

グローバルインパクト投資ファンド(気候変動)

追加型投信／内外／株式

交付運用報告書

第2期(決算日2023年11月15日)

作成対象期間(2022年11月16日～2023年11月15日)

第2期末(2023年11月15日)	
基準価額	8,150円
純資産総額	545百万円
第2期	
騰落率	△ 11.1%
分配金(税引前)合計	0円

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

(注) 騰落率は分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書(全体版)に記載しております。

○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。運用報告書(全体版)は、下記の手順にて閲覧・ダウンロードいただけます。

<運用報告書(全体版)の閲覧・ダウンロード方法>
右記URLにアクセス⇒「ファンド検索」にファンド名を入力⇒該当のファンドを選択⇒「交付運用報告書・運用報告書(全体版)」を選択

○運用報告書(全体版)は、受益者の方から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。

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「グローバルインパクト投資ファンド(気候変動)」は、このたび、第2期の決算を行いました。

当ファンドは、RMグローバルインパクト投資マザーファンド(気候変動)を通じて、日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場または店頭登録されている株式への投資を行い、信託財産の中長期的な成長と社会的インパクトの創出を目指して運用を行いました。

ここに、期中の運用経過等についてご報告申し上げます。

当ファンドにおける社会的インパクトの達成状況や対話・エンゲージメント活動等についてはインパクトレポート、また、社会的インパクト創出の観点を主要な要素として選定した投資銘柄の組入比率はマンスリーレポートに記載しています。下記URLをご覧ください。

<https://www.resona-am.co.jp/fund/120027/mokuromi.html>

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

<照会先>

電話番号：0120-223351

(委託会社の営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ：<https://www.resona-am.co.jp/>

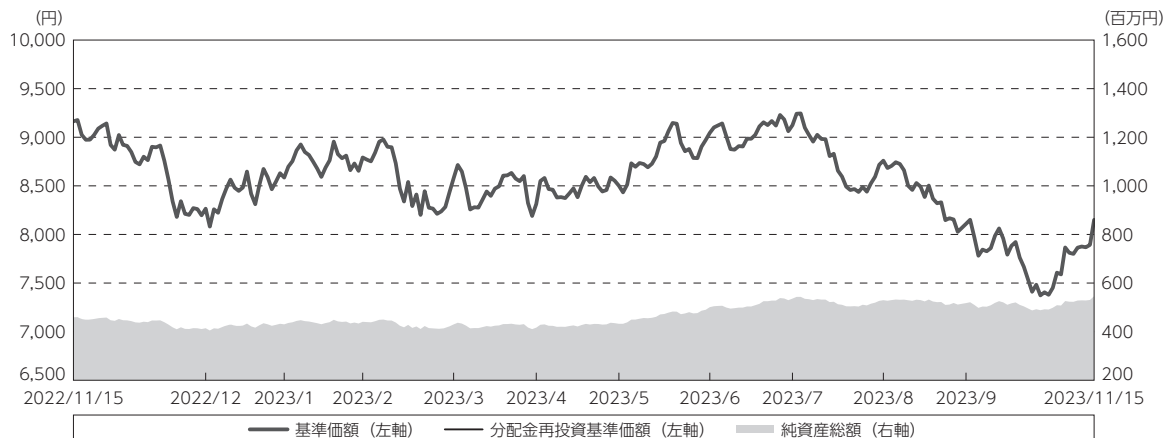


見やすく読みまちがえにくいユニバーサルデザインフォントを採用しています。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2022年11月16日～2023年11月15日)



期首：9,164円

期末：8,150円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：△ 11.1% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
 (注) 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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2022年11月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

保有比率の高い小型グロース株(成長株)の上昇が限定的だったことに加え、グローバル景気の先行き不透明感から投資案件を先送りする企業が散見され、その影響を受けた保有企業群が基準価額を押し下げました。

1万口当たりの費用明細

(2022年11月16日～2023年11月15日)

