

SMB C・アムンディ クライメート・アクション

追加型投信／内外／株式

第 9 期

(決算日 2024年 2月26日)

作成対象期間 (2023年 8月26日～2024年 2月26日)

第 9 期末 (2024年 2月26日)	
基準価額	18,137円
純資産総額	10,663百万円
第 9 期	
騰落率	17.1%
分配金 (税込み)	0円

(注) 騰落率は分配金 (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す。

●受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。

当ファンドは、「CPR Invest - クライメート・アクション」への投資を通じて、主に世界の気候変動対応に責任を持って取り組む企業の株式に実質的に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。また、「C A マネープールファンド (適格機関投資家専用)」にも投資を行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

当作成対象期間につきましてもそれに沿った運用を行いました。

ここに運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

- 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ます。

【閲覧方法】

右記くお問い合わせ先>に記載されているホームページアドレスにアクセス⇒「ファンド情報」メニューから「ファンド・基準価額一覧」(当ファンドが償還した場合は「償還ファンド一覧」)をクリック⇒当該一覧から当ファンドのファンド名称をクリック⇒運用報告書 (全体版) をクリック

- 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。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

<お問い合わせ先>

お客様サポートライン：050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス：<https://www.amundi.co.jp/>

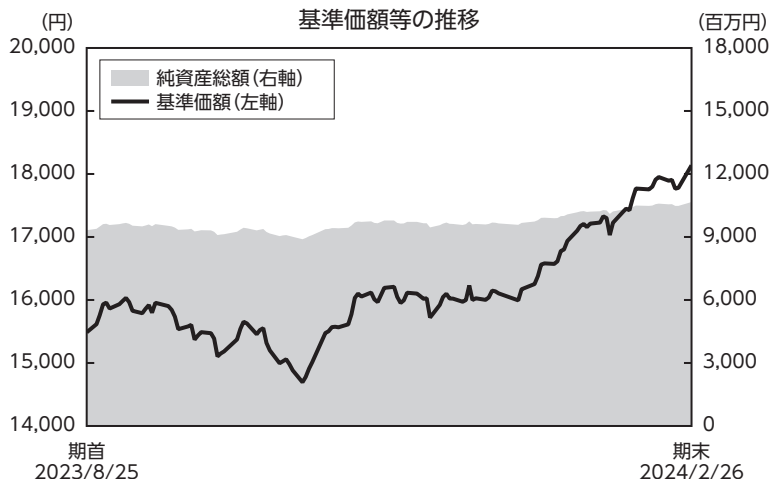
< 3434028・3456367 >

運用経過

基準価額等の推移

第9期首	15,486円
第9期末	18,137円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	17.1%

当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。



基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ① 2023年11月から当期末まで株式市場が全体として堅調に推移したこと
- ② 期を通じてパフォーマンスが良好であった情報技術や資本財・サービスセクターの高い組入れを保ち、銘柄選択も良好であったこと
- ③ 当期前半および2024年1月以降、主要通貨が円安傾向で推移したこと

下落要因

- ① 2023年9月から10月末にかけて、株式市場が全体として軟調に推移したこと
- ② 期を通じて素材および金融セクターで銘柄選択が足かせとなったこと
- ③ 2023年11月半ばから12月半ばにかけて、為替市場が一時的な円高となったこと

1 万口当たりの費用明細

項 目	第 9 期 (2023年 8月26日 ～2024年 2月26日)		項 目 の 概 要
	金額	比率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	87円 (22) (62) (3)	0.545% (0.139) (0.389) (0.017)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (印 刷 費 用) (そ の 他)	2 (1) (1) (0)	0.010 (0.005) (0.005) (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	89	0.555	
期中の平均基準価額は15,937円です。			

(注1) 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2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

