

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7作成期

第37期(決算日2016年7月19日) 第40期(決算日2016年10月17日)
第38期(決算日2016年8月17日) 第41期(決算日2016年11月17日)
第39期(決算日2016年9月20日) 第42期(決算日2016年12月19日)

作成対象期間(2016年6月18日～2016年12月19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、2016年12月19日に第42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42期末(2016年12月19日)

基準価額	3,116円
純資産総額	24,719百万円
第37期～第42期	
騰落率	14.8%
分配金(税込み)合計	600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

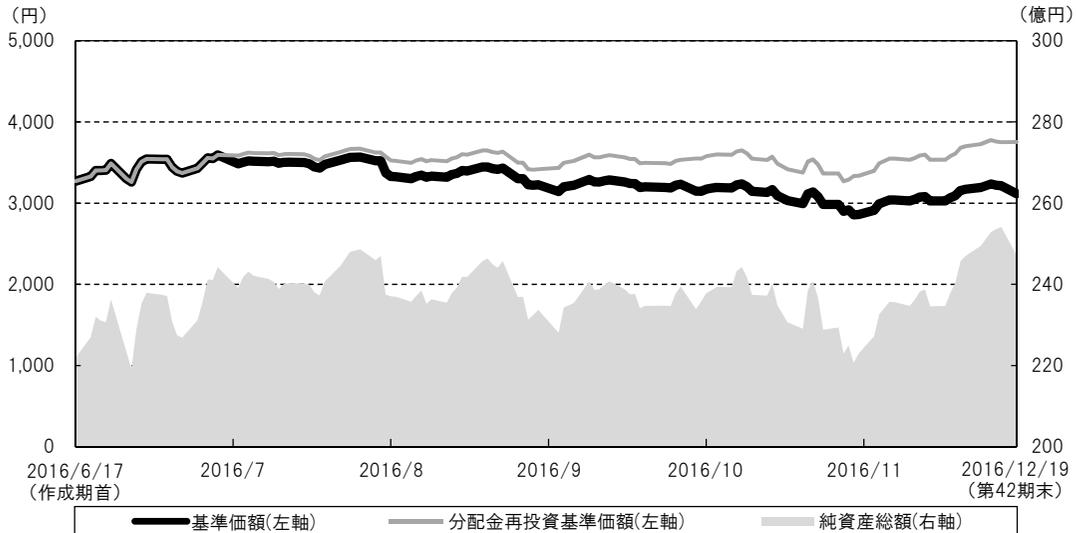
ホームページから、ファンドの商品概要、レポート等をご覧いただけます。

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

運用経過

基準価額等の推移

(2016年6月18日～2016年12月19日)



第37期首:3,269円

第42期末:3,116円(既払分配金(税込み):600円)

騰落率:14.8%(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いません。
- (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とみなして計算し、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(2016年6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、英国の欧州連合(EU)離脱決定を受けて世界的にリートが急落し、外国為替市場でもリスク回避の円買いが進行したことにより、2016年6月28日に当期の最安値である9,347円を付けました。しかし、7月以降は、投資家のリスク回避姿勢の後退や原油相場の反発、米利上げ観測の後退等により、グローバル・リートが反発し、選択通貨のブラジル・レアルが対ドルや対円で上昇したことから、税引前分配金再投資基準価額は概ね上昇基調となりました。

11月上旬以降は、米大統領選で勝利したトランプ氏の政策やインフレ期待を織り込む形で金利が急騰し、為替においてもドル高が進行したため、グローバル・リートや選択通貨のブラジル・レアルの下落により、税引前分配金再投資基準価額は軟調に推移しました。しかし、その後は米国景気の拡大期待などを背景にリートが反発し、為替も円が一段安となったことから、税引前分配金再投資基準価額は12月14日に当期の最高値である10,832円を付けました。当期末の税引前分配金再投資基準価額は作成期首比で+14.8%の10,765円となりました。

