

大和証券投資信託委託株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 352 号
加入協会 一般社団法人投資信託協会
一般社団法人日本投資顧問業協会

ダイワ J P X 日経 400 ファンド (米ドル投資型)

当社は、平成 26 年 1 月 6 日に「ダイワ J P X 日経 400 ファンド (米ドル投資型)」の設定と運用開始を予定しておりますので、お知らせいたします。概要は下記のとおりです。なお、下記内容は変更される場合があります。

記

1. ファンドの特色

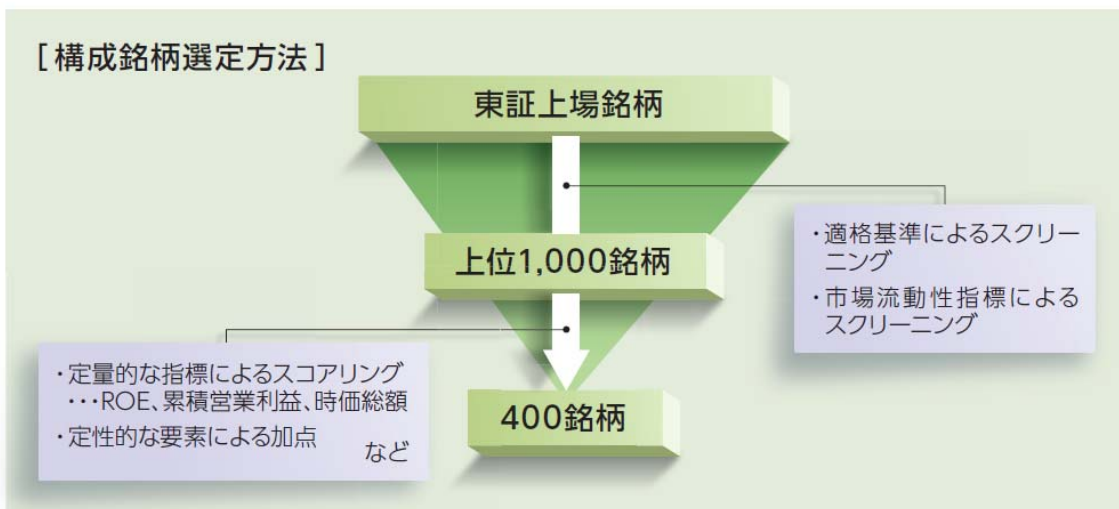
1 JPX日経インデックス400の構成銘柄に投資を行ないます。

※ファンドの資産規模、流動性等によっては、すべての構成銘柄に投資しないことがあります。

JPX日経インデックス400とは

- ◆ 日本取引所グループ(JPX)、東京証券取引所および日本経済新聞社が算出します。(起算日は平成25年8月30日、基準値は10,000です。)
- ◆ 東京証券取引所の市場第一部、市場第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から、時価総額、売買代金、ROE等をもとに、算出者が選定した銘柄を算出対象とします。
- ◆ 構成銘柄数は、原則として400銘柄*です。また、年に1回定期入替を行ないます。
※定期入替後の上場廃止等によって、構成銘柄数が一時的に下回ることがあります。
- ◆ 時価総額加重方式で算出され、1銘柄当たりの構成比率には1.5%の上限が設けられています。

[構成銘柄選定方法]



