

ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－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・レアル・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)

分配金のお知らせ

2013年8月7日

平素は、『ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－』をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは、2013年8月7日に決算を迎える、「通貨セレクト・コース」につきましては、初回の収益分配金(1万口当たり、税引前)を100円と致しましたことをご報告申し上げます。

「日本円・コース」、「豪ドル・コース」、「ブラジル・レアル・コース」および「米ドル・コース」につきましては、前回決算の分配金額と同額と致しました。

今後ともファンド運用にあたっては、パフォーマンスの向上をめざしてまいりますので、引き続きお引き立て賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

《各コースの分配金(1万口当たり、税引前)》

	日本円・コース	豪ドル・コース	ブラジル・レアル・コース	米ドル・コース	通貨セレクト・コース
当期決算 分配金	90円	200円	200円	90円	100円
(前回決算 分配金)	(90円)	(200円)	(200円)	(90円)	-
設定來 分配金合計額	1,920円	3,490円	4,240円	1,920円	100円
基準価額 2013年8月7日現在	10,360円	11,470円	9,173円	13,465円	9,416円

※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)。

※上記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。

分配方針

『ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－』の収益分配方針は、以下の通りとなっていきます。

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※分配金額は、決算の都度、収益分配方針に基づいて委託会社(大和投資信託)が決定しますので、将来の分配金額について、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。今後の市場環境や運用状況によっては、分配金額の変更あるいは分配金が支払われない場合もあります。

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(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、預金保険機関・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、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/>

Fund Letter

基準価額・純資産の推移

2013年8月7日現在

◆日本円・コース

基準価額	10,360円
純資産総額	48億円



◆豪ドル・コース

基準価額	11,470円
純資産総額	134億円



◆ブラジル・レアル・コース

基準価額	9,173円
純資産総額	1,636億円



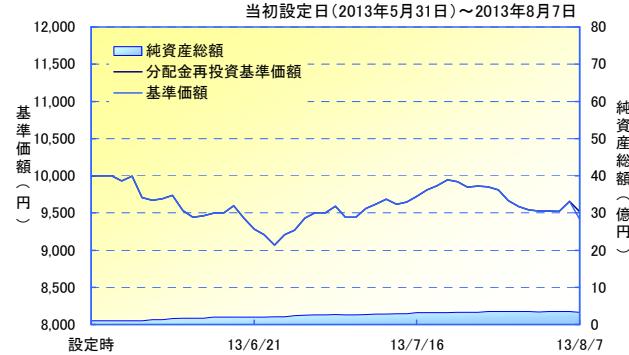
◆米ドル・コース

基準価額	13,465円
純資産総額	28億円



◆通貨セレクト・コース

基準価額	9,416円
純資産総額	3億円



※「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)。

※上記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。

以上

※1ページ目の「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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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。

