

新光グローバル・マクロ戦略ファンド (ファンドラップ)

追加型投信／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）

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、主として新光グローバル・マクロ戦略マザーファンドを通じて、わが国を含む世界の公社債に実質的に投資を行い、世界主要国の株価指数先物取引および債券先物取引、為替予約取引なども実質的に活用します。

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5月9日～2020年5月8日

第5期	決算日：2020年5月8日	
第5期末 (2020年5月8日)	基準価額	8,951円
	純資産総額	1,947百万円
第5期	騰落率	△3.4%
	分配金合計	0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)

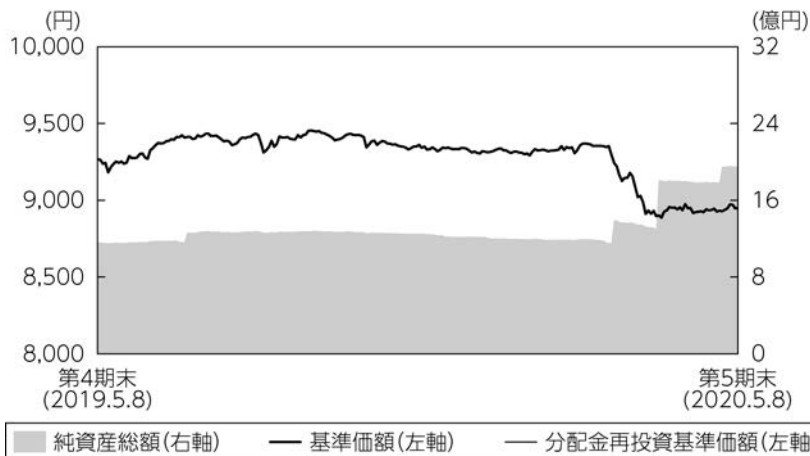
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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



第5期首： 9,266円
 第5期末： 8,951円
 (既払分配金0円)
 騰落率： △3.4%
 (分配金再投資ベース)

- (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はありません。
- (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

期首9,266円でスタートした基準価額は、8,951円（期首比△3.4%）で期末を迎えました。

当期全体では、株価指数先物取引や為替予約取引がそれぞれ基準価額にマイナスに作用した一方、債券先物取引はプラスに寄与しました。

1 万口当たりの費用明細

項目	第5期		項目の概要
	(2019年5月9日 ～2020年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	67円	0.721%	(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9,283円です。
(投信会社)	(61)	(0.655)	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)	(1)	(0.011)	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)	(5)	(0.055)	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) 売買委託手数料	12	0.131	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(先物・オプション)	(12)	(0.131)	
(c) その他費用	6	0.065	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.004)	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)	(6)	(0.062)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	85	0.916	

(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、売買委託手数料およびその他費用は、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。

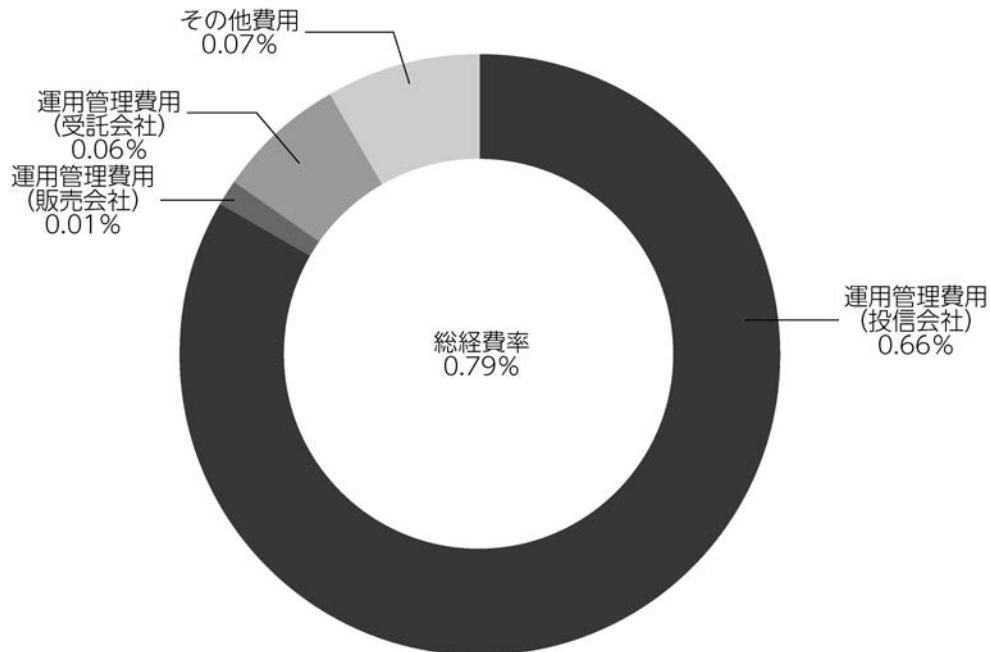
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

