

ダイワ／“RICI®”コモディティ・ファンド

元本確保型の商品ではありません

◆ファンドの特色

- ◆主な投資対象……………ケイマン籍の外国証券投資法人「RICI®」Commodity Fund Ltd.が発行する「RICI®」class A」（以下、「RICI®」ファンド クラスA」といいます。）と「ダイワ・マネー・マザーファンド」
- ◆ベンチマーク……………ロジャーズ国際コモディティ指数®(円換算)
- ◆目標とする運用成果……………ベンチマークに連動する運用成果を目指して運用を行ないます。

◆基準価額、純資産総額

基準価額	3,121円
純資産総額	20.01億円

* 既出分配金累計：500円

◆資産構成

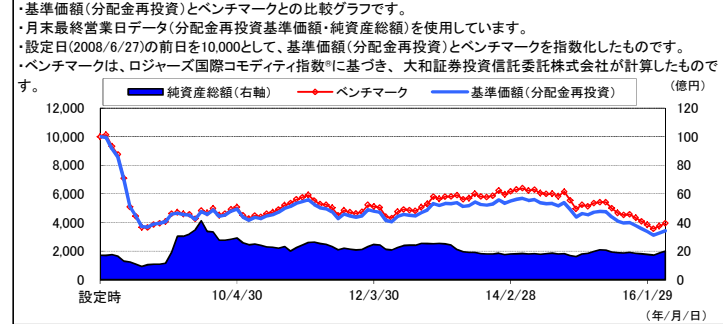
“RICI®”ファンド クラスA	98.45%
ダイワ・マネー・マザーファンド	0.46%
合計	98.91%
現金等	1.09%

* 比率は純資産総額対比です。
(ヘビィファンドの実質組入比率にて計算しています。)

◆為替ヘッジ

為替ヘッジ比率	0.00%
---------	-------

◆基準価額の推移



◆ファンド(分配金再投資)とベンチマークの収益率とリスク(標準偏差)

	3ヶ月間	6ヶ月間	1年間	3年間	5年間	10年間	設定来
ファンド収益率(分配金再投資)	1.83%	-14.38%	-27.45%	-13.62%	-9.36%	-	-12.72%
ベンチマーク収益率	2.50%	-13.72%	-26.38%	-12.13%	-7.79%	-	-11.35%
差異	-0.67%	-0.66%	-1.07%	-1.48%	-1.56%	-	-1.37%
ファンドリスク(分配金再投資)	-----	-----	16.01%	15.42%	17.27%	-	22.58%
ベンチマークリスク	-----	-----	16.45%	16.22%	18.00%	-	23.47%

* ファンド収益率(分配金再投資)とは、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入(再投資)した場合の収益率です。
 * 収益率・リスクともに月次収益率より算出。なお設定日が月中の場合、設定日が属する月の月次収益率は含んでいません。
 * 収益率は期間が1年以上の場合は年率換算しております。期間が1年未満のものについては年率換算していません。

◆“RICI®”ファンド クラスAの資産構成

商品先物	100.0%
先物計	100.0%

先物証拠金その他	33.5%
外国公社債	66.5%
計	100.0%

* 比率は“RICI®”ファンド クラスAの純資産総額対比です。
 * “RICI®”ファンド クラスAの資産構成は、基準価額への反映を考慮して、原則として月末から1営業日直前の市場に基づくデータを使用しています。

◆「ダイワ・マネー・マザーファンド」の資産構成

国内公社債	3.3%
コール・ローン、その他	96.7%
計	100.0%

* 比率は「ダイワ・マネー・マザーファンド」の純資産総額対比です。

◆通貨別構成

米ドル	98.5%
日本円	1.5%
上記計	100.0%

＜RICI®構成比率と月間騰落率＞ ※ (3月30日～4月27日終値ベース)

	ウエート	月間騰落率		ウエート	月間騰落率
エネルギー	40.00%		穀物	20.00%	
原油(WTI)	16.00%	14.30%	小麦(シカゴ上場)	4.75%	2.55%
原油(北海ブレント)	13.00%	15.82%	トウモロコシ	4.75%	3.57%
天然ガス	5.00%	2.04%	大豆	3.50%	12.25%
無鉛ガソリン(RBOB)	3.00%	7.84%	大豆油	2.00%	-0.41%
ヒーティング・オイル	1.80%	16.34%	小麦(カンザス上場)	1.00%	-0.10%
ガス・オイル	1.20%	12.15%	欧州小麦	1.00%	-0.92%
産業金属	14.00%		大豆粕	0.75%	19.56%
アルミニウム	4.00%	10.32%	欧州菜種	1.00%	2.80%
銅	4.00%	0.68%	米	0.75%	7.71%
鉛	2.00%	-0.01%	オーツ麦	0.50%	6.11%
亜鉛	2.00%	4.89%	ソフト	9.90%	
ニッケル	1.00%	9.04%	綿花	4.20%	11.14%
スズ	1.00%	1.36%	砂糖(ICE上場)	1.00%	-0.75%
貴金属	11.10%		砂糖(NYSE Liffe上場)	1.00%	2.74%
金	5.00%	1.77%	コーヒー	2.00%	2.48%
銀	4.00%	13.68%	ココア	1.00%	5.48%
プラチナ	1.80%	6.13%	オレンジジュース	0.60%	-10.35%
パラジウム	0.30%	7.65%	牛乳	0.10%	-5.34%
家畜	3.00%		その他	2.00%	
生牛	2.00%	-4.29%	ゴム	1.00%	12.34%
豚赤身肉	1.00%	-2.54%	板材	1.00%	-2.52%

