

グローバル・リート・ トリプル・プレミアム・ファンド (毎月分配型) (愛称:トリプル・プレミアム)

追加型投信／内外／その他資産
(不動産投信・為替・オプション)

交付運用報告書

第4作成期

第19期(決算日2015年1月19日) 第22期(決算日2015年4月17日)
第20期(決算日2015年2月17日) 第23期(決算日2015年5月18日)
第21期(決算日2015年3月17日) 第24期(決算日2015年6月17日)

作成対象期間(2014年12月18日～2015年6月17日)

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。
さて、「グローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド(毎月分配型)(愛称:トリプル・プレミアム)」は、2015年6月17日に第24期の決算を行いました。
当ファンドは、主として外国投資信託証券「CSグローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド」への投資を通じて、日本を含む世界のリート(グローバル・リート)へ実質的に投資することで、相対的に高い配当利回りの獲得と信託財産の成長を図ることをめざして運用を行いました。ここに期中の運用状況と収益分配状況についてご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

第24期末(2015年6月17日)

基準価額	5,499円
純資産総額	29,821百万円
第19期～第24期	
騰落率	△2.3%
分配金(税込み)合計	1,260円

(注1) 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。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

(注3) 当報告書における比率は、表示桁未満を四捨五入しております。

- 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旨を定めております。運用報告書(全体版)は、右記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)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URLにアクセス⇒「ファンド情報」⇒「当該ファンド」を選択⇒「目論見書・定期レポート等」を選択⇒「運用報告書(全体版)」より該当の決算期を選択ください。

 SBI Asset Management

SBIアセットマネジメント株式会社

〒106-6017 東京都港区六本木1-6-1

お問い合わせ先

電話番号 03-6229-0097

受付時間:営業日の9:00～17:00

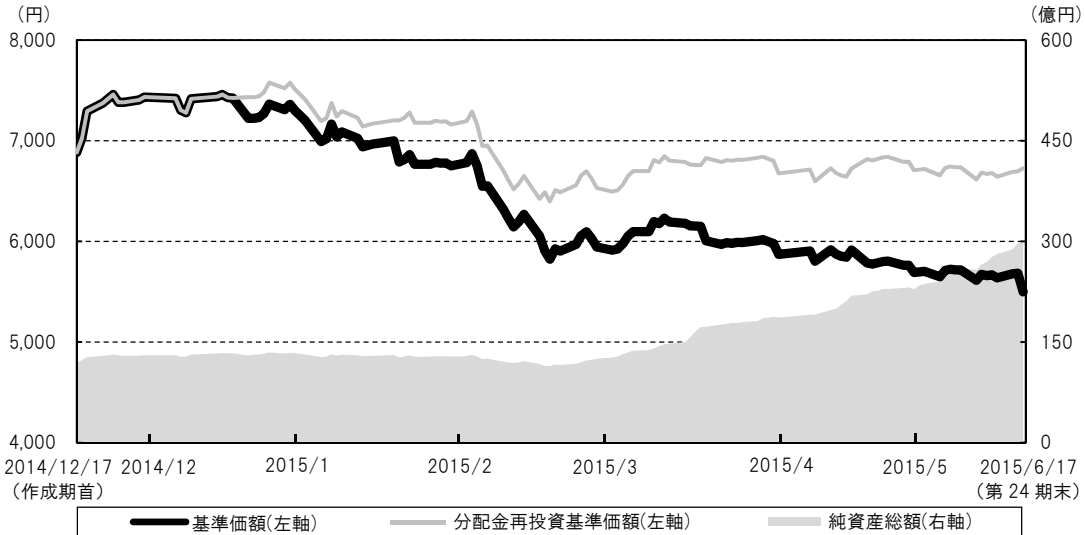
ホームページから、ファンドの商品概要、レポート等をご覧いただけます。

<http://www.sbiam.co.jp/>

運用経過

基準価額等の推移

(2014年12月18日～2015年6月17日)



第19期首:6,884円

第24期末:5,499円(既払分配金(税込み):1,260円)

騰落率:△2.3%(分配金再投資ベース)

