

2020年11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

メガトレンド・ロング・ショート・ファンド

追加型投信／内外／株式



当社は、2020年11月6日に「メガトレンド・ロング・ショート・ファンド」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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

記

1. ファンドの目的

日本を含む世界の株式の中からロング・ショート戦略※1を構築し、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。

2. ファンドの特色

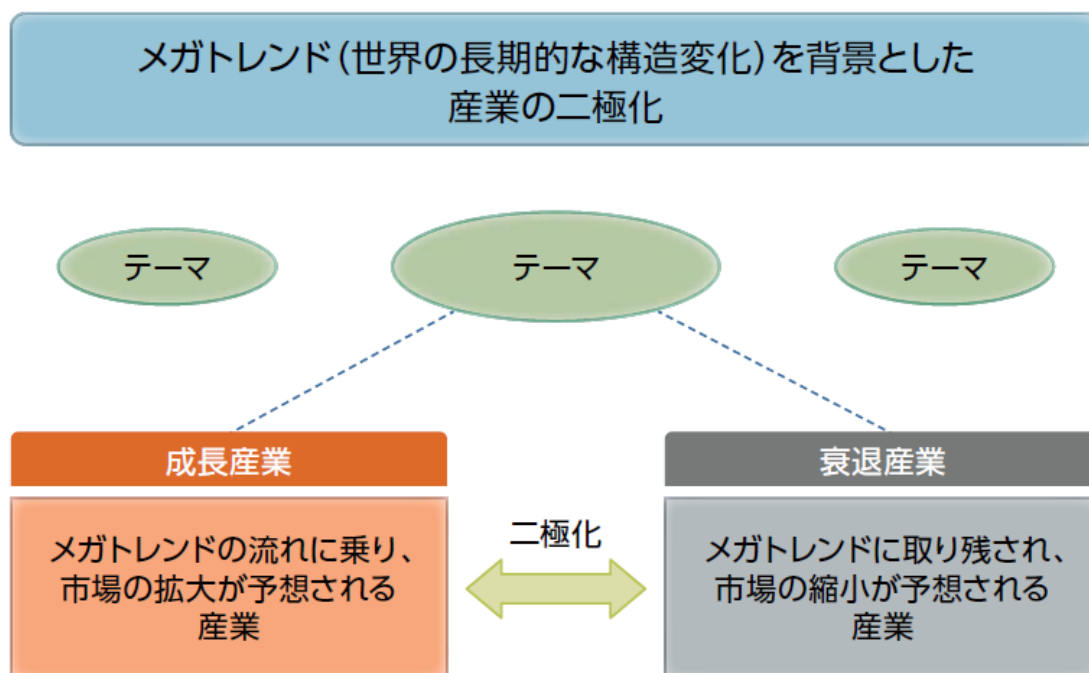
1 日本を含む世界の株式の中から、メガトレンド※2を背景とした複数のテーマを基に、ロング・ショート戦略を構築します。

※1 ロング・ショート戦略とは、買いポジションおよび売りポジションの2つを組み合わせる戦略をいいます。

※2 メガトレンドとは、世界の長期的な構造変化をいいます。

*連動債券への投資を通じて、上記の運用を行ないます。くわしくは、「投資対象連動債券の概要」をご参照下さい。

[メガトレンドを背景としたテーマのイメージ図]

