

フューチャートレンド世界株

追加型投信／内外／株式

償還交付運用報告書

第5期(償還日2023年12月19日)

作成対象期間(2023年11月15日～2023年12月19日)

第5期末(2023年12月19日)	
償還価額	19,922円85銭
純資産総額	120百万円
第5期	
騰落率	1.7%
分配金(税込み)合計	-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、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。

- 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ことができる旨を定めております。運用報告書(全体版)は、野村アセットマネジメントのホームページで閲覧・ダウンロードしていただけます。
- 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。

<運用報告書(全体版)の閲覧・ダウンロード方法>

右記ホームページを開く

⇒「ファンド検索」にファンド名を入力しファンドを選択

⇒ファンド詳細ページから「運用報告書(全体版)」を選択

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、グローバル・マルチテーママザーファンド受益証券への投資を通じて、主として新興国を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に投資を行ない、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行ないました。

このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行ない、償還価額が決定いたしました。

ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

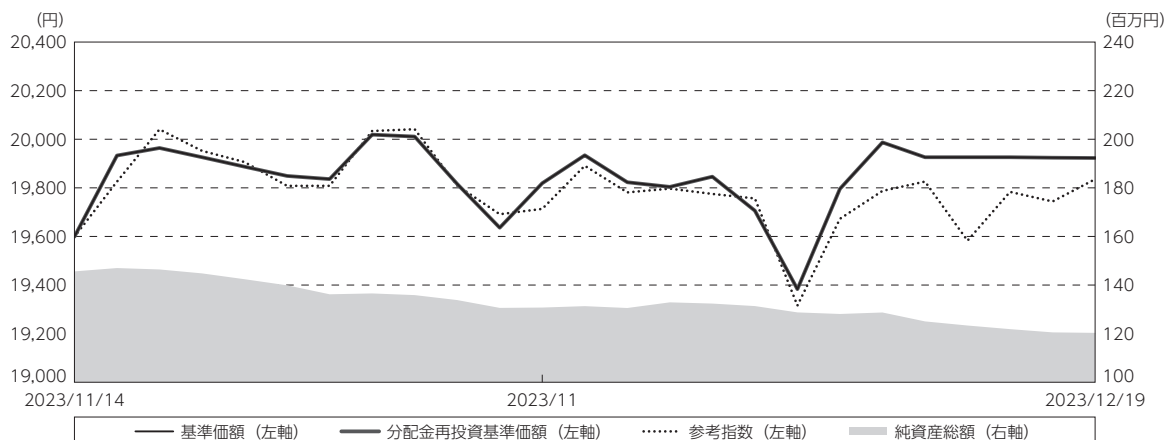


ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2023年11月15日～2023年12月19日)



期 首： 19,599円

期末 (償還日)：19,922円85銭 (既払分配金 (税込み)：一円)

騰 落 率： 1.7% (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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首 (2023年11月14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) 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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス (税引後配当込み・円換算ベース) です。詳細は4ページをご参照ください。参考指数は、作成期首 (2023年11月14日) の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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。

○基準価額の変動要因

(上昇) 10月の米CPI (消費者物価指数) 上昇率が市場予想を下回ったことが好感されたこと、11月のFOMC (米連邦公開市場委員会) において政策金利の据え置きが決定されたことを受け、利上げが最終局面に近づいたことが再認識され投資家心理が上向いたこと

1 万口当たりの費用明細

(2023年11月15日～2023年12月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 28	% 0.142	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投信会社)	(14)	(0.068)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販売会社)	(14)	(0.068)	購入後の情報提供、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および事務手続き等
(受託会社)	(1)	(0.005)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	1	0.005	(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
(株 式)	(1)	(0.005)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	0	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)	(0)	(0.000)	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)	(0)	(0.000)	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
合 計	29	0.148	
期中の平均基準価額は、19,819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。

