

使用開始日  
2021年5月25日



当ファンドは、特化型運用を行います。

## USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型

追加型投信／内外／債券

当ファンドは、特化型運用を行います。

## USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型

追加型投信／内外／債券

- 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
- ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下、「請求目論見書」といいます。)は、委託会社のホームページで閲覧できます。  
本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ファンドの販売会社、基準価額等については委託会社の照会先までお問い合わせください。

〈委託会社〉[ファンドの運用の指図を行う者]

**アセットマネジメントOne 株式会社**

金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第324号

委託会社への照会先

【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)

【ホームページアドレス】

<http://www.am-one.co.jp/>

〈受託会社〉[ファンドの財産の保管および管理を行う者]

**株式会社りそな銀行**

本書は下記①および②で構成されております。内容はそれぞれ異なりますので、ご購入に際しては、ご購入対象となるファンドの投資信託説明書(交付目論見書)をお読みください。

①投資信託説明書(交付目論見書) USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型

②投資信託説明書(交付目論見書) USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型

使用開始日  
2021年5月25日



当ファンドは、特化型運用を行います。

## USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型

追加型投信／内外／債券

商品分類			属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ <sup>※2</sup>
追加型	内外	債券	その他資産(投資信託証券 <sup>※1</sup> )	年12回(毎月)	グローバル(日本を含む)	ファンド・オブ・ファンズ	あり(適時ヘッジ <sup>*</sup> )

※1 投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「債券 一般」です。

※2 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

◆上記の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

\*当ファンドは、市況動向等に応じて為替ヘッジを行うことがあります。常に行うわけではありません。為替ヘッジについての詳細は、後述の「ファンドの特色」をご参照ください。

この目論見書により行う「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2021年5月24日に関東財務局長に提出しており、2021年5月25日にその効力が生じております。

- 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
- ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下、「請求目論見書」といいます。)は、委託会社のホームページで閲覧できます。  
本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ファンドの販売会社、基準価額等については委託会社の照会先までお問い合わせください。

〈委託会社〉[ファンドの運用の指図を行う者]

### アセットマネジメントOne 株式会社

金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第324号  
設立年月日:1985年7月1日  
資本金:20億円(2021年2月末現在)  
運用する投資信託財産の合計純資産総額:18兆1,306億円  
(2021年2月末現在)

委託会社への照会先

【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)

【ホームページアドレス】  
<http://www.am-one.co.jp/>

〈受託会社〉[ファンドの財産の保管および管理を行う者]

### 株式会社りそな銀行

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。



# ファンドの目的・特色

## ファンドの目的

信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

## ファンドの特色

**1** 主として米ドル建て米国債券\*に投資し、各債券種類への投資比率を機動的に変更することで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

- 米ドル建ての外国投資信託「DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド」への投資を通じて、実質的に米ドル建て米国債券に投資します。外国投資信託への投資比率は、原則として高位を保ちますが、外国投資信託の流動性およびファンドの資金動向等を勘案の上決定します。
- 外国投資信託の実質的な運用は、ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーが行います。
- 外国投資信託の運用では、各債券種類への投資比率を機動的に変更します。

\*主要投資対象となる米ドル建て米国債券の主な債券種類は、米国の国債、政府機関債、モーゲージ債、投資適格社債、ハイイールド債等です。なお、米国以外の企業が発行した米ドル建て社債等に投資する場合があります。

**2** 通常時は為替ヘッジを行いませんが、円高・米ドル安が予想される局面では一時的に為替ヘッジを行います。

- ファンドの実質的な主要投資対象資産は米ドル建て債券です。この米ドルの対円為替変動リスクについて、通常時は為替ヘッジを行わず円安・米ドル高による為替差益の獲得をめざします。
- 円高・米ドル安が予想される局面では、一時的に為替ヘッジを行い、基準価額への為替変動リスクの低減をめざします。
- 為替ヘッジ取引については委託会社が行います。

**3** 分配頻度の異なる2つのファンド(毎月決算型、年1回決算型)から、お客さまの投資ニーズに合わせて選択できます。

① USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型	毎月23日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として配当等収益と売買益等から分配を行います。
② USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型	毎年8月23日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として配当等収益と売買益等から分配を行います。

※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。

※「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」を選択される際には、当該ファンドの目論見書をご覧ください。

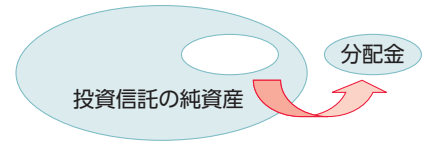


# ファンドの目的・特色

## 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。

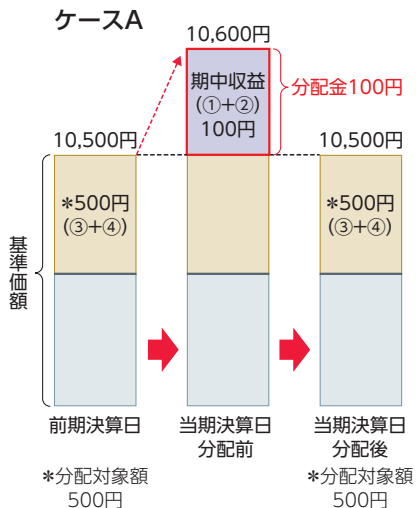
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 分配金額と基準価額の関係(イメージ)

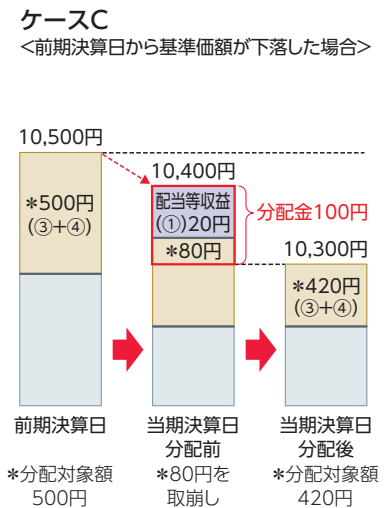
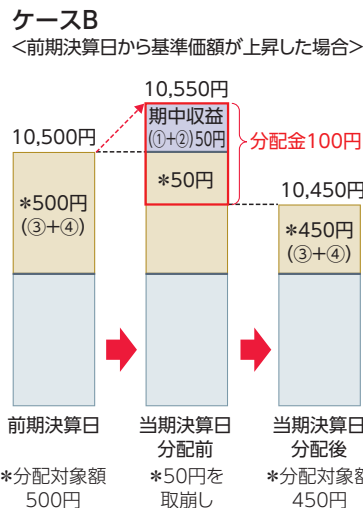
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

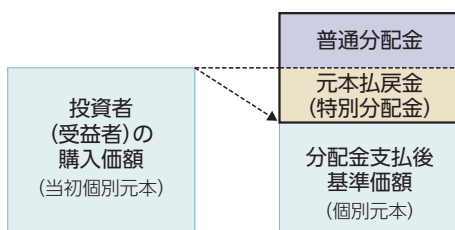
ケースC : 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★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。

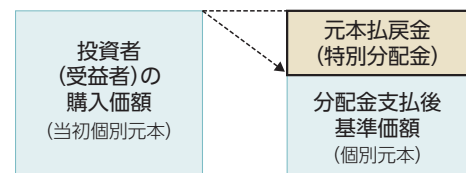
◆投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※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。

#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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、後掲「手続・手数料等」の「ファンドの費用・税金」をご参照ください。

