

# 農林中金<パートナーズ>日米6資産分散ファンド（安定運用コース） [愛称：コア6エバー]の運用状況について



2022年10月作成（2022年9月末時点）

ファンド情報提供資料

2022年に入り、コア6エバーの基準価額は下落傾向となり、足もとでは10,000円を下回り推移しています。（9月末時点：9,792円）組入比率4割を占める米国債券が米国の利上げを受けて長期金利が上昇する等を背景に下落したことが主な要因です。

## コア6エバーの分配金再投資基準価額（2022年以降）



期間：2021年12月末～2022年9月末 上記のグラフやデータは過去のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

・分配金再投資ベースは分配金（課税前）を再投資したものと計算しており、分配金があった場合は実際の基準価額とは異なります。また、実際のファンドにおいては、課税の条件によってお客様ごとに値は異なります。

### 2022年以降のコア6エバー

#### 寄与度内訳



### 直近6か月のコア6エバー

#### 寄与度内訳



### 直近3か月のコア6エバー

#### 寄与度内訳



上記のグラフやデータは過去のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

出所：Bloombergより作成 期間：2021年12月末～2022年9月末

2021年12月末を10,000として指数化し算出。日本株式：日経平均株価（配当込み）、日本債券：NOMURA-BPI（総合）、日本REIT：東証REIT指数（配当込み）、米国株式：S&P500指数（円ヘッジ・配当込み）、米国債券：FTSE米国債券インデックス（円ヘッジ）、S&P US-REIT指数（円ヘッジ・配当込み） 寄与度は各インデックスをコア6エバーの基本配分比率で試算したものであり、実際のマザーファンドの寄与度とは異なります。

運用管理費用（信託報酬）… 投信を保有している期間に間接的に負担する運用にかかる費用です。

■ 10ページの「主なりリスクと費用」および「留意事項」を必ずお読み下さい。

2022年10月作成（2022年9月末時点）

ファンド情報提供資料

2000年以降の大きな株価下落時でのコア6エバーのシミュレーションでは、日米の株式とREITが下落する一方、米国債券や日本債券はプラスとなっており、資産分散の効果により下落幅を抑制していました。しかし、今回の米国の利上げに伴う下落局面では米国債券は大きく下落。日本債券も下落しており資産分散効果が効かない状況となっています。

### 過去の下落局面での日米6資産の値動き



### 過去の下落局面でのコア6エバーシミュレーションおよび組入資産の寄与度



出所：Bloombergより作成 期間：2003年3月末～2022年9月末  
 コア6エバーのシミュレーションは日米6資産をコア6エバーの基本配分比率で加重平均したリターンより信託報酬+消費税を控除して試算。2018年3月末以降は分配金再投資基準価額より試算。  
 日本株式：日経平均株価（配当込み）、日本債券：NOMURA-BPI（総合）、日本REIT：東証REIT指数（配当込み）、米国株式：S&P500指数（円ヘッジ・配当込み）、米国債券：FTSE米国国債インデックス（円ヘッジ）、米国REIT：S&P US-REIT指数（円ヘッジ・配当込み）

