

アムンディ・欧州ハイ・イールド債券ファンド (米ドルコース)

追加型投信／海外／債券

第 15 作成期

第82期 (決算日 2020年11月9日)

第83期 (決算日 2020年12月8日)

第84期 (決算日 2021年1月8日)

第85期 (決算日 2021年2月8日)

第86期 (決算日 2021年3月8日)

第87期 (決算日 2021年4月8日)

作成対象期間 (2020年10月9日～2021年4月8日)

第87期末 (2021年4月8日)	
基準価額	5,280円
純資産総額	12,397百万円
第82期～第87期	
騰落率	9.6%
分配金 (税込み) 合計	420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、欧州のハイイールド債を主要投資対象とするユーロ売り／米ドル買いの為替取引を行う、「ストラクチャラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。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。

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<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

※ホームページ掲載日より5年間は閲覧いただけます。

- 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。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町1丁目2番2号

<お問い合わせ先>

お客様サポートライン：0120-202-900 (2021年6月30日まで)
03-3593-5911※ (2021年7月1日から)
※通話料は有料です

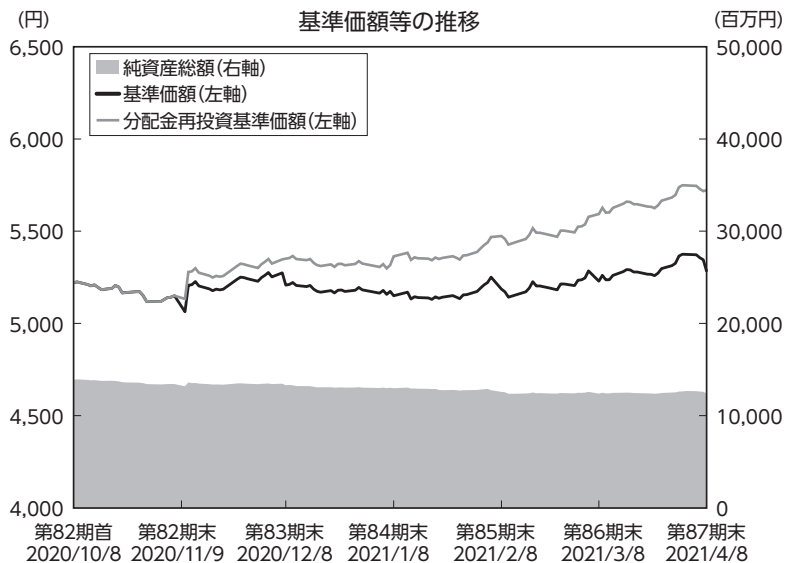
受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで
ホームページアドレス：<https://www.amundi.co.jp/>

運用経過

基準価額等の推移

第82期首	5,221円
第87期末	5,280円
既払分配金 (税込み)	420円
騰落率	9.6% (分配金再投資ベース)

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。



(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、2020年10月8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。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ① 作成期を通じて中央銀行、政府による過去最大のQE (量的緩和)や財政措置が強力な支援要因となり、クレジット・スプレッド (国債との利回り格差) が大きく縮小したこと
- ② 11月以降、米国大統領選挙でバイデン氏が勝利し、米国上院決選投票で民主党が過半数を獲得したことで、安定した政策運営、経済政策が期待され、クレジット・スプレッドが縮小したこと
- ③ 年末にEU (欧州連合) 離脱に関する通商交渉で英国とEUが合意したことによって不透明感が後退し、投資家心理が改善したこと
- ④ 為替市場において、当作成期は米ドル高・円安となったこと
- ⑤ ユーロ売り/米ドル買いの為替取引により、プレミアム (金利差相当分の収益) を得たこと

下落要因

- ① 年が明けても新型コロナウイルス感染者数の増加抑制が困難で経済活動が低迷した状態が続いたこと
- ② 1月から3月までオーバーウェイトしていた劣後債のクレジット・スプレッドが拡大したこと

1万口当たりの費用明細

項 目	第82期～第87期 (2020年10月9日 ～2021年4月8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)	29円 (8) (20) (1)	0.554% (0.154) (0.384) (0.016)	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)	0 (0) (0)	0.008 (0.005) (0.002)	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
合 計	29	0.562	
期中の平均基準価額は5,210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。

