

日韓ロング・ショートファンド

追加型投信／内外／株式／特殊型（ロング・ショート型）

第3期 交付運用報告書

（決算日2017年8月7日）

作成対象期間（2017年2月7日～2017年8月7日）

第3期末(2017年8月7日)	
基準価額	10,045円
純資産総額	402百万円
第3期	
騰落率	0.2%
分配金(税込み)合計	300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と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り捨てて表示しております。

受益者のみなさまへ

毎々格別のお引き立てに預かり、厚く御礼申し上げます。

さて、今般「日韓ロング・ショートファンド」は、去る2017年8月7日に第3期の決算を行いました。

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として日本および韓国の株式等に実質的に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指します。

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。

ここに謹んで第3期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも、お引き立てのほど宜しくお願い申し上げます。

当ファンドは、約款において運用報告書（全体版）を電子交付することが定められております。運用報告書（全体版）は、下記の手順でご覧いただけます。なお、書面をご要望される場合は、販売会社までお問い合わせください。

【閲覧方法】

右記URLにアクセス⇒投資信託一覧⇒(各ファンドごとの)ファンドの特徴⇒運用報告書 を選択

日本アジア・アセット・マネジメント株式会社

東京都中央区日本橋小網町12-7

(お問い合わせ先)

お客様デスク Tel:03-6892-7150

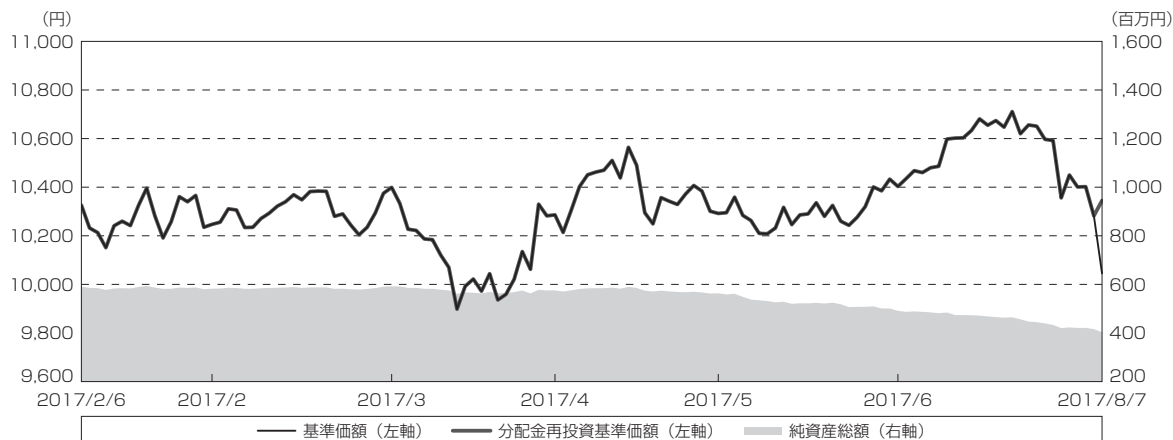
(営業日の9:00～17:00)

<http://www.ja-am.jp/>

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2017年2月7日～2017年8月7日)



期 首：10,326円

期 末：10,045円 (既払分配金(税込み):300円)

騰落率： 0.2% (分配金再投資ベース)

- (注) 当ファンドには、その運用手法の特徴から、運用成果の比較対象となる適切な指標がないため、ベンチマーク等はありません。
- (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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状態を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、2017年2月6日の値が基準価額と同一となるよう指数化しています。
- (注) 分配金再投資基準価額は、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。
- (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

当期の基準価額は上昇しました。

(プラス要因)

- ・ 政治的な不安の解消や米国株式市場の上昇を背景に、韓国株式市場が上昇基調で推移したこと

(マイナス要因)

- ・ 米国での政権運営の不透明感が台頭したこと等から日本株式市場が下落したこと
- ・ 米国長期金利の低下や地政学的リスクの高まりから円高が進行したこと

1万口当たりの費用明細

(2017年2月7日～2017年8月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	63 円	0.614 %	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(22)	(0.215)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(39)	(0.377)	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
（受託会社）	(2)	(0.022)	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	9	0.086	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 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（投資信託証券）	(9)	(0.086)	
(c) その他費用	71	0.690	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）	(-)	(-)	海外における保管銀行等に支払う有価証券の保管および資金の送金・資産の移転に係る費用
（監査費用）	(10)	(0.100)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（印刷費用）	(16)	(0.152)	目論見書・運用報告書作成、印刷および交付に係る費用
（その他）	(45)	(0.437)	計理業務費用、届出書類作成等費用、公告費用、法律顧問および 税務顧問費用、その他費用・手数料等
合 計	143	1.390	
期中の平均基準価額は、10,330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」には、信託財産に関する租税、信託事務の処理に係る諸費用（受益証券等の管理事務、印刷費用、公告費用、監査費用、法律顧問・税務顧問への報酬費用等）、それらに付随する消費税等相当額などを含みます。

