

使用開始日 2023年3月2日

## 投資信託説明書 (交付目論見書)

# 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) / 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



ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読み下さい。

■委託会社 (ファンドの運用の指図等を行ないます。)

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

**大和アセットマネジメント**

Daiwa Asset Management

■受託会社 (ファンドの財産の保管、管理等を行ないます。)

株式会社りそな銀行

■委託会社の照会先



ホームページ

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



コールセンター 受付時間 9:00 ~ 17:00 (営業日のみ)

0120-106212



■ファンドに関する投資信託説明書 (請求目論見書) を含む詳細な情報は委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードすることができます。また、本書には約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。

■本文書は、金融商品取引法 (昭和23年法律第25号) 第13条の規定に基づく目論見書です。

UD  
FONT

見やすく読みまちがえにくい  
ユニバーサルデザインフォント  
を採用しています。

◆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。

ファンドの名称	略称
ダイワ日本株ストラテジー $\alpha$ (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)	日本円・コース
ダイワ日本株ストラテジー $\alpha$ (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)	豪ドル・コース
ダイワ日本株ストラテジー $\alpha$ (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)	ブラジル・リアル・コース
ダイワ日本株ストラテジー $\alpha$ (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)	米ドル・コース
ダイワ日本株ストラテジー $\alpha$ (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)	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 $\alpha$  (通貨選択型) – ジャパン・トリプルリターンズ –」とします。

商品分類			属性区分			
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
追加型	国内	株式	その他資産 (投資信託証券 (その他資産))	年12回 (毎月)	日本	ファンド・オブ・ファンズ

※商品分類・属性区分の定義について

くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ [ <http://www.toushin.or.jp/> ] をご参照下さい。

#### 〈委託会社の情報〉

委託会社名	大和アセットマネジメント株式会社
設立年月日	1959年12月12日
資本金	151億74百万円
運用する投資信託財産の 合計純資産総額	22兆1,073億99百万円 (2022年12月末現在)

- 本文書により行なう「ダイワ日本株ストラテジー $\alpha$  (通貨選択型) – ジャパン・トリプルリターンズ –」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2023年3月1日に関東財務局長に提出しており、2023年3月2日にその届出の効力が生じています。
- 当ファンドは、商品内容に関して重大な変更を行なう場合に、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき、事前に受益者の意向を確認する手続きを行ないます。
- 当ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産等との分別管理等が義務付けられています。
- 請求目論見書は、投資者の請求により販売会社から交付されます (請求を行なった場合には、その旨をご自身で記録しておくようにして下さい。)

# 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

### 1. 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。

- ◆投資対象銘柄は「TOPIX100」構成銘柄から金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。
- ◆ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。
- ◆選定時における各銘柄の構成比率は概ね均等とします。  
また、銘柄の見直しは約1カ月ごとに行ないます。
- ◆個別銘柄ごとにコール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。  
コール・オプションの満期日は、原則として売却から約1カ月後とします。

### 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、「日本円・コース」を除き、日本円売り／対象通貨買いの為替取引を行ないます。



(注) 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。

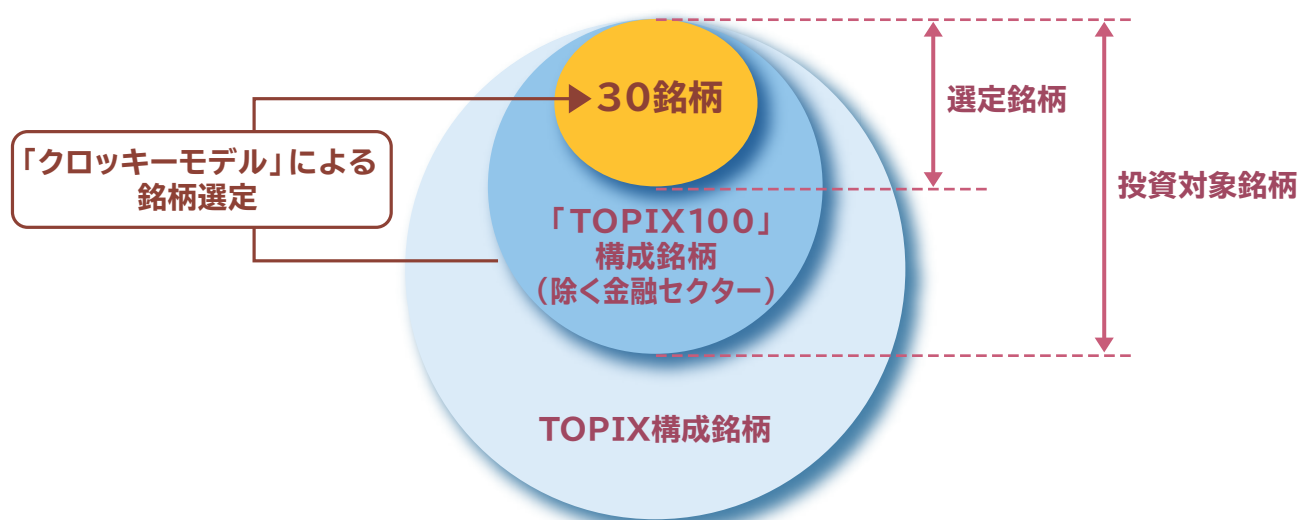
### 3. 毎月8日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

# ファンドの目的・特色

## 1 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。

- ◆投資対象銘柄は「TOPIX100」構成銘柄から金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。
- ◆ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。
- ◆選定時における各銘柄の構成比率は概ね均等とします。また、銘柄の見直しは約1カ月ごとに行ないます。

### 銘柄選定のイメージ



※「TOPIX100」は、TOPIX構成銘柄のうち、時価総額、流動性の高い100銘柄から構成される時価総額方式の株価指数です。

※金融セクターには、不動産などが含まれます。

### 「クロッキーモデル」とは

- クロッキーモデルは、ドイツ銀行グループが1995年から1996年にかけて開発した株式分析手法で、世界の機関投資家に利用されています。
- クロッキーモデルは、開発以来一貫した手法で国・業種を超えて株式投資をするために、統一した投資尺度を提供しています。
- 世界の大型株を対象として、企業が開示している会計データを徹底的に分析することで企業の本質的価値を算出しています。

※ドイツ銀行グループは、1870年にベルリンで創業されたドイツ銀行を中心とする世界最大級の総合金融グループです。世界各国で事業を展開し、幅広い金融サービスを提供しています。

◆個別銘柄ごとにコール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。

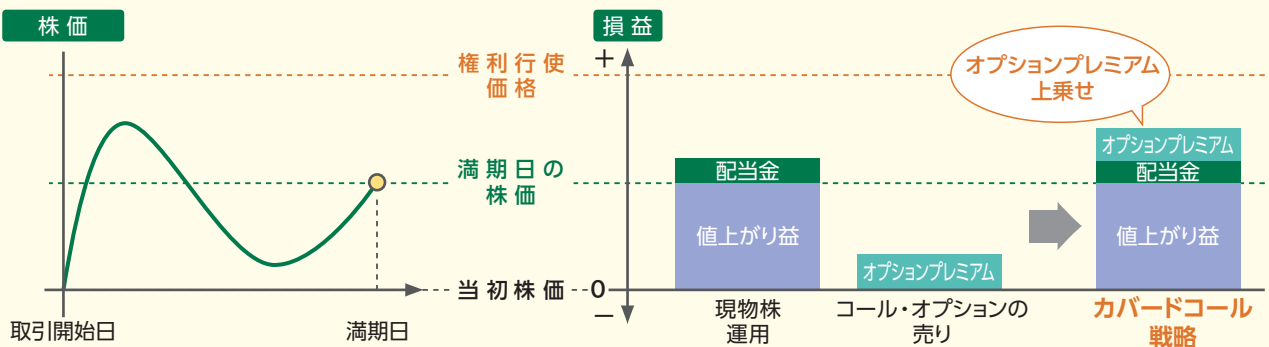
## カバードコール戦略とは

- 株式を保有しつつ、株式のコール・オプション（買う権利）を売却する戦略です。
- 株価の上昇／下落にかかわらず、オプションプレミアムを獲得することができます。
- 一方で、株価の上昇による利益は一定の水準までに限定されます。
  - ・「オプションプレミアム」とは、オプションの買い手が売り手に支払う対価をいいます。
  - ・「権利行使価格」とは、オプションの権利行使の基準となる株価をいいます。

