

## 1st Anniversary Report

「ロボット戦略Ⅱ 世界成長ファンド（愛称：あんしんロボ）」は、ファンドの設定から1年を迎えました。設定来の運用状況等をご報告いたします。

資産運用も自動運転の時代へ

## ロボット戦略シリーズ

～24時間、休むことなくロボット（コンピュータープログラム）が運用～



### ロボット戦略Ⅱ 世界成長ファンド

愛称：あんしんロボ

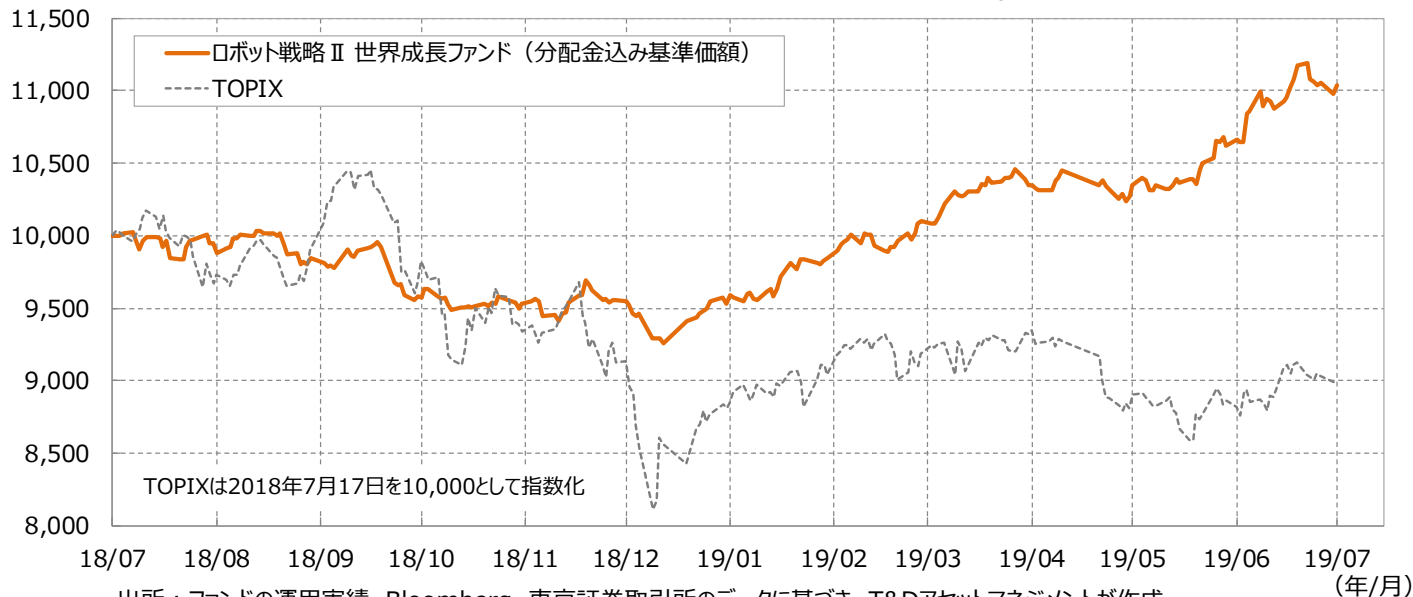
追加型投信/内外/資産複合



成長の番人コンピューター「察知（さち）くん」  
（ファンドのイメージキャラクターです。）

【ファンド設定来の基準価額の推移】

期間：2018年7月17日～2019年7月17日（日次）



## ファンドの運用状況（2ページもご参照ください。）

### 2018年

- ◆ ファンド設定後、2018年9月末までは株式、社債が上昇する中、国債、商品、インフレ連動債が下落し、基準価額への影響は1.0%の下落となりました。
- ◆ 2018年10-12月は国債が上昇する中、株式が大幅に下落したことにより、基準価額は期間中6.4%の下落となりました。

