

ユーロ・ボンド・ポート

追加型投信 / 海外 / 債券

月次運用レポート

2012年5月

商品の特色(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)

当ファンドは、インカム・ゲインの確保およびキャピタル・ゲインの獲得により信託財産の成長をはかることを目的として運用を行います。

- ユーロ建債券および英ポンド建債券に分散投資します。
シティグループ欧州世界国債インデックス(円ベース)をベンチマークとします。
運用にあたってはDIAM International Ltdの運用アドバイス・情報を参考にします。
- 高格付(AA-格相当以上)の債券に限定して投資します。
- 3ヵ月毎に決算を行い、収益を分配することをめざします。
3ヵ月毎(3月、6月、9月および12月の各26日。休業日の場合は翌営業日。)に決算を行い、原則として基準価額水準にかかわらず利子・配当等収益を分配することをめざします。
将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。
分配金が支払われない場合もあります。
- 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ます。

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。

- 為替リスク 為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落(円高)になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落(円高)度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、当ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。
- 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。当ファンドは、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。
- 信用リスク 信用リスクとは、公社債および短期金融商品の発行者が、経営不振、その他の理由により利息や償還金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る(債務不履行)リスクをいいます。一般に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、当該公社債等の価格は下落(価格がゼロになることもあります。)し、当ファンドの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。

ファンドの関係法人

- < 委託会社 > DIAMアセットマネジメント株式会社
- < 受託会社 > 株式会社りそな銀行
- < 販売会社 > 販売会社一覧をご覧ください
- < 投資顧問会社 > DIAM International Ltd

委託会社の照会先

- DIAMアセットマネジメント株式会社
- コールセンター 0120-506-860
(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.diam.co.jp/>

当資料は5枚ものです。P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」を必ずご確認ください。

設定・運用は

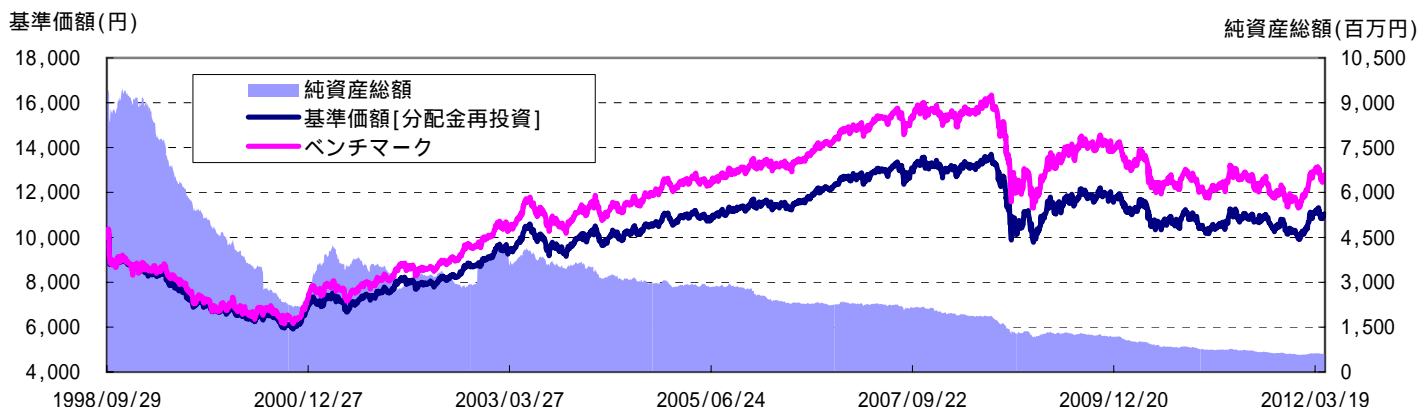
DIAMアセットマネジメント



- 商号等: DIAM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324号
- 加入協会: 社団法人投資信託協会
社団法人日本証券投資顧問業協会

ユーロ・ボンド・ポート
追加型投信 / 海外 / 債券
月次運用レポート (2012年5月)

運用実績の推移



(設定日：1998年9月30日)

基準価額[分配金再投資]は、税引前の分配金を再投資したものと計算していますので、実際の基準価額とは異なります。
 基準価額[分配金再投資] = 前日基準価額[分配金再投資] × (当日基準価額 ÷ 前日基準価額) (決算日の当日基準価額は税引前分配金込み)
 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。
 当ファンドのベンチマークはシティグループ欧州世界国債インデックス(円ベース)であり、1998年9月29日の値を10,000として指数化して表示しています。
 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。

