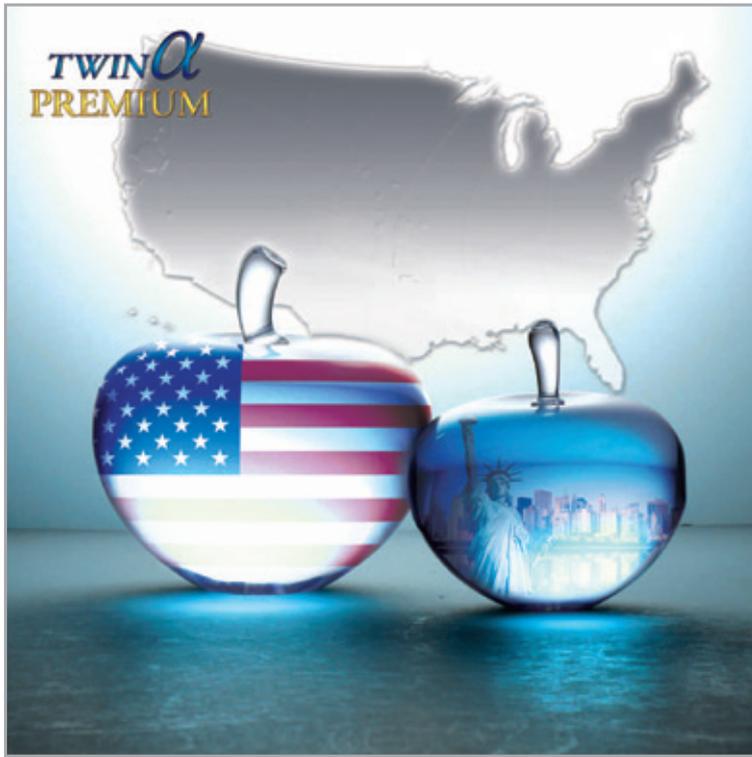


使用開始日 2024年1月12日

投資信託説明書 (交付目論見書)

ダイワ米国株主還元株ツイン α プレミアム (毎月分配型 / 年2回決算型)

追加型投信 / 海外 / 株式



ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読み下さい。

■委託会社 (ファンドの運用の指図等を行ないます。)

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

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

■受託会社 (ファンドの財産の保管、管理等を行ないます。)

みずほ信託銀行株式会社

■委託会社の照会先



ホームページ

<https://www.daiwa-am.co.jp/>



コールセンター 受付時間 9:00 ~ 17:00 (営業日のみ)

0120-106212



■ファンドに関する投資信託説明書 (請求目論見書) を含む詳細な情報は委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードすることができます。また、本書には約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。

■本文書は、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。

UD
FONT

見やすく読みまちがえにくい
ユニバーサルデザインフォント
を採用しています。

- ◆以下、各ファンドの略称としてそれぞれ次を用いることがあります。
 ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型):毎月分配型
 ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型):年2回決算型
- ◆各ファンドの総称を「ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム」とします。

[ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型)]

| 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) | 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 |
| 追加型 | 海外 | 株式 | その他資産(投資信託証券(株式 一般)) | 年12回(毎月) | 北米 | ファンド・オブ・ファンズ | なし |

[ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型)]

| 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) | 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 |
| 追加型 | 海外 | 株式 | その他資産(投資信託証券(株式 一般)) | 年2回 | 北米 | ファンド・オブ・ファンズ | なし |

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

※商品分類・属性区分の定義について

くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ[<http://www.toushin.or.jp/>]をご参照下さい。

大和アセットマネジメントでは、毎月分配型のファンドを、次の方にふさわしい運用商品と考えています。

- 年金の補完などを目的として、定期的に資産を取り崩すニーズがある方。
- 以下の分配金の仕組みを理解し、投資信託の運用を続けながら分配金を毎月受け取りたい方。
- ファンドの購入価額や運用状況によっては、分配金の一部または全部が実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。(複利効果を重視して長期的な資産形成をお考えの方には、毎月分配型のファンドは適していません。)
- 分配金は計算期間中の収益を超えて支払われることがあり、分配金の水準は必ずしもファンドの収益率を示すものではありません。

〈委託会社の情報〉

| | |
|--------------------|------------------|
| 委託会社名 | 大和アセットマネジメント株式会社 |
| 設立年月日 | 1959年12月12日 |
| 資本金 | 151億74百万円 |
| 運用する投資信託財産の合計純資産総額 | 25兆7,390億28百万円 |
| | (2023年10月末現在) |

- 本文書により行なう「ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム」の募集については、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2024年1月11日に関東財務局長に提出しており、2024年1月12日にその届出の効力が生じています。
- 当ファンドは、商品内容に関して重大な変更を行なう場合に、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき、事前に受益者の意向を確認する手続きを行ないます。
- 当ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産等との分別管理等が義務付けられています。
- 請求目論見書は、投資者の請求により販売会社から交付されます(請求を行なった場合には、その旨をご自身で記録しておくようにして下さい)。

ファンドの目的

継続的に株主還元を行なう米国企業の株式へ投資するとともに、個別株式および通貨のカバードコール戦略を組み合わせることで、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

