

## 運用報告書 (全体版)

### DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ <円コース>

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	2009年10月29日から2024年10月29日までです。
運用方針	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。
主要投資対象	主として円建ての外国投資信託である「ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (J P Y)」の投資信託証券へ投資を行います。また、証券投資信託である「DIAMマネーマザーファンド」受益証券への投資も行います。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。
運用方法	主として円建ての外国投資信託への投資を通じて、米ドル建ての新興国ソブリン債 (国債および政府機関債等 <sup>(*)</sup> ) に実質的な投資を行います。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、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案し決定します。 (* ) 各国政府および政府関係機関が発行する債券であるソブリン債、または政府が出資している企業や政府保証が付いた債券である準ソブリン債を含みます。 外国投資信託においては、米ドルを売り予約し、円を買い予約する為替取引を行います。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。
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。) 等の全額を分配対象額とし、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等を中心に安定分配をめざします。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。また、毎年1月および7月の決算時には、基準価額水準を勘案し、安定分配に加えて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。 「原則として利子配当等収益等を中心に安定分配をめざす」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。また、基準価額水準、運用の状況等によっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

第154期	<決算日	2022年11月7日>
第155期	<決算日	2022年12月5日>
第156期	<決算日	2023年1月5日>
第157期	<決算日	2023年2月6日>
第158期	<決算日	2023年3月6日>
第159期	<決算日	2023年4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新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>」は、2023年4月5日に第159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新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>

### ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託 組入比率	純資産 総額
		(分配落)	税込 み金	期騰 落率		
第23作成期	130期(2020年11月5日)	円 5,562	円 20	% 1.2	% 98.4	百万円 1,836
	131期(2020年12月7日)	5,704	20	2.9	98.1	1,868
	132期(2021年1月5日)	5,748	20	1.1	98.8	1,869
	133期(2021年2月5日)	5,610	20	△2.1	97.9	1,782
	134期(2021年3月5日)	5,352	20	△4.2	98.2	1,676
	135期(2021年4月5日)	5,258	20	△1.4	98.4	1,623
第24作成期	136期(2021年5月6日)	5,301	20	1.2	98.6	1,612
	137期(2021年6月7日)	5,356	20	1.4	98.9	1,625
	138期(2021年7月5日)	5,366	20	0.6	97.9	1,605
	139期(2021年8月5日)	5,400	20	1.0	98.6	1,603
	140期(2021年9月6日)	5,426	20	0.9	98.6	1,587
	141期(2021年10月5日)	5,212	20	△3.6	98.5	1,505
第25作成期	142期(2021年11月5日)	5,201	20	0.2	98.6	1,479
	143期(2021年12月6日)	5,105	20	△1.5	98.5	1,436
	144期(2022年1月5日)	5,047	15	△0.8	98.5	1,395
	145期(2022年2月7日)	4,836	15	△3.9	98.4	1,321
	146期(2022年3月7日)	4,277	15	△11.2	97.7	1,158
	147期(2022年4月5日)	4,388	15	2.9	97.8	1,165
第26作成期	148期(2022年5月6日)	4,010	15	△8.3	98.4	1,043
	149期(2022年6月6日)	4,024	15	0.7	98.2	1,038
	150期(2022年7月5日)	3,749	15	△6.5	98.4	962
	151期(2022年8月5日)	3,875	15	3.8	97.8	984
	152期(2022年9月5日)	3,727	15	△3.4	97.8	944
	153期(2022年10月5日)	3,547	15	△4.4	98.0	883
第27作成期	154期(2022年11月7日)	3,466	15	△1.9	98.0	849
	155期(2022年12月5日)	3,739	15	8.3	98.7	910
	156期(2023年1月5日)	3,693	15	△0.8	98.3	892
	157期(2023年2月6日)	3,820	15	3.8	98.6	919
	158期(2023年3月6日)	3,615	15	△5.0	98.5	857
	159期(2023年4月5日)	3,674	15	2.0	97.8	857

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注3) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注4) △(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

