

マクロ・トータル・リターン・ファンド

追加型投信／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）

作成対象期間：2022年6月4日～2022年12月5日

第 13 期 決算日：2022年12月5日

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
当ファンドは、日本を含む世界各国の株式、債券および通貨に係る取引を含むデリバティブ取引等の幅広い資産を実質的な主要投資対象とし、特定の市場に左右されることなく収益の獲得を目的としています。ここに運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドが受益者のみなさまの資産形成に資するよう、運用に努めてまいりますので、よろしくお願い申し上げます。

第13期末（2022年12月5日）

基準価額	9,064円
純資産総額	8,122百万円
騰落率	-1.0%
分配金合計 ^(*)	0円

(*) 当期間の合計分配金額です。

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、以下の方法でご覧いただけます。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。


閲覧・ダウンロード方法



<https://www.am.mufig.jp/>

[ファンド検索] に
ファンド名を入力

各ファンドの詳細ページで
閲覧およびダウンロード

 **MUFG** 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
ホームページ <https://www.am.mufig.jp/>

■当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用
フリーダイヤル  **0120-151034**

（受付時間：営業日の9：00～17：00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

運用経過

第13期：2022年6月4日～2022年12月5日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第13期首	9,152円
-------	--------

第13期末	9,064円
-------	--------

既払分配金	0円
-------	----

騰落率	-1.0%
-----	-------

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（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。

※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、受益者のみなさま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、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.0%の下落となりました。

▶ 基準価額の主な変動要因

下落要因

主に債券戦略の下落などがマイナスに影響しました。

2022年6月4日～2022年12月5日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a)信託報酬	57	0.630	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(期中の日数÷年間日数)
（投信会社）	(20)	(0.223)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(36)	(0.390)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.017)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)その他費用	0	0.001	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.001)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	57	0.631	

期中の平均基準価額は、9,120円です。

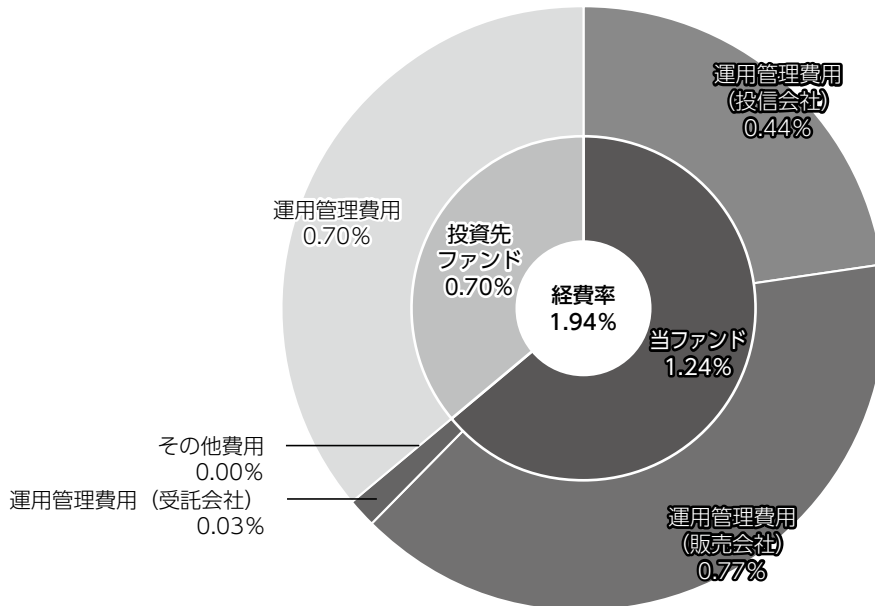
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

- (注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
- (注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。
- (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)

■ 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**経費率（年率）は1.94%**です。



経費率 (①+②)	(%)	1.94
①当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	(%)	0.70

(注) 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) 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) 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（マザーファンドを除く。）です。

(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 前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。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、前記には含まれておりません。

2017年12月4日～2022年12月5日

最近5年間の基準価額等の推移について



※分配金再投資基準価額は、2017年12月4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

	2017/12/4 期初	2018/12/3 決算日	2019/12/3 決算日	2020/12/3 決算日	2021/12/3 決算日	2022/12/5 決算日
基準価額 (円)	10,402	9,888	9,743	10,306	10,315	9,064
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	250	0	350	600	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	-2.6	-1.5	9.4	5.9	-12.1
純資産総額 (百万円)	20,967	12,104	9,891	8,192	7,039	8,122

