

販売用資料

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)
＜愛称:「上場米債(為替ヘッジあり)」＞

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)
＜愛称:「上場米債(為替ヘッジなし)」＞

2016年8月

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)概要

証券コード	1487
上場市場	東京証券取引所
連動指数	S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)
主要投資対象	主として別に定める投資信託証券の一部またはすべてに投資を行いません。
最低売買単位	1口 (20,000 円程度: 2016年8月29日現在)
上場日(設定日)	2016年8月31日 (2016年8月29日)
設定・解約方式	金銭設定・金銭解約
決算日	毎年1月、7月の各10日
収益分配	年2回、分配方針に基づいて分配を行いません。
課税関係	課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。 <ul style="list-style-type: none"> ・公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 ・配当控除の適用はありません。 ・原則として、益金不算入制度が適用外です。
運用管理費用(信託報酬)	<p>《当ファンド》</p> <p>ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.1026%(税抜0.095%)以内 運用管理費用は、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。</p> <p>《投資対象とする投資信託証券》</p> <p>純資産総額に対し年率0.0702%(税抜0.065%)程度</p> <p>《実施的な負担》</p> <p>純資産総額に対し年率0.1728%(税抜0.16%)程度 ※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。</p>
その他の費用・手数料	<p>《諸費用(目論見書の作成費用など)》</p> <p>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</p> <p>《売買委託手数料など》</p> <p>組入有価証券の売買委託手数料、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0.54(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。</p>

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)概要

証券コード	1486
上場市場	東京証券取引所
連動指数	S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)
主要投資対象	主として別に定める投資信託証券の一部またはすべてに投資を行いません。
最低売買単位	1口 (20,000 円程度: 2016年8月29日現在)
上場日(設定日)	2016年8月31日 (2016年8月29日)
設定・解約方式	金銭設定・金銭解約
決算日	毎年1月、7月の各10日
収益分配	年2回、分配方針に基づいて分配を行いません。
課税関係	課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。 <ul style="list-style-type: none"> ・公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 ・配当控除の適用はありません。 ・原則として、益金不算入制度が適用外です。
運用管理費用(信託報酬)	<p>《当ファンド》</p> <p>ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.1026%(税抜0.095%)以内 運用管理費用は、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。</p> <p>《投資対象とする投資信託証券》</p> <p>純資産総額に対し年率0.0702%(税抜0.065%)程度</p> <p>《実施的な負担》</p> <p>純資産総額に対し年率0.1728%(税抜0.16%)程度</p> <p>※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。</p>
その他の費用・手数料	<p>《諸費用(目論見書の作成費用など)》</p> <p>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</p> <p>《売買委託手数料など》</p> <p>組入有価証券の売買委託手数料、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0.54(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。</p>

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

《連動対象となる指数》

連動対象となる指数は、「為替ヘッジあり」はS&P 米国債7-10年指数（TTM、円建て、円ヘッジ）、「為替ヘッジなし」はS&P 米国債7-10年指数（TTM、円建て）になります。残存期間が7年～10年の米国債の総合投資収益を指数化したもので、為替ヘッジの有無により二つに区分されます。

