

使用開始日 2022年10月13日

## 投資信託説明書(交付目論見書)

# ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式αコース/通貨αコース/株式&通貨ツインαコース

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。)

三井住友信託銀行株式会社

■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・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型) 株式 $\alpha$ コース：株式 $\alpha$ コース  
 ダイワ・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型) 通貨 $\alpha$ コース：通貨 $\alpha$ コース  
 ダイワ・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型) 株式&通貨ツイン $\alpha$ コース  
 ：株式&通貨ツイン $\alpha$ コース

❖ 各ファンドの総称を「ダイワ・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型)」とします。

[ダイワ・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型) 株式 $\alpha$ コース]  
 [ダイワ・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型) 通貨 $\alpha$ コース]  
 [ダイワ・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型) 株式&通貨ツイン $\alpha$ コース]

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)	オセアニア	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。

〈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 22兆9,003億80百万円  
 (2022年7月末現在)

- 本文書により行なう「ダイワ・オーストラリア高配当株 $\alpha$  (毎月分配型)」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2022年10月12日に関東財務局長に提出しており、2022年10月13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

予想配当利回りの高いオーストラリア株式へ投資するとともに、オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、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** 株式への投資とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

- 相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式に投資します。
- コール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。

**2** カバードコール戦略の構築方法により3つのコースがあります。

### 株式 $\alpha$ コース

- 株式のオプション取引を活用したカバードコール戦略を構築します。  
権利行使価格を上回る株式の値上がり益を放棄する代わりに、株式のオプションプレミアムの確保をめざします。

### 通貨 $\alpha$ コース

- 通貨のオプション取引を活用したカバードコール戦略を構築します。  
権利行使価格を上回る為替差益を放棄する代わりに、通貨のオプションプレミアムの確保をめざします。

### 株式&通貨ツイン $\alpha$ コース

- 株式および通貨のオプション取引を活用したカバードコール戦略を構築します。  
権利行使価格を上回る株式の値上がり益および為替差益を放棄する代わりに、株式および通貨のオプションプレミアムの確保をめざします。

**3** 毎月17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。



## 2 カバードコール戦略の構築方法により3つのコースがあります。

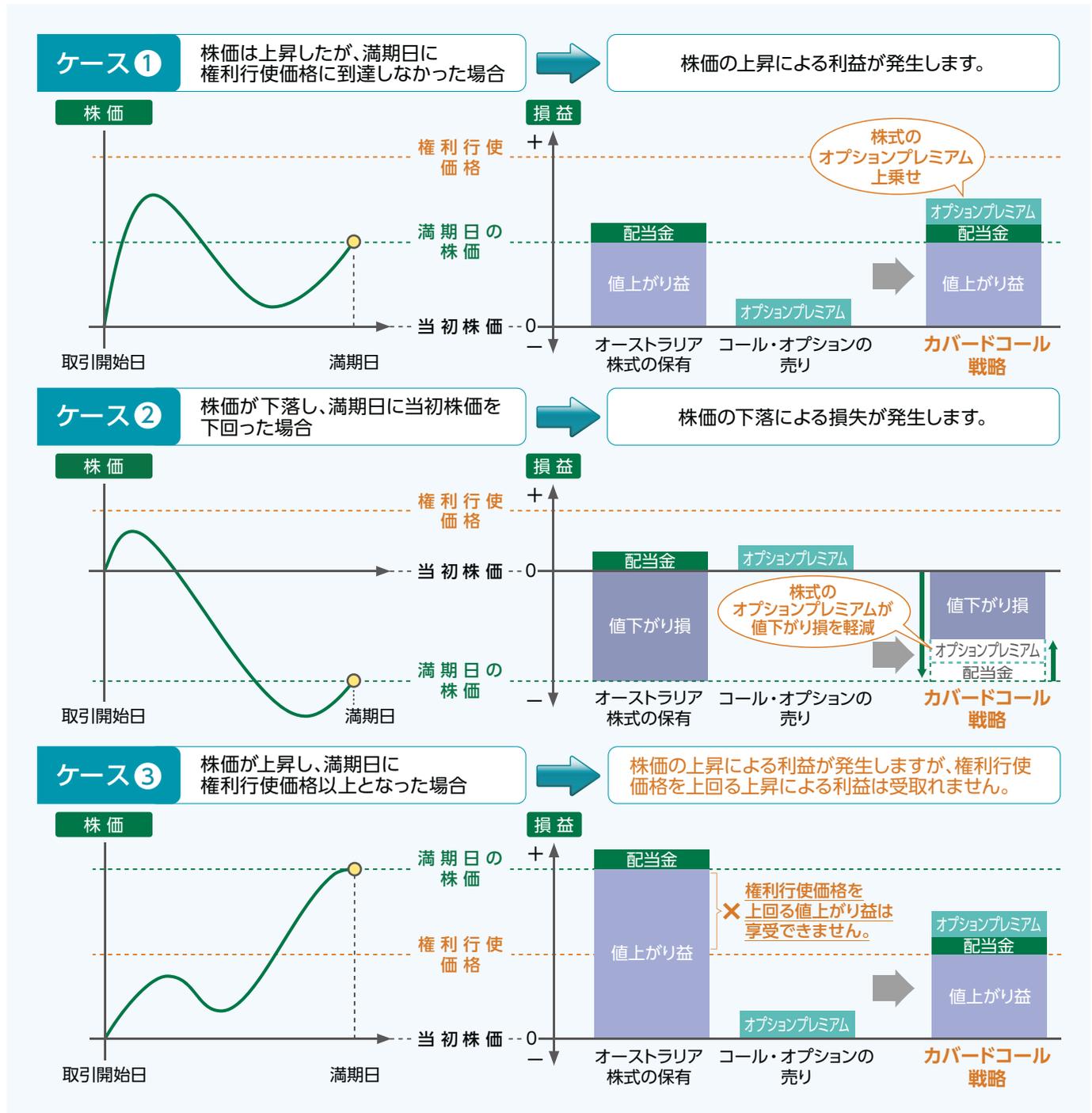
コース名/ カバードコール戦略	収益の源泉のイメージ	
	株式を源泉とする部分	為替を源泉とする部分
<p><b>株式αコース</b></p> <p>株式カバードコール戦略</p>	<p>株式カバードコール戦略の効果</p> <p>株式のオプションプレミアム 株式の値上がり益</p> <p>株式の値下がり損</p> <p>株式の配当金</p> <p>権利行使価格を上回る 値上がり益は享受できません。</p>	<p>為替差益</p> <p>為替差損</p>
<p><b>通貨αコース</b></p> <p>通貨カバードコール戦略</p>	<p>株式の配当金</p> <p>株式の値上がり益</p> <p>株式の値下がり損</p>	<p>通貨カバードコール戦略の効果</p> <p>為替差益</p> <p>通貨のオプションプレミアム</p> <p>為替差損</p> <p>権利行使価格を上回る 為替差益は享受できません。</p>
<p><b>株式&amp;通貨 ツインαコース</b></p> <p>株式カバードコール戦略 + 通貨カバードコール戦略</p>	<p>株式カバードコール戦略の効果</p> <p>株式のオプションプレミアム 株式の値上がり益</p> <p>株式の値下がり損</p> <p>株式の配当金</p> <p>権利行使価格を上回る 値上がり益は享受できません。</p>	<p>通貨カバードコール戦略の効果</p> <p>為替差益</p> <p>通貨のオプションプレミアム</p> <p>為替差損</p> <p>権利行使価格を上回る 為替差益は享受できません。</p>

