

2021 年 6 月 24 日

大 和 アセットマネジメント株 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 ムーンショットインデックス

追加型投信／海外／株式／インデックス型

当社は、2021 年 7 月 9 日に S&P Kensho Moonshots 指数（円ベース）の動きに連動した投資成果を目指す、「iFreeNEXT ムーンショットインデックス」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 2021 年 6 月 24 日時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。

■ S&P Kensho Moonshots 指数とは？

S&P Kensho Moonshots指数^{※1}は、時価総額、流動性の制約のもとEarly Stage Compositeイノベーション・スコア^{※2}が高い50銘柄の米国上場株式のパフォーマンスを表す指数です。2014年7月1日を基準日とし、その日の指数値を100として算出され、2020年10月より公表されています。

ユニバース：米国上場株式

スクリーニング

～時価総額、流動性、研究開発費等に基づくスクリーニング～

時価総額

1億ドル以上
(米国上場銘柄のうち
上位10%を除く)

流動性

3ヵ月の日次平均取引金額
100万ドル以上

研究開発費・売上高

企業の開示書類上で
研究開発費・売上高が
プラスであること

50銘柄選定

Early Stage Composite
イノベーション・スコア^{※2}に基づく

銘柄の入れ替え：年1回(6月)
構成比率：等金額^{※3}

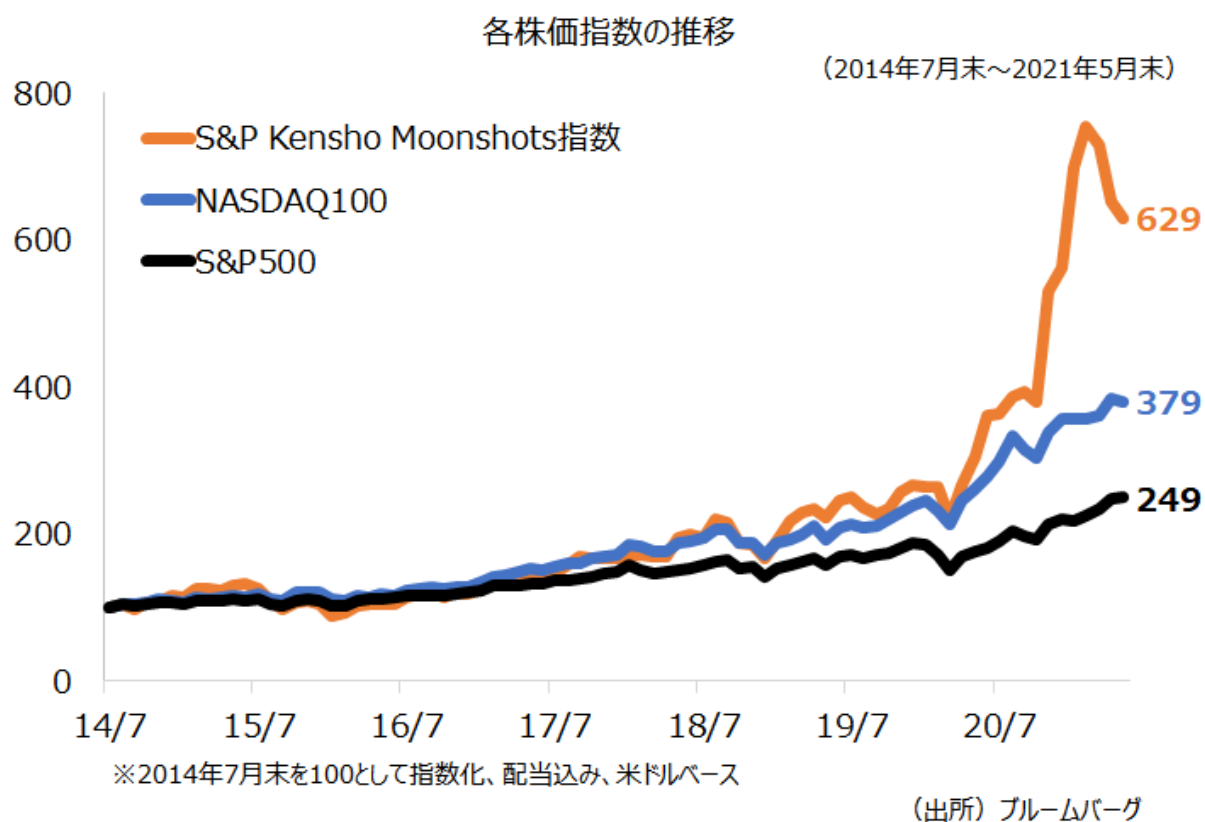
※ 上図は大和アセットマネジメントが、公開されているS&P Kensho Moonshots指数のインデックスメソドロジーに基づき作成したイメージ図です。実際の銘柄選定プロセスを厳密に表現したものではありませんので、ご注意ください。また、届出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※1 Kenshoとはデータ分析・機械学習・自然言語処理など、AIの技術を強みとする米国のテクノロジー企業です。2013年に創業され、AIやフィンテックの分野で多数の受賞歴があります。主要事業である市場分析サービスは多くの金融機関に導入されています。現在はS&P Global Inc.の100%子会社です。