- (注1) 当ファンドは、特定のベンチマーク及び参考指数等は採用しておりません。
- (注2) 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3) 分配金の再投資についてはお客様がご利用のコース等により異なります。また、ファンドの運用経過については、当ファンドのパフォーマンスを示したものであり、ファンドの購入価額により課税条件等が異なるため、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、期首(2014年12月17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。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの税引前分配金再投資基準価額は、グローバル・リートの上昇などを受けて、12月下旬から1月下旬にかけて緩やかな上昇基調が続きました。しかし、2月以降は、米国の早期利上げ観測によりグローバル・リートが下落したことや、国営石油会社ペトロブラスの汚職に伴う政治的混乱などにより選択通貨のブラジル・レアルが大幅下落したことにより、税引前分配金再投資基準価額は、3月18日に当期の最安値である10,078円を付けました。その後は、主要各国の金利上昇が嫌気されグローバル・リートの下落基調が継続した一方、選択通貨のインドネシア・ルピアやブラジル・レアルの反発、ドルが対円で上昇したことなどを受けて、税引前分配金再投資基準価額は一進一退の値動きとなりました。当期末にかけては、グローバル・リートや選択通貨のブラジル・レアルがやや値を戻す動きとなり、当期末の税引前分配金再投資基準価額は作成期首比で△2.3%の10,598円となりました。

1 万口当たりの費用明細

(2014年12月18日～2015年6月17日)

項 目	当 作 成 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	40	0.614	(a)信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(19)	(0.292)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(20)	(0.300)	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 ）	(1)	(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) そ の 他 費 用	1	0.008	(b)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	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
（ 印 刷 ）	(0)	(0.007)	開示資料等の作成・印刷費用等
合 計	41	0.622	
作成期中の平均基準価額は6,498円です。			

(注1) 作成期中の費用(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2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 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。

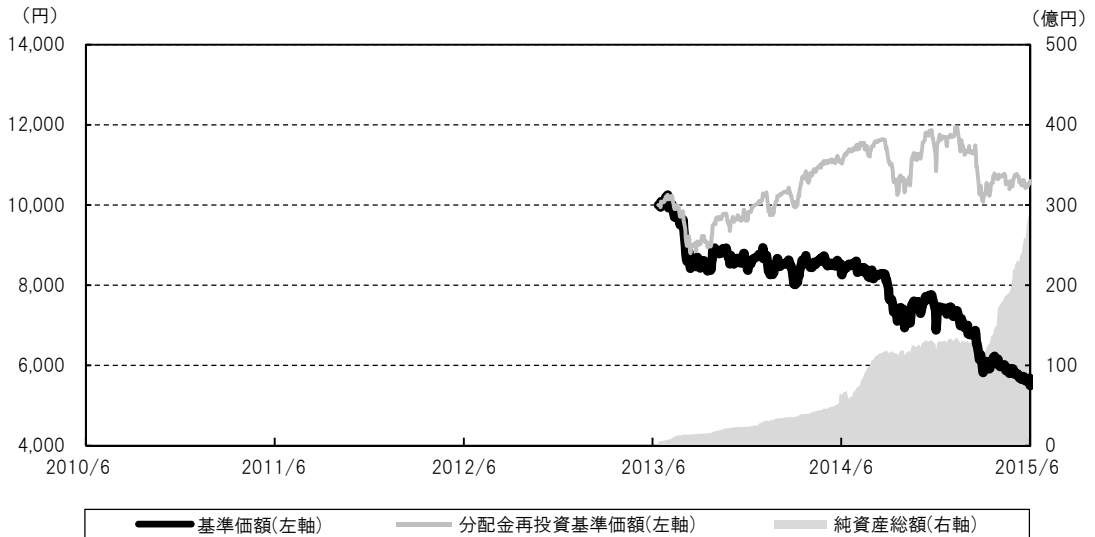
(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注5) 各項目の費用は、当ファンドが組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「組入上位ファンドの概要」に表示しております。

最近5年間の基準価額等の推移

(2010年6月18日～2015年6月17日)



- (注1) 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2) 分配金の再投資についてはお客様がご利用のコース等により異なります。また、ファンドの運用経過については、当ファンドのパフォーマンスを示したものであり、ファンドの購入価額により課税条件等が異なるため、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 当ファンドについては設定日以降のデータが5年に満たないため、実在するデータ(2013年6月28日から2015年6月17日)のみの記載となっております。

	2013年6月28日 設定日	2014年6月17日 決算日	2015年6月17日 決算日
基準価額 (円)	10,000	8,276	5,499
期間分配金合計(税込み) (円)	—	2,520	2,520
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	10.52	△ 4.11
純資産総額 (百万円)	537	6,299	29,821

