

2024年3月22日

au アセットマネジメント株式会社

「auAM Quantitative-Control レバレッジ NASDAQ100」(愛称「Qレバナス」)、au カブコム証券と楽天証券に提供開始

au アセットマネジメント株式会社(本社:東京都千代田区、代表取締役社長:清水 慎一、以下 au アセットマネジメント)は、2024年3月22日より、au カブコム証券株式会社(本社:東京都千代田区、代表取締役会長兼社長:二宮 明雄)、楽天証券株式会社(本社:東京都港区、代表取締役社長:楠 雄治)に、au アセットマネジメントが運用する「auAM Quantitative-Control レバレッジ NASDAQ100」の提供を開始しました。

※取扱開始時刻(購入受付開始時刻)は販売会社によって異なります。詳しくは販売会社にご確認ください。



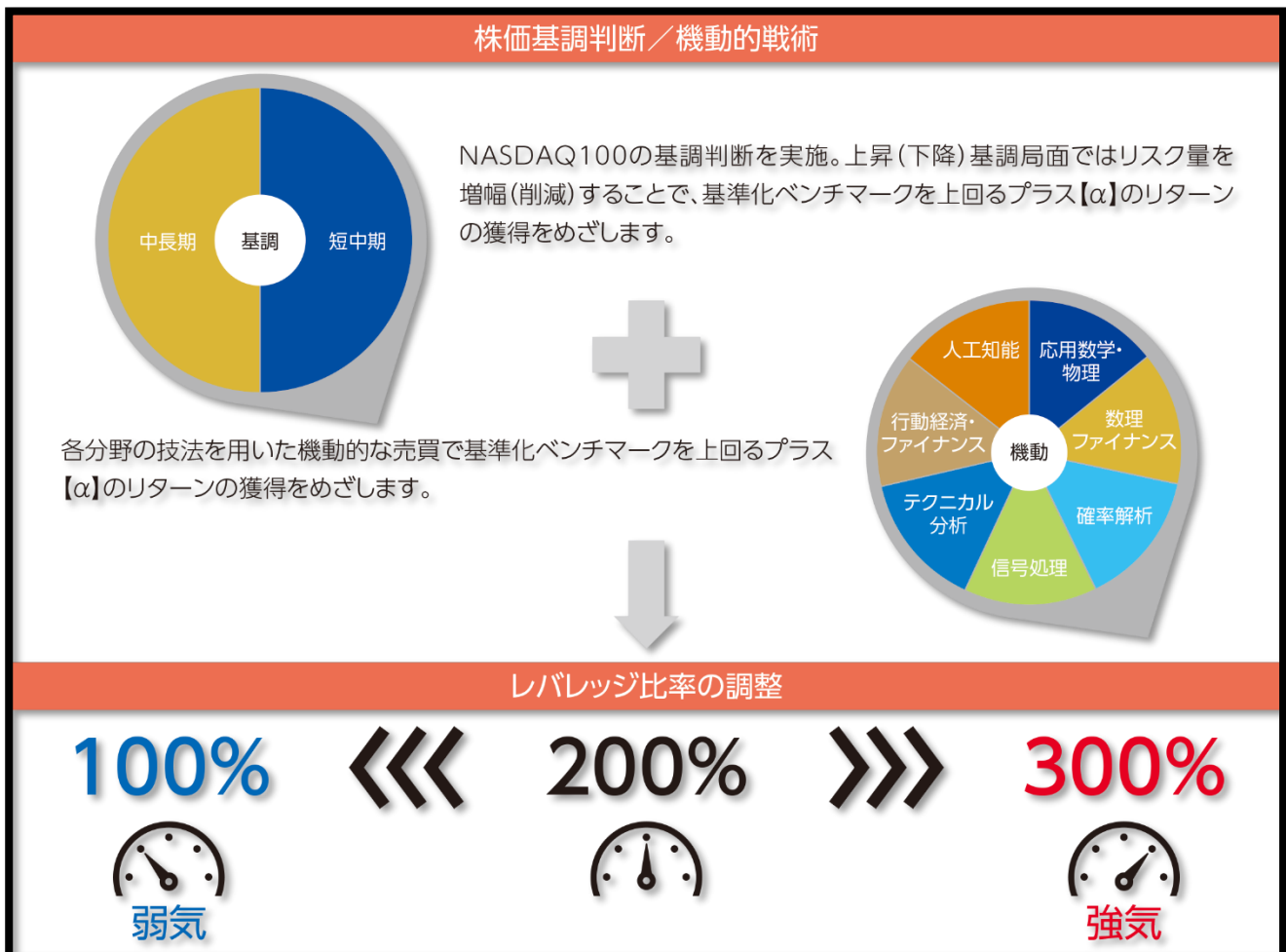
当社公募投資信託としては初となるクオンツ手法を用い、レバレッジ比率をおおむね1倍から3倍にコントロールすることで、日々の基準価額の値動きがNASDAQ100指数(円ヘッジベース)の値動きの2倍を上回るプラスアルファのリターンの獲得を目指すファンドを設定します。