### ケース①

株価は上昇したが、満期日に権利行使価格に到達しなかった場合

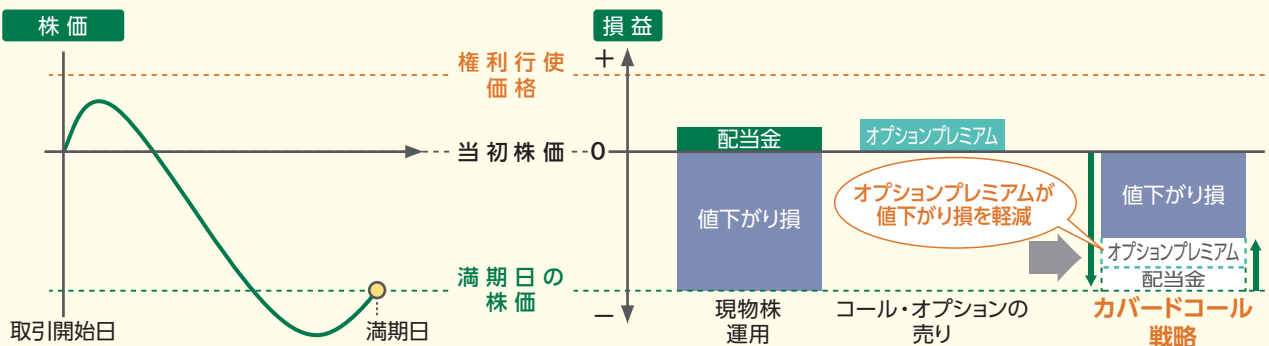
株価の上昇による利益が発生します。



### ケース②

株価が下落し、満期日に当初株価を下回った場合

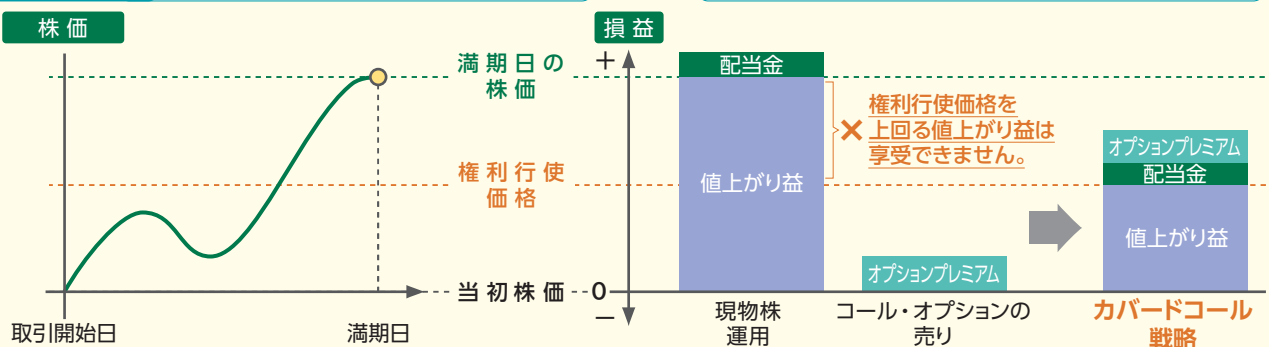
株価の下落による損失が発生します。



### ケース③

株価が上昇し、満期日に権利行使価格以上となった場合

株価の上昇による利益が発生しますが、権利行使価格を上回る上昇による利益は受取れません。



※上記は配当金の支払いがあった場合の損益イメージを表したものです。

※当ファンドにおいて、カバードコール戦略の損益は毎営業日時価評価され、基準価額に反映されます。

※当ファンドにおけるカバードコール戦略の損益は、対象となる株式の銘柄ごとに異なります。

※上記は当ファンドの損益を示したものではありません。

※上記はイメージであり、実際の株価、配当金、オプションプレミアムとは異なります。

※上記は投資成果を示唆または保証するものではありません。





# ファンドの目的・特色

## 当ファンドにおけるカバードコール戦略について

- コール・オプションの満期日は、原則として売却から約1カ月後とします。
- 原則として、コール・オプションが満期を迎えるごとに、銘柄を見直すとともに新たにコール・オプションを売却することで、カバードコール戦略を再構築します。
- 権利行使が満期日のみに限定されているオプションを利用します。

## 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、「日本円・コース」を除き、日本円売り／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	—	—
 豪ドル・コース	日本円売り／豪ドル買い	豪ドル
 ブラジル・リアル・コース	日本円売り／ブラジル・リアル買い	ブラジル・リアル
 米ドル・コース	日本円売り／米ドル買い	米ドル
 通貨セレクト・コース	日本円売り／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。

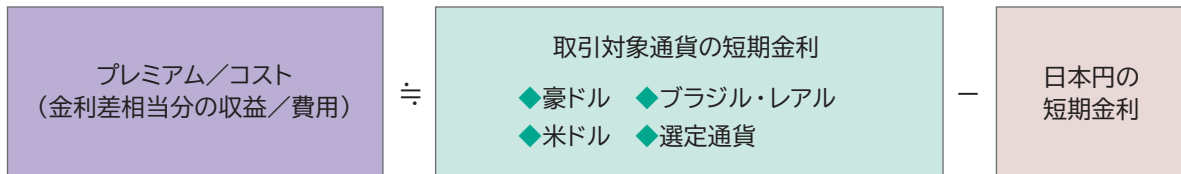
- ◆「日本円・コース」以外の各コースでは、為替取引を行なうことにより、「為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）／コスト（金利差相当分の費用）」が生じます。
- ◆「日本円・コース」以外の各コースでは、為替取引の対象通貨の対円レートの上昇（円安）／下落（円高）により、為替差益／為替差損が生じます。
- ◆「通貨セレクト・コース」において、選定通貨とは、以下の＜通貨の運用方針＞により、為替取引の対象通貨として選定された通貨をいいます。

### ＜通貨の運用方針＞

- 原則として、「FTSE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・マーケットズ 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があります。
- 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。

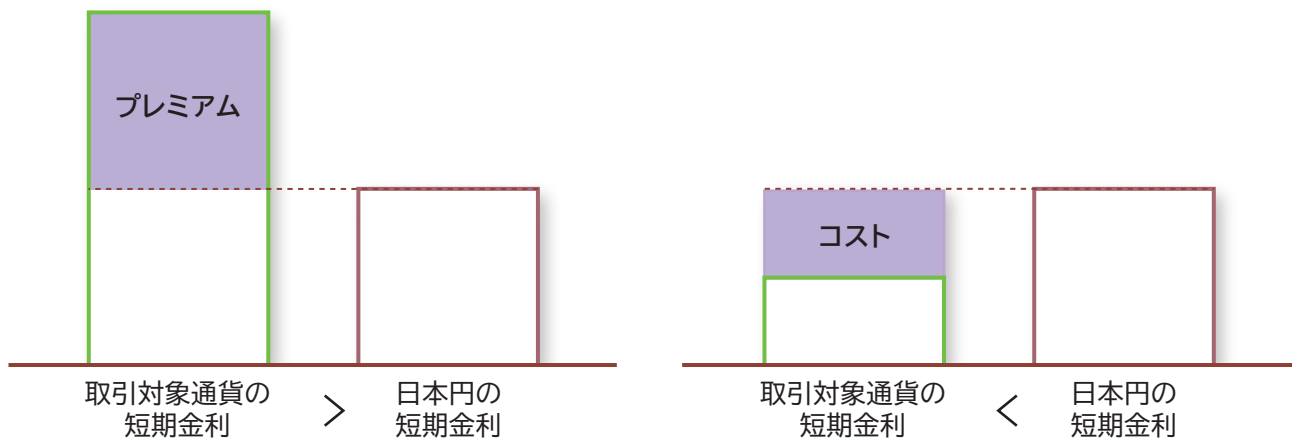
為替取引によるプレミアム (金利差相当分の収益) / コスト (金利差相当分の費用) について

