

三菱UFJ SRIファンド

愛称：ファミリー・フレンドリー

追加型投信／国内／株式

作成対象期間：2022年11月22日～2023年11月20日

第 19 期 決算日：2023年11月20日

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
当ファンドは、わが国の株式を実質的な主要投資対象とし、「ファミリー・フレンドリー企業」として高く評価され、かつ株価が本来あるべき価格に対して割安と判断される銘柄に投資を行うことにより、長期的な値上がり益の獲得をめざすべく、運用を行っております。ここに運用状況をご報告申し上げます。
当ファンドが受益者のみなさまの資産形成に資するよう、運用に努めてまいりますので、よろしくお願い申し上げます。

第19期末 (2023年11月20日)

基準価額	13,288円
純資産総額	1,890百万円
騰落率	+ 25.2%
分配金合計 ^(*)	300円

(注) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率で表示しています。

(*) 当期間の合計分配金額です。

当ファンドは、投資信託約款において運用報告書（全体版）に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めており、以下の方法でご覧いただけます。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。

閲覧・ダウンロード方法



<https://www.am.mufg.jp/>

[ファンド検索] に
ファンド名を入力

各ファンドの詳細ページで
閲覧およびダウンロード

MUFG 三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

■当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用
フリーダイヤル **0120-151034**

(受付時間：営業日の9：00～17：00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

※当ファンドは「サステナブル・ファンド」です。

サステナブル・ファンドとは、ファンドの投資判断プロセスにおいてE S G要素を主要とし、環境や社会の課題解決・改善に寄与する企業等への投資を行い、お客さまの資産形成および持続可能な社会の実現に貢献するファンドとして、三菱UFJアセットマネジメントが定めたファンドをいいます。サステナブル・ファンドへの認定および除外は今後見直す場合があります。

詳細については、委託会社のホームページ (<https://www.am.mufig.jp/corp/houshin/csr/index.html>) でご覧いただけます。

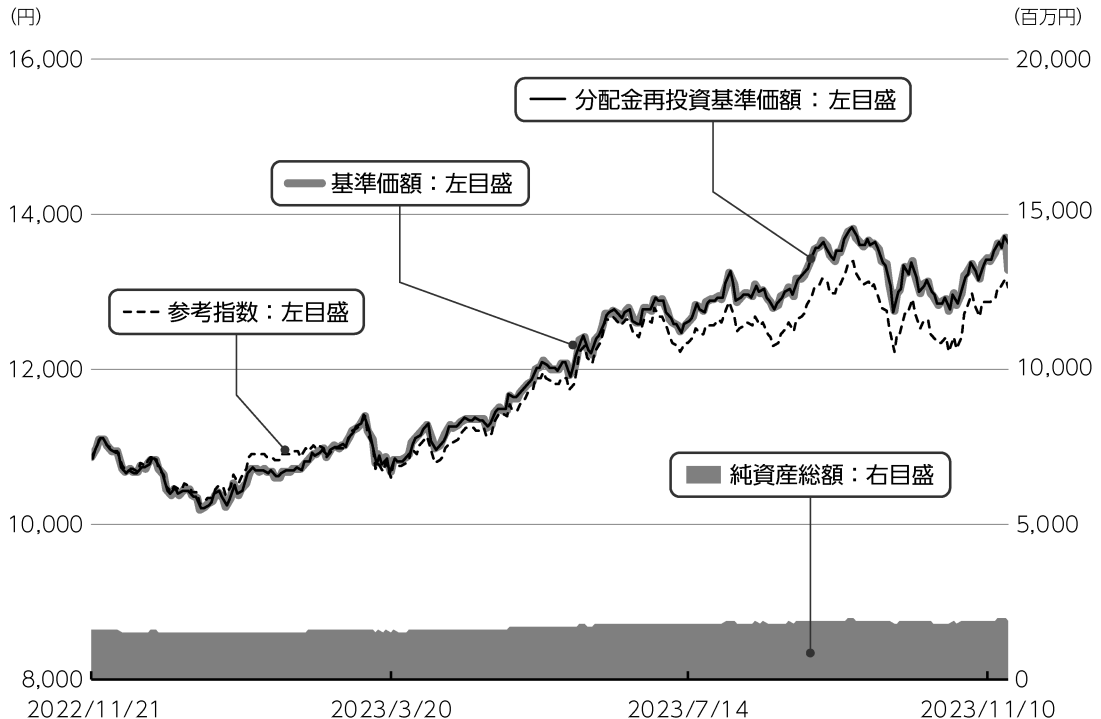
E S Gとは、環境 (Environment)、社会 (Social)、ガバナンス (Governance) の頭文字を取ったものです。

