



ALLIANCEBERNSTEIN®

交付運用報告書

# アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・ファンド

## 愛称 ボンド・ストーリー

追加型投信／内外／債券

第22期 (決算日2024年5月1日)

作成対象期間 (2023年5月2日～2024年5月1日)

第22期末 (2024年5月1日)	
基準価額	19,316円
純資産総額	1,389百万円
第22期	
騰落率	9.6%
分配金 (税込み) 合計	0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、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・ファンド」は、このたび第22期の決算を行いました。

当ファンドは、マザーファンドを通じて世界各国の投資適格債に投資し、相対的投資価値分析を基本としたアクティブ運用を行います。当期もこれに沿った運用を行ってまいりました。

ここに、当期の運用状況を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、お願い申し上げます。

## アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011 東京都千代田区内幸町二丁目1番6号 日比谷パークフロント

お問合せ先 **お客様窓口**電話番号 **03-5962-9687** (受付時間：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.alliancebernstein.co.jp>

○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。

○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。書面での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。

○当ファンドは、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。運用報告書(全体版)は、アライアンス・バーンスタイン株式会社のホームページにて閲覧・ダウンロードいただけます。

### <「運用報告書(全体版)」の閲覧・ダウンロード方法>

上記ホームページアドレスにアクセス → 「国内投資信託 基準価額一覧」を選択 → 「基準価額一覧」を選択 → 表内の当ファンド名を選択 → 「運用報告書(全体版)」のリンクを選択

## 運用経過

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・ファンド(以下「当ファンド」ということがあります。)の運用状況をご報告いたします。

### 期中の基準価額等の推移

(2023年5月2日～2024年5月1日)



期首：17,628円

期末：19,316円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 9.6% (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。  
 (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、お客様の損益の状況を示すものではありません。  
 (注) 上記騰落率は、小数第2位を四捨五入して表示しております。  
 (注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2023年5月1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) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(円ベース)です。詳細はP4をご参照ください。

### ○基準価額等の推移

基準価額(分配金(税込み)再投資)は前期末比で上昇しました。ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(円ベース)との比較では、同インデックスを下回るパフォーマンスとなりました。

### ○基準価額の変動要因

#### 上昇要因

- ・保有債券のクーポン収入
- ・保有しているユーロ圏のカバードボンドや米国投資適格社債の価格上昇
- ・円安米ドル高、円安ユーロ高

下落要因

・保有している米国や日本の国債の価格下落

1万口当たりの費用明細

(2023年5月2日～2024年5月1日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	236	1.287	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(109)	(0.594)	委託した資金の運用、基準価額の算出、法定書類作成等の対価
( 販 売 会 社 )	(117)	(0.638)	購入後の情報提供、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および事務手続き等の対価
( 受 託 会 社 )	( 10)	(0.055)	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	4	0.021	(b) 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 )	( 1)	(0.007)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
( 監 査 費 用 )	( 2)	(0.013)	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
( そ の 他 )	( 0)	(0.001)	その他は、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	240	1.308	
期中の平均基準価額は、18,312円です。			

(注) 期中の費用（消費税等の課されるものは消費税等相当額を含めて表示）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) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

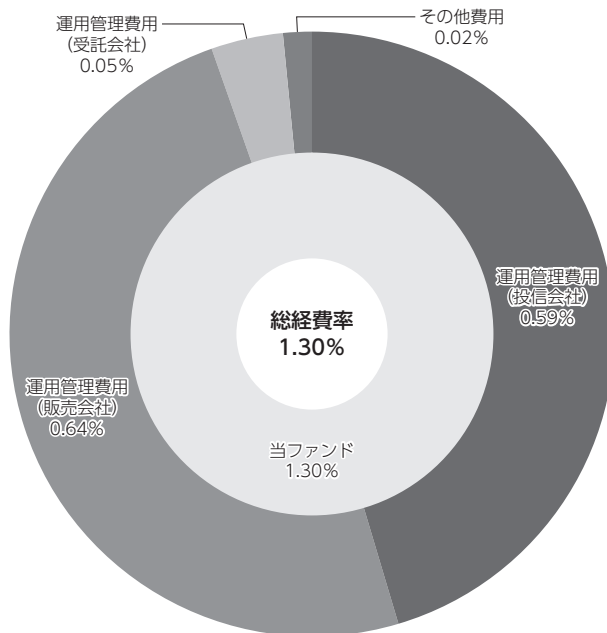
(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.30%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。