- 為替取引の対象通貨の短期金利が、日本円の短期金利よりも高い場合、「プレミアム (金利差相当分の収益)」が期待できます。
- 為替取引の対象通貨の短期金利が、日本円の短期金利よりも低い場合、「コスト (金利差相当分の費用)」が生じます。



● プレミアムが期待できるケース

● コストが生じるケース



※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。

※実際の為替取引によるプレミアム/コストの水準は、需給要因等によって金利差相当分とは異なる水準となり、プレミアムの縮小、コストの拡大が生じることがあります。

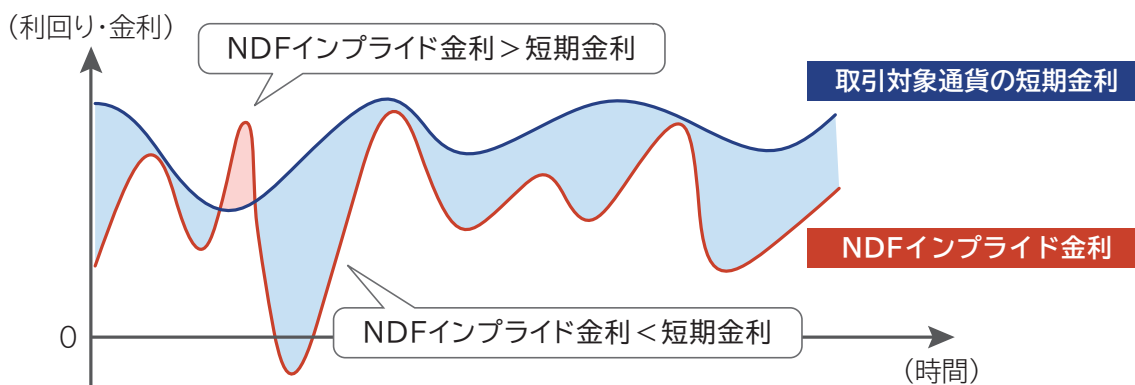
※取引対象通貨が新興国通貨の場合、為替取引を行なう際にNDF (ノン・デリバブル・フォワード) 取引を利用することがあります。NDF取引を用いて為替取引を行なう際、プレミアム/コストは、需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

# ファンドの目的・特色

## 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。

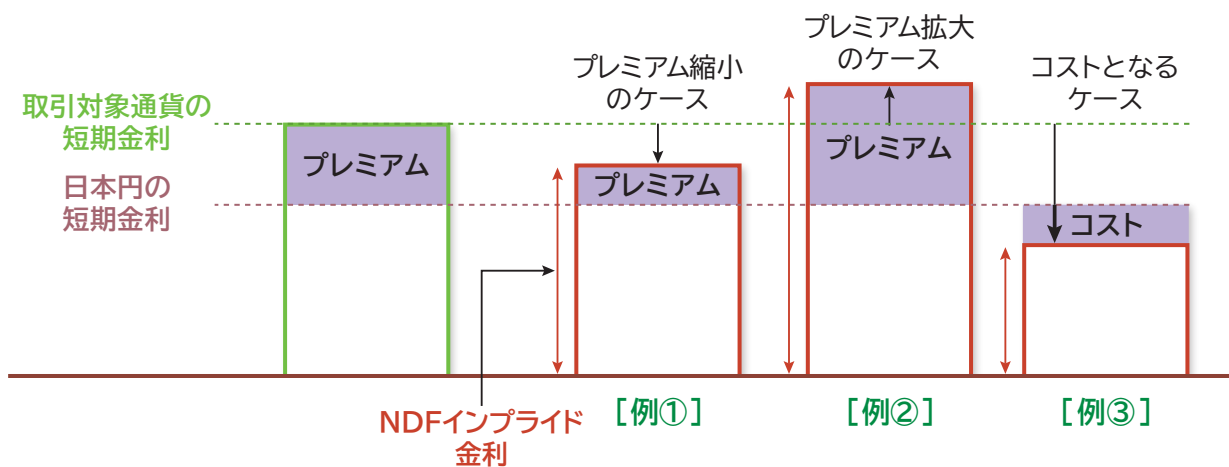
### NDFインプライド金利と取引対象通貨の短期金利が乖離するイメージ



※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。



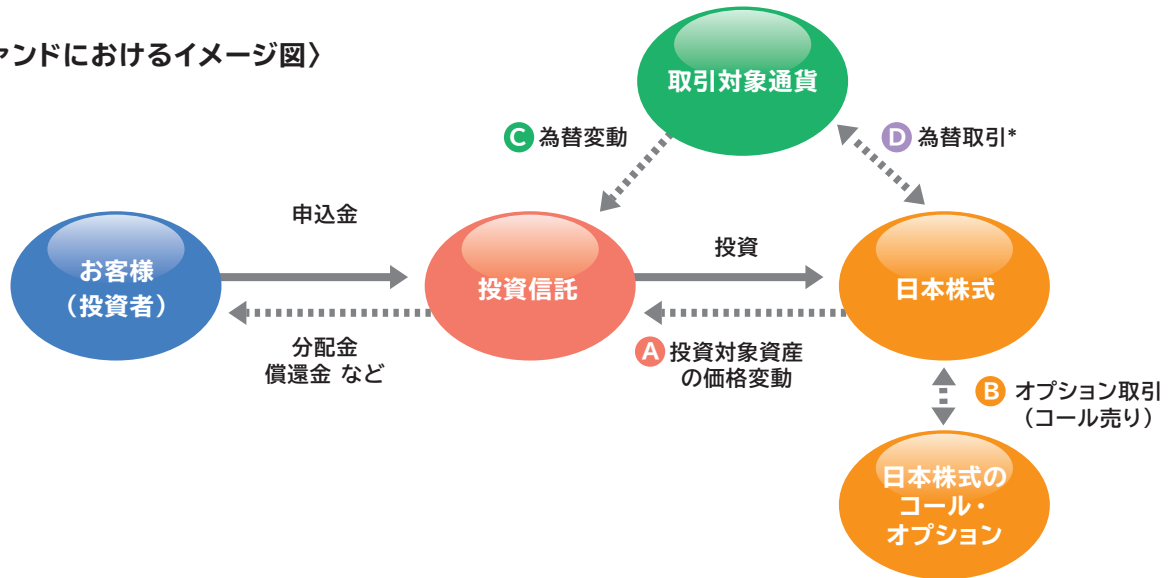
※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。  
※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。



