

2021年12月3日

投資家の皆様へ

大和アセットマネジメント株式会社

**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）
信託約款変更のお知らせ**

下記変更対象ファンドについて、信託約款の変更を行いますので、お知らせいたします。

1. 変更対象ファンド

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）

2. 変更内容

主要投資対象として、当ファンドと同様の基本方針で運用を行うロング・ショート戦略マザーファンドを追加します。

また、当該マザーファンドの運用手法を当ファンドの投資態度に反映させるため、以下の変更を行います。

- ・ 組み入れる株価指数先物の見直しを随時行えるようにするため、1 カ月ごとに見直しを行う旨の記載を削除します。
- ・ 組み入れる各株価指数先物の建玉の時価総額を均等とすることを目標にしていたが、均等としないことも可能にします。

3. 変更理由

当ファンドでは、先物の買建てを行うロング戦略マザーファンドと先物の売建てを行うショート戦略マザーファンドを組み合わせ運用を行っていますが、2021年9月30日付で新規設定されたロング・ショート戦略マザーファンドは、先物の買建てと売建てを同時に行うとともに、運用手法も一部見直しており、主要投資対象として追加することで、より効率的な運用ができると判断したため。

4. 変更適用日

2022年1月8日

5. 今後の運用および投資対象マザーファンドの除外

2022年1月8日付で信託約款を変更した後、投資資金を、従来からの主要投資対象であるロング戦略マザーファンドおよびショート戦略マザーファンドから、ロング・ショート戦略マザーファンドへ順次移管していきます。

最終的にロング・ショート戦略マザーファンドのみでの運用に切り替えたうえで、2022年2月28日付で再度信託約款の変更を行い、ロング戦略マザーファンドおよびショート戦略マザーファンドを主要投資対象から除外します。

以上