



SMTAM JPX日経インデックス400オープン

追加型投信／国内／株式／インデックス型



【ご留意事項】

- 当資料は三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
- ご購入のお申込みの際は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(外貨建資産には為替変動リスクを伴います。)に投資しますので基準価額は変動します。したがって、投資元本や利回りが保証されるものではありません。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆様へ帰属します。
- 投資信託は預貯金や保険契約とは異なり預金保険機構および保険契約者保護機構等の保護の対象ではありません。また、証券会社以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。
- 当資料は信頼できると判断した各種情報等に基づき作成していますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、今後予告なく変更される場合があります。
- 当資料中の図表、数値、その他データについては、過去のデータに基づき作成したものであり、将来の成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、将来の市場環境の変動等により運用方針等が変更される場合があります。
- 当資料で使用している各指数に関する著作権等の知的財産権、その他の一切の権利はそれぞれの指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

当資料は、ファンドの紹介を目的として三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成した資料です。
ご購入の際は、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



(登録金融機関(販売取扱会社))
株式会社ゆうちょ銀行
関東財務局長(登金)第611号
(加入協会) 日本証券業協会

(金融商品仲介業者)
日本郵便株式会社
関東財務局長(金仲)第325号

◆設定・運用は

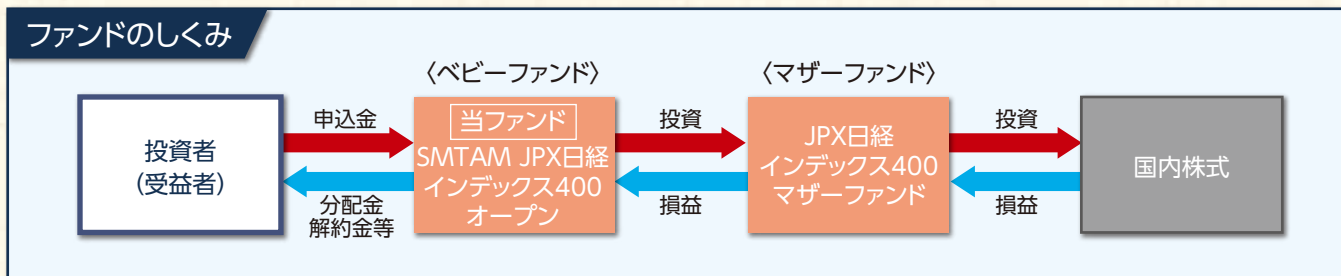


商号 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第347号
加入協会 一般社団法人投資信託協会
一般社団法人日本投資顧問業協会

ファンドの特色

1 わが国の金融商品取引所等に上場されている株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●JPX日経インデックス400 マザーファンドを主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。



2 JPX日経インデックス400 (配当込み)に連動する投資成果を目指します。

●株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。

※資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、上記の運用ができない場合があります。

JPX日経インデックス400とは

JPX日経インデックス400とは、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下、総称して「JPXグループ」)ならびに株式会社日本経済新聞社(以下、「日経」)によって独自に開発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。採用される400銘柄は、企業の健全性や流動性の観点から1,000銘柄に絞り込まれた上で、ROE、営業利益、時価総額の定量評価に定性評価を加味し、選定されます。



キーワード

ROE (自己資本利益率)

“Return on Equity”の略称で、「株主資本利益率」とも呼ばれます。投下した資本に対し、企業がどれだけ利益を上げられるのかを示した指標で、企業の収益力を判断する財務指標のひとつであり、海外投資家が重視する指標であるといわれています。

$$ROE(\%) = \frac{\text{当期純利益}}{\text{自己資本}} \times 100$$

3年ROE単純平均値(2020年選定銘柄を対象)

2021年8月6日基準

JPX日経インデックス400 構成銘柄	12.3%
東証市場第一部銘柄 ^{*1}	6.9%
非構成銘柄 ^{*1,*2}	3.8%

※1 3期いずれかの期で債務超過の銘柄、3年平均ROEが200%超、もしくは-200%未満の銘柄、対象期間の財務数値欠損銘柄は除外して計算。

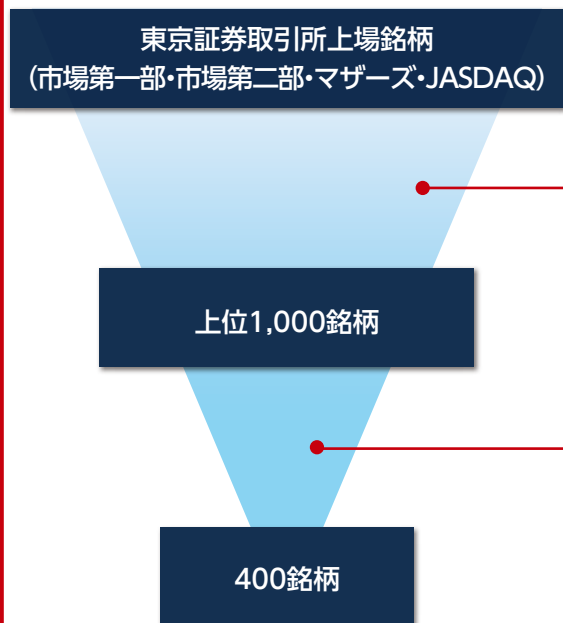
※2 JPX日経インデックス400の銘柄選定にかかる母集団のうちJPX日経インデックス400非構成銘柄が対象。