## 通貨選択型ファンドの収益のイメージ

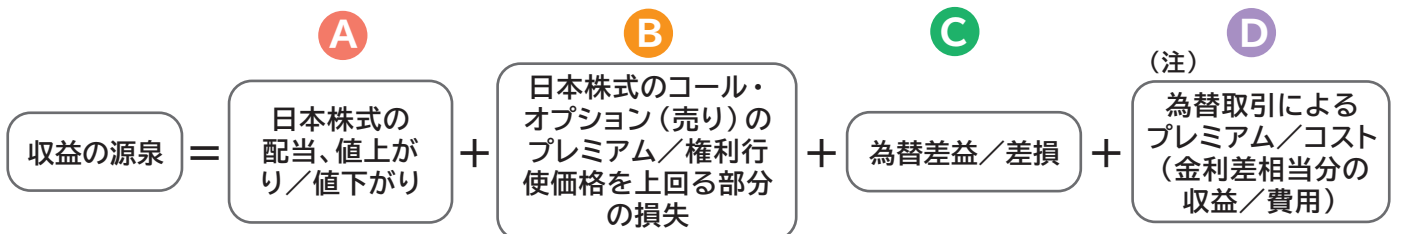
- 通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。
- 当ファンドでは、日本の株式に投資するとともに、個別株オプション取引および為替取引を活用します。

〈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。



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

(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。

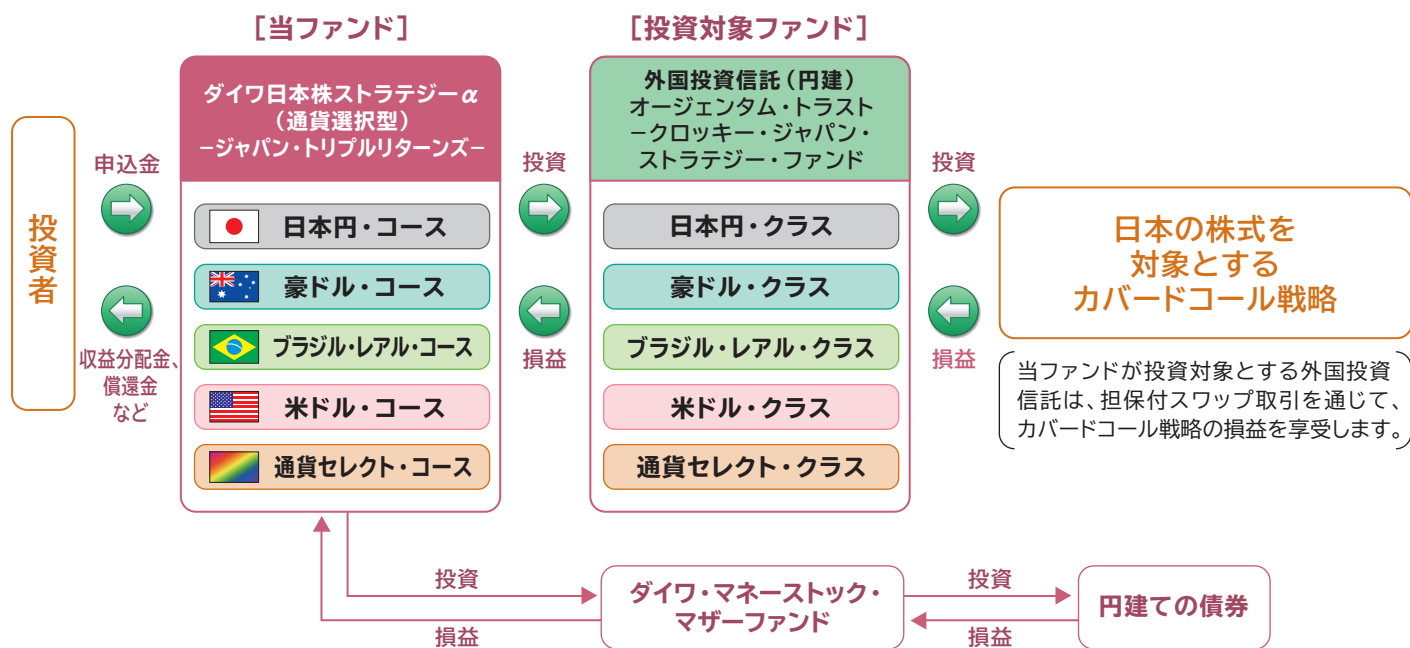
NDF取引を用いて為替取引を行なう際、為替取引によるプレミアム/コスト (金利差相当分の収益/費用) は、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

※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。

# ファンドの目的・特色

## ファンドの仕組み

- ◆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、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するとともに、「日本円・コース」を除き、為替取引を行いません。
- ◆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わず、担保付スワップ取引を通じて、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の損益を享受します。



※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。

※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

●当ファンドは、通常の状態では、投資対象とする外国投資信託への投資割合を高位に維持することを基本とします。

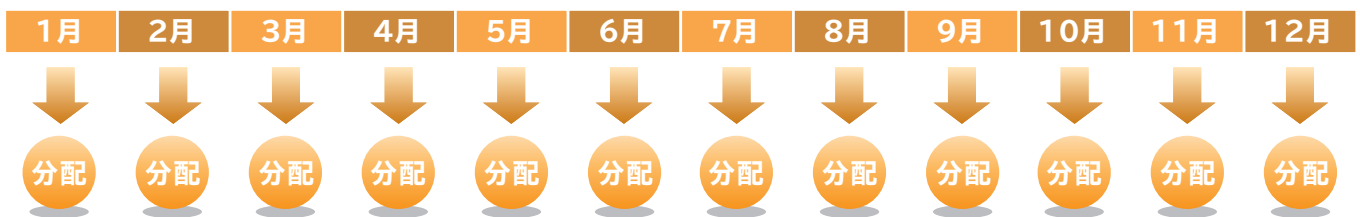
●大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1. および2. の運用が行なわれないことがあります。

3

毎月8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。

- 【分配方針】
- 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、分配を行わないことがあります。

### 収益分配のイメージ



※上記はイメージ図であり、**将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、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。**

※ファンドの基準価額は変動します。**投資元本、利回りが保証されているものではありません。**

### 主な投資制限

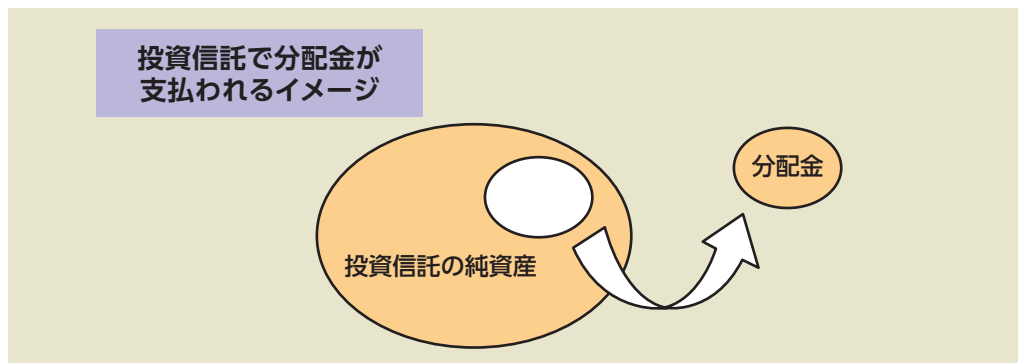
- 株式への直接投資は、行ないません。
- 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

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。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

