

# みずほ日本株アクティブ・オープン 〈愛称：トライアングル〉

追加型投信／国内／株式

## 受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、実質的に国内株式を投資対象とし、中長期的に信託財産の成長をはかることをめざして積極的な運用を行います。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

作成対象期間 2020年12月22日～2021年6月21日

第29期	決算日：2021年6月21日	
第29期末 (2021年6月21日)	基準価額	19,081円
	純資産総額	777百万円
第29期	騰落率	4.3%
	分配金合計	0円

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。  
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書(全体版)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、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書(全体版)は受益者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。

## ■運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター **0120-104-694**

(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

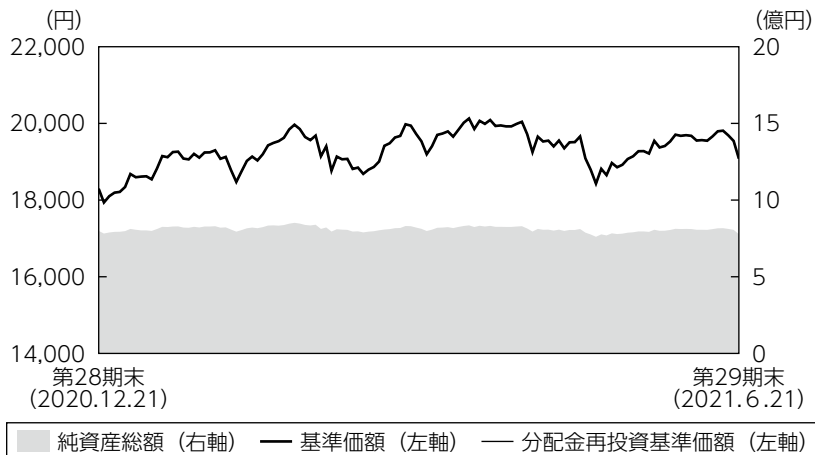
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2 <http://www.am-one.co.jp/>

## 運用経過の説明

### 基準価額等の推移



第29期首：18,294円  
 第29期末：19,081円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：4.3%  
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

世界経済の回復期待を背景に国内株式市場が割安株を中心に上昇した中で、組入れているマザーファンドのパフォーマンスは運用戦略の違いにより差は出たものの、全体としては概ね良好だったことから、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
ハイブリッド・セレクション・マザーファンド	10.1%
D I A M日本株式リサーチアクティブ・マザーファンド	0.9%
D I A M成長株オープン・マザーファンド	△0.6%

## 1 万口当たりの費用明細

項目	第29期		項目の概要
	(2020年12月22日 ～2021年6月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	169円	0.878%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は19,315円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、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等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	( 79)	(0.411)	
(販売会社)	( 79)	(0.411)	
(受託会社)	( 11)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	7	0.035	(b) 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 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 7)	(0.035)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.000)	
(c) その他費用 (監査費用)	0 ( 0)	0.001 (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	176	0.913	

(注1) 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・解約によって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。なお、売買委託手数料は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みません。

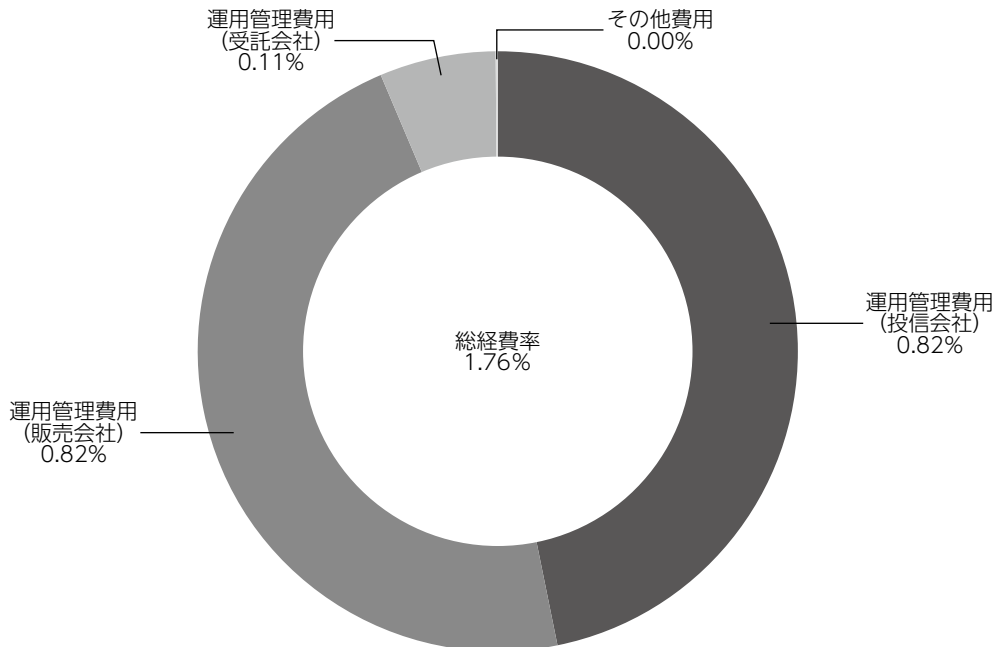
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.76%です。



