

ダイワ世界資産戦略ファンド(ダイワSMA専用) 2月末時点の運用状況について

2018年3月15日

《基準価額・純資産の推移》

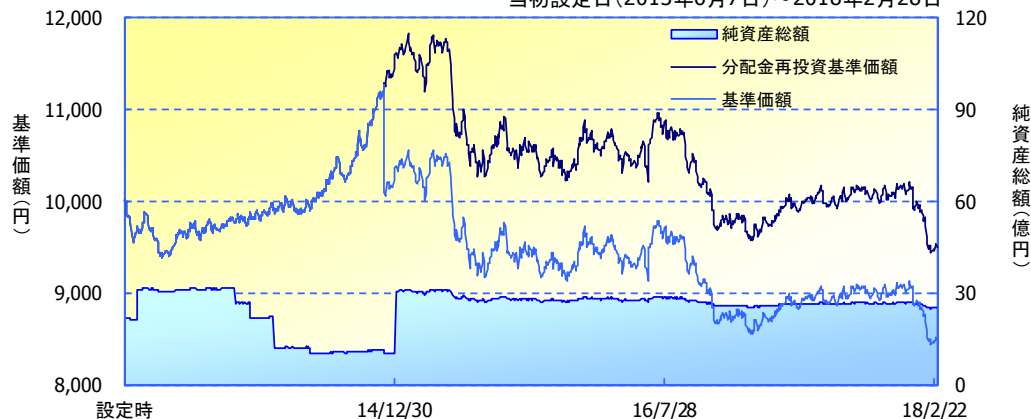
2018年2月28日現在

基準価額	8,473 円
純資産総額	25億円

期間別騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.1 %
3カ月間	-5.5 %
6カ月間	-6.4 %
1年間	-3.3 %
3年間	-17.9 %
5年間	----
年初来	-6.8 %
設定来	-5.2 %

当初設定日(2013年6月7日)～2018年2月28日



※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において、運用管理費用(信託報酬)は控除しています(後述のファンドの費用をご覧ください)。
※「期間別騰落率」の各計算期間は、基準日から過去に遡った期間とし、当該ファンドの「分配金再投資基準価額」を用いた騰落率を表しています。
※実際のファンドでは、課税条件によって投資者ごとの騰落率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。
※データは過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

《主要な資産の状況》

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成		
資産	銘柄数	比率
外国債券	24	69.8%
外国債券 先物	6	59.8%
外国投資信託	3	10.7%
国内債券	1	5.4%
外国投資証券	2	2.3%
外国株式 先物	4	-8.7%
コール・ローン、その他※		11.8%
合計	40	---

実質的な組入比率

実質的区分	比率
株式	2.2%
債券	134.9%
商品	2.1%
合計	139.3%

※上記は、当ファンドの投資助言者(アドバイザー)である大和証券株式会社からの情報提供に基づき、左記データを再分類したものです。

※外貨キャッシュ、経過利息等を含みます。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

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 <http://www.daiwa-am.co.jp/>

