

2013年5月2日

損保ジャパン日本興亜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351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
 【本件に関するお問い合わせ】 営業部 03-5290-3519

「日本株・市場リスクコントロールファンド 愛称 いざ！日本株」の設定

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社は、「日本株・市場リスクコントロールファンド（愛称：いざ！日本株）」を2013年5月31日に設定しますので、お知らせいたします。

商品分類及び属性区分

商品分類

属性区分

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	特殊型
追加型	国内	株式	特殊型 (絶対収益追求型)	その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	年2回	日本	ファミリー ファンド	絶対収益 追求型

商品分類及び属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

わが国の株式を主要投資対象に、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の着実な成長を図ることを目的とします。

ファンドの特色

1 わが国の株式への投資と株価指数先物取引(TOPIX先物)を組み合わせることにより、絶対収益の獲得を目指します。

- ・ファミリーファンド方式により運用を行います。
- ・株式への投資にあたっては、当社独自の株式評価モデルを用いて算出する投資価値と、市場価格を比較して、割安な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。
- ・通常時においては、株式と同額程度のTOPIX先物を売建てることにより、実質株式組入比率[※]を0%近辺とすることで、市場全体の動きの影響を極力排除し、投資元本に対する収益の獲得を目指します。

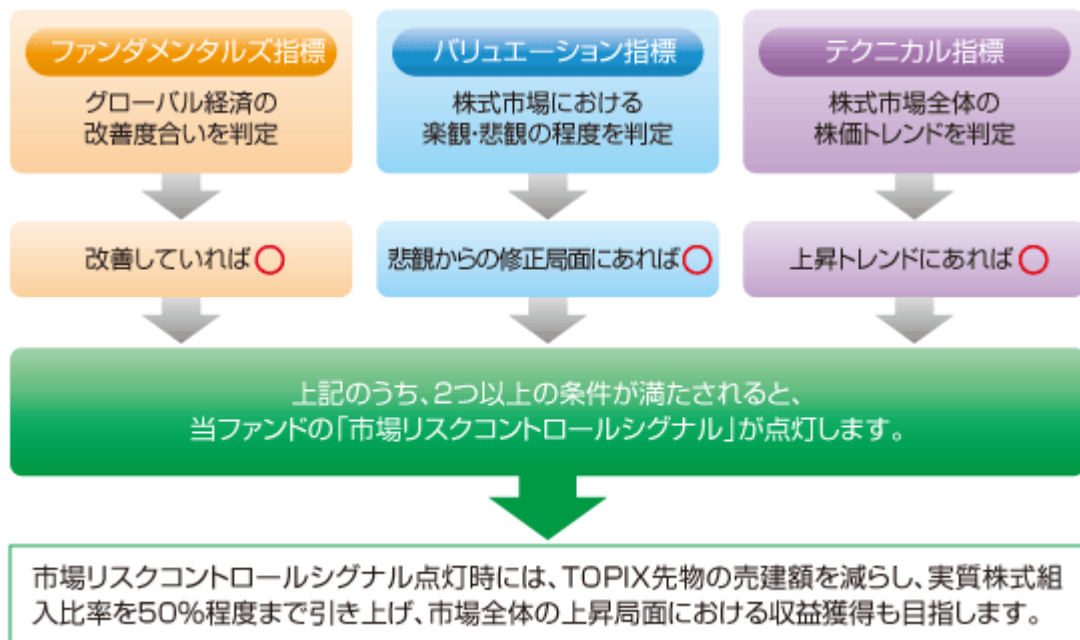
※「実質株式組入比率」とは、現物株式と株価指数先物の合計の組入比率をいいます。

当ファンドは「絶対収益追求型」の運用を行います。絶対収益追求型の運用とは、市場全体の動きに左右されずに、投資元本に対する収益をあげることを目的とします。ただし、「絶対に収益を得られる。」という意味ではありません。

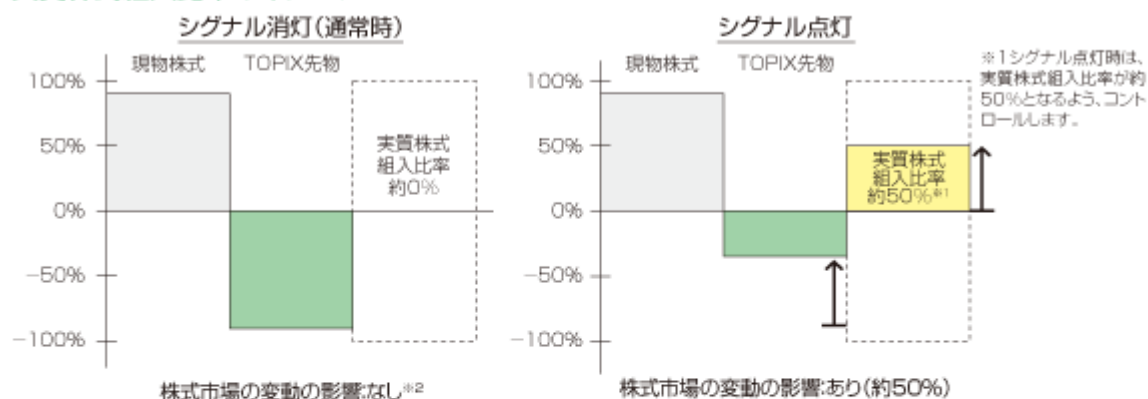
2 独自に開発した市場リスクコントロールシグナルにより、実質株式組入比率を機動的にコントロールし、株式市場の上昇局面における収益の獲得も目指します。

