

FANG+インデックス・オープン

指数算出方法変更のお知らせ

2022年12月12日

平素は当ファンドをご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

2022年12月19日より、当ファンドが連動を目指す「NYSE FANG+指数」の指数算出方法が変更となります。つきましては主な変更点とこれまでと変わらない点をお知らせいたします。

指数算出方法の主な変更点

| | 旧 | 新 |
|---------------|--|--|
| 投資対象 ユニバース | <ul style="list-style-type: none"> ■ 主要米国証券取引所に上場している株式（ADR※1等を含む） ■ ICEのセクター分類における「一般消費財・サービス」、「テクノロジー」の2セクター | <ul style="list-style-type: none"> ■ 米国で法人登録された企業で、米国をリスク所在国とする、主要米国証券取引所に上場している普通株式 ■ ICEのセクター分類における「一般消費財・サービス」、「テクノロジー」、「メディア・コミュニケーション」の3セクター |
| スクリーニング 条件 | <ul style="list-style-type: none"> ■ 時価総額50億ドル以上 ■ 上場後6カ月経過 ■ 6カ月間平均売買高が5000万ドル以上 | <ul style="list-style-type: none"> ■ 時価総額50億ドル以上 ■ 上場後60日経過 ■ 6カ月間平均売買高が5000万ドル以上、または取引履歴が6カ月未満の場合はデータ取得可能期間における1日平均売買高が5000万ドル以上 |
| 銘柄選定方法 | <ul style="list-style-type: none"> ■ 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 ■ 銘柄数：最低10銘柄 | <ul style="list-style-type: none"> ■ 原則として「FAANMG※3」6銘柄を組み入れる ■ 銘柄数：10銘柄 ■ 「FAANMG」以外の4銘柄は、 <ul style="list-style-type: none"> ・ 時価総額(35%) ・ 1日平均売買高(35%) ・ 直近12カ月株価売上高倍率(15%) ・ 直近12カ月売上高成長率(15%) の4指標を括弧内の比率で加重平均してランキング化し、その上位4銘柄を指数構成銘柄とする ■ 「FAANMG」以外の4銘柄は次の入れ替えタイミングで上位10位以内のランクであれば入れ替え対象とならない |

※1 米国預託証券の略。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。

※2 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。

※3 Meta Platforms、Apple、Amazon、Netflix、Microsoft、Googleの6銘柄を指します。

FANG+指数は何が変わるのか？

今回の指数算出方法変更の中で大きな変更点は3点であると考えています。

Ⅰ 米国で法人登録された企業・米国をリスク所在国とする企業を組み入れる

投資対象として米国で法人登録された企業でかつ米国をリスク所在国とする企業を投資対象ユニバースとすることで、**ADR等は除外**されることになりました。これにより米国外に籍を置く銘柄の組み入れが不可となりましたので、**地政学リスクの低下につながると考えられます**。

Ⅰ 原則として「FAANMG」6銘柄を指数構成銘柄とする

「FAANMG」とは「Meta Platforms」（メタ プラットフォームズ）（旧フェイスブック）、「Amazon」（アマゾン・ドット・コム）、「Apple」（アップル）、「Netflix」（ネットフリックス）、「Microsoft」（マイクロソフト）、「Google」（グーグル）（現：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とったものです。これらの銘柄は「FANG」のテーマを代表する銘柄であり、株式分類、上場取引所、セクター分類、時価総額、流動性、法人登録国、リスク所在国の変更が起きない限りは指数から除外されることはありません。

Ⅰ ルールベースで選定した4銘柄を組み入れる

今回の指数算出方法変更によって、株価指標や企業の売上高を基にランキング化し、その上位4銘柄を指数構成銘柄とするルールベースの銘柄選定となりました。どのように銘柄選定がされているかが明示されたという点で、**指数の透明性が高まった**と言えます。

