

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、「ロボット戦略Ⅱ 世界成長ファンド」は、2021年5月25日に第6期決算を行いました。

当ファンドはアイルランド籍投資法人「マン・ファンズ・VI plc」のサブファンドである「マン・AHL・ターゲットリスク」が発行する外国投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等の幅広い資産に投資を行い、値上がり益の獲得を目指します。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。

ロボット戦略Ⅱ 世界成長ファンド

愛称: あんしんロボ

商品分類（追加型投信／内外／資産複合）

第6期（決算日 2021年5月25日）
作成対象期間：2020年11月26日～2021年5月25日

第6期末（2021年5月25日）	
基準価額	10,040円
純資産総額	5,791百万円
第6期	
騰落率	2.7%
分配金合計	250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。

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



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

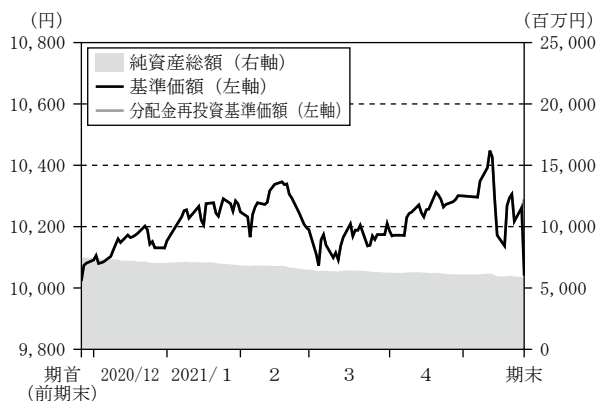
投信営業部 03-6722-4810

（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6期首：10,023円

第6期末：10,040円（既払分配金250円）

騰落率：2.7%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、期首（2020年11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。

基準価額の変動要因

高位に組入れている「マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）」において、国債セクターがマイナス寄与し、インフレ連動債はほぼ中立となりましたが、株式、社債、商品セクターがプラス寄与し、基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。

■ 組入ファンドの当期中の騰落率

組入ファンド	騰落率
マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）	3.3%
T&Dマネーアカウンタマザーファンド	△0.0

1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020/11/26～2021/ 5/25		
	金額	比率	
平均基準価額	10,194円		期中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）	46円 （ 17） （ 27） （ 2）	0.447% (0.164) (0.267) (0.016)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×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、運用報告書等各種書類の送付、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) その他費用 （監査費用）	1 （ 1）	0.009 (0.009)	(b) 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係る費用
合計	47	0.456	

(注) 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。

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。

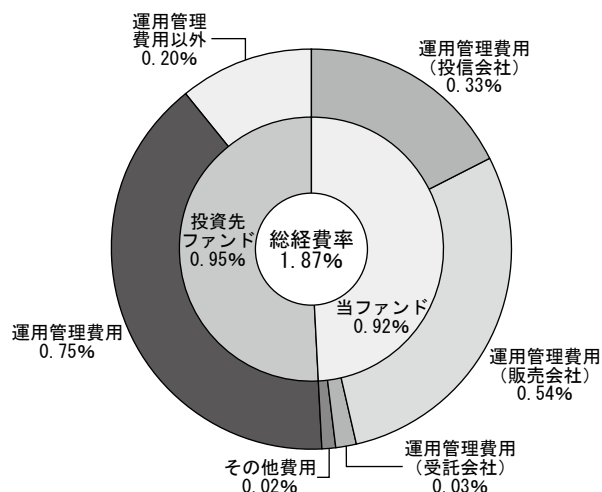
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

(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）を期中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。

(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（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除く。）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、1.87%です。



総経費率 (①+②+③)	1.87%
①当ファンドの費用の比率	0.92%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.75%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.20%

(注) ①の費用は、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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