(注1) 当ファンドは、ベンチマークは採用していません。また、適当な参考指数もないため当ファンドのみ表記しております。

(注2) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

(注3) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。

投資環境

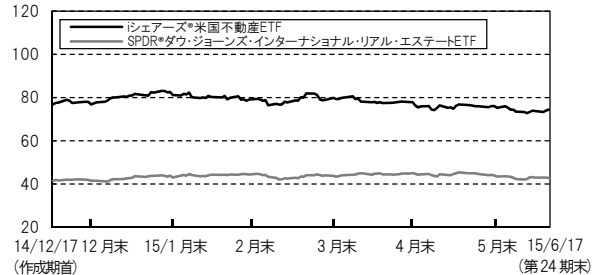
(2014年12月18日～2015年6月17日)

※以下のコメントの内容は、クレディ・スイス・グループからのコメントをもとにSBIアセットマネジメント株式会社が編集したものです。

グローバル・リート市場

先進国リート市況は当該期間は若干下落しました。当期間の前半では、ECB(欧州中央銀行)の国債買い入れプログラムや日銀の継続的な金融緩和政策、原油を中心とするコモディティ価格下落によるインフレ期待の後退や世界的な低金利環境などを背景に上昇基調で推移しました。その後、米国経済の力強い経済指標を受けて、FRB(米国連邦準備制度理事会)が年後半の利上げを示唆すると、米国の債券利回り上昇を背景に世界的にリートの利益確定売りにつながりました。国別の現地通貨建て騰落率を見ると、フランス(14.9%)や英国(14.3%)が大きく上昇しました。一方で、米国(△2.1%)、香港(△0.7%)、日本(△0.6%)が相対的には振るいませんでした。現地通貨建てのセクター別では、個人用倉庫、住宅施設、分散投資のパフォーマンスが相対的に良好だった一方で、医療施設やホテル/リゾートなどが低調でした。

当作成期のリートETF(米ドル建)の価格推移

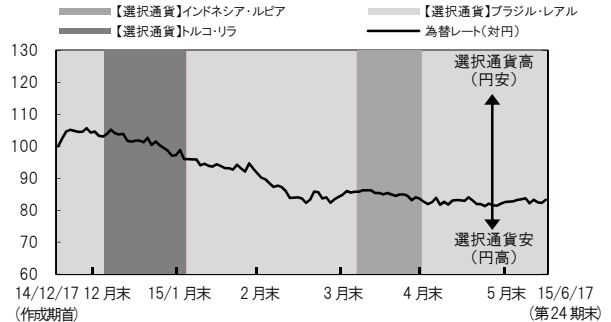


※ブルームバーグ等のデータを基にSBIアセットマネジメントにて作成しております。
 ※祝日等の場合には前営業日の数値で計算しております。

為替市場

当期における新興国のマクロ経済環境は、中国経済が減速し第一四半期の先進国経済が一時的に鈍化する中、国際商品相場下落を受けて、厳しいものとなりました。また、年内の米国の金融政策正常化へ向けた動きと欧州の量的緩和といった金融政策の相連を主な背景としたドル高の流れや、5月のドイツ国債を皮切りとした世界的な債券市場の下落に伴う先進国の金利上昇といった世界市場の動きは、新興国通貨のパフォーマンスに大きな打撃を与えました。新興国通貨は新興国債券や新興国株式の収益率を大幅に下回りましたが、通貨安は資源の輸出収入に頼る新興国経済にとって財政赤字の抑制につながるなど緩衝材としての役目を果たしています。

当作成期の選択通貨の変遷および為替レートの推移(対円)



※為替レート(対円)は、2014年12月17日を100とし、選択通貨が見直された場合は連続した指数となるよう算出しております。

ブラジルリアルは大きな政治スキャンダルと景気後退の影響から、他の新興国通貨を下回る収益率となりました。2015年上半期はブラジル中央銀行が計2%もの利上げを行いました。成長率の鈍化、インフレ率の上昇、長期債務格付けの悪化、そして交易条件の悪化などを通貨安として織り込まざるを得ない状況となりました。特にルセフ大統領の支持率が低下する中、政府が必要とされていた財政改革を実行しなかったことは、通貨にとっては大きなマイナス要因として作用しました。

インドネシアルピアは米ドルに対し割安な水準かつ対外不均衡が改善したにもかかわらず、上半期は下落しました。インドネシア中央銀行は2014年に実施した燃料補助金削減の副次的影響の抑制を目的とした金融引き締め姿勢を転換し、2015年2月に利下げに踏み切りました。これは弱含みの内需への配慮に加えて、経

