

## 上場インデックスファンド日経レバレッジ指数(1358)

<上場日経2倍(愛称) 追加型投信/国内/株式/ETF/インデックス型>

### <投資方針>

日経平均レバレッジ・インデックスの値動きに連動する投資成果をめざすため、日経平均株価に連動する上場投資信託証券の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が純資産総額に対して約2倍程度になるようにポートフォリオを構成し、原則としてそれを維持することにより、基準価額が同指数の動きと高位に連動することをめざします。

※日経平均レバレッジ・インデックスは、日々の騰落率を日経平均株価の騰落率の2倍として計算された指数です。基準時を2001年12月28日に置き、その日の指数値を10,000ポイントとして算出します。

### ファンドの騰落率

累積騰落率	基準価額	ベンチマーク
年初来	-13.74%	-13.64%
1ヵ月	-12.35%	-12.05%
3ヵ月	-5.70%	-6.00%
6ヵ月	-8.42%	-9.37%
1年間	-14.71%	-16.08%
設定来	356.61%	265.89%
年間騰落率		
2024	35.04%	32.58%
2023	65.50%	60.36%
2022	-18.49%	-21.10%
2021	8.30%	6.42%
2020	27.17%	26.22%

### ファンド情報

設定日	2014年8月25日
上場日	2014年8月26日
上場市場	東京証券取引所
信託期間	無期限
売買単位	1口
決算日	年1回(7月10日)
Bloombergコード	1358 jp equity
iNAVコード	1358IVVV index

### 運用状況

純資産総額	65.5 億円
基準価額(1口当たり)	45,707 円
信託報酬率	0.7075%
	(税込0.77825%)

### 分配金実績

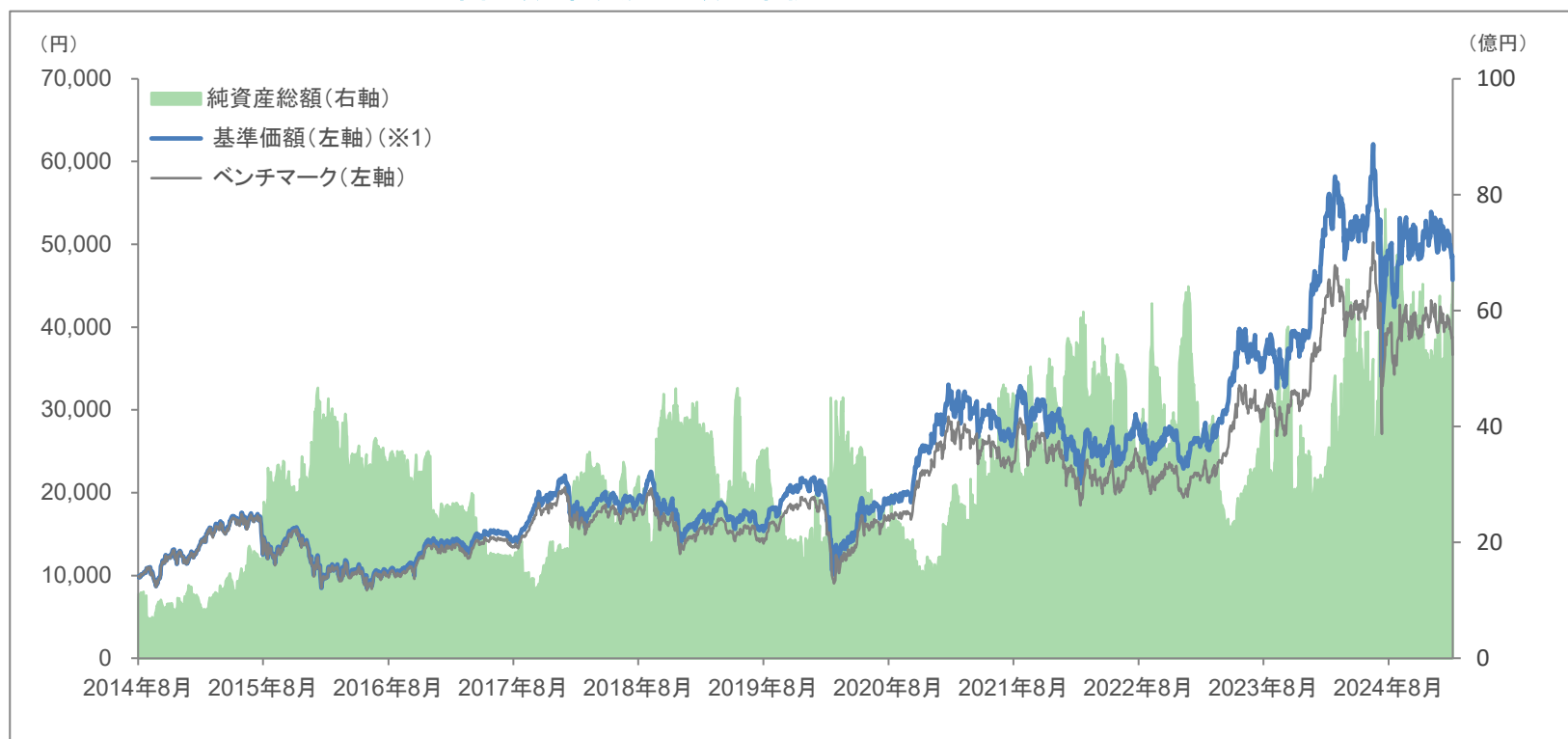
分配金実績	分配金(1口当たり)
2024年7月10日	152円00銭
2023年7月10日	12円00銭
2022年7月10日	138円00銭
2021年7月10日	84円00銭
2020年7月10日	58円00銭