### 2019年

- ◆ 2019年1-3月は投資対象資産のすべてが上昇し、特に株式の上昇の恩恵を受け、基準価額は期間中11.3%の上昇となりました。
- ◆ 4-6月も前期同様に基準価額は大幅な上昇（6%程度）となりました。投資対象資産の商品を除き、4資産が上昇し、特に国債は株式を上回る上昇となりました。
- ◆ 7月に入ってから株式、国債、インフレ連動債の上昇もあり、基準価額は7月17日現在、1%強のプラスリターンとなっています。

資産運用も自動運転の時代へ



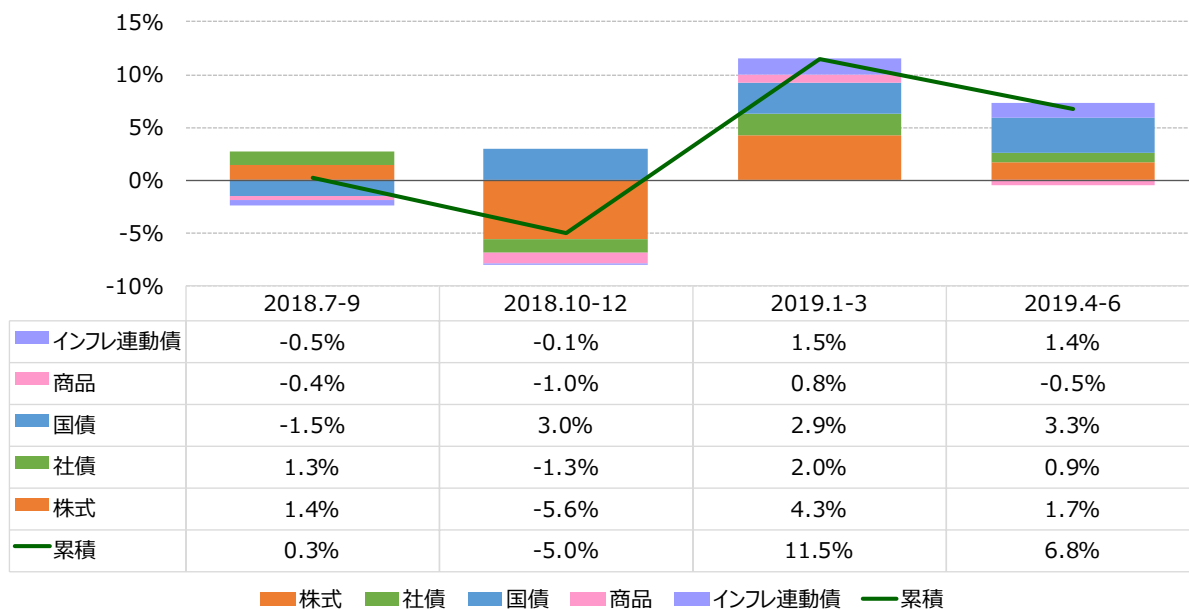
## ロボット戦略シリーズ

～24時間、休むことなくロボット（コンピュータープログラム）が運用～

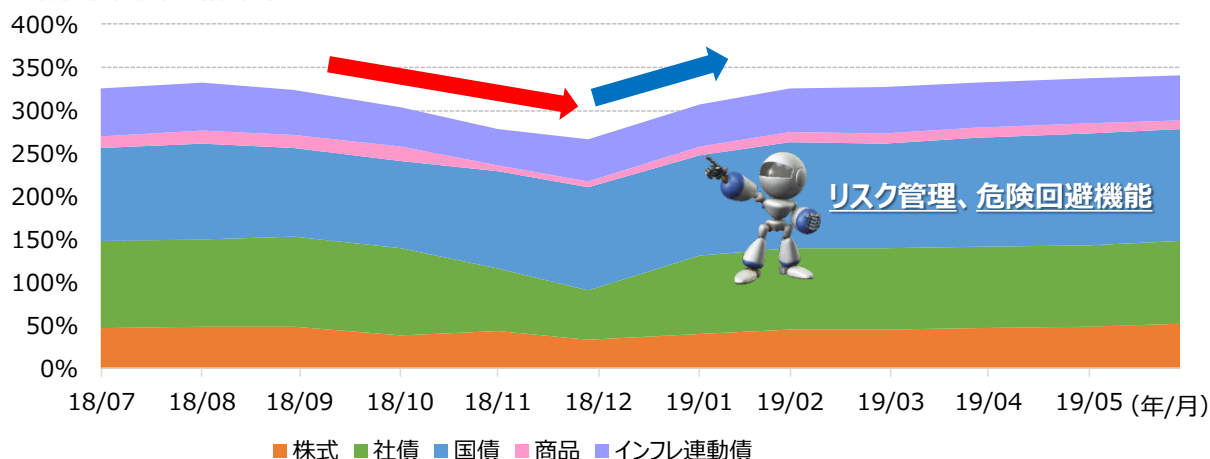
### ファンドの運用状況（セクター別の寄与度および投資比率）

下記は投資対象ファンド「マン・AHL・ターゲットリスク」の運用概況です。ファンドは「マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）」に投資を行います。当該ページのデータの基準日は現地基準です。

#### ◆セクター別寄与度（四半期）



#### ◆セクター別投資比率（推移）



期間：2018年7月～2019年6月（月次） 出所：マン・グループのデータに基づき、T&Dアセットマネジメントが作成



### リスク管理・危険回避機能

リスク管理においては、ポートフォリオ全体のリスクが一定となるように、24時間リスク管理が行われます。（目標リスクは、年率10%程度）

#### 2018年10月～2019年1月

- 個々の市場において下落トレンドとなり、自動ブレーキ機能が**発動**し、投資比率の抑制（損失回避行動）
- 1月以降から上昇トレンドに入り、早期に自動ブレーキ機能を**解除**し、1-6月は大きなプラスリターン

当ファンドには2つの自動ブレーキ機能があります。上記のセクター別投資比率では自動ブレーキ機能②の発動による投資比率の抑制が示されています。自動ブレーキ機能について詳しくは投資信託説明書（交付目論見書）や販売用冊子にてご確認ください。

記載のデータは過去の実績であり、将来の投資成果を示唆あるいは保証するものではありません。  
