

受益者の皆さまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「インベスコ 世界ブロックチェーン株式ファンド」は、このたび、第4期の決算を行いました。

当ファンドは日本を含む世界各国のブロックチェーン関連株式を実質的な主要投資対象とし、コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。

ここに、当作成対象期間の運用経過等について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。



インベスコ 世界ブロックチェーン 株式ファンド 愛称：世カエル

追加型投信／内外／株式／インデックス型



第4期末(2023年7月10日)

基準価額	20,123円
純資産総額	12,892百万円
第4期	
騰落率	0.8%
分配金(税込み)合計	0円

(注) 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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

交付運用報告書

第4期

(決算日 2023年7月10日)

作成対象期間 (2022年7月12日～2023年7月10日)

- 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、インベスコ・アセット・マネジメント株式会社の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<お問い合わせ先>のホームページにアクセスし、「ファンダー一覧」等から運用報告書(全体版)を閲覧およびダウンロードすることができます。

インベスコ・アセット・マネジメント

東京都港区六本木六丁目10番1号六本木ヒルズ森タワー14階

<お問い合わせ先>

お問い合わせダイヤル：(03)6447-3100
(受付時間：毎営業日の午前9時から午後5時)

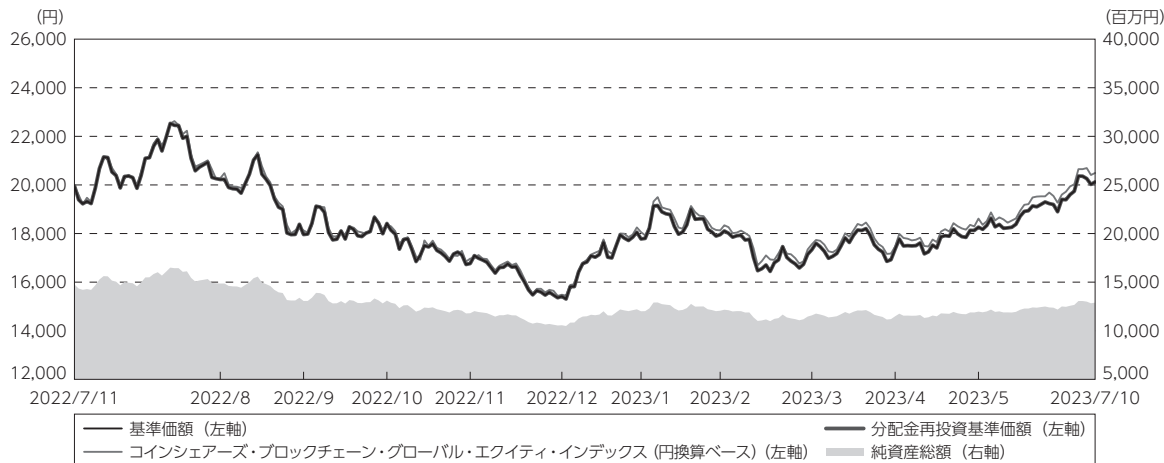
ホームページ <https://www.invesco.com/jp/ja/>

UD
FONT
見やすく読みまちがえにくい
ユニバーサルデザインフォントを
採用しています。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2022年7月12日～2023年7月10日)



期首：19,963円

期末：20,123円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 0.8% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、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、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。
- (注) 分配金再投資基準価額およびコインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス(円換算ベース)は、期首(2022年7月11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。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス(円換算ベース)は、ベンチマークです。ベンチマークの算出・取得ができない事態が生じた場合、委託会社はベンチマークの変更や廃止を含む運用方針の見直しを行うことまたはファンドを償還することがあります。ベンチマークの詳細は12ページをご参照ください。以下、同じです。

○基準価額の主な変動要因

[上昇要因]

- ・日本を含む世界各国のブロックチェーン関連株式を実質的な主要投資対象としているため、同関連銘柄の株価上昇が、基準価額の上昇要因となりました。ブロックチェーン関連株式のうち、米国の暗号資産マイニング企業やソフトウェア関連企業、台湾の半導体製造企業の株価が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
- ・実質外貨建資産の対円での為替ヘッジを行わなかったため、米ドルが対円で上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