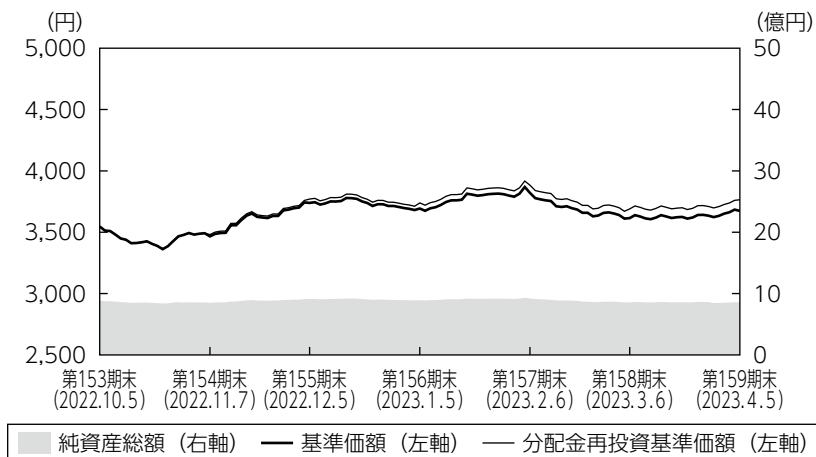
決算期	年 月 日	基準 価 額		投資信託受益証券 組 入 比 率
		騰	落 率	
第154期	(期 首) 2022 年 10 月 5 日	円 3,547	% -	% 98.0
	10 月 末	3,494	△1.5	97.3
	(期 末) 2022 年 11 月 7 日	3,481	△1.9	98.0
第155期	(期 首) 2022 年 11 月 7 日	3,466	-	98.0
	11 月 末	3,696	6.6	98.3
	(期 末) 2022 年 12 月 5 日	3,754	8.3	98.7
第156期	(期 首) 2022 年 12 月 5 日	3,739	-	98.7
	12 月 末	3,691	△1.3	97.9
	(期 末) 2023 年 1 月 5 日	3,708	△0.8	98.3
第157期	(期 首) 2023 年 1 月 5 日	3,693	-	98.3
	1 月 末	3,799	2.9	98.2
	(期 末) 2023 年 2 月 6 日	3,835	3.8	98.6
第158期	(期 首) 2023 年 2 月 6 日	3,820	-	98.6
	2 月 末	3,662	△4.1	98.1
	(期 末) 2023 年 3 月 6 日	3,630	△5.0	98.5
第159期	(期 首) 2023 年 3 月 6 日	3,615	-	98.5
	3 月 末	3,651	1.0	97.3
	(期 末) 2023 年 4 月 5 日	3,689	2.0	97.8

(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) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

## ■第154期～第159期の運用経過（2022年10月6日から2023年4月5日まで）

### 基準価額等の推移



第154期首： 3,547円  
 第159期末： 3,674円  
 (既払分配金90円)  
 騰落率： 6.2%  
 (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

新興国債券市場が上昇したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

### ◆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
ケイマン エマージングソブリン ファンド クラス (JPY)	6.9%
D I A Mマネーマザーファンド	△0.0%

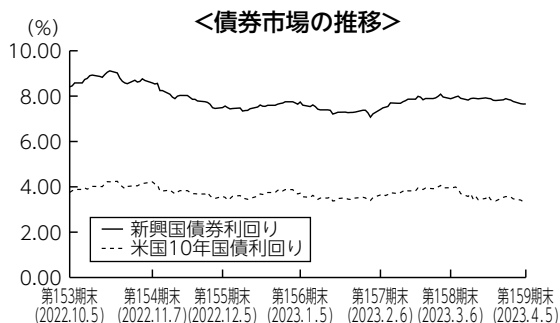
(注) ケイマン エマージングソブリン ファンド クラス (JPY) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

## 投資環境

当作成期の新興国債券市場は上昇しました。作成期前半は、米インフレの鈍化を受けて、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締め策を減速させるとの観測が広がったことなどが好感され、新興国債券市場は堅調に推移しました。しかし、その後、F R Bがタカ派姿勢を維持したことや米中堅銀行の経営破綻に端を発した世界的な信用不安を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、上昇幅を縮小させました。

米ドル／円相場は、米ドル安円高となりました。F R Bが金融引き締めを減速させるとの期待感や日本の金融当局が為替介入を実施したことにより、米ドルは対円で下落しました。更に、日銀が10年国債利回りの上限を0.25%から0.5%に修正し、日米金利差が縮小したことなども下落要因となりました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。



※新興国債券利回りは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・プラスの最終利回りです。

※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。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス ( J P Y ) の組入比率は原則として高位を維持し、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行いました。

### ●ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス ( J P Y )

当作成期の組入れ状況について、地域別では、アフリカ、中南米の比率をオーバーウェイト、欧州、アジア (主に中東) の比率をアンダーウェイトとしました。国別では、ブラジル、メキシコのウェイトを引き下げた一方、U A E (アラブ首長国連邦)、パナマなどのウェイトを引き上げました。サウジアラビア、中国については非保有となっています。

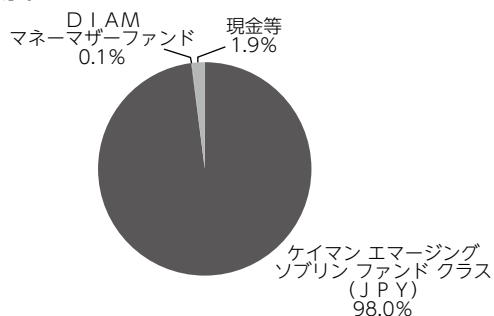
また、米ドルを売り予約し、円を買い予約する為替取引を行いました。

### ●D I A Mマネーマザーファンド

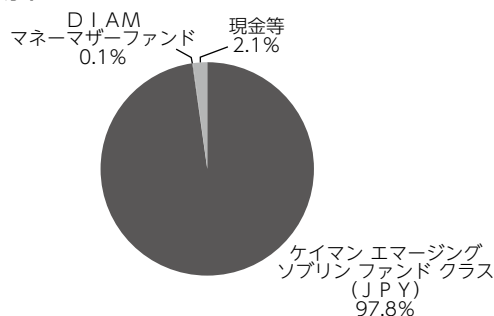
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