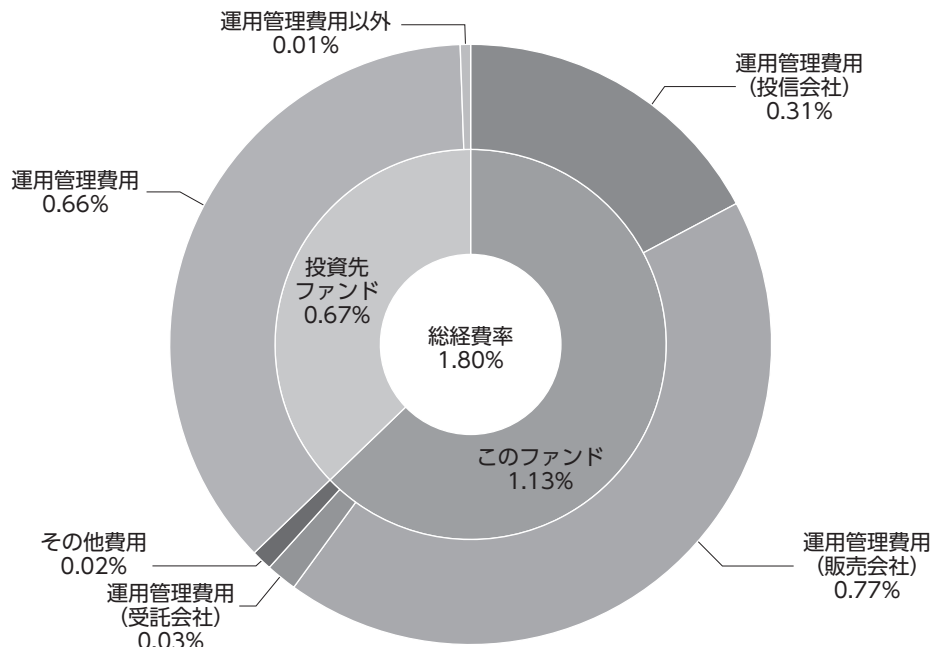
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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1.80%です。



総経費率 (①+②+③)	1.80%
①このファンドの費用の比率	1.13%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.66%
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。

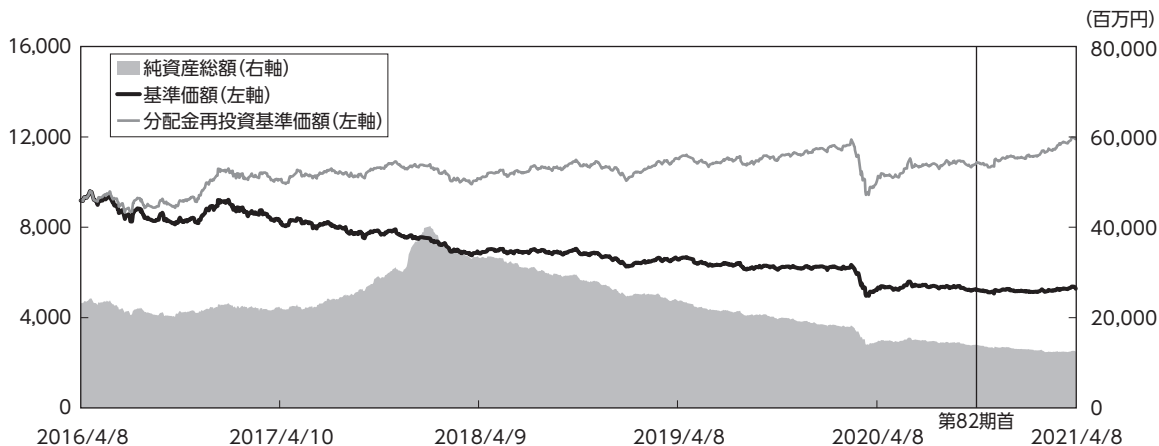
(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(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

(2016年4月8日～2021年4月8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、2016年4月8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

