

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

投資対象とする投資信託証券の追加のお知らせ

2023年3月9日

平素はダイワファンドラップをご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

「ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト」においては、株式会社 大和ファンド・コンサルティングの助言を受け、指定投資信託証券の選定、組入比率の決定を行っております。この度、投資対象とする投資信託証券の追加がありましたのでお知らせします。

■ 投資対象として新たに追加する投資信託証券

当ファンドの助言会社である株式会社 大和ファンド・コンサルティングの助言に基づき、投資対象とする投資信託証券の追加を3月9日に実施しました。

◇短期金利トレンドフォロー戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

（追加する理由）

- 本ファンドは、欧米の金利先物市場を対象としたトレンドフォロー戦略であり、リスク資産等を取り扱うヘッジファンド戦略に対し低相関で、安定的なリターンを獲得が期待できることから、本ファンドの組み入れは、「ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト」におけるパフォーマンスの向上に寄与すると考えられるため。

（運用会社）

- 大和アセットマネジメント株式会社

（主要投資対象）

- 短期金利トレンドフォロー戦略の成果に概ね連動する連動債券

※ 短期金利トレンドフォロー戦略とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・ピーエルシーが開発した、米国および欧州の金利先物を投資対象としたトレンドフォロー戦略で、短期金利からの安定的な収益獲得をめざします。

Ⅰ ファンドの目的・特色

ファンドの目的

- 各ファンドの目的は、次のとおりです。

ファンド名	ファンドの目的
FW日本株式セレクト	わが国の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。
FW外国株式セレクト	海外の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。
FW外国株式EM+	
FW日本債券セレクト	
FW外国債券セレクト	海外の債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
FW外国債券EM+	
FW J-REITセレクト	わが国のリートに投資し、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。
FW外国REITセレクト	海外のリートに投資し、信託財産の中長期的な成長と配当等収益の確保をめざします。
FWコモディティセレクト	コモディティ(商品)に関連する運用を通じて、信託財産の中長期的な成長をめざします。
FWヘッジファンドセレクト	オルタナティブ戦略・資産での運用を通じて、絶対収益 ^(注2) の獲得をめざします。

(注1)外貨建ての債券に為替ヘッジを行なう場合を含みます。

(注2)「絶対収益」とは、必ず収益を得るという意味ではなく、市場等の動きに左右されない(相対的でない)収益、という意味です。

(※)上記10本のファンドを総称して「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」といいます。

ファンドの特色

1. 「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」は、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。
 - 「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」の購入の申込みを行なう投資者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。
2. 「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」を構成する各ファンドは、投資対象が異なり、投資信託証券への投資を通じて実質的な運用を行ないます。
3. FWヘッジファンドセレクトは、オルタナティブ戦略・資産で運用を行なう複数の投資信託証券に投資を行なう「ファンド・オブ・ファンズ」です。
 - ※保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
 - ※短期の円建債券を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資する場合があります。
4. 指定投資信託証券の選定、組入比率の決定は、株式会社 大和ファンド・コンサルティングの助言を受け、これを行ないます。

◆下記は投資信託証券（指定投資信託証券等）について、目論見書作成時点で委託会社が各投資信託証券の運用会社から入手した情報をもとに記載したものであり、今後、名称変更となる場合、繰上償還等により投資信託証券が除外される場合、新たな投資信託証券が追加となる場合があります。

