

# 米欧債券・インカムオープン (毎月分配型)

追加型投信／海外／債券

## 交付運用報告書

第204期(決算日2021年1月5日) 第205期(決算日2021年2月5日) 第206期(決算日2021年3月5日)  
第207期(決算日2021年4月5日) 第208期(決算日2021年5月6日) 第209期(決算日2021年6月7日)

作成対象期間(2020年12月8日～2021年6月7日)

第209期末(2021年6月7日)	
基準価額	8,828円
純資産総額	1,601百万円
第204期～第209期	
騰落率	2.8%
分配金(税込み)合計	90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、米欧債券総合マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ておよびユーロ建ての公社債(国債、政府機関債、社債、MBS、CMBS、ABS等)に実質的に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。

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。

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

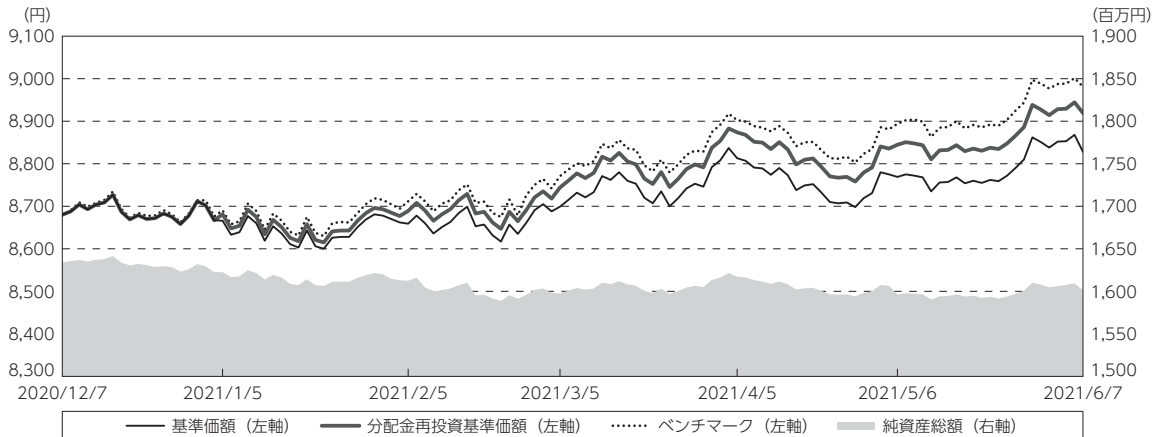


ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## 運用経過

## 作成期間中の基準価額等の推移

(2020年12月8日～2021年6月7日)



第204期首：8,680円

第209期末：8,828円 (既払分配金(税込み)：90円)

騰落率：2.8% (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。作成期首(2020年12月7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) ベンチマークは、ブルームバーグ・バークレイズ・米国総合インデックス(円換算ベース)およびブルームバーグ・バークレイズ・ユーロ総合インデックス(円換算ベース)を50%:50%の比率で当社が独自に合成した指数です。詳細は4ページをご参照ください。ベンチマークは、作成期首(2020年12月7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

米ドル建て債券とユーロ建て債券に、約50%程度ずつの比率で投資しました。このためファンドの基準価額は、円/ドルと円/ユーロの為替レート、及び米欧債券市場の動向の影響を受けて推移しました。当作成期においては、保有していた債券のインカム収入や、円がドルやユーロに対して円安方向へ推移したことなどが基準価額へのプラス要因となりました。

## 1万口当たりの費用明細

(2020年12月8日～2021年6月7日)

項 目	第204期～第209期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 53	% 0.603	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
( 投信会社)	(26)	(0.302)	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)	(24)	(0.274)	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)	( 2)	(0.027)	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	0	0.003	(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
( 先物・オプション)	( 0)	(0.003)	
(c) その他費用	3	0.037	(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
( 保管費用)	( 3)	(0.031)	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)	(0.001)	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)	( 0)	(0.005)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	56	0.643	
作成期間の平均基準価額は、8,737円です。			

(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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

