

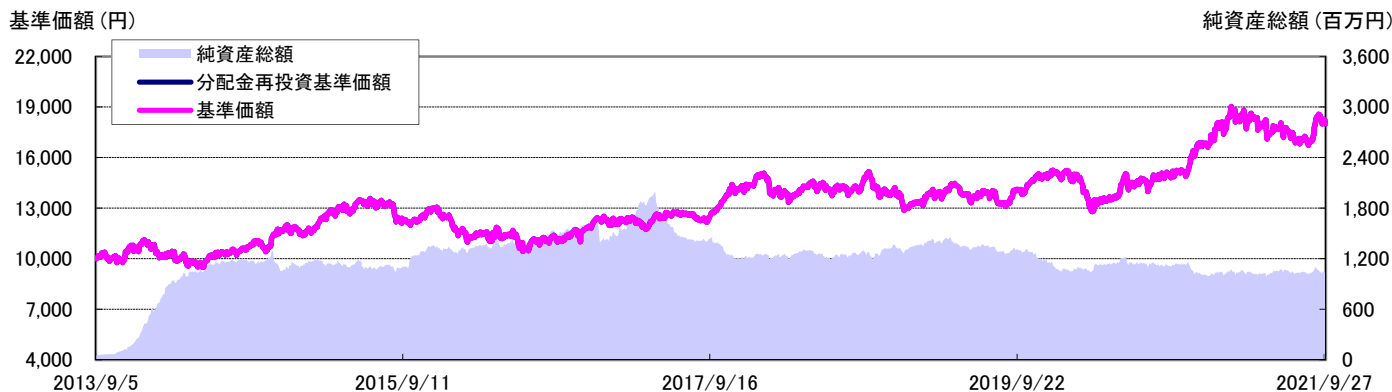
日経225リスクコントロールオープン

追加型投信／国内／株式

2021年9月30日基準

運用実績

運用実績の推移



(設定日:2013年9月6日)

基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。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。

分配金再投資基準価額＝前日分配金再投資基準価額×(当日基準価額÷前日基準価額)(※決算日の当日基準価額は税引前分配金込み)

基準価額は設定日前日を10,000円として計算しています。

上記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。

基準価額・純資産総額

基準価額	17,996 円
純資産総額	1,030 百万円

※基準価額は1万口当たり。

分配金実績(税引前) ※直近3年分

第6期 (2019.08.08)	0 円
第7期 (2020.08.11)	0 円
第8期 (2021.08.10)	0 円
設定来累計分配金	0 円

ポートフォリオ構成

実質株式組入比率	72.7 %
株式現物	72.4 %
株式先物	0.2 %
現金等	27.6 %
組入銘柄数	225

※1 実質株式組入比率とは、インデックス225 マザーファンドを通じて実質的に保有する株式現物と株式先物を合計した比率(純資産総額比)です。なお、当ファンドで直接組入れた場合、その株式現物および株式先物も含まれます。

※2 現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をあらわします。

※1 分配金は1万口当たり。

※2 上記の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。

※3 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。

騰落率(税引前分配金再投資)

1か月	3か月	6か月	1年	2年	3年
4.73%	2.05%	-0.97%	20.20%	28.39%	19.46%

※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。

※2 上記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。

※3 各期間は、基準日から過去に遡っています。

※ 当資料は6枚ものです。

※ P.5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。



アセットマネジメントOne

日経225リスクコントロールオープン

2021年9月30日基準

組入上位10業種

No.	業種	組入比率(%)
1	電気機器	17.41
2	小売業	8.21
3	情報・通信業	8.00
4	化学	5.58
5	医薬品	5.29
6	サービス業	4.90
7	機械	3.47
8	輸送用機器	3.24
9	精密機器	2.84
10	食料品	2.70