## ポートフォリオ構成 ※比率は純資産総額に対する割合です。

### 前作成期末



### 当作成期末



## 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154期	第155期	第156期	第157期	第158期	第159期
	2022年10月6日 ~2022年11月7日	2022年11月8日 ~2022年12月5日	2022年12月6日 ~2023年1月5日	2023年1月6日 ~2023年2月6日	2023年2月7日 ~2023年3月6日	2023年3月7日 ~2023年4月5日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.43%	0.40%	0.40%	0.39%	0.41%	0.41%
当期の収益	15円	15円	15円	15円	15円	15円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	689円	694円	697円	702円	705円	710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、ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス（J P Y）を高位に組入れることを基本とした運用を行い、高水準の利子収入の獲得と中長期的な信託財産の成長をめざします。また、D I A M マネーマザーファンドへの投資も行います。

### ●ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス（J P Y）

世界的なインフレ鈍化と中国のゼロコロナ政策の転換により新興国資産の見通しが改善しています。外貨準備、政治的な安定および効率的に政策を行う新興国を中心に中期的に先進国市場と比較して優位な資産となると見えています。投資戦略はサウジアラビア、中国をアンダーウェイト、オマーン、メキシコをオーバーウェイトとします。地域配分では中南米、アフリカをオーバーウェイト、アジア（主に中東）、欧州をアンダーウェイトといたします。加えて、米ドルを売り予約し、円を買い予約する為替取引を行います。

### ●D I A M マネーマザーファンド

2023年4月9日に黒田日銀総裁の後任として植田和男氏が日銀総裁に就任しますが、新体制発足後も急速な金融引き締めは見込みにくく、金融政策は緩和的な状態を維持するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。



## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第154期～第159期 (2022年10月6日 ～2023年4月5日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	21円	
(投信会社)	( 8)	(0.229)	
(販売会社)	(12)	(0.328)	
(受託会社)	( 1)	(0.016)	
(b) その他費用 (監査費用)	0 ( 0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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
合計	21	0.573	

(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。

(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。

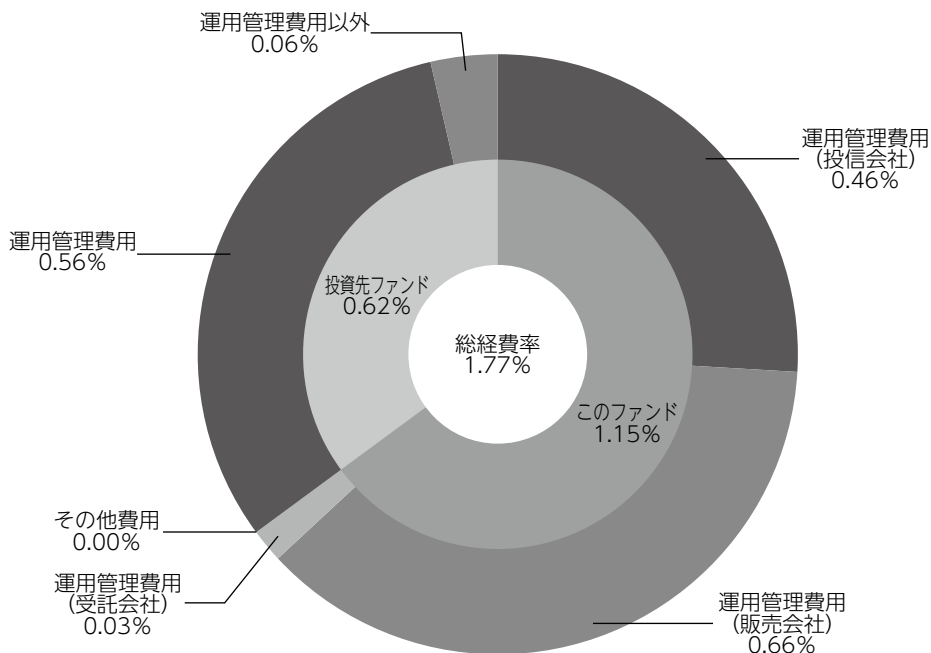
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く）が支払った費用を含みません。

## (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。



総経費率 (①+②+③)	1.77%
①このファンドの費用の比率	1.15%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.56%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1) ①の費用は、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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 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。

## ■売買及び取引の状況 (2022年10月6日から2023年4月5日まで)

投資信託受益証券

		第 154 期 ~ 第 159 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦貨建	ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス(J P Y)	千□ -	千円 -	千□ 14.1	千円 54,974

(注) 金額は受渡代金です。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2022年10月6日から2023年4月5日まで)

期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

## ■利害関係人との取引状況等 (2022年10月6日から2023年4月5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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第 26 作 成 期 末		第 27 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス(J P Y)	千□ 226.84237	千□ 212.74237	千円 837,992	% 97.8
合 計	226.84237	212.74237	837,992	97.8

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第 26 作 成 期 末		第 27 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	評 価 額
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 870	千□ 870	千円 875	

## ■投資信託財産の構成

2023年4月5日現在

項 目	第 27 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 837,992	% 97.3
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	875	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	22,648	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	861,516	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

