

DIAM ワールドREITアクティブファンド (毎月決算型)

<愛称：世界のハッピー・オーナー>

追加型投信／海外／不動産投信

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。

当ファンドは、マザーファンドを通じて、主として日本を除く世界各国の不動産投資信託証券（REIT）に投資を行い、信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。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。

作成対象期間 2022年6月10日～2022年12月9日

| | | |
|------------------------|-----------------|----------|
| 第182期 | 決算日：2022年7月11日 | |
| 第183期 | 決算日：2022年8月9日 | |
| 第184期 | 決算日：2022年9月9日 | |
| 第185期 | 決算日：2022年10月11日 | |
| 第186期 | 決算日：2022年11月9日 | |
| 第187期 | 決算日：2022年12月9日 | |
| 第187期末 (2022年12月9日) | 基準価額 | 8,633円 |
| | 純資産総額 | 1,426百万円 |
| 第182期～ 第187期 | 騰落率 | △11.3% |
| | 分配金合計 | 60円 |

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書（全体版）を電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書（全体版）は、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書（全体版）は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

■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)

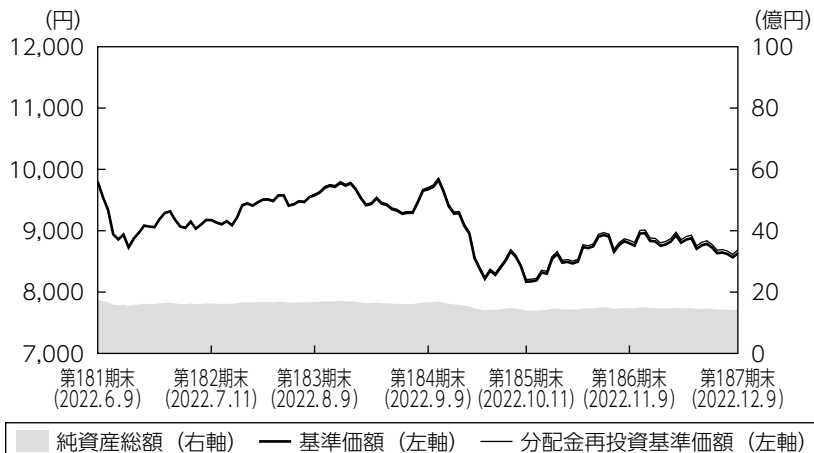
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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/>

運用経過の説明

基準価額等の推移



第182期首：9,800円
 第187期末：8,633円
 (既払分配金60円)
 騰落率：△11.3%
 (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

各国中央銀行による利上げへの警戒感や長期金利の上昇などを受けて各国リート市場が下落したことや、オーストラリアドルやカナダドルなどに対して円高が進行したことは、基準価額にマイナスに影響しました。一方、米ドルや香港ドル、シンガポールドルなどに対して円安が進行したことは基準価額にプラスに寄与しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|--------------------------------------|--------|
| DIAM US・リート・オープン・マザーファンド | △10.2% |
| DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド | △11.2% |

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第182期～第187期 (2022年6月10日 ～2022年12月9日) | | 項目の概要 |
|-------------|--|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| | (a) 信託報酬 | 79円 | |
| (投信会社) | (50) | (0.554) | |
| (販売会社) | (25) | (0.277) | |
| (受託会社) | (4) | (0.044) | |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.013 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.005) | |
| (投資証券) | (1) | (0.008) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.005 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.004) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.010 | (d) 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) | (1) | (0.009) | |
| (監査費用) | (0) | (0.001) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 82 | 0.903 | |

(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、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