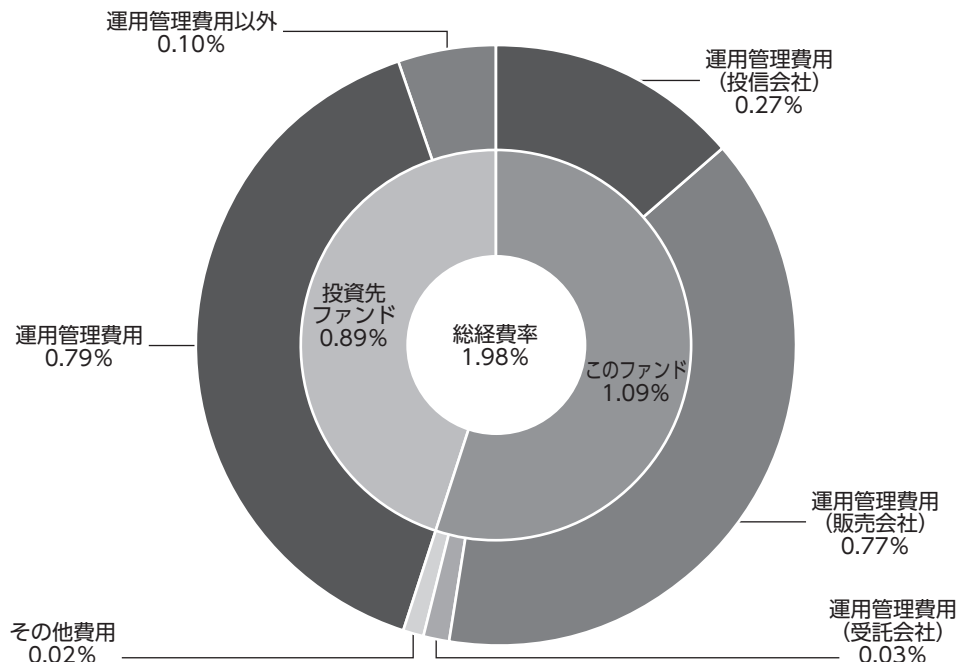
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(注5) 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、売買委託手数料およ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1.98%です。



総経費率 (①+②+③)	1.98%
①このファンドの費用の比率	1.09%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.79%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

(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。

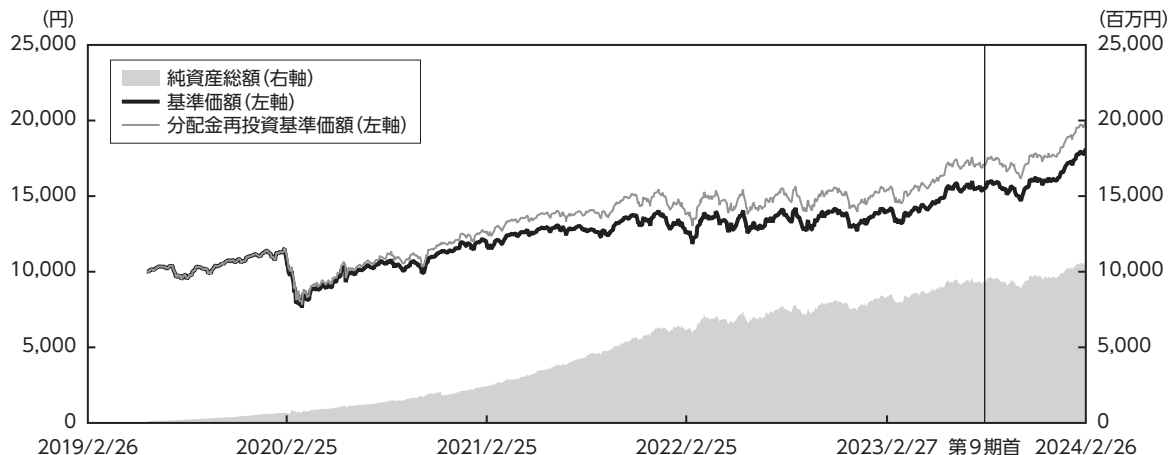
(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) 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6) 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

(2019年2月26日～2024年2月26日)



※運用実績が5年未満でも横軸は5年間表示しております。

(注1) 分配金再投資基準価額は、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。

(注2) 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お客様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、お客様の損益の状況を示すものではありません。

最近5年間の年間騰落率

	2019/6/14 設定日	2020/2/25 決算日	2021/2/25 決算日	2022/2/25 決算日	2023/2/27 決算日	2024/2/26 決算日
基準価額 (円)	10,000	10,718	11,810	12,600	13,993	18,137
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	300	500	300	0	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	10.2*	15.1	9.2	11.1	29.6
純資産総額 (百万円)	92	645	2,400	6,187	8,323	10,663

