

平成 25 年 5 月 13 日

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

ダイワ世界資産戦略ファンド（ダイワ SMA 専用）

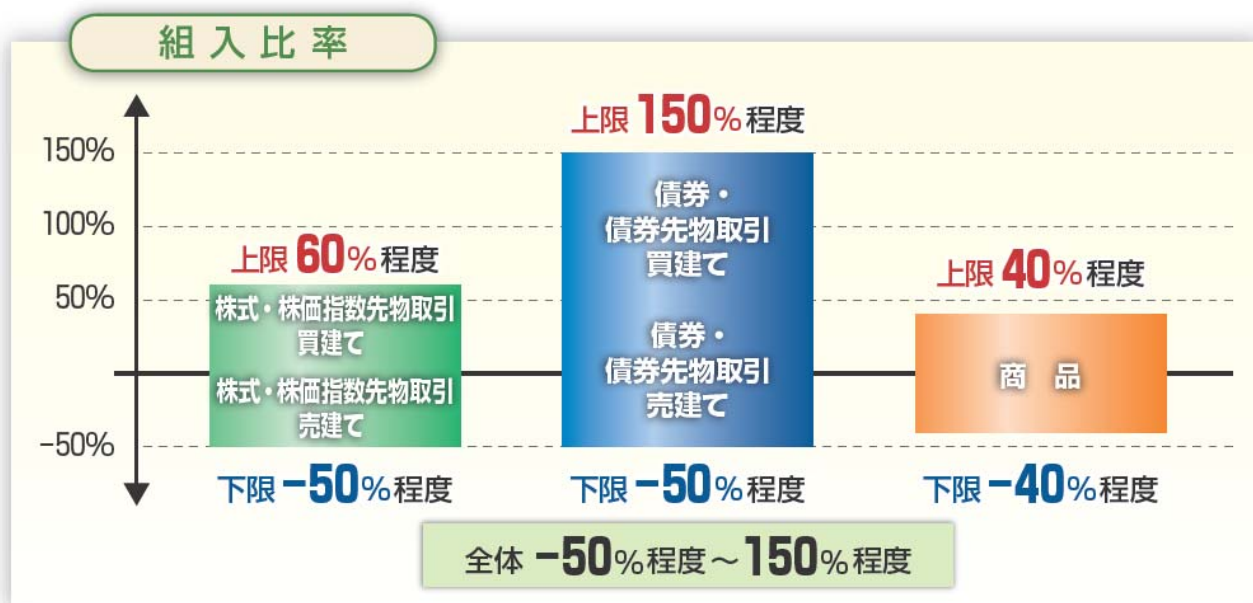
当社は、6 月 7 日に「ダイワ世界資産戦略ファンド（ダイワ SMA 専用）」の設定と運用開始を予定しておりますので、お知らせいたします。概要は下記のとおりです。なお、下記内容は変更される場合があります。

