

ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) — ジャパン・トリプルリターンズ —

日本円・コース (毎月分配型) / 豪ドル・コース (毎月分配型) / ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) / 米ドル・コース (毎月分配型) / 通貨セレクト・コース (毎月分配型)

追加型投信 / 国内 / 株式

基準日 : 2023年5月31日

「日本円・コース (毎月分配型)」の運用状況

信託期間 : 2013年6月19日 から 2023年6月8日 まで

決算日 : 毎月8日 (休業日の場合翌営業日)

回次コード : 5765

※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。

《基準価額・純資産の推移》

2023年5月31日現在

基準価額	6,943 円
純資産総額	10億円

期間別騰落率

期間	ファンド
1カ月間	+0.8 %
3カ月間	+5.6 %
6カ月間	+5.6 %
1年間	+9.1 %
3年間	+35.8 %
5年間	+28.6 %
年初来	+11.6 %
設定来	+64.3 %



※「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、実質的な運用管理費用 (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。

《分配の推移》

(1万口当たり、税引前)

決算期 (年/月)	分配金
第1~106期 合計 :	6,360円
第107期 (22/06)	60円
第108期 (22/07)	60円
第109期 (22/08)	60円
第110期 (22/09)	60円
第111期 (22/10)	60円
第112期 (22/11)	60円
第113期 (22/12)	60円
第114期 (23/01)	60円
第115期 (23/02)	60円
第116期 (23/03)	60円
第117期 (23/04)	60円
第118期 (23/05)	60円
分配金合計額	設定来 : 7,080円 直近12期 : 720円

※分配金は、収益配分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。

《ファンドマネージャーのコメント》

ファンドの満期償還に向けて、5月中旬よりわが国の短期金融資産等を中心とした安定運用に移行いたしました。それに伴い、株式等の値動きによる基準価額の変動はほとんどなくなりました。これまで長きにわたり、当ファンドをご愛顧賜り、誠にありがとうございました。

■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アセットマネジメントにより作成されたものです。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。当ファンドの取得をご希望の場合には投資信託説明書 (交付目論見書) を販売会社よりお渡しいたしますので、必ず内容をご確認の上ご自身でご判断ください。後述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。

設定・運用:

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

商号等

大和アセットマネジメント株式会社
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
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

「豪ドル・コース(毎月分配型)」の運用状況

信託期間 : 2013年6月19日 から 2023年6月8日 まで
 決算日 : 毎月8日(休業日の場合翌営業日)

回次コード : 5766

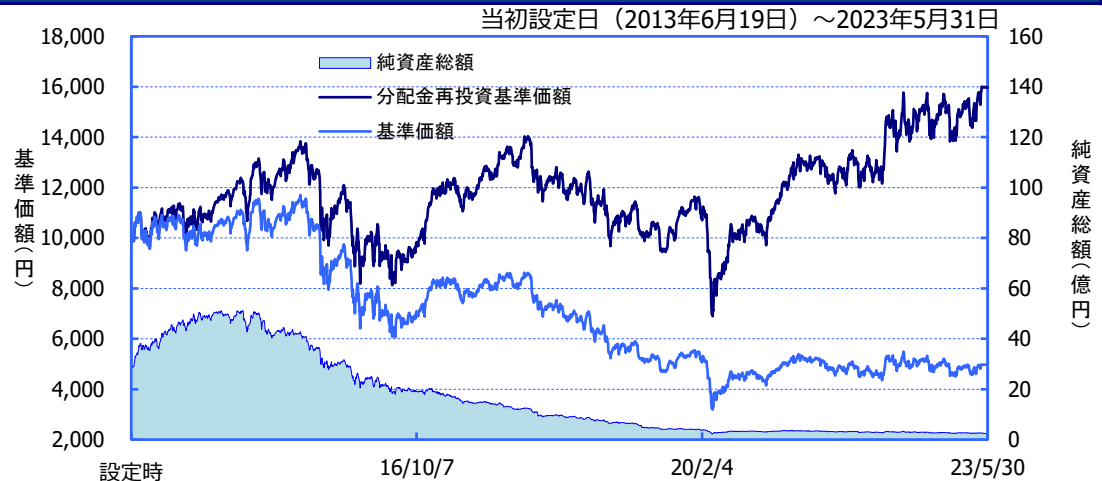
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

《基準価額・純資産の推移》

2023年5月31日現在

基準価額	4,967円
純資産総額	241百万円

期間	ファンド
1か月間	+3.2%
3か月間	+5.1%
6か月間	+4.1%
1年間	+10.6%
3年間	+63.7%
5年間	+33.2%
年初来	+13.3%
設定来	+59.6%



※「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、実質的な運用管理費用(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。

《分配の推移》

(1万口当たり、税引前)

決算期(年/月)	分配金
第1～106期	合計: 7,310円
第107期 (22/06)	50円
第108期 (22/07)	50円
第109期 (22/08)	50円
第110期 (22/09)	50円
第111期 (22/10)	50円
第112期 (22/11)	50円
第113期 (22/12)	50円
第114期 (23/01)	50円
第115期 (23/02)	50円
第116期 (23/03)	50円
第117期 (23/04)	50円
第118期 (23/05)	50円
分配金合計額	設定来: 7,910円 直近12期: 600円

