

マンAHLスマート・レバレッジ戦略ファンド（愛称：スマレバ）

Morningstar Award “Fund of the Year 2020” 優秀賞受賞のお知らせ

※当資料は、マンAHL社が提供するコメントを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。

2021年2月2日

平素は、マンAHLスマート・レバレッジ戦略ファンド（愛称：スマレバ）をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、皆様のお力添えのもと、良好なパフォーマンスが評価され、Morningstar Award “Fund of the Year 2020”にて、優秀賞を受賞することができました。今回の受賞にあたり、当ファンドの委託先であるマンAHL社のファンドマネージャーからのメッセージをお伝えさせていただきます。



安定資産（債券・バランス安定）型 部門
対象ファンド1,662本の中から
選ばれました。

【Morningstar Award “Fund of the Year 2020”について】

投資信託の評価機関であるモーニングスターが、国内の追加型株式投資信託を対象に、リスクやリターンといった定量面での評価を満たし、運用スタイルや調査体制等の定性面から、優れた運用実績とマネジメントを持つファンドを選考したアワード（賞）です。

“Fund of the Year 2020（ファンド オブ ザ イヤー 2020）”は2020年の運用成績が総合的に優秀であると判断された投資信託を対象として表彰しています。

留意事項は6ページをご参照ください。

マンAHL社のファンドマネージャーからのメッセージ

平素より当ファンドをご愛顧いただき、誠にありがとうございます。

この度は、マンAHLが運用する戦略を組み入れた当ファンドが、優秀ファンド賞の受賞に至ったことを大変光栄に思います。

2020年は、年初には世界的な株価大幅下落、いわゆる「コロナ・ショック」が発生する一方で、年後半にかけて株式市場は大きな上昇を見せるなど、リスクの高い相場環境となりました。こうした変化の激しい市場環境において、当ファンドは、徹底したリスク・コントロールを一貫して継続することで、安定的かつ良好なパフォーマンスを維持することができました。

新型コロナウイルス問題を背景に、グローバルな経済環境は引き続きより不透明感を増している状況にあります。このような不安定な環境下において、本戦略のように、グローバルな市場の変化を24時間休まずに監視していくことは、より重要になっていきます。マンAHLが誇る最先端のシステムをフル活用することで、引き続き、下振れを抑制しながら長期分散投資に資する運用を、日本の投資家の皆さまにお届けしていくことを約束致します。

