

2015年11月11日

プレスリリース

日興アセットマネジメント株式会社

“高配当”で“価格変動性が低い”スマートベータ型日本株ETFが登場

～ 12月1日に東証上場、「上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ」～

日興アセットマネジメント株式会社(以下、「日興アセット」)は、“高配当”と“低ボラティリティ(価格変動性)”に着目した新しい日本株指数への連動をめざす、スマートベータ*1型の上場投資信託(ETF)「上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ」<愛称: 上場高配当低ボラティリティ、証券コード: 1399>を新たに設定し、東京証券取引所に上場します。ファンドの設定は11月30日、上場は12月1日の予定です。



日興アセット取締役副会長の安倍秀雄は「国内ETF市場が急速に発展し、機関投資家ならびに個人投資家のみなさまのETFに対するニーズが高度化する中、日興アセットは特に強いご要望がありました『高配当』と『低ボラティリティ』にフォーカスした日本株ETFを開発いたしました。TOPIX型や日経平均株価型はもとより、既存の高配当型の日本株ETFとも明確に異なる商品性を誇る新ETFは、その使い勝手の良さや運用パフォーマンスにより、かつてない新しい付加価値をお届けできるものと確信しております」と述べています。

「上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ」<愛称: 上場高配当低ボラティリティ>は、このほど新しく開発された株価指数「MSCI ジャパン IMI カスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数」の構成銘柄に投資し、同指数の計算方法に従ってポートフォリオを構築することなどにより、指数の動きと連動することをめざします。「高配当」と「低ボラティリティ」に着目したスマートベータ(賢い指数)である同指数は、一定の流動性があり配当利回りが比較的高い銘柄をユニバースとして、全体の値動きができるだけ抑えられるような投資比率に最適化して組成されます。その際、1銘柄当たりのウェイトは最大で1%まで、最小で0.05%以上という制約があるほか、銀行・保険・証券などの金融セクターとREIT(不動産投資信託)を組入対象から除外していることも大きな特徴の1つです。この指数への連動をめざす「上場高配当低ボラティリティ」の投資銘柄数は120～130銘柄程度*2になる見込みです。なお、決算・分配は年4回(毎年1、4、7、10月)行ないます。

日興アセットはこれまで、投資家のみなさまのニーズに合致したさまざまなタイプのETFの開発に先駆的に取り組んでまいりました。今後もより一層の商品の充実を努め、幅広い投資機会をご提供してまいります。

以上

*1 市場全体の平均などを表す従来の指数とは異なり、銘柄の特定の要素に基づいて構成された株価指数をいいます。
*2 変動します。固定株数を組み入れるものではありません。

■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／国内／株式／ETF／インデックス型
上場市場	東京証券取引所
上場日	2015年12月1日(予定)
銘柄コード	1399
取引所における売買単位	10口単位
信託期間	無期限(2015年11月30日設定)
決算日	毎年1月、4月、7月、10月の各8日
収益分配	信託財産から生ずる配当等収益から諸経費などを控除後、全額分配することを原則とします。 ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■手数料等の概要

お客さまには、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0.378%(税抜0.35%)以内を乗じて得た額。
- その他費用 目論見書などの作成・交付、計理等の業務にかかる費用および決算短信の作成に係る費用(業務委託する場合の委託費用を含みます。)、監査費用、ファンドの上場に係る費用、標章使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限とする額が信託財産から支払われます。
組入有価証券の売買委託手数料、立替金の利息および貸付有価証券関連報酬(有価証券の貸付を行なった場合は、信託財産の収益となる品貸料に0.54(税抜0.5)を乗じて得た額)などについては、その都度、信託財産から支払われます。
※組入有価証券の売買委託手数料などは、運用状況など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、投資者のみなさま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・交換を行なう場合のお取扱いです。取引所で売買をされる投資者のみなさまには該当いたしませんのでご注意ください。]

申込締切時間	原則として、販売会社の営業日の午後3時までとします。 ※なお、受付締切時間が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
取得価額	取得申込受付日の基準価額
取得単位	ユニット株式の評価額を取得申込受付日の基準価額で除した口数(100口未満切上げ)を申込単位として、その整数倍とします。
交換価額	交換請求受付日の基準価額
交換単位	委託会社の定める口数を最小交換請求口数として、その整数倍とします。

<取得・交換(買取)時にご負担いただく費用>

- 取得時手数料 販売会社が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。
- 交換(買取)時手数料
販売会社は、受益者が交換請求を行なうときおよび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 ありません。

