

運用報告書 (全体版)

世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投資 / 内外 / 債券	
信託期間	2010年1月20日から2020年1月23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	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <円コース>	主として円建ての外国投資信託である「ダイヤモンドフィナンシャルセキュリティーズファンドクラス(JPY)」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「DIAマネーマーザーファンド」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。
	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <豪ドルコース>	主として円建ての外国投資信託である「ダイヤモンドフィナンシャルセキュリティーズファンドクラス(AUD)」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「DIAマネーマーザーファンド」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。
	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <ブラジルリアルコース>	主として円建ての外国投資信託である「ダイヤモンドフィナンシャルセキュリティーズファンドクラス(BRL)」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「DIAマネーマーザーファンド」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。
	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <中国元コース>	主として円建ての外国投資信託である「ダイヤモンドフィナンシャルセキュリティーズファンドクラス(CNY)」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「DIAマネーマーザーファンド」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	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <円コース>	主として円建ての外国投資信託への投資を通じて、先進国の金融機関 ^{(*)1} が発行したハイブリッド証券 ^{(*)2} 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。 (*)1 金融機関に関連する特別目的会社を含みます(以下、他のコースも同じ。) (*)2 ハイブリッド証券とは、普通株式と債権の中間的特性を有する有価証券であり、劣後債、優先投資証券などをいいます(以下、他のコースも同じ。) 外国投資信託においては、ユーロ、米ドルなど複数通貨(以下、「原資産通貨」といいます。他のコースも同じ。)建てのハイブリッド証券に投資しますが、この「原資産通貨」を売り予約し、円を買い予約する為替取引を行います。
	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <豪ドルコース>	主として円建ての外国投資信託への投資を通じて、先進国の金融機関が発行したハイブリッド証券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。 外国投資信託においては、ユーロ、米ドルなど複数通貨建てのハイブリッド証券に投資しますが、この「原資産通貨」を売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行います。
	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <ブラジルリアルコース>	主として円建ての外国投資信託への投資を通じて、先進国の金融機関が発行したハイブリッド証券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。 外国投資信託においては、ユーロ、米ドルなど複数通貨建てのハイブリッド証券に投資しますが、この「原資産通貨」を売り予約し、ブラジルリアルを買い予約する為替取引を行います。
	世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型) <中国元コース>	主として円建ての外国投資信託への投資を通じて、先進国の金融機関が発行したハイブリッド証券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。 外国投資信託においては、ユーロ、米ドルなど複数通貨建てのハイブリッド証券に投資しますが、この「原資産通貨」を売り予約し、中国元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23日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の剰余金等収益および有価証券(評価益を含みます。)等の全額を分配対象とし、基準価額水準、市場動向等を勘案して、分配金額を決定します。原則として剰余金等収益等を中心に安定分配を行うことを基本とします。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、上記安定分配相当額に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。 「原則として剰余金等収益等を中心に安定分配を行う」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留意ください。	

<円コース>
<豪ドルコース>
<ブラジルリアルコース>
<中国元コース>

第100期 <決算日 2018年5月23日>
第101期 <決算日 2018年6月25日>
第102期 <決算日 2018年7月23日>
第103期 <決算日 2018年8月23日>
第104期 <決算日 2018年9月25日>
第105期 <決算日 2018年10月23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、「世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型)」は、2018年10月23日に第105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/>

世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜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 入金	騰落 中率		
第14作成期	76期(2016年5月23日)	円 8,437	円 40	% 0.0	% 97.8	百万円 1,118
	77期(2016年6月23日)	8,427	40	0.4	97.8	1,115
	78期(2016年7月25日)	8,474	40	1.0	97.8	1,112
	79期(2016年8月23日)	8,498	40	0.8	97.9	1,114
	80期(2016年9月23日)	8,437	40	△0.2	97.8	1,082
	81期(2016年10月24日)	8,378	40	△0.2	97.8	1,022
第15作成期	82期(2016年11月24日)	8,258	40	△1.0	98.0	1,002
	83期(2016年12月26日)	8,226	40	0.1	97.9	999
	84期(2017年1月23日)	8,182	40	△0.0	98.3	990
	85期(2017年2月23日)	8,185	40	0.5	97.8	982
	86期(2017年3月23日)	8,150	40	0.1	97.8	962
	87期(2017年4月24日)	8,153	40	0.5	97.7	962
第16作成期	88期(2017年5月23日)	8,175	40	0.8	97.7	950
	89期(2017年6月23日)	8,158	40	0.3	97.7	923
	90期(2017年7月24日)	8,112	40	△0.1	97.8	895
	91期(2017年8月23日)	8,099	40	0.3	97.8	894
	92期(2017年9月25日)	8,047	40	△0.1	97.5	813
	93期(2017年10月23日)	8,021	40	0.2	97.6	810
第17作成期	94期(2017年11月24日)	8,008	40	0.3	97.8	808
	95期(2017年12月25日)	7,950	40	△0.2	97.8	802
	96期(2018年1月23日)	7,923	40	0.2	97.9	798
	97期(2018年2月23日)	7,793	40	△1.1	97.7	784
	98期(2018年3月23日)	7,714	40	△0.5	97.9	774
	99期(2018年4月23日)	7,676	40	0.0	98.0	768
第18作成期	100期(2018年5月23日)	7,579	40	△0.7	97.8	758
	101期(2018年6月25日)	7,530	40	△0.1	97.7	749
	102期(2018年7月23日)	7,471	40	△0.3	97.6	743
	103期(2018年8月23日)	7,451	40	0.3	97.7	741
	104期(2018年9月25日)	7,394	40	△0.2	97.7	730
	105期(2018年10月23日)	7,318	40	△0.5	97.7	720

(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、ベンチマークおよ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)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

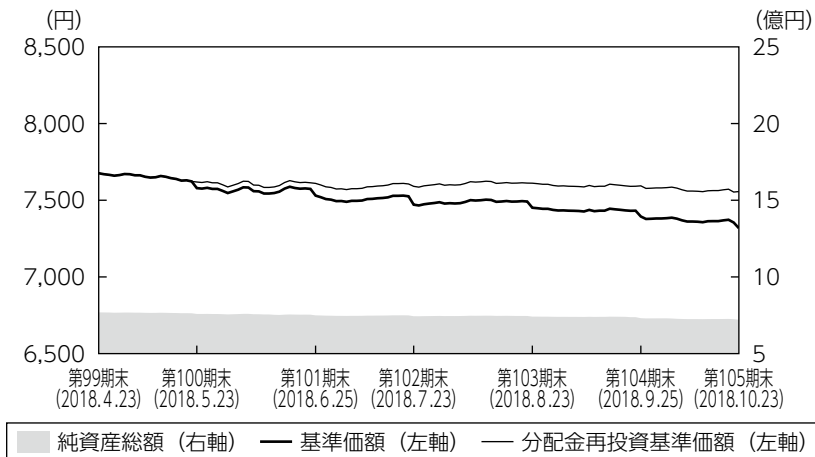
決算期	年	月	日	基準価額		投資信託受益証券 組入比率				
				騰	落率					
第100期	(期首)	2018	年	4	月	23	日	円	%	%
								7,676	-	98.0
				4	月	末			7,664	△0.2
第101期	(期末)	2018	年	5	月	23	日	7,619	△0.7	97.8
	(期首)	2018	年	5	月	23	日	7,579	-	97.8
				5	月	末			7,547	△0.4
第102期	(期末)	2018	年	6	月	25	日	7,570	△0.1	97.7
	(期首)	2018	年	6	月	25	日	7,530	-	97.7
				6	月	末			7,494	△0.5
第103期	(期末)	2018	年	7	月	23	日	7,511	△0.3	97.6
	(期首)	2018	年	7	月	23	日	7,471	-	97.6
				7	月	末			7,478	0.1
第104期	(期末)	2018	年	8	月	23	日	7,491	0.3	97.7
	(期首)	2018	年	8	月	23	日	7,451	-	97.7
				8	月	末			7,434	△0.2
第105期	(期末)	2018	年	9	月	25	日	7,434	△0.2	97.7
	(期首)	2018	年	9	月	25	日	7,394	-	97.7
				9	月	末			7,381	△0.2
	(期末)	2018	年	10	月	23	日	7,358	△0.5	97.7

