



【1480】

企業価値ETF【略称】

NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信【正式名称】

- 収益性が高く、適切な設備・人材投資などの還元政策に積極的に取り組んでいる日本株を構成銘柄とする時価総額加重平均型の株価指数「野村企業価値分配指数」との連動を目指すETF(上場投資信託)です。

1. NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信 の概要

(2018年1月31日 現在)

銘柄名	NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信		
対象指標	野村企業価値分配指数		
計算期間	毎年4月21日～10月20日、10月21日～翌年4月20日		
分配金支払基準日	毎年4月20日、10月20日(年2回)		
管理会社	野村アセットマネジメント株式会社		
銘柄コード	1480	市場価格(終値)(※1)	17,360 円
売買単位	1口単位	1口あたり分配金(※2)	275円
信託報酬	0.23% (税込; 0.2484 %)以内	分配金利回り(※3)	1.58%
純資産総額	90 億円	Indicative NAV/PCFの開示(※4)	あり
受益権口数	523 千口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	17,360 円

※1 上記の期日において約定がない場合、「市場価格(終値)」及び「1売買単位あたりの投資金額」には、直近時点の市場価格を記載しています。

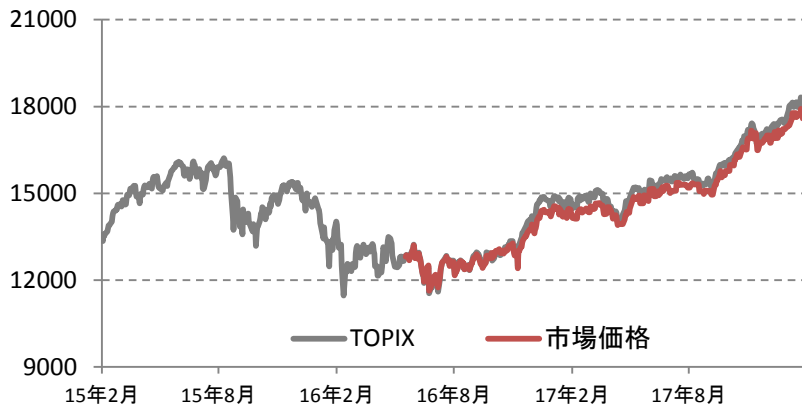
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※3 直近12か月の実績分配金及び作成日の終値をもとに算出した分配金利回りを記載しています。

※4 Indicative NAVとは、PCF情報に現時点の株価を乗じることによって算出されるリアルタイムの推定純資産額(1口あたり)、PCFとは、管理会社よりご提供をいただいたポートフォリオ構成銘柄情報ファイルのことを指します。ここでは東証を通じて開示しているIndicative NAV/PCF情報の有無を記載しています。

2. パフォーマンス

(2018年1月31日 現在)



※ 2016年5月19日 の市場価格を基準値とし、TOPIXの値を再換算しています。

■ 騰落率

期間	当銘柄	(参考)TOPIX
過去3か月	+5.15%	+4.01%
過去6か月	+14.21%	+13.47%
過去1年	+21.65%	+20.70%
過去3年	-	+29.80%
過去5年	-	+95.34%

■ 当銘柄のボラティリティ

ボラティリティ(過去30日)	-
ボラティリティ(過去90日)	-

※ 対象期間のうち13%以上の日に売買が成立していない場合、上場後の期間が記載の期間に満たない場合は「-」と表示されます。

対象指標の現在値 <http://nextfunds.jp/lineup/1480/detail.html>

3. ファンド組入銘柄

(2018年1月31日 現在)

	証券コード	銘柄名	構成比
1	7203	トヨタ自動車	3.18%
2	9432	日本電信電話	2.55%
3	8316	三井住友フィナンシャルグループ	2.30%
4	6861	キーエンス	2.18%
5	6954	ファナック	2.03%

4. 情報ベンダーコード

情報ベンダー名	ETFコード	対象指標
QUICK	1480/T	SNJPEVA/NRIJ
Bloomberg	1480 JP Equity	NMRIJOEV
Thomson Reuters	1480.T	.NEVA

5. 対象指標の概要

野村企業価値分配指数とは、国内の金融商品取引所に上場する全ての普通株式から、利益や配当、人件費、設備投資、研究開発等を基にした定量的な評価指標により選定される銘柄(上限300銘柄)で構成される時価総額加重平均型(3%ウェイト上限付)指数です。野村企業価値分配指数は、2001年8月17日を基準日とし、当該基準日の指数値を10000として、野村証券株式会社が算出・公表しています。

6. リンク債型ETFの信用リスク

- 当ETFはリンク債連動型ETFです。
- リンク債型ETFとは、主に金融機関が発行する指標に連動した投資成果を目的とする債券(リンク債)に投資することで、ETFの一口あたり純資産額の変動率と対象指標の変動率を一致させる運用手法を採るETFを指します。ETFが投資対象とするリンク債は、その償還価格が指標の動きに連動するようにリンク債発行者が保証しており、リンク債を保有することにより、ETFの一口あたり純資産額の変動率は指標の変動率に一致します。リンク債型ETFでは、一口あたり純資産額の変動率と指標の変動率の間に乖離(トラッキングエラー)が発生しない反面、リンク債の発行者の信用リスクが存在します。
- リンク債型ETFは、満期償還日までが比較的近く換金性の高いリンク債に投資していることが多いものの、リンク債の発行者の倒産や財務状況の悪化等の影響により、リンク債の価値が下落又は無価値になり、結果的にETFの基準価額が下落することがあります。
リンク債型ETFの投資にあたっては、リンク債の発行金融機関の健全性(例えば、財務状況や信用格付など)を確認し、リンク債の発行金融機関の信用状況を十分に把握することが重要です。
- これらの銘柄の有価証券届出書や月次に公表するマンスリーレポートでは、組入れ銘柄やその格付が開示されています。投資にあたっては、これらの情報にご留意いただく必要があります。

7. ETF情報入手一覧

- 各ETFに関するより詳細な商品概要
「野村アセットマネジメント株式会社 ETF専用ホームページ」 <http://nextfunds.jp/>
- ETFの現在値・前日比・売買高・PCF情報・インディカティブNAV・分配金
<http://www.tse.idmanagedsolutions.com/iopv/table?language=jp&iopv=1>
- 一口あたりの純資産総額、対象指数との乖離率、ファンドの組入銘柄等
(注)検索される場合には、検索条件に検索コード5ケタの管理会社コード「13064」を入力してください。
「適時開示情報閲覧サービス」 https://www.release.tdnet.info/inbs/I_main_00.html
- ETF株マップ
<http://etf.kabumap.com/servlets/etf/Action?SRC=page/top>

8. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETF/ETNの概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- ETF/ETNは値動きのある有価証券を投資対象としますので、連動対象である指標及び外国為替相場の変動、組入有価証券の価格の変動、組入有価証券の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又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。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- ETF/ETNの売買を行われるに際しては、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料の実績数値は過去のものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。
- 当資料は、2018年1月現在の内容です。その以後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。