

2020年10月6日

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  
加入協会 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

# 米国ABC戦略ファンド (1倍コース／3倍コース／5倍コース)

追加型投信／海外／資産複合



当社は、2020年10月5日に「米国ABC戦略ファンド（1倍コース／3倍コース／5倍コース）」の設定と運用開始を致しましたので、お知らせいたします。概要は下記のとおりです。なお、下記内容は変更される場合があります。

## 記

### 1. ファンドの目的

#### 1倍コース

連動債券への投資を通じて、米国の株式、リートおよび債券ならびに金に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

#### 3倍コース 5倍コース

連動債券への投資を通じて、米国の株式、リートおよび債券ならびに金に投資し、信託財産の成長をめざします。

### 2. ファンドの特色



**主として、連動債券<sup>※1</sup>への投資を通じて、米国の株式、リートおよび債券<sup>※2</sup>ならびに金に実質的に投資します。**

※1 連動債券について、くわしくは「投資対象債券の概要」をご参照下さい。

※2 米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。

委託会社の独自モデルに基づき、以下の方針で資産配分比率を変更します。

- 景気サイクルの局面判断によって投資対象資産の配分比率を調整します。
- 市場リスクが急激に高まったと判断した場合には、資産配分比率を切り替えることで、基準価額下落リスクの抑制をめざします。



**リスク水準の異なる3つのコースがあります。**

1倍コース：実質的に純資産総額と概ね同等額の投資を行ないます。

3倍コース：実質的に純資産総額の概ね3倍相当額の投資を行ないます。

5倍コース：実質的に純資産総額の概ね5倍相当額の投資を行ないます。

※市場環境および設定・解約による資金動向により、実質的な投資額がそれぞれ上記に定める水準から乖離する場合があります。

※「3倍コース」「5倍コース」のリターン水準はそれぞれ「1倍コース」のリターンの3倍、5倍になるものではありません。

販売会社によっては3つのコースのうち、一部のコースのみのお取扱いとなる場合があります。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

## ファンドの仕組み

- 連動債券を通じて、米国の株式、リートおよび債券ならびに金の投資成果を享受します。



※「1倍コース」「3倍コース」「5倍コース」はそれぞれ異なる連動債券に投資します。連動債券について、くわしくは「投資対象債券の概要」をご参照下さい。

- 連動債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。  
※実質組入外貨建資産は、リターン(損益)部分のみとなるため、為替変動による影響は限定されます。

当初設定日直後、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。



毎年4月4日および10月4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) 第1計算期間は、2021年4月4日(休業日の場合翌営業日)までとします。

### [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、基準価額の水準等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。



## [投資対象債券の概要]

### [1倍コース]

発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連動対象	Daiwa US ABC Strategy Index
特 色	<p>① 原則として、Daiwa US ABC Strategy Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。</p> <p>※Daiwa US ABC Strategy Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。</p> <p>※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。</p> <p>② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p>
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.05%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's : Aa2 / S&P : A+ / Fitch : AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、今後、記載内容が変更となる場合、投資対象債券が変更となる場合等があります。

### [3倍コース]

発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連動対象	Daiwa US ABC Strategy 3X Index
特 色	<p>① 原則として、Daiwa US ABC Strategy 3X Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。</p> <p>※Daiwa US ABC Strategy 3X Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。実質的にDaiwa US ABC Strategy Indexの概ね3倍相当額の投資を行ないます。</p> <p>※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。</p> <p>② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p>
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.25%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's : Aa2 / S&P : A+ / Fitch : AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、今後、記載内容が変更となる場合、投資対象債券が変更となる場合等があります。

[5倍コース]



発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連 動 対 象	Daiwa US ABC Strategy 5X Index
特 色	<p>① 原則として、Daiwa US ABC Strategy 5X Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。</p> <p>※Daiwa US ABC Strategy 5X Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。実質的にDaiwa US ABC Strategy Indexの概ね5倍相当額の投資を行ないます。</p> <p>※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。</p> <p>② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p>
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.50%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's : Aa2 / S&P : A+ / Fitch : AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、今後、記載内容が変更となる場合、投資対象債券が変更となる場合等があります。

