



DIAMコア資産設計ファンド（堅実型／積極型）
愛称：まもラップ（堅実型／積極型）
 追加型投信／内外／資産複合

基準価額の下値目安値の改定および足元の運用状況について

1. 基準価額の下値目安値の改定について

2017年7月12日から2017年10月11日までの下値目安値は下記の通りとなります。

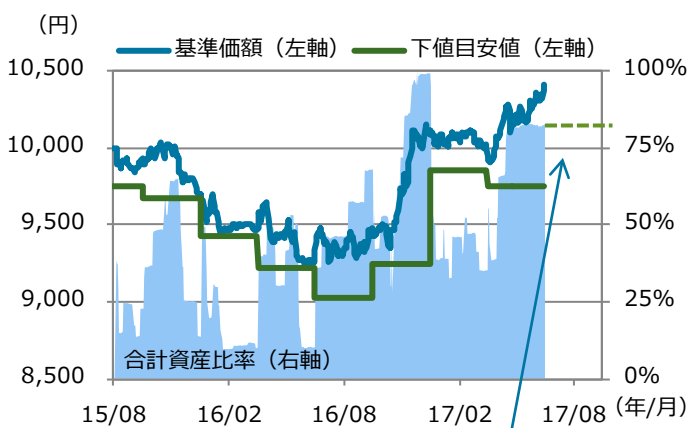
	堅実型	積極型
下値目安値 (2017年7月12日～2017年10月11日)	10,145 円	9,843 円
下値目安値の水準 改定日の基準価額に対する水準	-2.5%	-3.5%

※下値目安値は基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。
 ※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

運用実績（期間：2015年8月27日～2017年7月11日*）

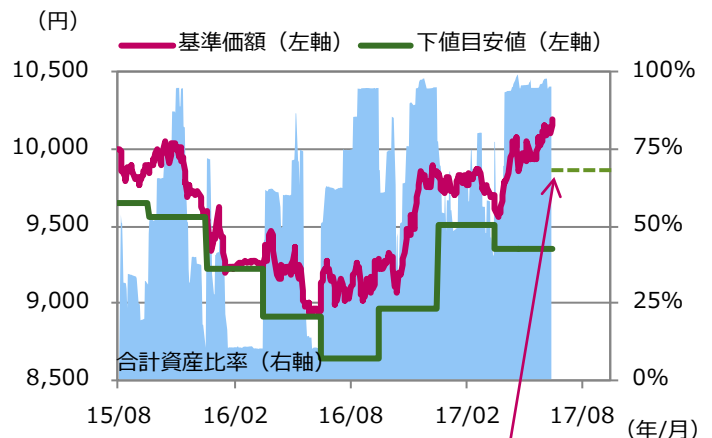
*2017年7月12日～2017年10月11日は下値目安値のみ表示

堅実型



下値目安値：10,145円
(2017年7月12日～2017年10月11日)

積極型



下値目安値：9,843円
(2017年7月12日～2017年10月11日)

(設定日：2015年8月28日)

※設定来の分配金はありません。※基準価額は設定日前日を10,000円として計算しています。※基準価額は信託報酬控除後です。なお、信託報酬率は「お客様にご負担いただく費用について」をご覧ください。※上記は過去の実績であり、将来の運用成果等をお約束するものではありません。※下値目安値は基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。※合計資産比率は純資産総額に対する各マザーファンド評価額の合計の割合です。

※P5の「当資料のお取り扱いについてのご注意」をご確認ください。



アセットマネジメントOne

商号等 / アセットマネジメントOne株式会社
 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第324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

2. 足元の運用状況について（期間：2017年4月12日～2017年7月11日）

■ 当期は、シリアや北朝鮮情勢の緊迫化などの地政学的リスクが高まったことを背景として、株式市場は世界的に下落して始まりました。その後、トランプ政権とロシアを巡る疑惑の強まりが下落要因となったものの、フランス大統領選でマクロン氏が当選し市場に安心感が広がったことなどから株式市場は世界的に上昇しました。なお、債券市場は、6月下旬までは弱めのインフレ指標が相次いだことなどを背景にして期初に比べて債券利回りは低下していましたが、各国中銀関係者が相次いで金融政策の正常化に前向きな発言をしたことなどから、期末にかけて欧州を中心に世界的に債券利回りは上昇しました。

堅実型

前回の下値目安値の改定直後における当ファンドの合計資産比率は約55%でした。4月下旬にかけて基準価額が下落したことから合計資産比率を約38%まで引き下げました。その後は期末にかけて基準価額が上昇基調で推移したため、5月中旬にかけて合計資産比率を約82%まで引き上げ、それを期末まで維持しました。

