

MAXIS 日本株高配当70マーケットニュートラル上場投信

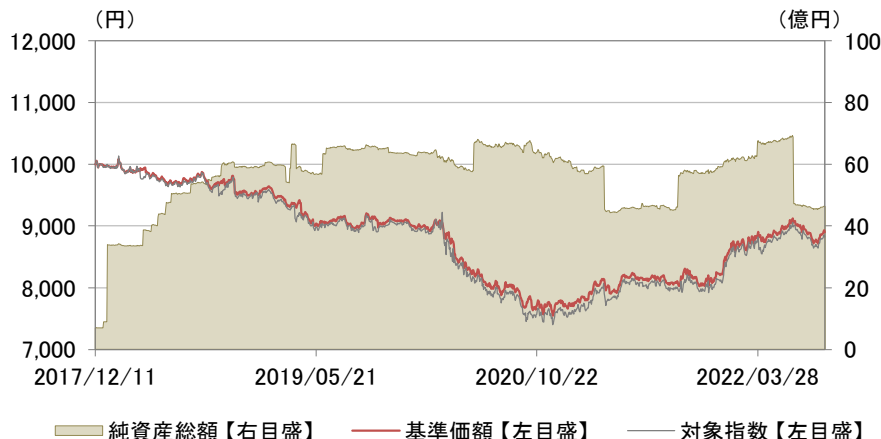
月次レポート

2022年

08月31日現在

追加型投信 / 国内 / 株式 / ETF / インデックス型

■ 基準価額および純資産総額の推移



- ・基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の値です。
- ・信託報酬率は、後記の「ファンドの費用」に記載しています。
- ・対象指数は、野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数です。
- ・詳しくは、後記の「野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数」についてをご覧ください。
- ・対象指数は、設定日を10,000として指数化しています。

■ 騰落率

	過去1ヵ月	過去3ヵ月	過去6ヵ月	過去1年	過去3年	設定来
ファンド	0.6%	-0.6%	3.2%	10.6%	-1.3%	-11.0%
対象指数	0.7%	-0.5%	3.4%	11.1%	-1.6%	-11.8%

- ・実際のファンドでは、課税条件によってお客さまごとの騰落率は異なります。
- ・また、換金時の費用・税金等は考慮していません。
- ・設定来のファンドの騰落率は、設定日を起点として計算しています。
- ・分配金実績がある場合でも、分配金(税引前)は考慮していません。

■ 組入上位10業種

業種	比率
1 情報・通信業	17.6%
2 卸売業	13.9%
3 保険業	7.7%
4 食料品	7.2%
5 輸送用機器	6.9%
6 化学	6.7%
7 建設業	6.4%
8 その他製品	5.1%
9 電気機器	4.4%
10 医薬品	4.2%

■ 組入上位10銘柄

銘柄	業種	比率
1 KDDI	情報・通信業	5.5%
2 日本電信電話	情報・通信業	5.3%
3 三菱商事	卸売業	5.3%
4 任天堂	その他製品	4.9%
5 ソフトバンク	情報・通信業	4.8%
6 日本たばこ産業	食料品	4.6%
7 東京海上ホールディングス	保険業	4.1%
8 トヨタ自動車	輸送用機器	4.0%
9 三井物産	卸売業	3.7%
10 伊藤忠商事	卸売業	3.5%

組入銘柄数: 70銘柄

・表示桁未満の数値がある場合、四捨五入しています。・原則として、比率は純資産総額に対する割合です。・コールローン他は未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。・業種は、東証33業種で分類しています。

■ 野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数について

・野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数は、「野村日本株高配当70・配当総額加重型」*(以下、原指数)をロング(買建て)、TOPIX先物をショート(売建て)するマーケットニュートラル戦略のパフォーマンスを表し、原指数のリターンとベータ(株式市場全体の動きに対する個別銘柄の感応度)調整したTOPIX先物のリターンとの差分を指数化したものです。TOPIX先物によるヘッジ比率は原指数の配当込みTOPIXに対するベータ値によって日々調整します。
* 原指数は、国内金融商品取引所に上場する全ての普通株式のうち、今期予想配当利回りの高い、原則70銘柄で構成される配当総額加重型の指数です。

■ 「野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数」の著作権等について

・野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数の知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値及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、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数は、JPXにより提供又は保証されるものではなく、JPXは、野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※後記の「本資料のご利用にあたっての注意事項等」をご覧ください。

MAXIS日本株高配当70マーケットニュートラル上場投信

追加型投信／国内／株式／ETF／インデックス型

ファンドの目的・特色

■ファンドの目的

対象指数(野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数)の値動きに連動する投資成果をめざします。

■ファンドの特色

投資方針 野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数に連動する投資成果をめざして運用を行います。

・ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数(以下「対象指数」といいます。)の変動率に一致させることを目的とし、対象指数に採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含みます。)の株式に投資を行うとともに、株価指数先物取引の売建てと同様の変動率となるよう、株価指数先物取引および株価指数オプション取引(コールの売りおよびプットの買い)*1を行います。