※設定日から2020年2月25日までの騰落率です。

(注) 運用成果の目標基準となるベンチマークおよび運用方針に対し適切に比較できる参考指数はありません。

投資環境

<世界株式市場>

当期初から10月下旬にかけて、世界株式市場は高金利の継続や不透明な景気見通しが懸念されて軟調に推移しましたが、11月以降、インフレ圧力緩和の兆しとともに米国の金融政策が利下げに転換する可能性を織り込み始めて債券利回りが急低下すると、株価は急反発しました。年明け後は早期利下げ期待が剥落して債券利回りも再び上昇に転じ、金利敏感セクターには逆風となったものの、株式市場全体としては大型成長株の業績への安心感などから続伸し、最高値を更新して当期末を迎えました。セクター別にみると、当期初から10月下旬にかけては不動産、公益事業などの金利敏感セクターを筆頭にほとんどのセクターが下落した一方、エネルギーは値を保ちました。11月以降の株価反発局面では情報技術、金融、不動産などがけん引役となった一方、エネルギーが反落し、生活必需品や公益事業なども鈍い動きとなりました。年明け後は、情報技術やコミュニケーション・サービスの大型成長株が一段と上昇した一方、公益事業、不動産、素材などが反落しました。通期では情報技術、コミュニケーション・サービス、金融などの上昇率が大きく、公益事業、生活必需品、エネルギーなどは期初の水準近くで当期末を迎えました。

<為替市場>

米国では2023年7月を最後に利上げを停止しましたが、これが即座に利下げにつながるわけではなく、高金利が長引く可能性を市場が認識したことで、米ドル高傾向が11月半ばまで続きました。米ドル/円相場は1米ドル146円前後の期初の水準から、151円台まで上昇しました。その後は、米国の早期利下げ期待が徐々に高まった一方で、日銀のマイナス金利解除が視野に入りだしたことで、11月半ばから12月末にかけては急速な円高となり、12月末には141円台まで戻しました。年明け後は、米国の早期利下げ期待が剥落したことで再び米ドル高となり、1米ドル150円前後で当期末を迎えました。英ポンド、ユーロなど欧州通貨は、期前半は対円で比較的狭いレンジでの動きでしたが、当期末にかけては対円で強含み、円独歩安となりました。

<日本短期国債市場>

当期の短期国債市場では、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りがマイナス圏での推移を継続しました。TDB 3ヵ月物利回りは、日銀によるマイナス金利政策や海外投資家からの需要に支えられ、-0.20%前後での推移が続きました。ただし、日銀によるマイナス金利解除が近づいているとの思惑から、当期末に向けては-0.10%近辺まで金利が上昇しました。

ポートフォリオ

<当ファンド>

当ファンドは、主に世界の気候変動対応に責任を持って取り組む企業の株式に投資する「CPR Invest – クライメート・アクション」に投資することにより、中長期的な信託財産の成長を目指した運用を行いました。「CPR Invest – クライメート・アクション」の組入比率は、基本方針に従い高位を維持しました。また、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<CPR Invest – クライメート・アクション>

当ファンドは、二酸化炭素排出量削減に積極的でESG^{*}評価の優れた企業のなかでも、バリュエーションと業績見通しの優れた70前後の銘柄で構成される株式ポートフォリオ運用を行いました。期中、新しい投資アイデアやバリュエーション、景気や業績見通しの変化に応じて銘柄入れ替えや比率変更を行いました。セクター別では、素材、エネルギーなどの組入れを引き下げた一方、情報技術、資本財・サービスなどを引き上げました。市場別では、フランスなどの組入れが減少し、米国、デンマークなどが増加しました。

※ESGは環境 (Environment)、社会 (Social)、ガバナンス (Governance) の頭文字を取ったもので、企業の持続的な成長性を判断するための評価軸です。

(CPRアセットマネジメント)

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

当期、主として12ヵ月以内に償還を迎える地方債への投資により、安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

ベンチマークとの差異

当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。

分配金

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項目	第9期
	(2023年8月26日～2024年2月26日)
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,136

- ・「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る点にご留意ください。
- ・「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

<当ファンド>

当ファンドが投資する「CPR Invest - クライメート・アクション」の組入比率を引き続き高位に保ちます。また、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行います。
(アムンディ・ジャパン株式会社)

