

オーロラⅡ (東欧投資ファンド)

追加型投信／海外／株式

交付運用報告書

第27期(決算日2023年7月11日)

作成対象期間(2022年7月12日～2023年7月11日)

第27期末(2023年7月11日)	
基準価額	13,025円
純資産総額	843百万円
第27期	
騰落率	45.5%
分配金(税込み)合計	170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ことができる旨を定めております。運用報告書(全体版)は、野村アセットマネジメントのホームページで閲覧・ダウンロードしていただけます。
- 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>

右記ホームページを開く

⇒「ファンド検索」にファンド名を入力しファンドを選択

⇒ファンド詳細ページから「運用報告書(全体版)」を選択

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当ファンドは、東欧諸国(ポーランド、ロシア、チェコ、ハンガリー等)の企業の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とし、信託財産の成長をはかることを目的として、積極的な運用を行ないます。

ここに、当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

当ファンドは、2023年3月31日に信託期間を延長する約款変更を行ない、2027年7月12日を信託期間終了日といたしました。

なお、当ファンドからスイッチング可能であるオーロラⅡ(トルコ投資ファンド、マネープールファンド)につきましては2024年10月1日に信託期間満了となりますのでご留意下さい。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉 営業日の午前9時～午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

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11日)



期 首：9,067円

期 末：13,025円 (既払分配金(税込み):170円)

騰落率：45.5% (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。作成期首(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) 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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 参考指数は、MSCI EM Eastern Europe IMI 10/40 Index (税引き後配当込み(ネット)、円換算ベース)です。詳細は4ページをご参照ください。参考指数は、作成期首(2022年7月11日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。

(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。

○基準価額の主な変動要因

(下 落) 欧州の景気減速懸念が高まったこと、ウクライナ情勢の緊迫化による中欧諸国(ポーランド、チェコ共和国、ハンガリー等)への悪影響が懸念され、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、ポーランドやチェコ共和国で超過利潤税の導入の可能性が示され大手エネルギー株や公益事業株などが下落したこと

(上 昇) 米国の利上げペース減速や中国のゼロコロナ政策緩和への期待などから、投資家心理が改善したこと、中欧各国の主要銀行の堅調な決算や、ECB(欧州中央銀行)の利上げペースの減速期待が好感されたこと

(下 落) 米利上げペースの再加速やECBの金融引き締め長期化が懸念されたこと、米金融機関の経営破綻などが警戒されたことやスイスの大手金融グループの経営不安が高まったこと

(上 昇) 米利上げの打ち止め期待が高まったこと、堅調な決算を発表したポーランドの銀行株などが上昇したこと

1万口当たりの費用明細

(2022年7月12日～2023年7月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 225	% 2.222	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率
(投 信 会 社)	(108)	(1.067)	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
(販 売 会 社)	(106)	(1.045)	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および事務手続き等
(受 託 会 社)	(11)	(0.110)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	3	0.031	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(3)	(0.031)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(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 ※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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	69	0.682	(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)	(58)	(0.571)	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)	(0)	(0.003)	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)	(11)	(0.107)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	297	2.935	
期中の平均基準価額は、10,144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。

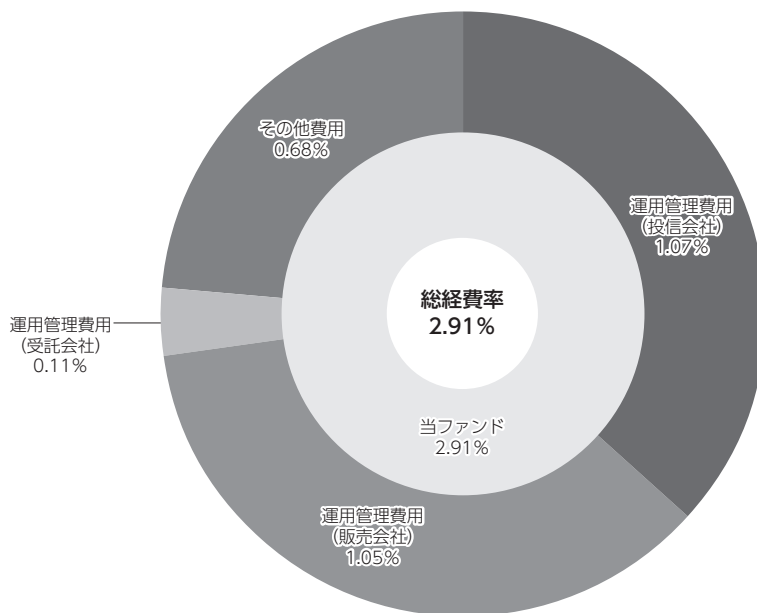
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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、売買委託手数料及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2.91%です。