基準価額・純資産総額	
基準価額	7,152 円
解約価額	7,138 円
純資産総額	608 百万円

分配金情報 (税引前)				直近3年分	
第43期 (2009.06.26)	35 円	第49期 (2010.12.27)	35 円		
第44期 (2009.09.28)	35 円	第50期 (2011.03.28)	35 円		
第45期 (2009.12.28)	35 円	第51期 (2011.06.27)	35 円		
第46期 (2010.03.26)	35 円	第52期 (2011.09.26)	35 円		
第47期 (2010.06.28)	35 円	第53期 (2011.12.26)	35 円		
第48期 (2010.09.27)	35 円	第54期 (2012.03.26)	35 円		
		累計分配金	3,391 円		

- 1 分配金は1万口当たり
- 2 上記の分配金は過去の実績であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 3 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

ポートフォリオ構成	
実質組入比率	94.2 %
内現物等組入比率	94.2 %
内先物等組入比率	0.0 %
現金等比率	5.8 %
組入銘柄数	14

比率は純資産総額に対する割合です。

ポートフォリオの状況	
平均複利回り	1.40%
平均クーポン	4.28%
平均残存期間	8.62
修正デュレーション	6.39

純資産総額を基に計算しています。

騰落率 (税引前分配金再投資)

	1ヵ月 (2012/03/30)	3ヵ月 (2012/01/31)	6ヵ月 (2011/10/31)	1年 (2011/04/28)	2年 (2010/04/30)	3年 (2009/04/30)
当ファンド	-1.57%	7.60%	1.93%	-2.24%	-4.30%	-3.42%
ベンチマーク	-1.72%	8.17%	5.36%	-2.58%	-5.93%	-4.29%
差	0.15%	-0.57%	-3.42%	0.34%	1.63%	0.88%

- 1 当ファンド騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しておりますので、実際の投資家利回りとは異なります。
- 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。

当資料は5枚ものです。

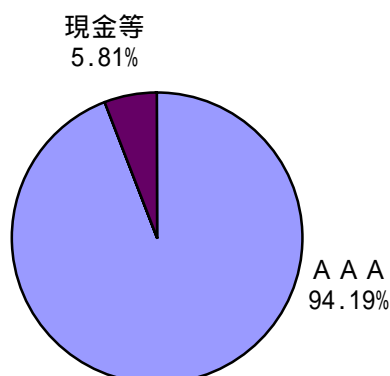
P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。

設定・運用は
DIAMアセットマネジメント



ユーロ・ボンド・ポート
追加型投信 / 海外 / 債券
月次運用レポート (2012年5月)

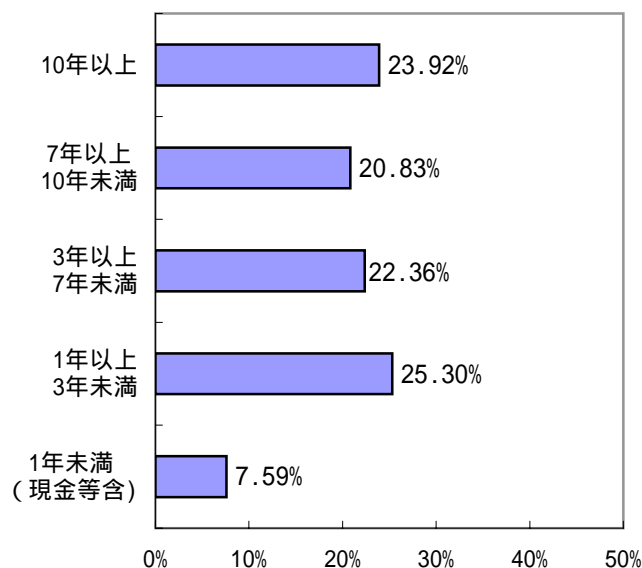
格付別構成



格付については、海外格付機関（S&PおよびMoody's）による上位のものを採用しています。また、+・-等の符号は省略し、S&Pの表示方法にあわせて表記しています。

