

FANG+インデックス・オープン FANG+指数のご紹介

※当資料は、FANG+指数のインデックスメソドロジーを基に大和投資信託が作成したものです。

2018年3月29日

お伝えしたいポイント

- ・ 注目を集める米国の「FANG」銘柄とは
- ・ FANG+指数の特徴、採用銘柄の選定方法・ウェイト付など

本レターでは、FANG+指数の内容を分かり易く説明させていただきます。

【FANGとは？】

「FANG」とは、フェイスブック（Facebook）、アマゾン・ドット・コム（Amazon）、ネットフリックス（Netflix）、グーグル（Google、現在の社名はアルファベット）の頭文字をつないだ造語で、インターネットに関連する米国の巨大な次世代テクノロジー企業群を意味しています。

当ファンドが連動を目指す「FANG+指数」は、「FANG」銘柄（上記の4社）にその他の高度成長技術を持つ米国上場企業を加えたものとなっています。

また、「FANG」銘柄にアップル（Apple）を加えた「FAANG」や、エヌビディア（Nvidia）を加えた「FANNG」などの造語もあるようです。

【採用銘柄はどのように選定されますか？】

米国の主要な証券取引所（NYSE、NASDAQ、NYSE American）に上場されている一般消費財・サービスまたはテクノロジーに分類される全ての株式（ADR*¹を含みます）の中から、時価総額や取引残高など一定の条件にて絞り込んだ上で選定されます。

「FANG」銘柄に加えて、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、ICEデータ・インディシーズLLC*²のガバナンス委員会により選定されます。

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投資信託により作成されたものです。■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、投資者のみなさまの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いますが、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。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。■当資料の中で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。■当資料の中で個別企業名が記載されている場合、それらは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。

販売会社等についてのお問い合わせ⇒ 大和投資信託 フリーダイヤル0120-106212（営業日の9:00～17:00）HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>

*¹ADRとは

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出来ます。

今回のFANG+指数採用銘柄の中では、中国企業である「アリババ」と「バイドゥ」がADRにあたります。

*²ICEデータ・インディシズLLCとは

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。

【採用銘柄が変更になることはありますか？】

3・6・9・12月の第3金曜日に行なわれる構成銘柄の変更タイミングにて、変更になる可能性があります。

ガバナンス委員会が、インデックスの品質・性格を維持するために必要と判断すれば追加や除外が行なわれます。

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。

また、上場廃止や合併等により、採用銘柄は変更となる場合があります。銘柄数が10銘柄を下回ってしまうようなケースでは、ガバナンス委員会が選定した新規銘柄が補充されることとなります。

【ガバナンス委員会による選定のポイントは？】

次世代テクノロジーを持ったインターネット/メディア関連企業から選定することとなりますが、その中でも特に「伝統的な技術・サービス企業」と「より革新的な技術を活用している企業」を区別することに注力しているようです。

【各銘柄のウエートはどうなっていますか？】

FANG+に採用されている各銘柄は、「等ウエート」にて投資されます。

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。

なお、ずっとそのままにしておくわけではなく、四半期の構成銘柄変更タイミングでまた等ウエートに比率は調整されます。

等ウエート投資に関しては、より詳しいご説明を次回以降のファンドレターで予定しております。

ここで述べられているインデックス・データは、ICE Data Indices, LLC、その関係会社（「ICE Data」）及び／又はその第三者サプライヤーの財産であり、大和投資信託による使用のためにライセンスされています。ICE Data及びその第三者サプライヤーは、その使用に関して一切の責任を負いません。免責条項の全文については、交付目論見書をご参照ください。

FANG+インデックス・オープン

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

米国上場企業の株式に投資し、NYSE FANG+指数（円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。

（注）「株式」…DR（預託証券）を含みます。

●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ないます。

ファンドの特色

1. 原則として、NYSE FANG+指数を構成する全銘柄に投資します。
2. 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。
3. 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。
 - ・マザーファンドは、「FANG+インデックス・マザーファンド」です。

※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+インデックスマザーファンド（以下「ファンド」）において、大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。大和証券投資信託委託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+ Index Mother 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."

FANG+インデックス・オープン

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

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。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。
- 「株価の変動（価格変動リスク、信用リスク）」、「集中投資のリスク」、「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）」
- ※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。
- ※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。

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〉2.16%(税抜 2.0%)	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）	年率 0.783% （税抜 0.725%）	運用管理費用の総額は、毎日、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。
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）「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下さい。
 - ※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：

大和投資信託

Daiwa Asset Management

商号等

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

FANG+インデックス・オープン 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
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	○			

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。