※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。

《ファンドマネージャーのコメント》

ファンドの満期償還に向けて、5月中旬よりわが国の短期金融資産等を中心とした安定運用に移行いたしました。それに伴い、株式、為替等の値動きによる基準価額の変動はほとんどなくなりました。これまで長きにわたり、当ファンドをご愛顧賜り、誠にありがとうございました。

「ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)」の運用状況

信託期間 : 2013年6月19日 から 2023年6月8日 まで
 決算日 : 毎月8日(休業日の場合翌営業日)

回次コード : 5767

※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。

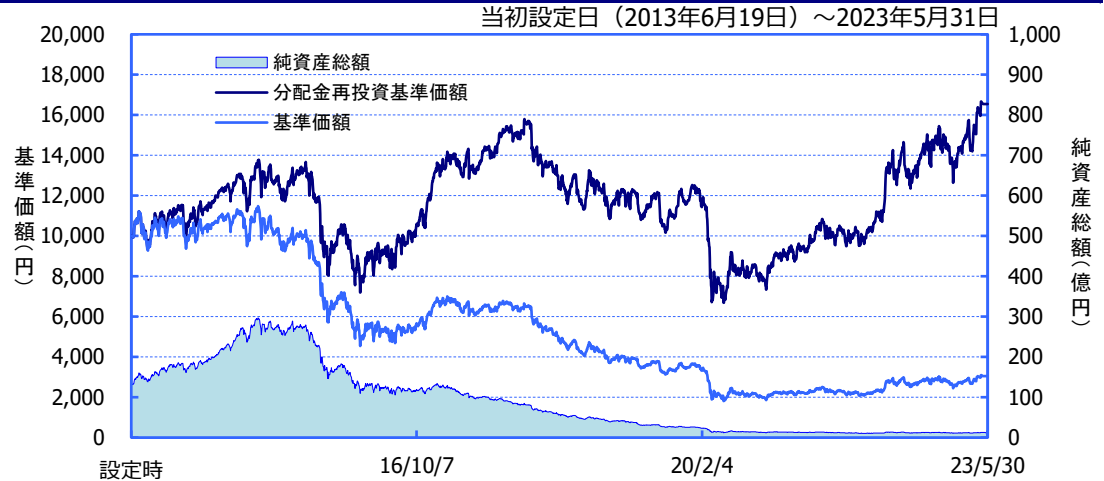
《基準価額・純資産の推移》

2023年5月31日現在

基準価額	3,050 円
純資産総額	12億円

期間別騰落率

期間	ファンド
1カ月間	+1.7 %
3カ月間	+10.3 %
6カ月間	+12.8 %
1年間	+18.2 %
3年間	+100.5 %
5年間	+34.0 %
年初来	+21.9 %
設定来	+65.4 %



※「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、実質的な運用管理費用(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。

《分配の推移》

(1万口当たり、税引前)

決算期(年/月)	分配金
第1～106期	合計: 8,950円
第107期 (22/06)	25円
第108期 (22/07)	25円
第109期 (22/08)	25円
第110期 (22/09)	25円
第111期 (22/10)	25円
第112期 (22/11)	25円
第113期 (22/12)	25円
第114期 (23/01)	25円
第115期 (23/02)	25円
第116期 (23/03)	25円
第117期 (23/04)	25円
第118期 (23/05)	25円
分配金合計額	設定来: 9,250円 直近12期: 300円

※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。

《ファンドマネージャーのコメント》

ファンドの満期償還に向けて、5月中旬よりわが国の短期金融資産等を中心とした安定運用に移行いたしました。それに伴い、株式、為替等の値動きによる基準価額の変動はほとんどなくなりました。これまで長きにわたり、当ファンドをご愛顧賜り、誠にありがとうございました。

「米ドル・コース(毎月分配型)」の運用状況

信託期間 : 2013年6月19日 から 2023年6月8日 まで
 決算日 : 毎月8日(休業日の場合翌営業日)

