

受益者の皆様へ

毎々格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「豪州高配当株ツインαファンド（毎月分配型）」は、第77期から第82期の決算を行いました。

当ファンドは外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツインαファンド」（以下、外国投資信託）を通じて、オーストラリアの証券取引所に上場する高配当株式等に投資し、相対的に高いインカムゲインの獲得と中長期的な信託財産の成長を目指します。また、外国投資信託においては、スワップ取引を通じて実質的に豪州株式市場全体（株価指数等）のオプション取引（コールオプションの売却）および通貨のオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。当作成対象期間につきましてもそれに沿った運用を行いました。

ここに運用状況をご報告申し上げます。今後ともより一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

当ファンドは、約款において運用報告書（全体版）を電子交付することが定められています。運用報告書（全体版）については下記の手順でご覧いただけます。なお、書面をご要望の場合は、販売会社までお問い合わせください。

<閲覧方法>

右記URL⇒ファンド情報⇒当ファンド名を選択⇒各種資料のダウンロード⇒「運用報告書（全体版）」を選択

**豪州高配当株
ツインαファンド
（毎月分配型）**

商品分類（追加型投信／海外／資産複合）

第14作成期

第77期（2019年2月25日） 第80期（2019年5月27日）
第78期（2019年3月25日） 第81期（2019年6月25日）
第79期（2019年4月25日） 第82期（2019年7月25日）
作成対象期間：2019年1月26日～2019年7月25日

| 第82期末（2019年7月25日） | |
|-------------------|----------|
| 基準価額 | 2,195円 |
| 純資産総額 | 5,764百万円 |
| 第77期～第82期 | |
| 騰落率 | 7.6% |
| 分配金合計 | 300円 |

（注）騰落率は収益分配金（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す。

T&Dアセットマネジメント株式会社

〒108-0014 東京都港区芝5-36-7

お問い合わせ先

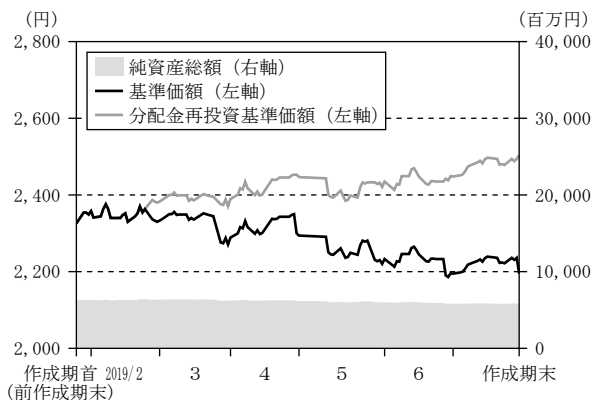
投信営業部 03-6722-4810

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

<https://www.tdasset.co.jp/>

運用経過

基準価額等の推移



第77期首：2,326円
 第82期末：2,195円（既払分配金300円）
 騰落率：7.6%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2019年1月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。
- (注) 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) 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。

基準価額の主な変動要因

高位に組み入れている外国投資信託において、保有しているオーストラリア高配当株式の価格上昇などがプラス寄与した結果、基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率

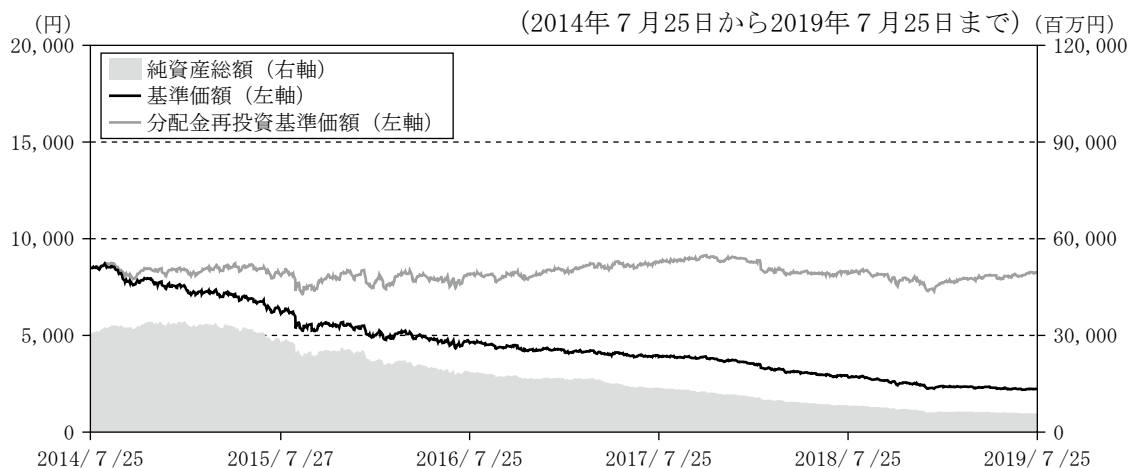
| 組入ファンド | 騰落率 |
|---|------|
| クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト (ケイマン) II-豪州高配当株・ツインαファンド | 8.6% |
| T&Dマネープールマザーファンド | △0.0 |

