

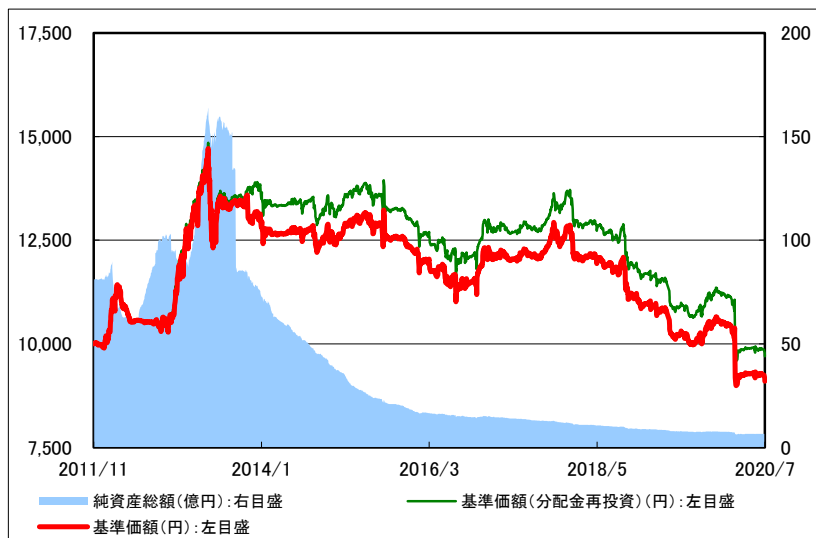
# ART テクニカル運用日本株式ファンド

追加型投信／国内／株式／特殊型(その他型(テクニカル運用モデル型))

当初設定日 : 2011年11月28日

作成基準日 : 2020年7月31日

## 基準価額の推移



- ※ データは、当初設定日から作成基準日までを表示しています。
- ※ 基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。
- ※ 基準価額は、信託報酬控除後です。

## 基準価額、純資産総額

	当月末	前月末比
基準価額	9,100 円	- 150 円
純資産総額	6.43 億円	- 0.10 億円

## 期間別騰落率

	騰落率
1ヵ月	-1.62%
3ヵ月	-2.16%
6ヵ月	-12.95%
1年	-10.76%
3年	-24.00%
設定来	-2.99%

- ※ ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。

## 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額 820 円

決算期	2017年11月	2018年11月	2019年11月
分配金	140 円	0 円	0 円

- ※ 運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### <本資料のお取扱いにおけるご留意点>

- 当資料は三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成したものであり、金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。
- ご購入のお申込みの際は最新の投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認ください。ご自身でご判断ください。
- 投資信託は値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替変動リスクを伴います。)に投資しますので基準価額は変動します。したがって、投資元本や利回りが保証されるものではありません。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆様に帰属します。
- 投資信託は預貯金や保険契約とは異なり預金保険機構および保険契約者保護機構等の保護の対象ではありません。また、証券会社以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。
- 当資料は信頼できると判断した各種情報等に基づき作成していますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、今後予告なく変更される場合があります。
- 当資料中の図表、数値、その他データについては、過去のデータに基づき作成したものであり、将来の成果を示唆あるいは保証するものではありません。また、将来の市場環境の変動等により運用方針等が変更される場合があります。

# ART テクニカル運用日本株式ファンド

追加型投信／国内／株式／特殊型(その他型(テクニカル運用モデル型))

当初設定日 : 2011年11月28日

作成基準日 : 2020年7月31日

## 資産の状況

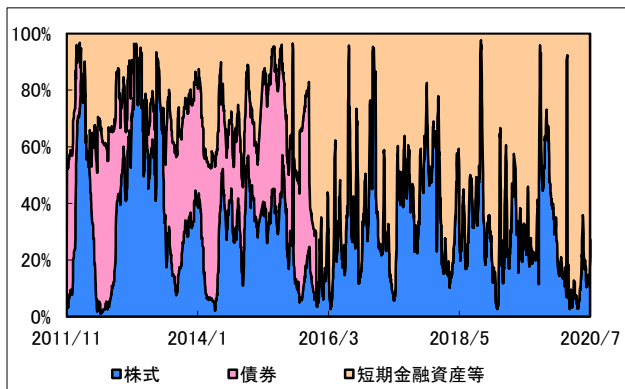
※ 当ページの数値はマザーファンドベースです。

### 資産内容

株式	27.31%
債券	0.00%
短期金融資産等	72.69%
合計	100.00%

※ 対純資産総額比です。

### 資産別組入比率の推移



※ データは、当初設定日から作成基準日までを表示しています。

## 各ロボットによる株式組入比率

種類	当月末	前月末
ロボット1	6.00%	14.05%
ロボット3	0.55%	1.50%
ロボット4	5.66%	0.94%
ロボット5	9.00%	1.37%
ロボット6	6.09%	0.43%

