

2020年7月15日

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
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

世界セレクトティブ株式オープン (為替ヘッジあり/年2回決算型)

追加型投信/海外/株式



当社は、2020年7月31日に「世界セレクトティブ株式オープン（為替ヘッジあり/年2回決算型）」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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

記

1. ファンドの目的

日本を除く世界の金融商品取引所上場株式等に投資し、信託財産の成長をめざします。

2. ファンドの特色

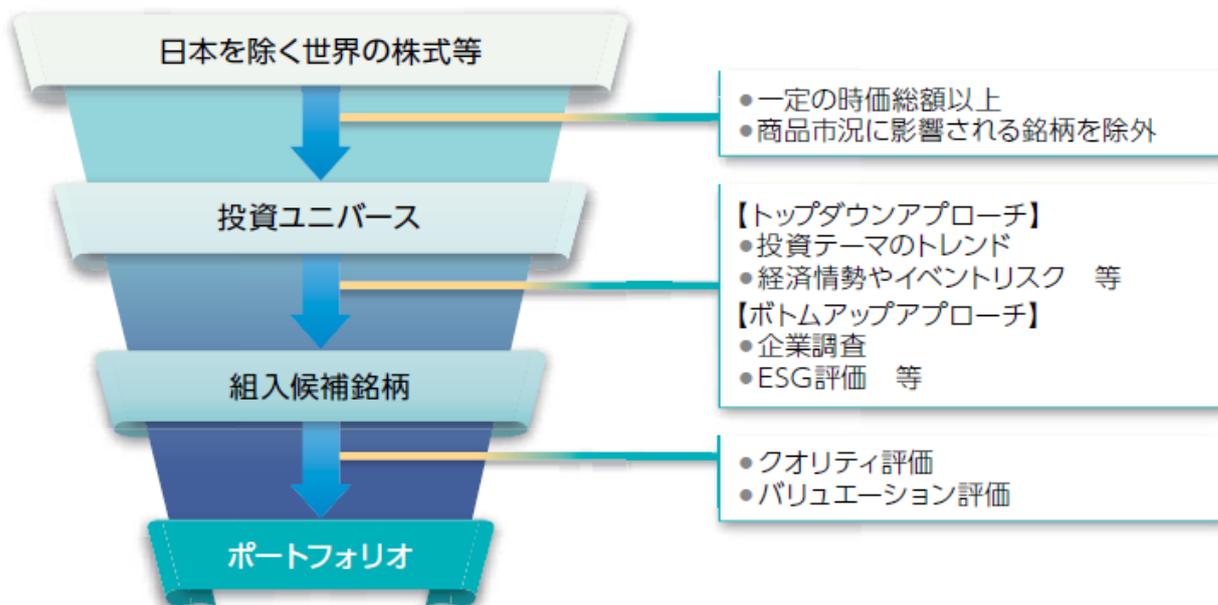


1 日本を除く世界の金融商品取引所上場株式等に投資します。

運用にあたっては、以下の方針を基本とします。

- 徹底したリサーチを通じて、持続的な優位性を持つ企業の株式等に投資することで、中長期での収益獲得をめざします。
- 市場環境に応じたポートフォリオの調整や株式組入比率の抑制などにより、世界の株式市場との連動性を一定程度以下に維持することで値下がりリスクの抑制に努めます。
- ポートフォリオ構築にあたっては、中長期での収益獲得に資すると考えられる銘柄への集中投資を行なうことを基本とします。

銘柄選定およびポートフォリオ構築のイメージ



(注)「株式等」…DR(預託証券)およびリート(不動産投資信託証券)を含みます。

※DR: Depositary Receiptの略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。また、通常は、預託された株式の通貨とは異なる通貨で取引されます。



株式等の運用は、マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッドが担当します。

マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッドについて

- マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッド(2006年設立、本拠地:オーストラリア)は、マゼラン・フィナンシャル・グループ(MFG)の投資運用部門です。国際優良企業への投資によるグローバル株式運用に強みを持ち、個人・機関投資家向けにグローバルな投資ファンドを提供しています。

