

ノムラ・アジア・シリーズ (ノムラ・豪州・フォーカス)

追加型投信／海外／株式

償還交付運用報告書

第15期(償還日2024年9月12日)

作成対象期間(2023年9月13日～2024年9月12日)

第15期末(2024年9月12日)	
償還価額	25,794円02銭
純資産総額	176百万円
第15期	
騰落率	23.4%
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、野村豪州株マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてオーストラリアの企業の株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に投資を行ない、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行ないました。

このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行ない、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株式会社

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

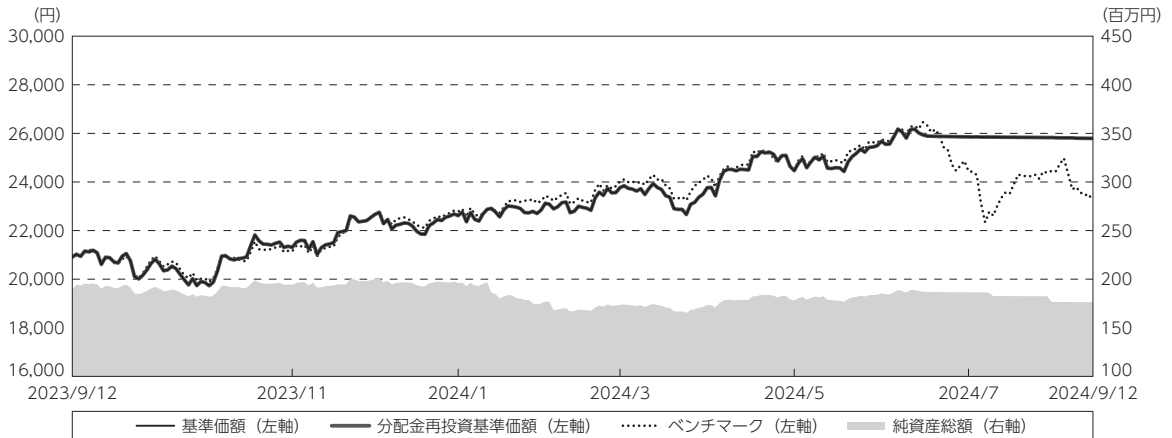
●ホームページ

<https://www.nomura-am.co.jp/>

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2023年9月13日～2024年9月12日)



期 首： 20,911円

期末(償還日)：25,794円02銭(既払分配金(税込み)：-円)

騰 落 率： 23.4% (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(2023年9月12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、S&P/ASX200指数(円換算ベース)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(2023年9月12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) 米金融引き締め長期化への懸念が高まったこと、2023年7-9月期のCPI(消費者物価指数)上昇率が市場予想を上回り、利上げ懸念が高まったこと
- (上 昇) 米金融引き締め長期化に対する懸念が後退したこと、堅調な中国の経済指標などを好感し鉄鉱石価格が上昇したこと、RBA(豪州準備銀行)がインフレ緩和の兆しを指摘したことなどから商品関連株や銀行株などが買われたこと、2024年1月の豪雇用統計が市場予想に反して低調だったことや2月のCPI上昇率が市場予想を下回ったことを受け、年内の利下げ観測が強まったこと
- (下 落) 中東情勢を巡る地政学的リスクの高まりが警戒されたこと、米早期利下げ期待が後退したこと
- (上 昇) 2024年1-3月期の実質GDP(国内総生産)成長率が市場予想を下回り、利上げ懸念が後退したこと、買収の検討が報道されたエネルギー株などが上昇したこと、為替市場で豪ドル高・円安が進行したこと
- (横ばい) 償還に伴い、保有有価証券の全売却を行ない、安定運用に切り替えたこと

1万口当たりの費用明細

(2023年9月13日～2024年9月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 397	% 1.705	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投信会社)	(192)	(0.825)	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)	(192)	(0.825)	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)	(13)	(0.055)	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	31	0.132	(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)	(29)	(0.124)	
(投資信託証券)	(2)	(0.008)	
(c) その他費用	91	0.392	(c) 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)	(90)	(0.386)	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)	(0.003)	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)	(1)	(0.003)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	519	2.229	
期中の平均基準価額は、23,266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。