(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100期～第105期の運用経過（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

基準価額等の推移



第100期首： 7,676円
 第105期末： 7,318円
 （既払分配金240円）
 騰落率： △1.6%
 （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

F R B（米連邦準備理事会）が年3回の利上げを実施し、今後も追加利上げの姿勢を維持していることを受け、米国の長期国債利回りが上昇（価格は下落）しました。一方、ハイブリッド証券は、イタリアの財政運営に対する不透明感、トルコリラの急落、欧州の銀行が保有するトルコ企業株や投資回収に対する懸念等を受けてリスク回避の動きが広がったことから、国債利回りととの格差を示す信用スプレッドは拡大し、基準価額は下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

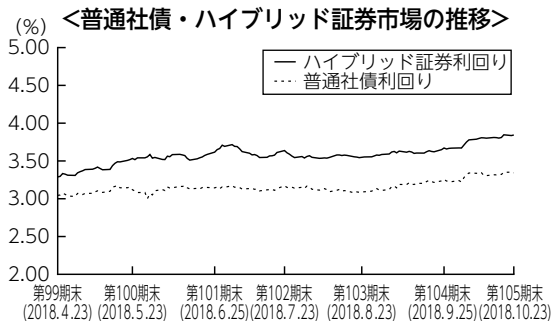
組入ファンド	騰落率
ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (J P Y)	△0.9%
D I A M マネー マザー ファンド	△0.0%

(注) ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (J P Y) 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

ハイブリッド証券市場は下落しました。好調な米国経済を背景に米国債利回りが短期ゾーンを中心に上昇（価格は下落）する一方で、ドイツ国債利回りは、2018年5月下旬のイタリア政情不安により大きく低下（価格は上昇）した後、作成期初を下回る水準で推移しました。イタリアの財政運営に対する不透明感、トルコリラの急落、欧州の銀行が保有するトルコ企業株や投資回収に対する懸念等を受けリスク回避の動きが広がったことから、信用スプレッドは拡大しました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは概ね $\Delta 0.33\% \sim \Delta 0.12\%$ 近辺で推移し、利回りは低下しました。7月31日の日銀金融政策決定会合において政策調整を行うとの観測記事によって国債市場のボラティリティ（価格の変動性）が高まりましたが、国内短期金融市場への影響は限定的でした。



※普通社債利回りはブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合：社債インデックスの利回り（*）、ハイブリッド証券利回りはブルームバーグ・パークレイズ・グローバル優先証券インデックスの利回り（*）です。

（*）利回りは、繰上償還利回りを表示しています。繰上償還利回りとは、債券の満期前に発行体により償還（コール）もしくは、買い戻され、繰上償還日に投資家が額面の支払いを受ける場合の利回りをいいます。繰上償還の実施は発行体の任意で行われるため、必ず繰上償還日に償還されるとは限りません。

※ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

ポートフォリオについて

●当ファンド

ダイアム フィナンシャル セキュリティーズ 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。

●ダイアム フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (J P Y)

世界の主要金融機関が発行するハイブリッド証券を中心にポートフォリオを構成しました。発行体の業績動向や信用力に加えて、ハイブリッド証券特有のリスクを評価し、分散投資を基本としました。国別配分においては、フランス、米国、英国のウェイトを高く維持しました。債券種別においては、期限付劣後債のみのポートフォリオとしました。

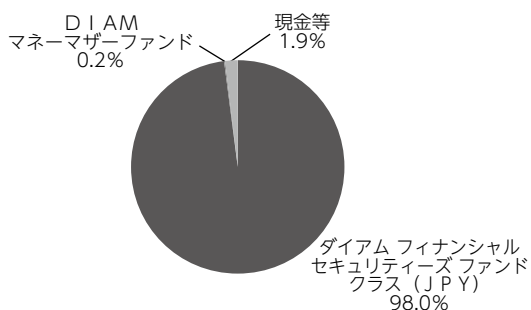
また、ユーロ、米ドルなど複数通貨 (以下、「原資産通貨」といいます。) を売り予約し、円を買い予約する為替取引を行いました。

●D I A Mマネーマザーファンド

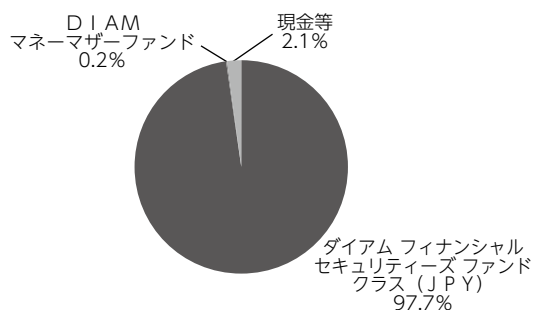
残存期間の短い政府保証債などで運用を行いました。

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100期	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期
	2018年4月24日 ~2018年5月23日	2018年5月24日 ~2018年6月25日	2018年6月26日 ~2018年7月23日	2018年7月24日 ~2018年8月23日	2018年8月24日 ~2018年9月25日	2018年9月26日 ~2018年10月23日
当期分配金（税引前）	40円	40円	40円	40円	40円	40円
対基準価額比率	0.53%	0.53%	0.53%	0.53%	0.54%	0.54%
当期の収益	40円	40円	40円	40円	40円	40円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	220円	221円	222円	223円	223円	225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、ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（JPY）を高位に組入れることを基本とした運用を行います。また、DIAMマネーマザーファンドへの投資も行います。

●ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（JPY）

主要先進国の国債利回りが低水準で推移する中、高い利回りを享受できるハイブリッド証券に対する投資家の需要は根強く、市場は堅調に推移すると思われます。引き続き、発行国、発行体、銘柄の分散を十分に図りながら、世界の主要金融機関に継続して投資します。銘柄選択においては、繰上償還延期リスク、利息・配当繰延リスクなど、ハイブリッド証券特有のリスクが債券価格に十分織り込まれた銘柄を厳選します。加えて、「原資産通貨」を売り予約し、円を買い予約する為替取引を行います。

