

アムンディ・リそな米国ハイ・イールド債券ファンド (ブラジルリアルコース)

追加型投信／海外／債券

第 28 作成期

第161期 (決算日 2023年 5 月 8 日)

第162期 (決算日 2023年 6 月 8 日)

第163期 (決算日 2023年 7 月10日)

第164期 (決算日 2023年 8 月 8 日)

第165期 (決算日 2023年 9 月 8 日)

第166期 (決算日 2023年10月10日)

作成対象期間 (2023年 4月11日～2023年10月10日)

第166期末 (2023年10月10日)	
基準価額	1,510円
純資産総額	6,451百万円
第161期～第166期	
騰落率	12.7%
分配金 (税込み) 合計	60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、米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／ブラジルリアル買いの為替取引を行う、「ストラクチャード米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (14 シェアクラス、円)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「C A マネープールファンド (適格機関投資家専用)」への投資も行います。

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<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/>

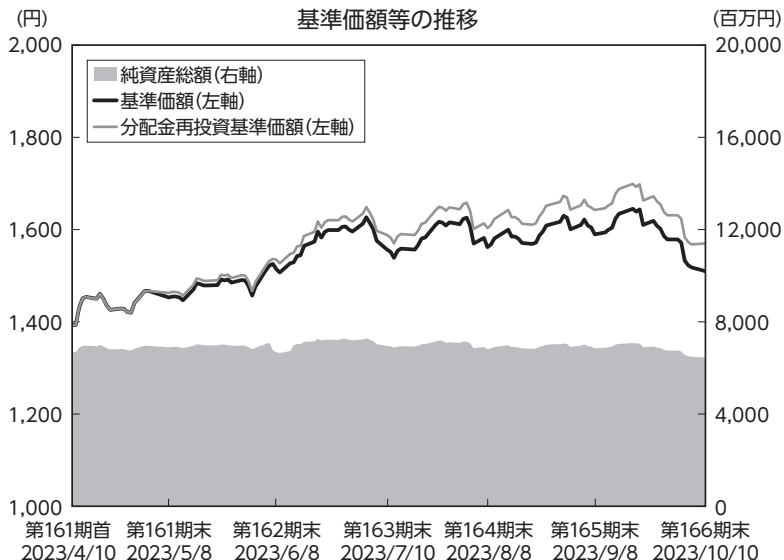
<3196566・3196532>

運用経過

基準価額等の推移

第161期首	1,393円
第166期末	1,510円
既払分配金 (税込み)	60円
騰落率	12.7% (分配金再投資ベース)

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。



(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。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2023年4月10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。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ① 当作成期初め、6月から8月にかけて、米国ハイイールド債券市場が上昇したこと
- ② 当作成期前半、ブラジルレアル高・円安が進行したこと
- ③ 米ドル売り／ブラジルレアル買いの為替取引により、プレミアム（金利差相当分の収益）を得たこと

下落要因

- ① 5月および9月頃に、米国ハイイールド債券市場が下落したこと
- ② 当作成期末にかけて、ブラジルレアル安・円高傾向となったこと

1万口当たりの費用明細

項 目	第161期～第166期 (2023年4月11日 ～2023年10月10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)	8円 (3) (4) (0)	0.484% (0.193) (0.275) (0.016)	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) (その他)	0 (0) (0)	0.006 (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 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	8	0.490	
期中の平均基準価額は1,555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。