	2016/4/8 期首	2017/4/10 決算日	2018/4/9 決算日	2019/4/8 決算日	2020/4/8 決算日	2021/4/8 決算日
基準価額(円)	9,183	8,187	6,848	6,576	5,218	5,280
期間分配金合計(税込み)(円)	—	1,800	1,420	840	840	840
分配金再投資基準価額騰落率(%)	—	9.9	0.5	8.8	-8.9	18.6
純資産総額(百万円)	23,136	21,976	33,190	23,747	14,534	12,397

(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

〈欧州ハイイールド債券市場〉

作成期初は大規模な新型コロナウイルスの感染再拡大に対処するために、世界中で新たな封じ込め措置が実施されました。こうした措置による景気回復への影響が投資家心理に影を落としましたが、ワクチン供給に対する期待の高まりや、前向きな金融政策が相次ぎ発表され市場は上昇トレンドを再開しました。こうした環境の下で、金融市場は各国・地域の中央銀行の支援により堅調に推移しました。こうした中、11月以降、クレジット・スプレッド（国債との利回り格差）が大幅に縮小しました。年明け後は、感染者数の抑制が進まず景気回復への懸念が高まったものの、ワクチン接種の実施や協調的な金融・財政刺激策が、前向きな投資家心理を引き続き後押ししました。その後は、景気回復が予想よりも力強くなるという見通しと、インフレ期待の上昇が相まって、投資家は中央銀行が一步退き、金融政策引き締めへ踏み切る可能性があることと懸念したことから、欧州と米国の国債利回りはいずれも大幅に上昇（債券価格は下落）しました。クレジット・スプレッドは作成期末にかけて縮小ペースは低下したものの、堅調に推移し、作成期を通じてみると欧州ハイイールド債券市場のクレジット・スプレッドは大幅に縮小しました。特にリスクの高い債券の縮小幅が大きなものとなりました。

〈為替市場〉

当作成期、米ドル／円相場は106円台で始まり、欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大を受け、経済活動制限の動きから景気先行き不安で米ドルは下落傾向となるなか、F R B（米連邦準備理事会）の金融緩和策の長期化観測などから米ドル安が進行し、2021年1月には102円台となりました。その後、バイデン政権による追加経済対策への期待などから米長期金利が上昇したことを受け米ドルは上昇すると、米株高や米経済指標の改善、ワクチンの普及なども背景に作成期後半は堅調に推移する展開となり110円台をつけた後、109円台で当作成期末を迎えました。

〈日本の短期国債市場〉

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ヵ月物の利回りは-0.14%前後の低い水準で始まりました。当作成期初は、年末越えの担保需要や海外勢の買い需要から、利回りは低い水準で推移していました。その後、海外勢の買い需要が後退したことから、利回りは上昇に転じました。作成期末にかけては、利回りはほぼ横ばいで推移し、-0.09%前後の水準で作成期末を迎えました。

ポートフォリオ 〈当ファンド〉

当ファンドは、主として欧州のハイイールド債に投資しユーロの為替リスクを米ドルの為替リスクに変換した投資信託証券「ストラクチャー欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行いました。当該投資信託証券への投資比率は高位を維持しました。なお、円建の国内籍投資信託「CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)」にも投資を行いました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈ストラクチャー欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)〉

当ファンドでは作成期を通じて、全般的な欧州ハイイールド債券へのエクスポージャーは中立程度を維持しました。クレジット・スプレッドが縮小する中、上昇余地が足元で限定的とみられる債券を削減しました。また、長期のBB格債へのエクスポージャーを削減し、より低格付のエクスポージャーをやや引き上げました。活況な新発債券市場に積極的に参加しました。セクター配分については、金融劣後債のオーバーウェイトが2020年11月から12月にプラスに働きました。2021年1月から3月にかけて、いくつかのハイブリッド債へのオーバー・エクスポージャーがマイナスに寄与しました。

(アムンディ・アセットマネジメント)

実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り/米ドル買いの為替取引を行い、当作成期を通じて米ドルのエクスポージャーをおおむね100%に維持しました。

(アムンディ・ジャパン株式会社)