※ 対純資産総額比です。

## 株式組入上位10銘柄

	銘柄	業種	比率
1	三菱自動車工業	輸送用機器	1.81%
2	資生堂	化学	1.36%
3	日産自動車	輸送用機器	1.32%
4	東京瓦斯	電気・ガス業	1.32%
5	ジェイテクト	機械	1.27%
6	IHI	機械	1.26%
7	コニカミノルタ	電気機器	1.21%
8	TDK	電気機器	0.91%
9	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	0.88%
10	横河電機	電気機器	0.87%

※ 対純資産総額比です。

組入銘柄数 : 42

<本資料のお取扱いにおけるご留意点>を必ずお読みください。

## ART テクニカル運用日本株式ファンド

追加型投信／国内／株式／特殊型(その他型(テクニカル運用モデル型))

当初設定日 : 2011年11月28日

作成基準日 : 2020年7月31日

### ファンドマネージャーのコメント

#### 【市場動向】

国内株式市場は、下落しました。

月前半は、香港国家安全維持法による米中対立悪化懸念や国内の新型コロナウイルス感染拡大などにより下落する場面はあったものの、米中経済指標の改善や新型コロナウイルスワクチンの開発報道などから上昇しました。月後半は、米国の4-6月期実質GDP(国内総生産)の落ち込みや、月末にかけて円高・米ドル安が進行したこと、国内企業の決算がコロナウイルスの影響で低調であったこと、国内の新型コロナウイルスの感染者数が連日で過去最高を更新するなど全国的な広がりを見せたことなどから市場心理が悪化し、下落しました。

#### 【運用実績】

当月の投資行動は買い越しとなり、当月末の株式組入比率は前月末比上昇しました。

月間の基準価額騰落率はマイナスとなりました。

株価の底入れ後の相場上昇局面をとらえることを目的として投資するロボット4、短期的な株価の下押し局面を狙って投資するロボット6などがマイナスに影響しました。

種類	特徴	運用コメント
ロボット1	直近の最高値を更新した銘柄を狙って投資	直近高値を更新した銘柄で買いサインが発生しました。 当月の基準価額騰落寄与: マイナス(▲0.15%) (主な売買銘柄) デンソー
ロボット3	株価が大幅に下落した後の反発局面で投資	買いサインの発生はありませんでした。 当月の基準価額騰落寄与: マイナス(▲0.13%)
ロボット4	株価の底入れ後の相場上昇局面をとらえることを目的として投資	株価が底入れしたと判断した銘柄で買いサインが発生しました。 当月の基準価額騰落寄与: マイナス(▲0.71%) (主な売買銘柄) 三越伊勢丹ホールディングス
ロボット5	短期的な株価の反発局面を狙い逆張り投資	大幅下落が生じた銘柄で買いサインが発生しました。 当月の基準価額騰落寄与: マイナス(▲0.20%) (主な売買銘柄) 日産自動車
ロボット6	株価の短期的な下押し局面をとらえて投資	短期的に株価が下押しした銘柄で買いサインが発生しました。 当月の基準価額騰落寄与: マイナス(▲0.28%) (主な売買銘柄) Zホールディングス

※ 各ロボットの基準価額騰落寄与は、概算値であり、実際の基準価額の変動を正確に説明するものではありません。あくまで傾向を知るための目安としてご覧ください。

※ 各ロボットの運用コメントはマザーファンドについて記載しています。

<本資料のお取扱いにおけるご留意点>を必ずお読みください。

## ART テクニカル運用日本株式ファンド

追加型投信／国内／株式／特殊型(その他型(テクニカル運用モデル型))

