

平成 30 年 10 月 26 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 日本小型株インデックス

当社は、平成 30 年 10 月 19 日に「iFreeNEXT 日本小型株インデックス」を設定しましたので、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、お客さまに幅広い選択肢を提供しているファンドシリーズです。

このたび私どもは、日本の小型株市場に連動する投資成果をめざすインデックスファンドを新たに加えることといたしました。

小型株市場の企業は、規模は小さいものの高い成長性を持つと私どもは考えており、当ファンドはそうした企業から構成される指数への連動をめざすことで、その成長性を享受することを目的としております。

このような趣旨にご賛同いただける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

**わが国の株式に投資し、日本の小型株市場の動きを捉える指数との連動をめざして運用を行ないます。**

## 2. ファンドの特色

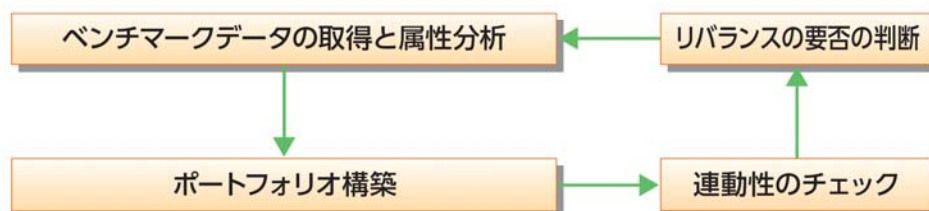
### 1 わが国の株式に投資し、投資成果を対象指数(ベンチマーク)の動きに連動させることをめざします。

- ◆連動をめざす対象指数(ベンチマーク)の選定および変更は、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し、委託会社の判断で決定するものとします。対象指数(ベンチマーク)については変更になる場合があります。
- ◆対象指数(ベンチマーク)は、TOPIX Small(トピックススモール)です。

#### ●TOPIX Smallについて

TOPIXの構成銘柄を一定の基準で規模ごとに細分化した浮動株時価総額加重型株価指数の一つです。TOPIX Smallは、東京証券取引所の市場第一部に上場する内国普通株式全銘柄の中から、TOPIX500構成銘柄を除いた全銘柄から構成される指数のことをいい、1998年4月1日を1000ポイントとして算出しています。

#### 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、ベンチマークへの連動をめざしたポートフォリオを構築します。また、運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を利用することがあります。ただし株価指数先物が存在しない等の理由から他の指数に連動する先物取引を利用する場合があります。そのためベンチマークと基準価額の動きに乖離が発生する可能性があります。

## ファンドの仕組み

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時、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。

## 分配方針

毎年10月18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10月18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。

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。



- ① TOPIX Smallの指数値及びTOPIX Smallの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIX Smallに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIX Smallの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有する。
- ② ㈱東京証券取引所は、TOPIX Smallの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIX Smallの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIX Smallの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③ ㈱東京証券取引所は、TOPIX Smallの指数値及びTOPIX Smallの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIX Smallの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ ㈱東京証券取引所は、TOPIX Smallの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、㈱東京証券取引所は、TOPIX Smallの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 本件インデックスファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥ ㈱東京証券取引所は、本件インデックスファンドの購入者又は公衆に対し、本件インデックスファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦ ㈱東京証券取引所は、当社又は本件インデックスファンドの購入者のニーズを、TOPIX Smallの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではない。
- ⑧ 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は本件インデックスファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

## ● 基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果をあげることがをめぐっ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
- ・ 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
- ・ 株価指数先物と指数の動きの不一致(先物を利用した場合)
- ・ 株式および株価指数先物取引の最低取引単位の影響
- ・ 株式および株価指数先物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。 小型株式については、株式市場全体の動きと比較して株価が大きく変動するリスクがあり、当ファンドの基準価額に影響する可能性があります。
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)	<b>年率0.432%</b> <b>(税抜0.40%)</b>	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0.19%	ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価です。
	販売会社	年率0.19%	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価です。
	受託会社	年率0.02%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価です。
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きます。	

(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。





5. ご参考

◆ 販売会社：楽天証券

	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4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	2018年10月19日から2020年1月10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、換金の申込みの受付を中止すること、すでに受付けた購入、換金の申込みを取消すことがあります。

	信託期間	無期限(2018年10月19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"> <li>受益権の口数が30億口を下ることとなった場合</li> <li>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</li> <li>やむを得ない事情が発生したとき</li> </ul>
	決算日	毎年10月18日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、2019年10月18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	500億円
	公 告	電子公告の方法により行ない、ホームページ[ <a href="http://www.daiwa-am.co.jp/">http://www.daiwa-am.co.jp/</a> ]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。配当控除の適用があります。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、販売会社にお問合わせ下さい。 ※2018年8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：三井住友信託銀行



## 6. その他

くわしくは、「有価証券届出書」、「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

以上