※株式カバードコール戦略の効果については後掲の「株式カバードコール戦略の効果(損益)のイメージ」、通貨カバードコール戦略の効果については後掲の「通貨カバードコール戦略の効果(損益)のイメージ」をご参照ください。

※上記は、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。

# ファンドの目的・特色

## 株式カバードコール戦略の効果(損益)のイメージ



**株式αコース** 上記の「株式カバードコール戦略の効果」に加えて、円に対する豪ドルの為替変動の影響を受けます。

**株式&通貨ツインαコース** 上記の「株式カバードコール戦略の効果」

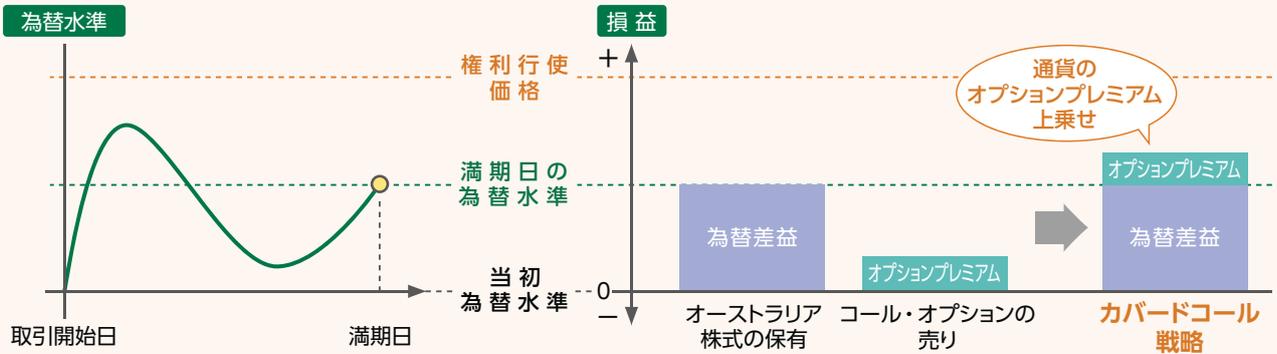
※ 上記はイメージであり、実際の価格および水準、配当金、オプションプレミアムとは異なります。また、  
 ※ 上記は、個別銘柄ごとに保有株数(または保有口数)全部にかかるコール・オプションまたは保有するおける損益を表したものであり、当ファンド全体の実際の損益を示したものではありません。  
 ※ 「株式カバードコール戦略の効果(損益)のイメージ」においては、株式の配当金の支払いがあったこと  
 ※ 当ファンドにおいて、カバードコール戦略の損益は毎営業日に時価評価され、基準価額に反映されます。