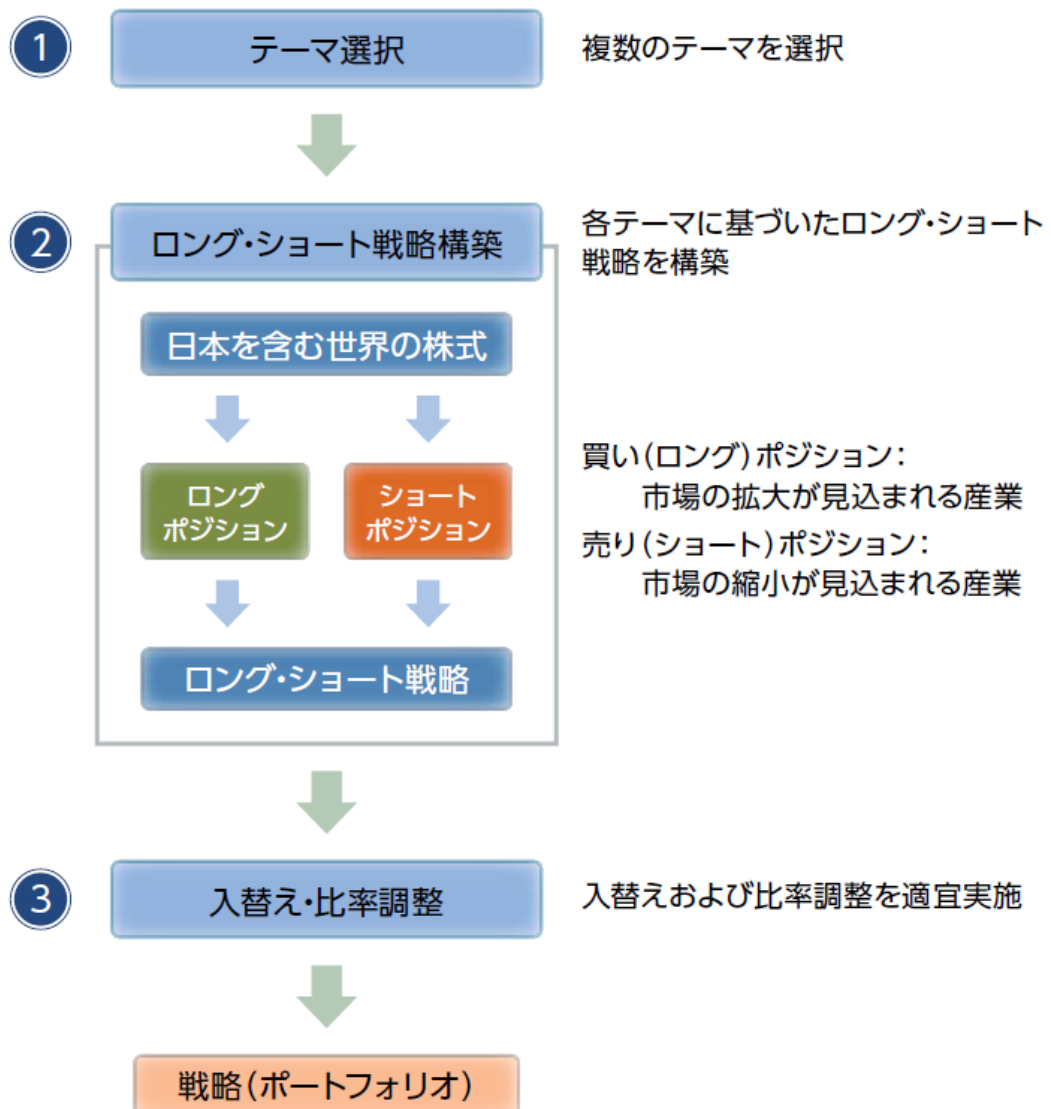


● 連動債券が連動対象とする戦略は、以下の内容を基本とします。

*大和アセットマネジメント株式会社は、戦略値算出にあたり、情報の提供を行ないます。

- ①メгатレンドの進行による影響を受けやすい複数のテーマを選択します。
- ②各テーマにおいて、日本を含む世界の株式の中から、市場の拡大が見込まれる産業を買い、市場の縮小が見込まれる産業を売ることによって、ロング・ショート戦略を構築します。
※株式の代わりにETF(上場投資信託証券)および先物取引等を用いることがあります。
- ③テーマや株式の入替えおよび比率調整を適宜実施します。

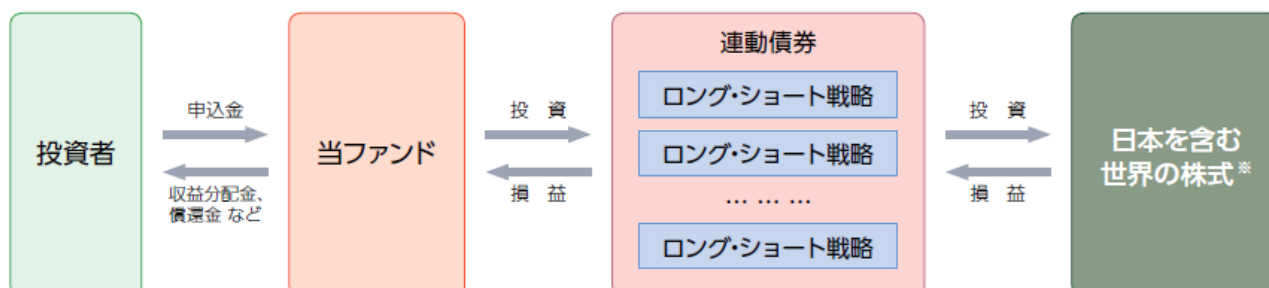
[戦略構築のイメージ図]



