

ニュースリリース

2014年2月6日

2014年2月6日より東武証券、丸八証券で募集開始



T&D保険グループのT&Dアセットマネジメント株式会社(東京都港区、代表取締役社長:藤瀬 宏)は、本年2月28日に「米国株式モニターファンド(愛称:ベクター博士)」を設定します。

〈ファンドの特色〉

1. 成長が期待される米国株式(S&P500)およびS&P500VIX短期先物指数^{※1}を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

- ファンドでは「ベクター戦略」の投資成果を実質的に享受する運用を行います。ファンドにおける「ベクター戦略」とは、S&P 500エクセスリターン指数およびVIX短期先物エクセスリターン指数を投資対象として、一定のルールに基づき、日次でその投資配分を調整する投資戦略です。両指数の投資配分比率は、The S&P 500 Dynamic VEQTOR Index^{※2}と同等となることを目指します。なお、エクセスリターン指数とは、参照する指数のトータルリターンからキャッシュ運用のリターンを控除したリターンを指数化したものです。
- 実際の運用にあたっては、有価証券店頭指数等先渡取引^{※3}を活用し、米国の代表的な株価指数の一つであるS&P500のリターンを指数化したS&P500エクセスリターン指数およびVIX短期先物エクセスリターン指数への実質的な投資効果を享受します。^{※4}
- ファンドの投資元本については円建てとなりますが、有価証券店頭指数等先渡取引の損益部分についてのみ米ドル建てとなるため為替変動リスクが発生します。

※1: VIX(ヴォラティリティ)指数(CBOE Volatility Index)とは、米国の主要株価指数の一つであるS&P500のオプション取引の値動きをもとにCBOE(シカゴオプション取引所)が算出・公表するものであり、数値が高いほど投資家が相場の先行きに不確実性を感じているとされます。

VIX(ヴォラティリティ)短期先物指数とは、先物決済日までの加重平均残存日数が約1ヵ月程度になるようにCBOEに上場されているVIX指数先物の第1限月物や第2限月物で構成される指数です。

※2: The S&P 500 Dynamic VEQTOR IndexはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJ」)およびThe Chicago Board Options Exchangeの商品です。

※3: 有価証券店頭指数等先渡取引とは、有価証券約定数値(有価証券指標として約定する数値)と有価証券現実数値(将来の一定の時期における現実の当該有価証券指標の数値)の差に基づいて算出される金銭の授受を約する取引又はこれに類似する取引をいいます。

※4: 有価証券店頭指数等先渡取引と同様の投資成果を享受する上場有価証券に投資する場合があります。なお、外貨建資産については為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

2. 「ベクター戦略」を活用することで、株式投資における価格変動リスク^{※5}の低減を目指すとともに、市場の下落局面においても新たな収益機会を獲得することを目指します。

※5: 株式投資における価格変動リスクとは、値動きの振れ幅をいいます。

資金動向や市況動向等によっては、上記のような運用が行われない場合があります。

当初申込期間	: 2014年2月6日(木)から2014年2月27日(木)まで
継続申込期間	: 2014年2月28日(金)以降
設定日	: 2014年2月28日(金)
取扱販売会社	: 東武証券株式会社、丸八証券株式会社

お申込みメモ

購入時	購入単位	販売会社が定める単位(当初元本 1口=1円)
	購入価額	当初申込期間:1口当たり1円 継続申込期間:購入申込受付日の翌営業日の基準価額
	購入の申込期間	当初申込期間:平成26年2月6日~平成26年2月27日 継続申込期間:平成26年2月28日以降
換金時	換金単位	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から、信託財産留保額を差し引いた額
	換金代金	原則として換金申込受付日から起算して6営業日目からお支払いします。
信託期間	平成31年2月28日まで(平成26年2月28日設定)	
決算日	1月15日(休業日の場合は翌営業日) 初回決算日は平成27年1月15日です。	
収益分配	年1回、毎決算時に収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。	
申込不可日	下記の申込不可日のいずれかに該当する日には、購入、換金の申込はできません。 <申込不可日> ・ ニューヨークの銀行休業日、ロンドンの銀行休業日、シカゴオプション取引所の休業日	

ファンドの費用

● 投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入価額に、 3.15%*(税抜3.0%) を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。 詳しくは販売会社にお問い合わせください。 ※消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.10%の率を乗じて得た額を、ご換金時にご負担いただきます。

● 投資者が信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用(信託報酬)	毎日、ファンドの純資産総額に 年1.5225%*(税抜1.45%) の率を乗じて得た額とします。 ※消費税率が8%になった場合は、年1.5660%となります。
その他の費用・手数料	<p>【監査費用】</p> <p>毎日、ファンドの純資産総額に年0.0084%*(税抜0.008%)の率を乗じて得た額とし、ファンドでご負担いただきます。また、特定資産(有価証券店頭指数等先渡取引)の価格等の調査に要する費用をファンドでご負担いただき、監査法人に支払います。特定資産の価格等の調査に要する費用は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率・上限額等を示すことができません。 ※消費税率が8%になった場合は、年0.00864%となります。</p> <p>【その他】</p> <p>組入る有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、有価証券店頭指数等先渡取引の管理費用等をファンドでご負担いただきます。これらの費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率・上限額等を示すことができません。</p>

* 上記の費用の合計額については、投資者がファンドを保有される期間等に依り異なりますので、表示することができません。

* 詳細につきましては必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をお読みください。

ファンドの投資リスクについて

ファンドの基準価額は、投資を行っている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者に帰属します。したがって、ファンドは投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。なお、ファンドは預貯金とは異なります。

◎ファンドの基準価額の変動要因となる主なリスクは次の通りです。

価格変動リスク

信用リスク
(カウンターパーティリスク)

為替変動リスク

流動性リスク

※基準価額の変動要因(リスク)は、上記に限定されるものではありません。
 詳細につきましては必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をお読みください。

ご留意いただきたい事項

- 当資料はT&Dアセットマネジメントが投資者の皆様への情報提供を目的として作成したものであり、投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は当社が信頼性が高いと判断した情報等に基づいて作成したのですが、その正確性・完全性を保証するものではありません。また、当資料に記載した情報は、当資料作成時点におけるものであり、将来の投資成果等を保証するものではありません。
- 投資信託はリスクを含む商品であり、株式および公社債等値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、運用実績は市場環境等により変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。これら運用による損益は全て投資者に帰属します。詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)でご確認ください。
- 投資信託は預貯金や保険契約と異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合、投資者保護基金の支払対象とはなりません。

以上



※本件に関するお問い合わせ※

T&Dアセットマネジメント株式会社 投信営業部

電話03-3434-5544 <http://www.tdasset.co.jp/>