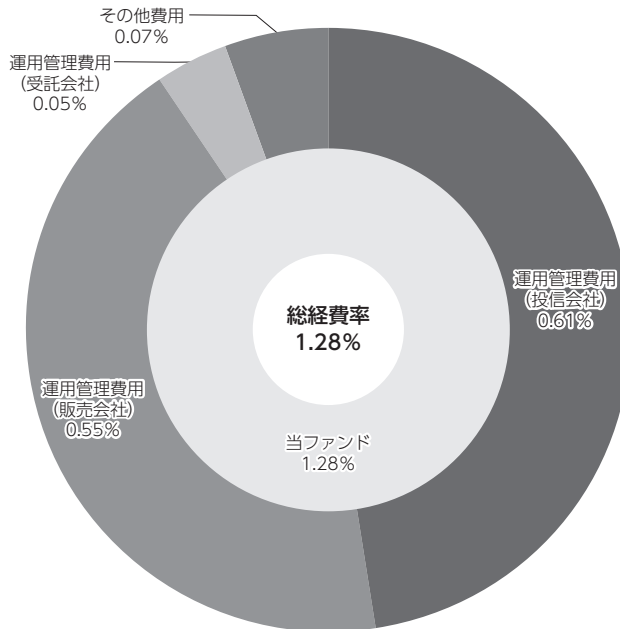
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

## (参考情報)

## ○総経費率

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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1.28%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、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

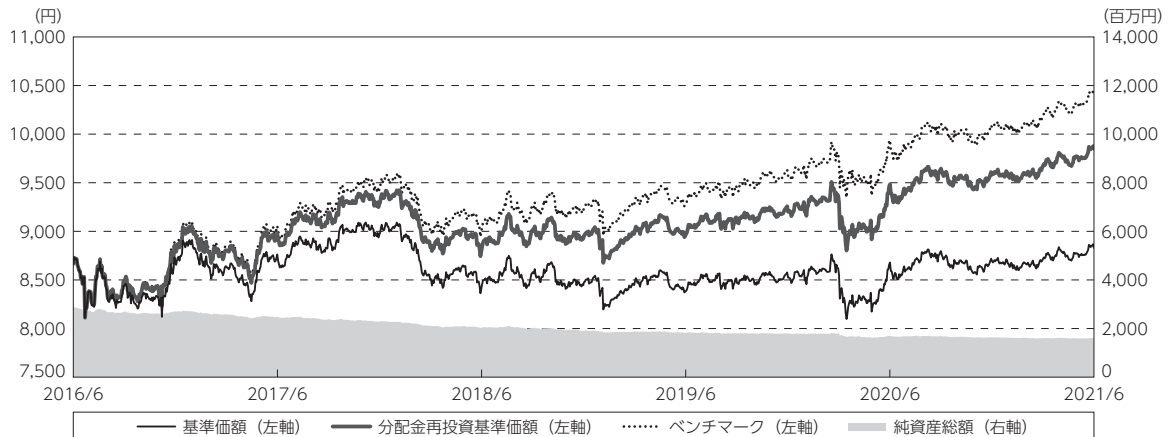
(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(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

(2016年6月6日～2021年6月7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。2016年6月6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) ベンチマークは、ブルームバーグ・パークレイズ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・パークレイズ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数です。詳細は以下をご参照ください。ベンチマークは、2016年6月6日の値が分配金再投資基準価額と同一となるように計算しております。

	2016年6月6日 決算日	2017年6月5日 決算日	2018年6月5日 決算日	2019年6月5日 決算日	2020年6月5日 決算日	2021年6月7日 決算日
基準価額 (円)	8,665	8,696	8,500	8,386	8,659	8,828
期間分配金合計(税込み) (円)	—	220	180	180	180	180
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	3.0	△ 0.2	0.8	5.5	4.1
ベンチマーク騰落率 (%)	—	3.9	1.2	2.0	6.8	4.9
純資産総額 (百万円)	2,856	2,466	2,053	1,825	1,702	1,601

- (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。

\* ベンチマーク＝ブルームバーグ・パークレイズ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・パークレイズ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数

\* ブルームバーグ・パークレイズ・米国総合インデックス（円換算ベース）はブルームバーグ・パークレイズ・米国総合インデックス（米ドルベース）をもとに、ブルームバーグ・パークレイズ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）はブルームバーグ・パークレイズ・ユーロ総合インデックス（ユーロベース）をもとに、当社が独自に円換算したものです。

\* ベンチマークの算出にあたっては、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対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。

\* ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。（出所：ブルームバーグ）

**投資環境**

(2020年12月8日～2021年6月7日)

米国債券市場は、当作成期間では、利回りは上昇（価格は下落）しました。新型コロナウイルスのワクチン接種の普及や米追加経済対策を通じた景気回復期待などから利回りは上昇しました。

欧州債券市場は、当作成期間では、利回りは上昇しました。ドラギ前ECB（欧州中央銀行）総裁の首相就任を受けイタリア政局への不安が後退したことや、米追加経済対策成立への期待感、新型コロナウイルスのワクチン接種進展などから利回りは上昇しました。