(注) 各項目の費用は、当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。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「組入ファンドの概要」に表示しております。

(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を乗じたものです。

(注) (－) は該当がないことを示します。

最近5年間の基準価額等の推移

(2012年8月6日～2017年8月7日)



(注) 分配金再投資基準価額は、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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状態を示すものではありません。

(注) 当ファンドの設定日は2016年5月16日です。

	2016年5月16日 設定日	2016年8月5日 決算日	2017年8月7日 決算日
基準価額 (円)	10,000	9,829	10,045
期間分配金合計(税込み) (円)	—	0	500
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△1.7	7.3
純資産総額 (百万円)	6	510	402

(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り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ます。

(注) 当ファンドには、その運用方法の特徴から、運用成果の比較対象となる適切な指標がないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 「—」は該当がないことを示します。

投資環境

(2017年2月7日～2017年8月7日)

※日韓ロング・ショートファンドはKB資産運用株式会社が運用する「KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメント トラスト」を組み入れているため、投資環境、今後の運用方針等については、同社からの情報も参考に作成しています。

【日本】

当期の日本株式市場は上昇しました。

期の前半は、米国での利上げペースが速まるとの見方が後退したことや政権運営の不透明感等から円高が進行したことに加え、北朝鮮情勢に対する警戒感等から2017年3月中旬から4月中旬にかけて大きく下落しました。期の後半は、フランス大統領選挙で中道派のマクロン候補が勝利し、欧州情勢の不透明感が後退し円安が進行したことから上昇に転じ、その後は、国内外の堅調な経済指標や米株高等を背景に堅調に推移しました。

【韓国】

当期の韓国株式市場は上昇しました。

期の前半は、韓国朴大統領の罷免が決定し政治的な不安が解消されたことや主力企業の決算が好感されたこと等から堅調に推移しました。期の後半は、2017年5月に良好な経済指標や韓国大統領選挙を控え景気刺激策への期待感から大幅に上昇した後は、米国株式市場の上昇等を背景に連日最高値を更新する展開となりました。

為替は対円で下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

(2017年2月7日～2017年8月7日)

○当ファンド

当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。「KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメント トラスト」を主要投資対象とし、同ファンドの高位組入れを維持して運用を行いました。期末時点での当ファンドにおける「KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメント トラスト」の組入比率は90.5%、「ユナイテッド日本債券ベビーファンド（適格機関投資家向け）」の組入比率は2.4%となりました。

いずれのファンドともマザーファンド受益証券を組入れ、当該マザーファンドで実質的な運用を行っております。従って、以下の投資行動等はマザーファンドにおけるものとして説明しています。

○KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメント トラスト^(注)

- ・マザーファンドへの投資を通じて、日本および韓国の株式等の買建て（ロング）と売建て（ショート）を機動的に行い、市場の変動リスクを管理しながら運用を行いました。
- ・韓国株式市場全体が上昇する中、ショートポジションで保有する銘柄も上昇したことや、通信、公益関連銘柄に予想外の規制が設けられたこと等がマイナスに影響したものの、圧倒的な技術力を背景とする半導体関連銘柄、中国の景気回復に支えられた機械関連銘柄等の株価上昇がプラスに寄与しました。

(注) KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ マスター インベストメント トラストを主要投資対象としています。

○ユニテッド日本債券ベビーファンド（適格機関投資家向け）^(注)

- ・期を通してマザーファンド受益証券を高位に組み入れました。
- ・マザーファンドの債券組入比率は、設定・解約時を除いて高位で推移させました。
- ・マザーファンドでは公社債を中心に、期中4銘柄前後でポートフォリオを構築しました。

(注) ユニテッド日本債券マザーファンドを主要投資対象としています。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2017年2月7日～2017年8月7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。運用手法の特徴から、運用成果の比較対象となる適切な指標がないため、ベンチマーク等はありません。

分配金

(2017年2月7日～2017年8月7日)

第3期の1万口当たり分配金（税込み）は、300円といたしました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

○分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり、税込み)

項 目	第3期
	2017年2月7日～ 2017年8月7日
当期分配金 (対基準価額比率)	300 2.900%
当期の収益	22
当期の収益以外	277
翌期繰越分配対象額	126

(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り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

