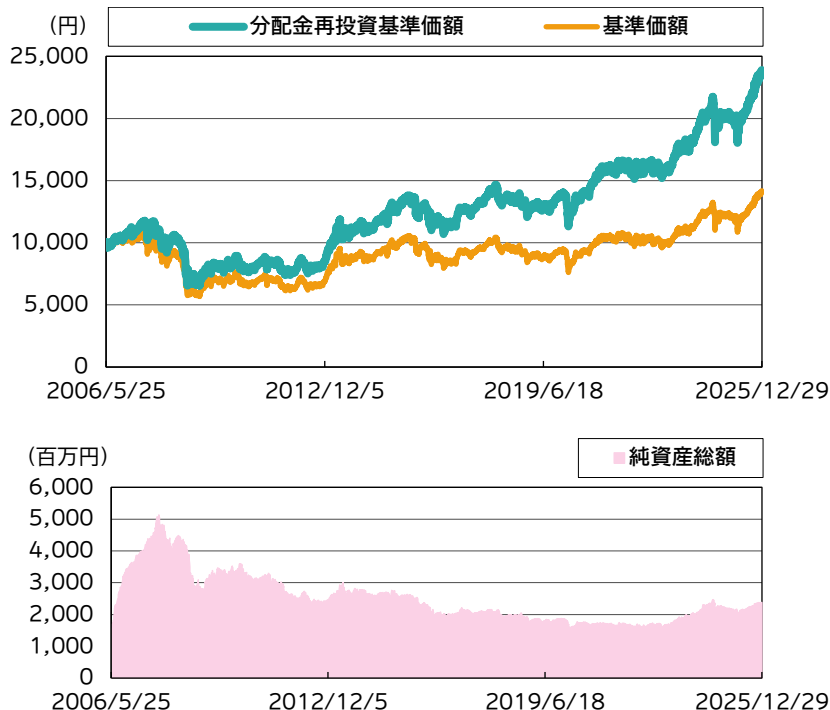


運用実績

運用実績の推移

(設定日:2006年5月26日)



※基準価額は、信託報酬控除後の価額です。設定前営業日を10,000円として指数化しています。なお、信託報酬率は「ファンドの費用」をご覧ください。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。

分配金の実績(税引前)(直近1年分)

期	決算日	分配金(円)
第111期	2025/01/06	40
第112期	2025/03/05	40
第113期	2025/05/07	40
第114期	2025/07/07	40
第115期	2025/09/05	40
第116期	2025/11/05	40
設定来累計分配金		4,960

※分配金は、1万口当たりの金額です。

※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。

基準価額・純資産総額

	当月末	前月末
基準価額(円)	14,130	13,975
純資産総額(百万円)	2,375	2,374

※基準価額は、1万口当たり。

	基準価額(円)	基準日
設定来高値	14,181	2025/12/29
設定来安値	5,675	2009/03/12

※同一の基準価額が複数ある場合、直近の日付を表示しています。

騰落率(税引前分配金再投資)(%)

1ヵ月	1.1
3ヵ月	7.8
6ヵ月	15.4
1年	16.3
3年	54.6
5年	58.2
10年	86.3
設定来	138.1

※騰落率は、税引前の分配金を再投資したものととして算出していますので、実際の投資家利回りとは異なります。

※各期間は、基準日から過去に遡っています。また、設定来の騰落率については、設定当初の投資元本を基に計算しています。

ポートフォリオ構成 (%)

DIAM SRI・マザー・ファンド	50.1
DIAM高格付イカム・オープン・マザー・ファンド	48.1
現金等	1.8

※組入比率は、純資産総額に対する割合です。

※現金等の中には未払金等が含まれるため、比率が一時的にマイナスとなる場合があります。

基準価額変動の要因分析(前月末比) (円)	
前月末基準価額	13,975
基準価額の変動要因	-
外国債券(DIAM高格付イカム・オープン・マザー・ファンド)	86
うち為替要因	143
国内株式(DIAM SRI・マザー・ファンド)	86
小計	172
信託報酬	-18
その他要因	1
分配金	0
基準価額前月末比	155
当月末基準価額	14,130

