

各位

会社名 スパークス・グループ株式会社
代表者の役職名 代表取締役社長 阿部 修平
(JASDAQコード番号：8739)
問い合わせ先 取締役 藤井 幹雄
電話番号 03-5437-9700

「スパークス・日本株・ロング・ショート・プラス」

このたび、当社の子会社であるスパークス・アセット・マネジメント株式会社は、公募投資信託「スパークス・日本株・ロング・ショート・プラス」(以下「当ファンド」)を、下記の通り設定いたします。

大きく下落した日本株式市場の反転局面ではレバレッジをかけることにより積極的にアップサイドを追求し、仮にもう一段の下落があった場合でも、ショート・ポジションでヘッジをかけることにより下落に備えた運用を追求できます。また、ショート・ポジションを大きく持つことにより、下落時でもリターンがあがるような運用を目指します。当ファンドは、日本株式ロング・ショート戦略において世界最大級、かつ最古参の運用会社であるスパークス・アセット・マネジメントが、約6年ぶりに設定する国内公募投信の日本株ロング・ショートファンドです。

記

ファンド名： スパークス・日本株・ロング・ショート・プラス
商品分類： 追加型投信／国内／株式／特殊型（ロング・ショート型、派生商品型）
信託期間： 平成21年6月30日～平成31年6月25日まで
決算日： 毎年6月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社： スパークス・アセット・マネジメント株式会社

【当ファンドの特色】

- 株式市場の変動を軽減しつつ、中長期的なプラスのリターンを目指す日本株式ロング・ショート戦略と、株価指数先物取引等を組み合わせたファンドです。
 - 株式市場の動きに左右されにくい収益の獲得を目指す「スパークス・日本株・ロング・ショート・マザーファンド」(以下、マザーファンド)への投資に加え、株価指数先物取引または株価指数先物オプション取引等(以下、株価指数先物取引等)を活用し、信託財産の中長期的な成長を目指します。
 - マザーファンドはわが国の株式を投資対象とし、ロング・ショート戦略により、株式市場の動きに左右されにくい収益の獲得を目指します。
 - 株価指数先物取引等を活用することにより、市場の上昇、下落局面に関わらず、積極的にリターンを追求します。
 - ロング・ショート戦略とは、将来の成長が見込まれる株式を買建て(ロング)する一方で、過大評価されている株式を主に信用取引により売建て(ショート)するという2つのポジションを組み合わせた手法です。
- ロングとショートのポジションの実質的な合計額は、純資産総額の2倍を上限とします。
 - マザーファンドの組入比率を高位に保ちつつ、株価指数先物取引等を活用するため、株式および株価指数先物取引等(以下、株式等)の実質投資割合が信託財産の純資産総額を超える場合があります。
 - 株式等の実質買建ての額(以下、ロング・ポジション)の合計額と、株式等の実質売建ての額(以下、ショート・ポジション)の絶対金額での実質投資合計額は、それぞれ信託財産の純資産総額の200%の範囲内、かつ、ロング・ポジションとショート・ポジションの絶対金額での実質投資合計額は信託財産の純資産総額の200%の範囲内とします。

【留意事項】

当ファンドのお申し込みの際には、以下のことにご留意くださいますようお願い申し上げます。

当ファンドの手数料等について

※下記手数料の合計額は、お申込金額や保有期間などに応じて異なりますのであらかじめ表示することができません。

申込手数料	3.15% (税抜 3%) を上限として、販売会社が定める率をお申込み受付日の基準価額に乘じた金額
信託財産留保額	解約請求受付日の基準価額に 0.3% の率を乘じた金額
換金 (解約) 手数料	ありません。
信託報酬	純資産総額に対して年率 1.953% (税抜 1.86%)
実績報酬	前営業日の基準価額がハイ・ウォーター・マークを上回った場合、当該基準価額と当該ハイ・ウォーター・マークの差額の 21% (税抜 20%) を費用計上。実績報酬は半期毎に信託財産から支払われ、ハイ・ウォーター・マークも半期毎に見直されます。
その他の費用等	(1) 監査報酬、目論見書や運用報告書等の作成費用等の諸費用〔純資産総額に対し上限年率 0.105% (税込)〕、(2) 有価証券売買時の売買委託手数料、(3) 売建て (ショート) 実行に伴い品貸料等の費用がかかります。 (2)、(3) はファンドの運用による取引量に応じて異なりますので、事前に料率や上限額等を表示することができません。

