

## ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンド

「トムソン・ロイター リッパー・ファンド・アワード・ジャパン 2018」受賞のお知らせ

2018年4月18日

平素は、『ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンド』をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。この度、「トムソン・ロイター リッパー・ファンド・アワード・ジャパン 2018」の「『投資信託』部門/コモディティ型 複合（評価期間：3年）」におきまして、当ファンドが

**最優秀ファンド賞**を受賞しました。

今回の受賞にあたり、受益者の皆さまに厚く御礼申し上げますとともに、運用担当者のメッセージをお伝えさせていただきます。また、この機会をお借りしまして改めて当ファンドの特徴についてご説明させていただきます。

「トムソン・ロイター リッパー・ファンド・アワードの評価の基となるトムソン・ロイター リッパー・リーダーズのファンドに関する情報は、投資信託の売買を推奨するものではありません。トムソン・ロイター リッパー・リーダーズが分析しているのは過去のファンドのパフォーマンスであり、過去のパフォーマンスは将来の結果を保証するものではないことにご留意ください。評価結果は、リッパーが信頼できると判断した出所からのデータおよび情報に基づいていますが、その正確性、完全性等について保証するものではありません。」

### 当ファンド運用担当者からのメッセージ

大和投資信託の「ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンド」は「トムソン・ロイター リッパー・ファンド・アワード・ジャパン 2018」におきまして、『投資信託』部門/コモディティ型 複合（評価期間：3年）「最優秀ファンド賞」を受賞致しました。本ファンドの設計コンセプトが受賞に値するトラックレコードにつながったと考えております。今後も、設計コンセプトに対し的確なオペレーションを行い、お客様の満足度向上に努めてまいります。

#### 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。■当ファンドのお申込みにあたっては、販売会社よりお渡す「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。■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。■当資料の中で個別企業名が記載されている場合、それらはあくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。■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/>

## <ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンドの特徴について>

★ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンドは

- インフレに強い特徴があります。

当ファンドは世界のコモディティ（商品）価格の中長期的な上昇を享受するために、世界中の経済活動に広く利用されている商品の値動きを表わすロジャーズ国際コモディティ指数®（以下、「RICI®」）の動き（円換算）に連動する投資成果をめざして運用を行っています。インフレ時には指数上昇が期待され、インフレヘッジの役割を果たすと考えます。

- リスク分散効果が期待されます。

当ファンドが対象としているコモディティの価格は、株式や債券の価格と異なる動きを示す（相関が低い）ため、分散投資の対象に適しています。また、採用されている商品先物は原油からオレンジジュースまで38種類（2018年3月末現在）と商品指数の中では構成銘柄数が多いのも特徴です。従いまして、アセットクラスとしてリスク分散のためのツールであるだけでなく、コモディティファンドとしてもリスク分散効果が期待されると考えます。

- 透明性が高いことも特徴です。

RICI®は、公的な取引所に上場されている商品先物だけで構成されるコモディティ指数です（商品の現物やトータルリターンスワップ契約等は組み入れておりません）。このため、投資家にとって価格の公正性や透明性が非常に高い指数になっています。

また、RICI®に採用されている商品先物はその構成銘柄と構成比率が毎年見直し・公表されます。2018年3月末現在では、下記のように開示されています。

エネルギー	構成銘柄	構成比率
40.00%	原油 (WTI)	15.00%
	原油 (北海ブレント)	13.00%
	天然ガス	6.00%
	無鉛ガソリン (RBOB)	3.00%
	ヒーティング・オイル	1.80%
	ガス・オイル	1.20%

産業金属	構成銘柄	構成比率
14.00%	アルミニウム	4.00%
	銅	4.00%
	鉛	2.00%
	亜鉛	2.00%
	ニッケル	1.00%
	スズ	1.00%