※要因分析は、組入資産の値動き等が基準価額に与えた影響等をご理解いただくために簡便的に計算した概算値であり、その完全性、正確性を保証するものではありません。

通貨別組入比率 (%)	
通貨	組入比率
日本円	50.9
カナダ・ドル	19.7
オーストラリア・ドル	19.5
ニュージーランド・ドル	4.9
ノルウェー・クローネ	4.9

※組入比率は、組入有価証券評価額に対する実質的な割合です。

外国債券:DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンドの状況

基準価額の推移



※当マザーファンドの設定前営業日を10,000円として指数化しています。

基準価額・純資産総額

	当月末	前月末
基準価額(円)	30,454	30,070
純資産総額(百万円)	85,333	85,240

※基準価額は、1万口当たり。

騰落率 (%)

1ヵ月	1.3
3ヵ月	5.9
6ヵ月	9.0
1年	8.5
3年	26.9
5年	29.3
10年	43.5
設定来	204.5

※各期間は、基準日から過去に遡っています。また、設定来は当マザーファンドにおける設定来の騰落率です。

ポートフォリオの状況

最終利回り(%)	3.76
平均クーポン(%)	2.78
平均残存期間(年)	7.06
修正デュレーション(年)	5.65

※組入債券の各データを純資産総額に対する割合で加重平均しています。
 ※修正デュレーションは、債券価格の金利変動に対する感応度を示す指標です。この値が大きいほど、金利が変化した場合の債券の価格変動が大きくなります。

※将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

格付別組入比率 (%)

格付け	組入比率
AAA	92.1
AA	7.9
A	-
BBB	-
BB以下	-
格付けなし	-
合計	100.0

※組入比率は、組入有価証券評価額に対する割合です。

※格付けについては、格付機関(S&PおよびMoody's)による格付けの上位のものを採用し、+・-等の符号は省略して表示しています。(表記方法はS&Pに準拠)

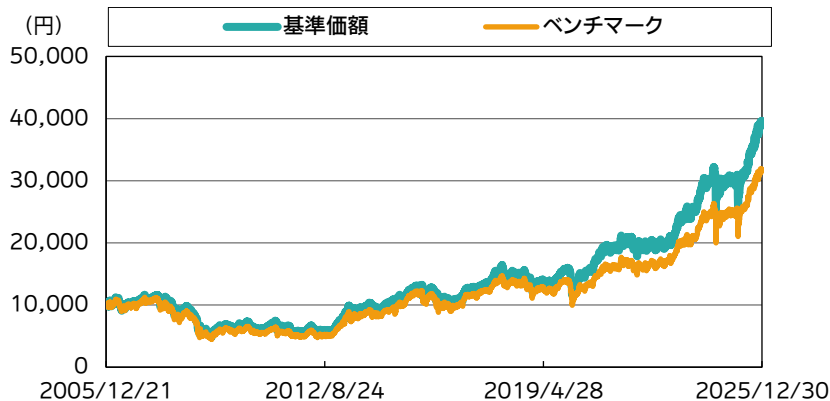
通貨別組入比率 (%)

通貨	組入比率
カナダ・ドル	40.1
オーストラリア・ドル	39.8
ニュージーランド・ドル	10.1
ノルウェー・クローネ	10.1

※組入比率は、組入有価証券評価額に対する割合です。

国内株式:DIAM SRI・マザーファンドの状況

基準価額の推移



※ベンチマークを含め、当マザーファンドの設定前営業日を10,000円として指数化しています。

※ベンチマークは、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。指数についての詳細は後掲の「指数の著作権などについて」をご参照ください。

基準価額・純資産総額

	当月末	前月末
基準価額(円)	39,451	38,972
純資産総額(百万円)	1,190	1,220

※基準価額は、1万口当たり。

騰落率 (%)