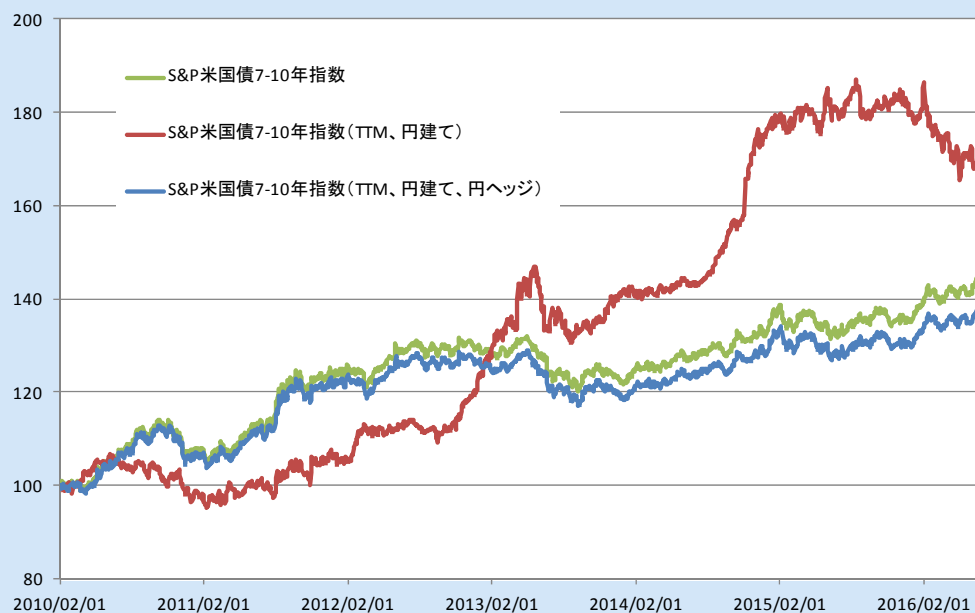
《ファンドの仕組み》



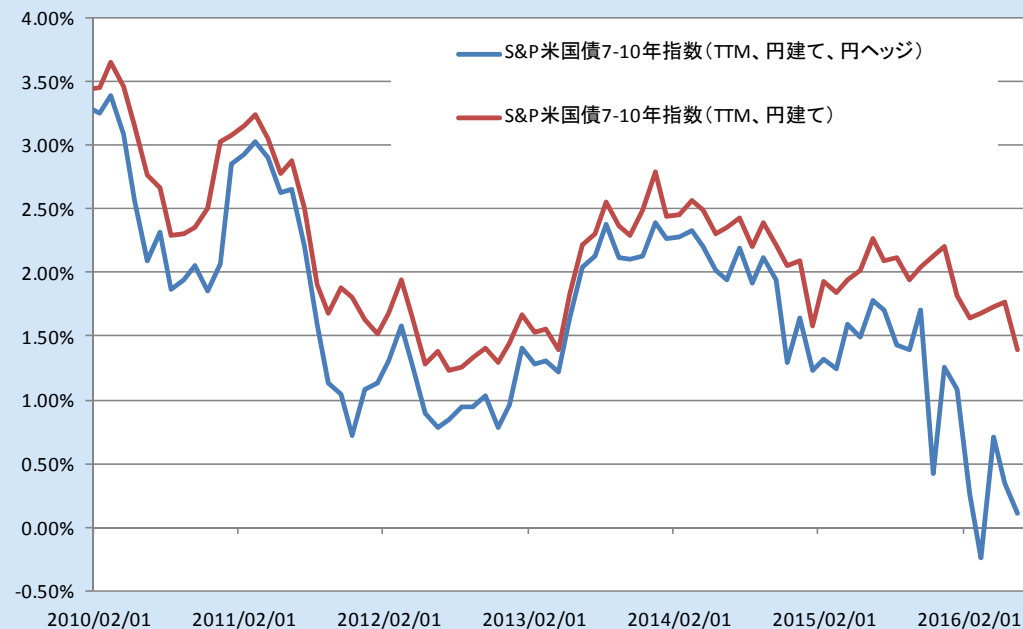
連動指数： S&P 米国債7-10年指数 (TTM、円建て、円ヘッジ)

S&P 米国債7-10年指数 (TTM、円建て)

トータルリターン指数累積パフォーマンス
(2010年2月1日～2016年6月30日)



利回り水準の推移
(2010年1月29日～2016年6月30日)



