

ダイワ・グローバル金融機関(G-SIBs)債券ファンド (部分為替ヘッジあり)2017-01

設定来の運用状況について

2017年2月10日

平素は、「ダイワ・グローバル金融機関(G-SIBs)債券ファンド(部分為替ヘッジあり)2017-01」をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

当ファンドの設定来の運用状況について、お知らせいたします。

◀基準価額・純資産の推移▶

※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。

当初設定日(2017年1月24日)～2017年2月8日

2017年2月8日現在

基準価額	10,062 円
純資産総額	19億円

期間別騰落率

期間	ファンド
1カ月間	----
3カ月間	----
6カ月間	----
1年間	----
3年間	----
5年間	----
年初来	----
設定来	+0.6 %



※「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の応当日までとし、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。

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投資信託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⇒ 大和投資信託 フリーダイヤル0120-106212(営業日の9:00～17:00) HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>

〈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
外国債券	19	94.7%
コール・ローン、その他※		5.3%
合計	19	100.0%

※外貨キャッシュ、経過利息等を含みます。

通貨別構成		合計100.0%
通貨		比率
日本円		69.6%
米ドル		30.4%

※保有する外貨建て資産の比率から、為替予約取引の比率を差し引いた実質的な比率を表示しています。

債券 種別構成		合計94.7%
種別		比率
事業債		94.7%

債券 格付別構成		
格付別		比率
AAA		---
AA		45.1%
A		54.9%
BBB		---
BB以下		---
合計		100.0%

債券 ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	3.5
最終利回り(%)	3.6
修正デュレーション	7.6
残存年数	9.0

※ポートフォリオ特性値は債券ポートフォリオに対する値です。為替ヘッジに伴うコスト等を考慮した値ではありません。
 ※ポートフォリオ特性値は、ファンドの組入債券等の各特性値(直接利回り、最終利回り等)を、その組入比率で加重平均したものです。

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
 ※格付別構成は、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

組入上位10銘柄					合計69.3%
銘柄名	通貨	利率(%)	償還日		比率
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	米ドル	3.85	2026/03/01		7.7%
Mizuho Financial Group Inc	米ドル	3.477	2026/04/12		7.7%
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	米ドル	2.632	2026/07/14		7.6%
Wells Fargo & Co	米ドル	3	2026/04/22		7.0%
JPMorgan Chase & Co	米ドル	3.3	2026/04/01		7.0%
HSBC Holdings PLC	米ドル	3.9	2026/05/25		6.9%
MORGAN STANLEY	米ドル	3.125	2026/07/27		6.6%
GOLDMAN SACHS GROUP INC.	米ドル	3.75	2026/02/25		6.5%
CITIGROUP INC.	米ドル	3.4	2026/05/01		6.1%
BANK OF AMERICA CORP.	米ドル	3.5	2026/04/19		6.0%

以上

ダイワ・グローバル金融機関(G-SIBs)債券ファンド (部分為替ヘッジあり)2017-01

ご購入の申し込みはできません。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

世界の銀行が発行する外貨建ての社債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。

- 世界の銀行は日本の銀行を含みます。

ファンドの特色

- G-SIBsに指定された銀行が発行する社債に投資します。
 - ◆投資対象は、G-SIBsに指定された銀行が発行する米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債とします。
 - ◆社債を取得後に当該銀行がG-SIBsでなくなった場合においても、市場動向および銘柄分析等による投資判断に基づき、当該銘柄の保有を継続することがあります。
 - ◆ファンドの償還日以前に償還が見込まれる銘柄に投資します。
 - ◆流動性の確保のため、米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての国債に投資することがあります。
 - ◆債券の格付けは、取得時においてA格相当以上とします。

※上記は投資対象とするマザーファンドにおける債券の取得時の基準であり、格付けの変更などにより、債券の格付けがA格相当未満の銘柄が組入れられる場合があります。

G-SIBs (Global Systemically Important Banks) とは

主要各国の中央銀行、金融監督当局等で構成される金融安定理事会 (FSB) が指定した、金融システム上、世界経済に与える影響が極めて大きい重要な銀行をいいます。

一般の銀行と比較し、自己資本の強化が要請される等、厳しい監督を受けることから、安全性の高い健全な経営が求められます。

G-SIBsに指定される銀行は、毎年11月に見直される予定です。

- 「為替ヘッジあり」および「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」

- 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」

- 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。

※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、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。

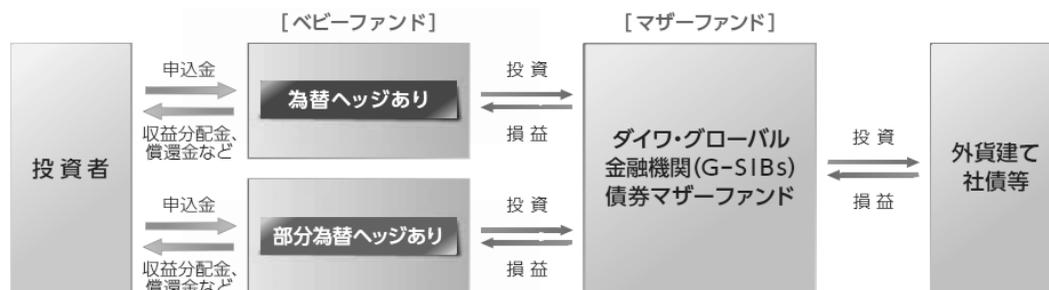
◆各ファンドの略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

ダイワ・グローバル金融機関 (G-SIBs) 債券ファンド (為替ヘッジあり) 2017-01: 為替ヘッジあり

ダイワ・グローバル金融機関 (G-SIBs) 債券ファンド (部分為替ヘッジあり) 2017-01: 部分為替ヘッジあり

◆各ファンドの総称を「ダイワ・グローバル金融機関 (G-SIBs) 債券ファンド 2017-01」とします。

- 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。



※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。

ダイワ・グローバル金融機関(G-SIBs)債券ファンド (部分為替ヘッジあり)2017-01

ご購入の申し込みはできません。

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）」、「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）」

※「為替ヘッジあり」は、為替ヘッジを行ないませんが、影響をすべて排除できるわけではありません。

※「部分為替ヘッジあり」は、実質的な円貨比率を70%に近づけることをめざしますので、為替ヘッジしていない部分については、為替レートの変動の影響を受けます。

※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、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	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0.54% (税抜0.5%)	運用管理費用の総額は、毎日、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、毎計算期末、途中換金および信託終了のときに信託財産中から支弁します。
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けます。

(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」に記載しています。

販売会社:

大和証券

Daiwa Securities

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

設定・運用:

大和投資信託

Daiwa Asset Management

商号等 大和証券投資信託委託株式会社
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