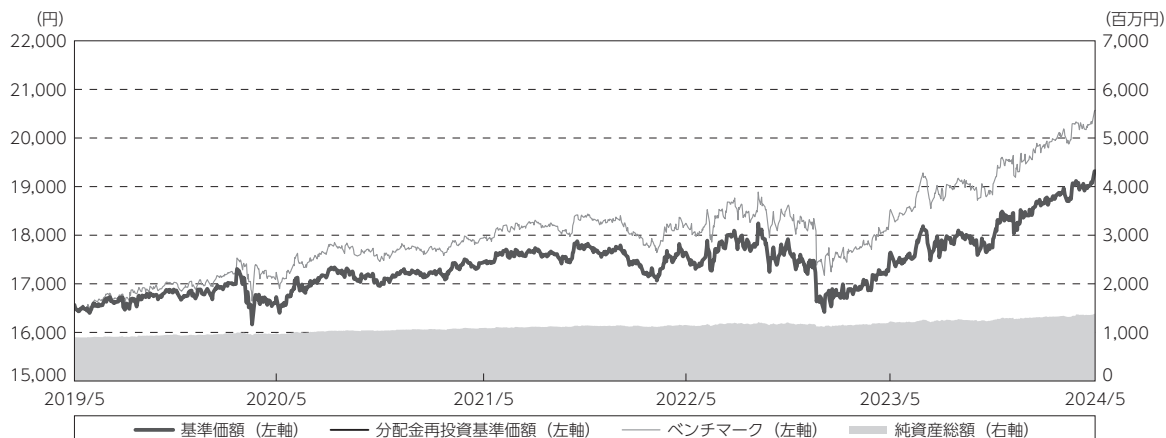
(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(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

(2019年5月7日～2024年5月1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、お客様の損益の状況を示すものではありません。  
 (注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、2019年5月7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。

	2019年5月7日 決算日	2020年5月1日 決算日	2021年5月6日 決算日	2022年5月2日 決算日	2023年5月1日 決算日	2024年5月1日 決算日
基準価額 (円)	16,567	16,728	17,440	17,642	17,628	19,316
期間分配金合計(税込み) (円)	—	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	1.0	4.3	1.2	△ 0.1	9.6
ベンチマーク騰落率 (%)	—	4.0	4.1	1.7	1.4	11.2
純資産総額 (百万円)	898	979	1,091	1,152	1,224	1,389

- (注) 上記騰落率は、小数第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。  
 (注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(円ベース)です。

### ●ベンチマークに関して

#### ○FTSE世界国債インデックス(円ベース)

FTSE世界国債インデックス(円ベース)は、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。当資料で使用している指数等に係る著作権等の知的財産権、その他一切の権利は、当該指数等の開発元または公表元に帰属します。

## 投資環境

(2023年5月2日～2024年5月1日)

### 【世界の債券市場】

当期は、米国国債、ドイツ国債、日本国債ともに、金利は、前期末比で上昇(価格は下落)しました。

米国国債金利は、期初から2023年10月にかけては、堅調な経済や米連邦準備理事会(FRB)のタカ派姿勢を背景に上昇基調で推移しました。その後12月にかけては、早期利下げ観測から金利は低下(価格は上昇)しました。期末にかけては、利下げ開始時期の先送り観測から金利は上昇しました。

ドイツ国債金利は、おおむね米国国債金利の動きに連動しましたが、上昇幅は小幅に留まりました。

日本国債金利は、2023年7月下旬の日本銀行(日銀)の長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)の修正発表を受けて10月末にかけて上昇しました。11月以降期末にかけては、米国の金利動向に連動した推移となりました。

### 【為替市場】

前期末比で、円安米ドル高、円安ユーロ高となりました。

米ドル円は、期初から2023年11月上旬にかけては、米国の政策金利見通しの引き上げや日銀の緩和政策の維持を背景に、円安米ドル高が進みました。その後2024年1月初めにかけては、米国国債金利の低下や、日銀のマイナス金利解除観測が高まったことを背景に、円高米ドル安が進行しました。期末にかけては、米国の早期利下げ観測の後退から再び円安米ドル高基調となりました。

ユーロ円は、米ドル円同様、日欧の金利差を背景に円安ユーロ高基調で推移しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

(2023年5月2日～2024年5月1日)

### 【当ファンド】

当ファンドはアライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド(以下「マザーファンド」といことがあります。)受益証券への投資を通じて、主として世界各国の投資適格格付の公社債へ投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的としています。当ファンドは実質外貨建資産について、原則として為替ヘッジは行いません。