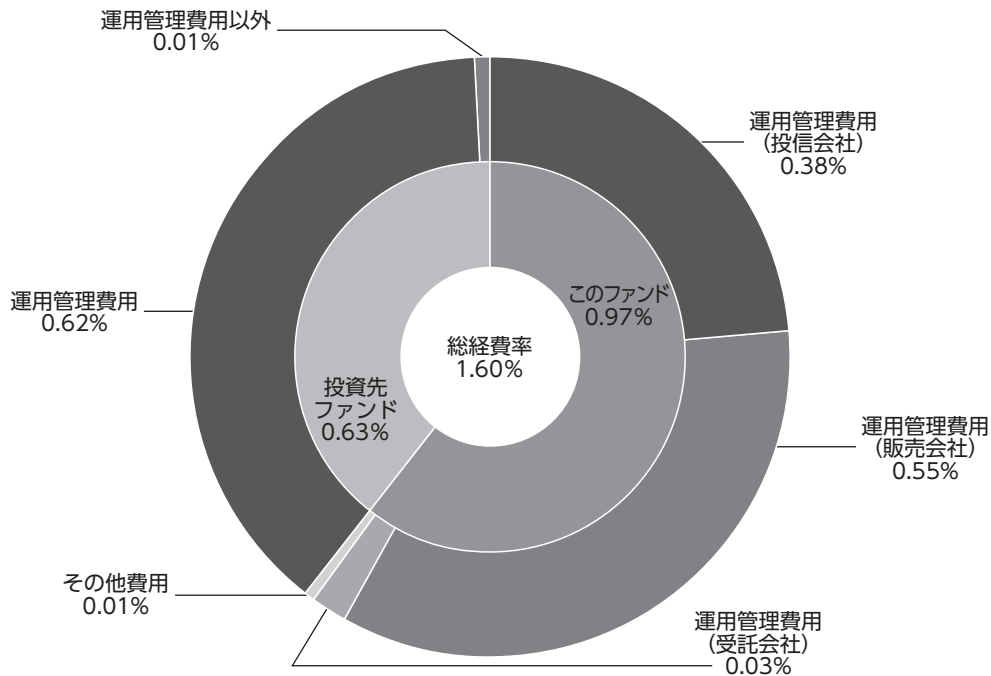
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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

当作成期中の運用・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1.60%です。



総経費率 (①+②+③)	1.60%
①このファンドの費用の比率	0.97%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.62%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

(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。

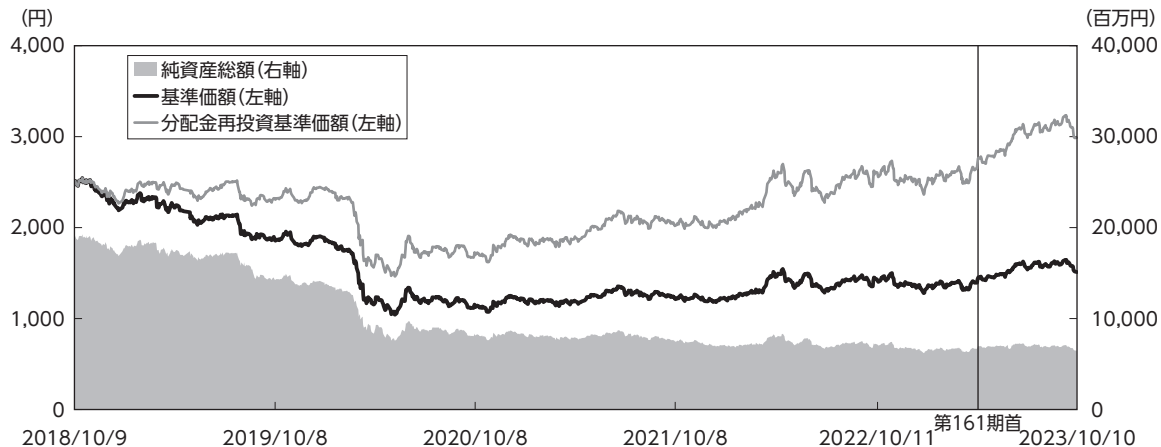
(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(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

(2018年10月9日～2023年10月10日)



(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。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2018年10月9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

決算日	2018/10/9 期首	2019/10/8 決算日	2020/10/8 決算日	2021/10/8 決算日	2022/10/11 決算日	2023/10/10 決算日
基準価額(円)	2,509	1,866	1,125	1,213	1,429	1,510
期間分配金合計(税込み)(円)	—	470	280	120	120	120
分配金再投資基準価額騰落率(%)	—	-7.5	-26.8	18.9	28.9	14.7
純資産総額(百万円)	18,958	14,278	8,127	7,446	7,152	6,451

