

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)

(ロングコース)追加型投信/内外/株式
(ロング・ショートコース)追加型投信/内外/株式/特殊型(ロング・ショート型) 基準日 : 2024年8月30日

「ロングコース」の運用状況

信託期間 : 2018年4月24日 から 2024年9月26日 まで
決算日 : 毎年4月15日 (休業日の場合翌営業日)

回次コード : 3352

※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。

《基準価額・純資産の推移》

2024年8月30日現在

基準価額	11,288 円
純資産総額	305百万円

期間別騰落率

期間	ファンド	参考指数
1か月間	+0.6 %	+2.9 %
3か月間	+0.5 %	+4.8 %
6か月間	+7.8 %	+7.1 %
1年間	+5.8 %	+15.4 %
3年間	-5.3 %	+5.0 %
5年間	+26.1 %	+54.6 %
年初来	+3.4 %	+10.5 %
設定来	+12.9 %	+52.4 %



※「参考指数」はMSCIオール・カンTRY・ワールド・インデックス(税引後配当込み・円ヘッジ)です。

※「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、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)。

※「期間別騰落率」の各計算期間は、基準日から過去に遡った期間とし、当該ファンドの「分配金再投資基準価額」を用いた騰落率を表しています。

※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。

※「参考指数」は当ファンドのベンチマークではありませんが、参考のため掲載しています。

※MSCIインデックスはMSCI Inc.が開発した指数です。MSCI公表データに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

《分配の推移》

(1万口当たり、税引前)

決算期(年/月)	分配金
第1期 (19/04)	0円
第2期 (20/04)	0円
第3期 (21/04)	0円
第4期 (22/04)	0円
第5期 (23/04)	0円
第6期 (24/04)	0円

分配金合計額 設定来 : 0円

※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。

《主要な資産の状況》

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成(先物除く)

資産	銘柄数	比率
コール・ローン、その他		100.0%
合計	0	100.0%

- ◆ 各ファンドの略称としてそれぞれ次を用いることがあります。
世界株式トレンドフォロー戦略ファンド(ロングコース) : ロングコース
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) : ロング・ショートコース
- ◆ 各ファンドの総称を「世界株式トレンドフォロー戦略ファンド」とします。

■ 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により作成されたものです。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。当ファンドの取得をご希望の場合には投資信託説明書(交付目論見書)を販売会社よりお渡しいたしますので、必ず内容をご確認の上ご自身でご判断ください。後述の当資料のお取り扱いにおけるご注意をよくお読みください。

「ロング・ショートコース」の運用状況

信託期間 : 2018年4月24日 から 2024年9月26日 まで
 決算日 : 毎年4月15日 (休業日の場合翌営業日)

回次コード : 3353

※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。

「基準価額・純資産の推移」

2024年8月30日現在

基準価額	7,852 円
純資産総額	98百万円

期間	ファンド	騰落率
1カ月間		-0.5 %
3カ月間		-0.8 %
6カ月間		-1.4 %
1年間		-5.8 %
3年間		-20.6 %
5年間		-18.5 %
年初来		-5.4 %
設定来		-21.5 %

当初設定日 (2018年4月24日) ~ 2024年8月30日



※「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、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)。

※「期間別騰落率」の各計算期間は、基準日から過去に遡った期間とし、当該ファンドの「分配金再投資基準価額」を用いた騰落率を表しています。

※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。

「分配の推移」

(1万口当たり、税引前)

決算期(年/月)	分配金
第1期 (19/04)	0円
第2期 (20/04)	0円
第3期 (21/04)	0円
第4期 (22/04)	0円
第5期 (23/04)	0円
第6期 (24/04)	0円

分配金合計額 設定来: 0円

※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。

「主要な資産の状況」

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成(先物除く)		
資産	銘柄数	比率
コール・ローン、その他		100.0%
合計	0	100.0%

【「ロングコース」・「ロング・ショートコース」の運用状況】

ロングコース・・・当月において、ファンドの基準価額は上昇しました。

ロング・ショートコース・・・当月において、ロング部分（買い建て部分）はプラス（基準価額の上昇）に寄与しましたが、ショート部分（売り建て部分）がマイナス（基準価額の下落）に寄与したため、ファンドの基準価額は下落しました。

