

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 2021年5月11日～2022年5月9日

第7期	決算日：2022年5月9日	
第7期末 (2022年5月9日)	基準価額	8,967円
	純資産総額	749百万円
第7期	騰落率	△0.2%
	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)

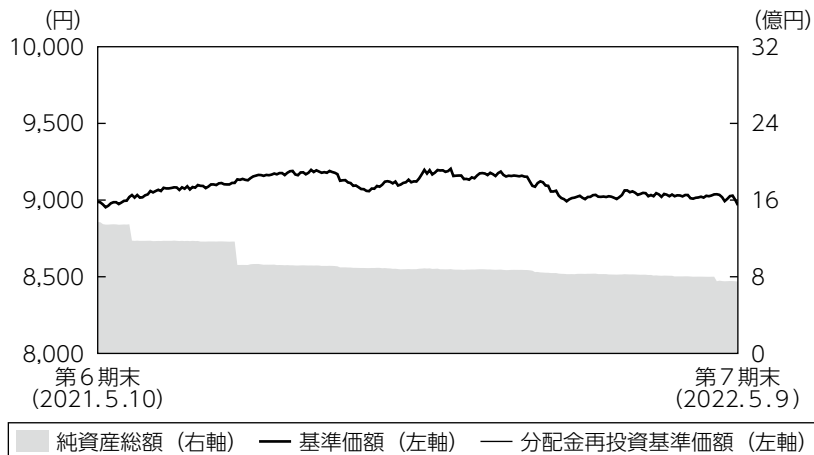
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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7期首： 8,989円
 第7期末： 8,967円
 (既払分配金0円)
 騰落率： $\Delta 0.2\%$
 (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8,989円でスタートした基準価額は、8,967円（期首比 $\Delta 0.2\%$ ）で期末を迎えました。

当期全体では、株価指数先物取引および為替予約取引が基準価額にプラスに寄与した一方、債券先物取引がマイナス要因となりました。

1 万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	(2021年5月11日 ～2022年5月9日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	66円	0.724%	(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9,091円です。 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
(投信会社)	(60)	(0.658)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(5)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	7	0.081	(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)	(7)	(0.081)	
(c) その他費用	7	0.081	(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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(7)	(0.077)	
合計	80	0.885	

(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。

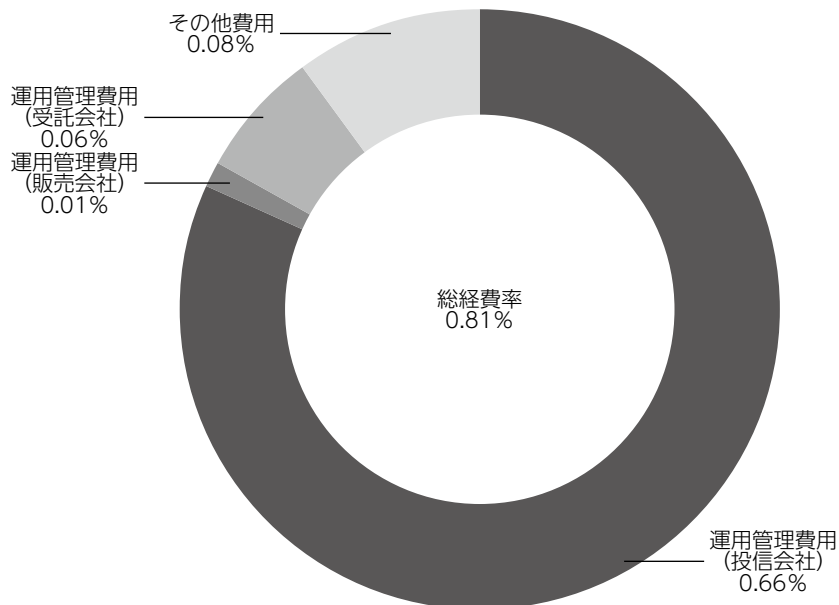
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.81%です。