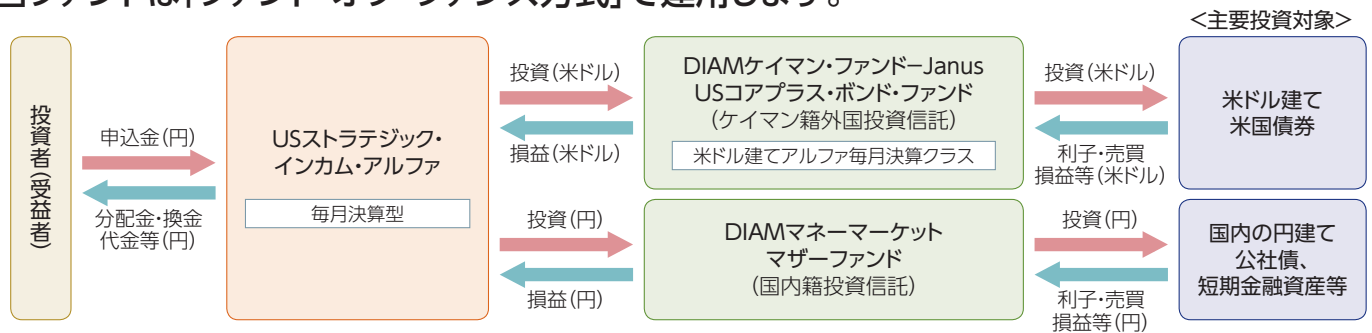


# ファンドの目的・特色

- 当ファンドは、特化型運用ファンドです。特化型運用ファンドとは、投資対象に一般社団法人投資信託協会規則に定める寄与度\*が10%を超える支配的な銘柄が存在し、または存在することとなる可能性が高いファンドをいいます。
  - 当ファンドが実質的な主要投資対象とする米ドル建て米国債券には、寄与度が10%を超えるまたは超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、投資先について特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該支配的な銘柄に経営破綻や経営・財務状況の悪化などが生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。
- \*寄与度とは、投資対象候補銘柄の時価総額に占める一発行体当たりの時価総額の割合、または運用管理等に用いる指数における一発行体当たりの構成割合をいいます。

## ■ ファンドの仕組み

当ファンドは「ファンド・オブ・ファンズ方式」で運用します。



※当ファンドは、「DIAMマネーマーケットマザーファンド」にも投資します。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。

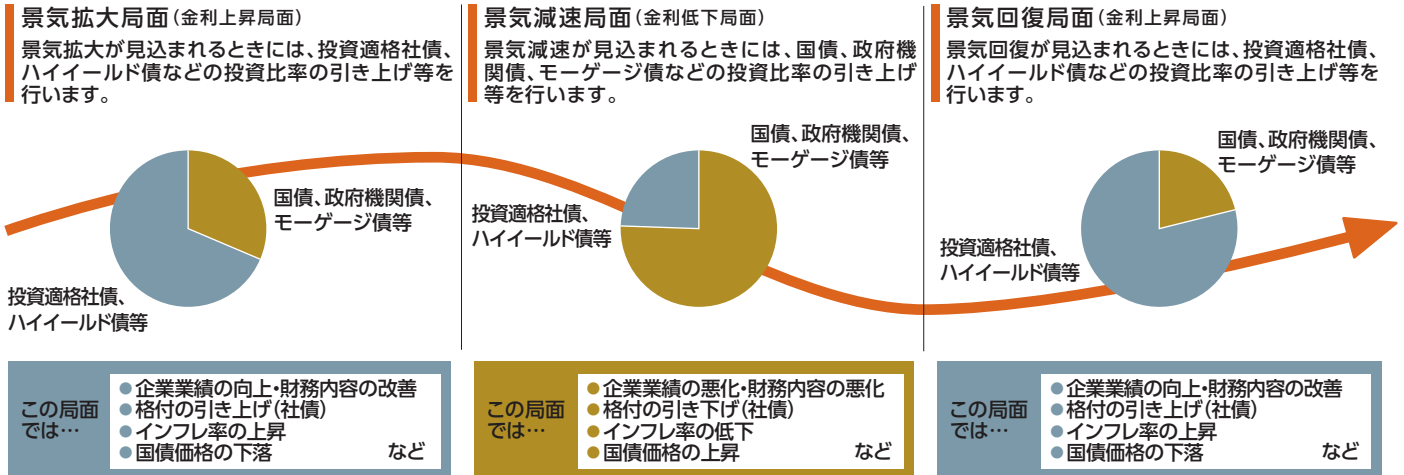




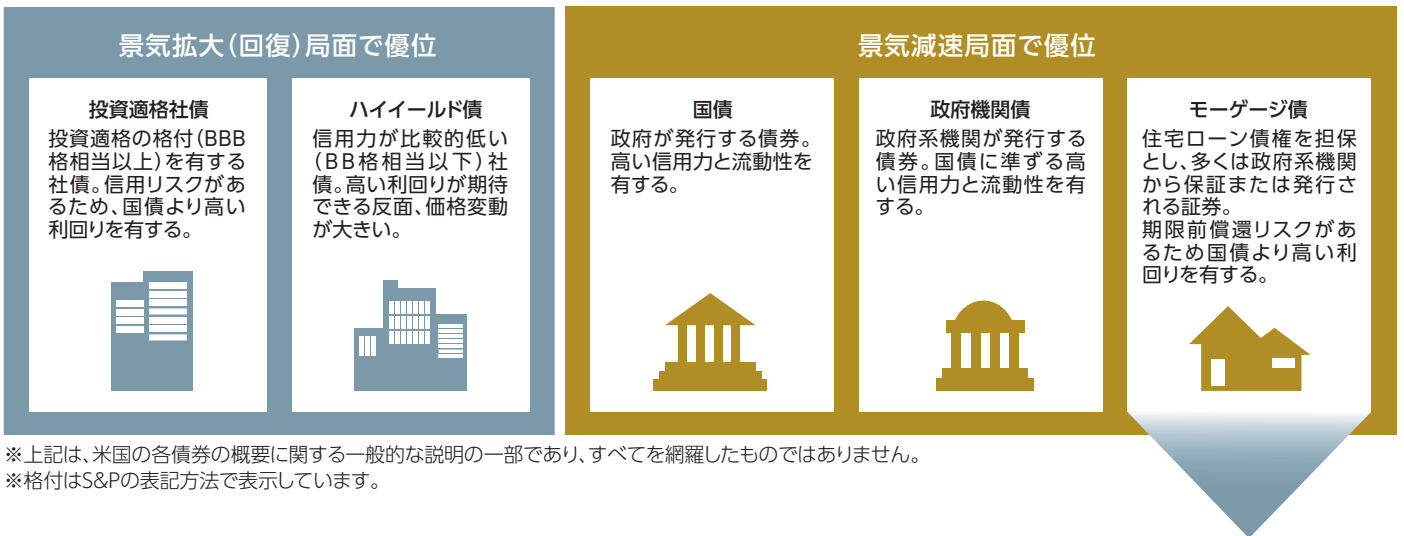
# ファンドの目的・特色

**ストラテジック・インカム戦略** ストラテジック・インカム戦略では、市場環境の変化をとらえ、それに応じて値動きの異なる各債券種類への投資比率を機動的に変更し、より安定した収益の確保をめざします。

## 各債券種類への投資比率変更の例



※ 上記はイメージであり、実際と異なる場合があります。また、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。  
 ※ 上記は景気動向および資産配分、景気局面での事象の一例を示したものであり、すべてを網羅したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。



※ 上記は、米国の各債券の概要に関する一般的な説明の一部であり、すべてを網羅したものではありません。  
 ※ 格付はS&Pの表記方法で表示しています。

## モーゲージ債とは～もっと知りたいあなたへ～

米国の債券市場において、モーゲージ債の残高は約10.9兆米ドルと国債に次ぐ発行残高です。モーゲージ債の大部分は政府系機関から発行・保証されているため、信用力は非常に高いものとなっています。また、一般的に金利上昇局面では同年限の国債に比べ下落幅が小さいことも特徴です。



