

2016年5月9日

受益者の皆様へ

DIAMアセットマネジメント株式会社

当社ファンドの基準価額下落について

当社が設定するファンドのうち以下のファンドの基準価額が大きく下落いたしましたので、お知らせいたします。

1. 基準価額および下落率（5月9日現在）

ファンド名	基準価額(円)	前日比(円)	下落率
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型） 豪ドルコース	9,550	▲ 683	▲ 6.67%
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型） トルコリラコース	7,724	▲ 552	▲ 6.67
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型） メキシコペソコース	8,235	▲ 558	▲ 6.35%
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分 配型）＜豪ドルコース＞	8,185	▲ 444	▲ 5.15%

当資料は4枚ものです。P.4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。

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：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. 市場の動向

(1) 国内株式

4月28日から5月6日にかけての国内株式市場は大きく下落しました。4月28日に日銀が追加緩和を見送ったことを受けた円高の地合いの中、28日から29日にかけて発表された米国経済指標が市場予想を下回ったことや、29日に米国財務省が発表した外国為替報告書において不公正な為替政策の可能性があるとする「為替監視リスト」に日本が含まれたことにより、為替介入などによる短期的な円安期待が後退したことから、円高米ドル安が一段と進行しました。この流れを受け、2日の国内株式市場は全面的に売られる展開となって大幅に下落し、6日の国内株式市場も小幅続落となりました。

【国内株主要指数の騰落率】

指数	終値 (5月6日)	4月28日比	騰落率
東証株価指数(TOPIX)	1,298.32	▲ 42.23	▲ 3.15%

※1 基準価額への反映を考慮して5月6日の値および4月28日比の騰落率を表示しております。

※2 Bloomberg のデータを基にD I AMアセットマネジメント作成。

(2) ハイブリッド証券

4月28日から5月6日にかけてのハイブリッド証券市場は小動きとなりました。世界的に株式市場が下落したこと等から、ハイブリッド証券の信用スプレッドは拡大傾向となり、ハイブリッド証券価格の下落要因となりました。一方、世界的に国債利回りが低下傾向となったことはハイブリッド証券価格の上昇要因となりました。

(3) 為替

日銀が追加金融緩和を見送ったことを受けて為替市場では全面的に円高の展開となり、資源国通貨や新興国通貨が大きく下落しました。特に、予想外の政策金利の引き下げが行われたオーストラリアや政治的不透明感の高まったトルコなどが相対的に大きく下落しました。

※基準価額への反映を考慮して市場の動向を記載しています。

当資料は4枚ものです。P.4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。

DIAMアセットマネジメント

商号等：D I AM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：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

3. 今後の見通し

(1) 国内株式

今後の国内株式市場は、日米欧など主要国の金融政策の不透明感が市場を不安定にさせていることなどを背景に、値幅の大きい相場展開が続く可能性があると考えます。また、円高の進行により企業業績の減速懸念が強まり、弱含む展開も考えられます。

一方で、原油価格の回復基調が続いていること、年明け以降続いてきた外国人投資家による日本株の売り越しが4月以降一服していることなど、好材料も見られます。政治的にも、消費増税見送りの観測が強まっているほか、今月に主要国首脳会議（伊勢志摩サミット）、7月に参院選が予定され、財政出動への期待が高まっており、企業業績に対しても過度に悲観的な見通しを持つ必要はないものと考えます。国内株式市場は、暫くは不安定な展開が続く弱含む可能性もありますが、徐々に落ち着きを取り戻すものと考えます。

(2) ハイブリッド証券

世界経済の先行き不透明感は払拭されておらず、金融市場ではリスク回避的な動きが当面出やすい状況が続くと見られ、ハイブリッド証券市場も不安定な値動きとなる可能性があります。しかし中長期的には、主要金融機関は自己資本比率を高める等バランスシートの強化を進めていること、主要先進国の国債利回りが低位で推移する中、相対的に高い利回りを享受できるハイブリッド証券に対する投資家の潜在需要が根強いと考えられること等から、ハイブリッド証券市場は国債市場を上回る投資リターンを確保すると予想します。