これまでと変わらない点

Ⅰ 各銘柄等ウェイト投資

これまでもFANG+指数の各銘柄は「等ウェイト」で投資されていましたが、この点は変更がありません。つまり指数構成銘柄数は10銘柄なので、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。

Ⅰ 指数の比率調整・銘柄入れ替えタイミングは毎年3月、6月、9月、12月の第3金曜日

各銘柄10%のウェイトで投資しても、銘柄ごとに値動きは異なるため、日々組入比率は10%から乖離が生じます。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。その際に構成銘柄の見直しも併せて行われます。

■ 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 (Meta Platforms)）、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 (Alphabet)）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。

日本語は参考として大和アセットマネジメント株式会社が作成したものであり、英語版と日本語版に矛盾・齟齬等がある場合は、英語版が優先されます。

出所：ICE Data Indices, LLC (以下「ICEデータ」)

「ICE」は、ICE データまたはその関連会社の登録商標です。「NYSE®」および「NYSE FANG+®」は、ICEデータの関連会社である NYSE Group, Inc. の登録商標であり、ICEデータが許諾を得て使用しています。「BoFA®」は、Bank of America Corporationの登録商標であり、Bank of America Corporationおよびその関連会社（以下「BoFA」）がライセンスを所有しています。BoFA の書面による事前の承認なしに使用することはできません。これらの登録商標について、FANG+インデックスマザーファンド（以下「ファンド」）において大和アセットマネジメント株式会社が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いずれも、ICEデータ、その関連会社またはその第三者供給元によって、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。ICEデータおよびその供給元は、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随することについて、いかなる表明保証を行うものではありません。ICEデータと大和アセットマネジメント株式会社の関係性は、特定の商標、商号と、指数またはその構成要素のライセンス供与です。指数は、大和アセットマネジメント株式会社、ファンド、受益者に関係なく、ICEデータによって決定、構成、計算されます。ICEデータは、指数の決定、構成、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受益者のニーズを考慮する義務を負いません。ICEデータは、ファンドの発行時期、価格、数量の決定、またはファンドの価格設定、販売、購入または償還に使用される計算式の決定に関与しておらず、その責任を負いません。特定のカスタム指数計算サービスを除き、ICEデータが提供するすべての情報は一般的な性質のものであり、大和アセットマネジメント株式会社またはその他の個人、団体、または個人のグループのニーズに合わせて調整されたものではありません。ICEデータは、ファンドの管理、マーケティング、または取引に関連する義務または責任を負いません。ICEデータは投資顧問会社ではありません。指数に特定の証券を含めることは、ICEデータがそのような証券の購入、売却、保有を推奨するものではなく、投資アドバイスとみなされるものでもありません。ICEデータおよびその供給元は、指数、指数値およびそれに含まれる、関連するまたはそこから得られる情報（「インデックスデータ」）を含む、特定の目的または用途に対する商品性または適合性の保証を含め、明示的及びまたは黙示的になすすべての保証及び表明を否認します。ICEデータおよびその供給元は、指数および指数値の妥当性、正確性、適時性または完全性に関して、いかなる損害または責任も負わないものとし、これらは「現状のまま」提供され、使用者は自己の責任で使用するものとします。

