

## 償還 運用報告書（全体版）

第10期<償還日2024年6月27日>

### DIAM新興国債券インデックスファンド <為替ヘッジなし>（ファンドラップ）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券（インデックス型）				
信託期間	2015年10月13日から2024年6月27日（当初無期限）までです。				
運用方針	J Pモルガン・エマーゼィング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。				
主要投資対象	<table border="1"> <tr> <td>DIAM新興国債券インデックスファンド&lt;為替ヘッジなし&gt;（ファンドラップ）</td> <td>エマーゼィング債券パッシブ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。</td> </tr> <tr> <td>エマーゼィング債券パッシブ・マザーファンド</td> <td>新興国の公社債を主要投資対象とします。</td> </tr> </table>	DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	エマーゼィング債券パッシブ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。	エマーゼィング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	エマーゼィング債券パッシブ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。				
エマーゼィング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。				
運用方法	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。実質組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが実質的に保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。実質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。				
組入制限	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。				
分配方針	決算日（原則として5月8日。休業日の場合は翌営業日。）に、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。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。				

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）」は、この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

## D I AM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)

### ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配 金	期 騰 落 率	期 騰 落 率	騰 落 率			
(設定日) 2015年10月13日	円 10,000	円 -	% -	ポイント (10月9日) 85,151.60	% -	% -	% -	百万円 1
1期 (2016年5月9日)	9,417	0	△5.8	81,280.93	△4.5	95.5	-	166
2期 (2017年5月8日)	10,267	0	9.0	91,875.21	13.0	96.4	-	210
3期 (2018年5月8日)	9,760	0	△4.9	86,418.83	△5.9	96.8	-	462
4期 (2019年5月8日)	10,457	0	7.1	92,116.41	6.6	97.2	-	470
5期 (2020年5月8日)	10,470	0	0.1	87,984.87	△4.5	105.4	-	274
6期 (2021年5月10日)	11,566	0	10.5	99,070.46	12.6	98.6	-	415
7期 (2022年5月9日)	10,674	0	△7.7	91,394.40	△7.7	87.3	-	294
8期 (2023年5月8日)	11,150	0	4.5	94,935.67	3.9	98.0	-	199
9期 (2024年5月8日)	13,025	0	16.8	119,726.93	26.1	98.4	-	135
(償還日) 2024年6月27日	(償還価額) 13,385.14	0	2.8	125,035.96	4.4	-	-	135

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) ベンチマークはJPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています (以下同じ)。

(注5) JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. Morgan・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します (以下同じ)。

(注6) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

### ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2024年5月8日	円 13,025	% -	ポイント 119,726.93	% -	% 98.4	% -
5月末	13,131	0.8	120,731.93	0.8	97.8	-
(償還日) 2024年6月27日	(償還価額) 13,385.14	2.8	125,035.96	4.4	-	-

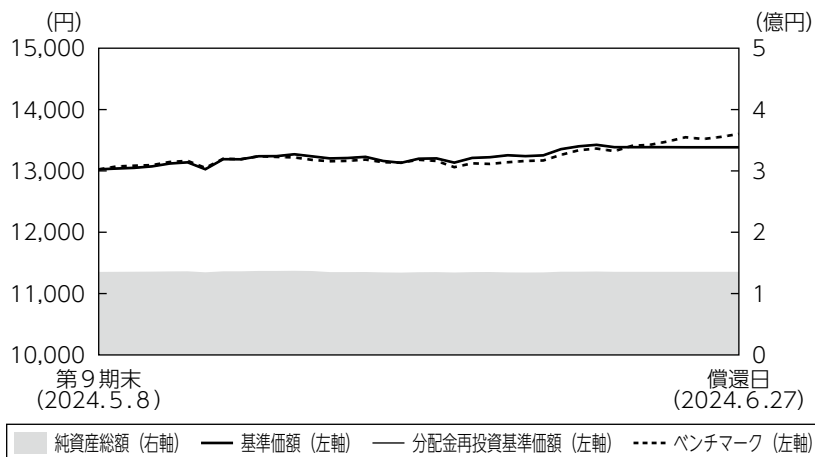
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■設定以来の運用経過（2015年10月13日から2024年6月27日まで）

### 第10期の基準価額等の推移



第10期首： 13,025円  
償還日： 13,385.14円  
(既払分配金0円)  
騰落率： 2.8%  
(分配金再投資ベース)