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第77期～第82期 | | 項目の概要 |
|--|----------------------------------|---|---|
| | 2019/1/26～2019/7/25 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| 平均基準価額 | 2,283円 | | 作成期間の平均基準価額です。 |
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社) | 16円 (6) (10) (0) | 0.712% (0.268) (0.428) (0.016) | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 購入後の情報提供、運用報告書各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 運用財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 (投資信託証券) | 0 (0) | 0.018 (0.018) | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料／作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) その他費用 (監査費用) (その他) | 0 (0) (0) | 0.007 (0.007) (0.000) | (c) その他費用＝作成期間のその他費用／作成期間の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託に係る手数料 |
| 合計 | 16 | 0.737 | |

- (注) 作成期間の費用（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。
- なお、その他費用は、当ファンドが組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) 平均基準価額の円未満は切捨て、それ以外の各金額は項目ごとに四捨五入してあります。
- (注) 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（親投資信託を除く。）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間末時点における「1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」に表示することとしております。
- (注) 「比率」欄は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）を作成期間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。

最近5年間の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2014年7月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 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) 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。

| | 2014年7月25日 期初 | 2015年7月27日 決算日 | 2016年7月25日 決算日 | 2017年7月25日 決算日 | 2018年7月25日 決算日 | 2019年7月25日 決算日 |
|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額（分配落）（円） | 8,486 | 6,126 | 4,626 | 3,879 | 2,843 | 2,195 |
| 期間分配金合計（税込み）（円） | — | 2,040 | 1,480 | 1,050 | 840 | 640 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率（%） | — | △ 4.7 | 0.6 | 7.6 | △ 5.9 | 0.6 |
| 純資産総額（百万円） | 30,495 | 27,814 | 18,532 | 13,608 | 8,146 | 5,764 |

(注) 当ファンドは豪州高配当株とオプション取引を組合わせた運用を行っており、比較対象として適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

■ オーストラリア株式市況

当作成期のオーストラリア株式市場は上昇しました。2019年2月、豪金融機関の不正行為を調査していた王立委員会が最終報告を公表しましたが、その中の勧告に大手金融機関への過度な規制が含まれず、予想より厳しいものとならなかったことが市場心理の改善につながり、株価は上昇しました。その後は、RBA（オーストラリア準備銀行）によるインフレ見通しの下方修正や、市場予想を下回る2018年10-12月期豪実質GDP成長率などを受けて、RBAによる利下げへの期待が強まったことなどが株価の下支えとなりました。4月から5月にかけては、中国の経済指標の予想外の堅調さを背景に、世界経済減速への過度な警戒感が後退したことや、オーストラリアの主要輸出品目である鉄鉱石価格が上昇基調で推移したことなどが株価の上昇要因となりました。オーストラリアの総選挙の結果を受けて、続投となるモリソン政権の経済政策への期待が強まったことも株価の好材料となりました。作成期末にかけては、RBAによる利下げの決定や、主要国株式市場の堅調さがオーストラリア株式市場の追い風となりました。

