



【1699】

野村原油【略称】

NEXT FUNDS NOMURA原油インデックス連動型上場投信【正式名称】

● 日本円換算したNOMURA原油ロングインデックスとの連動を目指すETF(上場投資信託)です。

1. NEXT FUNDS NOMURA原油インデックス連動型上場投信の概要

(2018年3月30日 現在)

銘柄名	NEXT FUNDS NOMURA原油インデックス連動型上場投信		
対象指標	円換算したNOMURA原油ロングインデックス		
計算期間	毎年2月11日～翌年2月10日		
分配金支払基準日	毎年2月10日(年1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	1699	市場価格(終値)(※1)	403 円
売買単位	10口単位	1口あたり分配金(※2)	0円
信託報酬	0.5% (税込; 0.54 %)以内	分配金利回り(※3)	0.00%
純資産総額	238 億円	Indicative NAV/PCFの開示(※4)	なし
受益権口数	58,830 千口	1売買単位あたりの投資金額(※1)	4,030 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。

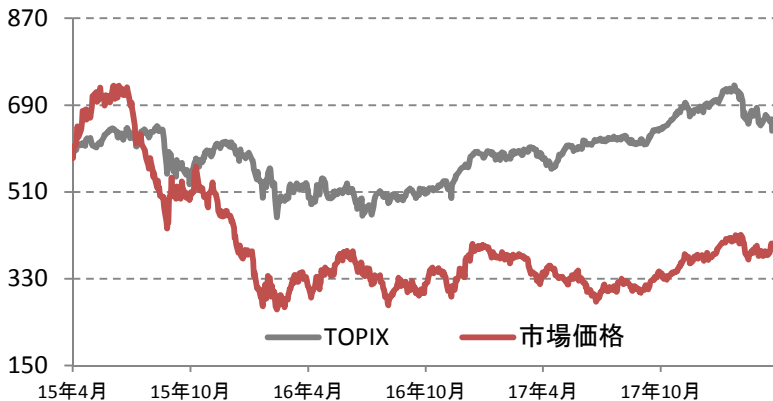
※2 直近12か月の実績分配金を記載しています。

※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3月30日 現在)



※ 2015年3月31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	+2.28%	-5.57%
過去6か月	+18.18%	+2.48%
過去1年	+17.49%	+13.47%
過去3年	-31.69%	+11.22%
過去5年	-57.40%	+65.87%

■ 当銘柄のボラティリティ

ボラティリティ(過去30日)	23.5%
ボラティリティ(過去90日)	23.1%

※ 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。

対象指数の推移 <http://qr.nomura.co.jp/jp/frcnri/index.html>

3. ファンド組入銘柄

(2017年7月31日 現在)

証券コード	銘柄名	構成比
1	- NYMEX WTI先物	99.62%
2		
3		
4		
5		

5. 対象指標の概要

NOMURA原油ロングインデックスは、世界の原油先物取引の中から、取引量が多く流動性が十分あるものを構成銘柄として採用し、原油価格の値動きに連動することを目的とするインデックスです。2008年12月31日を基準日とし、その日の指数値を1,000として算出されています。

指数算出ルールに従い、限月の変更を行います。野村証券金融工学研究センターが算出を行っています。

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	1699/T	COILL/NCI
Bloomberg	1699 JP Equity	-
Thomson Reuters	1699.T	-

6. 先物型ETF投資に際しての留意点

- 当ETFは先物型ETFです。
- 先物型ETFとは、先物取引の価格を用いる指標に連動するETF又は主に先物取引に投資を行うETFを言います。
- 先物価格は限月(先物の決済期間)の違いによって、その価格が異なります。その理由は「時間的価値」によるものです。時間的価値とは、現時点から限月までの期間における価格変動に対する期待を表すものです。また、商品先物は保管コスト(コスト・オブ・キャリー)等も先物価格に反映されます。
- 一般的に、限月までの期間が長ければ長いほど将来の価格の不確実性が増すことから、時間的価値は大きくなります。一方、先の限月の先物ほど安い、すなわち決済期日が短い(期近)価格の方が、決済期日が長い(期先)よりも高い状態になる場合もあります。
こうした要因により、先物型ETFは、先物取引の次限月以降の限月への乗換え(ロールオーバー)に伴って損益が発生する場合があります。
先物型ETFは、ロールオーバーを繰り返すことで減価していく場合があります。そのため、とりわけ中長期の投資を行う場合には留意が必要といえます。

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.idmanagementsolutions.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3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。