

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ  
「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド  
(米ドル建/毎月分配型) -通貨ドラゴン-」における  
「中国恒大集団 (China Evergrande Group)」保有状況のお知らせ

ダイワ・アセット・マネジメント (ヨーロッパ) リミテッド  
大和アセットマネジメント株式会社

投資者の皆様へ

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

各種メディアで報道されております「中国恒大集団 (China Evergrande Group)」につきまして、「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (米ドル建/毎月分配型) -通貨ドラゴン- (米ドル・コース、ブラジル・リアル・ヘッジコース、豪ドル・ヘッジコース)」(以下、「当ファンド」といいます。)における保有状況をお知らせいたします。

2021年7月末時点で、当ファンドの投資先ファンドが中国恒大集団の債券を保有しております。投資先ファンドでの組入比率を当ファンドベースに換算した組入比率は1.58%です。

今後の保有につきましては、状況を見守りながら検討してまいります。

今後とも、当ファンドをご愛顧くださいますよう、何卒よろしくお願い申し上げます。

以上

■当資料は、「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (米ドル建/毎月分配型) -通貨ドラゴン-」の運用状況や関連する情報等をお知らせするために、ダイワ・アセット・マネジメント・サービスズ・リミテッド (ケイマン) およびダイワ・アセット・マネジメント (ヨーロッパ) リミテッドからの情報提供をもと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 (交付目録見書)」の内容を必ずご確認ください。■投資信託は、値動きのある有価証券等 (外貨建資産には為替リスクもあります) 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。■分配金額は収益分配方針に基づいて管理会社が決定します。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。

## ■基準価額の変動要因

- 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、これを割り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、すべて受益者に帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

### <主な変動要因>

<p>債券の価格変動 (価格変動リスク・信用リスク)</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・債券の価格は一般に、金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します。債券の価格はまた、発行体の信用状況の影響を受けます。特に、発行体が支払不能(債務不履行)の場合またはその可能性が予想される場合、通常、債券の価格は大きく下落します。</li> <li>・組入債券の価格下落により、基準価額が下落することがあり、投資元本を割り込むことがあります。</li> <li>・投資適格債券に比べて、アジアのハイ・イールド債券を含むハイ・イールド債券の債務不履行リスクは一般的に高いと考えられます。ハイ・イールド債券の価格は、債券の市場規模または取引高が小さいこと、および債券の流動性が低いことに起因して、一般に、当初予想されていた投資価値とは異なる価格水準で取引されるため大きく変動する傾向があります。</li> </ul>
<p>為替変動リスク</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ファンドの基準価額は、米ドル建てで表示されます。</li> <li>・取引対象通貨が米ドルに対して下落した場合には、ブラジル・レアル・ヘッジコースまたは豪ドル・ヘッジコースの基準価額の下落要因となり、その結果、外国為替相場の変動により当該受益者が投資した元本を割り込むことがあります。</li> <li>・取引対象通貨の金利が米ドルの金利より低い場合、金利差が、ブラジル・レアル・ヘッジコースまたは豪ドル・ヘッジコースの為替取引によるコストとなり、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。</li> <li>・NDF取引を用いて為替取引を行う場合、コストは需給や規制等の影響により、金利差から予想される費用の水準と大きく異なることがあります。</li> <li>・新興国の為替レートは、短期間に大幅に変動することがあり、先進国の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。</li> </ul>
<p>カントリー・リスク</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落すること、または投資対象ファンドの投資方針に沿った運用が困難となることがあります。</li> <li>・新興国への投資には、先進国への投資と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。</li> </ul>
<p>その他</p>	<p>&lt;流動性リスク&gt;</p> <p>買戻請求の資金を手当てするためファンドの投資対象を売却する際、当該投資対象の市場規模や市場動向によっては当該売却により当該投資対象の市場実勢価格を押し下げるため、当初期待される価格で売却できないこともあります。かかる場合、基準価額が下落する要因となります。</p>

※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

- ◆ ファンドの基準価額は、米ドル建てで表示されます。したがって、日本円により投資が行われる場合、各コースの基準価額の円貨相当額は、日本円および米ドル間の外国為替レートの変動により影響を受けることがあります。
- ◆ 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。