回次コード : 5768

※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。

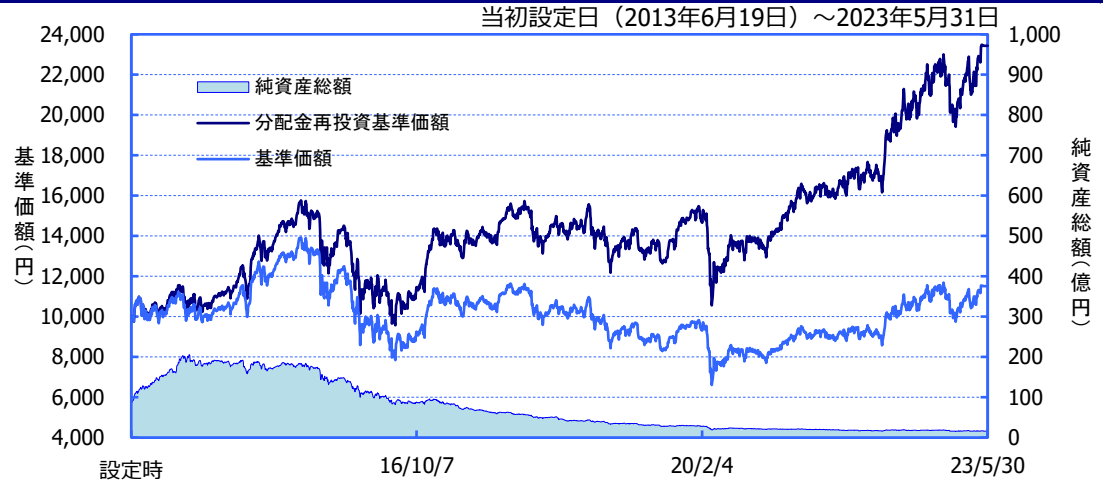
《基準価額・純資産の推移》

2023年5月31日現在

基準価額	11,501 円
純資産総額	15億円

期間別騰落率

期間	ファンド
1カ月間	+2.5 %
3カ月間	+6.4 %
6カ月間	+5.5 %
1年間	+19.4 %
3年間	+72.9 %
5年間	+66.7 %
年初来	+15.6 %
設定来	+134.3 %



※「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、実質的な運用管理費用(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。

《分配の推移》

(1万口当たり、税引前)

決算期(年/月)	分配金
第1～106期	合計: 6,360円
第107期 (22/06)	60円
第108期 (22/07)	60円
第109期 (22/08)	60円
第110期 (22/09)	60円
第111期 (22/10)	60円
第112期 (22/11)	60円
第113期 (22/12)	60円
第114期 (23/01)	60円
第115期 (23/02)	60円
第116期 (23/03)	60円
第117期 (23/04)	60円
第118期 (23/05)	60円
分配金合計額	設定来: 7,080円 直近12期: 720円

※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。

《ファンドマネージャーのコメント》

ファンドの満期償還に向けて、5月中旬よりわが国の短期金融資産等を中心とした安定運用に移行いたしました。それに伴い、株式、為替等の値動きによる基準価額の変動はほとんどなくなりました。これまで長きにわたり、当ファンドをご愛顧賜り、誠にありがとうございました。

「通貨セレクト・コース(毎月分配型)」の運用状況

信託期間 : 2013年6月19日 から 2023年6月8日 まで
 決算日 : 毎月8日(休業日の場合翌営業日)

回次コード : 5769

※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。

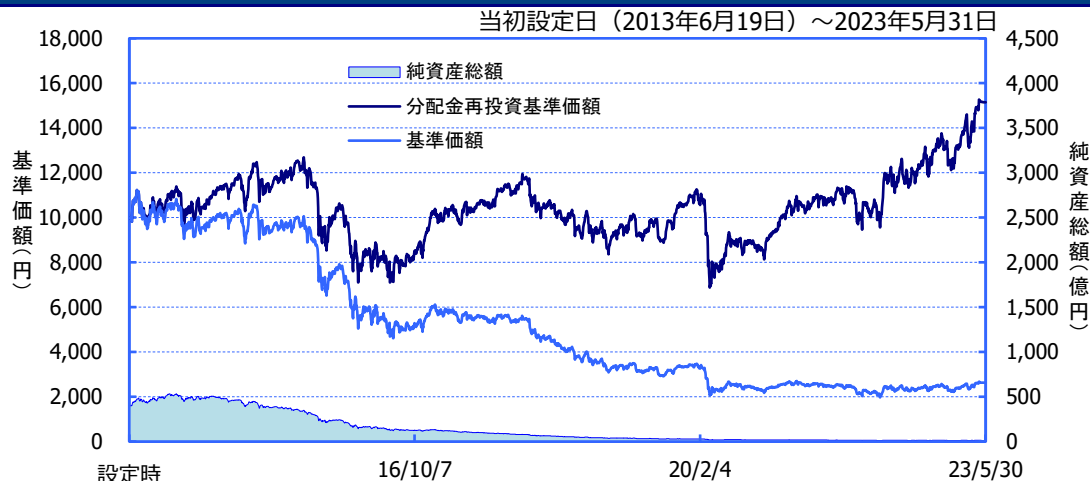
《基準価額・純資産の推移》

2023年5月31日現在

基準価額	2,625 円
純資産総額	12億円

期間別騰落率

期間	ファンド
1カ月間	+1.6 %
3カ月間	+9.0 %
6カ月間	+12.9 %
1年間	+27.4 %
3年間	+71.7 %
5年間	+51.4 %
年初来	+21.0 %
設定来	+51.5 %



※「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、実質的な運用管理費用(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。

《分配の推移》

(1万口当たり、税引前)

決算期(年/月)	分配金
第1～106期	合計: 8,010円
第107期 (22/06)	30円
第108期 (22/07)	30円
第109期 (22/08)	30円
第110期 (22/09)	30円
第111期 (22/10)	30円
第112期 (22/11)	30円
第113期 (22/12)	30円
第114期 (23/01)	30円
第115期 (23/02)	30円
第116期 (23/03)	30円
第117期 (23/04)	30円
第118期 (23/05)	30円
分配金合計額	設定来: 8,370円 直近12期: 360円

