

アムンディ・パトリモア・ジャパン（隔月決算型）

追加型投信／内外／資産複合

第16作成期

第46期（決算日 2023年7月14日）

第47期（決算日 2023年9月14日）

第48期（決算日 2023年11月14日）

作成対象期間（2023年5月16日～2023年11月14日）

第48期末（2023年11月14日）	
基準価額	9,238円
純資産総額	639百万円
第46期～第48期	
騰落率	△2.4%
分配金（税込み）合計	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、投資信託証券への投資を通じて、主として世界の株式、債券、不動産投資信託証券および短期金融資産など、幅広い資産に実質的に分散投資を行い、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。投資環境に応じて、各資産への配分比率や通貨配分を機動的に変更します。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。実質組入外貨建資産については、為替変動リスクのヘッジおよび円ベースでの投資収益の獲得を目的として、為替ヘッジ比率および通貨配分の変更を機動的に行います。

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/>

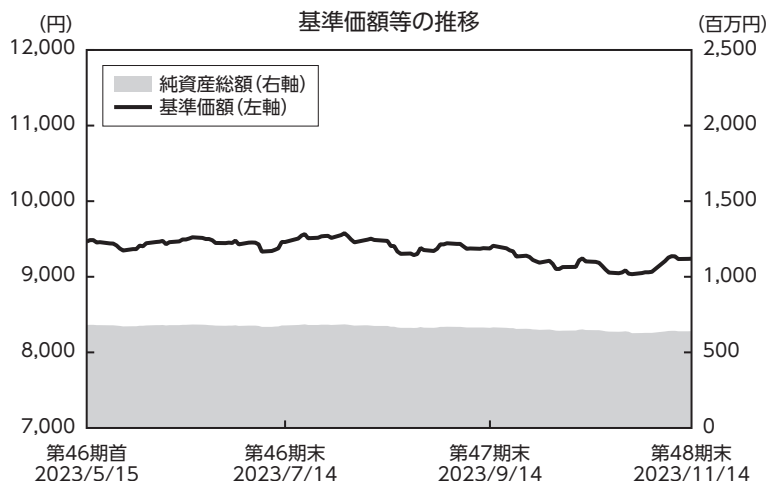
< 3246886・3273323 >

運用経過

基準価額等の推移

第46期首	9,466円
第48期末	9,238円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	△2.4%

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

下落要因

- ① 2023年8月から10月にかけて、グローバルに株式市場が下落したこと
- ② 作成期初から10月にかけて、金融引き締め長期化への懸念から金利が上昇（債券価格は下落）基調となり、先進国国債を中心に債券市場が下落したこと

上昇要因

- ① 2023年7月まで、米国市場での好調な企業決算や景気後退観測の緩和、インフレ鎮静化が期待されグローバルに株式市場が上昇したこと
- ② 2023年11月から作成期末にかけて、米国での利上げ停止が期待され、債券および株式市場が上昇したこと

1 万口当たりの費用明細

項 目	第46期～第48期 (2023年5月16日 ～2023年11月14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)	53円 (10) (41) (2)	0.566% (0.105) (0.440) (0.022)	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)	5 (0) (4) (0)	0.054 (0.005) (0.048) (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	58	0.620	
期中の平均基準価額は9,344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。