当ファンドは期を通じてほぼ全額をマザーファンド受益証券に投資しました。

### 【マザーファンド】

マザーファンドでは、ファンダメンタル分析と計量分析を融合した運用判断に基づき、世界各国の国債や投資適格社債の中から相対的に高い収益が期待される国、債券セクターや銘柄に対して機動的に資産配分を行いました。

結果として、米国国債など先進主要国の国債を中心に投資を行いました。加えて国債との利回り格差(スプレッド)があり投資妙味が高い社債や政府機関債などへも投資を行いました。国別では、アメリカやカナダ、オーストリアの組入比率が上昇した一方、日本の組入比率が低下しました。

### <マザーファンドの国別組入比率>

前期末 (2023年5月1日現在)

発行国	組入比率
アメリカ	36.9%
日本	16.1%
イギリス	7.0%
イタリア	5.0%
カナダ	4.0%
その他の国	29.2%
現金等	1.8%



当期末 (2024年5月1日現在)

発行国	組入比率
アメリカ	39.2%
カナダ	7.4%
イギリス	7.2%
日本	6.4%
オーストリア	6.3%
その他の国	31.9%
現金等	1.7%

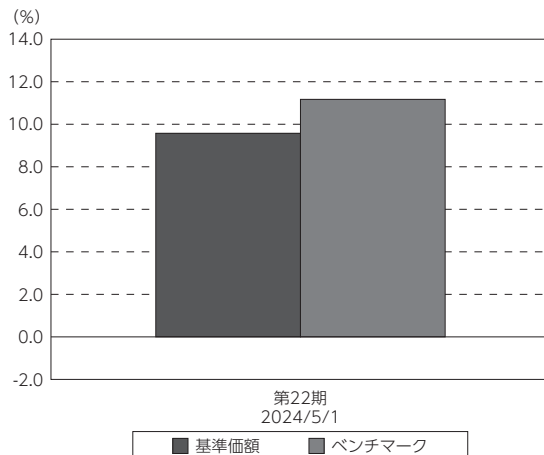
(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合 (小数第2位を四捨五入)。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年5月2日～2024年5月1日)

ベンチマークとの比較では、マザーファンドにおいて、中国を低めとした国別配分が主なマイナス要因となりました。一方、ユーロ圏の国債の銘柄選択や、カナダやユーロ圏の国債のイールドカーブ戦略が主なプラス要因となりました。

基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。  
 (注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（円ベース）です。詳細はP4をご参照ください。

## 分配金

(2023年5月2日～2024年5月1日)

当期の収益分配については、信託財産の成長を目指す観点から、見送ることとしました。なお、収益分配に充てなかった利益については、信託財産内に留保し「運用の基本方針」に基づいて運用を行います。

### ○分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり、税込み)

項目	第22期
	2023年5月2日～ 2024年5月1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	9,624

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の当期末基準価額（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。

(注) 上記表は、経費控除後の数値です。



## 今後の運用方針

### 【当ファンド】

引き続き、マザーファンド受益証券にほぼ全額投資する方針です。

### 【マザーファンド】

世界経済は、予想以上に堅調に推移しており、プラス成長が続くと予想しています。一方、落ち着きを見せ始めていたインフレは、実体経済の底堅さや地政学リスクによるコモディティ価格の上昇などから高位で推移しており、各国中央銀行も利下げを視野に入れているものの、慎重な対応をとる可能性もあります。また、これまでの利上げの影響や金融機関への規制強化から与信市場がタイト化する可能性、弱含みの中国経済、地政学リスクなどを背景に景気後退に陥る状況にならないか注視が必要です。

米国経済は、プラス成長となるものの、与信市場のタイト化が浸透し、需要においても力強さに欠け、潜在成長率を下回る低成長が続くと予想します。ただし、家計のバランスシートが比較的健全なためハードランディングになるとは予想していません。

欧州経済は、インフレ圧力は低下しているものの、停滞が続いています。2024年は昨年からやや回復し小幅ながらプラス成長を予想していますが、地政学リスクなどにより下振れが生じる可能性があります。