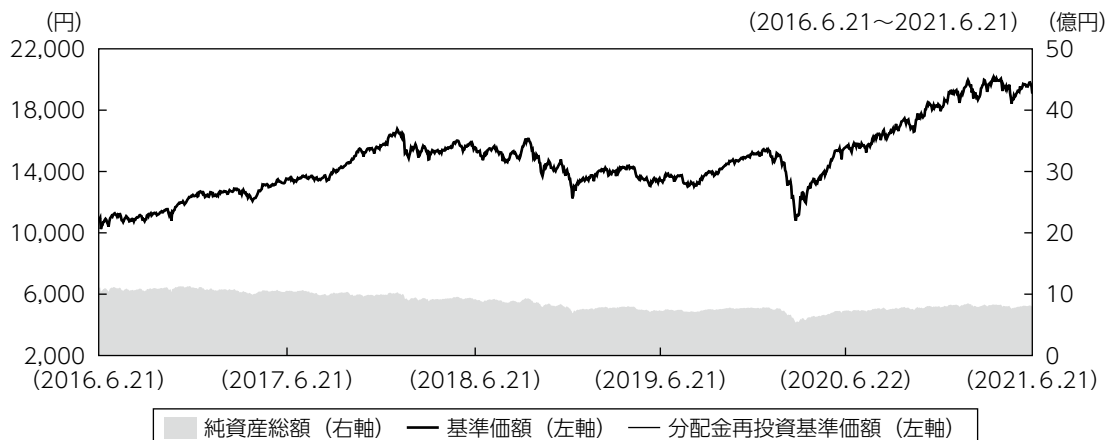
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

## 最近5年間の基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2016年6月21日の基準価額に合わせて指数化しています。

	2016年6月21日 期首	2017年6月21日 決算日	2018年6月21日 決算日	2019年6月21日 決算日	2020年6月22日 決算日	2021年6月21日 決算日
基準価額 (分配落) (円)	10,958	13,503	15,564	13,420	15,574	19,081
期間分配金合計 (税引前) (円)	—	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額の騰落率 (%)	—	23.2	15.3	△13.8	16.1	22.5
参考指数の騰落率 (%)	—	27.3	10.9	△9.6	4.8	22.9
純資産総額 (百万円)	1,109	1,053	919	730	731	777

(注) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。参考指数は東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) です。参考指数については後掲の<当ファンドの参考指数について>をご参照ください。

## 投資環境

国内株式市場は上昇しました。前期末から2021年3月にかけては、米欧などで新型コロナウイルスワクチンの接種が進展したことを背景に景気回復期待が高まり、コロナ禍で株価が低迷していた割安株や景気敏感株の上昇が主導する形で堅調に推移しました。4月から当期末にかけては、米国の物価上昇を受けて金融緩和政策の継続性に対する不透明感が強まったことなどから、一進一退の展開となりました。中小型株式市場は米国における大規模な財政政策の発表や新型コロナウイルスのワクチン接種の進展等を受けて上昇しましたが、1月以降は米国金利の大幅な上昇を受けて一進一退となりました。T O P I Xとの比較では、年明け以降の金利上昇を受けて金利の動きに対して逆相関となりやすいグロース銘柄のリターン悪化が進んだことから高P E R（株価収益率）銘柄の多い東証マザーズ株価指数を中心に中小型株は出遅れる形となりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

期を通じて、基本配分比率（ハイブリッド・セレクトジョン・マザーファンド：50%、D I A M日本株式リサーチアクティブ・マザーファンド：25%、D I A M成長株オープン・マザーファンド：25%）を概ね維持する運用を行いました。