[下落要因]

- ・ブロックチェーン関連株式のうち、暗号資産金融サービスを顧客基盤とする米国の地方銀行が自主精算や事業閉鎖したことや、期中のビットコイン価格の下落を受けて米国のマイニング大手企業が破産を申請し株価が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。

1万口当たりの費用明細

(2022年7月12日～2023年7月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	284	1.569	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(139)	(0.768)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(139)	(0.768)	購入後の情報提供、運用報告書等各种資料の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(6)	(0.033)	ファンドの財産の保管・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	29	0.160	(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
（ 株 式 ）	(29)	(0.160)	※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) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用	14	0.076	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(8)	(0.045)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 ）	(4)	(0.024)	印刷費用は、目論見書や運用報告書等の法定書類の作成・印刷に要する費用等
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する費用
合 計	327	1.805	
期中の平均基準価額は、18,119円です。			

(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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

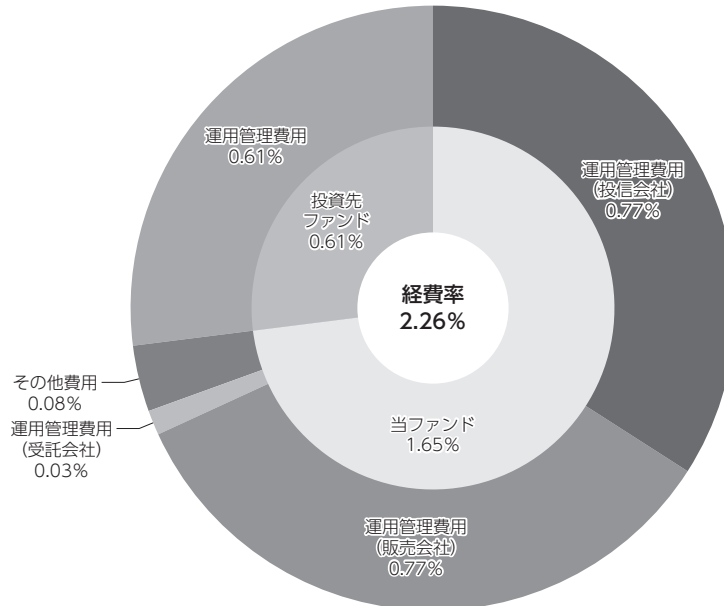
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 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、項目ごとに小数点以下第4位を四捨五入してあります。

(参考情報)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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経費率（年率）は2.26%です。



(単位:%)

経費率(①+②)	2.26
①当ファンドの費用の比率	1.65
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.61

(注) 当ファンドの費用は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、当ファンドの親投資信託が組み入れている投資信託証券です。

(注) 当ファンドの費用は、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。

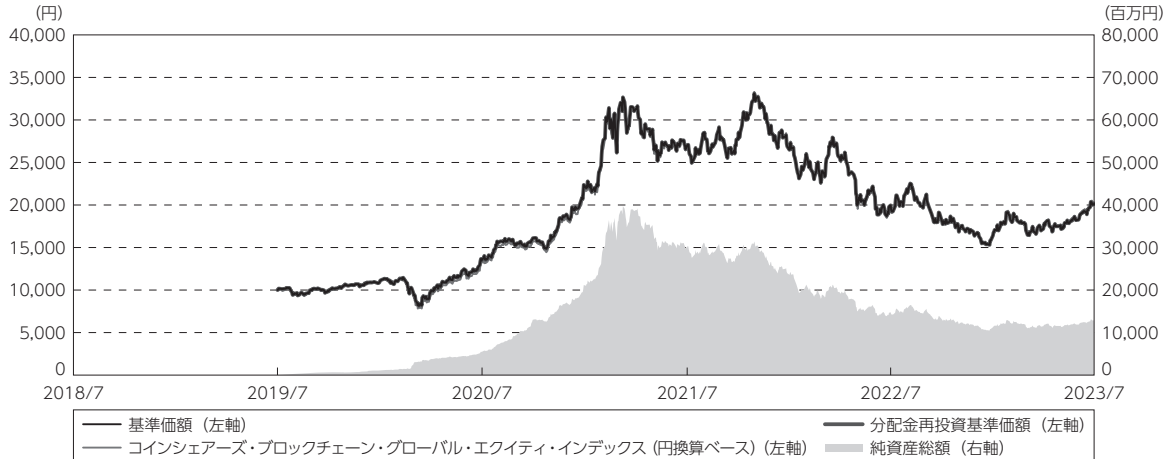
(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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。