〈CA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、以下のとおり分配を行いました。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82期	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期
	(2020年10月9日 ～2020年11月9日)	(2020年11月10日 ～2020年12月8日)	(2020年12月9日 ～2021年1月8日)	(2021年1月9日 ～2021年2月8日)	(2021年2月9日 ～2021年3月8日)	(2021年3月9日 ～2021年4月8日)
当期分配金	70	70	70	70	70	70
(対基準価額比率)	(1.364%)	(1.326%)	(1.341%)	(1.332%)	(1.321%)	(1.308%)
当期の収益	70	70	70	70	70	70
当期の収益以外	－	－	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	2,024	2,066	2,106	2,149	2,197	2,247

- ・「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「ストラクチャラー欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）」の組入比率を引き続き高位に保ちます。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。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

〈ストラクチャラー欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）〉

当ファンドは、利回りを求める動きやECB（欧州中央銀行）による買入れが市場を下支えするとみており、クレジット市場に関し前向きな姿勢を維持しています。クレジットのパフォーマンスは国債利回りのボラティリティ（価格変動性）の影響が大きくなっていますが、それを考慮しても依然として魅力度は高いと考えています。また、ハイブリッド債およびハイイールド債の上昇余地は大きいと考えています。したがって、当ファンドは、欧州ハイイールド債券市場に関しては、強気の見方を維持しています。

（アムンディ・アセットマネジメント）

今後もファンドの基本方針に従い、引き続き実質的なユーロ建資産に対し、ユーロ売り／米ドル買いの為替取引を継続いたします。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

〈CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）〉

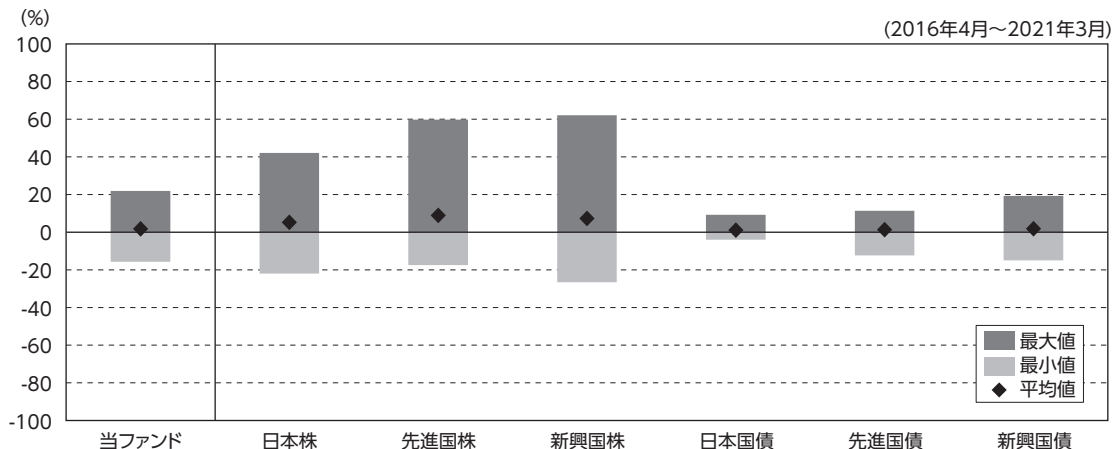
安全性重視の観点から、12ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

（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／海外／債券	
信託期間	2014年1月14日から2026年4月8日までです。	
運用方針	欧州のハイイールド債を主要投資対象とするユーロ売り／米ドル買いの為替取引を行う、「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。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・欧州ハイ・イールド債券ファンド(米ドルコース)	ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル) 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-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH5シェアクラス、米ドル)	欧州のハイイールド債
	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 欧州のハイイールド債を主要投資対象とするユーロ売り／米ドル買いの為替取引を行う、「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）」を主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。</p> <p>② 「ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド（IH5シェアクラス、米ドル）」への投資比率は、原則として投資信託財産の純資産総額の90%以上とすることを基本とします。</p>	
分配方針	毎決算時（年12回、原則毎月8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。	

