

ロジャーズ国際コモディティ指数®(RICI®)の 銘柄構成比率変更の発表について

2019年1月29日

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

ロジャーズ国際コモディティ指数®(以下、RICI®)について、RICI®委員会※より銘柄構成比率の変更についてのプレスリリースが発表されましたので、以下の通りご報告致します。

RICI®の構成銘柄のうち、牛乳の指数構成比率が0.1%から0.2%へ引き上げられ、板材の比率が1.0%から0.9%へ引き下げられます。

当該の変更につきましては、2019年1月末の限月乗換え時に変更されます。

弊社は、今回の変更により指数の継続性が失われるものではないと考えております。指数の変更に伴い、ファンドが投資対象ファンドを通じて保有する銘柄の構成比率を変更致します。

投資者の皆様におかれましては、引き続き御愛顧を賜りますよう宜しくお願い申し上げます。

【※ご参考】RICI®委員会は、RICI®の発案者であるジム・ロジャーズ®氏および、Daiwa Asset Management (America) Limited、UBS AG、Merrill Lynch、Price Asset Management、Diapason Commodities Management S.A.、CQGの代表者により構成されます。RICI®委員会メンバーは通常、毎年12月に会議を開催し、RICI®の計算方法、構成銘柄(品目)および指数の管理に関する決定等を行います。

当ファンドレターの対象ファンドは以下の通りです。

- ・ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド(愛称:賢者のセオリー)
- ・ダイワ／“RICI®”コモディティ・ファンド
- ・スマート・アロケーション・Dガード
- ・【ダイワファンドラップ専用投資信託】ダイワファンドラップコモディティセレクト
- ・ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(成長型)
- ・ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(安定型)
- ・ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)
- ・ダイワ／ロジャーズ国際コモディティ™・ファンド
- ・ダイワ・ダブルバランス・ファンド(Dガード付／部分為替ヘッジあり)
- ・DCスマート・アロケーション・Dガード

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、販売会社よりお渡しする「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 <https://www.daiwa-am.co.jp/>

変更前後の指数構成比率

	変更前	変更後
エネルギー	40.00%	40.00%
原油(WTI)	15.00%	15.00%
原油(北海ブレント)	13.00%	13.00%
天然ガス	6.00%	6.00%
RBOBガソリン	3.00%	3.00%
ヒーティング・オイル	1.80%	1.80%
ガス・オイル	1.20%	1.20%

	変更前	変更後
産業金属	14.00%	14.00%
アルミニウム	4.00%	4.00%
銅	4.00%	4.00%
鉛	2.00%	2.00%
亜鉛	2.00%	2.00%
ニッケル	1.00%	1.00%
スズ	1.00%	1.00%

	変更前	変更後
貴金属	11.10%	11.10%
金	5.00%	5.00%
銀	4.00%	4.00%
プラチナ	1.80%	1.80%
パラジウム	0.30%	0.30%

	変更前	変更後
家畜	3.00%	3.00%
生牛	2.00%	2.00%
豚赤身肉	1.00%	1.00%

	変更前	変更後
穀物	20.00%	20.00%
トウモロコシ	4.75%	4.75%
大豆	3.50%	3.50%
小麦(CBOT)	2.75%	2.75%
大豆油	2.00%	2.00%
欧州小麦	2.00%	2.00%
小麦(CME)	1.00%	1.00%
菜種	1.00%	1.00%
春小麦(MGEX)	1.00%	1.00%
大豆粕	0.75%	0.75%
米	0.75%	0.75%
オーツ麦	0.50%	0.50%

	変更前	変更後
ソフト	9.90%	10.00%
綿花	4.20%	4.20%
コーヒー	2.00%	2.00%
砂糖	1.00%	1.00%
白糖	1.00%	1.00%
ココア	1.00%	1.00%
オレンジジュース	0.60%	0.60%
牛乳	0.10%	↗ 0.20%

	変更前	変更後
その他	2.00%	1.90%
ゴム	1.00%	1.00%
板材	1.00%	↘ 0.90%

今回比率が変更される銘柄

ご参考までに、当該変更に関して指数管理会社より発表され、共同通信PRワイヤーより配信されたプレスリリースを次頁に掲載いたします。

以上

ロジャーズ国際コモディティ指数®(RICI®)の 銘柄構成比率変更の発表について

2018年11月27日

ビーランド・インタレスツ(Beeland Interests, Inc.)