### 資産構成

ミニ日経225先物	2.83%
日経平均株価指数先物	130.92%
上場インデックスファンド225	66.49%

※ 当ファンドの投資状況です。  
 ※ 個別の銘柄の取引を推奨するものではありません。  
 ※ 上記銘柄については将来の組入れを保証するものではありません。

### 基準価額と純資産総額の推移 (2014/8/25 - 2025/2/28)



※1 信託報酬控除後の基準価額を表示しています  
 ※ 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。  
 ※ ベンチマークは、グラフの始点の基準価額に合わせて指数化しております。

■当資料は、投資者の皆様にご理解を高めることを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。

## 上場インデックスファンド日経レバレッジ指数(1358)

&lt;上場日経2倍(愛称) 追加型投信/国内/株式/ETF/インデックス型&gt;

## 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。

## &lt;投資者が直接的に負担する費用&gt;

## ● 購入時手数料

**販売会社が独自に定める額**

※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※購入時手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

## ● 換金時手数料

**販売会社が独自に定める額**

※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※換金時手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。

## ● 信託財産留保額

**ありません。**

## &lt;投資者が信託財産で間接的に負担する費用&gt;

## ● 運用管理費用

当ファンド: ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.605%(税抜0.55%)以内(有価証券届出書提出日現在、税抜0.55%)

運用管理費用は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払われます。

(信託報酬)

実質的な負担: **純資産総額に対し年率0.77825%(税抜0.7075%)程度**

※投資対象とする上場投資信託証券の組入比率などにより変動します。

## ● その他費用・手数料

**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**

①目論見書などの作成および交付に係る費用、②計理およびこれに付随する業務に係る費用、③決算短信の作成に係る費用(①~③の業務を委託する場合の委託費用を含みます。)、④監査費用、⑤ファンドの上場に係る費用、⑥「日経平均レバレッジ・インデックス」の標準使用料などは、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払われます。

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

諸費用

(目論見書の

作成費用など)

組入る有価証券の売買委託手数料、資産を外国で保管する場合の費用、借入金の利息、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0.55(税抜0.5)以内(有価証券届出書提出日現在、税抜0.5)を乗じて得た額)などがその都度、信託財産から支払われます。

※運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。

売買委託手数料など

※投資家の皆様にご負担いただくファンドの費用などの合計額については、保有期間や運用の状況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。

## 投資リスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。基準価額変動リスクの大きいファンドですので、お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

## ● 基準価額の変動要因

投資者の皆様のご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全て投資者(受益者)の皆様にご帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に上場インデックスファンド225および株価指数先物取引にかかる権利を投資対象とするほか、日経平均株価への連動をめざす別の上場投資信託証券や株式へ投資する場合がありますので、上場投資信託証券、株価指数先物取引にかかる権利および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。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。当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

## 【価格変動リスク】

- 投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券は、連動目標とする日経平均株価の変動の影響を受けます。日経平均株価が下落する場合、上場投資信託証券の価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。
- 株価指数先物取引にかかる権利の価格は、株価指数の計算根拠となる対象企業の株価や、株価指数を構成する株式市場の値動きに影響を受けて変動します。また、国内および海外の他の株価指数の値動きに連動して変動することもあります。ファンドにおいては、株価指数に係る株式および株価指数を構成する株式市場の値動きに予想外の変動があった場合、株価指数先物取引にかかる権利の価格にも予想外の変動が生じる可能性があり、重大な損失が生じるリスクがあります。
- 株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- 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】

- 投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落(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。
- 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。

