

JPXプライム150ファンド

【追加型投信／国内／株式／インデックス型】



当資料は販売用資料であり、「投資信託説明書(交付目論見書)」ではありません。
お申込みの際は必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

「投資信託説明書(交付目論見書)」のご請求・お申込みは…

大和証券

Daiwa Securities

〈販売会社〉

商号等 大和証券株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第108号
加入協会 日本証券業協会
一般社団法人日本投資顧問業協会
一般社団法人金融先物取引業協会
一般社団法人第二種金融商品取引業協会
一般社団法人日本STO協会

設定・運用は…

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

〈委託会社〉

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
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

ファンドの特色

- わが国の株式に投資し、投資成果をJPXプライム150指数(配当込み)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- 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。

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、上記の運用が行なわれないことがあります。

- 毎年1月30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。

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、分配を行なわないことがあります。

※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。

JPXプライム150指数とは

- 東証プライム市場に上場する時価総額上位銘柄を対象に、財務実績に基づく「資本収益性」と将来情報や非財務情報も織り込まれた「市場評価」という、価値創造を測る2つの観点から選定される計150銘柄で構成された株価指数です。
- 浮動株ベースの時価総額加重方式で算出されます。
- 2023年5月26日を基点(1,000)とし、2023年7月3日より算出・公表されています。

JPXプライム150指数の選定プロセス

JPXプライム150指数は、150銘柄で構成されます。銘柄の定期入替は、原則毎年8月の最終営業日に行なわれます。

— JPXプライム150指数の銘柄選定のイメージ —



東証プライム市場指数の構成銘柄

※以下のいずれかに該当する銘柄は除外

- ✕ 上場維持基準を満たしていない銘柄
- ✕ 整理銘柄に指定されている銘柄
- ✕ 特設注意市場銘柄に指定されている銘柄
- ✕ 上場市場を変更することが公表されている銘柄



プライム市場 時価総額上位500銘柄を対象

基準1 資本収益性による銘柄選定 エクイティ・スプレッド基準

エクイティ・スプレッド*が大きい順に75社を選定
※会社の収益性と投資家が期待するリターン之差
(ROE-株主資本コスト)

基準2 市場評価による銘柄選定 PBR基準

エクイティ・スプレッド基準による選定銘柄を除きPBRが1倍を超えている企業の中から時価総額が大きい順に75社を選定

合計
150
銘柄

(時価総額加重)

※上記は指数の銘柄選定プロセスを簡易的に説明したものです。

(出所)日本取引所グループ

【ご参考】

■ ROE (自己資本利益率)	ROE(%)=(純利益÷自己資本)×100。企業の収益性を測る指標の一つであり、企業が株主から調達した資本をどれだけ効率よく利益に変えることができているかを示します。ROEの数値が高いほど、企業が自己資本を有効に利用していることになります。
■ 株主資本コスト	企業が株式を発行して調達する資金にかかるコストのことを指します。これは、株主がその企業に資金を投資するために期待するリターンのことでもあります。
■ PBR (株価純資産倍率)	PBR(倍)=株価÷1株当たり純資産。株価が1株当たり純資産の何倍まで買われているかを見る投資尺度です。

TOPIXとの比較

TOPIXは日本の株式市場全体を広範に網羅する指数であるのに対し、JPXプライム150指数は以下の選定基準により絞り込まれた150銘柄で構成されています。

項目	JPXプライム150	TOPIX(東証株価指数)
概要	価値創造が推定される日本を代表する企業で構成される指数	日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマーク
算出開始日	2023年7月3日	1969年7月1日
基準日	2023年5月26日	1968年1月4日
対象	東証プライム市場 時価総額上位500社	東証プライム市場
構成銘柄数	150	約2,100
選定	資本収益性と市場評価による選定	東証プライム市場上場の全銘柄 (時価総額と流動性を考慮)
算出方法	時価総額加重型	時価総額加重型

※上記は各指数の特徴を簡易的に説明したものです。2024年12月末時点。

(ご参考) TOPIXの見直しに関する詳細は、以下のURLをご参照ください。

日本取引所グループ(jpx.co.jp) <<https://www.jpx.co.jp/markets/indices/revisions-indices/02.html>>