貴金属	構成銘柄	構成比率
11.10%	金	5.00%
	銀	4.00%
	プラチナ	1.80%
	パラジウム	0.30%

家畜	構成銘柄	構成比率
3.00%	生牛	2.00%
	豚赤身肉	1.00%

穀物	構成銘柄	構成比率
20.00%	トウモロコシ	4.75%
	大豆	3.50%
	小麦 (CBOT 上場)	2.75%
	大豆油	2.00%
	欧州小麦	2.00%
	小麦 (CME 上場)	1.00%
	欧州菜種	1.00%
	小麦 (MGEX 上場)	1.00%
	大豆粕	0.75%
	米	0.75%
	オーツ麦	0.50%

ソフト	構成銘柄	構成比率
9.90%	綿花	4.20%
	コーヒー	2.00%
	砂糖 (ICE 上場)	1.00%
	砂糖 (NYSE Liffe 上場)	1.00%
	ココア	1.00%
	オレンジジュース	0.60%
	牛乳	0.10%

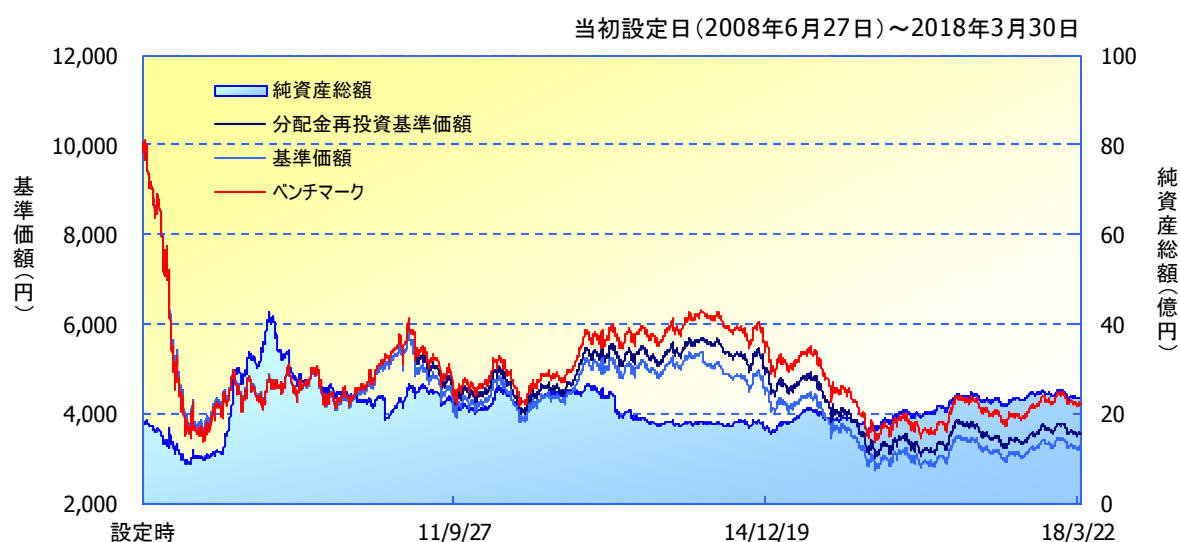
その他	構成銘柄	構成比率
2.00%	ゴム	1.00%
	板材	1.00%

※上記はRICI®の構成銘柄、構成比率を示したもので、当ファンドおよび「RICI®」ファンド クラスAにおける実際の商品先物取引の構成が上記と一致することを保証するものではありません。また、RICI®の構成については、随時、銘柄の入替え、構成比率の見直しが行われます。

## <基準価額・純資産総額の推移>

過去のパフォーマンス、ならびに純資産の推移については、下のグラフをご覧ください。

設定直後の基準価額の下落は、リーマンショックの影響によるものです。この時期は、景気減速による需要の鈍化懸念や債券への資金逃避のため、国際商品市場の調整が見られ、RICI®が大きく下落しました。なお、この時期、安全資産として考えられていた金は比較的底堅い動きを示していました。