	ファンド	ベンチマーク	差
1ヵ月	1.2	1.0	0.2
3ヵ月	10.6	8.8	1.7
6ヵ月	24.1	20.8	3.3
1年	28.4	25.5	3.0
3年	105.5	93.8	11.6
5年	122.9	113.2	9.7
10年	217.2	178.6	38.6
設定来	294.5	217.5	77.0

※各期間は、基準日から過去に遡っています。また、設定来は当マザーファンドにおける設定来の騰落率です。

組入上位10銘柄 (%) (組入銘柄数 92)

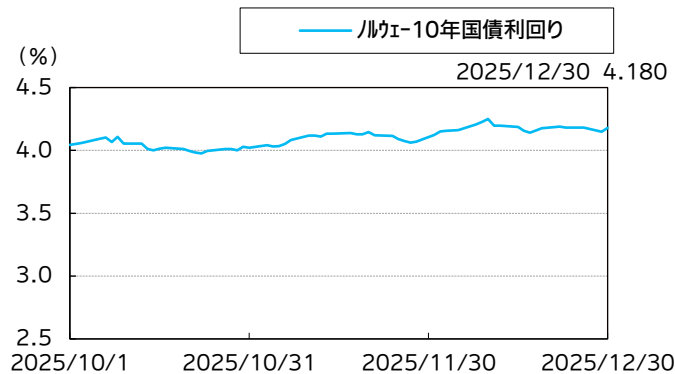
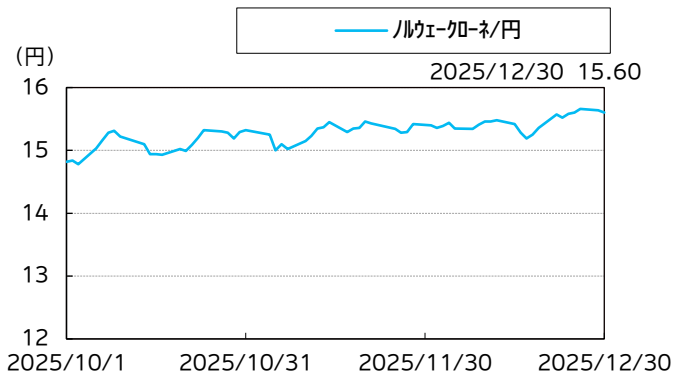
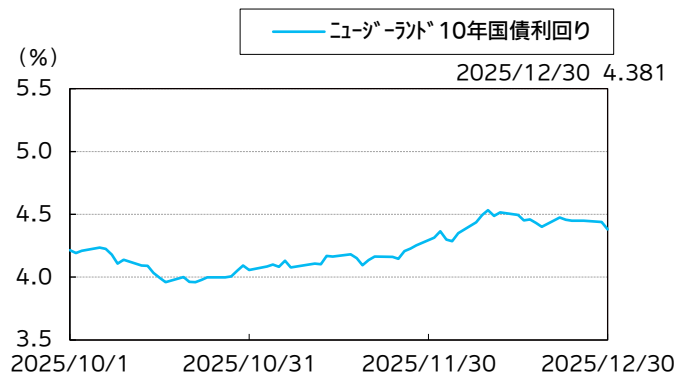
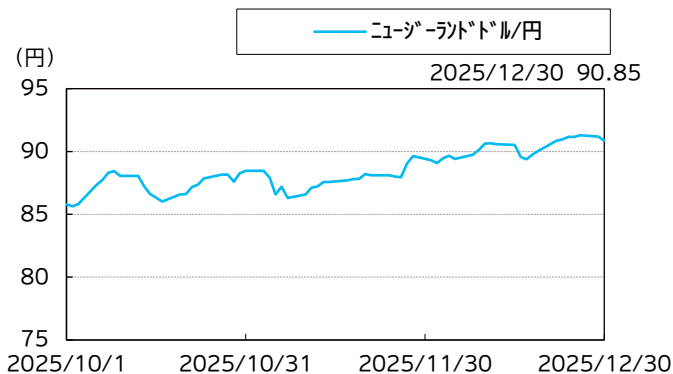