項目	当期		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)	141 (69) (69) (3)	1.650 (0.809) (0.808) (0.033)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ファンドの運用・調査、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 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) 売買委託手数料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	8 (8) (0)	0.093 (0.092) (0.000)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税 (株 式)	2 (2)	0.018 (0.018)	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他)	8 (7) (1) (0)	0.090 (0.082) (0.007) (0.001)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	159	1.851	
期中の平均基準価額は、8,532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。

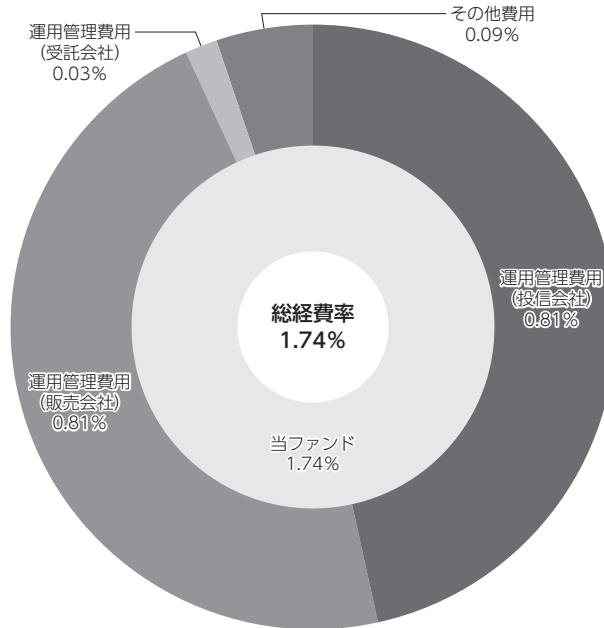
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.74%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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。

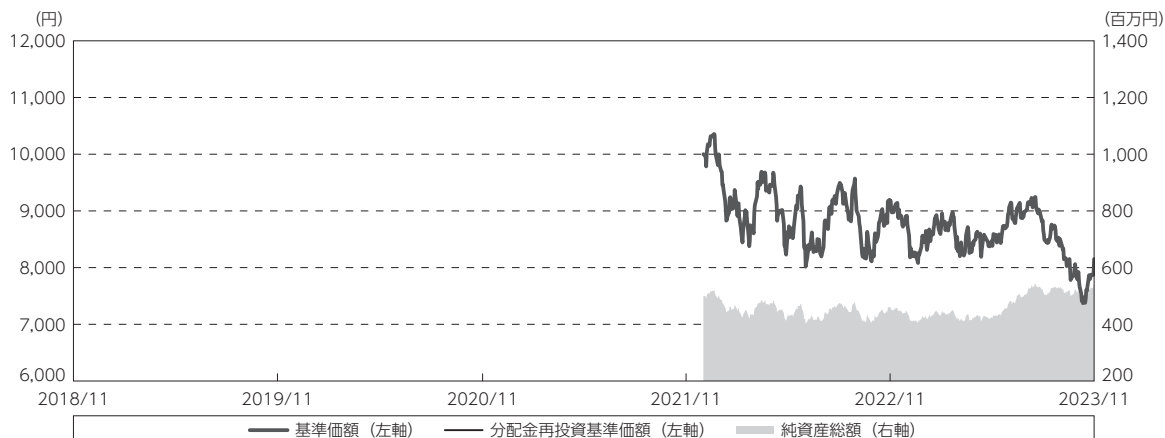
(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

最近5年間の基準価額等の推移

(2018年11月15日～2023年11月15日)



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
 (注) 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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
 (注) 当ファンドの設定日は2021年12月17日です。

	2021年12月17日 設定日	2022年11月15日 決算日	2023年11月15日 決算日
基準価額 (円)	10,000	9,164	8,150
期間分配金合計(税引前) (円)	—	0	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△ 8.4	△ 11.1
純資産総額 (百円)	501	459	545

- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
 (注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。
 (注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。
 ただし、設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しており、2022年11月15日の騰落率は設定当初との比較です。
 (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

投資環境

(2022年11月16日～2023年11月15日)

グローバル株式市況

グローバルの株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期初は、堅調な企業業績が支援材料となり緩やかに上昇しました。2023年3月には、米国の一部の中堅銀行の破綻などをきっかけに米欧を中心に金融システム不安が強まり、売り圧力が強まる場面もみられました。その後は、金融システム不安が小康状態入りしたほか、主要国中央銀行（日本除く）による利上げの最終局面入りが意識されたことなどから、買い安心感が広がりました。期末にかけて、F R B（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め長期化観測などが嫌気され、グローバルの株式市場では上昇幅を縮小しました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドル・ユーロの双方に対して円安となりました。

米ドルに対して、期初は、内外金利差の縮小に伴って1米ドル＝120円台後半まで円高が進む場面がみられました。その後、インフレ抑制を目指すF R Bが金融引き締めを続ける一方、日銀が金融緩和姿勢を維持したことなどから、1米ドル＝151円台まで円安が再度進行しました。

ユーロに対しては、E C B（欧州中央銀行）がインフレ抑制姿勢を維持するなか1ユーロ＝163円台まで円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

(2022年11月16日～2023年11月15日)

当ファンド

R Mグローバルインパクト投資マザーファンド（気候変動）受益証券を高位に組入れて運用を行いました。なお、実質組入外貨建資産については、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

R Mグローバルインパクト投資マザーファンド（気候変動）

世界における社会的課題である気候変動の緩和、気候変動の影響への適応等にビジネスとして取り組み、持続的に企業価値を拡大させるとともに、課題解決に対する社会的インパクトを創出することが期待できる企業に厳選して投資を行いました。

当期においては、社会的インパクト創出の確信度を高め、かつ企業の持続的成長を後押しするために、具体的なテーマに絞った投資先企業との対話・エンゲージメントに努めました。また、課題解決に向けた目標や道筋を明確化して企業との相互理解を深めるとともに、課題の規模・深刻さから推定される潜在的な事業機会を示すことで、高い目標設定を促しました。

当期のファンドの基準価額に影響を与えた主な投資銘柄は以下のとおりです。

<プラス要因>

■ゼネラル・エレクトリック（米国）

世界の電力の3分の1を同社製品によって供給しており、風力発電タービン市場においても高いシェアを有しています。高い技術力を土台に、世界最高水準の発電容量と発電効率を持つ発電タービンを市場に投入し、発電コストの低減に寄与することが期待されます。また1基あたりの発電容量が増えることで、必要なタービンの数が減ることになり風力発電事業者の運用・保守の負担も軽減できると考えられます。当期は堅調な業績に加え、会社分割による成長性への再評価気運が高まり、株価は上昇トレンドをたどりました。

<マイナス要因>

■エンフェーズ・エナジー（米国）

主に住宅向けの太陽光パネルの発電効率を引き上げるマイクロインバーターの開発・生産・販売を行っています。同社のマイクロインバーターは、太陽光パネルに取り付けることで発電効率を引き上げ、今まで太陽光発電には発電効率面から不向きであった場所にもパネル設置を可能にしています。当期は米国での最大市場であるカリフォルニア州でソーラーパネルの補助金スキームが変更されたことで減益となり、株価が下落しましたが、太陽光発電を軸とした電力の総合ソリューションプロバイダーとしての進化期待に変化は無く、外部環境の変化に留意しつつ継続保有としています。

■ダーリン・イングリディエンツ（米国）

バイオ燃料の生産で世界有数の規模を誇る企業です。大型の鉄道、船舶、飛行機など電化による温室効果ガス削減が難しい領域において、化石燃料をバイオ由来燃料に置き換えることによる低炭素化に期待しています。特に航空機業界で注目が集まっている次世代バイオ燃料のSAF（持続可能な航空燃料）は世界でも生産できる企業はほとんど無く、中長期的な業績寄与が見込まれています。足元はバイオ燃料の価格低下が懸念され株価は低調に推移していますが、成長期待に変化は無く、継続保有としています。

