

2009年11月19日

ニュースリリース

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目5番1号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第341号
加入協会 （社）投資信託協会、（社）日本証券投資顧問業協会

ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均を対象指標とした ETF の新規設定について

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社（代表取締役社長：水嶋浩雅、以下「シンプレクス AM」）は、日本で初めて米国の株価指数を連動対象とする上場投資信託（ETF）を新規設定することといたしました。米国の代表的な株価指数である「ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均」を対象指標とする『Simple-X NY ダウ・ジョーンズ・インデックス上場投信』を、12月7日（月）に新規設定し、東京証券取引所への上場を12月10日（木）に予定しております。

※ Simple-X NY ダウ・ジョーンズ・インデックス上場投信は、Dow Jones Industrial AverageSM（ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均）を対象指標とします。

当初設定時における指定参加者はシティグループ証券株式会社および日興コーディアル証券株式会社が予定されております。

今回の ETF の設定・上場により、シンプレクス AM が運用する ETF は、合計 2 本となります。シンプレクス AM は今後も投資家の皆様の利便に資するため、ETF の運用に努めてまいります。

* 「Simple-X」は、シンプレクス AM が運用する ETF シリーズの統一ブランドです。

※Dow Jones Industrial AverageSM（「ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均」）

Dow Jones Industrial AverageSM（以下「ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均」といいます。）は、米国の株式市場を左右する業界における有力企業 30 銘柄で構成された代表的な株価指数です。いわゆる伝統的な「工業株」に限定されるものではありません。ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均は米国市場全体を計る基準として使われ、金融界、技術産業、小売業、娯楽産業、消費財市場と様々な業種からなります。その結果、ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均のパフォーマンスは何百、何千という構成銘柄からなる、より複雑な指数のパフォーマンスと高い相関関係にあります。ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均は株価指数を開始した当初の計算方法とほとんど同じ方法で現在も計算されています。それは、主要取引所における構成銘柄の株価を単純に加算した合計値を現在の序数で割るという方法です。ダウ工業株 30 種平均は 100 年以上の歴史をもつ唯一の代表的な市場指数です。構成銘柄の変更は稀ですが、通常、ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均を構成する企業が大規模な変遷を遂げるときなどに見直しがあります。例えば、本業の変更、他企業による買収、倒産、などの場合です。構成銘柄見直しの頻度やその時期に関しては決まっておりません。ウォール・ストリート・ジャーナル紙の主要な編集陣が彼らの裁量で必要と考えたときに銘柄入れ

替えが行われます。

構成銘柄の選定はその彼ら個々の判断によりますが、他の主要編集陣が相談にのることもあります。構成銘柄の選定要素としては、必ず米国の企業であり、業界における牽引役であること、そして投資家に広く支持され、長期間に亘って持続的成長を遂げていることです。

※「Dow Jones」および「Dow Jones Industrial AverageSM」（「ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均」）は Dow Jones & Company, Inc.の登録商標で、シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社による一定の目的のための利用が許諾されています。「Dow Jones Industrial AverageSM」を参照する当ファンドは、Dow Jones により支援、奨励、販売、販売促進されておらず、Dow Jones は当ファンドへの投資が望ましいかどうかについて表明はしていません。

※ディスクレマー

「当ファンド」は、Dow Jones により支援、奨励、販売、販売促進されておりません。Dow Jones は「当ファンド」の保有者もしくは当ファンドの取引の適否に関して助言を行う公衆に対し、明示的であるか黙示的であるかを問わず、いかなる表明または保証を行いません。Dow Jones と認可所有者との間の関係は唯一、一定の商標、商号の使用を許諾することのみであり、Dow Jones および「平均株価指数」は、「認可所有者」または「当ファンド」と関わりなく Dow Jones が決定、構成、算出するものです。Dow Jones は「平均株価指数」の決定、構成または計算に際し、「認可所有者」または「当ファンド」の保有者の要求を考慮する義務を負いません。Dow Jones は、「当ファンド」の設定の時期、価額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わず、また関与していません。Dow Jones は「当ファンド」の管理や市場調査や取引に関する義務または責任を負いません。

Dow Jones は Dow Jones Industrial AverageSMまたはそれに含まれるデータの正確性および／または完全性を保証しておらず、また Dow Jones は、Dow Jones Industrial AverageSMに関する誤り、不作為または中止について責任を負いません。Dow Jones Industrial AverageSMまたはそれらに含まれるデータの利用により、「認可所有者」、「当ファンド」の保有者またはその他いかなる人もしくは組織に生じた結果について、明示的であるか黙示的であるかを問わず、いかなる保証も行いません。Dow Jones は、明示的または黙示的ないかなる保証も行わず、かつ Dow Jones Industrial AverageSM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、Dow Jones は、例えその可能性につき通知されていたとしても、いかなる喪失利益または間接的、懲罰的、特別もしくは重大な損害（喪失利益を含む）についても責任を負いません。Dow Jones およびシンプレクス・アセット・マネジメント株式会社の間の契約または取決めについて、第三者に利益を得る者は存在しません。