上記のグラフやデータは過去のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

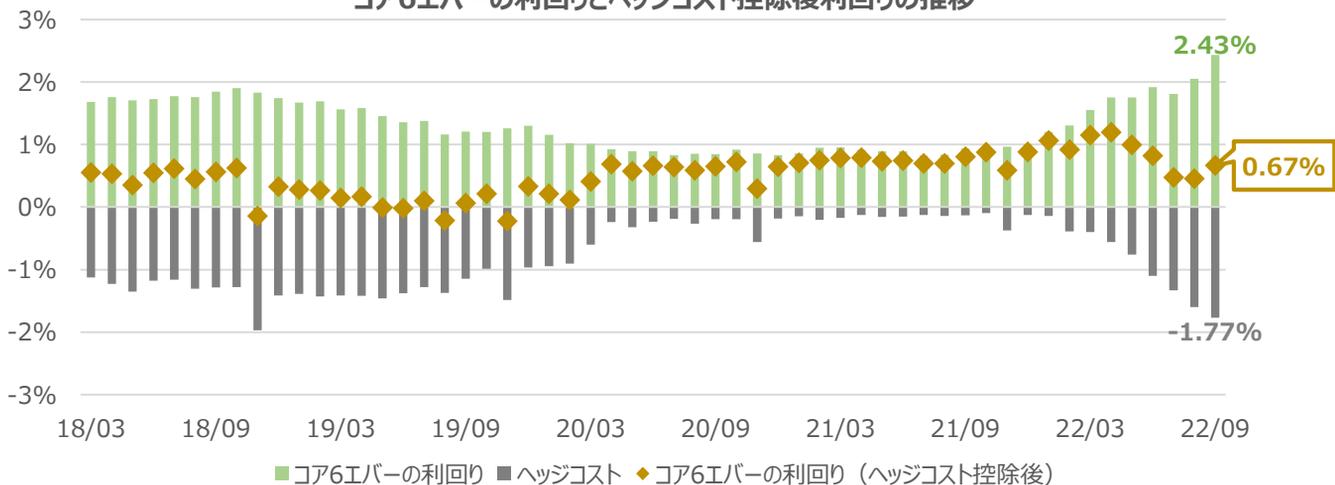
■ 10ページの「主なリスクと費用」および「留意事項」を必ずお読み下さい。

2022年10月作成（2022年9月末時点）

ファンド情報提供資料

以下のとおり、コア6エバーの設定来の利回りは上昇しています。ヘッジコストも上昇傾向ですが、ヘッジコストを控除した利回りは+0.67%（2022年9月末時点）となっています。

コア6エバーの利回りとヘッジコスト控除後利回りの推移



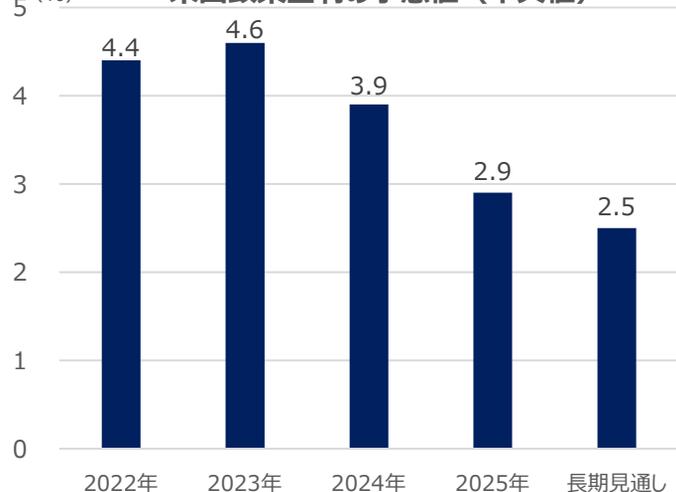
出所：Bloombergより作成 期間：2018年3月末～2022年9月末  
 コア6エバーの利回りは下記資産の利回りをコア6エバーの基本配分比率で按分して試算しており、実際のマザーファンドの利回りとは異なります。  
 ヘッジコストは当ファンドの実際のヘッジコストとは異なります。ヘッジコストは組入れ資産割合が米国資産50%のため1/2にして算出。  
 日本株式：日経平均株価、日本債券：NOMURA-BPI（総合）、日本REIT：東証REIT指数、米国株式：S&P500指数、米国債券：FTSE米国国債インデックス、米国REIT：S&P US-REIT指数

以下のとおり、ヘッジコスト（年率）は過去、政策金利と同程度の水準で推移してきました。米国の政策金利は来年度4.6%程度まで上昇することが見込まれており、ヘッジコスト上昇はコア6エバーの基準価額の押し下げ要因となります。2024年以降は政策金利引き下げにより、ヘッジコストは来年をピークに低下することが見込まれます。

米国政策金利と1か月ヘッジコストの推移



米国政策金利の予想値（中央値）※



出所：Bloombergより作成 期間：2003年6月末～2022年9月末

上記のコメントは9月末時点のものです。また、将来の市況環境の変動等を保証するものではありません。  
 上記のグラフやデータは過去のものであり、将来の運用成果や市況変動等を保証するものではありません。