大和投資信託

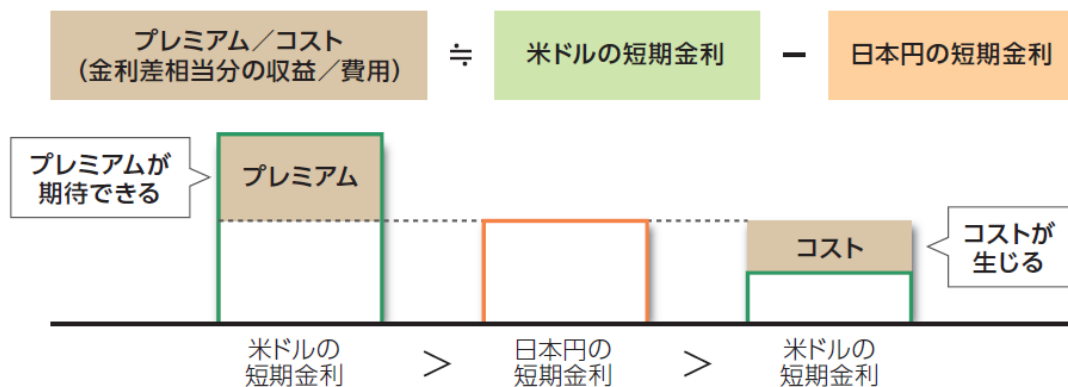
Daiwa Asset Management

2 円売り／米ドル買いの為替取引を行なうことで、米ドルへの投資効果を楽しむことをめざします。

- 米ドルの対円レートの上昇(円安)／下落(円高)により、為替差益／為替差損が生じます。
- 為替取引を行なうことにより、「為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)／コスト(金利差相当分の費用)」が生じます。

為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)／コスト(金利差相当分の費用)について

- ◆米ドルの短期金利が、日本円の短期金利よりも高い場合、「プレミアム(金利差相当分の収益)」が期待できます。
- ◆米ドルの短期金利が、日本円の短期金利よりも低い場合、「コスト(金利差相当分の費用)」が生じます。



※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。

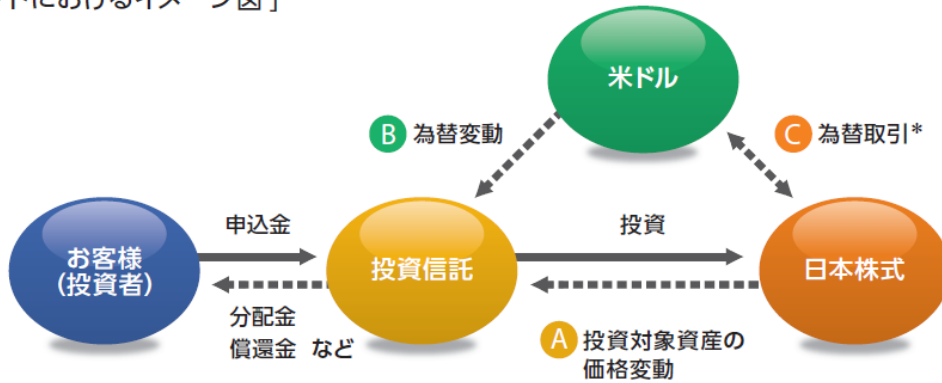
※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。

- 為替取引を行なうにあたっては、外国為替予約取引等を活用します。

通貨選択型ファンドの収益のイメージ

◆通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。

[当ファンドにおけるイメージ図]



*米ドルの対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

◆当ファンドの収益源としては、以下の3つの要素が挙げられます。これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

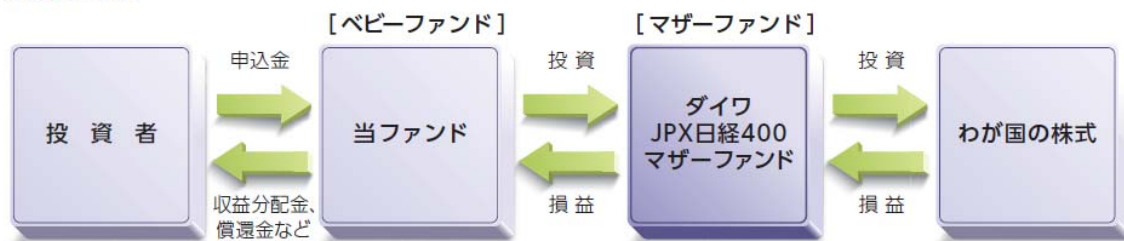
	A	B	C
収益の源泉	日本株式の 値上がり/値下がり、 配当	為替差益/差損	為替取引による プレミアム/コスト (金利差相当分の収益/費用)
収益を得られる ケース	株価の上昇、配当収入	・円に対して米ドル高 為替差益の発生	米ドルの短期金利 > 日本円の短期金利 プレミアム (金利差相当分の収益) の発生
損失やコストが 発生する ケース	株価の下落 ・発行企業の経営不安、 倒産等	為替差損の発生 ・円に対して米ドル安	コスト (金利差相当分の費用) の発生 米ドルの短期金利 < 日本円の短期金利