## 通貨カバードコール戦略の効果(損益)のイメージ

### ケース①

豪ドル(対円)は上昇したが、満期日に権利行使価格に到達しなかった場合

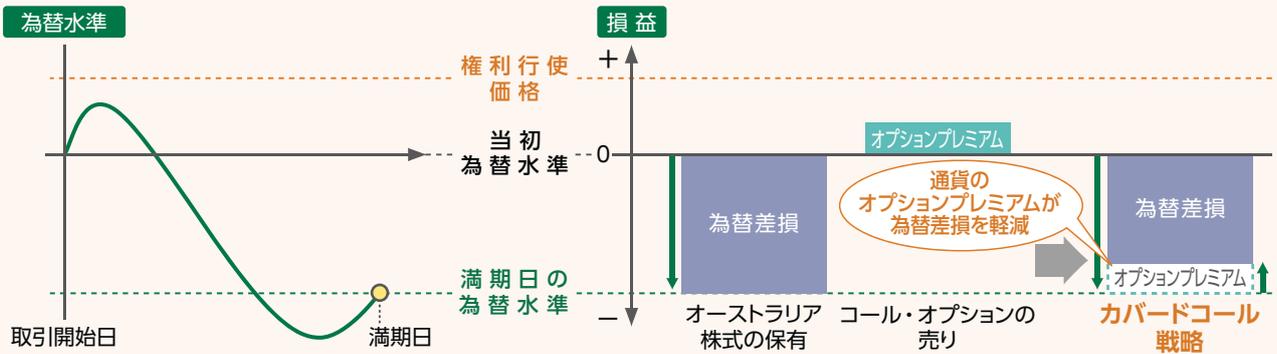
豪ドル(対円)の上昇による利益が発生します。



### ケース②

豪ドル(対円)が下落し、満期日に当初為替水準を下回った場合

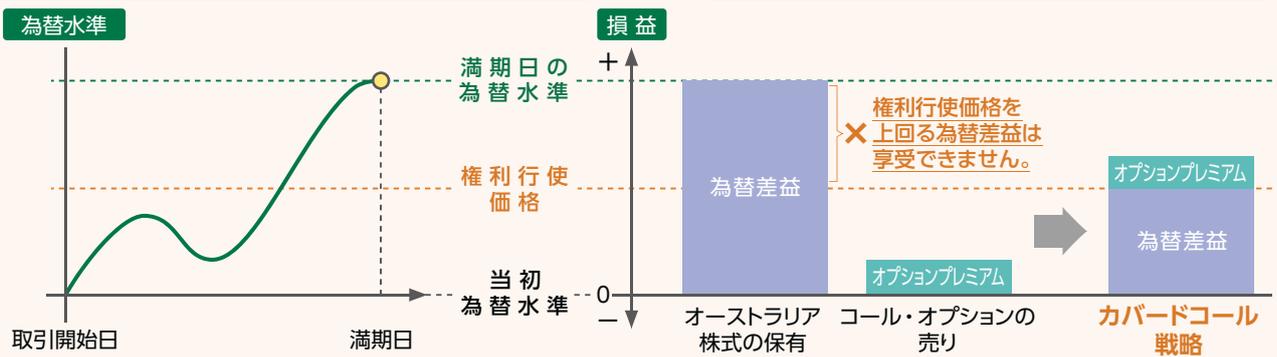
豪ドル(対円)の下落による損失が発生します。



### ケース③

豪ドル(対円)が上昇し、満期日に権利行使価格以上となった場合

豪ドル(対円)の上昇による利益が発生しますが、権利行使価格を上回る上昇による利益は受取れません。



### 通貨αコース

上記の「通貨カバードコール戦略の効果」に加えて、株式の価格変動の影響を受けます。

および「通貨カバードコール戦略の効果」の両方の効果があります。

投資成果を示唆または保証するものではありません。  
豪ドル建て資産の評価額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  
を前提として損益を表したものです。

# ファンドの目的・特色

オーストラリアの株式、株式カバードコール戦略、通貨カバードコール戦略の運用については、大和アセットマネジメント株式会社が助言を行ない、その助言に基づきクレディ・スイス・マネジメント(ケイマン)リミテッドが行ないます。

