

2022年10月28日

プレスリリース

日興アセットマネジメント株式会社

ネット専用ファンドシリーズ「Tracers」新商品
「Tracers S&P500 配当貴族インデックス(米国株式)」を設定

～長期にわたり連続増配を行なっている企業を抽出した指数に着目～

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、S&P500 指数の構成銘柄のうち、長期にわたり連続増配を行なっている企業の株式で構成される株価指数「S&P500 配当貴族指数」への連動をめざす追加型投信「Tracers S&P500 配当貴族インデックス(米国株式)」を10月28日に設定、運用を開始します。株式会社SBI証券、マネックス証券株式会社、楽天証券株式会社が10月28日から取り扱いを開始します。

当ファンドは、今年8月に誕生した日興アセットのネット専用ファンドシリーズ「Tracers」の3本目のファンドとなります。

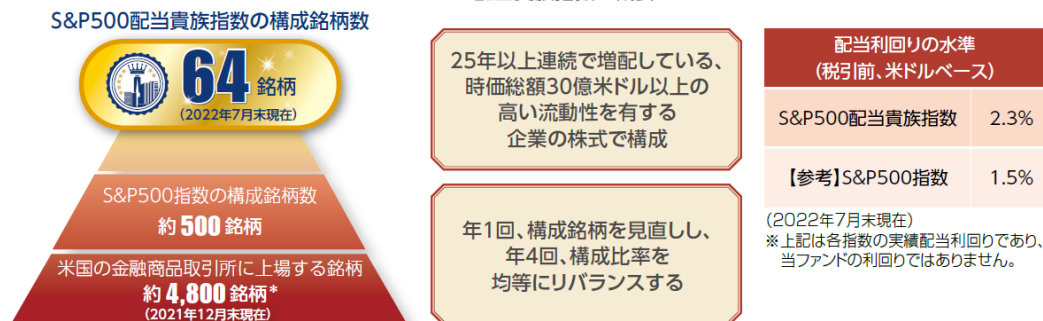
「Tracers S&P500 配当貴族インデックス(米国株式)」について

「Tracers」は、事前に定めたルールに沿って運用(トレース)する、ネット専用の低コスト・ファンドシリーズです。「Tracers」シリーズ3本目となる当ファンドでは、長期にわたり連続増配を行なっている企業に着目し、「S&P500 配当貴族指数(税引後配当込み、円換算ベース※)」に連動するというルールをトレースします。

※公表指数をもとに日興アセットマネジメントが円換算します。

「S&P500 配当貴族指数」とは、「S&P500 指数」の構成銘柄のうち、25年以上連続で増配している企業の株式で構成される株価指数です。「S&P500 指数」は、米国の金融商品取引所に上場している企業のうち、時価総額や流動性、業種のバランスなどを勘案して選ばれた500社の株式で構成されています。

<S&P500配当貴族指数の概要>



* データの取得の都合上、ニューヨーク証券取引所およびナスダック市場に上場する米国籍株式の数を掲載しています。なお、S&P500 指数の構成銘柄には、その他の米国取引所に上場する株式も選定されることがあります。

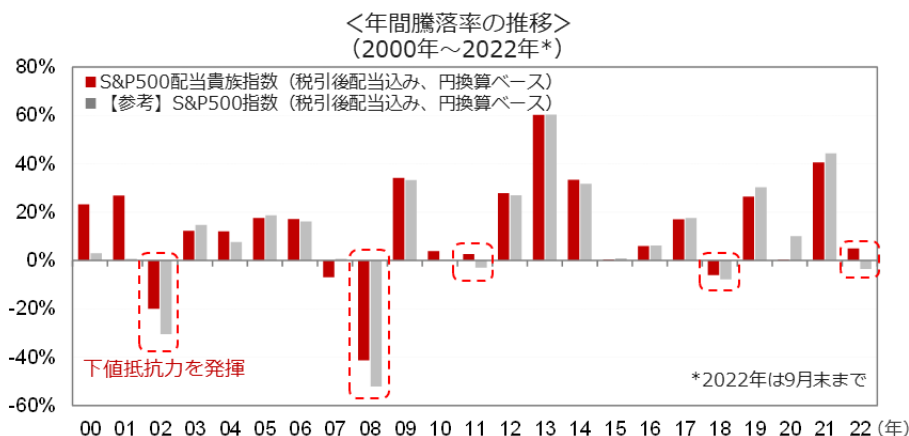
※25年以上連続で増配している企業の数40を下回った場合には、連続増配年数が25年に満たない企業の株式も構成銘柄に追加される場合があります。

S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス社および国際取引所連合などの信頼できると判断したデータをもとに日興アセットマネジメントが作成

当ファンドが連動を目指す「S&P500 配当貴族指数(税引後配当込み、円換算ベース)」では、中長期的には S&P500 指数(税引後配当込み、円換算ベース)を上回るパフォーマンスとなっています。



2000年以降の年間騰落率の推移を見ると、「S&P500 配当貴族指数(税引後配当込み、円換算ベース)」は、「S&P500 指数(税引後配当込み、円換算ベース)」の上昇局面で概ね良好なパフォーマンスとなっていることが確認できます。また、下落局面では、構成銘柄の安定的な配当などによる下値抵抗力が発揮され、相対的に下落が抑制されており、こうしたことが中長期での良好なパフォーマンスにつながっていると考えられます。



