

各 位

東京都 港区 六本木 一丁目 6 番 1 号  
株 式 会 社 S B I 証 券  
代 表 取 締 役 社 長 高 村 正 人  
問 い 合 せ 先 : 経 営 企 画 部 鈴 木 建  
電 話 番 号 : 03-5562-7210 (代表)

## レバレッジトラッカー取扱い開始のお知らせ ～低コストで日経平均にレバレッジ投資できる新しいトラッカー誕生！～

株式会社SBI証券（本社：東京都港区、代表取締役社長：高村正人、以下「当社」という。）は、2013年7月22日(月)(予定)より、eワラント証券株式会社（本社：東京都港区、代表取締役社長：ショーン・ローソン）が発行する「日経プラス5倍トラッカー」及び「日経マイナス3倍トラッカー」（以下、総称して「レバレッジトラッカー」という。）の取扱いを開始することとなりましたので、お知らせいたします。

### 記

トラッカーは、小額で国内外の株価指数、為替相場及び原油などのコモディティ（商品）相場に投資することができるカバードワラントで、中長期的にこれらの対象原資産と連動する値動きになるように設計されています。このたび当社が新たに取扱いを開始するレバレッジトラッカーは、日経平均にレバレッジ投資ができる新しいタイプのトラッカーです。買取価格（投資家の売却価格）が日経平均の変化幅のプラス5倍にほぼ連動する※1「日経プラス5倍トラッカー」と、マイナス3倍にほぼ連動する※1「日経マイナス3倍トラッカー」の2種類がご利用いただけることとなります。

レバレッジトラッカーの取引時間は類似商品のブルベア投信/ETFよりも長く、9:00から23:50までリアルタイムで取引ができます。また、取引手数料は無料（0円）です。さらに、保有期間中のコストとなる信託報酬もなく、低コストで日経平均に投資することが可能となります。

また、ブルベア投信/ETFは、手軽に株価指数等にレバレッジ投資ができる手段として普及していますが、その値動きは日々の日経平均の「変動率」に対して何倍と計算されるため、例えば相場がいったん下落した後、再び同じ水準に戻ったとしても基準価額が同じように戻るとは限りません。一方、レバレッジトラッカーは、相場が戻れば、買取価格がほぼ元の水準まで戻るように設計されていることが特徴です※2。つまり、レバレッジトラッカーの評価額は、日経平均の「変動幅」のプラス5倍かマイナス3倍にほぼ連動※2するため、購入時からの日経平均の変動幅を確認することで、およその評価額の変動を把握することができます※3。

上記の他にも、レバレッジトラッカーは、レバレッジ投資でありながら証拠金が不要であることや、損失の上限が投資元本に限定されるなどの様々なメリットを有しております。既にレバレッジ型投資商品で資産運用されている方はもちろんのこと、これからレバレッジ型投資商品での運用を始めようと検討されている方の入門商品としても、幅広いお客様にご利用いただけるものと期待しております。

(次ページに続く)

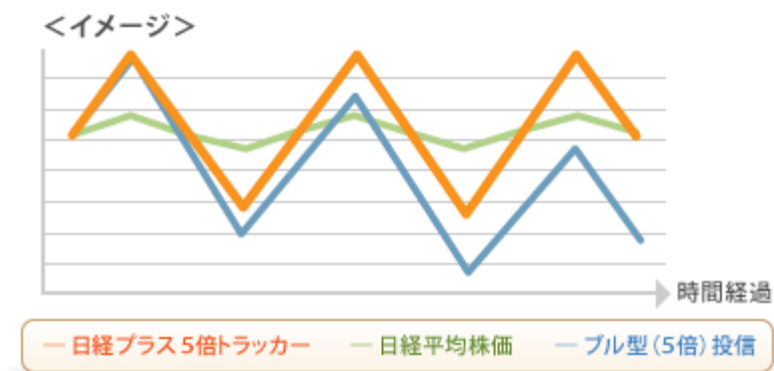
## 【類似商品との一般的な違い】

	レバレッジトラッカー	ブルベア型投信	ブルベア型ETF
取引時間	9:00-23:50	1日1回	国内市場の取引時間
取引価格	リアルタイムで変動	終値ベースで1日1回	リアルタイムで変動
価格変動の特徴	変動幅の〇倍	変動率の〇倍	変動率の〇倍
コスト	信託報酬	なし	あり
	取引委託手数料	無料 (0円)	取扱金融商品取引業者による
	売買スプレッド	あり	なし
その他	相場が上下を繰り返しても日経平均の価格変動幅に対して5倍またはマイナス3倍で連動する	相場が上下を繰り返す場合、中長期的な日経平均の価格変動との連動性が弱まる	相場が上下を繰り返す場合、中長期的な日経平均の価格変動との連動性が弱まる