（参考情報）

◆総経費率

当期中の運用・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0.79%です。



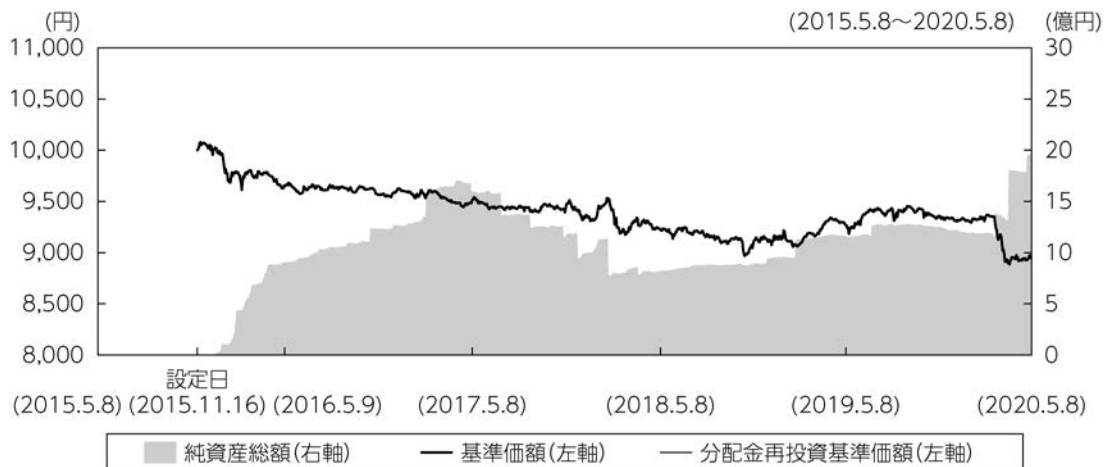
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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) 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はありません。
- (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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。

	2015年11月16日 設定日	2016年5月9日 決算日	2017年5月8日 決算日	2018年5月8日 決算日	2019年5月8日 決算日	2020年5月8日 決算日
基準価額 (分配落) (円)	10,000	9,647	9,513	9,224	9,266	8,951
期間分配金合計 (税引前) (円)	—	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額の騰落率 (%)	—	△3.5	△1.4	△3.0	0.5	△3.4
純資産総額 (百万円)	1	901	1,589	820	1,157	1,947

- (注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。
- (注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

投資環境

米中貿易摩擦の長期化から日本株式市場は夏場にかけて冴えない展開となりました。秋口から2019年末にかけては、米中貿易協議の進展期待や円高ドル安基調の一服、英国のEU（欧州連合）離脱を巡る混乱収束などを背景に、概ね堅調に推移しました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による混乱から、日本株式市場は2020年2月後半から3月半ばにかけて大幅な下落に見舞われました。当期全体では、期末の日本株式市場は期首比で下落しました。

米国株式市場は、米中貿易協議の進展期待などを背景に、2019年10月から2020年2月半ばにかけて概ね堅調な値動きとなりました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴うリスク回避の動きから、3月半ばにかけて大幅な下落となりました。期末にかけてはFRB（米連邦準備制度理事会）による大規模資金供給策などへの安心感から値を戻す展開となりました。