当初設定日 : 2011年11月28日

作成基準日 : 2020年7月31日

### ファンドの特色

1. 主として「ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド」への投資を通じて、複数の投資判断モデル(以下「ロボット」といいます。)を使ってわが国の株式に投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。
2. ファンドは、日経平均株価に採用されている銘柄の中から、予めプログラムされた各ロボットの投資判断基準をもとに、上昇局面と判断される銘柄を組み入れ、機動的に運用を行います。株式の実質投資割合は、大きく変動しゼロとなる場合もあります。

### 投資リスク

#### 《基準価額の変動要因》

- 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。  
従って、**投資者の皆様は投資元本は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。**
- **信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に戻属します。**
- **投資信託は預貯金と異なります。**

#### 【株価変動リスク】

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

#### 【信用リスク】

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### 【その他のリスク】

ファンドは、複数の投資判断モデルを使って機動的な運用を行いますが、市場環境等によってはモデルが十分に機能せず、基準価額の下落要因となる場合があります。

※ 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》

- 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及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、分配金の一部又は全部が、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小さかった場合も同様です。
- 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。

<本資料のお取扱いにおけるご留意点>を必ずお読みください。

## ART テクニカル運用日本株式ファンド

追加型投信／国内／株式／特殊型(その他型(テクニカル運用モデル型))

当初設定日 : 2011年11月28日

作成基準日 : 2020年7月31日

## お申込みメモ

- 購入単位 … 販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 購入価額 … 購入申込受付日の基準価額とします。  
(基準価額は1万口当たりで表示しています。)
- 換金単位 … 販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 換金価額 … 換金申込受付日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額とします。
- 換金代金 … 原則として、換金申込受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
- 申込締切時間 … 原則として、販売会社の営業日の午後3時までとします。
- 換金制限 … ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 購入・換金申込受付の中止及び取消し … 取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。
- 信託期間 … 無期限(2011年11月28日設定)
- 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(繰上償還)させることができます。  
・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合  
・ファンドを償還することが受益者のために有利であると認める場合  
・やむを得ない事情が発生した場合
- 決算日 … 毎年11月25日(休業日の場合は翌営業日)です。
- 収益分配 … 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
- 課税関係 … 課税上は株式投資信託として取り扱われます。  
公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度及び未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。  
なお、配当控除あるいは益金不算入制度の適用はありません。

## 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

購入申込受付日の基準価額に**3.3%(税抜3.0%)を上限**として販売会社が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

換金申込受付日の基準価額に**0.3%**の率を乗じて得た額を、換金時にご負担いただきます。

## 《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)

純資産総額に対して**年率1.54%(税抜1.4%)**

## ■ その他の費用・手数料

監査費用、有価証券の売買・保管、信託事務に係る諸費用、マザーファンドの解約に伴う信託財産留保額等をその都度(監査費用は日々)、ファンドが負担します。これらの費用は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※ 上記の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、上限額等を事前に示すことができません。

※ 詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「お申込みメモ」、「ファンドの費用・税金」をご覧ください。

## ART テクニカル運用日本株式ファンド

追加型投信／国内／株式／特殊型(その他型(テクニカル運用モデル型))

当初設定日 : 2011年11月28日

作成基準日 : 2020年7月31日

### 委託会社・その他の関係法人の概要

- 委託会社 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(ファンドの運用の指図を行う者)  
 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第347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  
 ホームページ : <https://www.smtam.jp/>  
 フリーダイヤル : 0120-668001 受付時間 9:00~17:00 [土日・祝日等は除く]
- 受託会社 三井住友信託銀行株式会社(ファンドの財産の保管及び管理を行う者)

### 販売会社

商号等		登録番号	加入協会			
			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
株式会社北都銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第10号	○			
三井住友信託銀行株式会社 ※	登録金融機関	関東財務局長(登金)第649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	○		○	○
岡三証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第53号	○	○		○
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第165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	○	○	○	○

※ 2018年10月1日以降、新規の買付けを停止しており、換金のみのお受付となります。

(ただし、累積投資コースの分配金再投資は引き続き行われます。)

- ・ お申込み、投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は、販売会社へお申し出ください。
- ・ 販売会社は今後変更となる場合があります。

<本資料のお取扱いにおけるご留意点>を必ずお読みください。