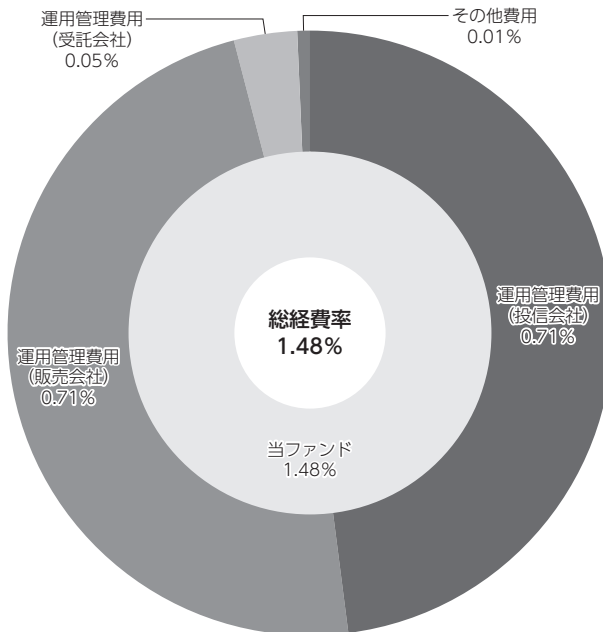
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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総経費率（年率）は1.48%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、売買委託手数料およ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。

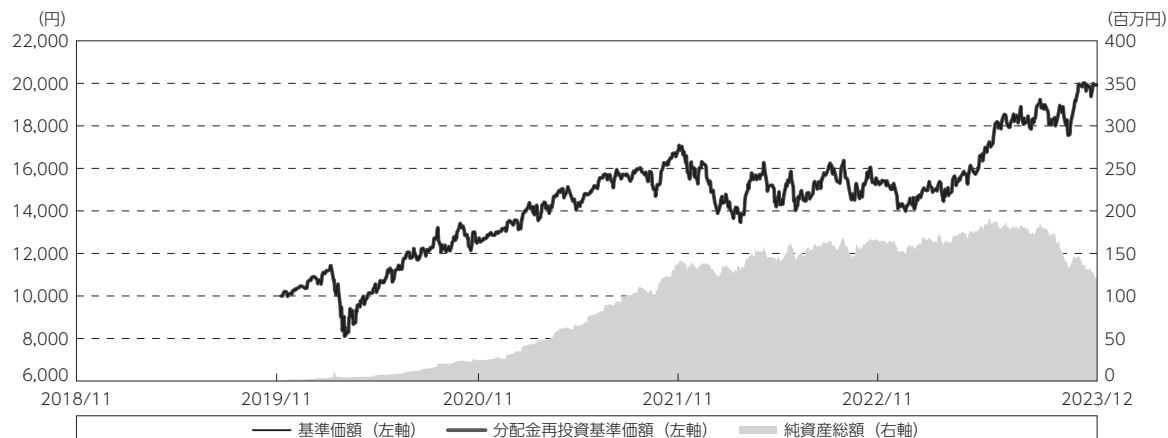
(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 当ファンドのその他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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14日～2023年12月19日)



- (注) 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、個々の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2019年11月25日です。

	2019年11月25日 設定日	2020年11月16日 決算日	2021年11月15日 決算日	2022年11月14日 決算日	2023年11月14日 決算日	2023年12月19日 償還日
基準価額 (円)	10,000	12,613	16,851	15,334	19,599	19,922.85
期間分配金合計(税込み) (円)	—	0	0	0	0	—
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	26.1	33.6	△ 9.0	27.8	1.7
参考指数騰落率 (%)	—	9.1	38.0	1.8	19.4	1.2
純資産総額 (百万円)	1	24	138	165	145	120

- (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、2020年11月16日の騰落率は設定当初との比較です。また、償還日の騰落率は償還日の直前の決算日との比較です。

* 参考指数 (= 「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引後配当込み・円換算ベース)」) は、MSCI ACWI (All Country World Index) Index (税引後配当込み・ドルベース) をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスを営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。