## ■リスクの管理体制

- ◆ 投資運用会社では、運用リスクの状況について、ファンドの投資制限、投資ガイドライン、運用方針に沿ったものであることをチェックします。また、定期的にコンプライアンス会議を開催し、法令、投資制限、投資ガイドライン等についてファンドの遵守状況をチェックします。
- ◆ ファンドは、ヘッジ目的のためにのみデリバティブ取引等を行っています。ファンドは、金融商品取引業者に対する自己資本比率規制における「市場リスク相当額」の算出方法のうち、標準的方式の市場リスク相当額の算出方法を参考に用いたリスク量が、ファンドの純資産総額の80%以内となるよう管理しています。

■当資料は、「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(米ドル建/毎月分配型)ー通貨ドラゴンー」の運用状況や関連する情報等をお知らせするために、ダイワ・アセット・マネジメント・サービス・リミテッド(ケイマン)およびダイワ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)リミテッドからの情報提供をもと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、販売会社よりお渡する「投資信託説明書(交付目録見書)」の内容を必ずご確認ください。■投資信託は、値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替リスクもあります)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。■分配金額は収益分配方針に基づいて管理会社が決定します。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。

# ■ ファンドの費用・税金

## ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用																									
購入時手数料	<p>購入は、口数でのお申込みいただけます。購入時手数料の額は、購入口数に応じて、次に掲げる率を乗じて得た額とします。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>購入時の申込口数</th> <th>手数料率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>5,000口未満</td> <td>購入金額の<b>3.30% (税抜3.00%)</b></td> </tr> <tr> <td>5,000口以上5万口未満</td> <td>購入金額の<b>1.65% (税抜1.50%)</b></td> </tr> <tr> <td>5万口以上10万口未満</td> <td>購入金額の<b>1.10% (税抜1.00%)</b></td> </tr> <tr> <td>10万口以上</td> <td>購入金額の<b>0.55% (税抜0.50%)</b></td> </tr> </tbody> </table> <p>購入時手数料は、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、取引執行等の対価として販売会社に支払われます。詳しくは販売会社にお問い合わせ下さい。</p> <p>(ご参考) 例えば、基準価額100.00米ドルの時に100口購入いただく場合は、次のように計算します。            購入時手数料=100.00米ドル×100口×3.30% (税込)=330.00米ドル            となり、購入金額に購入時手数料を加えた合計額 10,330米ドルをお支払いいただくこととなります。            ※基準価額は、通常、取引日の日本における翌営業日に日本で発表されます。            ※円貨でお申込みいただく場合、外貨と円貨との換算は、日本における販売会社が決定する為替レートによります。詳しくは、日本における販売会社までお問い合わせ下さい。</p>	購入時の申込口数	手数料率	5,000口未満	購入金額の <b>3.30% (税抜3.00%)</b>	5,000口以上5万口未満	購入金額の <b>1.65% (税抜1.50%)</b>	5万口以上10万口未満	購入金額の <b>1.10% (税抜1.00%)</b>	10万口以上	購入金額の <b>0.55% (税抜0.50%)</b>														
	購入時の申込口数	手数料率																							
5,000口未満	購入金額の <b>3.30% (税抜3.00%)</b>																								
5,000口以上5万口未満	購入金額の <b>1.65% (税抜1.50%)</b>																								
5万口以上10万口未満	購入金額の <b>1.10% (税抜1.00%)</b>																								
10万口以上	購入金額の <b>0.55% (税抜0.50%)</b>																								
換金(買戻し)手数料	ありません。																								
投資者が信託財産で間接的に負担する費用																									