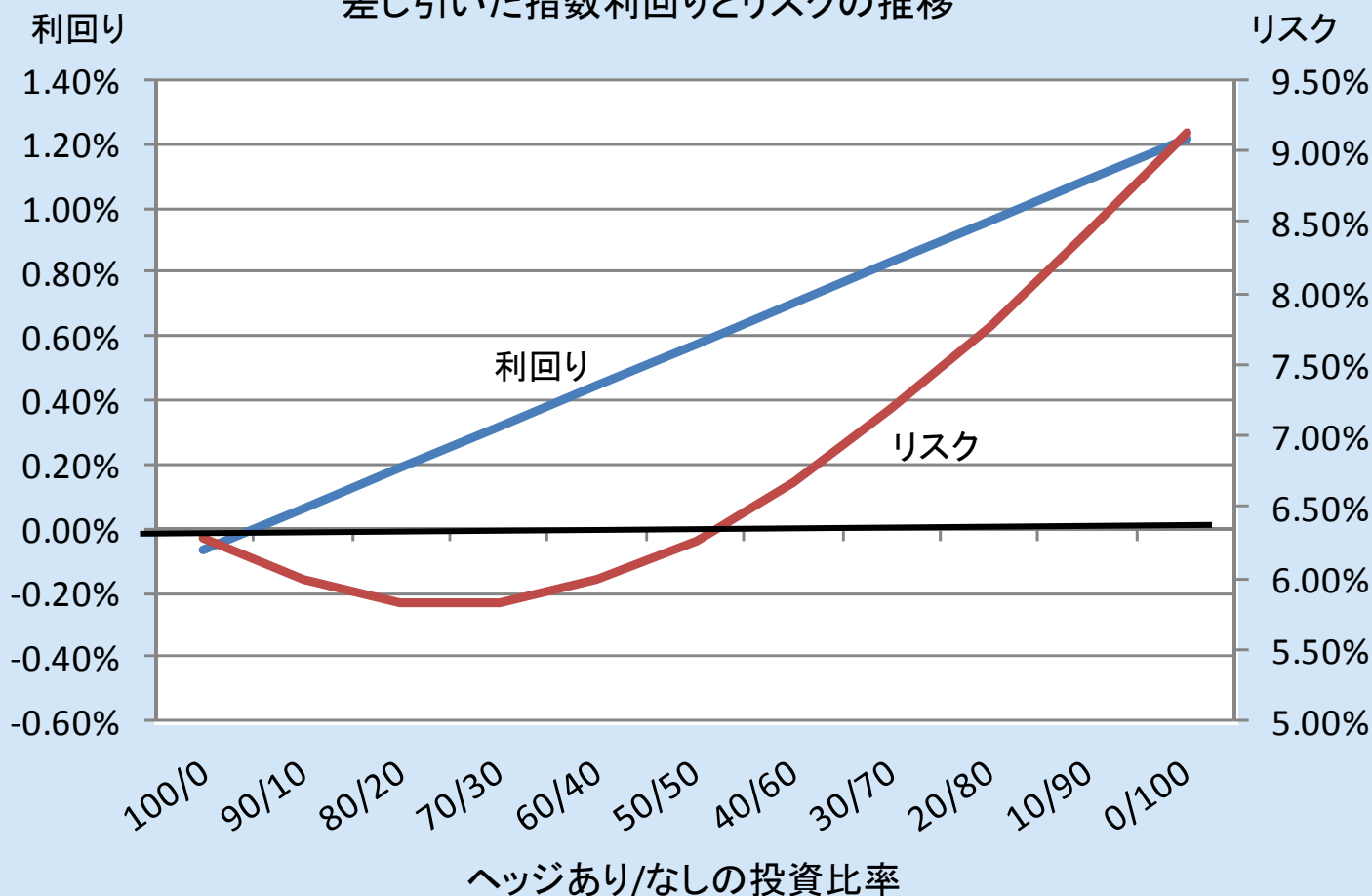
- ※ 2010年2月1日を100として、公表値をもとに、日興アセットマネジメントが指数化しています。
- ※ 信頼できると判断した情報をもとに日興アセットマネジメントが作成。
- ※ グラフおよびデータは過去のものであり、将来の運用成果などを約束するものではありません。

	リスク(年率)
S&P米国債7-10年指数	6.27%
S&P米国債7-10年指数(TTM、円建て)	9.13%
S&P米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)	6.28%