※「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（後述のファンドの費用をご覧ください）。

※当ファンドはロジャーズ国際コモディティ指数®（円換算）をベンチマークとしておりますが、同指数を上回る運用成果を保証するものではありません。

※ロジャーズ国際コモディティ指数®（円換算）は、同指数（米ドル建て）を円換算し、当ファンド設定時を10,000として大和投資信託が計算したものです。

## ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンド

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

### ファンドの目的・特色

#### ファンドの目的

- コモディティ（商品先物取引等）に投資し、信託財産の成長をめざします。

#### ファンドの特色

1. コモディティ（商品先物取引等）に投資します。
  - ・世界のコモディティ（商品）価格の中長期的な上昇を享受するために、ロジャーズ国際コモディティ指数®（「RICI®」）の動き（円換算）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
2. 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
    - ① ケイマン籍の外国証券投資法人「“RICI®” Commodity Fund Ltd.」が発行する「“RICI®” class A」（「“RICI®” ファンド クラス A」）の投資証券（米ドル建）
    - ② 国内籍の証券投資信託「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券（円建）

「ダイワ/“RICI®” コモディティ・ファンド」およびその関連ファンドであるケイマン籍の外国証券投資法人「“RICI®” Commodity Fund Ltd.」（そのサブファンドである「“RICI®” class A」を含みます。）（以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。）は James Beeland Rogers、Jim Rogers® または Beeland Interests, Inc.（以下、当注記において、総称して「Beeland」といいます。）により提供、保証、販売または販売促進されるものではありません。Beeland はファンド購入者、すべての潜在的ファンド購入者、政府当局、または公衆に対して、一般的な証券投資、特にファンドへの投資の助言能力を、明示的にも暗示的にも、表明または保証するものではありません。Beeland は Rogers International Commodity Index® の決定、構成、算出において大和証券投資信託委託株式会社およびその関連会社、またはファンド購入者の要求を考慮する義務を負いません。Beeland はファンドが発行される時期、価格もしくは数量の決定またはファンドが換金されるもしくは他の金融商品、証券に転換される際に使用される算式の決定または計算の責任を負わず関与もしていません。Beeland はファンドの管理、運営、販売、取引に関して義務または責任を負いません。「Jim Rogers®」、「Rogers International Commodity Index®」、「Rogers International Commodity™」および「RICI®」は、James Beeland Rogers、Jim Rogers® または Beeland Interests, Inc. のトレードマークおよびサービスマークであり、使用許諾を要します。

※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。

「商品先物取引による運用に伴うリスク」、「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）」

※基準価額の動きが指数と十分に連動するものではありません。

※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。

## ダイワ/“RICI®”コモディティ・ファンド

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」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	販売会社が別に定める率 (上限)3.24%(税抜3.0%)	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	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 1.1124% (税抜 1.03%)	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。
投資対象とする 投資信託証券	年率 0.7925%	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 の概算値	年率 1.9049% (税込) 程度 (純資産総額によっては上回る場合があります。)	
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。

※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ください。

※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。

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

## ダイワ／“RICI®” コモディティ・ファンド 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)	登録金融機関	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
株式会社岩手銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第3号	○			
藍澤証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第6号	○		○	
池田泉州TT証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第370号	○			
いちよし証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第24号	○		○	
株式会社SBI証券	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第44号	○	○		○
クレディ・スイス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第66号	○	○	○	○
高木証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第20号	○			
東海東京証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第140号	○	○		○
内藤証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第24号	○			
浜銀TT証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第197号	○			
ばんせい証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第148号	○			
PWM日本証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第50号	○			
日の出証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第31号	○			
フィデリティ証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第152号	○			
松阪証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第19号	○		○	
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	
UBS証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第2633号	○	○	○	○
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○
リーディング証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第78号	○			
リテラ・クリア証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第199号	○			
ワイエム証券株式会社	金融商品取引業者	中国財務局長(金商)第8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。