■ 当社のクオンツ手法について

主にテクノロジーを積極的に活用しながら、市場参加者が意識する着眼点や相場観と、学術的な数理科学の側面を踏まえた定量的なルールを構築して運用する手法です。

■ 運用戦略（レバレッジコントロール）について

当ファンドは以下のようなクオンツ手法を用いてレバレッジ比率をコントロールする事でプラスアルファのリターンを追求し、日々の基準価額の値動きが NASDAQ100 指数（円ヘッジベース）の値動きの 2 倍を上回ることをめざして運用を行います。



※実際のレバレッジ比率は、買建玉の時価総額の変動等により変動します。目標レバレッジ比率には一定の変動許容幅を設けます。

■ 信託報酬について

- 信託報酬の内訳は年率 0.325%(税抜)の基本信託報酬と、成功報酬で設計されています。
- 成功報酬は運用実績に応じて基準化ベンチマーク（注1）方式により算出します。
- 成功報酬控除前の基準価額（注2）が基準化ベンチマークを上回った場合、その【 α 】の 11%（税抜 10%）が成功報酬額となります。【 α 】は日々洗い替えを行い、【 α 】が減少した場合は成功

報酬額をファンドの基準価額へ戻し入れます。

●成功報酬控除前の基準価額が基準化ベンチマークを下回る場合は、成功報酬はいただきません。

(注1) 基準化ベンチマークとは、設定日前日に参照ベンチマーク<前日のNASDAQ100指数(円ヘッジベース)の値動きの2倍となるカスタムベンチマーク>が10,000となる乗数を算出し、その乗数と前日のベンチマークを乗算し算出するものです。

(注2) 信託報酬の基本報酬および経費控除後の価額

$[a] = \text{前営業日の基準価額} - \text{当日の基準化ベンチマーク}$
--

今後も、当社は TOP クオリティの運用ノウハウが詰まったアクティブクオンツファンドから、シンプルでわかりやすい低コストファンドまで、真にお客さまのためとなるファンドを開発し、提供してまいります。

以上

【会社概要】

会社名 : au アセットマネジメント株式会社
所在地 : 東京都千代田区西神田三丁目2番1号 千代田ファーストビル南館4階
代表者名 : 代表取締役社長 清水 慎一
株主構成 : au フィナンシャルホールディングス株式会社 66.6%
株式会社大和証券グループ本社 33.4%
事業内容 : 投資運用業
投資助言・代理業
第二種金融商品取引業
金融商品仲介業
確定拠出年金運営管理業
登録番号 : 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第3062号
金融商品仲介業者 関東財務局長(金仲)第872号
確定拠出年金運営管理機関登録番号792
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

「auAM Quantitative-Control レバレッジ NASDAQ100 ファンド」について

ファンドの目的

auAM Quantitative-Control レバレッジ NASDAQ100 マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きが NASDAQ100 指数（円ヘッジベース）の値動きの 2 倍を上回ることをめざして運用を行います。

ファンドの特色

- 主としてマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
- マザーファンドへの投資を通じて定量的なモデルに基づき、レバレッジ比率を 1～3 倍程度の範囲内でコントロールします。
- 実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。
 - ※ 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。
 - ※ 為替ヘッジを行う際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

