

オーロラファンド (日本投資ファンド)

追加型投信／国内／株式

償還交付運用報告書

第30期(償還日2016年10月30日)

作成対象期間(2015年10月31日～2016年10月30日)

第30期末(2016年10月30日)	
償還価額	5,224円24銭
純資産総額	543百万円
第30期	
騰落率	△9.9%
分配金(税込み)合計	-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、日本の株式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、積極的な運用を行いました。

このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行い、償還価額が決定いたしました。

ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

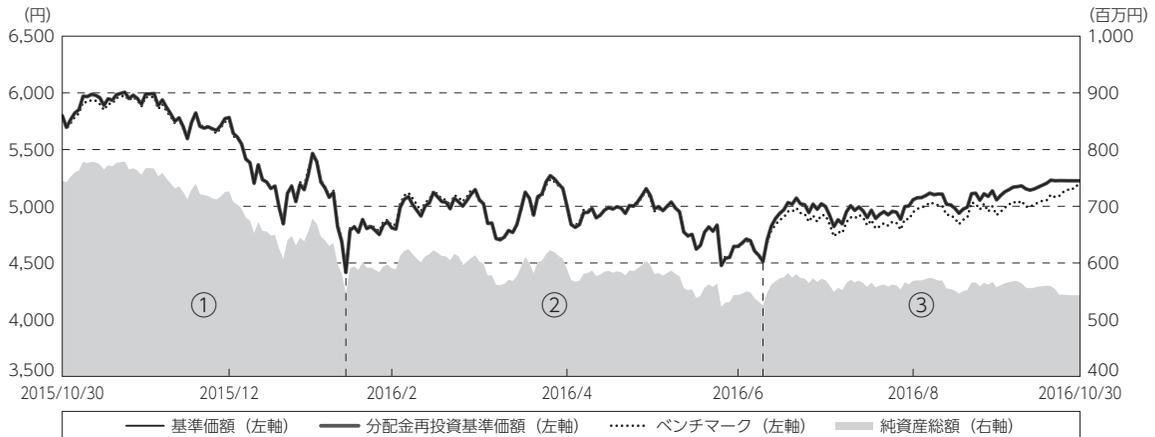
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

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

(2015年10月31日～2016年10月30日)



期 首： 5,799円
 期末(償還日)：5,224円24銭(既払分配金(税込み)：-円)
 騰 落 率： △9.9%(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(2015年10月30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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、東証株価指数(TOPIX)です。ベンチマークは、作成期首(2015年10月30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

* 基準価額は9.9%の下落

基準価額は、期首5,799円から償還時5,224.24円となりました。

①の局面(期首～'16年2月中旬)

(上昇) 日本企業の2015年度上期の企業業績が概ね堅調であったこと

(下落) 原油価格の急落や中国などの新興国・資源国経済に対する先行き不透明感が広がり、金融市場でリスク回避の動きが強まったこと

(上昇) 日銀が1月の金融政策決定会合において「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定したこと

(下落) 欧州の一部金融機関の債券利払いに対する懸念が広がったことや、米国経済の先行き懸念を背景に外国為替市場で円高ドル安が進み、企業業績への悪影響が懸念されたこと

②の局面（2月下旬～7月上旬）

- （上昇）原油価格など商品市況に反転の兆しが見られたことや、金融政策や財政政策への期待などから、リスク回避の動きが後退したこと
- （下落）日銀短観が市場予想を下回ったことなどから国内景気の先行き懸念が広がったことや、製造業を中心に円高を主な要因とした新年度の減益見通しが多く見られたこと
- （上昇）日本での主要国首脳会議（伊勢志摩サミット）を受けて、消費増税延期や大型補正予算などの政策期待が高まったこと
- （下落）英国のEU（欧州連合）残留／離脱を巡る国民投票で離脱派が多数となり、政治情勢や経済の不確実性が高まり、世界的に株式市場が下落したこと

③の局面（7月中旬～償還時）

- （上昇）参議院議員選挙での与党勝利を受けて政府による大規模な景気対策への期待が高まったこと
- （下落）米国の4－6月期実質GDP（国内総生産）成長率が市場予想を下回ったことなどを背景に、円高ドル安が進行したこと
- （上昇）日銀によるETF（上場投資信託）の買い入れ期待などが相場を下支えしたことや、企業業績の下方修正が一巡してきたこと