●DIAMマネーマザーファンド

日銀の金融政策の物価目標2%までは依然として距離があるため、当面は政策の据え置きが予想されます。マイナス金利政策が継続されると考えられるため、政府保証債や地方債などを組入れて運用を行っていきます。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第100期～第105期 (2018年4月24日 ～2018年10月23日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	51円	
(投信会社)	(19)	(0.249)	
(販売会社)	(30)	(0.406)	
(受託銀行)	(2)	(0.021)	
(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 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
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	51	0.677	

(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。

(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。

■ 売買及び取引の状況 (2018年4月24日から2018年10月23日まで)

投資信託受益証券

		第 100 期 ～ 第 105 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦 建	ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス(JPY)	千口	千円	千口	千円
		—	—	1.7	12,548

(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（2018年4月24日から2018年10月23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（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

【世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜円コース＞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等はありません。

【D I A M マネー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 区 分	第 100 期 ~ 第 105 期			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A			
公 社 債	百万円 503	百万円 202	% 40.2	百万円 200	百万円 -	% -

平均保有割合 0.1%

(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、みずほ証券です。

■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 17 作 成 期 末	第 18 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
ダイヤモンドファイナンシャルセキュリティーズファンドクラス(JPY)	千□ 99.22331	千□ 97.52331	千円 704,313	% 97.7
合 計	99.22331	97.52331	704,313	97.7

(注) 比率は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第 17 作 成 期 末	第 18 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
D I A M マネーマザーファンド	千□ 1,281	千□ 1,281	千円 1,294

■投資信託財産の構成

2018年10月23日現在

項 目	第 18 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	704,313	97.1
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	1,294	0.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19,916	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	725,523	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

(2018年5月23日)、(2018年6月25日)、(2018年7月23日)、(2018年8月23日)、(2018年9月25日)、(2018年10月23日)現在

項 目	第 100 期 末	第 101 期 末	第 102 期 末	第 103 期 末	第 104 期 末	第 105 期 末
(A) 資 産	763,454,012円	754,419,797円	748,657,106円	746,106,375円	740,709,338円	725,523,887円
コール・ローン等	20,375,871	20,757,551	20,998,810	20,613,392	22,385,034	19,916,274
投資信託受益証券(評価額)	741,783,615	732,367,849	726,364,027	724,198,714	714,110,163	704,313,344
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	1,294,526	1,294,397	1,294,269	1,294,269	1,294,141	1,294,269
未 収 入 金	-	-	-	-	2,920,000	-
(B) 負 債	4,855,804	4,906,552	4,788,332	4,836,700	9,769,257	4,694,318
未払収益分配金	4,003,550	3,981,400	3,982,453	3,979,683	3,954,413	3,939,840
未 払 解 約 金	-	-	29,600	-	4,909,695	-
未払信託報酬	850,227	922,938	774,431	854,971	903,004	752,761
その他未払費用	2,027	2,214	1,848	2,046	2,145	1,717
(C) 純資産総額(A-B)	758,598,208	749,513,245	743,868,774	741,269,675	730,940,081	720,829,569
元 本	1,000,887,567	995,350,164	995,613,285	994,920,934	988,603,364	984,960,181
次期繰越損益金	△242,289,359	△245,836,919	△251,744,511	△253,651,259	△257,663,283	△264,130,612
(D) 受 益 権 総 口 数	1,000,887,567口	995,350,164口	995,613,285口	994,920,934口	988,603,364口	984,960,181口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,579円	7,530円	7,471円	7,451円	7,394円	7,318円

(注) 第99期末における元本額は1,001,593,847円、当作成期間(第100期~第105期)中における追加設定元本額は1,811,753円、同解約元本額は18,445,419円です。

■損益の状況

〔自 2018年4月24日 至 2018年5月23日〕〔自 2018年5月24日 至 2018年6月23日〕〔自 2018年6月24日 至 2018年7月23日〕〔自 2018年7月24日 至 2018年8月23日〕〔自 2018年8月24日 至 2018年9月23日〕〔自 2018年9月24日 至 2018年10月23日〕

項 目	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(A) 配 当 等 収 益	4,950,110円	4,934,806円	4,919,831円	4,915,713円	4,892,436円	4,875,145円
受 取 配 当 金	4,951,166	4,936,166	4,920,997	4,916,920	4,893,566	4,876,166
受 取 利 息	-	4	-	-	-	2
支 払 利 息	△1,056	△1,364	△1,166	△1,207	△1,130	△1,023
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△9,802,188	△4,916,284	△6,003,688	△2,160,814	△5,655,569	△7,597,725
売 買 益	990	16,539	168	2,273	39,402	3,073
売 買 損	△9,803,178	△4,932,823	△6,003,856	△2,163,087	△5,694,971	△7,600,798
(C) 信 託 報 酬 等	△852,254	△925,152	△776,279	△857,017	△905,149	△754,478
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	△5,704,332	△906,630	△1,860,136	1,897,882	△1,668,282	△3,477,058
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△173,003,587	△181,646,091	△186,526,734	△192,176,171	△192,964,813	△197,795,619
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△59,577,890	△59,302,798	△59,375,188	△59,393,287	△59,075,775	△58,918,095
(配 当 等 相 当 額)	(14,684,985)	(14,605,958)	(14,612,076)	(14,604,257)	(14,513,869)	(14,462,693)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△74,262,875)	(△73,908,756)	(△73,987,264)	(△73,997,544)	(△73,589,644)	(△73,380,788)
(G) 合 計 (D + E + F)	△238,285,809	△241,855,519	△247,762,058	△249,671,576	△253,708,870	△260,190,772
(H) 収 益 分 配 金	△4,003,550	△3,981,400	△3,982,453	△3,979,683	△3,954,413	△3,939,840
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△242,289,359	△245,836,919	△251,744,511	△253,651,259	△257,663,283	△264,130,612
追 加 信 託 差 損 益 金	△59,577,890	△59,302,798	△59,375,188	△59,393,287	△59,075,775	△58,918,095
(配 当 等 相 当 額)	(14,684,985)	(14,605,958)	(14,612,076)	(14,604,257)	(14,513,869)	(14,462,693)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△74,262,875)	(△73,908,756)	(△73,987,264)	(△73,997,544)	(△73,589,644)	(△73,380,788)
分 配 準 備 積 立 金	7,425,737	7,411,446	7,572,894	7,645,011	7,627,740	7,778,712
繰 越 損 益 金	△190,137,206	△193,945,567	△199,942,217	△201,902,983	△206,215,248	△212,991,229