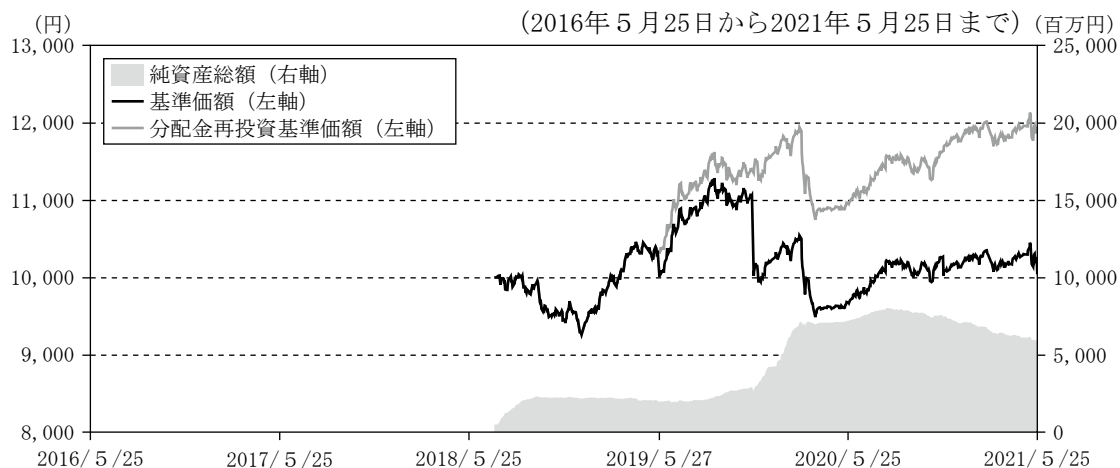
(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（親投資信託を除く）です。

(注) ①の費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 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は異なります。

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、設定日（2018年7月17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。

	2018年7月17日 設定日	2019年5月27日 決算日	2020年5月25日 決算日	2021年5月25日 決算日
基準価額（分配前）（円）	10,000	10,019	9,676	10,040
期間分配金合計（税込み）（円）	—	300	1,000	500
分配金再投資基準価額の騰落率（％）	—	3.2	6.2	9.0
純資産総額（百万円）	493	1,957	7,187	5,791

(注) 当ファンドは、特定の指数に連動すること・指数を上回ることを目的として運用していないため、また、運用方針に対し適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額には、当初元本を用いております。

■ 株式市場

期初から2021年1月中旬にかけては、欧米での新型コロナウイルスワクチンの接種開始や、米国で民主党大統領の下、議会も上下両院とも民主党が多数派となったことで、バイデン新政権による追加経済対策への期待を背景に株価は上昇しました。1月下旬には、個人投資家を中心とした投機的売買の影響による米国株式市場の一時的な不安定化等を受けて株価は弱含みました。2月から4月中旬にかけては、米長期金利上昇や新型コロナウイルス変異株の感染拡大などが時折重しとなりつつも、米国の新型コロナウイルスワクチンの接種進展による経済活動正常化への期待や追加経済対策の成立などを背景に、株価は上昇基調で推移しました。そのなかで、中国では、当局による金融引締め観測や新疆ウイグル自治区での人権侵害に対する米国やEU（欧州連合）による制裁措置の発表を背景に、株価が軟化しました。期末にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大や米国のキャピタルゲイン課税の強化、インフレ加速に対する警戒等から株価は上値が重くなりました。

■ 債券市場

期初から2020年12月末にかけては、新型コロナウイルスの感染状況やワクチンの接種開始などを巡り、金利は方向感を欠く展開となりました。概ね横ばいとなりました。2021年1月から2月末にかけては、米国では、バイデン新政権が発表した追加経済対策や新型コロナウイルスワクチンの接種進展による経済活動正常化への期待を背景にインフレ懸念が高まり、金利が大幅に上昇しました。欧州や日本でも、米国に追随し金利が上昇しました。3月には、FRB（米連邦準備制度理事会）が金利の上昇をさほど警戒していない、との見方を受け、米国では金利が一段と上昇する一方で、ECB（欧州中央銀行）の債券購入ペース引上げ決定や日銀の金融緩和継続の姿勢を受け、欧州や日本では金利上昇が抑制されました。4月に入り、米国では、金利上昇が一服し、期末にかけては、金融政策への思惑やインフレ懸念を巡り金利は上下し、方向感を欠く展開となりました。その間、欧州では、新型コロナウイルスワクチンの接種進展を受けた景気回復期待から金利が上昇し、日本では、国内の新型コロナウイルス感染再拡大を受け下落するなど、各国まちまちで推移しました。