投資リスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。

- **基準価額の主な変動要因** ※変動要因は下記に限定されるものではありません。
 - 株価指数先物取引の利用に伴うリスク
 - 価格変動リスク・信用リスク（株価の変動・公社債の価格変動）
 - 為替変動リスク
 - カントリー・リスク
 - その他（解約申込みに伴うリスク等）
 - 当ファンドの戦略に関するリスク
- **その他の留意点**
 - 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。
 - 流動性リスクに関する事項
当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、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で取引できないリスク、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、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
 - 当ファンドは、マザーファンドを通じてレバレッジ運用を行うにあたり先物取引を利用するため、借入金利に相当する負担があります。そのため、長期に保有する場合、金利負担が累積されます。
 - レバレッジ倍率に比した高リスク商品であり、初心者向けの商品ではありません。長期に保有する場合、対象資産の値動きに比べて基準価額が大幅に値下がりすることがあるため、そのことについてご

理解いただける方に適しています。

- **リスクの管理体制**

委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に関する基本方針に基づき、運用部門から独立した部署および会議体が直接的または間接的に運用部門へのモニタリング・監視を通し、運用リスクの管理を行います。

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行い、リスク管理会議において、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

お申込みメモ

購入単位	最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位
購入価額	①当初申込期間 1万円(1万口当たり) ②継続申込期間 購入申込受付日の翌営業日の基準価額(1万口当たり)
購入代金	販売会社が指定する期日までにお支払い下さい。
換金単位	最低単位を1口単位として販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額(1万口当たり)
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
申込締切時間	①当初申込期間 当初申込期間最終日の販売会社所定の時間まで (販売会社所定の事務手続きが完了したもの) ②継続申込期間 原則として、販売会社の営業日の午後3時まで (販売会社所定の事務手続きが完了したもの)
購入の申込期間	①当初申込期間 2024年3月19日から2024年3月21日まで ②継続申込期間 2024年3月22日から2025年5月20日まで 継続申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。
当初募集額	100億円を上限とします。
申込受付中止日	①ナスダック(米国)の休業日と同じ日付の日 ②シカゴ・マーカンタイル取引所の休業日と同じ日付の日 ③「委託会社の休業日かつシカゴ・マーカンタイル取引所が休業日でない日」の前営業日
換金制限	信託財産の資産管理を円滑に行うために大口の換金申込には制限があります。
購入・換金申込受付の中止および取消し	●次に該当する場合には、auアセットマネジメントの判断で、購入、換金の受け付けを中止または取消しにすることがあります。 <ul style="list-style-type: none">・株価指数先物取引のうち主として取引を行うものについて、当該先物取引にかかる金融商品取引所等における当日の立会が行われなくなるとともに停止されたとき。・株価指数先物取引のうち主として取引を行うものについて、当該先物取引にかかる金融商品取引所等における当日の立会終了時の当該先物取引の呼値が当該金融商品取引所等が定める呼値の幅の限度の値段とされる等やむを得ない事情が発生したことから、当ファンドの当該先物取引にかかる呼値の取引数量の全部もしくは一部についてその取引が成立しないとき。 ●金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情(投資対象国における非常事態による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)が発生した場合には、購入、換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けた購入、換金の申込みを取消することがあります。
信託期間	2034年3月21日(2024年3月22日設定)
繰上償還	委託会社は、NASDAQ100指数(米ドルベース)が改廃された場合には、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。 次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させること(繰上償還)ができます。 <ul style="list-style-type: none">●受益権の口数が10億口を下ることとなった場合●信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき●やむを得ない事情が発生したとき
決算日	2月22日、5月22日、8月22日、11月22日(休業日の場合は翌営業日) ※第1計算期間は、2024年5月22日(休業日の場合翌営業日)までとします。
収益分配	年4回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。 (注)当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。なお、お取扱い可能なコースおよびコース名については、異なることがありますので、販売会社にお問合せください。
信託金の限度額	500億円
公告	電子公告の方法により行い、ホームページ[https://www.kddi-am.com/]に掲載します。
運用報告書	毎年2月および8月の計算期末ならびに償還時に作成し、交付運用報告書をあらかじめお申出いただいたご住所にお届けします。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
課税関係	課税上は、株式投資信託として取扱われます。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA(少額投資非課税制度)の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの対象ではありません。 ※上記は、有価証券届出書提出日現在のものです。税法が改正された場合等には、変更される場合があります。

