

バンクローン・ファンド（ヘッジなし）

追加型投信／海外／その他資産（バンクローン）

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、主として米国企業向けバンクローン（貸付債権）に実質的な投資を行い、高水準のインカムゲインの確保を目指して運用を行います。外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

作成対象期間 2019年6月11日～2019年12月10日

第77期	決算日：2019年 7 月10日
第78期	決算日：2019年 8 月13日
第79期	決算日：2019年 9 月10日
第80期	決算日：2019年10月10日
第81期	決算日：2019年11月11日
第82期	決算日：2019年12月10日

第82期末 (2019年12月10日)	基 準 価 額	10,583円
	純資産総額	5,351百万円
第77期～ 第82期	騰 落 率	1.1%
	分配金合計	300円

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書（全体版）を電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書（全体版）は、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書（全体版）は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

■運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター **0120-104-694**

（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

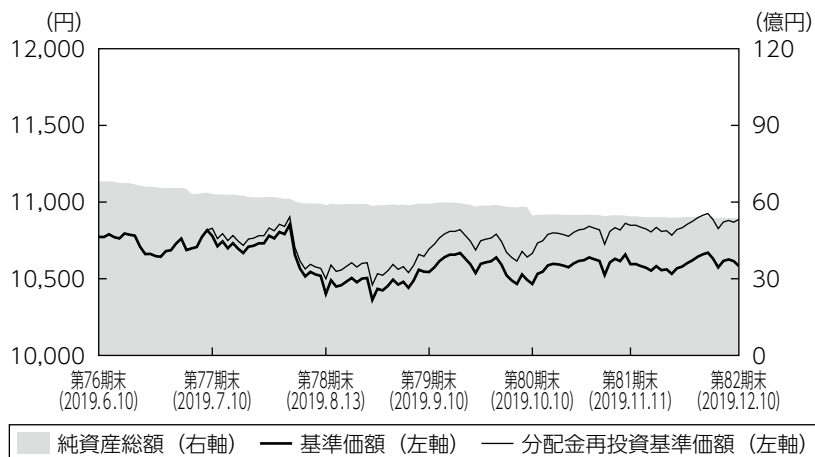
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2 <http://www.am-one.co.jp/>

運用経過の説明

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として米国企業向けバンクローン（貸付債権）に実質的な投資を行い、高水準のインカムゲインの確保を目指して運用を行いました。このような運用を行った結果、バンクローンの価格（キャピタル要因）が下落したことがマイナスに寄与したものの、相対的に高い利息収入（インカム要因）がプラスに寄与し、当作成期間における基準価額は上昇しました。

1 万口当たりの費用明細

項目	第77期～第82期 (2019年6月11日 ～2019年12月10日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	62円	0.587%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,610円です。
(投信会社)	(20)	(0.190)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(40)	(0.380)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.016)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.004	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(0)	(0.002)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	63	0.590	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れている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。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

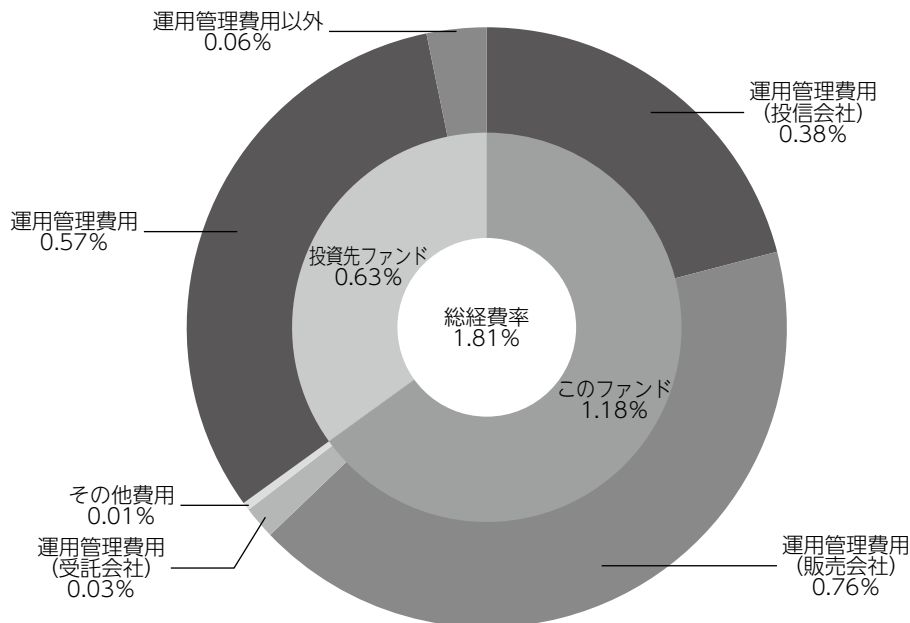
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