(2018年7月10日～2023年7月10日)

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、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。
- (注) コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）は、設定時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。
- (注) 当ファンドの設定日は2019年7月11日です。

	2019年7月11日 設定日	2020年7月10日 決算日	2021年7月12日 決算日	2022年7月11日 決算日	2023年7月10日 決算日
基準価額 (円)	10,000	13,578	27,025	19,963	20,123
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	0	0	0	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	35.8	99.0	△ 26.1	0.8
コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス (円換算ベース) (%)	—	32.6	101.7	△ 26.0	2.7
純資産総額 (百万円)	1	5,502	30,224	14,769	12,892

- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。
- (注) 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、2020年7月10日の騰落率は設定当初との比較です。
- (注) コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）は、ベンチマークです。

投資環境

コインシエアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス (円換算ベース) +2.7%
米ドル／円 142円54銭 (前期末 136円47銭)

※株価指数の騰落率は当期末時点 (対前期末比)、米ドル／円は当期末の数値です。

<ブロックチェーン株式市場>

当期の世界のブロックチェーン関連株式市場は小幅な上昇となりました。期の前半は、高インフレが続く中、欧米を中心に積極的な利上げが続き各国の長期金利が上昇したことを受け、株価収益率の高い傾向にある成長株が相対的に下落しました。また、2022年11月には暗号資産交換業大手のFTXトレーディング (非上場企業) およびその関連会社が、日本の民事再生法に相当する米連邦破産法第11条の適用を申請し破綻したため、暗号資産業界への懐疑的な見方が強まり、暗号資産からの資金流出が起きたことで、暗号資産金融サービス企業やマイニング企業の株価が下落しました。期の後半は、米国での米消費者物価指数 (C P I) の上昇率が鈍化したことでインフレ低下の期待が高まったことや、大手ハイテック関連企業が好決算となったことが好感され、グロース株やビットコイン価格が急騰し、ブロックチェーン関連株式も大きく値上がりしました。その後は米連邦準備理事会 (F R B) や欧州中央銀行 (E C B) の積極的な利上げが継続したこと、高止まりするインフレの影響から景気後退懸念が高まったことなどを背景に、株式市場は軟調な展開で推移しましたが、2023年6月に大手資産運用会社の複数社がビットコイン E T F の申請をしたことが報じられたことにより、暗号資産の今後の需要拡大や投資家層の広がりが期待され、期末にかけてブロックチェーン関連株式は上昇しました。

<為替市場>

当期、米ドルは対円で小幅に上昇しました。期の前半は、利上げに伴う米国での金利先高観につられ一時1米ドル=150円を超える水準まで米ドル高/円安が進んだものの、日銀による大規模な介入や米国での利上げペースの減速懸念などから2023年10月後半からは米ドル安/円高へと反転しました。期の後半は、日銀の植田新総裁が大規模な金融緩和政策を継続すると表明し、日米金利差が拡大するとの見方が広がったことに加え、F R Bが継続して利上げを実施しながらも米国経済が底堅く推移したことなどを背景に、米ドル高/円安が進行しました。

(2022年7月12日～2023年7月10日)

当ファンドのポートフォリオ

主として、インベスコ 世界ブロックチェーン株式 マザーファンド（以下、マザーファンドといいます。）に投資を行い、マザーファンドを通じて、日本を含む世界各国のブロックチェーン関連株式に投資を行いました。また、実質外貨建資産の投資にあたっては、為替ヘッジを行いませんでした。

