

2016年6月24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別紙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. 市場の動向

(1) 国内株式

24日の国内株式市場は大きく下落しました。英国時間23日に実施されたEU(欧州連合)離脱の是非を問う国民投票の開票が行われ、離脱支持の優勢が伝えられるにつれて市場ではリスク回避の動きが強まる展開となりました。離脱派の多数が確定すると、市場ではリスク回避の動きが急加速して大混乱の様相となり、先物市場では日経平均先物の取引でサーキットブレーカーが発動して取引が一時停止されたほか、為替市場では円高が加速しドル/円は一時2013年11月以来の100円割れとなる1ドル=99円台を付けました。国内株式市場は、欧州関連株を中心に全面的に売られる展開となり、日経平均株価の終値は前日比1,286.33円安(▲7.92%)と約16年ぶりの下げ幅となりました。

【国内株主要指数の騰落率】

指数	終値 (6月24日)	前日比	騰落率
日経平均株価	14,952.02	▲ 1,286.33	▲ 7.92 %
東証株価指数(TOPIX)	1,204.48	▲ 94.23	▲ 7.26 %
JPX 日経インデックス 400	10,869.19	▲ 856.11	▲ 7.30 %
JASDAQ INDEX	103.34	▲ 4.81	▲ 4.41 %
東証マザーズ指数	890.67	▲ 83.07	▲ 8.53 %

※Bloomberg のデータを基にDIAMアセットマネジメント作成。

当資料は6枚ものです。P.6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

160624投D313101臨時開示-1

(2) 為替

英国のEUの残留・離脱を問う国民投票の開票が進む中、離脱へ警戒感が高まったことから、英ポンドとユーロが米ドルおよび円に対して大きく乱高下しました。更に金融市場でのリスク許容度が低下し、米ドルが対円で一時1ドル=99円台を付けるなど円高米ドル安が進行したほか、その他の主要通貨も円に対して下落しました。

2. 今後の見通し

(1) 国内株式

英国の EU 離脱 (Brexit) というリスクシナリオが現実となったことにより、欧米市場をはじめ世界各国の市場において混乱が続く可能性があります。Brexit を機にその他の国においても EU 離脱などに向けた動きが強まる懸念もあり、欧州の政治的混乱が更なる波乱要素となる可能性も想定されます。これに対し、日本をはじめ各国の政府や中央銀行は金融市場の混乱に備えた協調策をとるものと見られ、また、円高が加速するようであれば日銀が緊急の追加緩和策を打ち出すとの見方も一部にあり、市場の先行きを見通しにくい状況が続く見込みです。

こうした不透明な環境下、当面の国内株式市場は Brexit による世界経済、企業業績への影響などを見極める局面になると見られ、短期的にはボラティリティ (値動き) の高い不安定な展開となると予想されます。

(2) 為替

英国の EU 離脱は同国の経済に与える影響が小さくなく、今後は英国の政策当局の動きを見極めることとなりますが、引き続きボラティリティが高まるなど金融市場の混乱が予想されます。ただしその場合、主要国の政策当局は協調して様々な政策対応を行うことが考えられるため、市場は次第に落ち着きを取り戻し、米ドルやユーロなどの主要通貨も次第に落ち着きを取り戻すと予想されます。

以 上

当資料は6枚ものです。P.6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

- ※ 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。
- ※ 日経平均株価（日経平均）は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均自体及び日経平均を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。本商品は、DIAMアセットマネジメント株式会社の責任のもとで組成・運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、本商品を保証するものではなく、本商品に関して一切の責任を負いません。
- ※ 東証株価指数（TOPIX）及び東証マザーズ指数は、株式会社東京証券取引所（㈱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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱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、㈱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。
- ※ 「JPX 日経インデックス 400」は、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「JPXグループ」という。）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」という。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX 日経インデックス 400」自体及び「JPX 日経インデックス 400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。本商品は、DIAMアセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」及び「日経」は、その運用及び本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。「JPXグループ」及び「日経」は、「JPX 日経インデックス 400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。
- ※ JASDAQ INDEX は、(株)東京証券取引所及びそのグループ会社（以下、「東証等」という。）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・ノウハウは東証等が所有しています。なお、本商品は、東証等により提供、保証又は販売されるものではなく、東証等は、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6枚ものです。P.6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

(別紙)

