

2012年4月12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、 「日経レバレッジ指数ETF」、「日経インバース指数ETF」を新規上場

野村アセットマネジメント株式会社(CEO兼執行役会長:岩崎俊博)は、本日、「NEXT FUNDS日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信」(愛称「日経レバレッジ指数ETF」、銘柄コード:1570)および「NEXT FUNDS日経平均インバース・インデックス連動型上場投信」(愛称「日経インバース指数ETF」、銘柄コード:1571)を、大阪証券取引所に上場した。

原指数の値動きの数倍の値動きをする性質をもつレバレッジ指数、および原指数と反対の値動きをする性質をもつインバース指数を連動対象とするETFは、本年3月12日に施行された規則改正により、新たに国内での上場が可能となった。両ETFは、それぞれ約100億円の信託金をもって4月10日に当初設定された。日経平均株価を原指数とするレバレッジ指数・インバース指数を連動対象とするETFの上場は、日本初となる。

また、本日、東京証券会館のJASDAQ-OSEプラザにおいて、株式会社日本経済新聞社及び株式会社大阪証券取引所の関係者の列席のもと、上場記念式典が行われた。

同社のCEO兼会長の岩崎俊博は、式典のスピーチで「日経レバレッジ指数ETF、ならびに日経インバース指数ETFの上場によって、日本市場の活性化に寄与していくことができたならば、これほどうれしいことはありません。」と述べた。

なお、本日の両ETFの市場取引は、日経レバレッジ指数ETFが、初値4,315円、終値4,355円、出来高106,395口、売買代金約4億58百万円、日経インバース指数ETFが、初値5,970円、終値5,940円、出来高7,317口、売買代金約44百万円、となった。(両ETFの売買単位は1口)

両ETFの設定・上場により、同社が運用するETF「NEXT FUNDS」は、合計39本となった。

※両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日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信」(「日経レバレッジ指数ETF」)および「NEXT FUNDS日経平均インバース・インデックス連動型上場投信」(「日経インバース指数ETF」)(以下、併せて「本ETF」と総称します。)の概要をご説明するために作成したご参考資料であり、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、投資家の皆さまのご自身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)に口座を開設になり、お申込みください。

■日経平均レバレッジ・インデックスについて

「日経平均レバレッジ・インデックス」(以下「日経レバレッジ指数」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レバレッジ指数自体及び日経レバレッジ指数を算出する手法、さらには、日経レバレッジ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。日経レバレッジ指数を対象とする「NEXT FUNDS日経平均レバレッジ・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日経平均レバレッジ・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、日経レバレッジ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、日経レバレッジ指数及び日経平均株価の計算方法、その他日経レバレッジ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。

■日経平均インバース・インデックスについて

「日経平均インバース・インデックス」(以下「日経インバース指数」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インバース指数自体及び日経インバース指数を算出する手法、さらには、日経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。日経インバース指数を対象とする「NEXT FUNDS日経平均インバース・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者の皆様へ帰属します。

したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様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。

日経平均レバレッジ・インデックスに内在する性質に関する注意点

日経平均レバレッジ・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レバレッジ・インデックスの騰落率は、一般に日経平均株価の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レバレッジ・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日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信(日経レバレッジ指数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。

日経平均インバース・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日経平均株価の騰落率の「-1倍」(マイナス1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「-1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「-1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日経平均インバース・インデックス連動型上場投信(日経インバース指数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>

本ETFそれぞれにつき、以下の①と②の合計額が、お客様の保有期間に応じてかかります。

- ① 純資産総額に、年0.84%(税抜年0.80%)以内(当初設定日(平成24年4月10日)現在、年0.84%(税抜年0.80%))の率を乗じて得た額
- ② 信託財産に属する有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料の42%(税抜40%)以内の額。

<商標使用料等>

本ETFそれぞれにつき、以下の金額が商標使用料としてかかります。

純資産総額に対し、原則として、年率0.063%(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126万円(税抜120万円)。

<ファンドの上場に係る費用>

本ETFそれぞれにつき、以下の合計額が上場に関してかかります。

- ・ 上場手数料:新規上場時の純資産総額に対して、及び追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時及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、0.007875%(税抜0.0075%)。
- ・ 上場の年賦課金:毎年末の純資産総額に対して、最大0.007875%(税抜0.0075%)。

<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%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
- ・ 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、投資家の皆さまがファンド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。