記

1. ファンドの特色

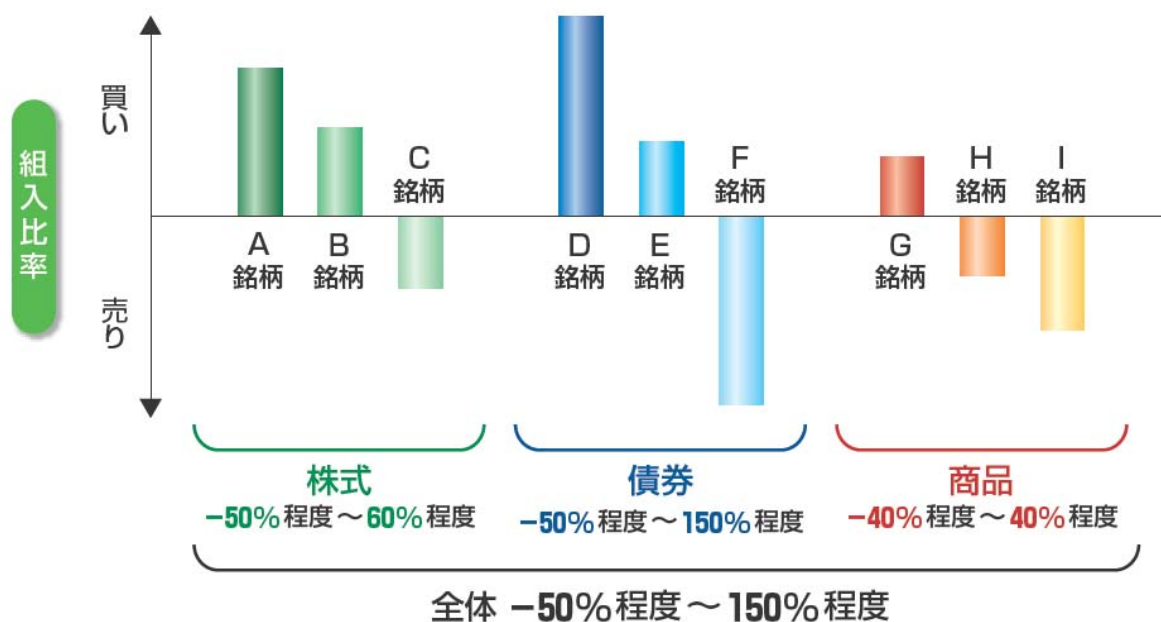
1 内外の株式、債券、商品に投資するとともに、派生商品を積極的に活用します。

- 内外の株式、債券および商品ならびにそれらの派生商品の買い（ロング）または売り（ショート）を行なうことにより、市場の動きにかかわらず収益を獲得することをめざします。
- 運用に当たっては、先物取引等のデリバティブ取引を積極的に活用します。
なお、商品への投資は、商品または商品指数を対象とする上場投資信託証券等を通じて行ないます。
- 各資産の実質的な組入比率は、以下の範囲とすることを基本とします。
※当ファンドにおいて、「実質的な組入比率」とは、当該各資産にかかる現物有価証券（上場投資信託証券等を除きます。以下同じ。）の組入総額および先物取引等の買建玉の時価総額を合計した額から、先物取引等の売建玉の時価総額を控除した額の、信託財産の純資産総額に対する比率をいいます。
- 現物有価証券の組入総額ならびに先物取引等の買建玉および売建玉の時価総額を合計した額は、信託財産の純資産総額の200%程度を上限とします。



• 上記の計算において、上場投資信託証券等およびオプション取引は先物取引に換算するものとします。

ポートフォリオのイメージ

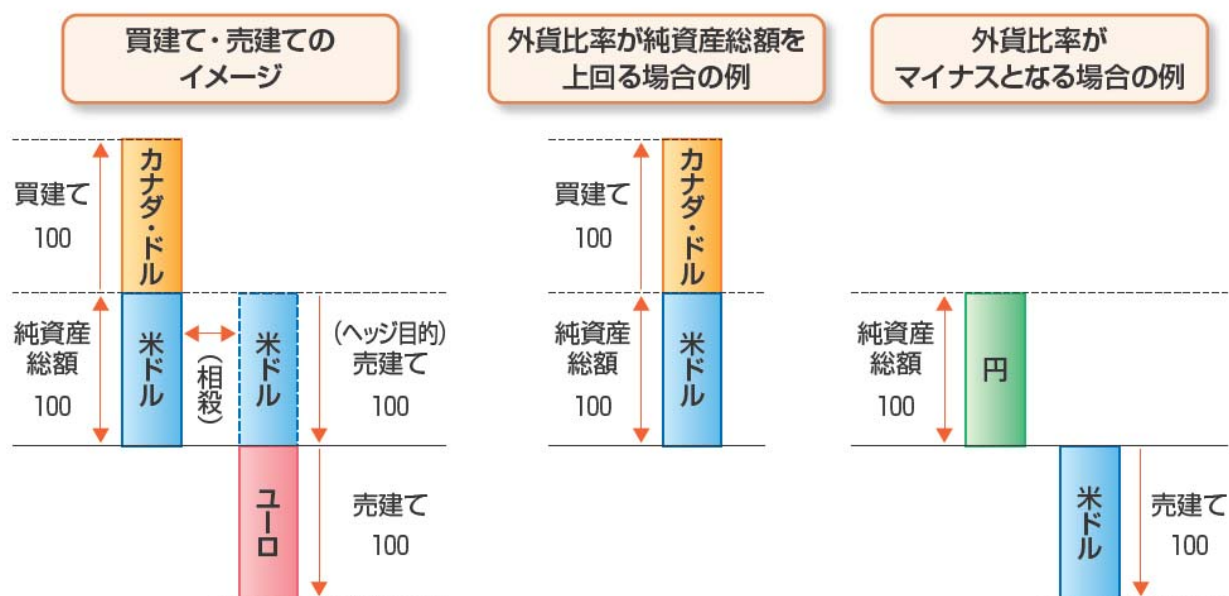


※上記はイメージであり、実際の運用とは異なる場合があります。

為替予約取引について（イメージ）

- パフォーマンスの向上を図るため、為替予約取引等をヘッジ目的以外で行なう場合があります。
- 為替予約取引等の日本円を基準とした買建ての合計額および売建ての合計額は、それぞれ信託財産の純資産総額の100%を上限とします。ただし、ヘッジ目的のものは除くものとします。