■ 為替市況

豪ドルは対円で下落しました。作成期初から4月中旬にかけては、オーストラリアの消費や雇用関連の経済指標の堅調さが豪ドルの買い材料となった一方、RBAのロウ総裁が、失業が増え、インフレの停滞が続く場合においては利下げする可能性があるとの考えを示したことなどを背景に、利下げ観測が強まったことが売り材料となって、豪ドルは円に対し一進一退する展開となりました。その後は、1-3月期豪消費者物価指数が約3年ぶりの低い伸びとなったことや、4月の豪雇用統計で失業率が市場予想を上回ったことなどから、豪ドルは円に対し下落しました。作成期末にかけては、米中貿易摩擦の深刻化やグローバル経済におよぼす悪影響への懸念が投資家心理の悪化につながったこと、RBAが利下げを決定し、さらなる利下げの可能性に言及したことなどが重石となって、豪ドルは円に対し上値の重い展開となりました。

■ 国内短期金融市況

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、作成期首の $\Delta 0.21\%$ から作成期末は $\Delta 0.13\%$ となりました。作成期中においては、需給悪化懸念や日銀の国庫短期証券買入オペ動向を巡る不透明感などが金利上昇要因となり、海外勢による需要や担保需要などが金利低下要因となりました。

当該投資信託のポートフォリオ

■ 当ファンド

作成期を通じて、「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツイン α ファンド」を概ね高位に組入れ、「T&Dマネープールマザーファンド」にも投資を行いました。

■ クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツイン α ファンド

主としてオーストラリアの高配当株式および投資信託証券（不動産投資信託（リート）を含む）への投資を行うと同時に、スワップ取引を通じて、オーストラリア株式市場全体（株価指数等）にかかるコールオプションを売却する「株式オプション α 戦略」および、円に対する豪ドルのコールオプションを売却する「通貨オプション α 戦略」を組合わせた運用を行いました。

■ T&Dマネープールマザーファンド

国庫短期証券の利回りがマイナスで推移したため組入れを見送り、作成期を通じて組入比率は0%としました。資産については、全額コールローン等で運用を行いました。

当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載しておりません。

分配金

1万口当たりの分配金（税込み）は、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、第77期から第82期まで各50円とさせていただきます。収益分配に充てなかった利益は、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

（単位：円・％、1万口当たり・税引前）

| 項目 | 第77期 | 第78期 | 第79期 | 第80期 | 第81期 | 第82期 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2019年1月26日 ～2019年2月25日 | 2019年2月26日 ～2019年3月25日 | 2019年3月26日 ～2019年4月25日 | 2019年4月26日 ～2019年5月27日 | 2019年5月28日 ～2019年6月25日 | 2019年6月26日 ～2019年7月25日 |
| 当期分配金 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 |
| （対基準価額比率） | 2.095 | 2.150 | 2.128 | 2.192 | 2.232 | 2.227 |
| 当期の収益 | 46 | 47 | 47 | 47 | 46 | 47 |
| 当期の収益以外 | 3 | 2 | 2 | 2 | 3 | 2 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,180 | 1,178 | 1,176 | 1,174 | 1,171 | 1,170 |

（注）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、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点以下切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。

今後の運用方針

■ 当ファンド

主要投資対象である「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツイン α ファンド」への投資比率を高位に保ち、もう一方の投資対象である「T&Dマネープールマザーファンド」への投資も継続する方針です。

■ クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツイン α ファンド

主としてオーストラリアの高配当株式および投資信託証券（不動産投資信託（リート）を含む）に投資することにより、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。また、スワップ取引を通じて、「株式オプション α 戦略」および「通貨オプション α 戦略」を活用し、引続き年率15%の目標オプション料（プレミアム収入）の獲得を目指します。

■ T&Dマネープールマザーファンド

日本経済は、雇用・所得環境の改善が続くなかで、緩やかな回復が続くことが期待されます。インフレ率は緩やかに上昇していくことが見込まれるものの、依然、基調的なインフレ圧力は弱く、インフレ期待が急速に高まる可能性は低いとみられます。こうしたなか、日銀の「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が金利抑制要因として作用することから、国内短期金利は低位で推移すると予想します。