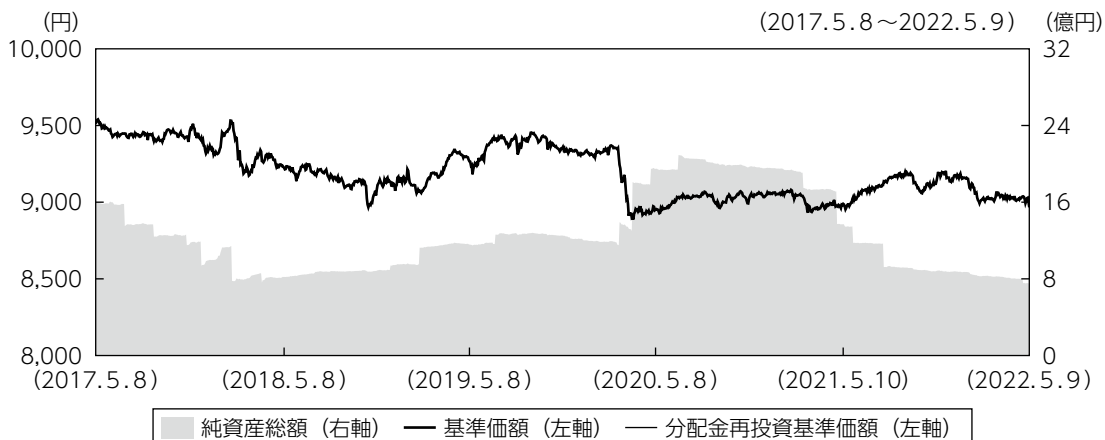
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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、2017年5月8日の基準価額に合わせて指数化しています。

	2017年5月8日 期首	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	2021年5月10日 決算日	2022年5月9日 決算日
基準価額 (分配落) (円)	9,513	9,224	9,266	8,951	8,989	8,967
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 (%)	—	△3.0	0.5	△3.4	0.4	△0.2
純資産総額 (百万円)	1,589	820	1,157	1,947	1,370	749

(注) 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

日本株式市場は、新型コロナウイルス変異株（デルタ株）の感染拡大が重石となり、揉み合いの展開が続きました。米国政府による財政出動への期待感などから2021年8月下旬から9月中旬にかけては上昇するも、その後は新たな新型コロナウイルス変異株（オミクロン株）の感染拡大に加え、米国の金融引き締め加速やロシアのウクライナへの軍事侵攻などへの懸念が、株価の下押し要因となりました。

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、新型コロナウイルスワクチンの接種進展などに伴う景気回復加速への期待感のなか、金融緩和の早期縮小に対するF R B（米連邦準備制度理事会）の慎重姿勢や、好決算の目立つ米国企業業績などを支えに2022年末にかけて上昇基調となりました。その後はF R Bによる金融引き締め加速やロシアによるウクライナ侵攻などへの懸念から、それまでの上げ幅を吐き出す格好となりました。

期末の米国株式市場は期首比で下落しました。

欧州株式市場は、新型コロナウイルスワクチンの接種進展に伴う景気回復期待や、F R BおよびECB（欧州中央銀行）の金融緩和姿勢などを支えに、2021年末にかけて概ね底堅い推移となりました。2022年の年明け以降は、F R BやECBによる早期利上げへの警戒感に加え、ロシアのウクライナへの軍事侵攻をきっかけとしたエネルギー価格の高騰が懸念される状況の下、概ね軟調な値動きとなりました。

期末の欧州株式市場は期首比で下落しました。

英国株式市場は、新型コロナウイルス対策の行動規制の緩和や英国経済の順調な回復などを背景に概ね堅調に推移しました。2021年10月以降は英国の早期利上げ観測が広がり、同年12月以降は計4回の利上げが実施されましたが、英国株式市場への影響は限定的でした。また、ロシアによるウクライナ侵攻への懸念から値下がりする場面もありましたが、一時的な下落にとどまりました。

期末の英国株式市場は期首比で上昇しました。

カナダ株式市場は、新型コロナウイルスワクチンの接種進展や原油価格の持ち直しなどを背景とした景気回復への期待感から概ね堅調な値動きとなりました。2022年に入ると、F R Bによる早期利上げ観測やロシアによるウクライナ侵攻への警戒感が広がる場面もありましたが、原油価格上昇が産油国のカナダ経済にプラスとの見方から、カナダ株式市場は引き続き底堅い展開となりました。

期末のカナダ株式市場は期首比で上昇しました。

豪州株式市場は、石炭などの資源価格上昇が豪州経済の追い風となり、2021年8月にかけて上昇しました。その後は新型コロナウイルスの感染拡大に伴うロックダウン（都市封鎖）などが重石となり、2021年末にかけて上値の重い展開となりました。2022年の年明け後はF R Bによる早期利上げへの警戒感などを背景に下落する場面もありましたが、程なく回復する展開となりました。