1万口当たりの費用明細

(2015年10月31日～2016年10月30日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(a) 信託報酬	80	1.534	
(a) 信託報酬 (投信会社)	(24)	(0.454)	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
(a) 信託報酬 (販売会社)	(51)	(0.972)	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
(a) 信託報酬 (受託会社)	(6)	(0.108)	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	0.051	(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
(b) 売買委託手数料 (株式)	(2)	(0.046)	
(b) 売買委託手数料 (先物・オプション)	(0)	(0.005)	
(c) その他費用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(c) その他費用 (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
合 計	83	1.588	
期中の平均基準価額は、5,211円です。			

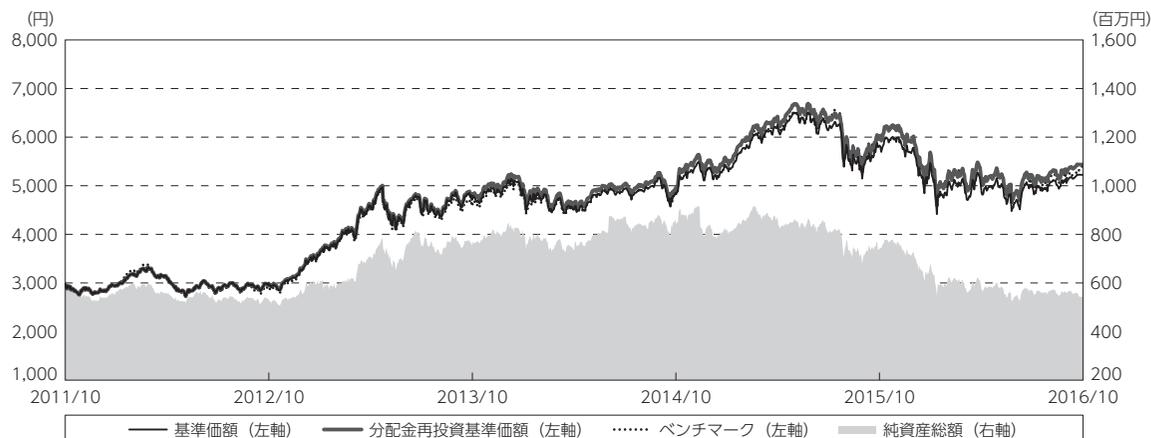
(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(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。

最近5年間の基準価額等の推移

(2011年10月31日～2016年10月30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。2011年10月31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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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、東証株価指数(TOPIX)です。ベンチマークは、2011年10月31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。

	2011年10月31日 決算日	2012年10月30日 決算日	2013年10月30日 決算日	2014年10月30日 決算日	2015年10月30日 決算日	2016年10月30日 償還日
基準価額 (円)	2,967	2,909	4,758	4,878	5,799	5,224.24
期間分配金合計(税込み) (円)	—	20	60	40	70	—
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△ 1.3	65.6	3.4	20.3	△ 9.9
ベンチマーク騰落率 (%)	—	△ 4.0	64.2	6.2	21.8	△ 10.6
純資産総額 (百万円)	587	516	761	849	745	543

(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年前の決算当日との比較です。

投資環境

(2015年10月31日～2016年10月30日)

- (1) 日本の2015年10－12月期の実質GDP成長率は、冬物商品の販売低迷などから実質個人消費が前期比年率－3.2%と大きく落ち込んだことが影響し、前期比年率－1.7%と2四半期ぶりのマイナスとなりました。しかし年明け以降は、1－3月期が同+2.1%、4－6月期が同+0.7%とプラス成長となり、景気は緩やかな拡大が続きしました。製造業を中心に設備投資や輸出の低迷が続いた一方で、住宅投資や補正予算の前倒し執行などによる公共投資の増加が景気を下支えしました。実質個人消費は、人手不足を背景とした雇用増や賃金上昇による所得環境の改善が続く中で、持ち直しました。
- (2) 政策面では、財政・金融の両面から景気を下支えするための政策が相次いで打ち出されました。政府は6月に2017年4月に予定されていた消費税率の10%への引き上げを2019年10月まで延期することを決定し、8月には「一億総活躍社会」実現へ向けた事業規模28.1兆円の経済対策を発表しました。また、日銀は1月の「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を皮切りに、7月にはETF買い入れ額の年間3.3兆円から6兆円への増額と、企業・金融機関の外貨資金調達環境の安定のための措置を決定し、9月には「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入しました。
- (3) 海外経済では、米国は雇用環境の改善が継続して内需主導の底堅い成長が続く中、2015年12月にFRB（米連邦準備制度理事会）は政策金利の引き上げを決定しました。しかしその後は、雇用の拡大ペースが一時的に減速したことや、世界経済の下振れリスクが残る中で、政策金利の引き上げは見送られました。欧州では、低インフレによる実質所得の改善などから緩やかな景気拡大が続き、ECB（欧州中央銀行）は中期的なインフレ期待の安定を目的に、2015年12月と2016年3月に追加金融緩和を決定しました。また、6月の英国のEU残留／離脱を巡る国民投票では離脱派が多数となり、政治情勢や経済の不確実性が高まったことから、8月にイングランド銀行（BOE）は政策金利の引き下げや資産購入などの金融緩和を実施しました。
- (4) 日本の主要企業（除く金融）の経常増益率は、2015年10－12期が前年同期比－1.5%、2016年1－3月期が同－26.5%、4－6月期が同－16.7%となり、3四半期連続の経常減益となりました。2016年度通期の予想経常増益率は前年度比+0.8%、2017年度は同+10.6%と予想されています。