為替市場は、ドルについては、経済回復期待が高まったことを背景とした米長期金利の上昇などを受け、当作成期間では上昇しました。

ユーロについては、市場予想を上回る経済指標やワクチン接種進展などを受け、ユーロ圏経済回復への期待感が高まり、当作成期間では上昇しました。

**当ファンドのポートフォリオ**

(2020年12月8日～2021年6月7日)

**[米欧債券・インカムオープン]**

[米欧債券総合マザーファンド] 受益証券の組み入れを高位に維持し、実質外貨建て資産については為替ヘッジを行いませんでした。

**[米欧債券総合マザーファンド]**

- ・ 為替については、当作成期を通じ、ドルとユーロの通貨比率を50%程度ずつに維持しました。
- ・ 債券については、米欧の主要債券セクター（国債・政府機関債、資産担保証券、社債など）にバランスよく分散した投資を行いました。
- ・ ファンドのデュレーションは、2021年5月末に6.6年程度としました。
- ・ 米国のセクター配分について、アセットバック証券の主要セクターであるMBS等、CMBS、ABSは、2021年5月末に9.7%、4.5%、0.8%程度としました。
- ・ 信用リスクについては、保守的なスタンスから、国債、政府機関債とBBB格以上の格付け（主要格付け機関の最低1社がBBB格以上の格付けを付与している）を持つ債券へ限定して投資を行いました。格下げなどで、BBB格未満となった債券は速やかに売却しました。

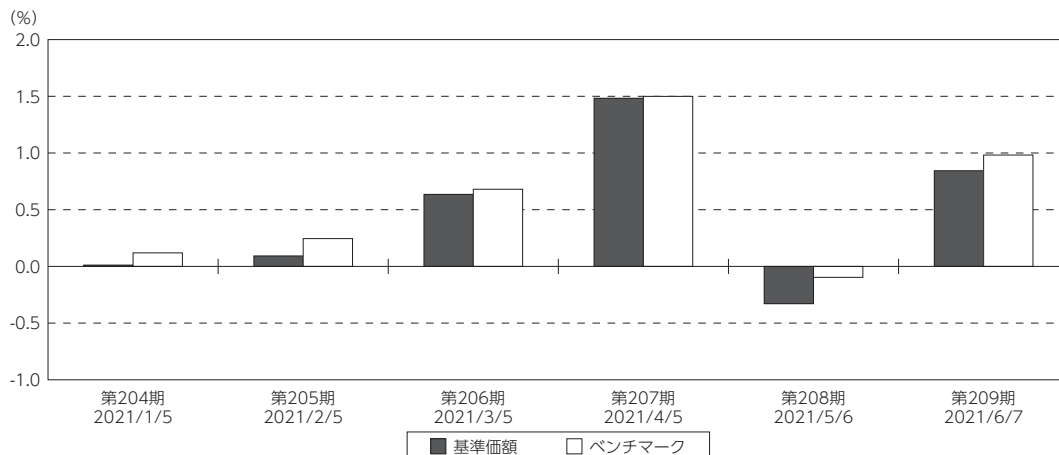
## 当ファンドのベンチマークとの差異

(2020年12月8日～2021年6月7日)

基準価額の騰落率<sup>\*</sup>は+2.8%となり、ベンチマークの+3.5%を0.7ポイント下回りました。基準価額とベンチマークとの主な差異要因は、米国投資適格社債や欧州投資適格社債の銘柄選択などでした。

<sup>\*</sup>基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

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分配金込みです。

(注) ベンチマークは、ブルームバーグ・パークレイズ・米国総合インデックス（円換算ベース）およびブルームバーグ・パークレイズ・ユーロ総合インデックス（円換算ベース）を50%：50%の比率で当社が独自に合成した指数です。

## 分配金

(2020年12月8日～2021年6月7日)

収益分配金については、各期の利子・配当収入などから信託報酬などの諸経費を差し引いた額をベースに決定しました。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204期	第205期	第206期	第207期	第208期	第209期
	2020年12月8日～ 2021年1月5日	2021年1月6日～ 2021年2月5日	2021年2月6日～ 2021年3月5日	2021年3月6日～ 2021年4月5日	2021年4月6日～ 2021年5月6日	2021年5月7日～ 2021年6月7日
当期分配金	15	15	15	15	15	15
(対基準価額比率)	0.173%	0.173%	0.172%	0.170%	0.171%	0.170%
当期の収益	4	—	10	—	3	10
当期の収益以外	10	15	4	15	11	5
翌期繰越分配対象額	395	386	381	379	367	364