当期全体では、期末の米国株式市場は期首比で上昇しました。

欧州株式市場は、ECB（欧州中央銀行）の金融緩和路線への転換や米中貿易協議の部分合意期待などを支えに、じりじりと上昇する展開となりました。その後、欧州での新型コロナウイルスの急速な感染拡大を背景に、2020年2月から3月半ばにかけては大幅な値下がりとなりました。期末にかけては各国政府による大型財政政策や中央銀行による資金供給策などが好材料となり、下げ幅を縮小する展開となりました。

当期全体では、期末の欧州株式市場は期首比で下落しました。

カナダ株式市場は、米中貿易協議の進展期待や米国とのNAFTA（北米自由貿易協定）に代わる新協定合意などを好材料に、徐々に値を上げる展開となりました。しかし2020年2月後半から3月後半にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界的な経済停滞への懸念から、大幅な下落となりました。その後はFRBによる大規模資金供給策などを支えに、期末にかけて値を戻す展開となりました。

当期全体では、期末のカナダ株式市場は期首比で下落しました。

豪州株式市場は、RBA（オーストラリア準備銀行）の金融緩和姿勢や米中貿易協議の進展期待などを追い風に概ね堅調な推移となりました。しかし新型コロナウイルスの大流行に伴う世界経済の混乱に加え、需要減少による資源価格下落への懸念から、2020年2月半ばから3月後半にかけて大幅な下落となりました。その後は各国の大規模な財政・金融政策などを支えに、期末にかけて値を戻す展開となりました。

当期全体では、期末の豪州株式市場は期首比で下落しました。

日本債券市場は、米中貿易協議の先行き不透明感に伴うリスク回避姿勢を背景に2019年の夏場にかけて概ね堅調に推移しました。その後は米中貿易協議の部分合意期待が強まり、一転して軟調な値動きとなりました。新型コロナウイルスの感染拡大による混乱が広がった2020年2月から3月にかけては、リスク回避の買いと換金売りなどが交錯し、乱高下する展開となりました。

当期全体では、期末の日本債券市場は期首比でほぼ横ばいとなりました。

米国債券市場は、米中貿易摩擦の長期化や米欧中央銀行の金融緩和姿勢などを背景に、2019年の夏場にかけて概ね堅調に推移しました。その後は米中貿易摩擦の緩和期待などを受けて、同年末にかけて概ね横ばいの展開となりました。新型コロナウイルスの中国国外での感染拡大懸念が強まった2020年2月後半以降は、投資家のリスク回避姿勢やF R Bの金融緩和などを背景に、上昇基調を強める展開となりました。

当期全体では、期末の米国債券市場は期首比で上昇しました。

欧州債券市場は、米中貿易摩擦やE C Bの金融緩和姿勢などを背景に2019年の夏場にかけて上昇しました。その後は英国のE U（欧州連合）離脱を巡る混乱収束を受けて債券市場の上昇は一服しました。新型コロナウイルスの感染拡大懸念が高まった2020年2月後半以降は、経済対策の財源を巡る懸念からイタリアが冴えない値動きとなった一方、英国は概ね堅調に推移しました。

当期全体では、期末の欧州債券市場はドイツ、英国、イタリアともに期首比で上昇しました。

カナダ債券市場は、米中貿易摩擦に伴う先行き不透明感から2019年の夏場にかけて概ね堅調な値動きとなりました。その後は米中貿易協議の進展期待などを背景に政策への不透明感が後退し、カナダ債券市場の上昇は一服しました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大を受けてカナダ中央銀行が大幅な利下げで対応したことなどから、カナダ債券市場は上昇基調を強める展開となりました。

当期全体では、期末のカナダ債券市場は期首比で上昇しました。

豪州債券市場は、米中貿易摩擦に伴う不確実性や豪州経済の成長鈍化を踏まえ、R B Aが金融緩和姿勢を維持したことなどから概ね底堅い推移となりました。米中貿易協議の部分合意期待などから債券市場の上昇が一服する場面もありましたが、森林火災の長期化や新型コロナウイルスの感染拡大によりR B Aが金融緩和姿勢を継続するなか、2020年に入っても概ね堅調に推移しました。

