

2020年11月30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

トレンド・キャッチ戦略ファンド (愛称:クラッシュハンター)

追加型投信/海外/株式



当社は、2020年12月14日に「トレンド・キャッチ戦略ファンド（愛称：クラッシュハンター）」の設定と運用開始を予定しておりますので、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。

1. ファンドの目的

米国の株価指数先物取引の売買により信託財産の成長をめざします。

2. ファンドの特色

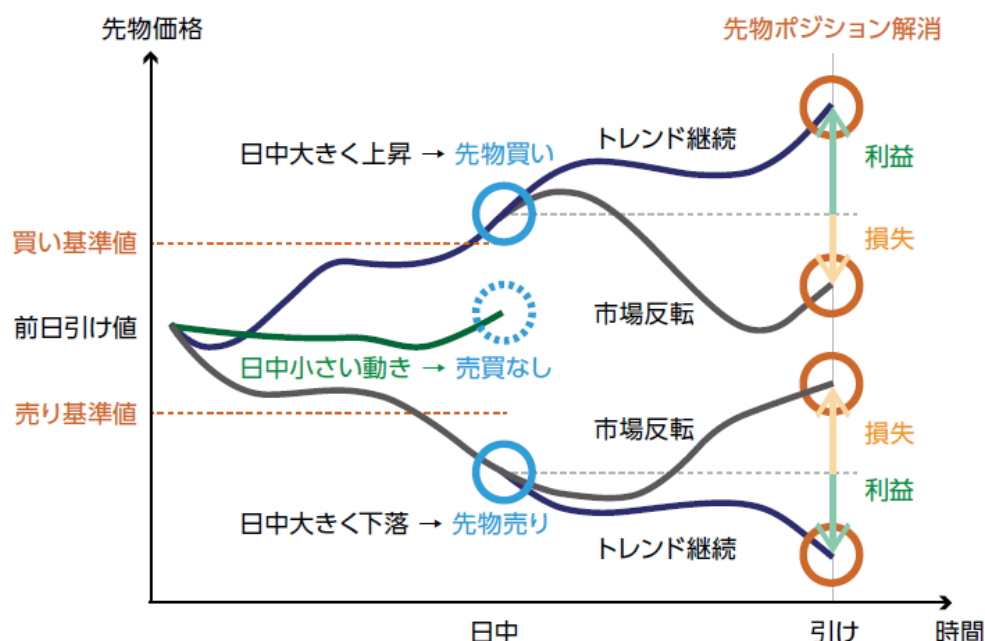
1

円建て短期公社債等へ投資を行なうとともに、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざします。

トレンド・キャッチ戦略とは

- 米国株式市場の取引時間内におけるS&P500株価指数先物価格のトレンドを捉えることをめざします。
- S&P500株価指数先物価格が日中に前日比で一定率以上上昇した場合には株価指数先物取引を買建て、一定率以上下落した場合には株価指数先物取引を売建てます。
- 株価指数先物取引はすべて当該取引日の取引終了までに反対売買を行なって損益を確定します。
- 株価指数先物取引の買建または売建のポジション総額は、見込み純資産総額の3倍程度を上限とします。

