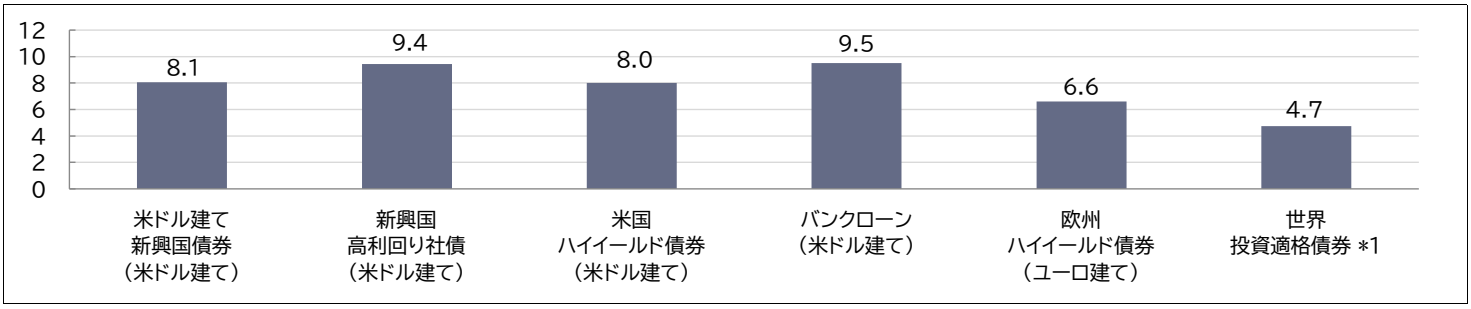
各資産の利回りと為替取引によるプレミアム／コスト （年率、単位:%） 三菱UFJアセットマネジメント

