

# リクソーETF ナスダック 100\*

## (\*シンセティックETF) (2826.HK)

EXCHANGE TRADED FUNDS BY  
**LYXOR**  
SOCIETE GENERALE GROUP

株式 (国・地域)

2011年11月

### ETF (上場投資信託)

#### リクソーETF ナスダック 100

「リクソーETF ナスダック 100」は、世界的に有名な株価指数「ナスダック 100指数」を通じて、ナスダック市場への投資手段を提供します。当該株価指数は、ナスダック上場上位100社、時価総額ベースで2兆6,500億米ドルを表しています。(出所:ブルームバーグ、2011年11月30日現在)

#### 投資目的

「リクソーETF ナスダック 100」は、「ナスダック 100指数」の組入銘柄の配当収入を含む税引き後のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。

#### リクソー・インターナショナル・アセット・マネジメント

2011年11月30日

リクソー・アセット・マネジメント・エス・エイ(リクソーAM)はソシエテ・ジェネラルの子会社であり、同社のコーポレート&インベストメントバンキング部門の一翼を担っております。現在819億ユーロ(\*約8.6兆円)の運用総資産を誇り、オルタナティブ投資、ストラクチャード・ファンド(仕組債ファンド)、ETF等のインデックス・トラッカー・ファンドの3つの分野に特化したビジネスを展開しています。

\*1ユーロ=104.50円(WMロイター)、2011年11月30日現在。

### ETFデータ

インデックス	ナスダック 100
法的形態	フランス籍投資信託
	UCIT I & III適格
設定日	2001年12月13日
上場日(香港市場)	2007年4月26日
通貨	米ドル
取引通貨	香港ドル
最低取引単位	100口
管理報酬	0.30% (年率)
分配金	年次
1口当たり純資産価格	9.2203米ドル
運用資産額	1,294万米ドル
	出所:リクソーAM

### コード

香港市場	2826
ISIN	FR0010446930
ロイター	2826.HK
ブルームバーグ	2826 HK

### パフォーマンス

#### インデックスの推移

出所:ブルームバーグ及びリクソーAM、2011年11月30日

	ETF*	連動先指数*		ETF*	連動先指数*
<b>年率年間パフォーマンス</b>			<b>年率月次パフォーマンス</b>		
2011 YTD	21.27%	21.41%	2011年1月	39.44%	40.08%
2010	19.46%	19.91%	2011年2月	48.51%	49.10%
2009	54.88%	54.90%	2011年3月	-5.92%	-5.43%
2008	-42.72%	-42.29%	2011年4月	41.11%	41.83%
			2011年5月	-13.19%	-12.85%
			2011年6月	-21.64%	-21.20%
			2011年7月	22.38%	22.80%
			2011年8月	-68.09%	-64.25%
			2011年9月	-10.78%	-15.72%
			2011年10月	348.87%	290.86%
			2011年11月	-75.80%	-76.03%
			2011年12月	-	-

\* 連動先指数: 価格リターン+分配金、税引き後。

\* ETFのパフォーマンスは、米ドルベースの1口当たり純資産価格に基づくものであり、分配金を含みます。

\* 最新月のパフォーマンスはまだ反映されていません。ご了承下さい。



\* 上記のグラフに示されたETFのパフォーマンスは、米ドルベースの1口当たり純資産価格に基づくものであり、分配金を含みません。

\* 過去の実績は将来のパフォーマンスを明示するものではありません。

#### マンスリーレポート

ウェブサイト: [www.lyxoretf.com.hk](http://www.lyxoretf.com.hk)

電話: +852 2166 4266

Eメール: [info@lyxoretf.com.hk](mailto:info@lyxoretf.com.hk)

### インデックス・データ

投資対象国・地域	アメリカ
投資対象資産	株式
構成銘柄数	100
通貨	米ドル
ブルームバーグ	NDX
ロイター	.NDX

ナスダック 100指数は、ナスダック市場上場銘柄のうち時価総額上位100社(金融業を除く)で構成されています。指数の構築方法の詳細については [www.nasdaq.com](http://www.nasdaq.com) をご覧ください。

### 資産配分

出所:ブルームバーグ、2011年11月30日

#### 組入れ上位10銘柄

APPLE INC	(テクノロジー)	14.22%
MICROSOFT CORP	(テクノロジー)	8.55%
ORACLE CORP	(テクノロジー)	6.18%
GOOGLE INC-CL A	(テクノロジー)	6.09%
INTEL CORP	(テクノロジー)	5.09%
CISCO SYSTEMS INC	(テクノロジー)	4.00%
QUALCOMM INC	(テクノロジー)	3.67%
AMAZON.COM INC	(小売)	3.51%
AMGEN INC	(ヘルスケア)	2.13%
COMCAST CORP-CLASS A	(メディア)	1.87%

#### 業種別

テクノロジー	62.98%
ヘルスケア	10.50%
小売	10.12%
メディア	5.15%
工業製品・サービス	4.56%
旅行・レジャー	3.25%
通信	1.42%
家庭用品	1.26%
食品・飲料	0.31%
化学	0.31%