投資哲学

持続可能な競争優位性を持つ国際優良企業へ、ボラティリティを抑制しつつ投資を行なうことは、株式の持つ長期的かつ本源的なリターンを獲得する上で最も有効である。

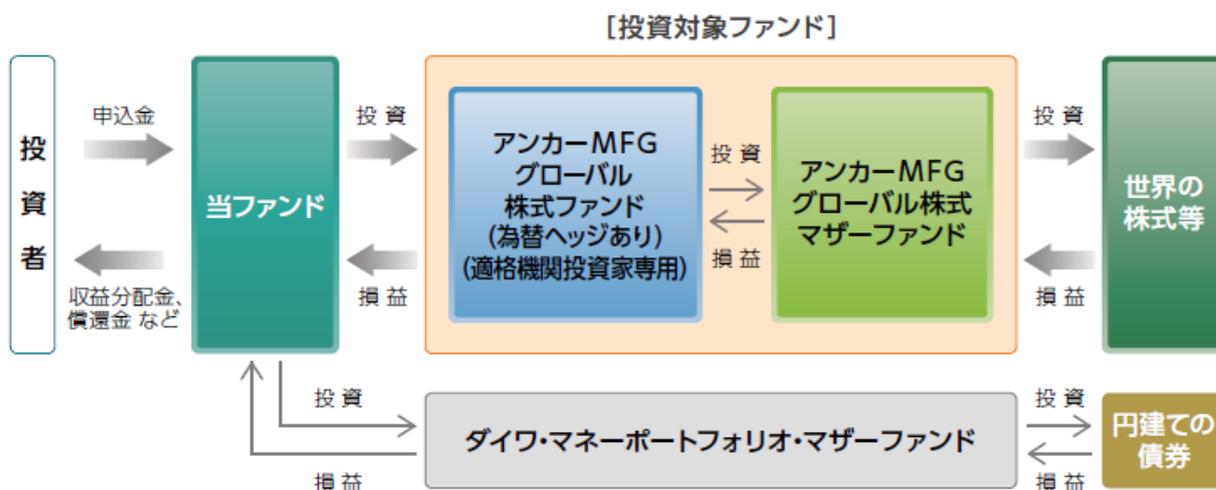


為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

- ◆ ただし、為替ヘッジを行なっても、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。また、為替ヘッジの手段がない、あるいは、ヘッジコストが過大と判断される際には、一部の通貨について、為替ヘッジを行なわない場合があります。
- ◆ 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。

ファンドの仕組み

- ◆ 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。
- ◆ 投資対象とする投資信託証券への投資を通じて、世界の株式等に投資します。



※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。

- ◆ 通常の状態では「アンカーMFGグローバル株式ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)」への投資割合を、高位に維持することを基本とします。
- ◆ 「アンカーMFGグローバル株式ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)」において、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。

- ◆ 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時、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.~3.の運用が行なわれないことがあります。



毎年4月25日および10月25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いません。

(注)第1計算期間は、2021年4月25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。

3. 投資リスク

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>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>当ファンドは、一銘柄当たりの組入比率が高くなる場合があり、より多数の銘柄に分散投資した場合に比べて基準価額の変動が大きくなる可能性があります。</p> <p>また、当ファンドは、新興国の株式にも投資することがあります。新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。</p> |
| <p>リ ー ト の 価 格 変 動</p> | <p>リートの価格は、不動産市況の変動、リートの収益や財務内容の変動、リートに関する法制度の変更等の影響を受けます。</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。</p> <p>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。特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。</p> <p>当ファンドは、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。また、一部の通貨について、為替ヘッジを行わない場合があるため、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。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。</p> |

| | |
|--|---|
|  <p>カントリー・リスク</p> | <p>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。</p> <p>新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。</p> |
| <p>そ の 他</p> | <p>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。</p> |