(出所) 日本取引所グループ

JPXプライム150指数への期待

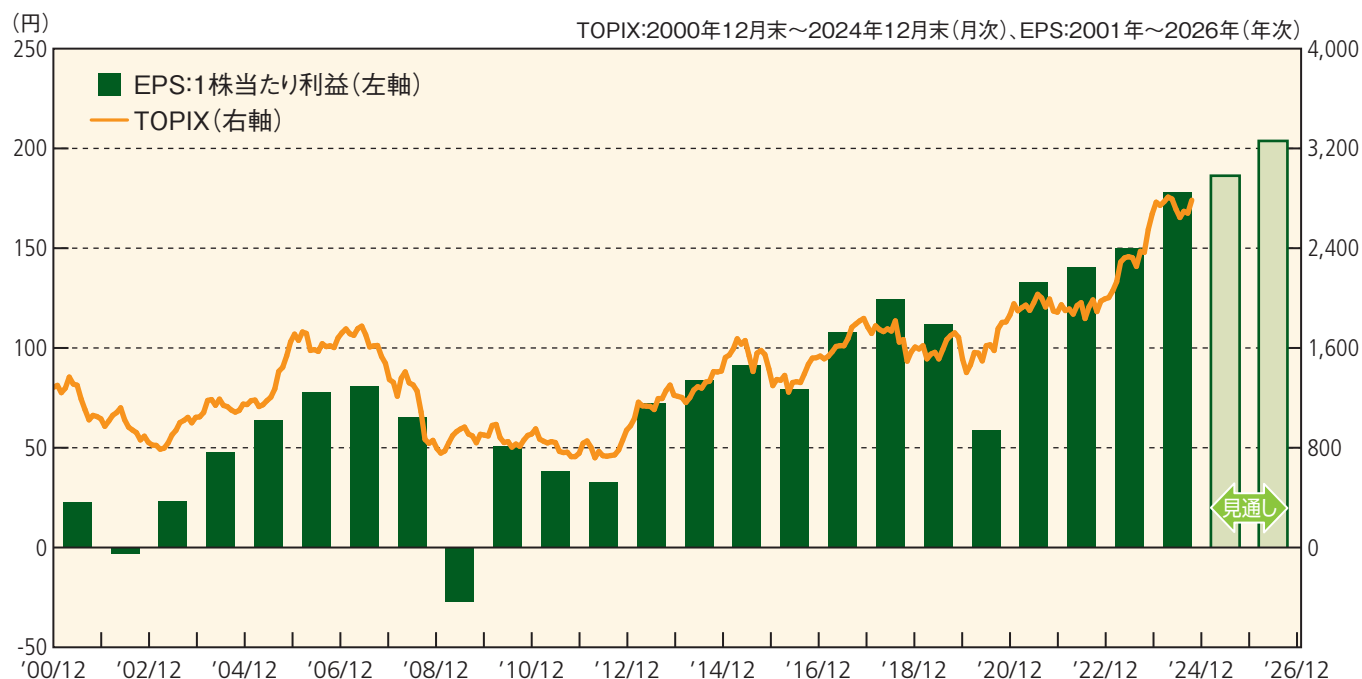
東証は上場企業に資本コストを上回るROEを求めており、それを体現する指数としてJPXプライム150指数が開発されました。当指数は価値創造が推定される日本を代表する企業を見える化し、当指数やその構成銘柄が国内外の機関投資家や個人投資家の中長期投資の対象となることを通じて、価値創造経営の浸透、日本株市場の魅力向上に寄与することが期待されます。



(出所) 日本取引所グループ

堅調な推移が期待される日本株

構造改革や経営効率化の取り組みにより、日本企業の持続的成長力は強化されています。日本企業のEPS(1株当たり利益)は、2013年以降おおむね順調に回復してきました。2020年はコロナ禍の影響で大幅減益となったものの、翌年には増益に転じ、過去最高益を更新し続けています。今後も堅調な推移が予想されています。