※ファンド年間騰落率は、収益分配金（税込み）を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。

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

第13期：2022年6月4日～2022年12月5日

投資環境について

【株式】

米国の株式市況は、主要中央銀行における金融引き締めへの警戒感や世界的な景気後退への懸念が強まったことなどから、下落しました。

国内及び欧州の株式市況は、期中米国の株式市況と同様の理由で下落する局面もあったものの、期後半にかけて米連邦準備制度理事会（FRB）による利上げペースの減速期待が高まったことなどから上昇し、期初を上回る水準となりました。

新興国の株式市況は概ね下落しました。

【債券】

日本を含む先進国の債券利回りは、主要中央銀行の大幅な利上げ決定に加え、物価上昇に対する懸念などを背景に上昇しました。

新興国の債券利回りも上昇しました。

【オルタナティブ】

日本を含む先進国の不動産投資信託（REIT）市況は、米国株式と同様の理由などから下落しました。

原油は、主要中央銀行の金融引き締めに伴う世界的な景気減速への懸念などを背景に下落しました。

金価格は、米ドルが主要通貨に対して上昇したことや、米国長期金利が上昇したことなどから下落しました。

【為替】

為替市場では、米ドルは米国金利の上昇による日米金利差拡大などから円に対して上昇しました。ユーロに関しても、欧州主要国と日本における金利差の拡大などを背景に円に対して上昇しました。

【国内短期金融市場】

当期の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、足下のコール・レートは-0.078%となりました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ マクロ・トータル・リターン・ファンド

外国投資法人である「JPMorgan・インベストメント・ファンズ・グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド」の投資信託証券「JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ）」を高位に組入れました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券への投資も行いました。

▶ JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ）

日本を含む世界各国の株式、債券および通貨に係る取引を含むデリバティブ取引等の幅広い資産を実質的な主要投資対象とし、特定の市場に左右されることなく収益の獲得をめざしました。

運用にあたっては、グローバルなマクロ環境に関する複数のテーマを選定し、当該テーマに沿った個別投資戦略を組み合わせることで運用を行い、絶対収益の追求をめざしました。

株式戦略について、期初から2022年8月頃にかけては世界経済成長の鈍化や、海外主要中央銀行によるインフレ抑制のための継続的な金融引き締めなどを背景に、リスク水準を引き下げていました。9月

頃から、大幅なリスク資産の価格調整などを踏まえ、短期的な反発を予想し、ディフェンシブなポジションの一部で利益確定を行い、ファンドのネット株式エクスポージャーをプラスに転換しました。なお、10月下旬に再度ポジションをより慎重なものとしております。また世界経済成長の鈍化に市場の関心がシフトする環境を踏まえ、ヘルスケア関連の株式保有を拡大しました。

債券戦略について、2022年6月から7月頃にかけて米国債のロングポジションを解消し、全体のデュレーションを引き下げる時期はあったものの、8月以降は米国債のロングポジションを戻し、全体のデュレーションも再度引き上げました。

通貨戦略について、期初から2022年8月頃にかけては景気減速等のリスク増大に伴い、主に米ドルをロング、南アフリカランド、豪ドル、ユーロをショートとするポジションとしていました。9月頃には米国の成長減速とインフレが安定する可能性に市場の関心がシフトする見込みを反映し、米ドルのロングを利益確定、主に日本円のロングに対し、米ドルをショートとするポジションとしていました。11月中旬にかけてはまた米ドルをロングとするポジションに戻しています。期を通してリスクオフの局面で堅調に推

移す傾向がある金を組み入れました。デリバティブ戦略では、ポートフォリオのリスク調整などを背景に機動的にポジションを取りました。

外国投資法人の運用は、J. P. モルガン・アセット・マネジメントが行いました。

原則として、為替取引を行うことで円に対するユーロの為替変動リスクの低減をはかりました。

▶ **マネー・マーケット・マザーファンド**
コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保をめざした運用を行いました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（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します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第13期 2022年6月4日～2022年12月5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	263

(注) 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 (作成対象期間末での見解です。)

