

平成 30 年 8 月 16 日

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

iFreeNEXT NASDAQ100インデックス

当社は、平成 30 年 8 月 31 日に「iFreeNEXT NASDAQ100 インデックス」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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

記

∞ 大和投資信託からのメッセージ ∞

iFreeNEXTは、特色のあるセクターや特定分野に焦点を絞った指数を対象として、従来よりお客さまに幅広い選択肢を提供している新しいコンセプトのファンドシリーズです。

さらにこのたび私どもは、NASDAQ100指数に連動する投資成果をめざすインデックスファンドを加えることといたしました。

NASDAQ100指数は、米国ナスダック市場に上場している時価総額の大きい非金融業100社の株式で構成される株価指数です。

構成銘柄を見てみると、IT、バイオテクノロジー、医療などの最先端技術やサービスを提供し、現代の米国を牽引する多様な企業で構成されております。

このような分野のインデックスファンドに投資をしたいとお考えのお客さまの資産運用、資産形成の一助となれば幸いです。

1. ファンドの目的

米国の株式に投資し、NASDAQ100指数(円ベース)の動きに連動した投資成果をめざします。

● NASDAQ100指数について

NASDAQ100指数は、米国のナスダック市場に上場している時価総額の大きい非金融業100社の株式で構成される株価指数です。(対象銘柄には、米国以外の企業の株式を含みます。)指数の計算方法は、調整済時価総額加重平均方式です。定期的な採用銘柄の入替えは毎年12月に行なわれますが、それ以外に、臨時に入替えが行なわれることがあります。

NASDAQ100指数は、1985年1月31日以降継続して算出され、現在の指数値は算出開始時の値を125として計算されています。なお、NASDAQ100指数は、ナスダック市場の全銘柄で構成されるNASDAQ総合指数(NASDAQ Composite Index)とは異なる指数です。

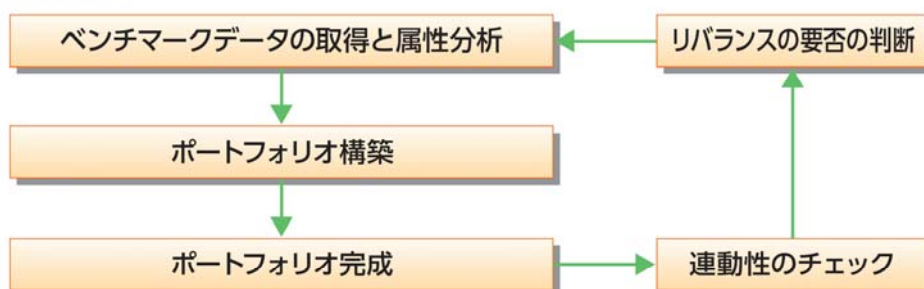
2. ファンドの特色

1

NASDAQ100指数を構成する銘柄に投資します。

運用の効率化を図るため、株価指数先物取引、ETF(上場投資信託証券)を利用することがあります。

運用プロセス



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

(注)「株式」…DR(預託証券)を含みます。

※DR: Depositary Receiptの略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。また、通常は、預託された株式の通貨とは異なる通貨で取引されます。

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。



- マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドにおいて、株式等の組入総額と株価指数先物取引等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。
- 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。

- 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」の運用が行なわれないことがあります。

2 当ファンドは、インターネットでのお申込みを想定したファンドです。

分配方針

毎年8月30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、2019年8月30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、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分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

当ファンドは、Nasdaq, Inc. またはその関連会社(以下、Nasdaq, Inc. およびその関連会社「株式会社」と総称します。)によって、支援、推奨、販売または販売促進されるものではありません。株式会社は、ファンドの合法性もしくは適合性について、または当ファンドに関する記述および開示の正確性もしくは妥当性について認定するものではありません。株式会社は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性や、NASDAQ-100 Indexの一般的な株式市況への追従可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行ないません。株式会社と大和証券投資信託委託株式会社(「ライセンサー」)との関係は、Nasdaq®およびNASDAQ-100 Indexの登録商標ならびに株式会社の一定の商号について使用を許諾すること、ならびに、大和証券投資信託委託株式会社または当ファンドとは無関係に、ナスダックが決定、構築および算出を行なうNASDAQ-100 Indexの使用を許諾することに限られます。ナスダックは、NASDAQ-100 Indexの決定、構築および計算に関し、大和証券投資信託委託株式会社または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。株式会社は、当ファンドの発行に関してその時期、価格もしくはその数量の決定について、または当ファンドを換金する際の算式の決定もしくは計算についての責任を負っておらず、また関与をしていません。株式会社は、NASDAQ-100 Indexとそれに含まれるデータの正確性および中断されない算出を保証しません。株式会社は、NASDAQ-100 Indexまたはそれに含まれるデータの利用により、大和証券投資信託委託株式会社、当ファンドの保有者またはその他いかなる者もしくは組織に生じた結果についても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行ないません。株式会社は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行わず、かつNASDAQ-100 Index®またはそれに含まれるデータの利用に関する、特定の目的または利用のための市場商品性または適合性については、いかなる保証についても明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、株式会社は、いかなる逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的損害や損失について、たとえもし当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。

● 基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、NASDAQ100指数(円ベース)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せん。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
- 運用管理費用(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
- 指数の算出に使用する為替レートと基準価額の算出に使用する為替レートの不一致
- 株価指数先物およびETFと指数の動きの不一致(先物およびETFを利用した場合)
- 株式および株価指数先物取引およびETFの最低取引単位の影響
- 株式および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

3. 投資リスク

基準価額の変動要因

- 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	外貨建資産については、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。組入外貨建資産について、当該外貨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。
 カ ン ト リ ー ・ リ ス ク	投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。
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。

4. ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
購入時手数料	販売会社が別に定める率 ※徴収している販売会社はありません。	—
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		
	料率等	費用の内容
運用管理費用 (信託報酬)	年率0.486% (税抜0.45%)	運用管理費用の総額は、日々の信託財産の純資産総額に対して左記の率を乗じて得た額とします。運用管理費用は、毎日計上され、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から支払われます。
配分 (税抜) (注1)	委託会社	年率0.215%
	販売会社	年率0.215%
	受託会社	年率0.02%
その他の費用・手数料	(注2)	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けます。


(注1)「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。


(注2)「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。また、上場投資信託証券は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

5. ご参考

◆ 販売会社：SBI証券

	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	換金申込受付日の翌営業日の基準価額(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 受 付 中 止 日	ナスダック(米国)またはニューヨーク証券取引所のいずれかの休業日 (注)申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問い合わせ下さい。
	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	2018年8月31日から2019年11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。)
	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み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発生した場合には、購入、換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けた購入の申込みを取消すことがあります。

	信 託 期 間	無期限(2018年8月31日当初設定)
	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 • NASDAQ100指数(円ベース)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8月30日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、2019年8月30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、販売会社にお問い合わせ下さい。
	信 託 金 の 限 度 額	3,000億円
	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、交付運用報告書を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。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、販売会社にお問い合わせ下さい。 *2018年6月末現在のものであり、税法が改正された場合等には変更される場合があります。

◆ 受託会社：りそな銀行

6. 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