

# ダイワ豪ドル建て高利回り証券α (毎月分配型)

&lt;5626&gt;

追加型投信／海外／資産複合

第117期 2024年 5月17日決算 第120期 2024年 8月19日決算

第118期 2024年 6月17日決算 第121期 2024年 9月17日決算

第119期 2024年 7月17日決算 満期償還 2024年10月17日償還

## 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資するとともに、オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略を構築し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしており、信託期間中につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

償還時	基準価額	4,757円12銭
	純資産総額	1,667百万円
第117期～償還期	騰落率	△2.4%
	分配金合計	150円

(注) 騰落率は分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

運用報告書に関するお問い合わせ先



コールセンター 受付時間 9:00～17:00 (営業日のみ)  
0120-106212

お客様の口座内容に関するご照会は、  
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。

■当ファンドは、信託約款において「運用報告書(全体版)」に記載すべき事項を電磁的方法によりご提供することを定めており、以下の手順で閲覧、ダウンロードいただけます。「運用報告書(全体版)」は受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社へお問い合わせください。



見やすく読みまちがえにくい  
ユニバーサルデザインフォント  
を採用しています。

◇TKU0562620241017◇

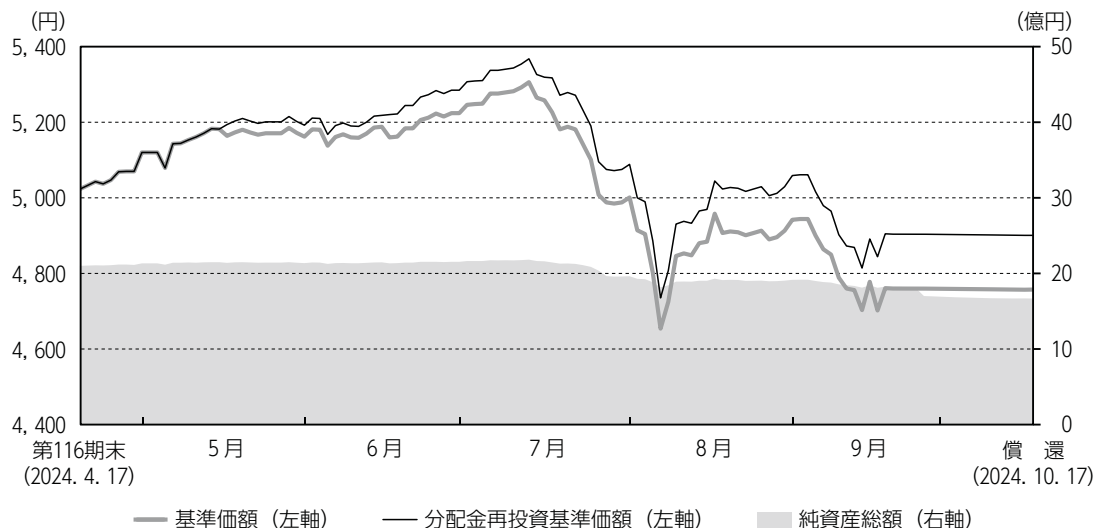
「運用報告書(全体版)」の閲覧・ダウンロード方法

上記のURLにアクセス → ページ下方の「償還済みファンド(運用報告書)」を選択 → リストから当ファンドの「一覧」をクリック → 目的の運用報告書(全体版)を選択



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

\* 分配金再投資基準価額は、分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまご利用のコースにより異なります (分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

### 基準価額・騰落率

第117期首：5,023円

償還時：4,757円12銭 (既払分配金150円)

騰落率：△2.4% (分配金再投資ベース)

### 基準価額の主な変動要因

償還前1カ月をめぐり安定運用に入るまでの期間、豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券等に投資するとともに、オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略を構築した結果、豪ドル円が下落 (円高) したことから、基準価額は下落しました。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第117期～償還期 (2024. 4. 18～2024. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	30円	0.594%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当作成期中の平均基準価額は5,015円です。</b>
（投 信 会 社）	(8)	(0.165)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(21)	(0.413)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(1)	(0.016)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.012	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（投 資 信 託 受 益 証 券）	(1)	(0.012)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	—	—	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
合 計	30	0.606	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

