

香港ハンセン指数ファンド(通貨選択型) 南アフリカランドコース 基準価額の下落について

2016年8月25日

当社公募投信のうち、以下のファンドの基準価額が5%以上下落していますので、お知らせいたします。

※ブル・ベア型投信、ETF(上場投資信託)を除く。

回次コード	8月25日 下落率 5.0%以上のファンド	基準価額	前日比	前日比騰落率
海外株式 3135	香港ハンセン指数ファンド(通貨選択型)南アフリカランドコース	6,135 円	-333 円	-5.1%

※当日の収益分配金(税引前)支払い前の価額を用いて前日比騰落率を算出しています。

◆以下に主な基準価額変動要因となった市況環境について掲載します。

【市場の動向】

8月24日(現地、以下同様)の香港株式市場は、ここ最近の上昇が急だったことや、週末のイエレンFRB(米国連邦準備制度理事会)議長の発言への警戒感もあり、利益確定売りが優勢となり、ハンセン指数は反落しました。

南アフリカ・ランドは、昨年12月に就任したゴードン財務相に、警察当局から出頭命令が出されたとの報道が嫌気されて下落しました。2016年5月、ゴードン財務相は国税庁長官時代、スパイ部門設立に関与した容疑で捜査が進められているとの報道がされていました。

【主要指標の動き】

市場指数

	直近値 8月24日	騰落率 8月23日比
香港 ハンセン指数	22,820.78	▲0.8%

為替(対円)

	直近値 8月24日	騰落率 8月23日比
南アフリカ・ランド	7.11	▲4.3%

※南アフリカ・ランドの騰落率は、基準価額の動きに対応する、ロンドン時間16時のレートを元に算出しています。

(出所)ブルームバーグのデータを基に大和投資信託が作成

以上

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。■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/>

収益分配金に関する留意事項

- ◆ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

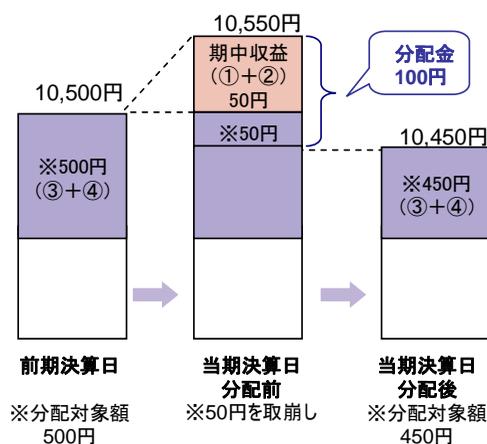
投資信託で分配金が支払われるイメージ



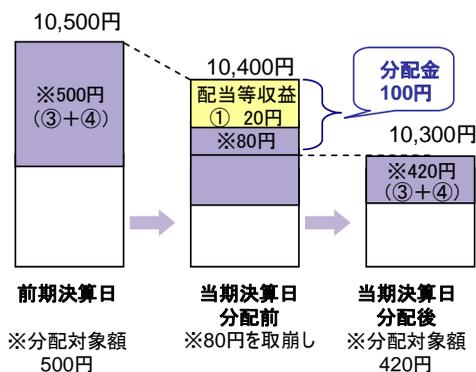
- ◆ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



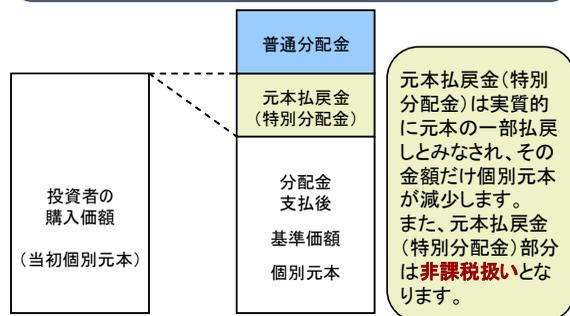
前期決算日から基準価額が下落した場合



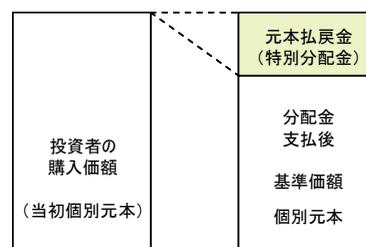
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