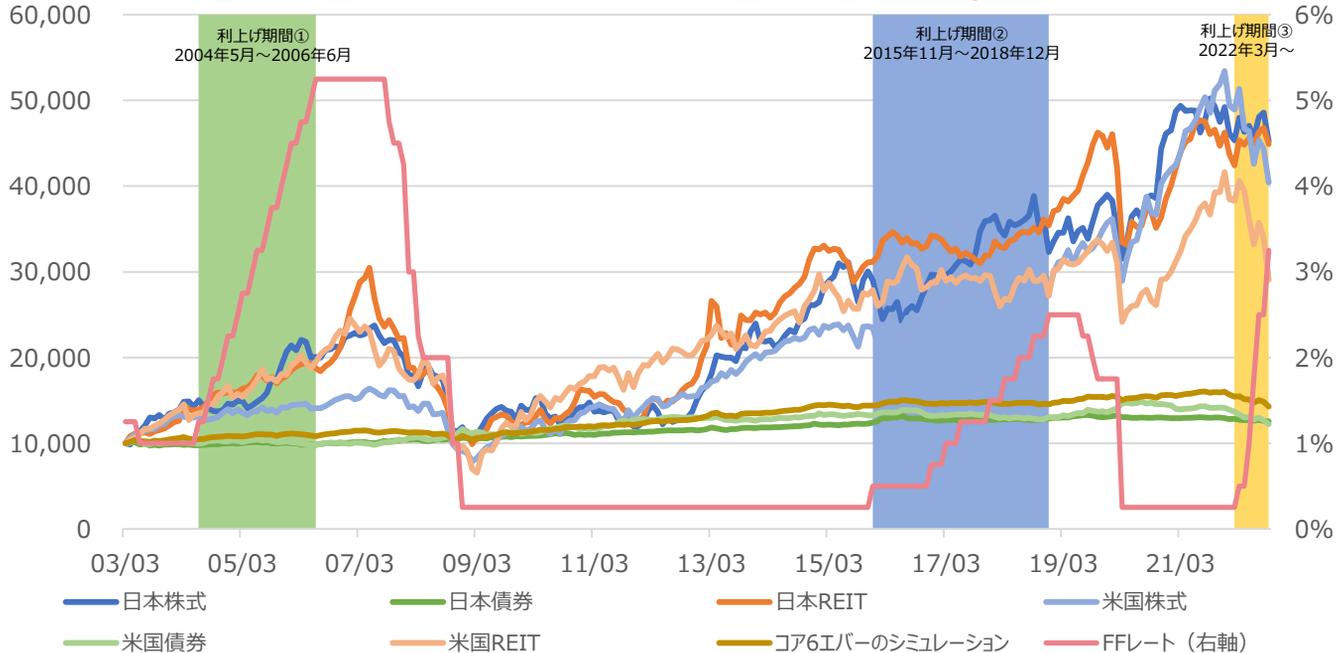
■ 10ページの「主なりリスクと費用」および「留意事項」を必ずお読み下さい。

2022年10月作成（2022年9月末時点）

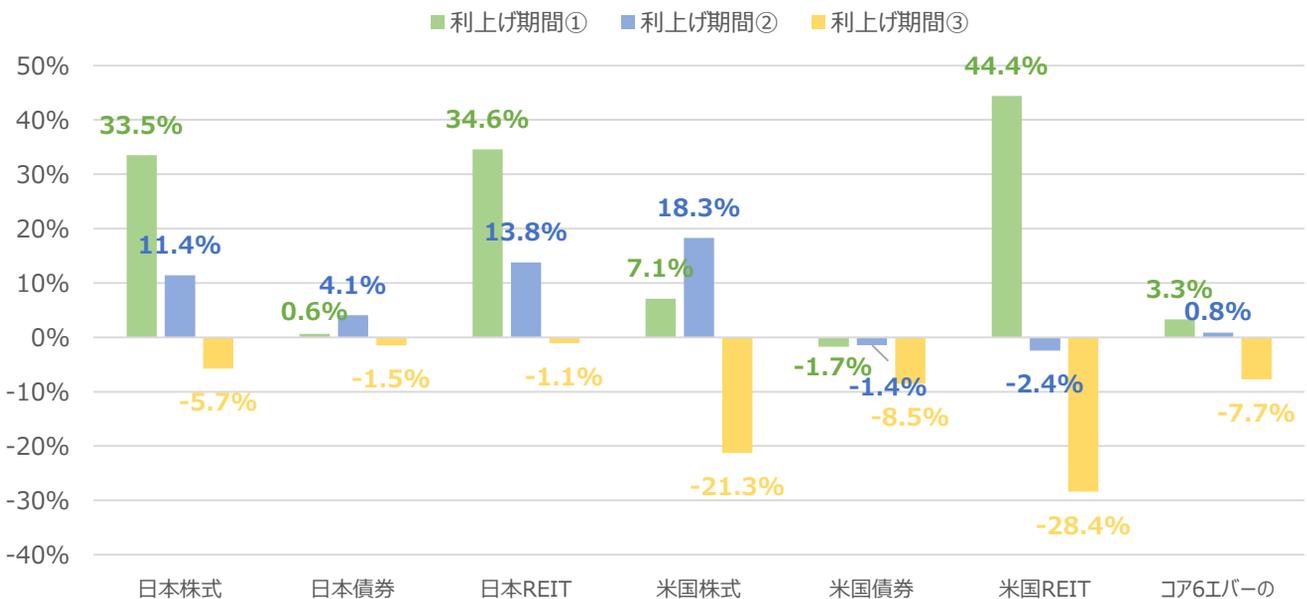
ファンド情報提供資料

2000年以降の利上げ局面では、コア6エバーのシミュレーションは過去2回ともプラスに転じました。米国債券はマイナスとなったものの、株式やREITなどが大幅に上昇したためです。利上げ期間中は利上げが始まって一定期間経過すると株式やREITなどが上昇する傾向があります。

