

ダイワ日本株ニュートラル・ファンド2016-09

単位型投信／国内／株式／特殊型（絶対収益追求型）

信託期間：2016年9月16日 から 2021年9月14日 まで

基準日：2021年8月31日

決算日：毎年3月14日および9月14日（休業日の場合翌営業日）

回次コード：3628

※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。

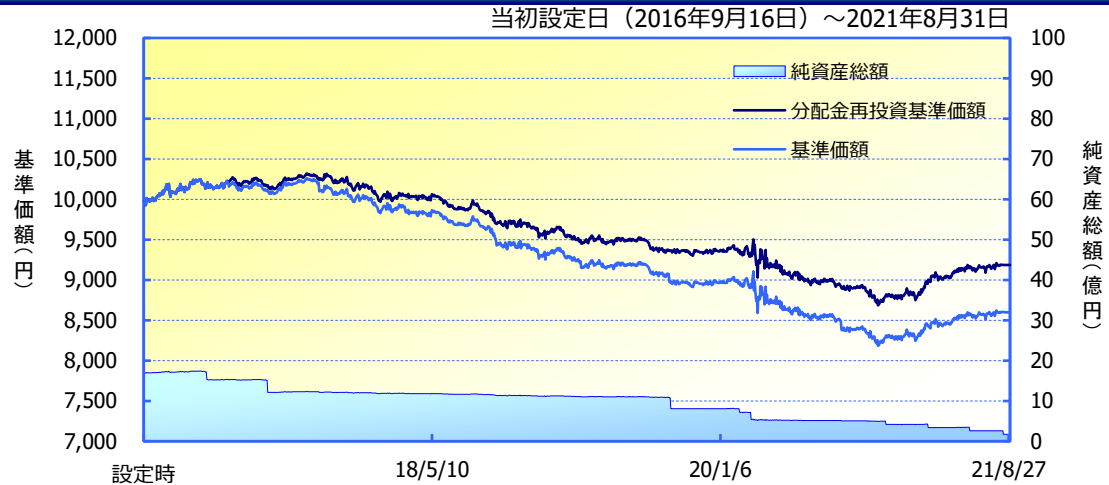
《基準価額・純資産の推移》

2021年8月31日現在

基準価額	8,597 円
純資産総額	171百万円

期間別騰落率

期間	ファンド
1カ月間	+0.5 %
3カ月間	+0.8 %
6カ月間	+4.2 %
1年間	+2.5 %
3年間	-6.8 %
5年間	-----
年初来	+4.6 %
設定来	-8.2 %



※「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 (17/03)	60円
第2期 (17/09)	85円
第3期 (18/03)	55円
第4期 (18/09)	75円
第5期 (19/03)	45円
第6期 (19/09)	90円
第7期 (20/03)	65円
第8期 (20/09)	80円
第9期 (21/03)	55円

分配金合計額 設定来：610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。

※他の分析情報についても、必要に応じて開示することがあります。

■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。

《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
国内株式	---	---
国内株式先物	---	---
不動産投資信託等	---	---
コール・ローン、その他	---	100.0%
合計	---	100.0%

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

＜株式市況＞

国内株式市場は上昇しました。国内外における新型コロナウイルス変異株への懸念と堅調な企業業績などの綱引きで上旬は一進一退で推移しました。中旬は米国や中国の経済指標の相次ぐ下振れで下落したものの、米国で新型コロナウイルスワクチンが正式承認されたことや、下旬に行われたパウエルFRB（米国連邦準備制度理事会）議長講演を無難に通過したことで株価は反発し、月間ではプラスとなりました。

＜運用経過＞

ベビーファンドの運用経過

「ジャパン・バリューウィナー・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、マザーファンドを通じて投資する株式と同額程度のTOPIX先物の売り建てを行いました。2021年8月13日に安定運用に入り、月末時点で、マザーファンドの組入比率は0%、国内株式先物の組入比率は0%となっています。

マザーファンドの運用経過

株式等の組入比率は、おおむね高位で推移させました。個別では、配当利回りが高く、業績が良いにもかかわらず割安に放置されている銘柄や、自社株買い等の株主還元が期待される銘柄に投資を行いました。個別銘柄の売買や株価変動により、業種では、小売業、サービス業、証券、商品先物取引業などの比率が上昇し、輸送用機器、化学、ゴム製品などの比率が低下しました。

＜今後の運用方針＞

ベビーファンドの運用方針

償還日（2021年9月14日）まで、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用を継続する予定です。

※TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利、ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

《ファンドの目的・特色》

ファンドの目的

- わが国の株式に投資し、市場平均を上回る収益の獲得を追求するとともに、株価指数先物取引の売建てを行ない、株式市場全体の値動きの影響を限定することで、安定した収益の確保をめざします。

ファンドの特色

1. 指標ごとに各銘柄をスコアリングし、高品質なポートフォリオの構築をめざします。
 - ・ポートフォリオ構築にあたっては、配当利回り、PBR（株価純資産倍率）、ROA（総資本利益率）、自社株買い実施確度等を定量的手法によりスコアリングし、業種の偏りや流動性等を勘案して、ハイスコア銘柄に分散投資します。
 2. 先物取引の売建てを組み合わせた株式ヘッジ戦略を用います。
 - ・TOPIX 先物取引の売建てを組み合わせた株式ヘッジ戦略により、わが国の株式市場全体の値動きにかかわらず、安定した収益の確保をめざします。
 - ・運用資産の75%程度以上を株式に投資し、残りはTOPIX 先物取引の売建てのために証拠金として使用します。
 - ・株価指数先物取引は、TOPIX 先物取引を利用することを原則としますが、流動性その他を考慮して他の株価指数先物取引等を利用することがあります。
 3. 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。
 - ・マザーファンドは、「ジャパン・バリュウウィナー・マザーファンド」です。
- ※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。

「株式ヘッジ戦略に伴うリスク」「株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）」、「株価指数先物取引の利用に伴うリスク」「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。

※当ファンドは、投資信託協会の商品分類（補足分類）において、「特殊型（絶対収益追求型）」に分類されます。ここで「絶対収益」とは、必ず収益を得るという意味ではなく、特定の市場に左右されにくい収益、という意味です。

※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0.7425% (税抜0.675%)	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/>

ダイワ日本株ニュートラル・ファンド2016-09 取扱い販売会社

販売会社名（業態別、50音順） （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 金融先物 取引業協会	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
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。