相対的に金利リスクの高い長期債への投資は見送り、国庫短期証券や短期金融商品等を中心とした安定的な運用を行います。

お知らせ

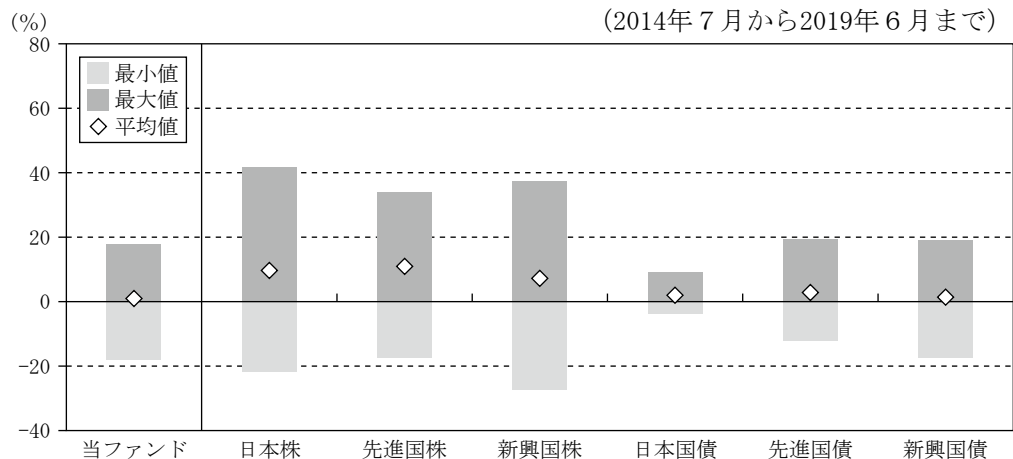
2019年4月25日適用で、信託期間を延長し、信託終了日を2020年7月27日から2023年4月25日とするよう約款変更を行いました。

当該投資信託の概要

| | | |
|-------------|--|---|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／海外／資産複合 | |
| 信 託 期 間 | 2012年8月31日から2023年4月25日まで | |
| 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 運 用 対 象 | 豪州高配当株ツインα ファンド (毎月分配型) | 外国投資信託である「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト (ケイマン) II-豪州高配当株・ツインαファンド」および親投資信託である「T&Dマネープールマザーファンド」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。 |
| | クレディ・スイス・ ユニバーサル・ トラスト (ケイマン) II- 豪州高配当株・ ツインαファンド | 主としてオーストラリアの証券取引所に上場している株式および投資信託証券 (不動産投資信託 (リート) を含みます。) に投資することにより、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。また、スワップ取引を通じて、実質的に豪州株式市場全体 (株価指数等) のオプション取引 (コールオプションの売却) および通貨のオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。 |
| | T&Dマネープール マザーファンド | わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。 |
| 組 入 制 限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 株式への直接投資は行いません。 | |
| 分 配 方 針 | 毎決算時 (毎月25日、休業日の場合は翌営業日) に分配を行います。ただし、必ず分配を行うものではありません。 分配金額は、分配対象額の範囲内で委託会社が決定するものとし、原則として、インカム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。 | |

【参考情報】

■ 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 |
|-----|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|
| 平均値 | 1.0 | 9.7 | 11.0 | 7.3 | 2.0 | 2.8 | 1.4 |
| 最大値 | 17.9 | 41.9 | 34.1 | 37.2 | 9.3 | 19.3 | 19.3 |
| 最小値 | △18.2 | △22.0 | △17.5 | △27.4 | △4.0 | △12.3 | △17.4 |

(注) 上記は、2014年7月から2019年6月の5年間の各月末における直近1年間騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

(注) 当ファンドおよび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あり、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) 騰落率は直近月末から60ヵ月遡って算出した結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 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 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、円ベースの指数を採用しております。

※詳細は後述の「指数に関して」をご参照ください。

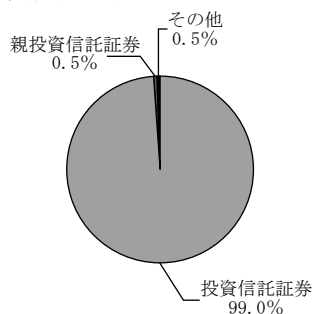
当該投資信託のデータ

当該ファンドの組入資産の内容

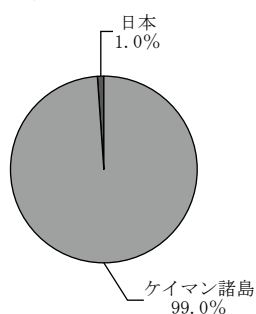
■ 組入（上位）ファンド（銘柄）

| 銘柄名 | 第82期末 |
|--|------------|
| | 2019年7月25日 |
| | 比率 |
| クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）II-豪州高配当株・ツインαファンド | 99.0% |
| T&Dマネープールマザーファンド | 0.5 |
| その他 | 0.5 |

