

『ダイワ・オルタナティブファンド・シリーズ “RICI” 連動元本確保型ファンド(豪ドル建)2005-10』

## ロジャーズ国際コモディティ指数™(RICI®)の構成品目の 基本ウェイト等変更の発表について

2009年1月9日

大和証券投資信託委託株式会社

平素は格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

ロジャーズ国際コモディティ指数™(以下、「RICI®」)について、RICI®委員会よりプレスリリースが発表されましたので、以下の通りご報告致します。

RICI®の構成品目のうち、大麦、小豆、羊毛の基本ウェイトが引き下げられると共に、大豆油、大豆、綿花の基本ウェイトが引き上げられます。詳細は、下表をご参照下さい。また、大豆、大豆油、大豆粕および金に関して、RICI®の算出に使用する商品先物の限月が一部修正されます。

当該変更は、2009年1月末の限月乗り換え時より実施されます。

構成品目	基本ウェイト		変更値
	変更前	変更後	
大麦	0.27%	0.10%	-0.17%
大豆油	2.00%	2.17%	+0.17%
小豆	0.25%	0.15%	-0.10%
大豆	3.25%	3.35%	+0.10%
羊毛	0.25%	0.10%	-0.15%
綿花	4.05%	4.20%	+0.15%

当該変更の理由は、流動性の面から運用に支障が出る可能性に対処するため、との説明をRICI®委員会より受けております。弊社および弊社グループにおいても、当該変更により、指数の概要及び継続性が変わるものではないと考えております。

当該変更に伴い、弊社ファンドが投資対象ファンドを通じて保有する商品先物ポートフォリオの構成比率も変更致します。投資家の皆様には、引き続き御愛顧を賜りたいと存じます。

(次頁にプレスリリースの和訳を記載致します。)

### 変更後の構成品目およびその比率

エネルギー 44.00%	基本ウェイト	
	原油 (WTI)	21.00%
	原油 (北海ブレント)	14.00%
	天然ガス	3.00%
	無鉛ガソリン (RBOB)	3.00%
	ヒーティング・オイル	1.80%
	ガス・オイル	1.20%
産業金属 14.00%	基本ウェイト	
	アルミニウム	4.00%
	銅	4.00%
	鉛	2.00%
	亜鉛	2.00%
	ニッケル	1.00%
貴金属 7.10%	基本ウェイト	
	金	3.00%
	銀	2.00%
	プラチナ	1.80%
	パラジウム	0.30%
家畜 3.00%	基本ウェイト	
	生牛	2.00%
	豚赤身肉	1.00%
穀物 19.94%	基本ウェイト	
	小麦	7.00%
	トウモロコシ	4.75%
	大豆	3.35%
	大豆油	2.17%
	大豆粕	0.75%
	菜種	0.67%
	米	0.50%
	小豆	0.15%
	オーツ麦	0.50%
ソフト 9.96%	基本ウェイト	
	綿花	4.20%
	砂糖	2.00%
	コーヒー	2.00%
	ココア	1.00%
	オレンジジュース	0.66%
	羊毛	0.10%
その他 2.00%	基本ウェイト	
	ゴム	1.00%
	板材	1.00%

【ご参考】 RICI®委員会は、RICI®の設立者であるジム・ロジャーズ®氏および、Daiwa Asset Management (America) Limited、UBS AG、ABN Amro、Merrill Lynch、Beeland Management Company、Diapason Commodity Management S.A.の代表者により構成されます。RICI®委員会メンバーは通常、毎年12月に会議を開催し、RICI®の計算方法、構成品目および指数の管理に関する決定等を行ないます。

### 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。当資料は、各種の信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性・完全性が保証されている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、意見等は当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。当資料中における運用実績等は、過去の実績および結果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。分配金額は、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。投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険・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、必ず内容をご確認いただき、ご自身でご判断ください。

販売会社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9:00～17:00) HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(プレスリリース和訳)

