

i F r e e 新興国債券インデックス

元本確保型の商品ではありません

◆ファンドの特色

- ・主な投資対象 …… 外国債券
- ・ベンチマーク …… JP モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)
- ・目標とする運用成果 …… ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行います。

◆基準価額、純資産総額

基準価額	11,531円
純資産総額	48.50億円

\* 既出分配金累計：0円

◆資産構成

債券	96.41%
債券先物	0.00%
債券実質	96.41%
現金等	3.59%

\* 比率は純資産総額対比です。  
(ヘビーファンドの実質組入比率にて計算しています。)

◆為替ヘッジ

為替ヘッジ比率	-
---------	---

\* 当ファンドは為替ヘッジを行いません。

◆ポートフォリオプロフィール

	ファンド	ベンチマーク
残存年数(年)	7.27	7.32
デュレーション(年)	5.24	5.28
複利利回り	4.86%	4.99%

\* ファンドの数値はヘビーファンドの実質組入債券の数値です。  
\* 上記デュレーションは、修正デュレーションを記載しています。

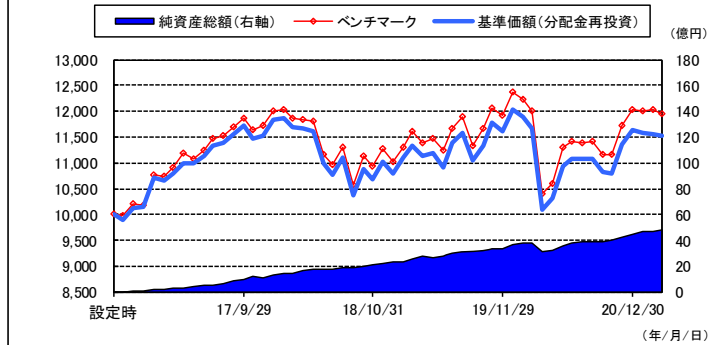
◆ファンド(分配金再投資)とベンチマークの収益率とリスク(標準偏差)

	3ヶ月間	6ヶ月間	1年間	3年間	5年間	10年間	設定来
ファンド収益率(分配金再投資)	-1.06%	6.50%	14.07%	-0.37%	-	-	3.47%
ベンチマーク収益率	-0.76%	6.92%	14.95%	0.33%	-	-	4.10%
差異	-0.30%	-0.41%	-0.88%	-0.70%	-	-	-0.63%
ファンドリスク(分配金再投資)	-----	-----	8.56%	13.02%	-	-	11.22%
ベンチマークリスク	-----	-----	8.68%	13.07%	-	-	11.30%

\* ファンド収益率(分配金再投資)とは、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入(再投資)した場合の収益率です。  
\* 収益率・リスクともに月次収益率より算出。なお設定日が月中の場合、設定日が属する月の月次収益率は含んでいません。  
\* 収益率は期間が1年以上の場合は年率換算しております。期間が1年未満のものについては年率換算していません。

◆基準価額の推移

- ・基準価額(分配金再投資)とベンチマークとの比較グラフです。
- ・月末最終営業日データ(分配金再投資基準価額・純資産総額)を使用しています。
- ・設定日(2016/9/8)の前日の基準価額とベンチマークを10,000として指数化したものです。
- ・ベンチマークは、JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(米ドルベース)に基づき、大和アセットマネジメント株式会社が計算したものです。



◆通貨別構成比

通貨	ファンドウエート
オフショア人民元	10.09%
インドネシア・ルピア	9.59%
メキシコ・ペソ	9.53%
タイ・バーツ	8.56%
ブラジル・レアル	8.07%
その他	54.16%

\* ファンドウエートは当ファンドの対純資産総額比です。

◆公社債残存別構成比

残存年数	ファンドウエート
1年未満	0.58%
1年以上～3年未満	21.35%
3年以上～7年未満	36.85%
7年以上～10年未満	19.69%
10年以上	21.52%

\* ファンドウエートは当ファンドの対債券ポートフォリオ比です。

◆組入上位銘柄

(組入銘柄数 242)

銘柄名	ファンドウエート	通貨	残存年数
1 Brazil Letras do Tesouro Nacional	2.08%	ブラジル・レアル	2.76
2 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1.52%	南アフリカ・ランド	5.73
3 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	1.28%	ブラジル・レアル	1.75
4 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	1.13%	ブラジル・レアル	3.75
5 Brazil Letras do Tesouro Nacional	1.08%	ブラジル・レアル	2.25
6 Mexican Bonos	0.96%	メキシコ・ペソ	8.17
7 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	0.96%	ブラジル・レアル	5.75
8 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	0.95%	南アフリカ・ランド	8.84
9 Poland Government Bond	0.94%	ポーランド・ズロチ	5.32
10 Mexican Bonos	0.90%	メキシコ・ペソ	6.18

\* ファンドウエートは当ファンドの対純資産総額比です。

◆過去3ヶ月間のパフォーマンス分析

多くの投資対象国の債券価格が下落(金利は上昇)した結果、基準価額は下落しました。

■当資料は、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、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、大和アセットマネジメント株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成されましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。■上記「基準価額」は、運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。■JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J. P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J. P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J. P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.