スマレバをいつもご愛顧下さりありがとうございます。

受益者の皆様へ当ファンドの良さがより伝わるよう、
特設サイトや動画、運用状況を記載したレターを弊社ホームページに掲載しています。

引き続き、スマレバを宜しくお願い致します。



= 過去のファンドレターなどをご覧ください =

■ ファンドレター

2021年1月15日発行 2020年の運用状況について

https://www.daiwa-am.co.jp/fundletter/20210115_01.pdf

2020年11月12日発行 2020年の運用状況について

https://www.daiwa-am.co.jp/fundletter/20201112_01.pdf

2020年10月23日発行 2020年の運用状況について

https://www.daiwa-am.co.jp/fundletter/20201023_01.pdf

2020年10月9日発行 2020年の運用状況について

https://www.daiwa-am.co.jp/fundletter/20201009_04.pdf

■ 動画

<https://www.youtube.com/embed/xcYyX41ebX8?rel=0>

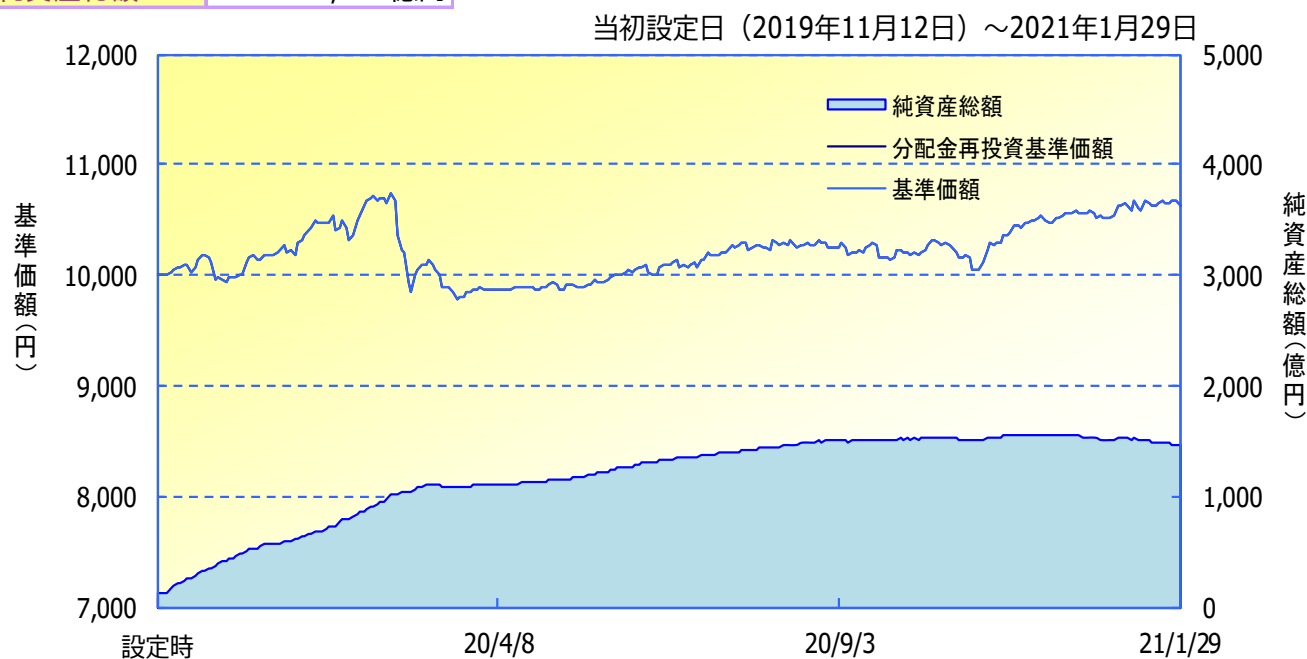
モーニングスター社
ファンドオブザイヤー2020
特設サイトはこちら



基準価額・純資産の推移(2021年1月29日現在)

マンAHLスマート・レバレッジ戦略ファンド（愛称：スマレバ）

基準価額	10,636 円
純資産総額	1,458億円



※「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（後述のファンドの費用をご覧ください）。
 ※実際のファンドでは、課税条件によって投資者ごとの騰落率は異なります。また、換金時の費用・税金等は考慮していません。
 ※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。

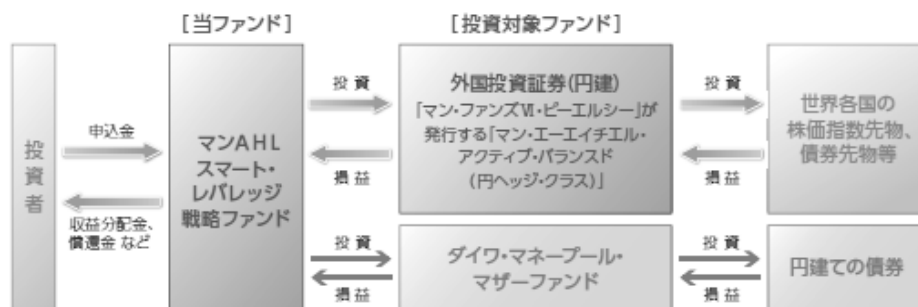
Ⅰ ファンドの目的・特色

ファンドの目的

- 世界各国の株価指数先物、債券先物等に投資を行ない、信託財産の成長をめざします。

ファンドの特色

1. 世界各国の株価指数先物、債券先物等に投資を行ない、独自の数量モデルを活用してポジションを構築します。
 - ◆目標ボラティリティ水準を維持することにより、あらゆる市場環境において超過収益の獲得をめざします。なお、目標ボラティリティは10%とします。
 - ◆デリバティブ取引において、レバレッジを活用します。
2. 運用は、AHL パートナース・エルエルピーが行ないます。
3. 為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。
 - ◆ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
 - ◆為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨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。
4. 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。
 - ◆外国投資証券を通じて、世界各国の株価指数先物、債券先物等に投資します。



※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。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「ファンドの目的・特色」をご覧ください。

Ⅰ 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。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

「価格変動リスク・信用リスク（株価の変動、公社債の価格変動）」、「株価指数先物取引・債券先物取引の利用に伴うリスク」、「当ファンドが活用する戦略に関するリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「その他（解約申込みに伴うリスク等）」

※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。

※当ファンドでは、デリバティブ取引を利用して純資産規模を上回る買建てを行なうことから、価格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。また、レバレッジを活用して取引を行ないますので、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。

※当ファンドは、為替ヘッジを行ないますが、影響をすべて排除できるわけではありません。また、為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨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。