(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) 当ファンドのその他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託事務の処理に要するその他の諸費用等が含まれます。

(注) 当ファンドのその他費用には、ロシアの法改正に伴い、預託証書をロシア本国の株式に転換するための手数料が含まれます。

(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

(2018年7月11日～2023年7月11日)



(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。2018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) 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、個々の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11日 決算日	2019年7月11日 決算日	2020年7月13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11日 決算日
基準価額 (円)	18,453	20,309	16,354	21,834	9,067	13,025
期間分配金合計(税込み) (円)	—	600	350	640	0	170
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	13.3	△ 17.8	37.4	△ 58.5	45.5
参考指数騰落率 (%)	—	13.2	△ 15.6	38.3	△ 74.2	42.4
純資産総額 (百万円)	2,404	1,573	1,146	1,300	581	843

(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。

* 参考指数 (= MSCI EM Eastern Europe IMI 10/40 Index (税引き後配当込み(ネット)、円換算ベース)) は MSCI EM Eastern Europe IMI 10/40 Index (現地通貨ベース) をもとに、当社が独自に円換算したものです。算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売相場仲値)で円換算しております。

* MSCI EM Eastern Europe IMI 10/40 Index は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI 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。

(出所) MSCI、ブルームバーグ

投資環境

(2022年7月12日～2023年7月11日)

東欧株式市場の中で、中欧株式市場については、期初、欧州の景気減速懸念が高まったことなどから下落して始まりました。その後も、ウクライナ情勢の緊迫化による中欧諸国への悪影響が懸念され、投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、ポーランドやチェコ共和国などで、政府による超過利潤税の導入の動きが嫌気され大手エネルギー株や公益事業株を中心に下落基調で推移しました。

2022年10月中旬以降は、米利上げペースの減速や中国のゼロコロナ政策緩和への期待などから、投資家心理が改善したことや、中欧各国の主要銀行の堅調な決算が好感されたことなどを受け上昇基調で推移しました。

2023年1月に入ると、米金融引き締め長期化への警戒感が和らいだことや中国の経済活動正常化への期待などを背景に世界的な株高となったことを受け上昇基調で推移しました。しかし、3月には米利上げペースの再加速やECBの金融引き締めの長期化、米金融機関の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営不安が高まったことなどを受け銀行株を中心に下落しました。4月以降は、米利上げの打ち止め期待が高まったことや、堅調な決算を発表したポーランドの銀行株が上昇したことなどを背景に上昇基調で推移し、当期において中欧株式市場は上昇となりました。

一方、ウクライナへの軍事侵攻が始まる以前は東欧株式市場の中で主要市場となっていたロシア株式市場は、モスクワ証券取引所が2022年3月下旬から取引を再開していますが、引き続き、本邦投資家による取引は制限されました。

当ファンドのポートフォリオ

(2022年7月12日～2023年7月11日)

・株式組入比率

原則として高位を維持するという運用方針に基づいて運用を行ない、組入比率はおおむね高位を維持しました。

・期中の主な動き

- (1) 国別配分では、期初においてはルーマニアをオーバーウェイト（参考指数に比べ高めの投資比率）とし、ハンガリーやポーランドをアンダーウェイト（参考指数に比べ低めの投資比率）としました。一方、期末においては、ルーマニアをオーバーウェイトとし、ハンガリーやチェコ共和国をアンダーウェイトとしました。
- (2) 業種配分では、期初においては、素材、生活必需品などをオーバーウェイトとし、金融、公益事業などをアンダーウェイトとしました。一方、期末においては、生活必需品、素材などをオーバーウェイトとし、公益事業、金融などをアンダーウェイトとしました。
- (3) 為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

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11日)

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数としているMSCI EM Eastern Europe IMI 10/40 Index (税引き後配当込み (ネット)、円換算ベース) の42.4%の上昇に対し、基準価額は45.5%の上昇となりました。

