

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

投資対象とする投資信託証券の追加のお知らせ

2019年9月12日

平素はダイワファンドラップをご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

「ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト」においては、株式会社 大和ファンド・コンサルティングの助言を受け、指定投資信託証券の選定、組入比率の決定を行っております。この度、投資対象とする投資信託証券の変更がありましたのでお知らせします。

■ 投資対象として新たに追加する投資信託証券

当ファンドの助言会社である株式会社 大和ファンド・コンサルティングの助言に基づき、投資対象とする投資信託証券の追加を9月12日に実施しました。

◇マラソン新興国債券ファンド 市場リスクヘッジ・クラス（ケイマン籍、円建）

（追加する理由）

- ・ 精緻なマクロ・ファンダメンタルズおよび投資対象債券の分析に基づいて新興国債券への投資が実施されており、さらにスワップ取引を活用した収益の安定化が期待できることから、本ファンドの組み入れが市場環境の影響を抑えつつ安定的なパフォーマンスを獲得するのに資すると考えられるため。

（運用会社）

- ・ マラソン・アセット・マネジメント・エルピー

（主要投資対象）

- ・ 新興国の債券等

（ベンチマーク）

- ・ なし

Ⅰ 投資対象として新たに追加する投資信託証券（続き）

◇ケイマン籍の外国投資法人「ナインティーンセブンティセブン・グローバル・マージャー・アービトラージ・ジャパン・リミテッド」が発行する「ナインティーンセブンティセブン・グローバル・マージャー・アービトラージ・ジャパン・リミテッド」のJPYクラス投資証券（円建）

（追加する理由）

- ・ 実績ある格付システムや経験豊富な運用体制によって、機動的な投資対象の評価見直しや大胆なエクスポージャーの調整を実施しており、本ファンドの組み入れが市場環境の影響を抑えつつ安定的なパフォーマンスを獲得するのに資すると考えられるため。

（運用会社）

- ・ UBSオコーナー・エルエルシー

（主要投資対象）

- ・ 世界各国の株式、デリバティブ取引など

（ベンチマーク）

- ・ なし

I ファンドの目的・特色

ファンドの目的

- 各ファンドの目的は、次のとおりです。

ファンド名	ファンドの目的
FW日本株式セレクト	わが国の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。
FW外国株式セレクト	海外の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。
FW外国株式EM+	
FW日本債券セレクト	わが国の債券に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。
FW外国債券セレクト	海外の債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
FW外国債券EM+	
FW J-REITセレクト	わが国のリート(不動産投資信託)に投資し、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。
FW外国REITセレクト	海外のリート(不動産投資信託)に投資し、信託財産の中長期的な成長と配当等収益の確保をめざします。
FWコモディティセレクト	コモディティ(商品先物取引等)に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざします。
FWヘッジFセレクト	絶対収益 ^(注) の獲得により、信託財産の成長をめざします。 (注)「絶対収益」とは必ず収益を得るという意味ではなく、市場等の動きに左右されない(相対的でない)収益、という意味です。

(※)上記10本のファンドを総称して「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」といいます。

ファンドの特色

1. 「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」は、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。
 - 「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」の購入の申込みを行なう投資者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。
2. 「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」を構成する各ファンドは、投資対象が異なり、投資信託証券への投資を通じて実質的な運用を行ないます。
FW ヘッジ F セレクトは、絶対収益の獲得をめざす複数の投資信託証券^(注)に投資します。
(注) 以下、「指定投資信託証券」といいます。
3. 指定投資信託証券の選定、組入比率の決定は、株式会社 大和ファンド・コンサルティングの助言を受け、これを行ないます。
4. FW ヘッジ F セレクトは、絶対収益の獲得をめざす複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。

■ ファンドの目的・特色

◆ 下記は投資信託証券（指定投資信託証券等）について、2019年8月現在で委託会社が各投資信託証券の運用会社から入手した情報をもとに記載したものであり、今後、名称変更となる場合、繰上償還等により投資信託証券が除外される場合、新たな投資信託証券が追加となる場合があります。