<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0.378%(税抜0.35%)以内を乗じて得た額。
- その他費用 目論見書などの作成・交付、計理等の業務にかかる費用および決算短信の作成に係る費用(業務委託する場合の委託費用を含みます。)、監査費用、ファンドの上場に係る費用、標章使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限とする額が信託財産から支払われます。
組入有価証券の売買委託手数料、立替金の利息および貸付有価証券関連報酬(有価証券の貸付を行なった場合は、信託財産の収益となる品貸料に0.54(税抜0.5)を乗じて得た額)などについては、その都度、信託財産から支払われます。
※組入有価証券の売買委託手数料などは、運用状況など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、投資者のみなさま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。

■リスク情報

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、市場取引価格または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)のみなさまに帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に株式を投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式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。

主なリスクは以下の通りです。

【価格変動リスク】【流動性リスク】【信用リスク】【有価証券の貸付などにおけるリスク】

※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。

■その他の留意事項

○当資料は、投資者のみなさまに日興アセットマネジメントが「上場インデックスファンド MSCI 日本株高配当低ボラティリティ」についてお伝えすることなどを目的として、日興アセットマネジメントが作成した資料です。

○当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

○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。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。

○当ファンドは、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を2015年11月11日に関東財務局長に提出しており、2015年11月27日よりその効力が発生します。なお、効力発生前に記載内容の訂正が行なわれる場合があります。

○投資信託の運用による損益は、すべて受益者のみなさまに帰属します。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: 日興アセットマネジメント株式会社

受託会社: 三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社: 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

販売会社: 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。)

■「MSCI ジャパン IMI カスタム高流動性高利回り低ボラティリティ指数」

当該ファンドは、MSCI Inc.(「MSCI」)、その関連会社、情報提供者その他 MSCI 指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI 関係者」という。)によって支持、保証、販売または販売促進されるものではない。MSCI 指数は、MSCI の独占的財産とする。MSCI および MSCI 指数の名称は、MSCI またはその関連会社のサービスマークであり、日興アセットマネジメント株式会社による特定の目的のために使用が許諾されている。MSCI 関係者は、当該ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織に対して、ファンド全般もしくは当該ファンド自体に対する投資適合性、または対応する株式市場の利回りを追跡する MSCI 指数の能力につき、明示的か黙示的かを問わず何ら表明または保証するものではない。MSCI またはその関連会社は、特定の商標、サービスマークおよび商号、ならびに、当該ファンドまたは当該ファンドの発行会社、所有者その他の者もしくは組織とは関係なく MSCI が決定、編集し計算した MSCI 指数のライセンサーである。いずれの MSCI 関係者も、MSCI 指数の決定、編集または計算にあたり、当該ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織の要望を考慮する義務を負わない。いずれの MSCI 関係者も、当該ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、当該ファンドを現金に換算する方程式もしくは当該ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与していない。また、いずれの MSCI 関係者も、当該ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織に対して、当該ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負わない。

MSCI は、自らが信頼できると考える情報源から MSCI 指数の計算に算入または使用するための情報を入手するが、いずれの MSCI 関係者も、MSCI 指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではない。いずれの MSCI 関係者も、明示的か黙示的かを問わず、当該ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織が、MSCI 指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行なわない。いずれの MSCI 関係者も、MSCI 指数またはそれに含まれるデータの、またはそれに関連する誤り、欠落または中断について責任を負わない。また、MSCI 指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いずれの MSCI 関係者も明示的または黙示的な保証を行なうものではなく、かつ MSCI 関係者は、それらに関する市場性または特定目的適合性に係る一切の保証を明示的に否認する。上記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、仮にその可能性について通知されていた場合であろうとも、MSCI 関係者は、かかる損害について責任を負わない。

当該有価証券、当該商品もしくは当該ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは組織も、MSCI の承認が必要か否かの確認を事前に MSCI に求めることなく、当該有価証券を支持、保証、販売または販売促進するために MSCI の商号、商標またはサービスマークを使用したり、それらに言及したりしてはならない。いかなる者または組織も、MSCI の書面による承認を事前に得ることなく MSCI との関係性を主張してはならない。

日興アセットマネジメントについて

日興アセットマネジメントは、日本そしてアジアを代表するグローバルな運用会社であり、世界の投資家の皆様に一流の投資ソリューションを提供しています。世界30以上の国から集まる豊富な人材を世界11カ国に擁し、約200名*の運用プロフェッショナルが19兆円余り**の資産を運用しています。55年の実践を経た投資哲学をアジアから世界へ広げていきます。

(上記データはすべて2015年6月末現在)

* 日興アセットマネジメント株式会社および連結子会社の役員を含む。

** 日興アセットマネジメント株式会社および海外子会社の連結運用資産残高(投資助言を含む)の2015年6月末現在のデータ

日興アセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第368号

加入協会: 一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会、日本証券業協会