

## 運用報告書 (全体版)

### DIAM高格付インカム・オープン (毎月決算コース)

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	
信託期間	2003年7月15日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。	
主要投資対象	DIAM高格付インカム・オープン (毎月決算コース)	DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド	高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券への投資を通じて、高格付資源国の公社債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。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	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使等により取得するものに限り、実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。	
分配方針	決算日 (原則として毎月5日。休業日の場合は翌営業日。) に、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。) 等の全額から、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。原則として利子配当等収益を中心にしつつ、これに売買益 (評価益を含みます。) 等を加えた分配対象額の範囲内で分配を行うことを基本とします。また、毎年6月および12月の決算時には委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。	

愛称：ハッピークローバー

第227期	<決算日	2022年7月5日>
第228期	<決算日	2022年8月5日>
第229期	<決算日	2022年9月5日>
第230期	<決算日	2022年10月5日>
第231期	<決算日	2022年11月7日>
第232期	<決算日	2022年12月5日>

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高格付インカム・オープン (毎月決算コース)」は、2022年12月5日に第232期の決算を行いました。ここに、運用経過等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

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

## D I AM高格付インカム・オープン（毎月決算コース）

### ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
		(分配落)	税金 込 分 配	み 金 騰 落 率			
		円	円	%	%	%	百万円
第35作成期	203期(2020年7月6日)	6,838	10	△0.4	98.6	—	121,786
	204期(2020年8月5日)	6,932	10	1.5	98.5	—	122,016
	205期(2020年9月7日)	7,054	10	1.9	98.2	—	121,408
	206期(2020年10月5日)	6,909	10	△1.9	97.7	—	117,807
	207期(2020年11月5日)	6,840	10	△0.9	98.3	—	115,324
	208期(2020年12月7日)	6,982	10	2.2	98.7	—	116,273
第36作成期	209期(2021年1月5日)	7,044	10	1.0	98.5	—	115,916
	210期(2021年2月5日)	7,061	10	0.4	98.1	—	113,761
	211期(2021年3月5日)	7,114	10	0.9	97.7	—	112,810
	212期(2021年4月5日)	7,268	10	2.3	98.6	—	113,761
	213期(2021年5月6日)	7,337	10	1.1	98.5	—	113,763
	214期(2021年6月7日)	7,399	10	1.0	97.8	—	113,620
第37作成期	215期(2021年7月5日)	7,332	10	△0.8	97.9	—	111,636
	216期(2021年8月5日)	7,182	10	△1.9	98.2	—	108,268
	217期(2021年9月6日)	7,192	10	0.3	97.9	—	107,661
	218期(2021年10月5日)	7,086	10	△1.3	98.4	—	105,220
	219期(2021年11月5日)	7,245	10	2.4	97.5	—	105,779
	220期(2021年12月6日)	6,944	10	△4.0	98.2	—	100,665
第38作成期	221期(2022年1月5日)	7,234	10	4.3	98.6	—	104,097
	222期(2022年2月7日)	6,973	10	△3.5	98.3	—	98,896
	223期(2022年3月7日)	7,090	10	1.8	98.3	—	100,006
	224期(2022年4月5日)	7,367	10	4.0	98.3	—	102,949
	225期(2022年5月6日)	7,201	10	△2.1	97.9	—	99,705
	226期(2022年6月6日)	7,302	5	1.5	97.8	—	100,573
第39作成期	227期(2022年7月5日)	7,308	5	0.2	98.7	—	99,478
	228期(2022年8月5日)	7,314	5	0.2	97.9	—	98,395
	229期(2022年9月5日)	7,345	5	0.5	97.6	—	97,783
	230期(2022年10月5日)	7,220	5	△1.6	97.5	—	95,321
	231期(2022年11月7日)	7,289	5	1.0	97.9	—	95,423
	232期(2022年12月5日)	7,155	5	△1.8	97.1	—	93,148

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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。

(注4) 当ファンドは高格付資源国の公社債を投資対象としており、コンセプトに合った指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
			騰	落		
第227期	(期首) 2022年6月6日	円 7,302	% -	% -	% 97.8	% -
	6月末	7,250	△0.7		98.7	-
	(期末) 2022年7月5日	7,313	0.2		98.7	-
第228期	(期首) 2022年7月5日	7,308	-		98.7	-
	7月末	7,432	1.7		97.7	-
	(期末) 2022年8月5日	7,319	0.2		97.9	-
第229期	(期首) 2022年8月5日	7,314	-		97.9	-
	8月末	7,335	0.3		97.9	-
	(期末) 2022年9月5日	7,350	0.5		97.6	-
第230期	(期首) 2022年9月5日	7,345	-		97.6	-
	9月末	7,181	△2.2		97.4	-
	(期末) 2022年10月5日	7,225	△1.6		97.5	-
第231期	(期首) 2022年10月5日	7,220	-		97.5	-
	10月末	7,360	1.9		97.6	-
	(期末) 2022年11月7日	7,294	1.0		97.9	-
第232期	(期首) 2022年11月7日	7,289	-		97.9	-
	11月末	7,172	△1.6		97.0	-
	(期末) 2022年12月5日	7,160	△1.8		97.1	-