日本経済は、2024年はプラス成長を予想しています。ただし、地政学リスクの高まりによるマイナスの影響を受ける可能性もあります。

引き続き、ファンダメンタル分析および計量分析に基づいて、世界各国の投資適格債を組み入れる方針です。

※将来の市場環境の変動等により、当該運用方針が変更される場合があります。

## お知らせ

2023年5月2日以降において、当ファンドの信託約款について、以下に掲げる事項を内容とする変更を行いました。

受益者に対して行う公告の方法を電子公告に変更したため、所要の変更を行いました。

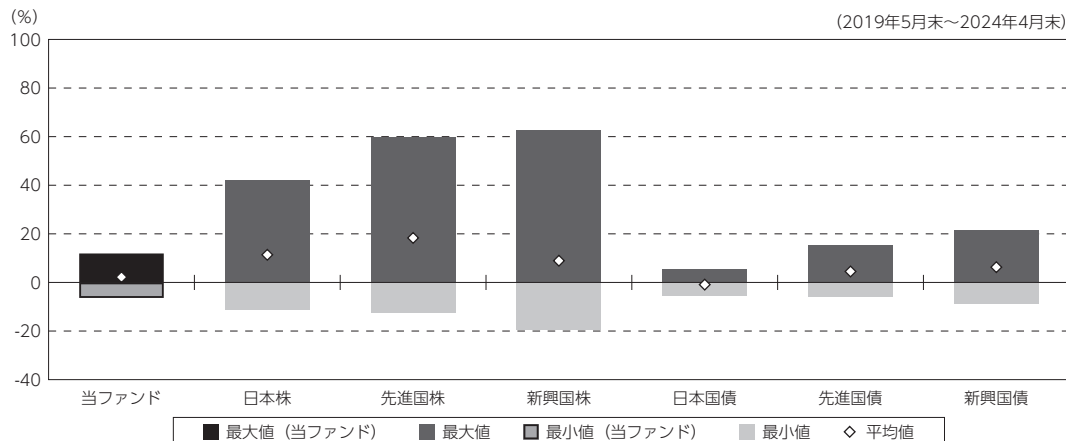
(変更日：2024年3月1日)

## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	無期限。ただし、信託約款所定の事由が生じたときは、信託契約を解約し、信託を終了（償還）させることがあります。	
運用方針	世界各国の投資適格格付けの公社債を主な投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。	
主要投資対象	アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・ファンド	アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド	世界各国の投資適格格付けの公社債（以下、「投資適格債」といいます）を主な投資対象とします。原則として、取得時に格付機関により投資適格格付け（BBB格以上）を得ている公社債としますが、格付けを得ていない場合でも、委託者が投資適格債に相当すると判断した場合は投資を行う場合もあります。
運用方法	<ol style="list-style-type: none"> <li>①マザーファンドを通じて、世界各国の投資適格債に投資します。</li> <li>②調査チームによる相対的投資価値分析を基本としたアクティブ運用を行います。</li> <li>③運用は、アライアンス・バーンスタイン・エル・ピーに委託します。</li> <li>④実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</li> <li>⑤ファミリーファンド方式で運用を行います。</li> </ol>	
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>①分配対象額は、経費控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</li> <li>②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、分配を行わない場合もあります。</li> <li>③留保益の運用については、特に制限を設けず、「基本方針」および「運用方法」に基づき元本と同一の運用を行います。</li> </ol>	

(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	11.9	42.1	59.8	62.7	5.4	15.3	21.5
最小値	△ 6.4	△ 11.4	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値	2.2	11.4	18.3	8.9	△ 0.9	4.5	6.3

(注) 上記グラフは、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、2019年5月～2024年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を表示し、定量的に比較できるように作成したものです。なお、すべ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) 当ファンドの年間騰落率は分配金再投資基準価額に基づき計算した騰落率ですので、実際の基準価額に基づき計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

《各資産クラスの指数》

- 日本株…… TOPIX (東証株価指数、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…… 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・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・ダイバーシファイド (円ベース)

※各指数についての説明は、P14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

(2024年5月1日現在)

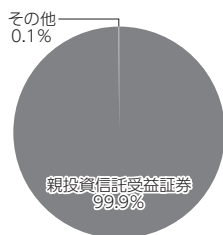
#### ○組入ファンド

銘 柄 名	第22期末
	%
アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド	99.9
組入銘柄数	1銘柄

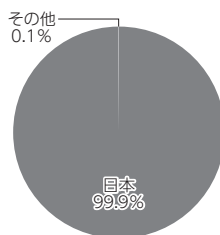
(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