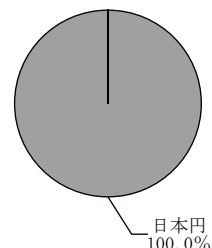
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注) 組入（上位）ファンド（銘柄）および各配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 国別配分は発行国を表示しております。

※詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）をご覧ください。

純資産等

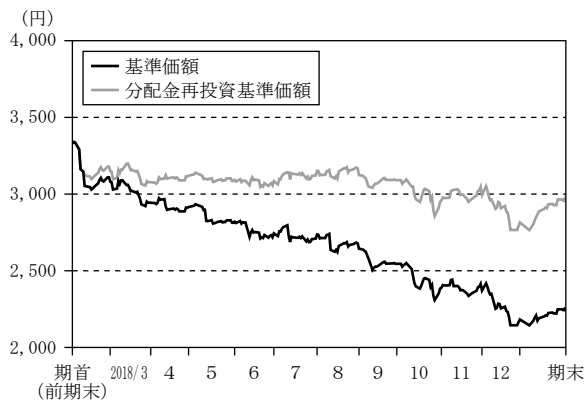
| 項目 | 第77期末 | 第78期末 | 第79期末 | 第80期末 | 第81期末 | 第82期末 |
|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 2019年2月25日 | 2019年3月25日 | 2019年4月25日 | 2019年5月27日 | 2019年6月25日 | 2019年7月25日 |
| 純資産総額 | 6,346,329,619円 | 6,187,378,934円 | 6,150,130,991円 | 6,020,462,778円 | 5,804,063,494円 | 5,764,688,940円 |
| 受益権総口数 | 27,159,501,005口 | 27,180,261,182口 | 26,743,473,956口 | 26,990,928,652口 | 26,497,006,517口 | 26,264,873,839口 |
| 1万口当たり基準価額 | 2,337円 | 2,276円 | 2,300円 | 2,231円 | 2,190円 | 2,195円 |

(注) 当作成期間（第77期～第82期）中における追加設定元本額は2,895,967,123円、同解約元本額は3,410,527,365円です。

組入上位ファンドの概要

クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツインαファンド（2018年2月1日から2019年1月31日まで）

■ 基準価額の推移



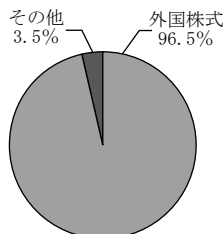
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首（2018年1月31日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。
- (注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

■ 1口当たりの費用明細

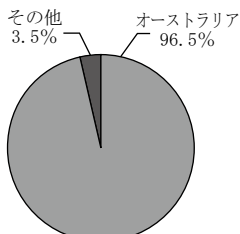
| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-----------|--------|--------|-------------------------------|
| 平均時価 | 2,634円 | | 期中の平均時価です。 |
| (a) 信託報酬 | 13 | 0.500% | (a) 信託報酬＝期中平均時価×信託報酬率 |
| (b) 売買手数料 | 1 | 0.042 | (b) 売買手数料＝期中の売買委託手数料／期末の受益権口数 |
| (c) その他費用 | 6 | 0.221 | (c) その他費用＝期中のその他費用／期末の受益権口数 |
| 合計 | 20 | 0.763 | |

- (注) 各費用は追加・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。
- (注) 平均時価の円未満は切捨て、それ以外の各金額は項目ごとに四捨五入してあります。
- (注) 「比率」欄は1口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均時価で除して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。

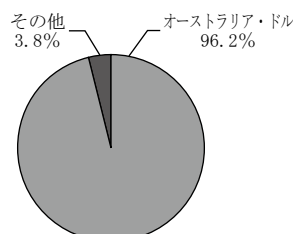
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



