

2015年8月24日

関係各位

野村アセットマネジメント株式会社

NEXT FUNDS

JPX日経インデックス400を基にしたレバレッジ指数、インバース指数、 ダブルインバース指数を連動対象とするETFの上場について

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)は本日、JPX日経400レバレッジ・インデックス、JPX日経400インバース・インデックスおよびJPX日経400ダブルインバース・インデックスの各指数を連動対象とする以下の3本のETF(以下、総称して「本ETF」)を東京証券取引所に上場しました。

「NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信」(愛称「JPX日経400レバレッジ指数ETF」、銘柄コード:1470)は、JPX日経インデックス400の日々の変動率のプラス2倍の変動をするJPX日経400レバレッジ・インデックスへの連動を目指す運用を行います。

本日の当ETFの市場取引(売買単位は1口)は、初値19,690円、終値17,900円、出来高18,284口、売買代金約3億39百万円となりました。

「NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス連動型上場投信」(愛称「JPX日経400インバース指数ETF」、銘柄コード:1471)は、JPX日経インデックス400の日々の変動率のマイナス1倍の変動をするJPX日経400インバース・インデックスへの連動を目指す運用を行います。

本日の当ETFの市場取引(売買単位は1口)は、初値6,660円、終値6,800円、出来高2,401口、売買代金約16百万円となりました。

「NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信」(愛称「JPX日経400ダブルインバース指数ETF」、銘柄コード:1472)は、JPX日経インデックス400の日々の変動率のマイナス2倍の変動をするJPX日経400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います。

本日の当ETFの市場取引(売買単位は1口)は、初値4,230円、終値4,425円、出来高1,542口、売買代金約7百万円となりました。

本ETFの設定・上場により、当社が運用するETF「NEXT FUNDS」※は、合計50本(外国で設定・上

場しているETFを含みます)となりました。

- ※「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ます。
- ※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ご覧ください。

以上

この資料は、「NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信」(「JPX日経400レバレッジ指数ETF」)、「NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス連動型上場投信」(「JPX日経400インバース指数ETF」)、「NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信」(「JPX日経400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。

■ 「JPX日経400レバレッジ・インデックス」の著作権等について

「JPX日経400レバレッジ・インデックス」(以下「本指数」といいます。)は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下総称して「JPXグループ」といいます。)並びに株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)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、「JPXグループ」および「日経」は、「本指数」自体および「本指数」を算定する手法、さらには「本指数」を算出する際の根拠となる「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「NEXT FUNDS JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」および「日経」は、その運用および「NEXT FUNDS JPX日経400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、一切の責任を負いません。「JPXグループ」および「日経」は、「本指数」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。

なお、JPX日経400レバレッジ・インデックスをJPX日経400レバレッジ指数という場合があります。

■ 「JPX日経400インバース・インデックス」の著作権等について

「JPX日経400インバース・インデックス」(以下「本指数」といいます。)は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下総称して「JPXグループ」といいます。)並びに株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)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、「JPXグループ」および「日経」は、「本指数」自体および「本指数」を算定する手法、さらには「本指数」を算出する際の根拠となる「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「NEXT FUNDS JPX日経400インバース・インデックス連動型上場投信」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」および「日経」は、その運用および「NEXT FUNDS JPX日経400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、一切の責任を負いません。「JPXグループ」および「日経」は、「本指数」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。

なお、JPX日経400インバース・インデックスをJPX日経400インバース指数という場合があります。

■ 「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」の著作権等について

「JPX日経400ダブルインバース・インデックス」(以下「本指数」といいます。)は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下総称して「JPXグループ」といいます。)並びに株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)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、「JPXグループ」および「日経」は、「本指数」自体および「本指数」を算定する手法、さらには「本指数」を算出する際の根拠となる「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「NEXT FUNDS JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」および「日経」は、その運用および「NEXT FUNDS JPX日経400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、一切の責任を負いません。「JPXグループ」および「日経」は、「本指数」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。

なお、JPX日経400ダブルインバース・インデックスをJPX日経400ダブルインバース指数という場合があります。

■ 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。

JPX日経400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

JPX日経400レバレッジ・インデックスは、常に、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JPX日経インデックス400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JPX日経400レバレッジ・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400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JPX日経400レバレッジ・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の2倍との差(ずれ)は、当該期間中のJPX日経インデックス400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、JPX日経インデックス400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 JPX日経400レバレッジ・インデックス連動型上場投信(JPX日経400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。

JPX日経400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

JPX日経400インバース・インデックスは、常に、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JPX日経インデックス400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JPX日経400インバース・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400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JPX日経400インバース・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の「-1倍」との差(ずれ)は、当該期間中のJPX日経インデックス400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、JPX日経インデックス400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 JPX日経400インバース・インデックス連動型上場投信(JPX日経400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。

JPX日経400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

JPX日経400ダブルインバース・インデックスは、常に、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JPX日経インデックス400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JPX日経400ダブルインバース・インデックスの騰落率は、一般にJPX日経インデックス400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JPX日経400ダブルインバース・インデックスの騰落率とJPX日経インデックス400の騰落率の「-2倍」との差(ずれ)は、当該期間中のJPX日経インデックス400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、JPX日経インデックス400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 JPX日経400ダブルインバース・インデックス連動型上場投信(JPX日経400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27年8月21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、その品賃料の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。

<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0.03%(平成27年8月21日現在)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