* MSCI ACWI (All Country World Index) Index (税引後配当込み・ドルベース) は、MSCIが開発した指数で、同指数の著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCI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ています。

(出所) MSCI

投資環境

(2023年11月15日～2023年12月19日)

世界の株式市場は、10月の米CPI上昇率が市場予想を下回ったことが好感されたことや、11月のFOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたことを受け、利上げが最終局面に近づいたことが再認識され投資家心理が上向いたことで上昇し、当期において世界の株式市場は上昇しました。

為替市場では、米インフレ率の低下などに伴い日米金利差が縮小したことから米ドル安が進行し、期を通じて米ドル安・円高となりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2023年11月15日～2023年12月19日)

[グローバル・マルチテーマ マザーファンド]

・株式組入比率

期を通じておおむね高位を維持しました。

・期中の主な動き

- (1) 業種別配分につきましては、情報技術セクターなどをオーバーウェイト（参考指数に比べ高めの投資比率）としました。一方、金融セクターなどをアンダーウェイト（参考指数に比べ低めの投資比率）としました。
- (2) テーマ別配分につきましては、「AI/クラウドサービス」や「IoT/スマートモビリティ」などのテーマに関連する銘柄の投資比率を期中平均で高めとしました。前期末から当期末への変化としては、「フィンテック」などのテーマに関連する銘柄の投資比率を引き上げた一方、「インフラ/エネルギー」などのテーマに関連する銘柄の投資比率を引き下げました。

[フューチャートレンド世界株]

- ・主要投資対象である [グローバル・マルチテーマ マザーファンド] 受益証券を期を通じておおむね高位に組み入れました。償還に向けて、12月中旬に [グローバル・マルチテーマ マザーファンド] 受益証券を全売却しました。

・為替ヘッジ

当ファンドの運用の基本方針に従い、為替ヘッジは行ないませんでした。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年11月15日～2023年12月19日)

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としているMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引後配当込み・円換算ベース)の騰落率が1.2%の上昇となったのに対して、基準価額は1.7%の上昇となりました。

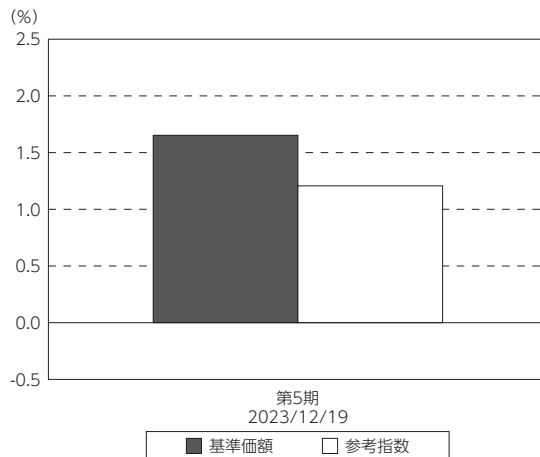
(主なプラス要因)

- ①情報技術セクターやヘルスケアセクター内での銘柄選択効果がプラスに寄与したこと
- ②企業のDX(デジタルトランスフォーメーション)が進む中で、サイバーセキュリティ製品やサービスへの需要の高まりによる中長期的な成長が期待できると判断し、オーバーウェイトとしていた米国のソフトウェア株や、動物向け臨床検査ビジネスの中長期的な業績成長が期待できると判断し、オーバーウェイトとしていた米国のヘルスケア機器・用品株などの株価騰落率が参考指数を上回ったこと

(主なマイナス要因)

- ①公益事業セクター内での銘柄選択効果がマイナスに影響したこと
- ②生成AI(人工知能)の利用拡大により、データセンター向け半導体の売り上げ拡大が期待できると判断し、オーバーウェイトとしていた米国の半導体・半導体製造装置株などの株価騰落率が参考指数を下回ったこと

基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)



(注) 参考指数は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引後配当込み・円換算ベース)です。

分配金

(2023年11月15日～2023年12月19日)

