

2519

NF・新興国債ヘッジ無ETF（愛称）

NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマーゼィング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス
（為替ヘッジなし）運動型上場投信〔追加型投信/海外/債券/ETF/インデックス型〕

NOMURA

NEXT FUNDS

月次レポート
2022年7月29日

■ ファンドの目的

日本円換算したJ.P.モルガン・エマーゼィング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（対象指数）に連動する投資成果を目指します。

■ J.P.モルガン・エマーゼィング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス

J.P. Morgan Securities LLC が公表している、エマーゼィング諸国が発行する米ドル建のプレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスです。

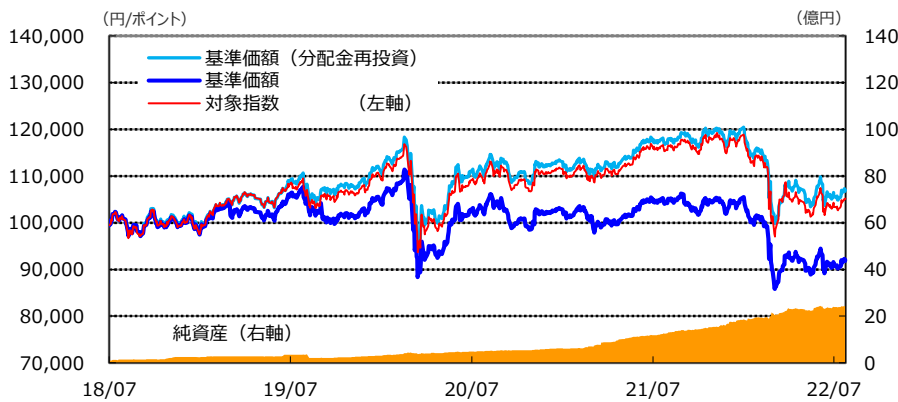
■ ファンド情報

設定日:	2018年7月6日
上場日:	2018年7月10日
上場市場:	東京証券取引所
信託期間:	無期限
売買単位:	10口
決算日:	毎年3月、9月の各7日
Bloomberg:	2519 JP <Equity>
ISIN:	JP3048730000
SEDOL:	BDVLR59
PCF配信:	あり

■ 運用実績

■ 運用実績の推移

(日次)



騰落率	1か月	3か月	6か月	1年	3年	設定来
基準価額 (分配金再投資)	1.4%	-0.4%	-7.8%	-8.4%	-2.8%	7.5%

(設定来 = 2018年7月6日以降)

・対象指数は、設定日当日の基準価額(99,460)に合わせて指数化しております。

・基準価額(分配金再投資)の推移および騰落率は、当該ファンドの信託報酬控除後の価額を用い、分配金を非課税で再投資したものと計算しております。従って、実際のファンドにおいては、課税条件によって受益者ごとに騰落率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。

・騰落率の各計算期間は、作成基準日から過去に遡った期間としております。

■ 資産内容

国・地域別配分	純資産比	通貨別配分	実質通貨比率
サウジアラビア	8.4%	アメリカ・ドル	99.9%
メキシコ	7.7%	日本・円	0.1%
トルコ	7.5%	ユーロ	0.0%
カタール	7.0%	-	-
アラブ首長国連邦	6.6%	-	-
その他の国・地域	60.3%	その他の通貨	0.0%
その他の資産	2.5%		
合計(※)	100.0%		

純資産総額
24.3 億円基準価額 (100口当たり)
91,987 円

分配金 (100口当たり、課税前)	
2022年3月	1,610 円
2021年9月	1,800 円
2021年3月	2,090 円
2020年9月	1,780 円
2020年3月	1,800 円
設定来累計	15,260 円

・分配金実績は、将来の分配金の水準を示唆あるいは保証するものではありません。

・分配金額は、信託財産から生ずる配当等収益(注)から経費を控除後、全額分配することを原則とします。ただし、分配金がゼロとなる場合もあります。また、売買益が生じても、分配は行ないません。