(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 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,098,612円	4,010,408円	4,144,194円	4,059,404円	3,988,035円	4,121,228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	14,684,985	14,605,958	14,612,076	14,604,257	14,513,869	14,462,693
(d) 分 配 準 備 積 立 金	7,330,675	7,382,438	7,411,153	7,565,290	7,594,118	7,597,324
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	26,114,272	25,998,804	26,167,423	26,228,951	26,096,022	26,181,245
(f) 1万口当たり当期待配対象額	260.91	261.20	262.83	263.63	263.97	265.81
(g) 分 配 金	4,003,550	3,981,400	3,982,453	3,979,683	3,954,413	3,939,840
(h) 1万口当たり分配金	40	40	40	40	40	40

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
1 万口当たり分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40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。

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年7月24日)

世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜豪ドルコース＞

■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 入金	期騰落 中率		
第14作成期	76期(2016年5月23日)	円 8,236	円 70	% △7.1	% 96.7	百万円 204
	77期(2016年6月23日)	8,071	70	△1.2	96.5	200
	78期(2016年7月25日)	8,171	70	2.1	97.0	197
	79期(2016年8月23日)	7,914	70	△2.3	97.5	189
	80期(2016年9月23日)	7,830	70	△0.2	97.3	172
	81期(2016年10月24日)	8,030	70	3.4	97.6	175
第15作成期	82期(2016年11月24日)	8,196	70	2.9	97.5	179
	83期(2016年12月26日)	8,450	70	4.0	97.7	199
	84期(2017年1月23日)	8,584	70	2.4	97.5	202
	85期(2017年2月23日)	8,620	70	1.2	98.1	197
	86期(2017年3月23日)	8,379	70	△2.0	97.8	192
	87期(2017年4月24日)	8,088	70	△2.6	97.5	185
第16作成期	88期(2017年5月23日)	8,183	70	2.0	97.5	187
	89期(2017年6月23日)	8,236	70	1.5	97.6	189
	90期(2017年7月24日)	8,564	70	4.8	97.8	196
	91期(2017年8月23日)	8,403	70	△1.1	97.6	193
	92期(2017年9月25日)	8,591	70	3.1	97.5	198
	93期(2017年10月23日)	8,489	70	△0.4	96.8	174
第17作成期	94期(2017年11月24日)	8,094	70	△3.8	97.7	166
	95期(2017年12月25日)	8,259	70	2.9	97.6	169
	96期(2018年1月23日)	8,370	70	2.2	98.2	167
	97期(2018年2月23日)	7,764	70	△6.4	97.6	157
	98期(2018年3月23日)	7,443	70	△3.2	97.3	151
	99期(2018年4月23日)	7,489	70	1.6	97.3	151
第18作成期	100期(2018年5月23日)	7,528	70	1.5	97.9	151
	101期(2018年6月25日)	7,224	70	△3.1	97.7	145
	102期(2018年7月23日)	7,246	70	1.3	97.5	145
	103期(2018年8月23日)	7,080	70	△1.3	95.1	107
	104期(2018年9月25日)	7,069	70	0.8	94.9	107
	105期(2018年10月23日)	6,812	70	△2.6	94.5	103

(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、ベンチマークおよ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

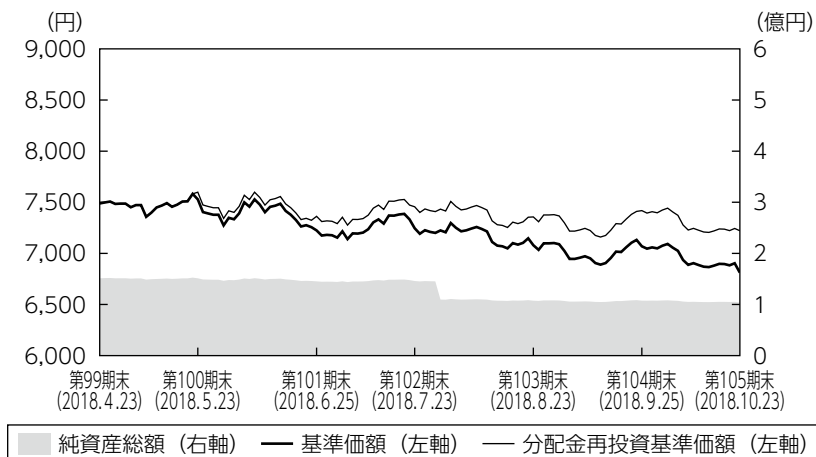
決算期	年	月	日	基準価額		投資信託受益証券 組入比率	
				円	騰落率		
第100期	(期首)	2018	4	23	円	%	%
					7,489	-	97.3
			4	月末		7,487	△0.0
	(期末)	2018	5	23			
					7,598	1.5	97.9
第101期	(期首)	2018	5	23			
					7,528	-	97.9
			5	月末		7,348	△2.4
	(期末)	2018	6	25			
					7,294	△3.1	97.7
第102期	(期首)	2018	6	25			
					7,224	-	97.7
			6	月末		7,154	△1.0
	(期末)	2018	7	23			
					7,316	1.3	97.5
第103期	(期首)	2018	7	23			
					7,246	-	97.5
			7	月末		7,206	△0.6
	(期末)	2018	8	23			
					7,150	△1.3	95.1
第104期	(期首)	2018	8	23			
					7,080	-	95.1
			8	月末		7,024	△0.8
	(期末)	2018	9	25			
					7,139	0.8	94.9
第105期	(期首)	2018	9	25			
					7,069	-	94.9
			9	月末		7,049	△0.3
	(期末)	2018	10	23			
					6,882	△2.6	94.5

(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100期～第105期の運用経過（2018年4月24日から2018年10月23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

ハイブリッド証券利回りと国債利回りの格差を示す信用スプレッドが拡大するとともに、米国の金利上昇を背景にハイブリッド証券価格が下落したことがマイナス要因となりました。加えて、豪ドルが投資家のリスク回避の動きを背景に対円で下落したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆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
ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (AUD)	△3.2%
D I A Mマネーマザーファンド	△0.0%

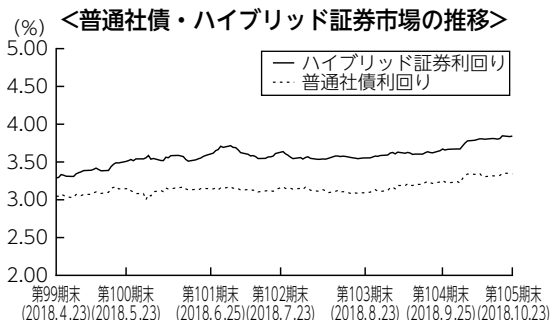
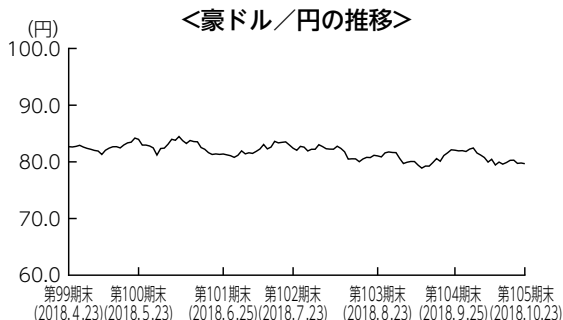
（注）ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (AUD) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