当ファンドの市場リスクコントロールシグナル

過去のわが国の株式市場における本格上昇局面の特徴を、当社が分析・開発したシグナルです。「ファンダメンタルズ指標」、「バリュエーション指標」、「テクニカル指標」の3つの指標を用いて算出したシグナルに基づき、実質株式組入比率が0%あるいは50%程度となるよう先物の売建額を調整し、株式市場全体の価格変動から受ける影響度合いをコントロールします。



<実質株式組入比率のイメージ>

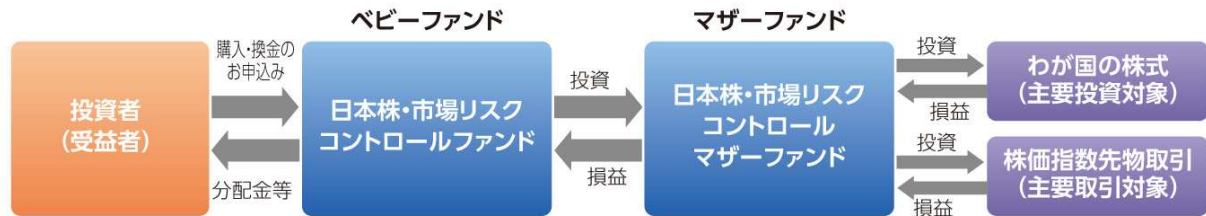


上記は当ファンドの運用戦略をご理解いただくためのイメージ図です。実際の組入比率は異なりますのでご注意ください。

当ファンドの「市場リスクコントロール」戦略では、実質株式組入比率をコントロールすることにより、株式市場の下落時には市場全体の価格低下による影響を抑制し、株式市場の上昇時には市場全体の価格上昇による収益の獲得を目指しますが、市場リスクコントロールシグナルが機能しない場合には、所定の効果が得られない場合があります。その場合、市場全体の価格低下の影響を抑制できないことや、市場全体の価格上昇による収益を獲得できないことがあります。また、一定水準以上の基準価額を保証するものではありません。

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」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」(当ファンド)とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



主な投資制限

- ◆ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ◆ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ◆ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

分配方針

毎決算時(原則として3月、9月の各15日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ① 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
- ③ 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※ 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

投資リスク

《基準価額の変動要因》

当ファンドの基準価額は、組入れられる有価証券等の値動き等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様[※]に帰属いたします。したがって、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金とは異なります。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

※基準価額の変動要因は、以下に限定されるものではありません。

◆価格変動リスク

当ファンドは、株式に投資するとともに、株価指数先物取引の売建てを行いますので、組入れている株式の価格が上昇した場合でも、株価指数先物の上昇幅が大きい場合には、基準価額が下落することがある等、当ファンドの基準価額の動きは、株式市場全体の動きと大きく異なる場合があります。

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、市況等の影響を受けて変動します。組入れている株式の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

株価指数先物の価格は、対象指数を構成する株式の価格や、先物市場の需給関係等を反映して変動します。当ファンドは、株価指数先物を売建てますので、株価指数先物の値上がりは基準価額が下落する要因となります。

◆信用リスク

株式の価格は、発行体の財務状態、経営、業績等の悪化及びそれらに関する外部評価の悪化等により下落することがあります。組入れている株式の価格の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また発行体の倒産や債務不履行等の場合は、株式の価値がなくなることもあり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

◆流動性リスク

国内外の政治・経済情勢の急変、天災地変、発行体の財務状態の悪化等により、有価証券等の取引量が減少することがあります。この場合、ファンドにとって最適な時期や価格で、有価証券等を売買できないことがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

また、取引量の著しい減少や取引停止の場合には、有価証券等の売買ができなかったり、想定外に不利な価格での売買となり、ファンドの基準価額が大きく下落する場合があります。

◆運用戦略に関するリスク

当ファンドは、市場リスクコントロールシグナルを用いて、株式の実質組入比率を機動的に変更することにより、株式市場の下落時のリスクを低減し、本格上昇時のリターン獲得を目指しますが、一定の基準価額水準を保証するものではありません。

また、株式市場が想定外に変動した場合等は、当ファンドの戦略が機能しないことがあり、市場の下落リスクの低減やリターンの獲得ができない場合があります。

《その他の留意点》

- ◆クーリングオフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用はありません。
- ◆収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。収益分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、収益分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、収益分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
- ◆マザーファンドに投資する別のベビーファンドの追加設定・解約等により、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額が影響を受ける場合があります。

《リスクの管理体制》

委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に対する取組方針に基づき、運用担当部から独立した部署及び社内委員会において運用に関する各種リスク管理を行います。