当ファンドのポートフォリオ

(2015年10月31日～2016年10月30日)

・株式組入比率

期首97.9%で始まり、期を通じて高位を維持した後、償還に向けて引き下げました。

・期中の主な動き

- ・「株式投資にあたっては、日本株式の中から収益性、成長性、安定性などを総合的に勘案して選択した銘柄に投資します。」との運用の基本方針に基づいた運用を継続しました。

- ・電気機器において、固定費削減などによる収益性の改善に加えて車載関連事業の中期的な成長が期待された日本シイエムケイなどを買い付けしました。また、非鉄金属において、金属価格の底打ちによる業績の改善が見込まれた三井金属鉱業などを買い付けしました。
- ・陸運業において、大規模修繕工事に伴う費用増などにより利益の伸び悩みが懸念された東日本旅客鉄道などを売却しました。また、化学において、液晶材料やドキュメント事業の業績悪化が懸念された富士フィルムホールディングスなどを売却しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2015年10月31日～2016年10月30日)

*ベンチマーク対比では0.7ポイントのプラス

今期の基準価額の騰落率は-9.9%となり、ベンチマークである東証株価指数 (TOPIX) の-10.6%を0.7ポイント上回りました。

【主な差異要因】

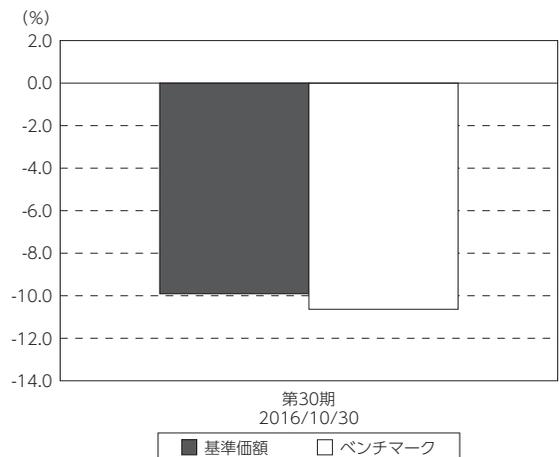
(プラス要因)

- ①ベンチマークに比べて値下がりが大きかった銀行業、輸送用機器への投資を少なめにしていたこと
- ②保有していたメガチップス、キーエンス、シークスなどが大きく値上がりしたこと

(マイナス要因)

- ①ベンチマークに比べて値下がり小さかった医薬品や食品への投資を少なめにしていたこと
- ②保有していたJ.フロント リテイリング、村田製作所、日本郵船などの値下がりベンチマークに比べて大きかったこと
- ③償還に向けた株式の売却後に、ベンチマークが上昇したこと

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



(注) ベンチマークは、東証株価指数 (TOPIX) です。

分配金

(2015年10月31日～2016年10月30日)

償還のため分配は行いませんでした。

設定来の運用経過

〈設定来の基準価額の推移〉



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時の10,000円から償還時5,224.24円となりました。設定来お支払いした分配金の合計は1万口あたり2,780円となりました。

① 1期～5期

- (上昇) 公定歩合の引き下げによる金利低下に加えて、円高や原油安などにより、内需関連企業を中心に業績が堅調に推移したこと
- (上昇) 海外経済の回復などにより世界的に株式市場が堅調に推移したことに加えて、国内景気も拡大基調が続いたこと
- (下落) インフレ懸念を背景に金利の先高感が広がったことや、イラクのクウェート侵攻により原油価格が急騰し、世界的に株式市場が下落したこと
- (上昇) 世界的に金利低下傾向が鮮明となり、株式市場が上昇に転じたこと

② 6期～10期

- (下落) 景気や企業収益の悪化に加えて、金融機関の不良債権問題に対する懸念が強まったこと
- (上昇) 公定歩合の引き下げや財政政策による景気回復期待が高まったこと
- (下落) 阪神・淡路大震災の発生や国内経済指標の悪化を受けて、企業業績や景気の腰折れ懸念が強まったこと
- (上昇) 住宅金融専門会社（住専）の不良債権処理の具体化が好感されたことや、国内景況感の改善が見られたこと