(注)「配当等収益」には、受取利息およびその他の収益金を含みます。

資産構成	
債券	97.5%
その他の資産	2.5%

ポートフォリオ特性値	
平均最終利回り	6.7%
平均デュレーション	8.3年

・上記のポートフォリオ特性値は、ファンドの組入債券等（現金等を含む）の各特性値（最終利回り、デュレーション）を、その組入比率で加重平均したものです。・デュレーション：金利がある一定割合で変動した場合、債券価格がどの程度変化するかを示す指標。

組入銘柄数： 210 銘柄

組入上位10銘柄	国・地域	純資産比
REPUBLIC OF PERU	ペルー	1.3%
SAUDI INTERNATIONAL BOND	サウジアラビア	1.2%
STATE OF QATAR	カタール	1.2%
STATE OF QATAR	カタール	1.2%
STATE OF QATAR	カタール	1.2%
REPUBLIC OF ECUADOR	エクアドル	1.2%
OMAN GOV INTERNTL BOND	オマーン	1.1%
FED REPUBLIC OF BRAZIL	ブラジル	1.1%
ABU DHABI GOVT INT'L	アラブ首長国連邦	1.1%
SAUDI INTERNATIONAL BOND	サウジアラビア	1.1%
合計		11.6%

※先物の建玉がある場合は合計欄を表示していません。・国・地域は原則発行国・地域で区分しております。

・純資産比は、当ファンドの投資対象であるマザーファンドおよび当ファンドが保有する債券から算出しております。・実質通貨比率は為替予約等を含めた実質的な比率をいいます。

当資料のご利用にあたっては、後記の「ご注意事項等」を必ずご覧ください。

1/2

■ 投資リスク

当ファンドは、債券等を実質的な投資対象としますので、連動対象である債券指数の変動、金利変動等による組入債券の価格の下落、組入債券の発行体の倒産や財務状況の悪化等の影響により、基準価額が下落することがあります。また、外貨建資産に投資しますので、為替の変動により基準価額が下落することがあります。

したがって、投資家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、損失が生じることがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

※詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）の「投資リスク」をご覧ください。投資信託説明書は、当社インターネットホームページでご覧いただけます。

■ 当ファンドに係る手数料・費用について

直接的にご負担いただく費用

〈取引所を通してお取引をされる場合に直接ご負担いただく費用〉

- 売買手数料 市場を通して売買される場合、販売会社が独自に定める金額がかかります。
 - 〈設定・換金される場合に直接ご負担いただく費用〉
 - 購入時手数料 ファンドの追加設定のお申込みの際には、販売会社が独自に定める額をご負担いただきます。
 - その他の費用 購入価額は、基準価額に100.50%以内（2022年5月30日現在100.30%）の率を乗じた価額となります。したがって、購入時には、基準価額に0.50%以内（2022年5月30日現在0.30%）の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、購入する口数に応じてご負担いただきます。
 - 信託財産留保額 換金時に、100口につき基準価額に0.50%以内（2022年5月30日現在0.30%）の率を乗じて得た額
 - 換金時手数料 ファンドを換金される際には、販売会社が独自に定める額をご負担いただきます。
- * 上記の売買手数料、購入時手数料、換金時手数料は販売会社ごとに手数料率が異なりますので、その上限額を表示することができません。

信託財産で間接的にご負担いただく費用

- 運用管理費用（信託報酬） ファンドの純資産総額に、年0.209%（税抜年0.19%）以内（2022年5月30日現在、年0.209%（税抜年0.19%））の率を乗じて得た額に、有価証券の貸付を行なった場合は、日々、その品賃料の44%（税抜40%）以内の額から、当該貸付に係る事務の処理を第三者に委託した場合に要する費用を控除した額を加算した額が、お客様の保有期間に応じてかかります。
- その他の費用・手数料
 - ◆ 対象指数に係る商標使用料（2022年5月30日現在）
ファンドの純資産総額に対し、年0.06%以下の率を乗じて得た額とします。
 - ◆ ファンドの上場に係る費用（2022年5月30日現在）
 - ・追加上場料：追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.00825%（税抜0.0075%）。
 - ・年間上場料：毎年末の純資産総額に対して、最大0.00825%（税抜0.0075%）。
 - ◆ 組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、ファンドに関する租税等。