※ 上記は、モーゲージ債の一般的な仕組みを示したイメージであり、すべての仕組みを説明したものではありません。  
 ※ 2020年9月末時点

(出所:米国証券業金融市場協会、各種資料をもとに委託会社作成)

上記は過去の情報であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

※ 上記は、委託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。  
 ※ 上記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。

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。



# ファンドの目的・特色

## ■主な投資制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③1発行体等あたりの当ファンドの純資産総額に対する実質比率は、原則として、35%以内とします。

## 追加的記載事項

### ■当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

ファンド名	DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ毎月決算クラス
形態	ケイマン籍米ドル建て外国投資信託
主要投資対象	米ドル建て米国債券(*)を主要投資対象とします。 (*)主要投資対象となる米ドル建て米国債券の主な債券種類は、米国の国債、政府機関債、モーゲージ債、投資適格社債、ハイイールド債等です。なお、米国以外の企業が発行した米ドル建て社債等に投資する場合があります。
投資態度	<p>①主として米ドル建て米国債券への投資を通じて、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・「ブルームバーグ・パークレイズ米国総合インデックス」<sup>(注)</sup>をベンチマークとし、ベンチマークを上回る成果をめざします。</li> <li>・企業ファンダメンタルズに基づくクレジット・リサーチにより、銘柄選択を行います。</li> <li>・各種債券セクターへの投資比率を機動的に変更します。</li> </ul> <p>②ポートフォリオのデュレーションは、ベンチマーク対比で125%から60%の範囲を目安とします。</p> <p>③投資する証券の平均格付(*)は、BBB-格相当以上とします。 (*)平均格付は時価加重平均で判定します。</p> <p>④ハイイールド債券(*)への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の35%以内とします。 (*)ハイイールド債券とは、格付会社3社のうち1社以上によって、BB+格相当以下に格付されている債券をさします。</p> <p>⑤同一発行体の発行する債券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。ただし、米国国債、米国政府機関債、およびモーゲージ債を除きます。なお、同一の政府支援機関が発行または保証等を行う債券(モーゲージ債を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の35%以内とします。</p> <p>⑥原則として、現金および現金等価物への投資は信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑦組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑧デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定しません。米国債先物をファンド全体のデュレーション・コントロールに活用する場合等があります。</p> <p>⑨ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに運用の指図にかかる権限を委託します。</p> <p>(注)ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。</p>
債券運用プロセス	<p>市場環境の変化をとらえ、各債券種類への投資比率を機動的に変更し、資産の長期的な安定成長をめざします。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>① 企業調査や債券市場などの多角的な情報から、独自のマクロ経済見通しを策定</li> <li>② 個別企業の調査・分析に基づき、社債の投資比率を決定し、銘柄を選別</li> <li>③ 社債以外の各種債券の投資魅力度を判断し、投資比率を決定</li> </ol> <p style="text-align: center;"><b>ポートフォリオの構築</b></p> <p style="text-align: right;">※2021年2月末現在 (出所:ジャナスの情報をもとに委託会社作成)</p>





# ファンドの目的・特色

主な投資制限	<p>①原則として、株式への投資は行いません。(ただし、コーポレートアクション等により取得した場合、可能な限り速やかに売却することとします。)</p> <p>②転換社債への投資は可としますが、原則として株式への転換は不可とします。</p> <p>③有価証券の空売りは行いません。</p> <p>④流動性に欠ける資産への投資は、信託財産の純資産総額の15%を超えないものとします。</p> <p>⑤信託財産の純資産総額の10%を超える借入は行いません。</p> <p>⑥投資信託証券(上場投資信託証券を含みます。 )への投資は行いません。</p> <p>⑦金融商品取引法上の有価証券および有価証券関連デリバティブ取引への投資比率は信託財産総額の50%以上とします。</p>
主要関係法人	<p>投資顧問会社:アセットマネジメントOne株式会社</p> <p>副投資顧問会社:ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー</p> <p>受託会社:ファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド</p> <p>管理事務代行会社:米国みずほ銀行</p> <p>保管銀行:米国みずほ銀行</p>
申込手数料	ありません。
信託報酬等	<p>純資産総額に対して年率0.49%程度</p> <p>(注)ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。</p>
その他費用	<p>信託財産に関する租税、組入資産の売買時の売買手数料、信託事務の処理に要する費用、信託財産の監査に要する費用、法律関係の費用、資産の保管などに要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担します。</p>

## ■ ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーについて

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーは、ジャナス・ヘンダーソン・グループの一員です。同グループは、ニューヨーク証券取引所およびオーストラリア証券取引所に上場している世界有数のアクティブ運用会社です。同グループは世界26都市のオフィスに2,000名超の従業員が在籍しており、グループの総運用資産残高は約4,016億米ドルに上ります(2020年12月末時点)。

創業以来、一貫して資産運用に専念。揺るぎない投資哲学と豊富な専門知識、グローバルに広がるネットワークを基盤に、様々な資産運用戦略の提供に取り組み、確かな実績を築いています。

(出所:ジャナスの情報をもとに委託会社作成)

ファンド名	DIAMマネーマーケットマザーファンド
主要投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産とします。
投資態度	<p>①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関<sup>(*)</sup>の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;Pとします。</p> <p>②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用会社(委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
信託報酬	ありません。

○マザーファンドの主な投資制限については、請求目論見書に記載しております。

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。



# 投資リスク

## 基準価額の変動要因

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて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。

### 金利 リスク

**金利の上昇(債券の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。**

一般的に金利が上昇すると債券の価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券に投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。当ファンドが実質的に投資するハイイールド債は、こうした金利変動の影響をより大きく受ける可能性があります。

### 為替 リスク

**為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。**

当ファンドは実質組入外貨建資産について、円高・米ドル安が予想される局面に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない場合、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高・米ドル安になった場合には基準価額が下がる要因となります。為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

当ファンドは、必ずしも円高・米ドル安局面で為替ヘッジを行うことや、円安・米ドル高局面で為替ヘッジを行わないことを約束するものではありません。為替ヘッジのタイミング等により、為替ヘッジを行っても為替変動リスクを抑制できない場合や為替ヘッジを行わなくても為替差益を享受できない場合があります。

### 信用 リスク

**投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。**

当ファンドが実質的に投資する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、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。当ファンドが実質的に投資するハイイールド債は、格付の高い債券に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

### 流動性 リスク

**投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。**

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もあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。当ファンドが実質的に投資するハイイールド債は、格付の高い債券に比べ市場規模や取引量が少なく、市況動向等によっては取引機会を急激に逸失するなど、流動性リスクが大きくなる場合があります。



# 投資リスク

## 期限前償還 リスク

住宅ローンの期限前償還の増減は、モーゲージ債の金利感応度を変化させ、基準価額の変動要因となる場合があります。

モーゲージ債の原資産である住宅ローンは、一般的に金利が低下すると借り換えによる返済が増え、金利が上昇すると借り換えによる返済が減少する傾向があり、モーゲージ債の価格は上下します。当ファンドは、実質的にモーゲージ債に投資しますので、住宅ローンの期限前返済の増減にともなう金利感応度の変化により基準価額が上下したり、基準価額が大きく下がる場合があります。

## 再投資 リスク

モーゲージ債の期限前償還等により再投資する場合は、金利低下時には利回りが低下し、債券価格が下落する場合があります。

投資したモーゲージ債の期限前償還などにより生じた金銭は、その時の実勢金利にて再投資しなければならないため、金利低下局面では、再投資後の利回りが、当初期待した利回りより低くなることもあり、当該債券の価格は下落する場合があります。したがって、モーゲージ債の期限前の償還金の増減により、基準価額が上下します。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」と「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