大和投資信託

Daiwa Asset Management

組入銘柄					合計139.3%
銘柄名	通貨	資産	利率(%)	償還日	比率
BUXL(30YR) 201803	ユーロ	外国債券 先物			19.4%
BUND(10YR) 201803	ユーロ	外国債券 先物			19.2%
GILT 10YR 201806	英ポンド	外国債券 先物			10.8%
United Kingdom Gilt	英ポンド	外国債券	6	2028/12/07	9.4%
United Kingdom Gilt	英ポンド	外国債券	4.5	2042/12/07	8.0%
GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	外国債券	6.25	2030/01/04	5.9%
SPDR S&P 500 ETF TRUST	米ドル	外国投資信託			5.9%
29 30年国債	日本円	国内債券	2.4	2038/09/20	5.4%
FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	外国債券	8.5	2023/04/25	5.2%
CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ・ドル	外国債券	4	2041/06/01	4.7%
BOBL(5YR) 201803	ユーロ	外国債券 先物			4.1%
United Kingdom Gilt	英ポンド	外国債券	8	2021/06/07	3.7%
CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ・ドル	外国債券	8	2027/06/01	3.5%
United States Treasury Note/Bond	米ドル	外国債券	6.625	2027/02/15	3.3%
T-BOND(ULTRA LONG) 201806	米ドル	外国債券 先物			3.3%
DAX 30(EUR) 201803	ユーロ	外国株式 先物			-3.3%
GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	外国債券	6.5	2027/07/04	3.2%
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	豪ドル	外国債券	5.5	2023/04/21	3.1%
T-BOND(LONG BOND) 201806	米ドル	外国債券 先物			3.0%
CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ・ドル	外国債券	9	2025/06/01	2.9%
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	ニュージーランド・ドル	外国債券	5.5	2023/04/15	2.8%
SPDR DJIA TRUST	米ドル	外国投資信託			2.7%
United States Treasury Note/Bond	米ドル	外国債券	4.5	2039/08/15	2.6%
United States Treasury Note/Bond	米ドル	外国債券	4.375	2041/05/15	2.6%
S&P500 E-MINI FUTURE 201803	米ドル	外国株式 先物			-2.4%
DJIA MINI E-CBOT 201803	米ドル	外国株式 先物			-2.2%
SPDR GOLD SHARES	米ドル	外国投資信託			2.1%
ISHARES MSCI GERMANY ETF	米ドル	外国投資証券			1.5%
SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン・クローネ	外国債券	3.5	2039/03/30	1.4%
SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン・クローネ	外国債券	5	2020/12/01	1.2%
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー・クローネ	外国債券	3	2024/03/14	1.2%
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー・クローネ	外国債券	4.5	2019/05/22	1.1%
GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	外国債券	4.75	2040/07/04	0.9%
FT 100 201803	英ポンド	外国株式 先物			-0.9%
ISHARES MSCI UNITED KINGDOM	米ドル	外国投資証券			0.8%
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	豪ドル	外国債券	5.75	2021/05/15	0.7%
NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	ニュージーランド・ドル	外国債券	6	2021/05/15	0.7%
United States Treasury Note/Bond	米ドル	外国債券	7.625	2025/02/15	0.6%
United States Treasury Note/Bond	米ドル	外国債券	4.75	2041/02/15	0.5%
CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ・ドル	外国債券	5.75	2033/06/01	0.5%

実質的な組入比率

通貨	実質的な組入れ比率				
	株式		債券		商品
	ETF等	先物	現物	先物	ETF等
日本円	-	-	5.4%	-	-
米ドル	10.9%	-4.5%	9.6%	6.4%	2.1%
ユーロ	-	-3.3%	15.3%	42.7%	-
英ポンド	-	-0.9%	21.0%	10.8%	-
カナダ・ドル	-	-	11.5%	-	-
豪ドル	-	-	3.8%	-	-
ノルウェー・クローネ	-	-	2.3%	-	-
スウェーデン・クローネ	-	-	2.6%	-	-
ニュージーランド・ドル	-	-	3.5%	-	-
全体	10.9%	-8.7%	75.2%	59.8%	2.1%
		2.2%		134.9%	
					139.3%

※上記は、当ファンドの投資助言者(アドバイザー)である大和証券株式会社からの情報提供に基づき、組入銘柄を再分類したものです。
※比率は、純資産総額に対するものです。
※四捨五入の関係で合計の数値と一致しない場合があります。



投資通貨比率と組入比率等		※為替エクスポージャー＝資産±為替予約（買＝プラス・売＝マイナス）		
通貨	為替エクスポージャー	資産＊	為替予約	
日本円	---	8.2%	---	
米ドル	2.9%	23.9%	-20.9%	
ユーロ	2.5%	18.2%	-15.7%	
英ポンド	1.8%	23.2%	-21.4%	
カナダ・ドル	1.5%	12.5%	-11.0%	
豪ドル	0.7%	4.4%	-3.7%	
ニュージーランド・ドル	0.7%	4.1%	-3.4%	
スウェーデン・クローネ	0.4%	2.9%	-2.5%	
ノルウェー・クローネ	0.4%	2.6%	-2.2%	
	---	---	---	
合計	11.0%	100.0%	-80.9%	