③ 11期～15期

- (下落) 消費税率の引き上げや特別減税の廃止が打ち出され、景気失速懸念が広がったことや、金融機

関の経営破綻などから、金融システム不安が台頭したこと

- (下落) 景気の先行き懸念が強まったことや、アジアやロシアの通貨危機の発生を受けて世界的に株式市場が下落したこと
- (上昇) 大規模な経済対策や日銀によるゼロ金利政策により景気が下支えされたことや、世界的に情報通信関連投資への楽観的な見方が広がったこと
- (下落) 世界の携帯電話やパソコン及び半導体の成長率の鈍化により、ハイテク関連企業中心に業績悪化懸念が台頭したこと
- (下落) 景気や企業収益の悪化が鮮明になってきたことや、構造改革に伴うデフレ懸念が強まったこと

④16期～20期

- (下落) 銀行の不良債権処理の遅れに対する懸念が強まったことや、金融機関の株式持ち合い解消や厚生年金基金の代行返上などにより株式需給が悪化したこと
- (上昇) 企業業績の回復基調が確認されたことや、国内経済指標の改善を受けて景気回復への期待が高まったこと
- (上昇) 為替が円安基調で推移し、企業業績に安心感が広がったことや、政府・日銀による景気の踊り場脱却宣言で、国内景気の改善期待が強まったこと
- (下落) 米国の金融政策への先行き不透明感の強まりなどから、新興国の株式市場が大きく下落したこと

⑤21期～25期

- (上昇) M&A(企業の合併・買収)の増加や増配・自社株買いなどの活発化により、日本企業の企業価値の向上が期待されたこと
- (下落) 米国でのサブプライムローン(信用力の低い個人向け住宅ローン)問題の広がりから、欧米の主要金融機関の経営不安が相次ぎ、世界的に金融不安が広がったこと
- (下落) 日米欧などの先進国や主要新興諸国の実質成長率などの経済指標が、相次いで実体経済の急激かつ大きな悪化を示したこと
- (上昇) 各国政府及び中央銀行が公的資金による資本の増強や政府保証の拡大など、相次いで金融・経済安定化策を打ち出したこと
- (下落) 欧州諸国の財政赤字問題に対する懸念が強まる一方で、東日本大震災の発生により日本経済の先行きに対して不透明感が広がったこと

⑥26期～30期

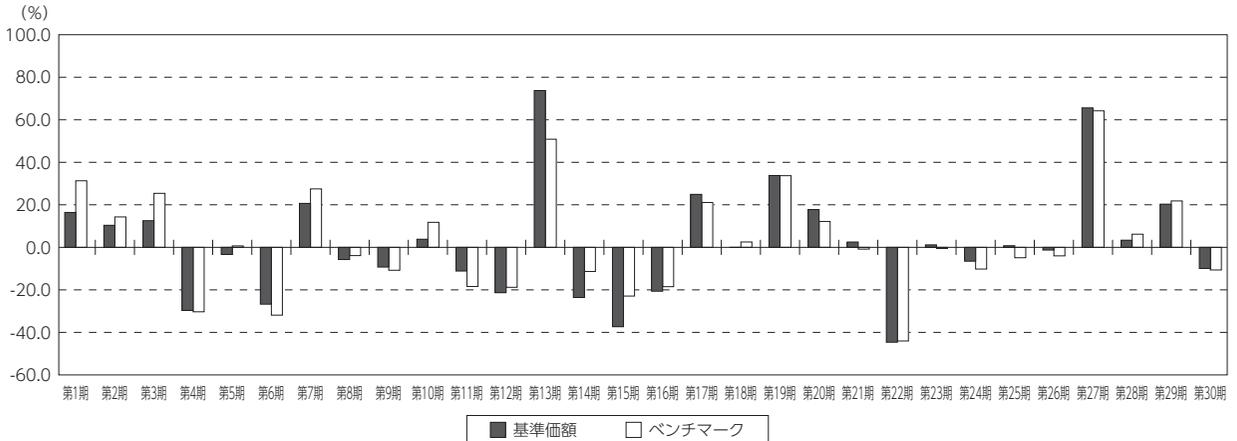
- (上昇) 政権交代によりデフレ脱却に向けた大胆な経済政策や成長戦略への期待が高まったことや、日銀による「量的・質的金融緩和」導入により、外国為替市場で円安が進んだこと
- (下落) 消費増税後の国内景気の落ち込みが想定以上に長期化したこと
- (上昇) 日銀による追加金融緩和や消費税増税の延期決定により、国内景気の先行きに対する懸念が後退したこと
- (下落) 原油価格の急落や中国などの新興国・資源国経済に対する先行き不透明感が広がり、金融市場でリスク回避の動きが強まったこと
- (下落) 米国経済の先行き懸念を背景に外国為替市場で円高ドル安が進み、企業業績への悪影響が懸念されたこと