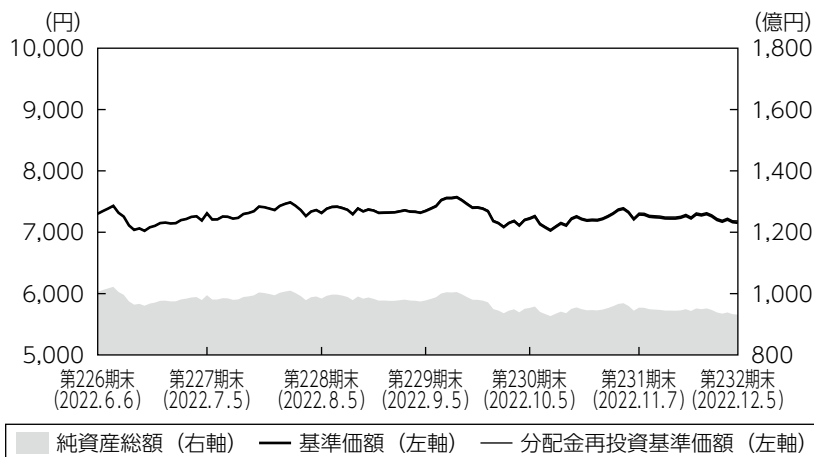
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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。

## ■第227期～第232期の運用経過（2022年6月7日から2022年12月5日まで）

### 基準価額等の推移



- (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はありません。
- (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は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

当作成期後半に発表された米国消費者物価指数の伸び率減速をきっかけに、2021年来続いた米ドル高円安基調が反転したことで主要な投資対象国通貨が対円で下落し、これが基準価額の下落要因となりました。一方、債券市場では、主要な投資対象国であるカナダとオーストラリアの10年国債利回りが低下（価格は上昇）し、これは基準価額の上昇要因となりました。こうした状況下、投資対象国通貨の下落を主因に基準価額は下落しました。

## 投資環境

外国債券市場では、投資対象国の10年国債利回りの動きがまちまちでした。主要国ではインフレ率が中央銀行の目標を大幅に上回る水準に上昇し、中央銀行がインフレ抑制を最優先に積極的な利上げを進めたことから、米欧などの多くの国債利回りが上昇（価格は下落）しました。しかしその一方で、投資対象国のカナダやオーストラリアでは当作成期中に利上げ幅を縮小するなど引き締め姿勢が弱まったこと、引き締めによる景気の減速や後退が意識されたことで、国債利回りが低下しました。

為替市場では、ニュージーランドを除き全ての投資対象国通貨が対円で下落しました。当作成期の半ばまでは米国での積極的な金融引き締めが意識される一方、日銀が緩和的な金融政策を堅持したことによる米ドル高円安を受けて、投資対象国通貨も対円で上昇しました。しかし作成期後半の米国でのインフレ減速をきっかけに、2021年から続いた米ドル高円安基調が急速に巻き戻される中、引き締め姿勢を強めたニュージーランドを除く全ての投資対象国通貨も対円で下落に転じました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

D I AM高格付インカム・オープン・マザーファンドを高位に組入れました。

### ●D I AM高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション\*については、新型コロナウイルスの感染動向と投資対象国および世界経済見通し、主要国および投資対象国の金融政策を勘案して、機動的に調整を行いました。当作成期末のデュレーションは、インフレ長期化の懸念が残ることや短期金利に対して長期金利の水準が低く投資妙味が低いと判断したことなどから、作成期初と比較して短期化しました。