＊ 資産には先物の建玉は含まれていません。
※比率は、純資産総額に対するものです。

以上

ダイワ世界資産戦略ファンド（ダイワSMA専用）

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。

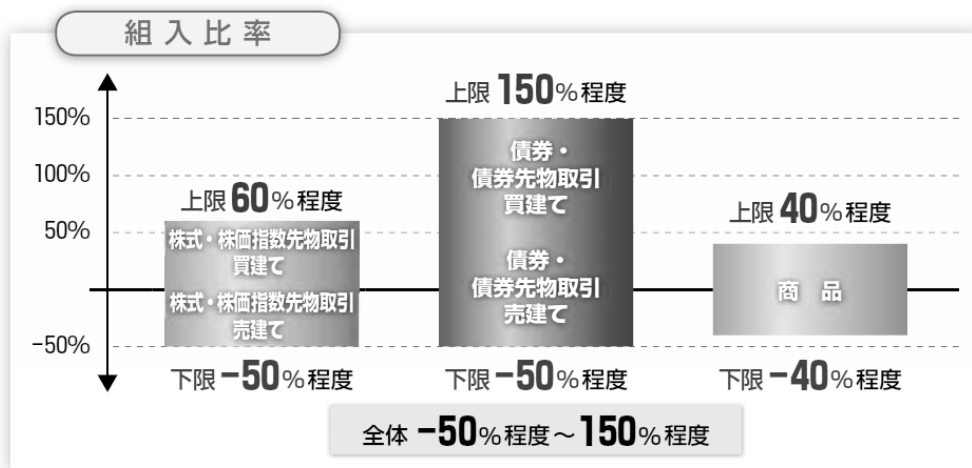
ファンドの目的・特色

ファンドの目的

- 内外の株式、債券、商品に投資するとともに、派生商品を積極的に活用し、組入比率を変更することで、収益の獲得をめざします。

ファンドの特色

1. 内外の株式、債券、商品に投資するとともに、派生商品を積極的に活用します。
 - 内外の株式、債券および商品ならびにそれらの派生商品の買い（ロング）または売り（ショート）を行なうことにより、市場の動きにかかわらず収益を獲得することをめざします。
 - 運用に当たっては、先物取引等のデリバティブ取引を積極的に活用します。なお、商品への投資は、商品または商品指数を対象とする上場投資信託証券等を通じて行ないます。
 - 各資産の実質的な組入比率は、以下の範囲とすることを基本とします。
 - ※ 当ファンドにおいて、「実質的な組入比率」とは、当該各資産にかかる現物有価証券（上場投資信託証券等を除きます。以下同じ。）の組入総額および先物取引等の買建玉の時価総額を合計した額から、先物取引等の売建玉の時価総額を控除した額の、信託財産の純資産総額に対する比率をいいます。
 - 現物有価証券の組入総額ならびに先物取引等の買建玉および売建玉の時価総額を合計した額は、信託財産の純資産総額の200%程度を上限とします。



・上記の計算において、上場投資信託証券等およびオプション取引は先物取引に換算するものとします。

為替予約取引について

- パフォーマンスの向上を図るため、為替予約取引等をヘッジ目的以外で行なう場合があります。
 - 為替予約取引等の日本円を基準とした買建ての合計額および売建ての合計額は、それぞれ信託財産の純資産総額の100%を上限とします。ただし、ヘッジ目的のものは除くものとします。
 - ※ ファンドの外貨比率が実質的に純資産総額を上回ること、またはマイナスの外貨比率となることがあります。
 - 2. 大和証券株式会社から運用にかかる助言を受けます。
 - 3. 当ファンドは、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。
 - ◆当ファンド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。
- ※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・ファンドの費用については、次頁をご覧ください。

ダイワ世界資産戦略ファンド（ダイワSMA専用）

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。

「運用手法にかかるリスク」、「有価証券（指数）先物取引の利用に伴うリスク」、「価格変動リスク・信用リスク（株価の変動、公社債の価格変動）」、「商品（指数）による運用に伴うリスク」、「上場投資信託証券の価格変動」、「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）」

※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。

※当ファンドは、投資信託協会の商品分類（補足分類）において、「特殊型（絶対収益追求型）」に分類されます。

ここで「絶対収益」とは、必ず収益を得るという意味ではなく、特定の市場に左右されにくい収益、という意味です。

※大和証券株式会社からの申入れにより、運用助言にかかる投資顧問契約が解除される場合、わが国の公社債等による安定運用に順次切替えを行ない、ファンド全体が安定運用に入った後、繰上償還します。

※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 ※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 0.972% (税抜 0.90%)	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。
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、上場投資信託証券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

設定・運用:

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

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