各コースについては、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。

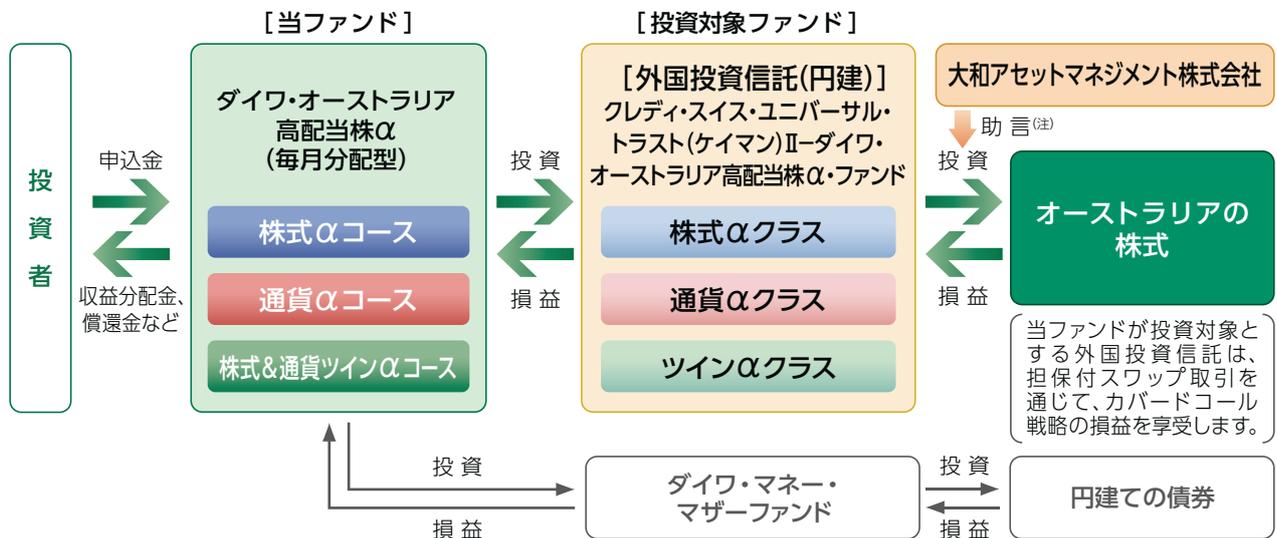
## スイッチング(乗換え)について

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。



## ファンドの仕組み

- 当ファンドは、複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- 外国投資信託の受益証券を通じて、オーストラリアの株式への投資とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。
- 当ファンドが投資対象とする外国投資信託では、直接株式への投資やオプション取引を行わず、担保付スワップ取引を通じて、オーストラリアの株式への投資とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の損益を受けます。



(注) オーストラリアの株式、株式カバードコール戦略、通貨カバードコール戦略の運用については、大和アセットマネジメント株式会社が助言を行ないます。

※ 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、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。

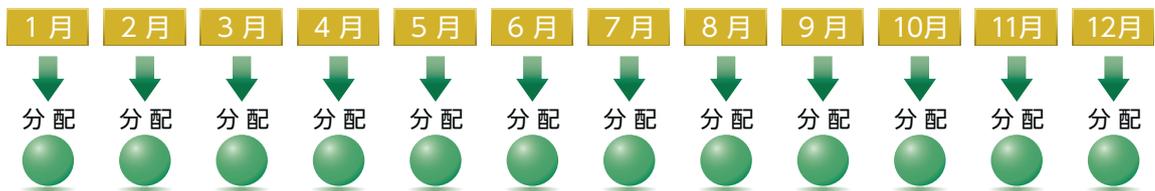
大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1. および2. の運用が行なわれないことがあります。

### 3 毎月17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]

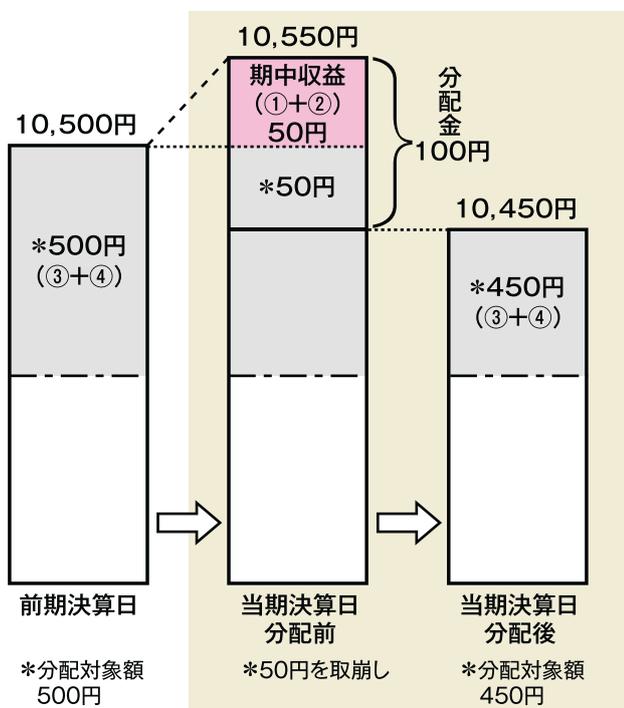
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



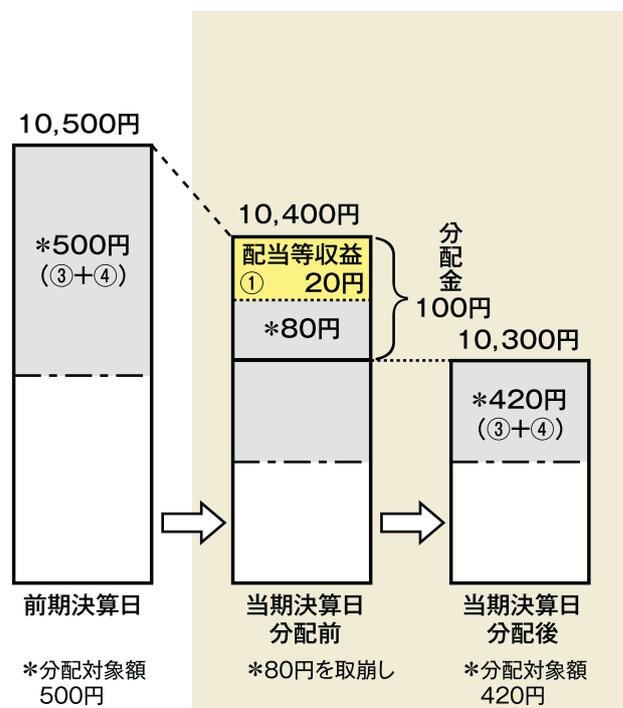
- 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(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小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。