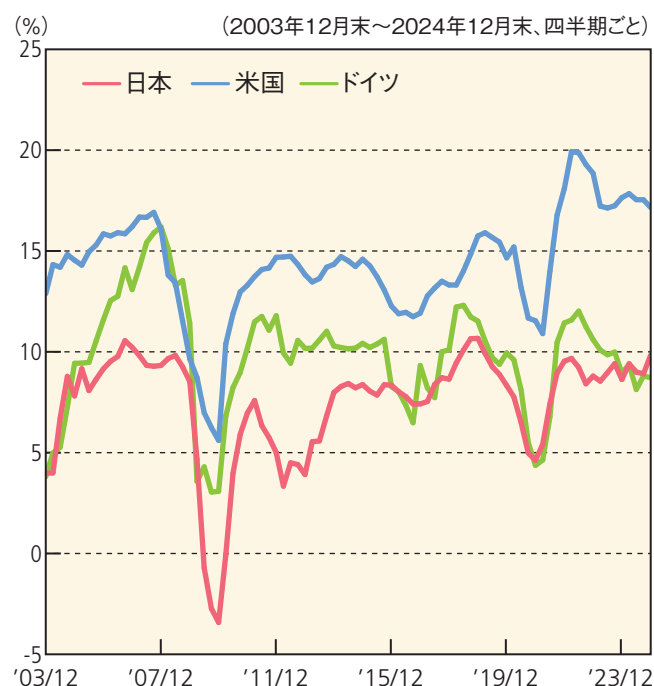


(出所)ブルームバーグ

日・米・独のROE、株価指数

東京証券取引所の「資本コストや株価を意識した経営の実現に向けた対応」の要請などを背景に、ROEの引き上げを求める投資環境になりつつあり、ROE向上による日本株の上昇が期待されます。

