

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

運用状況について

2018年5月7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・ショートコース)(愛称:トレフォロLS)」をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

■ファンドの特徴

当ファンドは、世界の株価指数の中から、上昇トレンドの強弱を、AI(人工知能)を取り入れた大和投資信託独自の計量モデルを活用して判断、投資することで、安定した収益を確保することを目指すファンドです。

実際の投資にあたっては、世界の主要な株価指数先物取引を活用し、上昇トレンドが相対的に強いと想定される上位3つ程度を買建てるとともに、相対的に弱いと想定される下位3つ程度を売建てます。

買建てと売建ての比率はおおむね5:5を基本とします。また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。

当ファンドが取引対象とする株価指数先物

欧州地域	アジア・オセアニア地域	北米地域
- FTSE100指数先物 英国 - DAX指数先物 ドイツ - CAC40指数先物 フランス - FTSE MIB指数先物 イタリア - IBEX35指数先物 スペイン - AEX指数先物 オランダ - ユーロ・ストックス50先物 欧州	- 日経225先物 日本 - ハンセン中国企業株指数先物 中国 - ハンセン指数先物 香港 - MSCI台湾指数先物 台湾 - MSCIシンガポール指数先物 シンガポール - ASX SPI200指数先物 豪州	- EミニS&P500先物 米国 - Eミニナスダック100先物 米国 - ラッセル2000ミニ先物 米国 - S&P/TSX60指数先物 カナダ

※当ファンドでは、世界の株価指数先物の中から、流動性等をもとに選んだ上記の株価指数先物を取引対象としています。(2018年3月現在)

※将来、流動性等によっては取引対象とする株価指数先物に変更となる可能性があります。

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投資信託により作成されたものです。■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のうえ、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、投資者のみなさまの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いますが、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。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。■当資料の中で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。■当資料の中で個別企業名が記載されている場合、それらは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。

販売会社等についてのお問い合わせ⇒ 大和投資信託 フリーダイヤル0120-106338(営業日の9:00~17:00) HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>

大和投資信託

Daiwa Asset Management

■ 4月末時点での組入状況と今後の運用方針

組入先物(買建て)		合計48.6%
対象とする国・地域名	銘柄名	比率
中国	ハンセン中国企業株指数先物	16.7%
台湾	MSCI台湾指数先物	16.2%
カナダ	S&P/TSX60指数先物	15.7%
組入先物(売建て)		合計-49.1%
対象とする国・地域名	銘柄名	比率
ドイツ	DAX指数先物	-17.3%
イタリア	FTSE MIB 指数先物	-16.4%
日本	日経225先物	-15.4%

※比率は、純資産総額に対するものです。

今後、組入れる株価指数先物は、1か月ごとに見直しを行ってまいります。

<ご参考>取引対象となる先物の対象指数の説明	
指数名	指数説明
日経平均株価	東京証券取引所第1部上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄で構成される株価平均指数。
ハンセン中国企業株指数	香港証券取引所上場の中国本土企業株(H株)で構成される浮動株調整後時価総額指数。
香港ハンセン指数	香港取引所上場の浮動株に基づく時価総額加重平均指数。
MSCI台湾指数	浮動株調整時価総額加重株指数。台湾市場の大型および中型のセグメントの業績を反映するように設計されている。
MSCIシンガポール指数	浮動株調整時価総額加重株指数。シンガポール市場の大型および中型のセグメントの業績を反映するように設計されている。
ASX SPI200指数	オーストラリア証券取引所上場の浮動株調整時価総額上位200銘柄からなる指数。オーストラリア株式の流動性、市場パフォーマンスを表す指標株価指数と見なされている。
FTSE100指数	ロンドン証券取引所上場の時価総額上位100銘柄で構成される時価総額加重平均指数。
ドイツDAX指数	フランクフルト証券取引所上場のドイツ企業のうち優良30銘柄を対象としたトータルリターン指数。指数値計算には浮動株を使用。
CAC40指数	フランスの指標株価指数。パリ証券取引所上場の企業株のうち、浮動株調整時価総額と流動性の上位40銘柄からなる。
FTSE MIB指数	イタリア取引所上場の流動性および時価総額が最も高い40銘柄で構成される。当指数の組み入れ銘柄を選定する場合、外国企業株も対象とされる。
IBEX35指数	スペイン連続時間市場の指標株価指数。最も流動性の高い35銘柄で構成される。証券取引所協会が指数値を算定、管理、公表する。指数値算出には浮動株を用いる。
AEX指数	アムステルダム証券取引所上場のオランダ指標銘柄で構成される単純加重平均指数。
ユーロ・ストックス50インデックス	ユーロ圏のスーパーセクターの上位優良銘柄で構成される代表的な指数。ユーロ圏の12カ国から50銘柄をカバー。資格をもつ金融機関が上場投資信託(ETF)、先物・オプション、仕組商品など幅広い投資商品の原証券として使用する。
S&P500種指数	時価総額加重平均指数。全主要業種を代表する500銘柄で構成され、米国経済のパフォーマンスを表す。
ナスダック100指数	調整時価総額加重平均指数。ナスダック上場の米国内および外国で発行された金融以外のセクターで時価総額と流動性が最も高い100銘柄で構成される。
ラッセル2000種指数	米国企業株のうち時価総額上位3000銘柄からなるラッセル3000種指数の時価総額1001-3000位の2000銘柄からなる。
S&P/TSX 60指数	時価総額加重平均指数。トロント証券取引所で取引される時価総額および流動性の上位60銘柄からなる。構成銘柄は、主にカナダ国内または多国籍の大手企業。

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

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

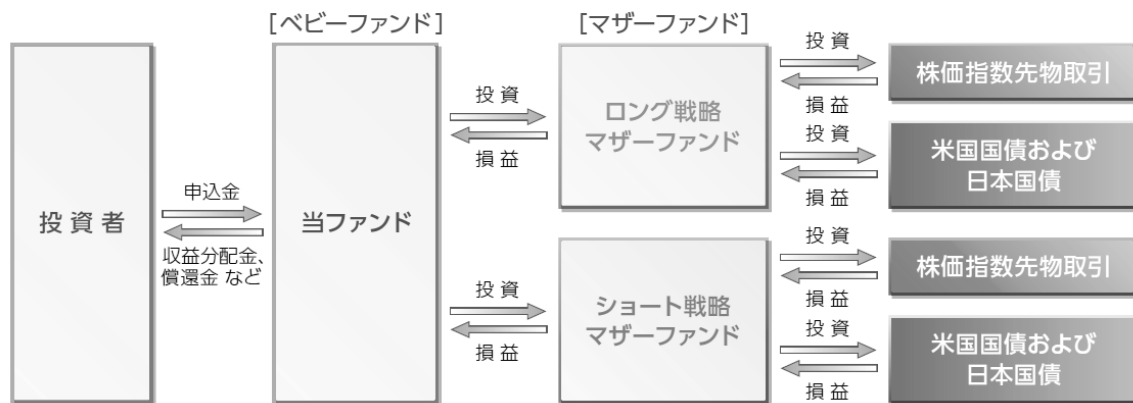
ファンドの目的・特色

ファンドの目的

- 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を取り入れた大和投資信託独自の計量モデルを活用します。
3. 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せん。
 - 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せん。



※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。

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

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」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>2.16%(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 1.3284% (税抜 1.23%)	運用管理費用の総額は、毎日、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。

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。

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)〕
大和証券投資信託委託株式会社
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