### ●ハイブリッド・セレクトジョン・マザーファンド

ポートフォリオの構成については、経済正常化により景気回復期待が高まる局面と判断し、景気敏感株を中心にバリュー株の比率を高めるなど、相場局面に応じて調整を行いました。個別銘柄については、投資テーマとして「スガノミクス」、「IoT（モノのインターネット）」、「コロナショックと経済回復」、「グリーン社会」の4つを継続し、個別の成長性や割安感などを踏まえて売買を行いました。

### ●D I A M日本株式リサーチアクティブ・マザーファンド

新型コロナウイルス感染症の収束による世界経済の回復を想定し、景気連動性の高い輸送用機器の比率を引き上げました。一方、成長期待は高いものの、株価上昇により割安感の薄れた情報・通信業や小売業など内需株の一部を売却しました。また、再生エネルギーや新分野のITサービスなどにも注目し、関連する銘柄を新たに組み入れました。

### ●D I A M成長株オープン・マザーファンド

中長期成長力に加え、競争力、マネジメントの質、事業収益性、バリュエーションの観点から魅力的と判断した銘柄を中心にポートフォリオを構築しました。当方針に基づき、キリンホールディングス、ファンケル、ヤプリなど中長期的に高成長が期待できる銘柄を新規に組み入れ、株価上昇等により割安感が薄れたZホールディングス、楽天グループやスキー事業の将来見通しが悪化した日本駐車場開発等を全売却しました。

## 【運用状況】

### ○組入上位10銘柄

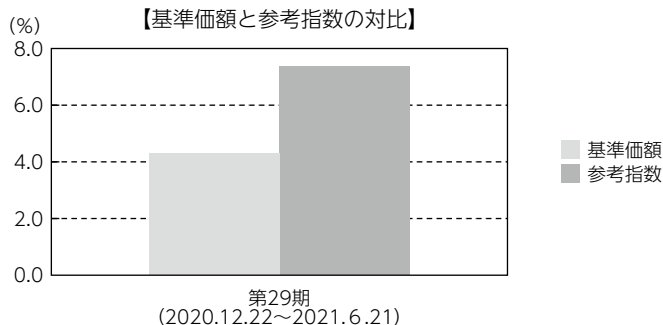
（組入銘柄数：231）

No.	銘柄	業種	組入比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2.5%
2	ソニーグループ	電気機器	2.2
3	富士電機	電気機器	2.0
4	日立製作所	電気機器	1.8
5	デンソー	輸送用機器	1.8
6	東京エレクトロン	電気機器	1.6
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.6
8	イビデン	電気機器	1.5
9	信越化学工業	化学	1.5
10	任天堂	その他製品	1.5

（注）組入比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

## 参考指数との差異

当ファンドはベンチマークを定めておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数である東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、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（1万口当たり）

項目	当期
	2020年12月22日 ～2021年6月21日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	9,640円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。



## 今後の運用方針

### ●当ファンド

基本配分比率は、原則として、ハイブリッド・セクション・マザーファンド：50%、D I AM日本株式リサーチアクティブ・マザーファンド：25%、D I AM成長株オープン・マザーファンド：25%とします。株式の実質組入比率は、原則として高位を維持します。

### ●ハイブリッド・セクション・マザーファンド

今後の株式市場は、当面は金融政策の見直しが議論される中で神経質な動きが続く可能性があると考えます。一方で、世界経済は依然として回復局面が続くと見ており、株式市場は次第に堅調な推移に転じていくと想定しています。運用方針としては、各国の政策動向や世界経済の回復状況などを注視しつつ、グロース株・バリュー株比率や中小型株比率などを調整する方針で臨みます。

### ●D I AM日本株式リサーチアクティブ・マザーファンド

2021年後半の株式市場は、新型コロナウイルスのワクチン接種の広がりに伴う経済再開効果を反映した展開になると見えています。先行する製造業の業績改善に加え、消費の持ち直しによるサービス業や小売業などの回復も想定されます。ポートフォリオについては、内需関連株に加え、再生エネルギーやDX（デジタルトランスフォーメーション）などのテーマに注目しつつ、個別企業の成長性を見極め、株価水準を考慮して構築する方針です。