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	1.8	5.2	8.9	7.3	1.1	1.3	1.9
最大値	21.9	42.1	59.8	62.1	9.3	11.4	19.3
最小値	-15.7	-22.0	-17.5	-26.6	-4.0	-12.3	-15.0

(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、2016年4月から2021年3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・ディバースィファイド (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

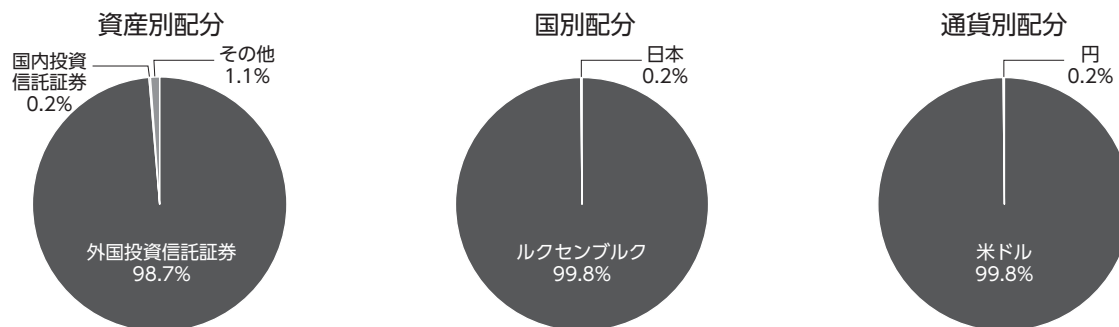
2021年4月8日現在
(組入銘柄数：2銘柄)

	銘柄	通貨	比率
1	ストラクチャル-欧州ハイ・イールド・ボンド (IH 5シェアクラス、米ドル)	米ドル	98.7%
2	CAマネープールファンド (適格機関投資家専用)	円	0.2%

(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



(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82期末 2020年11月9日	第83期末 2020年12月8日	第84期末 2021年1月8日	第85期末 2021年2月8日	第86期末 2021年3月8日	第87期末 2021年4月8日
純資産総額	13,182,354,894円	13,294,097,215円	12,964,507,602円	12,578,978,895円	12,385,100,611円	12,397,312,766円
受益権総口数	26,037,114,124口	25,527,098,049口	25,173,345,613口	24,253,751,350口	23,684,481,229口	23,481,801,081口
1万口当たり基準価額	5,063円	5,208円	5,150円	5,186円	5,229円	5,280円

※当作成期間 (第82期～第87期) 中における追加設定元本額は944,217,767円、同解約元本額は4,068,357,440円です。

組入ファンドの概要

<ストラクチュラ-欧州ハイ・イールド・ボンド>

決算日：2020年12月31日

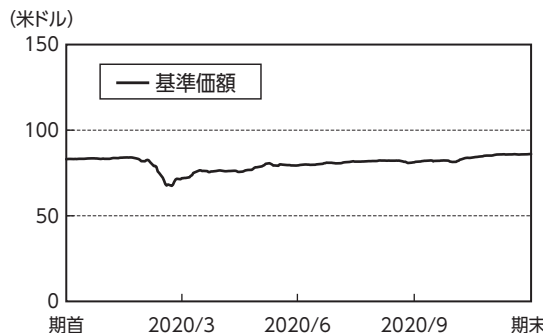
(計算期間：2020年1月1日～2020年12月31日)

「基準価額の推移」は（IH5シェアクラス、米ドル）の内容ですが、他の開示情報につきましては、他のシェアクラスを含むファンド全体の内容を掲載しております。

基準価額の推移（IH5シェアクラス、米ドル）組入上位10銘柄

2020年12月31日現在

(組入銘柄数：281銘柄)