ファンドの仕組み

- 連動債券への投資を通じて、日本を含む世界の株式の中から構築した複数のロング・ショート戦略から得られる投資効果を楽しめます。

※連動債券について、くわしくは、「投資対象連動債券の概要」をご参照下さい。



※世界の株式への投資においては、買いおよび売りの両方を行ないます。

※株式の代わりにETF(上場投資信託証券)および先物取引等を用いることがあります。

- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。
- 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。

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.の運用が行なわれないことがあります。

② 毎年11月5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11月5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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

3. 追加的記載事項

[投資対象連動債券の概要]

発行体／表示通貨	ボルト・インベストメンツ・ピーエルシー／円建て
連動対象	Mega Trend Long Short Strategy
特色	① 原則として、Mega Trend Long Short Strategyの値動きに100%程度連動します。 ※Mega Trend Long Short Strategyは、日本を含む世界の株式の中からメガトレンド（世界の長期的な構造変化）に基づいた複数のロング・ショート戦略を組み合わせた戦略です。 ② クレディ・スイス・インターナショナルを相手方とした担保付スワップ取引を通じて、Mega Trend Long Short Strategyに連動する投資成果を享受します。
報酬等	債券の評価額に対して年率0.19%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	信用格付けは取得しておりません。

※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、投資対象連動債券が変更となる場合等があります。

「ボルト・インベストメンツ・ピーエルシー」について

※ボルト・インベストメンツ・ピーエルシーは、分別保管される資産を裏付けとして債券を発行することを主な業務とする、アイルランド籍の特別目的会社です。裏付資産は保管会社によって分別管理されています。

[Mega Trend Long Short Strategyについて]

戦略値算出者	クレディ・スイス(香港)リミテッド
戦略構成情報提供者	大和アセットマネジメント株式会社
算出方法	大和アセットマネジメント株式会社がクレディ・スイス(香港)リミテッドへ情報提供し、クレディ・スイス(香港)リミテッドがStrategy Rulesに従って算出します。

※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があります。

4. 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	
株 価 の 変 動 (価格変動リスク・ 信用リスク)	<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。組入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。</p> <p>株式を売建てしている場合、当該銘柄の株価が上昇した場合には、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>新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、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考えられます。</p>
連 動 債 券 へ の 投資に伴うリスク	<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	<p>ロング・ショート戦略での運用においては、実質的な投資対象市場の価格が上昇した場合でも、収益が得られない場合や損失が発生する場合があります。</p> <p>また、市場環境によっては、ロング・ショート戦略での運用が効果的に機能しない可能性があります。基準価額が予想外に下落する場合があります。</p> <p>ロング・ショート戦略では、投資対象市場の動向による影響を受けにくい運用をめざしますが、その影響を全て排除できるわけではありません。</p> <p>投資対象市場やロング・ショート戦略により保有する株式などの値動きの見通しが予測と異なった場合は、基準価額の下落要因になります。</p>
為 替 変 動 リ ス ク	<p>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。</p> <p>特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。</p>

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。

5. 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) <u>3.3%(税抜3.0%)</u>	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)	<u>年率1.3475%</u> (<u>税抜1.225%</u>)	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、 毎計算期間の最初の6か月終了日(休業日の場合翌営業日)および 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0.60%
	販売会社	年率0.60%
	受託会社	年率0.025%
投資対象とする 連動債券	年率0.19%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	<u>年率1.5375%(税込)程度</u> (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・スワップ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。

6. ご参考

◆ 販売会社：SBI証券

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々営業日の基準価額(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々営業日の基準価額(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7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 東京証券取引所、ニューヨーク証券取引所、ナスダック(米国)、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト・パリ、香港証券取引所、深セン・香港ストック・コネクト(Northbound)または韓国証券取引所の休業日(土曜日および日曜日を除きます。)の前営業日 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11月6日から2022年1月28日まで ただし、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。

その他	信託期間	2025年11月5日まで(2020年11月6日設定) 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、信託を終了(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	毎年11月5日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は2021年11月5日(休業日の場合翌営業日)までとします。
	収益分配	年1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	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〔 https://www.daiwa-am.co.jp/ 〕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

7. 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