

使用開始日 2024.01.11

投資信託説明書(交付目論見書)

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

(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)



ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読み下さい。

■委託会社 (ファンドの運用の指図等を行ないます。)

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

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

■受託会社 (ファンドの財産の保管、管理等を行ないます。)

三菱UFJ信託銀行株式会社

■委託会社の照会先



ホームページ

<https://www.daiwa-am.co.jp/>



コールセンター 受付時間 9:00 ~ 17:00 (営業日のみ)

0120-106338



■ファンドに関する投資信託説明書(請求目論見書)を含む詳細な情報は委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードすることができます。また、本書には約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。

■本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書です。

UD
FONT

見やすく読みまちがえにくい
ユニバーサルデザインフォント
を採用しています。

- ◆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。

ファンド名	商品分類				属性区分					
	単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	補足分類	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	特殊型
ロングコース	追加型	内外	株式	—	その他資産 (投資信託証券 (その他資産 (株価指数先物)))	年1回	グローバル (含む日本)	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	—
ロング・ショートコース				特殊型 (ロング・ショート型)						ロング・ショート型

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

※商品分類・属性区分の定義について

くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ [<http://www.toushin.or.jp/>] をご参照下さい。

〈委託会社の情報〉

(2023年10月末現在)

委託会社名	大和アセットマネジメント株式会社	資本金	151億74百万円
設立年月日	1959年12月12日	運用する投資信託財産の合計純資産総額	25兆7,390億28百万円

- 本文書により行なう「世界株式トレンドフォロー戦略ファンド」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2024年1月10日に関東財務局長に提出しており、2024年1月11日にその届出の効力が生じています。
- 当ファンドは、商品内容に関して重大な変更を行なう場合に、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき、事前に受益者の意向を確認する手続きを行ないます。
- 当ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産等との分別管理等が義務付けられています。
- 請求目論見書は、投資者の請求により販売会社から交付されます(請求を行なった場合には、その旨をご自身で記録しておくようにして下さい)。

ファンドの目的

各コースの目的は、次のとおりです。

世界株式トレンドフォロー戦略ファンド

ロングコース

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。

当ファンドが取引対象とする株価指数先物

欧州地域

- 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**
- スイス株価指数先物 **スイス**

北米地域

- 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**
- ダウ先物ミニ **米国**

アジア・オセアニア地域

- 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**
- FTSE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**
- ニフティ50指数先物 **インド**

その他地域

- MSCIエマージング・マーケット指数先物 **新興国**
- FTSE/JSEアフリカトップ40指数先物 **南アフリカ**

※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。(2023年10月末現在)

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

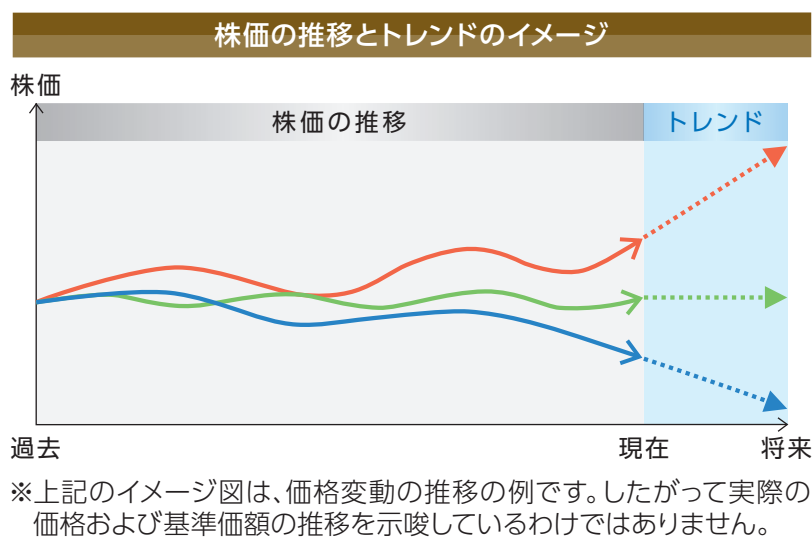
※上記先物と同一の指数を対象とする先物で、最小取引単位がより小さいものが上場されている場合、これらについても取引対象とします。