- (注1) 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

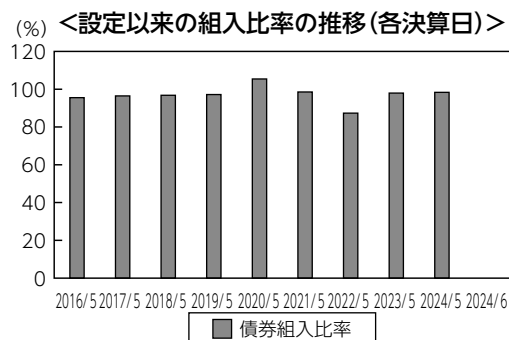
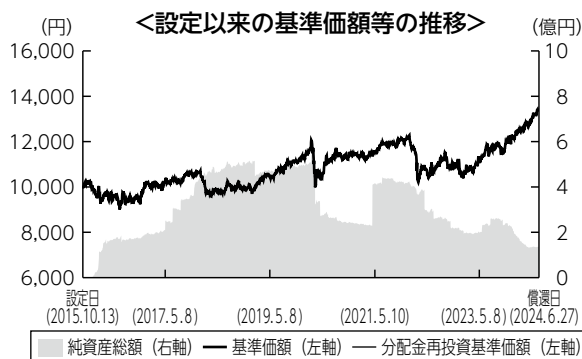
当期の新興国債券市場では、米国でC P I（消費者物価指数）の伸びが鈍化したことなどを背景に米国債券が上昇し、それに連れて多くの新興国債券が上昇しました。また、為替市場では円安米ドル高が進行しました。これらを受けて基準価額は上昇しました。

設定来では、33.9%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金0円）。設定来の新興国債券市場は、リスク選好の改善などを受けて上昇しました。為替市場では、日米の金利差が意識されたことなどから円安米ドル高が進行しました。これらを受けて基準価額は上昇しました。

## 設定来の投資環境

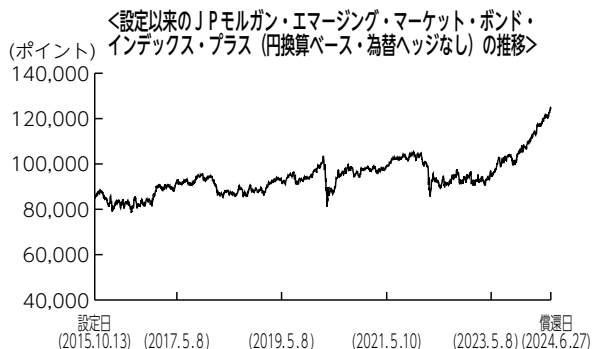
新興国債券市場は上昇しました。設定日から2021年にかけては、2020年3月に世界的な新型コロナウイルス感染拡大などを受けて一時下落したものの、概ね上昇基調で推移しました。その後、2022年2月にロシアがウクライナに軍事侵攻したことを受けて下落し、米中央銀行による金融引き締めなどもあり2022年10月にかけて下落基調となりました。償還日にかけては、堅調な米経済指標などを受けてリスク選好が改善したことなどから値を戻しました。

為替市場では米ドル/円相場は円安米ドル高となりました。米国では金融引き締め、日本では金融緩和が行われた局面において、日米の金利差が意識され米ドル/円相場は円安米ドル高となりました。



- (注1) 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。



## 設定来のポートフォリオについて

### ●当ファンド

エマージング債券パッシブ・マザーファンドを期を通じて高位に組み入れました。

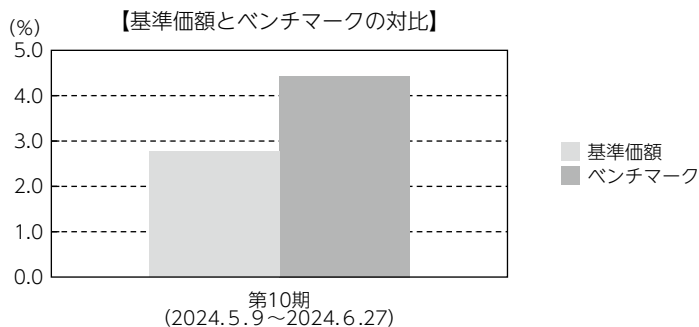
### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

## ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークは前期末比で4.4%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを1.7%下回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

ベンチマークは設定来で46.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを13.0%下回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第10期		項目の概要
	(2024年5月9日 ～2024年6月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	4円	0.029%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,243円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、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 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(3)	(0.022)	
(販売会社)	(0)	(0.001)	
(受託会社)	(1)	(0.006)	
(b) その他費用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(保管費用)	(0)	(0.001)	
合計	4	0.030	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