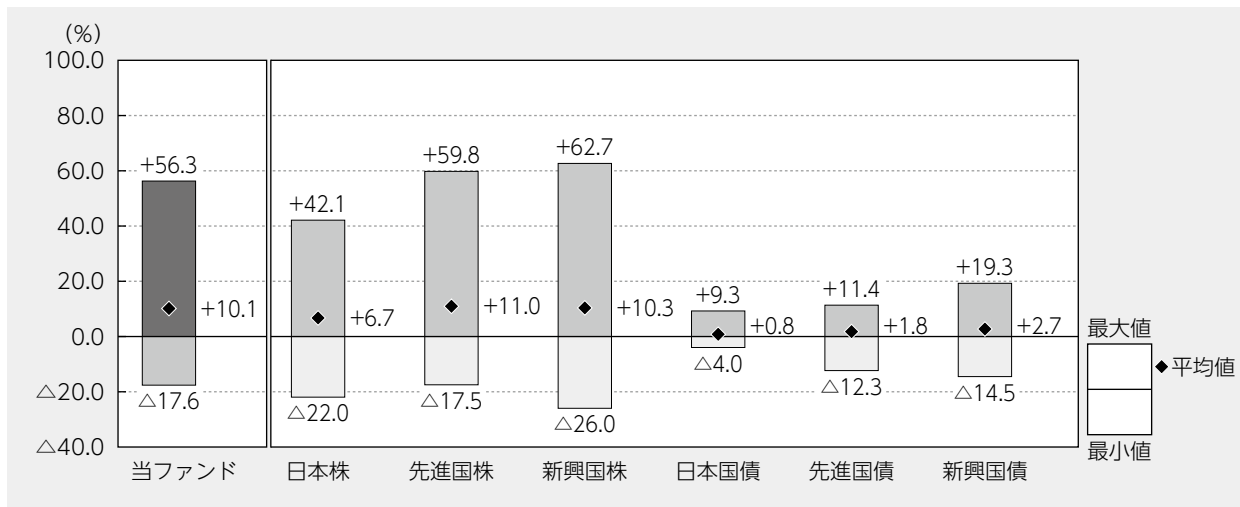
### ●D I AM成長株オープン・マザーファンド

新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、世界経済は再開に向けて動き始めましたが、株式市場はコロナ禍後の業績回復を既に織り込んだと考えるため上値は限られると予想しております。以上の前提に基づき、独自の強みを発揮することで中長期観点で高成長が期待出来る銘柄を主軸にしつつ、世界経済回復の恩恵を受ける割安な製造業関連銘柄の組入れも合わせて強化する予定です。

## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	2006年8月25日から無期限です。	
運用方針	実質的にわが国の株式を主要投資対象とし、中長期的に信託財産の成長をはかることをめざして積極的な運用を行います。	
主要投資対象	みずほ日本株 アクティブ・オープン	以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	ハイブリッド・ セレクション・ マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	D I A M日本株式 リサーチアクティブ・ マザーファンド	わが国の上場株式を主要投資対象とします。
	D I A M成長株 オープン・ マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
運用方法	<p>各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内株式を投資対象とし、積極的な運用を行います。</p> <p>「マルチ・マネージャー方式」により、3つのマザーファンドが、それぞれ独自の投資アイデア、運用手法でポートフォリオを構築することで幅広い投資機会を捉えることをめざします。</p> <p>「トップダウン・アプローチ」と「ボトムアップ・アプローチ」の2つの異なる国内株式運用手法を組み合わせることで、運用手法の分散を図ります。</p> <p>各マザーファンド受益証券への基本配分比率を定め、投資を行います。</p> <p>時価変動等によって各マザーファンドの時価構成比が基本配分比率から乖離した場合には、毎決算時に原則として基本配分比率に修正します。</p>	
分配方針	決算日（原則として6月、12月の各21日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。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。	

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較



2016年6月～2021年5月

(注1) 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2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、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3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

### \*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…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GBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)

(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。

※各指数については後掲の<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。

## 当ファンドのデータ

### 当ファンドの組入資産の内容（2021年6月21日現在）

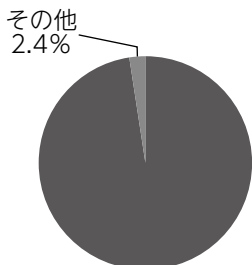
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：3ファンド)

	当期末
	2021年6月21日
ハイブリッド・セレクション・マザーファンド	49.9%
D I A M日本株式リサーチアクティブ・マザーファンド	24.0
D I A M成長株オープン・マザーファンド	23.7
その他	2.4

