

2019年7月26日

## 第17回（2019年）マーサーMPAアワード受賞

- 国内株式中小型株部門（3年）で3本（ほか） -

アセットマネジメントOne株式会社（東京都千代田区、取締役社長 菅野暁、以下「AM-One」）が運用する4本の戦略が、マーサージャパン株式会社が選定する「第17回（2019年）マーサーMPAアワード」（評価基準日：2019年3月末）を受賞しました。

### <受賞部門・運用プロダクト>

- ・国内株式中小型部門（3年） 「DIAM新興市場日本株ファンド」
- ・国内株式中小型部門（3年） 「国内株式アクティブ運用（グロース）」
- ・国内株式中小型部門（3年） 「国内株式中小型アクティブ」
- ・国内債券部門（3年） 「国内債券クレジット・スプレッド」\*

\*みずほ信託銀行から年金運用再委託を受け、運用を行っているものも含まれます。

この度、国内株式中小型部門（3年）のカテゴリーで受賞した「DIAM新興市場日本株ファンド」は、東証マザーズとジャスダック等、新興市場に上場する株式を中心に投資する追加型の公募投資信託で、2007年11月に運用を開始、設定来の運用成績は+1,103.65%を誇ります。当ファンドには今回のマーサーMPAアワードのほかに、本年5月に発表された株式会社格付投資情報センター（R&I）によるファンド大賞においても、投資信託10年部門の国内中小型株式カテゴリーにおける最優秀ファンド賞を獲得するなど、さまざまな受賞歴があります。

世界的な低金利環境が継続する中、年金スポンサーをはじめとする機関投資家の資産運用において、収益獲得に対するニーズはますます高まっています。AM-Oneは、お客さまのニーズにお応えする運用ソリューションの提供に、引き続き努めてまいります。

以上

※当該評価は、過去の一定期間の実績を分析したものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。

※巻末の留意事項を必ずお読みください。

## 【マーサーMPA (Japan) アワードについて】

「マーサーMPA アワード」は、世界的な資産運用コンサルタントであるマーサーの日本法人であるマーサージャパン株式会社が、日本における企業年金、あるいは機関投資家向けのコンサルティング・サービスを提供するために、収集・管理している円ベースの運用リターンの中から、優れた結果を達成した運用プロダクトを讃えるものです。賞の名前は、マーサーで運用リターンを分析するソフトウェアの名前(MPA=Manager Performance Analytics)をとったものです。

### マーサーMPAアワードの評価方法と表彰対象について

企業年金運用における主要なカテゴリー毎に5年あるいは3年で、トータル・リターンと代表的なインデックスに対するインフォメーション・レシオをそれぞれ基準化した数字を合計し、カテゴリー内の上位 10%(但し、最大8プロダクトまで)あるいは上位3位のファンドの多い方を選定しています(なお、国内株中小型、国内債券と外国債券はトータル・リターンのみ)。表彰対象とする運用プロダクトは、マーサーが管理する運用パフォーマンス・ユニバースに選定基準日時点で登録されているプロダクトのうち、日本国内に拠点を持つ会社が提供する運用プロダクトとし、その中で、マーサーが予め定めた基準(受賞意思の表明、カテゴリーの特性、最低資産額、実際の運用でのリターン、国内拠点の存在)に合致したプロダクトとしています。それゆえ、マーサーの運用パフォーマンス・ユニバース中には、受賞プロダクトよりも優れた運用パフォーマンスを挙げながらも受賞基準を満たさないことから受賞していない運用プロダクトがある場合があります。

(注) マーサーMPAアワードは過去の定量結果だけによる表彰であり、マーサーがマーサーの顧客に運用商品を推薦する場合に利用する定性評価とは何の関係もないものです。運用商品のリターン・データは運用報酬控除前であり、顧客が利用する際には、運用報酬の違いを考慮する必要がありますので、表彰対象と同じ期間に表彰された運用商品を使っている場合、表彰と同一の結果を得られるわけではありません。また、表彰に利用した評価基準が適切な方法であると保証するものではなく、表彰のために使ったデータや計算が正しいものであると保証するものでもありません。マーサーはこのアワードを受けた運用会社について何の保証をするものでも責任を持つわけではありません。過去の実績は将来のリターンを保証するものではありません。

詳細は、右記URL をご覧ください。 <https://www.mercer.co.jp/newsroom/2019-mpa-awards.html>

## 【R&Iファンド大賞2019】について】

「R & I ファンド大賞」は、R & I が信頼し得ると判断した過去のデータに基づく参考情報（ただし、その正確性及び完全性につきR & I が保証するものではありません）の提供を目的としており、特定商品の購入、売却、保有を推奨、又は将来のパフォーマンスを保証するものではありません。当大賞は、信用格付業ではなく、金融商品取引業等に関する内閣府令第299条第1項第28号に規定されるその他業務（信用格付業以外の業務であり、かつ、関連業務以外の業務）です。当該業務に関しては、信用格付行為に不当な影響を及ぼさないための措置が法令上要請されています。当大賞に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はR & I に帰属しており、無断複製・転載等を禁じます。

「投資信託10年部門」では、2014、2019年それぞれの3月末における5年間の運用実績データを用いた定量評価および2019年3月末時点における3年間の運用実績データを用いた定量評価がいずれも上位75%に入っているファンドに関して、2019年3月末における10年間の定量評価によるランキングに基づいて表彰している。定量評価は、シャープ・レシオを採用している。表彰対象は償還予定日まで1年以上の期間を有し、残高が30億円以上かつカテゴリー内で上位50%以上の条件を満たすファンドとしている。「投資信託10年部門」は確定拠出年金専用ファンド、SMA・ラップ口座専用ファンドを除く国内籍公募追加型株式投信を対象にしており、いずれも基本的にR&Iによる分類をベースとしている。