投資環境

ハイブリッド証券市場は下落しました。好調な米国経済を背景に米国債利回りが短期ゾーンを中心に上昇（価格は下落）する一方で、ドイツ国債利回りは、2018年5月下旬のイタリア政情不安により大きく低下（価格は上昇）した後、作成期初を下回る水準で推移しました。イタリアの財政運営に対する不透明感、トルコリラの急落、欧州の銀行が保有するトルコ企業株や投資回収に対する懸念等を受けリスク回避の動きが広がったことから、信用スプレッドは拡大しました。

豪ドル／円相場は円高豪ドル安となりました。当作成期は、オーストラリア経済が緩やかな回復基調を示し、失業率も低位で推移しました。しかしながら、労働賃金が伸び悩んだこと等からRBA（オーストラリア準備銀行）が政策金利を1.50%に維持し、漸進的な利上げを続ける米国との金利差は拡大しました。また、米中貿易摩擦によるオーストラリア経済への影響が懸念されたことや家計債務の増加による不透明要因等も、豪ドル安の要因となりました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは概ね $\Delta 0.33\% \sim \Delta 0.12\%$ 近辺で推移し、利回りは低下しました。7月31日の日銀金融政策決定会合において政策調整を行うとの観測記事によって国債市場のボラティリティ（価格の変動性）が高まりましたが、国内短期金融市場への影響は限定的でした。



※普通社債利回りはブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合：社債インデックスの利回り (*)、ハイブリッド証券利回りはブルームバーグ・パークレイズ・グローバル優先証券インデックスの利回り (*) です。

(*) 利回りは、繰上償還利回りを表示しています。繰上償還利回りとは、債券の満期前に発行体により償還（コール）もしくは、買い戻され、繰上償還日に投資家が額面の支払いを受ける場合の利回りをいいます。繰上償還の実施は発行体の任意で行われるため、必ず繰上償還日に償還されるとは限りません。

※ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

ポートフォリオについて

●当ファンド

ダイアム フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (AUD) 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。

●ダイアム フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (AUD)

世界の主要金融機関が発行するハイブリッド証券を中心にポートフォリオを構成しました。発行体の業績動向や信用力に加えて、ハイブリッド証券特有のリスクを評価し、分散投資を基本としました。国別配分においては、フランス、米国、英国のウェイトを高く維持しました。債券種別においては、期限付劣後債のみのポートフォリオとしました。

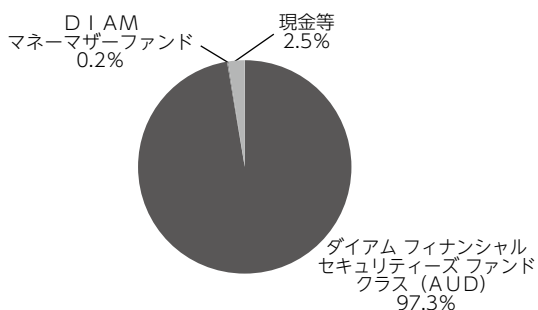
また、ユーロ、米ドルなど複数通貨（以下、「原資産通貨」といいます。）を売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行いました。

●D I A Mマネーマザーファンド

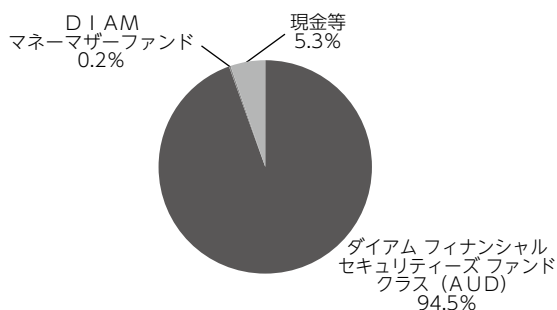
残存期間の短い政府保証債などで運用を行いました。

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100期	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期
	2018年4月24日 ~2018年5月23日	2018年5月24日 ~2018年6月25日	2018年6月26日 ~2018年7月23日	2018年7月24日 ~2018年8月23日	2018年8月24日 ~2018年9月25日	2018年9月26日 ~2018年10月23日
当期分配金（税引前）	70円	70円	70円	70円	70円	70円
対基準価額比率	0.92%	0.96%	0.96%	0.98%	0.98%	1.02%
当期の収益	70円	69円	70円	67円	67円	69円
当期の収益以外	-円	0円	-円	2円	2円	0円
翌期繰越分配対象額	2,304円	2,303円	2,306円	2,303円	2,301円	2,300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、ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（AUD）を高位に組入れることを基本とした運用を行います。また、D I AMマネーマザーファンドへの投資も行います。

●ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（AUD）

主要先進国の国債利回りが低水準で推移する中、高い利回りを享受できるハイブリッド証券に対する投資家の需要は根強く、市場は堅調に推移すると思われます。引き続き、発行国、発行体、銘柄の分散を十分に図りながら、世界の主要金融機関に継続して投資します。銘柄選択においては、繰上償還延期リスク、利息・配当繰延リスクなど、ハイブリッド証券特有のリスクが債券価格に十分織り込まれた銘柄を厳選します。加えて、「原資産通貨」を売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行います。

●D I AMマネーマザーファンド

日銀の金融政策の物価目標2%までは依然として距離があるため、当面は政策の据え置きが予想されます。マイナス金利政策が継続されると考えられるため、政府保証債や地方債などを組入れて運用を行っていきます。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第100期～第105期 (2018年4月24日 ～2018年10月23日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	49円	
(投信会社)	(18)	(0.249)	
(販売会社)	(29)	(0.406)	
(受託銀行)	(2)	(0.021)	
(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 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
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	49	0.677	

(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。

(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。

■ 売買及び取引の状況 (2018年4月24日から2018年10月23日まで)

投資信託受益証券

		第 100 期 ～ 第 105 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦 建	ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス(AUD)	千口	千円	千口	千円
		—	—	5.2	37,325

(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（2018年4月24日から2018年10月23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（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

【世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜豪ドルコース＞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等はありません。

【D I A M マネー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 100 期 ~ 第 105 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
公 社 債	百万円 503	百万円 202	% 40.2	百万円 200	百万円 -	% -

平均保有割合 0.0%

(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、みずほ証券です。

■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 17 作 成 期 末		第 18 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
ダイヤモンドファイナンシャルセキュリティーズファンドクラス(AUD)	千□ 19.73852	千□ 14.53852	千円 98,120	% 94.5
合 計	19.73852	14.53852	98,120	94.5

(注) 比率は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第 17 作 成 期 末		第 18 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□ 246	千□ 246	千円 249	千円 249

■投資信託財産の構成

2018年10月23日現在

項 目	第 18 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	98,120	93.4
D I A M マネーマザーファンド	249	0.2
コール・ローン等、その他	6,647	6.3
投資信託財産総額	105,017	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