1 万口当たりの費用明細

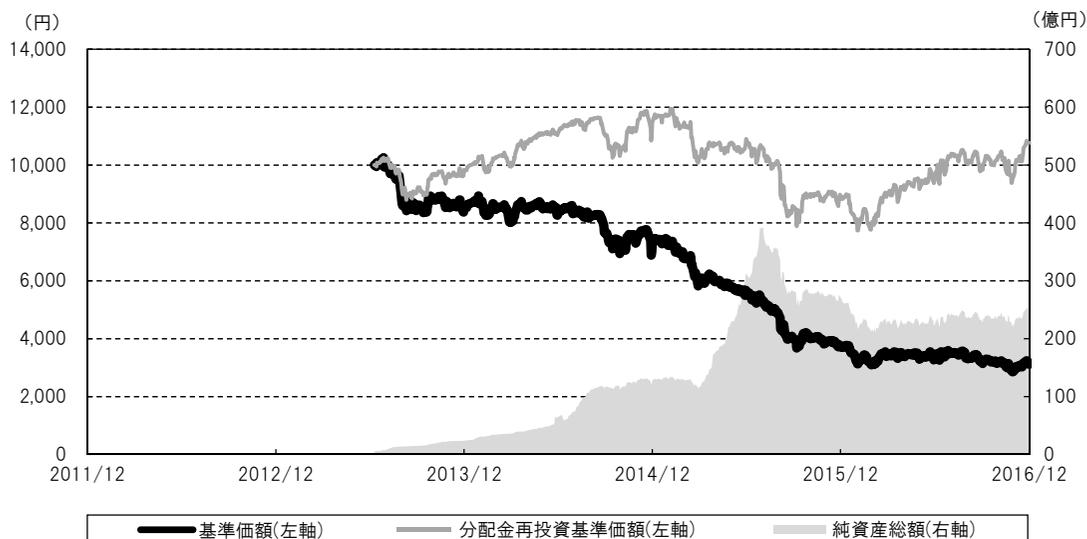
(2016年6月18日～2016年12月19日)

項 目	当 作 成 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	21	0.624	(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 ）	(10)	(0.301)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(10)	(0.301)	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	0	0.005	(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)	(0.004)	開示資料等の作成・印刷費用等
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	21	0.629	
作成期中の平均基準価額は3,312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

(2011年12月19日～2016年12月19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とみなして計算し、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2016年12月19日)のみの記載となっております。

	2013年6月28日 設定日	2013年12月17日 決算日	2014年12月17日 決算日	2015年12月17日 決算日	2016年12月19日 決算日
基準価額 (円)	10,000	8,931	6,884	3,740	3,116
期間分配金合計(税込み) (円)	—	1,260	2,520	2,190	1,220
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△3.4	12.2	△17.8	20.8
純資産総額 (百万円)	537	2,317	11,914	27,364	24,718

(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。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、2013年12月17日の騰落率は設定当初との比較です。

投資環境

(2016年6月18日～2016年12月19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が編集したものです。

○グローバル・リート市場

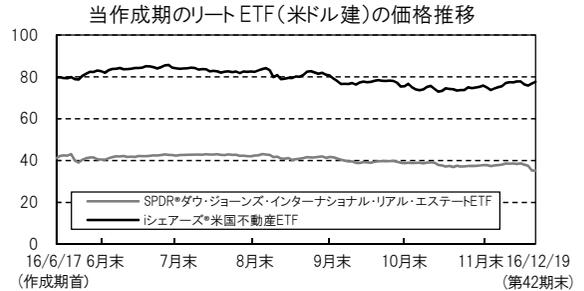
当作成期間(2016年6月18日から12月19日)の先進国リートは下落しました。当期間の上半は、世界的なハト派的金利見通しの中、英国のEU離脱の是非を問う国民投票や米国の軟調な雇用統計の結果を受け国債利回りが低下したこと、米国の利上げの時期予想の後退などが好感され、リート市況は上昇しました。8、9月は米国連邦準備制度理事会(FRB)の一部委員の利上げへのタカ派寄りの発言が原因となり急落する場面も見られましたが、世界経済が緩やかな成長を続けていることが下支えとなり、一定の範囲内で推移しました。

その後、FRBによる12月利上げ観測が高まったこと、欧州中央銀行(ECB)が量的緩和を来年縮小するのではないかという懸念が浮上したことを受け債券利回りが上昇しました。米大統領選も株式市場にとって悪材料とみなされ、市場の予測を裏切るかたちでランプ氏が次期米国大統領に選出されると、同氏が掲げる景気刺激策に市場の関心が集まり債券利回りが大幅に上昇したことなどがリート市況への重石となりました。しかしながら市場がすでに織り込み済みだったことから、実際に利上げが実施されても大きな影響は見られず、良好な米国経済指標を背景に反発しました。

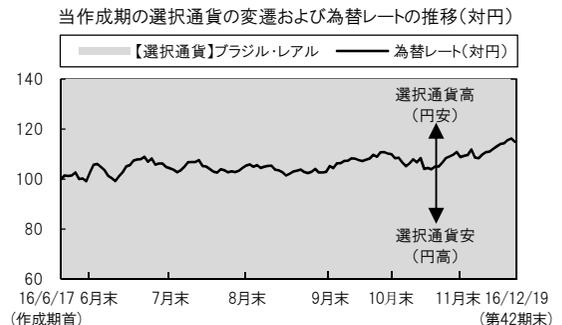
○為替市場

新興国通貨市場は6月に行われた英国のEU離脱に関する国民投票の結果とそれに伴う7月の株式市場急落を含み、市場の乱高下によるボラティリティの急激な上昇、原油価格の上昇、そして11月に行われた米大統領選によりランプ次期大統領が誕生したことによる米国金利の急上昇などといった世界的なイベントに翻弄される展開が続きました。

