



Russell 1000® Universe

2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017*
Highest index returns														
Size 44.39	Yield Focused 25.41	Momentum Focused 16.97	Yield 22.72	Quality 11.56	Low Volatility Focused -27.04	Yield Focused 42.84	Size 27.76	Yield 11.06	Yield Focused 19.20	Momentum Focused 40.21	Low Volatility Focused 19.16	Volatility 3.06	Yield Focused 23.35	Quality 28.07
Momentum Focused 34.49	Low Volatility Focused 23.34	Comprehensive 15.28	Yield Focused 20.70	Momentum 9.13	Volatility -31.10	Size 41.73	Momentum Focused 25.62	Volatility 8.46	Size 19.19	Comprehensive 38.15	Volatility 15.85	Momentum 2.69	Value 18.66	Momentum 22.83
Low Volatility Focused 31.48	Comprehensive 21.33	Size 11.08	Value 19.43	Momentum Focused 7.09	Quality -31.14	Momentum Focused 37.34	Comprehensive 23.59	Quality 8.46	Value 18.82	Low Volatility Focused 37.56	Comprehensive 14.89	Quality 2.11	Yield 17.37	Russell 1000 21.69
Comprehensive 31.40	Momentum Focused 20.45	Low Volatility Focused 10.55	Volatility 18.29	Comprehensive 5.89	Comprehensive -31.37	Low Volatility Focused 32.21	Low Volatility Focused 23.49	Comprehensive 6.31	Momentum Focused 17.25	Size 36.60	Yield 14.03	Low Volatility Focused 2.08	Low Volatility Focused 16.22	Momentum Focused 21.07
Value 29.99	Size 18.00	Momentum 9.21	Low Volatility Focused 16.78	Russell 1000 5.77	Yield Focused -32.23	Comprehensive 32.17	Yield Focused 23.00	Low Volatility Focused 6.17	Low Volatility Focused 16.93	Value 36.38	Quality 13.33	Comprehensive 2.00	Size 15.99	Comprehensive 20.22
Yield Focused 29.94	Value 16.64	Value 8.35	Comprehensive 15.85	Value 3.92	Yield -32.46	Russell 1000 28.43	Value 20.13	Yield Focused 4.90	Comprehensive 16.51	Yield Focused 36.15	Russell 1000 13.24	Russell 1000 0.92	Comprehensive 13.07	Volatility 20.00
Russell 1000 29.89	Yield 12.79	Quality 7.54	Russell 1000 15.46	Volatility 3.70	Momentum Focused -35.95	Quality 26.72	Yield 17.34	Momentum Focused 3.70	Russell 1000 16.42	Momentum 33.58	Value 12.88	Yield 0.04	Momentum Focused 12.72	Value 19.74
Momentum 26.92	Volatility 11.77	Yield Focused 6.63	Momentum 14.59	Size 3.48	Momentum -36.66	Value 24.90	Momentum 17.07	Momentum 2.28	Quality 16.09	Russell 1000 33.11	Momentum 12.65	Momentum Focused -0.70	Russell 1000 12.05	Size 18.25
Yield 25.26	Momentum 11.64	Russell 1000 6.27	Momentum Focused 14.45	Low Volatility Focused 2.93	Value -36.74	Momentum 22.44	Russell 1000 16.10	Value 1.80	Momentum 15.45	Quality 31.66	Yield Focused 12.62	Size -2.26	Volatility 11.56	Low Volatility Focused 18.22
Quality 24.21	Russell 1000 11.40	Volatility 4.24	Quality 14.30	Yield 1.99	Size -37.58	Volatility 17.85	Quality 14.55	Russell 1000 1.50	Volatility 13.25	Volatility 29.61	Momentum Focused 12.30	Value -3.34	Quality 10.71	Yield 15.96
Volatility 20.59	Quality 10.50	Yield 3.85	Size 14.26	Yield Focused -2.26	Russell 1000 -37.60	Yield 17.02	Volatility 11.83	Size -1.17	Yield 11.84	Yield 28.60	Size 11.32	Yield Focused -7.49	Momentum 7.94	Yield Focused 15.64
Lowest index returns														

*情報源: FTSE Russell. Data as of December 29, 2017. 開始日を含むパフォーマンスキルトチャートに参照されているインデックスは、以下の表にリストされています。本日より前のリターンはシミュレーションしたものです。