ファンドの特色

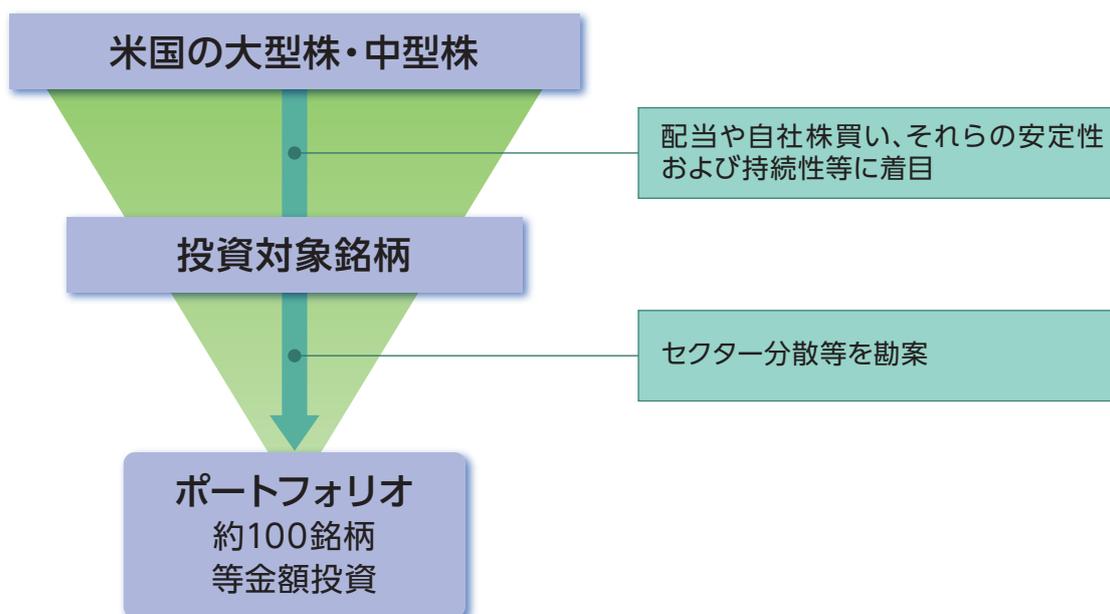
1 継続的に株主還元を行なう米国企業の株式に投資します。

(注)当ファンドにおいて、株主還元とは、配当支払いおよび自社株買いをいいます。

◆ 株式への投資にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。

- 米国の大型株・中型株の中から、配当や自社株買い、それらの安定性および持続性等に着目し、投資対象銘柄を選定します。
- 投資対象銘柄の中から、セクター分散等を勘案し、約100銘柄を選定します。
- 選定した約100銘柄に原則として等金額で投資を行ないます。

ポートフォリオ構築のイメージ



2 個別株式のカバードコール戦略を活用します。

◆ オプションプレミアムの獲得と株式の値上がり益をあわせたトータルリターンを追求します。

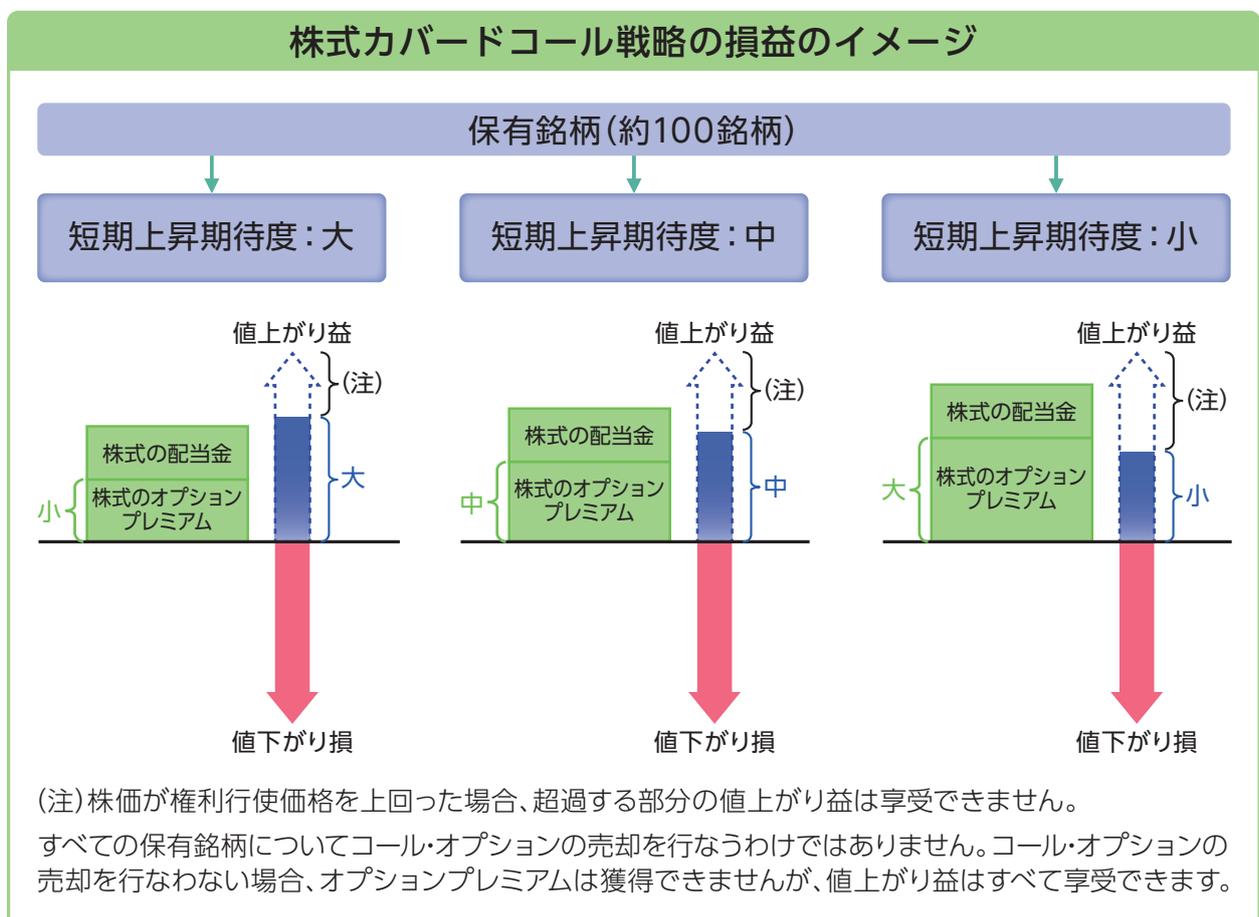
● 独自の定量分析に基づく個別銘柄の短期的な株価上昇期待度などをもとに、保有銘柄を3つのグループに分類し、グループごとにオプションの権利行使価格を設定します。

