

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 2020年10月5日提出

【発行者名】 大和アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 松下 浩一

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 西脇 保宏
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】 米国ABC戦略ファンド（1倍コース）
米国ABC戦略ファンド（3倍コース）
米国ABC戦略ファンド（5倍コース）

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 (1)当初自己設定
各ファンドについて5,000万円とし、合計で1億5,000万
円とします。
(2)継続申込期間
各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で30兆円を
上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2020年9月18日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項につき、主要投資対象である連動債券に係る記載事項を変更するため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原有価証券届出書の更新後の内容を示します。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

< 略 >

< 訂正前 >



主として、連動債券^{※1}への投資を通じて、米国の株式、リートおよび債券^{※2}ならびに金に実質的に投資します。

※1 連動債券とは、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイが発行する債券(円建)をいいます。くわしくは「投資対象債券の概要」をご参照下さい。

※2 米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。

委託会社の独自モデルに基づき、以下の方針で資産配分比率を変更します。

- 景気サイクルの局面判断によって投資対象資産の配分比率を調整します。
- 市場リスクが急激に高まったと判断した場合には、資産配分比率を切り替えることで、基準価額下落リスクの抑制をめざします。

< 略 >

〔投資対象債券の概要〕

〔1倍コース〕

発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連 動 対 象	Daiwa US ABC Strategy Index
特 色	① 原則として、Daiwa US ABC Strategy Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。 ※Daiwa US ABC Strategy Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。 ※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。 ② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.05%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's: Aa2 / S&P: A+ / Fitch: AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、変更となる場合があります。

〔3倍コース〕

発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連 動 対 象	Daiwa US ABC Strategy 3X Index
特 色	① 原則として、Daiwa US ABC Strategy 3X Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。 ※Daiwa US ABC Strategy 3X Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。実質的にDaiwa US ABC Strategy Indexの概ね3倍相当額の投資を行ないます。 ※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。 ② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.25%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's: Aa2 / S&P: A+ / Fitch: AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、変更となる場合があります。

[5倍コース]

発行体/発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ/円建て担保付連動債券
連動対象	Daiwa US ABC Strategy 5X Index
特 色	<p>① 原則として、Daiwa US ABC Strategy 5X Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。</p> <p>※Daiwa US ABC Strategy 5X Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。実質的にDaiwa US ABC Strategy Indexの概ね5倍相当額の投資を行ないます。</p> <p>※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。</p> <p>② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p>
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.50%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's: Aa2 / S&P: A+ / Fitch: AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

① 主として、連動債券^{※1}への投資を通じて、米国の株式、リートおよび債券^{※2}ならびに金に実質的に投資します。

※1 連動債券について、くわしくは「投資対象債券の概要」をご参照下さい。

※2 米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。

委託会社の独自モデルに基づき、以下の方針で資産配分比率を変更します。

- 景気サイクルの局面判断によって投資対象資産の配分比率を調整します。
- 市場リスクが急激に高まったと判断した場合には、資産配分比率を切り替えることで、基準価額下落リスクの抑制をめざします。

< 略 >

〔投資対象債券の概要〕

〔1倍コース〕

発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連 動 対 象	Daiwa US ABC Strategy Index
特 色	① 原則として、Daiwa US ABC Strategy Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。 ※Daiwa US ABC Strategy Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。 ※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。 ② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.05%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's: Aa2 / S&P: A+ / Fitch: AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、今後、記載内容が変更となる場合、投資対象債券が変更となる場合等があります。

〔3倍コース〕

発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連 動 対 象	Daiwa US ABC Strategy 3X Index
特 色	① 原則として、Daiwa US ABC Strategy 3X Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。 ※Daiwa US ABC Strategy 3X Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。実質的にDaiwa US ABC Strategy Indexの概ね3倍相当額の投資を行ないます。 ※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。 ② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.25%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's: Aa2 / S&P: A+ / Fitch: AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、今後、記載内容が変更となる場合、投資対象債券が変更となる場合等があります。

【5倍コース】

発行体／発行形態	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイ／円建て担保付連動債券
連 動 対 象	Daiwa US ABC Strategy 5X Index
特 色	① 原則として、Daiwa US ABC Strategy 5X Indexの値動きに100%程度連動します。連動割合については、原則日次でリバランスされます。 ※Daiwa US ABC Strategy 5X Indexは、景気サイクルの局面判断によって米国の株式、リートおよび債券ならびに金の配分比率を調整し、市場リスクが急激に高まった場合には、資産配分比率を切り替える指数です。実質的にDaiwa US ABC Strategy Indexの概ね5倍相当額の投資を行ないます。 ※米国の債券とは、米国国債、米国投資適格社債、米国ハイイールド債券、米ドル建新興国債券等をいいます。 ② 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
利 払 い 回 数	なし
報 酬 等	債券の評価額に対して年率0.50%程度 ただしその他、運用コスト等の費用がかかります。
信 用 格 付 け	発行体格付けとしてMoody's: Aa2 / S&P: A+ / Fitch: AA ただし、担保については発行体から分別管理されています。

※上記は目論見書作成時点での情報に基づくものであり、今後、記載内容が変更となる場合、投資対象債券が変更となる場合等があります。

(3) 【ファンドの仕組み】

< 略 >

< 訂正前 >

投資対象	ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイが発行する 債券（円建） など
------	---

< 略 >

< 訂正後 >

投資対象	米国の株式、リートおよび債券ならびに金の値動きを享受する債券 （円建） など
------	--

< 略 >

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

< 訂正前 >

主要投資対象

< 各ファンド共通 >

ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイが発行する債券(円建)(以下、「連動債券」といいます。)を主要投資対象とします。

< 略 >

< 訂正後 >

主要投資対象

< 各ファンド共通 >

米国の株式、リートおよび債券ならびに金の値動きを享受する債券(円建)(以下、「連動債券」といいます。)を主要投資対象とします。

< 略 >

3 【投資リスク】

< 略 >

< 訂正前 >

連動債券への投資に伴うリスク

当ファンドが投資対象とする連動債券において、連動債券が追加発行されないこととなる場合および連動債券の早期償還事由が生じた場合は、予想外の損失を被る可能性があります。

< 略 >

< 訂正後 >

連動債券への投資に伴うリスク

当ファンドが投資対象とする連動債券において、連動債券が追加発行されないこととなる場合および連動債券の早期償還事由が生じた場合は、予想外の損失を被る可能性があります。

連動債券の発行体がスワップ取引を活用した場合で、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には、予想外の損失を被る可能性があります。

< 略 >

第2 【管理及び運営】

3 【資産管理等の概要】

(5) 【その他】

< 略 >

< 訂正前 >

2. 委託会社は、当ファンドが主要投資対象とするジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エイが発行する債券が償還する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、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
4. 前3.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本4.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.から前5.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を

定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

3. 前2. の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、 の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

< 略 >