

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 JPX 日経 400 ファンド キープ 11

当社は、平成 26 年 3 月 19 日に「ダイワ JPX 日経 400 ファンド キープ 11」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

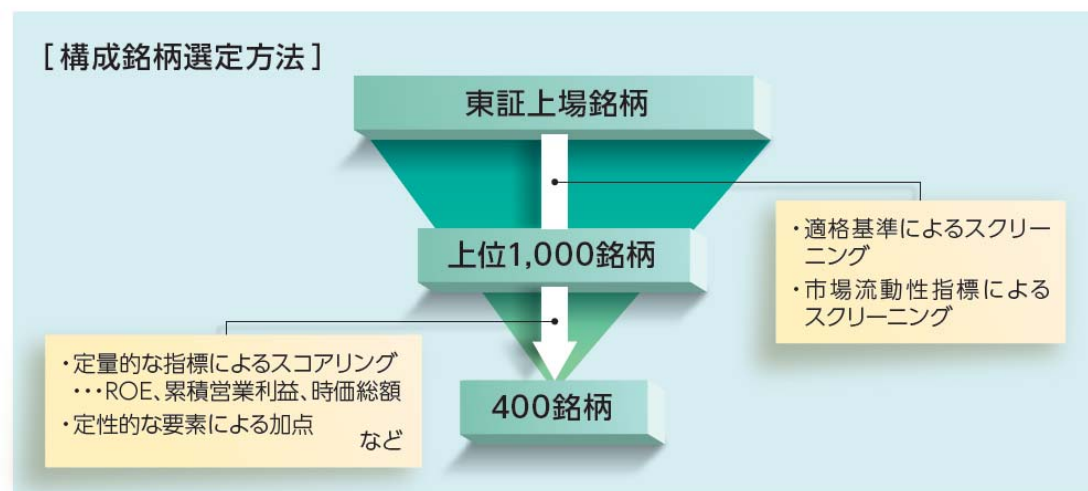
1

JPX日経インデックス400の構成銘柄に投資を行いません。

※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

- ① 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。)
- ② 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。
- ③ 構成銘柄数は、原則として400銘柄*です。また、年に1回定期入替を行いません。
※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。
- ④ 時価総額加重方式で算出され、定期入替時において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。



- 運用の効率化をはかるため、ダイワJPX日経400マザーファンドの受益証券、JPX日経インデックス400に連動するETFおよび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、株式、ダイワJPX日経400マザーファンドの受益証券およびETF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。