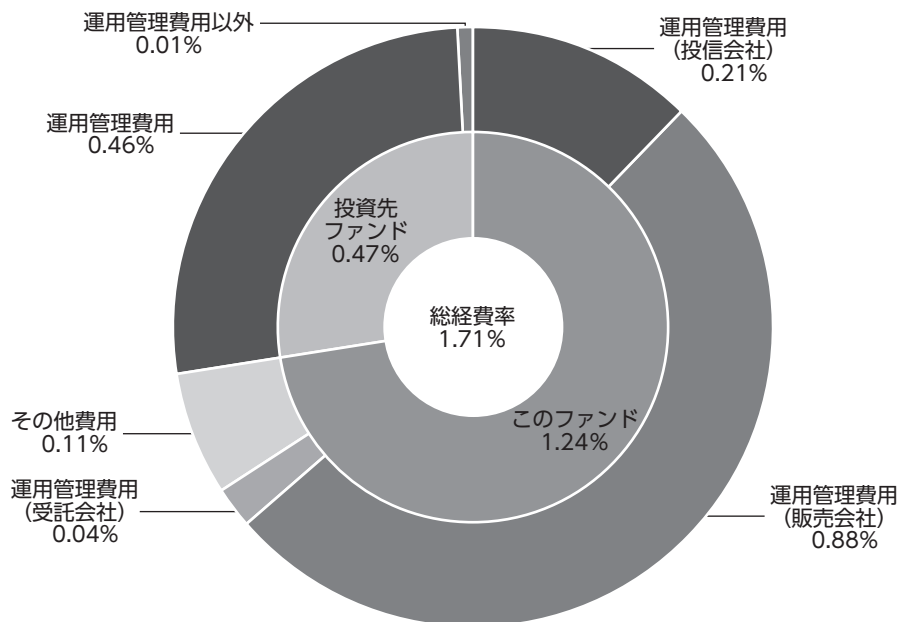
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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1.71%です。



総経費率 (①+②+③)	1.71%
①このファンドの費用の比率	1.24%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.46%
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。

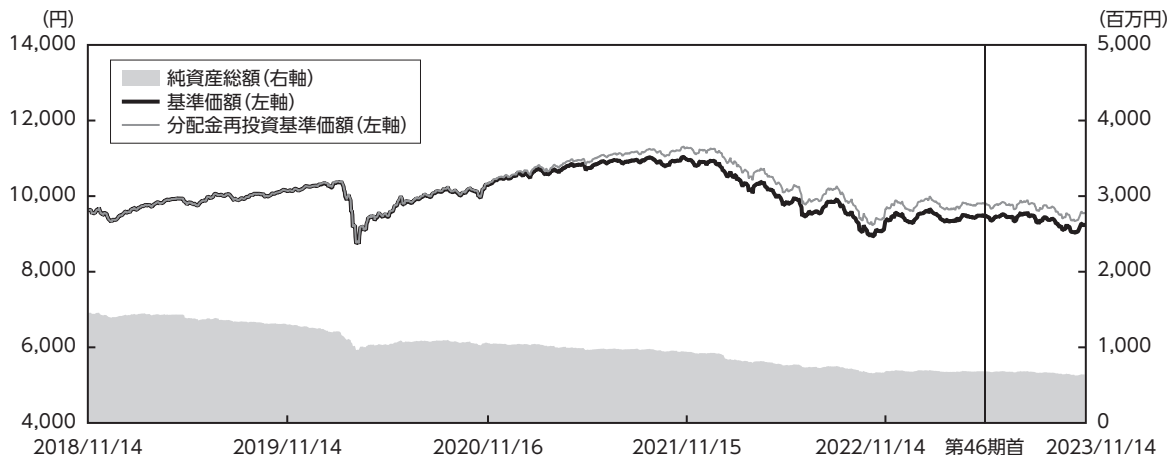
(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(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11月14日～2023年11月14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11月14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

	2018/11/14 期首	2019/11/14 決算日	2020/11/16 決算日	2021/11/15 決算日	2022/11/14 決算日	2023/11/14 決算日
基準価額 (円)	9,642	10,138	10,293	10,970	9,350	9,238
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	0	40	270	50	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	5.1	1.9	9.3	-14.4	-1.2
純資産総額 (百万円)	1,458	1,300	1,054	939	683	639

(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>

当作成期、世界の株式市場は上昇しましたが、地域別ではまちまちな動きとなりました。米国や円安の恩恵を受けた日本などのパフォーマンスがプラスとなった一方で、欧州やエマージング市場はマイナスとなりました。作成期初は、2023年3月に起きた米国の複数の地銀の破綻を受けて下落した後、回復に向かいました。米国の経済指標が市場予想を上回ったことに加え、発表された企業業績が堅調だったことや、人工知能に関して明るい見通しが広がったことで、特に米国の株式市場が好調に推移しました。また、欧州でも堅調な米国株式市場や中国の景気刺激策への期待等から上昇しました。8月以降は、欧米における金融引き締め長期化への懸念等から軟調となりましたが、作成期末にかけては、米国での利上げ局面終了への期待等から上昇基調となりました。