運用経過

第19期：2022年11月22日～2023年11月20日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第19期首	10,851円
第19期末	13,288円
既払分配金	300円
騰落率	25.2%
	(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみな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、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ25.2%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

米国におけるインフレ懸念の後退や利上げ停止観測、景気減速懸念がくすぶる米国などと比べた緩和的な金融環境や底堅い景況感など相対的な投資環境の良好さが意識され、国内株式市況が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

米中堅銀行の相次ぐ破綻により信用不安が高まったことや米国の金融引き締め長期化観測が根強いなかでの米国長期金利の上昇などにより、国内株式市況が一時的に下落したことが基準価額の一時的な下落要因となりました。

銘柄要因

上位5銘柄・・・SCREENホールディングス、川崎汽船、住友林業、マツダ、三井住友フィナンシャルグループ

下位5銘柄・・・アステラス製薬、三菱自動車工業、ディップ、三菱地所、カカクコム

※参考指数は、東証株価指数（TOPIX）です。詳細は最終ページの「指数に関して」をご参照ください。

※参考指数は、期首の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。

2022年11月22日～2023年11月20日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	197	1.643	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(92)	(0.767)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(92)	(0.767)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(13)	(0.109)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	0	0.003	(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)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	197	1.647	

期中の平均基準価額は、11,965円です。

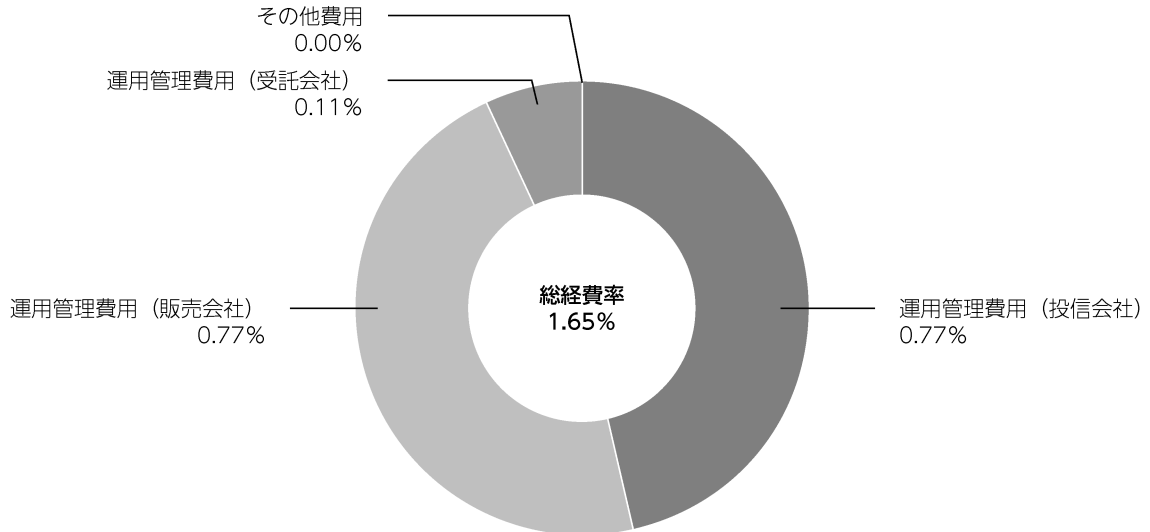
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）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1.65%**です。