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

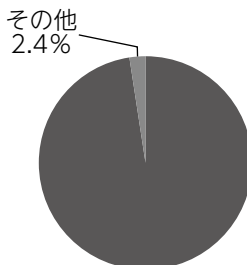
(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

#### ◆資産別配分



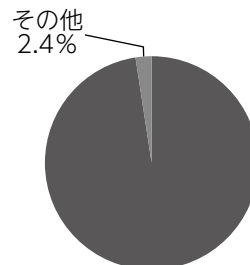
親投資信託受益証券  
97.6%

#### ◆国別配分



日本  
97.6%

#### ◆通貨別配分



日本・円  
97.6%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

### 純資産等

項目	当期末
	2021年6月21日
純資産総額	777,684,478円
受益権総口数	407,566,671口
1万口当たり基準価額	19,081円

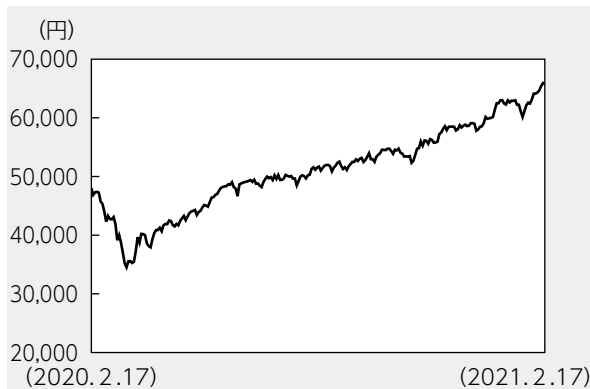
(注) 当期中における追加設定元本額は227,341円、同解約元本額は29,379,380円です。

## 組入ファンドの概要

[ハイブリッド・セレクション・マザーファンド]

(計算期間 2020年2月18日～2021年2月17日)

### ◆基準価額の推移



### ◆組入上位10銘柄 (現物)

銘柄名	通貨	比率
ソニー	日本・円	4.4%
日本電産	日本・円	3.0
ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
イビデン	日本・円	2.5
富士電機	日本・円	2.5
東京エレクトロン	日本・円	2.3
信越化学工業	日本・円	2.3
日本製鉄	日本・円	2.3
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.2
デンソー	日本・円	2.2
組入銘柄数	91銘柄	

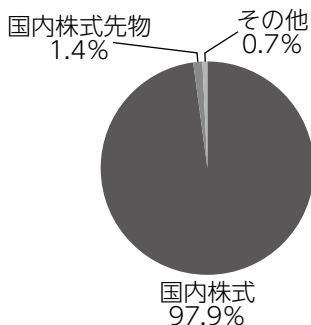
### ◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料	61円	0.120%
(株式)	(61)	(0.119)
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)
合計	61	0.120

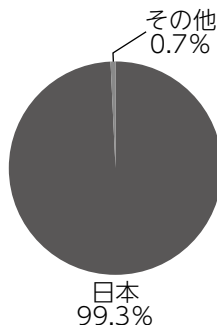
### ◆組入上位銘柄 (先物)

銘柄名	売買	比率
TOPIX	買建	1.4%
組入銘柄数	1銘柄	

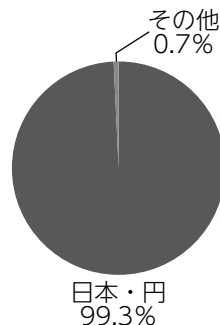
### ◆資産別配分



### ◆国別配分



### ◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 1万口当たりの費用明細の金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(51,077円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については2ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

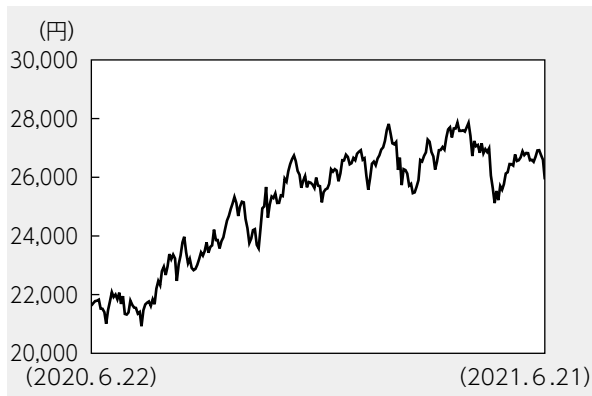
(注5) 国別配分、通貨別配分については、現物と先物の比率を合計して表示しています。