当資料をご覧いただくにあたっては、5ページのご留意いただきたい事項を必ずご確認ください。

## お申込みメモ

購入時	購入単位	販売会社が定める単位 詳しくは販売会社にお問い合わせください。
	購入価額	購入申込受付日の翌々営業日の基準価額
換金時	換金単位	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
	換金代金	原則として換金申込受付日から起算して9営業日目からお支払いします。
申込締切時間		原則として午後3時までに販売会社が受け付けたものを当日の申込分とします。
信託期間		2023年11月27日まで（2018年7月17日設定）
決算日		5月、11月の各25日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配		年2回、毎決算時に収益分配方針に基づいて収益の分配を行います。販売会社との契約によっては税引き後無手数料で再投資が可能です。ただし、必ず分配を行うものではありません。
申込不可日		下記のいずれかに該当する日には、購入・換金の申込はできません。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ダブリン、ロンドンの銀行の休業日</li> <li>・ダブリン、ロンドンの銀行の休業日（土曜日および日曜日を除く）の前営業日※</li> <li>・日本の祝日（土曜日を除く）の前営業日および前々営業日</li> </ul> ※ただしダブリンまたはロンドンの銀行の休業日（土曜日および日曜日を除く）が2連続以上となる場合には、当該連続休業日の初日の2営業日前、3営業日前および4営業日前も申込不可日となります。

## ファンドの費用

## ◆ 投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入価額に、 <b>3.24%（税抜3.0%）</b> を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。 詳しくは販売会社にお問い合わせください。
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