- ◆ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は**非課税扱い**となります。

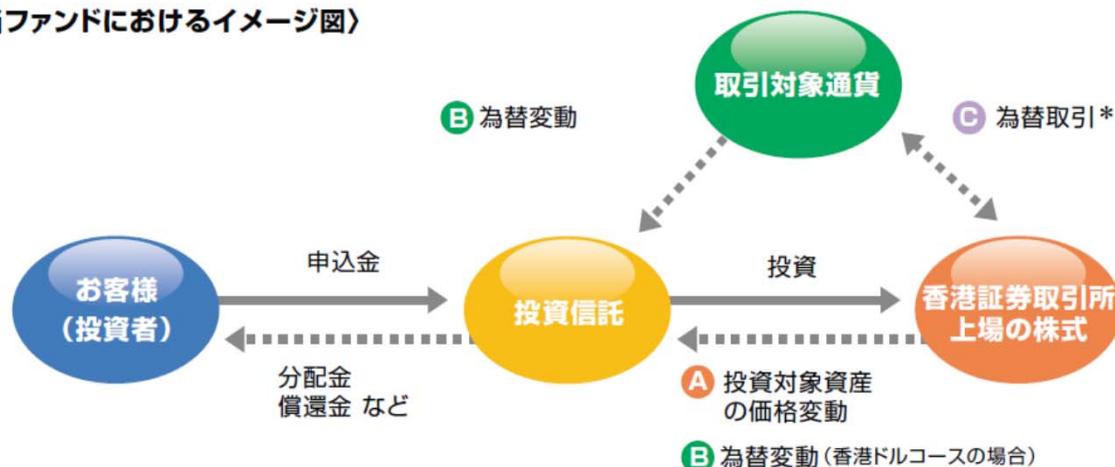
普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の(特別分配金)額だけ減少します。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

通貨選択型ファンドの収益のイメージ

- 通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。

〈当ファンドにおけるイメージ図〉



*取引対象通貨が円以外の場合には、当該取引対象通貨の対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

- 当ファンドの収益源としては、以下の3つの要素が挙げられます。

これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

収益の源泉	=	A 香港証券取引所上場の株式の 配当、値上がり/値下がり	+	B 為替差益/差損	+	(注) C 為替取引によるプレミアム/コスト (金利差相当分の収益/費用)
収益を得られる ケース		株価の上昇、配当収入		為替差益の発生 ・円に対して取引対象通貨高 ・円に対して香港ドル高 (香港ドルコースの場合)		取引対象通貨の短期金利 > 香港ドルの短期金利 プレミアム(金利差相当分の収益)の発生
損失やコストが 発生する ケース		株価の下落 ・発行企業の経営不安、倒産等		為替差損の発生 ・円に対して取引対象通貨安 ・円に対して香港ドル安 (香港ドルコースの場合) ※日本円コースを除きます。		コスト(金利差相当分の費用)の発生 取引対象通貨の短期金利 < 香港ドルの短期金利 ※香港ドルコースを除きます。

(注)取引対象通貨がブラジル・レアルの場合、為替取引を行なう際にNDF取引を利用する場合があります。NDF取引を用いて為替取引を行なう際、為替取引によるプレミアム/コスト(金利差相当分の収益/費用)は、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

※上記はイメージであり、実際の投資成果を示唆、保証するものではありません。

香港ハンセン指数ファンド(通貨選択型) 南アフリカランドコース

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

- 香港証券取引所上場の株式に投資するとともに、為替取引を行なうことで信託財産の成長をめざします。

ファンドの特色

- 香港証券取引所上場の株式に投資します。
 - ◆株式への投資にあたっては、香港ハンセン指数の値動きを概ね捉えることをめざします。
- 為替取引を行ないます。
 - ※ただし、「香港ドルコース」では為替取引を行ないません。
 - ◆通貨が異なる6つのコースがあります。
 - 各通貨コースの為替取引と為替差益または差損について

コース名 (取引対象通貨)	為替取引	為替差益または差損
ブラジルリアルコース (ブラジル・リアル)	香港ドル建資産について 香港ドル売り/ブラジル・リアル買い	ブラジル・リアル/円の為替変動による為替差益または差損が発生
豪ドルコース (豪ドル)	香港ドル建資産について 香港ドル売り/豪ドル買い	豪ドル/円の為替変動による為替差益または差損が発生
南アフリカランドコース (南アフリカ・ランド)	香港ドル建資産について 香港ドル売り/南アフリカ・ランド買い	南アフリカ・ランド/円の為替変動による為替差益または差損が発生
資源国通貨コース (資源国通貨)	香港ドル建資産について 香港ドル売り/資源国通貨買い(注1)	資源国通貨/円の為替変動による為替差益または差損が発生
香港ドルコース (なし)	なし	香港ドル/円の為替変動による為替差益または差損が発生
日本円コース (日本円)	香港ドル建資産について 香港ドル売り/日本円買い	なし(注2)