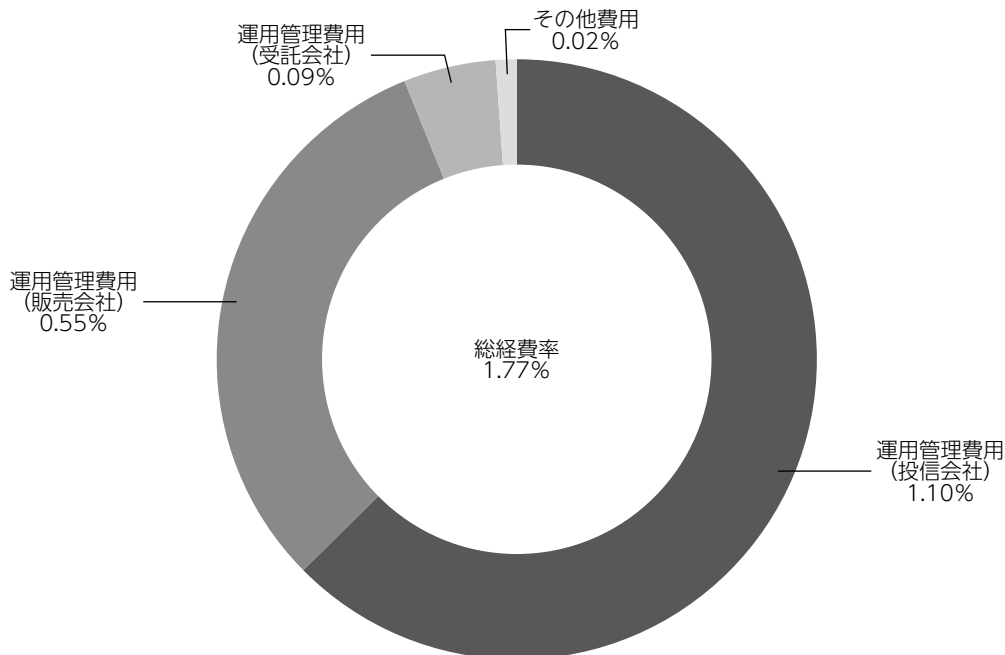
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.77%です。



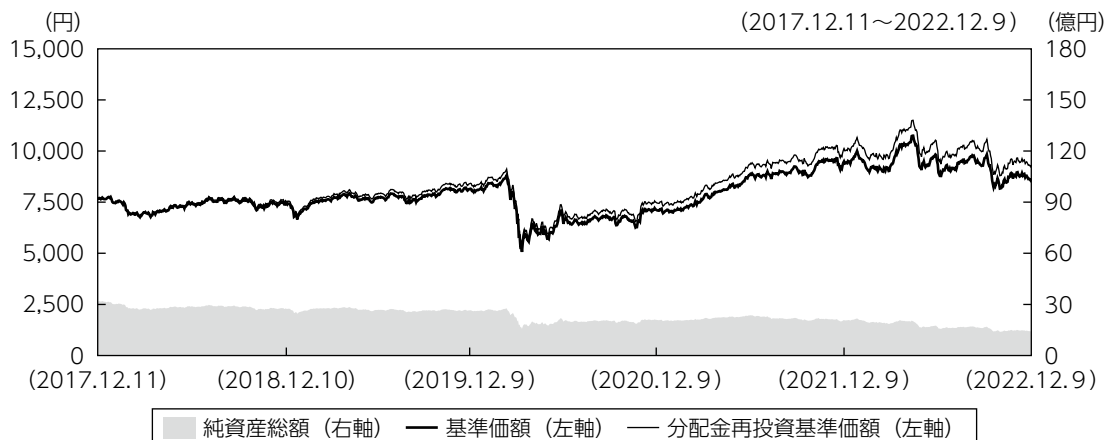
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

最近5年間の基準価額等の推移



- (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、2017年12月11日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2017年12月11日 期首 | 2018年12月10日 決算日 | 2019年12月9日 決算日 | 2020年12月9日 決算日 | 2021年12月9日 決算日 | 2022年12月9日 決算日 |
|--------------------|-------------------|--------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落) (円) | 7,661 | 7,417 | 8,142 | 7,127 | 9,499 | 8,633 |
| 期間分配金合計 (税引前) (円) | — | 120 | 120 | 120 | 120 | 120 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | — | △1.6 | 11.5 | △10.9 | 35.2 | △7.9 |
| 純資産総額 (百万円) | 3,169 | 2,744 | 2,651 | 2,093 | 2,081 | 1,426 |

(注) 当ファンドの信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得するというコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

投資環境

米国リート市場は下落しました。作成期初はインフレ進行に伴うF R B（米連邦準備理事会）による金融引き締めに対する懸念から下落して始まりました。その後もインフレが高止まりする中でF R Bのタカ派姿勢を嫌気して長期金利が上昇したことなどを受けて軟調に推移しました。作成期末にかけてはF R Bによる利上げの減速期待などからやや反発したものの、当作成期を通じては下落して取引を終えました。セクター別では、オフィスやヘルスケアなどが大きく下落しました。