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。

- 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、世界の株価指数先物を対象に、想定される上昇トレンドの強・弱を評価します。
- 想定される上昇トレンドが相対的に強い株価指数先物の買建てや相対的に弱い株価指数先物の売建てを行いません。

トレンドとは

- 一般的に、株価の値動きには一定期間一定方向に継続して動くという性質があるとされており、これを「トレンド」といいます。
- その性質を利用し、トレンドに追随して資産の買いや売りを行なう投資戦略のことを「トレンドフォロー戦略」といいます。



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**と想定されるもの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**と想定されるもの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**と想定されるもの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。

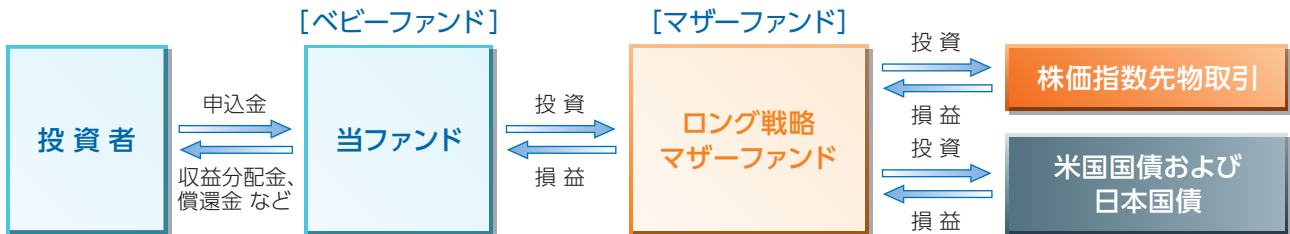
- ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
- 為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

ファンドの仕組み

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

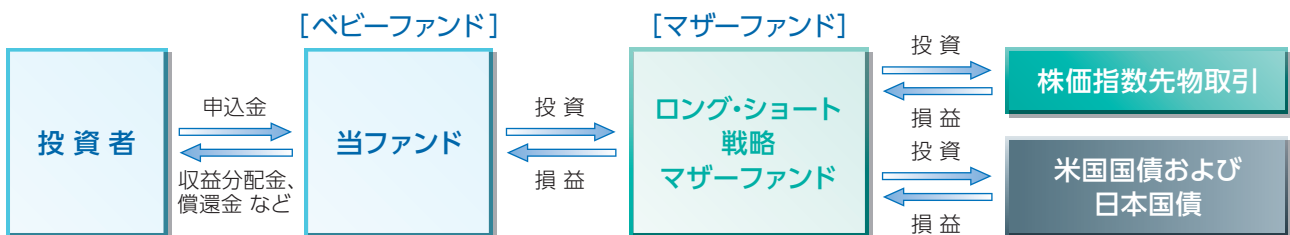
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ロングコース



- マザーファンドにおいて、株価指数先物の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額と同程度になるように調整を行いません。
- マザーファンドにおいて、外貨建資産の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。
- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ロング・ショートコース



- マザーファンドにおいて、株価指数先物の買建玉の時価総額の合計額と売建玉の時価総額の合計額を均等とすることを目標とします。
- マザーファンドにおいて、株価指数先物の建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額と同程度になるように調整を行いません。
- マザーファンドにおいて、外貨建資産の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。
- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※「ロング戦略マザーファンド」は株価指数先物取引の買建て、「ロング・ショート戦略マザーファンド」は株価指数先物取引の買建てと売建ての両方を行いません。

当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される
とき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.~4.の
運用が行なわれないことがあります。

⑤ 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 分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

※第1計算期間は、2019年4月15日(休業日の場合翌営業日)までとします。

[分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準
等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわ
ないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。