常赤字の抑制のために、若干の通貨安容認を意図したものと受け止められました。

トルコリラの収益率はマクロ経済政策により低迷しました。低水準にとどまる実質金利、不透明感の増す政治状況を背景に、經常赤字は GDP 対比で 5%に達し、トルコリラにとってマイナスに作用しました。有権者へ配慮する選挙期間に伴い、財政収支の改善が大きくは見込みづらいつの他、政府による中央銀行への利下げに対する政治圧力が増す中、6 月総選挙での与党敗北の影響を受けた政策変更リスクは先行き懸念といった形でトルコリラ相場に大きく影響を与えました。中央銀行は引き続き国内流動性の引き締めを維持していますが、2 月に 0.25%の利下げを行いました。6 月初旬に行われた総選挙での与党・公正発展党(AKP)の過半数割れは 2002 年政権樹立以降初めての出来事となり、先行き不透明感がさらに増す格好となりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2014年12月18日～2015年6月17日)

当ファンド

主として外国投資信託証券である「CSグローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド(適格機関投資家限定)」および国内の証券投資信託である「FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)」を主要投資対象とし、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得をめざして運用を行っております。

CSグローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド(適格機関投資家限定)

主として担保付スワップ取引を対象とし、実質的に米国リート ETF、米国外リート ETF と各 ETF を対象としたオプション取引に加え、米ドル売り選択通貨買いの為替予約取引、並びに円に対する当該選択通貨のコール・オプション(通貨オプション)を売却した投資成果を享受し、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得をめざして運用を行っております。

FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)

「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行っております。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2014年12月18日～2015年6月17日)

当ファンドにはベンチマークはありません。また、適当な参考指数もないことから、ベンチマーク、参考指数を特定していません。

分配金

(2014年12月18日～2015年6月17日)

当作成期における分配金は、当ファンドの分配方針に基づき、基準価額の水準や市況動向等を考慮した結果、第 19 期から第 24 期は 1 万口当たり各期 210 円(税引前)、合計 1,260 円(税引前)といたしました。

収益分配に充てなかった利益につきましては、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

(単位:円、1 万口当たり、税込み)

項 目	第 19 期	第 20 期	第 21 期	第 22 期	第 23 期	第 24 期
	2014年12月18日～ 2015年1月19日	2015年1月20日～ 2015年2月17日	2015年2月18日～ 2015年3月17日	2015年3月18日～ 2015年4月17日	2015年4月18日～ 2015年5月18日	2015年5月19日～ 2015年6月17日
当期分配金	210	210	210	210	210	210
(対基準価額比率)	2.825%	3.001%	3.434%	3.378%	3.502%	3.678%
当期の収益	210	210	210	210	210	210
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	876	937	1,026	1,113	1,195	1,314

(注 1) 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 2) 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(税込み)と一致しない場合があります。

今後の見通しと運用方針

〈今後の見通し〉

米国で予想される金利上昇の可能性による一時的な調整リスクはありますが、景気回復に伴う利上げは賃料や稼働率などの改善が期待できるため、中長期的には先進国リートにとってプラス要因になるとみています。また、米国以外の大半の国や地域、特に日本とユーロ圏では緩和的な金融政策が続くとみられ、リート全般にとってプラス材料です。

〈今後の運用方針〉

当初の運用方針通り、主としてCSグローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド(適格機関投資家限定)への投資を通じ、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がりが利益の獲得をめざして運用を行います。