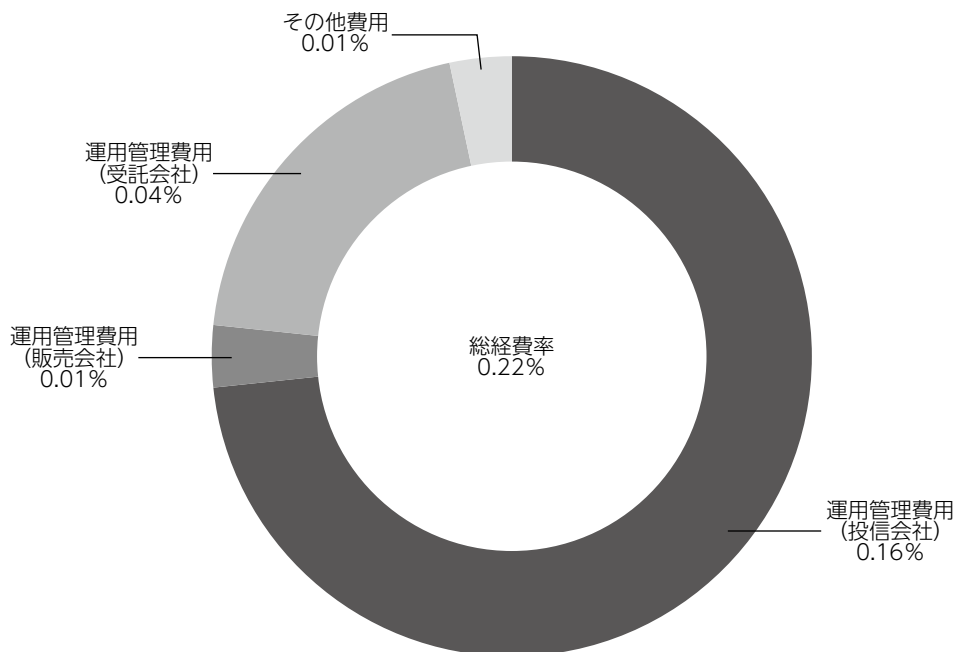
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.22%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2024年5月9日から2024年6月27日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
エマージェンシング債券 パッシブ・マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 56,284	千円 139,056

■利害関係人との取引状況等（2024年5月9日から2024年6月27日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

償還時における有価証券の組入れはありません。前期末の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	
	□ 数	金 額
エマージェンシング債券パッシブ・マザーファンド	千□ 56,284	千円



## ■投資信託財産の構成

2024年6月27日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 135,596	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	135,596	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月27日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	135,596,629円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	135,596,385
未 収 利 息	244
(B) 負 債	40,604
未 払 信 託 報 酬	40,604
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	135,556,025
元 本	101,273,557
償 還 差 損 益 金	34,282,468
(D) 受 益 権 総 口 数	101,273,557口
1 万 口 当 た り 償 還 価 額(C / D)	13,385円14銭

(注) 期首における元本額は103,920,143円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は2,646,586円です。

## ■損益の状況

当期 自2024年5月9日 至2024年6月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,712円
受 取 利 息	1,712
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,691,152
売 買 益	3,743,588
売 買 損	△52,436
(C) 信 託 報 酬 等	△40,604
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	3,652,260
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	19,265,303
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,364,905
(配 当 等 相 当 額)	(19,384,647)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,019,742)
(G) 合 計(D + E + F)	34,282,468
償 還 差 損 益 金(G)	34,282,468

(注1) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注2) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

## ■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2015年10月13日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年6月27日		資産総額	135,596,629円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	40,604円
				純資産総額	135,556,025円
受益権口数	1,000,000口	101,273,557口	100,273,557口	受益権口数	101,273,557口
元本額	1,000,000円	101,273,557円	100,273,557円	1万口当たり償還金	13,385円14銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	177,259,203円	166,933,224円	9,417円	0円	0.00%
第2期	205,198,127	210,678,413	10,267	0	0.00
第3期	473,813,465	462,452,857	9,760	0	0.00
第4期	449,932,414	470,473,265	10,457	0	0.00
第5期	262,017,781	274,333,295	10,470	0	0.00
第6期	359,479,876	415,773,620	11,566	0	0.00
第7期	276,244,299	294,860,707	10,674	0	0.00
第8期	179,174,406	199,781,889	11,150	0	0.00
第9期	103,920,143	135,350,816	13,025	0	0.00

## 償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税引前）	13,385円14銭
----------------	------------

### 償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置の適用を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは取扱販売会社までお問い合わせ下さい。

# エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2024年4月18日）

（計算期間 2023年4月19日～2024年4月18日）

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年3月6日から無期限です。
運用方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	期騰落率	期中率	期騰落率	期中率			
12期 (2020年4月20日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
13期 (2021年4月19日)	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	-	78,076
14期 (2022年4月18日)	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4	-	152,776
15期 (2023年4月18日)	19,947	△5.4	93,033.64	△5.3	97.6	-	137,292
16期 (2024年4月18日)	20,300	1.8	93,922.40	1.0	96.8	-	136,262
16期 (2024年4月18日)	23,481	15.7	117,190.62	24.8	98.2	-	112,310

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス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（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

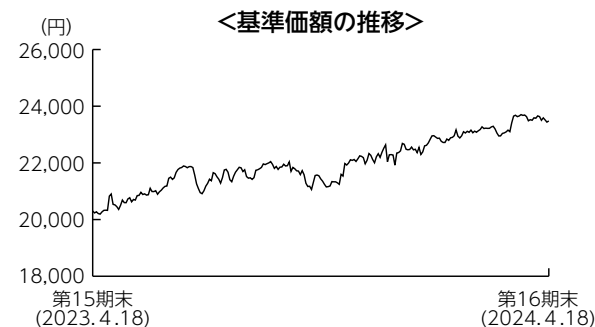
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2023 年 4 月 18 日	円 20,300	% -	ポイント 93,922.40	% -	% 96.8	% -
4 月 末	20,326	0.1	93,661.07	△0.3	98.6	-
5 月 末	20,908	3.0	96,860.26	3.1	97.9	-
6 月 末	21,872	7.7	102,541.84	9.2	95.9	-
7 月 末	21,475	5.8	101,562.43	8.1	97.5	-
8 月 末	21,963	8.2	103,973.59	10.7	97.6	-
9 月 末	21,586	6.3	102,072.50	8.7	86.8	-
10 月 末	21,245	4.7	100,626.42	7.1	97.7	-
11 月 末	22,216	9.4	105,978.47	12.8	97.7	-
12 月 末	22,482	10.7	107,454.17	14.4	96.0	-
2024 年 1 月 末	22,885	12.7	109,899.73	17.0	97.7	-
2 月 末	23,224	14.4	113,752.19	21.1	97.7	-
3 月 末	23,677	16.6	117,275.84	24.9	97.8	-
(期 末) 2024 年 4 月 18 日	23,481	15.7	117,190.62	24.8	98.2	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年4月19日から2024年4月18日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,481円となり、前期末比で15.7%上昇しました。

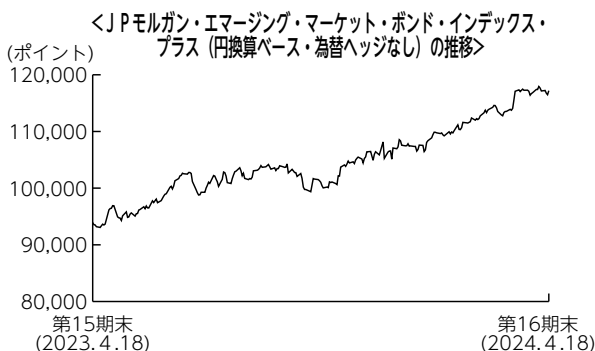
### 基準価額の主な変動要因

対米国債スプレッド（利回り格差）の縮小や米ドルが対円で上昇したことなどを主因に、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

新興国債券市場は上昇しました。期初から2023年10月末は米金融引き締め長期化観測などから米長期国債が下落し、それに連れて新興国債券も下落したものの、12月末にかけて米経済指標の下振れなどから早期の利下げ観測が強まり、米長期国債の上昇に連れて大きく上昇し、その後は横ばいで推移しました。対米国債スプレッドは縮小しました。米景気の軟着陸期待の高まりなどからリスク選考の改善などに伴い縮小しました。

為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。



期初から2023年10月にかけては、米国が利上げを続ける一方で日銀は緩和を続けたことにより、日米金融政策の違いが意識され、大幅に円安が進みました。その後は米国の早期利下げ観測が強まったことなどに伴い円高となる局面があったものの、日銀が2024年3月の金融政策決定会合にてマイナス金利を解除しつつも緩和的な金融環境を維持する方針を示したことで再び円安基調となりました。