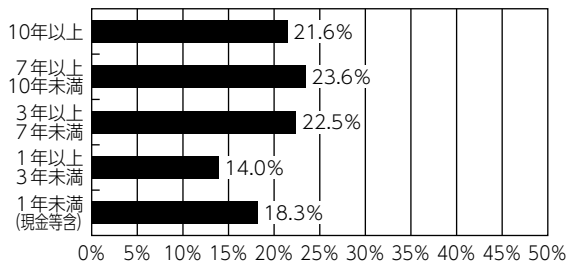
\*金利変動に対する債券価格の変動性。

## 【運用状況】

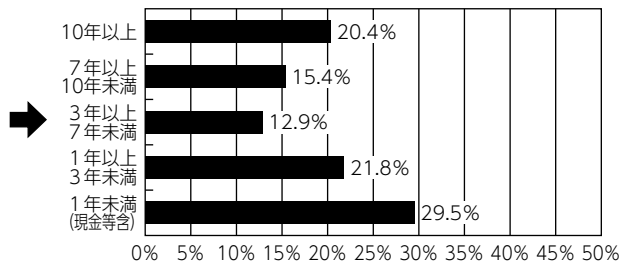
(注) 組入比率は、純資産総額に対する実質組入比率です。

### ○残存期間別構成比

#### 前作成期末

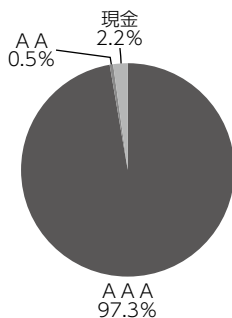


#### 当作成期末

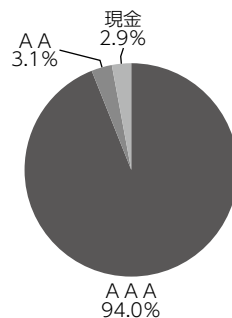


### ○格付別構成比

#### 前作成期末

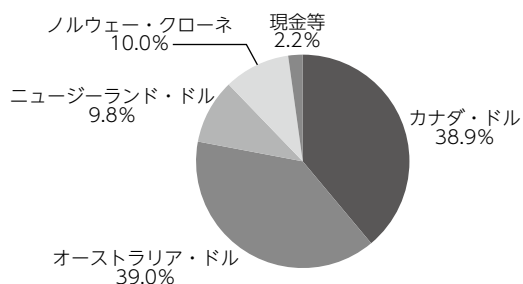


#### 当作成期末

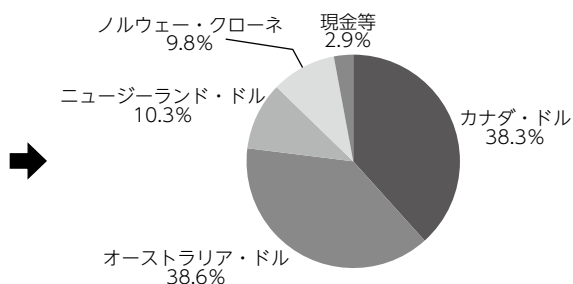


### ○通貨別構成比

#### 前作成期末



#### 当作成期末

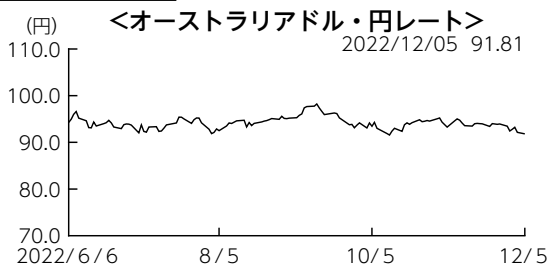


## 【各国の為替・金利動向】

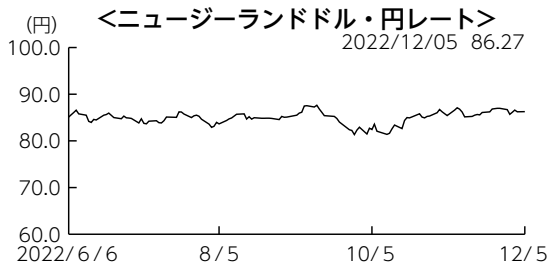
### カナダ



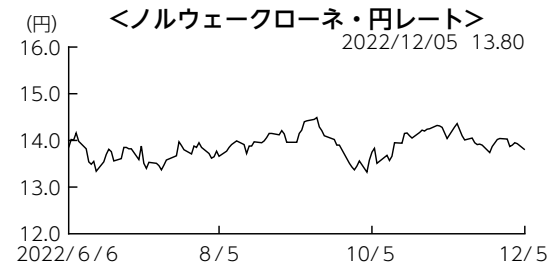
### オーストラリア



### ニュージーランド



### ノルウェー



## 分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第227期	第228期	第229期	第230期	第231期	第232期
	2022年6月7日 ～2022年7月5日	2022年7月6日 ～2022年8月5日	2022年8月6日 ～2022年9月5日	2022年9月6日 ～2022年10月5日	2022年10月6日 ～2022年11月7日	2022年11月8日 ～2022年12月5日
当期分配金（税引前）	5円	5円	5円	5円	5円	5円
対基準価額比率	0.07%	0.07%	0.07%	0.07%	0.07%	0.07%
当期の収益	5円	5円	5円	5円	5円	5円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	109円	113円	121円	125円	135円	137円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

引き続き、D I AM高格付インカム・オープン・マザーファンドを高位に組入れることで、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

### ●D I AM高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。デュレーションについては、中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資対象国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。



## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第227期～第232期 (2022年6月7日 ～2022年12月5日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	40円	
(投信会社)	(20)	(0.275)	
(販売会社)	(18)	(0.247)	
(受託会社)	( 2)	(0.027)	
(b) その他費用	0	0.005	(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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 0)	(0.005)	
(監査費用)	( 0)	(0.001)	
(その他)	( 0)	(0.000)	
合計	40	0.555	

(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。

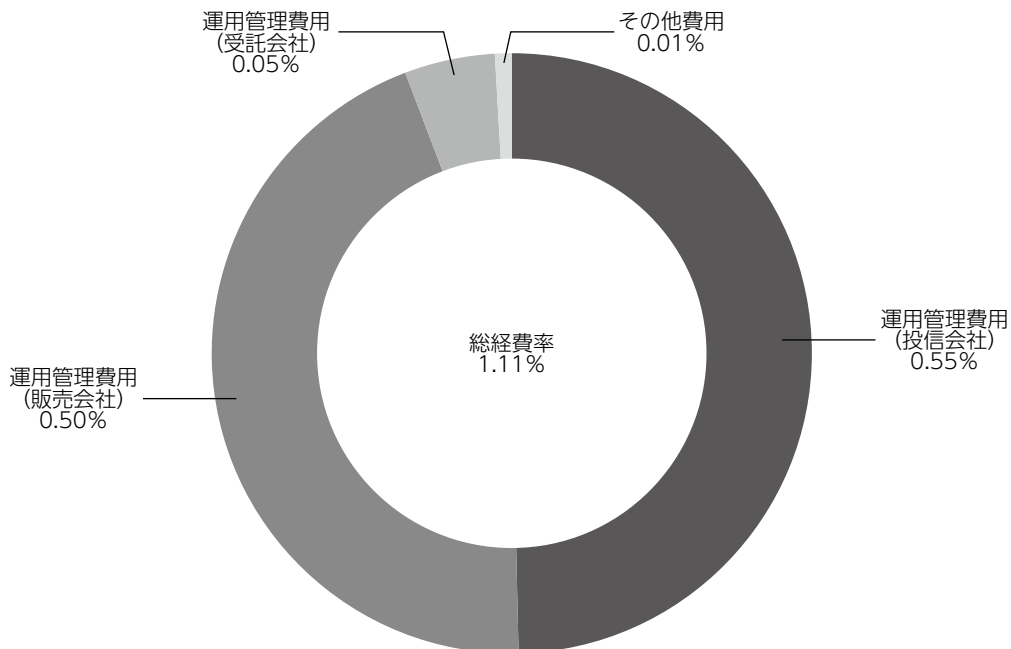
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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