結果としてこうした情勢は必ずしも新興国通貨にとってマイナス要因として作用はせず、期中に大きく下落したトルコリラを除いては、むしろ通貨上昇に作用しました。国内経済ではブラジルとロシアでは中央銀行による金融緩和に対して慎重な姿勢を継続し、米国に対し相対的に魅力的な実質金利水準を維持することで今後の米国金利の上昇に対して抵抗力を高める一方、景気後退からの出口への兆候が示され始めました。



※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。



※為替レート(対円)は、2016年6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。

○当作成期の選択通貨について

ブラジルレアル(2016年6月～12月)

ブラジルレアルは期中において最もパフォーマンスが良好であった通貨の一つです。財政改革、主には歳出上限法案などが議会で可決されたことにより財政規律に向け舵が切られ、インフレ率の安定化も好感されました。こうした情勢からブラジル中央銀行も注意深く金融緩和へ向け10月政策会合で0.25%利下げに踏み切りました。ブラジルの国内経済では各種景気指標は2016年末に向けて失速しましたが、一方でデysinフレーションの流れは加速し、国際収支動向は改善傾向が継続しています。そうした状況下でブラジルレアルは引き続き新興国高金利通貨で最も高い名目金利と実質金利水準により堅調に推移すると見えています。

当ファンドのポートフォリオ

(2016年6月18日～2016年12月19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いました。

<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まいりました。

<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いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2016年6月18日～2016年12月19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おりません。

分配金

(2016年6月18日～2016年12月19日)

第37期から第42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、合計600円(税引前)といたしました。

なお、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37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
	2016年6月18日～ 2016年7月19日	2016年7月20日～ 2016年8月17日	2016年8月18日～ 2016年9月20日	2016年9月21日～ 2016年10月17日	2016年10月18日～ 2016年11月17日	2016年11月18日～ 2016年12月19日
当期分配金 (対基準価額比率)	100 2.789%	100 2.880%	100 3.085%	100 3.079%	100 3.384%	100 3.109%
当期の収益	83	87	83	79	77	77
当期の収益以外	16	12	16	20	22	22
翌期繰越分配対象額	2,819	2,808	2,794	2,775	2,754	2,735

(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>

世界的に経済成長率は改善する見通しです。現在の好調な市場は、米国新政権による景気刺激策への期待や各国の好調な経済指標に支えられています。また最近の債券利回りの安定化を受けてリートは反発しています。

各国の国債利回りと比較してリートの配当利回りは依然として魅力的ではあるものの、引き続き金利動向に注視していく必要があるとみています。

<今後の運用方針>

引き続き、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

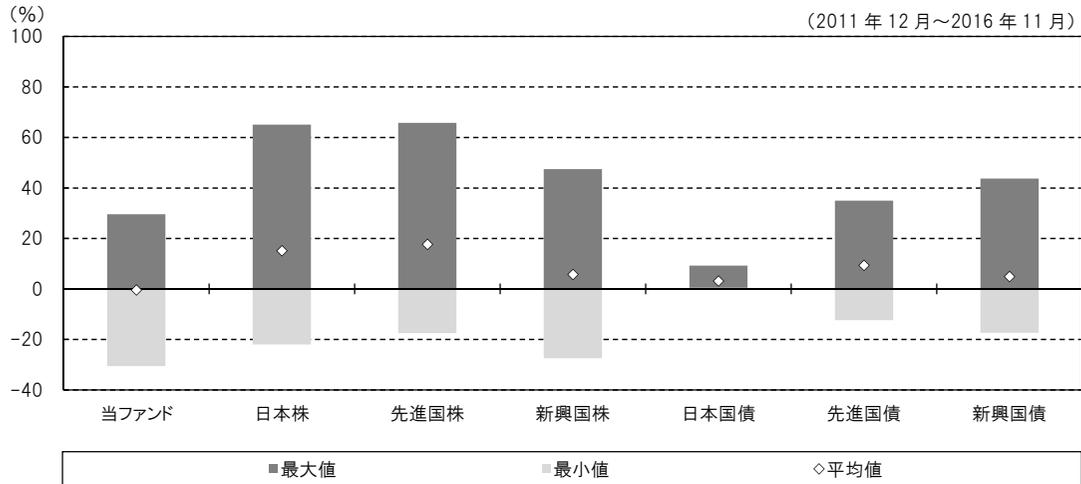
該当事項はありません。

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られたときは、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	原則として、「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)」の投資比率は高位を維持することを基本として運用を行い、当該外国投資信託証券への投資を通じて、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ます。
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	9.3	34.9	43.7
最小値	△30.6	△22.0	△17.5	△27.4	0.5	△12.3	△17.4
平均値	△0.4	15.1	17.7	5.7	3.1	9.3	5.0