マザーファンドでは、コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指しました。

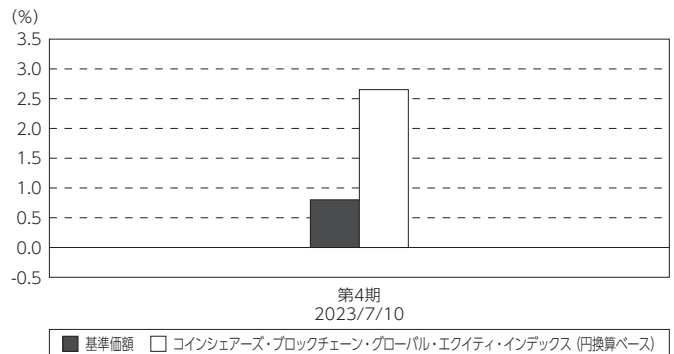
当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年7月12日～2023年7月10日)

当期の基準価額騰落率は+0.8%となり、ベンチマークであるコインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）の騰落率+2.7%を下回る結果となりました。

一般的に、インデックス・ファンドのパフォーマンスがベンチマークから乖離する要因としては、配当金（プラス要因）、信託報酬（マイナス要因）、取引や管理にかかるコスト（マイナス要因）による要因の他、個別銘柄の組入比率がファンドとベンチマークで若干乖離していることによる要因や、ファンド内でキャッシュを保有していることによる要因などがあります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は配当金（税込み）込みです。

(注) コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）は、ベンチマークです。

(2022年7月12日～2023年7月10日)

分配金

収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向、残存信託期間等を勘案し、当期は見送りとさせていただきます。収益分配金に充てなかった収益につきましては、信託財産に留保して元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり、税込み)

項 目	第 4 期
	2022年7月12日 ～2023年7月10日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	10,123

(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)に対する比率であり、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

主としてマザーファンドに投資を行い、マザーファンドを通じて、日本を含む世界各国のブロックチェーン関連株式に投資を行います。また、実質外貨建資産の投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。