当作成期中の運用・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1.11%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（2022年6月7日から2022年12月5日まで）

	第 227 期 ~ 第 232 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
D I A M 高 格 付 イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 162,369	千円 412,600	千□ 2,689,683	千円 6,851,800

## ■利害関係人との取引状況等（2022年6月7日から2022年12月5日まで）

### 【D I A M 高 格 付 イ ン カ ム ・ オ ー プ ン（毎月決算コース）における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 227 期 ~ 第 232 期					
	区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D
金 銭 信 託						

### 【D I A M 高 格 付 イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 227 期 ~ 第 232 期					
	区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D
金 銭 信 託						

平均保有割合 88.9%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

## ■組入資産の明細

親投資信託残高

	第38作成期末		第 39 作 成 期 末	
	□ 数	評 価 額	□ 数	評 価 額
D I A M 高 格 付 イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 39,493,461	千円 92,907,020	千□ 36,966,148	千円 92,907,020

<補足情報>

■D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド (41,527,281,528口) の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

外国 (外貨建) 公社債

区 分	2022 年 12 月 5 日 現 在							
	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
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 411,200	千カナダ・ドル 400,180	千円 40,110,093	% 38.4	% -	% 9.5	% 8.9	% 20.0
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 474,000	千オーストラリア・ドル 440,294	千円 40,423,426	38.7	-	21.8	3.8	13.1
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 140,500	千ニュージーランド・ドル 124,767	千円 10,763,671	10.3	-	6.3	3.1	1.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 785,000	千ノルウェー・クローネ 745,284	千円 10,284,928	9.9	-	2.8	3.8	3.3
合 計	-	-	千円 101,582,120	97.3	-	40.4	19.6	37.4

(注1) 邦貨換算金額は、2022年12月5日現在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、2022年12月5日現在のマザーファンド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	2022 年 12 月 5 日 現 在						償還年月日
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	16,000	15,676	1,571,298	2024/03/01	
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	71,000	69,913	7,007,407	2023/05/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	15,900	20,099	2,014,560	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	9,118	913,940	2037/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,793	580,652	2041/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,000	970	97,274	2025/06/01	
CANADA 2.75 08/01/24	国債証券	2.7500	32,000	31,446	3,151,904	2024/08/01	
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	77,000	75,777	7,595,206	2023/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	74,000	68,098	6,825,512	2025/09/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	13,300	1,333,115	2045/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	46,000	38,668	3,875,745	2051/12/01	
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	9,000	7,063	707,975	2053/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,943	495,468	2064/12/01	
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 7.875 11/30/23	地方債証券	7.8750	15,000	15,522	1,555,801	2023/11/30	
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	25,000	23,787	2,384,228	2025/12/15	
小 計	-	-	411,200	400,180	40,110,093	-	

銘柄	2022 年 12 月 5 日 現 在					
	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	
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	13,000	11,356	1,042,669	2047/03/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	5,000	5,334	489,775	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,000	9,344	857,946	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	42,000	42,380	3,890,935	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	25,000	25,307	2,323,501	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	21,000	20,022	1,838,261	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	23,000	21,808	2,002,200	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	9,000	7,764	712,884	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	25,000	20,729	1,903,132	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	15,000	15,419	1,415,646	2034/05/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	11,000	10,126	929,718	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	15,000	9,673	888,124	2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	18,000	16,352	1,501,284	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	3,000	2,901	266,382	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	10,000	9,614	882,706	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	20,000	17,246	1,583,426	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	20,000	16,365	1,502,544	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	12,000	11,064	1,015,849	2025/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	17,000	14,225	1,306,022	2030/12/21
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,317	488,244	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	1,000	987	90,687	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,449	316,666	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,962	1,281,933	2032/10/22
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	13,066	1,199,595	2032/11/22
TREASURY CORP VICTORIA 1.0 11/20/23	地方債証券	1.0000	30,000	29,315	2,691,446	2023/11/20
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 4.25 11/27/24	地方債証券	4.2500	10,000	10,131	930,127	2024/11/27
KOMBNK 4.5 04/17/23	特殊債券	4.5000	32,000	32,143	2,951,079	2023/04/17
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.8 05/31/23	特殊債券	2.8000	10,000	9,972	915,542	2023/05/31
NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,651	335,242	2036/06/30
KOMMUNALBANKEN AS 5.25 07/15/24	特殊債券	5.2500	25,000	25,515	2,342,555	2024/07/15
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,743	527,294	2031/08/18
小 計	—	—	474,000	440,294	40,423,426	—
<b>(ニュージーランド)</b>		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	10,000	10,123	873,326	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,591	827,485	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	9,406	811,465	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	11,500	10,825	933,955	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	6,000	4,609	397,673	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	14,000	9,631	830,868	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	10,000	8,205	707,845	2031/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	10,000	8,456	729,550	2032/05/15
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	2,000	1,628	140,494	2028/05/15