※これらは、ファンドから支払われます。（これらの費用等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。）

上記の費用の合計額については、投資家の皆様がファンドを保有される期間等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）の「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

■ J.P.モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスの著作権等について■

著作権はジェー・ピー・モルガンに全て帰属します（2018年）。ジェー・ピー・モルガンは、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーおよびその各国子会社または関連会社のマーケティングネームです。本ファンドは、ジェー・ピー・モルガンにより、支援、保証、販売、または宣伝されるものではありません。ジェー・ピー・モルガンは、本ファンドの所有者または他の一般人に対して、有価証券への投資全般もしくは本ファンドへの個別投資についての妥当性、またはJ.P.モルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（以下、「対象指数」）が債券市場全般のパフォーマンスを追従する能力について、明示または黙示を問わず、表明または保証するものではありません。ジェー・ピー・モルガンと野村アセットマネジメント株式会社（以下、「当社」）の関係は、対象指数のライセンス供与のみであり、対象指数は当社または本ファンドに関係なく、ジェー・ピー・モルガンにより決定、構成、計算されます。ジェー・ピー・モルガンは、対象指数を決定、構成、計算する上で、当社または本ファンドの所有者の要望を考慮する義務を負いません。ジェー・ピー・モルガンは、本ファンドが発行されるタイミング、価格もしくは数量について、または本ファンドが換金される計算式の決定もしくは計算について責任を負わず、またこれらに関与したこともありません。ジェー・ピー・モルガンは、本ファンドの管理、マーケティングや売買に関連する事項についていかなる義務または責任も負いません。

対象指数と本ファンドは、あらゆる瑕疵を含む現状有姿で提供されます。ジェー・ピー・モルガンは、対象指数および本ファンド、ならびに対象指数もしくは本ファンドに含まれるデータ、または当社、本ファンドの所有者、その他の個人もしくは組織が、対象指数もしくは本ファンドを利用して得たデータの有用性、連続性、適時性、品質、正確性や完全性を保証しません。ジェー・ピー・モルガンは、対象指数および、対象指数に含まれるデータ、または当社、本ファンドの所有者、その他の個人もしくは組織が、対象指数もしくは本ファンドを利用して得たデータが、特定の目的または使用に適合する商品性を有することについて、明示または黙示を問わず保証せず、それについての保証を明示的に否認します。いかなる場合でも、この書面の記載内容を越えて、表明または保証がなされることはありません。商品性、品質、正確性、特定の目的への適合性についての黙示の保証、侵害に対する黙示の保証、対象指数の利用または本ファンドの利用もしくは購入により得られる結果についての黙示の保証を含む、対象指数および本ファンドに関するいかなる表明や保証も否認されます。前記事項を制限することなく、いかなる場合においても、ジェー・ピー・モルガンは、実際の損失および逸失利益を含む、特別損害、懲罰的損害、直接的損害、間接的損害または派生的損害につき、たとえそれらの可能性について告知されていたとしても、責任を負いません。

ご注意事項等

ファンドは、値動きのある証券等に投資します（外貨建資産に投資する場合には、この他に為替変動リスクもあります。）ので、基準価額は変動します。したがって、元金が保証されているものではありません。ファンドの運用による損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。また、本書中の運用実績に関するグラフ、図表、数値その他いかなる内容も過去のものであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。当資料は、ファンドの運用状況に関する情報提供を目的として野村アセットマネジメントが作成した資料です。ご購入（追加設定）の際には、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を必ずご確認のうえご自身でご判断ください。

<委託会社> 野村アセットマネジメント株式会社【ファンドの運用の指図を行なう者】

<受託会社> 野村信託銀行株式会社【ファンドの財産の保管および管理を行なう者】

ファンドの基準価額等についてのお問い合わせ先：野村アセットマネジメント株式会社

☆サポートダイヤル☆ 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

☆インターネットホームページ☆ <http://www.nomura-am.co.jp/>

◆設定・運用は **野村アセットマネジメント**

金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第373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