※上記は「JPX日経インデックス400」の全てを網羅したものではありません。

(出所)東京証券取引所、日経および各種資料を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

JPX日経インデックス400の銘柄選定方法

資本の効率的活用や海外投資家など含む投資家を意識した経営的観点など、グローバルな投資基準に求められる諸要件を満たした「投資者にとって投資魅力の高い会社」で構成されています。



①適格基準によるスクリーニング

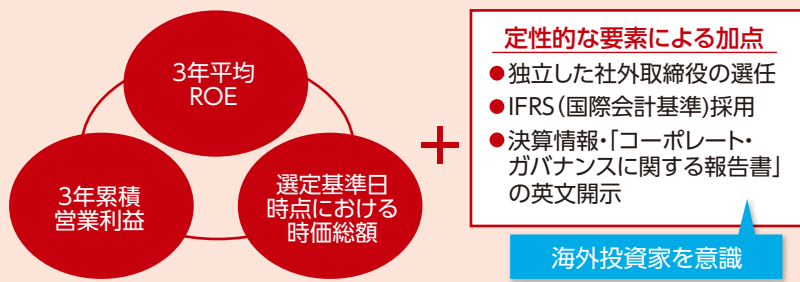
下記のいずれかに該当する銘柄を除外

上場後3年未満(テクニカル上場を除く)	過去3期全ての期で最終赤字
過去3期いずれかの期で債務超過	整理銘柄等に該当
過去3期全ての期で営業赤字	など

②市場流動性によるスクリーニング

直近3年間の売買代金	選定基準日時点における時価総額
------------	-----------------

③定量的な指標によるスコアリング



※上記は「JPX日経インデックス400の銘柄選定方法」の全てを網羅したものではありません。
(出所)東京証券取引所、日経および各種資料を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

TOPIX(東証株価指数)および日経平均株価(日経225)との比較

(2021年9月末現在)

	JPX日経インデックス400	TOPIX	日経平均株価																														
算出開始日	2014年1月6日	1969年7月1日	1950年9月7日																														
対象銘柄	東京証券取引所上場銘柄 市場第一部 394銘柄 市場第二部 1銘柄 マザーズ 0銘柄 JASDAQ 5銘柄	東京証券取引所市場第一部上場銘柄	東京証券取引所市場第一部上場銘柄から選定された225銘柄																														
銘柄数	400銘柄	2,183銘柄	225銘柄																														
時価総額	約325兆円*1	約448兆円*1	約449兆円(ご参考)																														
算出の特徴	浮動株調整時価総額加重型 (1銘柄当たり1.5%の構成比率上限)	浮動株調整時価総額加重型	株価平均型																														
銘柄選定のポイント	流動性に加え、ROEや営業利益など収益面を考慮した基準で選定	対象銘柄の全て	対象銘柄の中から流動性の高い銘柄を中心に業種間のバランスを考慮して選定																														
銘柄入替	原則として年1回 (8月の最終営業日)	定期的な入替はなし	原則として年1回 (10月の第1営業日)																														
組入上位5銘柄と構成比率(%)	<table border="1"> <tr><td>リクルートホールディングス</td><td>1.8</td></tr> <tr><td>キーエンス</td><td>1.7</td></tr> <tr><td>HOYA</td><td>1.7</td></tr> <tr><td>ソニーグループ</td><td>1.7</td></tr> <tr><td>三菱UFJフィナンシャル・グループ</td><td>1.6</td></tr> </table>	リクルートホールディングス	1.8	キーエンス	1.7	HOYA	1.7	ソニーグループ	1.7	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6	<table border="1"> <tr><td>トヨタ自動車</td><td>3.6</td></tr> <tr><td>ソニーグループ</td><td>2.8</td></tr> <tr><td>キーエンス</td><td>2.4</td></tr> <tr><td>ソフトバンクグループ</td><td>1.8</td></tr> <tr><td>リクルートホールディングス</td><td>1.7</td></tr> </table>	トヨタ自動車	3.6	ソニーグループ	2.8	キーエンス	2.4	ソフトバンクグループ	1.8	リクルートホールディングス	1.7	<table border="1"> <tr><td>ファーストリテイリング</td><td>10.1</td></tr> <tr><td>東京エレクトロン</td><td>6.1</td></tr> <tr><td>ソフトバンクグループ</td><td>4.8</td></tr> <tr><td>ファナック</td><td>3.0</td></tr> <tr><td>ダイキン工業</td><td>3.0</td></tr> </table>	ファーストリテイリング	10.1	東京エレクトロン	6.1	ソフトバンクグループ	4.8	ファナック	3.0	ダイキン工業	3.0
リクルートホールディングス	1.8																																
キーエンス	1.7																																
HOYA	1.7																																
ソニーグループ	1.7																																
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.6																																
トヨタ自動車	3.6																																
ソニーグループ	2.8																																
キーエンス	2.4																																
ソフトバンクグループ	1.8																																
リクルートホールディングス	1.7																																
ファーストリテイリング	10.1																																
東京エレクトロン	6.1																																
ソフトバンクグループ	4.8																																
ファナック	3.0																																
ダイキン工業	3.0																																
主な特徴	投資魅力の高い銘柄で構成	多くの銘柄の動きを反映	知名度が高く、わかりやすい																														
	算出期間が相対的に短い	業績の悪い(赤字)企業も含まれる	値がさ株*2の影響を受けやすい																														