銘 柄	2022 年 12 月 5 日 現 在					
	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	
<b>(ニュージーランド)</b>		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国 債 証 券	0.5000	1,000	879	75,880	2026/05/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 04/15/24	地 方 債 証 券	2.2500	12,000	11,537	995,343	2024/04/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25	地 方 債 証 券	2.7500	15,000	14,252	1,229,522	2025/04/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28	地 方 債 証 券	2.2500	10,000	8,835	762,213	2028/05/15
HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30	特 殊 債 券	2.1830	6,000	5,106	440,521	2030/04/24
KOMBNK 4.0 08/20/25	特 殊 債 券	4.0000	12,000	11,678	1,007,525	2025/08/20
小 計	—	—	140,500	124,767	10,763,671	—
<b>(ノルウェー)</b>		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国 債 証 券	1.5000	120,000	113,598	1,567,652	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国 債 証 券	1.7500	72,000	67,918	937,273	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国 債 証 券	3.0000	160,000	159,239	2,197,498	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国 債 証 券	1.7500	110,000	106,182	1,465,317	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国 債 証 券	2.0000	5,000	4,721	65,160	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国 債 証 券	2.0000	90,000	89,592	1,236,381	2023/05/24
NORWAY 2.125 05/18/32	国 債 証 券	2.1250	50,000	46,088	636,017	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国 債 証 券	1.3750	70,000	61,824	853,180	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国 債 証 券	1.7500	55,000	50,561	697,749	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国 債 証 券	1.2500	53,000	45,557	628,696	2031/09/17
小 計	—	—	785,000	745,284	10,284,928	—
合 計	—	—	—	—	101,582,120	—

## ■投資信託財産の構成

2022年12月5日現在

項 目	第 39 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	92,907,020	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	447,668	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	93,354,688	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) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドは2022年12月5日現在104,095,163千円、97.9％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、2022年12月5日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=100.23円、1オーストラリア・ドル=91.81円、1ニュージーランド・ドル=86.27円、1ノルウェー・クローネ=13.80円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年7月5日)、(2022年8月5日)、(2022年9月5日)、(2022年10月5日)、(2022年11月7日)、(2022年12月5日)現在

項 目	第 227 期 末	第 228 期 末	第 229 期 末	第 230 期 末	第 231 期 末	第 232 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>99,655,094,845円</b>	<b>98,677,638,916円</b>	<b>97,985,595,266円</b>	<b>95,509,185,337円</b>	<b>95,690,317,794円</b>	<b>93,354,688,863円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	240,084,398	240,073,142	239,729,874	240,014,863	238,825,364	240,068,540
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド(評価額)	99,238,110,447	98,155,765,774	97,542,765,392	95,082,470,474	95,181,692,430	92,907,020,323
未 収 入 金	176,900,000	281,800,000	203,100,000	186,700,000	269,800,000	207,600,000
<b>(B) 負 債</b>	<b>176,916,226</b>	<b>282,280,416</b>	<b>201,835,920</b>	<b>187,337,964</b>	<b>266,800,749</b>	<b>206,357,399</b>
未 払 収 益 分 配 金	68,062,095	67,262,427	66,563,752	66,008,655	65,456,901	65,088,713
未 払 解 約 金	22,670,632	122,095,366	43,181,083	33,071,725	106,911,371	61,308,328
未 払 信 託 報 酬	86,012,929	92,738,946	91,908,810	88,082,612	94,244,368	79,801,022
そ の 他 未 払 費 用	170,570	183,677	182,275	174,972	188,109	159,336
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>99,478,178,619</b>	<b>98,395,358,500</b>	<b>97,783,759,346</b>	<b>95,321,847,373</b>	<b>95,423,517,045</b>	<b>93,148,331,464</b>
元 本	136,124,191,565	134,524,854,800	133,127,504,802	132,017,311,259	130,913,803,796	130,177,426,926
次 期 繰 越 損 益 金	△36,646,012,946	△36,129,496,300	△35,343,745,456	△36,695,463,886	△35,490,286,751	△37,029,095,462
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>136,124,191,565口</b>	<b>134,524,854,800口</b>	<b>133,127,504,802口</b>	<b>132,017,311,259口</b>	<b>130,913,803,796口</b>	<b>130,177,426,926口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	7,308円	7,314円	7,345円	7,220円	7,289円	7,155円

(注) 第226期末における元本額は137,736,074,375円、当作成期間(第227期~第232期)中における追加設定元本額は557,273,992円、同解約元本額は8,115,921,441円です。

## ■損益の状況

〔自 2022年6月7日 至 2022年7月5日〕〔自 2022年7月6日 至 2022年8月5日〕〔自 2022年8月6日 至 2022年9月5日〕〔自 2022年9月6日 至 2022年10月5日〕〔自 2022年10月6日 至 2022年11月7日〕〔自 2022年11月8日 至 2022年12月5日〕

