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

信託期間 : 2020年12月14日 から 2025年12月12日 まで 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)

基 準 日 2025年5月30日 回次コード 3800

※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≫

2025年5月30日現在

基準価額 6,330 円 純資産総額 343百万円

期間別騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.8 %
3カ月間	-1.7 %
6カ月間	-8.6 %
1年間	-12.3 %
3年間	-11.5 %
5年間	
年初来	-7.2 %
設定来	-36.7 %



- ※「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)。
- ※「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 (21/06)0円 第2期 (21/12)0円 第3期 (22/06)0円 0円 第4期 (22/12)0円 第5期 (23/06)0円 第6期 (23/12)第7期 0円 (24/06)0円 第8期 (24/12)

≪主要な資産の状況≫ ※比率は、純資産総額に対するものです。

組入ファンド 運用会社名	合言 ファンド名	†100.4% 比率
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	米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド	100.4%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	0.0%

*ファンド名は略称です。ファンドの詳細については、「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

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。

■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。

設定·運用:

大和アセットマネジメント

商号等 大和アセットマネジメント株式会社

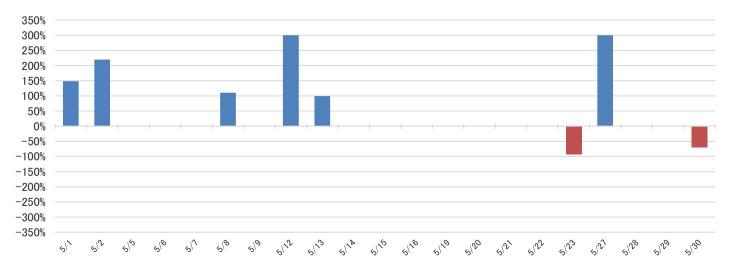
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第352号

-般社団法人投資信託協会 加入協会

- 般社団法人日本投資顧問業協会
- -般社団法人第二種金融商品取引業協会

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)内の日中先物ポジション比率の推移(%)

※以下のグラフは、米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンドについて、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・リミテッドが提供したデータを基に大和アセットマネジメントが作成したものです。



※先物ポジション量はスワップ取引における参照指数の実質的な株価指数先物取引への投資割合です。

米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンドの変動要因(%)	
米国株式イントラデイ・モメンタム・レバレッジド指数スワップ	-1.66%
国内債券	0.03%
その他	-0.03%
合計	-1.66%

月中の戦略発動回数(買建、売建	(1)
買い建て回数	6回
売り建て回数	2回

- ※当月の基準価額変動に対応する期間の、外国投資信託の変動要因を記載しています。
- ※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。
- ※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。
- ※上記の各データがファンドの基準価額へ反映するのには遅れが生じます。また、上記は計算上の値であること等からファンドのパフォーマンスとは完全には一致しません。

≪ファンドマネージャーのコメン<u>ト≫</u>

※現時点での投資判断を示したものであり、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。

※以下のコメントは、米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンドについて、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・リミテッドが提供した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。

【運用経過】

米国株式市場は上昇しました。米英貿易協定の合意や米中による相互関税の大幅引き下げ等の関税交渉の進展を背景に 月初から上昇基調で推移しました。その後は税制法案成立による財政悪化が取り沙汰されるなか、20年債入札が低調な結 果となり長期金利が上昇したことを嫌気して下落した局面もありましたが、トランプ大統領がEU追加関税の発動を延期す ると表明したことやエヌビディアの決算を好感し堅調に推移しました。

本戦略のパフォーマンスは-0.65%となりました。5月1日は、人工知能関連の銘柄への懸念が後退したことからS&P500種株価指数先物は上昇トレンドとなりましたが、本戦略が買建てポジションを構築以降はトレンドが反転したため、本戦略は単日で-1.1%のリターンとなりました。5月8日は、トランプ大統領が英国との貿易協定合意を発表し、対中関税の引き下げ可能性にも言及したことが背景で、S&P500種株価指数先物は上昇トレンドとなりました。しかしながら、本戦略が買建てポジションを構築以降はトレンドが反転したため、本戦略は単日で-0.9%のリターンとなりました。5月12日は、米国と中国が相互の関税率を一定期間引き下げることで合意したためリスクオンとなり、S&P500種株価指数先物は上昇トレンドとなりました。本戦略が買建てポジションを構築して以降もトレンドが継続したため、本戦略は単日で+1.7%のリターンとなりました。5月27日は、消費者信頼感の急回復を背景にS&P500種株価指数先物は上昇トレンドとなりました。本戦略が買建てポジションを構築して以降もトレンドが継続したため、本戦略は単日で+0.8%のリターンとなりました。

≪ファンドの目的・特色≫

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。

ファンドの特色

- ・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。
- ・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。

≪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	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			
リスク	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。			
	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。			
公社債の価格変動	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			
(価格変動リスク・信用リスク)	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。			
為替変動リスク	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。			
	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。			
カントリー・リスク	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。			
スワップ取引の利用に伴うリスク	・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。			
当ファンドが実質的に活用する戦略に	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			
関するリスク	が予想外に下落する場合があります。			
	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。			
その他	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			
ѵ <i>ᄫᄽᄓ</i> ᅘᇰᅔᇵᆓᇋᆚᅠᆝᄝᅝᄜᅌ	額が下落する要因となります。			

[※]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。

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。
- 当ファンドは、忠実義務に基づき、投資する投資信託証券について、その価格が入手できない、または入手した価格で評価すべきでないと考える場合には、適正と判断する直近の日の価格など当社が時価と認める価格で評価することがあります。

≪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〉 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。		<u>,—</u> ,		

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)		The second secon	年率1.2375% (税抜1.125%)	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	委託会社	年率0.35%	ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、 目論見書・運用報告書の作成等の対価です。			
	(税抜) (注 1)	販売会社 年率0.75% 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 の情報提供等の対価です。					
	受託会社 年率0.025%		年率0.025%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価です。			
	投資対象とする 投資信託証券 (目論見書作成時点)		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 (目論見書作成時点)		理費用	年率1.4375%(税込)程度				
その他の費用・				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)		
	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			
	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	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		
の中止および取消し	た場合には、購入、換金の申込みの受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		
	取消すことがあります。		
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。		
	・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		
	合わせ下さい。		
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。		

≪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 0120-106212(営業日の9:00~17:00) 当社ホームページ
- https://www.daiwa-am.co.jp/

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)

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
第四北越証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第128号	0			
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	0	0	0	0