■ その他市場

インフレ連動債は、資源価格上昇や景気回復への期待から期待インフレ率が上昇基調で推移するなか、各国まちまちの展開となりました。米国では、期初から2020年12月末は実質金利の低下から堅調に推移し、2021年1月から3月下旬にかけて国債金利の大幅な上昇を受けた実質金利の上昇で大きく軟化した後、期末にかけて再び堅調に推移し、期を通じては概ね横ばいとなりました。欧州でも、国債金利の上昇を受けて実質金利が上昇する場面もありましたが、インフレ懸念の加速から、期を通じては実質金利が低下し、堅調となりました。英国では、2月に実質金利が上昇した以外は、概ね横ばいで推移し、軟調となりました。

社債は、1月には米国株式市場の一時的な不安定化を受けたリスク回避の動き、2月下旬以降には米長期金利の上昇などを背景に、信用スプレッド（信用リスクを反映した上乗せ金利）が拡大する場面もありましたが、米国の追加経済対策や新型コロナウイルスワクチンの接種進展による経済

活動正常化への期待を受け、期を通じては、信用スプレッドがじりじりと縮小しました。

商品指数全体では、期初から2月末まで上昇後、3月にやや弱含み、期末にかけて再び上昇しました。原油価格や銅などのベース金属は、新型コロナウイルスの感染拡大による需要悪化懸念等が上値を抑える場面もありましたが、米国の新型コロナウイルスワクチンの接種進展による経済活動正常化への期待や中国のインフラ投資による需要増加観測などを背景に、上昇基調で推移しました。穀物、ソフト商品は、天候不順に伴う生産減や中国の輸入増加、市場予想を下回る作付け予定農地面積等を背景に、幅広く価格が堅調となりました。一方、金価格は、米国の財政支出増加観測を巡るインフレヘッジや金利動向を材料に上下し、期を通じては小幅な値動きとなりました。

■ 国内短期金融市場

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期首の $\Delta 0.10\%$ から期末は $\Delta 0.13\%$ となりました。期中においては、国庫短期証券の入札に伴う需給悪化懸念などが金利上昇要因となり、日銀の買入オペ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

「マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）」の組入比率は概ね高位を保ちました。また、「T&Dマネーアカウントマザーファンド」を組入れました。

■ マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）

世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等の幅広い資産クラスを投資対象とし、コンピュータープログラムを利用してポジションを構築し、市場環境に応じてエクスポージャーを増減させることで、中期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行いました。

■ T&Dマネーアカウントマザーファンド

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、期を通じて組入比率は0%となりました。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）は基準価額水準、市況動向等を勘案し、250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	当期
	2020年11月26日 ～2021年 5 月25 日
当期分配金	250
（対基準価額比率）	2.430
当期の収益	250
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	39

（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

「マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスク—日本円クラス（ヘッジ付）」の組入比率を高位に保ち、「T&Dマネーアカウントマザーファンド」を組入れた運用を行う方針です。

■ マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスク—日本円クラス（ヘッジ付）

世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等の幅広い資産クラスを投資対象とし、コンピュータープログラムを利用してポジションを構築し、市場環境に応じてエクスポージャーを増減させることで、中期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

■ T&Dマネーアカウントマザーファンド

日本経済は、当面、国内外における新型コロナウイルスの感染拡大の影響から厳しい状態が続くとみられます。また、インフレ率についても、新型コロナウイルスの感染拡大などの影響を受けて弱含むとみられます。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。