米国以外のリート市場についても、総じて下落する展開となりました。欧州リート市場は、減税案による混乱があった英国や、景気後退が懸念される大陸欧州は大きく下落しました。アジアリート市場では、中国のゼロコロナ政策維持に対する懸念などから香港の下げが目立ちました。オーストラリアリート市場は、R B A（オーストラリア準備銀行）が金利引き上げ幅を縮小したことなどから小幅な下げにとどまりました。

為替市場は、まちまちの展開となりました。各国で利上げが進む中、日銀は緩和姿勢を維持したことから、米ドルやユーロなどに対して円安となりました。一方でF R Bによる利上げの減速期待や政府・日銀による円買いの市場介入などを受けて、オーストラリアドルやカナダドルなどに対しては円高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

D I A M US・リート・オープン・マザーファンド40%、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド60%を基本配分比率とし、概ねこの割合となるよう、各マザーファンドの組入れを行いました。

●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

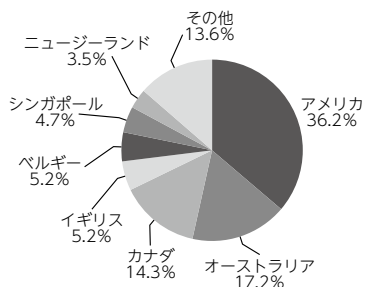
適正価格に到達したと見られる銘柄については、適宜入れ替えを行いました。また、米国景気の先行きや金利の動向も注視しつつ、保守的な財務体質かつ長期的に見て成長見込みがある銘柄や、割安な水準にある銘柄を選別して投資しました。工業やその他などの組入比率を引き上げた一方、ヘルスケアやオフィスなどの組入比率を引き下げました。

●D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

保守的な財務体質かつ配当成長の見込めるキャッシュフローの安定した銘柄を選別して投資を行いました。また、適正価格に到達した銘柄は適宜入れ替えを行いました。地域別では、オーストラリアやニュージーランドなどの組入比率を引き上げた一方、カナダやベルギーなどの組入比率を引き下げました。また、用途別では、小売りや住居施設などの組入比率を引き上げた一方、オフィスや混合型などの組入比率を引き下げました。

【運用状況】 2022年12月9日現在

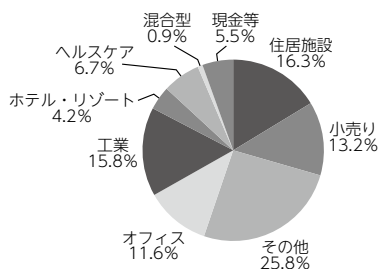
○発行国別配分



- ※1 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。
- ※2 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。
- ※3 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

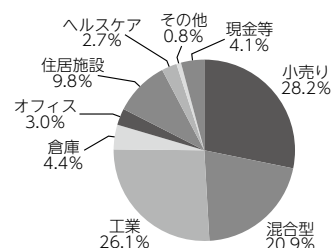
○各マザーファンドにおける用途別組入比率（純資産総額比）

DIAM US・リート・オープン・マザーファンド



- ※用途分類は、運用指図に関する権限を委託しているデビス・セレクトド・アドバイザーズ社独自の分類方法によるものです。

DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド



- ※用途分類は、運用指図に関する権限を委託しているファースト・センティア・インベスターズ（オーストラリア）アイエム・エルティエディー社独自の分類方法によるものです。

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182期 | 第183期 | 第184期 | 第185期 | 第186期 | 第187期 |
|------------|---------------------------|--------------------------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| | 2022年6月10日 ～2022年7月11日 | 2022年7月12日 ～2022年8月9日 | 2022年8月10日 ～2022年9月9日 | 2022年9月10日 ～2022年10月11日 | 2022年10月12日 ～2022年11月9日 | 2022年11月10日 ～2022年12月9日 |
| 当期分配金（税引前） | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |
| 対基準価額比率 | 0.11% | 0.10% | 0.10% | 0.12% | 0.11% | 0.12% |
| 当期の収益 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 7円 | 1円 |
| 当期の収益以外 | -円 | -円 | -円 | -円 | 2円 | 8円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 966円 | 980円 | 999円 | 1,006円 | 1,003円 | 995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 A M US・リート・オープン・マザーファンドおよびD I A M インターナショナル・リート・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を基本とした運用を行います。