米国株式先物市場の日中の動きと損益イメージ図



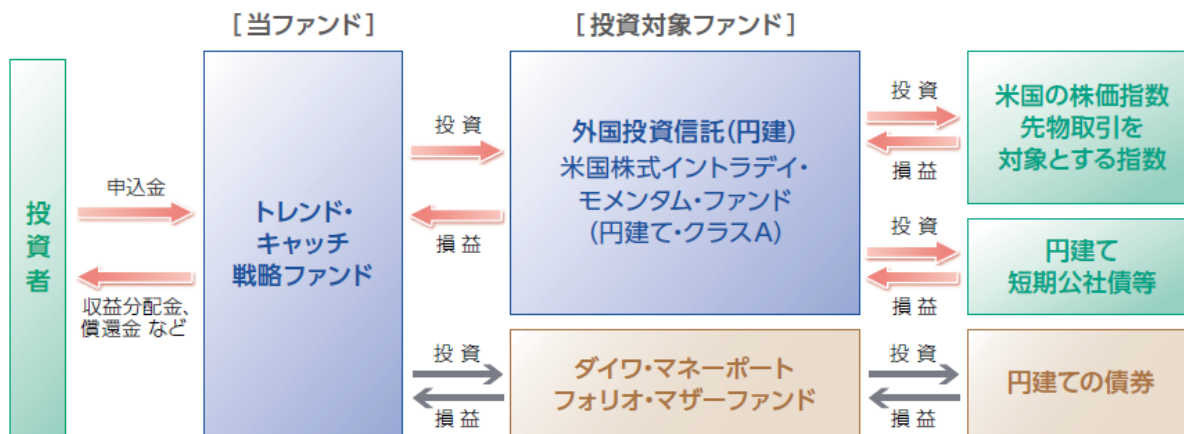
※上記のイメージ図は、先物価格変動の推移の例です。したがって実際の価格および基準価額の推移を示唆しているわけではありません。また、本戦略のすべてを説明するものではありません。

※当ファンドの将来の運用成果を保証または示唆するものではありません。

※当ファンドは、「米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド(円建て・クラスA)」への投資を通じて、トレンド・キャッチ戦略の実現をめざします。

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の2本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、円建て短期公社債等へ投資を行なうとともに、実質的に米国の株価指数先物取引を行ないます。
- 当ファンドが投資対象とする外国投資信託では、スワップ取引を通じて損益を享受します。



〔当ファンドが投資対象とする外国投資信託は、スワップ取引を通じて損益を享受します。〕

※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。

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時、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6月13日および12月13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6月13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、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。

3. 追加的記載事項

[投資対象ファンドの概要]

1. 「米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド(円建て・クラスA)」

形態／表示通貨	ケイマン籍の外国投資信託／円建て
運用の基本方針	スワップ取引を通じて「米国株式イントラデイ・モメンタム・レバレッジド指数(円建て、エクセスリターン)」の値動きを享受することを目的として運用を行ないます。
投資態度／特色	短期日本国債に投資するとともに「米国株式イントラデイ・モメンタム・レバレッジド指数(円建て、エクセスリターン)」(参照指数)に連動するスワップ取引を通じて、実質的にS&P500株価指数先物に投資を行ないます。 ※参照指数は、米国株式市場の取引時間内におけるS&P500株価指数先物価格のトレンドを捉えることをめざします。S&P500株価指数先物価格が日中に前日比で一定率以上上昇した場合には株価指数先物取引を買建て、一定率以上下落した場合には株価指数先物取引を売建てます。株価指数先物取引はすべて当該取引日の取引終了までに反対売買を行なって損益を確定します。株価指数先物取引の買建または売建のポジション総額は、見込み純資産総額の3倍程度を上限とします。 スワップ取引の相手方はシティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッド、またはその関連会社です。スワップ取引においては評価損益に対して担保の受払いが行なわれず。
管理報酬等	純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額 受託会社報酬：年率0.01% 運用保管報酬：年率0.19% その他費用：投資信託財産に関する租税、組み入れ有価証券の売買手数料、借入金の利息、ファンドの登録に係る費用、弁護士費用、取引費用等がかかります。
管理会社	シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッド

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、変更となる場合があります。

シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドについて

- ・シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドは、シティグループ・インク傘下の投資運用会社です。
- ・シティグループ・インクは、個人、法人、政府および団体を対象として、個人向け銀行業務やカードビジネス、法人投資銀行業務、証券業務、トランザクション・サービス、ウェルス・マネジメントの分野において、幅広い金融商品およびサービスを提供する、グローバルな総合金融持株会社です。

シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドおよびシティグループ・インクは、世界中で使用・登録されているシティグループ・インクまたはその関連会社の登録商標またはサービスマークであり、大和アセットマネジメント株式会社が利用許諾に基づき使用しています。