● 保有銘柄ごとに、当該株式のコール・オプションの売却を機動的に行ないます。

※「オプションプレミアム」とは、オプションの買い手が売り手に支払う対価をいいます。

※「権利行使価格」とは、オプションの権利行使の基準となる当該資産の価格をいいます。

他の条件を一定として、一般に権利行使価格が低いほど、コール・オプションを売却した際に得られるオプションプレミアムは高くなります。



※上記はイメージであり、実際の株価、配当金、オプションプレミアムとは異なります。また、投資成果を示唆または保証するものではありません。

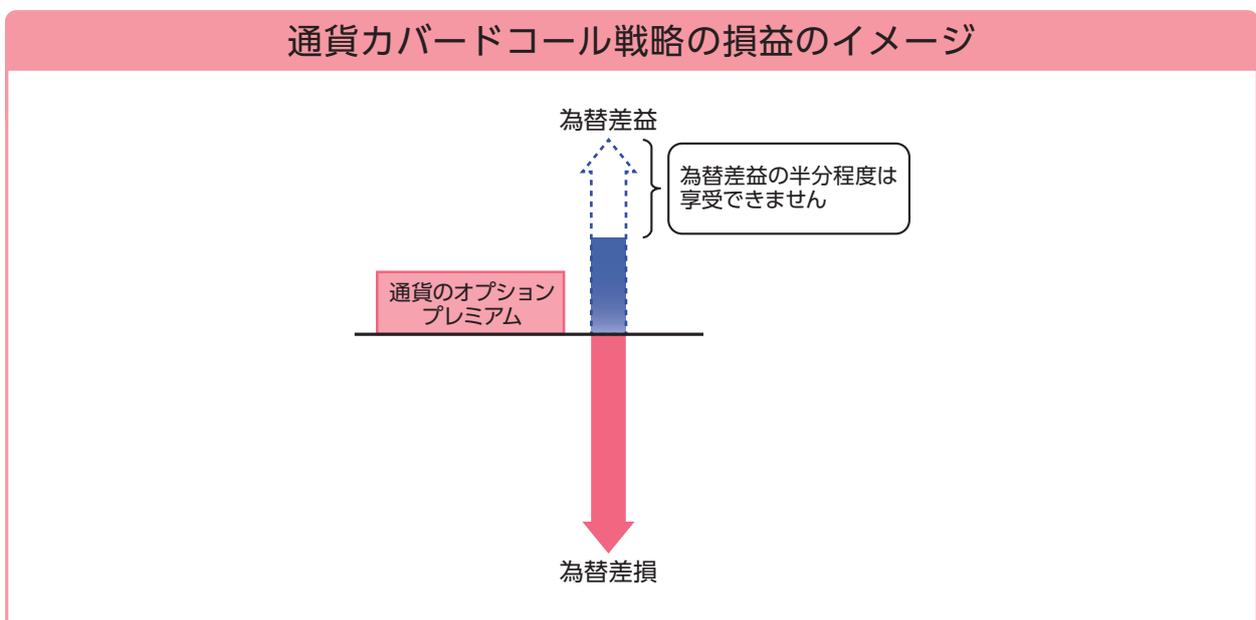
※上記は個別銘柄ごとに、保有株数の全部にかかるコール・オプションを売却した場合の、1つの権利行使期間における損益を表したものであり、当ファンド全体の損益を示したものではありません。

※上記は株式の配当金の支払いおよびオプションプレミアムの獲得があったことを前提として損益を表したものです。

※当ファンドにおいて、株式カバードコール戦略の損益は毎営業日に時価評価され、基準価額に反映されます。

3 通貨のカバードコール戦略を活用します。

- ◆ 円に対する米ドルのコール・オプションの売りを行いません。
- ◆ オプションのカバー率を純資産総額の50%程度とすることにより、米ドルの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざします。
※カバードコール戦略の比率は、運用環境等により50%から大きく乖離する場合があります。
- ◆ 権利行使価格がカバードコール戦略構築時の対象資産の価格と同水準のコール・オプションを売却します。



※上記はイメージであり、実際の為替水準、オプションプレミアムとは異なります。また、投資成果を示唆または保証するものではありません。

※上記は、純資産総額の50%にかかるコール・オプションを売却した場合の、1つの権利行使期間における損益を表したものであり、当ファンド全体の損益を示したものではありません。

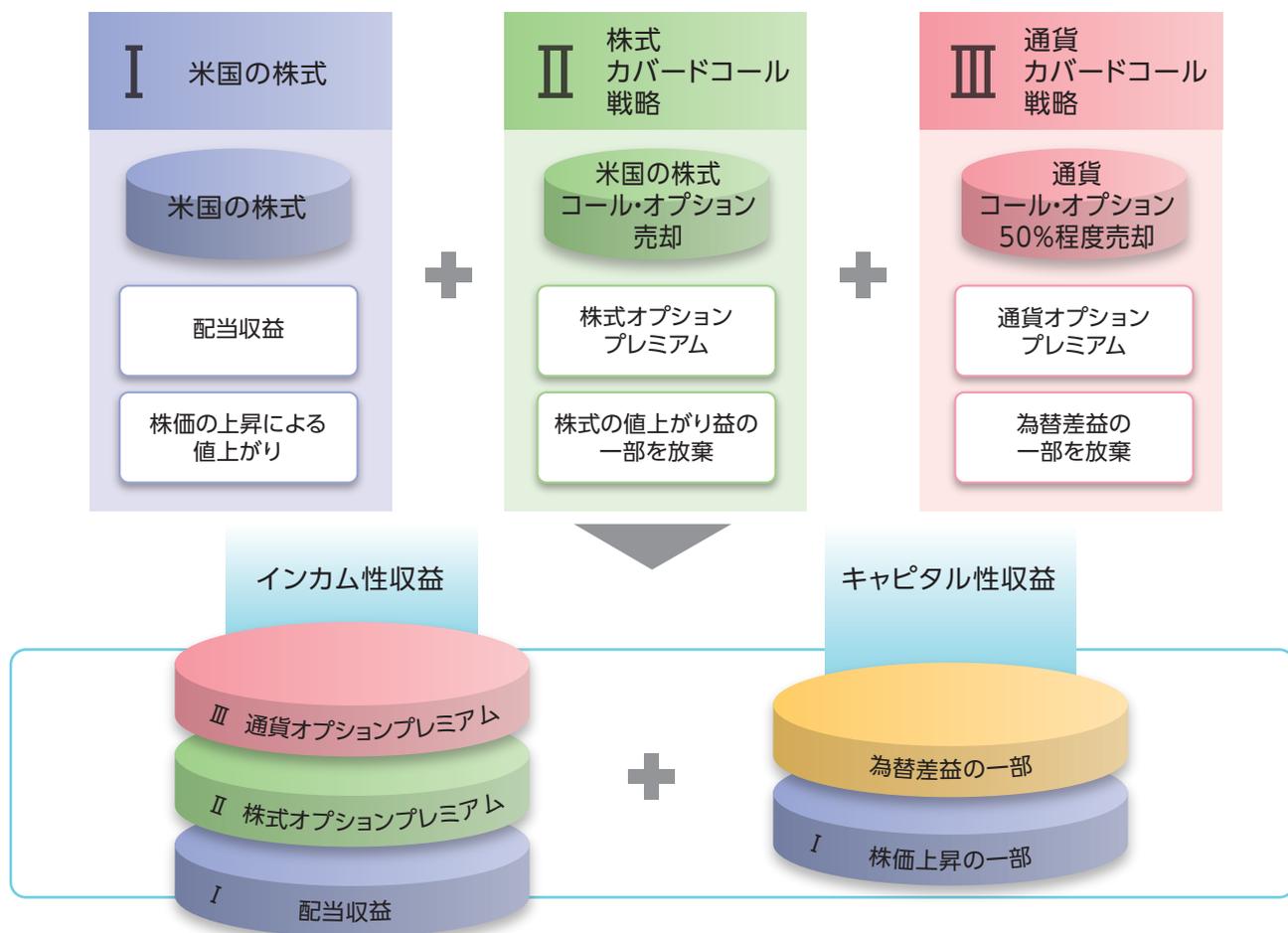
※当ファンドにおいて、通貨カバードコール戦略の損益は毎営業日に時価評価され、基準価額に反映されます。