(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四捨五入して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

### [米欧債券・インカムオープン]

[米欧債券総合マザーファンド] 受益証券の組み入れ比率を高位に維持し、実質外貨建て資産については為替ヘッジを行いません。

### [米欧債券総合マザーファンド]

- ・引き続き、米ドル建て資産とユーロ建て資産に、ほぼ50%ずつの比率で投資し、通貨を分散させます。
- ・セクター配分や個別銘柄選択については、セクター間及び銘柄間の相対価値に着目し、割安と判断されるセクターと銘柄でポートフォリオを構築していく方針です。また、市場の変動や相対価値の変化に応じて、ポートフォリオをこまめに調整し、収益の拡大を狙います。

## お知らせ

該当事項はございません。

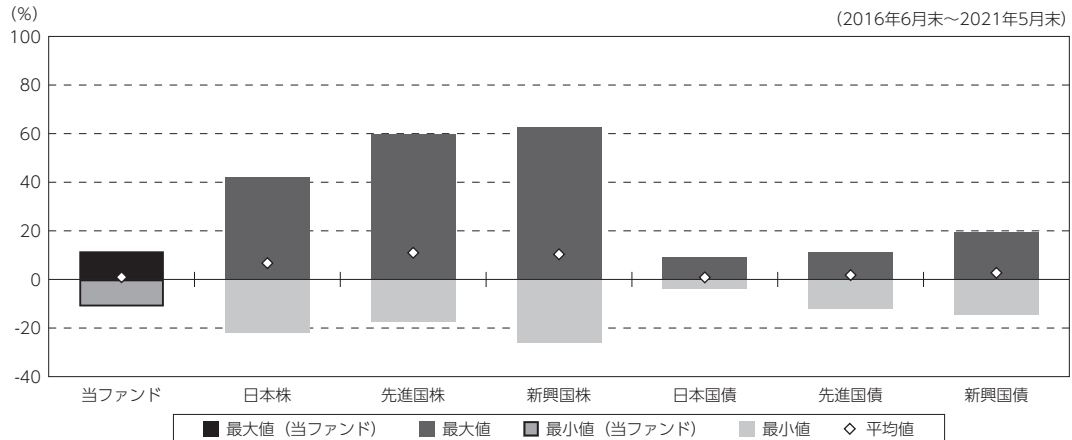
## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2003年12月19日より無期限とします。	
運用方針	米ドル建ておよびユーロ建ての公社債（国債、政府機関債、社債、MBS、CMBS、ABS等）を実質的な主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。米ドル建て資産およびユーロ建て資産への配分は50%：50%程度を基本とします。実質外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要投資対象	米欧債券・インカムオープン	米欧債券総合マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。
	米欧債券総合マザーファンド	米ドル建ておよびユーロ建ての公社債を主要投資対象とします。
運用方法	米欧債券総合マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ておよびユーロ建ての公社債（国債、政府機関債、社債、MBS、CMBS、ABS等）に実質的に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。	
分配方針	毎決算時に、原則として利子・配当等収益等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準等によっては、売買益等が中心となる場合があります。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	11.6	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値	△ 11.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.0	△ 4.0	△ 12.3	△ 14.5
平均値	0.9	6.7	11.0	10.3	0.8	1.8	2.7

(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) 2016年6月から2021年5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・ダイバーシファイド(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

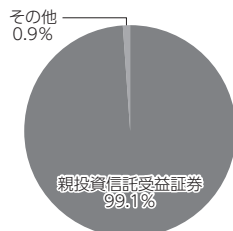
## 組入資産の内容

(2021年6月7日現在)

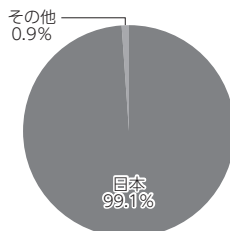
## ○組入上位ファンド

銘柄名	第209期末
米欧債券総合マザーファンド	99.1%
組入銘柄数	1銘柄

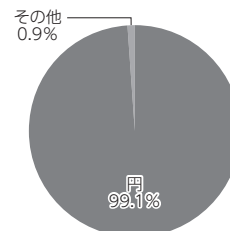
## ○資産別配分



## ○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%とならない場合があります。

(注) 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204期末	第205期末	第206期末	第207期末	第208期末	第209期末
	2021年1月5日	2021年2月5日	2021年3月5日	2021年4月5日	2021年5月6日	2021年6月7日
純資産総額	1,622,560,749円	1,612,469,590円	1,597,580,348円	1,617,156,739円	1,596,254,446円	1,601,161,408円
受益権総口数	1,872,354,109口	1,862,161,054口	1,836,462,281口	1,834,890,373口	1,820,437,285口	1,813,730,533口
1万口当たり基準価額	8,666円	8,659円	8,699円	8,813円	8,769円	8,828円

