

2023年6月23日

関係各位

野村アセットマネジメント株式会社

NEXT FUNDS

NEXT FUNDS JPX国債先物ダブルインバース指数連動型上場投信を新規上場

野村アセットマネジメント株式会社(CEO兼代表取締役社長:小池広靖、以下「当社」)は、「JPX国債先物ダブルインバース指数」を連動対象とするETF(以下「本ETF」)を東京証券取引所に上場しました^{※1}。本ETFは、本日より全国の証券会社を通じて取引所での売買が可能となります。

証券コード	銘柄名	対象指標	信託報酬率
2251	NEXT FUNDS JPX 国債先物ダブルインバース指数連動型上場投信 (愛称)NF・JGB 先物ダブルインバ ETF	JPX 国債先物ダブルインバース指数	年 0.418% (税抜年 0.38%) ^{※2}

本ETFは、国内初の債券インバース型ETFです。グローバルな金利上昇局面において、円金利の上昇リスクに対するヘッジニーズが高まっていると考え、本ETFを設定しました。

当社は1995年5月に国内第一号となるETFを上場しました。本ETFの設定・上場により、当社が運用するETF「NEXT FUNDS^{※3}」は合計68本となります。

本ETFの詳細については当社ホームページをご参照ください。

[NEXT FUNDS JPX 国債先物ダブルインバース指数連動型上場投信 \(2251\)](#)

※1 本ETFの詳細に関しては、有価証券届出書または目論見書をご覧ください。

※2 2023年6月21日時点

※3 「NEXT FUNDS」は、当社が運用するETFシリーズの統一ブランドです。「NEXT FUNDS」の名称は、「野村のETF(上場投資信託)」を意味する「Nomura Exchange Traded FUNDS」の頭文字であるとともに、「次世代のファンド」のラインナップを展開していく意図を表しています。

[NEXT FUNDS専用サイト](#)

以上

<JPX 国債先物ダブルインバース指数に内在する性質に関する注意点>

JPX 国債先物ダブルインバース指数(以下「当インデックス」)は、常に、前営業日に対する当営業日の当インデックスの騰落率が、同期間の長期国債先物の価格の騰落率の「-2倍」(マイナス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 JPX 国債先物ダブルインバース指数の騰落率は、一般に長期国債先物の価格の騰落率の「-2倍」とはならず、計算上、差(ずれ)が不可避に生じます。

2営業日以上離れた期間における JPX 国債先物ダブルインバース指数の騰落率と長期国債先物の価格の騰落率の「-2倍」との差(ずれ)は、当該期間中の長期国債先物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。一般に、長期国債先物取引の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差(ずれ)が生じ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(ずれ)が大きくなる傾向があります。

したがって、NEXT FUNDS JPX 国債先物ダブルインバース指数連動型上場投信(NF・JGB 先物ダブルインバ ETF)は、一般的に中長期の投資には向かず、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。

<指数の動きと実際のファンドの値動きの乖離に関する注意点>

実際のファンドの基準価額は、信託報酬等のコスト負担や追加設定・一部解約の影響、ファンドが取引を行なう国債先物取引と指数算出ルールで限月の変更タイミングが異なることなどにより、運用目標が完全に達成できるとは限りません。

また、ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

<JPX 国債先物ダブルインバース指数の著作権等について>

JPX 国債先物ダブルインバース指数の指数値及び JPX 国債先物ダブルインバース指数に係る標章又は商標は、株式会社 JPX 総研又は株式会社 JPX 総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など JPX 国債先物ダブルインバース指数に関するすべての権利・ノウハウ及び JPX 国債先物ダブルインバース指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は JPX が有します。JPX は、JPX 国債先物ダブルインバース指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPX により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても JPX は責任を負いません。

<野村アセットマネジメントからのお知らせ>

■ETFの投資リスク

ETFは、値動きのある有価証券等を主な投資対象としますので、連動対象である株価指数等の変動、組入有価証券等の価格の下落、組入有価証券の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因等の影響等により、市場取引価格または基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。また組入有価証券は為替相場の影響を受けるものもあるため、為替の変動により基準価額が下落することがあります。したがって、投資家の皆様の投資元金が保証されているものではありません。なお、投資信託は預貯金と異なります。

※ ETFのリスクは上記に限定されません。

信託の設定のお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。

■ETFに係る費用

市場を通してETFに投資する投資家の皆さまには以下の費用をご負担いただきます。

<売買手数料>

市場を通して投資される場合、取扱い第一種金融商品取引業者(証券会社)が独自に定める売買手数料がかかります(約定金額とは別にご負担いただきます(取扱会社毎に手数料率が異なりますので、その上限額を表示することができません))。

<信託報酬>

信託報酬の総額は、次の(1)により計算した額に、(2)により計算した額を加えて得た額とします。

信託報酬は信託財産中から支弁されますので、ETFの保有期間に応じて間接的にご負担いただく費用となります。

(1)信託財産の純資産総額に年1.045%*(税抜年0.95%)以内で委託者が定める率を乗じて得た額。

※ 複数のETFのうち、最大の信託報酬率を記載しております。一部、元本ベースで算出するETFもあります。

(2)信託財産に属する有価証券の貸付を行った場合は、その品貸料の55%*(税抜50%)以内の額。

※ 複数のETFのうち、最大の品貸料を記載しております。

<その他の費用>

ETFに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用(外国での財産の保管等に要する諸費用を含みます)、受託者の立替えた立替金の利息、組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、監査費用等、その他の諸費用(受益権の上場に係る費用および対象指標についての商標の使用料を含みます)およびそれらの諸費用に係る消費税等が、保有期間中、その都度かかります。これらは、信託財産中から支弁され、ETFの保有期間中に間接的にご負担いただく費用となります。その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率や上限額等を示すことができません。

上記の費用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等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)の「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

■ご注意事項

野村アセットマネジメント株式会社は、ETFについて、直接、投資者の皆さまのお申込みを承っておりません。ETFの投資にあたっては、取扱い第一種金融商品取引業者(証券会社)に口座を開設になり、お申込みください。

商号: 野村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373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/

一般社団法人第二種金融商品取引業協会