## 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>株式の価格変動 (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αコース ]</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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ます。想定したオプションプレミアムが確保できない場合もあります。</li> <li>・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。</li> <li>・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化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。</li> <li>・当ファンドでは個別銘柄ごとに株式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化する可能性があります。</li> </ul> <p>[ 通貨αコース ]</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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ます。想定したオプションプレミアムが確保できない場合もあります。</li> <li>・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。</li> <li>・通貨カバードコール戦略では、円に対する豪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化する可能性があります。戦略再構築を重ねた場合、円に対する豪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。</li> </ul> <p>[ 株式&amp;通貨ツインαコース ]</p> <p>上記の[ 株式αコース ]および[ 通貨αコース ]の両方を含みます。</p>

# 投資リスク

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。
スワップ取引の利用に伴うリスク	・スワップ取引の相手方に債務不履行や倒産その他の事態が生じた場合、カバードコール戦略の投資成果を享受することができず、ファンドの運用の継続が困難となり、予想外の損失を被る可能性があります。また、スワップ取引の相手方から受入れた担保を想定した価格で処分できない場合があることから損失を被る可能性があります。 ・当ファンドが投資対象とする外国投資信託は、スワップ取引の相手方が取引する株式やオプションについて何ら権利を有しません。
その他	解約資金を手当てするため組入証券を売却する際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却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期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、換金の申込みの受け付け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。

## リスクの管理体制

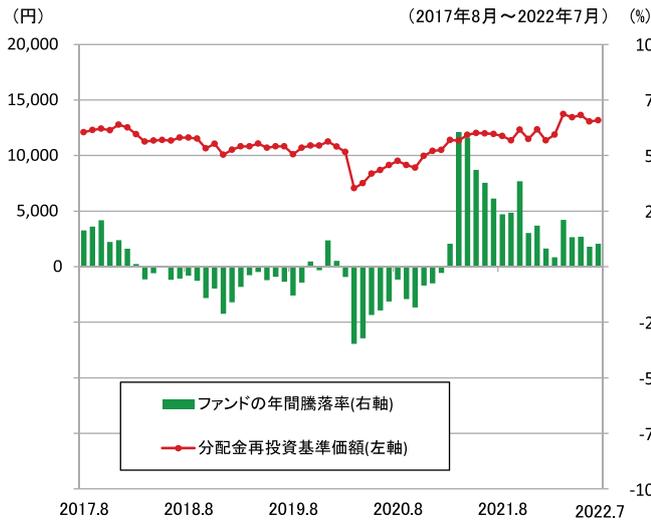
- 委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に関する基本方針に基づき、運用本部から独立した部署および会議体が直接的または間接的に運用本部へのモニタリング・監視を通し、運用リスクの管理を行ないます。
- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

## 参考情報

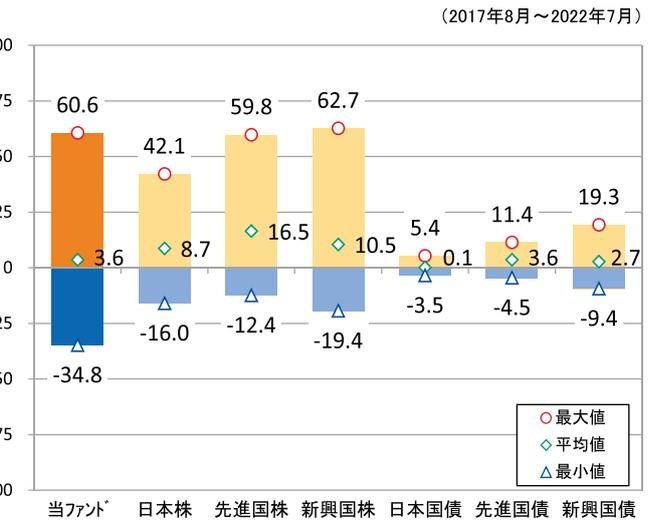
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

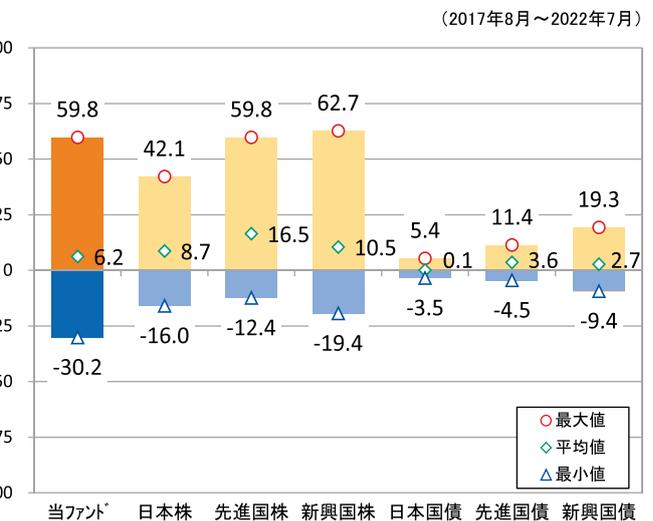
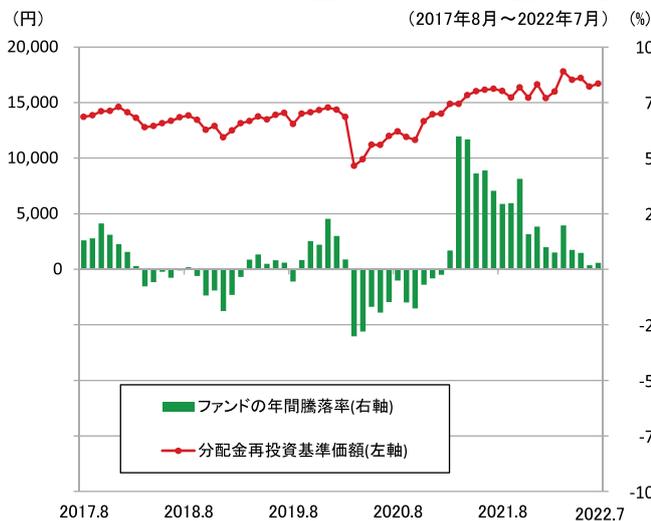
#### [ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式αコース]



