

# ＜日経225連動型上場投資信託＞

## 日経225投信

追加型投信 国内 株式 ETF インデックス型

### 【投資信託説明書（交付目論見書）】

（2011年9月30日）

商品分類					属性区分			
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	対象インデックス
追加型	国内	株式	ETF	インデックス型	株式 一般	年1回	日本	日経225

上記、商品分類および属性区分の定義については、社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧頂けます。

＜委託会社＞ 野村アセットマネジメント株式会社 [ファンドの運用の指図を行なう者]

■金融商品取引業者登録番号: 関東財務局長(金商)第373号 ■設立年月日: 昭和34年(1959年)12月1日

■資本金: 171億円(平成23年8月末現在) ■運用する投資信託財産の合計純資産総額: 15兆8886億円(平成23年7月29日現在)

＜受託会社＞ 三菱UFJ信託銀行株式会社 (再信託受託会社: 日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

[ファンドの財産の保管および管理を行なう者]

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

本書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。

この目論見書により行なう日経225連動型上場投資信託の募集については、発行者である野村アセットマネジメント株式会社(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平成23年9月29日に関東財務局長に提出しており、平成23年9月30日にその効力が生じております。

- ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下「請求目論見書」といいます。)は野村アセットマネジメント株式会社のホームページに掲載しています。なお、ファンドの投資信託約款の全文は請求目論見書に記載しています。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されています。
- 請求目論見書については販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの販売会社、ファンドの基準価額等については、下記の照会先までお問い合わせください。

照会先

野村アセットマネジメント株式会社

★サポートダイヤル★ 0120-753104  
＜受付時間＞営業日の午前9時～午後5時



★ホームページ★  
<http://www.nomura-am.co.jp/>



★携帯サイト★ (基準価額等)

<http://www.nomura-am.co.jp/mobile/>



## ファンドの目的・特色

### ファンドの目的

日経225(対象株価指数)に連動する投資成果を目指します。

### ファンドの特色

#### ■主要投資対象

日経225に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式を投資対象とします。

#### ■投資方針

- ①日経225に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式のみに投資を行ない、信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率を日経225における個別銘柄の株数の比率に維持することを目的とした運用を行ない、日経225に連動する投資成果を目指します。
- ②次の場合には、上記①に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうことがあります。
  - ア.日経225の計算方法が変更された場合
  - イ.日経225の除数の修正が行なわれた場合
  - ウ.日経225採用銘柄の変更が行なわれた場合
  - エ.追加信託または交換等が行なわれた場合
  - オ.その他連動性を維持するために必要な場合
- ③投資することを指図する株式は、日経225に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- ④上記①にかかわらず、日経225に連動する投資成果を目指すため、補完的に当該指数を対象とした株価指数先物取引の買建を行なうことができます。

#### ■日経平均株価(日経225)の著作権等について■

日経平均株価(日経225)に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。なお、同社は日経225連動型上場投資信託について一切の責任を負いません。

## ■主な投資制限

株式への投資割合	株式への投資割合には制限を設けません。
デリバティブの利用	日経225に連動する投資成果を目指すため、補完的に日経225を対象とした株価指数先物取引の買建を行なうことができます。

## ■分配の方針

毎年7月8日に分配を行ないます。

分配金額は、信託財産から生ずる配当等収益から経費を控除後、全額分配することを原則とします。ただし、分配できない場合もあります。また、売買益が生じても、分配は行ないません。



\* 将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

## 投資リスク

### 基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けませんが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様<sup>①</sup>に帰属します。

したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様<sup>②</sup>の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、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

**株価変動リスク** ファンドは株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

\* 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。

### 〈対象株価指数と基準価額の乖離要因〉

ファンドは、基準価額が対象株価指数と連動する投資成果を目指しますが、主として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運用上お約束できるものではありません。

- ① 同指数の構成銘柄異動、その他一部の交換の場合等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、売買手数料などの取引費用を負担すること
- ② 追加設定の一部が金銭にて行なわれた場合、および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること
- ③ 対象銘柄の売買価格と評価価格に価格差が生じる場合があること
- ④ 個別銘柄の組入比率を同指数構成銘柄の構成比率と全くの同一の比率とすることができない場合
- ⑤ 先物取引を利用した場合、先物価格と同指数との間に価格差があること
- ⑥ 信託報酬等のコスト負担があること