*1 JPX日経インデックス400およびTOPIXの時価総額は浮動株ベース。

*2 値がさ株とは、株価水準の高い銘柄のこと。

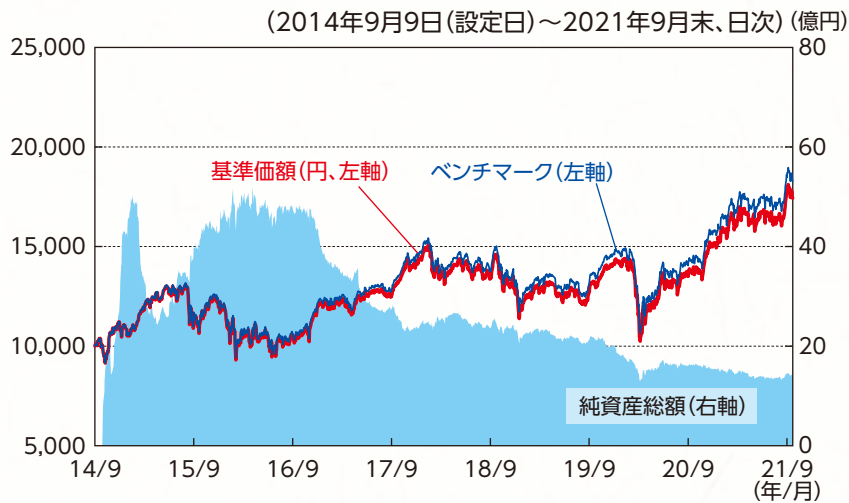
※JPX日経インデックス400および日経平均株価は、上場廃止等によって、銘柄数が一時的に下回る場合があります。

(出所)東京証券取引所、日経およびBloombergのデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※上記は過去のデータであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

当ファンドの運用状況 (2021年9月末現在)

基準価額および純資産総額の推移



2021年9月末現在

基準価額	17,426円
純資産総額	14.0億円

期間別騰落率

	ファンド	ベンチマーク	差
1カ月	4.4%	4.5%	-0.1%
3カ月	5.2%	5.4%	-0.2%
6カ月	4.6%	4.9%	-0.4%
1年	27.0%	27.8%	-0.8%
3年	19.7%	22.0%	-2.3%
設定来	74.3%	82.5%	-8.3%

※基準価額は信託報酬控除後です。

※ベンチマークはJPX日経インデックス400(配当込み)です。当初設定日を10,000として指数化しています。

資産内容

株式	98.3%
株式先物取引	1.7%
短期金融資産等	0.0%
合計	100.0%

※対純資産総額比、マザーファンドベース。

※上記は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

組入上位10業種

	業種	比率
1	電気機器	18.2%
2	化学	7.9%
3	情報・通信業	7.7%
4	医薬品	6.5%
5	輸送用機器	6.0%
6	機械	5.9%
7	サービス業	5.3%
8	卸売業	5.2%
9	銀行業	5.1%
10	小売業	4.1%

※対純資産総額比、マザーファンドベース。

組入上位10銘柄

(組入銘柄数:400銘柄)

	銘柄名	業種	比率
1	リクルートホールディングス	サービス業	1.8%
2	キーエンス	電気機器	1.7%
3	HOYA	精密機器	1.7%
4	ソニーグループ	電気機器	1.6%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.5%
6	ダイキン工業	機械	1.5%
7	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
8	日立製作所	電気機器	1.5%
9	トヨタ自動車	輸送用機器	1.5%
10	信越化学工業	化学	1.4%

