

## ダイワ日本企業外債ファンドS(為替ヘッジあり)2016-04

単位型投信／海外／債券

信託期間：2016年4月25日 から 2021年3月10日 まで

基準日：2021年2月26日

決算日：毎年3月10日および9月10日(休業日の場合翌営業日)

回次コード：3607

※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。

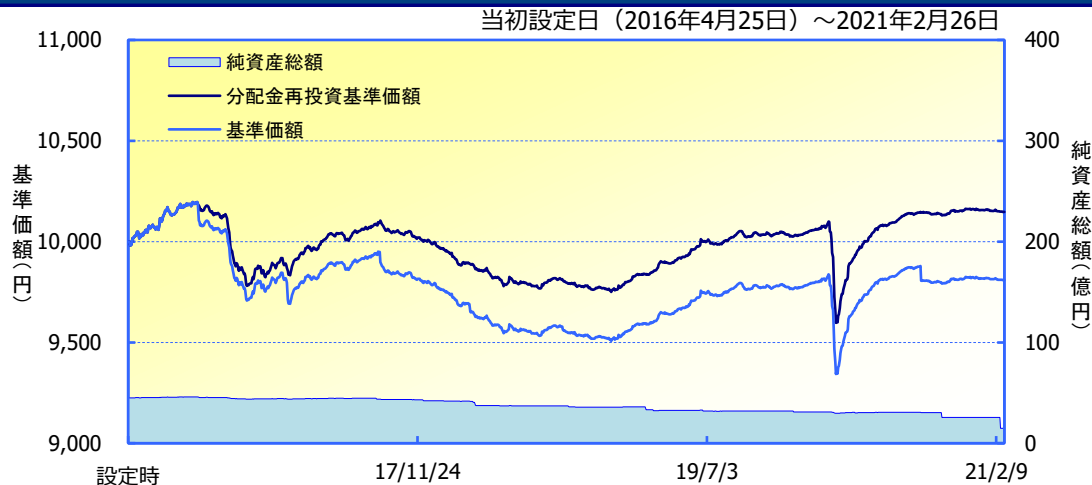
## 《基準価額・純資産の推移》

2021年2月26日現在

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 9,809 円 |
| 純資産総額 | 14億円    |

## 期間別騰落率

| 期間   | ファンド   |
|------|--------|
| 1カ月間 | -0.1 % |
| 3カ月間 | -0.1 % |
| 6カ月間 | +0.1 % |
| 1年間  | +0.7 % |
| 3年間  | +2.6 % |
| 5年間  | -----  |
| 年初来  | -0.1 % |
| 設定来  | +1.5 % |



※「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、運用管理費用(信託報酬)は控除しています(後述のファンドの費用をご覧ください)。

※「期間別騰落率」の各計算期間は、基準日から過去に遡った期間とし、当該ファンドの「分配金再投資基準価額」を用いた騰落率を表しています。

※実際のファンドでは、課税条件によって投資者ごとの騰落率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。

## 《分配の推移》

(1万口当たり、税引前)

| 決算期(年/月)    | 分配金      |
|-------------|----------|
| 第1期 (16/09) | 75円      |
| 第2期 (17/03) | 70円      |
| 第3期 (17/09) | 60円      |
| 第4期 (18/03) | 35円      |
| 第5期 (18/09) | 10円      |
| 第6期 (19/03) | 5円       |
| 第7期 (19/09) | 5円       |
| 第8期 (20/03) | 5円       |
| 第9期 (20/09) | 70円      |
| 分配金合計額      | 設定来：335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。

| 資産別構成        | 資産  | 銘柄数 | 比率     |
|--------------|-----|-----|--------|
| コール・ローン、その他※ |     |     | 100.0% |
| 合計           | --- |     | 100.0% |

※外貨キャッシュ、経過利息等を含みます。

| 通貨別構成 | 通貨 | 比率     |
|-------|----|--------|
| 日本円   |    | 100.0% |

## 《ファンドマネージャーのコメント》

## ＜運用概況＞

当ファンドでは満期償還日に向けて、月上旬よりわが国の短期金融資産等を中心とした安定運用に移行いたしました。これまで長きにわたり、当ファンドをご愛顧賜り、誠にありがとうございました。

■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により作成されたものです。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。後述の当資料のお取り扱いにおけるご注意をよくお読みください。

設定・運用：

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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  
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