お知らせ

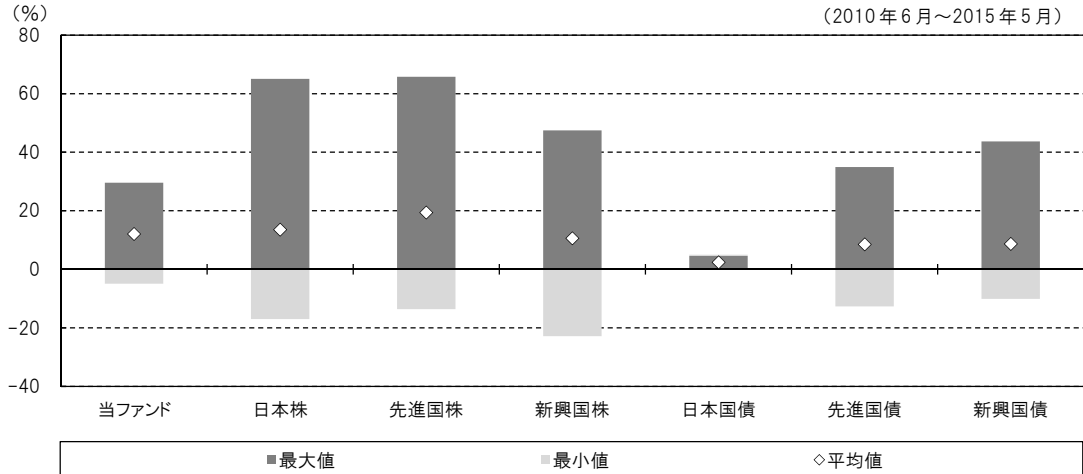
該当事項はありません。

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／その他資産(不動産投信・為替・オプション)
信託期間	平成30年6月18日(月)まで(設定日:平成25年6月28日(金)) ・信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。
運用方針	安定した配当収入の確保と中長期的な値上がりが利益の獲得を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として外国投資信託証券である「CS グローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド(適格機関投資家限定)」および国内の証券投資信託である「FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)」を主要投資対象とします。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。
運用方法	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への直接投資は行いません。 ③デリバティブの直接利用は行いません。 ④同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ⑤株式への直接投資は行いません。
分配方針	毎月17日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・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。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、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は、分配を行わないことがあります。 ③原則として、配当等収益を中心に分配を行うことを目指します。ただし、基準価額水準等によっては売買益(評価益を含みます。)が中心となる場合があります。また、必ず分配を行うものではありません。 ④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、運用の基本方針に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

(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	29.6	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値	△4.9	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△12.7	△10.1
平均値	12.1	13.6	19.4	10.6	2.4	8.5	8.7

(注1) 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2) 2010年6月から2015年5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値・最小値・平均値を表示したものです。

(注3) 当ファンドについては設定日以降のデータが5年に満たないため、2013年6月28日(設定日)から2015年5月29日のデータを基に算出しております。したがって、代表的な資産クラスとの比較対象期間が異なります。

(注4) 上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注5) 当ファンドは分配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(コクサイ)・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)

※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。

※各指数についての詳細は、最終ページをご参照ください。

* 代表的な資産クラスの騰落率は、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、SBIアセットマネジメントはその内容について、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。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

(2015年6月17日現在)

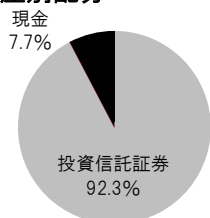
○組入上位ファンド

銘柄名	第4作成期末
CSグローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド	92.3%
FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	0.0%
組入銘柄数	2銘柄

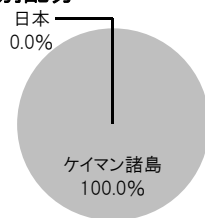
(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 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)に記載されています。

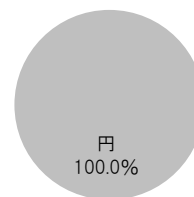
○資産別配分



○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割合です。

(注2) 国別配分は組入投資信託証券の株式評価額に対する比率です。

(注3) 国別配分は発行国を表示しております。

(注4) 通貨別配分は組入投資信託証券の株式評価額に対する比率です。

純資産等

項目	第19期末	第20期末	第21期末	第22期末	第23期末	第24期末
	2015年1月19日	2015年2月17日	2015年3月17日	2015年4月17日	2015年5月18日	2015年6月17日
純資産総額	12,975,599,155円	12,717,583,616円	11,447,747,855円	17,294,744,383円	22,094,795,946円	29,821,221,324円
受益権総口数	17,963,874,828口	18,734,501,987口	19,382,526,173口	28,795,932,834口	38,186,275,364口	54,226,099,847口
1万口当たり基準価額	7,223円	6,788円	5,906円	6,006円	5,786円	5,499円

(注) 当ファンドの作成期首元本額は17,307,503,395円、作成期中追加設定元本額は46,318,649,307円、作成期中一部解約元本額は9,400,052,855円です。

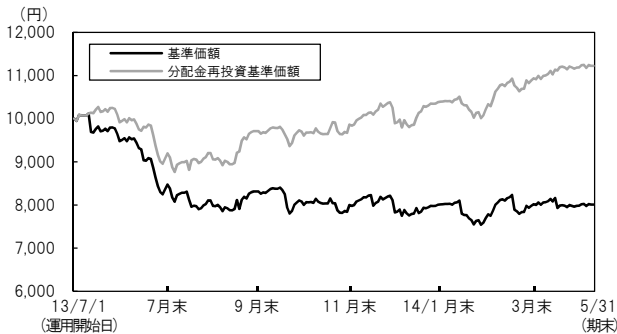
組入上位ファンドの概要

CSグローバル・リート・トリプル・プレミアム・ファンド

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成しております。

【基準価額の推移】

(2013年7月1日～2014年5月31日)



