

R&I ファンド大賞 2017 確定給付年金部門で外国債券運用戦略が受賞

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 西恵正、以下「AMOne」）が運用する「外国債券 リサーチアクティブ 金利・為替・クレジット型」が、5月22日、株式会社格付投資情報センター（R&I）が選定する「R&Iファンド大賞2017」の確定給付年金部門の外国債券カテゴリーを受賞しました。

「外国債券 リサーチアクティブ 金利・為替・クレジット型」は、トップダウン・アプローチと為替専担チームによる通貨配分により、安定的な超過リターンの獲得を目指す運用戦略です。国別・債券種別等により収益率に大きく差異があることに着目し、AMOneが強みを持つトップダウン判断を通じ複数の配分戦略を独立して選定することにより安定的な超過リターンの創出を目指します。なお通貨配分については債券配分から分離、国内系資産運用会社では数少ない為替専担チームが独立してコントロールすることで収益機会の拡大を志向している点も特徴です。

先に発表があった「R&Iファンド大賞2017」では14ファンドが受賞し、アセットマネジメントOneが最多受賞運用会社となりました。

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、安定的な利回りに対するニーズはますます高まっています。AMOneでは、投資家の皆さまのニーズにお応えする運用ソリューション提案の強化に、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。

【「R&Iファンド大賞2017」について】

「R & Iファンド大賞」は、R & I等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等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等に帰属しており、無断複製・転載等を禁じます。

・ 確定給付年金部門について

「確定給付年金部門」では2015、2016、2017年それぞれの3月末時点における1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、2017年3月末における3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、「確定給付年金部門」では定量評価に"インフォメーション・レシオ"を採用している。「確定給付年金部門」では受賞区分を設けていない。

【留意事項】

<投資顧問報酬の概要>

投資資産額	投資顧問料率（年率・税抜）
10億円以下の部分	0.45000%
10億円超～20億円以下の部分	0.35000%
20億円超～30億円以下の部分	0.30000%
30億円超～50億円以下の部分	0.25000%
50億円超～100億円以下の部分	0.20000%
100億円超～200億円以下の部分	0.15000%
200億円超～300億円以下の部分	0.14000%
300億円超～500億円以下の部分	0.13000%
500億円超の部分	0.13000%

投資顧問報酬の額は、お客さまの投資資産の額に上記の料率を乗じて算出した額です。

投資顧問報酬に加え、投資顧問報酬に係る消費税相当額をご負担いただくこととなります。

お客さまとの協議の上、別途、投資顧問報酬率を取り決める場合があります。

解約手数料はございません。

<投資顧問報酬以外の手数料等>

投資顧問報酬の他に、以下の手数料等が発生いたします。

■ 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。

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。詳細又はご不明な点等に関しましては、弊社の営業担当者までお問い合わせください。

<リスク要因>

投資一任契約においては、金利・通貨の価格、金融商品市場における相場等その他の指標に係る変動により、投資元本を割り込み、損失が生じることがあります。

投資対象に係るリスクは以下をご確認ください。

金利リスク●流動性リスク●信用リスク●カウンターパーティリスク●為替リスク●カントリーリスク●デリバティブ取引等に関するリスク

当戦略においては、金利変動、市場規模や取引量等により十分な流動性の下で取引を行えないこと、有価証券の発行者にかかる信用状況の変化、取引相手先の決済不履行、為替変動、投資対象国・地域における政治・経済情勢の悪化等、デリバティブ取引等により金利変動等を直接の原因として損失が生じることにより投資元本を割り込み、損失が生じることがあります。また、デリバティブ取引等の額は、当該デリバティブ取引等について預託すべき委託証拠金等の額を上回る可能性があります。また、金利等の指標に係る変動を直接の原因として生ずる損失額が保証金等の額を上回り、元本超過損が生じる可能性や追加的に保証金等の差し入れを必要とする可能性があります。

<注意事項>

当資料は投資一任契約を締結又は締結しようとするお客さま向けに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、契約締結前交付書面（金融商品取引法第37条の3）等により、必ず内容をご確認ください。

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（2017年5月22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。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さまご自身が負担することになります。

【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53兆円とアジアトップクラスの規模を誇ります。

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2017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