(注) 当作成期間中(第204期~第209期)における追加設定元本額は3,679,481円、同解約元本額は72,227,542円です。

## 組入上位ファンドの概要

## 米欧債券総合マザーファンド

運用経過等に関する詳細な内容につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

## 【基準価額の推移】



## 【1万口当たりの費用明細】

(2019年12月6日～2020年12月7日)

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	1 (1)	0.006 (0.006)
(b) その他費用 (保管費用)	38 (36)	0.195 (0.188)
(その他)	(1)	(0.007)
合計	39	0.201

期中の平均基準価額は、19,355円です。

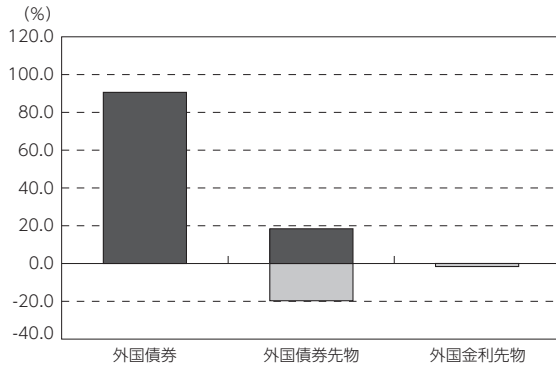
(注) 上記項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。  
 (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
 (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## 【組入上位10銘柄】

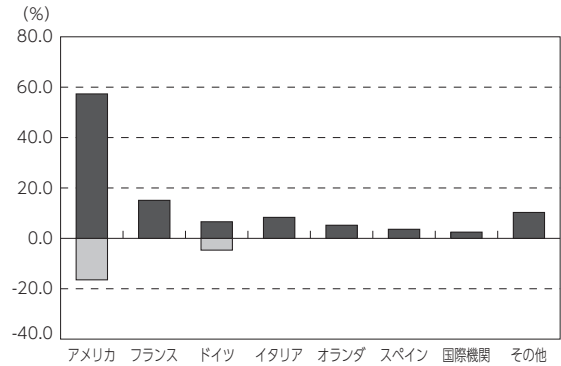
(2020年12月7日現在)

	銘柄名	業種 / 種別等	通貨	国(地域)	比率
1	2Y-TNOTE2103	債券先物(売建)	米ドル	アメリカ	8.5
2	T-NOTE 2103	債券先物(売建)	米ドル	アメリカ	5.3
3	5Y-TNOTE2103	債券先物(買建)	米ドル	アメリカ	4.9
4	BTS 2103	債券先物(買建)	ユーロ	イタリア	4.4
5	US TREASURY N/B 0.25% 2025/7/31	国債	米ドル	アメリカ	4.3
6	T-ULTRA 2103	債券先物(買建)	米ドル	アメリカ	4.0
7	OAT10Y 2103	債券先物(買建)	ユーロ	フランス	3.9
8	US TREASURY N/B 1.5% 2030/2/15	国債	米ドル	アメリカ	3.5
9	SCHATZ 2103	債券先物(売建)	ユーロ	ドイツ	2.6
10	BOBL 2103	債券先物(売建)	ユーロ	ドイツ	2.1
	組入銘柄数		425銘柄		

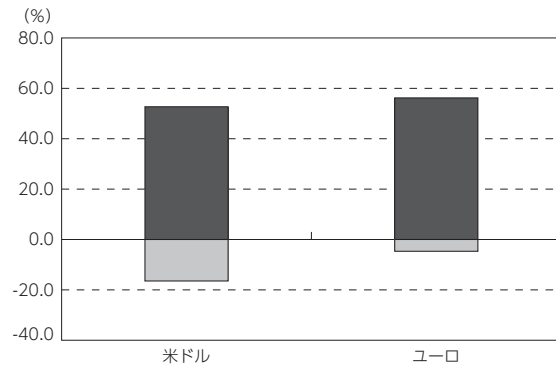
【資産別配分】



【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%となら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。

## <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) は、株式会社東京証券取引所 (㈱東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

### ○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、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)

「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (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を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て、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、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)