当期末における、社会的インパクト創出の観点を中心に選定した投資銘柄の純資産総額に占める組入比率は96.2%です。なお、保有全銘柄に占める当該投資銘柄の比率は100%です。

当ファンドにおける社会的インパクトの評価や当ファンドに関連した対話・エンゲージメント活動は、下記URLのインパクトレポートに詳細を記載しています。

<https://www.resona-am.co.jp/fund/120027/mokuromi.html>

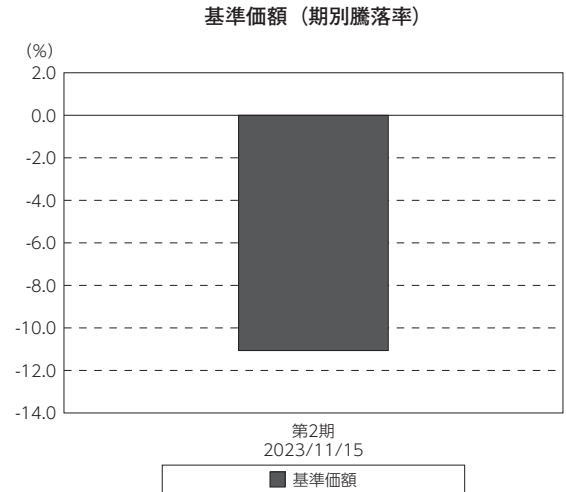
インパクトレポートでは、社会的インパクトの評価やその達成状況については、当ファンドの8つの重点ソリューション領域ごとに定量的・定性的に評価を行っています。また、対話・エンゲージメント活動については、実施件数および内容を記載するとともに、一部の投資先企業についてはその詳細もご紹介しています。

レポートの内容については投資先企業とも共有し、事業の更なる活性化と情報開示の高度化の促進に向けて活用しています。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年11月16日～2023年11月15日)

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

(2022年11月16日～2023年11月15日)

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益(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を行います。

○分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

項 目	第2期
	2022年11月16日～ 2023年11月15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	1

(注) 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

当ファンド

引き続き、RMグローバルインパクト投資マザーファンド(気候変動) 受益証券を高位に組み入れて運用を行う方針です。

RMグローバルインパクト投資マザーファンド(気候変動)

引き続き、世界における社会的課題である気候変動の緩和、気候変動の影響への適応などにビジネスとして取り組み、持続的に企業価値を拡大させるとともに、社会的インパクトを創出することが期待できる銘柄を厳選して投資を行います。また、新規銘柄の発掘に注力し、投資銘柄数を増やすとともに、足元の業績やリスクなどを考慮しながら柔軟にウエイト調整を実施することでパフォーマンスの安定性を高めます。

投資先企業への対話・エンゲージメントでは、関与する社会的課題に対する現状認識のすり合わせや、あるべき姿、長期目標の具体化について相互理解をさらに深めていくとともに、成果を生み出すための経営上の課題については業績への影響が顕在化する前の早い段階での把握に努め、問題解決に向けた取り組みを議論していきます。引き続き企業の社会的インパクトの定量化を株式評価に組み込み、その共有により企業の情報開示の充実を促すとともに、企業の戦略推進をサポートしていきます。

なお、次期においてもインパクトレポートを発行し、創出された社会的インパクトの評価や当ファンドに関連した対話・エンゲージメント活動について開示を行う予定です。また、投資先企業ともその内容を共有することで事業活動の一段の活性化、情報開示の高度化の促進に活用していきます。