Source ICE Data Indices, LLC ("ICE Data"), is used with permission. "ICE" is a service/trademark of ICE Data or its affiliates. "NYSE®" and "NYSE FANG+®" are registered trademarks of NYSE Group, Inc., an affiliate of ICE Data and are used by ICE Data with permission and under a license. "BoFA®" is a registered trademark of Bank of America Corporation licensed by Bank of America Corporation and its affiliates ("BoFA") and may not be used without BoFA's prior written approval. These trademarks have been licensed, along with the NYSE® FANG+™ Index and NYSE® FANG+™ Index (JPY) ("Index") for use by DAIWA ASSET MANAGEMENT in connection with FANG+ Index Mother Fund (the "Product"). Neither the DAIWA ASSET MANAGEMENT, FANG+ Index Mother Fund (the "Trust") nor the Product, as applicable, is sponsored, endorsed, sold or promoted by ICE Data Indices, LLC, its affiliates or its Third Party Suppliers ("ICE Data and its Suppliers"). ICE Data and its Suppliers make no representations or warranties regarding the advisability of investing in securities generally, in the Product particularly, the Trust or the ability of the Index to track general stock market performance. ICE Data's only relationship to DAIWA ASSET MANAGEMENT is the licensing of certain trademarks and trade names and the Index or components thereof. The Index is determined, composed and calculated by ICE Data without regard to the LICENSEE or the Product or its holders. ICE Data has no obligation to take the needs of the Licensee or the holders of the Product into consideration in determining, composing or calculating the Index. ICE Data is not responsible for and has not participated in the determination of the timing of, prices of, or quantities of the Product to be issued or in the determination or calculation of the equation by which the Product is to be priced, sold, purchased, or redeemed. Except for certain custom index calculation services, all information provided by ICE Data is general in nature and not tailored to the needs of LICENSEE or any other person, entity or group of persons. ICE Data has no obligation or liability in connection with the administration, marketing, or trading of the Product. ICE Data is not an investment advisor. Inclusion of a security within an index is not a recommendation by ICE Data to buy, sell, or hold such security, nor is it considered to be investment advice.

ICE DATA AND ITS SUPPLIERS DISCLAIM ANY AND ALL WARRANTIES AND REPRESENTATIONS, EXPRESS AND/OR IMPLIED, INCLUDING ANY WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE, INCLUDING THE INDICES, INDEX DATA AND ANY INFORMATION INCLUDED IN, RELATED TO, OR DERIVED THEREFROM ("INDEX DATA"). ICE DATA AND ITS SUPPLIERS SHALL NOT BE SUBJECT TO ANY DAMAGES OR LIABILITY WITH RESPECT TO THE ADEQUACY, ACCURACY, TIMELINESS OR COMPLETENESS OF THE INDICES AND THE INDEX DATA, WHICH ARE PROVIDED ON AN "AS IS" BASIS AND YOUR USE IS AT YOUR OWN RISK.

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〉2.2%（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0.7975% （税抜0.725%） | 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。 |
| 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+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 |
| 株式会社愛知銀行 | 登録金融機関 | 東海財務局長(登金)第12号 | ○ | | |
| 株式会社鹿児島銀行 (委託金融商品取引業者 九州FG証券株式会社) | 登録金融機関 | 九州財務局長(登金)第2号 | ○ | | |
| 株式会社高知銀行 | 登録金融機関 | 四国財務局長(登金)第8号 | ○ | | |
| 株式会社三十三銀行 | 登録金融機関 | 東海財務局長(登金)第16号 | ○ | | |
| 株式会社静岡中央銀行 | 登録金融機関 | 東海財務局長(登金)第15号 | ○ | | |
| 株式会社仙台銀行 | 登録金融機関 | 東北財務局長(登金)第16号 | ○ | | |
| 株式会社大東銀行 | 登録金融機関 | 東北財務局長(登金)第17号 | ○ | | |
| 株式会社但馬銀行 | 登録金融機関 | 近畿財務局長(登金)第14号 | ○ | | |
| 株式会社トマト銀行 | 登録金融機関 | 中国財務局長(登金)第11号 | ○ | | |
| 株式会社長崎銀行 | 登録金融機関 | 福岡財務支局長(登金)第11号 | ○ | | |
| 株式会社肥後銀行 (委託金融商品取引業者 九州FG証券株式会社) | 登録金融機関 | 九州財務局長(登金)第3号 | ○ | | |
| 九州FG証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 九州財務局長(金商)第18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 | ○ | | |
| 水戸証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第181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 | ○ | | ○ |
| めぶき証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第1771号 | ○ | | |
| リテラ・クリア証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第199号 | ○ | | |

上記の販売会社は今後変更となる場合があります。また、販売会社によって、新規のご購入の取扱いを行っていない場合や、お申込み方法・条件等が異なります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。