## [収益分配金に関する留意事項]

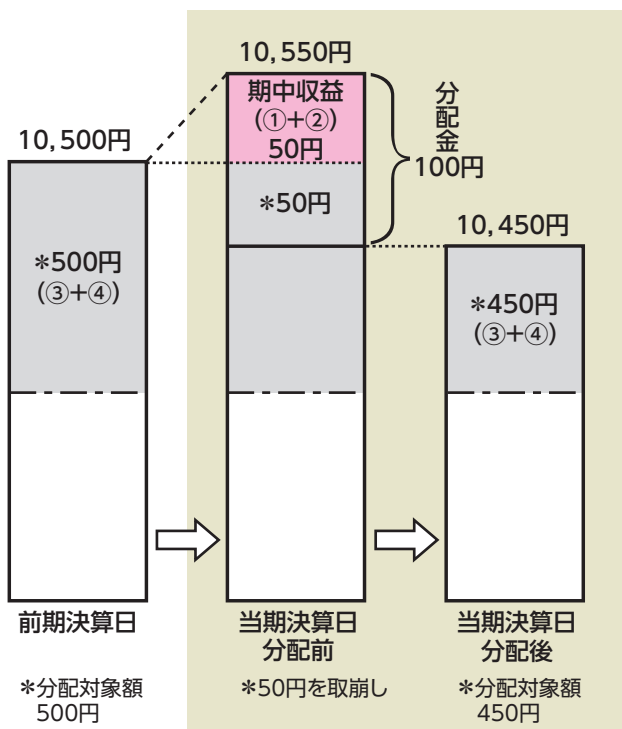
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



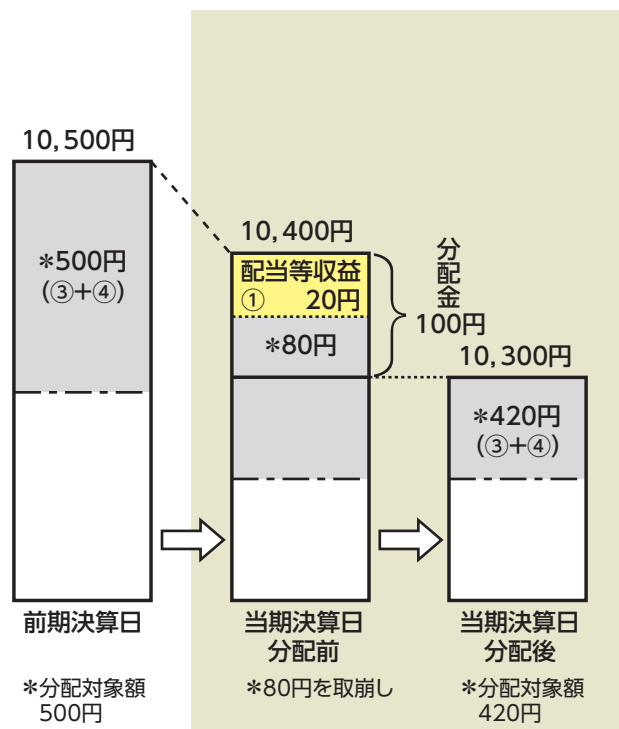
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### (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。

※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下さい。

- 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りが小さかった場合も同様です。

(注) 「手続・手数料等」の「〈税金〉」の部分にイメージ図を記載。

## [投資対象ファンドの概要]

### 1. 「オージェンタム・トラスト・クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド(日本円・クラス)」、 「同(豪ドル・クラス)」、「同(ブラジル・リアル・クラス)」、「同(米ドル・クラス)」、「同(通貨セレクト・クラス)」

形態/表示通貨	ケイマン籍の外国投資信託/円建								
運用の基本方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、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するとともに、為替取引を行ない*、信託財産の成長をめざします。 ※日本円・クラスは除きます。								
主な運用方針	<p>1. 主として、担保付スワップ取引を通じて、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の投資成果を享受します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>担保付スワップ取引の相手方は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・ピーエルシーです。</li> </ul> <p>2. カバードコール戦略の構築にあたっては、以下の点に留意します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>投資対象銘柄はTOPIX100構成銘柄から世界産業分類基準 (GICS) の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。</li> <li>ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。</li> <li>選定時における各銘柄の構成比率は概ね均等とします。</li> <li>個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするヨーロピアン・コール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。                      ※銘柄の見直しは約1か月ごとに行ないます。                      ※コール・オプションの満期日は、原則として売却から約1か月後とします。                      ※原則として、コール・オプションが満期を迎えるごとに、銘柄を見直すとともに新たにコール・オプションを売却することでカバードコール戦略を再構築します。</li> </ul> <p>3. 各クラスで以下の為替取引を行ないます。(日本円・クラスは除きます。)</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="background-color: #e0f2f1; text-align: center;">豪ドル・クラス</td> <td>日本円売り/豪ドル買い</td> </tr> <tr> <td style="background-color: #e0f2e1; text-align: center;">ブラジル・リアル・クラス</td> <td>日本円売り/ブラジル・リアル買い</td> </tr> <tr> <td style="background-color: #ffe0b2; text-align: center;">米ドル・クラス</td> <td>日本円売り/米ドル買い</td> </tr> <tr> <td style="background-color: #ffe082; text-align: center;">通貨セレクト・クラス</td> <td>日本円売り/選定通貨買い</td> </tr> </table> <p>〈通貨セレクト・クラスについて〉</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>大和アセットマネジメント株式会社が通貨の選定および配分比率について助言を行ないます。                      ※選定通貨とは、通貨運用助言会社の助言に基づき決定した複数の通貨をいいます。</li> </ul> <p>〈通貨セレクト・クラスにおける通貨の運用方針〉</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>原則として、FTSE世界国債インデックスおよびJ.P.モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケットズ・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があります。</li> <li>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。</li> <li>選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。</li> </ul>	豪ドル・クラス	日本円売り/豪ドル買い	ブラジル・リアル・クラス	日本円売り/ブラジル・リアル買い	米ドル・クラス	日本円売り/米ドル買い	通貨セレクト・クラス	日本円売り/選定通貨買い
豪ドル・クラス	日本円売り/豪ドル買い								
ブラジル・リアル・クラス	日本円売り/ブラジル・リアル買い								
米ドル・クラス	日本円売り/米ドル買い								
通貨セレクト・クラス	日本円売り/選定通貨買い								
管理報酬・担保付スワップにかかる費用等	<p>【日本円・クラス、豪ドル・クラス、ブラジル・リアル・クラス、米ドル・クラス】                  純資産総額に対して年率0.545%程度</p> <p>【通貨セレクト・クラス】                  純資産総額に対して年率0.695%程度</p> <p>ただしその他、監査費用、弁護士費用、有価証券売買委託手数料等、ファンドの運営に必要な各種経費等がかかります。</p>								
管理会社	IQ EQマネジメント・パミュダ・リミテッド								
備考	当外国投資信託は、担保付スワップ取引の相手方にカバードコール戦略の構築に必要な現金を支払い、当該戦略の評価額に相当する株式、国債などを担保として受け入れます。担保付スワップ取引の相手方は、日々の担保付スワップ取引の評価を行っており、担保も洗い替えされます。担保付スワップ取引の評価には、株式等へ投資する場合にかかるコストや税金等が反映されます。								

※上記は提出日現在の情報に基づくものであり、変更となる場合があります。

## ■IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッドについて■

IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッドは、IQ EQグループに属しています。IQ EQグループは専門サービスプロバイダーであり、世界の主要金融センターの大手投資銀行から専門のオルタナティブ投資運用会社にわたる広範囲の企業や機関投資家に、ファンドの運営・管理事務やコーポレート・サービスを提供するといった業務に従事しています。

## 2. ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用の基本方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主な投資態度	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
運用管理費用 (信託報酬)	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社



## 基準価額の変動要因

- 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。

### 〈主な変動要因〉

#### 株 価 の 変 動 (価格変動リスク・ 信用リスク)

- ・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

- ・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後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後する可能性があります。

#### 為 替 変 動 リ ス ク

- <日本円・コース以外のコース>
- ・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。
  - ・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。
- ※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。

## スワップ取引の利用に伴うリスク

- ・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こと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性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。

## リスクの管理体制

- 委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に関する基本方針に基づき、運用本部から独立した部署および会議体が直接的または間接的に運用本部へのモニタリング・監視を通し、運用リスクの管理を行ないます。
- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。