期末の豪州株式市場は期首比で上昇しました。

日本債券市場は、日本国内での新型コロナウイルス変異株（デルタ株）の感染拡大に伴うリスク回避の動きなどを背景に、2021年8月上旬にかけて概ね底堅い値動きとなりました。その後はインフレ圧力に伴う米国の早期利上げ観測から値下がりになりました。2022年の年明け後は、F R Bによる金融引き締め加速への警戒感や、日銀による金融緩和修正への思惑などから、債券価格の下落が進む展開となりました。

期末の日本債券市場は期首比で下落しました。

米国債券市場は、金融緩和の早期縮小に対するF R Bの慎重姿勢を追い風に、2021年7月末にかけて上昇しました。その後は物価上昇の長期化を受けてF R Bによる早期利上げ観測が高まり、米国債券市場は値下がりになりました。2022年の年明け後は、F R Bによる金融引き締め加速への警戒感から、債券価格の下落が進む展開となりました。

期末の米国債券市場は期首比で下落しました。

欧州債券市場（代表的な市場としてドイツ）は、E C Bの金融緩和姿勢や新型コロナウイルス変異株（オミクロン株）の感染拡大などを背景に下値の固い展開が続きました。2021年12月以降は、F R BやE C Bによる早期利上げへの懸念から軟調に推移しました。ロシアによるウクライナ侵攻に伴うリスク回避姿勢から買いが優勢となる場面もありましたが、一時的なものにとどまりました。

期末の欧州債券市場は期首比で下落しました。

英国債券市場は、2021年8月にかけては底堅く推移しましたが、イングランド銀行（中央銀行）による利上げ観測が広がった10月にかけては値下がりしました。その後イングランド銀行が利上げを開始した12月以降は、エネルギー価格上昇などに伴いインフレ長期化への警戒感が強まるなか、英国債券市場は下げ幅を拡大する展開となりました。

期末の英国債券市場は期首比で下落しました。

カナダ債券市場は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加傾向などを背景に、2021年8月にかけて概ね堅調に推移しました。その後はカナダ国内の物価上昇に伴い、カナダ銀行（中央銀行）による早期利上げ観測が広がったことなどをを受けて、一転して軟調な値動きとなりました。2022年3月から4月にかけてカナダ銀行が2度の利上げを実施するなか、期末にかけてカナダ債券市場の下落基調が続きました。

期末のカナダ債券市場は期首比で下落しました。

豪州債券市場は、新型コロナウイルスの感染拡大に伴うオーストラリア経済の減速懸念から、2021年8月にかけて概ね堅調に推移しました。その後はロックダウン解除や資源価格上昇などに伴うオーストラリア経済の回復期待や、R B A（オーストラリア準備銀行）による利上げ観測などを背景に、一転して軟調な値動きとなりました。

期末の豪州債券市場は期首比で下落しました。

1米ドル=108円台後半でスタートした米ドル／円相場は、米国のインフレ圧力が長期化するなか、F R Bによる早期利上げ観測が高まった2021年9月以降、円安ドル高が加速する展開となりました。2022年3月のF O M C（米連邦公開市場委員会）以降はF R Bのタカ派姿勢を受けて円安ドル高がさらに加速する格好となりました。原油高による日本の経常収支悪化なども円安ドル高要因となり、1米ドル=130円台後半で期末を迎えました。

1ユーロ=132円台前半でスタートしたユーロ／円相場は、新型コロナウイルス禍からの欧州経済の回復期待が円安ユーロ高要因となる一方、E C Bによる金融緩和長期化観測が円高ユーロ安要因となり、1ユーロ=130円を挟んだ展開となりました。2022年の年明け後は、年内利上げ観測の強まるE C Bと金融緩和継続の方針を崩さない日銀の間で金融政策の違いが鮮明となるなか、円安ユーロ高の展開となり、1ユーロ=137円台後半で期末を迎えました。

1英ポンド=152円台後半でスタートした英ポンド／円相場は、新型コロナウイルス対策の行動規制の段階的緩和に伴う英国経済の回復期待や、金融緩和縮小を巡る日英の方向性の違いなどが円安英ポンド高の圧力となりました。イングランド銀行（中央銀行）が2021年12月以降、計4回の利上げを実施した一方、日銀が金融緩和継続の方針を崩さなかった結果、円安英ポンド高が進行し、1英ポンド=160円台後半で期末を迎えました。