## リスクの管理体制

委託会社では、運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。また、運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

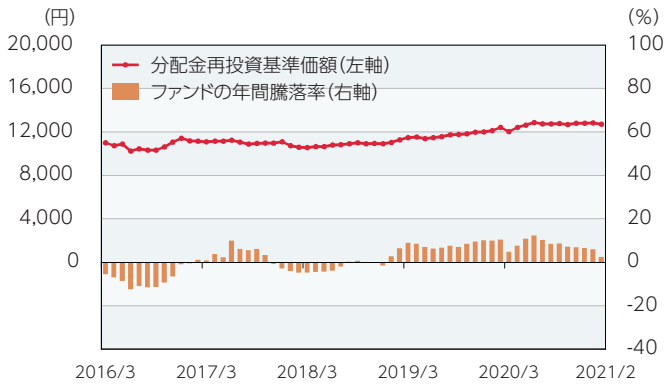
※リスク管理体制は、今後変更になることがあります。



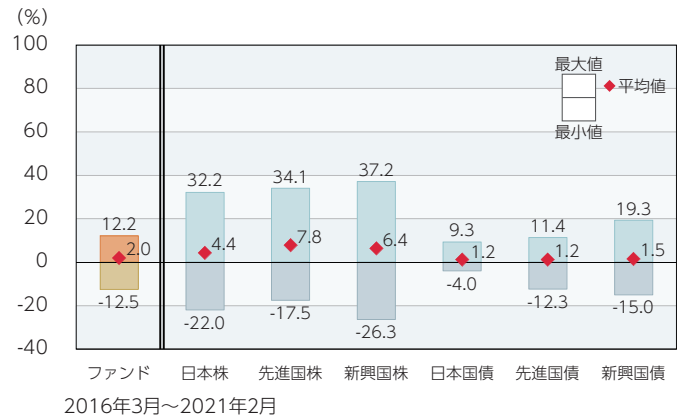
# 投資リスク

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



\*ファンドの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基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数 (TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村証券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス (除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

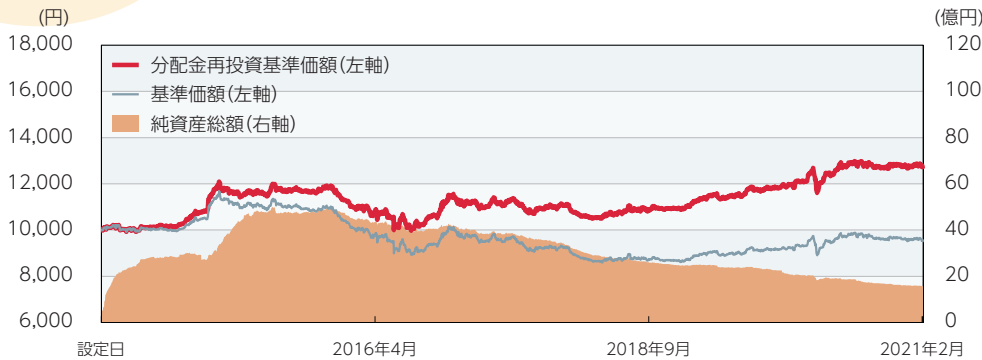
(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



# 運用実績

データの基準日:2021年2月26日

## 基準価額・純資産の推移 (2013年11月25日~2021年2月26日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※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。(設定日:2013年11月25日)

## 分配の推移(税引前)

2020年10月	20円
2020年11月	20円
2020年12月	20円
2021年1月	20円
2021年2月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	2,800円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ毎月決算クラス	97.18
2	DIAMマネーマーケットマザーファンド	0.38

### ■DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド

※ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーの現地月末データを基に作成しています。

※比率はDIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンドの純資産総額に対する割合です。

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種別	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	United States Treasury Note/Bond	国債	0.875	2030/11/15	3.9
2	US TSY INFL BOND 0.13 10/15/2025	国債	0.125	2025/10/15	3.1
3	United States Treasury Note/Bond	国債	0.375	2026/1/31	2.6
4	United States Treasury Note/Bond	国債	2.750	2042/8/15	1.8
5	United States Treasury Note/Bond	国債	1.625	2050/11/15	1.7
6	United States Treasury Note/Bond	国債	1.375	2050/8/15	1.6
7	Freddie Mac Pool	モーゲージ債	2.500	2050/10/1	1.5
8	Fannie Mae Pool	モーゲージ債	3.000	2047/2/1	0.9
9	Fannie Mae Pool	モーゲージ債	3.000	2048/11/1	0.8
10	Freddie Mac Pool	モーゲージ債	3.500	2047/12/1	0.8

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。





# 運用実績

データの基準日:2021年2月26日

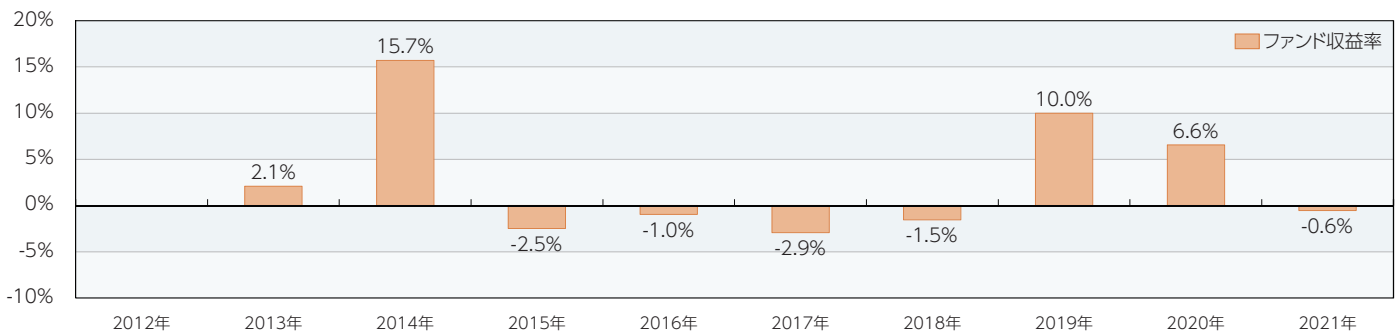
## ■DIAMマネーマーケットマザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

### 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	405回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2021/10/1	27.27
2	402回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2021/7/1	20.44
3	409回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/2/1	13.65

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2013年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



# 手続・手数料等

## 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)
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。)
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
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して7営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として営業日の午後3時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。
購入の申込期間	2021年5月25日から2021年11月22日まで ※申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。
購入・換金 申込不可日	以下のいずれかに該当する日には、購入・換金・スイッチングのお申込みの受付を行いません。 ・ニューヨーク証券取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
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・スイッチング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・スイッチングのお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	2023年8月23日まで(2013年11月25日設定)
繰上償還	当ファンドが主要投資対象とする外国投資信託が存続しないこととなった場合には、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)させます。 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。 ・受益者のために有利であると認める場合。 ・受益権口数が10億口を下回ることであった場合。 ・やむを得ない事情が発生した場合。
決算日	毎月23日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年12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。
信託金の限度額	5,000億円
公 告	原則として、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ( <a href="http://www.am-one.co.jp/">http://www.am-one.co.jp/</a> )に掲載します。
運用報告書	2月、8月のファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。 配当控除および益金不算入制度の適用はありません。
スイッチング	「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」と「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」との間でスイッチングができます。スイッチングとは、すでに保有しているファンドを換金すると同時に他のファンドの購入の申込みを行うことをいい、ファンドの換金代金が購入代金に充当されます。スイッチングの際には、ご換金時の費用(信託財産留保額)がかかるほか、税金および各販売会社が定める購入時手数料がかかる場合があります。 ※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。