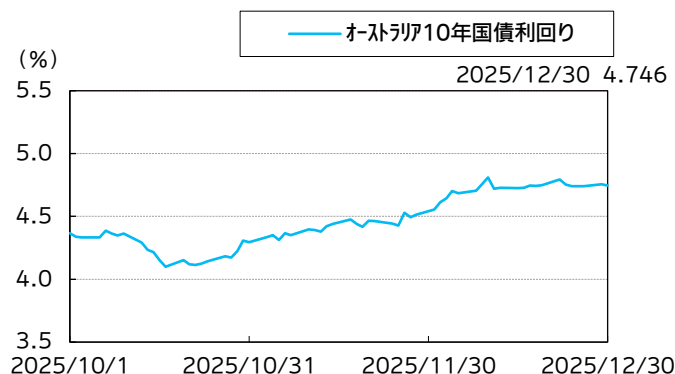
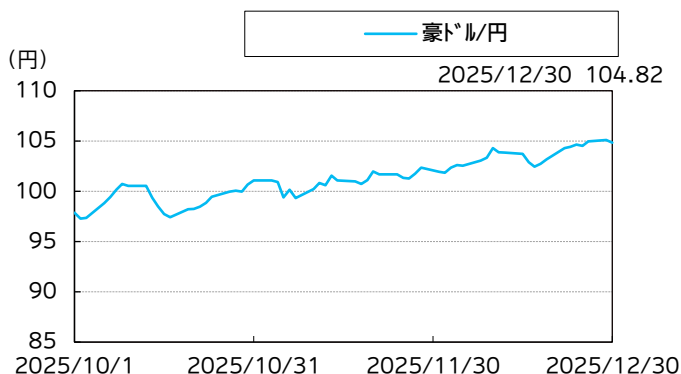
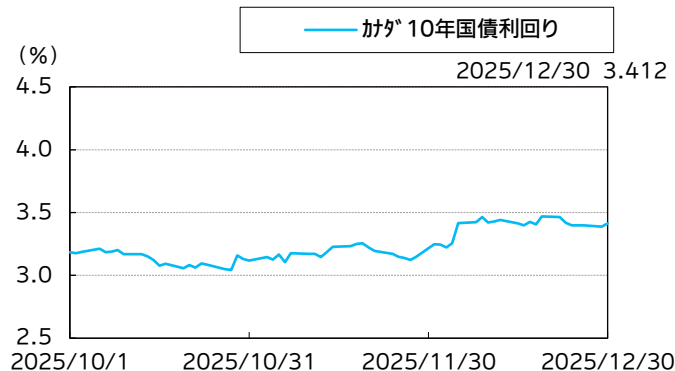
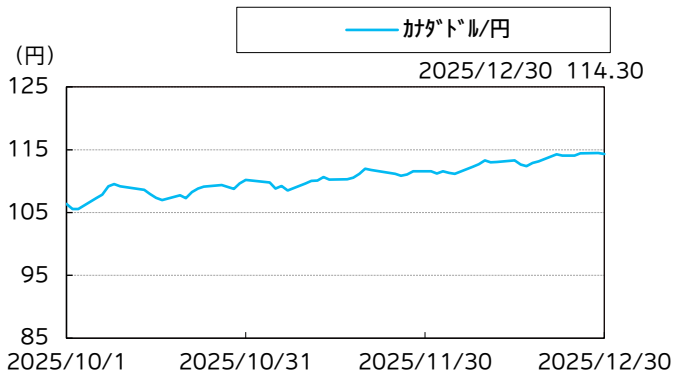
	銘柄	業種	組入比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4.0
2	ソニーグループ	電気機器	3.5
3	日立製作所	電気機器	3.3
4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3.3
5	東京海上ホールディングス	保険業	2.3
6	三井物産	卸売業	2.3
7	東京エレクトロン	電気機器	2.1
8	伊藤忠商事	卸売業	1.8
9	オリックス	その他金融業	1.6
10	乃村工藝社	サービス業	1.6