株式・通貨カバードコール戦略の効果について

- 株価(または円に対する米ドルの為替レート)の上昇/下落にかかわらず、オプションプレミアムを獲得することができます。
- 株価(または円に対する米ドルの為替レート)が上昇した場合、利益が発生しますが、株式の値上がり益の一部(または為替差益の半分程度)は享受できません。
- 株価(または円に対する米ドルの為替レート)が下落した場合、損失が発生しますが、オプションプレミアムにより損失が軽減されることで、収益の改善が期待できます。

ファンドの目的・特色

当ファンドの収益の源泉のイメージ



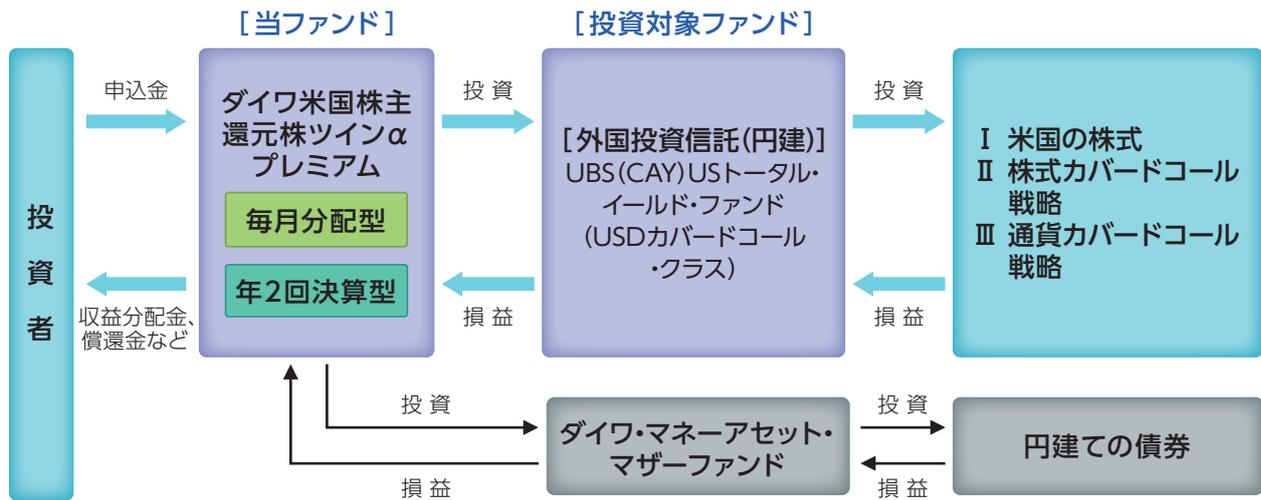
※上記はイメージであり、当ファンドの投資成果を示唆または保証するものではありません。

※上記は、収益の源泉についてのイメージであり、キャピタル性収益部分については、損失となる場合があります。

米国の株式、株式および通貨カバードコール戦略の運用については、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジーが行ないます。

ファンドの仕組み

◆ 当ファンドは、以下の2本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



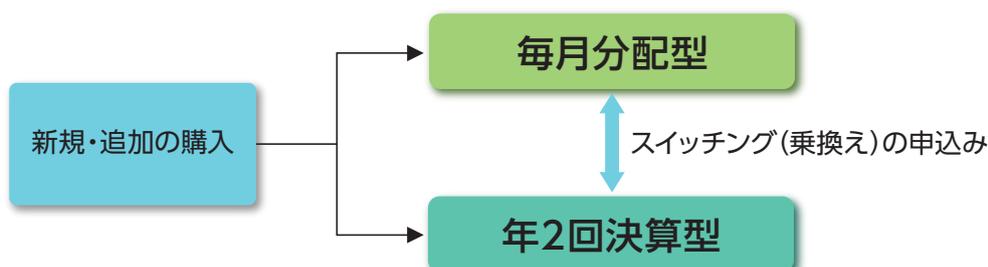
※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

- ◆ 当ファンドは、通常の状態では、投資対象とする外国投資信託への投資割合を高位に維持することを基本とします。
- ◆ 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。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される とき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～3.の運用が行なわれないことがあります。

4 「毎月分配型」と「年2回決算型」の2つのファンドがあります。

◆ 各ファンド間でスイッチング(乗換え)を行なうことができます。



ファンドの目的・特色

5 2つのファンドは、それぞれ毎月または年2回決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

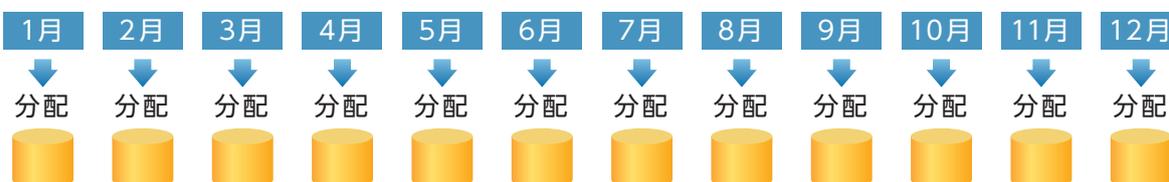
毎月分配型

毎月18日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

[分配方針]

- 1 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- 2 原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



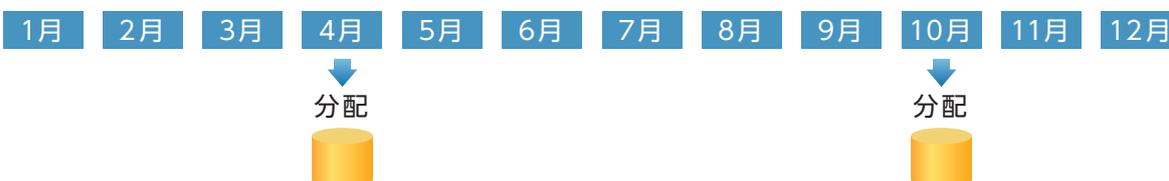
年2回決算型

毎年4月18日および10月18日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

[分配方針]

- 1 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- 2 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