マザーファンドでは、コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。

お知らせ

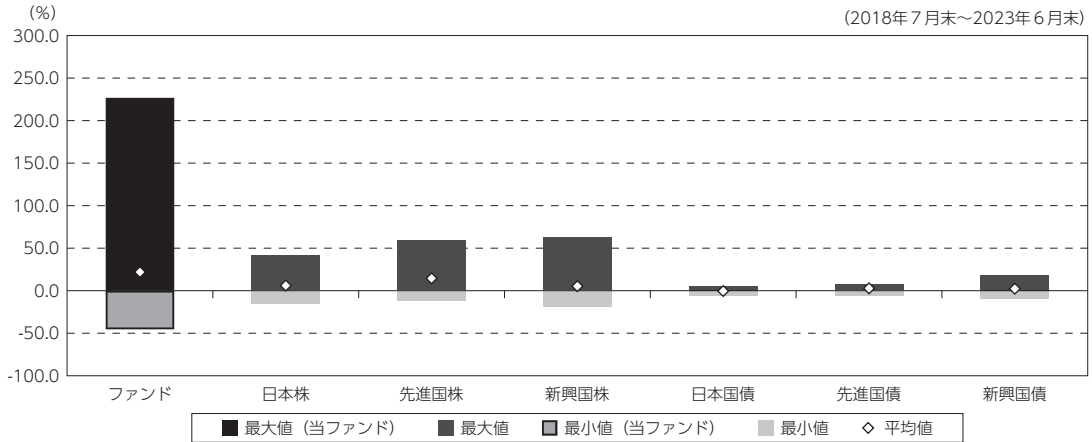
該当事項はございません。

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／株式／インデックス型	
信託期間	2029年7月10日まで	
運用方針	日本を含む世界各国のブロックチェーン関連株式を実質的な主要投資対象とし、コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。	
主要投資対象	インベスコ 世界ブロックチェーン株式ファンド	インベスコ 世界ブロックチェーン株式 マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	インベスコ 世界ブロックチェーン株式 マザーファンド	日本を含む世界各国のブロックチェーン関連株式に投資します。また、効率的な運用を目的として、ブロックチェーン関連株式を投資対象とする上場投資信託証券にも投資することがあります。
運用方法	<ul style="list-style-type: none"> ・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として、日本を含む世界各国のブロックチェーン関連株式に投資します。また、効率的な運用を目的として、ブロックチェーン関連株式を投資対象とする上場投資信託証券にも投資することがあります。 ・コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ・実質外貨建資産については、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。 	
分配方針	年1回の毎決算時（原則として7月10日。同日が休業日の場合は翌営業日）に委託会社が、基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して分配を行います。ただし、委託会社の判断により、分配を行わない場合があります。	

(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:%)

	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	21.9	6.0	14.5	5.3	-0.4	2.8	2.3
最大値	226.8	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	18.5
最小値	-45.4	-16.0	-12.4	-19.4	-5.5	-6.1	-9.4

(注) 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) 2018年7月から2023年6月の5年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・最小値を表示したものです。当ファンドの騰落率につきましては、ベンチマーク（2017年8月1日算出開始）の年間騰落率（2018年8月～2020年6月）が含まれています。

(注) 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) 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：TOPIX（東証株価指数）（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・ダイバーシファイド（円ベース）

※各指数についての説明は、P12～13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。

(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。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

(2023年7月10日現在)

○組入上位ファンド

銘柄名	第4期末
インベスコ 世界ブロックチェーン株式 マザーファンド	100.0%
組入銘柄数	1銘柄

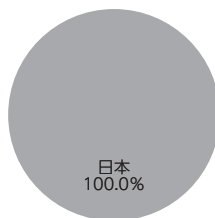
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 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。

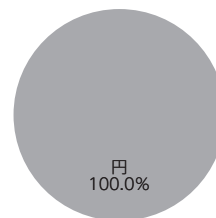
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては、発行体の国籍（所在国）などを表示しております。

純資産等

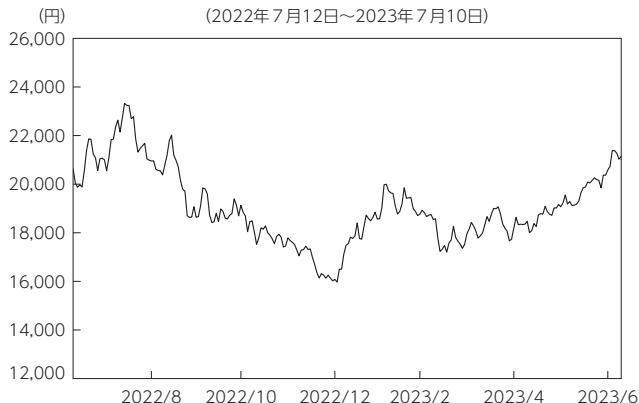
項目	第4期末
	2023年7月10日
純資産総額	12,892,245,147円
受益権総口数	6,406,607,363口
1万口当たり基準価額	20,123円

* 期中における追加設定元本額は582,736,737円、同解約元本額は1,574,926,794円です。

組入上位ファンドの概要

インベスコ 世界ブロックチェーン株式 マザーファンド

【基準価額の推移】



【1万口当たりの費用明細】

(2022年7月12日～2023年7月10日)

項目	当期	
	金額	比率
	円	%
(a) 売買委託手数料 (株 式)	30 (30)	0.159 (0.159)
(b) 有価証券取引税 (株 式)	0 (0)	0.000 (0.000)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	8 (8) (0)	0.045 (0.045) (0.000)
合計	38	0.204

期中の平均基準価額は、18,895円です。

(注) 上記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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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、項目ごとに小数点以下第4位を四捨五入してあります。

【組入上位10銘柄】

(2023年7月10日現在)