(2022年11月7日)、(2022年12月5日)、(2023年1月5日)、(2023年2月6日)、(2023年3月6日)、(2023年4月5日)現在

項 目	第 154 期 末	第 155 期 末	第 156 期 末	第 157 期 末	第 158 期 末	第 159 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>855,935,816円</b>	<b>915,112,894円</b>	<b>896,815,598円</b>	<b>924,140,706円</b>	<b>861,864,388円</b>	<b>861,516,562円</b>
コール・ローン等	22,364,659	15,373,370	18,844,080	16,107,165	16,026,252	22,648,886
投資信託受益証券(評価額)	832,695,328	898,863,869	877,096,124	907,157,886	844,962,568	837,992,195
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド ( 評 価 額 )	875,829	875,655	875,394	875,655	875,568	875,481
<b>(B) 負 債</b>	<b>6,128,820</b>	<b>4,438,705</b>	<b>4,551,044</b>	<b>4,534,584</b>	<b>4,338,737</b>	<b>4,313,902</b>
未払収益分配金	3,677,983	3,653,172	3,623,892	3,610,907	3,558,077	3,499,608
未払解約金	1,553,629	115	36,875	-	15	15
未払信託報酬	894,952	783,436	888,035	921,356	778,681	812,231
その他未払費用	2,256	1,982	2,242	2,321	1,964	2,048
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>849,806,996</b>	<b>910,674,189</b>	<b>892,264,554</b>	<b>919,606,122</b>	<b>857,525,651</b>	<b>857,202,660</b>
元 本	2,451,988,847	2,435,448,666	2,415,928,344	2,407,271,697	2,372,051,862	2,333,072,266
次期繰越損益金	△1,602,181,851	△1,524,774,477	△1,523,663,790	△1,487,665,575	△1,514,526,211	△1,475,869,606
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>2,451,988,847口</b>	<b>2,435,448,666口</b>	<b>2,415,928,344口</b>	<b>2,407,271,697口</b>	<b>2,372,051,862口</b>	<b>2,333,072,266口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	3,466円	3,739円	3,693円	3,820円	3,615円	3,674円

(注) 第153期末における元本額は2,491,607,041円、当作成期間(第154期~第159期)中における追加設定元本額は19,032,359円、同解約元本額は177,567,134円です。

## ■損益の状況

〔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〕〔自 2022年12月6日 至 2023年1月5日〕〔自 2023年1月6日 至 2023年2月6日〕〔自 2023年2月7日 至 2023年3月6日〕〔自 2023年3月7日 至 2023年4月5日〕

項 目	第 154 期	第 155 期	第 156 期	第 157 期	第 158 期	第 159 期
(A) 配 当 等 収 益	5,143,571円	5,127,248円	5,076,397円	5,083,740円	5,012,461円	4,941,727円
受 取 配 当 金	5,144,573	5,128,229	5,077,262	5,083,927	5,012,674	4,941,995
受 取 利 息	-	1	3	45	7	23
支 払 利 息	△1,002	△982	△868	△232	△220	△291
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△20,403,717	65,906,561	△11,670,778	29,984,208	△49,291,997	13,137,930
売 買 益	463,195	66,168,496	63,984	30,062,012	379,386	13,189,999
売 買 損	△20,866,912	△261,935	△11,734,762	△77,804	△49,671,383	△52,069
(C) 信 託 報 酬 等	△897,208	△785,418	△890,277	△923,677	△780,645	△814,279
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△16,157,354	70,248,391	△7,484,658	34,144,271	△45,060,181	17,265,378
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,362,790,594	△1,372,072,047	△1,291,301,728	△1,296,512,632	△1,246,314,648	△1,272,364,713
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△219,555,920	△219,297,649	△221,253,512	△221,686,307	△219,593,305	△217,270,663
(配 当 等 相 当 額)	(130,086,123)	(129,243,174)	(128,324,945)	(127,903,448)	(126,069,692)	(124,038,983)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△349,642,043)	(△348,540,823)	(△349,578,457)	(△349,589,755)	(△345,662,997)	(△341,309,646)
(G) 合 計 (D+E+F)	△1,598,503,868	△1,521,121,305	△1,520,039,898	△1,484,054,668	△1,510,968,134	△1,472,369,998
(H) 収 益 分 配 金	△3,677,983	△3,653,172	△3,623,892	△3,610,907	△3,558,077	△3,499,608
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,602,181,851	△1,524,774,477	△1,523,663,790	△1,487,665,575	△1,514,526,211	△1,475,869,606
追 加 信 託 差 損 益 金	△219,555,920	△219,297,649	△221,253,512	△221,686,307	△219,593,305	△217,270,663
(配 当 等 相 当 額)	(130,086,123)	(129,243,174)	(128,324,945)	(127,903,448)	(126,069,692)	(124,038,983)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△349,642,043)	(△348,540,823)	(△349,578,457)	(△349,589,755)	(△345,662,997)	(△341,309,646)
分 配 準 備 積 立 金	38,886,159	40,006,704	40,134,525	41,291,687	41,324,038	41,823,423
繰 越 損 益 金	△1,421,512,090	△1,345,483,532	△1,342,544,803	△1,307,270,955	△1,336,256,944	△1,300,422,366