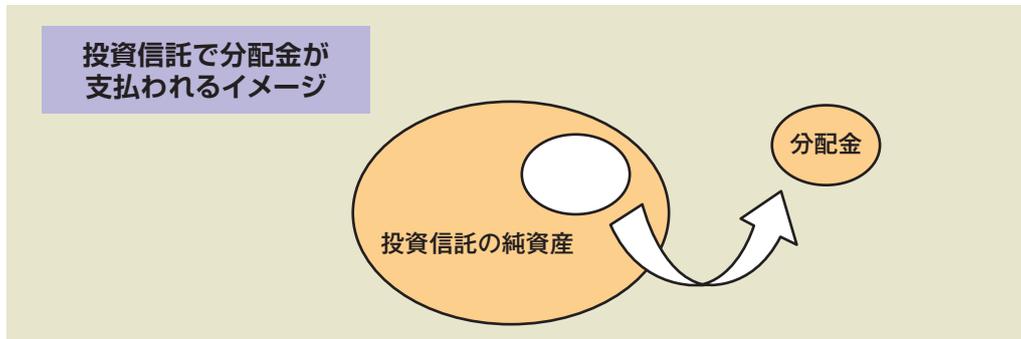
※上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
※ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

主な投資制限

- 株式への直接投資は、行ないません。
- 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

[収益分配金に関する留意事項]

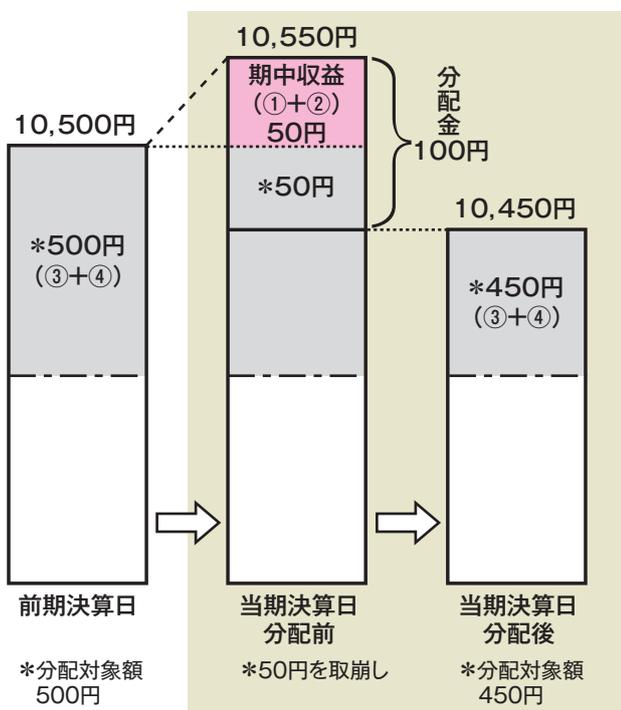
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



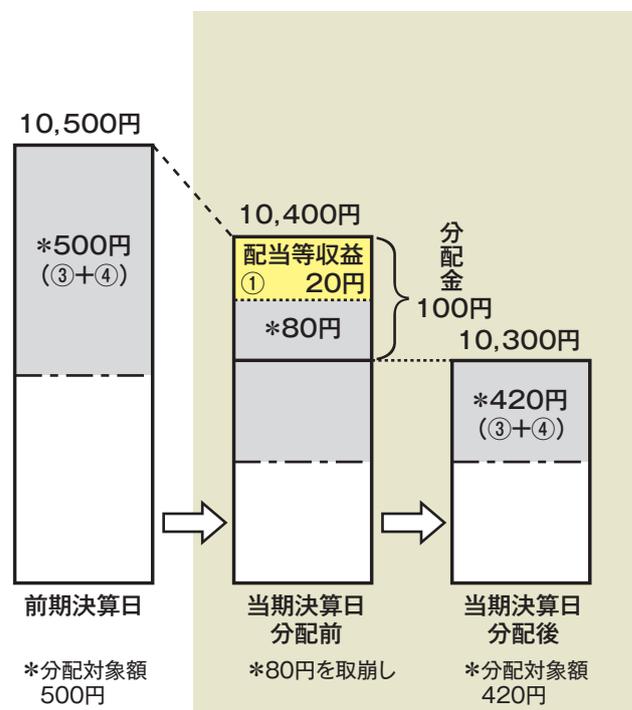
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)

(前期決算日から基準価額が上昇した場合)



(前期決算日から基準価額が下落した場合)



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

- 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がかさかった場合も同様です。

(注) 「手続・手数料等」の「税金」の部分にイメージ図を記載。

[投資対象ファンドの概要]

1. UBS (CAY) USトータル・イールド・ファンド (USDカバードコール・クラス)

| | |
|-----------|--|
| 形態 / 表示通貨 | ケイマン籍の外国投資信託 / 円建 |
| 運用の基本方針 | 主として、配当支払いと自社株買いによる継続的な株主還元を行なう米国企業の株式へ投資するとともに、個別株式および通貨のカバードコール戦略を組み合わせることで、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。 |
| 主な運用方針 | <ol style="list-style-type: none"> 主として、配当支払いと自社株買いによる継続的な株主還元を行なう米国企業の株式へ投資するとともに、個別株式および通貨のカバードコール戦略を組み合わせることで、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。 株式への投資にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。 <ul style="list-style-type: none"> 米国の大型株・中型株の中から、配当や自社株買い、それらの安定性および持続性等に着目し、投資対象銘柄を選定します。 投資対象銘柄の中から、セクター分散等を勘案し、約100銘柄を選定します。 選定した約100銘柄に原則として等金額で投資を行ないます。 個別株式のカバードコール戦略の構築にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。 <ul style="list-style-type: none"> 独自の定量分析に基づく個別銘柄の短期的な株価上昇期待度などをもとに、約100銘柄を3つのグループに分類し、グループごとにオプションの権利行使価格を設定します。 保有銘柄ごとに、当該株式のコール・オプションの売却を機動的に行なうことで、オプションプレミアムの獲得と株式の値上がり益をあわせたトータルリターンを追求します。 通貨カバードコール戦略の活用により、オプションプレミアムの確保をめざします。通貨カバードコール戦略では、円に対する米ドルのコール・オプションの売りを行ないます。オプションのカバー率は通常、当クラスの純資産総額の50%程度とすることにより、米ドルの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざします。 |
| 管理報酬等 | 純資産総額に対して年率0.705%程度 (監査費用、弁護士費用等を含みます。) ただし、その他ファンドの運営に必要な各種経費等がかかります。 |
| 投資顧問会社 | UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー |

UBSアセット・マネジメントについて

- UBSアセット・マネジメント・グループは、UBSグループの資産運用部門として、約173兆円の資産を運用するグローバルな資産運用グループです。(2023年9月末現在)
- UBSグループは、スイスを本拠地とする総合金融機関です。プライベート・バンキング、資産運用、投資銀行などの業務をグローバルに展開しています。

2. ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

| | |
|------------------|---|
| 運用の基本方針 | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主な投資態度 | ①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。 |
| 運用管理費用 (信託報酬) | かかりません。 |
| 委託会社 | 大和アセットマネジメント株式会社 |