項 目	第 227 期	第 228 期	第 229 期	第 230 期	第 231 期	第 232 期
(A) 配 当 等 収 益	△27,830円	△20,231円	△26,695円	△30,028円	△33,598円	△32,858円
受 取 利 息	1,434	864	129	1,135	155	94
支 払 利 息	△29,264	△21,095	△26,824	△31,163	△33,753	△32,952
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	236,544,025	245,950,969	568,890,090	△1,492,238,990	1,058,800,686	△1,593,101,507
売 買 益	256,407,116	255,294,948	572,902,850	16,406,612	1,065,320,323	3,798,354
売 買 損	△19,863,091	△9,343,979	△4,012,760	△1,508,645,602	△6,519,637	△1,596,899,861
(C) 信 託 報 酬 等	△86,183,499	△92,922,623	△92,091,085	△88,257,584	△94,432,477	△79,960,358
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	150,332,696	153,008,115	476,772,310	△1,580,526,602	964,334,611	△1,673,094,723
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△20,272,545,533	△19,940,988,167	△19,634,834,763	△19,050,482,985	△20,506,592,673	△19,481,788,092
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△16,455,738,014	△16,274,253,821	△16,119,119,251	△15,998,445,644	△15,882,571,788	△15,809,123,934
(配 当 等 相 当 額)	(973,034,083)	(961,932,951)	(952,383,539)	(944,980,884)	(937,727,187)	(933,177,732)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,428,772,097)	(△17,236,186,772)	(△17,071,502,790)	(△16,943,426,528)	(△16,820,298,975)	(△16,742,301,666)
(G) 合 計 (D + E + F)	△36,577,950,851	△36,062,233,873	△35,277,181,704	△36,629,455,231	△35,424,829,850	△36,964,006,749
(H) 収 益 分 配 金	△68,062,095	△67,262,427	△66,563,752	△66,008,655	△65,456,901	△65,088,713
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△36,646,012,946	△36,129,496,300	△35,343,745,456	△36,695,463,886	△35,490,286,751	△37,029,095,462
追 加 信 託 差 損 益 金	△16,455,738,014	△16,274,253,821	△16,119,119,251	△15,998,445,644	△15,882,571,788	△15,809,123,934
(配 当 等 相 当 額)	(973,060,209)	(961,971,898)	(952,444,349)	(945,030,670)	(937,785,088)	(933,209,127)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,428,798,223)	(△17,236,225,719)	(△17,071,563,600)	(△16,943,476,314)	(△16,820,356,876)	(△16,742,333,061)
分 配 準 備 積 立 金	510,774,255	566,620,519	666,668,895	707,846,136	837,167,851	862,886,139
繰 越 損 益 金	△20,701,049,187	△20,421,862,998	△19,891,295,100	△21,404,864,378	△20,444,882,814	△22,082,857,667

(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) (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3) (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。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	第 227 期	第 228 期	第 229 期	第 230 期	第 231 期	第 232 期
(a) 経費控除後の配当等収益	123,500,951円	129,415,155円	172,902,032円	113,224,810円	201,291,246円	96,183,554円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	973,060,209	961,971,898	952,444,349	945,030,670	937,785,088	933,209,127
(d) 分 配 準 備 積 立 金	455,335,399	504,467,791	560,330,615	660,629,981	701,333,506	831,791,298
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	1,551,896,559	1,595,854,844	1,685,676,996	1,718,885,461	1,840,409,840	1,861,183,979
(f) 1万口当たり当期分配対象額	114.01	118.63	126.62	130.20	140.58	142.97
(g) 分 配 金	68,062,095	67,262,427	66,563,752	66,008,655	65,456,901	65,088,713
(h) 1万口当たり分配金	5	5	5	5	5	5



## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第 227 期	第 228 期	第 229 期	第 230 期	第 231 期	第 232 期
1 万口当たり分配金	5円	5円	5円	5円	5円	5円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

# D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日 2022年6月6日）

（計算期間 2021年6月8日～2022年6月6日）

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドの第19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	2003年7月15日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主要投資対象	高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使等により取得するもの に限り、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

### ■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰	落 中 率			
15期 (2018年6月5日)	円	%	%	%	百万円
16期 (2019年6月5日)	21,494	2.7	97.1	—	186,790
17期 (2020年6月5日)	21,536	0.2	96.5	—	156,810
18期 (2021年6月7日)	22,639	5.1	98.5	—	137,252
19期 (2022年6月6日)	25,062	10.7	98.0	—	125,601
	25,405	1.4	98.0	—	112,677

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドは高格付資源国の公社債を投資対象としており、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

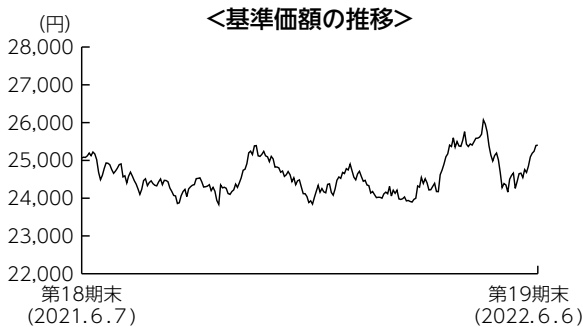
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 6 月 7 日	円 25,062	% -	% -	% 98.0	% -
6 月 末	24,657	△1.6		97.9	-
7 月 末	24,459	△2.4		98.5	-
8 月 末	24,302	△3.0		98.2	-
9 月 末	24,122	△3.8		98.4	-
10 月 末	25,093	0.1		98.1	-
11 月 末	24,118	△3.8		98.1	-
12 月 末	24,781	△1.1		98.5	-
2022年 1 月 末	24,000	△4.2		98.7	-
2 月 末	23,997	△4.2		98.7	-
3 月 末	25,498	1.7		98.2	-
4 月 末	25,131	0.3		98.6	-
5 月 末	25,091	0.1		97.9	-
(期 末) 2022年 6 月 6 日	25,405	1.4		98.0	-

(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（2021年6月8日から2022年6月6日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は25,405円となり、前期末比で1.4%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルス禍から世界経済の正常化が見込まれたことや、資源価格の上昇などからインフレが高進したことを背景に、主要中央銀行が金融引き締めへ転じたことなどによって国債利回りは上昇（価格は下落）し、基準価額にマイナスに寄与しました。一方、為替市場では、内外金利差の拡大見通しなどから投資対象国の通貨が対円で上昇し、基準価額に対してプラスとなりました。この結果、投資対象国の通貨の上昇を主因に基準価額が上昇しました。

## 投資環境

外国債券市場では、いずれの投資対象国でも10年国債利回りが上昇しました。新型コロナウイルスの変異株に対する懸念などから国債利回りが低下（価格は上昇）する場面もありましたが、その後変異株に対する懸念が後退し、景気見通しが改善したこと、インフレの高進などを背景に、投資対象国の中央銀行が量的緩和策の停止や利上げなどを発表したことなどから国債利回りが上昇しました。

