



【2086】 NZAM SP5H【略称】 NZAM 上場投信 S&P500(為替ヘッジあり)【正式名称】



- 米国の株式を主要投資対象とし、S&P500指数(配当込み、TTM、円建て、円ヘッジ)に連動する投資成果を目指すETF(上場投資信託)です。
- 国内組成のETFであり、通常の株式と同様に全国の証券会社にてお取り扱いしています。

1. NZAM 上場投信 S&P500(為替ヘッジあり)の概要

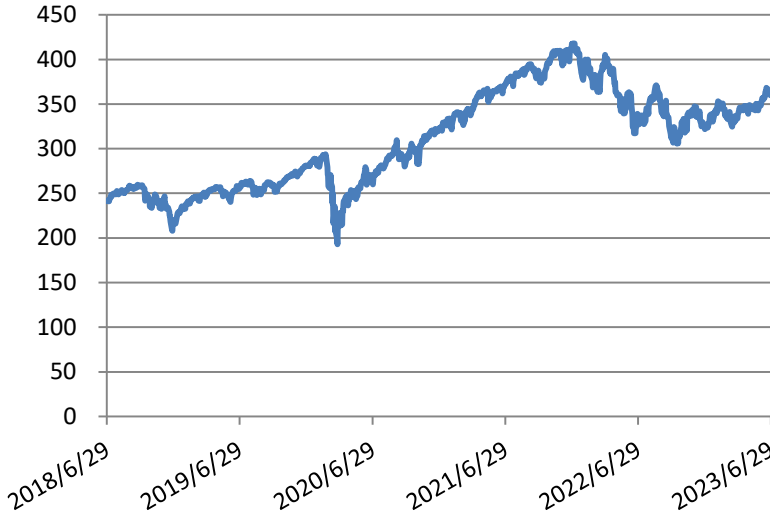
(2023年8月29日 現在)

銘柄名	NZAM 上場投信 S&P500(為替ヘッジあり)		
銘柄コード	2086		
対象指標	S&P500指数(配当込み、TTM、円建て、円ヘッジ)		
計算期間(※1)	毎年4月16日から10月15日、10月16日から翌年4月15日		
分配金支払基準日	毎年4月15日、10月15日(年2回)		
管理会社	農林中金全共連アセットマネジメント株式会社		
信託受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社		
上場取引所	東京証券取引所	貸借銘柄選定	あり(金銭・証券の貸付)
売買単位	10口単位	Indicative NAV/PCFの開示(※2)	あり
信託報酬	0.07%(税込:0.077%)以内	上場日	2023/9/22(予定)

※1 ただし、第1計算期間は、2023年9月21日から2024年4月15日とします。

※2 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. 対象指標の推移(2018年6月29日～2023年6月30日)



■ 対象指標の騰落率

期間	対象指標
過去1ヶ月	+4.3%
過去3ヶ月	+7.45%
過去6ヶ月	+11.7%
過去1年	+10.73%
過去3年	+38.48%
過去5年	+51.36%

3. 投資対象について

S&P500インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてS&P500指数(配当込み、TTM、円建て、円ヘッジ)に採用されている銘柄の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資を行います。

4. 対象指標の概要

S&P500指数は、投資情報会社であるS&Pダウ・ジョーンズインデックス社が算出している米国の代表的な株式指数です。米国の証券取引所に上場している代表的な約500銘柄の株価を基に算出しています。S&P500指数(配当込み、TTM、円建て、円ヘッジ)は、S&P500指数(米ドルベース)を円ヘッジし、円換算したものです。

5. ETF情報入手一覧

- 当ETFに関するより詳細な商品概要
「農林中金全共連アセットマネジメント株式会社 ホームページ」<https://www.ja-asset.co.jp/>
- 基準価額(一口あたりの純資産額)等に関する情報
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/base-price/index.html>

- 情報ベンダーコード

情報ベンダー名	QUICK	Bloomberg	Refinitiv
ETFコード	2086/T	2086 JP Equity	2086.T
対象指標	-	SPXTTMJN	-

- S&P500指数(配当込み、TTM、円建て、円ヘッジ)の算出要領
<https://www.spglobal.com/spdji/jp/indices/equity/sp-500-in-ttm-rates-jpy-hedged-index/#overview>

6. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETF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は値動きのある有価証券等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、組入有価証券等の価格の変動、組入有価証券等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の売買が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。
- 当資料は、2023年8月現在の内容です。その後、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。

<お問い合わせ>

株式会社東京証券取引所 上場推進部 | 〒103-8220 東京都中央区日本橋兜町2-1 | Tel:03-3666-0141(代)