●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

米国では、経済活動の正常化が進む一方で、インフレの進行や金利の上昇により米国経済の成長鈍化懸念が強まっており、米国リート市場は目先神経質な展開が予想されます。引き続き財務体質が良好で、長期的な成長が期待できる銘柄を選別して投資する方針です。また、割安な水準にある銘柄にも投資することにより、比較的高い配当利回りを維持できるポートフォリオを構築していきます。

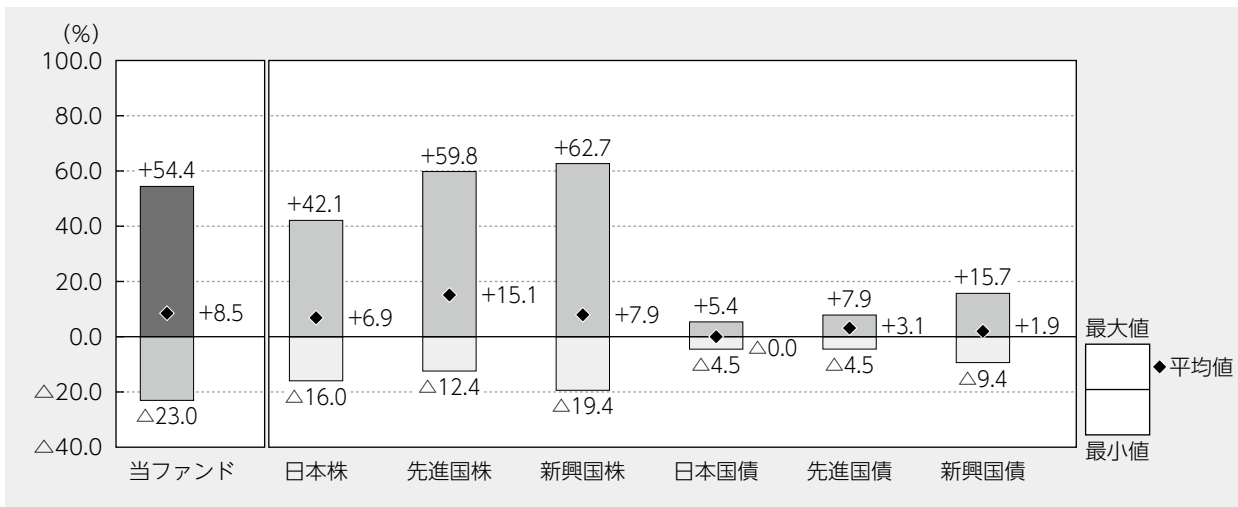
●D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

新型コロナウイルス対策の制限緩和が進む一方で、主要国における金融引き締め懸念によって、市場は不安定な展開になることが予想されます。欧州リート市場では、安定したキャッシュフローが期待できる銘柄を中心に投資を行う方針です。オーストラリアリート市場は、住居施設や工業、小売り等のうち財務体質や成長性、配当利回りといった点に優れる銘柄を選別し投資する方針です。アジアリート市場は、優れた収益成長見通しと健全な財務体質を有する銘柄に厳選して投資を行う方針です。

当ファンドの概要

| | | |
|--------|---|---|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／不動産投信 | |
| 信託期間 | 2007年5月24日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | DIAM ワールド REITアクティブファンド (毎月決算型) | DIAM US・リート・オープン・マザーファンド受益証券およびDIAM インターナショナル・リート・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 US・リート・オープン・マザーファンド | 米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| | DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド | 米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | <p>実質外貨建資産については、対円で為替ヘッジは行いません。マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。各マザーファンドへの投資割合は、世界各国のリート市場の市場規模等を参考として決定します。また、各マザーファンドの運用状況などを勘案し、投資割合を変更する場合があります。</p> <p>DIAM US・リート・オープン・マザーファンドの運用指図に関する権限は、デービス・セレクトド・アドバイザーズに、DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの運用指図に関する権限はファースト・センチア・インベスターズ（オーストラリア）アイエム・エルティーディーにそれぞれ委託します。</p> | |
| 分配方針 | <p>決算日（原則として毎月9日。休業日の場合は翌営業日。）に決算を行い、経費控除後の配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年3・6・9・12月の決算時には、原則として配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた収益分配を行うことをめざします。分配金額につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定するものとします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</p> | |