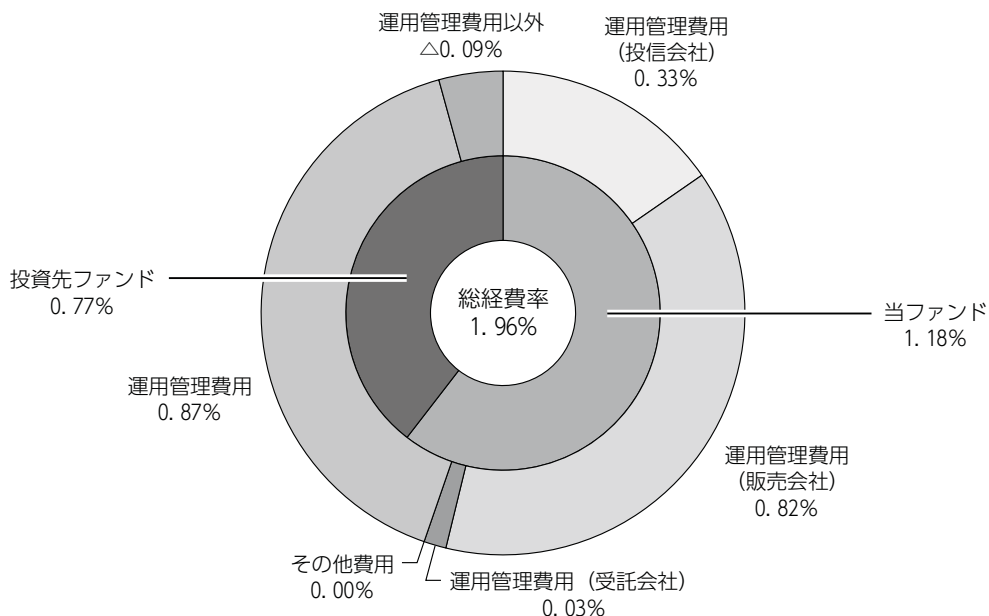
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## 参考情報

### ■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.96%です。



総経費率（① + ② + ③）	1.96%
①当ファンドの費用の比率	1.18%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.87%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	△0.09%

(注1) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用は、1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

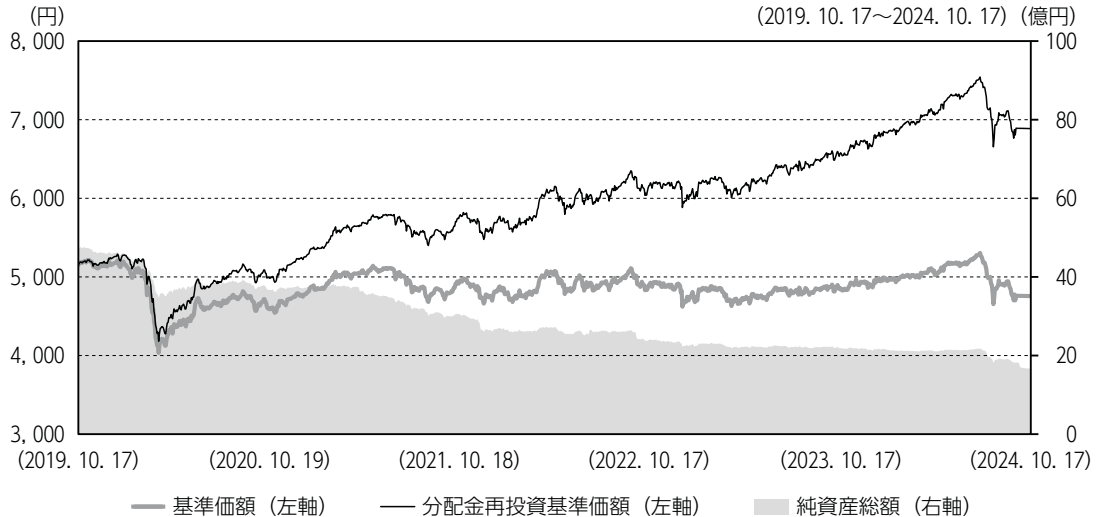
(注6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