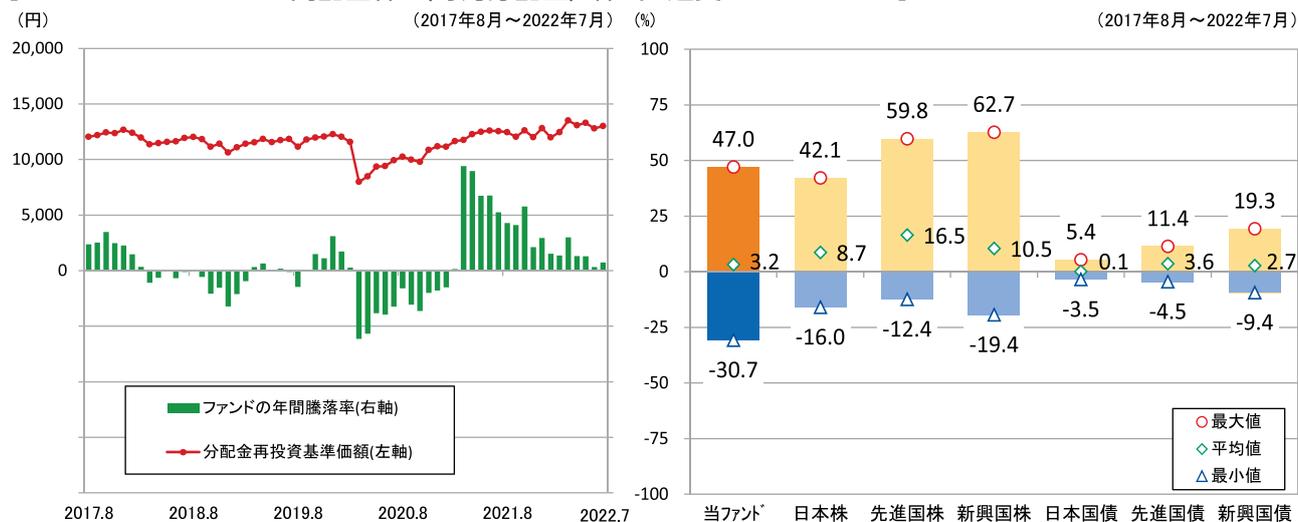
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 通貨αコース]



## [ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース]



※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：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)  
 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

●東証株価指数 (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、野村証券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野村証券株式会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.

●ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式αコース

2022年7月29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	3,480円
純資産総額	1.0億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	-2.0%
6カ月間	16.0%
1年間	10.4%
3年間	21.7%
5年間	7.4%
設定来	31.8%



※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: 480円 設定来分配金合計額: 8,130円

決算期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	21年8月	21年9月	21年10月	21年11月	21年12月	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月
分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40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。

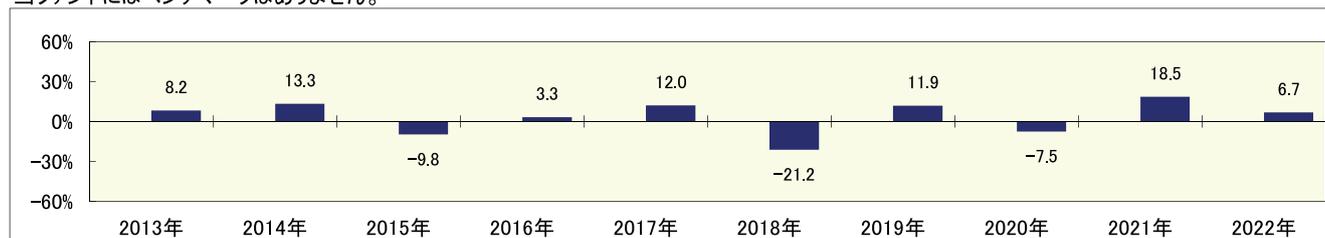
主要な資産の状況

※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
クレディ・スイス・マネジмент(ケイマン)リミテッド	オーストラリア高配当株α・ファンド(株式αクラス)	97.9%
大和アセットマネジмент	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.1%
合計		98.0%

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。  
 ・2013年は設定日(1月23日)から年末、2022年は7月29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。