(2018年5月23日)、(2018年6月25日)、(2018年7月23日)、(2018年8月23日)、(2018年9月25日)、(2018年10月23日)現在

項 目	第100期末	第101期末	第102期末	第103期末	第104期末	第105期末
(A) 資 産	153,080,104円	146,854,144円	147,519,887円	108,651,114円	108,732,845円	105,017,643円
コール・ローン等	4,831,442	4,724,448	4,955,968	6,239,744	6,452,346	6,647,982
投資信託受益証券(評価額)	147,999,422	141,880,481	142,314,729	102,162,180	102,031,333	98,120,471
D I A M マネーマザーファンド(評価額)	249,240	249,215	249,190	249,190	249,166	249,190
(B) 負 債	1,855,224	1,589,488	1,561,845	1,197,007	1,195,516	1,177,108
未払収益分配金	1,406,108	1,407,680	1,410,026	1,062,417	1,064,858	1,067,114
未払解約金	281,439	—	—	—	—	—
未払信託報酬	167,287	181,382	151,470	134,290	130,361	109,760
その他未払費用	390	426	349	300	297	234
(C) 純資産総額(A-B)	151,224,880	145,264,656	145,958,042	107,454,107	107,537,329	103,840,535
元 本	200,872,645	201,097,179	201,432,391	151,773,935	152,122,625	152,444,885
次期繰越損益金	△49,647,765	△55,832,523	△55,474,349	△44,319,828	△44,585,296	△48,604,350
(D) 受益権総口数	200,872,645口	201,097,179口	201,432,391口	151,773,935口	152,122,625口	152,444,885口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,528円	7,224円	7,246円	7,080円	7,069円	6,812円

(注) 第99期末における元本額は201,937,542円、当作成期間(第100期～第105期)中における追加設定元本額は2,034,074円、同解約元本額は51,526,731円です。

■損益の状況

〔自 2018年4月24日 至 2018年5月23日〕〔自 2018年5月24日 至 2018年6月23日〕〔自 2018年6月24日 至 2018年7月23日〕〔自 2018年7月24日 至 2018年8月23日〕〔自 2018年8月24日 至 2018年9月23日〕〔自 2018年9月24日 至 2018年10月23日〕

項 目	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(A) 配 当 等 収 益	1,576,208円	1,578,815円	1,578,837円	1,162,585円	1,162,730円	1,162,751円
受 取 配 当 金	1,576,460	1,579,082	1,579,082	1,163,082	1,163,082	1,163,082
受 取 利 息	1	-	-	9	-	-
支 払 利 息	△253	△267	△245	△506	△352	△331
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	779,297	△6,118,467	434,223	△2,487,051	△130,871	△3,910,219
売 買 益	776,970	247	434,248	224,996	-	560
売 買 損	2,327	△6,118,714	△25	△2,712,047	△130,871	△3,910,779
(C) 信 託 報 酬 等	△167,677	△181,808	△151,819	△134,590	△130,658	△109,994
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	2,187,828	△4,721,460	1,861,241	△1,459,056	901,201	△2,857,462
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△44,598,463	△43,795,630	△49,924,770	△37,213,631	△39,735,104	△39,890,063
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△5,831,022	△5,907,753	△6,000,794	△4,584,724	△4,686,535	△4,789,711
(配 当 等 相 当 額)	(18,416,289)	(18,481,469)	(18,558,703)	(14,019,133)	(14,099,476)	(14,178,221)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△24,247,311)	(△24,389,222)	(△24,559,497)	(△18,603,857)	(△18,786,011)	(△18,967,932)
(G) 合 計 (D+E+F)	△48,241,657	△54,424,843	△54,064,323	△43,257,411	△43,520,438	△47,537,236
(H) 収 益 分 配 金	△1,406,108	△1,407,680	△1,410,026	△1,062,417	△1,064,858	△1,067,114
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△49,647,765	△55,832,523	△55,474,349	△44,319,828	△44,585,296	△48,604,350
追 加 信 託 差 損 益 金	△5,831,022	△5,907,753	△6,000,794	△4,584,724	△4,686,535	△4,789,711
(配 当 等 相 当 額)	(18,416,289)	(18,481,469)	(18,558,703)	(14,019,133)	(14,099,476)	(14,178,221)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△24,247,311)	(△24,389,222)	(△24,559,497)	(△18,603,857)	(△18,786,011)	(△18,967,932)
分 配 準 備 積 立 金	27,868,098	27,844,138	27,893,984	20,947,353	20,914,708	20,895,896
繰 越 損 益 金	△71,684,841	△77,768,908	△77,367,539	△60,682,457	△60,813,469	△64,710,535

(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 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,464,141円	1,397,148円	1,459,872円	1,028,128円	1,032,213円	1,052,861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	18,416,289	18,481,469	18,558,703	14,019,133	14,099,476	14,178,221
(d) 分 配 準 備 積 立 金	27,810,065	27,854,670	27,844,138	20,981,642	20,947,353	20,910,149
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	47,690,495	47,733,287	47,862,713	36,028,903	36,079,042	36,141,231
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,374.17	2,373.64	2,376.12	2,373.85	2,371.71	2,370.77
(g) 分 配 金	1,406,108	1,407,680	1,410,026	1,062,417	1,064,858	1,067,114
(h) 1万口当たり分配金	70	70	70	70	70	70

■分配金のお知らせ

決算期	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
1 万口当たり分配金	70円	70円	70円	70円	70円	70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。

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年7月24日)

世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜ブラジルリアルコース＞

■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 入金	期騰落 中率		
第14作成期	76期(2016年5月23日)	円 4,861	円 50	% 1.3	% 97.7	百万円 1,168
	77期(2016年6月23日)	4,834	50	0.5	97.7	1,134
	78期(2016年7月25日)	5,074	50	6.0	97.9	1,172
	79期(2016年8月23日)	4,936	50	△1.7	97.6	1,137
	80期(2016年9月23日)	4,915	50	0.6	97.8	1,118
	81期(2016年10月24日)	5,192	50	6.7	97.8	1,160
第15作成期	82期(2016年11月24日)	5,157	50	0.3	98.0	1,128
	83期(2016年12月26日)	5,548	50	8.6	98.1	1,189
	84期(2017年1月23日)	5,644	50	2.6	97.8	1,190
	85期(2017年2月23日)	5,819	50	4.0	98.2	1,221
	86期(2017年3月23日)	5,673	50	△1.6	98.0	1,185
	87期(2017年4月24日)	5,491	50	△2.3	97.7	1,118
第16作成期	88期(2017年5月23日)	5,381	50	△1.1	97.3	1,091
	89期(2017年6月23日)	5,346	50	0.3	97.8	1,071
	90期(2017年7月24日)	5,677	50	7.1	97.9	1,129
	91期(2017年8月23日)	5,550	50	△1.4	98.2	1,085
	92期(2017年9月25日)	5,694	50	3.5	98.0	1,102
	93期(2017年10月23日)	5,638	50	△0.1	97.8	1,053
第17作成期	94期(2017年11月24日)	5,473	50	△2.0	97.7	1,021
	95期(2017年12月25日)	5,375	50	△0.9	97.7	988
	96期(2018年1月23日)	5,446	50	2.3	97.7	996
	97期(2018年2月23日)	5,083	50	△5.7	97.7	927
	98期(2018年3月23日)	4,905	50	△2.5	97.6	893
	99期(2018年4月23日)	4,805	50	△1.0	97.4	874
第18作成期	100期(2018年5月23日)	4,583	50	△3.6	97.3	830
	101期(2018年6月25日)	4,353	50	△3.9	97.3	785
	102期(2018年7月23日)	4,361	50	1.3	97.7	780
	103期(2018年8月23日)	3,995	50	△7.2	97.6	690
	104期(2018年9月25日)	4,051	50	2.7	97.8	691
	105期(2018年10月23日)	4,411	50	10.1	97.7	742