加入協会

# << 基準価額の変動要因分解 >>

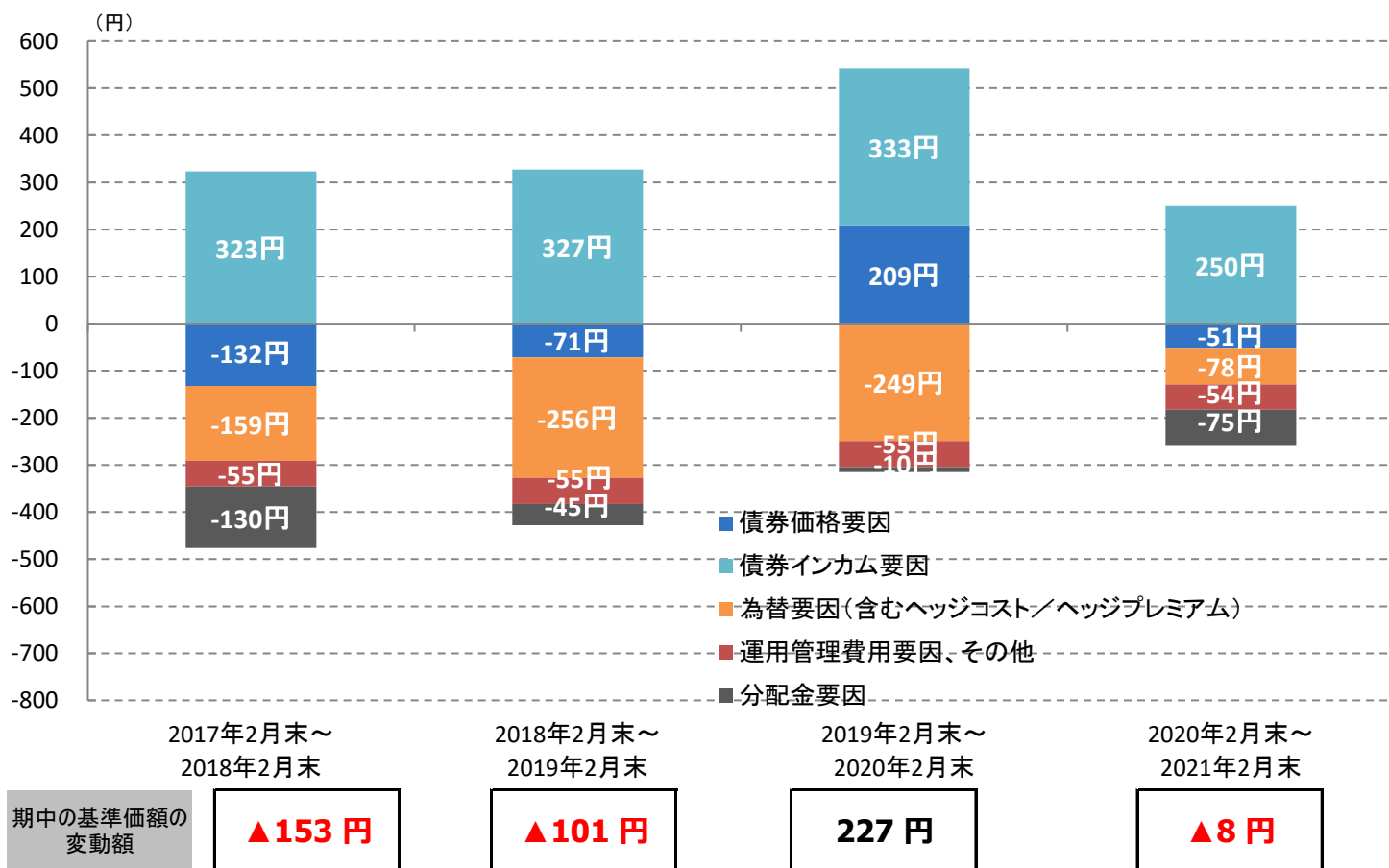
## 基準価額の月次変動要因分解

|                           |         |
|---------------------------|---------|
| 2021年2月末                  | 9,809 円 |
| 2021年1月末                  | 9,814 円 |
| 変動額                       | ▲5 円    |
| 債券価格要因                    | ▲7 円    |
| 債券インカム要因                  | 7 円     |
| 為替要因(含む為替ヘッジコスト/ヘッジプレミアム) | ▲2 円    |
| 運用管理費用要因、その他              | ▲4 円    |
| 分配金要因                     | 0 円     |