※上記は当該期間中の主なRICI®の構成銘柄、構成比率を示したもので、当ファンドおよび“RICI®”ファンド クラスAにおける実際の商品先物取引の構成が上記と一致することを保証するものではありません。また、RICI®の構成については、随時、銘柄の入替え、構成比率の見直しが行なわれます。
 ※月間騰落率は、主として当月のRICI®に使用される限月の終値を用いて計算しています。計算に用いた限月は、“RICI®”ファンド クラスAに実際に組み入れているものと必ずしも一致しません。

◆過去3ヶ月間のパフォーマンス分析

2016年2月～2016年4月の基準価額の騰落率は1.83%となりました。
 商品市況の上昇を受けて“RICI®”ファンド クラスA(米ドル建て)は12.46%の上昇、また米ドルは対円で9.20%の下落となりました。

■当資料は、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■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、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、大和証券投資信託委託株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成されましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。■上記「基準価額」は、信託報酬控除後のものです。■「ダイワ／“RICI®”コモディティ・ファンド」およびその関連ファンドであるケイマン籍の外国証券投資法人「RICI®」Commodity Fund Ltd. (そのサブファンドである「RICI®」class A)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®」、「Rogers International Commodity™」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。

ダイワ／“RICI®” コモディティ・ファンド

<リターン実績表>

(単位：%)

設定日：2008年6月27日

リターン		リターン		リターン		リターン	
2016年4月	4.98	2013年4月	-0.33	2010年4月	2.98		
2016年3月	4.72	2013年3月	2.66	2010年3月	6.09		
2016年2月	-7.37	2013年2月	-2.63	2010年2月	2.10		
2016年1月	-5.87	2013年1月	9.16	2010年1月	-9.40		
2015年12月	-5.68	2012年12月	4.33	2009年12月	7.08		
2015年11月	-5.29	2012年11月	5.12	2009年11月	-4.08		
2015年10月	0.83	2012年10月	-1.25	2009年10月	12.76		
2015年9月	-3.19	2012年9月	-1.06	2009年9月	-6.77		
2015年8月	-6.51	2012年8月	2.93	2009年8月	-0.77		
2015年7月	-7.87	2012年7月	9.83	2009年7月	-2.19		
2015年6月	-0.23	2012年6月	-2.55	2009年6月	1.61		
2015年5月	1.00	2012年5月	-12.26	2009年5月	13.18		
2015年4月	4.04	2012年4月	-1.51	2009年4月	2.38		
2015年3月	-1.90	2012年3月	-2.28	2009年3月	1.80		
2015年2月	5.43	2012年2月	10.00	2009年2月	5.54		
2015年1月	-10.66	2012年1月	1.84	2009年1月	-0.59		
2014年12月	-8.75	2011年12月	-1.85	2008年12月	-16.89		
2014年11月	4.25	2011年11月	-2.56	2008年11月	-13.12		
2014年10月	-3.15	2011年10月	7.10	2008年10月	-26.38		
2014年9月	0.31	2011年9月	-9.99	2008年9月	-18.79		
2014年8月	-1.12	2011年8月	-4.34	2008年8月	-6.25		
2014年7月	-3.87	2011年7月	-1.11	2008年7月	-7.94		
2014年6月	0.93	2011年6月	-4.52				
2014年5月	-2.61	2011年5月	-6.15				
2014年4月	1.19	2011年4月	2.34				
2014年3月	1.94	2011年3月	2.34				
2014年2月	3.18	2011年2月	4.50				
2014年1月	-4.39	2011年1月	2.50				
2013年12月	5.80	2010年12月	5.81				
2013年11月	1.38	2010年11月	3.94				
2013年10月	-0.74	2010年10月	1.61				
2013年9月	-3.40	2010年9月	4.81				
2013年8月	5.00	2010年8月	-2.07				
2013年7月	1.07	2010年7月	4.47				
2013年6月	-4.94	2010年6月	-4.97				
2013年5月	1.37	2010年5月	-11.19				

※リターンは、分配金込み基準価額の月次騰落率を掲載

■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■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、元本および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、大和証券投資信託委託株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成されましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。■「ダイワ／“RICI®”コモディティ・ファンド」およびその関連ファンドであるケイマン籍の外国証券投資法人「“RICI®” Commodity Fund Ltd.」（そのサブファンドである「“RICI®” class A」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®」、「Rogers International Commodity™」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。