

FANG+2倍ベア

FANG+インデックス銘柄入れ替えについて

2021年12月27日

■ 今回の入れ替え銘柄

12月の定期リバランスにおいて以下の銘柄入れ替えが行われたことをご連絡いたします。

新規採用銘柄	除外銘柄
マイクロソフト	ツイッター

■ FANG+インデックスとは

「FANG」とは「Facebook」（フェイスブック）（現 Meta Platforms：メタ プラットフォームズ）、「Amazon」（アマゾン・ドット・コム）、「Netflix」（ネットフリックス）、「Google」（グーグル）（現 Alphabet：アルファベット）といった世界のテクノロジーの進歩をリードする企業の頭文字をつないだものです。FANG+インデックスは、ICEデータ・インディシーズLLC※¹が算出しており、上記4銘柄に加え次世代テクノロジーをベースに、グローバルな現代社会において人々の生活に大きな影響力を持ち、高い知名度を有する米国上場企業を対象に構成された株価指数です。

■ FANG+インデックスの特徴

FANG+インデックスは、NYSE、NASDAQ、NYSE Americanなどの主要な米国証券取引所に上場している銘柄の中でConsumer Discretionary or Technology（一般消費財・サービスまたはテクノロジー）にセクター分類される株式（ADR※²を含みます）を投資ユニバースとしています。このユニバースの中から時価総額や流動性を勘案し、高度成長技術とインターネット/メディアの特性を示す銘柄がガバナンス委員会により構成銘柄として選定されます。各銘柄は「等ウエート」にて投資され、現在指数は10銘柄で構成されていますので、1銘柄あたりちょうど10%ずつ投資する、ということになります。しかしながら、10%ずつで投資を始めてもそれぞれの銘柄の日々の値動きは異なりますので、時間の経過とともにそれぞれの比率は変化していきます。10%より大きくなる銘柄もあれば、小さくなる銘柄も出てきますが、その比率を日々調整することはありません。比率の調整は毎年3月、6月、9月、12月の第3金曜日に行われます。また、ガバナンス委員会による構成銘柄の見直しも併せて行われます。この際に、前述の構成銘柄の決定方法にのっとり結果「FANG」銘柄が除外されてしまう可能性もあります。銘柄数につきましても、現在の採用銘柄数は10銘柄となっていますが、11銘柄以上になる可能性もあります。

※1 インターコンチネンタル取引所（ICE）グループの指数関連業務を運営する組織です。ICEやニューヨーク証券取引所（NYSE）の指数などを提供します。

※2 米国預託証券の略です。米国以外に籍を置いている企業が米国で発行する預託証券のことで、米国の証券取引所で取引することができます。

Ⅰ ファンドの目的・特色

ファンドの目的

各ファンドの目的は、次のとおりです。

FANG+ブルベアファンド

FANG+2倍ブル

日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度となることをめざします。

FANG+2倍ベア

日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度逆となることをめざします。

FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ

安定した収益の確保をめざします。

● NYSE FANG+について

NYSE FANG+指数は、次世代テクノロジーをベースに、グローバルな現代社会において人々の生活に大きな影響力を持ち、高い知名度を有する米国上場企業を対象に構成された株価指数です。

NYSE FANG+指数は、これらの企業に等金額投資したポートフォリオで構成されています。なお、「FANG」とは、主要銘柄であるフェイスブック(Facebook)、アマゾン・ドット・コム(Amazon.com)、ネットフリックス(Netflix)、グーグル(Google)の頭文字をつないだものです。

※当指数は、四半期(3・6・9・12月)ごとに等金額となるようリバランスを行いません。

ファンドの特色

1. 「FANG+2倍ブル」「FANG+2倍ベア」「FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ」それぞれの投資態度は次の通りです。

FANG+2倍ブル

- 日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度となることをめざして運用を行ないます。

※基準価額は、原則として計算日に知り得る直近の日の清算値段または最終相場が反映されます。

※米国の営業日においてNYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度となるための調整を行なうこととします。そのため、日本の休業日前後の基準価額の値動きが、NYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍から乖離する場合があります。

FANG+2倍ベア

- 日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行ないます。

※基準価額は、原則として計算日に知り得る直近の日の清算値段または最終相場が反映されます。

※米国の営業日においてNYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度逆となるための調整を行なうこととします。そのため、日本の休業日前後の基準価額の値動きが、NYSE FANG+指数(米ドルベース)の値動きの2倍逆から乖離する場合があります。

「FANG+2倍ブル」「FANG+2倍ベア」共通

- 以下の投資対象から流動性等を考慮してその配分比率を決定します。
 - パフォーマンス連動債券
 - ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
 - 米国の株価指数先物取引
- ※上記投資対象以外に、上記投資対象と同様の投資成果が期待できる資産を組み入れることがあります。