※ファンドの外貨比率が実質的に純資産総額を上回ること、またはマイナスの外貨比率となることがあります。



2

大和証券株式会社から運用にかかる助言を受けます。

大和証券の助言について

STEP 1

トレンドの分析・判断

価格動向や需給、市場固有の変動パターン等に対する分析を基に、各市場のトレンドを総合的に判断

STEP 2

将来の価格(目標値)の予測

大局的・中長期的な上値・下値の目処、短期的な上値・下値の目処を各種分析より予測

STEP 3

ポートフォリオの構築

マクロ環境や現在値を勘案し、個別資産および為替に対するエクスポージャーを決定、ポートフォリオを構築

- 当初設定日直後、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

当ファンドは、ダイワSMAに係る投資一任契約に基づいて、ダイワSMA口座の資金を運用するためのファンドです。

- ◆ 当ファンドの購入の申込みを行なう投資者は、販売会社とダイワSMA口座に関する
契約およびダイワSMAに係る投資一任契約を締結する必要があります。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

4

毎年6月10日および12月10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。

（注）第1計算期間は、平成25年12月10日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〈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、基準価額の水準等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、分配を行なわないことがあります。

各計算期末における収益分配前の基準価額（1万口当たり）が10,000円超の場合、10,000円を超える額を目処に分配金額を決定します。なお、計算期末に向けて基準価額が大きく上昇した場合など基準価額の動向等によっては、実際の分配額がこれと異なる場合があります。

主な投資制限

- 株式への投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

2. 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。

〈主な変動要因〉

<p>運用手法にかか るリスク</p>	<p>当ファンドでは、先物取引等を利用して純資産規模を上回る買建て、売建てを行なう場合があることから、価額変動リスクが現物有価証券に投資する場合と比べて大きくなる可能性があります。</p>
<p>有価証券（指数）先物 取引の利用に伴う リスク</p>	<p>先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合の先物価格の下落、または先物を売建てている場合の先物価格の上昇により損失が発生し、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>価格変動リスク・ 信用リスク</p>	<p>組入資産の価格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>株価の変動</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。</p>
<p>公社債の 価格変動</p>	<p>公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、公社債の価格は下落します。</p>
<p>商品（指数）による 運用に伴うリスク</p>	<p>商品等の取引価格は、さまざまな要因（商品の需給関係の変化、天候、農業生産、貿易動向、為替レート、金利の変動、政治的・経済的事由および政策、疾病、伝染病、技術発展等）に基づき変動します（個々の品目により具体的な変動要因は異なります。）。当ファンドの基準価額は、商品市場の変動の影響を受け、投資元本を下回ることがあります。</p>
<p>上場投資信託証券の 価格変動</p>	<p>取引所上場の投資信託証券は組入資産の価格変動等のほか、市況見通し、市場の需給等の要因で価格が変動します。組入れている取引所上場の投資信託証券の価格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>

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。
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。

3. ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用	
購入時手数料	販売会社が別に定めるものとします。 購入時手数料を徴収している販売会社はありません。
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	
運用管理費用 (信託報酬)	毎日、信託財産の純資産総額に対して年率0.945% (税抜0.90%) ※運用管理費用は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
委託会社	年率0.5985% (税抜0.57%)
販売会社	年率0.294% (税抜0.28%)
受託会社	年率0.0525% (税抜0.05%)
その他の費用・ 手数料	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。 ※「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。また、上場投資信託証券は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

4. ご参考

ファンド名	ダイワ世界資産戦略ファンド (ダイワ SMA 専用)
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	①当初申込期間 1万口当たり1万円 ②継続申込期間 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 (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5営業日目からお支払いします。
申込受付中止日	ニューヨーク証券取引所、モントリオール取引所、ロンドン証券取引所、ユーロネクスト・パリ、フランクフルト証券取引所、オーストラリア証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日 (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	①当初申込期間 平成25年5月27日から平成25年6月6日まで ②継続申込期間 平成25年6月7日から平成26年9月8日まで (終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)
設定日	平成25年6月7日
当初募集額	1,000億円を上限とします。
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、換金の申込みの受け付けを中止することがあります。
信託期間	平成25年6月7日から平成28年12月9日まで 受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長できます。

繰上償還	<ul style="list-style-type: none">●大和証券株式会社からの申入れにより、信託財産の運用助言にかかる投資顧問契約が解除される場合、わが国の公社債等による安定運用に順次切替えを行ない、ファンド全体が安定運用に入った後、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。<ul style="list-style-type: none">・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	毎年6月10日および12月10日（休業日の場合翌営業日） （注）第1計算期間は、平成25年12月10日（休業日の場合翌営業日）までとします。
収益分配	年2回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。
信託金の限度額	1兆円
公告	電子公告の方法により行ない、ホームページ [http://www.daiwa-am.co.jp/] に掲載します。
運用報告書	毎計算期末に作成し、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。
販売会社	大和証券
受託銀行	三井住友信託銀行

5. その他

詳しくは、「有価証券届出書」をご覧ください。また、「投資信託説明書（交付目論見書）」公表後は当該交付目論見書も併せてご覧ください。

以上