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

ヘッジあり/なしの投資比率を変化させた場合、税込信託報酬を差し引いた指数利回りとリスクの推移



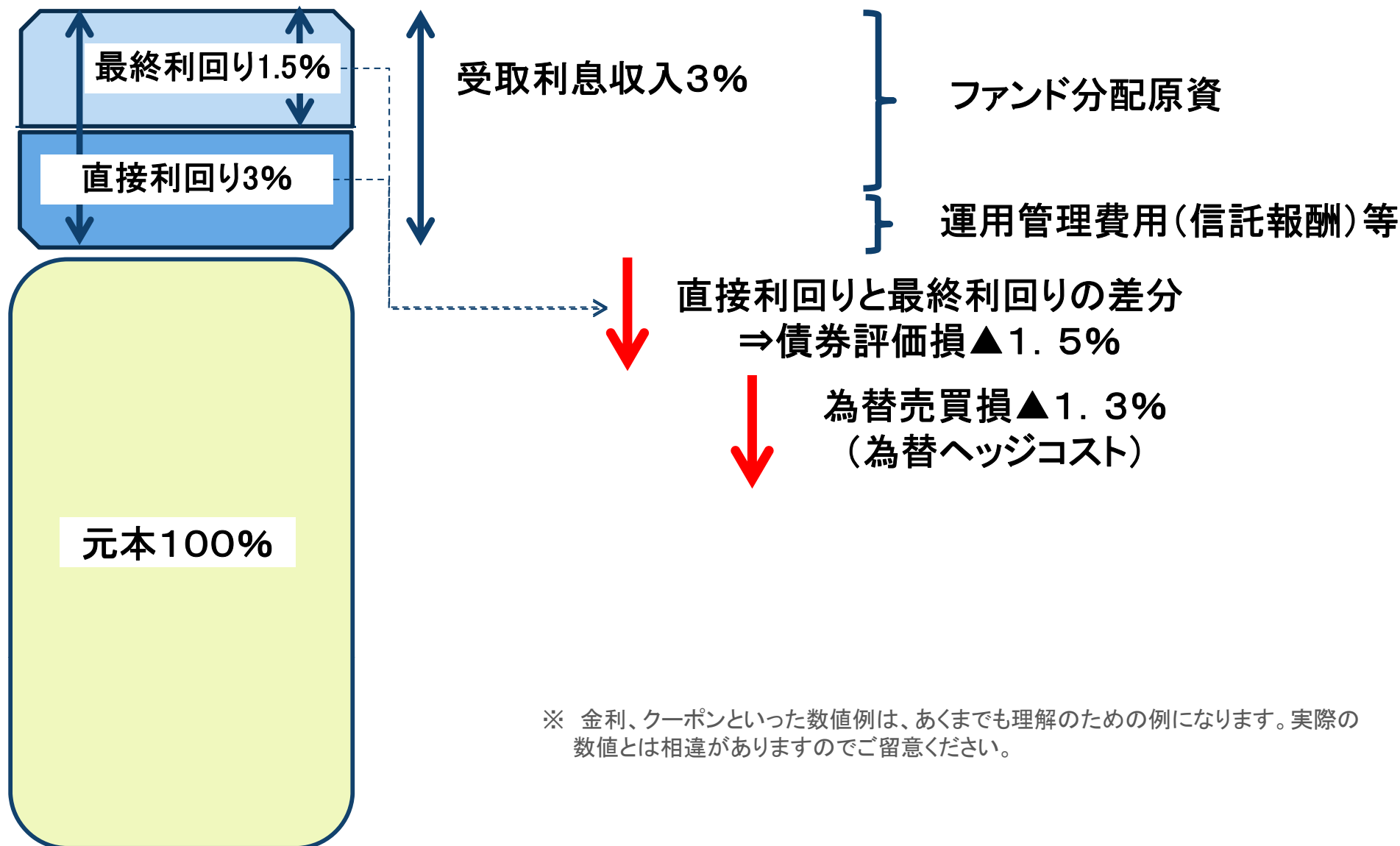
※利回りは2016年6月30日の指数利回りからETFの税込信託報酬を差し引いたもの。