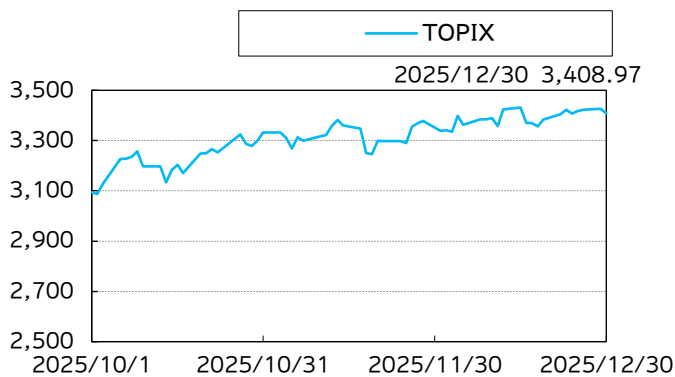
※組入比率は、組入有価証券評価額に対する割合です。

※業種は、東証33業種分類によるものです。

※当該個別銘柄の揭示は、銘柄推奨を目的としたものではありません。

市況動向(直近3ヵ月)





※指数の詳細は、後掲の「指数の著作権などについて」をご参照ください。

※為替は、一般社団法人投資信託協会が公表する対顧客電信売買相場の仲値(TTM)です。

※Bloombergのデータを基に委託会社が作成。

マーケット動向とファンドの動き

当ファンドの基準価額は前月末比で上昇しました。
当ファンドで組入れる2つのマザーファンドへの配分は原則として以下の基本配分比率とします。各マザーファンド受益証券の時価の変動により、時価構成比が基本配分から乖離した場合には、定期的に基本配分比率に修正します。
各マザーファンドの基本配分比率は以下の通りです。

○外国債券:DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド:50%

○国内株式:DIAM SRI・マザーファンド:50%

12月の債券市場では多くの国で10年国債利回りが上昇しました(価格は下落)。当月は、日銀による追加利上げが実施されたことや、オーストラリアでインフレ圧力の高まりからRBA(オーストラリア準備銀行)総裁が追加利上げの可能性について言及したこと、カナダでは失業率の大幅低下から利下げ局面の終了が意識されたことなどを受けて、米国を除いた多くの主要先進国で利下げ局面の終了を見込む展開となり10年国債利回りが上昇しました。当ファンドの投資国の10年国債利回りは、いずれも上昇しました。
為替市場では、当月のFOMC(米公開市場委員会)で利下げが実施された一方で、日銀が利上げを実施したことなどから米ドルは対円で小幅に下落したものの、当ファンドの投資通貨は、日本の財政拡張的な政策が意識された円安基調や、投資国での利下げ局面終了と将来の利上げが織り込まれる展開の中で、いずれも対円で上昇しました。
国内株式市場は上昇しました。日銀の利上げ観測の高まりが嫌気されたこと等から一時的に下落する場面がみられたものの、利下げ観測等を背景に米国市場が堅調に推移したことに支えられ、前月末比では上昇しました。

※マーケット動向とファンドの動きは、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。

※当資料中の各数値については、表示桁未満の数値がある場合、原則、四捨五入して表示しています。

※当資料中の各数値等は過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

当資料は、ファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。

「投資信託に関する留意点」、「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

ファンドの特色

DIAM SRI・マザーファンドおよびDIAM高格付インカム・オープン・マザーファンドへの投資を通じて、実質的にわが国の上場株式および高格付資源国の公社債へ投資し、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。

1. 日本株式と外国債券に分散投資を行うバランスファンドです。

- 実質的に、積極的にCSR(企業の社会責任)*¹へ取り組むわが国の上場企業の株式および高格付資源国*²の公社債へ投資を行い、安定的な収益の確保ならびに信託財産の着実な成長をめざします。