米国株式イントラデイ・モメンタム・レバレッジド指数(円建て、エクセスリターン) (以下、本インデックス)は、本インデックスの管理者および計算代理人としてのシティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッドにより提供されます。シティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッドおよびその関連会社(以下総称して「シティグループ」といいます)は、a)トレンド・キャッチ戦略ファンド(以下、本ファンド)に対して投資することへの当否、b)本ファンドの運用成果、c)本インデックスの水準、d)本ファンドまたは本インデックスの商品性または特定の目的への適合性、e)その他の事項に関して、何らかの明示的または黙示的な表明または保証を行っていません。シティグループは、本ファンドに対する支援、承認、運用、販売または促進を行ってならず、また本ファンドへの一切の責任を負っていません。本インデックスはシティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッドの専有情報であり、機密情報です。シティグループは、その業務の通常のプロセスにおいて、本インデックスの構成銘柄に関連した取引を行い、または関連を有する場合があります。これらの活動は本インデックスの水準に影響を与える可能性があります。シティグループは発生することがある利益相反を管理するための統制および緩和策を導入していますが、ある者が複数の資格において行為する場合には利益相反が生じる可能性があること、およびかかる利益相反が本インデックスの水準に(プラスまたはマイナスの)影響を与えることがあります。シティグループは、たとえ損害の可能性が通知されたとしても、いずれの者に対して(直接的、間接的、特別の、懲罰的、派生的、その他の)責任を何ら負わないものとします。シティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッドは、(a)本インデックスの計算、公表または通知を継続する義務を負うものではなく、(b)シティグループ・グローバル・マーケッツ・リミテッドに詐欺、過失、故意の不履行、義務(制定法上の義務を含みます。)の違反または悪意がない場合において、本インデックスに関する誤り、脱落、中断または遅延に関して責任を負わず、(c)また、他の者の代理人または受託者としてではなく、本人として行動するものとします。シティは、世界中で使用・登録されているシティグループ・インクまたはその関連会社の登録商標およびサービスマークです。


2. ダイワ・マネーポートフォリオ・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

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	
 <p>株価指数先物取引の利用に伴うリスク</p>	<p>株価指数先物の価格は、対象指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合の先物価格の下落、または先物を売建てている場合の先物価格の上昇により損失が発生し、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。また、先物を買建てている場合の株式市場の下落、または先物を売建てている場合の株式市場の上昇によって、株式市場の変動率に比べて大きな損失が生じる可能性があります。</p> <p>なお、対象指数の値動き等に変動がなくても、収益または損失が発生することがあります。</p>
 <p>公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）</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。組入公社債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>為替変動リスク</p>	<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>なお、当ファンドの実質組入外貨建資産は、スワップ取引を通じて享受する損益部分等に限定されます。</p>
 <p>カントリー・リスク</p>	<p>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。</p>
 <p>スワップ取引の利用に伴うリスク</p>	<ul style="list-style-type: none"> ・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、当ファンドの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場合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等の資産について何ら権利を有しません。

 <p>当ファンドが 実質的に活用する 戦略に関するリスク</p>	<p>市場の予期せぬ値動き等により、当戦略が効果的に機能しない可能性があり、基準価額が予想外に下落する場合があります。</p> <p>当ファンドは、先物取引等を利用して純資産規模を上回る投資を行なうことから、価額変動リスクが現物有価証券に投資する場合と比べて大きくなる可能性があります。</p>
<p>そ の 他</p>	<p>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。</p>

※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1.2375%</u> <u>(税抜1.125%)</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0.35%
	販売会社	年率0.75%
	受託会社	年率0.025%
投資対象とする 投資信託証券	年率0.2%程度	投資対象ファンドにおける運用管理費用等です。
実質的に負担する 運用管理費用	<u>年率1.4375% (税込)程度</u>	
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。


※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：大和証券

 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6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、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、ルクセンブルクの銀行の休業日 ② ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、ルクセンブルクの銀行の休業日(土曜日および日曜日を除きます。)の前営業日 ③ ①②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12月14日から2022年3月4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ることがあります。

 その他	信託期間	2025年12月12日まで(2020年12月14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	◎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。 <ul style="list-style-type: none"> ・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6月13日および12月13日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、2021年6月13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、販売会社にお問い合わせ下さい。
	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、販売会社にお問い合わせ下さい。 ※2020年9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：三菱UFJ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