同 ETF の概要は以下の通りです。

<概要>

商 品 分 類	追加型株式上場投資信託／海外／株式／ETF／インデックス型／ファンド・オブ・ファンズ
フ ァ ン ド 名	Simple-X NYダウ・ジョーンズ・インデックス上場投信（公募投資信託）
信 託 期 間	無期限(平成 21 年(2009 年)12 月 7 日設定)
上 場 市 場	東京証券取引所
取引所における売買単位	10 口単位
上 場 日	平成 21 年 12 月 10 日(予定)
フ ァ ン ド の 目 的	当ファンドは、ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均を対象指標とし、対象指標に連動する投資成果を目指す投資信託証券に投資を行なうことにより、円換算した対象指標に連動する(基準価額の変動率が対象指標の変動率に一致することをいいます。)投資成果を目指す追加型株式投資信託です。
主 な 投 資 対 象	以下の投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。)を主要投資対象とします。 ケイマン籍米ドル建外国投資信託「シンプレクスNYダウ・ジョーンズ・インデックス・トラッカー・ファンド」 証券投資信託「SAMマネー・マザーファンド」
決 算 日	年 1 回、12 月 6 日
収 益 分 配	原則として、年 1 回の決算日に、収益分配方針に基づいて分配を行いません。ただし、分配金がゼロとなる場合があります。なお、売買益が生じて、分配は行ないません。
売 買 委 託 手 数 料	取扱会社が定める手数料がかかります。詳しくは、取扱会社にお問い合わせください。
信 託 報 酬	信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に、年 0.1575%(税抜年 0.15%)以内の率を乗じて得た額が、お客様の保有期間に応じてかかります。 配分:<委託者>年 0.105%(税抜 0.10%)以内 <受託者>年 0.0525%(税抜 0.05%)以内 投資対象とする投資信託証券の信託報酬は、純資産総額に対し年 0.45%程度 (国内における消費税等相当額はかかりません。) 実質的に負担する信託報酬率は、年 0.6075%(税抜年 0.60%)程度
そ の 他 の 費 用	◆ ファンドの上場に係る費用 ● 新規上場料および追加上場料:新規上場時の純資産総額に対して、及び追加信託総額(毎年の 12 月末日現在の純資産総額を基準とし、新規上場日現在の純資産総額及び新規上場した年から前年までの各年の 12 月末日現在の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して、0.007875%(税抜 0.0075%)。 ● 年間上場料:毎年末の純資産総額に対して、0.007875%(税抜 0.0075%)及び TDnet 利用料 126,000 円(税抜 120,000 円)。 ● 上記の他、新規上場に際して、210 万円(税抜 200 万円)の費用があります。 ◆ 組入有効証券または商品等の売買の際に発生する売買委託手数料、組入有効証券の決済・保管費用、受益者原簿管理に係る費用、ファンド監査費用、有効証券届出書、有効証券報告書、目論見書および仮目論見書の作成、印刷および提出または交付に係る費用、「ダウ・ジョーンズ工業株30種平均」その他これに類する標章の使用料等。 これらは、信託財産中から支弁され、当該 ETF 保有期間中に間接的にご負担いただく費用となります。(当該費用については、運用状況により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。)
信 託 財 産 留 保 額	当ファンドには信託財産留保額はありませぬ。
販 売 会 社 (指 定 参 加 者)	シティグループ証券株式会社 日興コーディアル証券株式会社
受 託 銀 行	中央三井アセット信託銀行株式会社 (再信託先:日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

<当ファンドの主なリスク>

- ・ Simple-X NY ダウ・ジョーンズ・インデックス上場投信（以下、「当ファンド」）は、主に投資信託証券に投資を行ない、投資対象とする投資信託証券は、主に株式の株価や為替相場の変動等の影響を受けるため、当ファンドの基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・ 当ファンドは、金融機関の預金あるいは保険特約ではないため、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象とはなりません。銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- ・ 信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。取得申込者は、ファンドの投資目的およびリスク要因を十分に認識することが求められます。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

一般に株式の価格は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動は、残存期間・発行条件などによりばらつきがあります。

② 流動性リスク

有価証券等を売却あるいは購入しようとする際に、買い需要がなく売却不可能、あるいは売り供給がなく購入不可能等となる可能性があります。また、市場の取引規制により、不利な価格で取引を行わざるをえない可能性があります。市場動向、市場や行政等による規制、有価証券等の流通量などの状況、あるいは当ファンドの解約金額の規模によっては、組入有価証券等を市場実勢より低い価格で売却しなければならない又は、高い価格で買付しなければならないケースが考えられ、この場合には基準価額の下落要因となります。