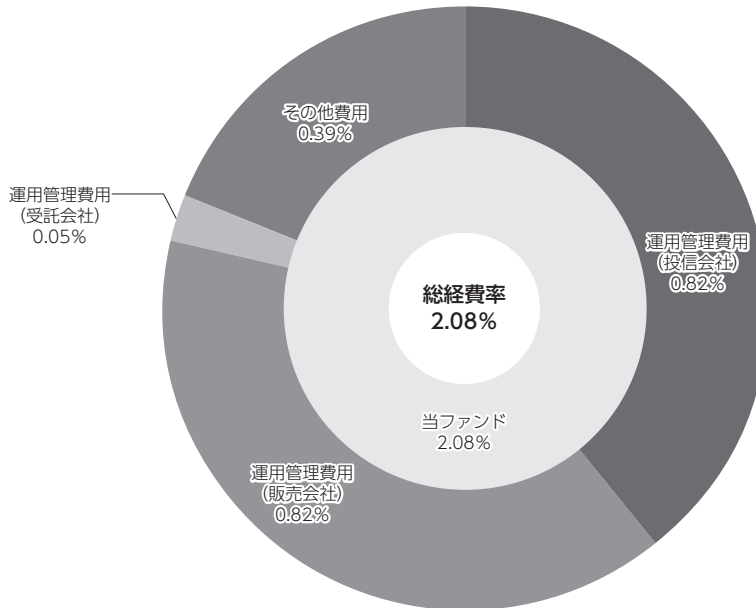
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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2.08%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。

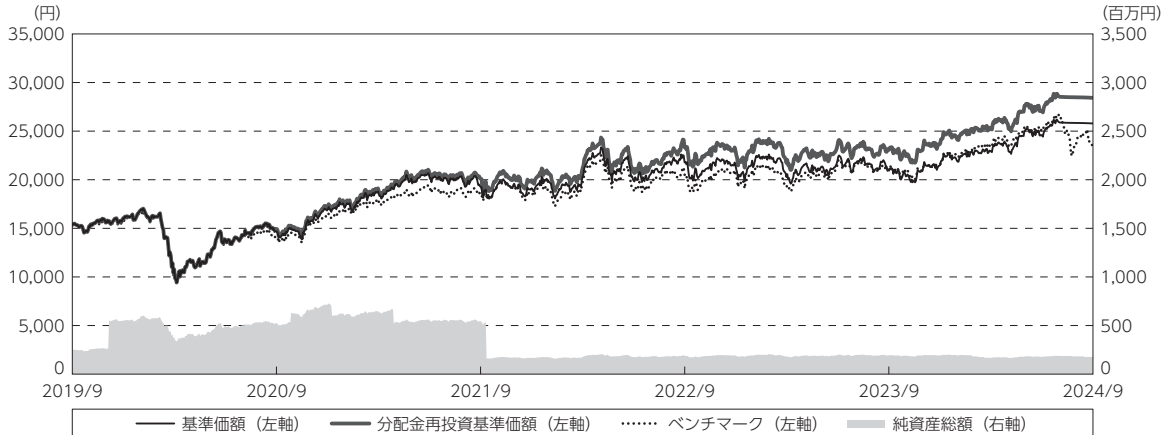
(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(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) 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

(2019年9月12日～2024年9月12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。2019年9月12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、S&P/ASX200指数(円換算ベース)です。詳細は以下をご参照ください。ベンチマークは、2019年9月12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。

	2019年9月12日 決算日	2020年9月14日 決算日	2021年9月13日 決算日	2022年9月12日 決算日	2023年9月12日 決算日	2024年9月12日 償還日
基準価額 (円)	15,336	14,623	19,459	22,243	20,911	25,794.02
期間分配金合計(税込み) (円)	—	250	500	600	600	—
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△ 3.0	36.5	17.4	△ 3.3	23.4
ベンチマーク騰落率 (%)	—	△ 8.2	32.5	12.4	0.6	12.4
純資産総額 (百万円)	244	512	535	187	189	176

(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(=S&P/ASX200指数(円換算ベース))は、S&P/ASX200指数(豪ドルベース)をもとに、当社が独自に円換算したものです。なお、指数算出にあたっては、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為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算しております。

*S&P/ASX200指数は、スタンダード&プアーズが発表している、オーストラリア証券取引所上場の時価総額上位200銘柄で構成される時価総額加重平均指数です。当該指数に関する一切の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーに帰属しております。