# 手続・手数料等

## ファンドの費用・税金

### ■ファンドの費用

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、 <b>3.3% (税抜3.0%)</b> 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。 購入時手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。																						
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 <b>0.1%</b> 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)	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.99% (税抜0.90%)  信託報酬=運用期間中の基準価額×信託報酬率  ※運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。  ※運用管理費用(信託報酬)の配分は、各販売会社の取扱純資産額<sup>(注)</sup>に応じて、以下の通りとします。  (注)各販売会社の取扱純資産額の算出に当たっては、「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」の取扱純資産額を合算いたします。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用(信託報酬)の配分(税抜)</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円以下の部分</td> <td>年率0.35%</td> <td>年率0.51%</td> <td rowspan="3">年率0.04%</td> </tr> <tr> <td>300億円超800億円以下の部分</td> <td>年率0.30%</td> <td>年率0.56%</td> </tr> <tr> <td>800億円超の部分</td> <td>年率0.25%</td> <td>年率0.61%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table>	運用管理費用(信託報酬)の配分(税抜)				各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社	300億円以下の部分	年率0.35%	年率0.51%	年率0.04%	300億円超800億円以下の部分	年率0.30%	年率0.56%	800億円超の部分	年率0.25%	年率0.61%	主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
	運用管理費用(信託報酬)の配分(税抜)																						
	各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社																			
	300億円以下の部分	年率0.35%	年率0.51%	年率0.04%																			
300億円超800億円以下の部分	年率0.30%	年率0.56%																					
800億円超の部分	年率0.25%	年率0.61%																					
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価																				
投資対象とする外国投資信託	外国投資信託の純資産総額に対して年率0.49%程度 (注)ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。																						
実質的な負担	ファンドの日々の純資産総額に対して <b>年率1.48% (税抜1.39%) (概算)</b> ※上記はファンドが投資対象とする外国投資信託を高位に組み入れた状態を想定しています。																						
その他の費用・手数料	<p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料</li> <li>・信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 等</li> </ul> <p>監査費用は毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のとき、その他の費用等はその都度ファンドから支払われます。  ※投資対象とする外国投資信託においては、上記以外にもその他の費用・手数料等が別途かかる場合があります。  ※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。</p>																						

※上記手数料等の合計額、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。



# 手続・手数料等

## ■税金

- 税金は表に記載の時期に適用されます。
- 以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分 配 時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換 金（ 解 約 ） 時 お よ び 償 還 時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

※上記は2021年2月末現在のものです。

※少額投資非課税制度[愛称:NISA(ニーサ)]および未成年者少額投資非課税制度[愛称:ジュニアNISA(ジュニアニーサ)]をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。





使用開始日  
2021年5月25日



当ファンドは、特化型運用を行います。

## USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型

追加型投信／内外／債券

商品分類			属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ <sup>※2</sup>
追加型	内外	債券	その他資産(投資信託証券 <sup>※1</sup> )	年1回	グローバル(日本を含む)	ファンド・オブ・ファンズ	あり(適時ヘッジ <sup>*</sup> )

※1 投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「債券 一般」です。

※2 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

◆上記の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

\*当ファンドは、市況動向等に応じて為替ヘッジを行うことがあります。常に行うわけではありません。為替ヘッジについての詳細は、後述の「ファンドの特色」をご参照ください。

この目論見書により行う「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2021年5月24日に関東財務局長に提出しており、2021年5月25日にその効力が生じております。

- 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
- ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下、「請求目論見書」といいます。)は、委託会社のホームページで閲覧できます。  
本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ファンドの販売会社、基準価額等については委託会社の照会先までお問い合わせください。

〈委託会社〉[ファンドの運用の指図を行う者]

### アセットマネジメントOne 株式会社

金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第324号  
設立年月日:1985年7月1日  
資本金:20億円(2021年2月末現在)  
運用する投資信託財産の合計純資産総額:18兆1,306億円  
(2021年2月末現在)

委託会社への照会先

【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)

【ホームページアドレス】

<http://www.am-one.co.jp/>

〈受託会社〉[ファンドの財産の保管および管理を行う者]

### 株式会社りそな銀行

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。



# ファンドの目的・特色

## ファンドの目的

信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

## ファンドの特色

**1** 主として米ドル建て米国債券\*に投資し、各債券種類への投資比率を機動的に変更することで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

- 米ドル建ての外国投資信託「DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド」への投資を通じて、実質的に米ドル建て米国債券に投資します。外国投資信託への投資比率は、原則として高位を保ちますが、外国投資信託の流動性およびファンドの資金動向等を勘案の上決定します。
- 外国投資信託の実質的な運用は、ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーが行います。
- 外国投資信託の運用では、各債券種類への投資比率を機動的に変更します。

\*主要投資対象となる米ドル建て米国債券の主な債券種類は、米国の国債、政府機関債、モーゲージ債、投資適格社債、ハイイールド債等です。なお、米国以外の企業が発行した米ドル建て社債等に投資する場合があります。

**2** 通常時は為替ヘッジを行いませんが、円高・米ドル安が予想される局面では一時的に為替ヘッジを行います。

- ファンドの実質的な主要投資対象資産は米ドル建て債券です。この米ドルの対円為替変動リスクについて、通常時は為替ヘッジを行わず円安・米ドル高による為替差益の獲得をめざします。
- 円高・米ドル安が予想される局面では、一時的に為替ヘッジを行い、基準価額への為替変動リスクの低減をめざします。
- 為替ヘッジ取引については委託会社が行います。

**3** 分配頻度の異なる2つのファンド(毎月決算型、年1回決算型)から、お客さまの投資ニーズに合わせて選択できます。

① USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型	毎月23日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として配当等収益と売買益等から分配を行います。
② USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型	毎年8月23日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として配当等収益と売買益等から分配を行います。

※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。

※「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」を選択される際には、当該ファンドの目論見書をご覧ください。

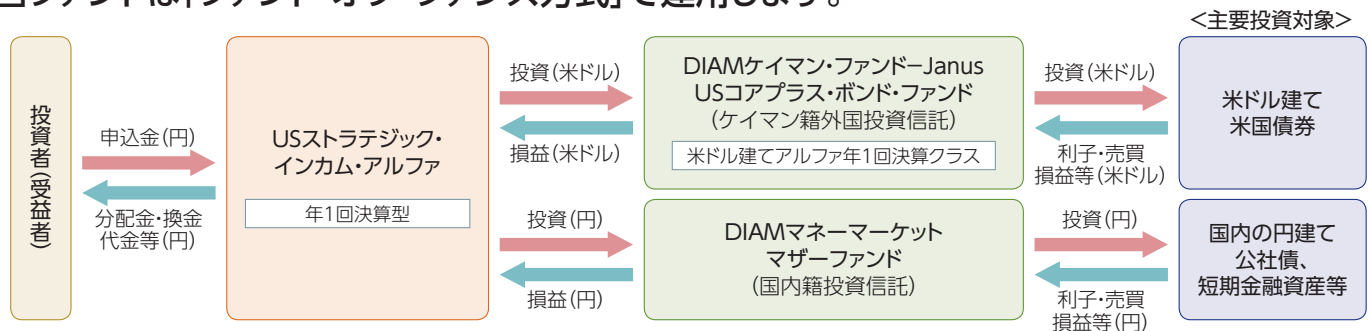


# ファンドの目的・特色

- 当ファンドは、特化型運用ファンドです。特化型運用ファンドとは、投資対象に一般社団法人投資信託協会規則に定める寄与度\*が10%を超える支配的な銘柄が存在し、または存在することとなる可能性が高いファンドをいいます。
  - 当ファンドが実質的な主要投資対象とする米ドル建て米国債券には、寄与度が10%を超えるまたは超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、投資先について特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該支配的な銘柄に経営破綻や経営・財務状況の悪化などが生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。
- \*寄与度とは、投資対象候補銘柄の時価総額に占める一発行体当たりの時価総額の割合、または運用管理等に用いる指数における一発行体当たりの構成割合をいいます。