運用管理費用 （信託報酬）	ファンド	毎日、ファンドの純資産総額に <b>年0.8856%（税抜0.82%）</b> の率を乗じて得た額とします。
	投資対象とする 外国投資信託	外国投資信託の純資産総額に対して年率上限1.09%の運用管理費用がかかります。
	実質的な負担	<b>年1.9756%（税抜1.91%）程度</b> ファンドが投資対象とする外国投資信託の信託報酬を加味して、受益者が実質的に負担する信託報酬率について算出したものです。
その他の 費用・手数料	<ul style="list-style-type: none"> <li>・信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。</li> <li>・証券取引に伴う手数料、組入資産の保管に要する費用等は、信託財産中から支弁します。また、組入外国投資信託において、証券取引・オプション取引等に伴う手数料、その他ファンドの運営に必要な各種費用等がかかります。</li> </ul> これらの費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率・上限額等を示すことができません。	

上記の費用の合計額については、投資者がファンドを保有される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。

## 販売会社の名称等

販売会社		登録番号	日本証券業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 第二種 金融商品 取引業協会
今村証券株式会社	金融商品 取引業者	北陸財務局長 (金商) 第3号	○			
株式会社SBI証券	金融商品 取引業者	関東財務局長 (金商) 第44号	○		○	○
株式会社十六銀行	登録金融 機関	東海財務局長 (登金) 第7号	○		○	
静岡東海証券株式会社	金融商品 取引業者	東海財務局長 (金商) 第8号	○			
第四証券株式会社	金融商品 取引業者	関東財務局長 (金商) 第128号	○			
めぶき証券株式会社	金融商品 取引業者	関東財務局長 (金商) 第1771号	○			
楽天証券株式会社	金融商品 取引業者	関東財務局長 (金商) 第195号	○	○	○	○
ワイエム証券株式会社	金融商品 取引業者	中国財務局長 (金商) 第8号	○			

加入協会に○印を記載しています。

## ファンドの関係法人

**委託会社**：T&Dアセットマネジメント株式会社

信託財産の運用指図等を行います。

**受託会社**：野村信託銀行株式会社

信託財産の保管・管理業務等を行います。

## 照会先

**T&Dアセットマネジメント株式会社**

電話番号：03-6722-4810

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)

インターネットホームページ：<https://www.tdasset.co.jp/>

## 投資リスク

**ファンドの基準価額は、投資を行っている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資者に帰属します。したがって、ファンドは投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。なお、ファンドは預貯金とは異なります。**

ファンドの基準価額の変動要因となる主なリスクは次の通りです。

価格変動リスク	信用リスク	為替変動リスク	流動性リスク
カントリーリスク	デリバティブのリスク	スワップ取引に伴うリスク	システムリスク

※基準価額の変動要因（リスク）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】

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。

## 分配金に関する留意点

- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり幅が小さかった場合も同様です。

レバレッジは、株価指数先物取引、債券先物取引、スワップ取引等のデリバティブ取引により活用されます。デリバティブ取引等によりレバレッジをかけた取引を行う場合には、デリバティブ取引等の価格が予想した方向と反対方向に動いた場合に、レバレッジがかかっていない場合に比べて損失が拡大し、基準価額が値下がりする要因となります。

## ご留意いただきたい事項

- 当資料はT&Dアセットマネジメントが情報提供を目的として作成したものであり、投資勧誘を目的としたものではありません。当資料は当社が信頼性が高いと判断した情報等に基づいて作成したのですが、その正確性・完全性を保証するものではありません。また、当資料で使用するデータは過去の実績もしくは表記時点での予測であり、将来の投資成果等を示唆あるいは保証するものではありません。当資料に記載された意見・見通しは表記時点での当社の判断を反映したものであり、将来の投資成果等を示唆あるいは保証するものではありません。また、将来予告なく変更されることがあります。
- 投資信託はリスクを含む商品であり、株式および公社債等値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、運用実績は市場環境等により変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。これら運用による損益は全て投資者に帰属します。
- 投資信託は預貯金や保険契約と異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合、投資者保護基金の支払対象とはなりません。
- 購入のお申込みにあたっては、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上、ご自身でご判断いただきますようお願い致します。投資信託説明書（交付目論見書）は販売会社にてご入手いただけます。

## ■ 設定・運用は

## T&amp;Dアセットマネジメント

商号：T & D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357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