

## 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

2016年9月10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が、この度、投資対象とする投資信託証券の追加を実施し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

当ファンドの運用助言者である株式会社 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10日に実施しました。

#### ◇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)

(追加する理由)

- 株価変動のきっかけとなるカタリストやマーケット環境を的確に見極めた上でバランス良くポートフォリオを構築しており、安定的な収益獲得が期待される点を評価したため。また、当ファンドを追加することにより株式市場に対する相関を抑えながらリターンの向上が期待される。

(運用会社)

- 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  
ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッドは、1988年に設立された世界最大級の資産運用会社である「ブラックロック」の英国拠点。「ブラックロック」の従業員数は12,000名超、投資プロフェッショナル数は1,800名超(2016年6月)。ニューヨーク証券取引所に上場。

#### ◇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・ファンドー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)

(追加する理由)

- 合理的なグローバルマクロ見通しに基づいて的確にポジションを構築し、市場環境急変時に迅速なリスクヘッジ対応を行なっている点を評価したため。また、当ファンドを追加することで戦略分散が進み、リターンの向上が期待される。

(運用会社)

- JPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッド  
JPモルガン・アセット・マネジメント(UK)リミテッドは世界有数の金融持株会社であるJPモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の資産運用部門である「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループの英国拠点。「JPモルガン・アセット・マネジメント」の従業員数は約8,400名、投資プロフェッショナル数は約1,040名(2016年6月)。

### 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/>

## 投資対象として新たに追加する投資信託証券

### ◇アイルランド籍の外国証券投資法人「イトン・ヴァンス・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「イトン・ヴァンス・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)

(追加する理由)

- 各国の政治・経済環境を的確に分析し積極的にポジションを取る一方で、リスク分散に配慮したポートフォリオの構築を平行して行うことを通じて、キャリー(利息収入)収益を効率的に獲得している点を評価したため。また、当ファンドを追加することで戦略分散が進み、リターンの向上が期待される。

(運用会社)

- イトン・ヴァンス・アドバイザーズ(アイルランド)リミテッド  
イトン・ヴァンス・アドバイザーズ(アイルランド)リミテッドは、1924年に設立された運用会社である「イトン・ヴァンス」の子会社。ロンドン、ボストン、ニューヨーク、シアトル、アトランタおよびシンガポールに拠点を有する。「イトン・ヴァンス」の従業員数は1,484名、投資プロフェッショナル数は322名(2016年6月)。ニューヨーク証券取引所に上場。

## 投資信託証券の状況

	対象資産	指定投資信託証券
投資対象となる既存の投資信託証券	ヘッジファンド	ダイワ・トピックス・ニュートラル
	ヘッジファンド	大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル
	ヘッジファンド	T&D米国金利戦略ファンド
	ヘッジファンド	シンプレクス・イベントドリブン・ファンド
	ヘッジファンド	ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ
	ヘッジファンド	SMAM・国内株式ロングショートVファンド
	ヘッジファンド	ニューバーガー・バーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド
新規追加の投資対象となる投資信託証券	ヘッジファンド	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
	ヘッジファンド	グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド
	ヘッジファンド	イトン・ヴァンス・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

※ ファンド名は「(FOFs用)(適格機関投資家専用)」を省略しています。

※ 大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラルの正式名称は、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)です。

※ ニューバーガー・バーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンドの正式名称は、アイルランド籍の外国証券投資法人「ニューバーガー・バーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「ニューバーガー・バーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド」の分配なし・円ヘッジクラス投資証券(円建)です。

※ ブラックロックUKエクイティ・アブソリュート・リターン・ファンドの正式名称は、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)です。

※ グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンドの正式名称は、ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「JPMオルガン・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・ファンドー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)です。

※ イトン・ヴァンス・インターナショナル(アイルランド)グローバル・マクロ・ファンドの正式名称は、アイルランド籍の外国証券投資法人「イトン・ヴァンス・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「イトン・ヴァンス・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)です。

以上

## 【ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ】 ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

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

- 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 <sup>(注)</sup> 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

- 「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。
- 「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<sup>(注)</sup>に投資します。  
(注) 以下、「指定投資信託証券」といいます。
- 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。
- 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。

## 【ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ】 ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

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

◆下記は、平成 28 年 9 月 10 日現在の投資信託証券（指定投資信託証券等）の一覧であり、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F 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)	大和住銀投信投資顧問株式会社	わが国の株式および株価指数先物取引等	—
T&D米国金利戦略ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	T&Dアセットマネジメント株式会社	わが国の国債および有価証券店頭指数等先物取引	—
シンプレクス・イベントドリブン・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社	わが国の株式のうち親子上場子会社等の株式	—
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	—
アイルランド籍の外国証券投資法人「ニューバーガー・バーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「ニューバーガー・バーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド」の分配なし・円ヘッジクラス投資証券 (円建)	ニューバーガー・バーマン・ヨーロッパ・リミテッド	世界各国の市場において上場または取引される株式およびETFを含む株式関連商品	—
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・ヴァンス・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・ヴァンス・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・ヴァンス・アドバイザーズ (アイルランド) 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	—

#### ◆ベンチマークについて

・ICE LIBOR の各指数は、Intercontinental Exchange, Inc. が発表しており、著作権は Intercontinental Exchange, Inc. に帰属します。

※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。

# 【ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ】 ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

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）」、「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）」、「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%)	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、毎計算期間の最初の6か月終了日（休業日の場合翌営業日）および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	年率 0.3672%（税抜 0.34%）～年率 1.35%+上限 0.20%	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（平成28年8月時点）	年率 1.122±0.23%程度（税込）（実際の組入状況等により変動します。）	
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。

※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」に記載しています。

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