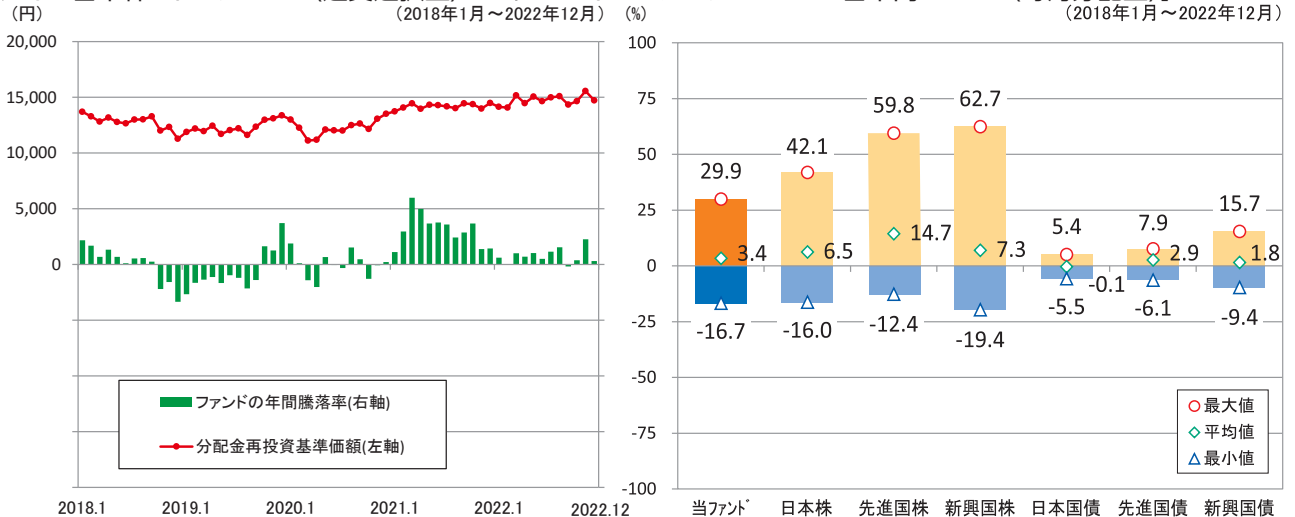
## 参考情報

●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

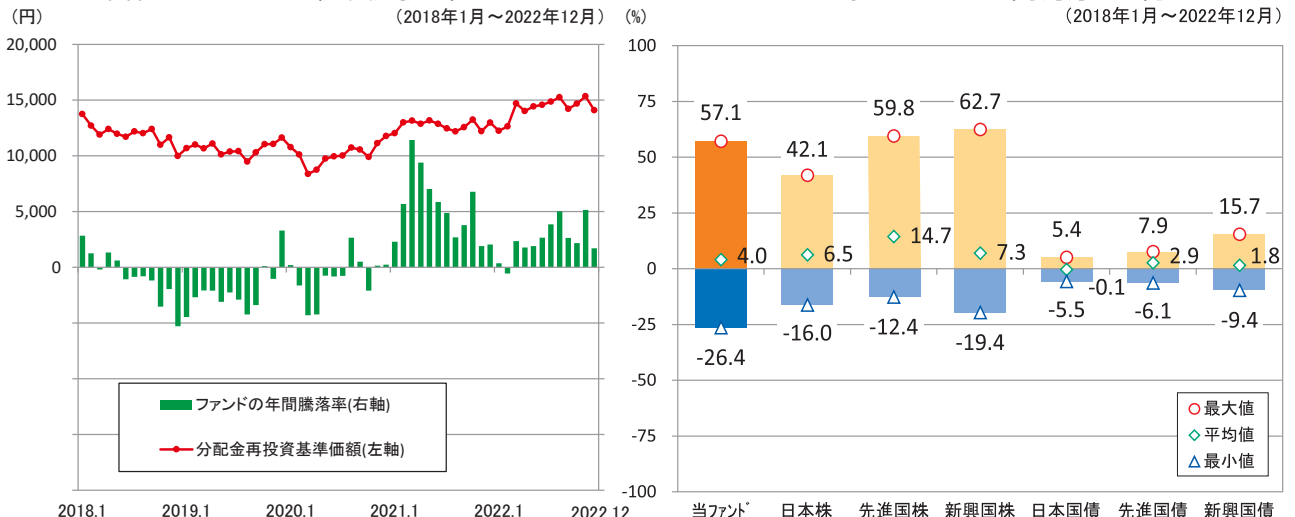
### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

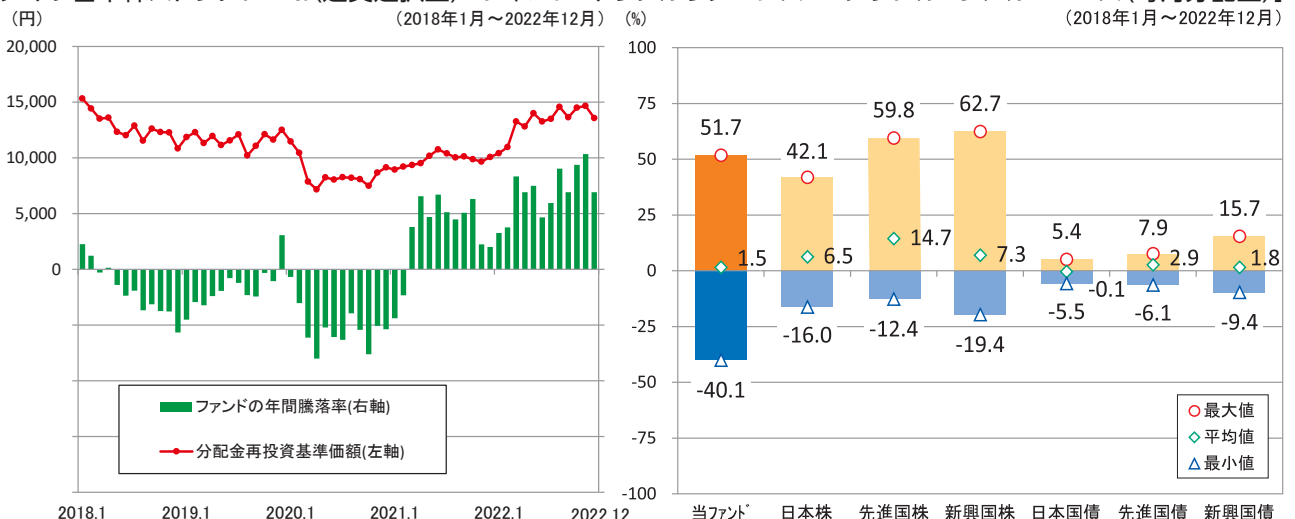
[ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ- 日本円・コース(毎月分配型)]



[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)]