（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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.81%です。



総経費率（①＋②＋③）	1.81%
①この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	0.57%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

（注1）①の費用は、1万口当た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）各比率は、年率換算した値です。

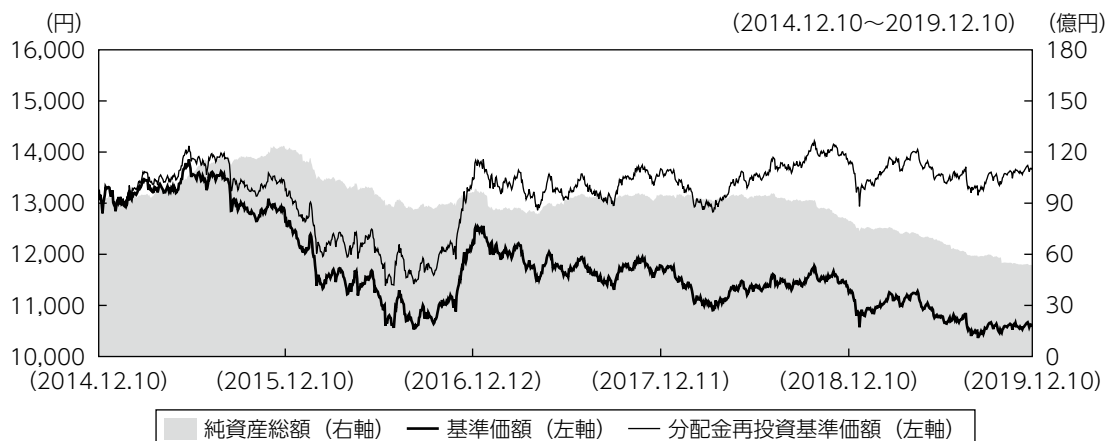
（注4）投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

（注5）①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

（注6）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7）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。

最近5年間の基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2014年12月10日の基準価額に合わせて指数化しています。

		2014年12月10日 期首	2015年12月10日 決算日	2016年12月12日 決算日	2017年12月11日 決算日	2018年12月10日 決算日	2019年12月10日 決算日
基準価額 (分配落)	(円)	13,264	12,666	12,235	11,778	11,250	10,583
期間分配金合計 (税引前)	(円)	—	600	600	600	600	600
分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	△0.1	1.9	1.3	0.7	△0.5
参考指数の騰落率	(%)	—	1.2	3.3	2.9	1.8	1.6
純資産総額	(百万円)	9,080	12,162	9,662	9,510	7,935	5,351

(注1) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。参考指数はS&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックス (円換算) です。参考指数については後掲の＜当ファンドの参考指数について＞をご参照ください。

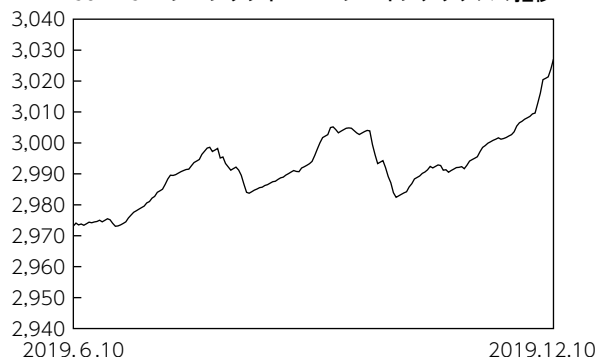
(注2) 参考指数は、基準価額への反映を考慮して、基準価額算出日前日の指数値を基準価額算出日当日の為替レート (対顧客電信売買相場仲値) で円換算してあります。

投資環境

● バンクローン市場

バンクローン市場は上昇しました。当作成期間の前半から半ばにかけては、米中貿易摩擦や世界経済の減速懸念などを受け投資家のリスク回避姿勢が強まり、バンクローンの価格は下落しました。2019年11月に入ると、米雇用統計や米GDP成長率が市場予想を上回り、利下げ観測が後退したことを背景に変動利付債であるバンクローンへの投資家需要が一部回復し同価格が上昇に転じ小幅値を戻しました。なお、バンクローンの相対的に高い利息収入は上昇要因となりました。