### 【投資信託に係るリスクと費用およびご注意事項】

DIAM新興市場日本株ファンド 追加型投信/国内/株式

#### 【ファンドの費用】

■購入時手数料：購入価額に、3.24%\*（税抜3.0%）を上限として、販売会社が別に定める手数料を乗じて得た額

\*消費税率が10%になった場合は3.3%となります

■換金手数料：なし

■ 信託財産留保額：基準価額に0.3%の率を乗じて得た額

■ 運用管理費用（信託報酬）：純資産総額に対して年率1.6416%\*（税込み1.52%）

\*消費税率が10%になった場合は1.672%となります

■ その他費用・手数料：組入れ有価証券等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、外国での資産の保管等に要する費用、監査費用等が信託財産から支払われます。※その他の費用・手数料については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

【ファンドの投資リスク】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。

基準価額の変動要因は、次に限定されるものではありません。

株価変動リスク、個別銘柄選択リスク、流動性リスク、信用リスク

当ファンドは実質的に、株式などの値動きのある有価証券等に投資します。このため、ファンドは株式市場の変動、投資した株式の価格変動、業種および個別銘柄の選択による株式市場全体の動向との乖離、市場に十分な需要や供給がないため取引を行えないまたは取引が不可能となること、組入有価証券等の発行者にかかる信用状況の変化等の影響により、組入れた有価証券等の価値が下落し、基準価額が下落することがあります。これらの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、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、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。また、投資信託は預貯金と異なります。

### 【投資一任契約にかかるリスクと費用等について】

投資一任契約に基づく運用におきましては、以下のリスク及びお客さまの費用負担が発生致します。

#### ● リスクについて

アセットマネジメントOne株式会社の提供する運用は、株式や債券等の値動きのある有価証券等に投資をしますので、市場環境（為替市場を含みます）、組入有価証券の発行者に係る信用状況等の変化により損失を被る恐れがあります。変動要因としましては、有価証券等の価格変動リスク、金利や金融市場の変動リスク、十分な流動性の下で取引が行えない流動性リスク、有価証券等の発行体の信用リスク及びカントリーリスク等の他、外貨建資産に投資している場合には為替変動リスクがあります。このため、ご投資いただく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。運用においてデリバティブ取引等を利用する場合、当該デリバティブ取引の額が当該デリバティブ取引等について預託すべき保証金等の額を上回る可能性があります。このため、損失が生じるおそれの他、元本超過損が生じるおそれ、追加的に保証金等の差し入れが必要となる可能性があります。当該デリバティブ取引の額の当該保証金等に対する比率については、個々の取引内容や条件により異なるため事前に示すことができません。

#### ● 費用について

投資一任契約にかかる報酬として、一般に、契約資産額に対して予め定めた料率の投資顧問報酬が契約期間に応じたかかります。上記に加え、成功報酬をご負担いただく場合があります。なお、成功報酬については、予め定めた基準等にもとづき実際の運用実績等に応じて投資顧問報酬が変動するほか、お客さまと別途協議により取り決めさせていただくことから、事前に計算方法、上限額等を示すことができません。投資顧問報酬の他に、以下の手数料等が発生致します。

#### ● 売買委託手数料等

投資一任契約に基づき、有価証券等の売買等を行う場合は、有価証券等の売買委託手数料等をご契約資産でご負担いただく場合があります。

#### ● 運用報酬等

投資一任契約に基づき、ご契約資産で投資信託等の運用商品へ投資を行う場合は、一般的には、当該運用商品に係る運用会社の運用報酬（成功報酬が設定されている場合は成功報酬を含みます）、投資信託等の管理報酬、有価証券等取引に係る手数料、信託事務の処理に要する諸費用、監査費用、法律関係の費用、資産の保管等に要する費用、借入金の利息等を間接的にご負担いただきます。また、投資信託等の運用商品を換金する際に、信託財産留保額や解約手数料がかかる場合があります。これらの投資顧問報酬以外の手数料等は、契約内容・資産残高等により変動し、あらかじめその額が確定していないため、その上限額及び計算方法等を記載することができません。

※なお、お客さまにご負担いただくこととなる投資顧問報酬及び投資顧問報酬以外の手数料等の合計額、その上限額及び計算方法等は、契約内容・資産残高等により変動し、あらかじめその額が確定していないため、記載することができません。

## 【ご注意事項】

- ・当資料はアセットマネジメントOne株式会社が作成したものです。
- ・お申込に際しては、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、弊社が保証するものではありません。また掲載データはあくまでも過去の実績であり、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(2019年7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。
- ・株式や債券等の相場の変動等により投資した資産が減少する場合がありますが、これによる損失はお客様ご自身が負担することになります。
- ・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ではありません。2. 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。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。

## 【アセットマネジメント One について】

アセットマネジメントOne株式会社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社（以下、総称して「統合4社」）が統合し、2016年10月1日に発足した資産運用会社です。「投資顧問事業」と「投資信託事業」の双方の事業領域における運用資産残高は約52兆円と国内有数の規模を誇ります。

統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、資産運用のプロフェッショナルとして、グローバル運用リサーチ体制に支えられた伝統的資産のアクティブ運用や金融工学を駆使した最先端の運用戦略等、個人投資家や機関投資家の多様な運用ニーズに対し、最高水準のソリューションの提供をめざします。 HP : <http://www.am-one.co.jp/>

※運用資産残高は2019年3月末時点。

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