# 運用実績

## ●ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 通貨αコース

2022年7月29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	4,647円
純資産総額	3.5億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.7%
3カ月間	-1.9%
6カ月間	8.5%
1年間	2.9%
3年間	18.7%
5年間	21.6%
設定来	67.2%



※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： 720円

設定来分配金合計額： 9,180円

決算期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	21年8月	21年9月	21年10月	21年11月	21年12月	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月
分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60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。

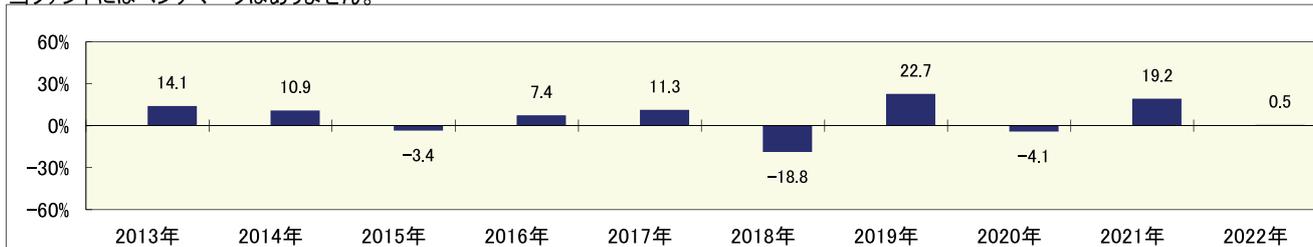
### 主要な資産の状況

※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
クレディ・スイス・マネジмент(ケイマン)リミテッド	オーストラリア高配当株α・ファンド(通貨αクラス)	99.3%
大和アセットマネジмент	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.0%
合計		99.4%

### 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。  
・2013年は設定日（1月23日）から年末、2022年は7月29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・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース

2022年7月29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	2,055円
純資産総額	38億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.7%
3カ月間	-0.6%
6カ月間	8.5%
1年間	3.7%
3年間	9.7%
5年間	8.4%
設定来	30.1%



※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: 360円      設定来分配金合計額: 9,245円

決算期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	21年8月	21年9月	21年10月	21年11月	21年12月	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月
分配金	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30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。

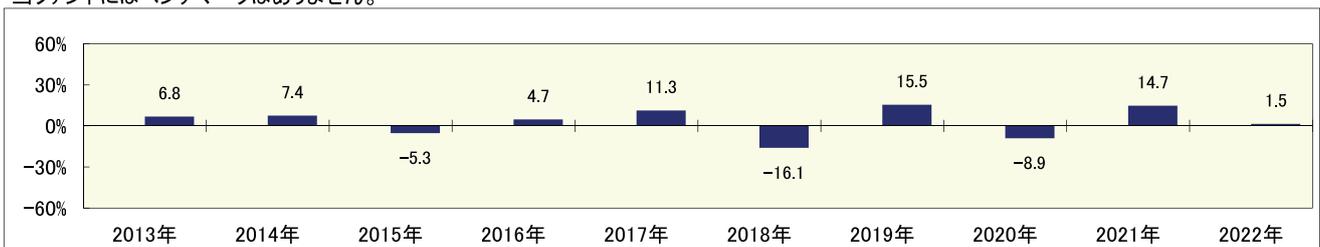
主要な資産の状況

※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
クレディ・スイス・マネジмент(ケイマン)リミテッド	オーストラリア高配当株α・ファンド(ツインαクラス)	98.6%
大和アセットマネジмент	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.0%
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。  
 ・2013年は設定日(1月23日)から年末、2022年は7月29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。

## 【投資対象ファンドの概要】

1. クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)II-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド(株式αクラス)
2. クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)II-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド(通貨αクラス)
3. クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)II-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド(ツインα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	<p>[株式αクラス] 主として、担保付スワップ取引を通じて、相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>[通貨αクラス] 主として、担保付スワップ取引を通じて、相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と通貨オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>[ツインαクラス] 主として、担保付スワップ取引を通じて、相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせた株式カバードコール戦略に加えて、通貨オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざします。</p>
主な運用方針	<p>① [株式αクラス] 主として、担保付スワップ取引を通じて、相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせた株式カバードコール戦略の投資成果を享受します。</p> <p>[通貨αクラス] 主として、担保付スワップ取引を通じて、相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と通貨オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略の投資成果を享受します。</p> <p>[ツインαクラス] 主として、担保付スワップ取引を通じて、相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせた株式カバードコール戦略に加えて、通貨オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略の投資成果を享受します。 担保付スワップ取引の相手方は、クレディ・スイス・インターナショナルです。</p> <p>② オーストラリア株式の運用にあたっては、以下の点に留意します。 ・オーストラリアの金融商品取引所上場株式等(不動産投資信託証券を含みます。)の中から、時価総額や流動性等を考慮して投資対象銘柄を選定します。 ・投資対象銘柄の中から、企業の利益成長性、財務内容、配当余力および配当政策等を分析し、予想配当利回りの水準が高いと判断される銘柄を中心に選別します。 ・オプションの取引価格、価格変動率等を考慮し組入候補銘柄を決定します。 ・株価バリュエーションや銘柄分散等を勘案してポートフォリオを構築します。</p> <p>③ [株式αクラス] 株式オプション取引の戦略構築にあたっては、以下の点に留意します。 ・個別銘柄ごとに、当該株式のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの確保をめざします。 ・オプションの取引価格を勘案し、個別銘柄ごとに保有株数(または保有口数)の全部または一部にかかるコール・オプションを売却することを基本とします。 ・権利行使が満期日のみに限定されているオプションを利用することを基本とします。</p> <p>[通貨αクラス] 通貨オプション取引の戦略構築にあたっては、以下の点に留意します。 ・円に対する豪ドルのコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの確保をめざします。 ・保有する豪ドル建て資産の評価額の全部にかかるコール・オプションを売却することを基本としますが、市場環境によっては保有する豪ドル建て資産の評価額の一部にかかるコール・オプションを売却する場合があります。 ・権利行使が満期日のみに限定されているオプションを利用することを基本とします。</p> <p>[ツインαクラス] 上記の[株式αクラス]および[通貨αクラス]の両方を含みます。</p> <p>④ オーストラリアの株式、株式カバードコール戦略、通貨カバードコール戦略の運用は、大和アセットマネジメント株式会社の助言に基づきクレディ・スイス・マネジメント(ケイマン)リミテッドが行ないます。</p>