基準価額の変動要因

- 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。

主な変動要因

| | |
|--|--|
| <p>株 価 の 変 動 (価 格 変 動 リ ス ク ・ 信 用 リ ス ク)</p> | <p>株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。組入銘柄の株価が下落した場合には、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。</p> |
| <p>為 替 変 動 リ ス ク</p> | <p>外貨建資産については、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、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。</p> |
| <p>カバードコール 戦略の利用に 伴うリスク</p> | <p>〈株式カバードコール戦略〉</p> <ul style="list-style-type: none"> ・オプションプレミアムの水準は、オプション売却時の株価水準、権利行使価格、株価変動率(ボラティリティ)、満期日までの期間、金利水準、配当金額、需給等により決定されるため、変動します。 ・株価水準や株価変動率の変動等によりコール・オプションの評価値が変動し、損失を被る場合があります。 ・株式カバードコール戦略では、株価が上昇した場合の値上がり益が限定されるため、株式のみに投資した場合に対して投資成果が劣後する可能性があります。戦略再構築を重ねた場合、株価が下落しその後当初の水準程度まで回復しても、基準価額の回復は株価に比べて緩やかになる可能性があります。 ・株式カバードコール戦略では個別銘柄ごとにカバードコール戦略を構築するため、株価上昇時の値上がり益が個別銘柄ごとに限定される結果、投資成果が株式市場全体の動きに対して劣後する可能性があります。 <p>〈通貨カバードコール戦略〉</p> <ul style="list-style-type: none"> ・オプションプレミアムの水準は、オプション売却時の為替水準、権利行使価格、為替変動率(ボラティリティ)、満期日までの期間、金利水準、需給等により決定されるため、変動します。 ・為替水準や為替変動率の変動等によりコール・オプションの評価値が変動し、損失を被る場合があります。 ・通貨カバードコール戦略では、円に対する米ドルの為替レートが上昇した場合の為替差益が限定されるため、通貨カバードコール戦略を構築しなかった場合に対して投資成果が劣後する可能性があります。戦略再構築を重ねた場合、円に対する米ドルが下落しその後当初の水準程度まで回復しても、基準価額の回復は為替レートに比べて緩やかになる可能性があります。 |

| | |
|-----------|---|
| カントリー・リスク | 投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。 |
| そ の 他 | 解約資金を手当てするためカバードコール戦略を解消(株式の売却およびオプションの買戻し)する際、市場規模や市場動向によっては当初期待される価格で解消できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。 |

※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

- 当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。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短時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、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。
- 当ファンドは、忠実義務に基づき、投資する投資信託証券について、その価格が入手できない、または入手した価格で評価すべきでないと考えられる場合には、適正と判断する直近の日の価格など当社が時価と認める価格で評価することがあります。

リスクの管理体制

- 委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に関する基本方針に基づき、運用本部から独立した部署および会議体が直接的または間接的に運用本部へのモニタリング・監視を通し、運用リスクの管理を行ないます。
- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

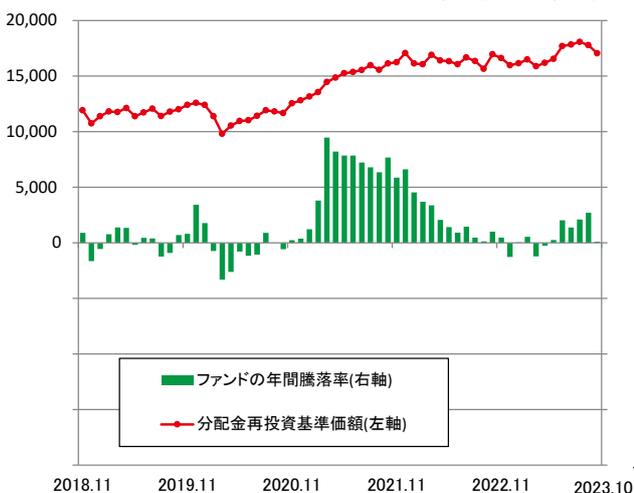
参考情報

●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

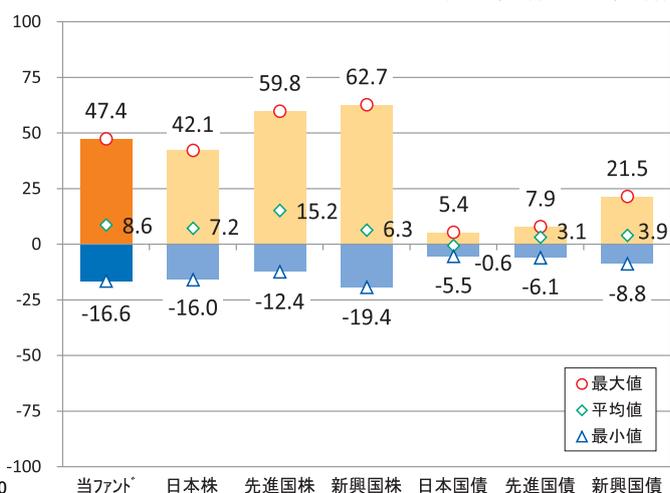
[ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型)]

(円) (2018年11月～2023年10月) (%)



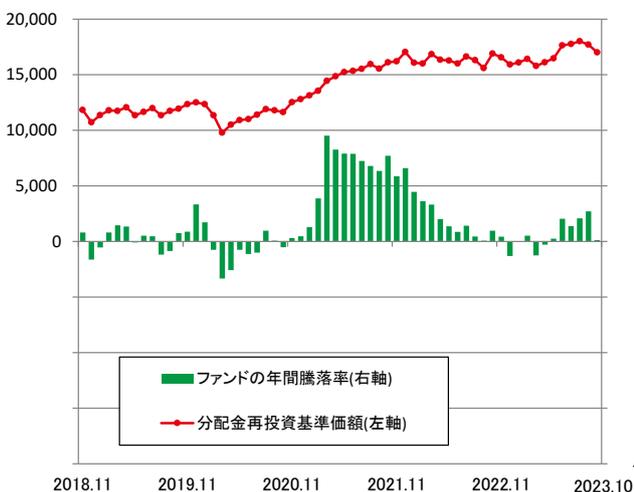
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2018年11月～2023年10月)