(出所) ブルームバーグ、為替レート(対顧客電信売買相場仲値)

投資環境

(2023年9月13日～2024年9月12日)

豪州株式市場は、期初、米金融引き締め長期化への懸念や2023年7－9月期のCPI上昇率が市場予想を上回り、利上げ懸念が高まったことなどから下落しました。11月以降は、米金融引き締め長期化に対する懸念が後退したことや堅調な中国の経済指標などを好感し鉄鉱石価格が上昇したこと、RBAがインフレ緩和の兆候を指摘したことなどから商品関連株や銀行株などが買われ上昇しました。

2024年1月に入ると、国内のインフレ指標の発表を前に投資家のリスク回避姿勢が強まったことや中国の利下げ見送りなどを受けて鉄鉱石価格が低迷したことを受け下落しました。しかし下旬には、2023年12月の小売売上高が前月比で減少したことを受けてRBAが利上げを見送るとの見方が強まったことなどから上昇に転じ、その後も1月の雇用統計が市場予想に反して低調だったことや2月のCPI上昇率が市場予想を下回り、年内の利下げ観測が再び強まったことを受けて、続伸しました。

4月には、中東情勢を巡る地政学的リスクの高まりが警戒されたことや、米早期利下げ期待が後退したことなどから下落しましたが、1－3月期の実質GDP成長率が市場予想を下回り、利上げ懸念が後退したことや買収の検討が報道されたエネルギー株などが上昇したことを受けて再び上昇しました。8月には、米景気減速懸念から世界的な株安となり下落したものの、期末にかけて反発し、当期において豪州株式市場は上昇となりました。

為替市場では、FRB（米連邦準備制度理事会）の早期利下げ期待が後退したことや、日銀が緩和的な金融政策を維持する見通しを示したことなどを背景に日米金利差の拡大期待が高まったことで2024年6月にかけて米ドル高・円安が進行しました。期末にかけては、米利下げ期待の高まりに加え、日銀の金融政策修正などにより日米金利差が縮小するとの見方が強まったことから米ドル安・円高となり、当期においては米ドル安・円高となりました。一方、豪ドルは、RBAによる年内の利下げ観測が後退したことなどから対米ドルで豪ドル高が進行し、対円でも豪ドル高・円安となりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2023年9月13日～2024年9月12日)

[野村豪州株マザーファンド]

・期中の主な動き

<投資比率を引き上げた主な業種・銘柄>

- ① AIの普及に伴うデータセンターの需要拡大の恩恵が期待できると判断したGOODMAN GROUP (工業用不動産投資信託)
- ② 中国政府による豪州産ワインに対する課税見直しの恩恵が期待できると判断したTREASURY WINE ESTATES LTD (飲料)

<投資比率を引き下げた主な業種・銘柄>

- ① 自動車需要の低迷を背景としたリチウム価格下落の影響が懸念されたMINERAL RESOURCES LTD (金属・鉱業)
- ② LNG (液化天然ガス) 価格低迷の悪影響が懸念されたWOODSIDE ENERGY GROUP LTD (石油・ガス・消耗燃料)
- ③ ファンド償還に向け、保有有価証券の全売却を行ないました。

・為替ヘッジ

当ファンドの方針に従い、為替ヘッジ (為替の売り予約) は行ないませんでした。

[ノムラ・アジア・シリーズ (ノムラ・豪州・フォーカス)]

・組入比率

主要投資対象である [野村豪州株マザーファンド] 受益証券を、期を通じておおむね高位に組み入れました。

・為替ヘッジ

当ファンドの方針に従い、為替ヘッジ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

(2023年9月13日～2024年9月12日)

当期は、ベンチマーク（S&P/ASX200指数（円換算ベース））が12.4%の上昇となったのに対して、基準価額は23.4%の上昇となりました。

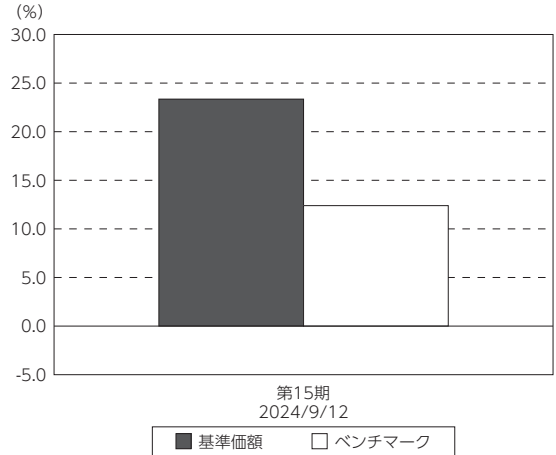
(主なプラス要因)