1カナダドル=89円台後半でスタートしたカナダドル／円相場は、カナダにおける新型コロナウイルスの感染再拡大などから2021年9月にかけて円高カナダドル安となりました。その後はカナダ銀行による早期利上げ観測や原油価格の上昇などを背景に円安カナダドル高の展開となり、1カナダドル=101円台前半で期末を迎えました。

1豪ドル=85円台前半でスタートした豪ドル／円相場は、オーストラリア国内の厳しいロックダウン（都市封鎖）などが重石となり、2021年8月にかけて円高豪ドル安の展開となりました。R B Aが量的金融緩和の縮小開始を決定した9月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う行動制限の緩和や資源価格の上昇などを背景に円安豪ドル高に振れる展開となり、1豪ドル=91円台後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ましたが、当マザーファンドに投資する一部のベビーファンドが2021年8月下旬に償還されて以降は、当マザーファンドの純資産減少に伴い短期社債の組み入れが困難となったため、組み入れを見送ることになりました。

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	TOPIX先物	5.1%
	米国	ミニS&P500先物	△7.3%
	ユーロ	ユーロ Stocks50先物	2.7%
	英国	FTSE100先物	3.2%
	カナダ	S&Pトロント60指数先物	6.8%
	豪州	ASX SPI200指数先物	2.2%
債券先物取引	米国	10年物国債先物	12.5%
	ドイツ	長期国債先物	5.6%
	英国	長期国債先物	△5.1%
	カナダ	10年物国債先物	11.8%
	豪州	10年物国債先物	10.5%
為替予約取引	米国	米ドル／円	△0.9%
	ユーロ	ユーロ／円	△0.4%
	英国	英ポンド／円	△0.9%
	カナダ	カナダドル／円	△1.2%
	豪州	豪ドル／円	0.6%

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
	2021年5月11日 ～2022年5月9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。

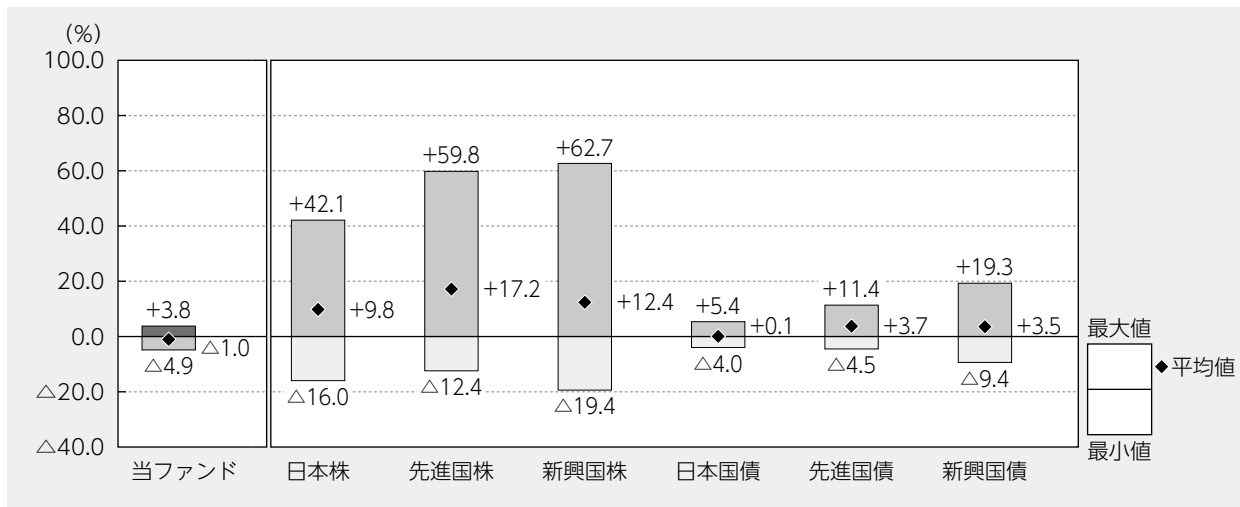
●新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド

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



2017年5月～2022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-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（2022年5月9日現在）

