

世界株式トレンドフォロー戦略ファンド (ロングコース/ロング・ショートコース)

最新の組入状況について (2021年4月)

2021年4月13日

平素は、「世界株式トレンドフォロー戦略ファンド (ロングコース/ロング・ショートコース)」をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

当ファンドの4月9日時点の組入状況についてお知らせいたします。

■ ロングコース

組入先物(買建て)		合計99.9%
対象とする国・地域名	銘柄名	比率
南アフリカ	FTSE/JSEアフリカトップ40指数先物	33.7%
新興国	MSCIエマージング・マーケット指数先物	33.2%
米国	ラッセル2000ミニ先物	33.0%

■ ロング・ショートコース

組入先物(買建て)		合計51.1%
対象とする国・地域名	銘柄名	比率
南アフリカ	FTSE/JSEアフリカトップ40指数先物	17.2%
新興国	MSCIエマージング・マーケット指数先物	17.0%
米国	ラッセル2000ミニ先物	16.9%

組入先物(売建て)		合計-51.6%
対象とする国・地域名	銘柄名	比率
スイス	スイス株価指数先物	-17.4%
英国	FTSE100指数先物	-17.2%
台湾	FTSE台湾指数先物	-17.0%

※比率は、純資産総額に対するものです。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

ロングコース

- AI（人工知能）を取り入れた計量モデルを活用することで、世界の株価指数先物のトレンドを捉えて取引対象を選定し、買建てを行なうことで信託財産の成長をめざします。

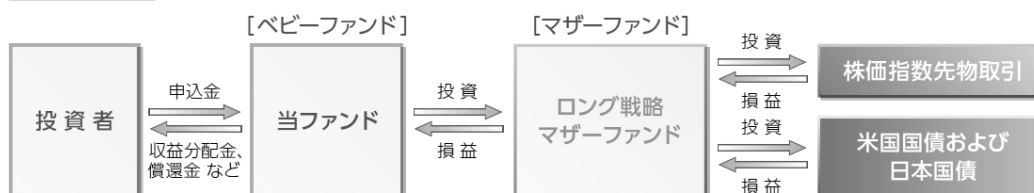
ロング・ショートコース

- AIを取り入れた計量モデルを活用することで、世界の株価指数先物のトレンドを捉えて取引対象を選定し、買建ておよび売建てを行なうことで、安定した収益の確保をめざします。

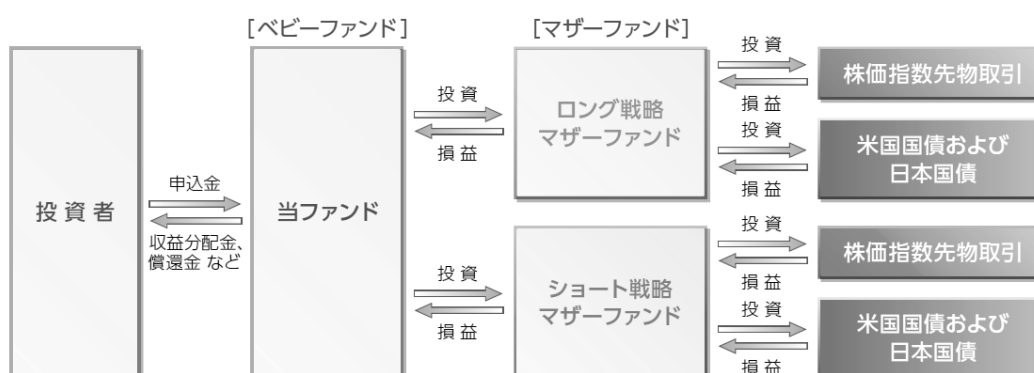
ファンドの特色

1. 世界の主要な株価指数先物取引を活用するとともに、米国国債および日本国債に投資します。
2. 世界の株価指数先物のトレンドを捉えるため、AIを取り入れた大和アセットマネジメント独自の計量モデルを活用します。
3. 投資手法の異なる2つのコースがあります。
 - ロングコース
 - 世界の株価指数先物の中から、上昇トレンドが相対的に強いと想定される上位3つ程度を選定して買建てます。
 - ロング・ショートコース
 - 世界の株価指数先物の中から、上昇トレンドが相対的に強いと想定される上位3つ程度を選定して買建てるとともに、上昇トレンドが相対的に弱いと想定される下位3つ程度を選定して売建てます。
 - 買建てと売建ての比率は、おおむね5：5を基本とします。
4. 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。
5. 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ロングコース



ロング・ショートコース



※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。

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。

「株価指数先物取引の利用に伴うリスク」、「公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）」、「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）」

※為替変動リスクの低減を図ります。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。

※新興国には先進国とは異なる新興国市場のリスクなどがあります。

※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。

※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〉2.2%（税抜 2.0%）	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 1.353% （税抜 1.23%）	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。
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。

お申込み



〔登録金融機関（販売取扱会社）〕
株式会社ゆうちょ銀行
関東財務局長（登金）第611号
〔加入協会〕日本証券業協会



〔金融商品仲介業者〕
日本郵便株式会社
関東財務局長（金仲）第325号

設定・運用



〔金融商品取引業者（委託会社）〕
大和アセットマネジメント株式会社
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

投資信託に関する留意事項

- 投資信託は預金・貯金ではありません。
- 日本郵便株式会社は、株式会社ゆうちょ銀行から委託を受けて、投資信託の申し込みの媒介（金融商品仲介行為）を行います。日本郵便株式会社は金融商品仲介行為に関して、株式会社ゆうちょ銀行の代理権を有していないとともに、お客さまから金銭もしくは有価証券をお預かりしません。
- 当資料は金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。投資信託取得の申し込みにあたっては、投資信託説明書（交付目論見書）をお渡ししますので必ず内容をご確認のうえご自身でご判断ください。
- 投資信託説明書（交付目論見書）はゆうちょ銀行各店または投資信託取扱郵便局の投資信託窓口にて用意しております。ただし、インターネット専用ファンドの投資信託説明書（交付目論見書）はインターネットによる電子交付となります。

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。
- 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おりませんので、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。