<CPR Invest - クライメート・アクション>

世界経済は緩やかな景気後退局面を迎えているとみられますが、株価上昇をけん引している大型成長株のバリュエーションは、足元の高成長が今後も支障なく続くことを前提としたものとなっており、反動安となるリスクに注意が必要であると思われます。また、景気減速に対応して金融緩和が予想されますが、様々な地政学的要因からインフレ圧力が十分に下がりず、利下げ時期がさらに先送りされる可能性にも注意が必要とみています。当ファンドではバリュエーションに配慮しながら、コスト管理に優れ、個別の好材料を提供する企業を臨機応変に選別し、全体としては景気感応度や企業の財務に関して慎重な姿勢を維持する方針です。

(CPRアセットマネジメント)

<CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

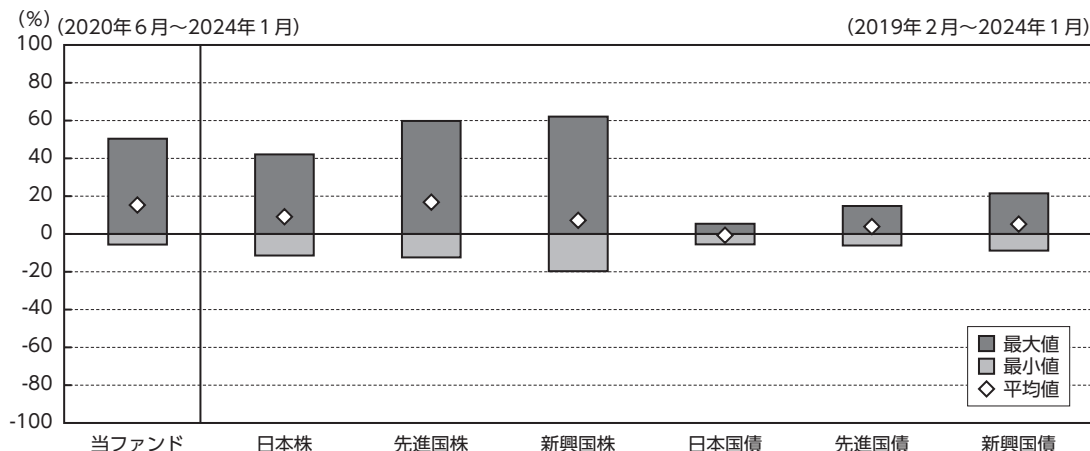
安全性重視の観点から、12ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	2019年6月14日から2029年2月26日までです。	
運用方針	「CPR Invest - クライメート・アクション」への投資を通じて、主に世界の気候変動対応に責任を持って取り組む企業の株式に実質的に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。また、「CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)」にも投資を行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要投資対象	S M B C ・ アムンディ クライメート・アクション	CPR Invest - クライメート・アクション CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)
	C P R I n v e s t - クライメート・アクション	世界の株式等
	CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)	本邦通貨表示の短期公社債
運用方法	①「CPR Invest - クライメート・アクション」への投資を通じて、主に世界の気候変動対応に責任を持って取り組む企業の株式へ投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。また、「CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)」にも投資を行います。 ②組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
分配方針	毎決算時(年2回決算、原則として毎年2月と8月の各25日、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、繰越分も含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。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、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率及び最小騰落率

(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	15.3	9.1	16.8	7.2	-0.7	3.9	5.2
最大値	50.4	42.1	59.8	62.1	5.4	14.8	21.5
最小値	-5.6	-11.4	-12.4	-19.7	-5.5	-6.1	-8.8

(注1) 上記は、当ファンドと他の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。

(注2) 当ファンドについては、2020年6月から2024年1月の3年8ヵ月間、他の代表的な資産クラスについては、2019年2月から2024年1月の5年間の各月末における直近1年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。

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 (税引後配当込み、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 (税引後配当込み、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・ディバースィファイド (円ベース)

※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、円ベースの指数を採用しております。

- ・全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。
- ・当ファンドは、分配金 (税込み) が分配時に再投資されたものとみなして計算した年間騰落率に基づき計算されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ・騰落率は直近月末から遡って算出した結果であり、当ファンドの決算日に対応した数値とは異なります。

ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入ファンド

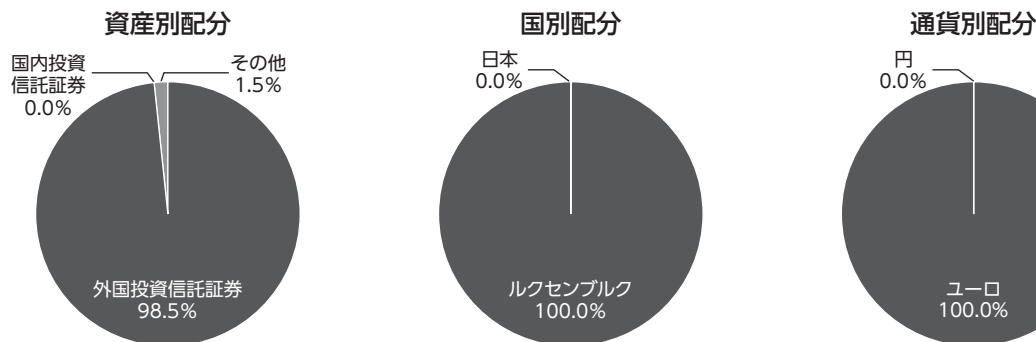
2024年2月26日現在
(組入銘柄数：2銘柄)

	銘柄	通貨	比率
1	CPR Invest - クライメート・アクション	ユーロ	98.5%
2	CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)	円	0.0%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 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)に記載されております。

種別構成



(注1) 資産別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 国別配分および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3) 比率は、小数点以下第2位を四捨五入しております。

純資産等

項目	第9期末 2024年2月26日
純資産総額	10,663,955,913円
受益権総口数	5,879,785,686口
1万口当たり基準価額	18,137円

※当期間(第9期)中における追加設定元本額は473,741,525円、同解約元本額は612,628,381円です。

組入ファンドの概要

<CPR Invest - フライメート・アクション>

決算日：2023年7月31日

(計算期間：2022年8月1日～2023年7月31日)

「基準価額の推移」は組入シェアクラスの内容ですが、他の開示情報につきましては、組入ファンド全体の内容を掲載して
います。

基準価額の推移 (組入シェアクラス)



組入上位10銘柄

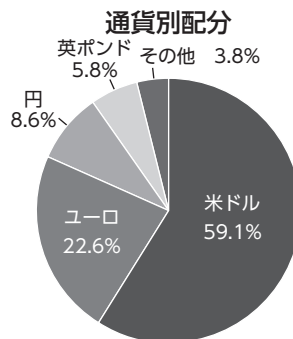
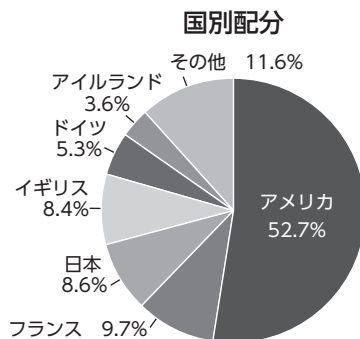
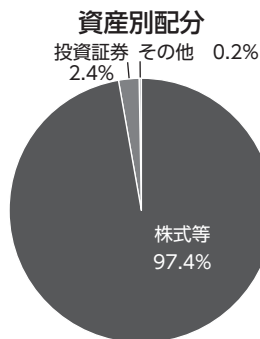
2023年7月31日現在
(組入銘柄数：76銘柄)

	銘柄	通貨	発行国	比率
1	MICROSOFT CORP	米ドル	アメリカ	5.4%
2	APPLE INC	米ドル	アメリカ	4.5%
3	ABBVIE INC	米ドル	アメリカ	2.6%
4	S&P GLOBAL INC	米ドル	アメリカ	2.6%
5	HOME DEPOT INC	米ドル	アメリカ	2.2%
6	SANOFI	ユーロ	フランス	2.2%
7	MASTERCARD INC -A-	米ドル	アメリカ	2.1%
8	TJX COS INC	米ドル	アメリカ	2.1%
9	BOSTON SCIENTIF CORP	米ドル	アメリカ	1.9%
10	MERCK & CO INC	米ドル	アメリカ	1.9%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 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)に記載されております。

種別構成



(注1) 資産別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

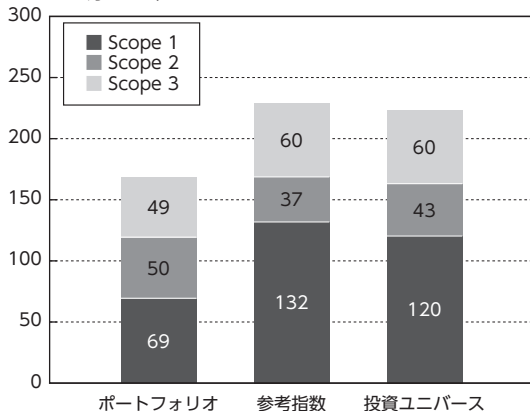
(注2) 国別配分および通貨別配分の比率は、ポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。