●FWヘッジFセレクト

投資信託証券	運用会社	主要投資対象
大和住銀Fof用ジャパン・マーケット・ニュートラル (適格機関投資家限定)	三井住友DSアセットマネジメント株式会社	わが国の株式および 株価指数先物取引等
ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ (FOFs用) (適格機関投資家専用)	ニッセイアセットマネジメント株式会社	日本および世界の 先進国の公社債および 国債先物取引等
M&Aアービトラージ戦略ファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	東京海上アセットマネジメント株式会社	世界の株式
UBSコモディティα戦略ファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	大和アセットマネジメント株式会社	コモディティ関連の 連動債券
短期金利トレンドフォロー戦略ファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用) ^(注)	大和アセットマネジメント株式会社	金利先物関連の 連動債券
マラソン新興国債券ファンド 市場リスクヘッジ・ クラス(ケイマン籍、円建)	マラソン・アセット・マネジメント・エルピー	新興国の債券等
ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ブラック ロック・ストラテジック・ファンズ」が発行する「ブラッ クロックUKエクイティ・アブソリュート・リターン・ファン ド」の円ヘッジクラスI投資証券(円建)	ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK) リミテッド	英国の株式もしくは 株式関連の派生商品等
ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「JPモルガ ン・インベストメント・ファンズ」が発行する「グローバ ル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド-JPMグ ローバル・マクロ・オポチュニティーズ(Iクラス)(円 ヘッジ)」の投資証券(円建)	JPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド	世界各国の株式、 債券等、デリバティブ 取引
アイルランド籍の外国証券投資法人「イートン・パン ス・インターナショナル(アイルランド)ファンズ・ビー エルシー」が発行する「イートン・パンス・インターナ ショナル(アイルランド)グローバル・マクロ・ファン ド」のクラスI Acc JPY(H)投資証券(円建)	MSIMファンド・マネジメント(アイルランド)リミテッド	新興国、フロンティア諸国を 含むグローバル市場の通貨、 ソブリン・クレジット、金利、 株式
ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ピクテTR」 が発行する「アトラス HJ JPY(円ヘッジ)」の投資証券 (円建)	ピクテ・アセット・マネジメント・エス・エイ、ピクテ・ アセット・マネジメント・リミテッド	世界各国の株式、 派生商品等
ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「JPモルガ ン・ファンズ」が発行する「US オポチュニスティック・ ロング・ショート・エクイティ・ファンド-US オポチュ ニスティック・ロング・ショート・エクイティ・ファンド(I クラス)(円ヘッジ)」の投資証券(円建)	JPモルガン・インベストメント・マネージメント・インク	米国の株式、 デリバティブ取引
ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ブラック ロック・ストラテジック・ファンズ」が発行する「ブラッ クロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイ ティ・アブソリュート・リターン・ファンド」のクラスI2円 ヘッジ投資証券(円建)	ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・ カンパニー、エヌ・エイ	米国、カナダ、 ラテンアメリカ諸国の 株式および株式関連 の派生商品等
ケイマン籍の外国投資法人「ナインティーンセプンティ セブン・グローバル・マーチャーズ・アービトラージ・ジャパ ン・リミテッド」が発行する「ナインティーンセプンティセ ブン・グローバル・マーチャーズ・アービトラージ・ジャパ ン・リミテッド」のJPYクラス投資証券(円建)	UBSオコーナー・エルエルシー	世界各国の株式、 デリバティブ取引など
アイルランド籍の外国証券投資法人「ノムラ・ファン ズ・アイルランド」が発行する「グローバル・ダイナ ミック・ボンド・ファンド」のI JPYヘッジクラス投資 証券(円建)	ノムラ・アセット・マネジメント U.K. リミテッド	世界の債券および 債券関連証券等

(注)については、2023年3月9日に追加となりました。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「ファンドの目的・特色」をご覧ください。

投資リスク

- 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。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

「株価（価格変動リスク・信用リスク）」、「公社債の価格（価格変動リスク・信用リスク、ハイ・イールド債券への投資リスク、転換社債への投資リスク）」、「デリバティブ取引の利用に伴うリスク」、「外国為替予約取引の利用に伴うリスク」、「オルタナティブ戦略・資産にかかるリスク・留意点」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「その他（解約申込みに伴うリスク等）」

※新興国には先進国とは異なる新興国市場のリスクなどがあります。

※株式を売建てしている場合、当該銘柄の株価が上昇した場合には、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。

※投資する指定投資信託証券において為替ヘッジを行なう場合、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、日本円の金利が組入外貨建資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※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。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「投資リスク」をご覧ください。

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
購入時手数料	販売会社が別に定める率 ※徴収している販売会社はありません。	—
信託財産留保額	ありません。	—
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
運用管理費用 (信託報酬)	年率0.484% (税抜0.44%)	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左記の率を乗じて得た額とします。
投資対象とする 投資信託証券	年率0.2981% (税抜0.271%) ~ 年率上限2.02% ただし、実績報酬制をとる投資対象ファンドの運用成果によっては、これを上回ることがあります。	投資対象ファンドにおける運用管理費用等です。
実質的に負担する 運用管理費用の概算値 (2023年1月時点)	年率1.5263% (0.9821%~2.5040%) 程度 (税込) (実際の組入状況等により変動します。)	
その他の費用・ 手数料	(注)	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。

(注)「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。

※運用管理費用の信託財産からの支払いは、毎計算期間の最初の6か月終了日（休業日の場合翌営業日）および毎計算期末または信託終了時に行なわれます。

※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、表示することができません。また、上場不動産投資信託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。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「手続・手数料等」をご覧ください。

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

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

当資料のお取扱いにおけるご注意

- 当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメントが作成したものです。
- 当ファンドの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。記載する投資判断は現時点のものであり、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。
- 当資料中で個別企業名が記載されている場合、あくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。
- 分配金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。