今後、米国の斬新的な減税や投資政策、中国共産党大会での指導部再編による投資拡大等、世界的な景気回復の勢いが実体経済の改善に繋がることが期待されます。一方で、原油価格や為替相場の乱高下等、景気回復に関する不確実性は継続しており、世界的な商品価格の上昇の勢いの持続とバリュエーションリスクが混在している状況です。堅調なファンダメンタルズではありますが、商品価格、為替レート、国債金利等のマクロ変数の動きを注視しつつ、マクロ環境の変化に比較的敏感に反応し良好な業績見通しを期待できる業種や銘柄を中心に投資を行う方針です。

今後の世界的な景気回復の恩恵の享受が期待されるITや景気循環等の輸出株、金利引き上げ基調の中、実績改善が予想される金融株、斬新的な消費回復の恩恵の享受が期待される内需関連株等に着目しています。一方、不確実性が高まっている状況では全体的なネットエクスポージャーを安定的に維持し、ショートポジションを弾力的に調整する予定です。

引き続き、企業の内在価値に着目した徹底的なリサーチに基づき、投資機会を積極的に探していきたいと考えます。同時に不確実性が高い現在の状況では、株式市場の変動性が小さくなるまで徹底したリスク管理を行わなければならないと判断します。

ファンドは、引き続き、「KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメント トラスト」の高位組入れを維持しながら、信託財産の中長期的な成長を目指します。

お知らせ

約款変更について

2017年2月7日から2017年8月7日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

運用体制の変更について

2017年2月7日から2017年8月7日までの期間に実施いたしました運用体制の変更はございません。

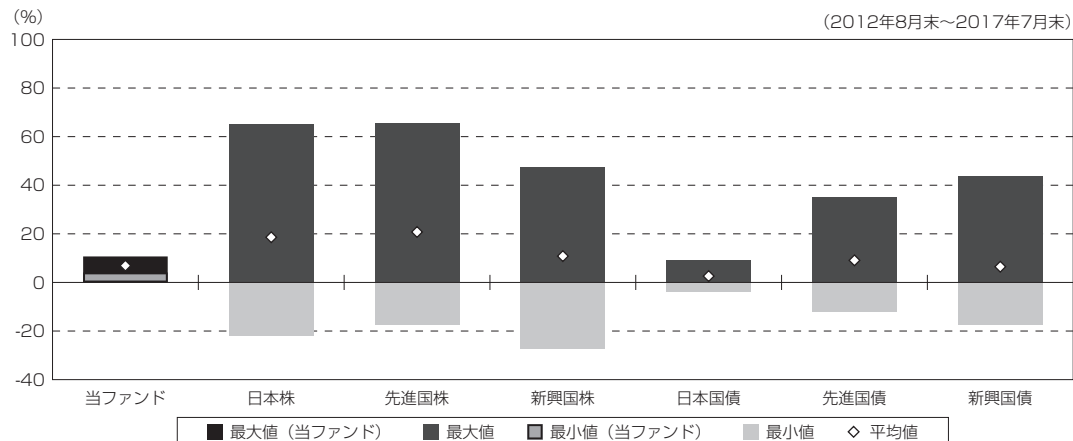
当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／株式／特殊型（ロング・ショート型）	
信託期間	2016年5月16日から2026年5月30日まで	
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として日本および韓国の株式等に実質的に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指します。	
主要投資対象	下記の投資信託証券を投資対象とします。	
	KB コリアアンドジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメントトラスト	KB資産運用株式会社が運用する韓国籍外国投資信託（韓国ウォン建て）
組入投資 信託証券の 運用方法	ユナイテッド日本債券 ベビーファンド (適格機関投資家向け)	日本アジア・アセット・マネジメント株式会社が運用する追加型証券投資信託
	KB コリアアンドジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメントトラスト	・マザーファンド「KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ マスター インベストメント トラスト」への投資を通じて、日本および韓国の株式等の買建て（ロング）と売建て（ショート）を機動的に行い、株式市場の変動リスクを管理しながら、信託財産の中長期的な成長を目指します。
分配方針	ユナイテッド日本債券 ベビーファンド (適格機関投資家向け)	・ユナイテッド日本債券マザーファンドを通じて、実質的にわが国の公社債に投資を行います。 ・マザーファンドはNOMURA-BPI総合を上回る運用成果を目指します。
	<ul style="list-style-type: none"> ・毎年2月5日および8月5日（休業日の場合は翌営業日）の決算時に分配を行います。 ・分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・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・市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないこともあります。 ・収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づき運用を行います。 	