お知らせ

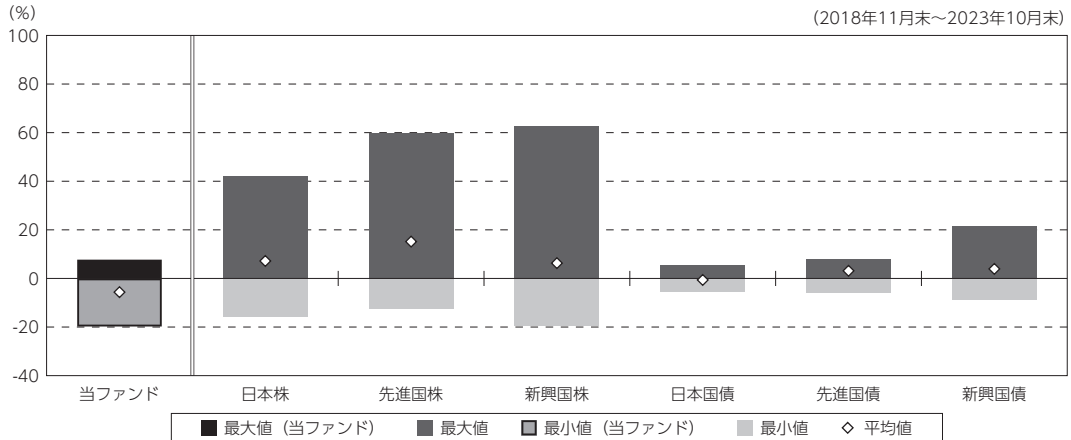
- ・社会的インパクトの創出も目指して運用を行っている旨を明記するため、約款に所要の変更を行いました。(2023年8月16日)

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	2021年12月17日から無期限です。	
運用方針	日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場または店頭登録されている株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長と社会的インパクトの創出を目指して運用を行います。	
主要投資対象	グローバルインパクト投資ファンド(気候変動)	・RMグローバルインパクト投資マザーファンド(気候変動)の受益証券
	RMグローバルインパクト投資マザーファンド(気候変動)	・国内および海外の金融商品取引市場に上場されている株式
運用方法	<p>①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じ、日本を含む先進国および新興国の金融商品取引所に上場または店頭登録(上場予定、店頭登録予定を含みます。)されている株式^{*1}に投資し、信託財産の中長期的な成長と社会的インパクトの創出を目指して運用を行います。なお、不動産投資信託証券^{*2}に投資する場合があります。</p> <p>*1 DR(預託証券)または株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 *2 一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。</p> <p>②世界における社会的課題である気候変動の緩和、気候変動の影響への適応等にビジネスとして取り組み、持続的に企業価値を拡大させるとともに、社会的インパクトを創出することが期待できる銘柄を厳選して投資を行います。</p> <p>③投資先企業等に対しては、企業価値の拡大と社会的インパクトの創出の促進を目指し、継続的にエンゲージメントに努めるとともに、社会的インパクトの創出状況について定量的・定性的に評価を行います。</p> <p>④マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>⑤実質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。</p>	
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。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。	

(参考情報)

○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(単位: %)

	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
最大値	7.7	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	21.5
最小値	△ 19.8	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値	△ 5.6	7.2	15.2	6.3	△ 0.6	3.1	3.9

- (注) 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。
 (注) 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年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドは2022年12月以降の年間騰落率を用いております。
 (注) 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) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

《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-KOKUSAI 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 G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド (円ベース)

※詳細は、後述の「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。

(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。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

(2023年11月15日現在)

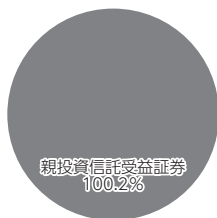
○組入上位ファンド

銘柄名	第2期末
RMグローバルインパクト投資マザーファンド(気候変動)	100.2%
組入銘柄数	1銘柄

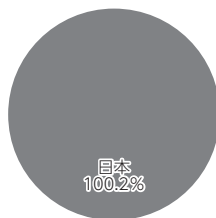
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

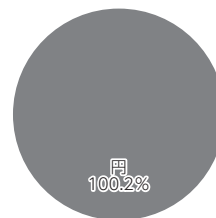
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