▶ マクロ・トータル・リターン・ファンド

外国投資法人である「JPMオルガン・インベストメント・ファンズ・グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド」の投資信託証券「JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ）」を高位に組み入れます。またマネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券への投資も行います。

▶ JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ）

日本を含む世界各国の株式、債券および通貨に係る取引を含むデリバティブ取引等の幅広い資産を実質的な主要投資対象とし、特定の市場に左右されることなく収益の獲得をめざします。

運用にあたっては、グローバルなマクロ環境に関する複数のテーマを選定し、当該テーマに沿った個別投資戦略を組み合わせ、運用を行い、絶対収益の追求をめざします。

外国投資法人の運用は、J. P. モルガン・アセット・マネジメントが行います。原則として、為替取引を行うことで円に対するユーロの為替変動リスクの低減をはかります。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

今後も日銀による金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は引き続き低位で推移すると予想しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

お知らせ

▶ 約款変更

- ・該当事項はありません。

▶ その他

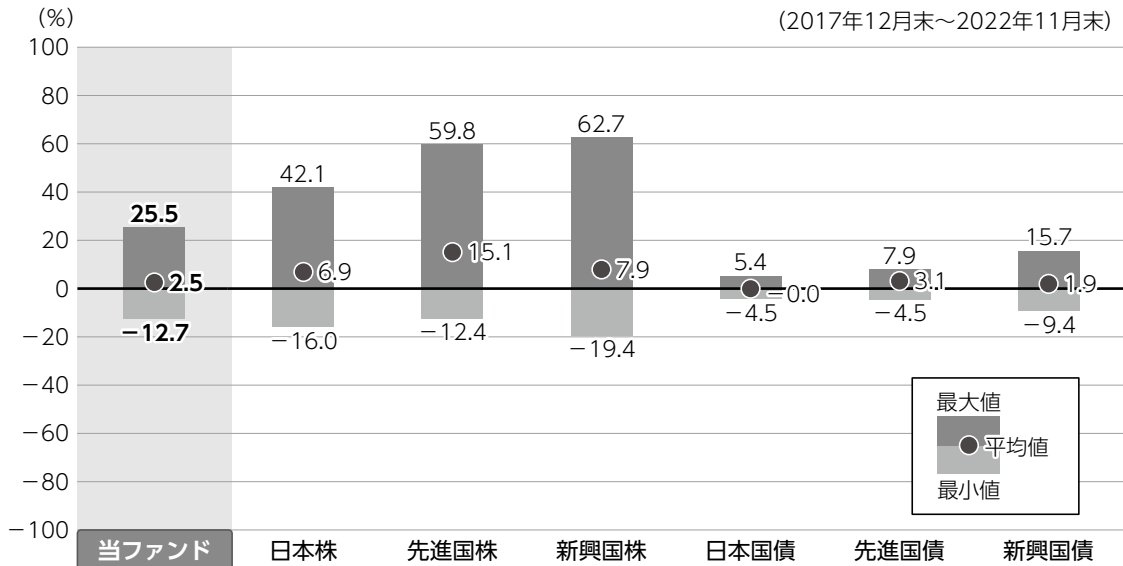
- ・該当事項はありません。

*本書が、受益者のみなさまのお手元に届くのは作成対象期間末から2ヵ月以上が経過していることにご留意ください。
なお、最近の運用状況や約款変更の内容等は当社ホームページ (<https://www.am.mufig.jp/>) にて開示を行っている場合があります。

当該投資信託の概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）
信託期間	2026年6月3日まで（2016年6月21日設定）
運用方針	<p>外国投資法人であるJPMorgan・インベストメント・ファンズグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンドの投資信託証券（JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ））への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、債券ならびに通貨に係る取引を含むデリバティブ取引等の幅広い資産（不動産投資信託証券、コモディティ・インデックスおよび転換証券等を含みます。）に投資を行います。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。</p> <p>外国投資法人の投資信託証券への投資は、高位を維持することを基本とします。外国投資法人において、ユーロ以外の通貨建て資産に投資する部分について、各当該通貨売りユーロ買いの為替取引を行うことがあります。また、投資する投資信託証券においては、原則として当該投資信託証券の純資産総額をユーロ換算した額とほぼ同額程度のユーロ売り円買いの為替取引を行い、円に対するユーロの為替変動リスクの低減をはかります。</p>
主要投資対象	<p>■当ファンド</p> <p>JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ）およびマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>■JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ）</p> <p>直接ないしデリバティブ取引等を通じて、世界各国の株式、債券等に投資します。また、預金、短期金融資産、リート、コモディティ・インデックスおよび転換証券等へ投資を行うことがあります。</p> <p>■マネー・マーケット・マザーファンド</p> <p>わが国の公社債等を主要投資対象とします。外貨建資産への投資は行いません。</p>
運用方法	日本を含む世界各国の株式、債券およびデリバティブ取引等の幅広い資産を実質的な主要投資対象とし、特定の市場に左右されることなく収益の獲得をめざします。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