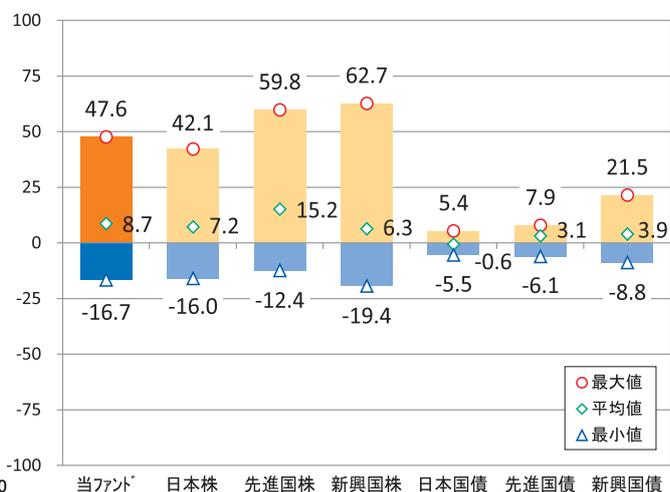


[ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型)]

(円) (2018年11月～2023年10月) (%)



(2018年11月～2023年10月)



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：配当込みTOPIX

先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。〔<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>〕●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

運用実績

●ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型)

2023年10月31日現在

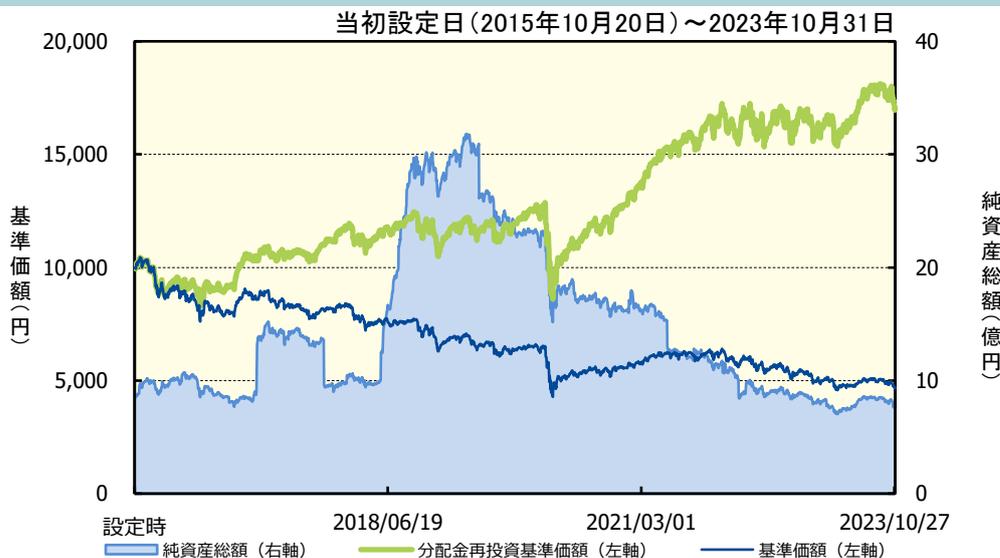
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

| | |
|-------|--------|
| 基準価額 | 4,669円 |
| 純資産総額 | 7.5億円 |

基準価額の騰落率

| 期間 | ファンド |
|------|-------|
| 1か月間 | -4.2% |
| 3か月間 | -4.4% |
| 6か月間 | 5.3% |
| 1年間 | 0.5% |
| 3年間 | 46.1% |
| 5年間 | 46.9% |
| 設定来 | 70.4% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 810円

設定来分配金合計額: 8,650円

| 決算期 | 第83期 | 第84期 | 第85期 | 第86期 | 第87期 | 第88期 | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 | 第94期 |
|-----|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| | 22年11月 | 22年12月 | 23年1月 | 23年2月 | 23年3月 | 23年4月 | 23年5月 | 23年6月 | 23年7月 | 23年8月 | 23年9月 | 23年10月 |
| 分配金 | 80円 | 80円 | 80円 | 80円 | 80円 | 80円 | 80円 | 50円 | 50円 | 50円 | 50円 | 50円 |

※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があります。

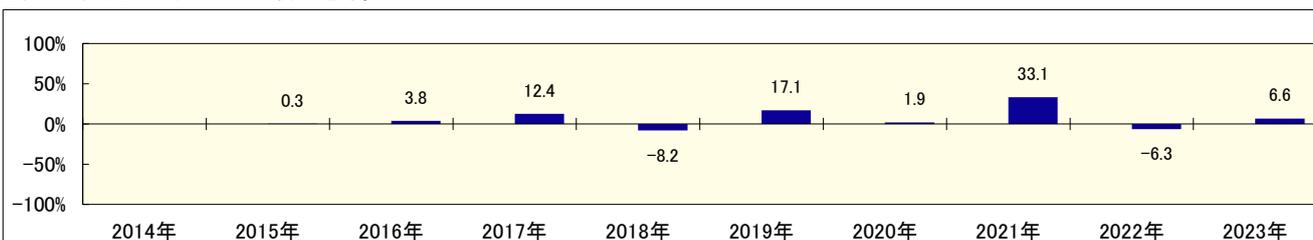
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 組入上位10ファンド | | |
|--------------------------|--|-------|
| 運用会社名 | ファンド名 | 比率 |
| UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー | UBS(GAY)USトータル・イールド・ファンド(USDカバードコール・クラス) | 98.5% |
| 大和アセットマネジメント | ダイワ・マネーアセット・マザーファンド | 0.1% |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| 合計 | | 98.6% |

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2015年は設定日(10月20日)から年末、2023年は10月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

●ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型)

2023年10月31日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 16,894円 |
| 純資産総額 | 11百万円 |

基準価額の騰落率

| 期間 | ファンド |
|------|-------|
| 1か月間 | -4.0% |
| 3か月間 | -4.3% |
| 6か月間 | 5.6% |
| 1年間 | 0.7% |
| 3年間 | 46.1% |
| 5年間 | 47.8% |
| 設定来 | 70.1% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。 ※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 10円 設定来分配金合計額: 90円

| 決算期 | 第5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 | 第11期 | 第12期 | 第13期 | 第14期 | 第15期 | 第16期 |
|-----|-------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|
| | 18年4月 | 18年10月 | 19年4月 | 19年10月 | 20年4月 | 20年10月 | 21年4月 | 21年10月 | 22年4月 | 22年10月 | 23年4月 | 23年10月 |
| 分配金 | 0円 | 10円 | 10円 | 0円 | 0円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 0円 | 0円 | 10円 |