<世界債券市場>

当作成期、世界の債券市場は米欧の中央銀行がタカ派的なスタンスを維持し、金利はおおむね上昇（債券価格は下落）基調となりました。作成期初から10月にかけて、多くの市場で金利は上昇基調を維持しました。F R B（米連邦準備理事会）は、9月および11月のF O M C（米連邦公開市場委員会）で2回連続で政策金利を据え置いたことから、利上げ終了期待が高まり、作成期末にかけては米国の金利は低下（債券価格は上昇）しました。日本では、日銀が7月の金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用を柔軟化し、10年国債利回りの1%までの上昇を許容することを決定したことから長期金利は10月末にかけて上昇したものの、作成期末にかけてはやや上げ幅を縮小しました。通期では国債市場のパフォーマンスはマイナスとなりましたが、投資適格社債市場はまちまちで、ハイイールド債市場はプラスとなりました。

<為替市場>

当作成期、通期では米ドルは多くの通貨に対して上昇しました。米国の第3四半期の良好な経済指標が米ドルの上昇を後押ししました。対円でも、7月末の日銀の金融政策決定会合で政策が微調整されたにもかかわらず、150円台まで上昇しました。また、ユーロも対円で上昇しました。

<日本短期国債市場>

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ヵ月物利回りがマイナス圏での推移を継続しました。T D B 3ヵ月物利回りは、-0.15%近辺でスタートし、7月の日銀金融政策修正により一時-0.10%近辺まで上昇しましたが、その後9月末から10月初にかけては年末越えの担保差入れ需要により一時-0.30%近辺まで低下し、作成期末にかけては-0.20%近辺での推移となりました。

ポートフォリオ

<当ファンド>

当ファンドは、円建の外国籍投資信託「ストラクチュラ-パトリモアン アブソリュート リターン JPY」と、円建の国内籍投資信託「C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）」を投資対象とし、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として、世界の株式、債券、不動産投資信託証券および短期金融資産など、幅広い資産へ実質的に投資します。当ファンドは「ストラクチュラ-パトリモアン アブソリュート リターン JPY」を高位に組入れることを運用の基本方針としていることから、当作成期もこの運用の基本方針に従い当該投資信託を高位に組入れました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<ストラクチュラ-パトリモアン アブソリュート リターン JPY>

当作成期初は、ポートフォリオにおける株式のエクスポージャーは29%程度、ポートフォリオのデュレーション（金利変動に対する感応度）は4.0年程度でスタートしました。作成期中、米国の経済指標の改善により利回りが上昇したため、ポートフォリオの修正デュレーションを4.3年程度へ引き上げました。また、グローバルで経済成長が鈍化する中、最も底堅いと思われる米国株を買い増し、株式のエクスポージャーは31%程度へ引き上げました。外貨建資産の多くは引き続き為替ヘッジを行いました。

(アムンディ・アセットマネジメント)

<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、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46期	第47期	第48期
	(2023年5月16日 ～2023年7月14日)	(2023年7月15日 ～2023年9月14日)	(2023年9月15日 ～2023年11月14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	980	980	980

・「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「ストラクチャラ-パトリモアン アブソリュート リターン JPY」の組入比率を引き続き高位に保ちます。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

<ストラクチャラ-パトリモアン アブソリュート リターン JPY>

市場は金融政策や経済成長、インフレの方向性を見極めようとしており、レンジ内での動きが続いています。2024年上半期の米国の景気後退は引き続き緩やかなものになると想定されますが、当ファンドは、長期金利の上昇や中東情勢、ひっ迫した金融情勢などから、世界経済の先行きを弱気にみています。これらのことから、株式に関してはより慎重なスタンスを維持していく方針です。株式の中では、引き続き相対的に米国を嗜好していきます。債券のデュレーションに関してはやや建設的な姿勢とし、デフォルト（債務不履行）見通しや金融環境を注視しつつ、質の高いクレジットを追求していきます。引き続き流動性を確保し、十分に分散した上で、アクティブなポートフォリオ運営を行って参ります。