当ファンドの主なリスクについて

当ファンド (マザーファンドを含む) は、主として株式等値動きのある有価証券に投資し、加えて派生商品取引を積極的に活用しますので、基準価額は大きく変動します。従って、金融機関の預金と異なり、投資元本が保証されているものではなく、組入れた有価証券の価格が変動する場合や、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込む場合もあります。当ファンドは、預金や保険契約と異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資家保護基金の支払いの対象とはなりません。信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

(1) 価格変動リスク (株式等への投資リスク・派生商品取引リスク)

当ファンドは、わが国の株式および株価指数先物取引等 (以下、株式等) を実質的な投資対象としますので、当ファンドへの投資には、株式等への投資にかかる価格変動等の様々なリスクが伴うこととなります。当ファンドに組入れられる株式等の価格は短期的または長期的に下落していく可能性があり、これらの価格変動または流動性に予想外の変動があった場合、重大な損失が生じる場合があります。

また当ファンドは、ロング・ポジションの合計額と、ショート・ポジションの絶対金額での実質投資合計額は、それぞれ信託財産の純資産総額の 2 倍の範囲内、かつ、ロング・ポジションとショート・ポジションの実質投資合計額は信託財産の純資産総額の 2 倍の範囲内としているため、ショート・ポジションの実質投資合計額がロング・ポジションの実質投資合計額を上回る場合があります。またそれぞれのポジションにレバレッジがかかる場合があります。従って、当社が予想した方向と反対方向に市場が動いた場合には損失が発生するリスクがあり、レバレッジがかかっている場合には損失が拡大するリスクがあります。また、株式市場の上昇局面でも損失を被るリスクがあります。

(2) 中小型株式等への投資リスク

当ファンドは、中小型株式へも投資を行います。これらの株式は、一般的に発行済株式時価総額が小さく、売買の少ない流動性の低い株式が少なくありません。その結果、こうした株式への投資はボラティリティ (価格変動率) が比較的高く、また流動性の高い株式に比べ、市況によっては大幅な安値で売却を余儀なくされる可能性があることから、より大きなリスクを伴います。

(3) ロング・ショート戦略固有のリスク

当ファンドは売建て (ショート・ポジション) 取引を行いますので、売建てた株式等が値上がりした場合、基準価額が下落する要因となります。また、ロング・ポジションおよびショート・ポジションの双方が誤っていた場合、双方に損失が発生するために、通常ファンドにおける損失よりも大きくなる可能性があります。

(4) 一部解約による資金流出等に伴うリスク

当ファンドの一部解約による資金流出に伴い、基準価額が影響を受ける場合があります。大量の解約があった場合、解約代金を手当てするため保有有価証券を売却しなければならないことがあります。その際には市場動向や取引量等の状況によって、基準価額が大きく変動することがあります。なお、当ファンドはマザーファンドの受益証券への投資を通じて運用を行いますので、同じマザーファンドに投資するベビーファンドの資金流入の影響を受ける場合があります。

(5) 運用制限に伴うリスク

当ファンドの運用は、規制上または社内方針等により売買を制限されることがあります。委託会社またはその

関連会社（以下、委託会社グループ）が投資を行っている（検討している場合を含む）銘柄も含め、特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限される場合があります。また委託会社グループが行う投資または他の運用業務に関連して、当ファンドにおいて投資にかかる売買を制限されることがあります。従って、これらにより当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

(6) 信用リスク

組入れられる株式や債券等の有価証券やコマーシャル・ペーパー等短期金融商品は、発行体に債務不履行が発生、あるいは懸念される場合には価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらは当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

<当社グループに関するお問い合わせ先>

スパークス・グループ株式会社 経営管理部
電話番号 03-5437-9700

<公募投信信託に関するお問い合わせ先>

スパークス・アセット・マネジメント株式会社 投信事業グループ 投信営業部
電話番号 03-5435-8200

（ただし、スパークス・アセット・マネジメント株式会社は直接販売を行っておりません。販売会社については、スパークス・アセット・マネジメント株式会社にお問合せ下さい。）

ご注意： 本お知らせは、弊社の事業内容をご理解いただくために、弊社のグループ会社がファンドの委託者として投資信託受益証券を発行する予定であることを公表した文書であり、投資勧誘を目的としたものではありません。

また、本お知らせの情報は発表日現在のものであり変更される可能性があります。