



追加型投信／海外／株式／インデックス型

# 中央三井ダウ・ジョーンズ インデックスファンド

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	為替ヘッジ	対象インデックス
追加型投信	海外	株式	インデックス型	その他資産 (注)	年1回	北米	ファミリー ファンド	なし	その他 (ダウ工業株30種平均株価 (NYダウ)(円ベース))

(注) 投資信託証券(株式 一般)

商品分類及び属性区分の定義については、社団法人投資信託協会のホームページ <http://www.toushin.or.jp/> でご覧いただけます。

- ファンドの販売会社、ファンドの基準価額等については、下記委託会社の照会先までお問い合わせください。
- **ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)は委託会社のインターネットホームページで閲覧、ダウンロードすることができます。**
- 投資信託説明書(請求目論見書)については、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に投資信託説明書(請求目論見書)をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- 本書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は投資信託説明書(請求目論見書)に掲載しています。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- 投資信託の信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- 本書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。
- この目論見書により行う中央三井ダウ・ジョーンズ インデックスファンドの募集については、発行者である中央三井アセットマネジメント株式会社(委託会社)は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を平成23年7月20日に関東財務局長に提出しており、平成23年7月21日にその届出の効力が生じております。

委託会社〔ファンドの運用の指図を行う者〕

中央三井アセットマネジメント株式会社

◆ 金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第356号

◆ 設立年月日：昭和61年9月19日 ◆ 資本金：3億円(平成23年11月30日現在)

◆ 運用する投資信託財産の合計純資産総額：2兆3,391億円(平成23年11月30日現在)

照会先	■ お問い合わせ窓口	電話番号：0120-668001(フリーダイヤル) / 03-5440-0190 (受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)
	■ インターネットホームページ	<a href="http://www.cmam.co.jp/">http://www.cmam.co.jp/</a>

受託会社〔ファンドの財産の保管及び管理を行う者〕

中央三井アセット信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

## ファンドの目的・特色

### 〈ファンドの目的〉

- 中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 〈ファンドの特色〉

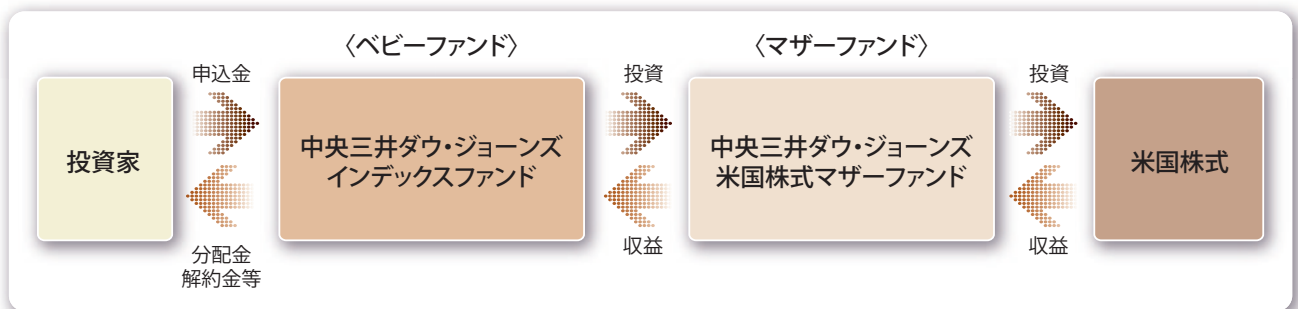
- ダウ工業株30種平均株価に採用されている米国の主要な株式30銘柄への投資を行い、ダウ工業株30種平均株価（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ダウ工業株30種平均株価とは

ダウ工業株30種平均株価<sup>(注)</sup>は、ダウ・ジョーンズが米国を代表する優良30銘柄を選出し、指数化したものです。1896年に12種平均株価として誕生し、現在では米国株式の値動きを示す代表的な株価指数として知られ、日本では「ダウ平均」、「NYダウ」、「ダウ工業株30種」などと呼ばれています。

### ● ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



### ● 主な投資制限

- 株式への投資割合……………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投資割合…同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への投資割合……………外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

### ● 分配方針

年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。

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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(注) ダウ工業株30種平均株価について