(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 154 期	第 155 期	第 156 期	第 157 期	第 158 期	第 159 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,246,365円	5,070,540円	4,186,113円	4,949,807円	4,231,816円	4,719,185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	130,086,123	129,243,174	128,324,945	127,903,448	126,069,692	124,038,983
(d) 分 配 準 備 積 立 金	38,317,777	38,589,336	39,572,304	39,952,787	40,650,299	40,603,846
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	172,650,265	172,903,050	172,083,362	172,806,042	170,951,807	169,362,014
(f) 1万口当たり当期分配対象額	704.12	709.94	712.29	717.85	720.69	725.92
(g) 分 配 金	3,677,983	3,653,172	3,623,892	3,610,907	3,558,077	3,499,608
(h) 1万口当たり分配金	15	15	15	15	15	15

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第 154 期	第 155 期	第 156 期	第 157 期	第 158 期	第 159 期
1 万口当たり分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15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。

# ケイマン エマージング ソブリン ファンド

クラスJPY/クラスUSD/クラスAUD/クラスZAR/クラスBRL/クラスCNY

当ファンドは「DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ」が投資対象とする外国投資信託です。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

<p>形 態</p> <p>投資方針および 主要投資対象</p>	<p>ケイマン籍円建外国投資信託</p> <p>①主として米ドル建ての新興国のソブリン債（国債および政府機関債等）に投資し、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。</p> <p>②ポートフォリオの運用に関しては、新興国の米ドル建て国債の代表的指数である「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（米ドルベース・為替ヘッジなし）」をベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざします。なお、ベンチマークは市場の構造変化等によっては今後見直す場合があります。</p> <p>③銘柄選定にあたっては、投資対象国のファンダメンタルズ分析や個別銘柄のバリュエーション分析等により決定します。</p> <p>④組入債券は、当初組入時において、S &amp; PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がB-格もしくはB3格相当以上を取得している債券とします。</p> <p>⑤原則として、ポートフォリオの平均格付*はB-格相当以上とします。</p> <p>⑥原則として、ポートフォリオの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーションに対して±2年以内とします。</p> <p>⑦米ドル建て以外の資産への投資は、純資産総額の20%以内を基本とします。但し、この場合は原則として対米ドルで為替取引することとします。</p> <p>⑧有価証券先物取引、金利スワップ等のデリバティブ取引を活用する場合があります。</p> <p>⑨各クラスは、米ドルに対して各クラスの通貨で為替取引を行います（クラスUSDを除く）。</p> <p>*平均格付とは、各組入債券にかかる信用格付を加重平均したものであり、外国投資信託にかかる信用格付ではありません。</p>
<p>投資顧問会社</p>	<p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー</p>
<p>受託銀行</p>	<p>FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited.</p>
<p>管理事務代行会社</p>	<p>Mizuho Trust &amp; Banking (Luxembourg) S.A.</p>
<p>保管銀行</p>	<p>Mizuho Bank (USA)</p>

ケイマン エマージング ソブリン ファンドはケイマン籍外国投資信託で、2021年12月31日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下の「運用計算書および純資産変動計算書（損益計算書）」および「投資有価証券およびその他純資産明細書」等は、2021年12月31日現在の財務諸表の原文の翻訳を抜粋したものです。なお、クラス分けされたものがないため、シリーズ・トラスト単位（ケイマン エマージング ソブリン ファンド）で掲載しています。シリーズ・トラストは複数のクラスで構成されています。

運用計算書および純資産変動計算書  
自2021年1月1日 至2021年12月31日  
(日本円建て)

<b>期首現在純資産</b>	<b>8,161,057,782</b>
<b>収益の部</b>	
債券利息	231,849,099
その他収益	1,944,251
払戻による損失	(3,772,660)
<b>収益合計</b>	<b>230,020,690</b>
<b>費用の部</b>	
投資運用報酬	28,177,748
管理事務及び保管報酬	9,955,774
監査報酬	4,133,733
受託報酬	1,642,585
その他費用	389,280
<b>費用合計</b>	<b>44,299,120</b>
<b>純投資収益</b>	<b>185,721,570</b>
投資有価証券売却による実現純利益	229,771,506
為替先渡契約および外貨取引による実現純損失	(153,560,444)
<b>期中実現純利益額</b>	<b>76,211,062</b>
投資有価証券による未実現純損益の変動	(185,569,939)
為替先渡契約および外貨取引による未実現純損益の変動	(187,395,375)
<b>期中未実現純減の変動額</b>	<b>(372,965,314)</b>
<b>運用による純資産の純減</b>	<b>(111,032,682)</b>
受益権口発行収入	19,000,000
受益権口償還コスト	(853,936,920)
<b>受益者取引による純支払額合計</b>	<b>(834,936,920)</b>
受益者に支払われた分配金	(1,083,942,069)
<b>期末現在純資産額</b>	<b>6,131,146,111</b>



投資有価証券およびその他純資産明細書  
2021年12月31日現在  
(日本円建て)