## RICI®委員会がRICI®の計算における一部品目の構成比率変更を発表

<<シカゴ 2009年1月7日>>

ロジャーズ国際コモディティ指数™を管理しているRICI®委員会は、RICI®の構成比率を以下の通り変更することに致しました。新しい構成比率は全て、2009年1月末の限月乗り換え時より採用されます。

綿花の基本ウェイトを、従来の4.05%から4.20%に引き上げます。

大豆の基本ウェイトを、従来の3.25%から3.35%に引き上げます。

大豆油の基本ウェイトを、従来の2.00%から2.17%に引き上げます。

小豆の基本ウェイトを、従来の0.25%から0.15%に引き下げます。

大麦の基本ウェイトを、従来の0.27%から0.10%に引き下げます。

羊毛の基本ウェイトを、従来の0.25%から0.10%に引き下げます。

RICI®委員会は限月乗り換え表の修正を行い、これらの修正点は改訂後のRICI®ルールブックに反映されています。

当該修正は、1月の最終営業日 の前営業日 から開始される、2009年1月の限月乗り換え時より実施されます。

以上

出所: RICI®委員会

営業日とはRICI®が算出される日を指します。

「ダイワ・オルタナティブファンド・シリーズ “RICI”運動元本確保型ファンド(豪ドル建)2005-10」およびその関連ファンドであるケイマン諸島投資法人Global Commodity Markets Fund 3 Ltd. (そのサブファンドである「ダイワ“RICI”ポートフォリオ3」を含みます。) (以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。)はJames Beeland Rogers, Jim Rogers®またはBeeland Interests, Inc. (以下、当注記において、総称して「Beeland」といいます。)により提供、保証、販売または販売促進されるものではありません。Beelandはファンド購入者、すべての潜在的ファンド購入者、政府当局、または公衆に対して、一般的な証券投資、特にファンドへの投資の助言能力を、明示的にも暗示的にも、表明または保証するものではありません。BeelandはRogers International Commodity Index®の決定、構成、算出において大和証券投資信託委託株式会社およびその関連会社、またはファンド購入者の要求を考慮する義務を負いません。Beelandはファンドが発行される時期、価格もしくは数量の決定またはファンドが換金されるもしくは他の金融商品、証券に転換される際に使用される算式の決定または計算の責任を負わず関与もしていません。Beelandはファンドの管理、運営、販売、取引に関して義務または責任を負いません。「Jim Rogers®」、「Rogers International Commodity Index®」、「RICI Portfolio」および「RICI®」は、James Beeland Rogers, Jim Rogers®または Beeland Interests, Inc.のトレードマークおよびサービスマークであり、使用許諾を要します。

### 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。当資料は、各種の信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性・完全性が保証されている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、意見等は当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。当資料中における運用実績等は、過去の実績および結果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。分配金額は、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。投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険・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、必ず内容をご確認いただき、ご自身でご判断ください。

販売会社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9:00~17:00) HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>

# ダイワ・オルタナティブファンド・シリーズ

## “RICI”連動元本確保型ファンド(豪ドル建)2005-10

お買付けのお申込みはできません。

### ファンドの特色

世界の商品先物市場の値動きを反映したパフォーマンスの獲得をめざすとともに、最終評価日における豪ドル建での当初投資元本の確保を図ります。著名な投資家であるジム・ロジャーズ氏を中心に厳選されたロジャーズ国際コモディティ指数 (RICI)の騰落率を部分的に反映します。ファンドの最終評価日の豪ドル建での当初投資元本は、取得時においてスタンダード・アンド・プアーズ社においてAA-以上またはムーディーズ・インベスターズ・サービス・インクにおいてAa3以上の格付けを有する高格付債に投資することにより、その確保をめざします。ファンドは、主として公社債に投資しますが、同時に積極運用ファンドへの投資を通じて、世界の商品先物取引(商品先物取引を含みます)による運用も行います。