管理報酬等	[株式αクラス][通貨αクラス] 純資産総額に対して年率0.57%程度 [ツインαクラス] 純資産総額に対して年率0.67%程度 (担保付スワップにかかる費用、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。
信託財産留保額	1口当たり純資産総額に対し0.30%
管理会社	クレディ・スイス・マネジメント(ケイマン)リミテッド
備考	当外国投資信託は、担保付スワップ取引の相手方に株式カバードコール戦略および通貨カバードコール戦略の構築に必要な現金を支払い、当該戦略の評価額に相当する担保資産を受け入れます。担保付スワップ取引の相手方は、日々の担保付スワップ取引の評価を行っており、担保も洗い替えされます。担保付スワップ取引の評価には、株式等へ投資する場合にかかるコストや税金等が反映されます。

※上記は提出日現在の情報に基づくものであり、変更となる場合があります。

## クレディ・スイスについて

クレディ・スイスは、スイスのチューリッヒに本拠を置き世界50カ国余りで事業を展開するグローバルな金融グループです。世界屈指のウェルス・マネジメント、高度な専門性を誇るインベストメント・バンキングおよびアセット・マネジメント事業を中核に、世界中の事業法人、機関投資家、富裕層個人顧客、スイス国内の個人顧客など幅広い層のお客様に、アドバイザリー・サービス、包括的なソリューション、革新的な商品を提供しています。

### 4. ダイワ・マネー・マザーファンド

運用の基本方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主な投資態度	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組入れにあたっては、取得時に第二位(A-2格相当)以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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

## 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 オーストラリア証券取引所の休業日 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	2022年10月13日から2023年1月13日まで
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あるときは、購入、換金の申込みの受付けを中止することがあります。
ス イ ッ チ ン グ ( 乗 換 え )	「株式αコース」、「通貨αコース」、「株式&通貨ツインαコース」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	2013年1月23日から2023年1月17日まで
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17日(休業日の場合翌営業日)
収 益 分 配	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。 (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3,000億円
公 告	電子公告の方法により行ない、ホームページ[ <a href="https://www.daiwa-am.co.jp/">https://www.daiwa-am.co.jp/</a> ]に掲載します。
運 用 報 告 書	毎年1月および7月の計算期末ならびに償還時に作成し、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、少額投資非課税制度の適用対象です。なお、当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合がありますので、くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。 ※2022年7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>0.3%</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1.353% (税抜1.23%)	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0.03%
投資対象とする 投資信託証券	「株式αコース」「通貨αコース」 年率0.57%程度 「株式&通貨ツインαコース」 年率0.67%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	「株式αコース」「通貨αコース」 「株式&通貨ツインαコース」	<u>年率1.923%(税込)程度</u> <u>年率2.023%(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。

# 手続・手数料等

## 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 <sup>(注)</sup> 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 <sup>(注)</sup> 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。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA(ジュニアニーサ)」をご利用の場合

毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

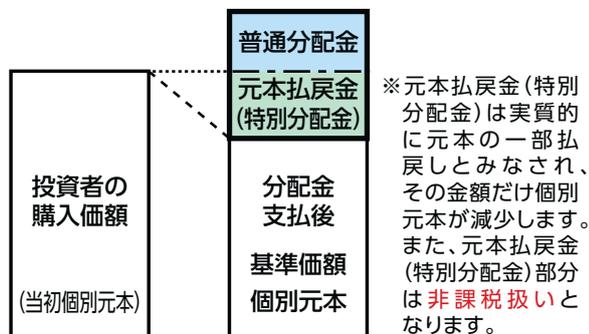
※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2022年7月末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。

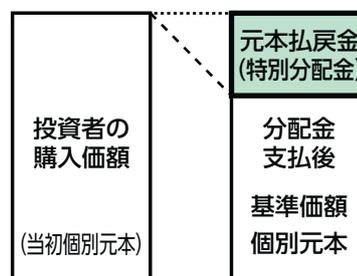
※法人の場合は上記とは異なります。

※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)の額だけ減少します。