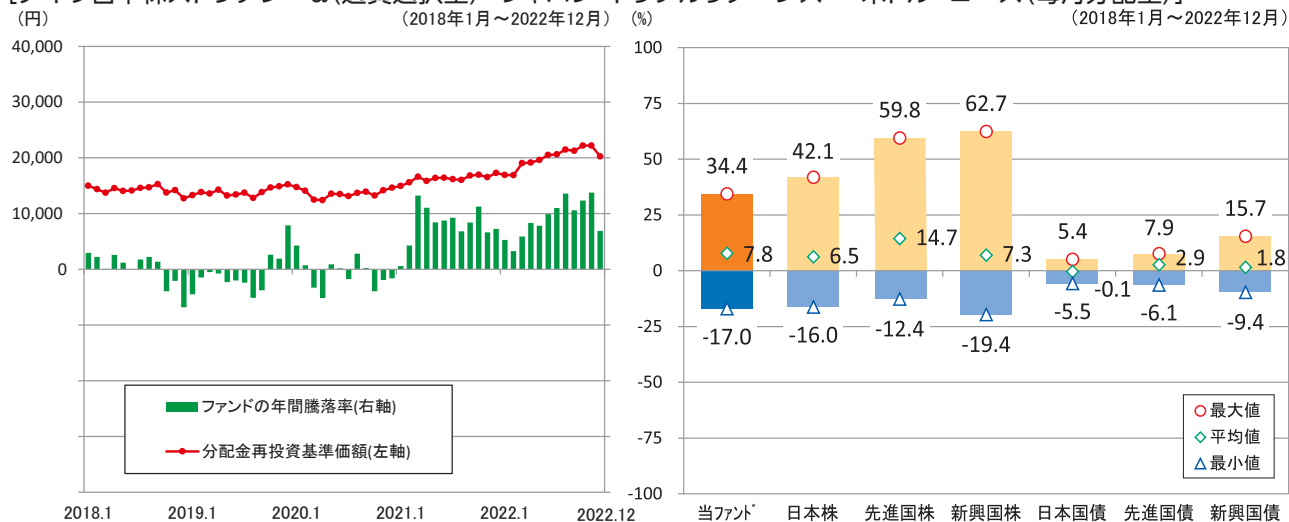


[ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)]

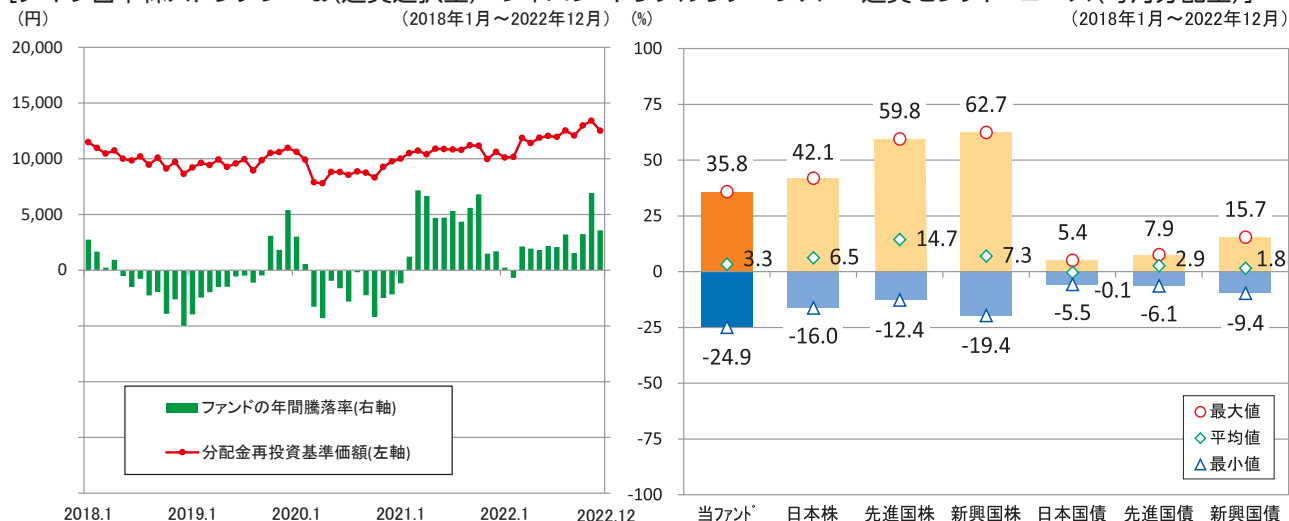


# 投資リスク

[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)]



[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)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、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たものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)  
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)  
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)  
日本国債：NOMURA-BPI国債  
先進国債：FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)  
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース)

※指数について

●東証株価指数 (TOPIX) 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。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. (「MSCI」) が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>] ●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

# 運用実績

● 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)

2022年12月30日現在

※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

基準価額	6,504円
純資産総額	10億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-5.4%
3カ月間	2.7%
6カ月間	0.5%
1年間	1.6%
3年間	10.1%
5年間	8.7%
設定来	47.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※「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。

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 720円 設定来分配金合計額: 6,780円

決算期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月	22年8月	22年9月	22年10月	22年11月	22年12月
分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60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を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。

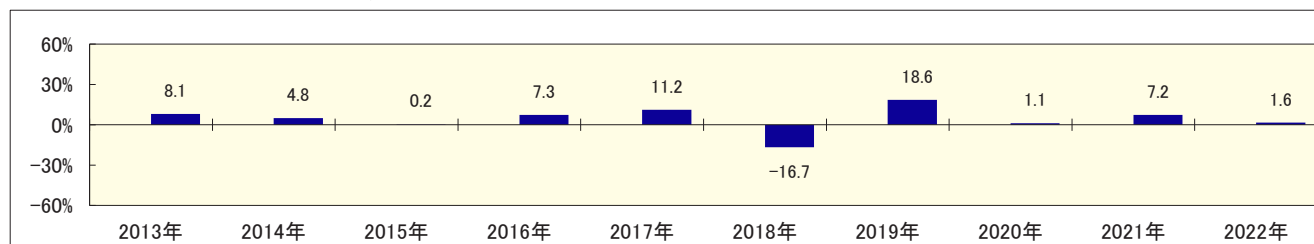
## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド(日本円・クラス)	97.5%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	0.0%
合計		97.5%

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
 ・2013年は設定日(6月19日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

● 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)

2022年12月30日現在

※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

基準価額	4,621円
純資産総額	2.5億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-8.1%
3カ月間	-0.9%
6カ月間	-3.3%
1年間	8.5%
3年間	21.0%
5年間	3.8%
設定来	40.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「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。

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 600円 設定来分配金合計額: 7,660円

決算期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月	22年8月	22年9月	22年10月	22年11月	22年12月
分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50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。

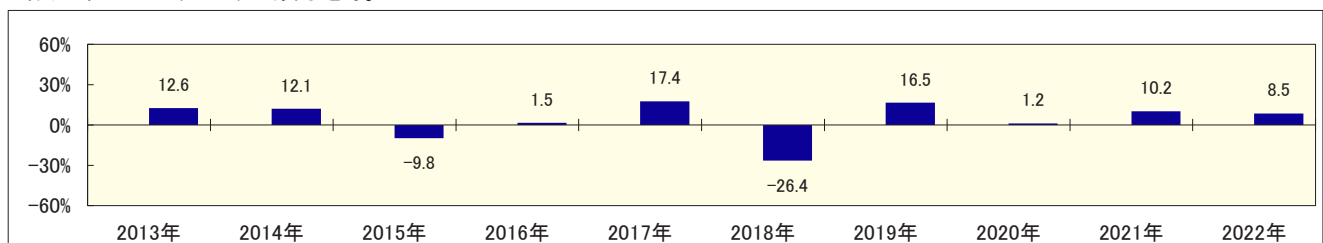
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・パミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド(豪ドル・クラス)	98.0%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	0.0%
合計		98.0%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
 ・2013年は設定日(6月19日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

# 運用実績

● 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)

2022年12月30日現在

※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

基準価額	2,616円
純資産総額	11億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-7.5%
3カ月間	-0.6%
6カ月間	2.3%
1年間	34.6%
3年間	8.4%
5年間	-10.4%
設定来	35.6%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「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。

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 300円

設定来分配金合計額: 9,125円

決算期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月	22年8月	22年9月	22年10月	22年11月	22年12月
分配金	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25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。