(注9) 投資先ファンドの運用管理費用以外は、当初積み立てた見積費用よりも実際の費用がかからなかったことから、マイナスの費用（収入）となっています。

最近 5 年間の基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、2019年10月17日の基準価額をもとに指数化したものです。

	2019年10月17日 期初	2020年10月19日 決算日	2021年10月18日 決算日	2022年10月17日 決算日	2023年10月17日 決算日	2024年10月17日 償還時
基準価額 (円)	5,149	4,600	4,921	4,841	4,844	4,757.12
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	390	360	360	360	330
分配金再投資基準価額の騰落率 (%)	—	△3.0	15.1	5.9	7.8	4.9
純資産総額 (百万円)	4,711	3,671	3,051	2,371	2,184	1,667

(注1) 比率は小数点第1位未満を四捨五入してあります。

(注2) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

## 設定以来の投資環境について

（2014. 6. 18～2024. 10. 17）

### ■ オーストラリア債券市場

オーストラリア債券市場では、金利は上昇（債券価格は下落）しました。

オーストラリア債券市場では、当ファンド設定日以降、ウクライナ情勢の悪化や、RBA（オーストラリア準備銀行）が政策金利を引き下げたこと、さらに2016年6月後半には英国のEU（欧州連合）離脱の是非を問う国民投票でEU離脱派が勝利したことなどから、9月にかけて、オーストラリア金利は低下（債券価格は上昇）基調で推移しました。その後、米国の政策金利が断続的に引き上げられたことなどを背景に欧米の金利が上昇する中、オーストラリア金利はやや水準を切上げてレンジ推移となりました。2019年に入ると、米国の利上げ打ち止めや世界的なインフレ沈静を背景にオーストラリア金利は低下に転じ、特に2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などからリスク回避的な動きが強まりました。年半ばにかけては、世界的な経済活動の低迷への懸念から株価や原油価格が下落し、RBAを含め各国の中央銀行が大幅な金融緩和に積極的な姿勢を示したことなどから、金利は低位で安定推移となりました。10月以降は、米国の追加経済対策への期待やFRB（米国連邦準備制度理事会）高官による金利上昇を容認する発言などから、米国金利に連れてオーストラリア金利は上昇しました。2022年1月以降は、米国のほか欧州においても金融引き締め観測が高まり、さらにはロシアのウクライナ侵攻やインフレ圧力なども加わったことから、世界的に金利は上昇しました。またRBAにおいても、政策金利の引き上げの実施により、オーストラリア金利は上昇しました。その後は、RBAによる追加利上げへの過度な懸念が後退したことなどから、オーストラリア金利は低下しました。

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券の信用スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は、当ファンド設定日から2016年2月にかけて、世界景気の先行きに対する懸念や原油価格の下落など商品市況の低迷などから、拡大基調で推移しました。2017年末にかけては、米国の景気後退懸念が弱まり世界景気への楽観的見方が大勢となったことなどに加え、需給およびファンダメンタルズ両面の好材料に支えられ、信用スプレッドは縮小しました。2019年末にかけては、新発債の起債増加や地政学リスクの高まりなどで世界的に信用スプレッドは拡大傾向となりましたが、オーストラリアでは投資家需要に支えられ、2020年初旬にかけてタイトな推移となりました。1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念からリスク回避的な動きが強まり、信用スプレッドは急拡大したものの各国経済対策などから低金利が続き、利回りに対する強い投資家需要から信用スプレッドは大きく縮小しました。2022年1月以降は、米国や欧州において金融引き締め観測が高まり、信用スプレッドも拡大基調となりました。2022年後半にかけても、ロシアのウクライナ侵攻、

インフレ圧力の見通しや世界経済の減速懸念などを背景に、市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、軟調に推移しました。その後は、オーストラリアでの堅調な労働市場や底堅い成長見通しなどが投資家心理を下支えするなど、タイトに推移しました。