\* 対象株価指数と基準価額の乖離要因は上記に限定されるものではありません。

### その他の留意点

- ◆ 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。
- 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ファンドが組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- ファンドの基準価額と対象株価指数は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が対象株価指数との連動または上回ることを保証するものではありません。
- 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。

## リスクの管理体制

委託会社では、ファンドのパフォーマンスの考査および運用リスクの管理をリスク管理関連の委員会を設けて行なっております。

### ●パフォーマンスの考査

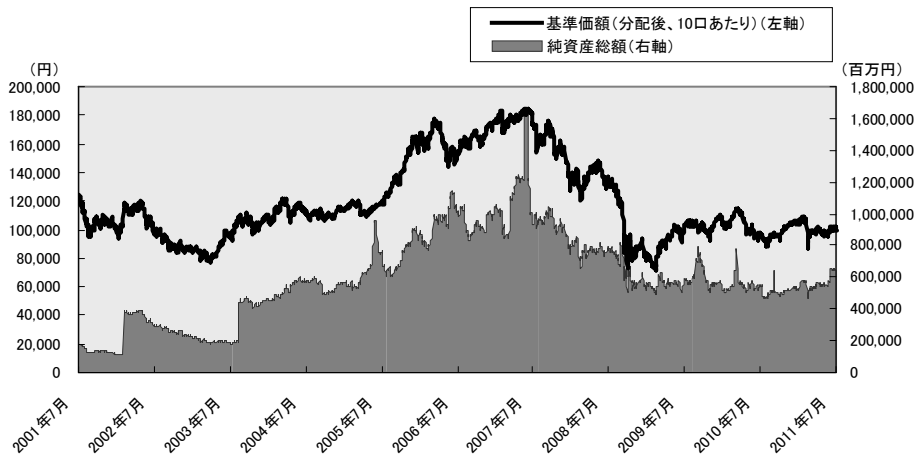
投資信託の信託財産についてパフォーマンスに基づいた定期的な考査(分析、評価)の結果の報告、審議を行ないます。

### ●運用リスクの管理

投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

## 運用実績 (2011年7月29日現在)

## 基準価額・純資産の推移 (日次)



## 分配の推移 (10口あたり、課税前)

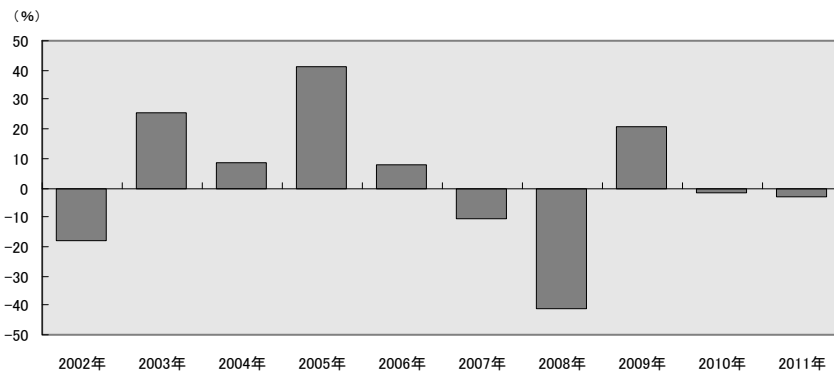
2011年7月	1,380 円
2010年7月	1,530 円
2009年7月	2,060 円
2008年7月	2,018 円
2007年7月	1,160 円
設定来累計	11,539 円

## 主要な資産の状況

銘柄別投資比率(上位)

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	ファナック	電気機器	6.0
2	ファーストリテイリング	小売業	5.6
3	ソフトバンク	情報・通信業	3.7
4	京セラ	電気機器	3.4
5	本田技研工業	輸送用機器	2.5
6	KDDI	情報・通信業	2.3
7	キヤノン	電気機器	2.3
8	テルモ	精密機器	1.8
9	信越化学工業	化学	1.7
10	東京エレクトロン	電気機器	1.7

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2011年は年初から7月末までのファンドの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