。

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
購入時手数料	3.3% (税抜3.0%) を上限として販売会社が別に定める率 くわしくは、販売会社にお問い合わせ下さい。	購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の 提供、事務手続き等の対価です。
信託財産留保額	ありません。	—
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、①基本報酬額に②成功報酬額を加算して得た額とします。	
	① 基本報酬額 純資産総額に対して年率0.3575% (税抜0.325%) を乗じて得た額とします。	
	委託会社	年率0.165% (税抜0.15%)
	販売会社	年率0.165% (税抜0.15%)
	受託会社	年率0.0275% (税抜0.025%)
	② 成功報酬額 成功報酬額は、前営業日の基準価額が当日の基準化ベンチマーク*を上回っている場合、その基準価額と基準化ベンチマークの差額に11% (税抜10%) を乗じて得た額を10,000で除した額に、前営業日の受益権口数から当日に計上した解約口数を減算した値を乗じて得た額を当日の成功報酬額とします。この成功報酬額は日々洗い替えを行い、基準価額を計算します。 なお解約があった場合の解約口数に対する成功報酬額は前々営業日の基準価額と前営業日の基準化ベンチマークから算出し、決算日まで累計されます。日々の成功報酬累計額は決算日に確定し支弁されます。 ※ベンチマークは前日のNASDAQ100指数 (円ヘッジベース) の値動きの2倍となるカスタムベンチマーク (ただし、設定日当日は前日と同数値とする。) ※基準化ベンチマークは設定日前日にベンチマークが10,000となる乗数 (ベンチマーク乗数) を算出し、その乗数と前日のベンチマークを乗算し日々算出します。決算日には前営業日の基準価額と当日の基準化ベンチマークを比較し、その決算日の翌日から次回決算日までを適用期間とするベンチマーク乗数を計算します。また、分配金が発生した場合は分配金の考慮を行います。 (当日基準化ベンチマーク=前日のベンチマーク × ベンチマーク乗数)	
その他の費用・ 手数料	監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を信託財産でご負担いただけます。 なお、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。	

手数料等の合計額については、保有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。

ご留意事項

- 当資料は、au アセットマネジメント株式会社が作成したプレスリリースであり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。ファンドの取得の申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書 (交付目論見書) の内容を必ずご確認の上、ご自身でご判断ください。
- 投資信託は、預金や保険契約と異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象とはなりません。
- 当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成されていますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。
- 当資料中に示された情報等は、作成日時点のものであり、事前の連絡なしに変更されることがあります。
- 分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- 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。
- ファンド名称の auAM は、au アセットマネジメントの略称です。

当ファンドは、Nasdaq, Inc. またはその関連会社（以下、Nasdaq, Inc. およびその関連会社を「株式会社」と総称します。）によって、支援、推奨、販売または販売促進されるものではありません。株式会社は、ファンドの合法性もしくは適合性について、または当ファンドに関する記述および開示の正確性もしくは妥当性について認定するものではありません。株式会社は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性や、NASDAQ-100 Index®の一般的な株式市況への追従可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行いません。株式会社と au アセットマネジメント株式会社との関係は、Nasdaq®および NASDAQ-100 Index®の登録商標ならびに株式会社の一定の商号について使用を許諾すること、ならびに、au アセットマネジメント株式会社または当ファンドとは無関係に、ナスダックが決定、構築および算出を行う NASDAQ-100 Index®の使用を許諾することに限られます。ナスダックは、NASDAQ-100 Index®の決定、構築および計算に関し、au アセットマネジメント株式会社または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。株式会社は、当ファンドの発行に関してその時期、価格もしくはその数量の決定について、または当ファンドを換金する際の算式の決定もしくは計算についての責任を負っておらず、また関与をしていません。株式会社は、NASDAQ-100 Index®とそれに含まれるデータの正確性および中断されない算出を保証しません。株式会社は、NASDAQ-100 Index®またはそれに含まれるデータの利用により、au アセットマネジメント株式会社、当ファンドの保有者またはその他いかなる者もしくは組織に生じた結果についても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行いません。株式会社は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行わず、かつ NASDAQ-100 Index®またはそれに含まれるデータの利用に関する、特定の目的または利用のための市場商品性または適合性については、いかなる保証についても明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、株式会社は、いかなる逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的損害や損失について、たとえもし当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。