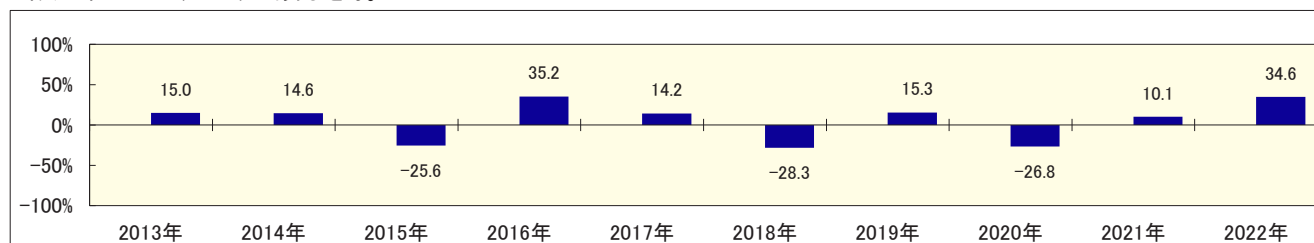
## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・パミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド(ブラジル・リアル・クラス)	99.2%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	0.0%
合計		99.2%

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
 ・2013年は設定日(6月19日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

● ダイワ日本株戦略ー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)

2022年12月30日現在

※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

基準価額	10,232円
純資産総額	16億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-8.7%
3カ月間	-4.8%
6カ月間	-1.2%
1年間	17.2%
3年間	32.9%
5年間	32.1%
設定来	102.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※「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。

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 720円												設定来分配金合計額: 6,780円
	第102期 22年1月	第103期 22年2月	第104期 22年3月	第105期 22年4月	第106期 22年5月	第107期 22年6月	第108期 22年7月	第109期 22年8月	第110期 22年9月	第111期 22年10月	第112期 22年11月	第113期 22年12月	
分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60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を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。

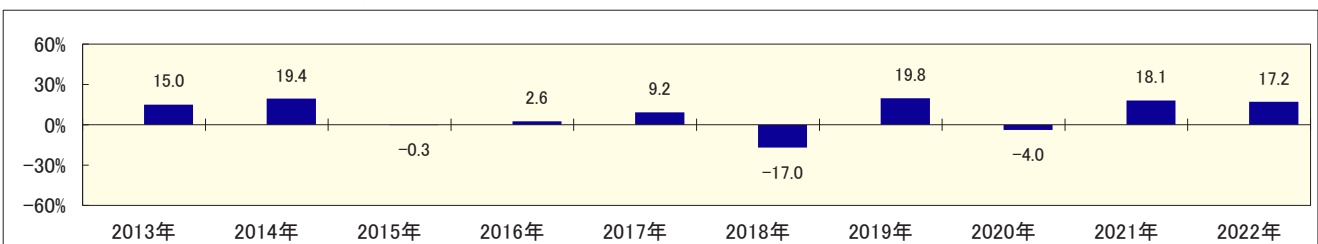
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド(米ドル・クラス)	97.6%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	0.0%
合計		97.7%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
・2013年は設定日(6月19日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

● 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)

2022年12月30日現在

※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

基準価額	2,306円
純資産総額	11億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-6.7%
3カ月間	3.6%
6カ月間	3.8%
1年間	17.9%
3年間	14.1%
5年間	8.8%
設定来	25.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※「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。

### 分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 360円 設定来分配金合計額: 8,220円

決算期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月	22年8月	22年9月	22年10月	22年11月	22年12月
分配金	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30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。

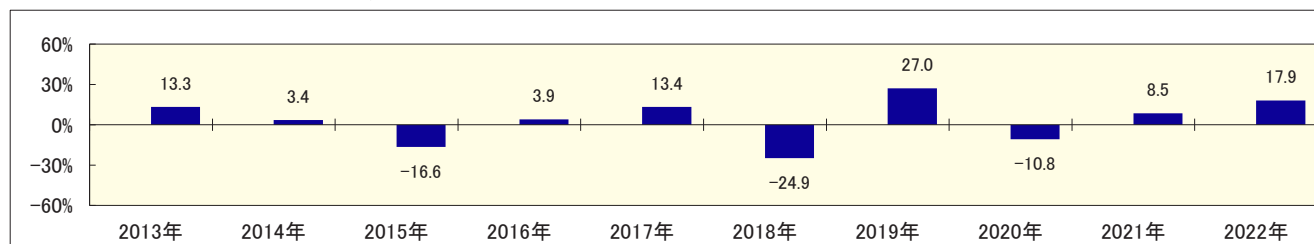
### 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド(通貨セレクト・クラス)	97.4%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	0.0%
合計		97.4%

### 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
・2013年は設定日(6月19日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



## 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)
購入の申込期間	2023年3月2日から2023年6月6日まで
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。
信託期間	2013年6月19日から2023年6月8日まで
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
決算日	毎月8日(休業日の場合翌営業日)
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いません。 (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。
信託金の限度額	各ファンドについて2,000億円
公 告	電子公告の方法により行ない、ホームページ[ <a href="https://www.daiwa-am.co.jp/">https://www.daiwa-am.co.jp/</a> ]に掲載します。
運用報告書	毎年6月および12月の計算期末ならびに償還時に作成し、交付運用報告書をあらかじめお申出いただいたご住所にお届けします。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
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。 ※2022年12月末現在のものであり、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。

## 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

	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) <b>3.3% (税抜3.0%)</b>	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	<b>0.30%</b>	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」 <b>年率2.0355% (税込) 程度</b> (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」 <b>年率2.1855% (税込) 程度</b> (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。

< 税金 >

- ・税金は表に記載の時期に適用されます。
- ・以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	<b>配当所得として課税</b> (注) 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および償還時	所得税および地方税	<b>譲渡所得として課税</b> (注) 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

(注) 所得税、復興特別所得税および地方税が課されます。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA (ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA (ジュニアニーサ)」をご利用の場合  
毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。  
ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

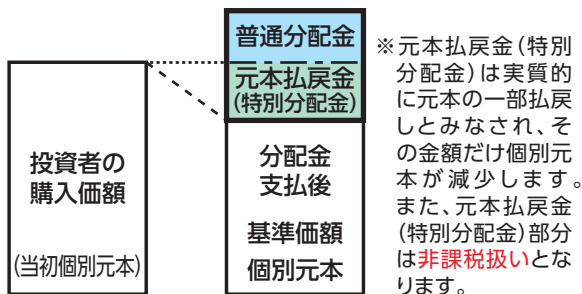
※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2022年12月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

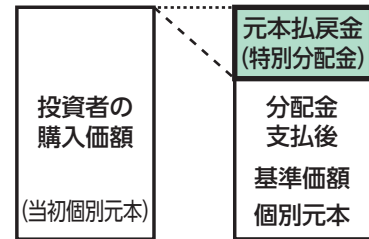
※法人の場合は上記とは異なります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(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(特別分配金) … 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)の額だけ減少します。

（参考情報） ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
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)	2.20%	1.49%	0.72%
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)	2.13%	1.49%	0.64%
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)	2.12%	1.48%	0.64%
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)	2.18%	1.49%	0.69%
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)	2.46%	1.48%	0.98%

※対象期間は2022年6月9日～2022年12月8日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。

※その他費用には、投資先ファンドにかかる費用が含まれています。

※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）の費用には、CROCI JP STRATEGY JPY（支払利息、担保付スワップにかかる費用）が含まれていません。

※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）の費用には、CROCI JP STRATEGY AUD（支払利息、担保付スワップにかかる費用）が含まれていません。

※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）の費用には、CROCI JP STRATEGY BRL（支払利息、担保付スワップにかかる費用）が含まれていません。

※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）の費用には、CROCI JP STRATEGY USD（支払利息、担保付スワップにかかる費用）が含まれていません。

※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）の費用には、CROCI JP STRATEGY CSC（支払利息、担保付スワップにかかる費用）が含まれていません。

上記以外のファンドについて、投資先ファンドにおいて含まれていない費用は認識していません。

※投資先ファンドの費用について、計上された期間が異なる場合があります。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。