

# 【ご案内】MSCI社が算出する外国株式指数の遡及修正について/MSCI指数の構成国の変更について

## ■ MSCI社が算出する外国株式指数の遡及修正について

MSCI社が算出・公表する外国株式のMSCI指数において、カナダ株式1銘柄（BROOKFIELD ASSET MAN A、ISIN: CA1125851040 以下、当該銘柄）の株価情報についての指数への反映不備が判明し、MSCI社において当該不備の是正に伴う指数値の修正が行われました。  
弊社ではMSCI社より連絡を受けた指数の修正内容を基に検証を行い、第1四半期の運用概況に掲載しているファンドおよび指数のパフォーマンス、要因分析について影響が無いことを確認しております。一方で、第1四半期運用概況に掲載した指数値の一部に修正が生じることから、当期より正しい値を掲載しております。

### 【指数の修正対象期間】

2021年6月28日～2021年7月20日

### 【修正対象指数および修正内容】

当該銘柄を含む指数を対象として、指数値の遡及修正が実施されました。第1四半期の運用概況に掲載した6月末の指数値のうち、次の指数について、当期より正しい値を掲載しております。

	2021年6月末 (修正前)	2021年6月末 (修正後)
MSCI KOKUSAI	4,889.78 ポイント	4,889.77 ポイント
MSCI KOKUSAI ESG LEADERS	2,774.28 ポイント	2,774.27 ポイント

\*いずれも(配当込・税引前)円ベース

以上

## ■ MSCI指数の構成国の変更について

MSCIが市場分類レビューを発表し、アルゼンチン・パキスタンについて新興国市場からの除外が決定されました。  
MSCIは、国別の指数算出国を「先進国市場」、「新興国市場」、「フロンティア市場」の3つの市場に分類し、「経済発展基準」「市場規模・流動性基準」「市場アクセス」の3つの基準に基づき分類を実施し、適宜見直しを実施しています。  
新興国市場に分類されるためには、3つの基準のうち「市場規模・流動性基準」「市場アクセス」の2つで一定の基準を満たしていることが求められています。

### ●アルゼンチン

新興国市場からスタンダードアローン市場\*に市場区分が変更され、2021年11月に新興国指数からの除外が実施される見込みです。なお、新興国指数への組入れ比率は約0.16%です。

### 【変更理由】

アルゼンチンの株式市場では2019年9月から資本規制が課されており、新興国指数の条件である「市場アクセス」を満たしていないと判断されたため。

### ●パキスタン

新興国市場からフロンティア市場に市場区分が変更され、2021年11月に新興国指数からの除外が実施される見込みです。なお、新興国指数への組入れ比率は約0.02%です。

### 【変更理由】

パキスタンの株式市場に上場する銘柄に、新興国指数の組み入れ基準として設定された規模・流動性の水準を満たす銘柄が存在しないため。

\*先進国、新興国、フロンティア市場のいずれにも分類されない(=フロンティア市場未満)の市場に対する区分。

(時点)2021/9末