

2022年10月21日

受益者の皆さまへ

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

フレキシブル日本株ファンド (愛称：先読みセンス) 当ファンドで活用する指標の変更のお知らせ

拝啓 時下ますますご清栄のこととお慶び申し上げます。
平素は格別のご高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております「フレキシブル日本株ファンド」(以下「当ファンド」といいます。)につきまして、当ファンドにおいて株式に対する投資リスクの低減を図るために活用する指標を下記の通り変更することとなりましたので、お知らせいたします。

なお、当該変更は、当ファンドの信託約款の変更には該当いたしません。

また、当ファンドの運用の基本方針、運用体制につきましては、実質的な変更はございません。

本お知らせに関しまして、受益者の皆さまのお手続きは不要です。

受益者の皆さまにおかれましては、何卒ご理解くださいますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧くださいますよう、よろしくお願い申し上げます。

敬具

記

1. 変更内容

当ファンドでは、主にわが国の株式に投資することで、信託財産の長期的な成長を目指すとともに、市場環境に応じて、株式への実質投資比率を機動的に変動させることで、株式に対する投資リスクの低減を図ります。

当ファンドの設定以降、株式への実質投資比率の調整にあたっては、UBS AG の開発した「UBS日本株式リスク指標プラス」を活用してきましたが、2022年10月21日より活用する指標を「UBS 日本株式リスク指標プラス」から弊社独自の「DMI シグナル」に変更いたします。

なお、これに伴う、当ファンドの運用管理費用（信託報酬）の変更はございません。

[ご参考]

変更後の当ファンドにおける実質株式投資比率の機動的な調整について

実質株式投資比率の機動的な調整

- 市場の方向性やトレンドの強さを判定するDMIシグナルにより市場局面を判定し、株価指数先物取引を活用して実質株式投資比率を調整します。
- 市場局面を「強気局面」と判定した場合は、「買い戦略」を採用し、実質株式投資比率を100%程度とします。
- 市場局面を「弱気局面」と判定した場合は、「待機戦略」を採用し、実質株式投資比率を0%程度とします。

DMIシグナル

市場の方向性	トレンドの強さ
<ul style="list-style-type: none"> ● TOPIXのDMI (週単位の高値更新幅から安値更新幅を引いた値) を活用 → DMIが基準値を超える場合: 上昇トレンド → DMIが基準値以下の場合: 下落トレンド 	<ul style="list-style-type: none"> ● ADX (DMIから派生したトレンドの強さを測定する指標) を活用 → ADXの絶対値が基準値を超える場合: 強いトレンド → ADXの絶対値が基準値以下の場合: 弱いトレンド

DMIシグナルを用いた局面判断

		トレンドの強さ (ADX)	
		強い	弱い
市場の方向性 (DMI)	上昇	強気局面	強気局面
	下落	弱気局面	強気局面

強気局面

買い戦略

実質株式投資比率
100%程度

現物株式に加え株価指数先物取引の買建てを行うこと等により、実質株式投資比率を100%程度とします。

←

→

弱気局面

待機戦略

実質株式投資比率
0%程度

現物株式に対し株価指数先物取引の売建て(ヘッジ)を行うこと等により、実質株式投資比率を0%程度とします。

※市場局面を判定する際に活用する「DMIシグナル」は、今後変更される場合があります。
 ※上記の実質株式投資比率はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

2. 変更日

2022年10月21日

以上

<本件に関するお問い合わせ>

三井住友DSアセットマネジメント コールセンター **0120-88-2976**

[受付時間] 午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

<お客さまの個別のお取引内容についてのお問い合わせ>

お取引先の販売会社にお問い合わせください。