※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。

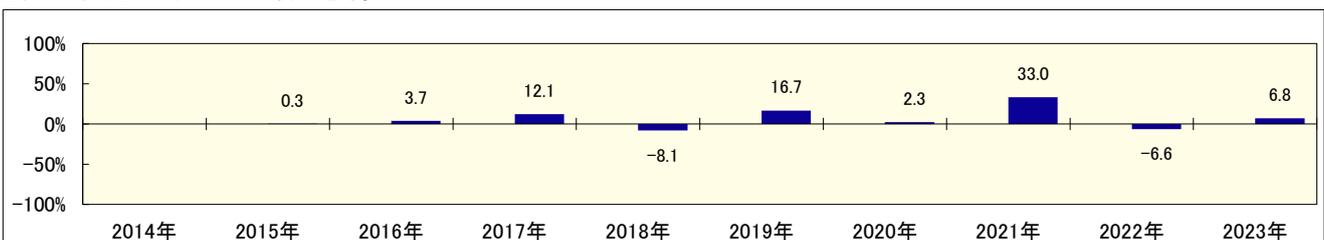
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 組入上位10ファンド | | |
|--------------------------|--|-------|
| 運用会社名 | ファンド名 | 比率 |
| UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー | UBS(GAY)USトータル・イールド・ファンド(USDカバードコール・クラス) | 98.3% |
| 大和アセットマネジメント | ダイワ・マネーアセット・マザーファンド | 0.1% |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| 合計 | | 98.3% |

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2015年は設定日(10月20日)から年末、2023年は10月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

お申込みメモ

| | |
|--------------------|---|
| 購入単位 | 最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位 |
| 購入価額 | 購入申込受付日の翌営業日の基準価額(1万口当たり) |
| 購入代金 | 販売会社が定める期日までにお支払い下さい。 |
| 換金単位 | 最低単位を1口単位として販売会社が定める単位 |
| 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(1万口当たり) |
| 換金代金 | 原則として換金申込受付日から起算して6営業日目からお支払いします。 |
| 申込受付中止日 | ① ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、スイス証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行またはチューリッヒの銀行のいずれかの休業日 ② ①のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日 ※ただし、購入申込みについては、当ファンドの運営および受益者に与える影響を考慮して受付けを行なうことがあります。 (注) 申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。 |
| 申込締切時間 | 午後3時まで(販売会社所定の事務手続きが完了したもの) |
| 購入の申込期間 | 2024年1月12日から2024年7月11日まで (終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。) |
| 換金制限 | 信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の換金申込みには制限があります。 |
| 購入・換金申込受付の中止および取消し | 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発生した場合には、購入、換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けた購入の申込みを取消すことがあります。 |
| スイッチング(乗換え) | [毎月分配型]および[年2回決算型]の間でスイッチング(乗換え)を行なうことができます。 |
| 信託期間 | 2015年10月20日から2025年10月17日まで 受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長できます。 |
| 繰上償還 | ●主要投資対象とする組入外国投資信託が存続しないこととなる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。 ●次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、繰上償還できます。 ・受益権の口数が30億口を下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 | [毎月分配型] 毎月18日(休業日の場合翌営業日) [年2回決算型] 毎年4月18日および10月18日(休業日の場合翌営業日) |
| 収益分配 | [毎月分配型] 年12回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 [年2回決算型] 年2回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 (注) 当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。なお、お取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。 |
| 信託金の限度額 | 各ファンドについて2,000億円 |

| | |
|-------|---|
| 公 告 | 電子公告の方法により行ない、ホームページ〔 https://www.daiwa-am.co.jp/ 〕に掲載します。 |
| 運用報告書 | [毎月分配型]については毎年4月および10月の計算期末ならびに償還時、[年2回決算型]については毎計算期末および償還時に作成し、交付運用報告書をあらかじめお申出いただいたご住所にお届けします。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。 |
| 課税関係 | 課税上は株式投資信託として取扱われます。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA(少額投資非課税制度)の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの対象ではありません。 ※2023年10月末現在のものであり、税法が改正された場合等には変更される場合があります。 |

ファンドの費用・税金

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 (上限) <u>3.3%(税抜3.0%)</u> | 購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。 |
| 信託財産留保額 | <u>0.20%</u> | 換金に伴い必要となる費用等を賄うため、換金代金から控除され、信託財産に繰入れられる額。 換金申込受付日の翌営業日の基準価額に対して左記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

| | 料率等 | 費用の内容 |
|--------------------|-------------------------|---|
| 運用管理費用 (信託報酬) | 年率1.3475% (税抜1.225%) | 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。運用管理費用は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。 |
| 配分 (税抜) (注1) | 委託会社 | 年率0.40% |
| | 販売会社 | 年率0.80% |
| | 受託会社 | 年率0.025% |
| 投資対象とする 投資信託証券 | 年率0.705%程度 | 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 | <u>年率2.0525%(税込)程度</u> | |
| その他の費用・ 手数料 | (注2) | 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1)「運用管理費用の配分」には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

(注2)「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。

※購入時手数料について、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

※運用管理費用の信託財産からの支払いは、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。

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 | 所得税および 地方税 | 配当所得として課税 ^(注) 普通分配金に対して20.315% |
| 換金(解約)時および 償還時 | 所得税および 地方税 | 譲渡所得として課税 ^(注) 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315% |

(注)所得税、復興特別所得税および地方税が課されます。

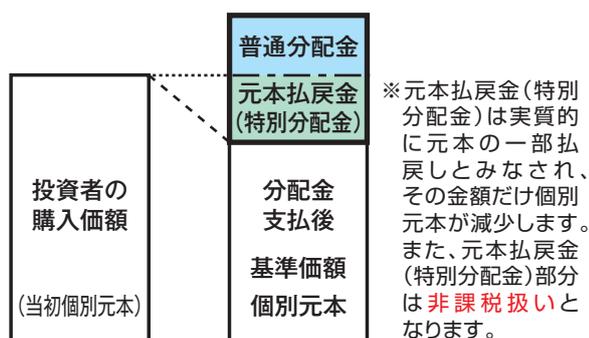
※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2023年10月末現在のもので、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。

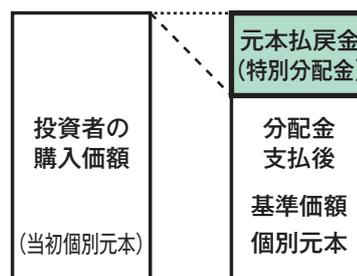
※法人の場合は上記とは異なります。

※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。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金 … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ(特別分配金)減少します。

(参考情報) ファンドの総経費率

| | 総経費率(①+②) | 運用管理費用の比率① | その他費用の比率② |
|---------------------------------|-----------|------------|-----------|
| ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (毎月分配型) | 2.79% | 1.34% | 1.45% |
| ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (年2回決算型) | 2.78% | 1.34% | 1.44% |

※対象期間は2023年4月19日～2023年10月18日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。)を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した値(年率)です。

※その他費用には、投資先ファンドにかかる費用が含まれています。

※投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

※投資先ファンドの費用について、計上された期間が異なる場合があります。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。