※リスクは2010年2月1日から2016年6月30日の実績(年率)。

※信頼できると判断した情報をもとに日興アセットマネジメントが作成。

※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。

分配に係る留意事項

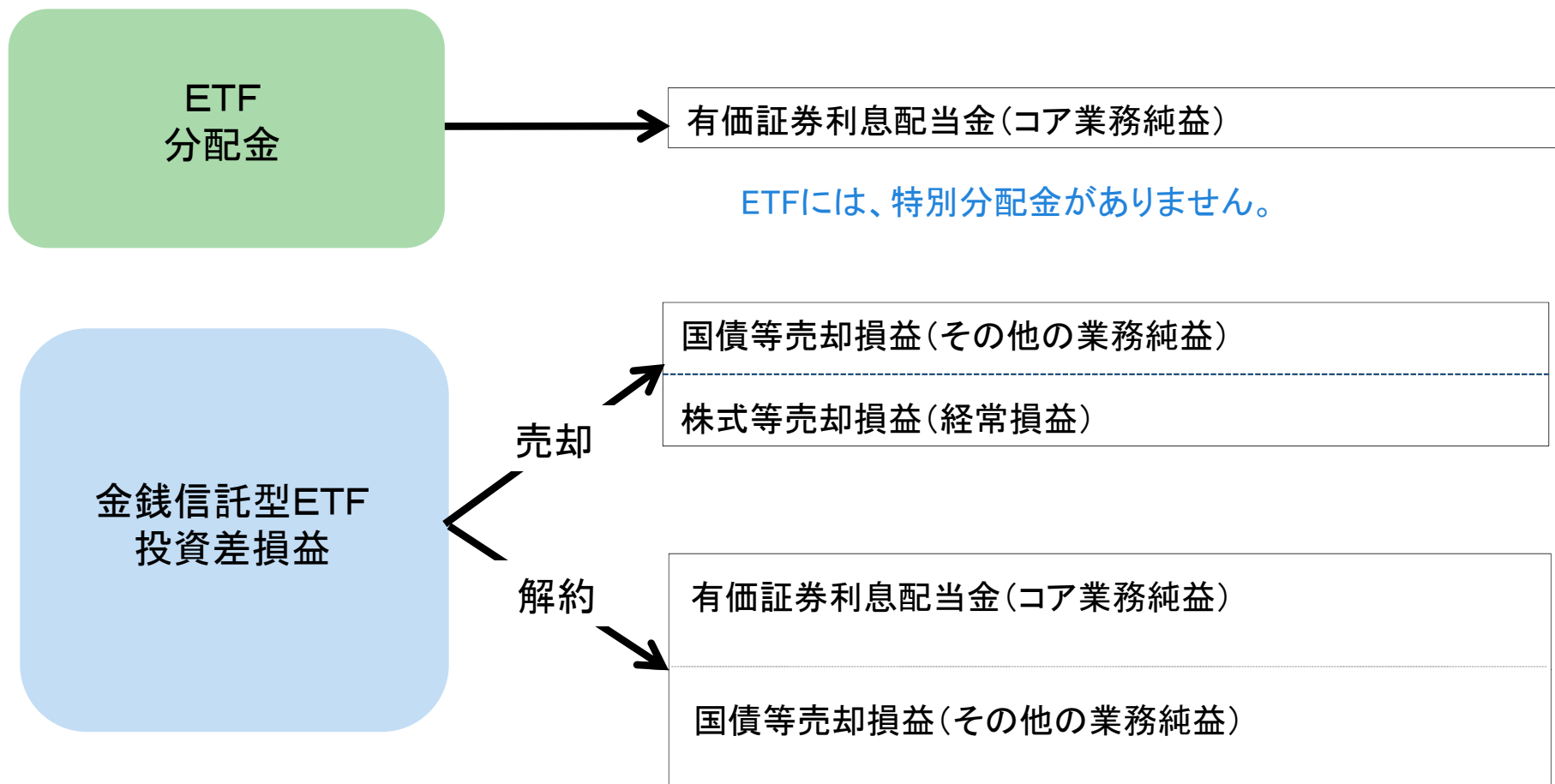


※ 金利、クーポンといった数値例は、あくまでも理解のための例になります。実際の数値とは相違がありますのでご注意ください。

会計処理

・会計処理上の特性

(金銭信託型ETFの解約時に利益が出た場合、有価証券利息配当金での処理が可能)