当期全体では、期末の豪州債券市場は期首比で上昇しました。

1米ドル=110円台前半でスタートした米ドル／円相場は、米中貿易摩擦に伴うリスク回避姿勢やF R Bの金融緩和姿勢などを背景に2019年夏場にかけて円高米ドル安となりました。その後は米中貿易協議の進展期待などから、同年末にかけて円安米ドル高となりました。2020年は新型コロナウイルスの感染拡大に伴う混乱のなか、基軸通貨の米ドルを確保する動きなどから乱高下する場面が見られ、1米ドル=106円台前半で期末を迎えました。

1ユーロ=123円台前半でスタートしたユーロ／円相場は、E C Bの金融緩和路線への転換や米中貿易協議の先行き不透明感などを背景に2019年夏場にかけて円高ユーロ安となりましたが、その後は米中貿易協議の部分合意期待や英国のE U離脱を巡る混乱収束などから、同年末にかけて円安ユーロ高となりました。2020年は新型コロナウイルスの感染拡大からの復興財源を巡るE U加盟国間の対立などから再び円高ユーロ安となり、1ユーロ=115円台前半で期末を迎えました。

1英ポンド=144円でスタートした英ポンド／円相場は、英国のE U離脱を巡る不透明感が嫌気されるなか、2019年夏場にかけて円高英ポンド安が進みました。その後、E U単一市場からの「合意なき離脱」が回避されることになり、同年末にかけて円安英ポンド高となりました。2020年の年明け以降は欧州での新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などから再び円高英ポンド安となり、1英ポンド=131円台後半で期末を迎えました。

1カナダドル=81円台後半でスタートしたカナダドル／円相場は、米中貿易摩擦に伴うリスク回避姿勢などを背景に2019年夏場にかけて円高カナダドル安で推移しました。秋口以降は米中貿易協議の部分合意期待が高まるなか、相対的に高金利のカナダドルを選好する動きなどから、円安カナダドル高に転じました。新型コロナウイルスの感染拡大懸念が高まった2020年2月後半以降は大幅な円高カナダドル安となり、1カナダドル=76円台前半で期末を迎えました。

1豪ドル=77円台前半でスタートした豪ドル／円相場は、R B Aの金融緩和姿勢や米中貿易協議の長期化に伴うリスク回避姿勢などを背景に2019年夏場にかけて円高豪ドル安となりました。その後は、2020年2月後半から3月後半にかけて、新型コロナウイルスの爆発的な感染拡大に伴う世界経済混乱や資源価格下落への懸念から円高豪ドル安が加速する展開となり、1豪ドル=69円台前半で期末を迎えました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

「新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド」を主要投資対象としました。マザーファンドの組入比率は期を通じて高位としました。

●新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

世界主要国の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引について、ロング（買い持ち）またはショート（売り持ち）のポジション調整を機動的に行いました。

また、わが国の公社債への投資として、短期社債を組み入れています。

アセットクラス	国/地域	銘柄	組入比率
株価指数先物取引	日本	日経225先物	△2.3%
		TOPIX先物	2.2%
	米国	ミニS&P500先物	3.5%
	ユーロ	ユーロストックス50先物	1.1%
	英国	FTSE100先物	2.4%
	カナダ	S&Pトロント60指数先物	△2.1%
	豪州	ASX SPI200指数先物	2.5%
債券先物取引	日本	10年物国債先物	△5.7%
	米国	10年物国債先物	3.3%
	ドイツ	長期国債先物	2.3%
	英国	長期国債先物	2.7%
	カナダ	10年物国債先物	4.7%
	豪州	10年物国債先物	1.9%
為替予約取引	米国	米ドル/円	△0.2%
	ユーロ	ユーロ/円	△0.5%
	英国	英ポンド/円	△0.8%
	カナダ	カナダドル/円	△0.6%
	豪州	豪ドル/円	△0.8%