手続・手数料等

お申込みメモ

購入の申込期間	当初申込期間 平成25年5月22日から平成25年5月30日まで 継続申込期間 平成25年5月31日から平成26年6月13日まで ※継続申込期間は上記期間満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。
購入単位	販売会社が定める単位 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
購入価額	当初申込期間 1口当たり1円 継続申込期間 購入申込受付日の基準価額
購入代金	販売会社が定める日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。
換金価額	換金請求受付日の基準価額から信託財産留保額を控除した額
換金代金	換金請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として午後3時まで(販売会社により異なる場合がありますので、詳細につきましては販売会社までお問い合わせください。)
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求を制限する場合があります。
購入・換金 申込受付の中止 及び取消し	委託会社は、購入・換金の申込総額が多額な場合、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、取引市場における流動性が極端に低下した場合、取引市場の混乱、自然災害、テロ、大規模停電、システム障害等により基準価額の算出が困難となった場合、その他やむを得ない事情があると判断したときは、購入・換金の受付を中止すること、及び既に受付けた当該申込みの受付を取り消すことができるものとします。
信託期間	平成30年3月15日まで(設定日 平成25年5月31日) ※委託会社は、信託約款の規定に基づき、信託期間を延長することができます。
繰上償還	受益権の残存口数が10億口を下回るようになった場合、繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、繰上償還させることがあります。
決算日	原則、3月、9月の各15日。(休業日の場合は翌営業日) ※初回決算日は平成25年9月17日。
収益分配	毎決算時(年2回)、収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。 ※分配金を受取る一般コースと、分配金を再投資する自動けいぞく投資コースがあります。販売会社によっては、どちらか一方のみのお取扱いとなる場合があります。各コースのお取扱いにつきましては、販売会社までお問い合わせください。
信託金の限度額	1,000億円
公告	日本経済新聞に掲載します。
運用報告書	原則、毎決算時及び償還時に、運用報告書を作成し、あらかじめお申し出いただいたご住所に販売会社を通じて交付します。
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があります。

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							
購入時手数料	購入価額に <u>3.15%(税抜3.0%)を上限</u> として販売会社が定めた手数料率を乗じた額です。 ※詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。						
信託財産留保額	換金請求受付日の基準価額に <u>0.3%</u> を乗じた額です。						
投資者が信託財産で間接的に負担する費用							
運用管理費用 (信託報酬)	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して<u>年率1.3125%(税抜1.25%)</u>を乗じた額とし、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。運用管理費用(信託報酬)の配分は以下の通りです。</p> <table border="1"> <tbody> <tr> <td>委託会社</td> <td>年率0.63%(税抜0.60%)</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率0.63%(税抜0.60%)</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率0.0525%(税抜0.05%)</td> </tr> </tbody> </table>	委託会社	年率0.63%(税抜0.60%)	販売会社	年率0.63%(税抜0.60%)	受託会社	年率0.0525%(税抜0.05%)
委託会社	年率0.63%(税抜0.60%)						
販売会社	年率0.63%(税抜0.60%)						
受託会社	年率0.0525%(税抜0.05%)						
その他の費用・手数料	<p>◆監査報酬 ファンドの日々の純資産総額に定率(年0.00315%(税抜0.0030%))を乗じた額とします。但し、実際の費用額(年間26.25万円(税抜25万円))を上限とします。なお、上限額は変動する可能性があります。</p> <p>◆その他の費用(*)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・組入価証券の売買の際に発生する売買委託手数料 ・売買委託手数料に対する消費税等相当額 ・先物取引・オプション取引及びコール取引等に要する費用 ・外国における資産の保管等に要する費用 ・信託財産に関する租税 ・受託会社の立替えた立替金の利息 等 <p>(*)「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。</p>						

※当該手数料等の合計額については、投資者の皆様がファンドを保有される期間、売買金額等に応じて異なりますので、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	所得税及び地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して10.147%
換金(解約)時 及び償還時	所得税及び地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時及び償還時の差益(譲渡益)に対して10.147%

※上記は、平成25年3月末現在のものです。平成26年1月1日以降は20.315%となる予定です。

なお、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。

■委託会社（信託財産の運用指図等を行います。）

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

■受託会社（信託財産の保管・管理等を行います。）

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社）

■販売会社（受益権の募集の取扱、販売、一部解約の実行の請求の受付、ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払等を行います。）

株式会社SBI証券

ご注意事項

- ・当資料は、ニュースリリースとして損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社が作成した資料です。したがって、勧誘を目的としたものではありません。また、法令に基づく開示書類ではありません。
- ・当資料に記載されている各事項は、作成時点のものであり、予告なしに変更する場合があります。
- ・投資信託は、主として値動きのある証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元金が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失が生じ、投資元金を割り込むことがあります。また、運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属いたします。
- ・投資信託の取得のお申込みにあたっては、販売会社から投資信託説明書（交付目論見書）を予め、または同時にお渡しいたしますので、必ずお受け取りいただき、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を十分にお読みいただいた上、ご自身でご判断ください。なお、投資信託説明書（交付目論見書）の提供は、販売会社において行います。