■当資料は、投資者の皆様にご「上場日経2倍(愛称)」へのご理解を高めていただく事を目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。

## 上場インデックスファンド日経レバレッジ指数(1358)

&lt;上場日経2倍(愛称) 追加型投信/国内/株式/ETF/インデックス型&gt;

## 【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。

## 【デリバティブリスク】

- 金融契約に基づくデリバティブとよばれる金融派生商品を用いることがあり、その価値は基礎となる原資産価値などに依存し、またそれらによって変動します。デリバティブの価値は、種類によっては、基礎となる原資産の価値以上に変動することがあります。また、取引相手の倒産などにより、当初の契約通りの取引を実行できず損失を被るリスク、取引を決済する場合に反対売買ができなくなるリスク、理論価格よりも大幅に不利な条件でしか反対売買ができなくなるリスクなどがあります。

## 【レバレッジリスク】

- ファンドが連動目標とする「日経平均レバレッジ・インデックス」は、日々の騰落率が日経平均株価の騰落率の2倍となるように計算された指数であり、ファンドは、原則として上場インデックスファンド225の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額に対して約2倍程度になるように日々調整を行ないます。したがって、株式市況の影響を大きく受けます。日経平均株価が下落した場合は、日経平均株価の値動きに比べて、大きな損失が生じる可能性があります。

## 【投資方針通りの運用ができないリスク】

次のような要因により、投資方針通りの運用ができず、目標とする投資成果が達成できない場合があります。

- 日経平均株価が大きく変動し、株価指数先物取引が制限値幅によりストップ高、またはストップ安などした場合。
- 株価指数先物市場の流動性の低下等により、必要な取引数量のうち全部または一部の取引が成立しない場合。
- 追加設定・解約の発生による運用資金の大幅な変動が発生した場合。

## 【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。

## &lt;日経平均レバレッジ・インデックスと基準価額の主な乖離要因&gt;

当ファンドは、基準価額の変動率を日経平均レバレッジ・インデック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約束できるものではありません。

- 株価指数先物取引の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。また、投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の値動きと日経平均株価の値動きが一致しないこと。
- 日々の追加設定・解約などに対応した株価指数先物取引や投資対象とする上場インデックスファンド225などの上場投資信託証券の約定価格と評価価格(終値)に差が生じること。
- 日経平均株価の採用銘柄の変更や資本異動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。
- 組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品質料が発生すること。

## ◇金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額の乖離

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。

## ※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、前営業日に対する当該営業日の騰落率が、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、複利効果により、一般に日経平均株価の2倍とはならず、計算上、差が生じます。
- 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。ただし一般に、一定のレンジ内で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が生じ、日経平均レバレッジ・インデックスの指数値は逡減す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、その差が大きくなる傾向があります。

※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。

## ● その他の留意事項

- 当資料は、投資者の皆様へ「上場日経2倍(愛称)」へのご理解を高めたいことを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。
- 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、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、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、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 当ファンドの基準価額の上昇率・下落率は、2営業日以上の場合、通常、同期間の日経平均株価の上昇率・下落率の約2倍程度とはなりません。そのため、それが長期にわたり継続することにより、期待した投資成果が得られない恐れがあります。上記の理由から、当ファンドは、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。
- 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。
- ETFを金融商品取引所で売買される場合には、委託会社作成の投資信託説明書(交付目論見書)は交付されません。売買をお申込みになる証券会社に、当該取引の内容についてご確認ください。
- 株式または金銭の拠出により当ファンドの取得(応募、追加設定)をご希望の場合には投資信託説明書(交付目論見書)を販売会社(指定参加者)よりお渡しいたしますので、必ず内容をご確認ください。

■当資料は、投資者の皆様へ「上場日経2倍(愛称)」へのご理解を高めたいことを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。

## 上場インデックスファンド日経レバレッジ指数(1358)

<上場日経2倍(愛称) 追加型投信/国内/株式/ETF/インデックス型>

### 指数の著作権などについて

- 「日経平均レバレッジ・インデックス」は、株式会社日本経済新聞社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、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均レバレッジ・インデックス」自体および「日経平均レバレッジ・インデックス」を算定する手法、さらには、「日経平均レバレッジ・インデックス」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る。
- 「日経」および「日経平均レバレッジ・インデックス」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- 当ファンドは、投資信託委託業者などの責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負わない。
- 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均レバレッジ・インデックス」および「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、責任を負わない。
- 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均レバレッジ・インデックス」および「日経平均株価」の計算方法など、その内容を変える権利および公表を停止する権利を有している。

■当資料は、投資者の皆様にご理解を高めたい事といたしまして、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。