S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックスの推移



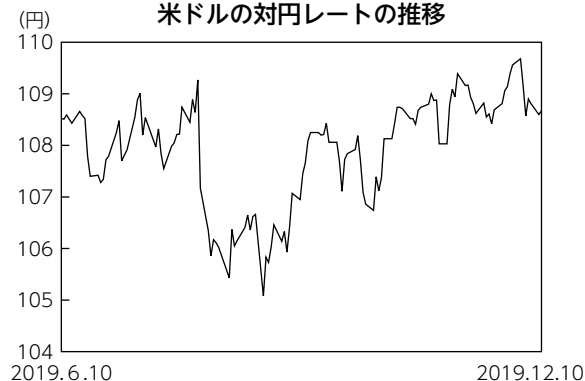
● 国内短期金融市場

残存1年程度の日本国債の利回りについては、日銀の金融緩和の影響もあり、マイナス圏で推移しました。

● 為替市場

米ドルは対円で上昇しました。米中の貿易摩擦や米連邦準備制度理事会（F R B）の金融政策などを睨みながら、米ドルは対円で一進一退の推移となりました。2019年8月に米中貿易摩擦の激化懸念を背景に大きく下落した後、米中の貿易協議が進展するとの期待が高まる局面で上昇に転じ、小幅上昇となりました。

米ドルの対円レートの推移



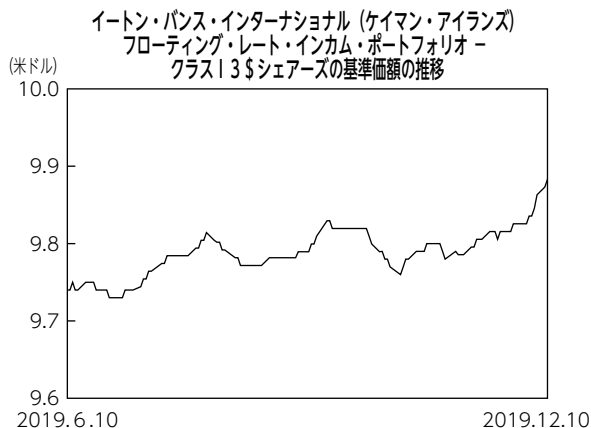
■ ポートフォリオについて

● 当ファンド

ケイマン諸島籍の外国投資法人「イートン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ クラスI 3 \$ シェアーズ」（以下「バンクローン・ポートフォリオ」という場合があります。）と国内投資信託「日本短期公社債マザーファンド」受益証券を投資対象とするファンド・オブ・ファンズの形式で運用を行いました。バンクローン・ポートフォリオの高位組み入れを継続しました。また、日本短期公社債マザーファンドの組み入れを継続しました。

● バンクローン・ポートフォリオ

ボトムアップリサーチによる銘柄選択を行い、B格、BB格のローン組入比率を高位として、安定性を重視した運用を行いました。このようなポートフォリオを構築することで、バンクローン市場における流動性の低下やクレジットコストが増加した場合においても、運用への影響を軽減できるものと考えました。



※当作成期間における分配金（累計）を加算しています。

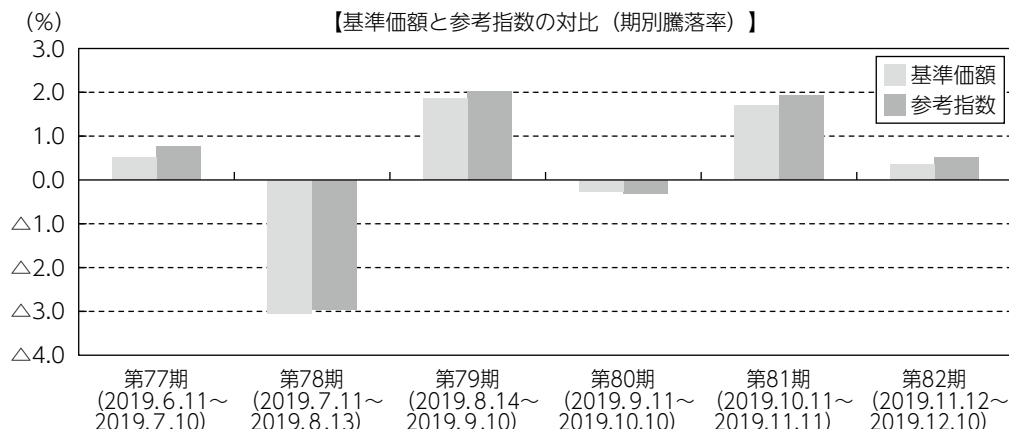
● 日本短期公社債マザーファンド

主として円建ての公社債に投資することにより安定した収益の確保を目指し、短期公社債を中心に投資を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは基準価額と参考となるS&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックス（円換算）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