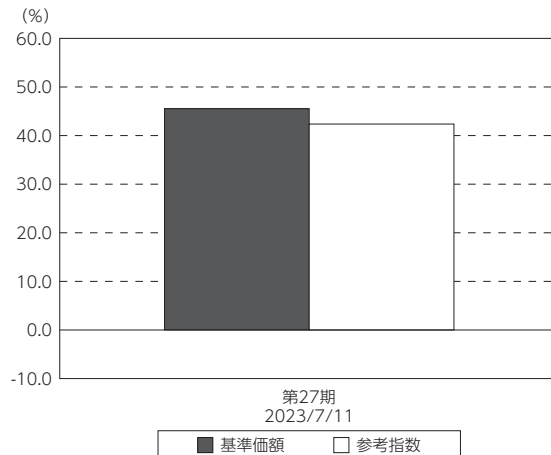
(主なプラス要因)

- ・ 国別配分で、株価騰落率が参考指数を下回ったチェコ共和国をアンダーウェイトとしたこと
- ・ 業種配分で、株価騰落率が参考指数を下回った公益事業をアンダーウェイトとしたこと
- ・ 個別銘柄で、株価騰落率が参考指数を上回ったポーランドの一般消費財・サービス株や素材株をオーバーウェイトとしたこと

(主なマイナス要因)

- ・ 国別配分で、株価騰落率が参考指数を下回ったルーマニアをオーバーウェイトとしたこと
- ・ 業種配分で、株価騰落率が参考指数を下回った素材をオーバーウェイトとしたこと
- ・ 個別銘柄で、株価騰落率が参考指数を下回ったポーランドの公益事業株やルーマニアの金融株をオーバーウェイトとしたこと

基準価額と参考指数の対比 (期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、MSCI EM Eastern Europe IMI 10/40 Index (税引き後配当込み (ネット)、円換算ベース) です。

分配金

(2022年7月12日～2023年7月11日)

今期の収益分配金については、基準価額水準等を勘案し、1万口当たり170円とさせていただきます。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税込み)

項 目	第27期
	2022年7月12日～2023年7月11日
当期分配金	170
(対基準価額比率)	1.288%
当期の収益	170
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	21,131

(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。

(注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

今後の運用方針

・投資環境

中欧諸国については、今まで高止まりしていたインフレ率がエネルギー価格の下落を背景に低下傾向となっています。また、賃金の堅調な伸びを背景に、インフレ圧力によって落ち込んだ個人消費は回復するとみられ、域内の景気回復を下支えするとみています。一方、経済の結びつきが強いユーロ圏には景気後退の兆しが表れています。足元では中欧諸国の鉱工業生産部門についても弱い指標が発表されており、景気動向には注意が必要です。ロシアについては、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が終結する前に、経済制裁が緩和されるとは考え難く、戦況の行方を注視します。

中欧諸国の株式市場については、配当利回りなどのバリュエーション(投資価値評価)指標の視点から割安感の強い銘柄も多く、株価バリュエーションが更に向上する余地が残っていると考えています。域内やEU(欧州連合)の景気動向を考えると資本財株や輸出株の業績には注意が必要ですが、消費関連株の業績回復は続くと考えられます。また、域内の銀行株やエネルギー株については、各国政府による超過利潤税などの一時的な措置の導入が業績へ影響を及ぼす懸念はあるものの、既にこうした影響は多くの銘柄の株価には織り込まれていると考えられます。ロシア株式市場については、引き続き、経済制裁や取引制限の動向を注視していきます。

・運用方針

個別銘柄については、中欧域内を含め、世界景気の回復が進むことで、高い利益創出力を発揮できる企業を中心に投資する方針です。

今後も基準価額の向上に努めて参りますので、引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

お知らせ

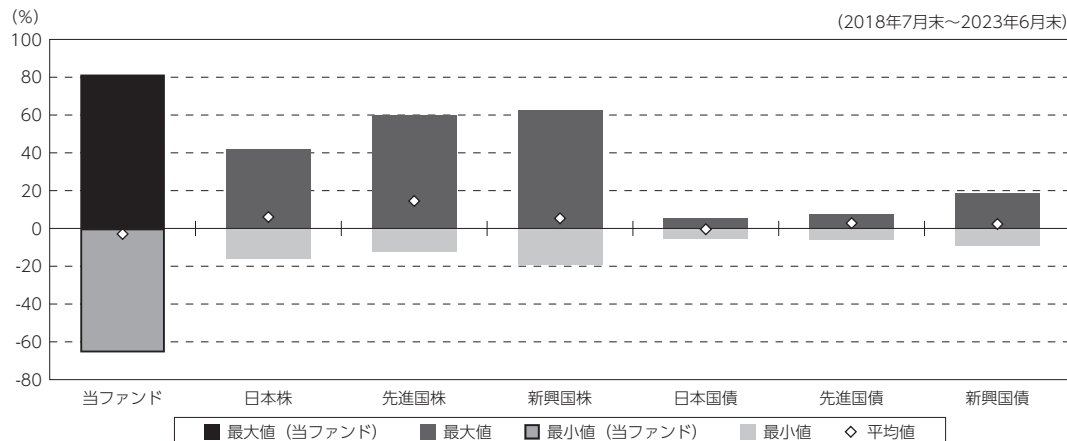
信託期間を3年更新し、信託期間終了日を2027年7月12日とする所要の約款変更を行ないました。
 <変更適用日：2023年3月31日>