純資産等

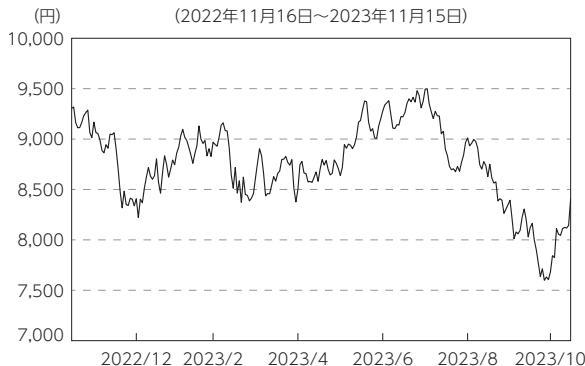
項目	第2期末
	2023年11月15日
純資産総額	545,917,633円
受益権総口数	669,829,918口
1万口当たり基準価額	8,150円

(注) 期中における追加設定元本額は178,692,527円、同解約元本額は9,862,609円です。

組入上位ファンドの概要

R Mグローバルインパクト投資マザーファンド(気候変動)

【基準価額の推移】



【1万口当たりの費用明細】

(2022年11月16日~2023年11月15日)

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (投資信託証券)	8 (8) (0)	0.093 (0.093) (0.000)
(b) 有価証券取引税 (株 式)	2 (2)	0.018 (0.018)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	7 (7) (0)	0.083 (0.082) (0.001)
合 計	17	0.194

期中の平均基準価額は、8,733円です。

(注) 上記項目の概要等詳細につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

【組入上位10銘柄】

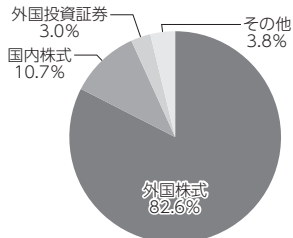
	銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
1	NOVOZYMES A/S-B SHARES	素材	デンマーククローネ	デンマーク	6.6%
2	ECOLAB INC	素材	米ドル	アメリカ	6.4
3	ANSYS INC	ソフトウェア・サービス	米ドル	アメリカ	5.8
4	MSCI INC	金融サービス	米ドル	アメリカ	5.8
5	AUTODESK INC	ソフトウェア・サービス	米ドル	アメリカ	5.8
6	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	米ドル	アメリカ	5.5
7	BALL CORP	素材	米ドル	アメリカ	5.5
8	GENUS PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	英ポンド	イギリス	5.4
9	XYLEM INC	資本財	米ドル	アメリカ	5.4
10	DARLING INGREDIENTS INC	食品・飲料・タバコ	米ドル	アメリカ	5.1
組入銘柄数			29銘柄		

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

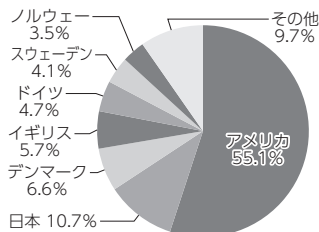
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

(注) 国(地域)につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

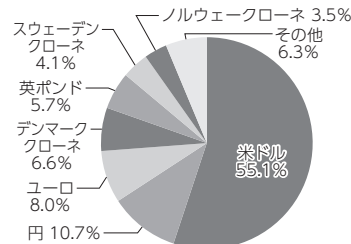
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(注) 組入上位10銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは2023年11月15日現在のものです。

※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書(全体版)をご参照ください。

<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>

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

○東証株価指数（TOPIX、配当込み）

東証株価指数（TOPIX、配当込み）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、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

○MSCI-KOKUSAI インデックス（配当込み、円ベース）

MSCI-KOKUSAI インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。

○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）

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）は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。

○NOMURA-BPI 国債

NOMURA-BPI 国債は、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日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI 国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、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）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指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関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 G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）

JP モルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JP モルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。