## ■ ファンドの仕組み

当ファンドは「ファンド・オブ・ファンズ方式」で運用します。



※当ファンドは、「DIAMマネーマーケットマザーファンド」にも投資します。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。



# ファンドの目的・特色

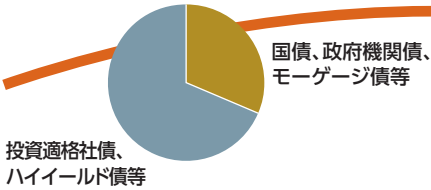
## ストラテジック・インカム戦略

ストラテジック・インカム戦略では、市場環境の変化をとらえ、それに応じて値動きの異なる各債券種類への投資比率を機動的に変更し、より安定した収益の確保をめざします。

### 各債券種類への投資比率変更の例

#### 景気拡大局面 (金利上昇局面)

景気拡大が見込まれるときには、投資適格社債、ハイイールド債などの投資比率の引き上げ等を行います。

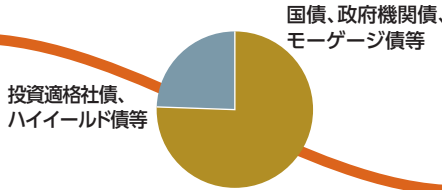


この局面では…

- 企業業績の向上・財務内容の改善
  - 格付の引き上げ(社債)
  - インフレ率の上昇
  - 国債価格の下落
- など

#### 景気減速局面 (金利低下局面)

景気減速が見込まれるときには、国債、政府機関債、モーゲージ債などの投資比率の引き上げ等を行います。

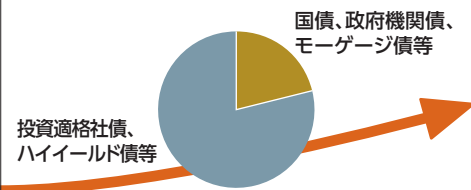


この局面では…

- 企業業績の悪化・財務内容の悪化
  - 格付の引き下げ(社債)
  - インフレ率の低下
  - 国債価格の上昇
- など

#### 景気回復局面 (金利上昇局面)

景気回復が見込まれるときには、投資適格社債、ハイイールド債などの投資比率の引き上げ等を行います。



この局面では…

- 企業業績の向上・財務内容の改善
  - 格付の引き上げ(社債)
  - インフレ率の上昇
  - 国債価格の下落
- など

※ 上記はイメージであり、実際と異なる場合があります。また、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

※ 上記は景気動向および資産配分、景気局面での事象の一例を示したものであり、すべてを網羅したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。

### 景気拡大(回復)局面で優位

#### 投資適格社債

投資適格の格付(BBB格相当以上)を有する社債。信用リスクがあるため、国債より高い利回りを有する。



#### ハイイールド債

信用力が比較的低い(BB格相当以下)社債。高い利回りが期待できる反面、価格変動が大きい。



### 景気減速局面で優位

#### 国債

政府が発行する債券。高い信用力と流動性を有する。



#### 政府機関債

政府系機関が発行する債券。国債に準ずる高い信用力と流動性を有する。



#### モーゲージ債

住宅ローン債権を担保とし、多くは政府系機関から保証または発行される証券。期限前償還リスクがあるため国債より高い利回りを有する。



※ 上記は、米国の各債券の概要に関する一般的な説明の一部であり、すべてを網羅したものではありません。

※ 格付はS&Pの表記方法で表示しています。

## モーゲージ債とは～もっと知りたいあなたへ～

米国の債券市場において、モーゲージ債の残高は約10.9兆米ドルと国債に次ぐ発行残高です。モーゲージ債の大部分は政府系機関から発行・保証されているため、信用力は非常に高いものとなっています。また、一般的に金利上昇局面では同年限の国債に比べ下落幅が小さいことも特徴です。

住宅ローンの借り手



金融機関



証券化機関



投資家



住宅ローン貸出

住宅ローン債権の売却

政府系機関

モーゲージ債の発行  
元利金支払いの保証

※ 上記は、モーゲージ債の一般的な仕組みを示したイメージであり、すべての仕組みを説明したものではありません。  
※ 2020年9月末時点

(出所:米国証券業金融市場協会、各種資料をもとに委託会社作成)

上記は過去の情報であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

※ 上記は、委託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。  
※ 上記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。

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。



# ファンドの目的・特色

## ■主な投資制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③1発行体等あたりの当ファンドの純資産総額に対する実質比率は、原則として、35%以内とします。

## 追加的記載事項

### ■当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

ファンド名	DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス
形態	ケイマン籍米ドル建て外国投資信託
主要投資対象	米ドル建て米国債券(*)を主要投資対象とします。 (*)主要投資対象となる米ドル建て米国債券の主な債券種類は、米国の国債、政府機関債、モーゲージ債、投資適格社債、ハイイールド債等です。なお、米国以外の企業が発行した米ドル建て社債等に投資する場合があります。
投資態度	<p>①主として米ドル建て米国債券への投資を通じて、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・「ブルームバーグ・パークレイズ米国総合インデックス」<sup>(注)</sup>をベンチマークとし、ベンチマークを上回る成果をめざします。</li> <li>・企業ファンダメンタルズに基づくクレジット・リサーチにより、銘柄選択を行います。</li> <li>・各種債券セクターへの投資比率を機動的に変更します。</li> </ul> <p>②ポートフォリオのデュレーションは、ベンチマーク対比で125%から60%の範囲を目安とします。</p> <p>③投資する証券の平均格付(*)は、BBB-格相当以上とします。 (*)平均格付は時価加重平均で判定します。</p> <p>④ハイイールド債券(*)への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の35%以内とします。 (*)ハイイールド債券とは、格付会社3社のうち1社以上によって、BB+格相当以下に格付されている債券をさします。</p> <p>⑤同一発行体の発行する債券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。ただし、米国国債、米国政府機関債、およびモーゲージ債を除きます。なお、同一の政府支援機関が発行または保証等を行う債券(モーゲージ債を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の35%以内とします。</p> <p>⑥原則として、現金および現金等価物への投資は信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑦組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑧デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定しません。米国債先物をファンド全体のデュレーション・コントロールに活用する場合等があります。</p> <p>⑨ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに運用の指図にかかる権限を委託します。</p> <p>(注)ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。</p>
債券運用プロセス	<p>市場環境の変化をとらえ、各債券種類への投資比率を機動的に変更し、資産の長期的な安定成長をめざします。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>① 企業調査や債券市場などの多角的な情報から、独自のマクロ経済見通しを策定</li> <li>② 個別企業の調査・分析に基づき、社債の投資比率を決定し、銘柄を選別</li> <li>③ 社債以外の各種債券の投資魅力度を判断し、投資比率を決定</li> </ol> <p style="text-align: center;"><b>ポートフォリオの構築</b></p> <p style="text-align: right;">※2021年2月末現在 (出所:ジャナスの情報をもとに委託会社作成)</p>