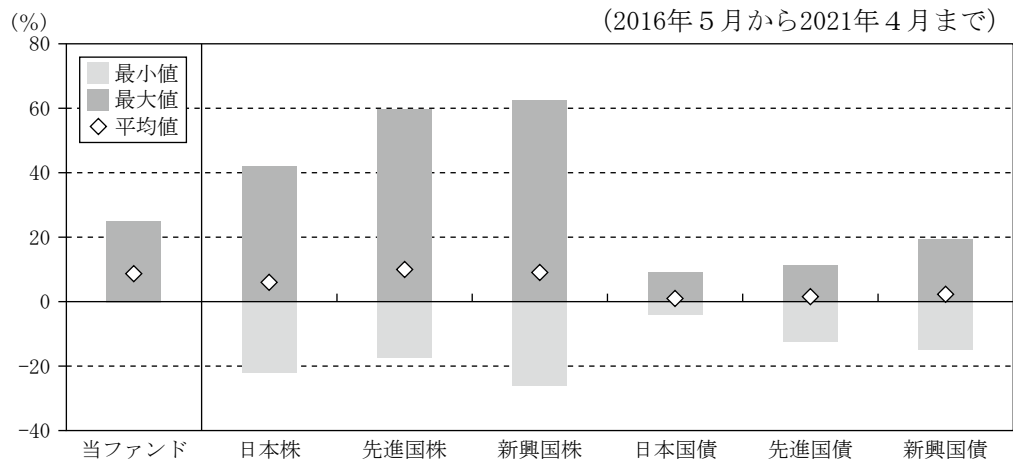
相対的に金利リスクの高い長期債への投資は見送り、国庫短期証券や短期金融商品等を中心とした安定的な運用を行います。

当 該 投 資 信 託 の 概 要

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合	
信 託 期 間	2018年 7 月 17日から2023年11月27日まで	
運 用 方 針	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	アイルランド籍投資法人「マン・ファンズ・VI plc」のサブファンドである「マン・AHL・ターゲットリスク」が発行する外国投資信託証券「日本円クラス（ヘッジ付）」および国内の証券投資信託である「T&Dマネーアカウンタマザーファンド」を主要投資対象とします。	
	マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスク－日本円クラス（ヘッジ付）	デリバティブ取引を積極的に活用し、世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等を主要投資対象とします。
	T&Dマネーアカウンタマザーファンド	わが国の国債、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。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 有価証券先物取引等の派生商品取引の指図は行いません。	
分 配 方 針	毎決算時（5月と11月の各25日、休業日の場合は翌営業日）に分配を行います。分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。	

【 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	8.6	6.0	10.0	9.0	1.0	1.6	2.3
最大値	25.0	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値	△ 0.5	△22.0	△17.5	△26.1	△4.0	△12.3	△15.0

(注) 上記は、2016年5月から2021年4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。

(注) 当ファンドは2018年7月17日に設定されたため、2019年7月以降のデータをもとに表示しております。

○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・ディバーシファイド（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。

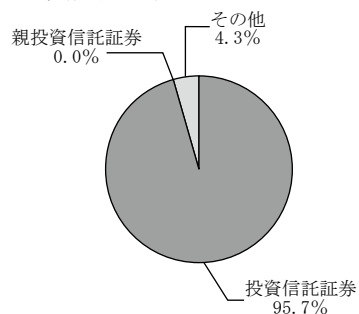
当該投資信託のデータ

当該ファンドの組入資産の内容

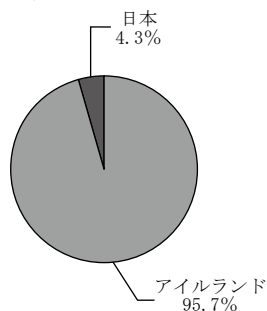
■ 組入（上位）ファンド（銘柄）

銘柄名	当期末
	2021年5月25日
	比率
マン・ファンズ・VI plc-マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）	95.7%
T&Dマネーアカウンタマザーファンド	0.0
その他	4.3