※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。

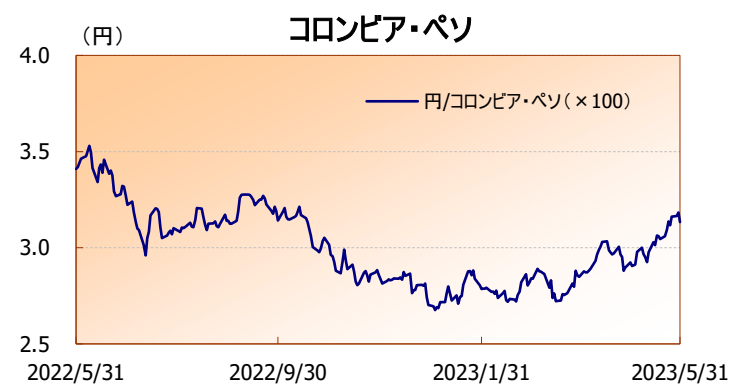
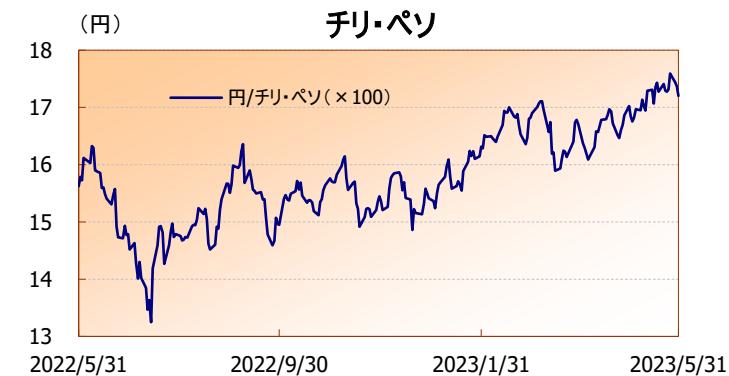
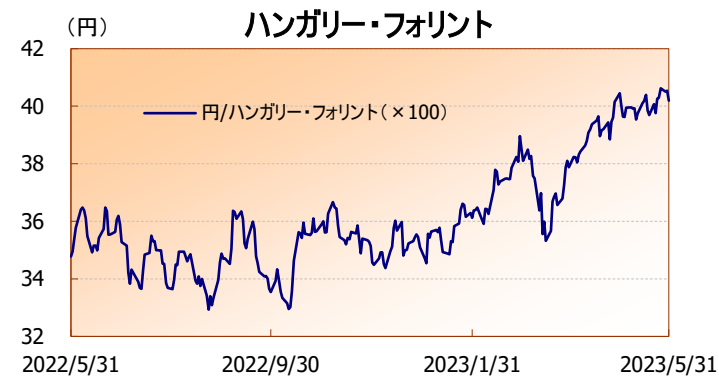
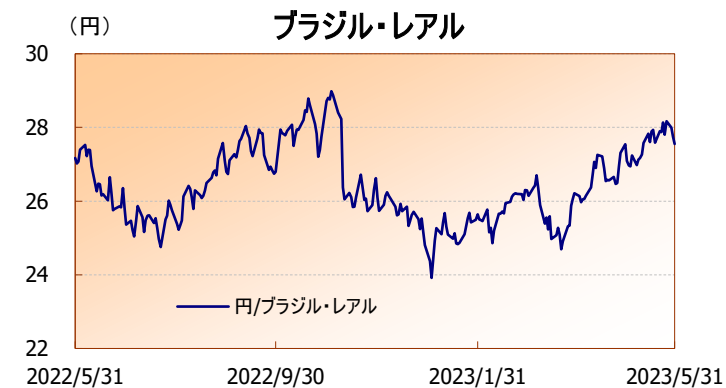
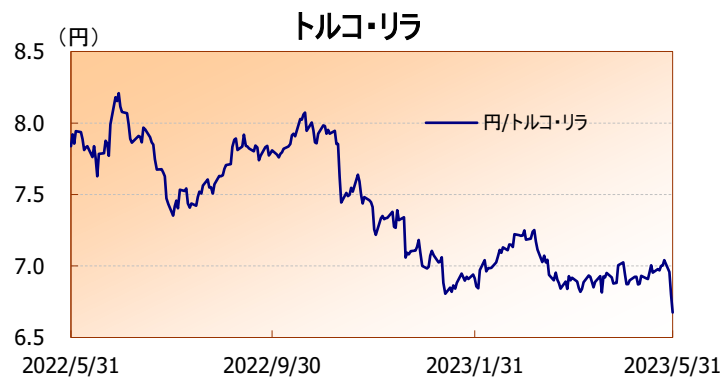
《ファンドマネージャーのコメント》

ファンドの満期償還に向けて、5月中旬よりわが国の短期金融資産等を中心とした安定運用に移行いたしました。それに伴い、株式、為替等の値動きによる基準価額の変動はほとんどなくなりました。これまで長きにわたり、当ファンドをご愛顧賜り、誠にありがとうございました。