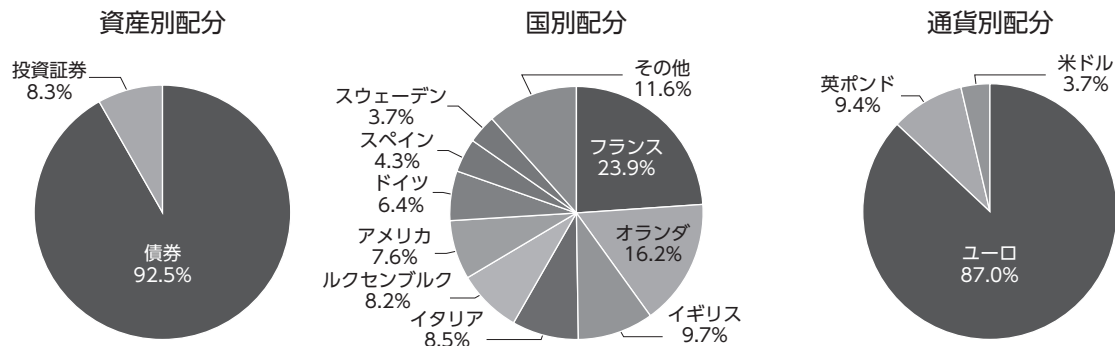
	銘柄	通貨	発行国	比率
1	AMUNDI TRESO CT C 3D -C- CAP 3 DEC	ユーロ	フランス	4.5%
2	AMUNDI 3 M I (C)	ユーロ	フランス	3.8%
3	FRANCE TREASURY BILL ZCP 060121	ユーロ	フランス	2.0%
4	TELEFONICA EURO FL.R 19-XX XX/XXA	ユーロ	オランダ	1.2%
5	FRANCE TREASURY BILL ZCP 130121	ユーロ	フランス	1.2%
6	ALTICE FRANCE HOLDING 8.0 19-27 15/05S	ユーロ	ルクセンブルク	0.9%
7	TELECOM ITALIA SPA 5.875 07-23 19/05A	英ポンド	イタリア	0.9%
8	NIDDA HEALTHCAR 3.50 17-24 30/09S	ユーロ	ドイツ	0.8%
9	GARFUNKELUX HOLDCO 3.75 20-25 01/11S	英ポンド	ルクセンブルク	0.7%
10	ELECTRICITE DE FL.R 20-XX XX/XXA	ユーロ	フランス	0.7%

(注) 基準価額は、収益分配金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。

(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



(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。

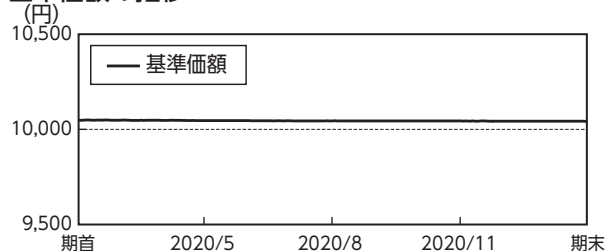
組入ファンドの概要

<CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)>

第14期 決算日：2021年2月15日

(計算期間：2020年2月18日～2021年2月15日)

基準価額の推移



組入銘柄

2021年2月15日現在

(組入銘柄数：3銘柄)

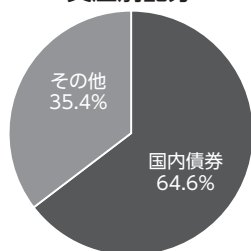
	銘柄	種別	比率
1	第348回大阪府公募公債(10年)	地方債	25.9%
2	平成28年度第2回札幌市公募公債(5年)	地方債	25.8%
3	第946回国庫短期証券	国債	12.9%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

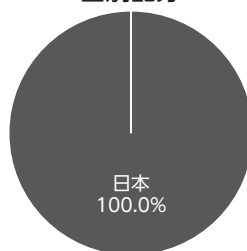
(注2) 銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されております。

種別構成

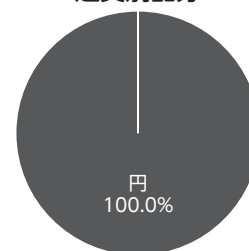
資産別配分



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14期 (2020年2月18日 ～2021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)	0.005 (0.005)	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	0.016	

期中の平均基準価額は10,044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、東京証券取引所第一部に上場している全銘柄を対象として算出した指数で、TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は東京証券取引所の知的財産であり、同指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は、東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有します。

• 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、野村證券株式会社が公表する、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野村證券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) 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・ディバースファイド (円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドとは、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