月中における両ファンドの組入銘柄は、下表の通りです。

※表中における「寄与」…1ヶ月間の基準価額騰落率に対する、影響の大きさをあらわします。

「+」はプラスに影響したものの、その中でも特にプラスに影響したものを「++」、

「-」はマイナスに影響したものの、その中でも特にマイナスに影響したものを「--」と記載しています。

※特に影響が大きかった「++」と「--」について、コメントを記載しています。

	寄与	(国名)組入銘柄名	コメント
ロングコース	++	-	-
	--	-	-
	寄与	(国名)組入銘柄名	
	+	(日本)日経225先物(CME)/(シンガポール)MSCIシンガポール指数先物/(英国)FTSE100指数先物/(中国)ミニハンセン中国企業株指数先物/(香港)ミニハンセン指数先物	
	-	(フランス)CAC40指数先物/(イタリア)ミニFTSE MIB指数先物/(スペイン)IBEX35ミニ指数先物	

	寄与	(国名)組入銘柄名	コメント
ロング・ショートコース	++	(日本)日経225先物(CME)	米国におけるハイテク株高を受けて上昇
	--	(イタリア)ミニFTSE MIB指数先物	月前半の米国における景気懸念を受けて下落
	寄与	(国名)組入銘柄名	
	+	(フランス)CAC40指数先物/(中国)ミニハンセン中国企業株指数先物/(香港)ミニハンセン指数先物	
	-	(シンガポール)MSCIシンガポール指数先物/(スペイン)IBEX35ミニ指数先物	

	寄与	(国名)組入銘柄名	コメント
ショートコース	++	(豪州)ASX SPI200指数先物	月前半の米国における景気懸念を受けて下落
	--	(台湾)FTSE台湾指数先物	半導体銘柄の好調を背景に上昇
	寄与	(国名)組入銘柄名	
	+	(新興国)MSCIエマージング・マーケット指数先物	
	-	(シンガポール)MSCIシンガポール指数先物/(南アフリカ)FTSE/JSEアフリカトップ40指数先物/(中国)ミニハンセン中国企業株指数先物/(インド)ニフティ50指数先物	

また繰上償還に備えるため、わが国の短期金融資産等を中心とした安定運用に移行いたしました。これまで長きにわたり、当ファンドをご愛顧賜り、誠にありがとうございました。

《ファンドの目的・特色》

ファンドの目的

- ・世界株式トレンドフォロー戦略ファンド（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。
- ・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）
 - ・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

- ・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。
- ・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。
- ・投資手法の異なる2つのコースがあります。
- ・為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。
- ・毎年4月15日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益配分方針に基づいて収益の分配を行いません。

《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	<p>[ロングコース]</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。</p> <p>先物を買建てている場合の先物価格の下落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。</p> <p>[ロング・ショートコース]</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。</p> <p>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。</p>
公社債の価格変動 (価格変動リスク・信用リスク)	<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。</p> <p>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>
当ファンドが活用する戦略に関するリスク	<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>
為替変動リスク	<p>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。</p> <p>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。</p>
カントリー・リスク	<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>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。</p>
その他	<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。

その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

《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>2.2%(税抜2.0%)</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1.353%</u> <u>(税抜1.23%)</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、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。
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0.03%
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。

※運用管理費用の信託財産からの支払いは、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時に行なわれます。

※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。

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 5 営業日目からお支払いします。
申込受付中止日	1. ニューヨークの銀行の休業日 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	(2024 年 11 月 4 日まで) 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） (2024 年 11 月 5 日以降) 原則として、午後 3 時 30 分まで（販売会社所定の事務手続きが完了したもの） なお、販売会社によっては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。
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（投資対象国における非常事態による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）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、すでに受け付けた購入の申込みを取消すことがあります。
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、信託を終了させること（繰上償還）ができます。 ・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
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。 ※販売会社との契約によっては、収益分配金の再投資が可能です。
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、一定の要件を満たした場合に NISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。 当ファンドは、NISA の対象ではありません。 ※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。

- **投資信託は、預金・貯金ではありません。また、投資信託は、元本および利回りの保証がない商品です。**
- 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。
- 投資信託の申し込みにあたっては、リスクや手数料等を含む商品内容が記載された重要情報シートならびに投資信託説明書（交付目論見書）および一体となっている目論見書補完書面の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
- ゆうちょ銀行各店または投資信託取扱局の窓口での申し込みの際には、重要情報シートならびに投資信託説明書（交付目論見書）および一体となっている目論見書補完書面を、書面交付または電子交付しております。インターネットでの申し込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）および一体となっている目論見書補完書面を電子交付しております。
- 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。
- 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

▶ **大和アセットマネジメント** フリーダイヤル 0120-106338（営業日の9:00～17:00）

当社ホームページ

▶ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

※当ファンドはインターネット専用商品です。ゆうちょ銀行・郵便局（投資信託取扱局）の店頭では、販売・購入に係るお取り扱いを行っておりません。