公認の証券取引所への上場を許可された譲渡性のある有価証券

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
<b>社債</b>					
800,000	BANCO NAC DE PAN 2.500% 08/11/30 REGS	USD	84,605,482	86,556,121	1.41%
400,000	BANCO NACIONAL 4.38% 10/14/25	USD	44,278,645	50,387,097	0.82%
400,000	COMISION FEDERAL 3.348% 02/09/31 REGS	USD	43,050,860	45,223,711	0.74%
200,000	COMISION FEDERAL 4.677% 02/09/51 REGS	USD	21,660,618	21,701,875	0.35%
200,000	ENA MASTER TRUST 4.000% 05/19/48	USD	21,735,973	23,162,148	0.38%
1,020,000	ESKOM HOLDINGS 6.350% 08/10/28 REGS	USD	108,963,689	126,940,912	2.07%
800,000	HUTAMA KARYA PER 3.750% 05/11/30 REGS	USD	90,839,055	98,604,052	1.61%
400,000	INDONESIA ASAHAN 6.757% 11/15/48 REGS	USD	44,246,837	58,998,418	0.96%
200,000	KAZMUNAYGAS NAT 5.750% 04/19/47 REGS	USD	24,684,496	28,221,599	0.46%
200,000	PEMEX MASTER TR 6.625% 6/15/35	USD	21,508,139	22,156,750	0.36%
500,000	PERTAMINA 4.300% 05/20/23 REGS	USD	55,643,612	59,973,833	0.98%
200,000	PERUSAHAAN LISTR 4.125% 05/15/27 REGS	USD	22,717,257	24,592,036	0.40%
200,000	PERUSAHAAN LISTR 5.450% 05/21/28 REGS	USD	25,384,262	26,408,084	0.43%
200,000	PETROLEOS DEL PE 4.750% 06/19/32 REGS	USD	23,683,056	24,060,044	0.39%
1,000,000	PETROLEOS DEL PE 5.625% 06/19/47 REGS	USD	113,122,044	114,153,878	1.86%
400,000	PETROLEOS MEXICA 4.500% 01/23/26	USD	38,819,718	46,633,686	0.76%
	社債合計		784,943,743	857,774,244	13.98%
<b>ソブリン債</b>					
200,000	ARAB REP EGYPT 6.588% 02/21/28 REGS	USD	23,699,090	22,444,960	0.37%
4,206,114	ARGENTINA 0.125% 01/09/38	USD	455,289,032	183,967,014	3.00%
3,686,000	ARGENTINA 0.125% 07/09/30	USD	402,921,853	149,555,399	2.44%
1,164,000	ARGENTINA 07/09/35	USD	142,519,017	43,041,258	0.70%
436,643	ARGENTINA 1.000% 07/09/29	USD	50,082,585	18,344,530	0.30%
200,000	ARMENIA 7.150% 03/26/25 REGS	USD	24,928,178	25,746,811	0.42%
800,000	BRAZIL REP OF 3.875% 06/12/30	USD	87,309,505	89,478,740	1.46%
800,000	BRAZIL REP OF 4.625% 01/13/28	USD	89,405,056	96,310,616	1.57%
2,200,000	BRAZIL REP OF 5.00% 01/27/45	USD	234,625,272	238,153,410	3.88%
170,000	BRAZIL REP OF 5.63% 01/07/41	USD	15,862,527	20,027,607	0.33%
600,000	COLOMBIA REP OF 3.000% 01/30/30	USD	65,255,542	63,250,327	1.03%
600,000	COLOMBIA REP OF 3.125% 04/15/31	USD	64,757,916	62,118,089	1.01%
200,000	COLOMBIA REP OF 3.250% 04/22/32	USD	21,005,634	20,746,775	0.34%
1,900,000	COLOMBIA REP OF 5.000% 06/15/45	USD	216,852,489	198,187,812	3.23%
300,000	COLOMBIA REP OF 5.200% 05/15/49	USD	32,735,149	31,844,947	0.52%
500,000	CORP FINANCIERA FXtoFL 07/15/29 REGS	USD	57,383,490	59,538,640	0.97%
200,000	FIN DEPT SHARJAH 4.000% 07/28/50 REGS	USD	22,457,258	20,899,398	0.34%
500,000	INDONESIA 5.25% 01/17/42	USD	47,431,874	72,337,300	1.18%
1,400,000	INDONESIA (REP) 4.750% 07/18/47 REGS	USD	159,497,697	195,344,060	3.19%
1,900,000	INDONESIA (REP) 6.63% 02/17/37 REGS	USD	168,885,676	305,878,860	4.99%
200,000	JORDAN 7.375% 10/10/47 REGS	USD	25,397,026	23,326,741	0.38%
200,000	PANAMA 2.252% 09/29/32	USD	21,190,287	21,886,265	0.36%
200,000	PANAMA 3.870% 07/23/60	USD	23,678,561	23,106,325	0.38%
400,000	PANAMA 4.30% 04/29/53	USD	36,092,768	49,597,050	0.81%
200,000	PANAMA 4.500% 05/15/47	USD	23,316,542	25,437,100	0.41%
180,000	PANAMA 6.70% 1/26/36	USD	24,174,714	27,799,309	0.45%
235,000	PHILIPPINES(REP) 3.700% 02/02/42	USD	25,555,516	29,574,181	0.48%
1,080,000	PHILIPPINES(REP) 3.700% 03/01/41	USD	122,731,205	135,917,994	2.22%
790,000	REP OF PHILIPPINES 6.375%10/23/2034	USD	89,728,967	126,468,054	2.06%