【投資環境】

国内株式市況について、5月上旬にかけては、日本銀行が4月28日に大規模金融緩和策の維持を決定し、好感した買いが続いたことから上昇しました。為替市況に関しては、日銀が金融緩和策を維持するとの発表を受けて円安が進み、各投資対象通貨は対円で上昇しました。

- ◆ 各ファンドの略称としてそれぞれ次を用いることがあります。
 - ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 日本円・コース(毎月分配型)
: 日本円・コース
 - ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 豪ドル・コース(毎月分配型)
: 豪ドル・コース
 - ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)
: ブラジル・リアル・コース
 - ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 米ドル・コース(毎月分配型)
: 米ドル・コース
 - ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 通貨セレクト・コース(毎月分配型)
: 通貨セレクト・コース
- ◆ 上記の総称を「ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー」とします。



(出所)ブルームバーグより大和アセットマネジメント作成

《ファンドの目的・特色》

ファンドの目的

- ・割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざします。

ファンドの特色

- ・割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。
- ・為替取引を活用します。
- ・毎月8日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益配分方針に基づいて収益の分配を行ないます。

TOPIX100の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

《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)	<ul style="list-style-type: none">・株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。・選定銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。・当ファンドは、銘柄数を絞り込んだ運用を行なうため、市場動向にかかわらず基準価額の変動が大きくなる可能性があります。
カバードコール戦略の利用に伴うリスク	<ul style="list-style-type: none">・オプションプレミアムの水準は、オプション売却時の株価水準、権利行使価格、株価変動率（ボラティリティ）、満期日までの期間、金利水準、配当金額、需給等により決定されます。・想定したオプションプレミアムが確保できない場合もあります。・株価水準や株価変動率の変動等によりコール・オプションの評価値が変動し、損失を被る場合があります。・カバードコール戦略では、株価が上昇した場合の値上がり益が限定されるため、株式のみに投資した場合に対して投資成果が劣化する可能性があります。戦略再構築を重ねた場合、株価が下落しその後当初の水準程度まで回復しても、基準価額の回復は株価に比べて緩やかになる可能性があります。・当ファンドでは個別銘柄ごとにカバードコール戦略を構築するため、株価上昇時の値上がり益が個別銘柄ごとに限定される結果、投資成果が株式市場全体の動きに対して劣化する可能性があります。
為替変動リスク	<p>＜日本円・コース以外のコース＞</p> <ul style="list-style-type: none">・取引対象通貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。・新興国通貨の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国通貨と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。・取引対象通貨の金利が日本円の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。 <p>※各ファンドの投資対象である外国投資信託において、NDF取引を用いて為替取引を行なう場合、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。</p>
スワップ取引の利用に伴うリスク	<ul style="list-style-type: none">・スワップ取引の相手方に債務不履行や倒産その他の事態が生じた場合、カバードコール戦略の投資成果を享受することができず、ファンドの運用の継続が困難となり、予想外の損失を被る可能性があります。また、スワップ取引の相手方から受入れた担保を想定した価格で処分できない場合があることから損失を被る可能性があります。・当ファンドが投資対象とする外国投資信託は、スワップ取引の相手方が取引する株式や

オプションについて何ら権利を有しません。

その他

解約資金を手当てするためカバードコール戦略を解消（株式の売却およびオプションの買戻し）する際、市場規模や市場動向によっては当初期待される価格で解消できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

※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。

その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

《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) 3.3%(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。
信託財産留保額	0.30%	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る額。換金申込受付日の翌営業日の基準価額に対して左記の率を乗じて得た額とします。

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1.4905% (税抜1.355%)	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。運用管理費用は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。
配分 (税抜) (注1)	委託会社	年率0.48%
	販売会社	年率0.85%
	受託会社	年率0.025%
投資対象とする 投資信託証券		投資対象ファンドにおける管理報酬・担保付スワップにかかる費用等です。 「日本円・コース」、「豪ドル・コース」、「ブラジル・リアル・コース」、「米ドル・コース」 年率0.545%程度 「通貨セレクト・コース」 年率0.695%程度
実質的に負担する 運用管理費用		「日本円・コース」、「豪ドル・コース」、「ブラジル・リアル・コース」、「米ドル・コース」 年率2.0355%(税込)程度 (純資産総額によっては上回る場合があります。) 「通貨セレクト・コース」 年率2.1855%(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2)	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1)「運用管理費用の配分」には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