(3) 為替

米国での政策金利の引き上げは緩やかなペースになると見られる中、中国景気の減速懸念の後退や原油価格の落ち着きなどが、資源国通貨や新興国通貨を当面下支えするものと見られます。一方で、世界景気の減速兆候や米国の早期利上げ警戒が高まる局面では、市場が不安定な動きとなり、新興国通貨の上値を抑える可能性も考えられます。

以上

- ※ 前記の市場の動向は、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。また、今後の見通しは、作成時点のものであり、将来の市場環境の変動等により変更される場合があります。
- ※ 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（株東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

当資料は4枚ものです。P.4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。

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：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

[お申込みに際しての留意事項]

●投資信託に係るリスクについて

投資信託は、主に国内外の株式・公社債および不動産投信(リート)等の値動きのある証券を投資対象とし投資元本が保証されていないため、当該資産の市場における取引価格の変動や為替の変動等により投資一単位当たりの価値が変動します。従ってお客様のご投資された金額を下回ることもあります。

また、投資信託は、個別の投資信託毎に投資対象資産の種類や投資制限、取引市場、投資対象国等が異なることから、リスクの内容や性質が異なりますので、ご投資に当たっては投資信託説明書(交付目論見書)をよくご覧下さい。

●投資信託に係る費用について

ご投資頂くお客様には以下の費用をご負担いただきます。

■ お客様が直接的に負担する費用

購入時手数料： 上限 3.78% (税込)

信託財産留保額： 上限 0.5%

■ お客様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)： 上限 年率 2.6824% (税込)

■ その他費用・手数料

上記以外に保有期間等に応じてご負担頂く費用があります。

投資信託説明書(交付目論見書)等でご確認下さい。

※ 上記に記載しているリスクや費用項目につきましては、一般的な投資信託を想定しております。費用の料率につきましては、DIAMアセットマネジメント株式会社が運用するすべての投資信託のうち、徴収する夫々の費用における最高の料率を記載しております。

※ 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。

[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ものです。

○当資料は情報提供を目的とするものであり、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。

○投資信託は、株式・債券および不動産投信(リート)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係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。

○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。

○当資料における内容は作成時点(2016年5月9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。

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。

当資料は4枚ものです。P.4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。

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：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

お取引にあたっての手数料等およびリスクについて

手数料等およびリスクについて

- 株式等の売買等にあたっては、「ダイワ・コンサルティング」コースの店舗（支店担当者）経由で国内委託取引を行う場合、約定代金に対して最大 1.24200%（但し、最低 2,700 円）の委託手数料（税込）が必要となります。また、外国株式等の外国取引にあたっては、現地諸費用等を別途いただくことがあります。
- 株式等の売買等にあたっては、価格等の変動による損失が生じるおそれがあります。また、外国株式等の売買等にあたっては価格変動のほかに為替相場の変動等による損失が生じるおそれがあります。
- 信用取引を行うにあたっては、売買代金の 30%以上で、かつ 30 万円以上の委託保証金が事前に必要です。信用取引は、少額の委託保証金で多額の取引を行うことができることから、損失の額が差し入れた委託保証金の額を上回るおそれがあります。
- 債券を募集・売出し等により、又は当社との相対取引により売買する場合は、その対価（購入対価・売却対価）のみを受払いいただきます。円貨建て債券は、金利水準の変動等により価格が上下し、損失を生じるおそれがあります。外貨建て債券は、金利水準の変動に加え、為替相場の変動等により損失が生じるおそれがあります。また、債券の発行者または元利金の支払いを保証する者の財務状況等の変化、およびそれらに関する外部評価の変化等により、損失を生じるおそれがあります。
- 投資信託をお取引していただく際に、銘柄ごとに設定された販売手数料および信託報酬等の諸経費、等をご負担いただきます。また、各商品等には価格の変動等による損失を生じるおそれがあります。

ご投資にあたっての留意点

- 取引コースや商品毎に手数料等およびリスクは異なりますので、上場有価証券等書面、契約締結前交付書面、目論見書、等をよくお読みください。
- 外国株式、外国債券の銘柄には、我が国の金融商品取引法に基づく企業内容の開示が行われていないものもあります。

商号等 : 大和証券株式会社 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第108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