025年12月6日	1.62%
LETRA TESOURO NACIONAL	BRL	0.00%	2026年1月1日	1.55%
LETRA TESOURO NACIONAL	BRL	0.00%	2026年7月1日	1.48%
MEX BONOS DESARR FIX RT	MXN	5.75%	2026年3月5日	1.20%
MEX BONOS DESARR FIX RT	MXN	7.75%	2031年5月29日	1.15%
LETRA TESOURO NACIONAL	BRL	0.00%	2025年7月1日	1.11%
NOTA DO TESOURO NACIONAL	BRL	10.00%	2027年1月1日	1.05%
MEX BONOS DESARR FIX RT	MXN	7.50%	2027年6月3日	1.03%
MEX BONOS DESARR FIX RT	MXN	7.00%	2026年9月3日	1.03%
NOTA DO TESOURO NACIONAL	BRL	10.00%	2029年1月1日	1.00%

利回り等

指標	
平均クーポン	4.75%
平均直接利回り	4.99%
平均最終利回り	6.12%
平均デュレーション	6.08 年
平均残存期間	8.69 年

※ 当ファンドの投資状況です。
※ 上記は個別債券について加重平均したものです。
※ 各利回りは、将来得られる期待利回りを示すものではありません。

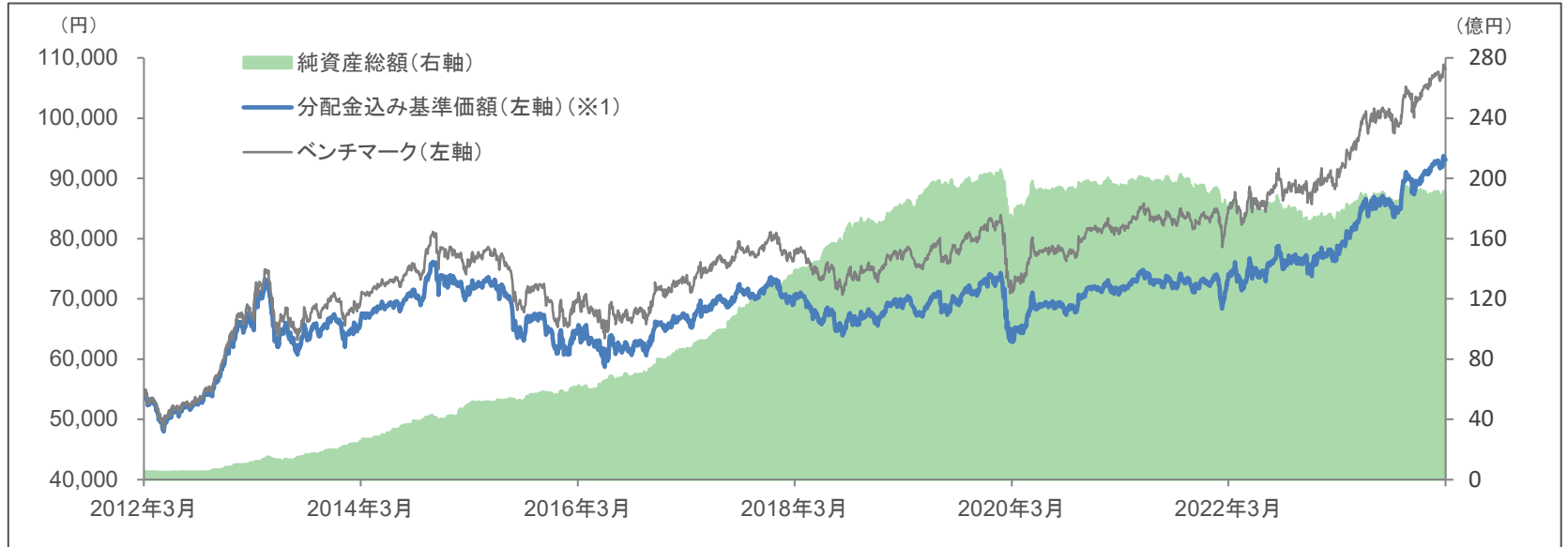
※ 当ファンドの投資状況です。※ 比率は純資産総額を分母として計算したものです。
※ 個別の銘柄の取引を推奨するものではありません。※ 上記銘柄については将来の組入れを保証するものではありません。
※ グラフおよびデータは過去のものであり、将来の運用成果などを約束するものではありません。