償還のため分配は行ないませんでした。

設定来の運用経過

<設定来の基準価額の推移>



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から償還時19,922.85円となりました。設定来お支払いした分配金は1万円あたり0円となりました。

第1期（2019年11月25日～2020年11月16日）

- (上 昇) 米中貿易協議において「第1段階」の合意文書が署名されたこと、2020年1月の米ISM製造業景気指数やユーロ圏総合PMI（購買担当者景気指数）が市場予想を上回ったこと、中国人民銀行（中央銀行）により金融市場へ資金供給が行なわれたこと、為替市場で円が下落（円安）したこと
- (下 落) 新型コロナウイルスの感染拡大により、世界的な経済活動の停滞による景気後退への懸念が高まったこと、OPEC（石油輸出国機構）とロシアなど非加盟産油国の減産交渉決裂を受けて原油価格が急落したこと、為替市場で円が上昇（円高）したこと
- (上 昇) 米国で大型経済対策の成立やFRB（米連邦準備制度理事会）による量的金融緩和策が決定したこと、同ウイルスのワクチン開発の進展が期待されたこと、EU（欧州連合）による復興計画案が公表されたこと、6月の米雇用統計、7月の米ISM製造業景気指数やユーロ圏製造業PMIが市場予想を上回ったこと
- (横ばい) 米中対立の激化や欧米の一部地域での同ウイルスの感染再拡大などを背景に投資家のリスク回避的な動きが強まったこと、為替市場で円が上昇したこと、一方、9月の米ISM非製造業景気指数やユーロ圏総合PMIが市場予想を上回ったこと

第2期（2020年11月17日～2021年11月15日）

- (上 昇) 新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済活動回復への期待が広がったこと、米上院決選投票で民主党が勝利したこと、バイデン米政権による1.9兆ドル規模の「米国救済計画」の成立が好感されたこと、2021年3月の雇用統計など米経済指標が市場予想を上回る回復を示したこと、為替市場で円が下落したこと
- (下 落) 堅調な米経済指標の発表を背景とした量的金融緩和縮小への警戒感などから金利上昇に弱いとされる成長株が軟調に推移したこと、為替市場で円が上昇したこと
- (上 昇) パウエルFRB議長が利上げを急がない姿勢を示したこと、バイデン米大統領が超党派の上院議員とインフラ投資法案で合意に達したこと、4-6月期の米企業決算が市場予想を上回ったこと
- (下 落) 米国での新型コロナウイルスの感染再拡大や市場予想を下回った8月の米雇用統計を受けて景気の先行き不透明感が意識されたこと、中国の大手不動産会社の債務問題により投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、FOMCを受けて米金融政策の正常化が意識され、米長期金利が上昇基調となったこと
- (上 昇) 新型コロナウイルスの経口治療薬の早期実用化への期待が台頭したこと、主要な米国企業の7-9月期決算が市場予想を上回ったこと、為替市場で円が下落したこと

第3期（2021年11月16日～2022年11月14日）

- (下 落) 新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大への懸念が広がったこと、FRBがインフレ対応重視で金融政策の正常化を前倒しで進めるとの見方が強まり、米長期金利が上昇したこと、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が嫌気されたこと
- (上 昇) 2022年3月のFOMCで市場予想と同じく0.25%の政策金利引き上げを決定するなど重要イベントを通過したこと、ロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待が高まったこと、為替市場で円が下落したこと
- (下 落) FRBの理事が資産圧縮を「5月にも急ピッチで始める」と発言するなど、金融引き締め姿勢の強まりに対する懸念が広がったこと、米ミシガン大学が発表した6月の消費者信頼感指数が市場予想を下回ったこと、物価上昇や金融引き締めによる企業業績の先行きに警戒感が高まったこと
- (上 昇) 4-6月期の米企業決算が市場予想を上回ったこと、7月の米CPI上昇率が6月と比較して減速したことで、FRBが金融引き締めペースを緩めるとの期待感が高まったこと
- (下 落) FRBのパウエル議長がインフレ抑制を最優先に利上げを継続する方針を示したことで、早期の利下げ期待が後退したこと、8月の米CPI上昇率が市場予想を上回ったことで、大幅利上げが実施されるとの観測が強まったこと
- (上 昇) 一部メディアが、米金融当局が年内に利上げペースの減速を協議する可能性を報じたこと、10月の米CPI上昇率が市場予想を下回ったことが好感されたこと