主な投資制限


- マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

基準価額の変動要因

- 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。

主な変動要因

 <p>株価指数先物取引の利用に伴うリスク</p>	<p>【ロングコース】 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。先物を買建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】 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。先物を買建ている場合の先物価格の下落、または先物を売建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>
 <p>公社債の価格変動 (価格変動リスク・信用リスク)</p>	<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。特に、発行体が債務不履行が発生させた場合、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>
 <p>当ファンドが活用する戦略に関するリスク</p>	<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>
 <p>為替変動リスク</p>	<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>

 <p>カントリー・リスク</p>	<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>
<p>そ の 他</p>	<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性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。

リスクの管理体制

- 委託会社では、取締役会が決定した運用リスク管理に関する基本方針に基づき、運用本部から独立した部署および会議体が直接的または間接的に運用本部へのモニタリング・監視を通し、運用リスクの管理を行ないます。
- 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

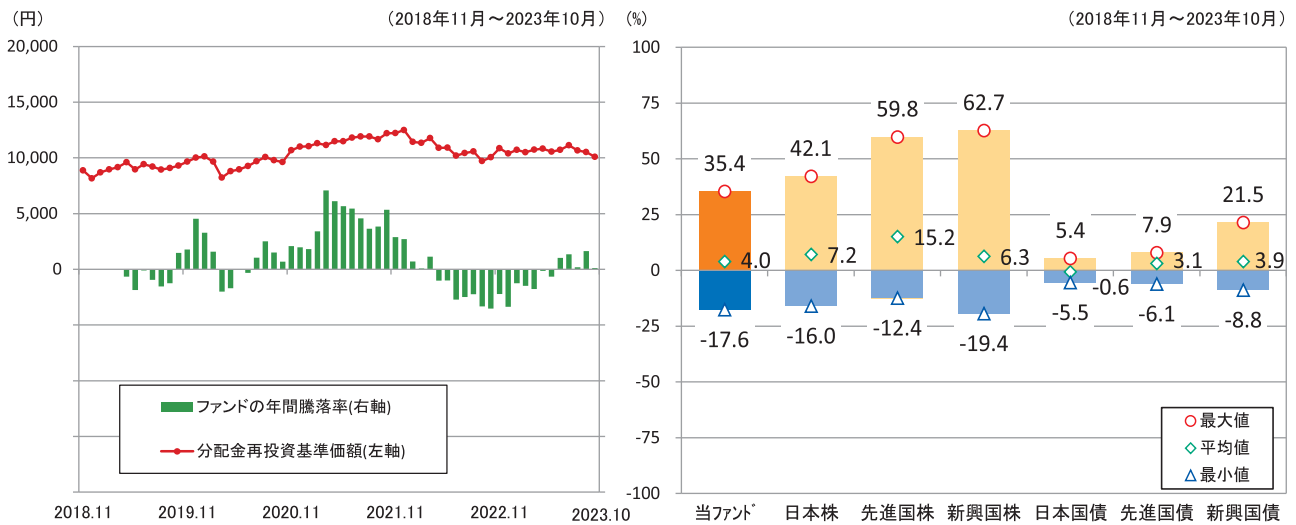
参考情報

◆ 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

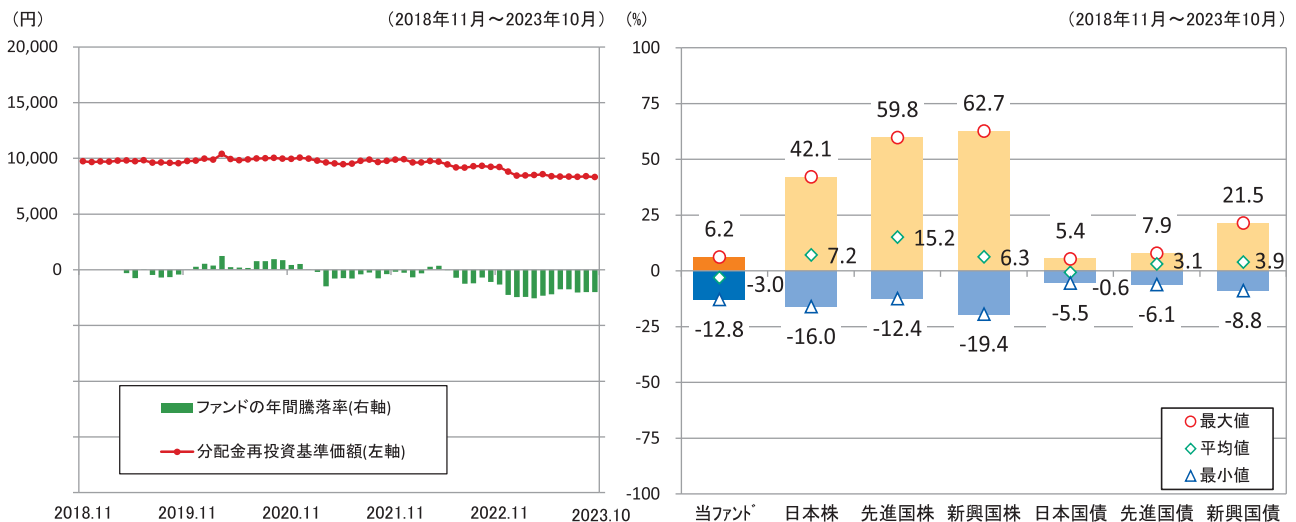
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