■当資料は、投資者の皆様へ「上場新興国債（愛称）」へのご理解を高めていただく事を目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。

上場インデックスファンド新興国債券(1566)

<上場新興国債(愛称) 追加型投信/海外/債券/ETF/インデックス型>

基準価額と純資産総額の推移 (2012/3/30 - 2024/3/31)



※1 分配金込み基準価額は、分配金(税引前)を再投資し、信託報酬控除後の基準価額を表示しています。
 ※ グラフおよびデータは過去のものであり、将来の運用成果などを約束するものではありません。
 ※ ベンチマークは、グラフの始点の基準価額に合わせて指数化しております。

手数料等の概要

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 **販売会社が独自に定める額**
 ※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 ※購入時手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。
- 換金時手数料 **販売会社が独自に定める額**
 ※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 ※換金時手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。
- 信託財産留保額 **換金時の基準価額に対し0.3%**
<投資者が信託財産で間接的に負担する費用>
- 運用管理費用 (信託報酬)
 当ファンド: ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.385%(税抜0.35%)以内(有価証券届出書提出日現在、税抜0.35%)
 運用管理費用は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払われます。
 投資対象とする投資信託証券: 純資産総額に対し0.11%(税抜0.1%)程度
実質的な負担: 純資産総額に対し年率0.495%程度(税抜0.45%)程度
 ※投資対象とする投資信託証券の組入比率や当該投資信託証券の変更などにより変動します。
- その他の費用・手数料
ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限とする額
 ①目論見書などの作成および交付に係る費用、②計理およびこれに付随する業務に係る費用、③決算短信の作成に係る費用(①~③の業務を委託する場合の委託費用を含みます。)、④監査費用、⑤ファンドの上場に係る費用、⑥「ブルームバーグ 自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックス」の標準使用料などは、委託会社が定めた時期に、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。
 組入る有価証券の売買委託手数料、資産を外国で保管する場合の費用、借入金の利息、立替金の利息および貸付有価証券関連報酬(有価証券の貸付を行なった場合は、信託財産の収益となる品賃料に0.55(税抜0.5)以内(有価証券届出書提出日現在、税抜0.5)を乗じて得た額)などがその都度、信託財産から支払われます。
 ※運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。
- 売買委託手数料など
 組入る有価証券の売買委託手数料、資産を外国で保管する場合の費用、借入金の利息、立替金の利息および貸付有価証券関連報酬(有価証券の貸付を行なった場合は、信託財産の収益となる品賃料に0.55(税抜0.5)以内(有価証券届出書提出日現在、税抜0.5)を乗じて得た額)などがその都度、信託財産から支払われます。
 ※運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。

※投資者の皆様にご負担いただくファンドの費用などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、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)をご覧ください。

投資リスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。基準価額変動リスクの大きいファンドですので、お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

● 基準価額の変動要因

投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、市場取引価格または基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
 当ファンドは、主に債券を実質的な投資対象としますので、債券の価格の下落や、債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

上場インデックスファンド新興国債券（1566） ＜上場新興国債（愛称） 追加型投信/海外/債券/ETF/インデックス型＞

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

【価格変動リスク】

- ・ 公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・ 新興国の債券は、先進国の債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

【流動性リスク】

- ・ 市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・ 新興国の債券は、先進国の債券に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

【信用リスク】

- ・ 公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・ 新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。

【為替変動リスク】

- ・ 外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・ 一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

【カントリー・リスク】

- ・ 投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・ 一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。