過去の利上げ局面でのコア6エバーのシミュレーションおよび組入6資産の推移



過去の利上げ期間におけるコア6エバーのシミュレーションと組入6資産の騰落率



出所：Bloombergより作成 期間：2003年3月末～2022年9月末 2003年3月末を10,000として指数化  
 コア6エバーのシミュレーションは日米6資産を各基本配分比率で加重平均したリターンより信託報酬+消費税を控除して試算。2018年3月末以降は分配金再投資基準価額より試算。  
 日本株式：日経平均株価（配当込み）、日本債券：NOMURA-BPI（総合）、日本REIT：東証REIT指数（配当込み）、米国株式：S&P500指数（円ヘッジ・配当込み）、米国債券：FTSE米国国債インデックス（円ヘッジ）、米国REIT：S&P US-REIT指数（円ヘッジ・配当込み）

上記のグラフやデータは過去のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

■ 10ページの「主なリスクと費用」および「留意事項」を必ずお読み下さい。

# 農林中金<パートナーズ>日米6資産分散ファンド（安定運用コース） [愛称：コア6エバー]の運用状況について

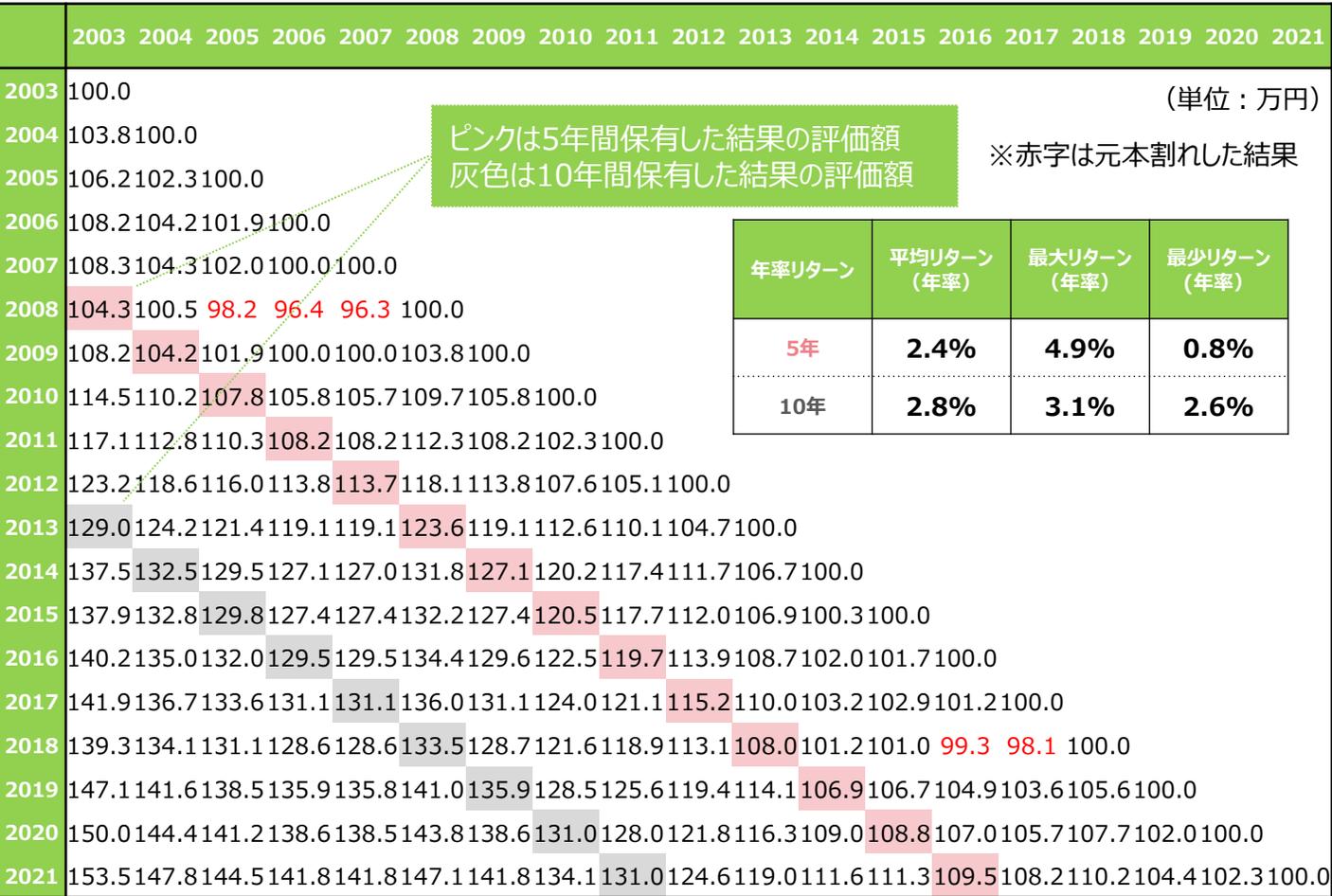