ファンド名	基準価額(円)	前日比(円)	下落率
DIAM新興企業日本株オープン米ドル型	8,569	▲ 1,030	▲ 10.73%
新日鉄住金グループ株式オープン	3,968	▲ 343	▲ 7.96%
日経225ノーロードオープン	10,108	▲ 864	▲ 7.87%
たわらノーロード日経225	7,667	▲ 653	▲ 7.85%
DIAMアジア関連日本株ファンド	16,185	▲ 1,301	▲ 7.44%
JPX日経400ノーロードオープン	9,541	▲ 752	▲ 7.31%
JPX日経400インデックスファンド	10,784	▲ 849	▲ 7.30%
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	16,864	▲ 1,321	▲ 7.26%
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	17,927	▲ 1,403	▲ 7.26%
DIAMDC国内株式インデックスファンド	8,731	▲ 683	▲ 7.26%
DIAM国内株オープン	13,504	▲ 1,029	▲ 7.08%
ハイブリッド・セレクション	15,420	▲ 1,164	▲ 7.02%
証券ジャパン日本株オープン	20,085	▲ 1,504	▲ 6.97%
DIAMジャパン	12,289	▲ 920	▲ 6.96%
DIAM新興市場日本株ファンド	37,463	▲ 2,784	▲ 6.92%
ユーロ・ボンド・ポート	8,118	▲ 598	▲ 6.86%
DL日本株式オープン	7,782	▲ 572	▲ 6.85%
DIAM日本株式オープン<DC年金>	11,802	▲ 865	▲ 6.83%
IBJITMジャパン・セレクション	7,703	▲ 563	▲ 6.81%
DIAMジャパン・セレクション<DC年金>	14,808	▲ 1,079	▲ 6.79%
DIAM割安日本株ファンド	11,185	▲ 814	▲ 6.78%
DIAM新興企業日本株ファンド	11,153	▲ 809	▲ 6.76%
DIAM割安日本株ファンド(年1回決算型)	9,580	▲ 694	▲ 6.75%
みずほ日本株アクティブ・オープン	10,249	▲ 732	▲ 6.67%
DIAM日本経済成長戦略ファンド	8,194	▲ 584	▲ 6.65%
日本経済『大転換』ファンド	8,242	▲ 584	▲ 6.62%
未来変革日本株ファンド	9,096	▲ 637	▲ 6.54%
DIAM成長株オープン	12,840	▲ 880	▲ 6.41%
自然環境保護ファンド	7,951	▲ 516	▲ 6.09%
DIAMバランス・インカム・オープン(毎月分配型)	6,681	▲ 425	▲ 5.98%

当資料は6枚ものです。P.6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

ファンド名	基準価額(円)	前日比(円)	下落率
DIAM高格付インカム・オープン<DC年金>	13,062	▲ 810	▲ 5.84%
DIAM高格付インカム・オープン(毎月決算コース)	6,830	▲ 423	▲ 5.83%
DIAM高格付インカム・オープン(1年決算コース)	11,305	▲ 699	▲ 5.82%
DIAMパッシブ資産分散ファンド	8,595	▲ 530	▲ 5.81%
DIAMオーストラリアリートオープン	9,714	▲ 590	▲ 5.73%
DIAMグローバル・ボンド・ポート毎月決算コース3	7,776	▲ 466	▲ 5.65%
たわらノーロード先進国債券	8,622	▲ 515	▲ 5.64%
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	15,560	▲ 929	▲ 5.63%
グローバル・ボンド・ポート(Dコース)	10,913	▲ 651	▲ 5.63%
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	14,006	▲ 835	▲ 5.63%
グローバル・ボンド・ポート毎月決算コース(為替ヘッジなし)	7,460	▲ 444	▲ 5.62%
DIAMグローバル・ボンド・ポート毎月決算コース2	7,146	▲ 425	▲ 5.61%
DIAMDCバランス70インデックスファンド	10,402	▲ 593	▲ 5.39%
USストラテジック・インカム・アルファ毎月決算型	9,002	▲ 510	▲ 5.36%
USストラテジック・インカム・アルファ年1回決算型	9,981	▲ 562	▲ 5.33%
DIAM高金利ソブリン債券ファンド(毎月決算型)	6,331	▲ 352	▲ 5.27%
DIAM世界インカム・オープン(毎月決算コース)	7,947	▲ 431	▲ 5.14%
DIAMアジア・オセアニア・リートファンド	12,301	▲ 665	▲ 5.13%
DIAMアジアリートファンド	8,934	▲ 478	▲ 5.08%
たわらノーロードplus国内株式高配当最小分散戦略	9,002	▲ 480	▲ 5.06%

以上

当資料は6枚ものです。P.6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6月24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6枚ものです。P.6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