代表的な資産クラスとの騰落率の比較



2017年12月～2022年11月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 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。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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)

(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。

※各指数については後掲の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

当ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容（2022年12月9日現在）

◆組入ファンド等

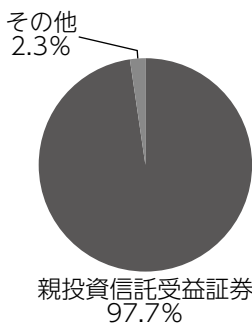
（組入ファンド数：2ファンド）

| | 第187期末 |
|--------------------------------------|------------|
| | 2022年12月9日 |
| DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド | 59.3% |
| DIAM US・リート・オープン・マザーファンド | 38.3 |
| その他 | 2.4 |

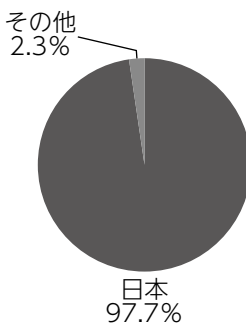
（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

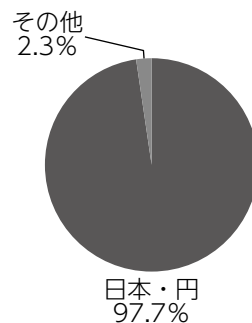
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

純資産等

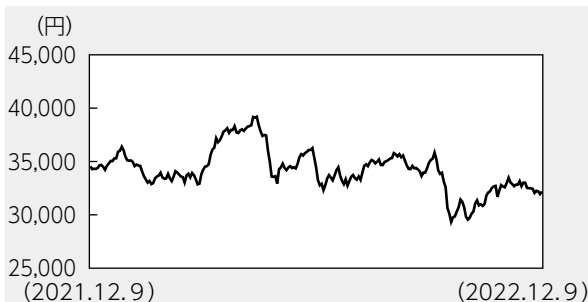
| 項目 | 第182期末 | 第183期末 | 第184期末 | 第185期末 | 第186期末 | 第187期末 |
|------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2022年7月11日 | 2022年8月9日 | 2022年9月9日 | 2022年10月11日 | 2022年11月9日 | 2022年12月9日 |
| 純資産総額 | 1,628,607,952円 | 1,679,225,060円 | 1,666,966,180円 | 1,392,509,032円 | 1,472,638,176円 | 1,426,130,301円 |
| 受益権総口数 | 1,775,457,492口 | 1,753,476,310口 | 1,722,716,180口 | 1,704,847,663口 | 1,674,152,933口 | 1,651,954,911口 |
| 1万口当たり基準価額 | 9,173円 | 9,577円 | 9,676円 | 8,168円 | 8,796円 | 8,633円 |

（注）当作成期間（第182期～第187期）中における追加設定元本額は4,034,748円、同解約元本額は135,172,663円です。

組入ファンドの概要

[DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド] (計算期間 2021年12月10日~2022年12月9日)

◆基準価額の推移



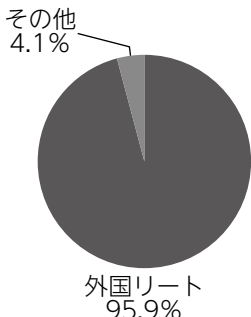
◆組入上位10銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|---|-------------|------|
| WAREHOUSES DE PAUW | ユーロ | 7.5% |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | ニュージーランド・ドル | 5.9 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | カナダ・ドル | 5.5 |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | カナダ・ドル | 5.2 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | オーストラリア・ドル | 5.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | カナダ・ドル | 4.9 |
| VICINITY CENTRES | オーストラリア・ドル | 4.8 |
| SEGO PLC | イギリス・ポンド | 4.5 |
| NATIONAL STORAGE REIT | オーストラリア・ドル | 4.4 |
| UNITE GROUP PLC | イギリス・ポンド | 4.3 |
| 組入銘柄数 | | 32銘柄 |