管理報酬等	<p>ファンドの資産から支払われる総報酬は、純資産総額の<b>年率1.135%程度(注1)および年間10,000米ドル</b>です。            (注1) 管理事務代行報酬に最低報酬金額が設定されているため、各コースの純資産総額の合計額によっては、年率1.135%程度を上回ることがあります。            (注2) ブラジル・レアル・ヘッジコースおよび豪ドル・ヘッジコースについては、各コースの純資産総額の年率0.01%のヘッジ費用が支払われます。            (注3) 上記のほか、ファンドの預り資産の年率0.01%および取引毎に15米ドルの資産保管報酬が支払われます。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>手数料等</th> <th>支払先</th> <th>報酬料率</th> <th>対価とする役務の内容</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>受託報酬</td> <td>受託会社</td> <td>年間10,000米ドル</td> <td>ファンドの受託業務</td> </tr> <tr> <td>投資運用報酬</td> <td>投資運用会社</td> <td>年率0.185%</td> <td>ファンドに関する投資運用業務</td> </tr> <tr> <td>管理事務代行報酬</td> <td>管理事務代行会社</td> <td>年率0.03% (最低年間22,500米ドル)</td> <td>ファンドの管理事務代行業務</td> </tr> <tr> <td>管理会社代行サービス報酬</td> <td>管理会社代行サービス会社</td> <td>年率0.22%</td> <td>ファンドの管理会社が行う業務を日本国内において代行する業務</td> </tr> <tr> <td>販売報酬/代行協会報酬</td> <td>販売会社/代行協会員</td> <td>年率0.60%/年率0.10%</td> <td>運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等/ファンド証券の(1口当たりの)純資産価格の公表業務、目論見書、決算報告書等の販売会社への交付業務等</td> </tr> </tbody> </table>	手数料等	支払先	報酬料率	対価とする役務の内容	受託報酬	受託会社	年間10,000米ドル	ファンドの受託業務	投資運用報酬	投資運用会社	年率0.185%	ファンドに関する投資運用業務	管理事務代行報酬	管理事務代行会社	年率0.03% (最低年間22,500米ドル)	ファンドの管理事務代行業務	管理会社代行サービス報酬	管理会社代行サービス会社	年率0.22%	ファンドの管理会社が行う業務を日本国内において代行する業務	販売報酬/代行協会報酬	販売会社/代行協会員	年率0.60%/年率0.10%	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等/ファンド証券の(1口当たりの)純資産価格の公表業務、目論見書、決算報告書等の販売会社への交付業務等
	手数料等	支払先	報酬料率	対価とする役務の内容																					
受託報酬	受託会社	年間10,000米ドル	ファンドの受託業務																						
投資運用報酬	投資運用会社	年率0.185%	ファンドに関する投資運用業務																						
管理事務代行報酬	管理事務代行会社	年率0.03% (最低年間22,500米ドル)	ファンドの管理事務代行業務																						
管理会社代行サービス報酬	管理会社代行サービス会社	年率0.22%	ファンドの管理会社が行う業務を日本国内において代行する業務																						
販売報酬/代行協会報酬	販売会社/代行協会員	年率0.60%/年率0.10%	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等/ファンド証券の(1口当たりの)純資産価格の公表業務、目論見書、決算報告書等の販売会社への交付業務等																						
投資対象ファンドの報酬	年率0.71%程度																								
実質的な管理報酬等	<p><b>年率1.845%程度(注)および年間10,000米ドル</b>            (注) 各コースの純資産総額の合計額によっては、年率1.845%程度を上回ることがあります。</p>																								
その他の費用・手数料	<p>ファンドは、弁護士報酬、監査報酬、印刷費用等の直接の運営のコストおよび費用を負担する場合があります。            ※「その他の費用・手数料」については、ファンドが負担することにより、投資者の皆様が間接的にご負担いただくこととなります。これらの費用については、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。</p>																								

※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。※これらの詳細につきましては、請求目論見書の該当箇所をご参照下さい。

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

設定は…  
**ダイワ・アセット・マネジメント・サービス・リミテッド(ケイマン)**

運用は…  
**ダイワ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)リミテッド**

■当資料は、「ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(米ドル建/毎月分配型)ー通貨ドラゴンー」の運用状況や関連する情報等をお知らせするために、ダイワ・アセット・マネジメント・サービス・リミテッド(ケイマン)およびダイワ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)リミテッドからの情報提供をもとに大和アセット・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、ご自身でご判断下さい。■投資信託は、値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替リスクもあります)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。■分配金額は収益分配方針に基づいて管理会社が決定します。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。