(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

〈米国ハイイールド債券市場〉

当作成期の米国ハイイールド債券市場は、3月中旬に起きた銀行破綻が市場にボラティリティ（価格変動性）を引き起こしましたが、経済指標がおおむね堅調であったこと、および1－3月期決算報告も良好であったことから、4月は上昇しました。5月は、頑固なインフレを示すデータやF R B（米連邦準備理事会）のコメントから、F O M C（米連邦公開市場委員会）が金融引き締めを継続する可能性があるとの見方が強まり、金利に対して弱気なセンチメントが強まったことを受けて市場は下落しました。6月は、米国の経済成長が上向きであったことから、ソフトランディングへの期待の高まりを反映し、市場は上昇しました。インフレ率の低下と景気後退の回避というソフトランディングへの期待の高まりから、7月も強気相場となり、市場は上昇しました。デイスインフレ継続の見通しが続いたことにより、8月も引き続き市場は上昇しました。9月は、米国経済が底堅く、F R Bは高金利長期化を維持するだろうという見方を背景に、米国国債市場の下落により米国ハイイールド債券市場も下落しました。ICE BofA US High Yield Constrained Index（以下、「米国ハイイールド債券指数」）が示す当作成期のリターンはプラスとなりました。格付別では、C C C格債、B格債、B B格債の順となりました。過去12カ月の発行額面ベースのデフォルト（債務不履行）率は前作成期末比で上昇しました。

〈為替市場〉

当作成期、ブラジルリアル／円相場は26円台で始まり、中国への資源輸出拡大への期待や財政悪化懸念の後退などが支援材料となるなか、ブラジル中央銀行の利下げ開始観測などが重しとなる場面があったものの、当作成期半ばにかけて上昇基調となりました。その後、日銀による長短金利操作の柔軟化決定を受けてややブラジルリアル安・円高となったものの、ブラジルの財政健全化に向けた動きや資源価格の上昇などが支援材料となった一方で、ブラジル中央銀行による利下げや中国景気への警戒感などから一進一退の動きとなり、29円近辺で当作成期末を迎えました。

〈日本の短期国債市場〉

当作成期の短期国債市場では、日銀によるマイナス金利政策のもと、T D B（国庫短期証券）3ヵ月物利回りは引き続きマイナス圏で推移しました。T D B 3ヵ月物利回りは、米欧の銀行に対する信用不安の沈静化や、7月の日銀による金融政策修正により、一時-0.10%近辺まで上昇しました。しかしその後9月末から10月月初にかけては、年末越えの担保差入れなどを目的とした需要が高まり、利回りは一時-0.30%近辺まで低下しました。

ポートフォリオ 〈当ファンド〉

当ファンドは、米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする外国籍投資信託「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)」に投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いました。当ファンドは「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)」に90%以上投資することを基本としていることから、この運用の基本方針に従い、当作成期初より当該投資信託を高位に組み入れました。なお、国内籍投資信託「C A マネープールファンド (適格機関投資家専用)」にも投資を行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)〉

ポートフォリオにおいて、金融引き締めの影響を受けやすいB B 格債を米国ハイイールド債券指数比でアンダーウェイトし、経済回復の恩恵を受けやすいと考えられるB 格債およびC C C 格債をオーバーウェイトとしました。セクター別では、割安であると判断したレジャー、素材、金融サービスなどをオーバーウェイトした一方、割高であると判断した資本財、通信、公益などをアンダーウェイトしました。2023年前半に従来型の石油・ガスへのエクスポージャーを減らした後、同セクターのリスクを選択的に引き上げ始めた一方で、経済再開テーマと考えられるセクターにおいて好機を捉え、引き続き利益確定を行いました。また、通信セクター内で割安と考えられる銘柄のウェイトを引き上げました。石油の中期的な需給動向に対する見方が良好となったことから、9月に石油・ガス生産関連銘柄を組み入れるとともに、ウェイトを引き上げました。

(ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク)

米ドル建資産に対し、米ドル売り/ブラジルリアル買いの為替取引を行い、当作成期を通じてブラジルリアルのエクスポージャーをおおむね100%に維持しました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈C A マネープールファンド (適格機関投資家専用)〉

当作成期、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、以下のとおり分配を行いました。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161期	第162期	第163期	第164期	第165期	第166期
	(2023年4月11日 ~2023年5月8日)	(2023年5月9日 ~2023年6月8日)	(2023年6月9日 ~2023年7月10日)	(2023年7月11日 ~2023年8月8日)	(2023年8月9日 ~2023年9月8日)	(2023年9月9日 ~2023年10月10日)
当期分配金	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	(0.684%)	(0.656%)	(0.638%)	(0.636%)	(0.625%)	(0.658%)
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	-	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	2,519	2,531	2,542	2,553	2,564	2,575

- ・「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「ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)」の組入比率を引き続き高位に保ちます。なお、「CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)」への投資も行います。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈ストラクチュラ-米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)〉

今後は、財政赤字が経済を刺激し続けると同時に、長短金利の上昇 (債券価格は下落)、原油高および米ドル高すべてが金融引き締め作用に作用すると考えられます。FOMCでは、2024年のコアPCEインフレ率の予想中央値が2.6%に据え置かれました。この水準はデフレーションの進展を示唆するものですが、依然としてインフレ率をさらに低下させる必要性があり、その結果、高金利長期化という見通しにつながっています。当ファンドは、高金利が長期化するとの見方は強調されすぎており、長期的には金利は低下 (債券価格は上昇) する可能性が高いとみています。その場合、米国ハイイールド債券市場の現在の利回り水準は、良好な投資機会になると考えています。

(ノムラ・コーポレート・リサーチ・アンド・アセット・マネジメント・インク)

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き米ドル建資産に対し、米ドル売り/ブラジルリアル買いの為替取引を継続いたします。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)〉

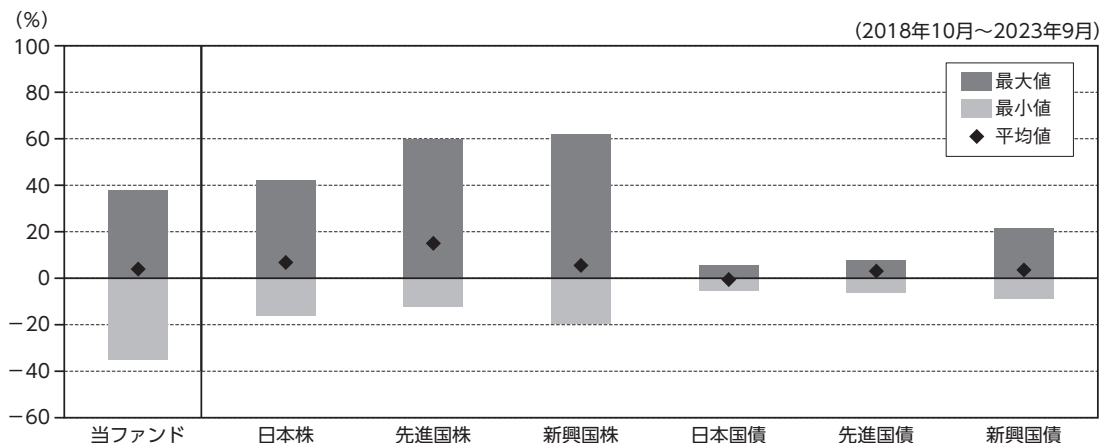
安全性重視の観点から、12ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