(注) 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。

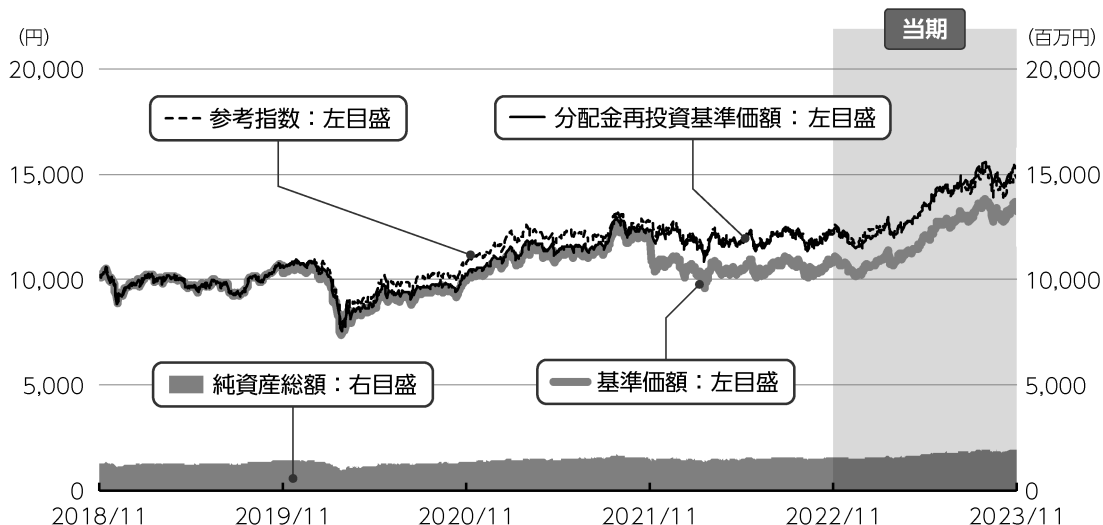
(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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は異なります。

2018年11月20日～2023年11月20日

最近5年間の基準価額等の推移について



※分配金再投資基準価額、参考指数は、2018年11月20日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

最近5年間の年間騰落率

	2018/11/20 期初	2019/11/20 決算日	2020/11/20 決算日	2021/11/22 決算日	2022/11/21 決算日	2023/11/20 決算日
基準価額 (円)	10,189	10,346	10,005	10,982	10,851	13,288
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	250	0	1,100	0	300
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	4.0	-3.3	20.8	-1.2	25.2
参考指数騰落率 (%)	—	4.0	2.1	18.3	-3.4	20.3
純資産総額 (百万円)	1,275	1,369	1,358	1,385	1,559	1,890

※ファンド年間騰落率は、参考指数年間騰落率と比較するため、収益分配金（税込み）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。

参考指数は、東証株価指数（TOPIX）です。詳細は最終ページの「指数に関して」をご参照ください。

投資環境について

国内株式市場

国内株式市場は上昇しました。

期間の初めから2022年12月末にかけては、米国景気の減速懸念が意識されたことのほか、日銀金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅が拡大されたことが事実上の金融引き締めと解釈されて円高・米ドル安が進行したことなどが嫌気され、国内株式市場は下落しました。

2023年1月から3月上旬にかけては、中国の「ゼロコロナ政策」解除で景気回復期待が高まったほか、米国での賃金インフレの鈍化が好感されたことから国内株式市場は上昇しました。しかし、3月中旬には、米中堅銀行の破綻による信用不安により投資家のリスク回避姿勢が強まり、上昇幅を縮小しました。