当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。ファンド・オブ・ファンズ方式とは、ファンドの信託財産を主に他のファンドに投資する仕組みで、一般社団法人投資信託協会の定める商品分類において、「主として投資信託証券に投資するもの」をいいます。

(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	10.7	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	4.1	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	6.9	18.6	20.8	10.8	2.6	9.1	6.5

(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) 2012年8月末から2017年7月末の5年間における1年騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。なお、当ファンドにつきましては、2017年5月以降の年間騰落率を用いています。

(注) 上記の騰落率は直近月末から60ヵ月遡った算出結果であり、当ファンドの決算日に対応した数値とは異なります。

(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：シティ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・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、最終ページの「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

(2017年8月7日現在)

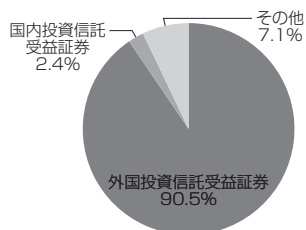
○組入ファンド

ファンド名	第3期末 %
KB コリアンドジャパンロングアンドショートセキュリティーズインベスメントトラスト	90.5
ユナイテッド日本債券ベビーファンド（適格機関投資家向け）	2.4
その他	7.1
組入ファンド数	2ファンド

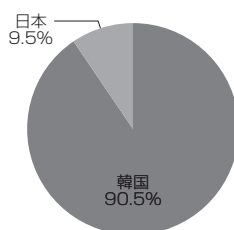
(注) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 組入比率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。

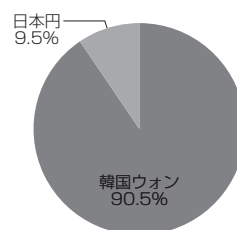
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 比率は当ファンドの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) 各数値を四捨五入しているため、合計値が100%にならないことがあります。

純資産等

項目	第3期末
	2017年8月7日
純資産総額	402,827,876円
受益権総口数	401,013,727口
1万口当たり基準価額	10,045円

* 期中における追加設定元本額は21,122,783円、同解約元本額は192,383,824円です。

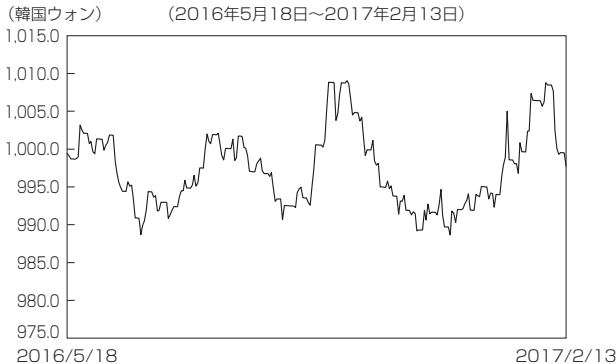
組入ファンドの概要

KB コリア アンド ジャパン ロング アンド ショート セキュリティーズ インベストメント トラスト

※当ファンドは複数のシェアクラスから構成されております。基準価額の推移を除いて以下の内容は全てのシェアクラスを合算したものです。

※KB資産運用株式会社の資料を基に、日本アジア・アセット・マネジメント株式会社が作成しています。

【基準価額の推移】



(注) 現地基準日ベース

【費用明細】

(2016年5月18日～2017年2月13日)
(単位：韓国ウォン)

	期 末
	2017年2月13日
運 用 手 数 料	192,499,412
販 売 手 数 料	92,886,614
受 託 手 数 料	12,373,634
事 務 受 託 手 数 料	4,123,450
そ の 他 費 用	665,690
費用合計	302,548,800

(注) 費用明細は1万口当たりの情報の入手が困難であるため、当外国投資信託証券全体の金額を表示しています。

【現物資産上位10銘柄】

ロングポジション

	銘柄名	資産	比率
			%
1	Korea Monetary Stabilization Bond	債券	48.9
2	Samsung Electronics Co.,Ltd.	株式	9.9
3	NCSOFT Corporation	株式	3.3
4	LG Chem Ltd.	株式	2.2
5	NAVER Corporation	株式	2.0
6	KB Financial Group Inc.	株式	1.8
7	KIM KINDEX SYNTH-Japan Inverse ETF H - Equity-Derivatives	ETF	1.5
8	LG Hausys Ltd.	株式	1.3
9	Samsung KODEX Gold Futures Special Asset ETF	ETF	1.2
10	Lotte Chemical Corporation	株式	1.1
組入銘柄数		28銘柄	

※KB Financial Groupは、KB資産運用株式会社の関係会社です。

ロング	ショート	ネット
87.9%	16.1%	71.7%

【派生商品】

銘柄名	買建て	売建て
金融デリバティブ商品	0.1%	16.4%

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

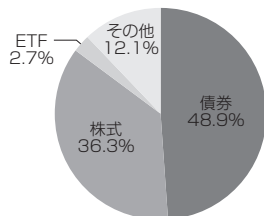
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