当ファンドは銘柄選定においてESG*³を主要な要素とするファンドではありません。

2. 奇数月の各5日(休業日の場合は翌営業日。)に決算を行い、原則として経費控除後の利子、配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の範囲内で分配を行います。

- 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。

3. 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。

- *1 「CSR」とは、Corporate Social Responsibilityの略です。また、CSR(企業の社会責任)を重視して投資することをSRI(Socially Responsible Investment 社会的責任投資)といいます。
- *2 当ファンドにおいて「資源国」とは、「石油、鉱物資源、ガス、石炭等の資源を産出する国で、その資源がその国の経済もしくは世界経済に影響を与えると考えられる国」と定義します。投資対象となる国は、「資源国」の中から、信用力・金利・為替見通し等を判断材料とし、選定します。
- *3 「ESG」とは、環境(Environment)、社会(Social)、企業統治(Governance)の略称です。

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。

主な投資リスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみな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。

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。

● 資産配分リスク

各資産（国内株式および外国債券）の資産配分比率は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

● 株価変動リスク

株式の価格は、一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動により、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

● 個別銘柄選択リスク

当ファンドでは、実質的に個別銘柄の選択により超過収益を積み上げることが目標としているため、株式市場全体の動きとは異なる場合があります。個別銘柄選択リスクとは、実質的に投資した株式の価格変動によっては収益の源泉となる場合がありますが、株式市場全体の動向にかかわらず基準価額の下落の原因となる可能性があるリスクをいいます。

● 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

● 金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に、金利が上昇した場合には、債券の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

● 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、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。当ファンドでは、為替リスクに対して対円での為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に大きく影響します。

● 流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位(当初元本1口＝1円)	信託期間	無期限(2006年5月26日設定)
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額(基準価額は1万口当たりで表示しています。)	繰上償還	次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)することがあります。 ・受益権の口数が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。
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。		
換金単位	販売会社が定める単位		
換金価額	換金申込受付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	決算日	毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各5日(休業日の場合は翌営業日)
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して5営業日目からお支払いします。	収益分配	年6回の毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。 ※お申込コースには、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。詳細は販売会社までお問い合わせください。
申込締切時間	原則として営業日の午後3時30分までに販売会社が受付けたものを当日分のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。		
購入・換金申込不可日	カナダの銀行の休業日に該当する場合には、購入・換金のお申込みの受付を行いません。	課税関係	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。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度(NISA)の適用対象となります。 当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。 ※税法が改正された場合等には、上記内容が変更となる場合があります。
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。		

ファンドの費用

以下の手数料等の合計額、その上限額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。
※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ことがあります。

● 投資者が直接的に負担する費用

購入時手数料	購入価額に、 3.3%(税抜3.0%) を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額となります。
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に 0.3% の率を乗じて得た額を、換金時にご負担いただきます。

● 投資者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)	ファンドの日々の純資産総額に対して 年率 1.485%(税抜1.35%) ※信託報酬には、DIAM SRI・マザーファンドの投資顧問会社(SOMPOリスクマネジメント株式会社)に対する投資顧問報酬が含まれます。
その他の費用・ 手数料	その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。 ・組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料 ・信託事務の処理に要する諸費用 ・外国での資産の保管等に要する費用 ・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用等 ※これらの費用等は、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・上限額等を示すことができません。

投資信託に関する留意点

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、アセットマネジメントOne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。
- 投資信託は、株式や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、投資者のみな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。ファンドの運用による損益は全て投資者のみなさまに帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。
- 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、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のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

委託会社およびファンドの関係法人

- ＜委託会社＞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
- ＜受託会社＞みずほ信託銀行株式会社
- ＜販売会社＞販売会社一覧をご覧ください。

委託会社の照会先

- アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター 0120-104-694
(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)
- ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

