

## 上場Tracers 米国債0-2年ラダー(為替ヘッジなし)(2093)

<上場Tr米債0-2年ラダー(為替ヘッジなし)(愛称) 追加型投信/海外/債券/ETF>

### <投資方針>

当ファンドは、主として、残存期間が2年以下の米国国債に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。原則として、投資対象とする債券を、残存期間に応じて6か月以下、6か月超12か月以下、12か月超18か月以下、18か月超24か月以下の4つのグループに分け、流動性や売買コストなどを考慮しながら各グループへ概ね等金額となるよう分散投資(=ラダー型運用)を行う等の、事前に定めたルールに沿って運用(トレース)します。

なお、当ETFは、連動対象となる指数が存在しないため、東証規則上の「国内アクティブ運用型ETF」に該当します。

### ファンドの騰落率

累積騰落率	分配金込み基準価額	参考指標*
年初来	10.17%	10.34%
1か月	-4.69%	-4.69%
3か月	-1.27%	-1.35%
6か月	5.65%	5.70%
1年間	-	-
上場来	6.69%	6.88%
年間騰落率		
2023	-	-
2022	-	-
2021	-	-
2020	-	-
2019	-	-

※ 分配金込み基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものを表示しています。

\*「ICE BofA 1年米国債インデックス(為替ヘッジなし、円ベース(TTM))」を参考指標とします。

### 分配金実績

分配金実績	分配金(1口当たり)
2024年5月10日	65円50銭
2024年2月10日	111円30銭
2023年11月10日	19円00銭
-	-

### ファンド情報

設定日	2023年10月2日
上場日	2023年10月5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
組入銘柄数	21銘柄
決算日	年4回(2・5・8・11月10日)
Bloombergコード	2093 jp equity
iNAVコード	2093JPV index

### 運用状況

純資産総額	73億円
基準価額(1口当たり)	5,101円
信託報酬率	0.06%
	(税込0.066%)

※ 当ファンドの投資状況です。

### 資産構成

国債	105.34%
現金・その他資産	-5.34%

\*参考指標は、ICE BofA 1年米国債インデックスを日興アセットマネジメントが円換算したもので、当ファンドのベンチマークではありません。

\*ICE BofA 1年米国債インデックスは、ICE Data Indices, LLCが発表する指数で、残存期間約1年(ただし1年を超えない)の米国債を1か月保有し、翌月に同条件の米国債にロールオーバーすることを繰り返した場合のパフォーマンスを指数化したものです。

### 組入上位銘柄

組入上位銘柄	通貨	クーポン	償還日	比率
TREASURY BILL	USD	0.000%	2024年11月21日	4.98%
TREASURY BILL	USD	0.000%	2025年1月16日	4.98%
TREASURY BILL	USD	0.000%	2025年7月10日	4.98%
TREASURY BILL	USD	0.000%	2024年8月20日	4.98%
TREASURY BILL	USD	0.000%	2024年10月17日	4.98%
TREASURY BILL	USD	0.000%	2024年12月26日	4.98%
US TREASURY N/B	USD	4.250%	2025年12月31日	4.96%
US TREASURY N/B	USD	4.625%	2026年6月30日	4.96%
US TREASURY N/B	USD	4.625%	2025年6月30日	4.96%
US TREASURY N/B	USD	4.875%	2026年5月31日	4.94%

※ 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。

### 利回り等

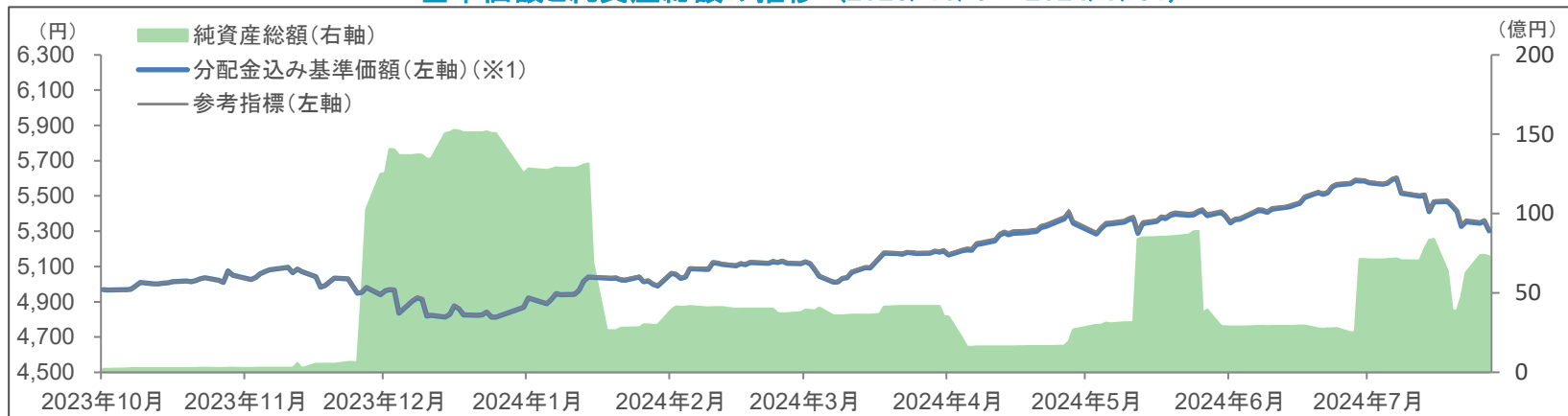
指標	
平均クーポン	3.23%
平均直接利回り	3.23%
平均最終利回り	4.83%
平均デュレーション	0.97年
平均残存期間	1.02年