為替市場では、全ての投資対象国の通貨が対円で上昇しました。景気回復やインフレの高進から、投資対象国の政策金利の引き上げが見込まれたことで内外金利差の拡大が意識されたこと、エネルギー価格の高騰などから日本の経常収支悪化が意識されたことなどを背景に、投資対象国の通貨に対して円安が大きく進みました。

## ポートフォリオについて

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション\*については、新型コロナウイルスの感染動向と投資対象国および世界経済見通し、主要国および投資対象国の金融政策を勘案して、機動的に調整を行いました。当期末のデュレーションは、利回り上昇が一定程度進んだとの判断から、前期末と比較して長期化しました。

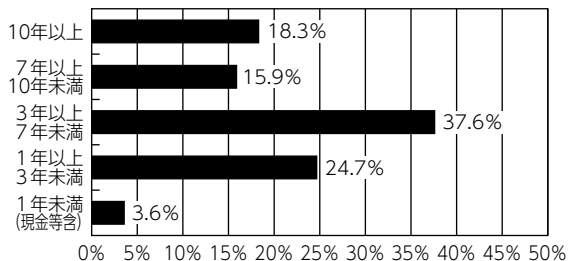
\*金利変動に対する債券価格の変動性。

## 【運用状況】

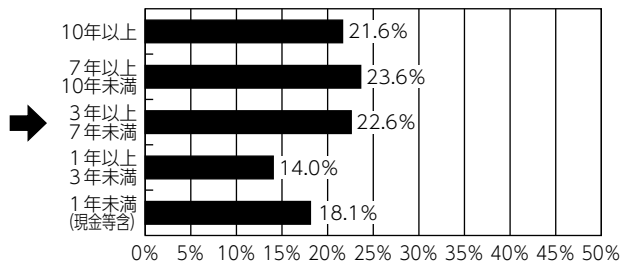
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○残存期間別構成比

期首 (前期末)

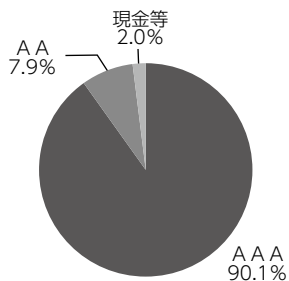


期末

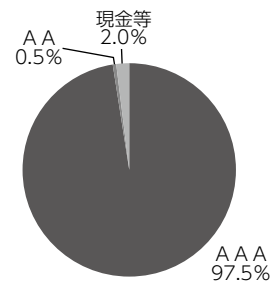


### ○格付別構成比

期首 (前期末)

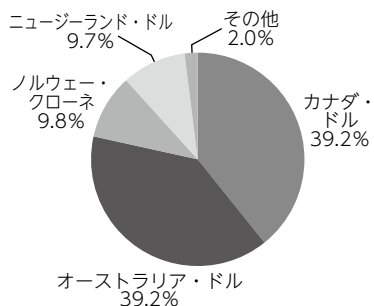


期末

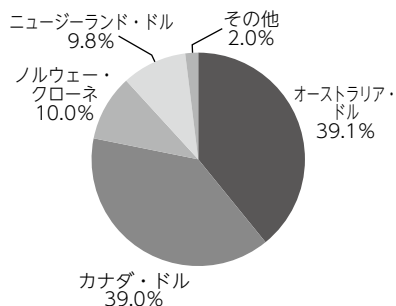


### ○通貨別構成比

期首 (前期末)



期末

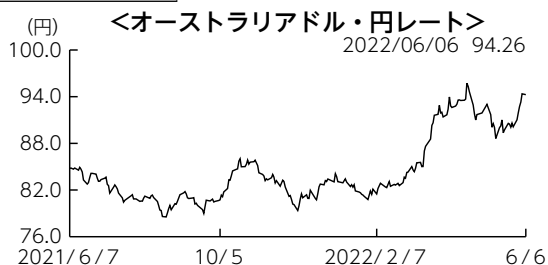


## 【各国の為替・金利動向】

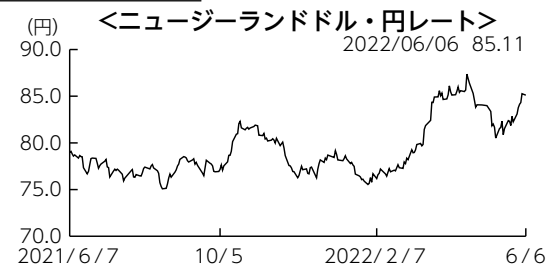
### カナダ



### オーストラリア



### ニュージーランド



### ノルウェー



## 今後の運用方針

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。デフレーションについては、中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

## ■ 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)	2円	0.010%	(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	2	0.010	
期中の平均基準価額は24,592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 (2021年6月8日から2022年6月6日まで)

### 公社債

			買 付 額	売 付 額
外	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 479,812	千カナダ・ドル 457,153 (-)
		地方債証券	-	28,381 (-)
		特殊債証券	-	63,610 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 766,644	千オーストラリア・ドル 739,212 (-)
		地方債証券	108,540	162,065 (-)
		特殊債証券	22,965	41,242 (-)
国	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 56,876	千ニュージーランド・ドル 66,355 (-)
		地方債証券	9,933	9,211 (-)
		特殊債証券	5,481	- (-)
ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 267,823	千ノルウェー・クローネ 179,588 (-)	
	特殊債証券	-	- (150,000)	

