

2024 年 7 月 3 日

au アセットマネジメント株式会社

「auAM レバレッジ NASDAQ100 為替ヘッジ無し」提供開始 ～SNS での投資家の声をヒントにファンドを組成～

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 7 月 26 日に追加型投資信託「auAM レバレッジ NASDAQ100 為替ヘッジ無し」（以下、当ファンド）の設定・運用を開始することをお知らせします。

また、当ファンドは 2024 年 7 月 19 日より、株式会社 SBI 証券（本社：東京都港区、代表取締役社長：高村 正人）、マネックス証券株式会社（本社：東京都港区、取締役社長執行役員：清明 祐子）にて、2024 年 7 月 22 日より楽天証券株式会社（本社：東京都港区、代表取締役社長：楠 雄治）にて募集が開始※されます。

※ 募集取扱期間は販売会社により異なる場合があります。詳しくは各販売会社にご確認ください。

The image is a promotional graphic for the auAM Leverage NASDAQ100 No Hedge Fund. It features a black silhouette of a bull on a red background with a white grid pattern. The text 'auAM レバレッジ NASDAQ100 為替ヘッジ無し' is at the top in white and orange. Below it, '追加型投信／海外／株式／特殊型（その他）' is written in white. The central text reads 'NASDAQ 100 BULL X2' and 'US\$ 為替ヘッジ無し* X1'. At the bottom left, a small note states: '※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。' At the bottom right, another note states: '※外国為替取引等を用いて純資産の1倍相当の米ドルに投資することで、為替ヘッジ無しと同等の投資成果を目指すファンドです。'

当ファンドは「東出 卓朗 | [au アセットマネジメント\(株\) 公式](#)」X（旧 Twitter）アカウントに寄せられた「資金効率を重視し、レバレッジ型ファンドへ投資を行い、円ベースのリターンではなく、ドルベースのリターンを享受したい」という声をヒントに組成しました。今後も投資家の声に幅広く耳を傾け投資家の要望に応えていきます。

当ファンドは、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。後述の「● マザーファンドの概要」をご覧ください。）の受益証券を高位に組み入れる

ことにより、純資産総額の 2 倍程度の NASDAQ100 指数 先物（米ドルベース）を買い建てるとともに、為替予約取引等により純資産総額程度の 米ドルを保有します。これにより、純資産の 2 倍程度の NASDAQ100 指数（米ドルベース） のリターンと、純資産相当の米ドル保有に伴うリターンの獲得を目指します。

■「NASDAQ100」指数について

- ・ NASDAQ100 指数は、米国のナスダック市場に上場している時価総額の大きい非金融業 100 社の株式で構成される株価指数です。（対象銘柄には、米国以外の企業の株式を含みます）
- ・ 指数の計算方法は、調整済時価 総額加重平均方式です。定期的な採用銘柄の入替えは毎年 12 月に行われますが、それ以外に、臨時に入替えが 行われることがあります。
NASDAQ100 指数は、1985 年 1 月 31 日以降継続して算出され、現在の指数値は算出開始時の値を 125 と して計算されています。
- ・ なお、NASDAQ100 指数は、ナスダック市場の全銘柄で構成される NASDAQ 総合指数 (NASDAQ Composite Index)とは異なる指数です。

今後も、au アセットマネジメントはシンプルでわかりやすい低コストファンドから、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 レバレッジ NASDAQ100 為替ヘッジ無し」について

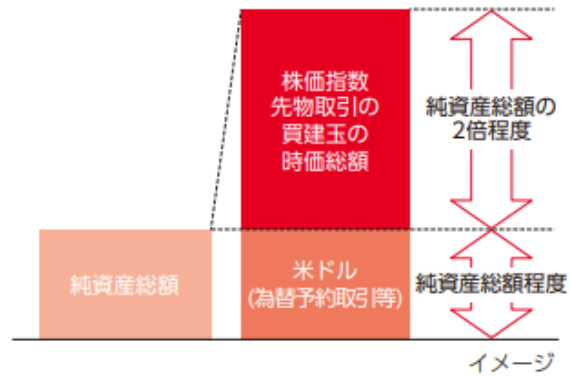
ファンドの目的

マザーファンドの 受益証券を高位に組み入れることにより、純資産総額の 2 倍程度の NASDAQ100 指数 先物（米ドルベース）を買い建てるとともに、為替予約取引等により純資産総額程度の米ドルを保有します。これにより、純資産の 2 倍程度の NASDAQ100 指数（米ドルベース）のリターンと、純資産相当の米ドル保有に伴うリターンの獲得を目指します。

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、純資産総額の 2 倍程度の NASDAQ100 指数先物（米ドルベース）を買い建てるとともに、為替予約取引等により純資産総額程度の米ドルを保有します。

株価指数先物取引*の買建玉の時価総額が、原則として純資産総額の2倍程度になるように調整するとともに、為替予約取引等により純資産総額程度の米ドルを保有します。これにより、純資産の2倍程度のNASDAQ100指数(米ドルベース)のリターンと、純資産相当の米ドル保有に伴うリターンの獲得を目指します。



※上記はあくまでもイメージであり、実際の株価指数先物の組入れは必ずしも上記のようになるとは限りません。

* 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。

マザーファンドの概要

ファンド名	auAMレバレッジ NASDAQ100マザーファンド
主要投資対象	米国の株価指数先物取引、米国の債券および国内の債券
投資態度	①主として、米国の債券および国内の債券に投資するとともに、米国の株価指数先物取引を買い建てます。 ②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倍程度になるように調整することにより、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。 ③為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

※マザーファンドの主な投資制限等の詳細については、請求目論見書または約款に記載しております。

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。

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) (注)2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。 [原則として、販売会社の営業日の午後3時30分まで(販売会社所定の事務手続きが完了したもの)]なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合せ下さい。
購入の申込期間	①当初申込期間 2024年7月19日から2024年7月25日まで ②継続申込期間 2024年7月26日から2025年10月28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。
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・マーカント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・マーカント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、換金の受付けを中止または取消しにすることがあります。 ・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かったときもしくは停止されたとき。 ・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値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、換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けた購入、換金の申込みを取消すことがあります。
信託期間	無期限(2024年7月26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。 ●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	毎年7月27日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1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、異なる場合がありますので、販売会社にお問合せください。
信託金の限度額	5,000億円
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	毎計算期末に作成し、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。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。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

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	2.2%(税抜2.0%)を上限として販売会社が別に定める率 くわしくは、販売会社にお問合せ下さい。	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		
	料率等	費用の内容
運用管理費用 (信託報酬)	年率0.4334%(税抜0.394%)	運用管理費用の総額は、日々の信託財産の純資産総額に 対して左記の率を乗じて得た額とします。運用管理費用 は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日 (休業日の場合翌営業日)および毎計算期末または信 託終了のときに信託財産から支払われます。
運用管理費用の配分(税抜) ④		
委託会社	0.20295% (税抜0.1845%)	ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準 価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価です。
販売会社	0.20295% (税抜0.1845%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの 管理、購入後の情報提供等の対価です。
受託会社	0.0275% (税抜0.025%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価です。
(注)「運用管理費用の配分」には、別途消費税率を乗じた額がかかります。		
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。 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。		

当資料のお取扱いにおけるご注意

- 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、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、これを割り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。
- 投資信託は預貯金とは異なります。
- 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。