*1 限月と権利行使価格が同一のコール・オプションの売りとプット・オプションの買いを組み合わせることによって、先物の売建てを行った場合と同じポジションを合成することができます。

・野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数の値動きには、以下のような特徴があります。

原指数に比べて、国内株式市場全般の動きに左右されにくく、また、日々の変動率が小さくなる傾向があります。このため、原指数に比べ利益・損失の額が小さくなる傾向があります。

国内株式市場全般の下落による損失を低減させる効果が期待できる反面、国内株式市場全般の上昇による収益機会も限定されることがあり、加えて日々の変動率が小さくなる傾向があります。したがって、国内株式市場全般の値動きを捉えた投資行動を行う投資家や短期的に収益を求める投資家は、期待する投資成果が得られにくいいため留意が必要です。

■上場投信の仕組み

・ファンドの受益権は、金融商品取引所(東京証券取引所)で上場され、株式と同様に、市場価格で売買することができます。

■分配方針

・年4回の決算時(1・4・7・10月の各10日)に分配を行います。

・分配金額は、経費等控除後の配当等収益の全額を原則とします。

・分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、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。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

投資リスク

■基準価額・市場価格の変動要因(以下、両者を合わせて「基準価額等」と言う場合があります。)

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けます。また、ファンドの市場価格は基準価額の変動以外に市場要因等の影響を受けます。運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

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なく、基準価額等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。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額等の変動要因として、主に以下のリスクがあります。(次ページに続きます。)

価格変動リスク	株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額等の下落要因となります。
信用リスク	株式の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、株式の価格が下落すること、配当金が減額あるいは支払いが停止されること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。
流動性リスク	有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な条件での取引となる場合があります。
株価指数先物に関するリスク	株価指数先物は株価変動等の影響を受けて価格が変動するため、ファンドはその影響を受けます。なお、需給や当該株価指数に対する期待等により、理論上期待される水準とは大きく異なる価格となる場合があります。また、株価指数先物を売建てしている場合に、株価指数先物価格の上昇により損失が発生すると、基準価額等の下落要因となります。
株価指数オプションに関するリスク	株価指数オプションは株価変動等の影響を受けて価格が変動するため、ファンドはその影響を受けます。なお、需給や当該株価指数に対する期待等により、理論上期待される水準とは大きく異なる価格となる場合があります。ファンドは、株価指数先物の「売建て」と同様の投資効果をめざして株価指数オプションを活用することがありますが、必ずしも株価指数先物の「売建て」と同じ投資効果が得られるとは限りません。

ご購入(追加設定)の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

MAXIS日本株高配当70マーケットニュートラル上場投信

追加型投信／国内／株式／ETF／インデックス型

投資リスク

株式の「買付け」と 株価指数先物の 「売建て」(株価指数 オプション取引(コール の売りおよびプットの 買い)を含む)を組み合 わせることによるリスク	ファンドは株式の「買付け」と株価指数先物の「売建て」を組み合わせることで、株式市場全体の騰落の影響を低減することをめざしますが、完全に株式市場の価格変動リスクを排除できるわけではありません。また、指数採用銘柄への投資に伴い、株式市場の価格変動リスクに加え、当該銘柄のリスク等の影響をより大きく受けます。このため「買付け」をした株式の投資成果が株式市場全体の騰落を下回る場合等には、基準価額等の下落要因となります。
--	--

■その他の留意点

- ・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。
- ・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性が生じた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、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・ファンドは、換金時期に制限がありますのでご注意ください。
- ・ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格はファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

ご購入(追加設定)の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

MAXIS日本株高配当70マーケットニュートラル上場投信

追加型投信／国内／株式／ETF／インデックス型

手続・手数料等

■お申込みメモ

購入単位 ^(*)	1万口の整数倍で販売会社が定める単位／販売会社にご確認ください。
購入価額 ^(*)	<p>購入申込受付日の基準価額</p> <p>なお、原則、購入申込受付日の正午までに受付けた購入申込み(当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を当該購入申込受付日の申込みとします。正午過ぎに受付けた購入申込みは翌営業日を購入申込受付日とします。くわしくは販売会社にご確認ください。</p> <p>※基準価額は1口当たりで表示されます。基準価額は委託会社の照会先でご確認ください。</p>
換金単位 ^(*)	1万口の整数倍で販売会社が定める単位／販売会社にご確認ください。
換金価額 ^(*)	<p>換金申込受付日の基準価額</p> <p>なお、原則、換金申込受付日の正午までに受付けた換金申込み(当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を当該換金申込受付日の申込みとします。正午過ぎに受付けた換金申込みは翌営業日を換金申込受付日とします。くわしくは販売会社にご確認ください。</p>
換金代金 ^(*)	<p>原則として、換金申込受付日から起算して4営業日目から販売会社においてお支払いします。</p> <p>購入・換金申込受付日が次のいずれかに該当する場合は、購入・換金はできません。</p> <p><購入></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日 2. 対象指数の銘柄変更実施日および指数用株式数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内 3. 決算日の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、決算日が休業日の場合は、当該決算日の5営業日前から起算して5営業日以内) 4. ファンドが終了することとなる場合において、償還日の直前5営業日間 5. 委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき <p><換金></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日 2. 対象指数の銘柄変更実施日および指数用株式数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内 3. 決算日の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、決算日が休業日の場合は、当該決算日の5営業日前から起算して5営業日以内) 4. ファンドが終了することとなる場合において、償還日の直前5営業日間 5. 委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき <p>なお、委託会社は、1. から5. に定める日のお申込みであっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間におけるお申込みについては、お申込みの受付を行うことができます。</p>
申込締切時間 ^(*)	原則として、正午までに販売会社が受付けたものを当日の申込分とします。