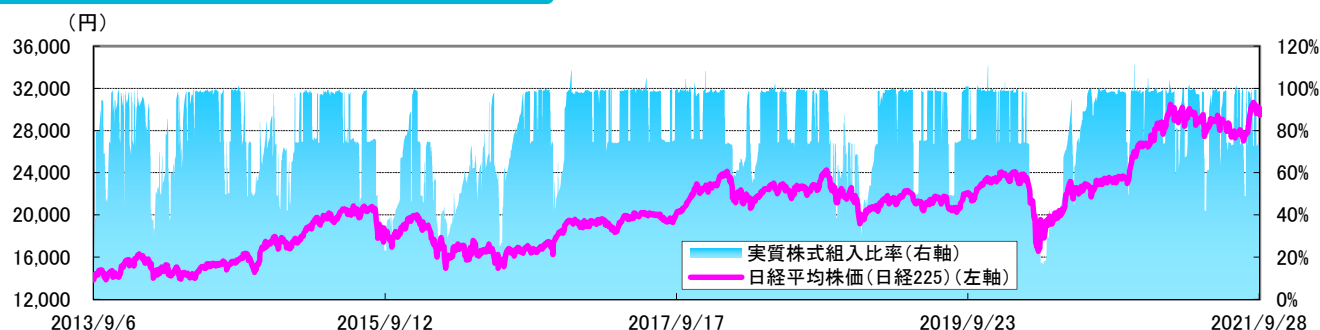
※ 組入比率は純資産総額に対する割合です。

組入上位10銘柄

No.	銘柄	組入比率(%)
1	ファーストリテイリング	7.15
2	東京エレクトロン	4.31
3	ソフトバンクグループ	3.37
4	ファナック	2.13
5	ダイキン工業	2.12
6	KDDI	1.92
7	テルモ	1.83
8	リクルートホールディングス	1.78
9	アドバンテスト	1.74
10	エムスリー	1.66

※ 組入比率は純資産総額に対する割合です。

実質株式組入比率の推移(設定来)



※ 実質株式組入比率とは、日経225インデックスファンド・マザーファンドおよびインデックス225 マザーファンドを通じて実質的に保有する株式現物と株式先物を合計した比率(純資産総額比)です。なお、日経225インデックスファンド・マザーファンドの組入は2013年9月6日～2021年9月16日まで、インデックス225 マザーファンドの組入は2021年6月2日より開始。また、当ファンドで直接組入れた場合、その株式現物および株式先物も含まれます。

【ご参考】日経平均株価の騰落率

1か月	3か月	6か月	1年	2年	3年
4.85%	2.30%	0.94%	27.03%	35.38%	22.11%

マーケット動向

当月の国内株式市場は上昇しました。上旬は、前月下旬からの上昇基調が続く中、菅首相が自民党総裁選への不出馬を表明すると、衆院選における与党大敗が回避されるとの期待などから一段と上昇しました。中旬は、米国と中国の株安が重しとなったものの、総裁選への期待感が続き、上昇幅を拡大しました。下旬は、中国不動産大手の巨額債務を巡る懸念などに伴う米国と中国の株安から下落し、月間の上昇幅を縮小しました。

当ファンドの動き

2021年8月末から2021年9月末までの日経平均株価のリターンが4.85%だったのに対し、ファンドのリターンは4.73%となりました。日経平均株価のボラティリティ(株価変動率)は、月初から中旬までは低い水準で推移しましたが、下旬はやや上昇基調となりました。シグナルは、上旬は概ね安定局面を示しましたが、中旬から下旬はほぼ警戒局面を示す展開となりました。この結果、上旬は実質組入比率を99%前後の水準で推移させましたが、中旬から月末にかけては、実質組入比率を約73%程度に引き下げる展開となりました。月末時点における実質株式組入比率は約73%となりました。

※ 上記のマーケット動向と当ファンドの動きは、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、四捨五入して表示しています。

※ 当資料は6枚ものです。

※ P.5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。



アセットマネジメントOne

日経225リスクコントロールオープン

2021年9月30日基準

ファンドの特色(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。

○ わが国の株式に実質的に投資し、信託財産の成長を目的として、積極的な運用を行います。

- ・ 当ファンドは、日経225インデックスファンド・マザーファンド、日経225採用銘柄、および株価指数先物取引等を主要投資対象とします。

* マザーファンドの入替のため、「インデックス225 マザーファンド」を2021年6月2日に投資対象に追加し、「日経225インデックスファンド・マザーファンド」を2021年9月17日に投資対象から削除する予定です。

○ リスクコントロール戦略を活用し、基準価額の下落リスクを軽減することをめざします。

○ 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。

主な投資リスクと費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、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。その他の留意点など、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。