(注2)「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合わせ下さい。

※運用管理費用の信託財産からの支払いは、毎計算期末または信託終了時に行なわれます。

※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。

《お申込みメモ》

購入単位	最低単位を 1 円単位または 1 口単位として販売会社が定める単位
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額（1 万口当たり）
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払い下さい。
換金単位	最低単位を 1 口単位として販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額を控除した価額（1 万口当たり）
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して 6 営業日目からお支払いします。
申込受付中止日	①ロンドンの銀行の休業日 ②①のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日 ※ただし、購入申込については、当ファンドの運営および受益者に与える影響を考慮して受け付けを行なうことがあります。 （注）申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。
申込締切時間	午後 3 時まで（販売会社所定の事務手続きが完了したもの）
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の換金申込みには制限があります。
購入・換金申込受付 の中止および取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、購入、換金の申込みの受け付けを中止することがあります。
スイッチング（乗換え）	「日本円・コース」、「豪ドル・コース」、「ブラジル・リアル・コース」、「米ドル・コース」、「通貨セレクト・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。
繰上償還	●主要投資対象とする組入外国投資信託が存続しないこととなる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させます。 ●次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、繰上償還できます。 ・受益権の口数が 30 億口を下ることとなった場合 ・信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき ・やむを得ない事情が発生したとき
収益分配	年 12 回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 （注）当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金支払いコース」があります。なお、お取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。
課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。なお、当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合がありますので、くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。 ※税法が改正された場合等には変更される場合があります。

《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

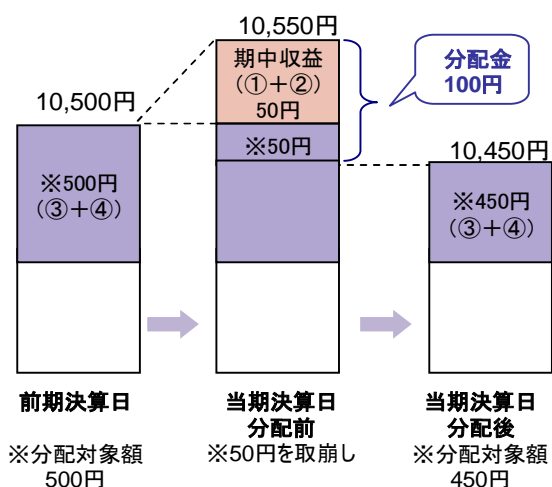
投資信託の純資産

分配金

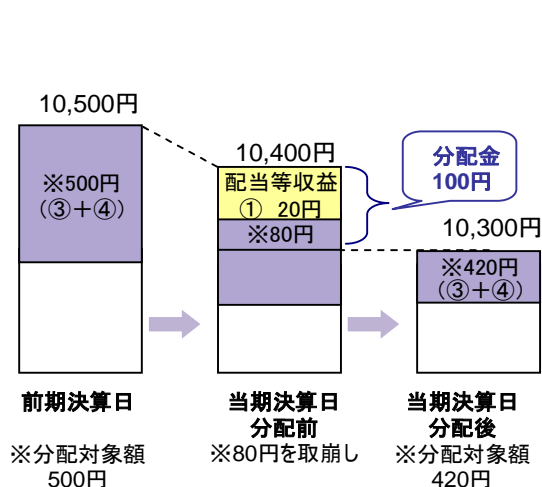
- ◆ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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



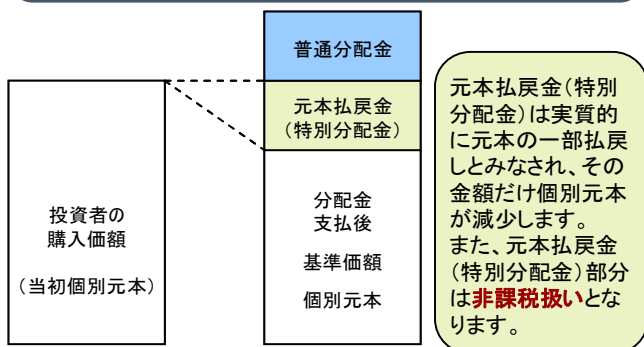
前期決算日から基準価額が下落した場合



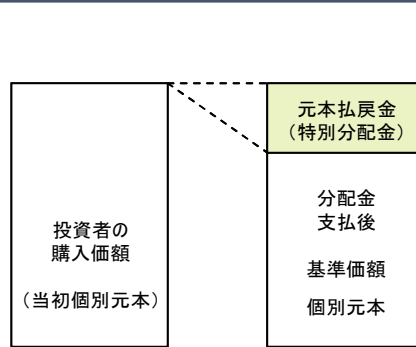
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

- ◆ 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



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。

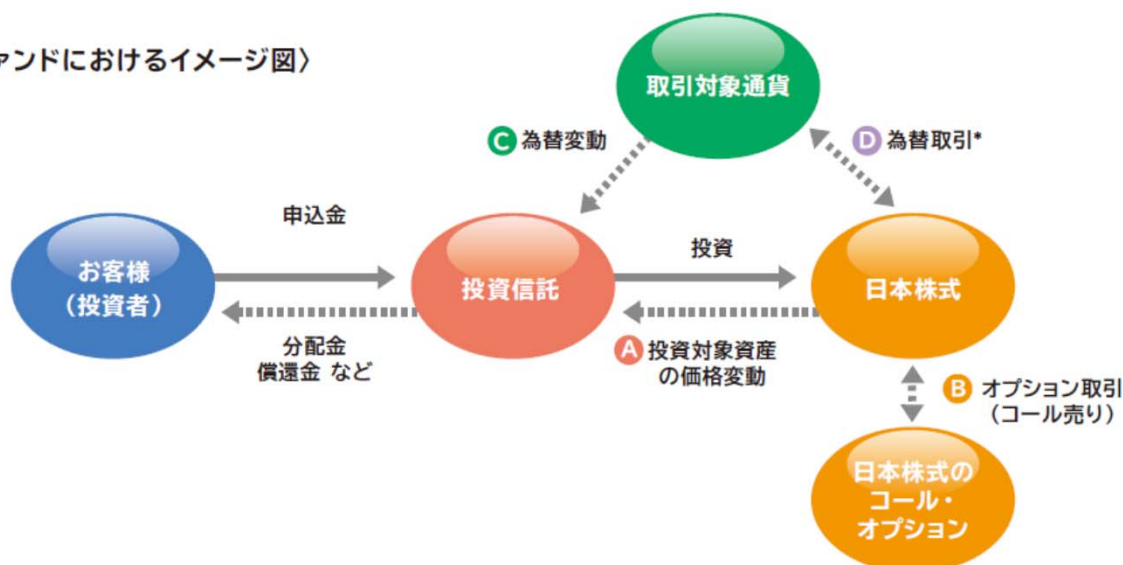
元本払戻金 : 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の(特別分配金)額だけ減少します。