※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。

4. 追加的記載事項

【投資対象ファンドの概要】

1. アンカーMFGグローバル株式ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)

| | |
|---------|--|
| 運用の基本方針 | この投資信託は、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | マザーファンドの受益証券 [マザーファンド] 海外の金融商品取引所に上場している企業の株式等* *リート(不動産投資信託証券)やDR(預託証券)、その他の証券を含みます。 |
| 主な投資態度 | ①主として、マザーファンドの受益証券に投資することにより、信託財産の成長をめざして運用を行なうことを基本とします。 ②マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ③実質組入外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。ただし、為替ヘッジの手段がない、あるいは、ヘッジコストが過大と判断される際には、一部の通貨について、為替ヘッジを行なわない場合があります。 [マザーファンド] ①徹底したリサーチを通じて選別した持続的な優位性を持つ高クオリティ企業の株式等に中長期に投資することで、一つの経済サイクルを通して年率10%以上のリターン獲得をめざします。 ②ファンドの市場感応度を一定程度以下に調節することで値下がりリスクの抑制に努めます。 ③ポートフォリオの構築にあたっては、確信度の高い銘柄に対する集中投資を行ないます。投資銘柄数は、原則として20銘柄以上、40銘柄以下とします。 ④投資対象とする株式等は、取得時において、原則として時価総額250億米ドル以上の銘柄とします。ただし、原則として原油や天然資源などの商品市況に影響される銘柄は除きます。 ⑤外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行ないません。 ⑥マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッドに外貨建資産の運用の指図に関する権限を委託します。 |
| 管理報酬等 | 純資産総額に対し、年率0.825%(税抜0.75%)を乗じて得た額とします。 |
| 委託会社 | ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社 |
| 運用委託先 | [マザーファンド] マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッド |

ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社について

- 1889年シカゴにて信託銀行として創業の金融グループ、ノーザン・トラスト・コーポレーションの資産運用部門の日本拠点です。
- ノーザン・トラスト・コーポレーションの資産運用部門は、グローバルに運用拠点を持ち、世界各地の年金基金、ソブリン・ファンド、金融機関等の機関投資家を主要顧客としてパッシブ運用やマネージャー・オブ・マネージャーズ運用(運用会社のリサーチ能力を生かし、複数の外部運用会社を選定し組み合わせた運用)に強みを持っています。

2. ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

| | |
|--------------|---|
| 運用の基本方針 | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主な投資態度 | ①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・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 |

5. 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)3.3%(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1.1275% (税抜1.025%) | 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、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。 |
| 配分 (税抜) (注1) | 委託会社 | 年率0.30% |
| | 販売会社 | 年率0.70% |
| | 受託会社 | 年率0.025% |
| 投資対象とする 投資信託証券 | 年率0.825%(税抜0.75%) | 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 | 年率1.9525%(税込)程度 | |
| 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。

※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、上場不動産投資信託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。

6. ご参考

◆ 販売会社：丸三証券

| | | |
|--|------|-------------------------------|
|  購入時 | 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。 |

| | | |
|--|------|-----------------------------------|
|  換金時 | 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6営業日目からお支払いします。 |

| | | |
|---|--------------------|--|
|  申込について | 申込受付中止日 | ニューヨーク証券取引所またはオーストラリア証券取引所のいずれかの休業日(日本の休業日を除きます。)の前営業日 (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 | 2020年7月31日から2021年7月16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。) |
| | 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み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発生した場合には、購入、換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受付けた購入、換金の申込みを取消すことがあります。 |

| | | |
|---|---------|---|
|  <p>その他</p> | 信託期間 | 2024年4月25日まで(2020年7月31日当初設定) 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"> ●主要投資対象とするアンカーMFGグローバル株式ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)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。 <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4月25日および10月25日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、2021年4月25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。 (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 | 1,500億円 |
| | 公 告 | 電子公告の方法により行ない、ホームページ【 https://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、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。 ※2020年4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。 |

◆ 受託会社：三菱UFJ信託銀行

6. その他

くわしくは、「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