【1万口当たりの費用明細】

入手可能な費用明細のデータが存在しないため、掲載しておりません。

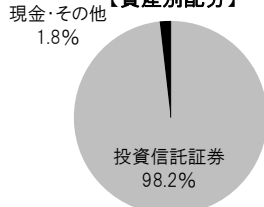
【組入銘柄】

(2014年5月30日現在)

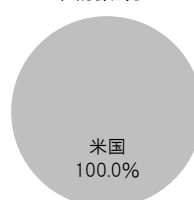
銘柄名	比率(%)
iシェアーズ®米国不動産ETF	73.4
SPDR®ダウ・ジョーンズ・インターナショナル・リアル・エステートETF	24.8
組入銘柄数	2銘柄

(注) 比率は、純資産総額に対する割合です。

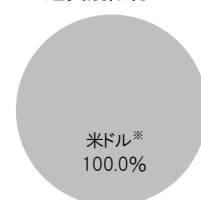
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注1) 組入銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは、2014年5月30日現在のものです。

(注2) 組入投資信託証券については、担保付スワップ取引を通じて実質的に投資しています。

(注3) 資産別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合、国別・通貨別配分の比率は投資信託証券の評価額合計に対する割合です。

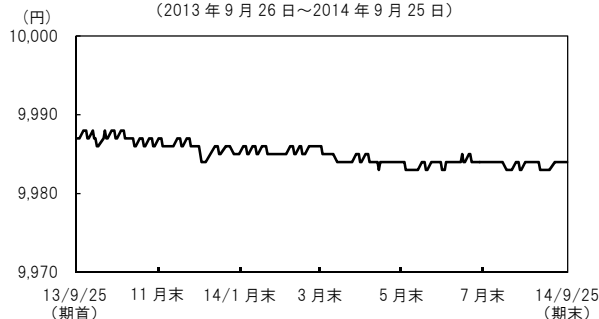
※ 通貨別配分は組入銘柄を取引する際の通貨を表示しております。

FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成しております。

【基準価額の推移】

(2013年9月26日～2014年9月25日)



【1万口当たりの費用明細】

(2013年9月26日～2014年9月25日)

項目	円
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	14 (11) (1) (2)
(b) 保管費用等	0
合計	14

(注) 上記項目の概要につきましては、P2をご参照ください。

【組入上位 10 銘柄】

(2014年9月25日現在)

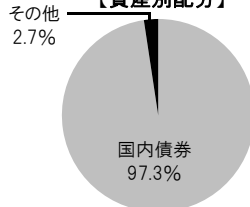
銘柄名	国/地域	比率(%)
第 265 回利付国債(10年)	日本	34.9
第 346 回政府保証道路債券	日本	7.1
第 145 回政府保証阪神高速道路債券	日本	7.1
第 345 回政府保証道路債券	日本	7.1
第 321 回利付国債(2年)	日本	7.0
第 87 回利付国債(5年)	日本	4.1
第 298 回中国電力株式会社債	日本	3.2
第 10 回政府保証日本政策投資銀行債券	日本	2.9
平成 17 年度第 2 回埼玉県公募公債	日本	2.9
平成 17 年度第 2 回愛知県公募公債(10年)	日本	2.9
組入銘柄数	18 銘柄	

(注1) 比率は、純資産総額に対する割合です。

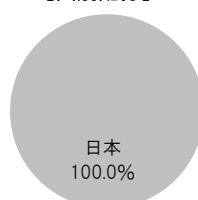
(注2) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

(注3) 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。

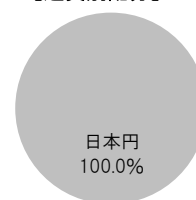
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注1) 基準価額の推移、組入上位 10 銘柄、資産別・国別・通貨別のデータは 2014 年 9 月 25 日現在のものです。

(注2) 1 万口当たりの費用の明細は、「FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)」の直近の決算期のものです。

(注3) 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の著作権等 >

○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)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)は、MSCI inc.が開発した、世界の新興国の株式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 国債は、野村證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、野村證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、円換算ベース)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)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。