※上表は一般的な内容を記述したものであり、具体的な金融商品および取引条件等によっては上記と異なる場合があります。

## 【日経プラス5倍トラッカーの値動きのイメージ】

レバレッジトラッカーは相場が戻れば、買取価格がほぼ元の水準まで戻ってきます（自動ロスカットが実行済みである場合や、配当落ち日などを除く）。



この図は日経平均株価の値動きとの関係をわかりやすく説明するために例示およびイメージ化したものであり、実際の値動きとは異なります。また、本資料作成時においてブル型（5倍）投信は国内において公募されていません。

- ※1 2,000 ワラント（単位）あたり。ただし、特に配当落ち日においては日経平均の変化幅に連動しないことがあります。また、自動ロスカット機能が具備されており、買取価格が一度でも1円を下回った場合、1円以下での固定価格による買取のみとなります。
- ※2 ただし、特に配当落ち日においては日経平均の変化幅に連動しないことがあります。※1の自動ロスカット実行後は固定価格による買取のみとなるので買取価格は変動しません。
- ※3 お客様の購入価格と売却価格には価格差（売買スプレッド）がありますので、評価額、評価損益の計算にあたっては売買スプレッドを考慮する必要があります。

「日経」及び日経平均を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて株式会社日本経済新聞社に帰属します。

詳細につきましては、当社WEBサイトにてご確認ください。(https://www.sbisecc.co.jp/)

### <金融商品取引法等に係る表示>

商号等 株式会社SBI証券 金融商品取引業者  
 登録番号 関東財務局長（金商）第44号  
 加入協会 日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会

(次ページに続く)

<手数料等及びリスク情報について>

- ・取引手数料は無料です。
- ・eワラント（カバードワラント）は、対象原資産である株式・株価指数、投資証券(REIT)、預託証券、国債先物、通貨（リンク債）、コモディティ（リンク債）の価格変動、時間経過（一部の銘柄を除き、一般に時間経過と共に価格が下落する）や為替相場（対象原資産が国外のものの場合）など様々な要因が価格に影響を与えるので、投資元本の保証はなく、投資元本の全てを失うおそれがあるリスクの高い有価証券です。また、対象原資産に直接投資するよりも、一般に価格変動の割合が大きくなります（ただし、eワラントの価格が極端に低い場合には、対象原資産の値動きにほとんど反応しない場合があります）。
- ・ニアピンeワラント（カバードワラント）は、対象原資産である株価指数や為替相場の変動や、時間経過（同日内を含む）等、様々な要因が価格に影響を与えるので、元本の保証はなく投資元本のすべてを失うおそれがあるリスクの高い有価証券です。また、対象原資産に直接投資するよりも、一般に価格変動の割合が大きくなります。最大受取可能額は1ワラント当たり100円に設定され、満期参照原資産価格がピン価格から一定価格以上乖離した場合は満期時に価格がゼロになります。同一満期日を持つ全ての種類のニアピンeワラントを購入されても、投資金額の全てを回収することができない可能性があります。
- ・トラッカーeワラント（カバードワラント）は、対象原資産である株価指数、通貨（リンク債）、コモディティ（リンク債）の価格変動や為替相場（対象原資産が国外のものの場合）など様々な要因が価格に影響を与える有価証券です。このため、投資元本の保証がなく、損失が生じる恐れがあります。トラッカーeワラントの価格は、eワラントに比べると一般に対象原資産の価格により近い動きをします（ただし、レバレッジトラッカーは同方向または逆方向に増幅されたような値動きとなります）が、任意の二時点間において対象原資産の価格に連動するものではありません。また、金利水準、満期日までの予想受取配当金及び対象原資産の貸株料等の変動によって、対象原資産に対する投資収益率の前提が変化した場合には、トラッカーeワラントの価格も影響を受けます。詳細は、最新の外国証券情報をご参照ください。
- ・取引時間内であっても取引が停止されることがあります。
- ・お客様の購入価格と売却価格には価格差（売却スプレッド）があります。

\*\*\*\*\*

本プレスリリースに関するお問い合わせ先： 経営企画部 03-5562-7215