比率は純資産総額に対する割合です。

残存年限別配分



比率は純資産総額に対する割合です。

通貨別配分

No	通貨名	組入比率
1	ユーロ	89.54%
2	イギリス・ポンド	4.65%

比率は純資産総額に対する割合です。

国別配分

No	発行国	組入比率
1	ドイツ	56.47%
2	フランス	21.50%
3	フィンランド	9.79%
4	英国	4.65%
5	オランダ	1.78%

比率は純資産総額に対する割合です。

組入上位10銘柄

No	銘柄	セクター	クーポン	償還日	国名	通貨	格付	組入比率(%)
1	DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	国債	4.25%	2014/07/04	ドイツ	ユーロ	AAA	15.36
2	DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	国債	3.25%	2020/01/04	ドイツ	ユーロ	AAA	10.50
3	FRANCE OAT 8.25 04/25/22	国債	8.25%	2022/04/25	フランス	ユーロ	AAA	10.33
4	BUNDESobl 2.5 02/27/15	国債	2.50%	2015/02/27	ドイツ	ユーロ	AAA	9.94
5	FINLAND 4.25 07/04/15	国債	4.25%	2015/07/04	フィンランド	ユーロ	AAA	9.79
6	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債	5.50%	2031/01/04	ドイツ	ユーロ	AAA	8.96
7	FRANCE OAT 3.75 04/25/17	国債	3.75%	2017/04/25	フランス	ユーロ	AAA	6.36
8	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	国債	4.00%	2018/01/04	ドイツ	ユーロ	AAA	6.21
9	UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債	4.75%	2038/12/07	イギリス	英ポンド	AAA	4.65
10	DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債	4.00%	2037/01/04	ドイツ	ユーロ	AAA	3.18

1 比率は純資産総額に対する割合です。

2 格付については、海外格付機関（S&PおよびMoody's）による上位のものを採用しています。また、+・-等の符号は省略し、S&Pの表示方法にあわせて表記しています。

シティグループ欧州世界国債インデックス（円ベース）に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。

当資料は5枚ものです。

P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。

設定・運用は
DIAMアセットマネジメント



ユーロ・ボンド・ポート
追加型投信 / 海外 / 債券
月次運用レポート (2012年5月)

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から信託財産留保額を控除した価額とします。
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	ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行のいずれかの休業日に該当する日には、購入・換金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等があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入・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	無期限です。(設定日:1998年9月30日)
繰上償還	次のいずれかに該当する場合等には、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。 受益権口数が10億口を下回ることとなった場合。 受益者のために有利であると認めるとき。 やむを得ない事情が発生したとき。
決算日	原則として3月26日、6月26日、9月26日および12月26日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年4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。 「分配金再投資コース」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。
課税関係	当ファンドは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。 税法が改正された場合等には、上記内容が変更となることがあります。

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。

購入時	
購入時手数料	購入価額に2.1%(税抜2.0%)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	換金申込日の翌営業日の基準価額に0.2%を乗じて得た額とします。
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1.05%(税抜1.0%)を日々ご負担いただきます。
その他費用・手数料	組入る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。)

当資料は5枚ものです。
P.5の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。

設定・運用は
DIAMアセットマネジメント



ユーロ・ボンド・ポート
追加型投信 / 海外 / 債券
月次運用レポート (2012年5月)

投資信託ご購入の注意

投資信託は、

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。

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。

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、DIAMアセットマネジメント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DIAMアセットマネジメント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、その情報の完全性、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(2012年5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、債券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となります。

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。

2012年5月11日現在

商号	登録番号等	日本証券業協会	社団法人日本証券投資顧問業協会	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
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					
みずほ証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第94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					
SMB C日興証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第2251号					
水戸証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第181号					
株式会社みずほ銀行	登録金融機関 関東財務局長(登金)第3号					1
株式会社証券ジャパン	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第170号					1

その他にもお取扱いを行っている販売会社があります。

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)

「ユーロ・ボンド・ポート」が、
リップラー・ファンド・アワード・ジャパン2012 において
「最優秀ファンド」(債券型 欧州(評価期間:5年))を受賞しました。



「リップラー・ファンド・アワード・ジャパン2012」は、世界19都市で開催している「Lipper Fund Awards」プログラムの一環として行われ、日本において販売登録されている国内および外国籍ファンドを対象に、優れたファンドとその運用会社を選定し、表彰するものです。選定/評価に際しては、リップラー独自の投資信託評価システム「リップラー リーダー レーティングシステム(リップラー リーダーズ、Lipper Leaders)」の中の「コンシスタントリターン(収益一貫性)」を用いています。リップラー・ファンド・アワードに関する情報は、投資信託の売買を推奨するものではありません。リップラー・ファンド・アワードは、過去のファンドのパフォーマンスを分析したものであり、過去のパフォーマンスは将来の結果を保証するものではありません。評価結果は、リップラーが信頼できると判断した出所からのデータおよび情報に基づいていますが、その正確性、完全性等について保証するものではありません。

なお、評価対象ファンドは、日本国内で販売されているファンドのうち、2011年末時点で36カ月以上の運用実績のあるファンドです。(c) Thomson Reuters 2012. All rights reserved.

当資料は5枚ものです。

設定・運用は

DIAMアセットマネジメント