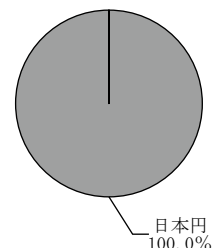
■ 資産別配分



■ 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

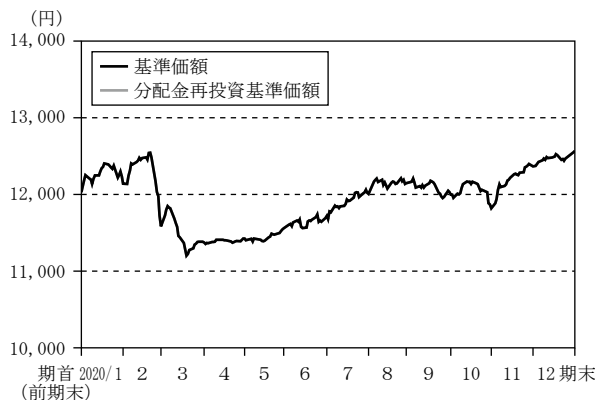
項目	当期末
	2021年5月25日
純資産総額	5,791,889,554円
受益権総口数	5,769,038,306口
1万口当たり基準価額	10,040円

（注）期中における追加設定元本額は464,817,730円、同解約元本額は2,047,101,072円です。

組入上位ファンドの概要

マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスク－日本円クラス（ヘッジ付）（2020年1月1日から2020年12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（2019年12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。

以下は、「マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスク」の状況です。

■ 組入銘柄（債券）（上位10銘柄）（組入銘柄数：17銘柄）

銘柄名	国	比率
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/03/2029	イギリス	9.5%
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/07/2029	アメリカ	8.7
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.5% 15/04/2030	ドイツ	7.4
French Republic Government Bond Oat 0.7% 25/07/2030	フランス	6.5
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2024	アメリカ	5.4
France Treasury Bill BTF 0% 24/03/2021	フランス	1.5
France Treasury Bill BTF 0% 24/02/2021	フランス	1.5
French Discount T-Bill 0% 27/01/2021	フランス	1.5
United States Treasury Bill 0% 21/01/2021	アメリカ	1.2
United States Treasury Bill 0% 28/01/2021	アメリカ	1.2

■ 為替先渡取引（上位10銘柄）（組入銘柄数：28銘柄）

通貨		満期日	比率
買い	売り		
EUR	USD	2021/2/1	0.9%
AUD	USD	2021/2/1	0.4
GBP	USD	2021/2/1	0.2
CHF	USD	2021/2/1	0.1
JPY	USD	2021/2/1	0.1
GBP	USD	2021/1/14	0.0
BRL	USD	2021/2/1	0.0
SGD	USD	2021/2/1	0.0
USD	EUR	2021/1/14	0.0
USD	BRL	2021/2/1	0.0

■ 先物取引（上位10銘柄）（組入銘柄数：40銘柄）

買い		
銘柄名	国	比率
S&P500 EMINI Future March 2021	アメリカ	0.1%
KOSPI2 Index Futures March 2021	韓国	0.1
NASDAQ 100 E-MINI March 2021	アメリカ	0.1
NIKKEI 225 (SGX) March 2021	シンガポール	0.1
Swiss Market Index Futures March 2021	ドイツ	0.1
TOPIX Index Futures March 2021	日本	0.1
Long GILT Future March 2021	イギリス	0.1
FTSE China A50 January 2021	シンガポール	0.0
DAX INDEX Futures March 2021	ドイツ	0.0
HANG SENG Index Futures January 2021	香港	0.0