4月から6月にかけては、米欧の金融当局による迅速な対応により金融システム不安への過度な警戒感が和らいだことや、米国におけるインフレ懸念や大幅な利上げ観測の後退が好感されたほか、外国人

投資家の物色動向が牽引役となったことなどから、国内株式市場は概ね上昇基調で推移しました。

7月から9月中旬にかけては、米国債の格下げや米債務上限問題などが相場の重しとなる場面もあったものの、米国におけるインフレ懸念の後退や利上げ停止観測、景気減速懸念がくすぶる米国などと比べた緩和的な金融環境や底堅い景況感など相対的な投資環境の良好さが意識され、国内株式市場は堅調に推移しました。しかし、9月末には、米政府機関の閉鎖懸念のほか、米金融引き締めの長期化観測などを受けて、国内株式市場は上昇幅を縮小しました。

10月以降、米国長期金利の上昇や緊迫化する中東情勢が国内株式市場の重しとなったものの、米金融引き締めの長期化観測の後退や米国長期金利の先高観の修正などが好感され、期間末にかけて国内株式市場は上昇しました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ SRIファンド

三菱UFJ SRIマザーファンド受益証券を通じて、わが国の株式に投資しています。運用の基本方針にしたがい、マザーファンドの組入比率は高水準を維持しました。

▶ 三菱UFJ SRIマザーファンド

銘柄選択にあたっては、「ファミリー・フレンドリー企業」として高く評価され、かつ株価が本来あるべき価格（理論株価）に対して割安と判断される銘柄に投資を行いました。

なお、「ファミリー・フレンドリー企業」としての評価はグッドバンカー社からの投資助言に基づいて行い、また個別銘柄の理論株価および理論株価に対する割安度の測定については、三菱UFJ信託銀行と同社グループの投資理論研究機関「MTEC」（三菱UFJトラスト投資工学研究所）が共同開発した「理論株価モデル」を活用しています。

組入銘柄数は、期間の初めは65銘柄としましたが、期間中に新たな銘柄の購入や組入れ銘柄の売却を行った結果、期間末において1銘柄減少し64銘柄としました。期間の初めと期間末の変化では34銘柄を新規に組み入れ、35銘柄を全株売却しています。

SRIの観点からの売買

中期経営計画において環境変化に適応し続ける人材組織を掲げて人材戦略を打ち出したことを評価した阪和興業や、中期経営計画において多様性の推進と人権の尊重を掲げるなど人材の多様化と育成に積極的であることを評価した雪印メグミルクなどを新規に組み入れました。

本ファンドの投資対象候補銘柄は、全てファミリー・フレンドリー企業としての評価を行っております。このうち上位1/3に属する高い評価を受ける銘柄が、本ファンド全体の組み入れの90.1%を占めております。これら以外の組入銘柄もファミリー・フレンドリー企業として一定の評価を確保しつつ、理論株価に対して割安と判断される銘柄に投資をしています。

SRI要因等

地政学リスクなどによる世界景気の先行きが懸念される場面でのクオリティ特性の発揮や、外国人投資家からの資金流入により職場環境や多様性の尊重に関する制度の充実化に向けて積極的に取り組んでいる企業の株価が上昇したことにより、SRIスコアの有効性はプラスとなりました。

ダイバーシティ&インクルージョンを経

営理念実現のための重要な取り組みとして推進していることを評価して保有していた川崎汽船は、積極的な株主還元姿勢などが評価され株価が上昇したことがプラスに寄与しました。一方で、多様な人材の活躍や各従業員が能力を発揮しやすい環境づくりを推進していることを評価して保有していたカカクコムはショッピングや広告事業の低迷を受けて株価が下落したことがマイナスに作用しました。

※SRI (Socially Responsible Investment: 社会的責任投資) とは、財務的な観点からだけでなく、特に社会的存在として企業のあり方を評価して投資する運用手法です。