(アムンディ・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）>

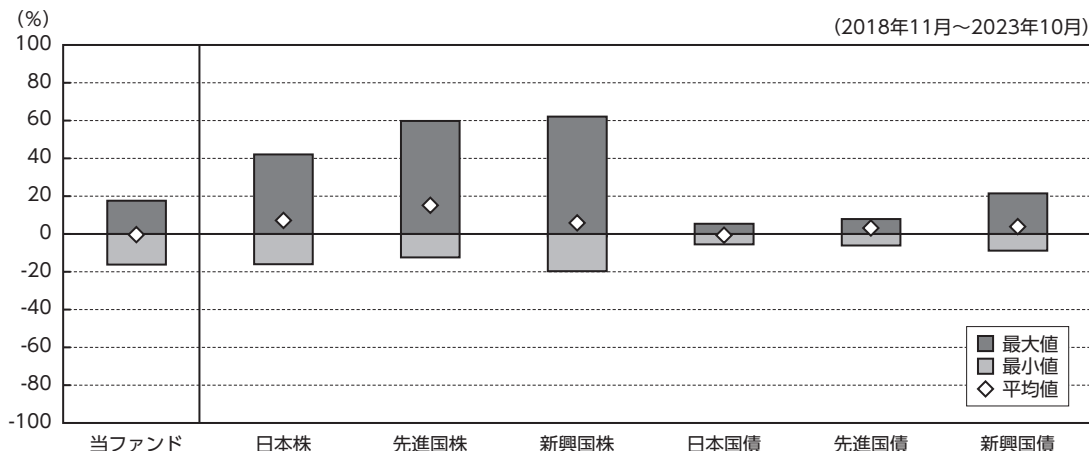
安全性重視の観点から、12ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

(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／資産複合	
信託期間	2015年12月11日から2025年11月14日までです。	
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として世界の株式、債券、不動産投資信託証券および短期金融資産など、幅広い資産に実質的に分散投資を行い、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。投資環境に応じて、各資産への配分比率や通貨配分を機動的に変更します。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・パトリモア・ジャパン（隔月決算型）	ストラクチュラ・パトリモア アブソリュート リターン JPY CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）
	ストラクチュラ・パトリモア アブソリュート リターン JPY	世界の株式、債券、不動産投資信託証券および短期金融資産など
	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投資信託証券への投資を通じて、主として世界の株式、債券、不動産投資信託証券および短期金融資産など、幅広い資産に実質的に分散投資を行い、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。</p> <p>②原則として、幅広い資産に投資する指定投資信託証券の投資比率を高位に保ちます。</p> <p>③実質組入外貨建資産については、為替変動リスクのヘッジおよび円ベースでの投資収益の獲得を目的として、為替ヘッジ比率および通貨配分の変更を機動的に行います。</p>	
分配方針	<p>毎決算時（年6回決算、原則として1月、3月、5月、7月、9月および11月の各14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	-0.4	7.2	15.2	5.9	-0.6	3.1	3.9
最大値	17.6	42.1	59.8	62.1	5.4	7.9	21.5
最小値	-16.2	-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11月から2023年10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

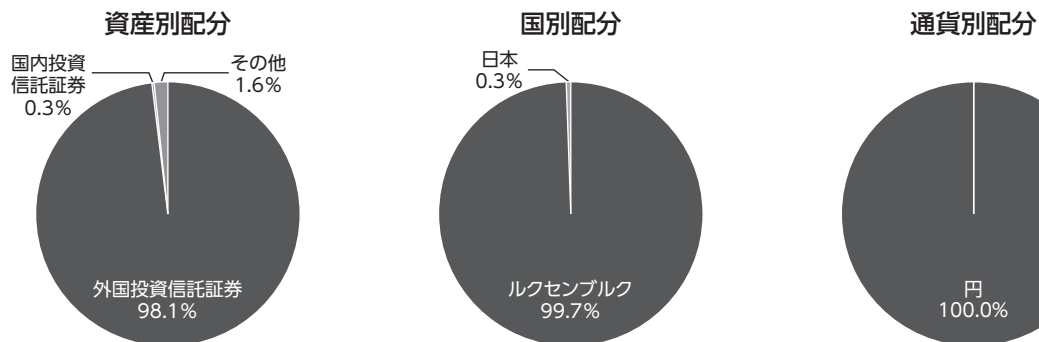
2023年11月14日現在
(組入銘柄数：2銘柄)