## ポートフォリオについて

ベンチマークである J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

### 【運用状況】

#### ○国別構成比

##### 期首（前期末）

国	ファンド	ベンチマーク	差	
中南米	アルゼンチン	3.5%	△3.5%	
	ブラジル	5.1%	4.2%	0.8%
	チリ	6.4%	5.5%	0.9%
	メキシコ	9.2%	7.9%	1.3%
	パナマ	5.7%	4.8%	0.9%
	ペルー	3.8%	2.9%	0.9%
	ベネズエラ	—	0.0%	△0.0%
	エクアドル	—	2.2%	△2.2%
	コロンビア	5.9%	5.0%	0.9%
	ドミニカ共和国	5.8%	4.9%	1.0%
ウルグアイ	2.6%	1.8%	0.7%	
計	44.5%	42.8%	1.6%	
欧州	ハンガリー	4.6%	3.2%	1.4%
	トルコ	—	10.0%	△10.0%
	ウクライナ	—	0.4%	△0.4%
	ルーマニア	2.9%	1.2%	1.7%
計	7.4%	14.8%	△7.4%	
アジア・オセアニア	中国	0.6%	3.4%	△2.8%
	インドネシア	4.4%	3.0%	1.4%
	フィリピン	2.9%	1.6%	1.2%
	スリランカ	—	0.4%	△0.4%
計	7.9%	8.4%	△0.6%	
中近東	カタール	9.7%	8.5%	1.2%
	アラブ首長国連邦	8.7%	7.3%	1.4%
	サウジアラビア	11.4%	10.1%	1.3%
	オマーン	3.3%	2.8%	0.5%
計	33.1%	28.6%	4.5%	
アフリカ	南アフリカ	3.9%	2.1%	1.9%
	エジプト	—	2.8%	△2.8%
	ナイジェリア	—	0.4%	△0.4%
	計	3.9%	5.3%	△1.4%
現金など	3.2%	—	—	
合計	100.0%	100.0%	—	

##### 期末

国	ファンド	ベンチマーク	差	
中南米	アルゼンチン	—	5.9%	△5.9%
	ブラジル	7.3%	5.8%	1.6%
	チリ	6.7%	5.2%	1.4%
	メキシコ	9.8%	7.6%	2.2%
	パナマ	4.5%	3.5%	1.0%
	ペルー	3.3%	2.6%	0.7%
	ベネズエラ	—	0.0%	△0.0%
	エクアドル	—	3.0%	△3.0%
	コロンビア	4.5%	3.6%	1.0%
	ドミニカ共和国	6.3%	4.9%	1.4%
ウルグアイ	1.1%	0.9%	0.2%	
計	43.6%	42.9%	0.7%	
欧州	ポーランド	7.0%	5.8%	1.2%
	ハンガリー	7.0%	4.1%	2.9%
	トルコ	—	9.6%	△9.6%
	ウクライナ	—	0.7%	△0.7%
	ルーマニア	5.8%	3.2%	2.6%
計	19.8%	23.4%	△3.6%	
アジア・オセアニア	中国	1.2%	3.3%	△2.1%
	インドネシア	3.7%	2.7%	0.9%
	フィリピン	1.2%	0.9%	0.2%
	スリランカ	—	0.6%	△0.6%
計	6.1%	7.6%	△1.5%	
中近東	カタール	3.8%	3.3%	0.5%
	アラブ首長国連邦	7.1%	6.2%	0.9%
	サウジアラビア	10.8%	9.6%	1.2%
	オマーン	2.3%	2.1%	0.3%
計	24.0%	21.1%	2.9%	
アフリカ	南アフリカ	4.8%	2.0%	2.8%
	エジプト	—	2.5%	△2.5%
	ナイジェリア	—	0.5%	△0.5%
	計	4.8%	5.0%	△0.2%
現金など	1.8%	—	—	
合計	100.0%	100.0%	—	

(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) ベンチマークは、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスです。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で24.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを9.1%下回りました。運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	3円 (3)	0.012% (0.012)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.012	
期中の平均基準価額は22,003円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■ 売買及び取引の状況 (2023年4月19日から2024年4月18日まで)

### 公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 770,013	千アメリカ・ドル 991,781 (1,380)

(注1) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2023年4月19日から2024年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 829,100	千アメリカ・ドル 714,199	千円 110,315,301	% 98.2	% 20.7	% 81.2	% 13.0	% 4.0
合 計	-	-	110,315,301	98.2	20.7	81.2	13.0	4.0

