

2020年10月5日

各位

会社名 野村アセットマネジメント株式会社
(管理会社コード 13064)
代表者名 CEO 兼代表取締役社長 中川 順子
問い合わせ先 サポートダイヤル 山中 淳
TEL 0120-753104

NEXT FUNDS NOMURA 原油インデックス連動型上場投信の

連動対象指標に関するお知らせ

下記の通り、対象 ETF の連動対象指標である「NOMURA 原油ロングインデックス」について、算出会社である野村証券株式会社から、算出ルールの変更が公表されましたので、変更内容およびこれを受けた対象 ETF における対応についてお知らせいたします。

記

[対象 ETF (括弧内は銘柄コード)]

NEXT FUNDS NOMURA 原油インデックス連動型上場投信 (1699)

[連動対象指標における変更]

対象 ETF の連動対象指標である「NOMURA 原油ロングインデックス」の計算の対象とする限月に関して、以下の変更が予定されています。

(変更後)	(変更前)
WTI 原油先物取引の第 1 限月または第 2 限月から先の期先の 3 つの限月 (第 2 限月、第 3 限月および第 4 限月、または第 3 限月、第 4 限月および第 5 限月) の先物	WTI 原油先物取引の第 1 限月または第 2 限月の先物

※先物には満期 (限月) があり、最も満期に近いものから第 1 限月、第 2 限月…とされています。

算出ルールの変更は、2020年11月30日からになります。

詳細につきましては、以下をご参照ください。

・野村証券金融工学研究センターのウェブサイト: [【http://qr.nomura.co.jp/oil/index.html】](http://qr.nomura.co.jp/oil/index.html)

[対象 ETF における対応]

変更後の算出ルールは、対象限月の分散を図るものであり、原油先物に投資し、原油価格の値動きを捉えるという連動対象指標の目的に沿ったものと考えられます。また、資産保全を図りつつ、継続的に対象指標に連動した運用を提供可能とする変更であると判断いたしましたので、引き続き「NOMURA 原油ロングインデックス」を連動対象指標とした運用を継続いたします。

なお、満期が近い限月は短期的な需給などの影響をより強く受ける傾向があります。当該算出ルールの変更により連動対象指標の対象限月が単一の限月から相対的に満期が遠い期先の 3 つの限月へと変更されるため、変更前と比較して短期的な需給の変動などによる連動対象指標の値動きへの影響が小さくなることが想定されます。

また、現時点で対象 ETF は資産保全の観点から期先限月への早めの乗り換えおよび限月を分散した投資の対応を行なっております。結果として、今後は連動対象指標との連動性が高まることが想定されます。

詳細につきましては、以下をご参照ください。

- ・野村アセットマネジメントのウェブサイト：[【https://nextfunds.jp/lineup/1699/】](https://nextfunds.jp/lineup/1699/)

以 上