- ① AIの普及に伴うデータセンターの需要拡大の恩恵が期待され株価騰落率がベンチマークを上回った工業用不動産投資信託をオーバーウェイト（ベンチマークより高い投資比率）としていたこと
- ② 新しい経営陣による事業改革への期待から株価騰落率がベンチマークを上回った、カジノゲーム機器などを提供するホテル・レストラン・レジャー株をオーバーウェイトとしていたこと

(主なマイナス要因)

- ① 土地税制の変更を受けて収益見通しの不透明感が高まり株価騰落率がベンチマークを下回った不動産管理・開発株をオーバーウェイトとしていたこと
- ② 米大統領選挙を控え再生可能エネルギー関連政策の不透明感が高まり株価騰落率がベンチマークを下回ったエネルギーや資源開発プロジェクトを手掛ける建設・土木株をオーバーウェイトとしていたこと

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、S&P/ASX200指数（円換算ベース）です。

分配金

(2023年9月13日～2024年9月12日)

償還のため分配は行ないませんでした。

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円が償還時25,794.02円となりました。設定来お支払いした分配金は1万円当たり3,530円となりました。

第1期－第5期

- (上 昇) 国内の景気回復に加え、米国や中国の景気回復の恩恵も受けるとの期待が高まったこと、日本の原発事故の影響で世界の電力供給が火力発電へシフトするとの見方から、エネルギー商品市況が堅調に推移したこと
- (下 落) IEA（国際エネルギー機関）が加盟国の石油備蓄を放出する方針を示したことで原油先物価格が下落したこと、米連邦債務の上限引き上げ協議が難航し世界的に株安となったこと
- (上 昇) 米国で「財政の崖」回避法案が可決され景気悪化の懸念が後退したこと、中国の景気刺激策への期待を背景に商品市況が上昇したこと、炭素税廃止法案が上院を通過したこと

第6期－第10期

- (上 昇) RBAが利下げを実施したことや原油価格の回復が好感されたこと、米早期利上げ観測の後退から金融株など高配当銘柄が買い戻されたこと
- (下 落) 中国の株安や原油安、欧州金融機関の信用不安などをを受け投資家のリスク回避姿勢が強まったこと
- (上 昇) OPEC（石油輸出国機構）の減産合意などをを受けて原油高が好感されたこと、堅調な中国経済指標や米株高が好感されたこと
- (下 落) 米長期金利上昇への警戒感から世界的な株安となったこと、与党・自由党の党首を巡る政局不透明感が嫌気されたこと、中国の景気減速懸念が強まったこと
- (上 昇) 2019年5月の総選挙で与党・保守連合が想定外に勝利を収めたことが好感されたこと、米中貿易摩擦緩和の動きや主要各国の追加金融緩和への期待が高まったこと

第11期～第15期

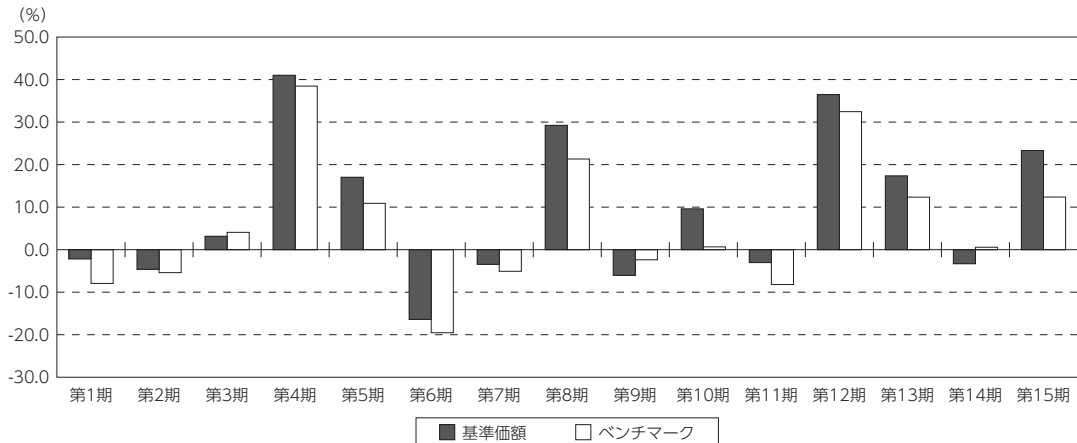
- (下 落) 新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、世界的な経済活動の停滞による景気減速への懸念が高まったこと
- (上 昇) 新型コロナウイルスのワクチン接種普及による経済正常化への期待が高まったこと、大規模な米追加経済対策の成立やRBAによる金融緩和策の継続が好感されたこと
- (横ばい) 新型コロナウイルスに伴うロックダウン（都市封鎖）が解除されたこと、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受け、市場に先行き不透明感が広がったこと
- (上 昇) ロシアへの経済制裁措置を背景とした供給懸念から資源価格が上昇し資源関連株が上昇したこと、為替市場で豪ドル高・円安が進行したこと

