

## 日興アセットマネジメントのETF



## のご紹介

特色：シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果をめざします。

上場外債	銘柄コード：1677
シティグループ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	ブルームバーグティッカー：SBWJNJYU

本資料では、「上場インデックスファンド海外債券 (Citigroup WGBI) 毎月分配型」を「上場外債」と言っております。

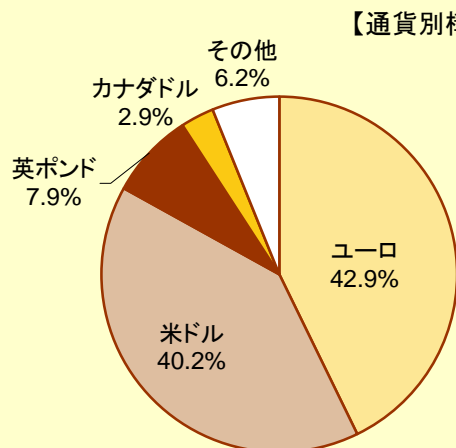


# 当ファンドが連動をめざす指数のご紹介

## シティグループ 世界国債 インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) とは？

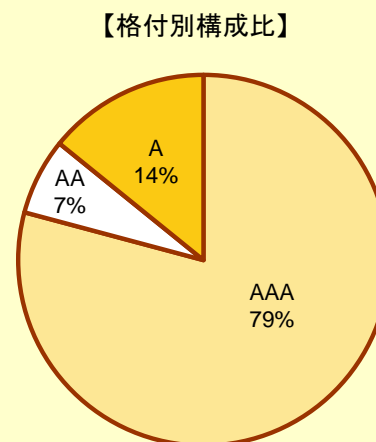
- シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した債券インデックスで、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額比率で加重平均して算出されています。
- シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数であり、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数は、日本を除く主要先進国の国債市場の値動きを表す指数として知られています。

## シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の通貨および格付の構成比率



ユーロの国別内訳

イタリア	10.0%
ドイツ	9.8%
フランス	9.6%
スペイン	4.1%
ベルギー	2.7%
オランダ	2.6%
オーストリア	1.8%
ポルトガル	1.0%
アイルランド	0.8%
フィンランド	0.6%
合計	42.9%



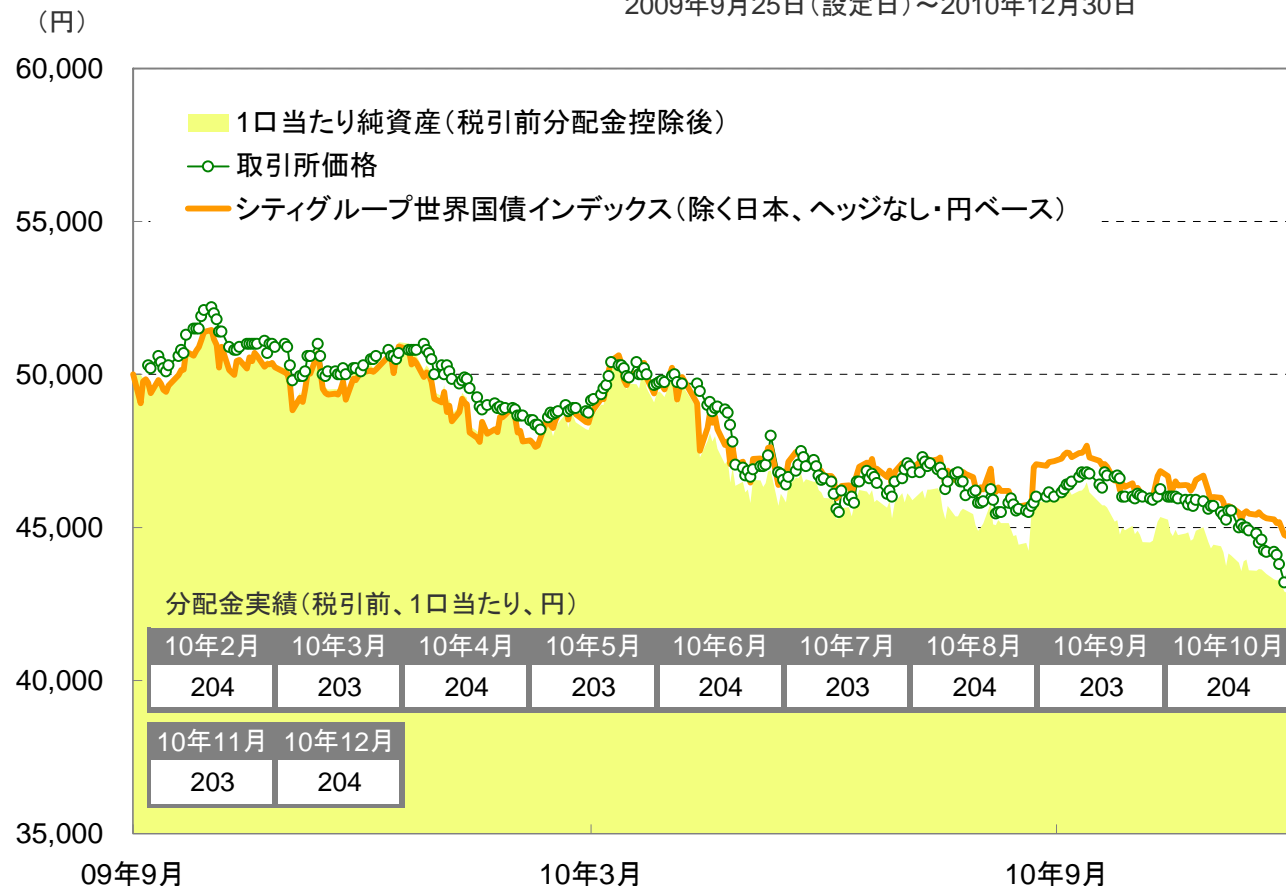
※上記データは過去のものであり、将来の運用成果などを約束するものではありません。  
※上記は、時価総額比率です。