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末							
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	国債証券	3.1000	3,000	1,788	276,254	2061/01/22		
PANAMA 4.5 01/19/63	国債証券	4.5000	8,000	5,002	772,664	2063/01/19		
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	1,000	1,012	156,361	2026/01/29		
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	国債証券	3.7500	5,400	3,656	564,768	2055/01/21		
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	国債証券	5.8750	6,000	4,851	749,390	2060/01/30		
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	国債証券	5.0000	4,000	3,388	523,379	2053/01/18		
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	500	600	92,769	2038/01/17		
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	国債証券	5.3000	3,000	2,435	376,183	2041/01/21		
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	2,200	2,181	336,976	2025/01/15		
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	1,600	1,564	241,604	2027/01/08		
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	1,000	991	153,222	2026/01/08		
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	国債証券	5.2500	3,000	2,687	415,118	2050/01/16		
PERU 3.0 01/15/34	国債証券	3.0000	9,000	7,109	1,098,158	2034/01/15		
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	国債証券	3.5000	4,000	2,785	430,245	2050/01/25		
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	国債証券	3.5000	10,200	8,704	1,344,573	2034/01/31		
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	国債証券	5.7500	1,000	941	145,476	2054/01/16		
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	8,000	6,592	1,018,267	2030/01/23		
BRAZIL 4.75 01/14/50	国債証券	4.7500	7,000	4,964	766,892	2050/01/14		
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	国債証券	2.5500	8,200	6,769	1,045,598	2032/01/27		
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	6,000	4,512	697,074	2050/01/31		
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国債証券	2.4500	1,200	1,005	155,328	2031/01/31		
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	国債証券	5.6250	5,000	4,939	762,894	2028/01/17		
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	国債証券	4.3750	5,000	4,821	744,662	2031/01/23		
ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	7.1250	16,000	16,589	2,562,397	2033/01/17		
ROMANIA 6.375 01/30/34	国債証券	6.3750	2,000	1,963	303,204	2034/01/30		
PERU 2.783 01/23/31	国債証券	2.7830	9,000	7,522	1,161,962	2031/01/23		
COLOMBIA 3.0 01/30/30	国債証券	3.0000	8,000	6,451	996,565	2030/01/30		



銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	国債証券	6.2500	5,000	5,058	781,316	2031/01/25
PERU 2.392 01/23/26	国債証券	2.3920	2,000	1,892	292,378	2026/01/23
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	国債証券	4.5000	9,000	7,996	1,235,186	2030/01/30
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	国債証券	2.7500	6,200	5,769	891,156	2027/01/31
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	国債証券	4.7500	8,000	7,865	1,214,925	2028/01/18
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	国債証券	4.8500	3,000	2,939	454,061	2029/01/22
ROMANIA 5.875 01/30/29	国債証券	5.8750	6,000	5,897	910,866	2029/01/30
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	国債証券	3.4500	2,000	1,236	191,054	2061/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	国債証券	4.4000	3,000	2,179	336,645	2052/02/12
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	国債証券	3.5000	9,000	7,257	1,120,941	2034/02/12
ROMANIA 4.0 02/14/51	国債証券	4.0000	9,000	6,052	934,869	2051/02/14
COLOMBIA 7.5 02/02/34	国債証券	7.5000	8,000	7,900	1,220,298	2034/02/02
PANAMA 6.4 02/14/35	国債証券	6.4000	8,000	7,456	1,151,748	2035/02/14
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	国債証券	6.3500	7,000	7,007	1,082,357	2035/02/09
ROMANIA 3.0 02/14/31	国債証券	3.0000	3,000	2,467	381,139	2031/02/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	国債証券	2.2500	12,000	9,355	1,445,069	2033/02/02
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国債証券	6.0000	5,200	4,871	752,524	2033/02/22
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	5.5000	12,000	11,396	1,760,315	2029/02/22
ROMANIA 6.625 02/17/28	国債証券	6.6250	9,000	9,149	1,413,267	2028/02/17
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	国債証券	5.5000	9,000	8,625	1,332,268	2054/03/18
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	4.8170	8,000	7,070	1,092,121	2049/03/14
HUNGARY 5.5 03/26/36	国債証券	5.5000	3,000	2,819	435,522	2036/03/26
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	国債証券	4.3400	7,000	5,887	909,429	2042/03/07
PERU 3.55 03/10/51	国債証券	3.5500	8,000	5,441	840,571	2051/03/10
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	4.0000	8,000	7,674	1,185,464	2029/03/14
INDONESIA 3.05 03/12/51	国債証券	3.0500	4,000	2,650	409,322	2051/03/12
INDONESIA 1.85 03/12/31	国債証券	1.8500	3,200	2,547	393,540	2031/03/12
BRAZIL 6.125 03/15/34	国債証券	6.1250	3,000	2,854	440,920	2034/03/15
ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	国債証券	1.7000	7,000	5,654	873,436	2031/03/02
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	国債証券	4.6250	6,000	5,877	907,770	2029/03/18
PANAMA 4.5 04/01/56	国債証券	4.5000	9,000	5,706	881,456	2056/04/01
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	国債証券	3.7500	4,000	2,390	369,248	2071/04/19
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	国債証券	4.5000	4,000	3,095	478,053	2060/04/22
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	国債証券	3.5000	5,000	3,455	533,813	2053/04/15
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	国債証券	5.0000	7,000	5,628	869,360	2051/04/27
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	国債証券	7.3000	10,000	8,437	1,303,256	2052/04/20
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	5,000	4,742	732,603	2029/04/22
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	国債証券	5.5000	8,000	7,662	1,183,565	2053/04/04
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	国債証券	4.7500	5,000	4,608	711,770	2032/04/27
COLOMBIA 3.25 04/22/32	国債証券	3.2500	7,000	5,295	817,999	2032/04/22
COLOMBIA 8.0 04/20/33	国債証券	8.0000	7,000	7,166	1,106,977	2033/04/20
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	1,400	1,354	209,158	2026/04/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	4.3750	11,000	10,582	1,634,607	2029/04/16
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	国債証券	4.5000	4,000	3,824	590,709	2030/04/17