○ベンチマークとの対比

設定来では、ベンチマークが96.3%の上昇となったのに対して、基準価額（分配金再投資）は217.1%の上昇となりました。

主なプラス要因は「野村豪州株マザーファンド」において、保有銘柄の銘柄選択がプラスに寄与したことなどです。

＜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、S&P/ASX200指数（円換算ベース）です。

当ファンドは約款の規定により、2024年9月12日をもちまして償還となりました。ご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。

お知らせ

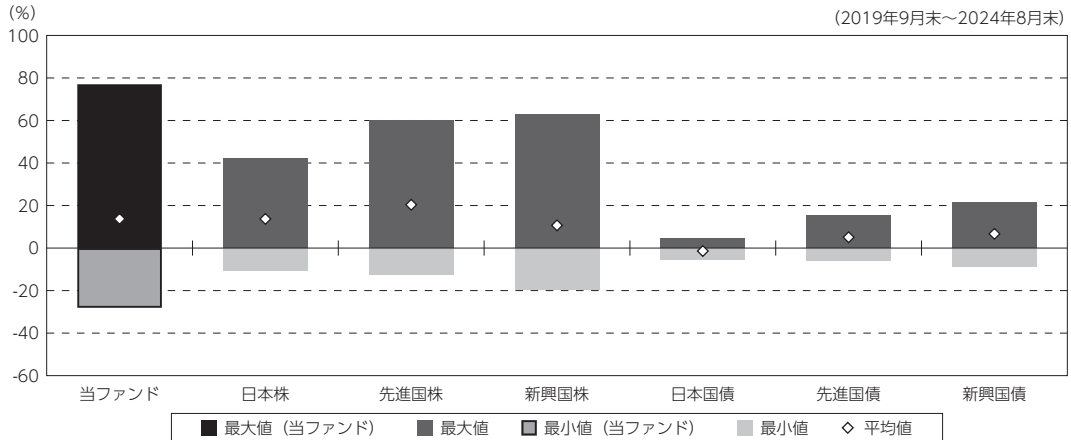
投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する所要の約款変更を行ないました。
 <変更適用日：2024年7月4日>

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	2009年12月7日から2024年9月12日までです。	
運用方針	野村豪州株マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主としてオーストラリアの企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。	
主要投資対象	ノムラ・アジア・シリーズ (ノムラ・豪州・フォーカス)	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	オーストラリアの企業の株式を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてオーストラリアの企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に投資を行ない、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。	
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。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。	

(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	77.0	42.1	59.8	62.7	4.4	15.3	21.5
最小値	△ 28.1	△ 10.4	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値	13.7	13.7	20.4	10.7	△ 1.4	5.1	6.7

(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) 2019年9月から2024年8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

(2024年9月12日現在)

2024年9月12日現在、有価証券等の組入れはございません。

マザーファンドの直近の計算期間の内容につきましては、償還運用報告書（全体版）に記載しております。

純資産等

項 目	第15期末(償還日)	
	2024年9月12日	
純資産総額	176,374,989円	
受益権総口数	68,378,246口	
1万口当たり償還価額	25,794円02銭	

(注) 期中における追加設定元本額は2,296,494円、同解約元本額は24,377,052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)

配当込み TOPIX (「東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)」といいます。) 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」といいます。) 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)