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／株式
信託期間	1996年7月12日から2027年7月12日までです。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目的として、積極的な運用を行ないます。
主要投資対象	東欧諸国（ポーランド、ロシア、チェコ、ハンガリー等）の企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
運用方法	東欧諸国（ポーランド、ロシア、チェコ、ハンガリー等）の企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、信託財産の成長をはかることを目的として、積極的な運用を行ないます。
分配方針	毎決算時に、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から基準価額の水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行ないます。

(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:%)

	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
最大値	81.4	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	18.5
最小値	△ 65.6	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値	△ 2.9	6.0	14.5	5.3	△ 0.4	2.8	2.3

(注) 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) 2018年7月から2023年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

(注) 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。

《代表的な資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数 (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、ヘッジなし・円ベース)

新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

※各指数についての説明は、後述の「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

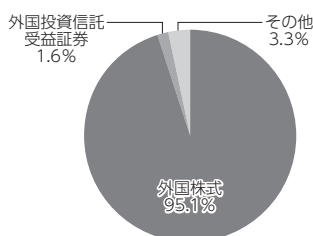
組入資産の内容

(2023年7月11日現在)

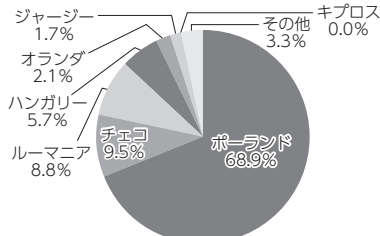
○組入上位10銘柄

	銘柄名	業種 / 種別等	通貨	国 (地域)	比率
					%
1	DINO POLSKA SA	生活必需品流通・小売り	ポーランドズロチ	ポーランド	8.8
2	BANK PEKAO SA	銀行	ポーランドズロチ	ポーランド	8.1
3	ORLEN SA	石油・ガス・消耗燃料	ポーランドズロチ	ポーランド	7.8
4	KOMERCNI BANKA AS	銀行	チェココルナ	チェコ	5.2
5	KRUK SA	消費者金融	ポーランドズロチ	ポーランド	5.0
6	OTP BANK NYRT	銀行	ハンガリーフォリント	ハンガリー	4.9
7	SANTANDER BANK POLSKA SA	銀行	ポーランドズロチ	ポーランド	4.5
8	DOM DEVELOPMENT SA	家庭用耐久財	ポーランドズロチ	ポーランド	4.3
9	OMV PETROM SA	石油・ガス・消耗燃料	ルーマニアレイ	ルーマニア	4.2
10	LIVECHAT SOFTWARE SA	ソフトウェア	ポーランドズロチ	ポーランド	4.0
	組入銘柄数		40銘柄		

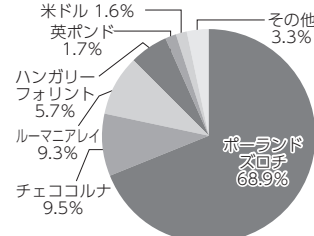
○資産別配分



○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。資産の状況等によっては合計が100%とされない場合があります。
 (注) 国 (地域) および国別配分は、原則として発行国 (地域) もしくは投資国 (地域) を表示しております。
 (注) 組入銘柄に関する詳細な情報等は、運用報告書 (全体版) に記載しております。
 (注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

純資産等

項目	第27期末	
	2023年7月11日	
純資産総額	843,250,816円	
受益権総口数	647,409,643口	
1万円当たり基準価額	13,025円	

(注) 期中における追加設定元本額は96,264,121円、同解約元本額は90,160,666円です。

<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) (配当込み) の指数値及び東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に係る標章又は商標は、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 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

○MSCI-KOKUSAI 指数 (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 (配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAI 指数 (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 (配当込み、円ベース) は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI 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

NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、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。なお、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は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行なわれる野村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、ヘッジなし・円ベース)

FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、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・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます) についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国の J.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSLLC」と呼びます) (「指数スポンサー」) は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行なう際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他)