※上記はイメージであり、実際の投資成果を示唆、保証するものではありません。

ファンドの仕組み

- ◆ 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 運用の効率化をはかるため、わが国の株価指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

3 毎年3月22日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注) 第1計算期間は、平成26年3月22日(休業日の場合翌営業日)までとします。

[分配方針]

- 1 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- 2 原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

- ①「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所（以下総称して「JPXグループ」といいます。）ならびに株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- ②「JPX日経インデックス400」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「JPXグループ」および「日経」に帰属しています。
- ③「ダイワJPX日経400ファンド(米ドル投資型)」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」および「日経」は、その運用および「ダイワJPX日経400ファンド(米ドル投資型)」の取引に関して、一切の責任を負いません。
- ④「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- ⑤「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

2. 投資リスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。
- 投資信託は預貯金とは異なります。

〈主な変動要因〉

株価の変動 (価格変動リスク・ 信用リスク)	株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
為替変動リスク	米ドルの為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。 米ドルの金利が日本円の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなります。
その他	解約資金を手当てするため組入証券を売却する際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

※ 基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

3. ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用	
購入時手数料	販売会社が別に定めるものとします。 購入時の申込手数料の料率の上限は、 2.1%*(税抜 2.0%) です。 *消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、 2.16% となります。
信託財産留保額	ありません。
投資者が信託財産で間接的に負担する費用	
運用管理費用 (信託報酬)	毎日、信託財産の純資産総額に対して 年率 0.68775%*(税抜 0.655%) *消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、 年率 0.7074% となります。 ※運用管理費用は、毎計算期間の最初の6か月終了日(休業日の場合翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
委託会社	年率 0.32%(税抜)
販売会社	年率 0.30%(税抜)
受託会社	年率 0.035%(税抜)
*左記の運用管理費用の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。	
その他の費用・ 手数料	監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を信託財産でご負担いただきます。 ※「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

4. ご参考

ファンド名	ダイワ JPX 日経 400 ファンド (米ドル投資型)
購入単位	最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額(1万口当たり)
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払い下さい。
換金単位	最低単位を1口単位として販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の基準価額基準価額(1万口当たり)
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
申込締切時間	午後3時まで(販売会社所定の事務手続きが完了したもの)
購入の申込期間	平成26年1月6日から平成26年12月22日まで (終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)
設定日	平成26年1月6日
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の換金申込には制限があります。
購入・換金申込受付の 中止および取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、購入、換金の申込みの受け付けを中止することがあります。
信託期間	平成26年1月6日から平成36年12月22日まで 受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長できます。

繰上償還	次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させること(繰上償還)ができます。 <ul style="list-style-type: none">・ 受益権の口数が30億口を下ることとなった場合・ JPX日経インデックス400が改廃された場合・ 信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき・ やむを得ない事情が発生したとき
決算日	毎年3月22日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、平成26年3月22日(休業日の場合翌営業日)までとします。
収益分配	年1回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 (注)当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。なお、お取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。
信託金の限度額	1兆円
公告	電子公告の方法により行ない、ホームページ[http://www.daiwa-am.co.jp/]に掲載します。
運用報告書	毎計算期末に作成し、あらかじめお申出いただいたご住所にお届けします。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です(平成26年1月1日以降)。 なお、当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合がありますので、くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。
受託銀行	りそな銀行

5. その他

くわしくは、「有価証券届出書」をご覧ください。また、「投資信託説明書(交付目論見書)」公表後は当該交付目論見書も併せてご覧ください。