「Dow Jones Industrial Average<sup>SM</sup>」(「ダウ工業株30種平均株価」)は、CME Group Index Services LLC (以下「CME指数」といいます。)の許諾商標であるDow Jones指数の商品であり、使用ライセンスが供与されています。「Dow Jones<sup>®</sup>」、「Dow Jones Industrial Average<sup>SM</sup>」、「DJIA<sup>SM</sup>」、および「Dow Jones指数」は、Dow Jones Trademark Holdings, LLC (以下「ダウ・ジョーンズ」といいます。)のサービスマークであり、中央三井アセットマネジメントによる一定の目的のための使用が許諾されています。ダウ・ジョーンズ、CME指数およびこれらの各関係会社は、Dow Jones Industrial Average (以下「DJIA」といいます。)およびその各サービスマークについて、当ファンドに関連するライセンスの供与以外、中央三井アセットマネジメントとは関係がありません。

ダウ・ジョーンズ、CME指数およびこれらの各関係会社は以下のことを行いません。

- 当ファンドを支援、是認、販売または宣伝すること。
- 公衆に当ファンドへの投資を推奨すること。
- 当ファンドの設定の時期、数量もしくは価格の決定について責任または義務を負い、あるいはこれらを決定すること。
- 当ファンドの管理、運営または取引に対する責任または義務を負うこと。
- DJIAの決定、構成または計算に際し、当ファンドまたは受益者の要求を考慮し、またはその義務を負うこと。
- 上記にかかわらず、CME Group Inc.とその関係会社は、当ファンドと無関係であるが、類似しておりかつ競合し得る金融商品を独自に発行し、または支援することがあります。さらに、CME Group Inc.とその関係会社は、DJIAのパフォーマンスに関連する金融商品を積極的に取引しています。これらの取引がDJIAおよび当ファンドの評価に影響を及ぼす可能性があります。

ダウ・ジョーンズ、CME指数およびこれらの各関係会社は、当ファンドに関連する責任を負わないものとし、具体的には、

- ダウ・ジョーンズ、CME指数およびこれらの各関係会社は、明示的または暗示的な保証を行わず、また、以下についての一切の保証を否認します。
- DJIAまたはこれに関連するデータの利用により、当ファンド、受益者またはその他の者が将来得る結果
- DJIAまたはこれに関連するデータの正確性または完全性
- DJIAまたはこれに関連するデータについて特定の目的または利用のための市場商品性または適性
- ダウ・ジョーンズ、CME指数およびこれらの各関係会社は、DJIAまたはこれに関連するデータの誤り、不作為または障害について責任を負わないものとし、
- いかなる場合も、ダウ・ジョーンズ、CME指数およびこれらの各関係会社は、その可能性につき通知されていたとしても喪失利益または間接的、懲罰的、特別もしくは結果的損害もしくは損失について責任を負わないものとし、

上述の当該指数および商標に関するライセンス供与は、中央三井アセットマネジメントの利益のために行われるものであり、他のいかなる第三者のためでもありません。

## 投資リスク

### 〈基準価額の変動要因〉

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、投資者の皆さま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及び損失は、全て投資者の皆さまに帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

株価変動 リスク	一般に、企業業績、国内外の景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、株価が下落（上昇）した場合には基準価額の下落（上昇）要因となります。
為替変動 リスク	一般に、投資している国の通貨が円に対して弱く（円高に）なれば基準価額の下落要因となり、強く（円安に）なれば基準価額の上昇要因となります。
信用 リスク	一般に、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、又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、マザーファンドへの投資を通じて、ベンチマーク（ダウ工業株30種平均株価（NYダウ）（円ベース））と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドの基準価額騰落率とベンチマークの騰落率は必ずしも一致しません。
- 収益分配金に関する留意点  
収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後）を超えて行われる場合があります。したがって、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。  
受益者の購入価額等によっては、収益分配金の全額又は一部が、実質的に投資元本の一部払戻しに相当する場合があります。  
収益分配金は信託財産から支払われます。このため、収益分配金支払い後の信託財産は減少することとなり、支払われた収益分配金の水準に応じて基準価額が下落する要因となります。計算期間中に発生した運用収益（経費控除後）を超えて収益分配が行われる場合、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。