販売会社一覧

○印は協会への加入を意味します。

2026年1月14日現在

商号	登録番号等	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	備考
株式会社群馬銀行	登録金融機関 関東財務局長(登金)第46号	○		○		
株式会社第四北越銀行	登録金融機関 関東財務局長(登金)第47号	○		○		
ぐんぎん証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第2938号	○				
第四北越証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第128号	○				
野村證券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第142号	○	○	○	○	※1

- その他にもお取扱いを行っている販売会社がある場合があります。
 - 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。
 - 販売会社によってお申込みの条件、制限等が異なります。詳しくは販売会社に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)

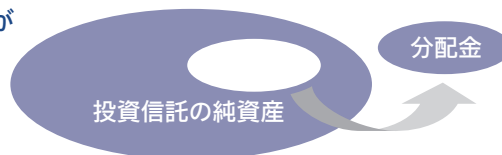
指数の著作権などについて

東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

収益分配金に関する留意事項

投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、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になります。また、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。

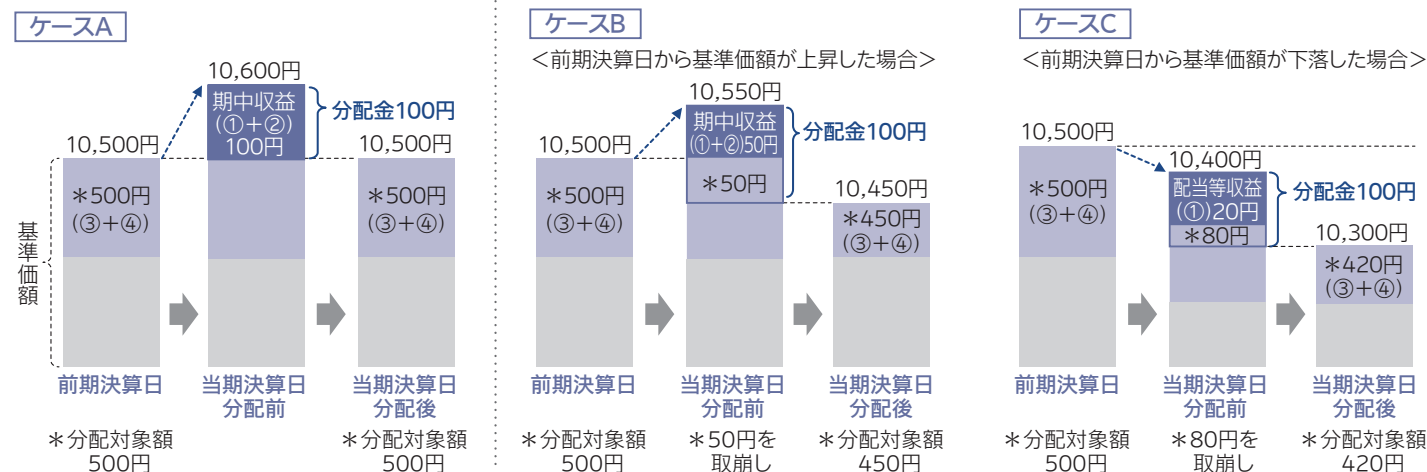
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後） ②有価証券売買益・評価益（経費控除後） ③分配準備積立金 ④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA	分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差	0円 = 100円
ケースB	分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差	▲50円 = 50円
ケースC	分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差	▲200円 = ▲100円

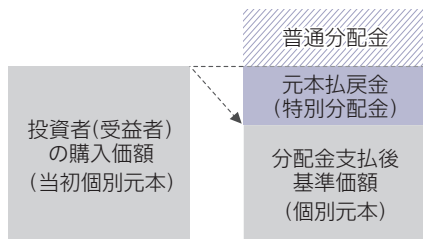
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

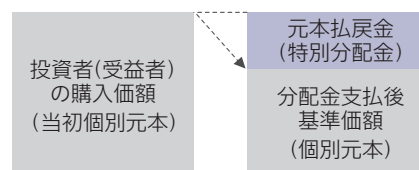
投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は、非課税扱いとなります。



普通分配金：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、投資信託説明書（交付目論見書）をご確認ください。