

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）

【投信協会商品分類】 追加型投信／国内／株式／特殊型（絶対収益追求型）

【設定日】 2013年5月31日 【決算日】 原則、3月、9月の各15日

第10期 決算速報

平素は「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）」に格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

当ファンドは2018年3月15日、第10期決算を迎えました。今期の分配金は基準価額水準、市場動向等を総合的に勘案し、以下のとおり決定致しましたので、ご報告申し上げます。

今後とも信託財産の成長を目指して運用を行って参りますので、引き続きご愛顧賜りますようお願い申し上げます。

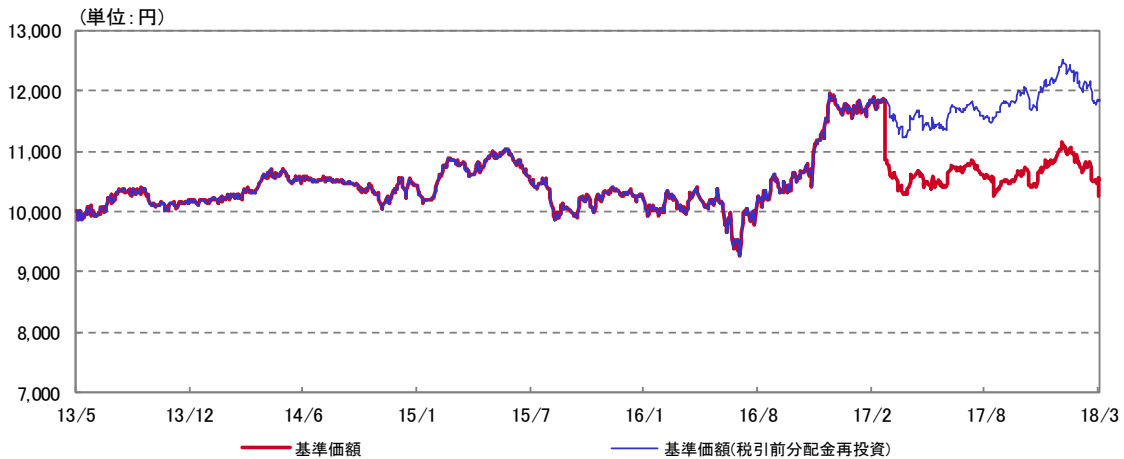
当期決算概要

| 当期末基準価額 (1万口当たり、分配金落ち後) | 当期分配金 (1万口当たり、税引前) | 前期分配金 (1万口当たり、税引前) | 設定来分配金累計 (1万口当たり、税引前) |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|
| 10,264円 | 250円 | 300円 | 1,550円 |

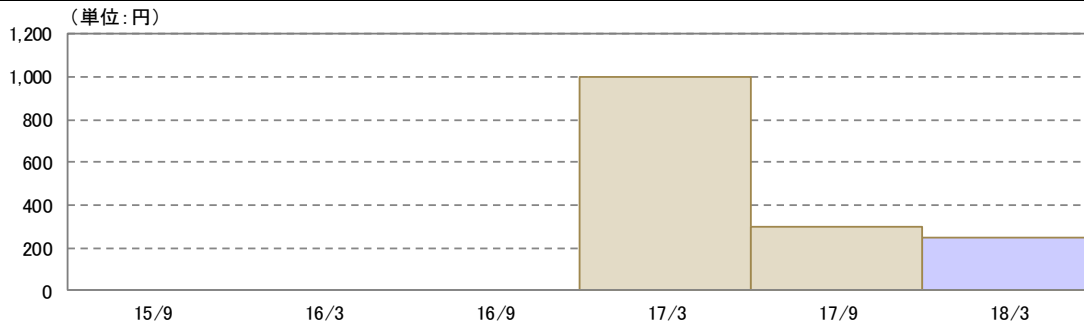
※ 収益分配金額は委託会社が決定します。今後の市場環境や運用状況によっては、分配金額の変更あるいは分配金が支払われない場合もあります。

基準価額の推移

2013/05/31～2018/03/15



分配実績(直近3年分/ 1万口当たり、税引前)



※ 基準価額(税引前分配金再投資)は、分配実績があった場合に、税引前の分配金を決算日の基準価額で再投資したもとして計算しております(以下同じ)。

※ 基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)の計算において信託報酬(後掲「ファンドの費用」参照)は控除されております(以下同じ)。

※ 当ファンドは、ベンチマークを設定していません。

※ 分配実績がない場合、あるいは設定来累計の分配金額が少額の場合、基準価額及び基準価額(税引前分配金再投資)のグラフが重なって表示される場合があります。

上記の運用実績に関する数値、グラフ等は、すべて過去のものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