### ファンドにかかるリスクについて

投資信託証券への投資を通じて、主として商品先物取引、内外の公社債など値動きのある証券に投資しますので、これらの価格下落や、発行企業・発行体の経営不安、倒産等の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。ファンドは豪ドル建であり、積極運用ファンドは各国の通貨建てで取引される商品先物に投資するため、為替レートの変動による影響を受けます。また、ファンドの純資産価格は豪ドルで表示されるため、円貨から投資した場合には、円貨換算した純資産価格は外国為替相場の変動の影響を受けます。したがって、投資家の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本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。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。商品先物取引による運用に伴うリスク 公社債の価格変動(価格変動リスクや信用リスクなど) 外国証券への投資に伴うリスク(為替リスクやカントリー・リスクなど) その他(解約申込みに伴うリスクや短期金融資産の信用リスクなど)

### ファンドにかかる手数料等について

ファンドのご購入時や運用期間中には以下の費用がかかります。

#### 直接ご負担いただく費用

申込手数料 お買付けのお申込みはできません。

#### 保有期間中に間接的にご負担いただく費用

管理報酬 当初元本(1,000豪ドル)に対して年率1.4%。ほかに、設立費用・登録料、監査費用、有価証券の売買や先物取引の際に発生する費用がファンドから支払われます。また、投資するファンドについて、純資産総額に対して年率1.37%を乗じた額の報酬、設立費用・登録料、監査費用、有価証券の売買や先物取引の際に発生する費用等が支払われます。(その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。)

分類	= ケイマン籍オープンエンド契約型外国投資信託
信託期間	= 平成17年10月25日から平成22年10月29日まで
収益分配	= 無分配
基準価額の算出	= 週1回
ご換金	= 原則として、各取引日の前営業日から起算して4営業日前の日(最終評価日後については、取引日当日)の午後4時30分(日本時間)までに、販売会社に対して買戻しを請求することができます。 ファンドの「取引日」とは、平成17年12月以降の毎月第2土曜日の直前営業日および毎月第4土曜日の直前営業日とします。また、最終評価日(平成22年9月30日)ならびに最終評価日後償還日までの毎営業日を取引日とします。

「営業日」とは、東京証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、シドニーの銀行、ダブリンの銀行のいずれもが営業している日をいいます。

設定・運用:

**大和投資信託**  
Daikoku 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 社団法人投資信託協会  
社団法人日本証券投資顧問業協会

「ダイワ・オルタナティブファンド・シリーズ “RICI”連動元本確保型ファンド(豪ドル建)2005-10」およびその関連ファンドであるケイマン諸島投資法人Global Commodity Markets Fund 3 Ltd.(そのサブファンドである「ダイワ“RICI”ポートフォリオ3」を含みます。)(以下、当注記において、総称して「ファンド」といいます。 )はJames Beeland Rogers, Jim Rogers®またはBeeland Interests, Inc.(以下、当注記において、総称して「Beeland」といいます。 )により提供、保証、販売または販売促進されるものではありません。Beelandはファンド購入者、すべての潜在的ファンド購入者、政府当局、または公衆に対して、一般的な証券投資、特にファンドへの投資の助言能力を、明示的にも暗示的にも、表明または保証するものではありません。BeelandはRogers International Commodity Index®の決定、構成、算出において大和証券投資信託委託株式会社およびその関連会社、またはファンド購入者の要求を考慮する義務を負いません。Beelandはファンドが発行される時期、価格もしくは数量の決定またはファンドが換金されるもしくは他の金融商品、証券に転換される際に使用される算式の決定または計算の責任を負わず関与もしていません。Beelandはファンドの管理、運営、販売、取引に関して義務または責任を負いません。「Jim Rogers」、「Rogers International Commodity Index®」、「RICI Portfolio」および「RICI」は、James Beeland Rogers, Jim Rogers®または Beeland Interests, Inc.のトレードマークおよびサービスマークであり、使用許諾を要します。

### 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作成されたものです。当資料は、各種の信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性・完全性が保証されている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、意見等は当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。当資料中における運用実績等は、過去の実績および結果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。分配金額は、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。投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金・保険・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。

販売会社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9:00 ~ 17:00) HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>