※対純資産総額比、マザーファンドベース。

※上記は過去のデータであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

JPX日経インデックス400 (試算値および発表値) の推移



※JPX日経インデックス400試算値は、JPXグループおよび日経の試算によるものです。過去の構成銘柄選定における定性的な要素による加減等、「JPX日経インデックス400算出要領」の記載と一部異なる方法で算出しています。

※TOPIXはグラフ起点のJPX日経インデックス400の試算値を基に指数化。

※当ファンドのベンチマークはJPX日経インデックス400(配当込み)です。

(出所)東京証券取引所、日経およびBloombergのデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※上記は、過去のデータであり、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、当ファンドの運用状況を表したものではありません。

「JPX日経インデックス400」は、JPXグループならびに日経によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPXグループおよび日経は、同指数自体および同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、JPXグループおよび日経は、その運用および本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。JPXグループおよび日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

2022年4月4日に東京証券取引所(以下「東証」といいます。)は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ(スタンダード・グロース)」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

ファンドの投資リスク

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。信託財産に生じた利益および損失は、全て投資者の皆様に帰属します。投資信託は預貯金と異なります。**

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、またはそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※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。

その他の留意点

- ファンドは、JPX日経インデックス400(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。
- 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、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。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、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、分配金の一部または全部が、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、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。
- 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。

ご購入の際は、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

お申込みメモ

信託期間 無期限(2014年9月9日設定)
決算日 毎年9月8日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配 年1回、毎決算時に分配金額を決定します。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 ※販売会社によっては分配金の再投資が可能です。 ※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。
購入単位 販売会社が個別に定める単位とします。詳しくは販売会社に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とします。
換金単位 販売会社が個別に定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
換金価額 換金申込受付日の基準価額とします。
換金代金 原則として、換金申込受付日から起算して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、販売会社の営業日の午後3時までとします。
課税関係 課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。

ファンドの費用

▼お客様が直接的にご負担いただく費用

購入時手数料
購入価額に販売会社が個別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
(上限2.2%(税抜2.0%))

信託財産留保額
ありません。

▼お客様が間接的にご負担いただく費用

運用管理費用(信託報酬)
純資産総額に対して**年率0.627%(税抜0.57%)**

<運用管理費用の配分と主な役務>

委託会社 年率0.209%(税抜0.19%) ◇委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社 年率0.363%(税抜0.33%) ◇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、購入後の情報提供等の対価
受託会社 年率0.055%(税抜0.05%) ◇運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

その他の費用・手数料

監査費用、有価証券の売買・保管、信託事務に係る諸費用等をその都度(監査費用は日々)、ファンドが負担します。これらの費用は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記の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、上限額等を事前に示すことができません。

委託会社およびファンドの関係法人

委託会社：三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 [ファンドの運用の指図]

受託会社：三井住友信託銀行株式会社 [ファンドの財産の保管および管理]

販売会社：株式会社ゆうちょ銀行 [募集・販売の取扱い、目論見書・運用報告書の交付等]

投資信託に関する留意事項

- 投資信託は預金・貯金ではありません。
- 日本郵便株式会社は、株式会社ゆうちょ銀行から委託を受けて、投資信託の申し込みの媒介(金融商品仲介行為)を行います。日本郵便株式会社は金融商品仲介行為に関して、株式会社ゆうちょ銀行の代理権を有していないとともに、お客さまから金銭もしくは有価証券をお預かりしません。
- 当資料は金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。投資信託取得の申し込みにあたっては、投資信託説明書(交付目論見書)をお渡ししますので必ず内容をご確認のうえご自身でご判断ください。
- 投資信託説明書(交付目論見書)はゆうちょ銀行各店または投資信託取扱郵便局の投資信託窓口にて用意しております。ただし、インターネット専用ファンドの投資信託説明書(交付目論見書)はインターネットによる電子交付となります。

◆投資信託説明書(交付目論見書)のご請求、お申込みは



[登録金融機関(販売取扱会社)]
株式会社ゆうちょ銀行
関東財務局長(登金)第611号
(加入協会) 日本証券業協会

[金融商品仲介業者]
日本郵便株式会社
関東財務局長(金仲)第325号

◆設定・運用は



商号 三井住友トラスト・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347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

お申込み、取扱店舗等の照会については、株式会社ゆうちょ銀行投信コールセンターへ

投信コールセンター **0800(800)4104** ハロー ハロー ヨイトーシ 通話料 無料
受付時間/月曜日～金曜日 午前9時～午後6時(ただし、祝祭日、12月31日～1月3日を除きます。)
<https://www.jp-bank.japanpost.jp/>

0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)
<https://www.smtam.jp/>