(注6) その他は、純資産総額を100%として、現物と先物の比率を差し引いたものです。

(注7) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

【DIAM日本株式リサーチアクティブ・マザーファンド】（計算期間 2020年6月23日～2021年6月21日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄

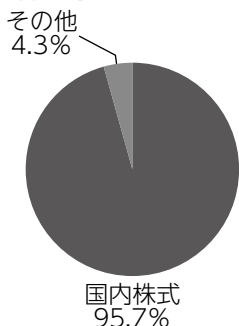
銘柄名	通貨	比率
任天堂	日本・円	3.5%
トヨタ自動車	日本・円	3.1
デンソー	日本・円	2.7
富士電機	日本・円	2.7
東京エレクトロン	日本・円	2.5
リクルートホールディングス	日本・円	2.3
セブン&アイ・ホールディングス	日本・円	2.1
信越化学工業	日本・円	1.9
日立製作所	日本・円	1.9
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.9
組入銘柄数	62銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

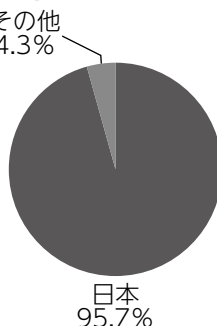
項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株式)	34円 (34)	0.134% (0.134)
合計	34	0.134

期中の平均基準価額は25,119円です。

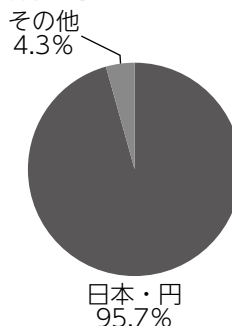
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 「1万口当たりの費用明細」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・解約によって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。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。なお、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3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

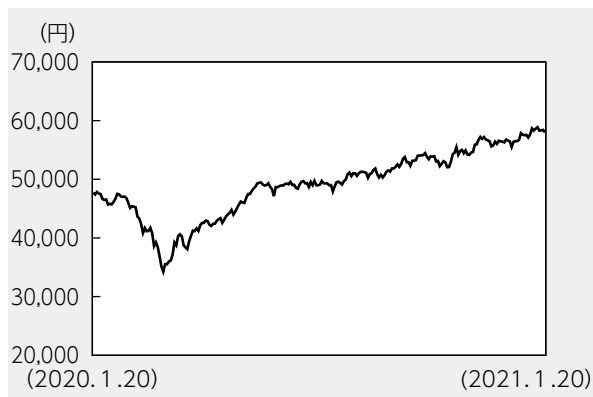
(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注6) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

【DIAM成長株オープン・マザーファンド】（計算期間 2020年1月21日～2021年1月20日）

◆基準価額の推移



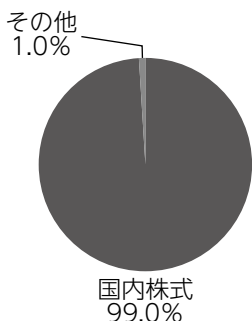
◆組入上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
GMOペイメントゲートウェイ	日本・円	3.5%
日本M&Aセンター	日本・円	3.4
朝日インテック	日本・円	3.0
エムスリー	日本・円	3.0
浜松ホトニクス	日本・円	2.6
ファーストリテイリング	日本・円	2.5
中外製薬	日本・円	2.4
イー・ギャランティ	日本・円	2.2
ディスコ	日本・円	2.2
コスモス薬品	日本・円	2.1
組入銘柄数	129銘柄	

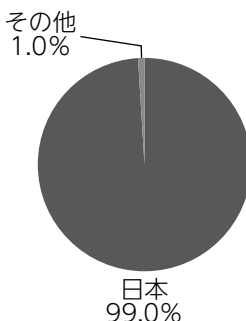
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株式)	12円 (12)	0.024% (0.024)
合計	12	0.024

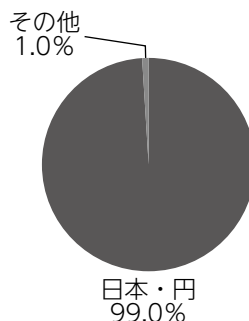
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 1万口当たりの費用明細の金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（49,173円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については2ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注6) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

## <当ファンドの参考指数について>

### ●東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）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・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈱東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## <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>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）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は、㈱東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の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。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」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債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。