開始日を含むパフォーマンスキルトチャートに参照されているインデックスは、以下の表にリストされています。本日より前のリターンはシミュレーションしたものです。

インデックス	開始月	インデックス	開始月	インデックス	開始月
Russell 1000 Comprehensive Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Quality Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Index	Dec-1978
Russell 1000 Low Volatility Focused Factor Index	Nov-2015	Russell 1000 Size Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Yield Factor Index	Sep-2015
Russell 1000 Momentum Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Value Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Yield Focused Factor Index	Nov-2015
Russell 1000 Momentum Focused Factor Index	Nov-2015	Russell 1000 Volatility Factor Index	Sep-2015		

Russell 1000® Universe

当社のインデックスの詳細については、ftserussell.comをご覧ください

FTSE Russell 資料の免責事項

London Stock Exchange Group plcおよび関連グループ事業体（「LSEグループ」）。LSEグループには、(1)FTSE International Limited（「FTSE」）、(2)Frank Russell Company（「Russell」）、(3)FTSE TMX Global Debt Capital Markets IncおよびFTSE TMX Global Debt Capital Markets Limited（合わせて「FTSE TMX」といいます）ならびに(4) MTSNext Limited（「MTSNext」）が含まれます。無断複写・転載を禁じます。

FTSE Russell®は、FTSE、Russell、FTSE TMXおよびMTS Next Limitedの商号です。ここで使用される「FTSE®」、「Russell®」、「FTSE Russell®」、「MTS®」、「FTSE TMX®」、「FTSE4Good®」、「ICB®」およびその他の商標ならびにサービスマーク（登録されているか否かは問いません）はすべて、LSEグループの該当メンバー会社またはそのそれぞれのライセンサーによって所有またはライセンスを供与されているか、FTSE、Russell、MTSNext、FTSE TMXが所有、またはそのライセンスに基づいて使用されています。

すべての情報は、情報提供のみを目的として提供されています。本刊行物に掲載されているすべての情報の正確性には万全を期しておりますが、LSEグループのいかなるメンバー会社、そのそれぞれの取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、本刊行物または本刊行物に含まれるいかなる情報、データの使用による誤りまたは損害に対し一切の責任を負いません。

LSEグループのいかなるメンバー会社、そのそれぞれの取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、明示・黙示を問わず、[インデックス]を使用した結果や、[インデックス]が使用されるあらゆる特定目的への[それら]の適合性についていかなる要求、予測、補償、表明も行いません。

LSEグループのいかなるメンバー会社、そのそれぞれの取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも投資アドバイスを提供しません。本[文書]のいかなる内容も、金融や投資の助言を構成しません。LSEグループのいかなるメンバー会社、取締役、役員、従業員、パートナーまたはライセンサーも、いかなる資産への投資の推奨度に関しても一切の表明を行いません。このような資産への投資における決定は、ここに記載されるいかなる情報にも依拠すべきではありません。インデックスに直接投資することはできません。インデックスへのある資産の編入は、その資産の購入、売却または保持を推奨するものではありません。ライセンスされた専門家から法律、税務、投資についての助言を得ることなく、本刊行物に記載される一般情報を実行しないでください。

この情報のいかなる部分も、LSEグループの該当メンバー会社の書面による事前の許可なく、複製、情報検索システムへの蓄積、電子・機械・写真複写・録音など何らかの方法による転送を行わないでください。LSEグループのインデックスデータの使用および販売、ならびに金融商品を作成するためのデータの使用には、FTSE、Russell、FTSE TMX、MTSNextおよび/またはそのそれぞれのライセンサーのライセンスが必要です。

過去のパフォーマンスは将来の結果を保証するものではありません。チャートやグラフは、例示のみを目的として提供されています。提示されるインデックスリターンは、必ずしも投資可能資産の実際の取引の結果を示しません。一部の提示リターンは検証試験でのパフォーマンスを反映していることがあります。検証試験されたパフォーマンスは、実際のパフォーマンスではなく、仮想のものです。検証試験の計算は、インデックスの正式公開時点で有効な方法に基づいています。ただし、検証試験データは事後考察によるインデックス方法論の適用を反映していることがあり、インデックスの計算は、インデックスの計算に使用される基本的な経済データの改訂に基づき月ごとに変更されることがあります。