※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。

※くわしくは「投資信託説明書（交付目論見書）」の「投資リスク」をご覧ください。

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) 3.3% (税抜 3.0%)	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)	年率 1.2375% (税抜 1.125%) 以内*	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。
	*ファンド設定日から起算して 66 営業日目の翌日以降において、前営業日における過去 65 営業日間の分配金再投資基準価額※の騰落率が 2%未満である場合には、以下となります。	
	運用管理費用	年率 0.6875% (税抜 0.625%)
投資対象とする 投資信託証券	年率 1.09%以内 (2021 年 1 月 5 日現在 : 0.95%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	年率 1.6375%~2.1875% (税込) 程度 ※2021 年 1 月 5 日現在。今後この数値は見直される場合があります。	
その他の費用・ 手数料	(注)	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)「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ください。

※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。

※くわしくは「投資信託説明書(交付目論見書)」の「手続・手数料等」をご覧ください。

設定・運用：

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

商号等

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

【Morningstar Award “Fund of the Year 2020”について】

投資信託の評価機関であるモーニングスターが、国内の追加型株式投資信託を対象に、リスクやリターンといった定量面での評価を満たし、運用スタイルや調査体制等の定性面から、優れた運用実績とマネジメントを持つファンドを選考したアワード（賞）です。

“Fund of the Year 2020（ファンド オブ ザ イヤー 2020）”は2020年の運用成績が総合的に優秀であると判断された投資信託を対象として表彰しています。

【Morningstar Award “Fund of the Year 2020”に関する留意事項】

Morningstar Award “Fund of the Year 2020”は過去の情報に基づくものであり、将来のパフォーマンスを保証するものではありません。また、モーニングスター株式会社が信頼できると判断したデータにより評価しましたが、その正確性、完全性等について保証するものではありません。著作権等の知的所有権その他一切の権利はモーニングスター株式会社並びに Morningstar, Inc. に帰属し、許可なく複製、転載、引用することを禁じます。

当賞は国内追加型株式投資信託を選考対象として独自の定量分析、定性分析に基づき、2020年において各部門別に総合的に優秀であるとモーニングスターが判断したものです。安定資産（債券・バランス安定）型は、2020年12月末において当該部門に属するファンド1,662本の中から選考されました。

当資料のお取り扱いにおけるご注意

- 当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和アセットマネジメント株式会社が作成したものです。
- 当ファンドのお申込みにあたっては、販売会社よりお渡しする「投資信託説明書（交付目論見書）」の内容を必ずご確認ください。ご自身でご判断ください。
- 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、投資元本が保証されているものではありません。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。
- 投資信託は預金や保険契約とは異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は投資者保護基金の対象ではありません。
- 当資料は信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。記載する指数・統計資料等の知的所有権、その他一切の権利はその発行者および許諾者に帰属します。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者の皆さまの実質的な投資成果を示すものではありません。記載内容は資料作成時点のものであり、予告なく変更されることがあります。記載する投資判断は現時点のものであり、将来の市況環境の変動等を保証するものではありません。
- 当資料中で個別企業名が記載されている場合、あくまでも参考のために掲載したものであり、各企業の推奨を目的とするものではありません。また、ファンドに今後組み入れることを、示唆・保証するものではありません。
- 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。

マンAHLスマート・レバレッジ戦略ファンド（愛称：スマレバ） 取扱い販売会社

販売会社名（業態別、50音順） （金融商品取引業者名）		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会
株式会社愛媛銀行	登録金融機関	四国財務局長(登金)第6号	○			
株式会社香川銀行	登録金融機関	四国財務局長(登金)第7号	○			
株式会社関西みらい銀行	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第7号	○	○		
株式会社佐賀銀行	登録金融機関	福岡財務支局長(登金)第1号	○	○		
株式会社新生銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第10号	○	○		
株式会社大東銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第17号	○			
株式会社中京銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第17号	○			
株式会社筑波銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第44号	○			
株式会社富山銀行	登録金融機関	北陸財務局長(登金)第1号	○			
三井住友信託銀行株式会社	登録金融機関	関東財務局長(登金)第649号	○	○	○	
株式会社みなと銀行	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第22号	○	○		
株式会社横浜銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第36号	○	○		
OKB証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第191号	○			
大和証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第108号	○	○	○	○
ちばぎん証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第114号	○			
リテラ・クレア証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第199号	○			

上記の販売会社については今後変更となる場合があります。また、新規のご購入の取り扱いを行っていない場合がありますので、各販売会社にご確認ください。