※2 Early Stage Compositeイノベーション・スコアは、企業の研究開発費、開示書類におけるイノベーション関連ワードの集計結果等に基づき算出されたスコアです。

※3 指数計算における各構成銘柄の構成比率は、等金額を基本に流動性等に基づく比率調整が行われ決定されます。半年に1回、リバランスが行われます。

■ 過去のパフォーマンス



上記はあくまで過去の指数の推移でありファンドの実績ではございません。

また、必ずしも将来の成果を示唆・保証するものではありません。

■ 指数構成銘柄の一覧 (2021年6月18日時点)

ティッカー	銘柄	ウェイト
ASAN	Asana, Inc. Class A	2.83%
BTCM	BIT Mining Limited	2.39%
PRQR	ProQR Therapeutics BV	2.37%
CHPT	ChargePoint Holdings, Inc.	2.36%
MDB	MongoDB, Inc.	2.34%
LC	LendingClub Corp	2.31%
VRNS	Varonis Systems Inc	2.30%
ASXC	Asensus Surgical, Inc.	2.21%
SOHU	Sohu.com Inc ADR	2.17%
BIGC	BigCommerce Holdings, Inc.	2.16%
CRSP	CRISPR Therapeutics AG	2.15%
SLAB	Silicon Laboratories Inc	2.12%
SLGG	Super League Gaming, Inc.	2.11%
SPCE	Virgin Galactic Holdings Inc	2.11%
EOSE	Eos Energy Enterprises, Inc	2.08%
ARCT	Arcturus Therapeutics Holdings Inc.	2.07%
RDWR	Radware Ltd	2.07%
EBON	Ebang International Holdings, Inc.-A	2.07%
AMBA	Ambarella Inc	2.05%
MRCY	Mercury Systems Inc	2.04%
WORK	Slack Technologies, Inc.-A	2.03%
DBX	Dropbox, Inc.	2.02%
AVAV	Aerovironment Inc	2.01%
ERII	Energy Recovery Inc.	2.00%
AGYS	Agilysys Inc	1.99%
IRBT	iRobot Corp	1.98%
FFIV	F5 Networks Inc	1.97%
NNDM	Nano Dimension Ltd. ADR	1.96%
NTCT	Netscout Systems Inc	1.95%
SOLO	Electrameccanica Vehicles Corp.	1.94%
XNET	Xunlei Ltd.	1.93%
LAZR	Luminar Technologies, Inc	1.93%
XPER	Xperi Holding Corporation	1.92%
JNPR	Juniper Networks Inc	1.91%
YELP	Yelp Inc	1.90%
NKLA	Nikola Corporation	1.90%
MASS	908 Devices Inc	1.90%
OCFT	OneConnect Financial Technology Co. Ltd.	1.89%
VLDR	Velodyne Lidar Inc	1.89%
BLDP	Ballard Power Systems Inc	1.88%
DM	Desktop Metal, Inc. Class A	1.88%
ORTX	Orchard Therapeutics PLC	1.86%
RMO	Romeo Power, Inc Class A	1.79%
MVIS	Microvision Inc	1.79%
WKHS	Workhorse Group Inc.	1.77%
IBRX	ImmunityBio, Inc	1.76%
ADAP	Adaptimmune Therapeutics plc ADR	1.72%
INO	Inovio Pharmaceuticals Inc	1.71%
VUZI	Vuzix Corp	1.67%
AXDX	Accelerate Diagnostics Inc.	0.83%

上記の企業はあくまでも参考のために掲載したものであり、個別企業の推奨を目的とするものではありません。（出所：S&P Dow Jones Indices）

1. ファンドの目的

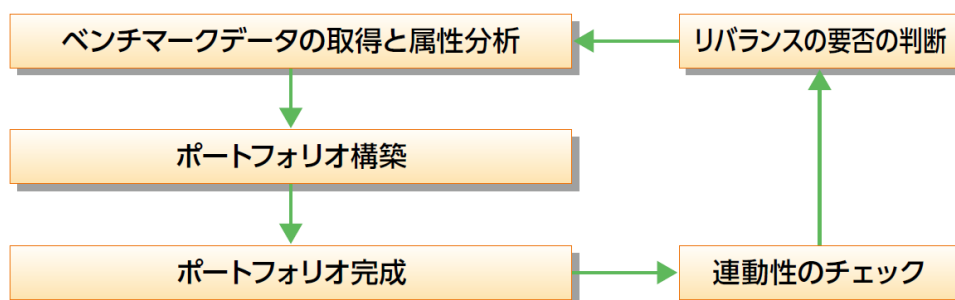
米国の株式に投資し、投資成果をS&P Kensho Moonshots指数(円ベース)の動きに連動させることをめざします。