※各指数は、公表指数をもとに日興アセットマネジメントが円換算したものです。
 ※S&P500配当貴族指数(税引後配当込み、米ドルベース)の算出開始日は2014年5月1日です。なお、算出開始日前のデータは、算出開始日における算出要領に基づき当該指数の開発元が試算した値であり、指数の実際のパフォーマンスではありません。
 ※ベンチマーク「S&P500配当貴族指数(税引後配当込み、円換算ベース)」はあくまで参考情報であり、当ファンドの運用実績ではありません。
 ※参考として掲載したS&P500指数は、当ファンドのベンチマークではありません。
 ※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
 ※上記は過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

<商品開発者コメント:日興アセット 商品開発部 バイスプレジデント 金澤拓也>

S&P500 指数の構成銘柄の中から、安定収益をあげ増配というかたちで株主に還元し続ける優良株を抽出した指数が S&P500 配当貴族指数です。S&P500 配当貴族指数の業種構成比を S&P500 指数と

比べてみると、生活必需品関連や製造業などが多い一方で、IT 関連は低く抑えられています。相対的に堅固なビジネスモデルで安定収益を上げている企業が多いのが、S&P500 配当貴族指数の特徴といえます。

今までとは違う投資の選択肢を検討している方々に「こんなの欲しかった」と感じていただけるよう開発した商品です。

ファンドシリーズ「Tracers (トレイサーズ)」について



「Tracers」は、「こんなの欲しかった」と投資家の皆様にご共感いただける投資アイデアをファンドの設計に取り入れ、「インデックス (指数)」や「独自に定めたルール」などのルールに沿って運用 (トレース) する、日興アセットのファンドシリーズです。

同シリーズは、日興アセットとしては初となる、ネット専用のパッシブファンド (非アクティブ) シリーズとなります。事前に決めたルールに沿って運用することから、「なぞる」という意味である「Trace (トレース)」から名づけました。

指数などに連動した運用をめざすインデックスファンドに代表される、見通しに基づく判断を入れない「非アクティブ型」運用の選択肢は幅広く、様々な可能性があります。Tracers シリーズでは、指数だけにとどまらない、独自に定めたルール通りに運用するパッシブファンドを開発し、ネット専用とすることでノーロード・低コストで提供していきます。



※上記は当社独自の考えに基づく分類であり、一般的な分類と異なる場合があります。

ファンドシリーズ「Tracers」ならびに各ファンドの詳細は、以下の公式サイトにてご紹介しています。

Tracers 特設ページ: <https://www.nikkoam.com/sp/tracers>

「Tracers S&P500 ゴールドプラス」: <https://www.nikkoam.com/fund/detail/645066>

「Tracers グローバル 2 倍株 (地球コンプリート)」: <https://www.nikkoam.com/fund/detail/645052>

「Tracers S&P500 配当貴族インデックス (米国株式)」: <https://www.nikkoam.com/fund/detail/645073>

以上

<「Tracers S&P500 配当貴族インデックス(米国株式)」について>

■手数料等の概要

投資者の皆様には、以下の費用をご負担いただきます。

<直接的にご負担いただく費用>

- 購入時手数料： ありません。
- 換金手数料： ありません。
- 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(信託報酬)：ファンドの日々の純資産総額に対し年率 0.1155%(税抜 0.105%)
- その他の費用・手数料： 目論見書などの作成・交付および計理等の業務に係る費用(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。
入有価証券の売買委託手数料、借入金の利息および立替金の利息などがその都度、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、上限額などを示すことはできません。

※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。

※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

投資者の皆様は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)の皆様には帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に株式を実質的な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。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】【流動性リスク】【信用リスク】【為替変動リスク】

※詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

※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。

■「S&P500 配当貴族指数」について

S&P500 配当貴族指数は S&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社(「SPDJ」)の商品であり、これの使用ライセンスが日興アセットマネジメント株式会社に付与されています。S&P®、S&P500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®および CDX®は、S&P Global, Inc. またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは SPDJ に付与されており、日興アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P500 配当貴族指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

■その他の留意事項

- 当資料は、投資者の皆様へ「Tracers S&P500 配当貴族インデックス(米国株式)」へのご理解を高めて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。
- 当ファンドをお申込みの際には、投資信託説明書(交付目論見書)などを販売会社よりお渡ししますので、内容を必ずご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。

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資産運用会社です。株式、債券、オルタナティブ、マルチアセットなど多様な資産クラスを対象とするアクティブ運用や ETF(上場投資信託)を含むパッシブ運用など、革新的な投資ソリューションを提供しています。

日興アセットマネジメントは 60 年を超える実績を誇ります。約 25 の国・地域から集まる人材は多様性に富み、約 200 名*の運用プロフェッショナルが約 28 兆円**の資産を運用しています。世界 11 国・地域***において事業を展開し、グローバルな視点を活かしてお客様のニーズにお応えする様々な商品を開発するとともに、優れた運用パフォーマンスの実現を追求しています。銀行などの金融機関、証券会社、生命保険・損害保険、ファイナンシャルアドバイザーなど、国内外の計 400 社超の販売ネットワークを通じ、個人投資家の皆様や年金基金や金融機関など世界中の機関投資家のお客様に対して幅広いサービスを提供しています。

詳しくは、日興アセットマネジメントの [HP](#) をご覧ください。

* 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社員を含む。

** 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 2022 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、海外子会社および関連会社を含む。

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