## 手続・手数料等

### お申込みメモ

受益権の取得	受益権の取得(追加設定)は、原則として、委託会社が事前に提示する現物株式のポートフォリオ(「指定株式ポートフォリオ」といいます。)による設定に限定します。
取得単位	1ユニット*以上1ユニット単位 *「ユニット」とは、日経225に連動すると委託会社が想定する1単位の株式のポートフォリオに相当する口数の受益権をいいます。(1ユニット=10口の整数倍とし、取得申込受付日に委託会社が定めます。)
指定株式ポートフォリオの提示	取得申込日の2営業日前までに、申込ユニット数に応じた指定株式ポートフォリオを販売会社に提示します。
取得価額	取得申込受付日(取得申込日の翌営業日)の基準価額 (ファンドの基準価額は10口あたりで表示しております。)
指定株式ポートフォリオの受渡し	取得申込者は、取得申込日から起算して3営業日目までに、販売会社に保護預けをするものとします。
当初元本	当初元本は1口あたり12,307円とします。
受益権の交換	受益者は、自己の有する受益権につき、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を請求することができます。
交換単位	信託財産に属する銘柄の株式の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が日経225に連動すると想定する、1単位の現物株式のポートフォリオを構成する銘柄の株式につき取引所売買単位の整数倍の株数と交換するために必要な口数を基礎として委託会社が定めた口数(以下「最小交換口数」といいます。)とします。 なお、最小交換口数は、交換申込日の2営業日前までに委託会社が決定し、販売会社に通知します。
交換価額	交換請求受付日(交換申込日の翌営業日)の基準価額
交換株式の交付	原則として交換請求受付日から起算して4営業日目から、振替機関等の口座に交換の請求を行なった受益者に係る株数の増加の記載または記録が行なわれます。
申込締切時間	午後3時までに、申込みが行なわれたものを翌営業日の受付分とします。
取得の申込期間	平成23年9月30日から平成24年9月27日まで * 申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。
申込不可日	次の期日または期間における、取得、交換の各申込みについては、原則として受付を停止します。ただし、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される場合は、取得、交換の各お申込みの受付を行なうことができます。 <取得> ・日経225構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内 ・ファンドの計算期間終了日(決算日)の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、計算期間終了日が休日(営業日でない日)をいいます。)の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内 ・上記のほか、委託会社が、投資方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき <交換> ・日経225構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日 ・日経225構成銘柄の変更および株数変更等に伴う除数の変更日の前営業日から起算して5営業日以内 ・ファンドの計算期間終了日(決算日)の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、計算期間終了日が休日(営業日でない日)をいいます。)の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内 ・上記のほか、委託会社が、投資方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

取得・交換申込受付の中止及び取消し	金融商品取引所における取引の停止等、その他やむを得ない事情があるときは、取得、交換の各お申込みの受付を停止すること、およびすでに受付けた取得、交換の各お申込みの受付を取消することができます。
信託期間	無期限（平成13年7月9日設定）
上場市場	大阪証券取引所
繰上償還	受益権の口数が30万口を下回る事となった場合等は、償還となる場合があります。また、上場した全ての金融商品取引所において上場廃止になった場合または日経225が廃止された場合は、償還となります。
決算日	毎年7月8日
収益分配	年1回の決算時に分配を行いません。
追加信託の限度額	10兆円相当
公 告	原則、 <a href="http://www.nomura-am.co.jp/">http://www.nomura-am.co.jp/</a> に電子公告を掲載します。
運用報告書	運用報告書は作成いたしません。

## ファンドの費用・税金

### ■ファンドの費用

#### 投資者が直接的に負担する費用

取得時手数料	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。)
信託財産留保額	ありません
交換時手数料	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。)

#### 投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用 (信託報酬)	信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とします。 信託報酬率が年0.231%(税抜年0.22%)の場合の信託報酬の配分は下記の通りとします。									
	ファンドの 純資産総額	7500億円以下 の部分	7500億円超 1兆円以下 の部分	1兆円超 2兆円以下 の部分	2兆円超 の部分					
	信託報酬率	年0.252%(税抜年0.24%)以内 (平成23年9月29日現在 <b>年0.231%(税抜年0.22%)</b> )								
	配分 (税抜)	委託会社	受託会社	年0.15%	年0.16%	年0.17%	年0.18%	年0.07%	年0.06%	年0.05%
その他の費用・ 手数料	<p>また、その他の費用・手数料として、以下の費用等がファンドから支払われます。これらの費用等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・組入価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料</li> <li>・ファンドに関する租税、監査費用 等</li> </ul>									

※上記配分は、平成23年9月29日現在の信託報酬率における配分です。

ファンドの信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

### ■税金

- 税金は表に記載の時期に適用されます。
- 以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税及び地方税	配当所得として課税 収益分配金に対して10%
売却時及び交換時	所得税及び地方税	譲渡所得として課税 売却時及び交換時の差益(譲渡益)に対して10%

\* 上記は平成23年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

\* 法人の場合は上記とは異なります。

\* 税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。