# ファンドの目的・特色

主な投資制限	<p>①原則として、株式への投資は行いません。(ただし、コーポレートアクション等により取得した場合、可能な限り速やかに売却することとします。)</p> <p>②転換社債への投資は可としますが、原則として株式への転換は不可とします。</p> <p>③有価証券の空売りは行いません。</p> <p>④流動性に欠ける資産への投資は、信託財産の純資産総額の15%を超えないものとします。</p> <p>⑤信託財産の純資産総額の10%を超える借入は行いません。</p> <p>⑥投資信託証券(上場投資信託証券を含みます。 )への投資は行いません。</p> <p>⑦金融商品取引法上の有価証券および有価証券関連デリバティブ取引への投資比率は信託財産総額の50%以上とします。</p>
主要関係法人	<p>投資顧問会社:アセットマネジメントOne株式会社</p> <p>副投資顧問会社:ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー</p> <p>受託会社:ファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド</p> <p>管理事務代行会社:米国みずほ銀行</p> <p>保管銀行:米国みずほ銀行</p>
申込手数料	ありません。
信託報酬等	<p>純資産総額に対して年率0.49%程度</p> <p>(注)ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。</p>
その他費用	<p>信託財産に関する租税、組入資産の売買時の売買手数料、信託事務の処理に要する費用、信託財産の監査に要する費用、法律関係の費用、資産の保管などに要する費用、借入金の利息および立替金の利息などを負担する場合があります。また、ファンドの設立に係る費用はファンドが負担します。</p>

## ■ ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーについて

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーは、ジャナス・ヘンダーソン・グループの一員です。同グループは、ニューヨーク証券取引所およびオーストラリア証券取引所に上場している世界有数のアクティブ運用会社です。同グループは世界26都市のオフィスに2,000名超の従業員が在籍しており、グループの総運用資産残高は約4,016億米ドルに上ります(2020年12月末時点)。

創業以来、一貫して資産運用に専念。揺るぎない投資哲学と豊富な専門知識、グローバルに広がるネットワークを基盤に、様々な資産運用戦略の提供に取り組み、確かな実績を築いています。

(出所:ジャナスの情報をもとに委託会社作成)

ファンド名	DIAMマネーマーケットマザーファンド
主要投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産とします。
投資態度	<p>①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関<sup>(*)</sup>の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;Pとします。</p> <p>②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用会社(委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
信託報酬	ありません。

○マザーファンドの主な投資制限については、請求目論見書に記載しております。

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。



# 投資リスク

## 基準価額の変動要因

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて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。

### 金利 リスク

**金利の上昇(債券の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。**

一般的に金利が上昇すると債券の価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券に投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。当ファンドが実質的に投資するハイイールド債は、こうした金利変動の影響をより大きく受ける可能性があります。

### 為替 リスク

**為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。**

当ファンドは実質組入外貨建資産について、円高・米ドル安が予想される局面に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない場合、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高・米ドル安になった場合には基準価額が下がる要因となります。為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

当ファンドは、必ずしも円高・米ドル安局面で為替ヘッジを行うことや、円安・米ドル高局面で為替ヘッジを行わないことを約束するものではありません。為替ヘッジのタイミング等により、為替ヘッジを行っても為替変動リスクを抑制できない場合や為替ヘッジを行わなくても為替差益を享受できない場合があります。

### 信用 リスク

**投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。**

当ファンドが実質的に投資する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、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。当ファンドが実質的に投資するハイイールド債は、格付の高い債券に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

### 流動性 リスク

**投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。**

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もあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。当ファンドが実質的に投資するハイイールド債は、格付の高い債券に比べ市場規模や取引量が少なく、市況動向等によっては取引機会を急激に逸失するなど、流動性リスクが大きくなる場合があります。



# 投資リスク

## 期限前償還 リスク

住宅ローンの期限前償還の増減は、モーゲージ債の金利感応度を変化させ、基準価額の変動要因となる場合があります。

モーゲージ債の原資産である住宅ローンは、一般的に金利が低下すると借り換えによる返済が増え、金利が上昇すると借り換えによる返済が減少する傾向があり、モーゲージ債の価格は上下します。当ファンドは、実質的にモーゲージ債に投資しますので、住宅ローンの期限前返済の増減にともなう金利感応度の変化により基準価額が上下したり、基準価額が大きく下がる場合があります。

## 再投資 リスク

モーゲージ債の期限前償還等により再投資する場合は、金利低下時には利回りが低下し、債券価格が下落する場合があります。

投資したモーゲージ債の期限前償還などにより生じた金銭は、その時の実勢金利にて再投資しなければならないため、金利低下局面では、再投資後の利回りが、当初期待した利回りより低くなることもあり、当該債券の価格は下落する場合があります。したがって、モーゲージ債の期限前の償還金の増減により、基準価額が上下します。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。



# 投資リスク

## その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、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。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、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。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、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。

- 「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」と「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

## リスクの管理体制

委託会社では、運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。また、運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

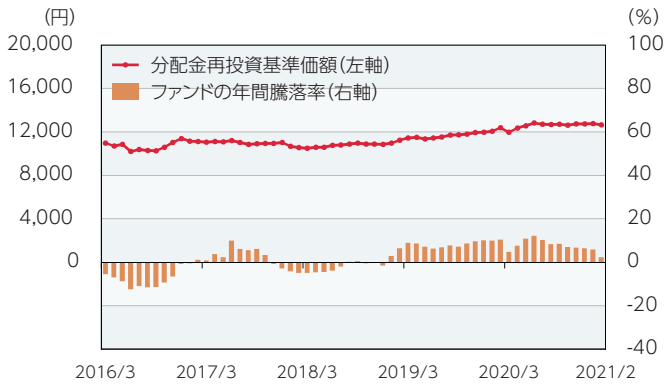
※リスク管理体制は、今後変更になることがあります。



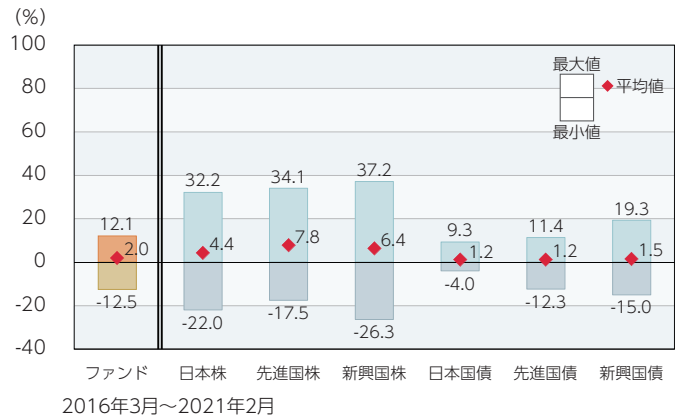
# 投資リスク

## <参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



\*ファンドの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基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数 (TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村証券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス (除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

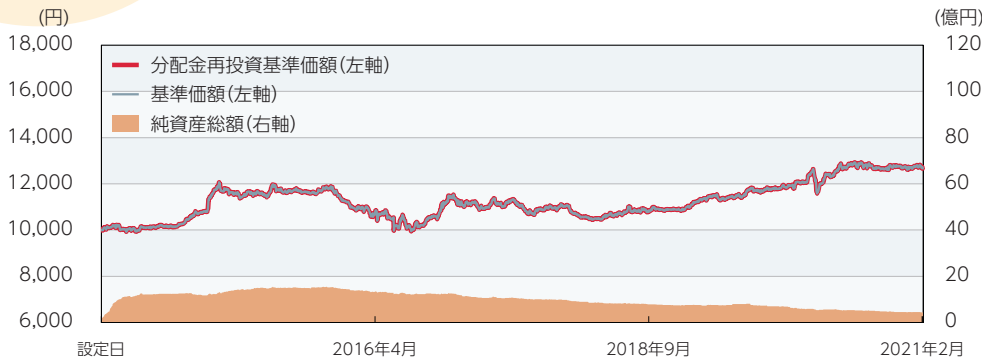




# 運用実績

データの基準日:2021年2月26日

## 基準価額・純資産の推移 (2013年11月25日~2021年2月26日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※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。  
(設定日:2013年11月25日)

