

2014年6月26日

関係各位

野村アセットマネジメント株式会社



野村アセットマネジメント、 ダブルインバース指数を連動対象とするETF(上場投信)を新規設定

～7月16日に東京証券取引所へ上場予定～

野村アセットマネジメント株式会社(CEO兼執行役社長:渡邊国夫)は、日経平均ダブルインバース・インデックスを連動対象とするETFを新たに設定すると発表した。

同社が設定するのは、「NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信」(愛称「日経ダブルインバース指数ETF」、銘柄コード:1357)で、日経平均株価の日々の変動率のマイナス2倍の変動をする日経平均ダブルインバース・インデックスへの連動を目指す運用を行う。設定は7月14日の予定である。

同社は、日経平均株価の日々の変動率のプラス2倍の変動をする指数を連動対象とするETF、マイナス1倍の変動をする指数を連動対象とするETFを既に設定しているが、今回新たにマイナス2倍の変動をする指数を連動対象とするETFを加える。

本ETFは本日、東京証券取引所より上場承認を受けた。上場予定日は7月16日で、同日より全国の証券会社を通じて取引所での売買が可能となる。上場当初の最低投資金額は、5千円程度(1口単位)となる見込みである。

本ETFの設定・上場により、同社が運用するETF「NEXT FUNDS」は、合計43本となる*。

*「NEXT FUNDS」は、同社が運用するETFシリーズの統一ブランド。「NEXT FUNDS」の名称は、「野村のETF(上場投資信託)」を意味する「Nomura Exchange Traded FUNDS」の頭文字であるとともに、「次世代のファンド」のラインナップを展開していく意図を表している。

*本ETFの詳細に関しては、有価証券届出書または目論見書を参照のこと。

以上

この資料は、「NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信」(「日経ダブルインバース指数ETF」)の概要をご説明するために作成したご参考用資料であり、投資勧誘を目的として作成したものではありません。投資に際しては、投資家の皆さまの責任と判断でなさるようお願いいたします。

野村アセットマネジメント株式会社は、本ETFについて、直接、投資家の皆さまのお申込みを承っておりません。本ETFへの投資にあたっては、最寄りの取扱い第一種金融商品取引業者(証券会社)に口座を開設の上、お申込みください。

■ 日経平均ダブルインバース・インデックスの著作権等について

「日経平均ダブルインバース・インデックス」(以下「日経ダブルインバース指数」という。)は、株式会社日本経済新聞社(以下「日本経済新聞社」という。)によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、日本経済新聞社は日経ダブルインバース指数自体及び日経ダブルインバース指数を算出する手法、さらには、日経ダブルインバース指数を算出する際の根拠となる「日経平均株価」に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。日経ダブルインバース指数を対象とする「NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信」は、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、その運用及び「NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信」の取引に関して、日本経済新聞社は一切の義務ないし責任を負いません。日本経済新聞社は、日経ダブルインバース指数及び日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。日本経済新聞社は、日経ダブルインバース指数及び日経平均株価の計算方法、その他日経ダブルインバース指数の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

■ 本ETFに係るリスクについて

本ETFの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆さまに帰属します。

したがって、本ETFにおいて、投資家の皆さまの投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

日経平均ダブルインバース・インデックスに内在する性質に関する注意点

日経平均ダブルインバース・インデックスは、つねに、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の日経平均株価の騰落率の「-2倍」(マイナス2倍)となるよう計算されます。しかしながら、2営業日以上離れた期間における日経平均ダブルインバース・インデックスの騰落率は、一般に日経平均株価の騰落率の「-2倍」とはならず、計算上、差(ずれ)が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間における日経平均ダブルインバース・インデックスの騰落率と日経平均株価の騰落率の「-2倍」との差(ずれ)は、当該期間中の日経平均株価の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、日経平均株価の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差(ずれ)が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差(ずれ)が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信(日経ダブルインバース指数ETF)は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

■ 本ETFに係る手数料等について

<売買手数料>

市場を通して投資される場合、取扱い第一種金融商品取引業者(証券会社)が独自に定める売買手数料がかかり、約定金額とは別にご負担いただきます(取扱会社毎に手数料率が異なりますので、その上限額を表示することができません)。

<信託報酬>

以下の①と②の合計額が、投資家の皆さまの保有期間に応じてかかります。

- ① 日々の本ETFの純資産総額に年0.864%(税抜年0.80%)以内(平成26年7月14日現在、年0.864%(税抜年0.80%))の率を乗じて得た額。
- ② 有価証券の貸付を行なった場合は、日々、その品貸料の43.2%(税抜40%)以内の額。

<商標使用料等>

以下の金額が商標使用料としてかかります。

本ETFの純資産総額に対し、原則として、年率0.0648%(税抜0.06%)以下。ただし、年率0.06%により計算した金額が年間税抜120万円を下回る場合は、年額129.6万円(税抜120万円)。

<上場に係る費用>

以下の合計額が上場に関してかかります。

- ・ 新規上場料および追加上場料:新規上場時の純資産総額に対して、および追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して、0.0081%(税抜0.0075%)。
 - ・ 年間上場料:毎年末の純資産総額に対して、最大0.0081%(税抜0.0075%)。
- 上記の他、新規上場に際して、54万円(税抜50万円)の上場審査料がかかります。

<申込手数料>

本ETFの追加設定のお申込みの際には、販売会社が独自に定める額をご負担いただきます。

<換金(解約)手数料>

本ETFの解約の実行を請求される場合には、販売会社が独自に定める額をご負担いただきます。

<信託財産留保額>

本ETFそれぞれにつき、解約の実行をする際に、100口につき基準価額に0.05%以内(平成26年7月14日現在、0.05%)の率を乗じて得た額がかかり、信託財産に留保されます。

<その他の費用*>

- ・ 組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料
 - ・ 外貨建資産の保管等に要する費用
 - ・ 本ETFに関する租税、監査費用等
- * 「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。当該手数料の合計額については、投資家の皆さまが本ETFを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

上記の費用の合計額については、投資家の皆さまが本ETFを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第373号

一般社団法人投資信託協会会員

一般社団法人日本投資顧問業協会会員