2022年10月作成（2022年9月末時点）

ファンド情報提供資料

以下のコア6エバーのシミュレーションでは、短期的には元本割れしている時期があるものの5年間保有していれば過去は元本は割れていませんでした。短期間ではどうしてもマーケット変動の要因を受けて値下がりすることもあります。長期投資するとその後の回復により損失を回復することが期待できます。

## 【コア6エバー】100万円スポット投資を行った際の保有期間別シミュレーション



年率リターン	平均リターン (年率)	最大リターン (年率)	最少リターン (年率)
5年	2.4%	4.9%	0.8%
10年	2.8%	3.1%	2.6%

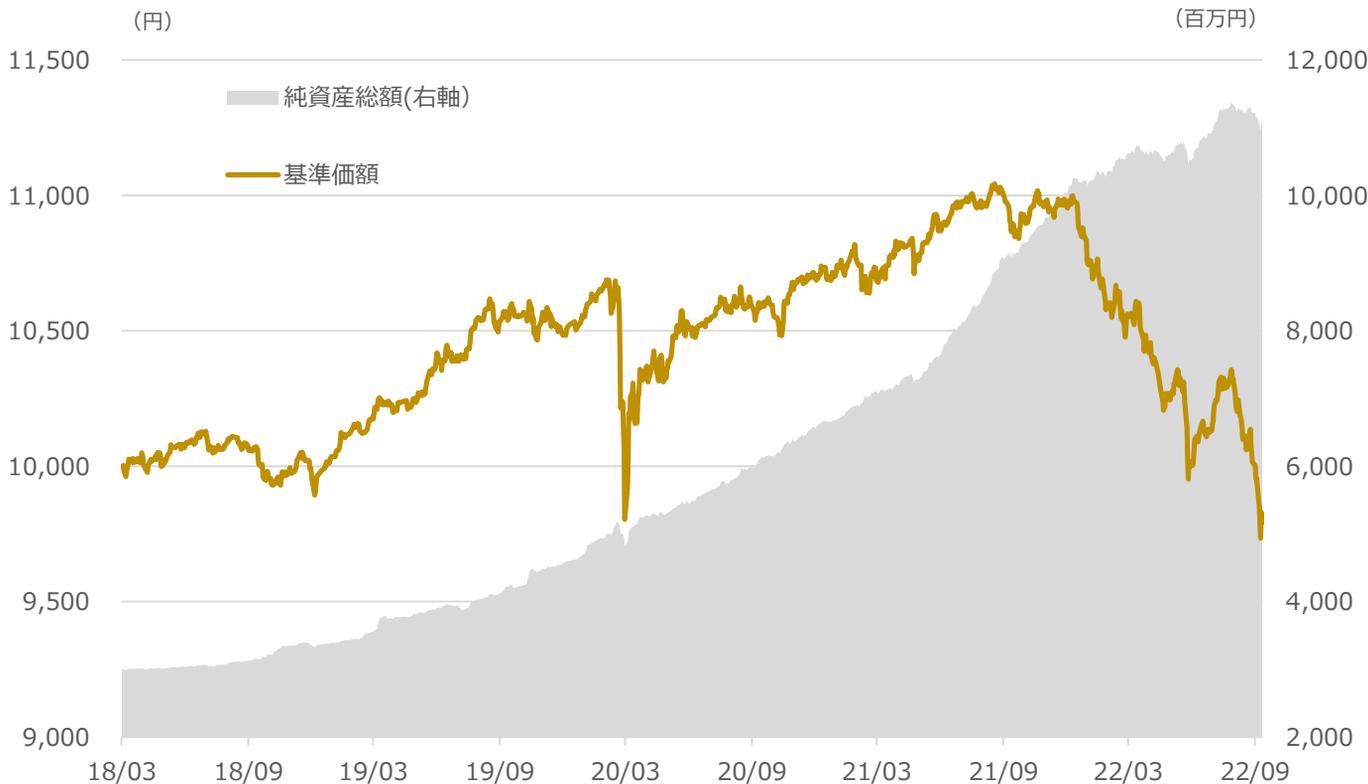
出所：Bloombergより作成 期間：2003年12月末～2021年12月末  
 ※2003年12月末～2018年3月20日まではコア6エバーの基本配分比率を元に、組入6資産の収益率より信託報酬（年0.85%+消費税）を控除して算出。日本株式：日経平均株価（配当込み）、日本債券：NOMURA-BPI（総合）、日本REIT：東証REIT指数（配当込み）、米国株式：S&P500指数（円ヘッジ・配当込）、米国債券：FTSE米国債券（円ヘッジ）、米国REIT：S&P米国REIT指数（円ヘッジ・配当込）