収益分配金につきましては運用実績・分配原資等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第77期 2019年6月11日 ～2019年7月10日	第78期 2019年7月11日 ～2019年8月13日	第79期 2019年8月14日 ～2019年9月10日	第80期 2019年9月11日 ～2019年10月10日	第81期 2019年10月11日 ～2019年11月11日	第82期 2019年11月12日 ～2019年12月10日
当期分配金（税引前）	50円	50円	50円	50円	50円	50円
対基準価額比率	0.46%	0.48%	0.47%	0.48%	0.47%	0.47%
当期の収益	39円	27円	48円	32円	36円	31円
当期の収益以外	10円	22円	1円	17円	13円	18円
翌期繰越分配対象額	2,379円	2,357円	2,355円	2,338円	2,324円	2,306円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「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・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、バンクローン・ポートフォリオおよび日本短期公社債マザーファンドへの投資を継続し、高水準のインカムゲインの確保を目指して運用を行います。

●バンクローン・ポートフォリオ

世界経済に関しては、米国において緩やかな拡大基調が続くと見ているものの、当面は貿易摩擦の景気への影響や、政治・経済基盤が不安定な国の動向などを慎重に見極める必要があると考えます。こうした中、相対的に利回り水準が高いバンクローンに対する良好な需要が継続すると考えられることからバンクローン市場は底堅く推移すると想定しています。引き続き、クレジットリスクに関して、B格、B B格ローンを中心としたポートフォリオを構築して収益の安定を図る方針です。

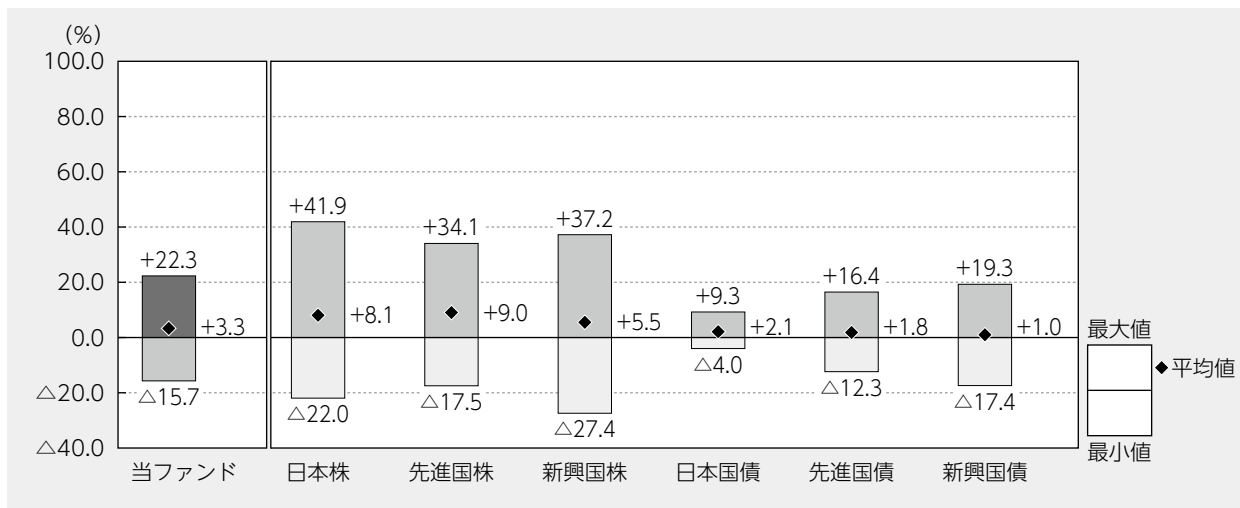
●日本短期公社債マザーファンド

引き続き短期公社債などを中心に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、市場環境によっては、目標とする運用ができない場合があります。