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
200,000	REPUBLIC OF PERU 8.75% 11/21/33	USD	20,109,388	35,951,715	0.59%
180,000	REPUBLIC OF PERU 2.392% 01/23/26	USD	19,389,886	21,070,413	0.34%
330,000	REPUBLIC OF PERU 2.783% 01/23/31	USD	35,548,217	37,888,422	0.62%
520,000	ROMANIA 3.000% 02/14/31 REGS	USD	57,349,379	60,929,456	0.99%
400,000	ROMANIA 4.000% 02/14/51 REGS	USD	46,713,678	46,183,092	0.75%
1,153,425	RUSSIA FOREIGN BOND 7.5% 03/31/2030	USD	143,228,017	150,700,962	2.46%
2,600,000	RUSSIA-EUROBOND 5.63% 04/04/42	USD	313,130,947	390,893,412	6.38%
200,000	SENEGAL REP OF 6.750% 03/13/48	USD	22,539,298	22,637,868	0.37%
700,000	SOUTH AFRICA 5.375% 07/24/44	USD	70,692,336	77,181,226	1.26%
300,000	SOUTH AFRICA 5.750% 09/30/49	USD	32,244,000	33,295,552	0.54%
200,000	TURK IHRACAT 5.750% 07/06/26 REGS	USD	22,056,693	21,168,501	0.35%
1,900,000	TURKEY REP OF 4.25% 04/14/26	USD	181,313,127	196,545,451	3.21%
200,000	TURKEY REP OF 4.875% 10/09/26	USD	21,299,869	20,921,405	0.34%
2,000,000	TURKEY REP OF 4.88% 04/16/43	USD	170,236,444	176,989,270	2.89%
510,000	TURKEY REP OF 6.000% 03/25/27	USD	58,733,876	55,495,338	0.91%
1,200,000	TURKEY REP OF 6.125% 10/24/28	USD	118,220,323	128,910,987	2.10%
700,000	TURKEY REP OF 6.350% 08/10/24	USD	75,262,659	79,450,077	1.30%
800,000	UKRAINE GOV'T 7.375% 09/25/32	USD	84,042,878	82,423,570	1.34%
300,000	UKRAINE GOV'T 8.994% 02/01/24 REGS	USD	32,908,897	34,579,999	0.56%
1,700,000	UKRAINE GOV'T 9.750% 11/01/28 REGS	USD	184,625,027	198,524,825	3.24%
600,000	UNITED MEXICAN 2.659% 05/24/31	USD	64,310,089	67,541,371	1.10%
2,500,000	UNITED MEXICAN 4.60% 01/23/46	USD	281,337,034	308,614,752	5.03%
1,720,000	UNITED MEXICAN 4.75% 03/08/44	USD	179,983,169	216,394,284	3.54%
	ソブリン債合計		5,010,045,657	4,844,621,520	79.03%
	<b>投資有価証券公正価値合計</b>		<b>5,794,989,400</b>	<b>5,702,395,764</b>	<b>93.01%</b>

2021年12月31日	
クラスAUD (日本円)	
発行済受益権口数	192,003.17
1口当たり純資産価額	3,161
クラスBRL (日本円)	
発行済受益権口数	6,254,213.62
1口当たり純資産価額	599
クラスCNY (日本円)	
発行済受益権口数	4,867.77
1口当たり純資産価額	10,360
クラスJPY (日本円)	
発行済受益権口数	250,242.37
1口当たり純資産価額	5,533
クラスUSD (日本円)	
発行済受益権口数	6,700.94
1口当たり純資産価額	9,105
クラスZAR (日本円)	
発行済受益権口数	164,721.00
1口当たり純資産価額	1,729

# D I A Mマネーマザーファンド

## 運用報告書

第14期（決算日 2023年4月5日）

（計算期間 2022年4月6日～2023年4月5日）

D I A Mマネーマザーファンドの第14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	2009年10月29日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保をめざします。
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を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建て資産への投資は行いません。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券 組入比率	新株予約権 付社債 (転換社債)	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落 中率				
10期(2019年4月5日)	10,098	△0.0	79.4	—	—	百万円 16,167
11期(2020年4月6日)	10,089	△0.1	69.3	—	—	1,139
12期(2021年4月5日)	10,080	△0.1	62.4	—	—	1,064
13期(2022年4月5日)	10,071	△0.1	76.3	—	—	1,192
14期(2023年4月5日)	10,063	△0.1	71.8	—	—	1,253