■ トータルリターン・スワップ取引
（組入銘柄数：1銘柄）

銘柄名	国・地域	数量	比率
BBG Commex AG&LV Capital	アメリカ	4,421,000	0.1%

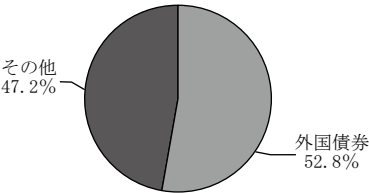
■ クレジット・デフォルト・スワップ取引
売り
（組入銘柄数：4銘柄）

銘柄名	国・地域	数量	比率
ITraxx Xovers 34V1 5 Years 500bps 20 December 2025	欧州	△190,000,000	0.7%
NAHYS 35V1 5 Years 500bps 20 December 2025	アメリカ	△290,000,000	0.7
NAIGS 35V1 5 Years 100bps 20 December 2025	アメリカ	△585,000,000	0.3
ITraxx Europes 34V1 5 Years 100bps 20 December 2025	欧州	△435,000,000	0.3

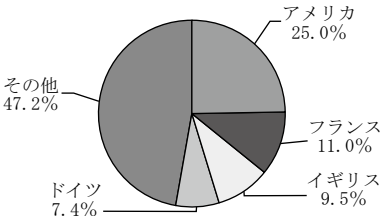
■ 1口当たりの費用明細

1口当たりの費用明細に相当する情報がないため、開示することができません。

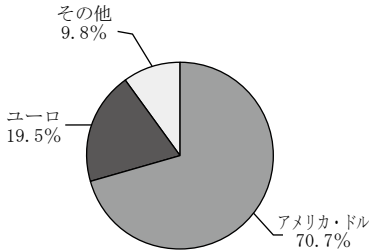
■ 資産別配分



■ 国別配分

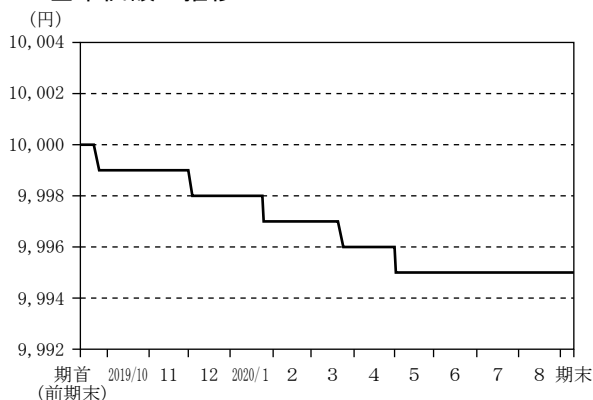


■ 通貨別配分



- (注) 組入銘柄、為替先渡取引、先物取引、スワップ取引および各配分のデータは直近の決算日現在のものです。日付は現地基準日です。
 - (注) 組入銘柄、為替先渡取引、先物取引、スワップ取引および各配分の比率は純資産総額に対する評価額（先物取引、スワップ取引については、監査済報告書の損益計算書上のFair Value）の比率です。
 - (注) 組入銘柄、為替先渡取引、先物取引、スワップ取引および各配分はマン・グループ・ジャパン・リミテッドより入手したデータをもとに作成したものです。
- ※詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）でご覧いただけます。

■ 基準価額の推移



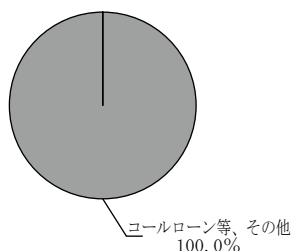
■ 組入銘柄

当期末における組入れはありません。

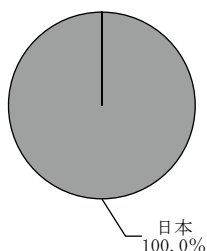
■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	2019/9/11～2020/9/10	
	金額	比率
平均基準価額	9,996円	
その他費用 (その他)	0円 (0)	0.001% (0.001)
合計	0	0.001

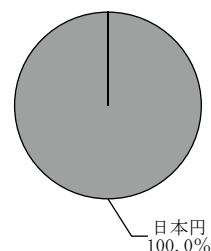
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注) 1万口当たりの費用明細は直近の決算期のものです。費用項目につきましては2ページ(1万口当たりの費用明細の項目の概要)をご参照ください。また、その他費用のその他は金銭信託に係る手数料です。

(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。

※詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)でご覧いただけます。

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、野村證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。



T&Dアセットマネジメント株式会社