○ベンチマークとの差異

設定来では、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）が-2.1%となったのに対し、基準価額の騰落率[※]は-30.6%となりました。

※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、東証株価指数（TOPIX）です。

(主なプラス要因)

- ・第6期にベンチマークが大きく下落する中で、実質株式比率を60%~85%程度としていたこと
- ・第11期にベンチマークに比べて値下がりが大きかった銀行業や証券業などへの投資を少なめにしていたこと
- ・第13期に保有していた市況・素材関連株やソフトウェア関連株などが大きく上昇したこと
- ・第20期、第21期にベンチマークをアンダーパフォームした銀行業への投資を少なめにしていたことや、保有していたゲーム関連株などが大きく上昇したこと
- ・第24期~第27期にベンチマークをアンダーパフォームした電気・ガス業への投資を少なめにしていたことや、保有していた自動車関連株や電気機器株などが大きく上昇したこと

(主なマイナス要因)

- ・第1期から第3期にかけてベンチマークが大きく上昇する中で、実質株式組入比率を40%~80%程度としていたこと
- ・第7期にベンチマークが大きく上昇する中で、実質株式比率を80%台としていたこと
- ・第14期、第15期にベンチマークに比べて値下がりが大きかった電気機器やサービス業への投資を多めにしていた一方で、堅調な値動きを示した電気・ガス業や陸運業への投資を少なめにしていたこと

お知らせ

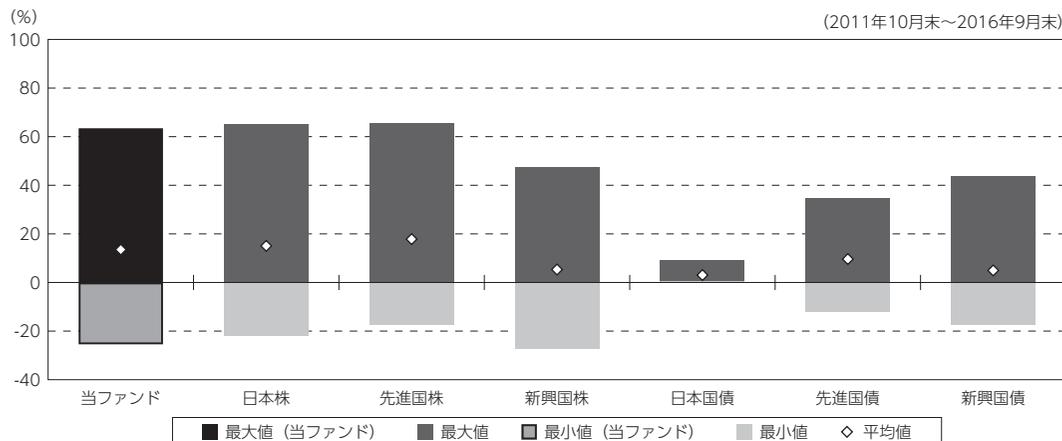
該当事項はございません。

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／株式
信託期間	1986年10月31日から2016年10月30日（当初、2001年10月30日）までです。
運用方針	日本の証券への投資により、信託財産の成長をはかることを目的として、積極的な運用を行います。 日本株式の中から収益性、成長性、安定性などを総合的に勘案して選択した銘柄に投資します。
主要投資対象	日本の株式を主要投資対象とします。
運用方法	日本の株式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、積極的な運用を行います。
分配方針	配当等収益は原則として全額分配し、売買益等は運用実績を勘案して分配します。

(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	63.5	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	△ 25.4	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	0.5	△ 12.3	△ 17.4
平均値	13.5	15.0	17.8	5.3	3.0	9.6	4.9

(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) 2011年10月から2016年9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：シティ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

(2016年10月30日現在)

2016年10月30日現在、有価証券等の組入れはございません。

純資産等

項 目	第30期末(償還日)
	2016年10月30日
純資産総額	543,060,250円
受益権総口数	1,039,501,703口
1万口当たり償還価額	5,224円24銭

(注) 期中における追加設定元本額は51,376,686円、同解約元本額は297,001,518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) 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。

○シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

「シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLC が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益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、Citigroup Index LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index 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ち、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、Citigroup Index LLC 他)