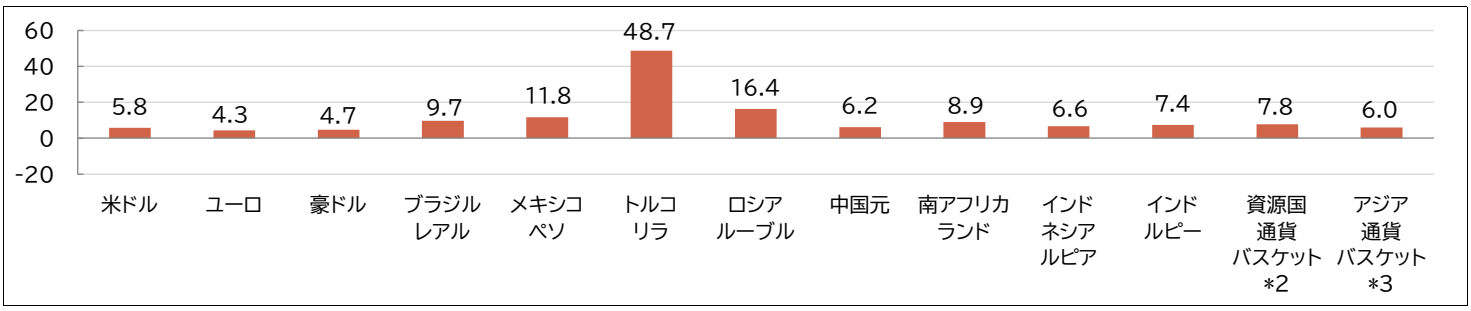
情報ご提供資料

データ基準日　2024年2月29日

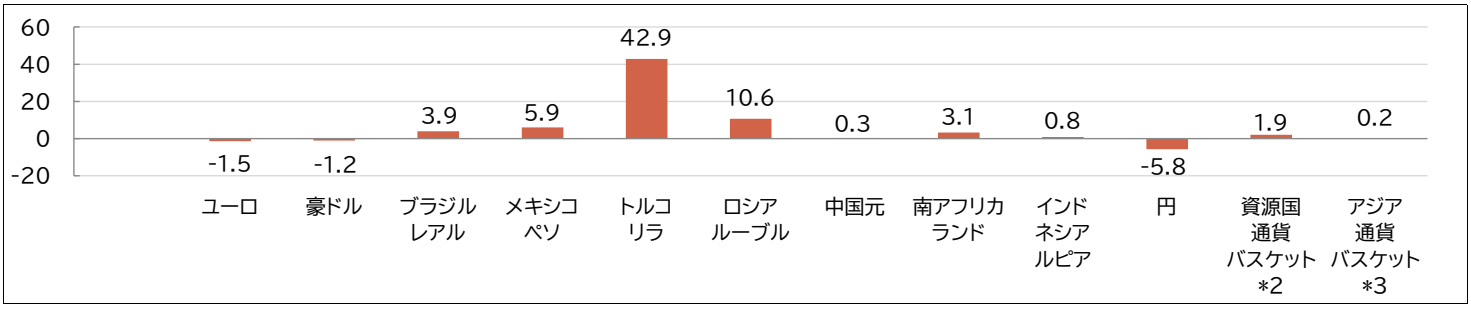
■各資産の利回り（指数ベース）



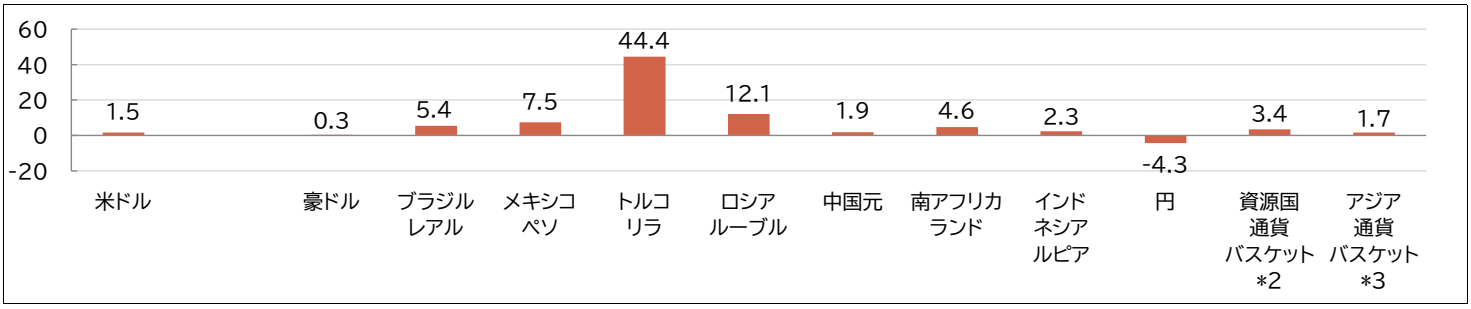
■円に対する為替取引によるプレミアム／コスト



■米ドルに対する為替取引によるプレミアム／コスト



■ユーロに対する為替取引によるプレミアム／コスト



（出所）Bloomberg、トムソン・ロイター、ICE Data Indices, LLC、クレディ・スイス証券、FTSE Fixed Income LLCのデータを基に三菱UFJアセットマネジメント作成

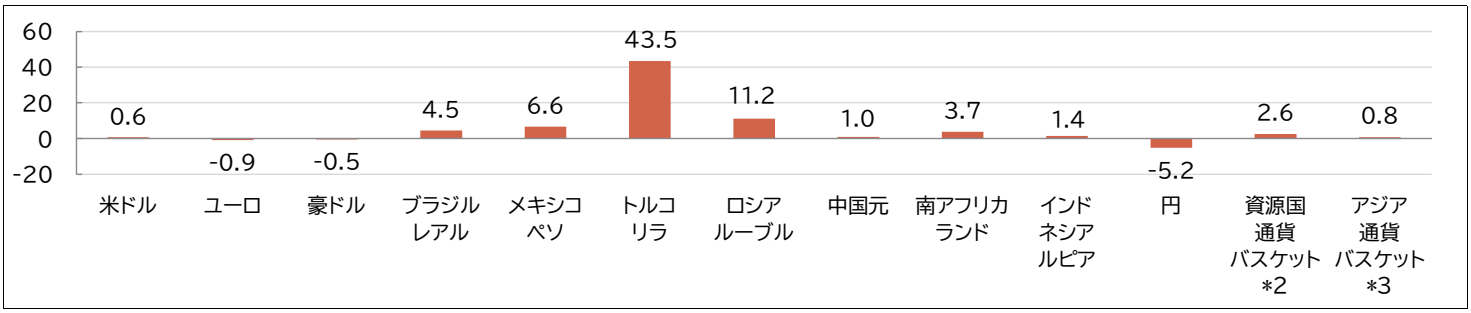
三菱UFJアセットマネジメント株式会社
金融商品取引業者　関東財務局長(金商)第404号
加入協会：一般社団法人投資信託協会
一般社団法人日本投資顧問業協会

各資産の利回りと為替取引によるプレミアム／コスト （年率、単位：%）三菱UFJアセットマネジメント

情報ご提供資料

データ基準日　2024年2月29日

■世界投資適格債券構成通貨 *4に対する為替取引によるプレミアム／コスト



（出所）Bloombergのデータを基に三菱UFJアセットマネジメント作成

*1　社債75%、国債25%で構成　*2　豪ドル、ブラジルレアル、南アフリカランド各1/3ずつで構成
*3　インドネシアルピア、インドルピー、韓国ウォン各1/3ずつで構成　*4　米ドル50%、ユーロ40%、英ポンド10%で構成

上記は公表会社が公表している直近値を使用しています。
各資産の利回りは為替やその他の特性を考慮しておらず、利回りだけで単純に比較できるものではありません。
上記の利回り、為替取引によるプレミアム／コストはあくまでも一時点の断面であり、将来の市場環境の変動や運用状況・成果を示唆・保証するものではありません。為替取引によるプレミアム／コストは各通貨間の直物レートと先物（1ヵ月）レートから、また一部の新興国通貨では直物レートとNDF（ノン・デリバラブル・フォワード）（1ヵ月）取引レートから三菱UFJアセットマネジメントが簡便的に算出したものであり、実際の為替取引によるプレミアム／コストとは異なります。

【本資料で使用している指数等について】
■米ドル建て新興国債券：JPモルガンEMBIグローバル・ダイバーシファイド
■新興国高利回り社債：JPモルガンCEMBIブロード・ノン・インベストメント・グレード
■米国ハイイールド債券：ICE BofA 米国ハイ・イールド・コンストレインド指数　■バンクローン：クレディ・スイス・レバレッジド・ローン・インデックス
■欧州ハイイールド債券：ICE BofA 欧州ハイ・イールド・コンストレインド指数
■世界投資適格債券：ブルームバーグ グローバル総合（日本円除く）社債インデックスとFTSE世界国債インデックス（除く日本）を各75%、25%で構成
本資料中の指数等の知的所有権、その他一切の権利はその発行者および許諾者に帰属します。また、発行者および許諾者が指数等の正確性、完全性を保証するものではありません。
各指数等に関する免責事項等については、委託会社のホームページ（https://www.am.mufg.jp/other/disclaimer.html）をあわせてご確認ください。

【本資料に関するご注意事項等】
■本資料は、投資環境等に関する情報提供のために三菱UFJアセットマネジメントが作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。販売会社が投資勧誘に使用することを想定して作成したものではありません。
■本資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。
■本資料は信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性等を保証するものではありません。