(注) 実際の適用にあたっては会計士にご相談ください。

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

■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。]

取得・交換取扱時間	原則として、販売会社の営業日の午後2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。
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額
購入単位	500口以上で販売会社が定める単位 ※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。
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額
換金単位	500口以上1口単位 ※販売会社によって異なる場合があります。 ※保有する受益権口数が金融商品取引所の定める取引単位に満たない場合は、当該受益権の買取りの申込みができません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

<購入・換金時にご負担いただく費用>

- 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。

<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>

- 運用管理費用 当ファンド
(信託報酬) ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.1026%(税抜0.095%)以内
運用管理費用は、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。
- 投資対象とする投資信託証券
純資産総額に対し年率0.0702%(税抜0.065%)程度
- 実施的な負担 **純資産総額に対し年率0.1728%(税抜0.16%)程度**
※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。

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

●その他費用 諸費用

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「S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)」、「S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)」の標章使用料などは、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。

売買委託手数料など

組入有価証券の売買委託手数料、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0.54(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。

投資者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。

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

投資リスク①

<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。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>

投資者の皆様は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)の皆様へ帰属します。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。

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>

◆為替ヘッジあり

・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

◆為替ヘッジなし

・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。

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

投資リスク②

＜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。

◆為替ヘッジあり

＜S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)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S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の変動率に一致させることをめざしますが、当ファンドおよび投資対象とする投資信託証券には、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。
- ・S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)の採用銘柄以外の銘柄に投資をすることがあること、S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)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S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て、円ヘッジ)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。

◆為替ヘッジなし

＜S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)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S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の変動率に一致させることをめざしますが、当ファンドおよび投資対象とする投資信託証券には、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。
- ・S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)の採用銘柄以外の銘柄に投資をすることがあること、S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)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S&P 米国債7-10年指数(TTM、円建て)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。

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487)

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

投資リスク③

◇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。

◇ その他の留意事項

当資料は、投資者の皆様には弊社の運用するETFについてのご理解を高めいただくことを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。

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。

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。当該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。

※委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2016年8月10日に関東財務局長に提出しております。有価証券届出書の届出の効力が発生するまでに、記載内容が訂正される場合があります。効力の発生の有無については、委託会社のホームページで確認いただけます。

上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)(1487) 上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)(1486)

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] http://www.nikkoam.com/ [コールセンター] 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

「S&P 米国債7-10年指数」

「Standard & Poor's®」「S&P®」「スタンダード&プアーズ」は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーが所有する登録商標であり、日興アセットマネジメント株式会社に対して利用許諾が与えられている。スタンダード&プアーズは、「上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジあり)」および「上場インデックスファンド米国債券(為替ヘッジなし)」(以下「両商品」)を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、また両商品への投資適合性についていかなる表明・保証・条件付け等するものではない。

両商品は、スタンダード&プアーズ及びその関連会社(以下、「S&P」)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。S&P は、明示的にも暗示的にも、両商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または両商品に関する投資について、またS&P 米国債7-10年指数が市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではない。S&P 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、S&P 及びS&P 米国債7-10年指数の登録商標についての利用許諾を与えることである。S&P は、S&P 米国債7-10年指数に関する決定、作成及び計算において、日興アセットマネジメント株式会社又は両商品の所有者の要求等を考慮に入れずに行う。S&P は両商品の販売に関する時期、価格の決定、又は両商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていない。S&P は、両商品の管理、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。

S&P は、S&P 米国債7-10年指数の計算及びその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではない。S&P は、S&P 米国債7-10年指数に含まれるいかなる誤り、欠落又は障害に対する責任を負わない。

S&P は、S&P 米国債7-10年指数又はそれらに含まれる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、両商品の所有者又はその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しない。S&P は、S&P 米国債7-10年指数又はそれらに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行わない。

以上のことに関わらず、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、S&P が責任を負うことはない。

nikko am

www.nikkoam.com