分配金

収益分配金につきましては基準価額水準・市況動向等を勘案し、無分配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	当期
	2019年5月9日 ～2020年5月8日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	－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

引き続きマザーファンドの高位組み入れを継続する方針です。

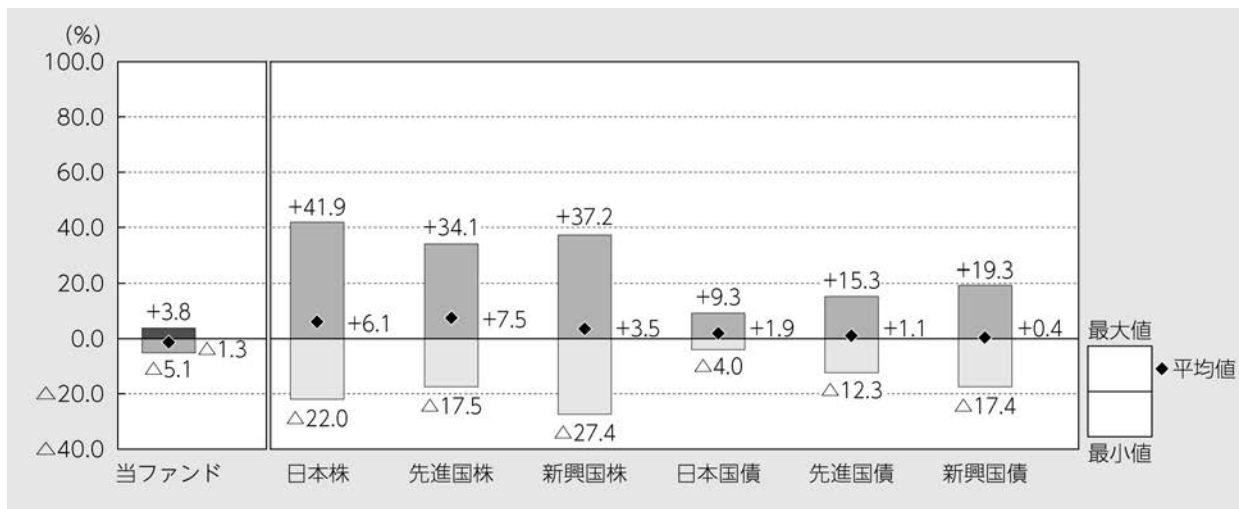
●新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

引き続き、わが国を含む世界の公社債に投資を行うと同時に、世界主要国の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引等も活用しつつ、投資信託財産の成長を目指して積極的な運用を行う方針です。

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）	
信託期間	原則、無期限です。	
運用方針	投資信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。	
主要投資対象	新光グローバル・マクロ戦略ファンド（ファンドラップ）	新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド受益証券を投資対象とします。
	新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド	わが国および海外の公社債を主要投資対象とし、世界主要国の株価指数先物取引および債券先物取引を主要取引対象とし、為替予約取引等も活用します。
運用方法	主として新光グローバル・マクロ戦略マザーファンドへの投資を通じて、わが国を含む世界の公社債に実質的に投資を行い、世界主要国の株価指数先物取引および債券先物取引、為替予約取引等も実質的に活用しつつ、投資信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。	
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、基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、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



当ファンド : 2016年11月～2020年4月

代表的な資産クラス : 2015年5月～2020年4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-E Mグローバル・ディバースィファイド（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 (2020年5月8日現在)

◆組入ファンド等

(組入ファンド数：1ファンド)

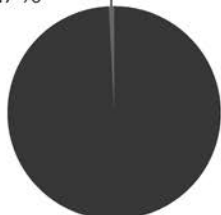
	当期末
	2020年5月8日
新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド	99.3%
その他	0.7