2022年10月作成（2022年9月末時点）

ファンド情報提供資料

## 【ご参考】コア6エバーの設定来の基準価額と純資産総額の推移

コア6エバーの設定来基準価額と純資産総額の推移



期間：2018年3月20日～2022年9月末

### コア6エバー期間別騰落率

	騰落率
設定来	-2.08%
直近3年間	-7.26%
直近1年間	-10.17%
直近半年間	-7.70%
直近3ヵ月	-3.14%
直近1ヵ月	-3.72%

上記のグラフやデータは過去のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

■ 10ページの「主なりリスクと費用」および「留意事項」を必ずお読み下さい。

2022年10月作成（2022年9月末時点）

ファンド情報提供資料

## <今後の運用について>

今後の運用につきましては、基本的な運用方針に変更はありません。引き続き、原則として各マザーファンド受益証券への基本配分比率に基づき各マザーファンドの組入れを行い、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## 【ご参考】今後の相場見通し（2022年9月末時点）

<日本>

### ■ 株式

日本株式について、交易条件の悪化に伴う投入コストの上昇には留意が必要であるものの、製造業の回復など経済活動の再開や入国制限撤廃に伴うインバウンド需要の復調が企業業績の押し上げ要因となることが想定されます。また、グローバルに見て相対的に緩和的な金融環境が継続する中、PER<sup>※1</sup>などバリュエーションの観点で割高感も限定的であり、日本株は横ばい圏での推移を見込みます。

※<sup>1</sup> PER：株価の割安・割高を判断する指標です。株価÷利益（1株）で計算され、値が高いほど割高、値が低いほど割安と判断されます。

### ■ 債券

日銀は、イールドカーブの低位安定を志向し、長期金利はゼロ%程度で推移するよう長期国債の買入れを行うことを決定していることから、国内長期金利は横ばい圏での推移を想定するものの、当面は日銀の金融政策修正が意識されやすい展開を見込みます。国内超長期金利は、他年限対比での日銀の国債買入割合の低さが金利上昇圧力となるものの、ヘッジコストの上昇を背景にヘッジ付き外債対比で超長期債の投資妙味が増しており、銀行勢中心に投資家需要が見込まれることから、低下を見込みます。

### ■ REIT

J-REIT市場は、新型肺炎の感染収束後も大企業を中心に在宅勤務の継続が見込まれる中、資産構成比が高いオフィス物件の業績回復は期待し難いと予想されます。また、日銀の金融政策修正が意識されやすいことや米国の金融政策にかかる不透明感が上値を抑えたと想定します。一方、NAV倍率<sup>※2</sup>（投資口価格÷1口あたり純資産価値）が1倍程度の水準では、割安感を意識した資金流入が下値を支えると見込まれることから、横ばい圏での推移を見込みます。

※<sup>2</sup> NAV倍率：REIT価格の割安・割高を判断する指標です。NAV倍率が1以下だとREIT価格は割安と判断されます。

<米国>

### ■ 株式

米国株式について、利上げやQT<sup>※3</sup>のペースなど金融政策を巡る不透明感や景気減速懸念から、上値が抑えられることを想定します。企業業績については、深刻な景気後退を見込まないことから、大幅な悪化を予想しないものの、原材料価格・人件費の上昇や供給制約の影響による下押しが継続すると見込まれます。かかる中、米国株は変動性が高まりながらも、横ばい圏での推移を見込みます。

※<sup>3</sup> QT：量的引き締め（Quantitative Tighteningの略称）で量的緩和策で中央銀行が購入した国債などの資産を売却することを指し、金融引き締め策の一つになります。