## 分配の推移(税引前)

2016年 8月	0円
2017年 8月	0円
2018年 8月	0円
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	DIAMケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス	96.87
2	DIAMマネーマーケットマザーファンド	0.55

■DIAMケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンド

※ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーの現地月末データを基に作成しています。

※比率はDIAMケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンドの純資産総額に対する割合です。

### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種別	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	United States Treasury Note/Bond	国債	0.875	2030/11/15	3.9
2	US TSY INFL BOND 0.13 10/15/2025	国債	0.125	2025/10/15	3.1
3	United States Treasury Note/Bond	国債	0.375	2026/1/31	2.6
4	United States Treasury Note/Bond	国債	2.750	2042/8/15	1.8
5	United States Treasury Note/Bond	国債	1.625	2050/11/15	1.7
6	United States Treasury Note/Bond	国債	1.375	2050/8/15	1.6
7	Freddie Mac Pool	モーゲージ債	2.500	2050/10/1	1.5
8	Fannie Mae Pool	モーゲージ債	3.000	2047/2/1	0.9
9	Fannie Mae Pool	モーゲージ債	3.000	2048/11/1	0.8
10	Freddie Mac Pool	モーゲージ債	3.500	2047/12/1	0.8

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。





# 運用実績

データの基準日:2021年2月26日

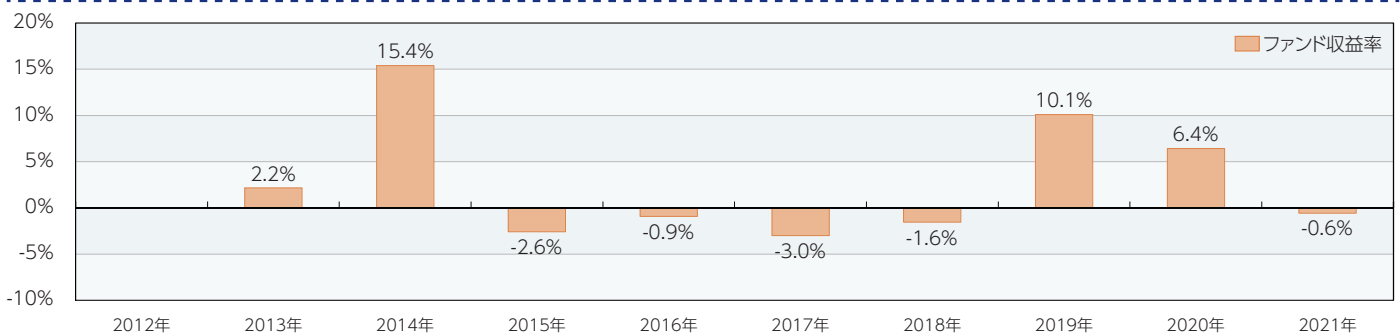
## ■DIAMマネーマーケットマザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

### 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	405回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2021/10/1	27.27
2	402回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2021/7/1	20.44
3	409回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/2/1	13.65

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2013年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



# 手続・手数料等

## 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)
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。)
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
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して7営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として営業日の午後3時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。
購入の申込期間	2021年5月25日から2021年11月22日まで ※申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。
購入・換金 申込不可日	以下のいずれかに該当する日には、購入・換金・スイッチングのお申込みの受付を行いません。 ・ニューヨーク証券取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
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・スイッチング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・スイッチングのお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	2023年8月23日まで(2013年11月25日設定)
繰上償還	当ファンドが主要投資対象とする外国投資信託が存続しないこととなった場合には、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)させます。 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。 ・受益者のために有利であると認める場合。 ・受益権口数が10億口を下回ることであった場合。 ・やむを得ない事情が発生した場合。
決算日	毎年8月23日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年1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。
信託金の限度額	5,000億円
公 告	原則として、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ( <a href="http://www.am-one.co.jp/">http://www.am-one.co.jp/</a> )に掲載します。
運用報告書	ファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて交付します。
課税関係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。 配当控除および益金不算入制度の適用はありません。
スイッチング	「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」と「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」との間でスイッチングができます。スイッチングとは、すでに保有しているファンドを換金すると同時に他のファンドの購入の申込みを行うことをいい、ファンドの換金代金が購入代金に充当されます。スイッチングの際には、ご換金時の費用(信託財産留保額)がかかるほか、税金および各販売会社が定める購入時手数料がかかる場合があります。 ※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。



# 手続・手数料等

## ファンドの費用・税金

### ■ファンドの費用

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、 <b>3.3% (税抜3.0%)</b> 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。 購入時手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。																						
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 <b>0.1%</b> 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)	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.99% (税抜0.90%)            信託報酬=運用期間中の基準価額×信託報酬率            ※運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。            ※運用管理費用(信託報酬)の配分は、各販売会社の取扱純資産額<sup>(注)</sup>に応じて、以下の通りとします。            (注)各販売会社の取扱純資産額の算出に当たっては、「USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」の取扱純資産額を合算いたします。</p> <table border="1" style="width: 100%; text-align: center;"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用(信託報酬)の配分(税抜)</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円以下の部分</td> <td>年率0.35%</td> <td>年率0.51%</td> <td rowspan="3">年率0.04%</td> </tr> <tr> <td>300億円超800億円以下の部分</td> <td>年率0.30%</td> <td>年率0.56%</td> </tr> <tr> <td>800億円超の部分</td> <td>年率0.25%</td> <td>年率0.61%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価</td> <td>購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価</td> <td>運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価</td> </tr> </tbody> </table>	運用管理費用(信託報酬)の配分(税抜)				各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社	300億円以下の部分	年率0.35%	年率0.51%	年率0.04%	300億円超800億円以下の部分	年率0.30%	年率0.56%	800億円超の部分	年率0.25%	年率0.61%	主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
	運用管理費用(信託報酬)の配分(税抜)																						
	各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社																			
	300億円以下の部分	年率0.35%	年率0.51%	年率0.04%																			
300億円超800億円以下の部分	年率0.30%	年率0.56%																					
800億円超の部分	年率0.25%	年率0.61%																					
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価																				
投資対象とする外国投資信託	外国投資信託の純資産総額に対して年率0.49%程度 (注)ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。																						
実質的な負担	ファンドの日々の純資産総額に対して <b>年率1.48% (税抜1.39%) (概算)</b> ※上記はファンドが投資対象とする外国投資信託を高位に組み入れた状態を想定しています。																						
その他の費用・手数料	<p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・組入有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料</li> <li>・信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 等</li> </ul> <p>監査費用は毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、その他の費用等はその都度ファンドから支払われます。</p> <p>※投資対象とする外国投資信託においては、上記以外にもその他の費用・手数料等が別途かかる場合があります。</p> <p>※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。</p>																						

※上記手数料等の合計額、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。



# 手続・手数料等

## ■税金

- 税金は表に記載の時期に適用されます。
- 以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分 配 時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換 金（ 解 約 ） 時 お よ び 償 還 時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対して20.315%

※上記は2021年2月末現在のものです。

※少額投資非課税制度[愛称:NISA(ニーサ)]および未成年者少額投資非課税制度[愛称:ジュニアNISA(ジュニアニーサ)]をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人の場合は上記とは異なります。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。



<白 紙>