- (注) 組入銘柄、スワップ取引の状況および各配分のデータは直近の決算日現在のものです。日付は現地基準です。
- (注) 組入銘柄、スワップ取引の状況および各配分の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、スワップ取引の状況、費用明細および各配分はバンクオブニューヨークメロン証券株式会社より入手した情報をもとに作成しております。
- (注) 外国株式には、リートを含みます。
- ※詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）をご覧ください。

■ 上位10銘柄

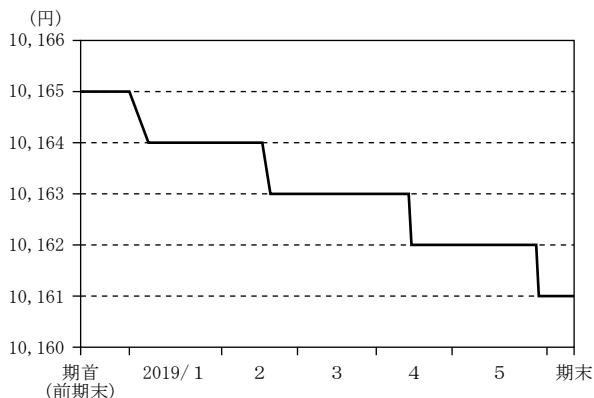
（組入銘柄数：41銘柄）

| 銘柄名 | 業種 | 比率 |
|--------------------------------|----------|------|
| AGL ENERGY LTD | 公益事業 | 6.2% |
| AUST AND NZ BANKING GROUP | 銀行 | 5.6 |
| TELSTRA CORP LTD | 電気通信サービス | 5.1 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | エネルギー | 4.5 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 銀行 | 4.1 |
| WESTPAC BANKING CORP | 銀行 | 3.9 |
| SCENTRE GROUP | 不動産 | 3.7 |
| STOCKLAND | 不動産 | 3.7 |
| WESFARMERS LTD | 小売 | 3.5 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 銀行 | 3.4 |

■ スワップ取引の状況

| 想定元本額 | 評価額 | 比率 |
|----------------|--------------|-------|
| 6,220,105,063円 | △73,726,905円 | △1.2% |

■ 基準価額の推移



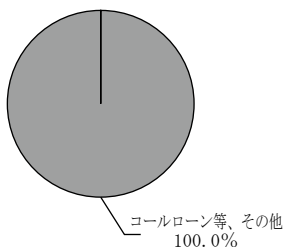
■ 組入銘柄

当期末における組入れはありません。

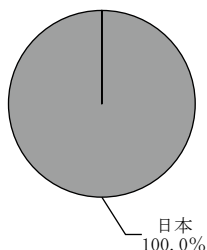
■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | |
|----------------|----------------------|-------------------|
| | 2018/12/11~2019/6/10 | |
| | 金額 | 比率 |
| 平均基準価額 | 10,163円 | |
| その他費用 (その他) | 0円 (0) | 0.003% (0.003) |
| 合計 | 0 | 0.003 |

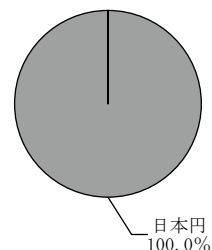
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注) 各配分のデータは直近の決算日現在のものです。

(注) 各配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 国別配分は発行国を表示しております。

(注) 1万口当たりの費用明細は直近の決算期のものです。その他費用のその他は、金銭信託に係る手数料です。

※詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)をご覧ください。

指数に関して

○「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）（配当込み）

東証株価指数（TOPIX）とは、東証第一部上場全銘柄の時価総額を基準時の時価総額で除して算出したわが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する一切の知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

MSCIコクサイ・インデックスはMSCIが開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国の株式市場の動きを捉える指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はMSCI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・インデックスは、MSCIが開発した新興国の株式市場の動きを捉える株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はMSCIに帰属します。

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表している指数で、日本で発行されている公募利付国債の市場全体を表す投資収益指数です。その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスを用いて行われるT&Dアセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し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、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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、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。

JPMorganGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ベース）

JPMorganGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPMorgan社が算出し公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成されている指数です。同指数の著作権はJPMorgan社に帰属します。