※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》

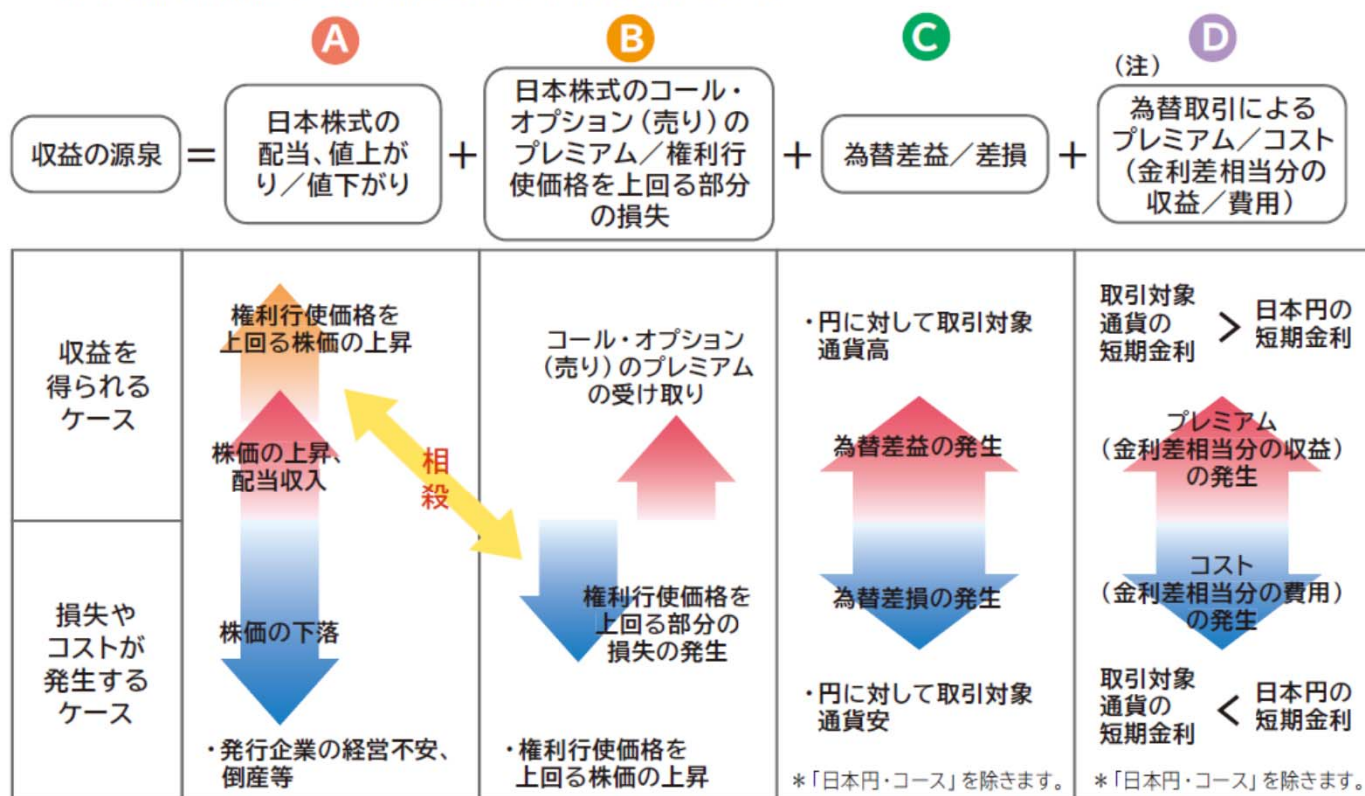
- 通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。
- 当ファンドでは、日本の株式に投資するとともに、個別株オプション取引および為替取引を活用します。