ロジャーズ国際商品指数(RICI(R))が構成銘柄比率を調整

AsiaNet 76357 (2144)

【シンガポール2018年11月26日PR Newswire＝共同通信JBN】ジム・ロジャーズ氏とビーランド・インタレスツ(Beeland Interests, Inc.)は、ロジャーズ国際商品指数(Rogers International Commodity Index、RICI(R))委員会の年次会合の後、RICIの構成銘柄比率を下記のように調整すると発表した。

クラスIIIミルクの比率は0.10%から0.20%に増加し、木材は1.0%から0.90%に減少する。RICI農業サブ・インデックスのインデックス比率は比例して調整される。

これらの調整は、2019年1月末に始まる2019年1月のインデックス・ロールオーバーから有効になる。

RICIは、農産物、エネルギー商品、金属、鉱物など世界の経済活動に広く利用されている国際取引商品群(バスケット)の値動きを表す指数である(採用されている先物商品は38種類)。RICIおよびそのサブ・インデックスは世界各地で多くの投資銀行や投資家に利用されている。

現状のRICIハンドブックのコピーは、以下のリンク先から無料でダウンロードできる。

<http://www.beelandinterests.com/RICI%20Handbook.html>

コモディティ投資の提唱者である投資家ジム・ロジャーズ氏は1997年から1998年にかけてRICIを発案し、現在はこの指数の所有企業であるビーランド・インタレスツの最高経営責任者(CEO)を務めている。ロジャーズ氏が現在議長を務めているRICI委員会が、指数の構成目と構成比率を決定する。ジム・ロジャーズ氏は「冒険投資家ジム・ロジャーズ世界バイク紀行」(Investment Biker)、「冒険投資家ジム・ロジャーズ世界大発見」(Adventure Capitalist)、「大投資家ジム・ロジャーズが語る商品の時代」(Hot Commodities)、「ジム・ロジャーズ中国の時代」(A Bull In China)、「人生と投資で成功するために娘に贈る12の言葉」(A Gift to My Children)、「Street Smarts – Adventures on the Road and in the Markets」の著者でもある。

「ジム・ロジャーズ」(Jim Rogers)、「ジェームズ・ビーランド・ロジャーズ・ジュニア」(James Beeland Rogers, Jr.)、「ロジャーズ」(Rogers)はビーランド・インタレスツの商標/サービスマークであり、「ロジャーズ国際商品指数」(Rogers International Commodity Index)と「RICI」はビーランド・インタレスツの登録商標/サービスマークである。許可なく使用できない。「ジム・ロジャーズ」および「ジェームズ・ビーランド・ロジャーズ・ジュニア」の個人名ならびに肖像権はジェームズ・ビーランド・ロジャーズ・ジュニアが所有しており、その許可なく使用できない。

ソース: Beeland Interests, Inc.

▽問い合わせ先

Ms. Hiang Lim via email: hiang@jimrogers.com

「ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド(愛称:賢者のセオリー)」およびその関連ファンドであるケイマン諸島投資信託「Daiwa“RICI”Fund」(以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。)はJames BeelandRogers、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®」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。

「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。

「スマート・アロケーション・Dガード」「ダイワRICI®ヘッジ型マザーファンド」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。

「ダイワファンドラップコモディティセレクト」およびその組入ファンドであるケイマン諸島投資信託「ダイワ“RICI”ファンド」(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®」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。

「Daiwa “RICI” Fund」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®」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。

「ダイワ/ロジャーズ国際コモディティ・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。

「ダイワ・ダブルバランス・ファンド(Dガード付/部分為替ヘッジあり)」「ダイワRICI®ヘッジ型マザーファンド」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。

「DCスマート・アロケーション・Dガード」「ダイワRICI®ヘッジ型マザーファンド」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。

投資信託のご購入に際し、お客さまにご理解いただきたいこと

お客さまが投資信託をご購入する際には、以下の2つの注意点を十分ご理解いただいた上で、当該投資信託の「投資信託説明書（交付目論見書）」を必ずご覧いただき、ご自身の判断で投資に関する最終決定をなさるようお願いいたします。

注意点① お客さまにご負担いただく費用について

	種類	料率 (税込)	費用の内容	ご負担いただく費用金額のイメージ (金額は左記の料率の上限で計算しています)
直接的にご負担いただく費用	購入時手数料	0~3.24% (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。	基準価額10,000円の時に100万口を購入される場合、 最大32,400円 をご負担いただけます。
	信託財産留保額	0~0.5%	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ます。	基準価額10,000円の時に100万口を換金される場合、 最大5,000円 をご負担いただけます。
信託財産で間接的にご負担いただく費用	運用管理費用 (信託報酬)	年率 0~2.5528%	投資信託の運用・管理費用として、販売会社、委託会社、受託会社の三者が、信託財産の中から受け取る報酬です。	基準価額10,000円の時に100万口を保有される場合、 最大1日あたり約70円 をご負担いただけます。
	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けます。(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)	

※費用の種類や料率等は販売会社や個々の投資信託によって異なります。上記費用の料率は**大和投資信託が運用する一般的な投資信託の料率**を表示しております。投資信託によっては**換金手数料**をご負担いただく場合があります。※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。※投資信託により異なりますので、くわしくは販売会社にお問い合わせください。また、詳細につきましては「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

注意点② 投資信託のリスクについて

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。投資信託が投資する有価証券等によりリスクの要因は異なりますので、お申込みにあたっては、投資信託の「投資信託説明書（交付目論見書）」をご覧ください。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

〈委託会社〉

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