第4期（2022年11月15日～2023年11月14日）

- (下 落) 2022年12月のFOMCで継続利上げの必要性が強調され、景気後退と企業収益悪化への警戒が高まったこと、為替市場で円が上昇したこと
- (上 昇) 12月の雇用統計において賃金上昇率が前月から減速したことなどからFRBの金融引き締め長期化への警戒が和らいだこと、12月のCPI上昇率が前月比で低下したことにより、FRBの利上げペースの更なる鈍化が期待されたこと
- (下 落) FRB議長が米上院銀行委員会での議会証言で利上げペースの再加速や利上げ長期化の可能性を示唆したこと、米地銀の経営破綻を発端とした信用不安が広がったこと
- (上 昇) 米地銀を巡る過度な懸念が和らぎ、投資家心理が改善したこと、米インフレ率の鈍化傾向が見られたことから利上げ打ち止め期待が高まったこと、市場予想を上回った米大手IT企業の2023年1-3月期決算や、米大手半導体企業の5-7月期の業績見通しなどが市場予想を大きく上回ったことが好感されたこと、為替市場で円が下落したこと
- (横ばい) 大手格付機関が米国債の格付けを引き下げたこと、7月のFOMC議事録で、政策金利引き上げ継続の可能性が議論されていたことが明らかとなり金融引き締めが長期化するとの懸念が高まったこと、9月のFOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたものの、年内に追加利上げを行ない、高い金利水準を維持する方針が示唆されたこと、為替市場で円が下落したこと
- (上 昇) 11月のFOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたことを受け、利上げが最終局面に近づいたことが再認識され投資家心理が上向いたこと

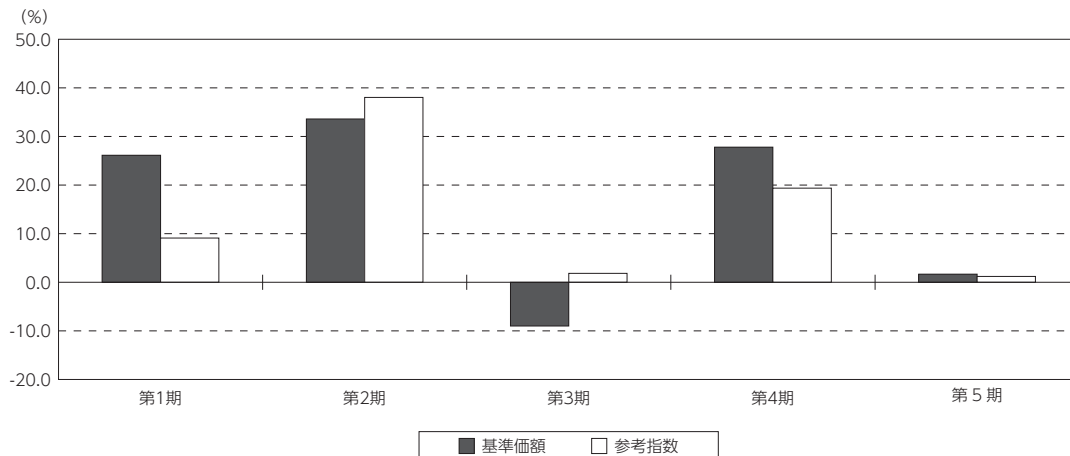
第5期（2023年11月15日～2023年12月19日）

- (上 昇) 10月の米CPI上昇率が市場予想を下回ったことが好感されたこと、11月のFOMCにおいて政策金利の据え置きが決定されたことを受け、利上げが最終局面に近づいたことが再認識され投資家心理が上向いたこと