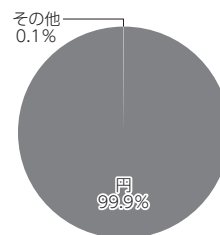
#### ○資産別配分



#### ○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を表示しております。

### 純資産等

項 目	第22期末
	2024年5月1日
純 資 産 総 額	1,389,575,843円
受 益 権 総 口 数	719,382,863口
1万口当たり基準価額	19,316円

(注) 期中における追加設定元本額は125,105,567円、同一部解約元本額は100,320,154円です。

組入ファンドの概要

アライアンス・バーンスタイン・グローバル・ボンド・マザーファンド

当マザーファンドの当計算期間の運用経過等については、「運用報告書（全体版）」をご覧ください。運用報告書（全体版）の入手方法は、表紙ページの一番下の段に記載しております。

【基準価額の推移】



【1万円当たりの費用明細】

(2023年5月2日～2024年5月1日)

項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用 ( 保管費用 ) ( その他 )	円 2 (2) (0)	% 0.008 (0.007) (0.001)
合計	2	0.008

期中の平均基準価額は、24,019円です。

- (注) 上記項目の概要につきましては、運用報告書（全体版）をご参照ください。
- (注) 期中の費用（消費税等の課されるものは消費税相当額を含めて表示）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) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。
- (注) 各比率は、1万円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。

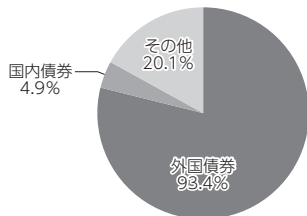
【組入上位10銘柄】

(2024年5月1日現在)

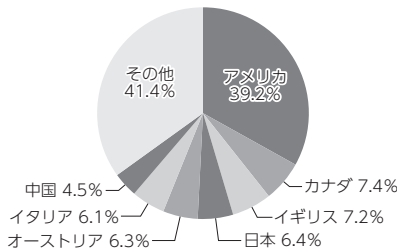
銘柄名	業種 / 種別等	通貨	国（地域）	比率
1 US TREASURY 3.5% 2028/4/30	国債証券	米ドル	アメリカ	7.1%
2 US TREASURY 2.125% 2026/5/31	国債証券	米ドル	アメリカ	4.9%
3 CHINA GOVERNMENT 2.55% 2028/10/15	国債証券	中国元	中国	4.5%
4 US TREASURY 4% 2029/1/31	国債証券	米ドル	アメリカ	4.4%
5 US TREASURY 1.25% 2028/3/31	国債証券	米ドル	アメリカ	4.2%
6 REPUBLIC OF AUSTRIA 0.9% 2032/2/20	国債証券	ユーロ	オーストリア	4.0%
7 CANADIAN GOVERNMENT 3.5% 2028/3/1	国債証券	カナダドル	カナダ	3.7%
8 UK TREASURY 4.625% 2034/1/31	国債証券	英ポンド	イギリス	3.3%
9 BUONI POLIENNALI DEL TES 4% 2031/10/30	国債証券	ユーロ	イタリア	3.0%
10 US TREASURY 1.5% 2028/11/30	国債証券	米ドル	アメリカ	2.3%
組入銘柄数		129銘柄		

- (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。
- (注) 国（地域）につきましては発行国を表示しております。

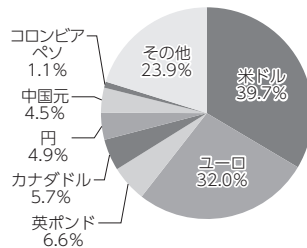
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



- (注) 比率は当マザー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を表示しております。

【直物為替先渡取引残高】

(2024年5月1日現在)

銘柄別	取引契約残高			
	当期末想定元本額			
	買 建		売 建	
	外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額
米ドル	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
(チリペソ)	4,395	694	4,390	693
(コロンビアペソ)	5,798	915	7,653	1,208
(インドネシアルピア)	4,344	686	3,321	524
(インドルピー)	4,514	713	2,998	473
(韓国ウォン)	1,492	235	1,480	233
(マレーシアリングgit)	1,353	213	—	—
(ペルーソル)	2,920	461	5,522	872
(新台湾ドル)	4,376	691	4,363	689

## <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>

### ○TOPIX（東証株価指数、配当込み）

TOPIX（東証株価指数、配当込み）は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社が算出し公表する、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、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株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

### ○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。

### ○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）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指数です。なお、FTSE 世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、FTSE Fixed Income 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・ダイバーシファイド(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・ダイバーシファイド (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・ダイバーシ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。