(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) 2011年12月から2016年11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2016年11月30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) 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(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。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

(2016年12月19日現在)

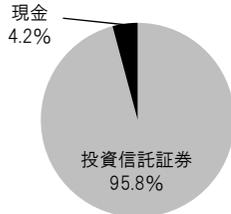
○組入上位ファンド

銘柄名	第7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	95.8%
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

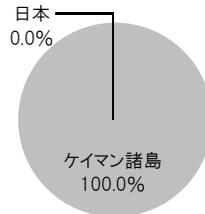
(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

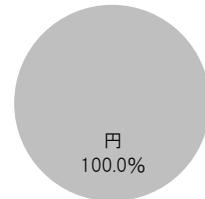
○資産別配分



○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37期末	第38期末	第39期末	第40期末	第41期末	第42期末
	2016年7月19日	2016年8月17日	2016年9月20日	2016年10月17日	2016年11月17日	2016年12月19日
純資産総額	23,909,123,027円	23,744,954,094円	22,808,964,679円	23,389,023,111円	22,070,502,776円	24,718,737,778円
受益権総口数	68,599,463,363口	70,415,709,155口	72,609,071,061口	74,292,004,467口	77,303,634,289口	79,319,382,578口
1万口当たり基準価額	3,485円	3,372円	3,141円	3,148円	2,855円	3,116円

(注) 当ファンドの作成期首元本額は67,882,999,603円、作成期中追加設定元本額は26,323,040,215円、作成期中一部解約元本額は14,886,657,240円です。

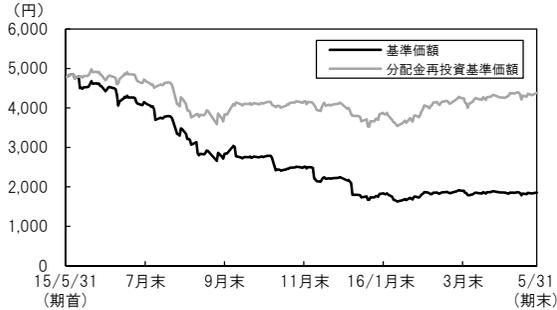
組入上位ファンドの概要

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】

(2015年6月1日～2016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】

(2016年5月31日現在)

銘柄名	比率(%)
iシェアーズ®米国不動産ETF	74.9
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	25.1
組入銘柄数	2銘柄

※投資信託証券の評価額合計に対する比率です。

【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注1) 基準価額の推移、組入銘柄、資産別・国別・通貨別配分のデータは、2016年5月31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。

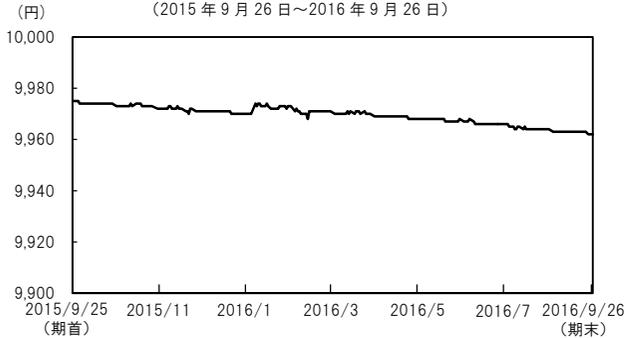
※ 通貨別配分は組入銘柄を取引する際の通貨を表示しております。

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】

(2015年9月26日～2016年9月26日)



【1万口当たりの費用明細】

(2015年9月26日～2016年9月26日)

項目	当期	
	金額	比率
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	14 (11) (1) (2)	0.141 (0.108) (0.011) (0.022)
(b) その他費用 (監査費用) (その他)	1 (0) (0)	0.005 (0.002) (0.004)
合計	15	0.146

(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】

(2016年9月26日現在)

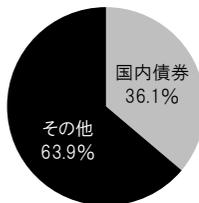
銘柄名	国/地域	比率(%)
1 第869回政府保証公営企業債券	日本	7.9
2 第19回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	日本	6.2
3 第871回政府保証公営企業債券	日本	5.6
4 第3回政府保証西日本高速道路債券	日本	3.1
5 第6回政府保証東日本高速道路債券	日本	2.7
6 第310回中国電力株式会社債	日本	1.3
7 第306回中国電力株式会社債	日本	1.3
8 第8回政府保証西日本高速道路債券	日本	1.3
9 平成18年度第6回静岡県公募債	日本	1.3
10 第10回政府保証中日本高速道路債券	日本	1.3
組入銘柄数		13銘柄

(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 2016 年 9 月 26 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＞

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。

○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。