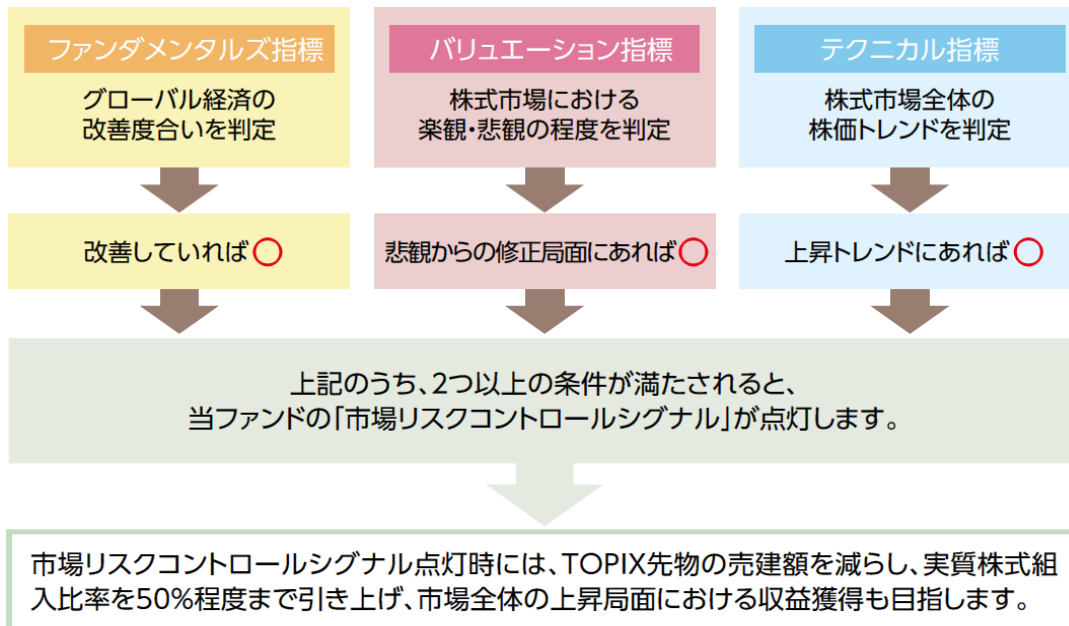
日本株・市場リスクコントロールファンド（愛称:いざ！日本株）

ファンドの特色

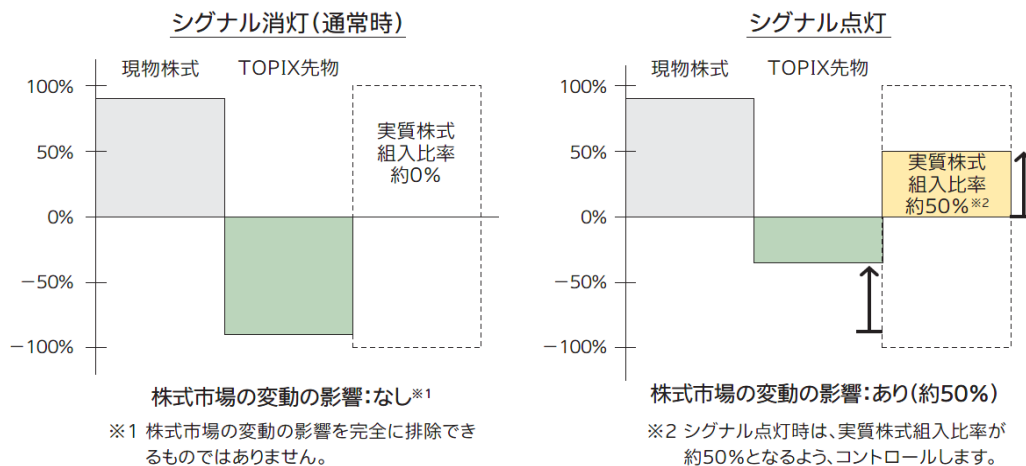
- わが国の株式への投資と株価指数先物取引（TOPIX先物）を組み合わせることにより、絶対収益の獲得を目指します。
当ファンドは「絶対収益追求型」の運用を行います。絶対収益追求型の運用とは、市場全体の動きに左右されずに、投資元本に対する収益をあげることを目的とします。ただし、「絶対に収益を得られる。」という意味ではありません。
- 独自に開発した市場リスクコントロールシグナルにより、実質株式組入比率を機動的にコントロールし、株式市場の上昇局面における収益の獲得も目指します。

<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。**

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）

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へ帰属いたします。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。