2. ファンドの特色

米国の株式に投資し、投資成果をS&P Kensho Moonshots指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

効率性の観点から、米国株式の指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券)に投資する場合があります。

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。

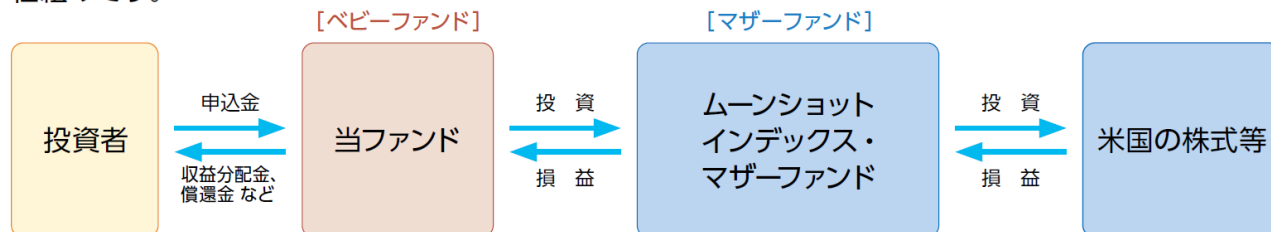
(注)「株式」…DR(預託証券)を含みます。

※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。

3. 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」の運用が行なわれないことがあります。

4. ファンドの費用・税金

〈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0.77% (税抜0.7%)	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0.36%
	販売会社	年率0.32%
	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。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。

〈税金〉

- ・税金は表に記載の時期に適用されます。
- ・以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時 期	項 目	税 金
分 配 時	所得税および地方税	配当所得として課税 ^(注) 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 ^(注) 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

(注)所得税、復興特別所得税および地方税が課されます。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

満20歳以上の方を対象とした少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2021年4月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5. 分配方針

毎年7月8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、2022年7月8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、分配を行わないことがあります。

6. 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	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。

7. 基準価額に関する留意点

当ファンドは、S&P Kensho Moonshots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
- ・ 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、株価指数先物取引およびETF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

8. 主な投資制限

- マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

S&P Kensho Moonshots指数はS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、Standard & Poor's Financial Services LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。インデックスに直接投資することはできません。iFreeNEXT ムーンショットインデックス (以下、当ファンドと言います) は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社 (総称して「S&P Dow Jones Indices」) によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P Kensho Moonshots指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。インデックスの過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S&P Kensho Moonshots指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと大和アセットマネジメント株式会社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P Kensho Moonshots指数は大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P Kensho Moonshots指数の決定、構成または計算において大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは当ファンドの価格および数量、または当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P Kensho Moonshots指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P DOW JONES INDICESは、S&P Kensho Moonshots指数またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信 (電子通信も含む) を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS&P Kensho Moonshots指数を使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、大和アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESと大和アセットマネジメント株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

9. お申し込みメモ

◆受託会社：りそな銀行

 購入時	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。

 換金時	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。

 申込について	申 込 受 付 中 止 日	ニューヨーク証券取引所の休業日 (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	2021年7月9日から2022年9月30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、換金の申込みの受付けを中止すること、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。

 その他	信 託 期 間	無期限(2021年7月9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(繰上償還)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7月8日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、2022年7月8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	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[https://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に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。 ※2021年4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。

当資料のお取り扱いにおけるご注意

- 当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメント株式会社が作成したものです。
- 当ファンドのお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容を必ずご確認ください。
- 投資信託は値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではありません。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。
- 投資信託は預金や保険契約とは異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は投資者保護基金の対象ではありません。
- 当資料は信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。記載する指数・統計資料等の知的所有権、その他一切の権利はその発行者および許諾者に帰属します。また、税金、手数料等を考慮しておりませんので、投資者の皆さまの実質的な投資成果を示すものではありません。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なく変更されることがあります。記載する投資判断は現時点のものであり、将来の市況環境の変動等を保証するものではありません。
- 当資料中で個別企業名が記載されている場合、あくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。
- 分配金は収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

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