(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 (2021年6月8日から2022年6月6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年末満
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 438,300	千カナダ・ドル 422,912	千円 43,961,742	% 39.0	% -	% 17.4	% 6.9	% 14.7
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 509,500	千オーストラリア・ドル 467,917	千円 44,105,941	39.1	-	23.8	11.9	3.5
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 145,500	千ニュージーランド・ドル 130,325	千円 11,091,974	9.8	-	6.1	2.9	0.9
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 853,000	千ノルウェー・クローネ 816,989	千円 11,315,308	10.0	-	4.3	2.7	3.0
合 計	-	-	千円 110,474,966	98.0	-	51.7	24.4	22.0

(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	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	16,000	15,840	1,646,604	2024/03/01
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	25,000	24,457	2,542,312	2023/05/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	15,100	18,589	1,932,397	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	8,000	9,369	973,931	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	15,900	19,782	2,056,357	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,959	931,352	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,659	588,283	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	4,000	3,783	393,313	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,000	981	102,029	2025/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	30,000	26,164	2,719,802	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	27,000	23,679	2,461,510	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	10,000	9,082	944,099	2032/06/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	65,000	64,880	6,744,371	2022/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	34,000	31,453	3,269,580	2025/09/01
CANADA 0.25 11/01/22	国債証券	0.2500	38,000	37,705	3,919,486	2022/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,935	1,344,652	2045/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	56,000	45,484	4,728,135	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,694	488,015	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	24,000	19,398	2,016,424	2030/12/01

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	
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 7.875 11/30/23	地方債証券	7.8750	15,000	16,047	1,668,127	2023/11/30
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	25,000	23,962	2,490,951	2025/12/15
小計	—	—	438,300	422,912	43,961,742	—
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	8,000	6,950	655,169	2047/03/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	30,000	32,103	3,026,087	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,000	9,371	883,387	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	23,000	22,851	2,153,965	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	25,000	25,192	2,374,647	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	20,000	18,819	1,773,878	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	38,000	35,586	3,354,416	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	14,000	12,037	1,134,685	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	25,000	20,339	1,917,233	2032/05/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	18,000	11,403	1,074,846	2051/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	19,000	19,100	1,800,370	2022/07/15
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	18,000	16,093	1,516,993	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	13,000	12,411	1,169,870	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	15,000	14,259	1,344,080	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	20,000	16,951	1,597,865	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	20,000	16,044	1,512,368	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	17,000	15,435	1,454,964	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	34,500	32,401	3,054,121	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	32,000	26,241	2,473,481	2030/12/21
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,324	501,922	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	1,000	988	93,217	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,428	323,173	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,974	1,317,228	2032/10/22
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	13,170	1,241,493	2032/11/22
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 4.25 11/27/24	地方債証券	4.2500	10,000	10,118	953,722	2024/11/27
KOMBNK 4.5 04/17/23	特殊債券	4.5000	12,000	12,187	1,148,797	2023/04/17
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.8 05/31/23	特殊債券	2.8000	10,000	10,002	942,823	2023/05/31
NATIONAL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,622	341,501	2036/06/30
KOMMUNALBANKEN AS 5.25 07/15/24	特殊債券	5.2500	25,000	25,846	2,436,267	2024/07/15
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,658	533,359	2031/08/18
小計	—	—	509,500	467,917	44,105,941	—
<b>(ニュージーランド)</b>		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	10,000	10,454	889,803	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,764	831,049	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	9,522	810,451	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	11,500	11,110	945,597	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	6,000	4,618	393,116	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	19,000	13,191	1,122,751	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	10,000	8,370	712,370	2031/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	10,000	8,611	732,915	2032/05/15



## ■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	110,474,966	95.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,035,476	4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	115,510,442	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、112,185,351千円、97.1％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、2022年6月6日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=103.95円、1オーストラリア・ドル=94.26円、1ニュージーランド・ドル=85.11円、1ノルウェー・クローネ=13.85円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	115,510,442,702円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,474,037,416
公 社 債(評価額)	110,474,966,219
未 収 入 金	3,050,093,036
未 収 利 息	418,263,896
前 払 費 用	93,082,135
(B) 負 債	2,832,751,588
未 払 金	2,553,861,588
未 払 解 約 金	278,890,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	112,677,691,114
元 本	44,353,039,204
次 期 繰 越 損 益 金	68,324,651,910
(D) 受 益 権 総 口 数	44,353,039,204口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,405円

(注1) 期首元本額 50,117,263,636円

追加設定元本額 1,055,748,093円

一部解約元本額 6,819,972,525円

(注2) 期末における元本の内訳

DIA M高格付インカム・オープン(毎月決算コース) 39,493,461,972円

DIA M高格付インカム・オープン<DC年金> 1,047,493,073円

DIA M高格付インカム・オープン(1年決算コース) 483,281,186円

自然環境保護ファンド 324,462,162円

DIA M世界インカム・オープン(毎月決算コース) 739,820,778円

DIA M世界3資産オープン(毎月決算型) 249,057,263円

DIA M高格付インカム私募オープン(3ヵ月決算コース) (適格機関投資家向け)

1,821,020,290円

DIA M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定) 24,203,758円

DIA M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) 170,238,722円

期末元本合計 44,353,039,204円

## ■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,807,717,937円
受 取 利 息	2,807,851,621
支 払 利 息	△133,684
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,525,904,814
売 買 益	13,786,418,696
売 買 損	△15,312,323,510
(C) そ の 他 費 用	△11,157,389
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,270,655,734
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	75,484,733,744
(F) 解 約 差 損 益 金	△9,991,218,475
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,560,480,907
(H) 合 計(D+E+F+G)	68,324,651,910
次 期 繰 越 損 益 金(H)	68,324,651,910

(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。