※ 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。

### 基準価額と純資産総額の推移 (2023/10/5 - 2024/7/31)



※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。※ 参考指標は、「ICE BofA 1年米国債インデックス(為替ヘッジなし、円ベース(TTM))」であり、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。

■ 当資料は、投資者の皆様へ「上場Tr米債0-2年ラダー(為替ヘッジなし)(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Tracers 米国債0-2年ラダー(為替ヘッジなし)(2093)

&lt;上場Tr米債0-2年ラダー(為替ヘッジなし)(愛称) 追加型投信/海外/債券/ETF&gt;

## 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。

## &lt;投資者が直接的に負担する費用&gt;

- 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 **ありません。**

## &lt;投資者が信託財産で間接的に負担する費用&gt;

- 運用管理費用  
(信託報酬)  
ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.066%(税抜0.06%)以内  
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。
- 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0.03%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限とする額**  
諸費用  
(目論見書の作成費用など)  
①目論見書や財務諸表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運用において使用する指数の標章使用料などは、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、借入金の利息および立替金の利息などがその都度、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。また、有価証券の貸付は現在行なっておりませんので、それに関連する報酬はかかりません。
- 売買委託手数料など

※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。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う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)の皆様にも帰属します。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。

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。

## 【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。

## 【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。

## 【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。

## ◇金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

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。

※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。

## 上場Tracers 米国債0-2年ラダー(為替ヘッジなし)(2093)

&lt;上場Tr米債0-2年ラダー(為替ヘッジなし)(愛称) 追加型投信/海外/債券/ETF&gt;

## ● その他の留意事項

- 当資料は、投資者の皆様にご理解を高めることを目的として、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。

## 指数の著作権などについて

出所ICE Data Indices, LLCは許可を得て使用しています。ICE® は、ICE Data Indices, LLCまたはその関連会社の登録商標です。BofA® は Bank of America Corporation およびその関連会社(以下「BofA」)によってライセンスされた Bank of America Corporation の登録商標であり、BofA の書面による事前承認なしに使用することはできません。ICE Data Indices, LLC、その関連会社およびそのサプライヤーは、インデックス、インデックス・データおよびそれらに含まれる、関連する、または派生するあらゆるデータを含め、商品性または特定の目的や使用に対する適合性の保証を含む、明示および/または黙示のあらゆる保証および表明を否認するものとします。ICE Data Indices, LLC、その関連会社およびそのサプライヤーは、インデックス、インデックス・データまたはその構成要素について、妥当性、正確性、適時性または完全性に関して、いかなる損害または責任も負わないものとし、これらは「現状のまま」提供され、その使用は自己責任で行うものとします。ICE Data Indices, LLC、その関連会社およびそのサプライヤーは、日興アセットマネジメント株式会社、または同社の商品やサービスについて、スポンサー、保証、推奨を行うものではありません。なお、以下の英文ディスクレーマーと齟齬がある場合には、英文が優先されます。

SOURCE ICE DATA INDICES, LLC ("ICE DATA"), IS USED WITH PERMISSION. ICE® IS A REGISTERED TRADEMARK OF ICE DATA OR ITS AFFILIATES AND BOFA® IS A REGISTERED TRADEMARK OF BANK OF AMERICA CORPORATION LICENSED BY BANK OF AMERICA CORPORATION AND ITS AFFILIATES ("BOFA") AND MAY NOT BE USED WITHOUT BOFA'S PRIOR WRITTEN APPROVAL. ICE DATA, ITS AFFILIATES AND THEIR RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS DISCLAIM ANY AND ALL WARRANTIES AND REPRESENTATIONS, EXPRESS AND/OR IMPLIED, INCLUDING ANY WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE, INCLUDING THE INDICES, INDEX DATA AND ANY DATA INCLUDED IN, RELATED TO, OR DERIVED THEREFROM. NEITHER ICE DATA, ITS AFFILIATES NOR THEIR RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS SHALL BE SUBJECT TO ANY DAMAGES OR LIABILITY WITH RESPECT TO THE ADEQUACY, ACCURACY, TIMELINESS OR COMPLETENESS OF THE INDICES OR THE INDEX DATA OR ANY COMPONENT THEREOF, AND THE INDICES AND INDEX DATA AND ALL COMPONENTS THEREOF ARE PROVIDED ON AN "AS IS" BASIS AND YOUR USE IS AT YOUR OWN RISK. ICE DATA, ITS AFFILIATES AND THEIR RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS DO NOT SPONSOR, ENDORSE, OR RECOMMEND NIKKO ASSET MANAGEMENT CO., LTD., OR ANY OF ITS PRODUCTS OR SERVICES.

■当資料は、投資者の皆様にご理解を高めることを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。