

平成 29 年 2 月 9 日

各位

会社名 野村アセットマネジメント株式会社
代表者名 CEO 兼執行役社長 渡邊 国夫
(管理会社コード 13064)
問い合わせ先 商品企画部長 渡部 昭裕
TEL(03)3241-9511

上場 ETF の店頭デリバティブ取引の評価方法等に係る約款変更のお知らせ

謹啓 時下益々ご清祥のこととお喜び申し上げます。

上場 ETF の約款変更について下記の通り決定いたしましたのでご連絡致します。

謹白

<記>

[投資信託約款変更に係る上場 ETF の名称 (括弧内は銘柄コード)]

上海株式指数・上証 5 0 連動型上場投資信託 (1309)
NEXT FUNDS 南アフリカ株式指数・FTSE/JSE Africa Top40 連動型上場投信 (1323)
NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信 (1324)
NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信 (1325)
金価格連動型上場投資信託 (1328)
NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信 (1357)
NEXT FUNDS JPX 日経 400 レバレッジ・インデックス連動型上場投信 (1470)
NEXT FUNDS JPX 日経 400 インバース・インデックス連動型上場投信 (1471)
NEXT FUNDS JPX 日経 400 ダブルインバース・インデックス連動型上場投信 (1472)
NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信 (1480)
NEXT FUNDS NASDAQ-100®連動型上場投信 (1545)
NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株 3 0 種平均株価連動型上場投信 (1546)
NEXT FUNDS タイ株式 SET50 指数連動型上場投信 (1559)
NEXT FUNDS FTSE ブルサ・マレーシア KLCI 連動型上場投信 (1560)
NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信 (1570)
NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス連動型上場投信 (1571)
NEXT FUNDS JPX 日経インデックス 400 連動型上場投信 (1591)
NEXT FUNDS R/N ファンダメンタル・インデックス上場投信 (1598)
NEXT FUNDS インド株式指数・Nifty 50 連動型上場投信 (1678)
NEXT FUNDS 日経・東商取白金指数連動型上場投信 (1682)
NEXT FUNDS NOMURA 原油インデックス連動型上場投信 (1699)

[変更の内容]

- ①上記上場 ETF のうち、スワップ取引または直物為替先渡取引（以下「店頭デリバティブ取引」といいます。）を取引対象としている上場 ETF の投資信託約款について、店頭デリバティブ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更します。
- ②上記上場 ETF のうち、外国為替予約取引を取引対象としている上場 ETF の投資信託約款について、外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加します。

（後述の「新旧対照表」をご参照ください。）

[変更の理由]

- ①店頭デリバティブ取引の評価の方法に関し、制度や環境等の変化に応じた評価方法を可能とするため、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載にするものです。
- ②外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加し、担保授受の指図を明確化するものです。

[約款変更と書面決議の手続き等]

上記につきましては、重大な約款変更には該当しないため、書面による決議または異議申立手続きは行ないません。

[変更の日程]

平成 29 年 3 月 30 日 内閣総理大臣への約款変更の届出日
平成 29 年 3 月 31 日 約款変更日

[当該投資信託約款変更に係る新旧対照表]

1. スワップ取引

下線部_____は変更部分を示します。

| (変更後) | (変更前) |
|---|--|
| (スワップ取引の運用指図) 第●条 <略> ③ スワップ取引の評価は、 <u>当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。</u> <以下略> | (スワップ取引の運用指図) 第●条 <同左> ③ スワップ取引の評価は、 <u>当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。</u> <同左> |

<対象上場 ETF>

NEXT FUNDS 南アフリカ株式指数・FTSE/JSE Africa Top40 連動型上場投信（第 24 条の 2）

NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信（第 24 条の 2）

- NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信（第 24 条の 2）
- NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS JPX 日経 400 レバレッジ・インデックス連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS JPX 日経 400 インバース・インデックス連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS JPX 日経 400 ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS NASDAQ-100®連動型上場投信（第 22 条）
- NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均株価連動型上場投信（第 22 条）
- NEXT FUNDS タイ株式 SET50 指数連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS FTSE ブルサ・マレーシア KLCI 連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス連動型上場投信（第 23 条）
- NEXT FUNDS 日経・東商取白金指数連動型上場投信（第 22 条）
- NEXT FUNDS NOMURA 原油インデックス連動型上場投信（第 22 条）