# リクソーETF ナスダック 100\*

## (\*シンセティックETF) (2826.HK)

EXCHANGE TRADED FUNDS BY  
**LYXOR**  
SOCIETE GENERALE GROUP

株式（国・地域）

2011年11月

当投資はリスクを含みます。当資料は、情報提供のみを目的としており、リクソーETFナスダック100(「リクソーETF」)の販売申込や買付申込の勧誘を構成するものではありません。連動先のインデックスのパフォーマンスは、リクソーETFの将来の結果を示唆するものではなく、また、過去の実績が将来の結果を保証するものでもありません。投資家の皆様は、投資目的やリスク要因、カウンター・パーティ・リスクや上場廃止時の取決めについて、目論見書にてご確認ください。ソシエテ ジェネラルは、スワップ協定におけるカウンター・パーティの役割を担います。目論見書は [www.lyxoretf.com.hk](http://www.lyxoretf.com.hk)、または [www.hkex.com.hk](http://www.hkex.com.hk)、にてご参照いただけます。投資家の皆様はETFが一般的な契約投資信託とは異なり、販売会社によって一口当りのサイズが異なる場合があることにご留意願います。香港証券取引所におけるリクソーETFの市場価格は一口当りの純資産価格とは異なることがあります。委託手数料の計算はETF単位で行われます。

リクソーETFナスダック100はナスダック証券取引所やその系列子会社等によるスポンサー提供等は一切受けておりません。

リクソーETFナスダック100の投資家の皆様、あるいはより広く一般投資家の皆様に対し、ナスダック100™も、ナスダック100™の子会社も、またはナスダック100™指数の発行または算出に関わるいかなる系列会社も、一般的なファンドまたは特にリクソーETFナスダック100を売買することの利点について、もしくはナスダック100™が世界の株式市場のパフォーマンスを反映する能力について、いかなる明示的あるいは暗黙の宣言または保証も致しません。ナスダック100™はナスダック100™と系列子会社として確固たる名を有し、登録商標され、またナスダック100™指数はマネージャーやリクソーETFナスダック100との協議もなく、ナスダック100™によって全て決定、構成、算出されます。

ナスダックとナスダックの子会社、さらにはナスダックの指数に関わる会社のいずれも、ナスダック100指数について決定、構成または計算をする時、マネージャーあるいはリクソーETFナスダック100の投資家の要件を考慮することはありません。ナスダック指数はリクソーETFの運用開始日、価格、ボリュームさらには純資産価額を証明する決断と計算には何ら関与しません。ナスダックとナスダックの子会社、さらにはナスダックの指数に関わる会社のいずれも、リクソーETFナスダック100の管理・運用・販売において推測できるいかなる責務も負いません。指数の詳細な免責条項は目論見書をご参照下さい。

この文書は、リクソー・アセット・マネジメントにより発行されたものであり、香港証券先物委員会による検閲は受けていません。

**重要事項** 投資にはリスクがあります。投資家は、リクソーETFへの投資によって損失を被る可能性があります。投資家は、以下の点にご留意下さい：

- 各リクソーETFは、フランスの法律に基づきFCP(共同投資ファンド)として組成され、契約型ミューチュアル・ファンド(contractual mutual fund)の形態を取っています。
- 各リクソーETFの投資目的は、関連する連動先指数のパフォーマンスに連動する投資成果を提供することにあります。各リクソーETFのパフォーマンスは、関連する連動先指数のパフォーマンスと高い相関を持つ可能性があります。
- 関連する連動先指数によって代表される一部の市場、特に新興市場は、他の市場より大きなリスクを伴います。
- リクソーETFの価格は変動し、短期間に大きく値下がりする可能性があります。投資家は当該リクソーETFへの投資額の一部分、または全てを失う可能性があります。
- 各リクソーETFは「シンセティック・リプリケーション」と呼ばれる投資手法を採用し、当該リクソーETFの資産の10%を上限として、OTC市場で取引される金融派生商品であるエクイティリンク・スワップ契約を、当該リクソーETFの設定に際して締結します。その結果、各リクソーETFは、カウンター・パーティが契約を守れない可能性があるというカウンター・パーティ・リスクを負います。そうしたリスクはリクソーETFの純資産の10%までに限定されており、また過去にそうした上限を順守しなかった例はありません。
- 投資希望者は、取引の性格を十分に理解し、このような取引を行うことによって起こる可能性のあるリスクを含めた自身の目的と状況を踏まえた上で、取引の妥当性に関して独自の評価を行うことを確実にするための措置を講じるべきです。投資希望者はまた、こうした評価を行うにあたって独立した専門家の助言を求めることも考慮すべきです。
- 投資の意思決定は投資家自身のものですが、専門のアドバイザーが、当該リクソーETFが投資家に適していると助言し、かつ投資家の投資目的と一致する理由を方法も含めて説明しない限りは、投資家はいかなるリクソーETFにも投資すべきではありません。