- 外貨建資産の運用にあたっては、ダイワ・アセット・マネジメント(アメリカ)リミテッドに運用の指図にかかる権限の一部を委託することがあります。

- 為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないません。

※ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ

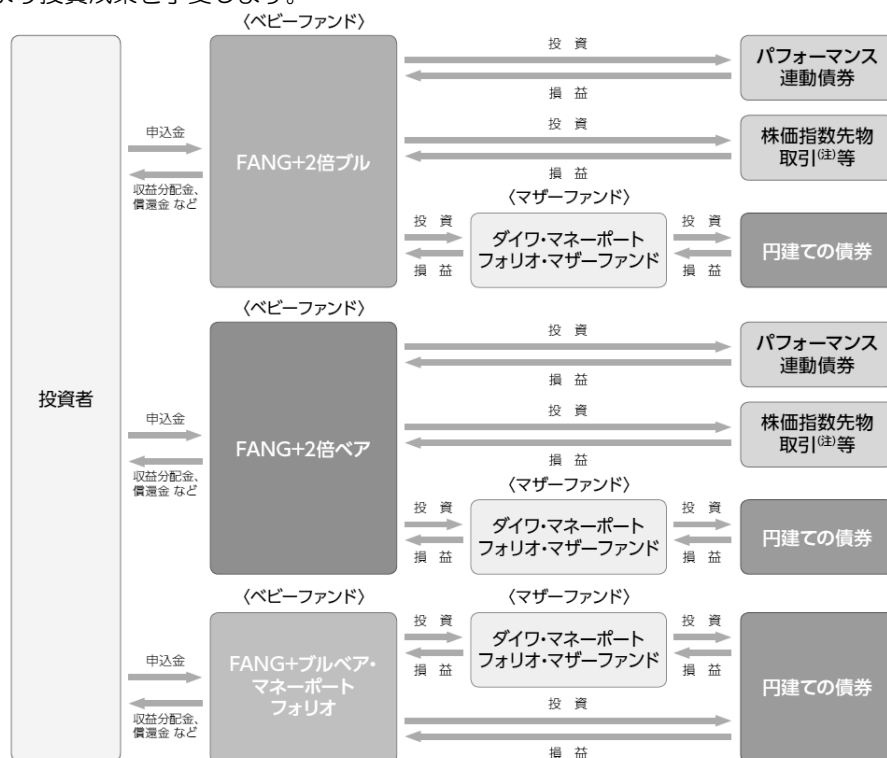
- スイッチング資金を一時滞留させる受皿としての役割をもったファンドで、円建ての債券を中心に安定運用を行ないます。
- 円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。

- 投資者のみなさまのご判断により、各ファンド間のスイッチング（乗換え）ができます。
※ 「FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ」の購入は、スイッチング（乗換え）による場合のみとなります。



※販売会社によっては3つのファンドのうち、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。また、販売会社によっては、スイッチング（乗換え）のお取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問合わせください。

2. 当ファンドは、ファミリーファンド方式での運用の他、パフォーマンス連動債券および先物取引等を通じた運用により投資成果を享受します。



(注) 「FANG+2倍ブル」は株価指数先物取引の買建て、
「FANG+2倍ベア」は株価指数先物取引の売建てを行ないます。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「ファンドの目的・特色」をご覧ください。

NYSE® FANG+™は、ICE Data Indices, LLCまたはその関連会社(以下「ICEデータ」)の登録商標であり、NYSE® FANG+™指数およびNYSE® FANG+™指数(円ベース)(以下「指数」)を利用するライセンスがFANG+ブルベアファンド(以下「ファンド」)において、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。大和アセットマネジメント株式会社およびファンドは、ICEデータによってスポンサー、販売、または販売促進されているものではなく、ICEデータは、証券投資全般、特にファンドへの投資の妥当性について、または指数が一般的な株式市場のパフォーマンスを追従することについて、いかなる表明保証を行うものではありません。

ICEデータおよびその第三者供給元は、明示または黙示の保証を行わず、インデックス、インデックスの値またはそれに含まれるすべてのデータに関して、商品性または特定の目的への適合性のすべての保証を明示的に否認します。ICEデータは、たとえそのような損害の可能性について、特別、懲罰的損害、直接的、間接的、または結果的損害(利益の損失を含む)に対する責任は通知されていたとしても一切負いません。

"NYSE® FANG+™" is a service/trade mark of ICE Data Indices, LLC or its affiliates ("ICE Data") and has been licensed along with the NYSE® FANG+™ Index and NYSE® FANG+™ Index (JPY) ("Indexes") for use by DAIWA ASSET MANAGEMENT in connection with FANG+ BULL BEAR FUND (the "Fund"). Neither DAIWA ASSET MANAGEMENT nor the Fund, as applicable, are sponsored, endorsed, sold or promoted by ICE Data. ICE Data makes no representations or warranties regarding the advisability of investing in securities generally, in the Fund particularly or the ability of the Indexes to track general stock market performance.