[世界株式トレンドフォロー戦略ファンド(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)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、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たものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：配当込みTOPIX

先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。〔<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>〕●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

● 世界株式トレンドフォロー戦略ファンド(ロングコース)

2023年10月31日現在

※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

基準価額	10,102円
純資産総額	3.6億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.0%
3カ月間	-9.2%
6カ月間	-6.7%
1年間	0.5%
3年間	4.9%
5年間	16.5%
設定来	1.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※「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。

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 19年4月	第2期 20年4月	第3期 21年4月	第4期 22年4月	第5期 23年4月					
分配金	0円	0円	0円	0円	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

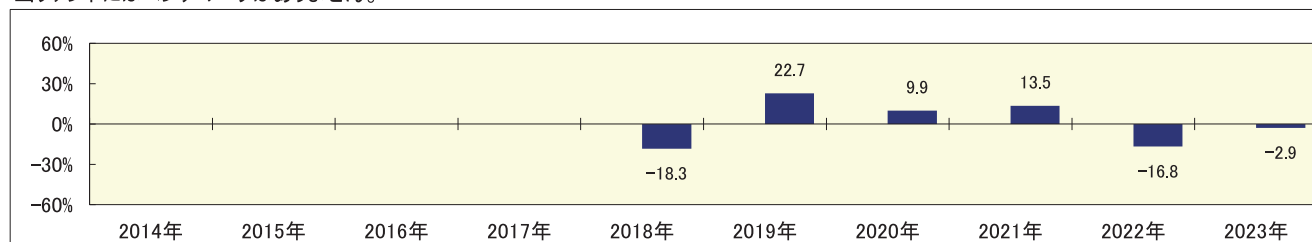
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	組入上位10銘柄	比率
外国株式 先物	8	100.0%	MSCI SING IX ETS NOV 23	32.7%
国内債券	6	68.1%	CAC40 10 EURO NOV 23	20.9%
			MICRO DAX DEC 23	13.6%
			S&P/TSE 60 INDEX DEC 23	13.5%
			1145国庫短期証券	12.1%
			1121国庫短期証券	11.8%
			1164国庫短期証券	11.6%
			1133国庫短期証券	11.6%
			1139国庫短期証券	11.0%
コール・ローン、その他		31.9%	1152国庫短期証券	9.9%
合計	14	-	合計	148.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
 ・2018年は設定日(4月24日)から年末、2023年は10月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