## 基準価額の設定来変動要因分解

|                           |          |
|---------------------------|----------|
| 2021年2月末                  | 9,809 円  |
| 設定時                       | 10,000 円 |
| 変動額                       | ▲191 円   |
| 債券価格要因                    | ▲230 円   |
| 債券インカム要因                  | 1,502 円  |
| 為替要因(含む為替ヘッジコスト/ヘッジプレミアム) | ▲862 円   |
| 運用管理費用要因、その他              | ▲266 円   |
| 分配金要因                     | ▲335 円   |

## 基準価額の期間別設定来変動要因分解



※変動要因分解は、簡便法に基づく概算値であり、実際の数値とは異なる場合があります。また、その他には、設定・解約の影響などがあります。表示桁未満の四捨五入等の関係で各欄の数値の合計が変動額の数値と合わないことがあります。設定時から2017年2月末の期間については、期間の長さが1年に満たないため表示していません。

## << 参考 >> 市況データ

(2016年4月25日～2021年2月26日)



(出所) 各種資料より大和アセットマネジメント作成

※短期金利差は、投資信託協会が公表している3ヶ月の為替先物予約レートを基に大和アセットマネジメントが算出したものです。

## 《ファンドの目的・特色》

### ファンドの目的

- 日系企業が発行する外貨建ての社債等に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

### ファンドの特色

1. 日系企業が発行する外貨建ての社債等に投資します。
  - 日系企業とは、日本企業もしくはその子会社をいいます。
  - 社債等には、日本の政府機関、地方公共団体等が発行する債券を含みます。
  - 投資対象は、主として日系企業が発行する米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等とします。  
必ずしも、上記通貨のすべてが組入れられるわけではありません。
  - 劣後債も投資対象とします。その組入れは純資産総額の30%程度を上限とします。
  - 流動性の確保およびポートフォリオの修正デュレーションの調整のため、上記通貨建ての海外の国債やコマーシャル・ペーパー等に投資することがあります。
  - 外貨建て社債等の格付けは、取得時において投資適格（BBB 格相当以上）とします。
  - ポートフォリオの修正デュレーションは、ファンドの残存年数+0.3（年）以内とすることをめざします。
2. 「為替ヘッジあり」と「部分為替ヘッジあり」の2つのファンドがあります。
  - 「為替ヘッジあり」は、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。  
※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。
  - 「部分為替ヘッジあり」は、保有実質外貨建資産について、為替ヘッジを行なうことにより、当ファンドの実質的な円貨比率を70%に近づけることをめざします。  
※為替ヘッジしていない部分については、為替変動の影響を受けます。

※2つのファンドとも、為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入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ます。
3. 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。
  - ・ マザーファンドは、「ダイワ日本企業外債マザーファンド S2016-04」です。
  - ・ マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。

※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。

「公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）」、「劣後債固有のリスク（劣後リスク（法的弁済順位が劣後するリスク）・繰上償還延期リスク・利払繰延リスク・その他）」、「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）」

※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              | ご購入の申し込みはできません。       | —                                                                         |
| 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 0.55%<br>(税抜 0.5%) | 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。                              |
| 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。

※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。

※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。

## 《当資料のお取り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により作成されたものです。
- 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、投資者のみなさまの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。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。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。
- 当資料の中で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。
- 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。

販売会社等についてのお問い合わせ

▶ **大和アセットマネジメント** フリーダイヤル 0120-106212(営業日の9:00~17:00)

当社ホームページ

▶ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## ダイワ日本企業外債ファンドS（為替ヘッジあり）2016-04 取扱い販売会社

| 販売会社名（業態別、50音順）<br>（金融商品取引業者名） |          | 登録番号            | 加入協会    |                         |                         |                            |
|--------------------------------|----------|-----------------|---------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|
|                                |          |                 | 日本証券業協会 | 一般社団法人<br>金融先物<br>取引業協会 | 一般社団法人<br>日本投資<br>顧問業協会 | 一般社団法人<br>第二種金融商<br>品取引業協会 |
| 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 | ○       | ○                       | ○                       | ○                          |

上記の販売会社については今後変更となる場合があります。また、新規のご購入の取り扱いを行っていない場合がありますので、各販売会社にご確認ください。