●上記は、2017年12月から2022年11月の5年間における1年騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて定量的に比較できるように作成したものです。

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 (配当込み)
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)
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)
新興国債	JPMorgan Global Diversified

※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、円換算しています。

●全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

●ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

●騰落率は直近前月末から60ヵ月遡った算出結果であり、ファンドの決算日に対応した数値とは異なります。

当該投資信託のデータ

2022年12月5日現在

当該投資信託の組入資産の内容

組入ファンド

(組入銘柄数：2銘柄)

ファンド名	第13期末 2022年12月5日
JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド (Iクラス) (円建て、円ヘッジ)	97.7%
マネー・マーケット・マザーファンド	0.0%

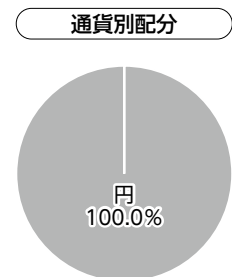
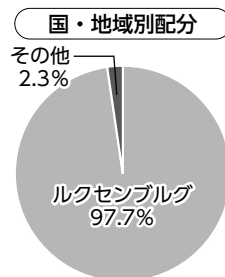
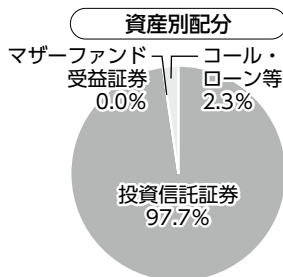
※比率は当ファンドの純資産総額に対する各投資信託証券の評価額の割合です。

純資産等

項目	第13期末 2022年12月5日
純資産総額 (円)	8,122,649,287
受益権口数 (口)	8,961,043,190
1万口当たり基準価額 (円)	9,064

※当期中において追加設定元本は888,175,629円
同解約元本は 549,893,934円です。

種別構成等



※比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。構成比率が5%未満の項目は「その他」に分類しています。

※国・地域別配分の「その他」には、コール・ローン等のように、複数の金融機関等（国内外）を相手先とし他のファンドの余剰資金等と合せて運用しているものを含みます。

※【国・地域別配分】、【通貨別配分】は、組入ファンドの発行地、発行通貨を表示しています。

2021年12月31日現在

組入上位ファンドの概要

▶ JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（Iクラス）（円建て、円ヘッジ）

基準価額の推移

2020年12月31日～2021年12月31日



基準価額の推移以外の開示情報につきましては、クラス分けされたものがないため、外国投資法人の「JPMorgan・インベストメント・ファンズ・グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド」ベースで表示しています。

1万口当たりの費用明細

2021年1月1日～2021年12月31日

1万口当たりの費用明細に相当する情報がないため、開示できません。

▶ JPMorgan・インベストメント・ファンズ・グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド

組入上位10銘柄（ロングポジション）

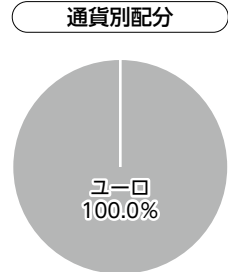
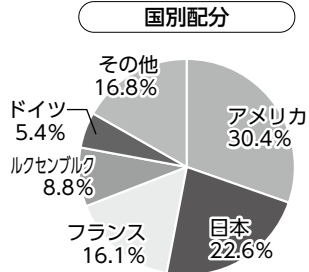
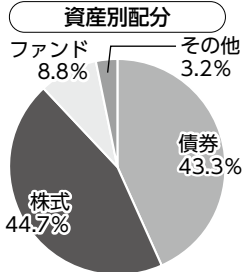
（組入銘柄数：52銘柄）