※ファミリー・フレンドリー評価上位企業とは全調査対象企業のうちファミリー・フレンドリー評価の観点から上位1/3以上に位置する企業です。

委託会社のスチュワードシップ活動

委託会社はお客さまから委託された資産の運用を行う立場として、投資先企業が株主利益を考慮して企業価値の向上や持

続的な成長を果たすことに資するため、気候変動や人権・ダイバーシティ、ガバナンス体制などの投資先企業におけるESG課題を重視し、企業との「目的を持った対話」や明確な方針のもとでの議決権行使などのスチュワードシップ活動を実施しました。

2022年11月から2023年10月に開催された投資先国内企業の株主総会における議決権行使状況についてご案内します。会社提案の23,107議案に関しては4,630議案に反対、株主提案433議案に関しては38議案に賛成しました。この結果、会社提案に対する反対行使比率は20.04%となりました。

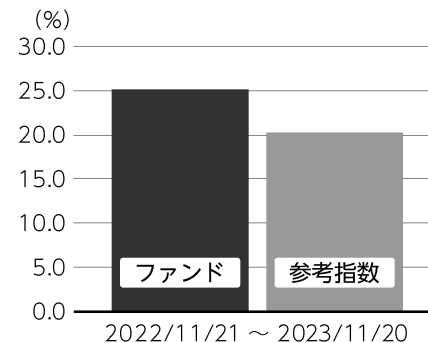
委託会社のスチュワードシップ活動は当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/corp/responsible/stewardshipcode.html>) にて開示を行っています。

当該投資信託の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。右記のグラフは当ファンド（ベビーファンド）の基準価額と参考指数との対比です。

参考指数は東証株価指数（TOPIX）です。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第19期 2022年11月22日～2023年11月20日	
	当期分配金（対基準価額比率）	300
当期の収益	300	
当期の収益以外	—	
翌期繰越分配対象額	3,991	

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

▶三菱UFJ SRIファンド

三菱UFJ SRIマザーファンド受益証券の組入比率は、引き続き高水準を維持する方針です。

▶三菱UFJ SRIマザーファンド

「ファミリー・フレンドリー企業」として、産休、育児、介護休業などの各種制度の整備・運用状況、多様な労働条件の整備・運用状況、仕事と家庭などの両立対応、子育てや介護に関する社会への支援活動などの観点から評価が高く、かつ独自の理論株価モデルで算出される株価

に対して割安と判断される銘柄を多く組み入れることをめざします。また、業種構成や規模構成などの要素については参考指数(TOPIX)と過度にカイ離しないようにポートフォリオを構築し運用することをめざします。

なお、今後においては、個別銘柄ベースでのファミリー・フレンドリー評価に変更があった場合、あるいは業績予想、株価水準等が大きく変化し、割安度が低下した際には、ファンドコンセプトを維持するために銘柄の入れ替えを行う方針です。

お知らせ

▶ 約款変更

- ・委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)