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／その他資産（バンクローン）	
信 託 期 間	2012年12月17日から2022年12月9日まで。	
運 用 方 針	投資信託証券を主要投資対象として、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	投資信託証券
	イートン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオークラス13\$シェアーズ	米ドル建ての企業向けバンクローン（貸付債権）
	日本短期公社債マザーファンド	本邦通貨建ての公社債
運 用 方 法	以下の投資信託証券を通じて、主として米ドル建ての企業向けバンクローン（貸付債権）に実質的な投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 ケイマン諸島籍外国投資法人 イートン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオークラス13\$シェアーズ（以下、「バンクローン・ポートフォリオ」といいます。）米ドル建投資証券 内国証券投資信託（親投資信託） 日本短期公社債マザーファンド受益証券 各投資信託証券への投資割合は、資産動向や市況動向などを勘案して決定するものとし、バンクローン・ポートフォリオの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。 外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。	
分 配 方 針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配金額は、投資信託証券からの分配金水準等を参考に委託者が決定します。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。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

代表的な資産クラスとの騰落率の比較



2014年12月～2019年11月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、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す。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

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GBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)

(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。

※各指数については後掲の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

当ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容（2019年12月10日現在）

◆組入ファンド等

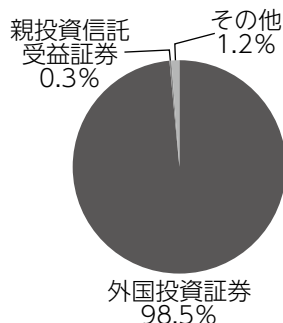
（組入ファンド数：2ファンド）

	第82期末 2019年12月10日
イトン・バンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ） フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ クラスI 3\$シェアーズ	98.5%
日本短期公社債マザーファンド	0.3
その他	1.2

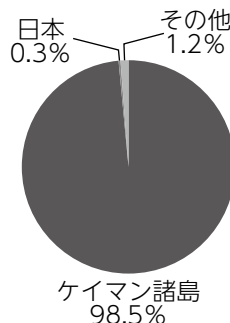
（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

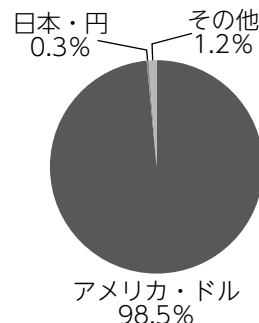
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

（注3）国別配分につきましては発行国（地域）で表示しております。

純資産等

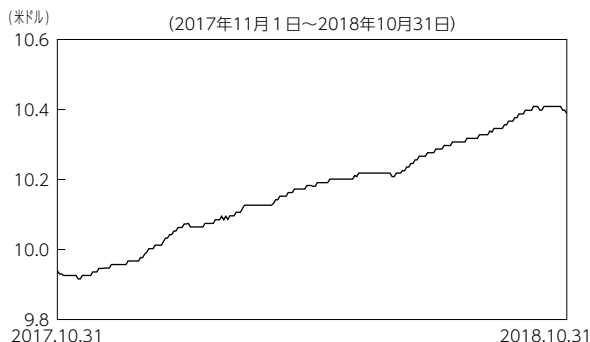
項目	第77期末 2019年7月10日	第78期末 2019年8月13日	第79期末 2019年9月10日	第80期末 2019年10月10日	第81期末 2019年11月11日	第82期末 2019年12月10日
純資産総額	6,318,332,810円	5,878,602,054円	5,931,241,653円	5,471,382,119円	5,438,222,559円	5,351,468,282円
受益権総口数	5,861,487,581口	5,652,147,864口	5,625,267,838口	5,227,548,462口	5,132,666,921口	5,056,848,707口
1万口当たり基準価額	10,779円	10,401円	10,544円	10,466円	10,595円	10,583円

（注）当作成期間（第77期～第82期）中における追加設定元本額は86,918,840円、同解約元本額は1,349,855,078円です。

組入ファンドの概要

【イートン・パンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ－クラスI 3\$シェアーズ】

◆基準価額の推移



◆1万口当たりの費用明細

(2017年11月1日～2018年10月31日)

当該期間の1万口当たりの費用明細については
開示されていないため、掲載しておりません。

◆組入上位10銘柄

(2018年10月31日現在)

	銘柄名	業種／種別等	通貨	比率
				%
1	Reynolds Group Holdings Inc.	バンクローン	米ドル	1.10
2	JBS USA, LLC	バンクローン	米ドル	1.10
3	Infor (US), Inc.	バンクローン	米ドル	1.09
4	Asurion LLC	バンクローン	米ドル	1.07
5	Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	バンクローン	米ドル	1.06
6	Sprint Communications, Inc.	バンクローン	米ドル	1.04
7	Virgin Media Investment Holdings Limited	バンクローン	米ドル	0.95
8	Jaguar Holding Company II	バンクローン	米ドル	0.92
9	Uber Technologies	バンクローン	米ドル	0.91
10	Albertsons, LLC	バンクローン	米ドル	0.91
組入銘柄数		472銘柄		