(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／海外／債券	
信託期間	2009年11月6日から2024年10月8日までです。	
運用方針	米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／ブラジルリアル買いの為替取引を行う、「ストラクチャー米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (14シェアクラス、円)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、「CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)」への投資も行います。	
主要投資対象	アムンディ・リソナ米国ハイ・イールド債券ファンド (ブラジルリアルコース)	ストラクチャー米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (14シェアクラス、円) CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)
	ストラクチャー米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (14シェアクラス、円)	米ドル建のハイイールド債
	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	<p>① 米ドル建のハイイールド債を主要投資対象とする米ドル売り／ブラジルリアル買いの為替取引を行う、「ストラクチャー米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (14シェアクラス、円)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。</p> <p>② 「ストラクチャー米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (14シェアクラス、円)」への投資比率は、原則として90%以上とすることを基本とします。</p>	
分配方針	<p>毎決算時 (年12回、原則毎月8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、経費控除後の繰越分を含めた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、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もあります。</p>	

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	3.9	6.8	15.0	5.5	-0.6	3.0	3.5
最大値	37.8	42.1	59.8	62.1	5.4	7.9	21.5
最小値	-34.8	-16.0	-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) 上記は、2018年10月から2023年9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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

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

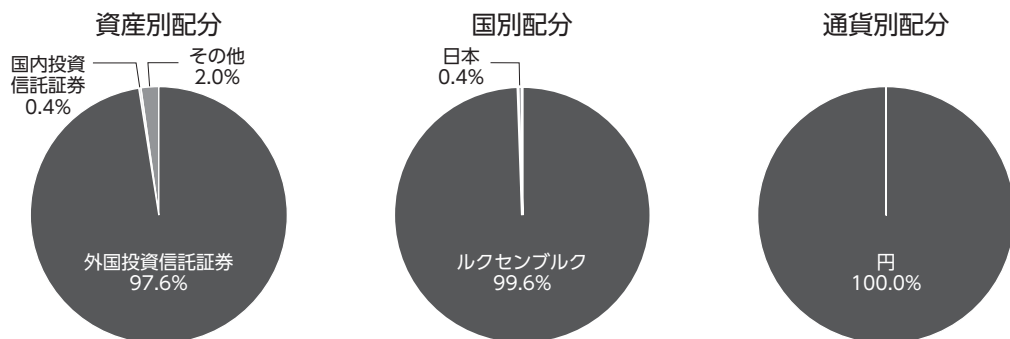
2023年10月10日現在
(組入銘柄数：2銘柄)

	銘柄	比率
1	ストラクチャル米国ハイ・イールド・ボンド-ブラジルリアル (I4シェアクラス、円)	97.6%
2	CAマナープールファンド (適格機関投資家専用)	0.4%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 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161期末 2023年5月8日	第162期末 2023年6月8日	第163期末 2023年7月10日	第164期末 2023年8月8日	第165期末 2023年9月8日	第166期末 2023年10月10日
純資産総額	6,895,699,715円	6,680,274,578円	6,951,482,196円	6,813,209,956円	6,853,897,666円	6,451,948,364円
受益権総口数	47,467,181,389口	44,116,953,769口	44,654,995,623口	43,622,724,332口	43,100,199,823口	42,735,313,609口
1万円当たり基準価額	1,453円	1,514円	1,557円	1,562円	1,590円	1,510円

※当作成期間(第161期~第166期)中における追加設定元本額は2,685,443,132円、同解約元本額は7,837,341,894円です。

組入ファンドの概要

<ストラクチャー・米国ハイ・イールド・ボンド・ブラジルリアル>

決算日：2022年12月31日

(計算期間：2022年1月1日～2022年12月31日)