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

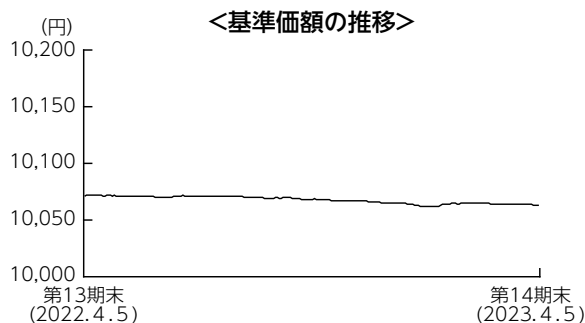
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 組 入 比 率	新 株 予 約 権 付 社 債 ( 転 換 社 債 ) 組 入 比 率	債 先 物 比 率
(期 首) 2022年 4 月 5 日	10,071	—	76.3	—	—
4 月 末	10,071	0.0	76.3	—	—
5 月 末	10,071	0.0	76.3	—	—
6 月 末	10,071	0.0	75.5	—	—
7 月 末	10,071	0.0	75.5	—	—
8 月 末	10,069	△0.0	75.5	—	—
9 月 末	10,068	△0.0	75.5	—	—
10 月 末	10,067	△0.0	75.6	—	—
11 月 末	10,065	△0.1	75.9	—	—
12 月 末	10,062	△0.1	75.9	—	—
2023年 1 月 末	10,064	△0.1	75.3	—	—
2 月 末	10,064	△0.1	75.3	—	—
3 月 末	10,063	△0.1	71.8	—	—
(期 末) 2023年 4 月 5 日	10,063	△0.1	71.8	—	—

(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（2022年4月6日から2023年4月5日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は10,063円となり、前期末比で0.1%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざした運用を行いましたが、日銀のマイナス金利政策の影響が大きく基準価額は前期末比で下落して期末を迎えました。

## 投資環境

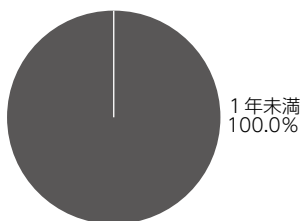
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

## ポートフォリオについて

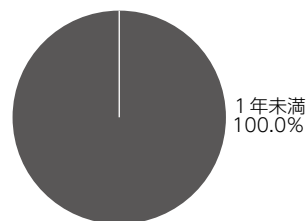
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

### ○残存年限別構成比 期首（前期末）



### 当期末



## 今後の運用方針

2023年4月9日に黒田日銀総裁の後任として植田和男氏が日銀総裁に就任しますが、新体制発足後も急速な金融引き締めは見込みにくく、金融政策は緩和的な状態を維持するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

## ■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■ 売買及び取引の状況 (2022年4月6日から2023年4月5日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	901,029	(910,000)

(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 (2022年4月6日から2023年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決算期 区分	当			期		
	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	D/C
金銭信託	百万円 0.028	百万円 0.028	%	百万円 0.028	百万円 0.028	%
		100.0			100.0	

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

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）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		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	900,000	900,426	71.8	—	—	—	71.8
合 計	900,000	900,426	71.8	—	—	—	71.8

(注) 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

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期		末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
4 2 4 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	200,000	200,020	2023/05/01
4 2 6 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	200,000	200,090	2023/07/01
4 2 7 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	200,000	200,102	2023/08/01
4 2 9 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	200,000	200,140	2023/10/01
4 3 0 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,074	2023/11/01
合 計	—	900,000	900,426	—

## ■投資信託財産の構成

2023年4月5日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
	900,426	71.8	900,426	71.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	353,089	28.2	353,089	28.2
投 資 信 託 財 産 総 額	1,253,515	100.0	1,253,515	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

(2023年4月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,253,515,428円
コ ー ル ・ 公 司	353,078,860
未 収 金	900,426,000
前 払 金	10,144
	424
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,253,515,428
元 本	1,245,658,613
次 期 繰 越 損 益 金	7,856,815
(D) 受 益 権 総 口 数	1,245,658,613口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,063円

(注1) 期首元本額	1,184,299,773円	みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) ブラジルレアルコース	9,925円
追加設定元本額	67,418,522円	マシュエズ・アジア株式ファンド	29,641,137円
一部解約元本額	6,059,682円	One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円
(注2) 期末における元本の内訳		One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円
バンクローン・ファンド (ヘッジなし)	15,843,407円	One世界分散セレクト (Cコース)	99,040円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり)	13,867,169円	世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型)	99,109円
バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型)	1,088,285円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり/年1回決算型)	98,095円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3,959,763円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	989,197円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	494,102円	ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号	494,102円	リスクコントロール世界8資産/バランスファンド (F OF S 用) (適格機関投資家専用)	27,831,876円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号	48,517円	期末元本合計	1,245,658,613円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	395,083円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	11,377円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	98,027円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	989,197円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	395,083円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	494,102円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	494,102円		
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>	791,316円		
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>	2,474,972円		
クルーズコントロール	990,000,991円		
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	39,586,646円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルレアルコース>	10,530,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円		
USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり)	993,740円		
USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし)	1,987,479円		
DIAM・ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>	9,935円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 円コース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 米ドルコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 豪ドルコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) メキシコペソコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) トルコリラコース	9,925円		



## ■損益の状況

当期 自2022年4月6日 至2023年4月5日

項	目	当 期
(A) 配	当 等 収 益	276,679円
受	取 利 息	389,729
支	払 利 息	△113,050
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	△1,274,900
売	買 損 益	△1,274,900
(C) 当	期 損 益 金(A+B)	△998,221
(D) 前	期 繰 越 損 益 金	8,464,251
(E) 解	約 差 損 益 金	△40,693
(F) 追	加 信 託 差 損 益 金	431,478
(G) 合	計(C+D+E+F)	7,856,815
次	期 繰 越 損 益 金(G)	7,856,815

(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) (E)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) (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。