### ■ 債券

米国長期金利については、FRBがインフレの上方リスクを警戒しインフレ期待の安定化に舵を切った中、期待インフレ率は抑制が見込まれる一方、前例にとらわれない性急なペースでの利上げに加えて中立金利<sup>※4</sup>を大きく超える利上げが見込まれることや、QTによる国債需給の緩み、変動性の高止まりなどを背景に、当面は実質金利主導での上昇圧力がかかりやすい展開が見込まれます。但し強力な金融引き締めの効果から相応の景気減速や物価上昇ペースの鈍化が想定される中、中期的に米国長期金利は低下を見込みます。

※<sup>4</sup> 中立金利：金融引き締めでも金融緩和でもない状態の金利のことを指します。

### ■ REIT

米国REIT市場は、eコマースの一段の進展や5Gへの設備投資継続、在宅勤務の定着などを要因として用途別の成長率の差が拡大することが想定されます。指数については、経済活動の正常化に伴う回復は望めるものの、米国長期金利対比の分配利回り（イールド・スプレッド）<sup>※5</sup>で見た割高感から、横ばいから下落の展開を見込みます。

※<sup>5</sup> イールド・スプレッド：配当利回りから10年債利回りを控除したもので、イールド・スプレッドが大きくなれば割安、小さくなれば割高な状況を指します。

## 商品の特色

- 主として日本株式、日本債券、日本上場不動産投資信託（J-REIT）、米国株式、米国債券および米国上場不動産投資信託（REIT）に実質的に分散投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- 実質組入外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、原則としてすべて対円での為替ヘッジを行います。
- お客様のそれぞれの資産運用の目的などに合わせて、2つのファンド（安定運用コース、資産形成コース）から選択いただけます。

2つのファンド（安定運用コース、資産形成コース）の各資産（資産別のマザーファンド）への基本配分比率は次のとおりとします。

※詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）の特色をご覧ください。

	安定運用コース	資産形成コース
日本株式	5.00%	16.70%
日本債券	40.00%	16.70%
日本REIT	5.00%	16.70%
米国株式	5.00%	16.70%
米国債券	40.00%	16.70%
米国REIT	5.00%	16.70%

- 各マザーファンドの特色について

マザーファンド	主要投資対象	主な投資態度
日経225 インデックス・マザーファンド	日本株式	日経平均株価（日経225）と連動する成果を目指します。
J A 日本債券マザーファンド	日本債券	NOMURA – BPI総合を中長期的に上回る成果を目指します。
東証REIT インデックス・マザーファンド	日本REIT	東証REIT指数（配当込み）と連動する成果を目指します。
S&P500 インデックス・マザーファンド	米国株式	S&P500指数（当社円換算ベース）と連動する成果を目指します。
米国債券・マザーファンド	米国債券	FTSE米国国債インデックス（円ベース）を上回る成果を目指します。
S&P米国REIT インデックス・マザーファンド	米国REIT	S&P米国REIT指数（配当込み、当社円換算ベース）と連動する成果を目指します。

## お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
購入代金	販売会社の指定する日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して6営業日目から支払いを行います。
申込締切時間	原則として午後3時までとなります。（ただし、受付時間は販売会社により異なる場合もありますので、詳細につきましては販売会社までお問い合わせください。）
申込受付不可日	ニューヨーク証券取引所の休場日またはニューヨークの銀行の休業日には、購入・換金の申込受付を行いません。（詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。）
換金制限	信託財産の資産管理を円滑に行うために大口の換金には制限を設ける場合があります。
購入・換金申込受付の中止及び取消し	金融商品取引所等における取引の停止等により購入・換金の申込受付が中止または取消しとなることがあります。
信託期間	無期限（設定日：2018年3月20日）
繰上償還	受益権の総口数が10億口を下回った場合などには、繰上償還となる場合があります。
決算日	毎年11月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配	毎年11月の決算時に分配を行います。販売会社との契約によっては、税引き後、無手数料で再投資が可能です。（年1回）
信託金の限度額	1兆円を限度とします。
公告	委託会社が投資者（受益者）に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。
運用報告書	毎年11月の決算時及び償還後に交付運用報告書を作成し、販売会社より知れている投資者（受益者）に対して交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 配当控除、益金不算入制度の適用はありません。なお、税制が改正された場合等には変更される場合があります。
スイッチング	（安定運用コース）（資産形成コース）間でスイッチングが可能です。 スイッチングとは、各ファンド間の乗換えのことで、ファンドの換金と同時に、当該換金代金をもって他のファンドの購入の申込みをする場合をいいます。 申込単位は、1口単位で、購入時手数料はかかりませんが、換金するファンドには、税金がかかります。

金融商品取引所や外国金融商品市場における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときには、ご購入申込みもしくはご換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けたご購入申込みもしくはご換金申込みを取り消す場合があります。