	銘柄	種類	国	比率(%)
1	JPMorgan EUR Liquidity LVNAV Fund- JPM EUR Liquidity LVNAV X (flexdist.)	ファンド	ルクセンブルク	8.8
2	France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 16/03/2022	債券	フランス	4.9
3	France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 09/03/2022	債券	フランス	4.8
4	France Treasury Bill BTF, Reg. S 0% 02/03/2022	債券	フランス	4.8
5	Japan Treasury Bill 0% 28/03/2022	債券	日本	4.8
6	Germany Treasury Bill, Reg. S 0% 21/04/2022	債券	ドイツ	4.8
7	Japan Treasury Bill 0% 07/03/2022	債券	日本	4.7
8	Japan Treasury Bill 0% 06/01/2022	債券	日本	4.6
9	Japan Treasury Bill 0% 28/02/2022	債券	日本	4.4
10	Japan Treasury Bill 0% 21/02/2022	債券	日本	3.4

※比率は外国投資法人の純資産総額に対する割合です。

※なお、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）でご覧いただけます。

種別構成等



※比率は外国投資法人の純資産総額に対する割合です（派生商品を除く）。構成比率が5%未満の項目は「その他」に分類しています。

※資産別配分の「その他」は現金・預金・その他資産（負債控除後）です。

※国別配分は発行国を表示しています。国別配分の「その他」には現金・預金・その他資産（負債控除後）を含みます。

※通貨別配分は、アニュアルレポートに開示されていないため、外国投資法人の建値通貨を表示しています。

968469

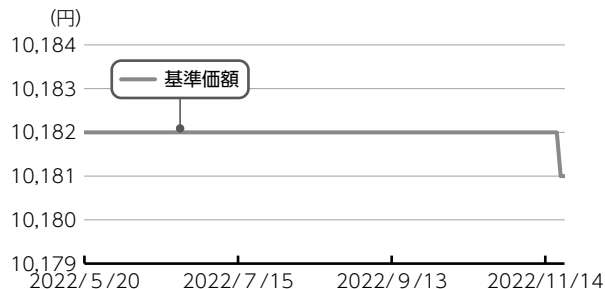
2022年11月21日現在

組入上位ファンドの概要

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

基準価額の推移

2022年5月20日～2022年11月21日



1万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

当期において費用が発生していないため、費用明細は作成しておりません。

組入上位10銘柄

(組入銘柄数：3銘柄)

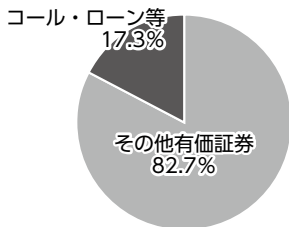
	銘柄	種類	国・地域	業種/種別	比率(%)
1	ミズホリース 221122	其他有価証券	日本	コマーシャル・ペーパー	75.2
2	アミカスF 221122	其他有価証券	日本	コマーシャル・ペーパー	3.8
3	オリコ 221122	其他有価証券	日本	コマーシャル・ペーパー	3.8
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					

※比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合です。
※原則、国・地域については、発行地を表示しています。

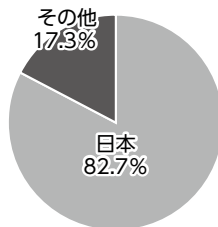
※なお、全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)でご覧いただけます。

種別構成等

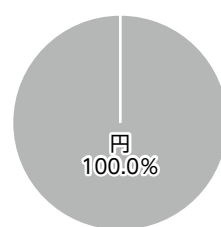
資産別配分



国・地域別配分



通貨別配分



※比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合です。
構成比率が5%未満の項目は「その他」に分類しています。

※原則、国・地域については、発行地を表示しています。

※国・地域別配分の「その他」には、コール・ローン等のように、複数の金融機関等(国内外)を相手先とした他のファンドの余裕資金等と合わせて運用しているものを含みます。

指数に関して

▶ 「ファンドと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）（配当込み）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、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」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・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

●MSCI コクサイ・インデックス（配当込み）

MSCI コクサイ・インデックス（配当込み）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。また、MSCI コクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべて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）

MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み）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。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

●NOMURA-BPI（国債）

NOMURA-BPI（国債）とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI（総合）のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●FTSE世界国債インデックス（除く日本）

FTSE世界国債インデックス（除く日本）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債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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・ダイバーシファイド

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。



三菱UFJ国際投信