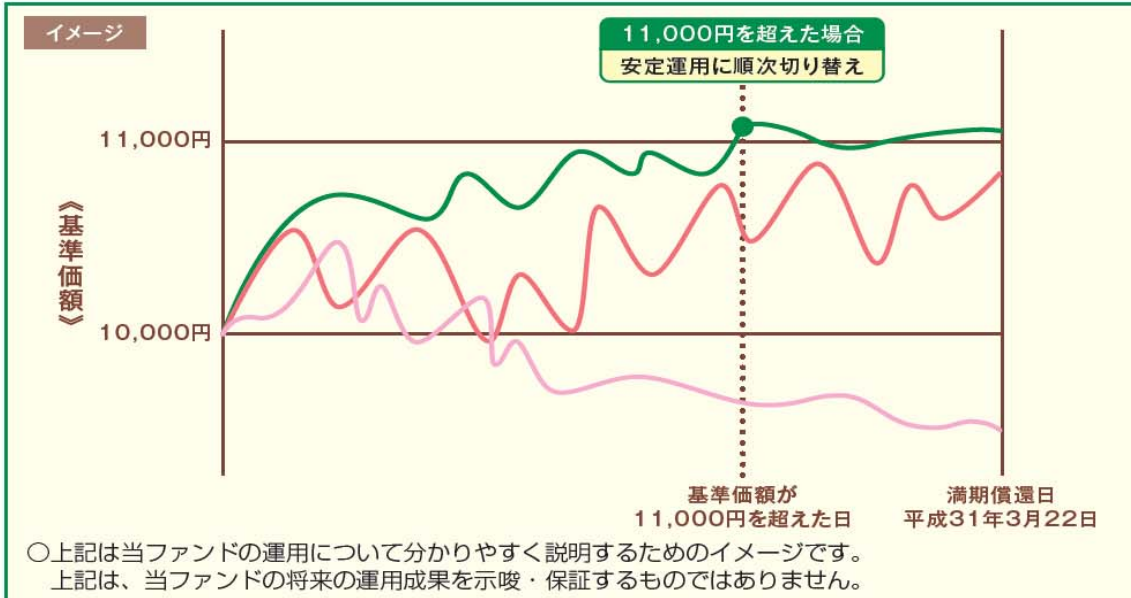
大和投資信託

Daiwa Asset Management

2

基準価額が一度でも11,000円を超えた場合、安定運用に順次切り替えを行いません。

- 基準価額は1万口当たりとし、既払分配金を加算しません。



※基準価額が11,000円を超えてから償還までの市況動向等により、基準価額が11,000円以下となることがあります。

※基準価額が11,000円を超えた日の翌日から運用管理費用（信託報酬）を切り替えます。運用管理費用（信託報酬）について、くわしくは、「ファンドの費用」をご参照下さい。

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いません。

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。



〈基準価額が、一度でも11,000円を超えた場合〉



○基準価額が11,000円を超えてからわが国の債券等による運用に切り替えられるまで日数がかかることがあります。

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時、JPX日経インデックス400が改廃されたとき、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。



毎年3月22日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、
収益配分方針に基づき収益の配分を行ないます。

（注）第1計算期間は、平成27年3月22日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〈配分方針〉

- ①配分対象額は、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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して配分金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、配分を行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 キープ11」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 キープ11」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。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、JPX日経インデックス400の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- ・ 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- ・ 信託報酬、売買委託手数料等の費用負担
- ・ 株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- ・ 指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- ・ 株価指数先物*またはETFと指数の動きの不一致（先物またはETFを利用した場合）
- ・ 株式および株価指数先物取引*の最低取引単位の影響
- ・ 株式、株価指数先物*およびETFの流動性低下時における売買対応の影響
- ・ 指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響

*届出日（平成26年3月3日）現在、JPX日経インデックス400の先物取引は導入されておりません。同指数以外の指数先物取引を利用することがあります。

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。
公社債の価格変動 (価格変動リスク・ 信用リスク)	〈安定運用に切り替え後〉 公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、公社債の価格は下落します。組入公社債の価格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。
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、 1.05%* (税抜 1.0%) です。 *消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、 1.08% 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)	
基準価額が、一度でも11,000円を超えた場合	基準価額が一度でも11,000円を超えた場合、最初に基準価額が11,000円を超えた日の翌日から以下の料率に切り替えます。 運用管理費用の率は、各月ごとに決定するものとし、各月の1日から各月の翌月の1日の前日までの当該率は、各月の前月の最終5営業日における無担保コール翌日物レートの平均値に0.525* (税抜 0.5) を乗じて得た率とします。ただし、当該率が年率0.68775%* (税抜 0.655%) を超える場合には、年率0.68775%* (税抜 0.655%) とします。 *消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、それぞれ0.54、年率0.7074%、年率0.7074%となります。	
上記による総額に対する比率で表示しています。		
委託会社	販売会社	受託会社
24.44%	66.67%	8.89%
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 キープ 11
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 (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2時30分まで (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3月19日から平成27年6月16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 3 月 19 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 3 月 19 日から平成 31 年 3 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。 ・受益権の口数が 30 億口を下ることとなった場合 ・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 27 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いません。
信託金の限度額	2,000 億円
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。
販売会社	大和証券
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。

以上