【有価証券の貸付などにおけるリスク】

- ・ 有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク（取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク）を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

＜円換算したブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスと基準価額の主な乖離要因＞

当ファンドは、基準価額の変動率を円換算したブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの変動率に一致させることをめざしますが、当ファンドおよび投資対象とする投資信託証券には、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

- ・ 資金の流入から実際に投資信託証券を買い付けるタイミングのずれの発生。
- ・ ブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの採用銘柄以外の銘柄に投資をすることがあること、ブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの採用銘柄の変更や構成比率の変更などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
- ・ 有価証券の貸付による品賃料が発生すること。
- ・ 先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックスの採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

◇金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額の乖離

当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などに左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

※ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

※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。

● その他の留意事項

- ・ 当資料は、投資者の皆様へ「上場新興国債（愛称）」へのご理解を高めていただくことを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。
- ・ 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。
- ・ 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護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。
- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・ 投資信託の運用による損益は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・ ETFを金融商品取引所で売買される場合には、委託会社作成の投資信託説明書（交付目論見書）は交付されません。売買をお申込みになる証券会社に、当該取引の内容についてご確認ください。
- ・ 株式または金銭の拠出により当ファンドの取得（応募、追加設定）をご希望の場合には投資信託説明書（交付目論見書）を販売会社（指定参加者）よりお渡しいたしますので、必ず内容をご確認ください。

上場インデックスファンド新興国債券（1566）

＜上場新興国債（愛称） 追加型投信/海外/債券/ETF/インデックス型＞

指数の著作権などについて

「Bloomberg®」およびブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックス（以下「当指数」）は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）、および当指数の管理者であるブルームバーグ・インデックス・サービス・リミテッド（Bloomberg Index Services Limited）（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、日興アセットマネジメント株式会社（以下「日興アセット」）による特定の目的での使用のために使用許諾されています。

上場インデックスファンド新興国債券（以下「当ファンド」）について、ブルームバーグは後援、支持、販売、または宣伝するものではありません。ブルームバーグは、一般的な証券への投資の推奨可能性または特に当ファンドへの投資の推奨可能性について、当ファンドの所有者もしくは相手先に、あるいは一般の人々に、明示、黙示を問わずいかなる表明、保証も行いません。日興アセットとブルームバーグの唯一の関係は、特定の商標、商号、サービスマークの使用許諾、および当指数の使用許諾であり、これは、日興アセットまたは当ファンドを考慮せずに、BISLが決定、構成、計算します。ブルームバーグは当指数を決定、構成、もしくは計算する際に、日興アセットまたは当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務はありません。ブルームバーグは当ファンドの発行時期、発行価格、発行数について責任を負わず、それに関与していません。ブルームバーグは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、当ファンドの顧客（これらに限定されません）に対し、いかなる義務、法的責任も負いません。

ブルームバーグは、当指数もしくはそれらに関連するデータの正確性および／または完全性を保証するものではなく、それに関連する過誤、不作為、または中断に対して一切の責任を負いません。ブルームバーグは、日興アセット、当ファンドの所有者、もしくはその他の個人または法人が当指数、またはそれに関連するデータを使用したことで、獲得する結果について、明示的にも黙示的にもいかなる保証も行いません。ブルームバーグは、当指数もしくはそれらに関連するデータについて、特定の目的もしくは使用に対する商品性または適合性に関する明示的、黙示的な保証を行わず、あらゆる保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、法律で最大限に許される限り、ブルームバーグ、そのライセンサー、およびそれぞれの従業員、請負業者、エーエージェント、サプライヤー、ベンダーは、当ファンド、当指数またはそれらに関するデータまたは値について、過失、その他によるかにかかわらずその可能性について知らされていた場合でも、直接的、間接的、結果的、偶発的、懲罰的、またはそれ以外の被害または損害について法的責任もしくは責任を負いません。

■当資料は、投資者の皆様へ「上場新興国債（愛称）」へのご理解を高めていただく事を目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。