詳細については、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

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）

お申込みメモ

| | |
|-------------------|--|
| 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 | 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35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10億口を下回ることとなった場合、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） |
| 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。 ※ 平成30年1月15日以降は、委託会社のホームページ(http://www.sink-am.co.jp/)に掲載します。 |
| 運用報告書 | 原則、毎決算時及び償還時に、交付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。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。配当控除の適用があります。なお、益金不算入制度の適用はありません。 |

●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20.315% |
| 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20.315% |

※ 少額投資非課税制度「愛称:NISA(ニーサ)」をご利用の場合

毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※ 法人の場合は上記とは異なります。

※ 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。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。

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）

Ⅰ 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 3.24%（税抜3.0%）を上限 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。 | 販売会社によるファンドの商品説明・投資環境の説明・事務処理等の対価 |
| 信託財産留保額 | 換金請求受付日の基準価額に 0.3% 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） | ファンドの日々の純資産総額に対して 年率1.35%（税抜1.25%） を乗じた額です。 運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに、ファンドから支払われます。 | 運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率 |
| | 委託会社 年率0.60%（税抜） | ファンドの運用の対価 |
| | 販売会社 年率0.60%（税抜） | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| | 受託会社 年率0.05%（税抜） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価 |
| その他の費用・手数料 | 以下の費用・手数料等が、ファンドから支払われます。 ● 監査費用 ファンドの日々の純資産総額に定率（年0.00324%（税抜0.0030%））を乗じた額とし、実際の費用額（年間27万円（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。 ● その他の費用※ 売買委託手数料、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等 ※ 「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。 | <ul style="list-style-type: none"> ● 監査費用： 監査法人に支払うファンド監査にかかる費用 ● 売買委託手数料： 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 ● 保管費用： 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用 |

※ 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。

●委託会社・その他の関係法人

| | |
|------|---|
| 委託会社 | <p>ファンドの運用の指図を行います。</p> <p>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 ホームページ : http://www.sjn-k-am.co.jp/ 電話番号 : 0120-69-5432 ●クライアントサービス第二部</p> |
| 受託会社 | <p>ファンドの財産の保管及び管理を行います。</p> <p>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)</p> |
| 販売会社 | <p>受益権の募集の取扱、販売、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金の再投資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。</p> |

●販売会社（順不同、○は加入協会を表す）

| 販売会社名 | 区分 | 登録番号 | 加入協会 | | | | 備考 |
|-----------|----------|-----------------|---------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----|
| | | | 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 | |
| 株式会社SBI証券 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第44号 | ○ | | ○ | ○ | |
| 立花証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第110号 | ○ | | ○ | | |
| 楽天証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第195号 | ○ | ○ | ○ | ○ | |
| 高木証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 近畿財務局長(金商)第20号 | ○ | | | | |
| 広島信用金庫 | 登録金融機関 | 中国財務局長(登金)第44号 | ○ | | | | |

<備考欄の表示について>

- ※1 記載の日付より新規お取扱いを開始します。
- ※2 記載の日付以降の新規お取扱いを行いません。
- ※3 新規のお取扱いを行っておりません。

<ご留意事項>

- ・上記掲載の販売会社は、今後変更となる場合があります。
- ・上記掲載以外の販売会社において、お取扱いを行っている場合があります。
- ・詳細は販売会社または委託会社までお問い合わせください。

当資料のご利用にあたっての注意事項

- ◆ 当資料は、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社により作成された販売用資料であり、法令に基づく開示書類ではありません。当ファンドの購入のお申込みの際には販売会社より投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめ、または同時にお渡しいたしますので、必ずお受け取りの上、詳細は投資信託説明書（交付目論見書）をご確認ください。
- ◆ 当ファンドは、値動きのある証券に投資しますので、基準価額は大きく変動します。また、外貨建て資産に投資する場合には、為替リスクがあります。投資信託は、リスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動します。したがって、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、すべて投資者の皆様には帰属します。投資に関する最終決定はご自身の判断でなさるようお願い申し上げます。
- ◆ 投資信託は、預金や保険契約と異なり、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。
- ◆ 登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。
- ◆ 当資料に記載されているグラフ・数値等は過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。分配金に関しては、運用状況によっては、分配金額が変わる場合、或いは分配金が支払われない場合があります。
- ◆ ファンドマネージャーのコメント、方針、その他の予測数値等については、作成時点での投資判断を示したものであり、将来の市況環境の変動等により、当該運用方針やその他予測数値等が変更される場合があります。また、記載した内容は、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。
- ◆ 当資料に記載されている各数値は四捨五入して表示していることがありますので、誤差が生じている場合があります。
- ◆ 当資料に記載されている各事項につきましては、正確性を期しておりますが、その正確性を保証するものではありません。当資料に記載の当社の意見等は予告なく変更することがあります。