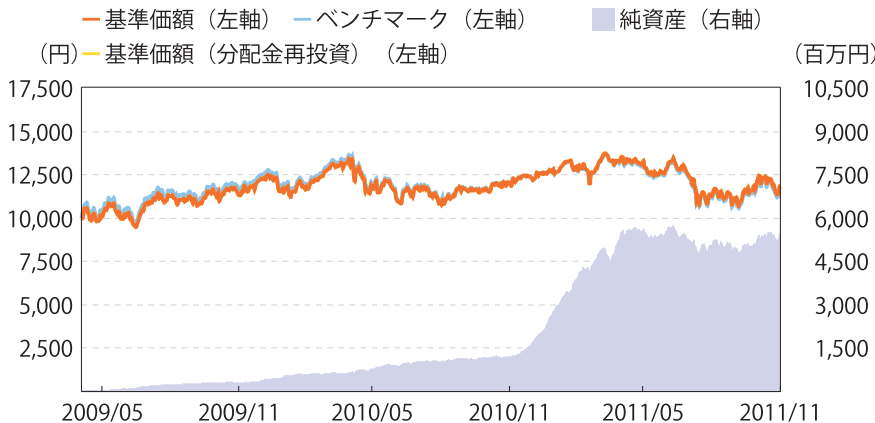
### 〈リスクの管理体制〉

- 法令諸規則、約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェック、リスクのモニタリングは、運用部門から独立した管理部門である業務管理室が日々実施しております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。
- パフォーマンス評価等は、業務管理室において行っております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

# 運用実績

2011年11月30日現在（基準日）

## 〈基準価額・純資産の推移〉



- ・基準価額及び基準価額(分配金再投資)は、信託報酬控除後の値です。
- ・基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして算出した値です。
- ・ベンチマークは、設定日の基準価額に合わせて指数化しています。

## 〈分配の推移〉

2011年4月	0円
2010年4月	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

- ・分配金は1万口当たり、税引前の値です。
- ・運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 〈主な資産の状況〉

### 資産別投資比率

資産	比率
株式現物	91.24%
その他資産	8.76%
合計	100.00%
株式先物	9.08%

- ・比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の評価金額の比率をいいます。
- ・ファンドはマザーファンドを組入れますので、実質比率を記載しています。

### 業種別投資比率（中央三井ダウ・ジョーンズ米国株式マザーファンド）

業種	比率
資本財	19.16%
ソフトウェア・サービス	12.29%
エネルギー	10.41%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.97%
食品・飲料・タバコ	6.06%
その他	36.28%
合計	91.16%

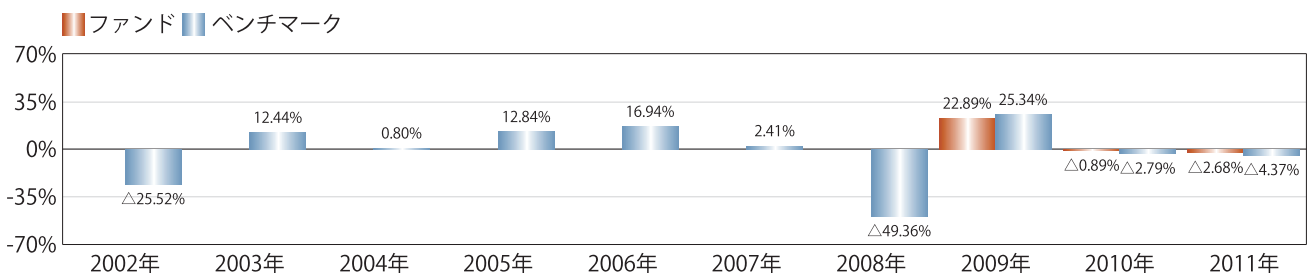
- ・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該業種の評価金額の比率をいいます。

### 組入上位銘柄（中央三井ダウ・ジョーンズ米国株式マザーファンド）

銘柄名	業種	比率
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	ソフトウェア・サービス	10.80%
CHEVRON CORP	エネルギー	5.81%
MC DONALD'S CORPORATION	消費者サービス	5.58%
CATERPILLAR INC	資本財	5.41%
3M COMPANY	資本財	4.61%
EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	4.59%
UNITED TECHNOLOGIES CORP	資本財	4.36%
COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	3.95%
BOEING COMPANY	資本財	3.90%
JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.75%
	合計	52.76%