## ■為替相場

豪ドルは対円で上昇（円安）しました。

豪ドル対円為替相場は、当ファンド設定日からやや上昇しましたが、中国景気の悪化懸念による商品市況の低迷、RBA（オーストラリア準備銀行）が政策金利の引き下げを決定したこと、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことなどから、2016年半ばにかけて下落（円高）基調で推移しました。その後は、資源価格の上昇などから豪ドルは対円で上昇基調となったものの、2018年以降は、株価や原油価格が下落したことに加え、2020年には新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などからリスク回避的な動きが強まったことから、3月まで豪ドルは対円で大きく下落しました。その後は、世界的な経済対策への期待感や、ウクライナ情勢の緊迫化などから資源価格が上昇したことで、豪ドルは対円で上昇に転じました。日銀が長短金利操作の修正など異次元の金融緩和姿勢をやや後退させたことや、欧米の銀行不安を背景に投資家心理が悪化したことから、豪ドルは対円で下落する場面もありましたが、日銀が各国政府・中央銀行に比べて著しく緩和的な金融政策を続ける中で内外金利差の拡大が意識され、2024年6月にかけて、豪ドルは上昇基調で推移しました。償還期末にかけては、オーストラリア債券の金利低下により内外金利差が縮小したことや、日銀の追加利上げへの警戒感が高まったことなどを背景に、豪ドルは対円で下落しました。

## ■通貨オプション市況

通貨オプション市況は、当ファンド設定日から2016年半ばにかけては、中国の景気減速懸念や原油価格の下落などから豪ドル円が下落するなど市場の警戒感が高まったことで、豪ドル円のボラティリティは上昇しました。2016年後半から2019年末にかけては、世界的に景気が安定して推移したことや豪ドル円の値動きも比較的落ち着いて推移したことなどから、ボラティリティは低下しました。2020年前半は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に市場の警戒感が急速に高まり、ボラティリティは大きく上昇しましたが、その後は各国政府・中央銀行による大規模な景気刺激策や金融緩和を受けて市場は落ち着きを取り戻し、ボラティリティは低下しました。2021年半ばから2022年後半にかけては、ウクライナ情勢への懸念や中国不動産会社のデフォルト（債務不履行）懸念などを背景に市場の警戒感が高まり、ボラティリティは上昇しました。2023年以降は、豪ドル円が堅調に推移したことなどから、ボラティリティは低下しました。しかし2024年半ばに入ると、日本政府関係者の円安けん制発言や日銀の利上げ観測などを背景に市場の警戒感が高まり、ボラティリティは上昇しました。

## 信託期間中の運用方針

### ■当ファンド

主として、「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」の受益証券を通じて、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等への投資により、高利回りの獲得をめざすとともに、通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の構築により、オプションプレミアムの確保をめざします。

※ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）：  
ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

### ■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

流通市場で割安に評価されている証券を発掘するとともに、新規証券の発行市場でも銘柄選択を行います。引き続き、流通市場および新規発行の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。市場の動向と状況を注意深く観察しながら新しい投資機会を求める姿勢を継続します。

通貨カバードコール戦略については、保有する豪ドル建資産の評価額の50%程度のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの獲得をめざします。

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

## 信託期間中のポートフォリオについて

（2014. 6. 18～2024. 10. 17）

### ■当ファンド

当ファンドは、「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」と「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズであり、信託期間を通じて「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」への投資割合を高位に維持することを基本としました。

### ■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券等への投資により、高利回りの獲得をめざすとともに、通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の構築により、オプションプレミアムの確保をめざして運用を行いました。円に対する豪ドルのコール・オプションのカバー率は、保有する豪ドル建資産の評価額の50%程度を維持しました。

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行いました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