各国のROEの推移



各国の株価指数の推移

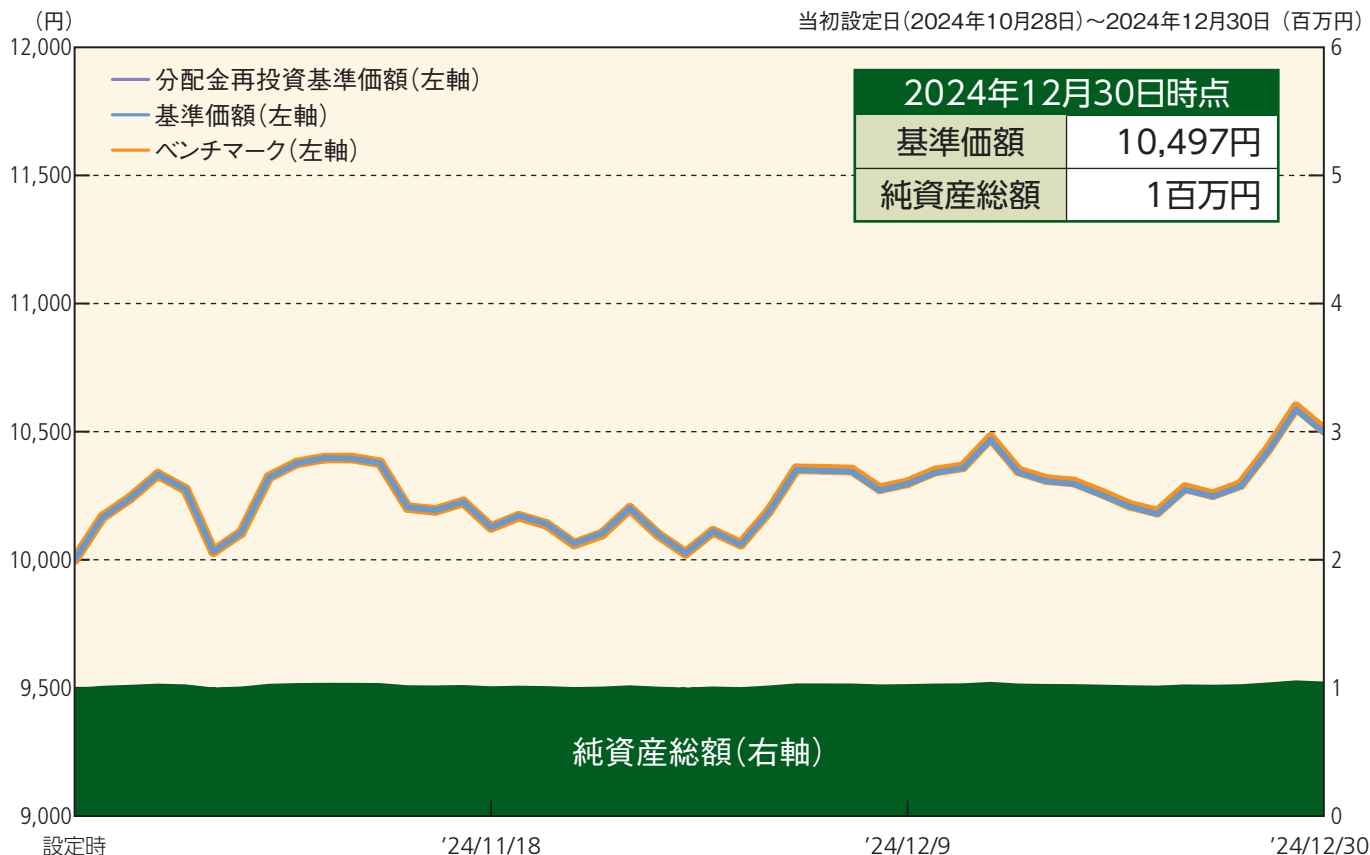


※上記データは、MSCI各国インデックス(配当込み、現地通貨ベース)のデータを使用しています。

(出所)ブルームバーグ

ファンドの運用状況 (基準日:2024年12月30日)

基準価額と純資産の推移



主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

基準日：2024年12月30日

株式 業種別構成 合計97.9%	
東証33業種名	比率
電気機器	24.3%
情報・通信業	9.5%
輸送用機器	9.0%
卸売業	9.0%
機械	5.8%
サービス業	5.7%
化学	5.0%
医薬品	4.8%
小売業	4.3%
その他	20.4%

組入上位10銘柄 合計33.6%			
銘柄名	東証33業種名	比率	
トヨタ自動車	輸送用機器	6.9%	
ソニーグループ	電気機器	4.8%	
日立	電気機器	4.2%	
リクルートホールディングス	サービス業	3.7%	
キーエンス	電気機器	2.7%	
任天堂	その他製品	2.4%	
TOPIX 先物 0703月	—	2.3%	
伊藤忠	卸売業	2.3%	
東京海上HD	保険業	2.3%	
三井物産	卸売業	2.1%	

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。

※基準価額の計算において、運用管理費用(信託報酬)は控除しています(「ファンドの費用」をご覧ください)。

※当ファンドはJPXプライム150指数(配当込み)をベンチマークとしておりますが、同指数を上回る運用成果を保証するものではありません。

※グラフ上のベンチマークは、グラフの起点時の分配金再投資基準価額に基づき指数化しています。

※四捨五入の関係で合計が一致しないことがあります。

※上記は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・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。

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。

基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、JPXプライム150指数(配当込み)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、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。

※くわしくは、「投資信託説明書(交付目論見書)」の「追加的記載事項」をご覧ください。

その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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関する基本方針に基づき、運用本部から独立した部署および会議体が直接的または間接的に運用本部へのモニタリング・監視を通し、運用リスクの管理を行ないます。
- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

JPXプライム150指数について

- ① 配当込みJPXプライム150指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ② JPXは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③ JPXは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ JPXは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

お申込みメモ (大和証券でお申込みの場合)

購入単位	100円以上1円単位*または100口以上1口単位 *購入時手数料および購入時手数料に対する消費税等に相当する金額を含めて、上記単位でご購入いただけます。
購入・換金価額	申込受付日の基準価額(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4営業日目からお支払いします。
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。
信託期間	2045年1月30日まで(2024年10月28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30億口を下回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に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1月30日(休業日の場合、翌営業日)
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。 「分配金再投資コース」をご利用の場合:収益分配金は、税金を差引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。 「分配金支払いコース」をご利用の場合:収益分配金は、税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日までに お支払いします。
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。配当控除の適用があります。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、一定の要件を満たした場合にNISA(少額投資非課税制度)の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせください。 ※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。

ファンドの費用 当ファンドのご購入時や運用期間中には以下の費用がかかります。(消費税率10%の場合)(大和証券でお申込みの場合)

お客さまが直接的に負担する費用	
購入時手数料	購入金額に一律 2.2%(税込) を乗じて得た額
信託財産留保額	ありません。
お客さま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)	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 年率0.5775%(税込) を乗じて得た額
その他の費用・手数料	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。 ※「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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

- 〈受託会社〉 ファンドの財産の保管、管理等を行ないます。
- 〈委託会社〉 ファンドの運用の指図等を行ないます。
 - お電話によるお問い合わせ先 フリーダイヤル
 - 委託会社のホームページ アドレス

三菱UFJ信託銀行株式会社
大和アセットマネジメント株式会社
☎ 0120-106212 (営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

当資料のお取り扱いにおけるご注意

- 当資料は大和アセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。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。
- 分配金額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。