▶ その他

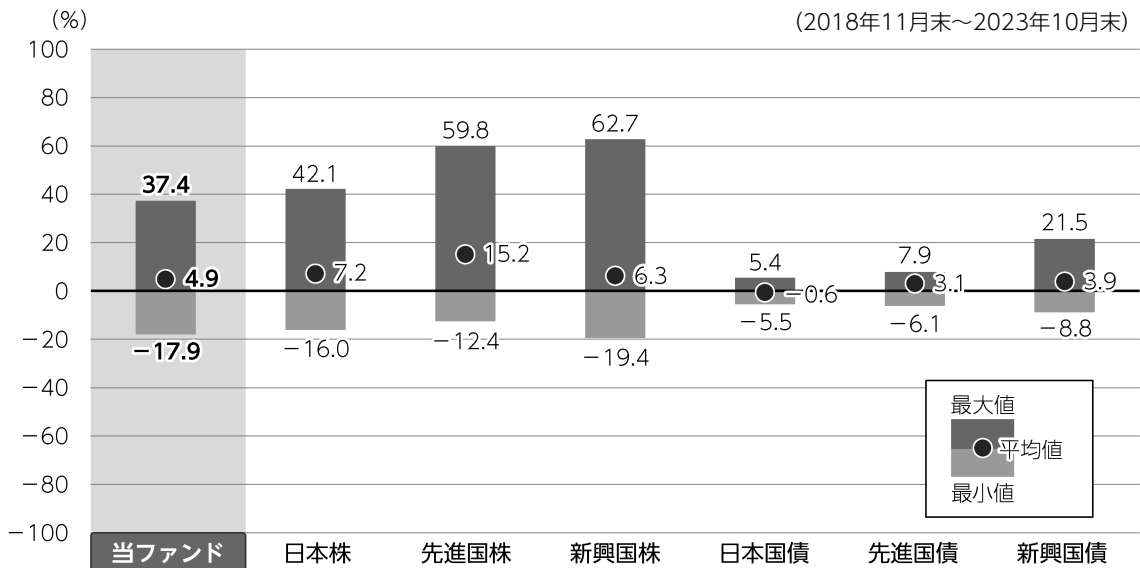
- ・該当事項はありません。

*本書が、受益者のみなさまのお手元に届くのは作成対象期間末から2ヵ月以上が経過していることにご留意ください。
なお、最近の運用状況や約款変更の内容等は当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) にて開示を行っている場合があります。

当該投資信託の概要

商品分類	追加型投信／国内／株式
信託期間	無期限（2004年12月3日設定）
運用方針	三菱UFJ SRIマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。
主要投資対象	<p>■当ファンド 三菱UFJ SRIマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、わが国の株式に直接投資することがあります。</p> <p>■三菱UFJ SRIマザーファンド わが国の株式を主要投資対象とします。</p>
運用方法	わが国の株式を実質的な主要投資対象とし、「ファミリー・フレンドリー企業」として高く評価され、かつ株価が本来あるべき価格（理論株価）に対して割安と判断される銘柄に投資を行うことにより、長期的な値上がり益の獲得をめざします。
分配方針	毎年1回決算（原則として11月20日。ただし、11月20日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。原則として、決算日の基準価額水準が当初元本額10,000円（10,000口当たり）を超えている場合に、当期の基準価額上昇分の範囲内で分配します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



●上記は、2018年11月から2023年10月の5年間における1年騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて定量的に比較できるように作成したものです。

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)
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)
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)
新興国債	JPMorgan Global Diversified

※詳細は最終ページの「指数に関して」をご参照ください。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

●全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

●ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

●騰落率は直近前月末から60ヵ月遡った算出結果であり、ファンドの決算日に対応した数値とは異なります。

当該投資信託のデータ

2023年11月20日現在

▶ 当該投資信託の組入資産の内容

組入ファンド

(組入銘柄数：1銘柄)

ファンド名	第19期末 2023年11月20日
三菱UFJ SRIマザーファンド	99.7%

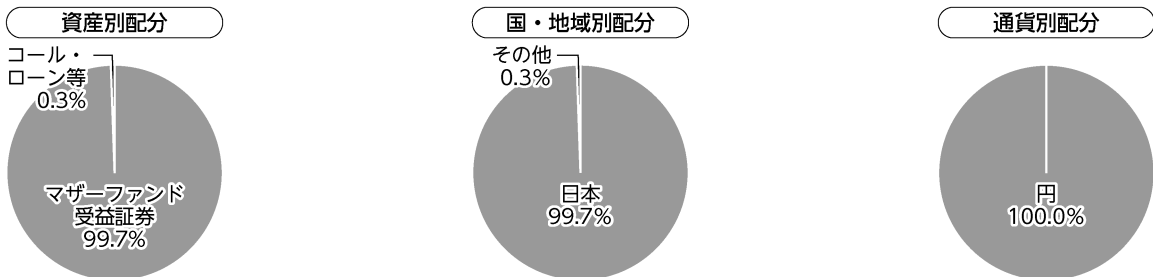
※比率は当ファンドの純資産総額に対するマザーファンドの評価額の割合です。

純資産等

項目	第19期末 2023年11月20日
純資産総額 (円)	1,890,941,654
受益権口数 (口)	1,422,995,863
1万口当たり基準価額 (円)	13,288

