

株式市場のアノマリーに投資するファンドの販売開始

～ 月末月初の日経平均株価の上昇傾向を狙って集中投資 ～

ひまわり証券（東京都港区、代表取締役 山地一郎、ひまわりホールディングス株式会社〔ジャスダック 8738〕の100%子会社）は、1月29日より、株式市場のアノマリー（理論では説明できない市場変動の法則）に投資することで、市場平均を上回る運用成績を目指す投資信託『TOM 運用日本株式ファンド』の販売を開始します。

アノマリーとは、毎年同じ時期に起きる株価の変動など、合理的には説明がつかないけれども経験則として知られている法則のことを言います。日本を含む世界の主要な株式市場では、月末月初の期間に株価が上昇する傾向があるというアノマリーが知られており、毎月支払われる給料や累積投資関連の購入による影響など、諸説が唱えられています。

『TOM 運用日本株式ファンド』は、株式市場のこのアノマリーに着目し、上昇傾向が観測される月末近くから翌月初め（Turn Of the Month）にかけてのみ日経平均株価指数に投資することで、わが国の株式市場を上回るリターンの獲得を目指す投資信託です。過去の日経平均株価指数に当てはめて同様の運用手法を実施したと仮定した試算では、2000年1月から2009年7月末までの運用で、日経平均株価指数が年率マイナス6.2%の実績だったのに対し、同運用手法では年率プラス12.8%と、大幅に上回っています。

同ファンドは、パークレイズ・キャピタル・ファンド・ソリューションズ・ジャパン株式会社（東京都千代田区）が2009年9月に設定したもので、同月より運用が開始されています。現在、地方証券会社など11社が販売会社として同ファンドを取り扱っていますが、このたび、ネット証券としては初めてひまわり証券が同ファンドの販売を開始するものです。

ひまわり証券は先物取引やFXなどのアクティブ投資に特化した証券会社として、投資信託においても積極的に利益を狙っていくユニークな商品の品揃えを増やし、投資家に提供してまいります。

【ご参考】

- ひまわり証券について : <http://sec.himawari-group.co.jp/>
- パークレイズ・キャピタル・ファンド・ソリューションズ・ジャパン株式会社について : <https://www.bcfs.barcap.jp/>

【お問い合わせ先】 ひまわり証券株式会社 広報チーム／中川・鈴木

TEL: 03-5400-3695 FAX: 03-5400-3696 E-mail: info-pr@sec.himawari-group.co.jp

東京都港区海岸 1-11-1 ニューピア竹芝ノースタワー 6F

『TOM運用日本株式ファンド』の概要

ファンドの形態	追加型投信
委託会社	パークレイズ・キャピタル・ファンド・ソリューションズ・ジャパン株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）
申込単位	10,000 口以上 10,000 口単位
販売手数料	3.15%以内（消費税込み）
継続申込期間	2009年9月24日～2010年12月20日 継続申込期間は有価証券報告書を提出することにより更新されます。原則として毎営業日にお申込を受付けます。
信託設定日	2009年9月24日
信託期間	信託設定日から2019年9月20日まで

【投資信託に投資する場合の重要事項】

- 手数料、申込単位
 - ・投資信託には、取得時のお申込手数料ならびに保有期間中の信託報酬等がかかります。また、投資信託によっては信託財産留保金が設定されており、換金する際に費用をご負担いただく場合があります。
 - ・手数料、申込単位は、投資信託によって異なります。
- 紙面の都合上、記載できませんので弊社ホームページをご確認ください。
- リスク
 - ・投資信託はリスクを含む金融商品であり、運用実績は組入れ有価証券等の値動き、為替変動、市場環境等による影響を受けます。従って、ご購入時の価額を下回る場合があります。また、預金とは違い、元本が保証されているものではありません。
 - 販売用資料、また付随する記載内容で使用しているグラフ、パフォーマンス等は、参考データとする目的で過去の実績を示したものであり、将来の成果を保証または示唆するものではありません。
 - 投資信託には、預金保険制度の適用はありません。
 - 販売用資料、また付随する記載内容は、金融商品取引法に基づく開示書類（内容）ではありません。お申込みの際には目論見書をお渡ししますので必ず内容をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
 - 契約締結前交付書面・口座約款等をよくお読みいただき、お取引の仕組み・ルールを十分にご理解のうえ、資産に合わせて、お客様ご自身の判断と責任においてお申込みを行っていただきますようお願い申し上げます。

ひまわり証券株式会社

関東財務局長（金商）第150号（金融商品取引業）

加入協会：社団法人金融先物取引業協会・日本証券業協会

※当資料は、プレスリリースとしてひまわり証券が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。また、勧誘を目的に使用することはできません。

【お問い合わせ先】 ひまわり証券株式会社 広報チーム／中川・鈴木

TEL:03-5400-3695 FAX:03-5400-3696 E-mail:info-pr@sec.himawari-group.co.jp

東京都港区海岸 1-11-1 ニューピア竹芝ノースタワー 6F