この結果、2017年4月11日から2017年7月11日までの期間で基準価額は4.05%の上昇となりました。

積極型

前回の下値目安値の改定直後における当ファンドの合計資産比率は約78%でした。4月下旬にかけて基準価額が下落したことから合計資産比率を約54%まで引き下げました。その後基準価額が短期的に大幅に上昇したことから5月上旬には合計資産比率をほぼフルインベストメントの約95%まで引き上げ、その後も基準価額は上昇基調で推移したことから合計資産比率約95%を期末まで維持しました。

この結果、2017年4月11日から2017年7月11日までの期間で基準価額は5.25%の上昇となりました。

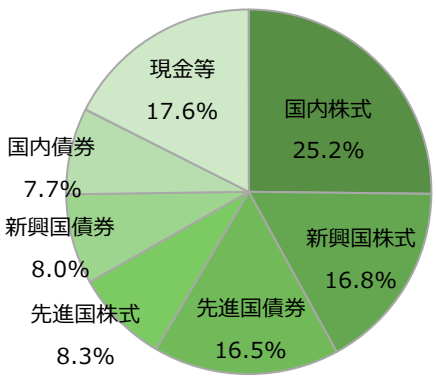
騰落率（税引前、基準日：2017年7月11日）

	1か月	3か月	6か月	1年	設定来
堅実型	2.12%	4.05%	2.91%	12.38%	4.05%
積極型	2.48%	5.25%	3.51%	13.89%	2.00%

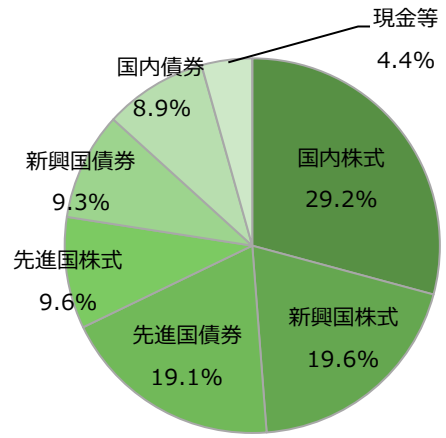
※1 設定来の分配金はありません。※2 上記は過去の実績であり、将来の運用成果等をお約束するものではありません。
※3 各期間は、基準日から過去に遡っています。また設定来の騰落率については、設定当初の投資元本を基に計算しています。

ポートフォリオ構成（基準日：2017年7月11日）

堅実型



積極型



※1 組入比率は純資産総額に対する割合です。※2 現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をあらわします。※3 国内債券：国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式：国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、先進国債券：外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、先進国株式：外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、新興国債券：エマーゼンク債券パッシブ・マザーファンド、新興国株式：エマーゼンク株式パッシブ・マザーファンド ※4 端数の関係上、合計が100%とならない場合があります。

ファンドの特色(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

- 国内外の6資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
 - ・主として、日本、先進国および新興国の債券・株式に以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
 - 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、
 - 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、
 - エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド
 - ・実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円で為替ヘッジを行いません。
 - ・6資産の配分比率(以下、基本配分比率とします。)は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。
 - 基準価額の下落を一定水準(下値目安値(*))までに抑えることを目標とします。
 - ・基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(以下、合計資産比率とします。)を機動的に変更します。
 - ・下値目安値は、3ヵ月毎に改定します(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には翌営業日。)
 - (*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)
 - 下値目安値の異なる堅実型と積極型から選択できます。なお、2ファンド間でスイッチングが可能です。
 - ・各ファンドの下値目安値は、以下の通りとします。ただし、委託会社の判断により今後変更する場合があります。
 - (堅実型) 改定日の基準価額の-2.5%、(積極型) 改定日の基準価額の-3.5%
- ※ 基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。
- 資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資リスクと費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の主な変動要因により、基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。当ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。また、投資信託は預貯金と異なりです。

なお、基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。その他の留意点など、くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

- 資産配分リスク…………… ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。
 ファンドは現金等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行いますが、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。
- 株価変動リスク…………… ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。
- 金利リスク…………… 一般的に金利が上昇すると債券の価格は下落します。ファンドは、実質的に債券に投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。
- 為替リスク…………… ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。
- 信用リスク…………… ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。
- 流動性リスク…………… ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることもあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。
- カントリーリスク…………… ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

当ファンドへの投資に伴う主な費用は購入時手数料、信託報酬などです。

費用の詳細につきましては、当資料中の「お客様にご負担いただく費用について」および投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