## 分配金について

1万口当り、第1期～第39期各80円、第40期～第53期各60円、第54期～第65期各40円、第66期～第121期各30円の収益分配を行いました。

また、第117期～第121期の収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項目	第117期	第118期	第119期	第120期	第121期
	2024年4月18日 ～2024年5月17日	2024年5月18日 ～2024年6月17日	2024年6月18日 ～2024年7月17日	2024年7月18日 ～2024年8月19日	2024年8月20日 ～2024年9月17日
当期分配金(税込み) (円)	30	30	30	30	30
対基準価額比率 (%)	0.58	0.58	0.57	0.61	0.63
当期の収益 (円)	30	30	30	30	30
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	455	465	479	490	495

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

### 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項目	第117期	第118期	第119期	第120期	第121期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 44.79円	✓ 40.86円	✓ 43.50円	✓ 40.65円	✓ 35.25円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	53.04	53.73	54.37	54.87	55.43
(d) 分配準備積立金	387.27	401.38	411.61	424.61	434.71
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	485.11	495.98	509.49	520.14	525.40
(f) 分配金	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	455.11	465.98	479.49	490.14	495.40

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



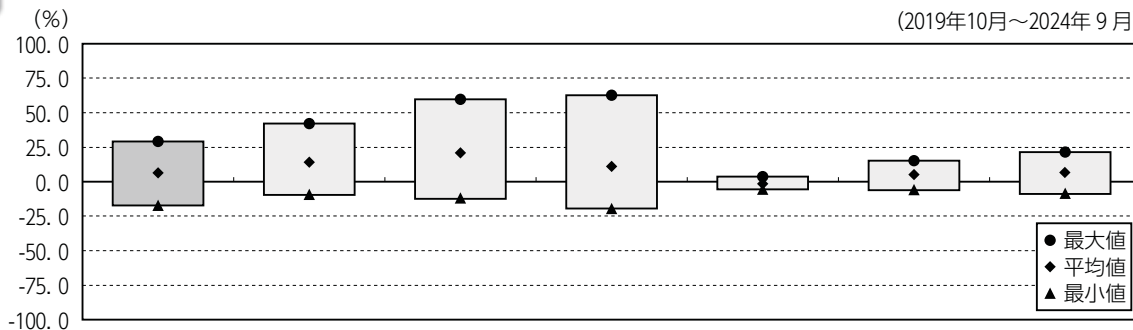
## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／資産複合	
信託期間	2014年6月18日～2024年10月17日	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	当ファンド	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」（以下「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	円建ての債券
当ファンドの運用方法	<p>①主として、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）の受益証券を通じて、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等への投資により、高利回りの獲得をめざすとともに、通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の構築により、オプションプレミアムの確保をめざします。</p> <p>②当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）とダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）の投資割合を高位に維持することを基本とします。</p> <p>③ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）では、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。</p>	
マザーファンドの運用方法	<p>①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。</p> <p>②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。</p>	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	



## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2019年10月～2024年 9月)



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	29.2	42.1	59.8	62.7	3.7	15.3	21.5
平均値	6.4	14.1	20.9	11.1	△1.5	5.2	6.8
最小値	△17.1	△9.5	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△8.8

上記の図表は、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。

②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※上記の騰落率は直近月末から60カ月さかのぼった算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

※資産クラスについて

日本株……………配当込みTOPIX

先進国株……………MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株……………MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債……………NOMURA-BPI国債

先進国債……………FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債……………JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる商標または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる商標または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドに基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[ <https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html> ] ●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・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.

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



## ファンドデータ

### 当ファンドの組入資産の内容

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

### 純資産等

項 目	第117期末	第118期末	第119期末	第120期末	第121期末	償還時
	2024年 5月17日	2024年 6月17日	2024年 7月17日	2024年 8月19日	2024年 9月17日	2024年10月17日
純資産総額	2,140,127,790円	2,133,720,519円	2,145,500,290円	1,910,727,655円	1,811,124,907円	1,667,283,571円
受益権総口数	4,144,064,188口	4,134,933,214口	4,105,819,037口	3,893,719,456口	3,851,730,424口	3,504,814,682口
1万口当り基準価額	5,164円	5,160円	5,226円	4,907円	4,702円	4,757円12銭

\* 当作成期間（第117期～償還期）中における追加設定元本額は35,433,493円、同解約元本額は711,341,383円です。

\* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。