### 3. 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。

#### 〈主な変動要因〉

 <p>価格変動リスク・信用リスク</p>	<p>組入資産の価格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。</p>
<p>株 価 の 変 動</p>	<p>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。</p>
<p>リ ー ト の 価 格 変 動</p>	<p>リートの価格は、不動産市況の変動、リートの収益や財務内容の変動、リートに関する法制度の変更等の影響を受けます。</p>
<p>公 社 債 の 価 格 変 動</p>	<p>公社債の価格は、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。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、公社債の価格は下落します。</p> <p>ハイイールド債券は、投資適格債券に比べ、一般に債務不履行が生じるリスクが高いと考えられます。ハイイールド債券は、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向があります。</p> <p>新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。</p>
<p>金 の 取 引 価 格 の 変 動</p>	<p>金の取引価格は、様々な要因(商品の需給関係の変化、貿易動向、為替レート、金利の変動、政治的・経済的事由および政策、技術発展等)に基づき変動します。当ファンドの基準価額は、金の取引価格の変動の影響を受け、投資元本を割込むことがあります。</p>
 <p>連動債券への投資に伴うリスク</p>	<p>当ファンドが投資対象とする連動債券において、連動債券が追加発行されないこととなる場合および連動債券の早期償還事由が生じた場合は、予想外の損失を被る可能性があります。</p> <p>連動債券の発行体がスワップ取引を活用した場合で、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には、予想外の損失を被る可能性があります。</p>



## 当ファンドの戦略 に関するリスク

「3倍コース」および「5倍コース」では、連動債券を通じて純資産規模を上回る投資を行なうことから、投資対象の市場における値動きに比べて大きな損失が生じる可能性があります。



## 為替変動リスク

外貨建資産については、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。組入外貨建資産について、当該外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。



## カントリー・リスク

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したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

## そ の 他

解約資金を手当てするため組入証券を売却する際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却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。また、連動債券の値付業者の財務状況が著しく悪化した場合などには、当該債券の流動性が著しく低下する可能性があり、その影響により、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

※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。



#### 4. 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	ありません。	—
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)	<b>年率1.2375% (税抜1.125%)</b>	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、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。
配分 (税抜) (注1)	委託会社	年率0.4%
	販売会社	年率0.7%
	受託会社	年率0.025%
投資対象とする 連動債券	「1倍コース」年率0.05%程度 「3倍コース」年率0.25%程度 「5倍コース」年率0.50%程度	連動債券にかかる費用等です。
実質的に負担する 運用管理費用の 概算値	「1倍コース」 <b>年率1.2875%(税込)程度</b> 「3倍コース」 <b>年率1.4875%(税込)程度</b> 「5倍コース」 <b>年率1.7375%(税込)程度</b> (連動債券にかかる費用等を含めたものです。実際の組入状況等により変動します。)	
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) 当ファンドおよび連動債券における「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い合わせ下さい。


※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。

5. ご参考

◆ 販売会社：SBI証券、みずほ信託銀行

 購入時	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。

 換金時	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(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5営業日目からお支払いします。

 申込について	申込受付中止日	① ニューヨーク証券取引所、シカゴ・マーカンタイル取引所、シカゴ・オプション取引所、ニューヨークの銀行または香港の銀行の休業日 ② ①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 (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	2020年10月5日から2021年12月28日まで (終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)
	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み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発生した場合には、購入、換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受付けた購入、換金の申込みを取消すことがあります。

 <p>その他</p>	信託期間	2025年10月3日まで(2020年10月5日当初設定) 受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長できます。
	繰上償還	◎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、繰上償還ができます。 ・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	毎年4月4日および10月4日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、2021年4月4日(休業日の場合翌営業日)までとします。
	収益分配	年2回、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。 (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1,000億円
	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	毎計算期末に作成し、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。 ※2020年7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。

◆ 受託会社：みずほ信託銀行

## 6. その他

くわしくは、「有価証券届出書」をご覧ください。また、「投資信託説明書（交付目論見書）」公表後は当該交付目論見書も併せてご覧ください。

以上

〈お問い合わせ先〉 営業企画部プロモーション戦略課 TEL 03-5555-3483