お申込みメモ(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

購入単位	各販売会社が定める単位(当初元本:1口=1円)
購入価額	お申込日の翌営業日の基準価額とします。
購入代金	お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに購入代金を販売会社に支払うものとします。
換金単位	各販売会社が定める単位
換金価額	換金のお申込日の翌営業日の基準価額とします。
換金代金	原則として換金のお申込日より起算して5営業日目から支払います。
申込締切時間	原則として販売会社の毎営業日の午後3時までとします。
購入・換金不可日	ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日には、購入・換金・スイッチングのお申込みの受付を行いません。
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。
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があるときは、購入・換金・スイッチングのお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入・換金・スイッチングのお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	無期限です。(設定日:2015年8月28日)
繰上償還	次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了する場合があります。 ① 信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合。 ② 各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回るようになった場合。 ③ マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合。 ④ やむを得ない事情が発生した場合。
決算日	原則として毎年4月、10月の各11日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年2回、毎決算日に収益分配方針に基づき、収益分配を行います。 ※「分配金受取コース」の場合、決算日から起算して原則として5営業日までにお支払いを開始します。 ※「分配金自動けいぞく投資コース」の場合、税引後、無手数料で自動的に全額が再投資されます。
スイッチング	(堅実型)(積極型)の2つのファンド間でスイッチングができます。 スイッチングとは、すでに保有しているファンドを換金すると同時に他のファンドの購入の申込みを行うことをいい、ファンドの換金代金が購入代金に充当されます。 スイッチングの際には、税金および各販売会社が定める手数料がかかる場合があります。 ※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。
課税関係	課税上は、株式投資信託として取り扱われます。 原則として、分配時の普通分配金ならびに換金時の値上がり益および償還時の償還差益に対して課税されます。 ※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。 ※税法が改正された場合等には、上記内容が変更となる場合があります。

お客様にご負担いただく費用について(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

以下の手数料等の合計額等については、保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

詳細については、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

※税法が改正された場合等には、税込手数料等が変更となる場合があります。

●購入時

購入時手数料	購入価額に3.24%(税抜3.0%)を上限として 各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。 ※くわしくは販売会社にお問い合わせください。
スイッチング手数料	スイッチングによるお申込日の翌営業日の基準価額に3.24%(税抜3.0%)を上限として 各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。 ※くわしくは販売会社にお問い合わせください。

●換金時

換金手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

●保有期間中(信託財産から間接的にご負担いただきます。)

運用管理費用(信託報酬)	信託財産の純資産総額に対して年率1.134%(税抜1.05%) を日々ご負担いただきます。
その他費用・手数料	組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用、外国での資産の保管等に要する諸費用等が信託財産から支払われます。(その他費用・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、上限額等を表示することができません。)

※上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

投資信託ご購入の注意

投資信託は、

- ① 預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ② 購入金額については元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ③ 投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

当資料のお取扱いについてのご注意

- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が作成した販売用資料です。
- お申込みに際しては、販売会社からお渡しする投資信託説明書（交付目論見書）の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。
- 当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が信頼できると判断したデータにより作成しておりますが、その内容の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また掲載データは過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 当資料に記載されている運用実績は税引前分配金を再投資したものとする基準価額の変化を示したものであり、税金および手数料は計算に含まれておりません。
- 当資料における内容は作成時点（2017年7月11日）のものであり、今後予告なく変更される場合があります。
- 当ファンドは、実質的に債券、株式等の値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります）に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者にかかる信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

◆分配金に関する留意点◆

○収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、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。

○受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、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。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

○分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、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。

◆委託会社およびファンドの関係法人 ◆

<委託会社>アセットマネジメントOne株式会社
 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第324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

<受託会社>みずほ信託銀行株式会社
 <販売会社>販売会社一覧をご覧ください
 <投資顧問会社>みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

◆委託会社の照会先 ◆

アセットマネジメントOne株式会社
 コールセンター 0120-104-694
 （受付時間：営業日の午前9時～午後5時）
 ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

販売会社（お申込み、投資信託説明書（交付目論見書）のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください）

○印は協会への加入を意味します。 2017年7月11日現在

商号	登録番号等	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	備考
GMOクリック証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第77号	○		○	○	
高木証券株式会社	金融商品取引業者 近畿財務局長（金商）第20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	○	○	○		

●その他にもお取扱いを行っている販売会社がある場合があります。

また、上記の販売会社は今後変更となる場合があるため、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

<備考欄について>

※1 新規募集の取扱いおよび販売業務を行っておりません。

※2 備考欄に記載されている日付からのお取扱いとなりますのでご注意ください。

※3 備考欄に記載されている日付からお取扱いを行いませんのでご注意ください。

（原則、金融機関コード順）

販売会社（お申込み、投資信託説明書（交付目論見書）のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください）

以下は取次販売会社です。

2017年7月11日現在

○印は協会への加入を意味します。

商号	登録番号等	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	備考
埼玉縣信用金庫	登録金融機関 関東財務局長（登金）第202号	○				
柏崎信用金庫	登録金融機関 関東財務局長（登金）第242号					
大阪信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長（登金）第45号					
奈良中央信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長（登金）第72号					
尼崎信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長（登金）第39号	○				