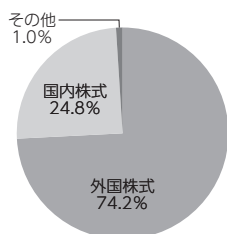
	銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
					%
1	MICROSTRATEGY-CL A	ソフトウェア・サービス	米ドル	アメリカ	5.1
2	CLEANSARK	ソフトウェア・サービス	米ドル	アメリカ	5.1
3	マネックスグループ	証券・商品先物取引業	円	日本	4.8
4	SAMSUNG ELECTRONICS	テクノロジー/ハードウェア/半導体	韓国ウォン	韓国	4.8
5	TAIWAN SEMI CONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	新台幣ドル	台湾	4.8
6	S B Iホールディングス	証券・商品先物取引業	円	日本	4.5
7	R10T BLOCKCHAIN	ソフトウェア・サービス	米ドル	アメリカ	3.9
8	COINBASE GLOBAL-A	金融サービス	米ドル	アメリカ	3.8
9	KAKAO	メディア・娯楽	韓国ウォン	韓国	3.7
10	CME GROUP	金融サービス	米ドル	アメリカ	3.2
	組入銘柄数			45銘柄	

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

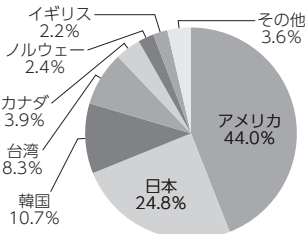
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

(注) 国(地域)につきましては、発行体の国籍(所在国)などを表示しております。

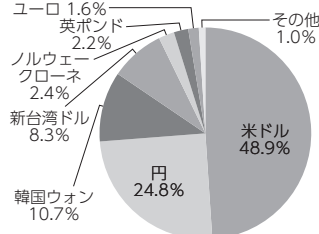
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては、発行体の国籍(所在国)などを表示しております。

(注) その他には現金等を含む場合があります。

※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書(全体版)をご参照ください。

<当ファンドのベンチマークについて>

ベンチマークとして、コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（円換算ベース）を使用しています。基準日前営業日のコインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（米ドルベース）の数値を、委託会社が基準日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場の仲値）で独自に円換算したものです。

コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックスは、コインシェアーズ・インターナショナル・リミテッドが独自の分析に基づき選定した銘柄で構成され、ソラクティブ AG（ソラクティブ社）によって算出、公表されています。

ソラクティブ社は、コインシェアーズ・ブロックチェーン・グローバル・エクイティ・インデックス（当指数）、およびその登録商標、当指数データの利用結果に関して、何時、いかなる点においても明示的、黙示的な保証または確約を行いません。ソラクティブ社は当指数を正確に算出するために最善を尽くしますが、指数提供者としての義務にかかわらず、投資家および金融商品の仲介者を含む第三者に対して、当指数の誤りを指摘する義務を負いません。ソラクティブ社による当指数の公表および金融商品に関連した目的での当指数または当指数の商標利用の使用許諾は、ファンドへの投資を推奨するものではなく、また、ファンドへの投資に関してソラクティブ社の保証または意見を表明するものではありません。

<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>

○TOPIX（東証株価指数）（配当込み）

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、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株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。

○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 Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCI コクサイ・インデックスに対する著作権及びその他の知的財産権はすべて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）

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、世界の新興国で構成されています。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他の知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。なお、円ベース指数については、委託会社がMSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）に、当日の米ドル為替レート（WM/ロイター値）を乗じて算出しています。

○NOMURA - BPI 国債

NOMURA - BPI 国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

○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、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、FTSE世界国債インデックスに関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。

○JPモルガンGBI – EMグローバル・ダイバーシファイド（円ベース）

JPモルガンGBI – EMグローバル・ダイバーシファイドは、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。円ベース指数については、委託会社がJPモルガンGBI – EMグローバル・ダイバーシファイド（米ドルベース）に、当日の米ドル為替レート（WM/ロイター値）を乗じて算出しています。

指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.及び関係会社（「JPモルガン」）に帰属しております。JPモルガンは、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。JPモルガンは、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、ファンドを推奨するものでもなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。