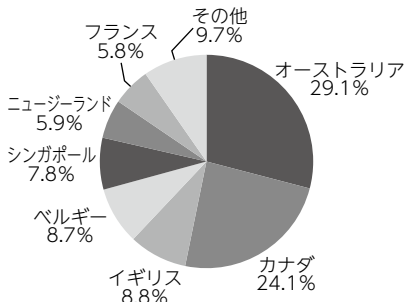
◆1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | |
|-------------------------------------|--------------------|------------------------------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券) | 5円 (4) (1) | 0.014% (0.011) (0.002) |
| (b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券) | 5 (0) (5) | 0.014 (0.001) (0.014) |
| (c) その他費用 (保管費用) (その他) | 8 (6) (2) | 0.024 (0.019) (0.005) |
| 合計 | 18 | 0.052 |
| 期中の平均基準価額は34,197円です。 | | |

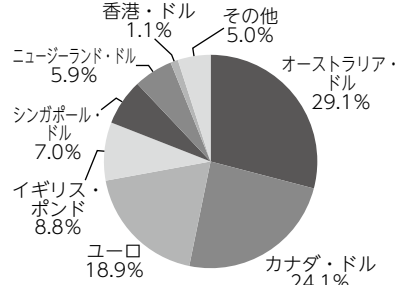
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分

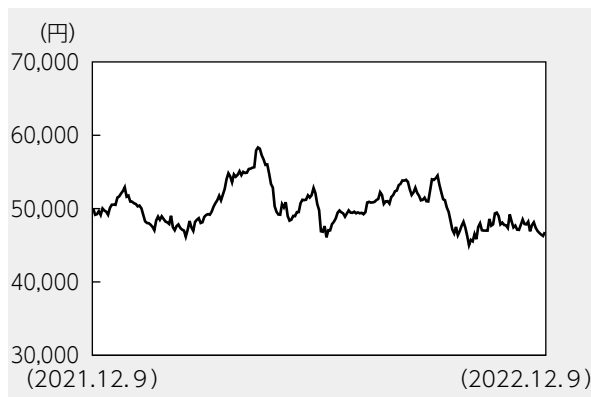


- (注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。
 (注2) 「1万口当たりの費用明細」期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。
 (注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。
 (注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。
 (注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。
 (注6) 国別配分は、発行国(地域)を表示しています。
 (注7) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。
 (注8) 計算期間中の運用経過や組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

[DIAM US・リート・オープン・マザーファンド]

(計算期間 2021年12月10日～2022年12月9日)

◆基準価額の推移



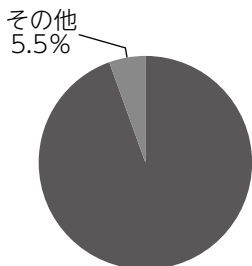
◆組入上位10銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------------------|---------|------|
| PROLOGIS INC | アメリカ・ドル | 7.1% |
| PUBLIC STORAGE | アメリカ・ドル | 5.1 |
| EQUINIX INC | アメリカ・ドル | 4.7 |
| AMERICAN TOWER CORP | アメリカ・ドル | 4.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | アメリカ・ドル | 4.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | アメリカ・ドル | 3.8 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | アメリカ・ドル | 3.7 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | アメリカ・ドル | 3.7 |
| TERRENO REALTY CORP | アメリカ・ドル | 3.4 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | アメリカ・ドル | 3.3 |
| 組入銘柄数 | 38銘柄 | |

◆1万口当たりの費用明細

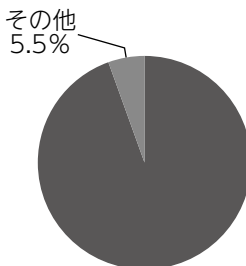
| 項目 | 当期 | |
|------------------------------|-----------------|-----------------------------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) 売買委託手数料 (投資証券) | 17円 (17) | 0.034% (0.034) |
| (b) その他費用 (保管費用) (その他) | 7 (6) (1) | 0.015 (0.012) (0.003) |
| 合計 | 25 | 0.049 |
| 期中の平均基準価額は50,088円です。 | | |

◆資産別配分



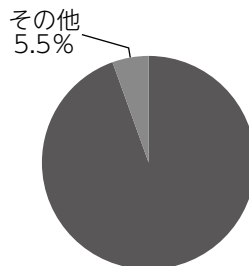
外国リート
94.5%

◆国別配分



アメリカ
94.5%

◆通貨別配分



アメリカ・ドル
94.5%

(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 「1万口当たりの費用明細」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。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注6) 国別配分は、発行国(地域)を表示しています。

(注7) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。
- 「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。
- 「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。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。
- 「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。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」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。

(このページは白紙です)