- 株価変動リスク…………… 当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。当ファンドは実質株式組入比率を変更することで、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行います。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。当ファンドは運用に当たって株価指数先物取引を活用しますが、組入株式と指数先物の価格変動率は一致するものではありません。そのため、実質株式組入比率を引き下げるために指数先物売り建ての場合、組入株式と指数先物の値動きの差がファンドの収益となる場合があります。一方、損失となる場合があります。
- 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もあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。
- 信用リスク…………… 当ファンドが実質的に投資する株式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。

当ファンドへの投資に伴う主な費用は購入時手数料、信託報酬などです。

費用の詳細につきましては、当資料中の「ファンドの費用」および投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

○「日経平均株価」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、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」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ています。当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません。

※ 当資料は6枚ものです。

※ P.5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。



アセットマネジメントOne

日経225リスクコントロールオープン

2021年9月30日基準

お申込みメモ(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

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	換金申込受付日の基準価額
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。
申込締切時間	原則として営業日の午後3時まで販売会社が受付けたものを当日分のお申込みとします。
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。
信託期間	2028年8月8日まで(2013年9月6日設定)
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)することができます。 ・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となった場合。 ・やむを得ない事情が発生したとき。
決算日	毎年8月8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。
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、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)」の適用対象です。 ※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。

ファンドの費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

以下の手数料等の合計額、その上限額等については、購入金額や保有期間など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場合があります。

●投資者が信託財産で間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。 ※くわしくは販売会社にお問い合わせください。
換金手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

●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1.1%(税抜1.0%)
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。

※ 当資料は6枚ものです。

※ P.5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。



アセットマネジメントOne

日経225リスクコントロールオープン

2021年9月30日基準

投資信託ご購入の注意

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。
- 当ファンドは、実質的に株式等の値動きのある有価証券に投資をします。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。ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。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(2021年10月11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。

◆収益分配金に関する留意事項◆

- 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で、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。

◆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 <http://www.am-one.co.jp/>

販売会社(お申込み、投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください)

○印は協会への加入を意味します。

2021年10月11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
株式会社岩手銀行	登録金融機関 東北財務局長(登金)第3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	○		○		
株式会社紀陽銀行	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第8号	○				
株式会社中国銀行	登録金融機関 中国財務局長(登金)第2号	○		○		
第一生命保険株式会社	登録金融機関 関東財務局長(登金)第657号	○	○			
auカブコム証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第61号	○	○	○		
株式会社SBI証券	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第44号	○		○	○	
静岡東海証券株式会社	金融商品取引業者 東海財務局長(金商)第8号	○				
立花証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第110号	○		○		
楽天証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○	
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	○	
株式会社山形銀行	登録金融機関 東北財務局長(登金)第12号	○				※1
株式会社池田泉州銀行	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第6号	○		○		※1

●その他にもお取扱いを行っている販売会社があります。

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。

<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)

※ 当資料は6枚ものです。



アセットマネジメントOne

日経225リスクコントロールオープン

2021年9月30日基準

販売会社(お申込み、投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください)

2021年10月11日現在

以下は取次販売会社です。
○印は協会への加入を意味します。

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
大地みらい信用金庫	登録金融機関 北海道財務局長(登金)第26号					
福島信用金庫	登録金融機関 東北財務局長(登金)第50号					
桐生信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第234号					
しのめ信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第232号					
足利小山信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第217号					
栃木信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第224号					
結城信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第228号					
飯能信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第203号					
朝日信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第143号	○				
東京東信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第179号	○				
西武信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第162号	○				
三条信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第244号					
新井信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第241号					
長野信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第256号	○				
飯田信用金庫	登録金融機関 関東財務局長(登金)第252号					
静清信用金庫	登録金融機関 東海財務局長(登金)第43号	○				
豊川信用金庫	登録金融機関 東海財務局長(登金)第54号					
豊田信用金庫	登録金融機関 東海財務局長(登金)第55号	○				
滋賀中央信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第79号					
長浜信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第69号					
京都北都信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第54号					
大阪信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第45号					
永和信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第43号					
姫路信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第80号	○				
尼崎信用金庫	登録金融機関 近畿財務局長(登金)第39号	○				
呉信用金庫	登録金融機関 中国財務局長(登金)第25号					
愛媛信用金庫	登録金融機関 四国財務局長(登金)第15号					
福岡ひびき信用金庫	登録金融機関 福岡財務支局長(登金)第24号	○				
桑名三重信用金庫	登録金融機関 東海財務局長(登金)第37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。

<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)

※ 当資料は6枚ものです。

※ P.5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。



アセットマネジメントOne