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	国債証券	3.2500	6,000	5,223	806,817	2030/04/16
COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	3.1250	8,000	6,220	960,820	2031/04/15
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	国債証券	4.4000	6,000	4,956	765,596	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	国債証券	3.8750	5,000	3,788	585,114	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	国債証券	3.1250	6,000	5,399	834,080	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	国債証券	3.7500	2,000	1,876	289,829	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	国債証券	3.4000	6,000	5,878	907,946	2025/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	国債証券	2.5000	6,000	5,822	899,293	2025/04/16
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	国債証券	3.7710	4,000	2,450	378,437	2061/05/24
UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	国債証券	6.4000	2,000	1,901	293,685	2054/05/07
UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	国債証券	6.3380	5,000	4,705	726,795	2053/05/04
BRAZIL 7.125 05/13/54	国債証券	7.1250	3,000	2,863	442,248	2054/05/13
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	国債証券	3.1000	9,000	6,405	989,445	2041/05/07
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	国債証券	2.6590	8,000	6,506	1,005,016	2031/05/24
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	国債証券	4.8750	6,000	5,514	851,750	2033/05/19
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	8,000	7,432	1,147,995	2029/05/30
HUNGARY 6.125 05/22/28	国債証券	6.1250	8,000	8,109	1,252,665	2028/05/22
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	2,000	1,835	283,434	2030/06/22
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	国債証券	6.4000	9,000	8,083	1,248,524	2049/06/05
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	9,000	7,892	1,219,078	2030/06/12
ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	国債証券	1.6250	5,000	4,344	671,051	2028/06/02
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	4,000	3,864	596,965	2025/06/06
HUNGARY 5.25 06/16/29	国債証券	5.2500	13,000	12,668	1,956,776	2029/06/16
PANAMA 3.87 07/23/60	国債証券	3.8700	4,000	2,244	346,614	2060/07/23
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	国債証券	2.5500	4,000	3,173	490,203	2033/07/27
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	国債証券	3.2000	7,000	4,762	735,583	2046/07/06
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	国債証券	4.8750	9,000	8,625	1,332,347	2033/07/18
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	国債証券	4.0500	5,000	4,682	723,243	2032/07/07
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	国債証券	4.2800	9,000	6,936	1,071,341	2041/08/14
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	国債証券	6.0000	7,000	7,032	1,086,280	2029/08/01
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	国債証券	2.7000	4,000	2,180	336,867	2070/09/02
HUNGARY 3.125 09/21/51	国債証券	3.1250	7,000	4,199	648,604	2051/09/21
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	200	182	28,153	2029/09/18
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	国債証券	4.8750	7,000	6,089	940,602	2032/09/23
PANAMA 2.252 09/29/32	国債証券	2.2520	7,000	4,904	757,509	2032/09/29
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	国債証券	5.1250	9,000	8,725	1,347,768	2034/09/18
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	国債証券	3.1250	4,000	2,645	408,546	2049/09/30
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	国債証券	4.9170	4,000	3,974	613,901	2033/09/25
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	15,000	10,592	1,636,132	2049/09/30
HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	6.2500	13,000	13,137	2,029,264	2032/09/22
BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	3.7500	14,000	11,846	1,829,761	2031/09/12
HUNGARY 2.125 09/22/31	国債証券	2.1250	13,000	10,064	1,554,574	2031/09/22
ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	国債証券	1.8750	7,000	5,650	872,847	2031/09/15
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	国債証券	2.5000	5,000	4,406	680,669	2029/09/30