○参考指数との対比

設定来では、参考指数の騰落率が85.2%の上昇となったのに対して、基準価額は99.2%の上昇となりました。株価騰落率が参考指数を上回った情報技術セクターをオーバーウェイトとしていたことや、ヘルスケアセクターや情報技術セクター内での銘柄選択効果がプラスに寄与しました。

<基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）>



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引後配当込み・円換算ベース）です。

当ファンドは2023年12月19日をもちまして繰上償還となりました。ご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。

お知らせ

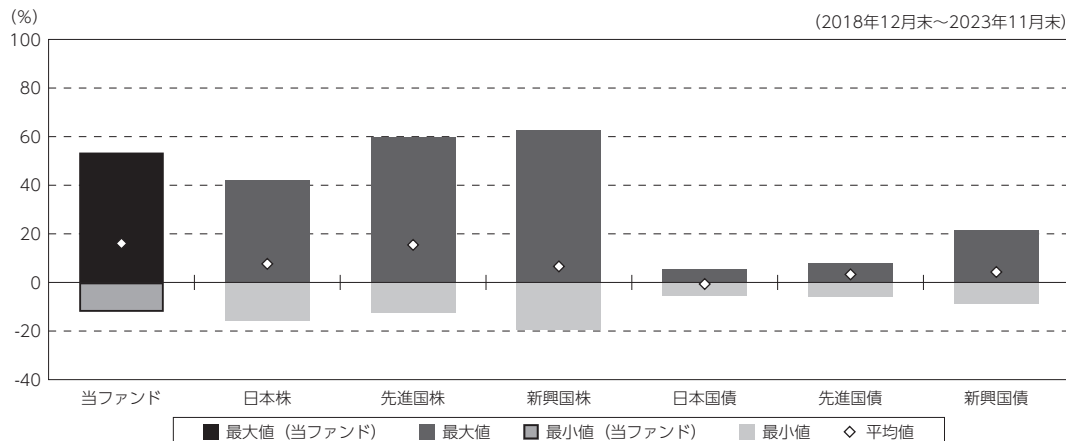
該当事項はございません。

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	2023年12月19日をもちまして繰上償還いたします。(設定日2019年11月25日)	
運用方針	グローバル・マルチテーマ マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、新興国を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。	
主要投資対象	フューチャートレンド世界株	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	新興国を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として新興国を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に投資を行ない、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。	
分配方針	毎決算時に、原則として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。）等から、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。	

(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	53.4	42.1	59.8	62.7	5.4	8.0	21.5
最小値	△ 12.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値	16.0	7.6	15.4	6.6	△ 0.6	3.3	4.3

(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12月から2023年11月の5年間(当ファンドは2020年11月から2023年11月)の各月末における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。

(注) 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。

《代表的な資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数 (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、ヘッジなし・円ベース)

新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)

※各指数についての説明は、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12月19日現在)

2023年12月19日現在、有価証券等の組入れはございません。

マザーファンドの直近の計算期間の内容につきましては、償還運用報告書（全体版）に記載しております。

純資産等

項 目	第5期末(償還日)	
	2023年12月19日	
純資産総額	120,321,728円	
受益権総口数	60,393,848口	
1万口当たり償還価額	19,922円85銭	

(注) 期中における追加設定元本額は1,492,527円、同解約元本額は15,398,540円です。

<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) の指数値及び東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に係る標章又は商標は、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 (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、利用など東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に係る標章又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、東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及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-KOKUSAI 指数 (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)

MSCI-KOKUSAI 指数 (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 が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI 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ています。

○NOMURA-BPI 国債

NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、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。なお、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は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行なわれる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し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、ヘッジなし・円ベース)

FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) 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。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。

○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます) についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国の J.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSLLC」と呼びます) (「指数スポンサー」) は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。

JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行なう際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他)