● FW ヘッジ セレクト

投資信託証券	運用会社	主要投資対象	ベンチマーク
ダイワ・トピックス・ニュートラル (FOFs用) (適格機関投資家専用)	大和証券投資信託委託株式会社	わが国の株式および 株価指数先物取引の 売建て	—
大和住銀Fof用ジャパン・ マーケット・ニュートラル (適格機関投資家限定)	三井住友DSアセット・マネジメント 株式会社	わが国の株式および 株価指数先物取引等	—
ニッセイ・グローバル・ボンド・ オポチュニティ (FOFs用) (適格機関投資家専用)	ニッセイアセット マネジメント株式会社	日本および世界の 先進国の公社債および 国債先物取引等	—
SMAM・国内株式ロングショート Vファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	三井住友DSアセット・マネジメント 株式会社	わが国の株式への 投資と、信用取引等 による株式の売建て	—
グローバル・ボンドアルファ戦略 ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	アセット・マネジメント・One株式会社	日本および世界各国 の債券先物取引	—
ストラテジックCBファンド (適格機関投資家専用)	日興アセット・マネジメント株式会社	転換社債型新株予約 権付社債 (CB) および 信用取引による株式 の売建て	—
ブルーベイ・グローバル・ソブリン・ オポチュニティーズ (ケイマン籍、 円建)	ブルーベイ・アセット・マネジメント・ エルエルピー	エマージング諸国を 含むグローバルの 国債、金利、通貨	—
ヌビーン・エクイティ・マーケット・ ニュートラル・ファンド (円ヘッジ クラス) (ケイマン籍、円建)	ヌビーン・アセット・マネジメント・ エルエルシー	米国の株式	—
マラソン新興国債券ファンド 市場 リスクヘッジ・クラス (ケイマン籍、 円建) ^(注)	マラソン・アセット・マネジメント・エルピー	新興国の債券等	—
ルクセンブルグ籍の外国証券投資 法人「ブラックロック・ストラテジッ ク・ファンズ」が発行する「ブラック ロックUKエクイティ・アブソリュート・ リターン・ファンド」の円ヘッジ クラスI投資証券 (円建)	ブラックロック・インベストメント・ マネジメント (UK) リミテッド	英国の株式もしくは 株式関連の派生商品等	—
ルクセンブルグ籍の外国証券投資 法人「JPモルガン・インベストメン ト・ファンズ」が発行する「グロー バル・マクロ・オポチュニティーズ・ ファンド-JPMグローバル・マクロ・ オポチュニティーズ (Iクラス) (円ヘ ッジ)」の投資証券 (円建)	JPモルガン・アセット・マネジメント (UK) リミテッド	世界各国の株式、 債券等、デリバティブ 取引	ICEユーロLIBOR1か月指数 (円ヘッジ後)
アイルランド籍の外国証券投資法人 「イートン・パンス・インターナシ ョナル (アイルランド) ファンズ・ ピーエルシー」が発行する「イートン・ パンス・インターナショナル (アイル ランド) グローバル・マクロ・ ファンド」のクラスI 2投資証券 (円建)	イートン・パンス・グローバル・ アドバイザーズ・リミテッド	新興国、フロンティア諸国を 含むグローバル市場の通貨、 ソブリン・クレジット、金利、 株式	—
ルクセンブルグ籍の外国証券投資 法人「ピクテTR」が発行する「アト ラス HJ JPY (円ヘッジ)」の投資証券 (円建)	ピクテ・アセット・マネジメント・エス・ エイ、ピクテ・アセット・ マネジメント・リミテッド	世界各国の株式、 派生商品等	—
ルクセンブルグ籍の外国証券投資 法人「JPモルガン・ファンズ」が発行 する「US オポチュニスティック・ ロング・ショート・エクイティ・ ファンド-US オポチュニスティック・ ロング・ショート・エクイティ・ ファンド (Iクラス) (円 ヘッジ)」の投資証券 (円建)	JPモルガン・インベストメント・ マネージメント・インク	米国の株式、 デリバティブ取引	ICE1 Month USD LIBOR 円ヘッジ
アイルランド籍の外国証券投資法人 「マン・ファンズ・VI ピーエルシー」 が発行する「マン・オルタナティブ・ スタイル・リスク・プレミア」のクラス IH 投資証券 (円建)	マン・ソリューションズ・リミテッド	世界の株式、債券、 通貨および派生商品	—
ルクセンブルグ籍の外国証券投資 法人「ブラックロック・ストラテジッ ク・ファンズ」が発行する「ブラック ロック・アメリカス・ダイバーシファ イド・エクイティ・アブソリュート・ リターン・ファンド」のクラスI2円ヘ ッジ投資証券 (円建)	ブラックロック・インスティテューシ ョナル・トラスト・カンパニー、 エヌ・エイ	米国、カナダ、 ラテンアメリカ諸国の 株式および株式関連 の派生商品等	—
ケイマン籍の外国投資法人「ナイン ティーンセプティセブン・グロー バル・マーチャント・アービトラージ・ ジャパン・リミテッド」が発行する「 ナインティーンセプティセブン・ グローバル・マーチャント・アー ビトラージ・ジャパン・リミテッド」 のJPYクラス投資 証券 (円建) ^(注)	UBSオコーナー・エルエルシー	世界各国の株式、 デリバティブ取引など	—

※(注)については、2019年9月12日に追加となりました。

※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。

「株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）」、「公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク、ハイ・イールド債券への投資リスク、転換社債への投資リスク）」、「デリバティブ取引の利用に伴うリスク」、「有価証券（指数）先物取引等の利用に伴うリスク」、「外国為替予約取引の利用に伴うリスク」、「運用手法にかかるリスク・留意点」、「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）」

※新興国には先進国とは異なる新興国市場のリスクなどがあります。

※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	販売会社が別に定める率 ※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		
	料率等	費用の内容
運用管理費用（信託報酬）	年率 0.4752%* (税抜 0.44%) *消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.484%となります。	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。
投資対象とする投資信託証券	年率 0.4428% (税抜 0.41%) ~ 年率上限 2.02% *上記は消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、以下の率となります。 年率 0.451% (税抜 0.41%) ~ 年率上限 2.02% ただし、実績報酬制をとる投資対象ファンドの運用成果によっては、これを上回ることがあります。	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(2019年7月時点)	年率 1.403±0.49%程度* (税込) (実際の組入状況等により変動します。) *消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、1.415±0.48%程度となります。	
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。

※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。

※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。

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

当資料のお取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が作成したものです。
- 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くださいのうえ、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おりますが、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。記載する指数・統計資料等の知的所有権、その他一切の権利はその発行者および許諾者に帰属します。また、税金、手数料等を考慮しておりませんので、投資者の皆さまの実質的な投資成果を示すものではありません。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なく変更されることがあります。記載する投資判断は現時点のものであり、将来の市況環境の変動等を保証するものではありません。
- 当資料中で個別企業名が記載されている場合、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。