※当期中において追加設定元本は144,747,610円
同解約元本は 158,920,741円です。

種別構成等



※比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。構成比率が5%未満の項目は「その他」に分類しています。

※国・地域別配分の「その他」には、コール・ローン等のように、複数の金融機関等（国内外）を相手先として他のファンドの余裕資金等と合せて運用しているものを含みます。

※【国・地域別配分】、【通貨別配分】は、組入ファンドの発行地、発行通貨を表示しています。

290156

2023年11月20日現在

組入上位ファンドの概要

三菱UFJ SRIマザーファンド

基準価額の推移

2022年11月21日～2023年11月20日



1万口当たりの費用明細

2022年11月22日～2023年11月20日

項目	当期	
	金額(円)	比率(%)
(a)売買委託手数料	0	0.001
(株 式)	(0)	(0.001)
合計	0	0.001

期中の平均基準価額は、26,791円です。

※項目の概要については、前記「1万口当たりの費用明細」をご参照ください。

組入上位10銘柄

(組入銘柄数：64銘柄)

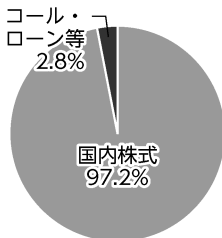
	銘柄	種類	国・地域	業種/種別	比率(%)
1	東京海上ホールディングス	株式	日本	保険業	2.0
2	信越化学工業	株式	日本	化学	2.0
3	住友林業	株式	日本	建設業	2.0
4	明治ホールディングス	株式	日本	食料品	2.0
5	S C S K	株式	日本	情報・通信業	2.0
6	B I P R O G Y	株式	日本	情報・通信業	2.0
7	カカココム	株式	日本	サービス業	2.0
8	L I X I L	株式	日本	金属製品	2.0
9	テクノプロ・ホールディングス	株式	日本	サービス業	2.0
10	大和証券グループ本社	株式	日本	証券、商品先物取引業	2.0

※比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合です。
 ※原則、国・地域については、法人登録地を表示しています。

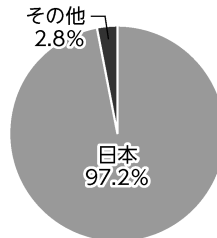
※なお、全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。

種別構成等

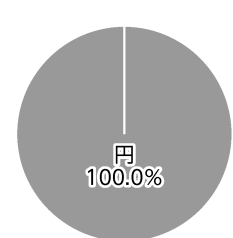
資産別配分



国・地域別配分



通貨別配分



※比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合です。
 構成比率が5%未満の項目は「その他」に分類しています。
 ※原則、国・地域については、法人登録地を表示しています。

※国・地域別配分の「その他」には、コール・ローン等のように、複数の金融機関等（国内外）を相手先とし他のファンドの余裕資金等と合せて運用しているものを含みます。

指数に関して

▶ ファンドの参考指数である『東証株価指数（TOPIX）』について

東証株価指数（TOPIX）とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、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、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社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TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

▶ 「ファンドと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）（配当込み）

東証株価指数（TOPIX）（配当込み）とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、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、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社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TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

●MSCI コクサイ・インデックス（配当込み）

MSCI コクサイ・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCI コクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

●MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み）

MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

●NOMURA-BPI（国債）

NOMURA-BPI（国債）とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI（総合）のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用される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）

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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

●JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権は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。







三菱UFJアセットマネジメント