2. 直物為替先渡取引

下線部_____は変更部分を示します。

| (変更後) | (変更前) |
|---|--|
| <p>(直物為替先渡取引の運用指図)</p> <p>第●条 <略></p> <p>③ 直物為替先渡取引の評価は、<u>当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。</u></p> <p><以下略></p> | <p>(直物為替先渡取引の運用指図)</p> <p>第●条 <同左></p> <p>③ 直物為替先渡取引の評価は、<u>当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。</u></p> <p><同左></p> |

<対象上場 ETF>

- NEXT FUNDS 南アフリカ株式指数・FTSE/JSE Africa Top40 連動型上場投信（第 28 条の 2）
- NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信（第 28 条の 2）
- NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信（第 28 条の 2）
- NEXT FUNDS タイ株式 SET50 指数連動型上場投信（第 28 条）
- NEXT FUNDS FTSE ブルサ・マレーシア KLCI 連動型上場投信（第 28 条）

3. 外国為替予約取引

3-①

下線部_____は変更部分を示します。

| (変更後) | (変更前) |
|--|--|
| <p>(外国為替予約取引の指図)</p> <p>第●条 <略></p> <p>② 委託者は、<u>外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</u></p> | <p>(外国為替予約取引の指図)</p> <p>第●条 <同左></p> <p><新設></p> |

<対象上場 ETF>

- NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（第 26 条）
- NEXT FUNDS JPX 日経 400 レバレッジ・インデックス連動型上場投信（第 26 条）
- NEXT FUNDS JPX 日経 400 インバース・インデックス連動型上場投信（第 26 条）

NEXT FUNDS JPX 日経 400 ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（第 26 条）
 NEXT FUNDS 野村企業価値分配指数連動型上場投信（第 25 条）
 NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（第 26 条）
 NEXT FUNDS 日経平均インバース・インデックス連動型上場投信（第 26 条）
 NEXT FUNDS R/N ファンダメンタル・インデックス上場投信（第 25 条）

3-②

下線部_____は変更部分を示します。

| (変更後) | (変更前) |
|--|--|
| (外国為替予約取引の指図および範囲) 第●条 <略> <u>④ 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</u> | (外国為替予約取引の指図および範囲) 第●条 <同左> <新設> |

<対象上場 ETF>

NEXT FUNDS 南アフリカ株式指数・FTSE/JSE Africa Top40 連動型上場投信（第 27 条）
 NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信（第 27 条）
 NEXT FUNDS ブラジル株式指数・ボベスパ連動型上場投信（第 27 条）
 NEXT FUNDS NASDAQ-100®連動型上場投信（第 25 条）
 NEXT FUNDS ダウ・ジョーンズ工業株 30 種平均株価連動型上場投信（第 25 条）
 NEXT FUNDS タイ株式 SET50 指数連動型上場投信（第 26 条）
 NEXT FUNDS FTSE ブルサ・マレーシア KLCI 連動型上場投信（第 26 条）
 NEXT FUNDS JPX 日経インデックス 400 連動型上場投信（第 25 条）
 NEXT FUNDS NOMURA 原油インデックス連動型上場投信（第 26 条）

3-③

下線部_____は変更部分を示します。

| (変更後) | (変更前) |
|---|---------------------------------|
| (外国為替予約の指図) 第●条 <略> <u>② 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</u> | (外国為替予約の指図) 第●条 <同左> <新設> |

<対象上場 ETF>

上海株式指数・上証 50 連動型上場投資信託（第 31 条）
 金価格連動型上場投資信託（第 31 条）
 NEXT FUNDS インド株式指数・Nifty 50 連動型上場投信（第 23 条）

以上