	銘柄	比率
1	ストラクチャラ-パトリモアン アブソリュート リターン JPY	98.1%
2	CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)	0.3%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 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46期末 2023年7月14日	第47期末 2023年9月14日	第48期末 2023年11月14日
純資産総額	677,207,693円	662,168,286円	639,701,365円
受益権総口数	715,861,009口	706,465,441口	692,437,759口
1万口当たり基準価額	9,460円	9,373円	9,238円

※当作成期間(第46期～第48期)中における追加設定元本額は151,531円、同解約元本額は26,912,644円です。

組入ファンドの概要

<ストラクチャル・パトリモアン アブソリュート リターン J P Y>

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」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

2022年12月31日現在
(組入銘柄数：135銘柄)

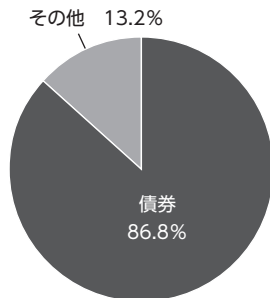
	銘柄	通貨	発行国	比率
1	JAPAN 0.10 15-25 10/03S	円	日本	7.9%
2	UNITED STATES 2.00 15-25 15/08S	米ドル	アメリカ	5.4%
3	SPAIN 2.75 14-24 31/10A	ユーロ	スペイン	4.9%
4	UNITED STATES 2.50 14-24 15/05S	米ドル	アメリカ	4.7%
5	US TREASURY N/B 2.8750 18-28 15/05S	米ドル	アメリカ	4.1%
6	UNITED STATES 4.75 11-41 15/02S	米ドル	アメリカ	3.3%
7	UNITED STATES 2.875 15-16 15/08S	米ドル	アメリカ	3.2%
8	ITALY 1.85 17-24 15/05S	ユーロ	イタリア	2.4%
9	FRANCE 0.5 18-29 25/05A	ユーロ	フランス	2.2%
10	ITALY 3.75 14-24 01/09S	ユーロ	イタリア	2.2%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

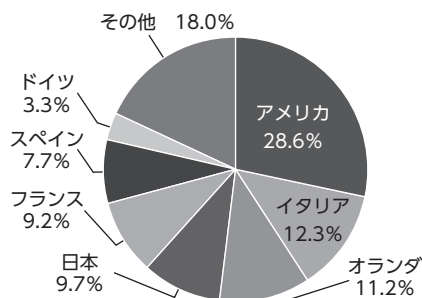
(注2) 全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されております。

種別構成

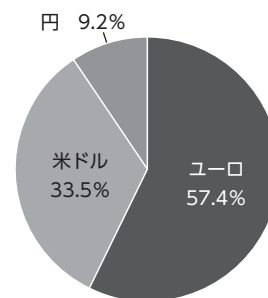
資産別配分



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

該当情報の取得ができないため、掲載はしていません。

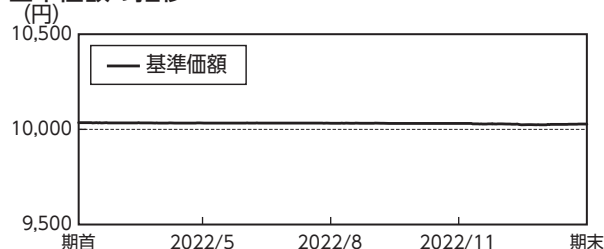
組入ファンドの概要

<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)

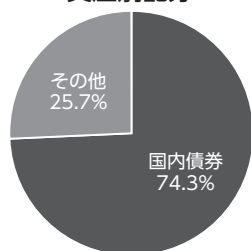
	銘柄	種別	比率
1	第128回共同発行市場公募地方債	地方債	53.1%
2	第375回大阪府公募公債(10年)	地方債	21.2%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

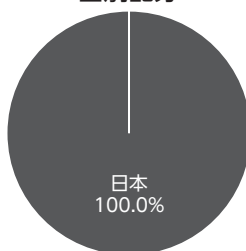
(注2) 銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されております。

種別構成

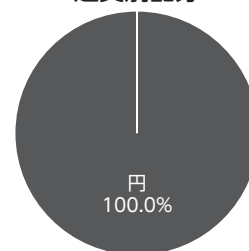
資産別配分



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「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