◆組入ファンド等

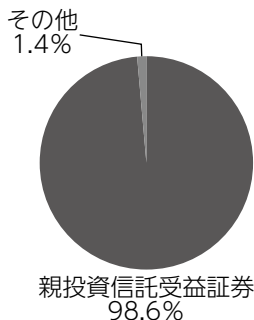
（組入ファンド数：1ファンド）

	当期末
	2022年5月9日
新光グローバル・マクロ戦略マザーファンド	98.6%
その他	1.4

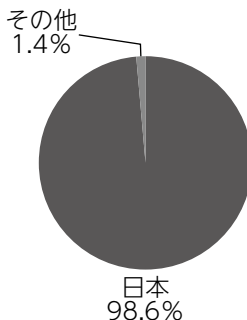
（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（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。

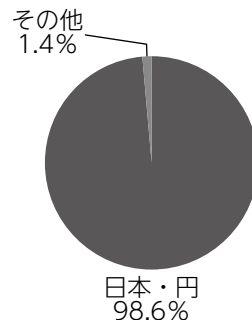
◆資産別配分



◆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。

純資産等

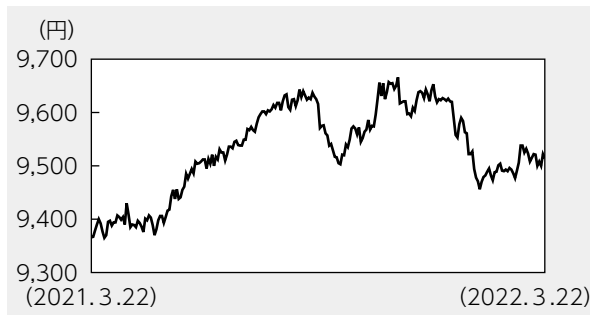
項目	当期末
	2022年5月9日
純資産総額	749,990,486円
受益権総口数	836,410,178口
1万口当たり基準価額	8,967円

（注）当期中における追加設定元本額は41,806,087円、同解約元本額は729,614,779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 2021年3月23日～2022年3月22日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄（先物）

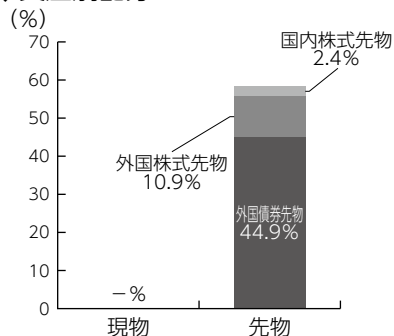
銘柄名	売買	比率
EURO-BUND FUTURES	買建	21.0%
CAN 10YR BOND FUTURES	買建	10.9
US 10YR NOTE FUTURES	買建	7.3
LONG GILT FUTURES	買建	7.1
S&P/TSE 60 IX FUTURES	買建	6.3
FTSE 100 INDEX FUTURES	買建	5.8
DJ EURO STOXX 50	売建	3.1
TOPIX	買建	2.4
SPI 200 FUTURES	買建	2.0
AUST 10Y BOND FUTURES	売建	1.4
組入銘柄数	10銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

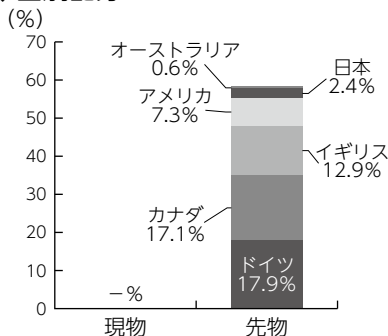
項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	8円 (8)	0.083% (0.083)
(b) その他費用 (その他)	6 (6)	0.059 (0.059)
合計	14	0.142

期中の平均基準価額は9,531円です。

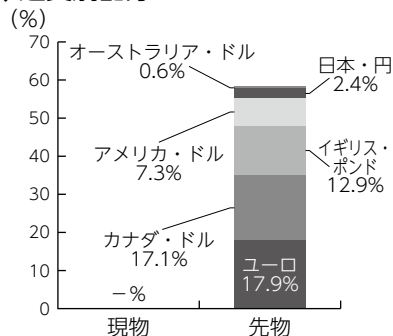
◆資産別配分



◆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) 資産別配分、国別配分、通貨別配分の先物比率は、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、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、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」という。）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標章または商標に関するすべての権利はJPX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。