銘柄	当 期			評 価 額		末
	種 類	利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
				千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	4.8500	14,000	12,454	1,923,747	2029/09/30
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	国債証券	3.2500	5,000	3,234	499,571	2061/10/19
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	国債証券	5.7500	3,000	3,079	475,685	2034/10/28
INDONESIA 4.2 10/15/50	国債証券	4.2000	8,000	6,357	982,051	2050/10/15
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国債証券	5.5000	11,000	11,051	1,707,086	2032/10/25
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	国債証券	4.8750	9,000	8,638	1,334,273	2033/10/04
BRAZIL 6.0 10/20/33	国債証券	6.0000	12,000	11,452	1,768,987	2033/10/20
INDONESIA 3.85 10/15/30	国債証券	3.8500	10,400	9,564	1,477,398	2030/10/15
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	国債証券	1.2000	4,000	3,255	502,832	2030/10/21
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	国債証券	3.2500	9,200	8,151	1,259,055	2030/10/22
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	国債証券	2.9000	4,000	3,853	595,221	2025/10/22
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	国債証券	1.2500	4,000	3,658	565,076	2026/10/26
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	国債証券	5.7500	6,000	6,121	945,526	2032/11/16
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	国債証券	5.5000	5,000	5,050	780,158	2027/11/16
PERU 2.78 12/01/60	国債証券	2.7800	4,000	2,130	329,128	2060/12/01
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	国債証券	2.6500	6,000	3,741	577,867	2045/12/10
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	国債証券	1.9500	2,000	1,957	302,375	2024/12/03
合 計	-	-	829,100	714,199	110,315,301	-

## ■投資信託財産の構成

2024年4月18日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円 110,315,301		% 97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,647,402		2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	112,962,704		100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、112,350,092千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.46円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月18日)現在

項	目	当	期	末
(A)	資 産	113,312,304,596	円	
	コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,374,323,241		
	公 社 債(評価額)	110,315,301,340		
	未 収 入 金	350,000,000		
	未 収 利 息	1,056,809,359		
	未 払 費 用	215,870,656		
(B)	負 債	1,002,018,226		
	未 払 金	573,079,226		
	未 払 解 約 金	428,939,000		
(C)	純 資 産 総 額(A-B)	112,310,286,370		
	元 本	47,831,274,931		
	次 期 繰 越 損 益 金	64,479,011,439		
(D)	受 益 権 総 口 数	47,831,274,931	口	
	1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	23,481	円	

## ■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

項	目	当	期
(A)	配 当 等 収 益	5,614,232,019	円
	受 取 利 息	5,613,461,401	
	そ の 他 収 益 金	1,112,433	
	支 払 利 息	△341,815	
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益	10,007,181,950	
	売 買 益	18,663,475,866	
	売 買 損	△8,656,293,916	
(C)	そ の 他 費 用	△13,081,454	
(D)	当 期 損 益 金(A+B+C)	15,608,332,515	
(E)	前 期 繰 越 損 益 金	69,138,728,177	
(F)	解 約 差 損 益 金	△72,993,928,691	
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金	52,725,879,438	
(H)	合 計(D+E+F+G)	64,479,011,439	
	次 期 繰 越 損 益 金(H)	64,479,011,439	

(注1) 期首元本額 67,123,867,342円  
追加設定元本額 43,526,714,562円  
一部解約元本額 62,819,306,973円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>	56,545,881円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,402,228,783円
たわらノーロード バランス(堅実型)	185,898,554円
たわらノーロード バランス(標準型)	611,432,709円
たわらノーロード バランス(積極型)	288,880,377円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	488,065円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	5,013,325円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	66,432,394円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	7,270,485円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,800,979円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	62,340,964円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10)	271,810,079円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20)	409,557,576円
DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30)	829,027,400円
投資のソムリエ	12,760,704,368円
クルーズコントロール	175,172,226円
投資のソムリエ<DC年金>	1,299,821,204円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	377,434,623円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,188,460,901円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,769,475,205円
ワールドアセットバランス(基本コース)	332,991,505円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	755,680,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	79,148,286円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	40,307,356円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	10,742,825円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	261,787,480円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	641,380,664円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	222,835,935円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	96,645,355円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	43,884,243円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	27,134,290円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,707,467円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	2,067,283円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	19,919,297円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	15,421,084,811円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	194,553,833円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	726,463,768円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)	451,003,739円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOF5用)(適格機関投資家専用)	7,063,327円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	93,025,067円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	63,720,320円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,556,331,527円
期末元本合計	47,831,274,931円

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。  
(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。