(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

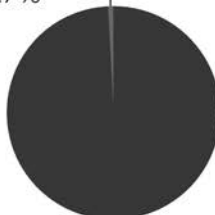
その他
0.7%



親投資信託受益証券
99.3%

◆国別配分

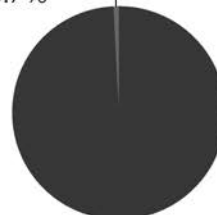
その他
0.7%



日本
99.3%

◆通貨別配分

その他
0.7%



日本・円
99.3%

(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。

純資産等

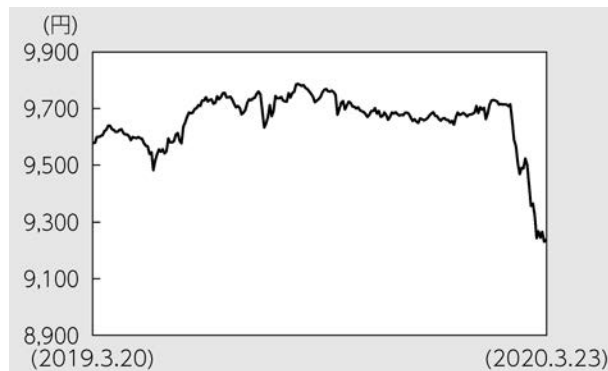
項目	当期末
	2020年5月8日
純資産総額	1,947,862,399円
受益権総口数	2,176,103,937口
1万口当たり基準価額	8,951円

(注) 当期中における追加設定元本額は1,212,913,540円、同解約元本額は285,926,035円です。

組入ファンドの概要

【新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド】（計算期間 2019年3月21日～2020年3月23日）

◆基準価額の推移



◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	15円 (15)	0.154% (0.154)
(b) その他費用 (その他)	13 (13)	0.138 (0.138)
合計	28	0.292
期中の平均基準価額は9,659円です。		

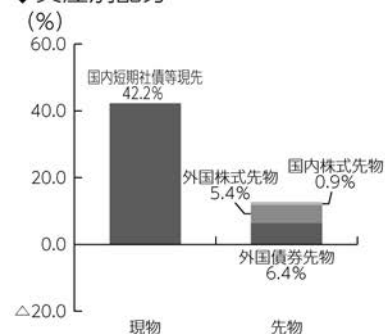
◆組入上位10銘柄（先物）

銘柄名	売買	比率
EURO-BUND FUTURE	買建	3.4%
US 10YR NOTE FUT	買建	3.2
S&P/TSE 60 IX FUT	買建	1.9
TOPIX	買建	1.6
S&P500 EMINI FUT	買建	1.6
AUST 10Y BOND FUT	売建	1.6
CAN 10YR BOND FUT	買建	1.4
DJ EURO STOXX 50	買建	0.7
日経平均	売建	0.7
SPI 200 FUTURES	買建	0.6
組入銘柄数	11銘柄	

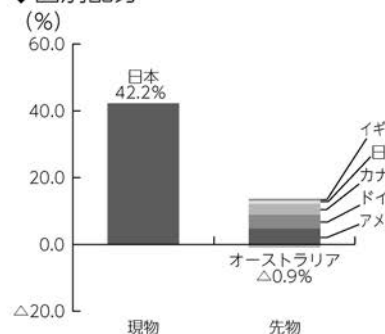
◆組入上位銘柄（国内短期社債等）

銘柄名	通貨	比率
エムジーリス	日本・円	42.2%
銘柄数	1銘柄	

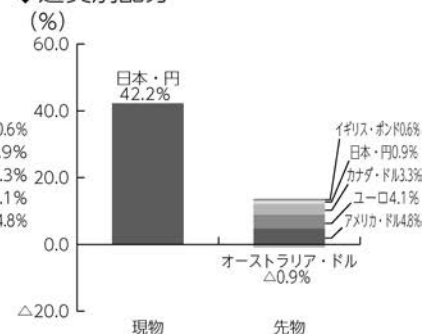
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



- (注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。
 (注2) 「1万口当たりの費用明細」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。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。
 (注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。
 (注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。
 (注5) 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。
 (注6) 先物比率は、買建比率－売建比率です。
 (注7) 計算期間中の運用経過や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）に記載されています。

<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・ディバーシファイド」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。