基準価額の推移



(注) 基準価額は、収益分配金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。

組入上位10銘柄

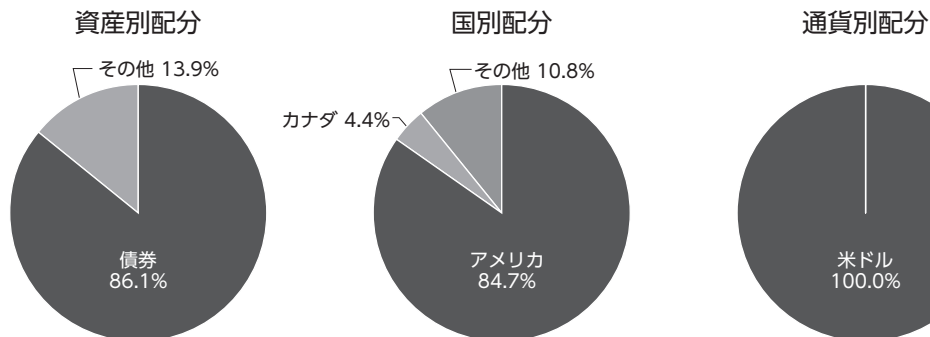
2022年12月31日現在
(組入銘柄数：783銘柄)

	銘柄	通貨	発行国	比率
1	CARNIVAL CORP 5.75 21-27 01/03S	米ドル	パナマ	1.0%
2	CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.5 21-32 01/05S	米ドル	アメリカ	0.7%
3	NAVIENT CORP 6.75 17-25 25/06S	米ドル	アメリカ	0.6%
4	CARNIVAL CORP 7.625 20-26 01/03S	米ドル	パナマ	0.6%
5	CITGO HOLDING I 9.2500 19-24 01/08S	米ドル	アメリカ	0.6%
6	CCO HOLD 4.75 22-32 01/02S	米ドル	アメリカ	0.5%
7	CSC HOLDINGS LLC 5.0 21-31 15/11S	米ドル	アメリカ	0.5%
8	BOMBARDIER 7.875 19-27 15/04S	米ドル	カナダ	0.5%
9	IMOLA MERGER CO 4.7500 21-29 15/05S	米ドル	アメリカ	0.5%
10	LIFE TIME INC 8.00 21-26 15/04S	米ドル	アメリカ	0.4%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 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。

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。

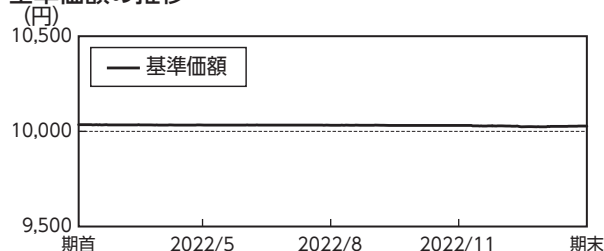
組入ファンドの概要

<CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)>

第16期 決算日：2023年2月15日

(計算期間：2022年2月16日～2023年2月15日)

基準価額の推移



組入銘柄

2023年2月15日現在
(組入銘柄数：2銘柄)

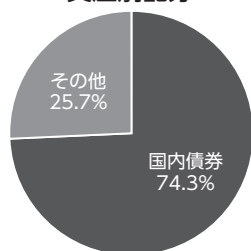
	銘柄	種別	比率
1	第128回共同発行市場公募地方債	地方債	53.1%
2	第375回大阪府公募公債(10年)	地方債	21.2%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

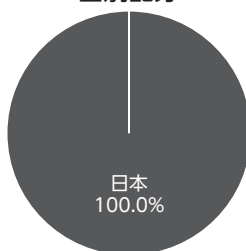
(注2) 銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されております。

種別構成

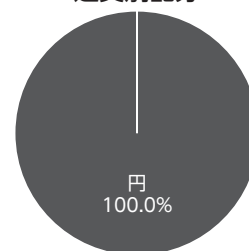
資産別配分



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16期 (2022年2月16日 ～2023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) (受託会社)	1円 (1) (0) (0)	0.011% (0.009) (0.001) (0.002)	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 (その他)	1 (1)	0.007 (0.007)	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
合 計	2	0.018	

期中の平均基準価額は10,031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「NFRC」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NFRC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・ディバースファイド (円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドとは、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