- ・上記は、ファンドが主要投資対象としているマザーファンドの組入上位銘柄です。
- ・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

## 〈年間収益率の推移〉



- ・年間収益率は[期間中の基準価額増減+分配金(税引前)]/前年末の基準価額で算出しています。
- ・2009年はファンドの設定日から年末までの分配金(税引前)を含む基準価額の騰落率を表示しています。ベンチマークの騰落率も同様です。
- ・2011年(直近年)は年初から基準日までの分配金(税引前)を含む基準価額の騰落率を表示しています。ベンチマークの騰落率も同様です。
- ・ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しているものであり、ファンドの運用実績ではありません。

- ・運用実績は、ファンドの過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
- ・最新の運用実績は、表紙に記載の委託会社ホームページでご確認いただけます。

〈お申込みメモ〉

購 入 単 位	販売会社が定める単位とします。 (収益分配金を再投資する場合は1口単位) 詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。
購 入 価 額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額とします。 基準価額は便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。 (収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額)
購 入 代 金	販売会社が定める期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とします。
換 金 価 額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額を控除した価額とします。
換 金 代 金	原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目から支払われます。
申 込 締 切 時 間	営業日の午後3時までとします。
購 入 の 申 込 期 間	平成23年7月21日から平成24年7月20日までの間、毎営業日お申込みいただけます。 (なお、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。)
受 付 不 可 日	ニューヨーク証券取引所が休業日の場合は、購入・換金のお申込を受付けないものとします。
換 金 制 限	ありません。
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、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は購入・換金のお申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた購入・換金のお申込みの取消しを行うことがあります。
信 託 期 間	無期限(平成21年4月30日設定)
繰 上 償 還	委託会社は、次のいずれかの事由に該当する場合、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。 ・信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億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4月20日(休業日の場合は翌営業日。)です。
収 益 分 配	年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。 収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の2つの申込方法があります。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。
信 託 金 の 限 度 額	上限 1兆円
公 告	委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。
運 用 報 告 書	毎決算時に、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、知れている受益者に対して交付します。
課 税 関 係	課税上は株式投資信託として取扱われます。 原則として、分配時の普通分配金並びに換金時及び償還時の差益は課税の対象となります。

## 〈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	購入申込受付日の翌営業日の基準価額に、 <b>3.15%（税抜3.0%）</b> の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。 詳しくは販売会社にお問い合わせください。
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に <b>0.2%</b> の率を乗じて得た額とします。

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>計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に<b>年率0.7245%（税抜0.69%）</b>を乗じて得た額とします。その配分については、下記をご覧ください。 運用管理費用（信託報酬）は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。</p> <p>【運用管理費用（信託報酬）の総額及び配分】</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="2">総額</th> <th>年率 0.7245%</th> <th>（税抜 0.69%）</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td rowspan="3">（配分）</td> <td>委託会社</td> <td>年率 0.3465%</td> <td>（税抜 0.33%）</td> </tr> <tr> <td>販売会社</td> <td>年率 0.315%</td> <td>（税抜 0.3%）</td> </tr> <tr> <td>受託会社</td> <td>年率 0.063%</td> <td>（税抜 0.06%）</td> </tr> </tbody> </table>	総額		年率 0.7245%	（税抜 0.69%）	（配分）	委託会社	年率 0.3465%	（税抜 0.33%）	販売会社	年率 0.315%	（税抜 0.3%）	受託会社	年率 0.063%	（税抜 0.06%）
総額		年率 0.7245%	（税抜 0.69%）												
（配分）	委託会社	年率 0.3465%	（税抜 0.33%）												
	販売会社	年率 0.315%	（税抜 0.3%）												
	受託会社	年率 0.063%	（税抜 0.06%）												
その他の費用・手数料	<p>○以下の費用（消費税等相当額を含みます。）が、ご投資家の皆様がファンドを保有される期間中、その都度かかります。 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引に要する費用等</p> <p>○信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。</p> <p>○借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。</p> <p>上記の費用については、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>														

## 〈ファンドの税金〉

投資者が負担する税金		
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%
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%
<ul style="list-style-type: none"> <li>・上記は、平成23年11月30日現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更されることがあります。</li> <li>・法人の場合は上記とは異なります。</li> <li>・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。</li> </ul>		