(*)の項目は、購入申込・換金請求されるお客さま向けです。

ご購入(追加設定)の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

MAXIS日本株高配当70マーケットニュートラル上場投信

追加型投信／国内／株式／ETF／インデックス型

手続・手数料等

■お申込みメモ

換金制限 ^(*)	ファンドの資金管理を円滑に行うため、大口の換金のお申込みに制限を設ける場合があります。
買取り ^(*)	販売会社は、次に該当する場合には受益権を買取ります。ただし、償還日の2営業日前までとします。 ・受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき 受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。 なお、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の買取りを停止すること、およびすでに受付けた受益権の買取りを取消すことがあります。
購入・換金申込受付の中止及び取消し ^(*)	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取消すことがあります。
信託期間	無期限(2017年12月11日設定、2017年12月13日上場)
繰上償還	受益権の口数が7万口を下回ることとなった場合等には、信託期間を繰上げて償還となることがあります。 なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合、対象指数が廃止された場合、対象指数の計算方法その他の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めたファンドの信託約款の変更が書面決議により否決された場合は、原則として、ファンドを償還させます。
決算日	毎年1・4・7・10月の10日
収益分配	年4回の決算時に分配を行います。 収益分配金は、原則として、毎決算後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者(決算日において受益者名簿に名義登録されている受益者)があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振込む方式等により支払われます。
課税関係	課税上は、上場証券投資信託として取扱われます。個人受益者については、収益分配時の普通分配金ならびに売却時、換金時および償還時の譲渡益に対して課税されます。NISA(少額投資非課税制度)およびジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)の適用対象です。税法が改正された場合等には、変更となることがあります。くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。
証券コード	1499
ISIN	JP3048670008
上場市場	東京証券取引所
取引所における 売買単位	1口単位

(*)の項目は、購入申込・換金請求されるお客さま向けです。

ご購入(追加設定)の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

MAXIS日本株高配当70マーケットニュートラル上場投信

追加型投信／国内／株式／ETF／インデックス型

手続・手数料等

■ファンドの費用

お客さまが直接的に負担する費用

<購入申込・換金請求されるお客さま>

購入時手数料 **販売会社が定める額**
(購入される販売会社により異なります。くわしくは、販売会社にご確認ください。)

信託財産留保額 ありません。

換金時手数料 **販売会社が定める額**
(換金される販売会社により異なります。くわしくは、販売会社にご確認ください。)

<取引所を通してお取引されるお客さま>

売買委託手数料 **取引所を通してお取引される場合、取扱い第一種金融商品取引業者(証券会社)が独自に定める売買委託手数料がかり、約定金額とは別にご負担いただきます。**(取扱会社ごとに手数料が異なりますので、その上限額を表示することができません。)

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) 日々の純資産総額に対して、**年率0.440%(税抜 年率0.400%)以内**をかけた額
くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

監査法人に支払われるファンドの監査費用・有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料・有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用・その他信託事務の処理にかかる諸費用等についてもファンドが負担します。
※上記の費用・手数料については、売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

その他の費用・手数料

上記のほか、以下の費用・手数料についてもファンドが負担します。
・受益権の上場に係る費用(追加上場料(追加上場時の増加額に対して0.00825%(税抜 0.0075%))、年間上場料(毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%(税抜 0.0075%))
・対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(信託財産の純資産総額に年率0.055%(税抜 年率0.05%)(上限)をかけた額)

※運用管理費用(信託報酬)、監査費用、受益権の上場に係る費用および対象指数についての商標の使用料は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎決算時または償還時にファンドから支払われます。

※上記の費用(手数料等)については、保有・約定金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。

本資料のご利用にあたっての注意事項等

●本資料は、三菱UFJ国際投信が作成した資料です。投資信託をご購入(追加設定)の場合は、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認ください。●本資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。●本資料は信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性等を保証するものではありません。●本資料中のグラフ・数値等は、過去の実績・状況であり、将来の市場環境等や運用成果等を示唆・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おりませんので、実質的な投資成果を示すものではありません。●投資信託は、預金等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。銀行等の登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の補償の対象ではありません。●投資信託は、販売会社がお申込みの取扱いを行い委託会社が運用を行います。

●委託会社(ファンドの運用の指図等)

三菱UFJ国際投信株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第404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

<ホームページアドレス> <https://www.am.mufg.jp/>
<お客さま専用フリーダイヤル> 0120-151034
(受付時間 営業日の9:00~17:00)

●受託会社(ファンドの財産の保管・管理等)

三菱UFJ信託銀行株式会社

ご購入(追加設定)の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。