(注1)「資源国通貨コース」では、ブラジル・リアル、豪ドル、南アフリカ・ランドに対して3分の1程度ずつ為替取引を行ないます。

(注2)「日本円コース」では、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、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。

- ◆6つのコースの間でスイッチング(乗換え)を行なうことができます。
 - ※販売会社によっては取扱いコースが異なる場合があります。また、販売会社によっては、スイッチング(乗換え)のお取扱いがない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。
- 毎月20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。
- ※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。

ハンセン指数は、ハンセン・データ・サービス・リミテッドからライセンスを得たハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドにより算出および公表されています。ハンセン指数という商標および名称は、ハンセン・データ・サービス・リミテッドが独占的に所有しています。ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドおよびハンセン・データ・サービス・リミテッドは、大和証券投資信託委託株式会社が「香港ハンセン指数ファンド(通貨選択型)」およびその投資対象ファンドである「ケイマン籍の外国投資信託ダイヤ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド」(以下、「本商品」)に関連してハンセン指数を使用することおよび参照することに同意していますが、ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドおよびハンセン・データ・サービス・リミテッドは、本商品のプロカーもしくは保有者またはその他の者に対し、(i)ハンセン指数およびその算定またはそれに関連する情報の正確性または完全性、または(ii)ハンセン指数、ハンセン指数構成銘柄またはハンセン指数に含まれるデータの目的適合性もしくは適当性、または(iii)ハンセン指数、ハンセン指数構成銘柄またはハンセン指数に含まれるデータをいかなる目的のためであれ、ある者が使用したことにより結果を得ることにつき、保証、表明または確約するものではなく、ハンセン指数に関していかなる種類の保証、表明または確約を明示的にも黙示的にも行なうものではありません。ハンセン指数の算定および編集の手順および基準ならびに関係する一または複数の計算式、構成銘柄および構成要素は、いつでもハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドにより通知なしに変更または修正されることがあります。適用法令により許容される範囲で、(i)本商品に関連して大和証券投資信託委託株式会社がハンセン指数を使用したことおよび/もしくは参照したことに関して、または(ii)ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドによるハンセン指数の算定における不正確性、欠落、過誤もしくは誤謬に対し、または(iii)第三者から提供されるハンセン指数の算定に関連して使用される情報の不正確性、欠落、過誤、誤謬もしくは不完全性に対し、または(iv)上記のいずれかの結果、本商品のプロカーもしくは保有者または本商品を取扱うその他の者が直接または間接的に被る可能性のある経済的またはその他の損失に対し、ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドまたはハンセン・データ・サービス・リミテッドは何らの責任または債務を負うものではなく、また、プロカー、保有者または本商品を取扱うその他の者は、いかなる方法でも本商品に関連してハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドおよび/またはハンセン・データ・サービス・リミテッドに対して請求、訴訟または法的手続きを行なうことはできません。したがって、プロカー、保有者または本商品を取扱うその他の者は、かかる免責条項を十分に認識した上で本商品を取扱うものとし、ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドおよびハンセン・データ・サービス・リミテッドに依拠することはできません。誤解がないように付言すると、かかる免責条項により、プロカー、保有者またはその他の者とハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドおよび/またはハンセン・データ・サービス・リミテッドとの間に契約上のまたは準契約上の関係が生じるものではなく、また、かかる関係が生じたとしても解してはなりません。

香港ハンセン指数ファンド(通貨選択型)南アフリカランドコース

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。

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)」、「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。

※投資対象資産の通貨である香港ドルの為替変動リスクを完全に排除することはできませんので、基準価額は円に対する香港ドルの為替変動の影響を受ける場合があります。また、取引対象通貨の金利が香港ドルの金利より低いときには、金利差相当分がコストとなります。

※NDF 取引を用いて為替取引を行なう際、コストは需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

※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。

※当ファンドの投資対象である外国投資信託の株式の運用にあたっては、香港ハンセン指数の値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないますが、資金の流出入や売買等の要因から、基準価額は当該指数の動きと乖離する場合があります。

※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 (上限)3.24%(税抜3.0%) スイッチング(乗換え)による購入時の申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。	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 1.2204% (税抜 1.13%)	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。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。
投資対象とする投資信託証券	〔香港ドルコース以外〕 年率 0.40%程度 〔香港ドルコース〕 年率 0.39%程度	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	〔香港ドルコース以外〕 年率 1.6204% (税込) 程度 (純資産総額によっては上回る場合があります。) 〔香港ドルコース〕 年率 1.6104% (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い合わせください。

※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

※1ページ目の「当資料のお取り扱いにおけるご注意」をよくお読みください。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）南アフリカランドコース 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
SMBCフレンド証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第40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。