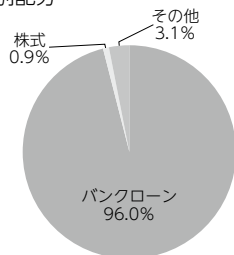
(注1) 比率は、イートン・パンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオの純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 「イートン・パンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ－クラスI 3\$シェアーズ」は、「イートン・パンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ」の個別クラスとなっております。

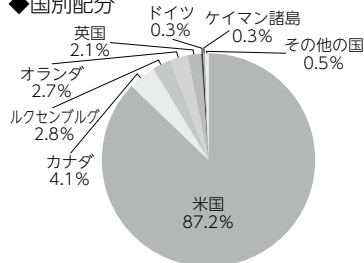
(注3) 上記の表は、イートン・パンス・マネジメントが作成したデータをもとに記載してあります。

(注4) 組入銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）に記載してあります。

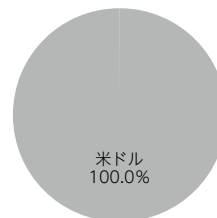
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 資産別配分の比率は、イートン・パンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオの純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) その他は、純資産総額から有価証券等を差し引いた数字です。

(注3) 「イートン・パンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ クラスⅠ 3\$シェアーズ」は、「イートン・パンス・インターナショナル（ケイマン・アイランズ）フローティング・レート・インカム・ポートフォリオ」の個別クラスとなっております。

(注4) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示してあります。

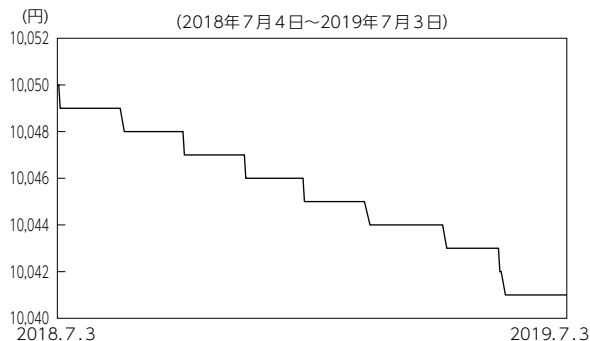
(注5) 国別配分、通貨別配分の比率は、ポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

(注6) 比率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示してあります。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注7) 上記のグラフは、イートン・パンス・マネジメントが作成したデータをもとに記載してあります。

【日本短期公社債マザーファンド】

◆基準価額の推移



◆1万口当たりの費用明細

該当事項はございません。

(2018年7月4日～2019年7月3日)

◆組入上位10銘柄

(2019年7月3日現在)

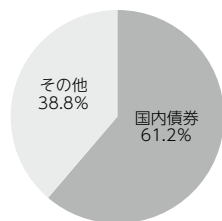
	銘柄名	業種／種類別	通貨	国（地域）	比率 %
1	平成20年度第9回 奈良県公債	地方債証券	円	日本	61.2
2	—	—	—	—	—
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—
組入銘柄数		1銘柄			

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

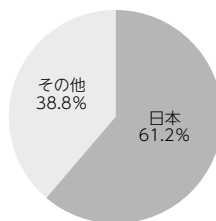
(注2) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載してあります。

(注3) 国（地域）につきましては発行国もしくは投資国を表示してあります。

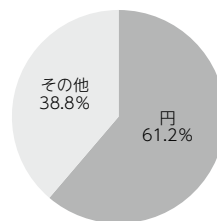
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示してあります。

(注3) その他は、純資産総額から有価証券等を差し引いた数字です。

(注4) 比率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示してあります。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書（全体版）をご参照ください。

＜当ファンドの参考指数について＞

●S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックス（円換算）

- ・S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックスは、米ドル建てのバンクローンを対象として、S&Pが定める一定の条件を満たしている銘柄によって構成される指数です。
- ・S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックスは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLCまたはその関連会社は、いかなる指数の資産クラスまたは市場セクターを正確に代表する能力に関して、明示または黙示を問わずいかなる表明または保証もしません。また、S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。
- ・S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックス（円換算）は、S&P/LSTAレバレッジド・ローン・インデックスをアセットマネジメントOneが円換算し、指数化したものです。

＜代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について＞

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）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は、㈱東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が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ために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、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（除く日本）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した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GBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。