ICE DATA AND ITS RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS MAKE NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND HEREBY EXPRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE WITH RESPECT TO THE INDEXES, INDEX VALUES OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. IN NO EVENT SHALL ICE DATA HAVE ANY LIABILITY FOR ANY SPECIAL, PUNITIVE, DIRECT, INDIRECT, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES (INCLUDING LOST PROFITS), EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.

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。基準価額の変動要因は、以下のとおりです。

「価格変動リスク・信用リスク(株価の変動、公社債の価格変動)」、「株価指数先物取引の利用に伴うリスク」、「パフォーマンス連動債券への投資に伴うリスク」、「連動対象の指数に関するリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「その他(解約申込みに伴うリスク等、パフォーマンス連動債券の流動性に関するリスク)」

※「FANG+2倍ブル」および「FANG+2倍ベア」では為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

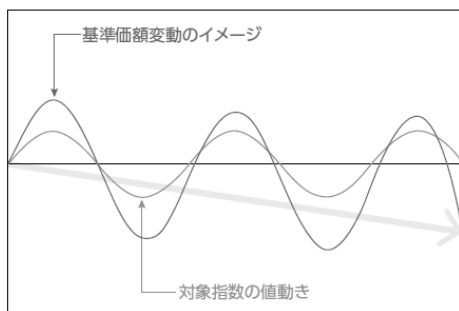
※レバレッジ運用を行なう先物取引やパフォーマンス連動債券への投資においては、一般に借入金利に相当する負担があります。そのため、長期に保有する場合、金利負担が累積されます。

※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。

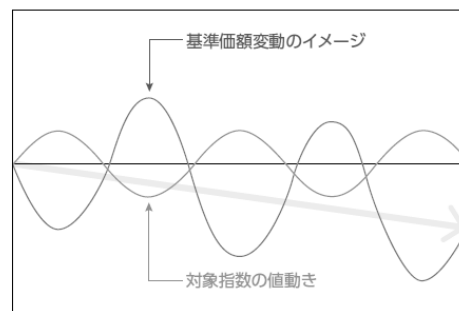
※くわしくは「投資信託説明書(交付目論見書)」の「投資リスク」をご覧ください。

- ◆「FANG+2倍ブル」または「FANG+2倍ベア」を2日以上保有した場合、ファンド保有期間を通しての投資成果が、「2倍程度」または「2倍程度逆」となるわけではありません。
- ◆一般に、対象指数が上昇・下落をしながら動いた場合には、保有期間が長くなる程、基準価額がより大きく押下げられる傾向があります。

— 「FANG+2倍ブル」の基準価額変動のイメージ —



— 「FANG+2倍ベア」の基準価額変動のイメージ —



※上記は、あくまでイメージであり、実際の基準価額の動きとは一致しません。

Ⅰ 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 〈上限〉2.2% (税抜 2.0%) スイッチング (乗換え) による 購入時の申込手数料については、 販売会社にお問合わせください。	購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。
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		
	料率等	費用の内容
運用管理費用 (信託報酬)	〈FANG+ブルベア・マネーポート フォリオ以外の各ファンド〉 年率 1.166% (税抜 1.06%) 〈FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ〉 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0.55 (税抜 0.5) を乗じて得た率とします。ただし、当該率が 年率 0.99% (税抜 0.90%) を超える場合には、年率 0.99% (税抜 0.90%) とし、当該率が年率 0.00011% (税抜 0.0001%) を下る場合には、年率 0.00011% (税抜 0.0001%) とします。	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。
投資対象とする パフォーマンス 連動債券	〈FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ以外の各ファンド〉 年率 0.29%程度 パフォーマンス連動債券にかかる費用等です。	
実質的に負担する 運用管理費用の 概算値	〈FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ以外の各ファンド〉 年率 1.456% (税込) 以下 (パフォーマンス連動債券にかかる費用等を含めたものです。実際の組入状況等により変動します。)	
その他の費用・ 手数料	(注)	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・スワップ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) 当ファンドおよびパフォーマンス連動債券における「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。

※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問合わせください。

※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。

※くわしくは「投資信託説明書 (交付目論見書)」の「手続・手数料等」をご覧ください。

設定・運用：

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

商号等

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

当資料のお取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のうえ、ご自身でご判断ください。
- 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。

FANG+2倍ペア 取扱い販売会社

販売会社名 (業態別、50音順) (金融商品取引業者名)		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会
PayPay銀行株式会社	登録金融機関	関東財務局長(登金)第624号	○	○		
auカブコム証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第61号	○	○	○	
株式会社SBI証券	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第44号	○	○		○
立花証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第110号	○	○		
ニュース証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第138号	○		○	
松井証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第164号	○	○		
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	○
三田証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第175号	○			
むさし証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第105号	○			○
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○

上記の販売会社については今後変更となる場合があります。また、新規のご購入の取り扱いを行っていない場合がありますので、各販売会社にご確認ください。