出所:シティグループ・グローバル・マーケッツ・インク  
(2010年12月末現在)



# パフォーマンスについて

2009年9月25日(設定日)～2010年12月30日



1口当たり純資産  
(税引前分配金控除後)

42,186.14 円

取引所価格

43,200 円

シティグループ世界国債  
インデックス  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

44,109.74 円 (注)

(2010年12月30日現在)

(注) 設定日の1口当たり純資産(50,000円)をもとに、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を指数化した数字です。

●1口当たり純資産は、信託報酬控除後の値です。信託報酬の詳細につきましては、次頁の「手数料等の概要」をご覧ください。

※グラフおよびデータは過去のものであり、将来の運用成果などを約束するものではありません。

■当資料は、日興アセットマネジメントが「上場外債」の投資信託説明書(交付目論見書)を補足することなどを目的とし、投資家の皆様に当ファンドへのご理解を高めていただくために作成した販売用資料です。



# 取引所における売買時のファンド概要

商品分類	追加型投信／海外／債券／ETF／インデックス型
上場市場	東京証券取引所
上場日	2009年9月30日
銘柄コード	1677
取引所における売買単位	10口単位
信託期間	無期限(2009年9月25日設定)
決算日	毎月10日
収益分配	信託財産から生ずる配当等収益などから諸経費などを控除した全額を、毎決算時に分配することを原則とします。

## 手数料等の概要

お客様には、以下の費用をご負担いただきます。

### <取引所における売買時にご負担いただく費用>

- 売買手数料 取扱会社が定める手数料とします。詳しくは、取扱会社にお問い合わせください。

### <信託財産で間接的にご負担いただく(ファンドから支払われる)費用>

- 信託報酬 純資産総額に対して年率0.2625%(税抜0.25%)程度を乗じて得た額が実質的な信託報酬となります。信託報酬率の内訳は、当ファンドの信託報酬率が年率0.1575%(税抜0.15%)以内、投資対象とする投資信託証券の組入れに係る信託報酬率が年率0.105%(税抜0.1%)程度となります。  
上記の他に、信託財産で保有する上場投資信託証券の貸付を行なった場合は、受取った品賃料に0.525(税抜0.5)以内を乗じて得た額。  
※受益者が実質的に負担する信託報酬率(年率)は、投資対象とする投資信託証券の組入比率や当該投資信託証券の変更などにより変動します。
- その他費用 組入有価証券の売買委託手数料、監査費用、立替金の利息、受益権の上場に係る費用、標章の使用料など  
※その他費用については、運用状況により変動するものであり、事前に料率、上限額などを示すことができません。

※当ファンドの手数料などの合計額については、投資家の皆様がファンドを保有される期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

※詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。



## ファンド概要

【直接ファンドに設定・解約を行なう場合のお取扱です。取引所で売買をされる投資家の皆様には該当いたしませんのでご注意ください。】

取得・換金取扱時間	原則として、販売会社の営業日の午後2時まで、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。 なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
お申込不可日	原則として、取得申込日が毎月6日の2営業日前から決算日の2営業日前までの間、英国証券取引所の休業日、ニューヨーク証券取引所の休業日、ロンドンの銀行休業日またはニューヨークの銀行休業日に当たる場合は、取得のお申込みの受付は行ないません。 詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
お申込価額	取得申込受付日の翌営業日の基準価額
お申込単位	1万口以上で販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
ご換金不可日	原則として、換金請求日が毎月6日の2営業日前から決算日の2営業日前までの間、英国証券取引所の休業日、ニューヨーク証券取引所の休業日、ロンドンの銀行休業日またはニューヨークの銀行休業日に当たる場合は、換金請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
ご解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託報酬留保額を控除した価額
ご解約代金のお支払い	原則として、解約請求受付日から起算して8営業日目からお支払いいたします。

### <取得・換金時にご負担いただく費用>

- お申込手数料 販売会社が独自に定める手数料とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
なお、当該手数料には消費税等相当額がかかります。
- 換金手数料 販売会社は、受益者が解約請求を行なうとき、または受益権の買取りを行なうときは、当該受益者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。  
※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- 信託財産留保額 換金時の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額(1口当たり)

### <信託財産で間接的にご負担いただく(ファンドから支払われる)費用>

- 信託報酬 純資産総額に対して年率0.2625%(税抜0.25%)程度を乗じて得た額が実質的な信託報酬となります。信託報酬率の内訳は、当ファンドの信託報酬率が年率0.1575%(税抜0.15%)以内、投資対象とする投資信託証券の組入れに係る信託報酬率が年率0.105%(税抜0.1%)程度となります。  
上記の他に、信託財産で保有する上場投資信託証券の貸付を行なった場合は、受取った品貸料に0.525(税抜0.5)以内を乗じて得た額。  
※受益者が実質的に負担する信託報酬率(年率)は、投資対象とする投資信託証券の組入比率や当該投資信託証券の変更などにより変動します。
- その他費用 組入有価証券の売買委託手数料、監査費用、立替金の利息、受益権の上場に係る費用、標章の使用料など  
※その他費用については、運用状況により変動するものであり、事前に料率、上限額などを示すことができません。

※当ファンドの手数料などの合計額については、投資家の皆様が発金を保有される期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

※詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

■当資料は、日興アセットマネジメントが「上場外債」の投資信託説明書(交付目論見書)を補足することなどを目的とし、投資家の皆様にご理解を高めさせていただくために作成した販売用資料です。



## 留意事項①

### ● リスク情報

当ファンドは、主に債券を実質的な投資対象としますので、債券の価格の下落や、債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

したがって、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、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様に帰属します。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

#### 【価格変動リスク】

公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

#### 【流動性リスク】

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

#### 【信用リスク】

公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

#### 【為替変動リスク】

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

(次頁に続く)



銘柄コード: 1677

## 留意事項②

(前頁より続く)

### 【有価証券の貸付などにおけるリスク】

有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク(取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク)を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

### ＜シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)と基準価額の主なカイ離要因＞

当ファンドは、基準価額の変動率をシティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の変動率に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

- ・ 資金の流入から実際に投資信託証券を買い付けるタイミングのずれの発生。
- ・ シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の採用銘柄以外の銘柄に投資をすることがあること、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の採用銘柄の変更や構成比率の変更などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
- ・ 有価証券の貸付による品貸料が発生すること。
- ・ 先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとシティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

### ◇ 金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

※ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。  
 ※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

■当資料は、日興アセットマネジメントが「上場外債」の投資信託説明書(交付目論見書)を補足することなどを目的とし、投資家の皆様に当ファンドへのご理解を高めていただくために作成した販売用資料です。



## 留意事項③

### ● その他の留意事項

当資料は、日興アセットマネジメントが「上場外債」についてお伝えすることなどを目的とし、投資家の皆様に当ファンドへのご理解を高めていただくために作成した販売用資料です。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。