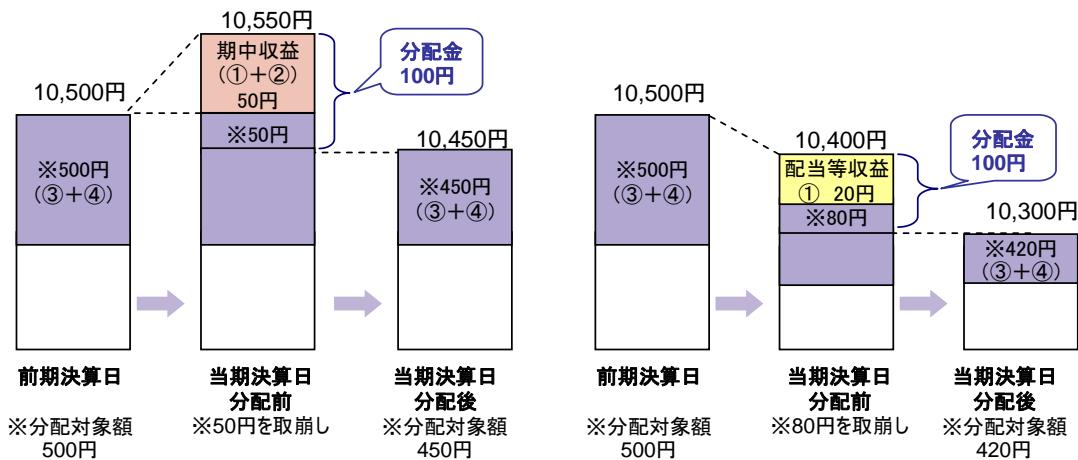


- ◆ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

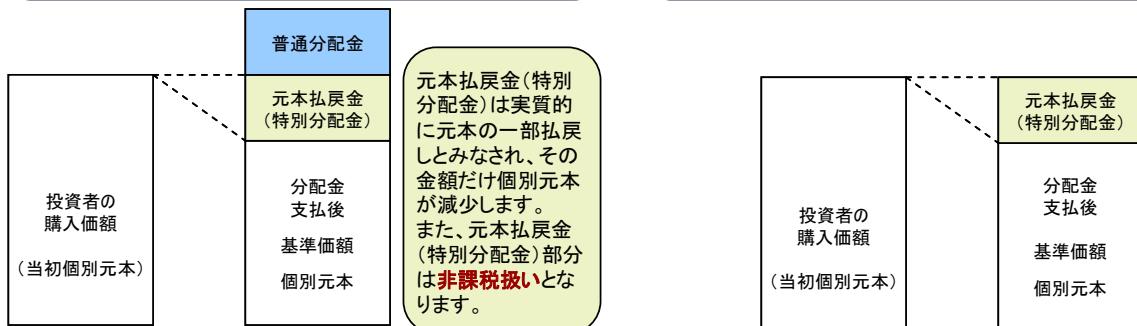


(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

- ◆ 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が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部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。

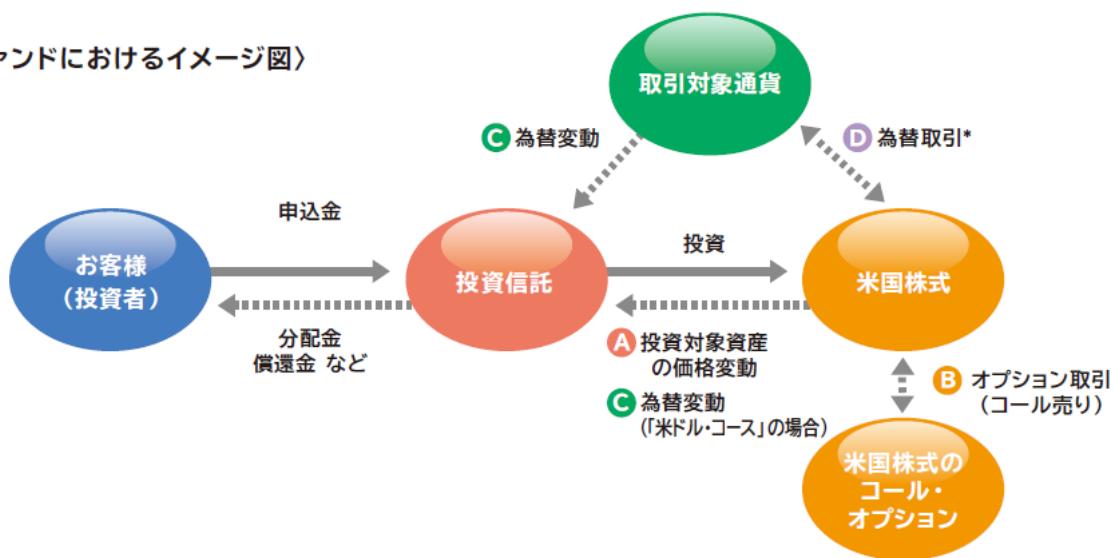
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意ください。

※1ページ目の「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。

通貨選択型ファンドの収益のイメージ

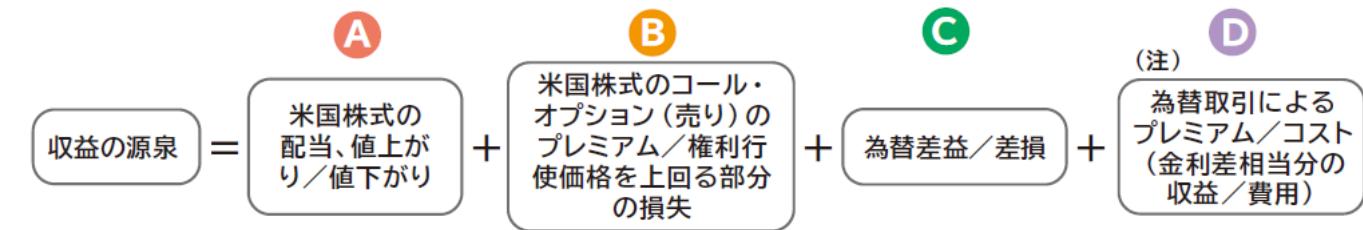
- 通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。
- 当ファンドでは、米国の株式に投資するとともに、個別株オプション取引および為替取引を活用します。

〈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。



収益を得られるケース	権利行使価格を上回る株価の上昇 株価の上昇、配当収入 相殺	コール・オプション（売り）のプレミアムの受け取り 権利行使価格を上回る部分の損失の発生	・円に対して取引対象通貨高 ・円に対して米ドル高（「米ドル・コース」の場合） 為替差益の発生 為替差損の発生	取引対象通貨の短期金利 > 米ドルの短期金利 プレミアム（金利差相当分の収益）の発生 コスト（金利差相当分の費用）の発生
損失やコストが発生するケース	・発行企業の経営不安、倒産等	・権利行使価格を上回る株価の上昇	・円に対して取引対象通貨安 ・円に対して米ドル安（「米ドル・コース」の場合） ＊「日本円・コース」を除きます。	取引対象通貨の短期金利 < 米ドルの短期金利 ＊「米ドル・コース」を除きます。