〈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。



(注) 為替取引を行なう際にNDF取引を利用することがあります。

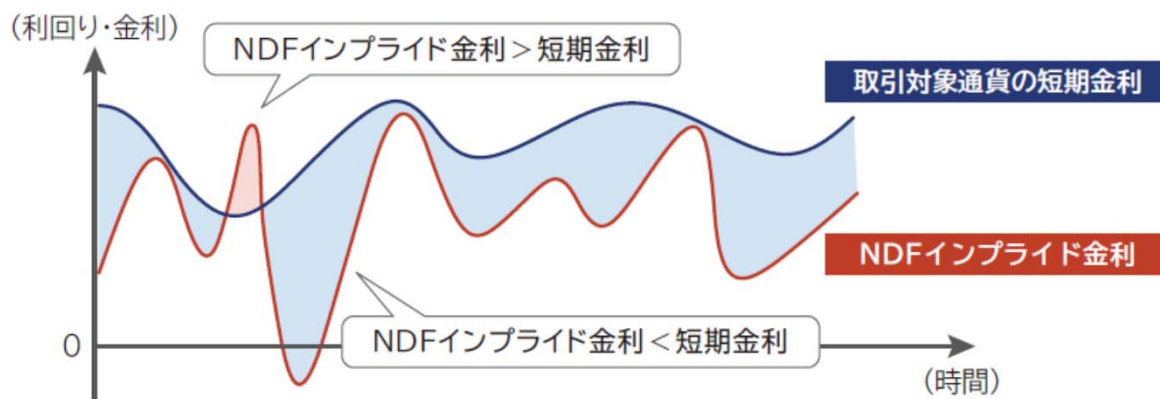
NDF取引を用いて為替取引を行なう際、為替取引によるプレミアム/コスト(金利差相当分の収益/費用)は、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

※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。

《NDF取引とは》

- ◆取引対象通貨を用いた受け渡しは行わず、米ドル等の主要通貨による差金決済を相対で行なう取引です。
- ◆NDF取引価格から算出される“NDFインプライド金利”は、市場の流動性が低く、割高や割安を是正する動き（裁定）が働きにくいことから市場参加者の期待や需給などの要因により、**取引対象通貨の短期金利の水準から大きく乖離する場合があります。**

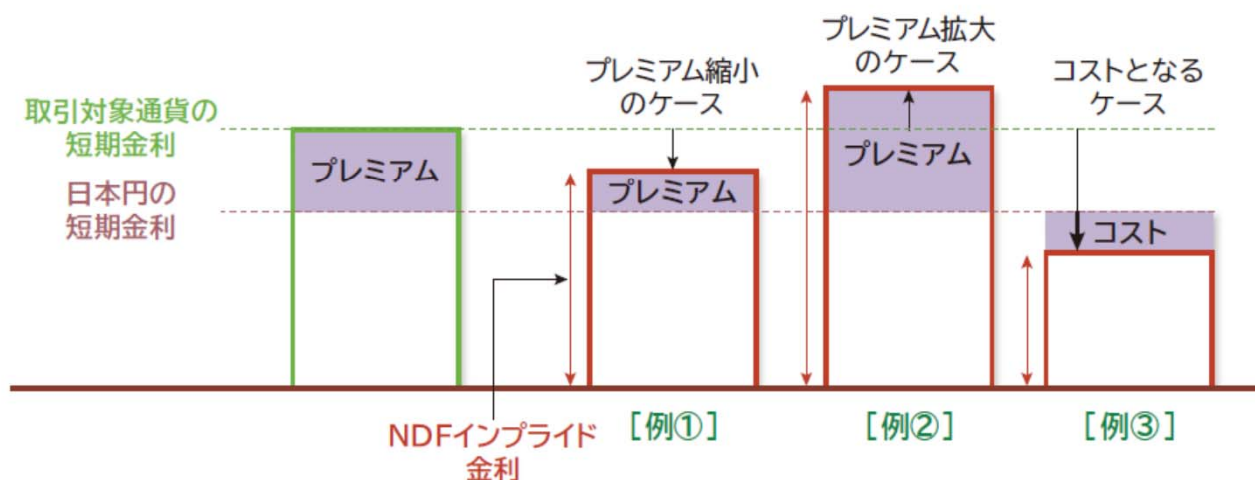
NDFインプライド金利と取引対象通貨の短期金利が乖離するイメージ



※上記はイメージであり、当ファンドのパフォーマンスとは異なります。

NDFインプライド金利の変動の影響

- ◆市場参加者の通貨上昇（下落）期待や需給などにより、NDFインプライド金利は低く（高く）なる可能性があります。NDFインプライド金利が取引対象通貨の短期金利より低く（高く）なると、**為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）が縮小【例①】（拡大【例②】）し、場合によっては為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）となるケース【例③】**もあります。



※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。

※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。

◀ 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アセットマネジメント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

▶ **大和アセットマネジメント** フリーダイヤル 0120-106212(営業日の9:00~17:00)

当社ホームページ

▶ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 日本円・コース（毎月分配型）
 ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 豪ドル・コース（毎月分配型）
 ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）
 ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 米ドル・コース（毎月分配型）
 ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） - ジャパン・トリプルリターンズ - 通貨セレクト・コース（毎月分配型）

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
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	○	○	○	○

上記の販売会社は今後変更となる場合があります。また、販売会社によって、新規のご購入の取扱いを行っていない場合や、お申込み方法・条件等が異なります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。