(注3) 比率は、小数点以下第2位を四捨五入しております。

炭素強度

2023年7月31日現在

(tCO₂e/100万ユーロ)



(注1) これは1年間に100万ユーロの売上げを実現するためにどれだけ温室効果ガスが排出されるかを示す指標で、数値が低い方が望ましいものです。温室効果ガス排出量(二酸化炭素換算、トン)を売上高(百万ユーロ単位)で割った値を銘柄ごとに算出し、加重平均しています。

排出量は企業のバリューチェーンごとに以下の3つの区分に分けられます。

- Scope 1: 当該企業自らによる温室効果ガスの直接排出(燃料の燃焼、工業プロセス)
- Scope 2: 他社から当該企業に供給された電気、熱・蒸気の使用に伴う間接排出
- Scope 3: Scope1、Scope2以外の間接排出(事業者の活動に関連する他社の排出)。
ただし、当レポートでは、当該企業が直接影響を与えることができる一次サプライヤに関連する上流部門での排出量のみを使用しています。

(注2) データの出所はTrucost社です。京都議定書で定められた6種類の温室効果ガス排出量を対象とし、それぞれのGWP(地球温暖化係数)に基づいて二酸化炭素に換算しています。

(注3) 参考指数はMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスです。

1万口当たりの費用明細

該当情報の取得ができないため、掲載はしていません。

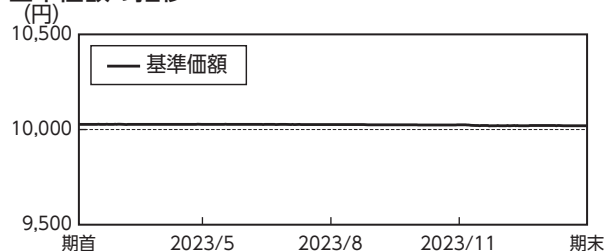
組入ファンドの概要

<C A マネープールファンド (適格機関投資家専用)>

第17期 決算日：2024年2月15日

(計算期間：2023年2月16日～2024年2月15日)

基準価額の推移



組入銘柄

2024年2月15日現在
(組入銘柄数：4銘柄)

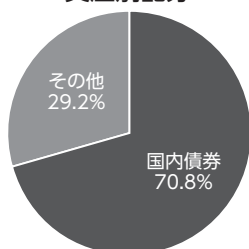
	銘柄	種別	比率
1	第139回共同発行市場公募地方債	地方債	30.4%
2	第134回共同発行市場公募地方債	地方債	20.2%
3	第137回共同発行市場公募地方債	地方債	10.1%
4	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	地方債	10.1%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

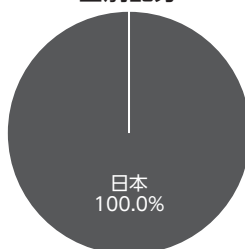
(注2) 銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されております。

種別構成

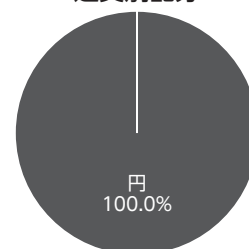
資産別配分



国別配分



通貨別配分



(注1) 資産別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 国別配分および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3) 比率は、小数点以下第2位を四捨五入しております。

1万口当たりの費用明細

項目	第17期 (2023年2月16日 ～2024年2月15日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社)	1円 (1) (0)	0.011% (0.009) (0.001)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(受託会社)	(0)	(0.002)	
(b) その他費用 (その他)	1 (1)	0.012 (0.012)	
合計	2	0.023	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
期中の平均基準価額は10,024円です。			

(注1) 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2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 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。

指数に関して

◇「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）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・ベンチマークです。TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

●MSCIコクサイ・インデックス（税引後配当込み、円ベース）

MSCIコクサイ・インデックスとは、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。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ます。

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ベース）

MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、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。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（以下「NFRFC」という。）が公表する、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投資収益指数です。同指数の知的財産権とその他一切の権利はNFRFCに帰属します。

●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。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・ディバーシファイド（円ベース）

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドとは、J.P.Morgan Securities LLCが算出し公表している、現地通貨建のエマージング・マーケット債で構成されている指数です。同指数の著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

Amundi
ASSET MANAGEMENT
アムンディ アセットマネジメント