### ■ 委託会社、その他の関係法人

- 委託会社：農林中金全共連アセットマネジメント株式会社（金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第372号 一般社団法人 投資信託協会会員/一般社団法人 日本投資顧問業協会会員）  
信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。
- 受託会社：三菱UFJ信託銀行株式会社（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）  
追加信託に係る振替機関への通知等、信託財産の保管・管理・計算等を行います。
- 販売会社：以下をご覧ください。  
ファンドの募集の取扱い・販売、目論見書・運用報告書の交付、一部解約の請求の受付、収益分配金、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

販売会社等につきましては、以下の照会先までお問い合わせください。

◆農林中金全共連アセットマネジメント株式会社  
ホームページ： <https://www.ja-asset.co.jp/>  
フリーダイヤル： 0120-439-244（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

お申込、投資信託説明書（交付目論見書）のご提供は

## 主なリスクと費用

下記の事項は、この投資信託（以下、「当ファンド」といいます。）をお申込みされる投資家の皆様にあらかじめ、ご確認いただきたい重要な事項としてお知らせするものです。

お申し込みの際には、下記の事項および投資信託説明書（交付目論見書）の内容をよくお読みください。

### ■ 当ファンドに係るリスクについて

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的に株式、公社債およびREITなど値動きのある証券（外貨建証券は為替変動リスクもあります）を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、投資者（受益者）の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。

ファンドの運用による損益は、すべて投資者（受益者）の皆様はに帰属します。

投資信託は、預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「株価変動リスク」、「REIT（リート）の価格変動リスク」、「金利変動リスク」、「為替変動リスク」、などがあります。

※詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）の「投資リスク」をご覧ください。

### ■ 当ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用	
購入時手数料	購入申込日の翌営業日の基準価額に、販売会社が個別に定める手数料率を乗じた額です。ご購入時の手数料の上限は1.10%（税抜1.00%）です。
信託財産留保額	ありません。
投資者が信託財産で間接的に負担する費用	
運用管理費用（信託報酬）	毎日、純資産総額に年0.935%（税抜0.85%）を乗じた額を計上します。毎計算期間の最初の6ヵ月終了日及び毎計算期間末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。
その他の費用・手数料	監査費用は、毎日、純資産総額に年0.0033%（税抜0.003%）を乗じた額を計上します。毎計算期間末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。
	有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等は、その都度信託財産中から支払われます。 ※運用状況により変動するため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

※ファンドの費用の合計額は、投資者の皆様がファンドを保有する期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

※ご購入の際は、必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

## 留意事項

- 当資料は、農林中金全共連アセットマネジメント株式会社（以下、「当社」といいます）が作成した販売用資料であり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
- 当資料は当社が信頼できると判断したデータ等により作成しましたが、その正確性、完全性等を保証するものではなく、また事前の通知なしに内容を変更する場合があります。市場環境等の見直しにつきましても、その確実性を保証するものではありません。また、将来の運用成果を保証するものでもありません。
- 当ファンドは、株式、公社債およびREITなど値動きの生じる証券（外貨建証券は為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は日々変動します。したがって、元金および収益分配が保証されるものではなく、投資元本を割り込むことがあります。また、運用の成果は運用の実績により変動します。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客様に負っていただくこととなります。
- 投資信託は預貯金や保険商品とは異なり、預金（貯金）保険機構、保険契約者保護機構の保護対象ではありません。投資信託のお申込みに関しては、クーリングオフの適用はありません。
- ご購入の際は、販売会社より投資信託説明書（交付目論見書）をお渡しますので、必ずお受取りいただき、詳細をご確認のうえ、ご自身でご判断いただきますようお願いいたします。

## 指数について

### 日本株式

- 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社（以下「(株)日本経済新聞社」といいます）によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、(株)日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- 「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て(株)日本経済新聞社に帰属しています。
- 本件投資信託は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、(株)日本経済新聞社は、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。
- (株)日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。
- (株)日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

### 日本REIT

- 東証REIT指数の指数値および同指数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、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数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。
- JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、JPXは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

### 日本債券

- 「NOMURA-BPI総合」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

### 米国株式・米国REIT

- S&P500®（以下「S&P500指数」といいます）、S&P米国REIT（以下「S&P米国REIT指数」といいます）はS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJII」といいます）の商品であり、これを利用するライセンスが農林中金全共連アセットマネジメント株式会社に付与されています。
- Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」といいます）の登録商標です。また、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」といいます）の登録商標です。これらの商標を利用するライセンスがSPDJIIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが農林中金全共連アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。
- 当ファンドは、SPDJII、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P500指数、S&P米国REIT指数の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

### 米国債券

- 「FTSE米国国債インデックス」はFTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。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。