

2023年7月21日

au アセットマネジメント株式会社

## 「auAM レバレッジ NASDAQ100」 楽天証券に提供開始

au アセットマネジメント株式会社（以下 au アセットマネジメント）は、2023年7月21日より、楽天証券株式会社（以下 楽天証券）に、au アセットマネジメントが運用する「auAM レバレッジ NASDAQ100」（以下 当ファンド）の提供を開始します。



### 【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 66.6%<br>大和証券グループ本社 33.4%                                  |
| 事業内容 | : 投資運用業<br>投資助言・代理業<br>第二種金融商品取引業<br>金融商品仲介業<br>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<br>金融商品仲介業者 関東財務局長（金仲）第872号<br>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<br>一般社団法人 日本投資顧問業協会   |

## 「auAM レバレッジ NASDAQ100」について

### ファンドの目的

auAM 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（米ドルベース）の値動きの 2 倍程度となることをめざします。

### 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、日々の基準価額の値動きが NASDAQ100 指数（米ドルベース）の値動きの 2 倍程度となることをめざします。
- マザーファンドを通じて株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、原則として信託財産の純資産総額の 2 倍程度となるように調整します。

（注）追加設定、解約がある場合、既存受益者と新規受益者の公平性を維持するために、設定金額と解約金額の差額分に対して、原則として、当日中に株価指数先物取引を買建てもしくは転売するものとしてします。この結果、株価指数先物取引の買建玉の時価総額は、上記のようにならないことがあります。

\* 利用する先物取引は、流動性、効率性等を勘案して決定します。主として、NASDAQ100 指数を対象とした先物取引を利用する予定です。売買高等の市況動向等の変化に応じて、他の株価指数先物取引を利用することがあります。

当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色の運用が行われないことがあります。

- 実質組み入れ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。

**日々の基準価額の値動きは、米国の株式市場の値動きの「ちょうど 2 倍」になるとはかぎりません。その主な要因は次のとおりです。**

イ. 米国の株式市場の値動きと、利用する株価指数先物の値動きとの差

ロ. 株価指数先物取引の約定価格と終値の差

ハ. 株価指数先物取引をロールオーバーする過程における、限月の異なる先物間の価格差の変動

ニ. 運用管理費用（信託報酬）、監査報酬、売買委託手数料等の負担

ホ. 株価指数先物の流動性が低下した場合における売買対応の影響

ヘ. 株価指数先物と最低取引単位の影響

ト. 配当利回りと短期金利の差

※ 将来の米国の金利水準によっては、さらに乖離が拡大する場合があります。

チ. 為替変動により、株価指数先物取引の買建ての額を円に換算した額が、目標としている額から乖離することにより、目標とする投資成果が達成できない場合があること

### 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）

■ **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定を定め、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体制について、監督します。

**ファンドの費用**

**投資者が直接的に負担する費用**

|         | 料率等                     |
|---------|-------------------------|
| 購入時手数料  | 販売会社が別に定める率<上限>2.2%(税込) |
| 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**

|              | 料率等  |
|--------------|--|
| 運用管理費用(信託報酬) | 年率0.4334%(税抜0.394%)  |
| 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きます。<br>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。 |

※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問合せください。

※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。

以上