③ 信用リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて有価証券等に投資します。一般に、有価証券等に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、これらの価格は下落し（価格がゼロになることもあります。）、基準価額が下落することがあります。

④ 為替変動リスク

当ファンドは、外貨建資産を保有するため、当該通貨と円との為替相場変動の影響を受け、損失が生じることがあります。

⑤ 税制リスク

当ファンドが投資する外国投資信託はケイマン籍であり、ケイマン籍のファンドは、対象指標を構成する米国の株式または対象指標に関連する株価指数先物取引に投資を行ないます。したがって、米国やケイマン諸島における課税については、今後変更となる場合があります。

⑥ カントリー・リスク

投資対象国における非常事態など（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針にしたがった運用ができない場合があります。

⑦ 有価証券の貸付等におけるリスク

有価証券の貸付等において、取引先リスク(取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる危険のこと)が生じる可能性があります。

<対象指標と基準価額のカイ離要因>

当ファンドは、基準価額の変動率を円換算した対象指標の変動率に一致させるよう運用することをめざしますが、当ファンドおよび投資対象とする投資信託証券には、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

- ・ 資金の流入から実際に投資信託証券を買い付けるタイミングのずれの発生。
- ・ 対象指標の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬・売買委託手数料などの費用を負担すること。
- ・ 組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

- ・先物取引を利用した場合、先物取引と対象指標との間に価格差があること。
- ・当ファンドの当初発行価格は、当初自己設定の前々営業日（平成 21 年 12 月 3 日）における対象指標の終値に当初自己設定の前営業日（平成 21 年 12 月 4 日）における対顧客相場の仲値を乗じて得た額を 100 で除した額（小数点以下は切り上げます）となります。一方、当ファンドがケイマン籍米ドル建外国投資信託「シンプレクスNYダウ・ジョーンズ・インデックス・トラッカー・ファンド」の投資を行なうのは、設定日（平成 21 年 12 月 7 日）以降となるため、シンプレクスNYダウ・ジョーンズ・インデックス・トラッカー・ファンドが対象指標に採用されている銘柄の株式等に投資を行なうのは平成 21 年 12 月 8 日以降となります。当初発行価格の決定からシンプレクスNYダウ・ジョーンズ・インデックス・トラッカー・ファンドが対象指標に採用されている銘柄の株式等に投資を行なうまでの間、当ファンドは対象指標の変動と一致した推移とはなりません。

<その他の留意点>

- ① 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により投資信託証券にかかる投資や換金ができない場合があるときは、信託約款の規定にしたがい、委託会社の判断で受益権の設定及び一部解約の受付を中止することがあります。
- ② 分配金は、分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、配当収益等がない又は少額の場合、分配を行わない場合があります。
- ③ 当ファンドの基準価額の計算は、法令および社団法人投資信託協会規則等に従って時価評価を行います。有価証券等及び投資信託証券の評価は、基準価額計算日に知りうる直近の日の価格で行ないます。外貨建資産の評価は、基準価額計算日における対顧客相場の仲値で評価します。
- ④ 適用となる法令・税制・会計制度等は、今後、変更される可能性があります。

当資料は、ニュースリリースとしてシンプレクス・アセット・マネジメント株式会社が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料は、信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について弊社が保証するものではありません。当資料に掲載されている内容等は、当資料作成時点のものです。また、当資料に示された見解は、当資料作成時点における弊社の判断によるものです。当資料中のいかなる内容も、将来の市場環境等の変動を保証するものではありません。当資料中のいかなる内容も、将来の運用成果等を保証するものではありません。投資信託の受益権の基準価額は、投資信託に組入れられている有価証券等の特性による値動きにより影響や又、為替相場の変動等の影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。従いまして、投資信託は元本が保証されるものではありません。また、投資成果を事前に保証するものではありません。投資信託をお申込みの際は、最新の投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ず、運用方針およびリスク要因等、手数料の合計、報酬等の内容をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。投資信託説明書（交付目論見書）につきましては、販売会社にご請求下さい。投資信託は、預金保険機構及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、証券会社以外の登録金融機関で購入された投資信託は、投資者保護基金の支払対象にはなりません。委託会社は、金融商品取引法第 5 条の規定により有価証券届出書を平成 21 年 7 月 15 日に提出しておりますが、その効力は生じておりません。

■本件に関するお問い合わせは下記まで
シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
担当 管理本部 鶴澤

TEL 03-5208-5103

FAX 03-5208-5233

〒100-6515 東京都千代田区丸の内 1-5-1 新丸の内ビルディング 15F