ショートポジション

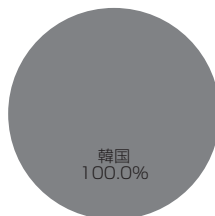
(2017年2月13日現在)

	銘柄名	資産	比率
			%
1	Kia Motors Corporation	株式	2.7
2	BGF retail Co.,Ltd.	株式	2.0
3	POSCO DAEWOO Corp.	株式	1.8
4	LG Uplus Corp.	株式	1.4
5	Hana Financial Group Inc.	株式	1.0
6	Doosan Bobcat Inc.	株式	0.8
7	POSCO	株式	0.7
8	Lotte Shopping Co.,Ltd.	株式	0.6
9	Hyundai Marine & Fire Insurance Co.,Ltd.	株式	0.6
10	Kangwon Land, Inc.	株式	0.5
組入銘柄数		19銘柄	

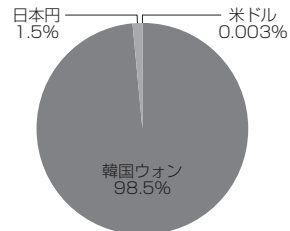
【資産別配分】



【国別配分】



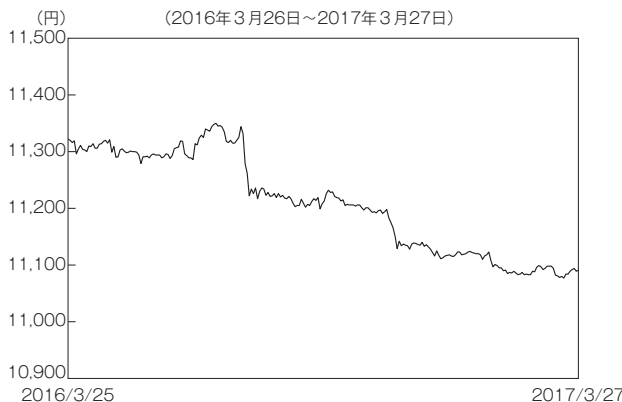
【通貨別配分】



- (注) 資産別配分・通貨別配分の比率は純資産総額に対する割合です。
- (注) 国別配分の比率は現物資産における有価証券部分に対する評価額の割合です。
- (注) 各数値を四捨五入しているため、合計値が100%にならないことがあります。

ユナイテッド日本債券ベビーファンド（適格機関投資家向け）

【基準価額の推移】



【1万口当たりの費用明細】

(2016年3月26日～2017年3月27日)

項目	当期金額
信託報酬 (会社)	24円
(販売会社)	(12)
(受託会社)	(2)
(受託会社)	(10)
その他の費用	148
(保管費用)	(-)
(監査費用)	(21)
(印刷費用)	(15)
(その他)	(113)
合計	172

期中の平均基準価額は、11,214円です。

(注) 項目等詳細につきましては運用報告書（全体版）に記載しております。

【組入上位10銘柄】

(2017年3月27日現在)

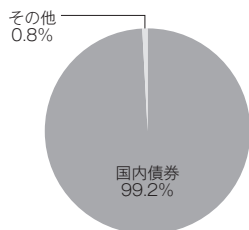
	銘柄名	業種／種別等	通貨	国（地域）	比率
1	第319回利付国債（10年）	国債証券	日本円	日本	48.4
2	第87回利付国債（20年）	国債証券	日本円	日本	27.3
3	第293回利付国債（10年）	国債証券	日本円	日本	23.4
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—
	組入銘柄数		3銘柄		

(注) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

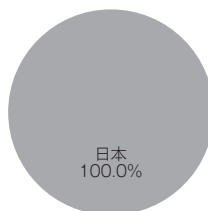
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

(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。

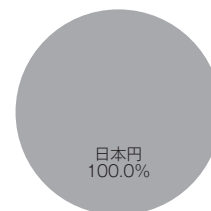
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 組入上位10銘柄、資産別・国別・通貨別のデータは、「ユナイテッド日本債券マザーファンド」の決算日（2017年3月27日）現在のもので、当該ファンドが投資対象とするマザーファンドの内容を記載しています。（比率は純資産総額に対する評価額の割合）

(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国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。

<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、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄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、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

○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、野村証券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、野村証券株式会社に帰属します。

○シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース) は、Citigroup Index LLCが開発した、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、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

○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・ディバースファイド (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・ディバースファイド (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・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。