(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。

ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)トристリプルリターンズー^{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・レアル・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)}

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

- 割安と判断される米国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

1. 割安と判断される米国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。
2. 為替取引を活用します。

◆当ファンドには次の5つのコースがあり、「米ドル・コース」を除き、米ドル建ての資産に
対して米ドル売り／対象通貨買いの為替取引を行ないます。

コース名	為替取引の内容	取引対象通貨
 日本円・コース	米ドル建ての資産に対して 米ドル売り／日本円買い	日本円
 豪ドル・コース	米ドル建ての資産に対して 米ドル売り／豪ドル買い	豪ドル
 ブラジル・レアル・コース	米ドル建ての資産に対して 米ドル売り／ブラジル・レアル買い	ブラジル・レアル
 米ドル・コース	—————	—————
 通貨セレクト・コース	米ドル建ての資産に対して 米ドル売り／選定通貨買い	選定通貨

※5つの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。

- ◆「米ドル・コース」以外の各コースでは、為替取引を行なうことにより、「為替取引による
プレミアム（金利差相当分の収益）／コスト（金利差相当分の費用）」が生じます。
- ◆「日本円・コース」では、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に
排除できるものではありません。
- ◆「日本円・コース」以外の各コースでは、為替取引の対象通貨の対円レートの上昇（円安）／
下落（円高）により、為替差益／為替差損が生じます。
- ◆「通貨セレクト・コース」において、選定通貨とは、以下の<通貨の運用方針>により、為替取
引の対象通貨として選定された通貨をいいます。

<通貨の運用方針>

- 原則として、「シティグループ世界国債インデックス」および「JPモルガン ガバメント・
ボンド・インデックス－エマージング・マーケット ブロード」の構成国の通貨の中から、
金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、6つの通貨を選定します。
※上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合もあります。
- 選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。
- 選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。

ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－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・レアル・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)

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

3. 每月7日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。
(注)「通貨セレクト・コース」について
第1計算期末には、収益の分配は行ないません。第1計算期間は、平成25年7月7日（休業日の場合翌営業日）までとします。分配開始は、平成25年8月の決算からになります。
4. 当ファンドは、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。
 - ◆外国投資信託の受益証券を通じて、米国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とともに、「米ドル・コース」を除き、米ドル建ての資産に対して為替取引を行ないます。
 - ◆当ファンドが投資対象とする外国投資信託では、直接株式への投資やオプション取引を行なわず、担保付スワップ取引を通じて、米国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の損益を享受します。

◆以下、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。

ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－ 日本円・コース(毎月分配型)
：日本円・コース
ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－ 豪ドル・コース(毎月分配型)
：豪ドル・コース
ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－ ブラジル・レアル・コース(毎月分配型)
：ブラジル・レアル・コース
ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－ 米ドル・コース(毎月分配型)
：米ドル・コース
ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－ 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「ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)－トリプルリターンズ－」とします。

※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。

ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)トристリプルリターンズー^{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・レアル・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)}

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）」、「カバードコール戦略の利用に伴うリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「スワップ取引の利用に伴うリスク」、「その他（解約申込みに伴うリスク等）」

〈日本円・コース〉

※為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

※日本円の金利が米ドルの金利より低いときには、金利差相当分がコストとなります。

〈豪ドル・コース、ブラジル・レアル・コース、通貨セレクト・コース〉

※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。

※投資対象資産の通貨である米ドルの為替変動リスクを完全に排除することはできませんので、基準価額は円に対する米ドルの為替変動の影響を受ける場合があります。また、取引対象通貨の金利が米ドルの金利より低いときには、金利差相当分がコストとなります。

〈米ドル・コース〉

※組入外貨建資産について、米ドルが円に対して米ドル安の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。

※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。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	
購入時手数料	販売会社が別に定めるものとします。 購入時の申込手数料の料率の上限は、 3.15%（税抜 3.0%） です。 スイッ칭（乗換え）による購入時の申込手数料を徴収している販売会社はありません。
信託財産留保額	1万口当たり換金申込受付日の翌営業日の基準価額の 0.5%
投資者が信託財産で間接的に負担する費用	
運用管理費用 (信託報酬)	毎日、信託財産の純資産総額に対して 年率 1.28625%（税抜 1.225%） ※運用管理費用は、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	「日本円・コース」、「豪ドル・コース」、「ブラジル・レアル・コース」、「米ドル・コース」年率0.68%程度 「通貨セレクト・コース」年率0.83%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・レアル・コース」、「米ドル・コース」 年率 1.96625%（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 2.11625%（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	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。 ※「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」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
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
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