運用実績

● 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)

2023年10月31日現在

※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

基準価額	8,313円
純資産総額	1.4億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.9%
3カ月間	-0.5%
6カ月間	-3.1%
1年間	-10.1%
3年間	-16.6%
5年間	-14.9%
設定来	-16.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「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。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 19年4月	第2期 20年4月	第3期 21年4月	第4期 22年4月	第5期 23年4月					
分配金	0円	0円	0円	0円	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

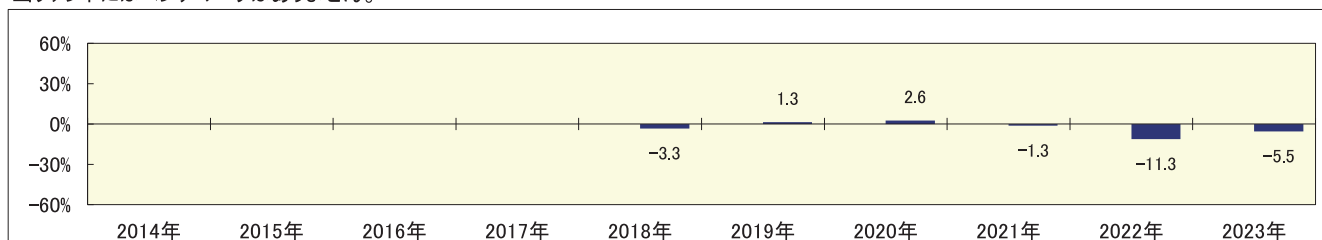
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	組入上位10銘柄	比率
国内債券	5	55.3%	H-SHARES INDEX NOV 23	-16.6%
外国株式 先物	16	-0.4%	MSCI SING IX ETS NOV 23	16.4%
			1133国庫短期証券	12.7%
			1164国庫短期証券	12.0%
			1152国庫短期証券	10.6%
			CAC40 10 EURO NOV 23	10.0%
			1189国庫短期証券	9.9%
			1183国庫短期証券	9.9%
			AMSTERDAM INDEX NOV 23	-9.6%
コール・ローン、その他		44.7%	FTSE TAIWAN NOV 23	-7.7%
合計	21	-	合計	-

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。また、先物の売建玉が組入上位10銘柄にある場合は、組入上位10銘柄の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移


当ファンドにはベンチマークはありません。





・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2018年は設定日(4月24日)から年末、2023年は10月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

お申込みメモ

 購入時	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。

 換金時	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。

 申込について	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	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)
	購入の申込期間	2024年1月11日から2024年7月8日まで (終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)
	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。

 <p>その他</p>	信託期間	2028年4月14日まで(2018年4月24日当初設定) 受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長できます。
	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
	決算日	毎年4月15日(休業日の場合翌営業日) (注)第1計算期間は、2019年4月15日(休業日の場合翌営業日)までとします。
	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。
	信託金の限度額	各ファンドについて5,000億円
	公 告	電子公告の方法により行ない、ホームページ〔 https://www.daiwa-am.co.jp/ 〕に掲載します。
	運用報告書	毎計算期末および償還時に作成し、交付運用報告書をあらかじめお申出いただいたご住所にお届けします。 また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
	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。 ※2023年10月末現在のものであり、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。

ファンドの費用・税金

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。

税金

- ・税金は表に記載の時期に適用されます。
- ・以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税および 地方税	配当所得として課税 ^(注) 普通分配金に対して20.315%
換金(解約)時および 償還時	所得税および 地方税	譲渡所得として課税 ^(注) 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

(注)所得税、復興特別所得税および地方税が課されます。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2023年10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
世界株式トレンドフォロー戦略ファンド (ロングコース)	1.50%	1.35%	0.14%
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)	1.69%	1.35%	0.34%

※対象期間は2022年4月16日～2023年4月17日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。)を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。