投資信託の運用による損益は、すべて受益者の皆様に帰属します。当ファンドをお申込みの際には、契約締結前交付書面などを十分にお読みください。

## 委託会社、その他関係法人

委託会社  
受託会社  
販売会社

日興アセットマネジメント株式会社

野村信託銀行株式会社

販売会社については下記にお問い合わせください。

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページアドレス <http://www.nikkoam.com/> コールセンター電話番号 0120-25-1404 (午前9時～午後5時、土、日、祝・休日は除く。)



# 指数の著作権などについて

## 「シティグループ世界国債インデックス」

「上場インデックスファンド海外債券 (Citigroup WGBI) 毎月分配型 (愛称: 上場外債)」(以下、本商品)は、シティグループ・インデックスLLC(以下、シティグループ・インデックス)又はその関係会社(以下、総称して、シティグループ)によって支持、保証、販売又は販売促進されるものではない。シティグループ・インデックスは、本商品の所有者、所有者となる可能性のある者もしくは一般の者に対して、有価証券全般又は本商品への投資適合性について、また本商品がシティグループ世界国債インデックスの利回りに追従する能力、及びシティグループ世界国債インデックスが債券市場全般の利回りに追従する能力について、明示的にも暗示的にも、何ら表明又は保証するものではない。シティグループ・インデックスの日興アセットマネジメント株式会社に対する唯一の関係は、シティグループが有する特定の情報、データ及び登録商標についての利用許諾を与えるものである。シティグループ・インデックスは、シティグループ世界国債インデックスに関する決定、作成及び計算について、日興アセットマネジメント株式会社又は本商品を考慮することなく行なう。シティグループ・インデックスは、シティグループ世界国債インデックスに関する決定、作成又は計算において、日興アセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者あるいは所有者となる可能性のある者の要望等を考慮せずに行なう。シティグループ・インデックスは本商品の価格・数量の決定、発行・販売に関する時期、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に関わっておらず、これらに責任を負うことはない。シティグループ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではない。

シティグループ・インデックスは、シティグループ世界国債インデックス又はそれに含まれるいかなるデータの正確性や完全性を保証するものではなく、シティグループ世界国債インデックスに係る口頭や書面のコミュニケーション(電子媒体を含む)を含む一切の情報伝達に関して、いかなる誤り、欠落又は遅延に対しても何ら責任を負わないものとする。シティグループ・インデックスは、シティグループ世界国債インデックス又はそれらに含まれる一切のデータの使用により、日興アセットマネジメント株式会社、本商品の所有者あるいは所有者となる可能性のある者、又はその他の者や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも何ら保証しない。シティグループ・インデックスは、シティグループ世界国債インデックス又はそれに含まれる一切のデータに関して、商品性の保証や特定の目的・使用における適合性に対する一切の保証を免除されることを明示し、かつそれらに関して明示もしくは暗示の保証も行わない。以上のことに関わらず、契約、不法行為、無過失責任などの別を問わずに生じる直接的、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害(利益の損失を含む)について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、シティグループが責任を負うことはない。

Copyright © 2009年, シティグループ・インデックスLLC. All rights reserved. CITIGROUPは、世界中で使用・登録されるシティグループ・インク又はその関連会社の登録商標であり、日興アセットマネジメント株式会社が利用許諾に基づき特定の目的において使用する。シティグループ・インデックスLLC(以下、シティグループ・インデックス)の書面による事前の許可がある場合を除き、シティグループ・インデックスの提供するデータ及び情報を複製することは、その形態の別を問わず一切禁止されている。本商品は、シティグループ・インデックスによって支持、保証、販売又は販売促進されるものではなく、シティグループ・インデックスは本商品への投資適合性について何ら表明するものではない。人為的な又は機械による誤りの可能性があることから、シティグループ・インデックスは、いかなるデータ及び情報に関しても、その正確性、妥当性、完全性又は可用性を保証するものではなく、いかなる誤りや欠落、あるいはそのデータ及び情報の使用により生じる結果に対する責任を負わない。シティグループ・インデックスは、商品性の保証や特定の目的・使用に対する適合性の保証などをはじめ、明示的にも暗示的にも一切保証するものではない。シティグループ・インデックスは、いかなる場合においても、シティグループ・インデックスの提供するデータ及び情報の使用一切に関係する直接的、間接的、特別な、あるいは結果的な損害について責任を負うものではない。

**nikko am**

[www.nikkoam.com](http://www.nikkoam.com)