(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、ベンチマークおよ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

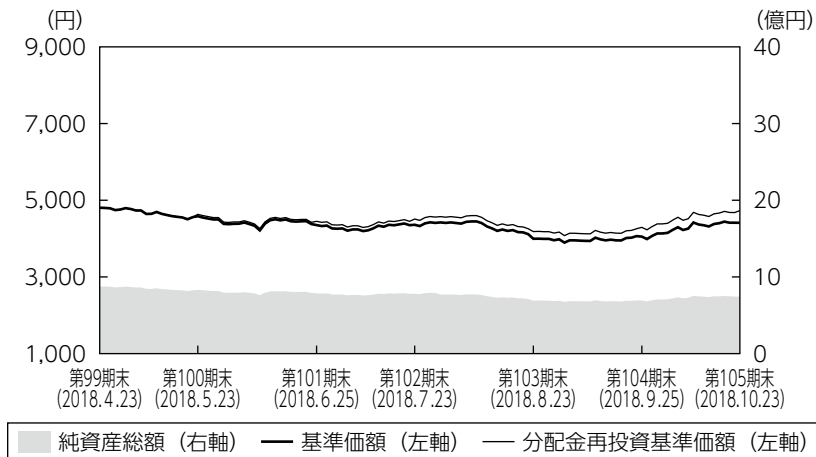
決算期	年 月 日	基準 価 額		投資信託受益証券 組 入 比 率
		騰 落 率	率	
第100期	(期首) 2018年4月23日	円 4,805	% -	% 97.4
	4月 末	4,758	△1.0	97.2
	(期末) 2018年5月23日	4,633	△3.6	97.3
第101期	(期首) 2018年5月23日	4,583	-	97.3
	5月 末	4,375	△4.5	97.2
	(期末) 2018年6月25日	4,403	△3.9	97.3
第102期	(期首) 2018年6月25日	4,353	-	97.3
	6月 末	4,257	△2.2	97.1
	(期末) 2018年7月23日	4,411	1.3	97.7
第103期	(期首) 2018年7月23日	4,361	-	97.7
	7月 末	4,408	1.1	97.6
	(期末) 2018年8月23日	4,045	△7.2	97.6
第104期	(期首) 2018年8月23日	3,995	-	97.6
	8月 末	3,894	△2.5	97.4
	(期末) 2018年9月25日	4,101	2.7	97.8
第105期	(期首) 2018年9月25日	4,051	-	97.8
	9月 末	4,135	2.1	97.6
	(期末) 2018年10月23日	4,461	10.1	97.7

(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100期～第105期の運用経過（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

基準価額等の推移



第100期首： 4,805円
 第105期末： 4,411円
 （既払分配金300円）
 騰落率： △1.6%
 （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

為替取引によるプレミアム収入がプラス要因となったものの、ハイブリッド証券利回りと国債利回りの格差を示す信用スプレッドの拡大や、米国の金利上昇を背景としたハイブリッド証券価格の下落、ブラジルレアルが国内政治の不透明感や投資家のリスク回避の動きを背景に対円で下落したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆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
ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (BRL)	△1.0%
DIAMマネーマザーファンド	△0.0%

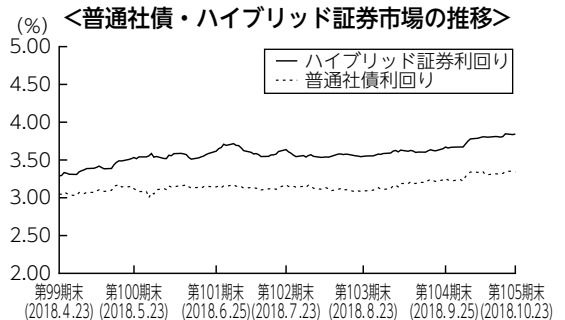
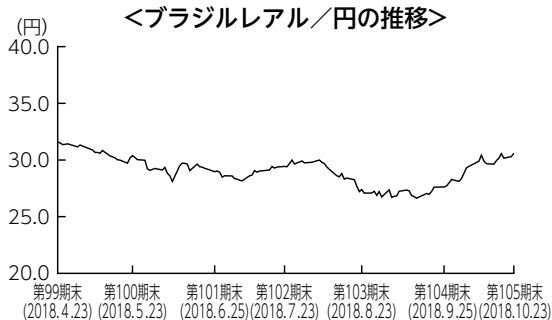
（注）ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (BRL) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

投資環境

ハイブリッド証券市場は下落しました。好調な米国経済を背景に米国債利回りが短期ゾーンを中心に上昇（価格は下落）する一方で、ドイツ国債利回りは、2018年5月下旬のイタリア政情不安により大きく低下（価格は上昇）した後、作成期初を下回る水準で推移しました。イタリアの財政運営に対する不透明感、トルコリラの急落、欧州の銀行が保有するトルコ企業株や投資回収に対する懸念等を受けリスク回避の動きが広がったことから、信用スプレッドは拡大しました。

ブラジルレアル／円相場は円高レアル安となりました。当作成期は、2018年10月に予定されていた大統領選挙や年金改革を含む財政構造改革の停滞など国内の政治的な不透明感、アルゼンチンやトルコに端を発する新興国通貨の急落、米国の保護主義的な政策への懸念等がレアル安の要因となりました。9月中旬以降、レアルは上昇に転じましたが、作成期初の水準まで回復するには至りませんでした。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは概ね $\Delta 0.33\% \sim \Delta 0.12\%$ 近辺で推移し、利回りは低下しました。7月31日の日銀金融政策決定会合において政策調整を行うとの観測記事によって国債市場のボラティリティ（価格の変動性）が高まりましたが、国内短期金融市場への影響は限定的でした。



※普通社債利回りはブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合：社債インデックスの利回り (*)、ハイブリッド証券利回りはブルームバーグ・バークレイズ・グローバル優先証券インデックスの利回り (*) です。

(*) 利回りは、繰上償還利回りを表示しています。繰上償還利回りとは、債券の満期前に発行体により償還（コール）もしくは、買い戻され、繰上償還日に投資家が額面の支払いを受ける場合の利回りをいいます。繰上償還の実施は発行体の任意で行われるため、必ず繰上償還日に償還されるとは限りません。

※ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

ポートフォリオについて

●当ファンド

ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (B R L) 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。

●ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (B R L)

世界の主要金融機関が発行するハイブリッド証券を中心にポートフォリオを構成しました。発行体の業績動向や信用力に加えて、ハイブリッド証券特有のリスクを評価し、分散投資を基本としました。国別配分においては、フランス、米国、英国のウェイトを高く維持しました。債券種別においては、期限付劣後債のみのポートフォリオとしました。

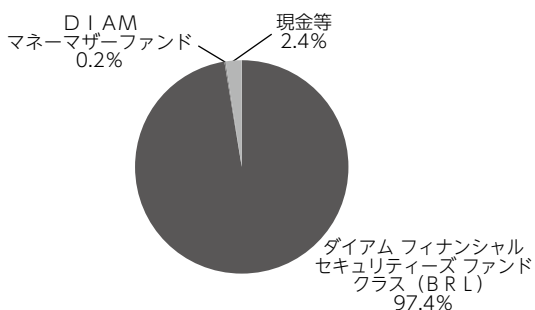
また、ユーロ、米ドルなど複数通貨（以下、「原資産通貨」といいます。）を売り予約し、ブラジルレアルを買い予約する為替取引を行いました。

●D I A Mマネーマザーファンド

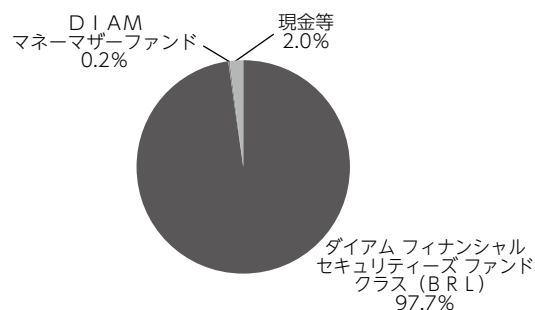
残存期間の短い政府保証債などで運用を行いました。

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100期	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期
	2018年4月24日 ~2018年5月23日	2018年5月24日 ~2018年6月25日	2018年6月26日 ~2018年7月23日	2018年7月24日 ~2018年8月23日	2018年8月24日 ~2018年9月25日	2018年9月26日 ~2018年10月23日
当期分配金（税引前）	50円	50円	50円	50円	50円	50円
対基準価額比率	1.08%	1.14%	1.13%	1.24%	1.22%	1.12%
当期の収益	50円	50円	50円	50円	50円	50円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,256円	1,268円	1,282円	1,295円	1,311円	1,329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、ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（BRL）を高位に組入れることを基本とした運用を行います。また、DIAMマネーマザーファンドへの投資も行います。

●ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（BRL）

主要先進国の国債利回りが低水準で推移する中、高い利回りを享受できるハイブリッド証券に対する投資家の需要は根強く、市場は堅調に推移すると思われます。引き続き、発行国、発行体、銘柄の分散を十分に図りながら、世界の主要金融機関に継続して投資します。銘柄選択においては、繰上償還延期リスク、利息・配当繰延リスクなど、ハイブリッド証券特有のリスクが債券価格に十分織り込まれた銘柄を厳選します。加えて、「原資産通貨」を売り予約し、ブラジルリアルを買い予約する為替取引を行います。

●DIAMマネーマザーファンド

日銀の金融政策の物価目標2%までは依然として距離があるため、当面は政策の据え置きが予想されます。マイナス金利政策が継続されると考えられるため、政府保証債や地方債などを組入れて運用を行っていきます。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第100期～第105期 (2018年4月24日 ～2018年10月23日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	29円	
(投信会社)	(11)	(0.248)	
(販売会社)	(18)	(0.405)	
(受託銀行)	(1)	(0.021)	
(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 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
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	29	0.676	

(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。

(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。

■ 売買及び取引の状況（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

投資信託受益証券

		第 100 期 ～ 第 105 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦 建	ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス(BRL)	千□ —	千円 —	千□ 10.4	千円 38,511

(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（2018年4月24日から2018年10月23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（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

【世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜ブラジルリアルコース＞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等はありません。

【D I A M マネー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 区 分	第 100 期 ~ 第 105 期			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A			
公 社 債	百万円 503	百万円 202	% 40.2	百万円 200	百万円 -	% -

平均保有割合 0.2%

(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、みずほ証券です。

■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 17 作 成 期 末	第 18 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
ダイヤモンドファイナンシャルセキュリティーズファンドクラス(BRL)	千□ 204.42089	千□ 194.02089	千円 725,444	% 97.7
合 計	204.42089	194.02089	725,444	97.7

(注) 比率は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第 17 作 成 期 末	第 18 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
D I A M マネーマザーファンド	千□ 1,689	千□ 1,689	千円 1,705

■投資信託財産の構成

2018年10月23日現在

項 目	第 18 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 725,444	% 96.0
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	1,705	0.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	28,890	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	756,040	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

(2018年5月23日)、(2018年6月25日)、(2018年7月23日)、(2018年8月23日)、(2018年9月25日)、(2018年10月23日)現在

項 目	第 100 期 末	第 101 期 末	第 102 期 末	第 103 期 末	第 104 期 末	第 105 期 末
(A) 資 産	840,784,912円	797,578,520円	794,023,992円	701,292,918円	704,569,657円	756,040,647円
コール・ローン等	30,389,565	31,133,833	28,601,578	26,062,161	26,340,717	28,890,571
投資信託受益証券(評価額)	808,689,040	764,738,549	762,595,645	673,524,788	676,523,140	725,444,107
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	1,706,307	1,706,138	1,705,969	1,705,969	1,705,800	1,705,969
未 収 入 金	-	-	1,120,800	-	-	-
(B) 負 債	10,013,575	11,713,814	13,215,022	10,963,488	13,028,404	13,897,338
未払収益分配金	9,064,538	9,027,447	8,951,575	8,640,085	8,535,546	8,412,671
未払解約金	-	1,705,620	3,458,928	1,452,500	3,654,148	4,729,607
未払信託報酬	946,780	978,398	802,608	868,834	836,719	753,349
その他未払費用	2,257	2,349	1,911	2,069	1,991	1,711
(C) 純資産総額(A-B)	830,771,337	785,864,706	780,808,970	690,329,430	691,541,253	742,143,309
元 本	1,812,907,721	1,805,489,460	1,790,315,162	1,728,017,100	1,707,109,377	1,682,534,376
次期繰越損益金	△982,136,384	△1,019,624,754	△1,009,506,192	△1,037,687,670	△1,015,568,124	△940,391,067
(D) 受 益 権 総 口 数	1,812,907,721口	1,805,489,460口	1,790,315,162口	1,728,017,100口	1,707,109,377口	1,682,534,376口
1万口当たり基準価額(C/D)	4,583円	4,353円	4,361円	3,995円	4,051円	4,411円

(注) 第99期末における元本額は1,819,431,883円、当作成期間(第100期～第105期)中における追加設定元本額は31,766,413円、同解約元本額は168,663,920円です。

■損益の状況

〔自 2018年4月24日 至 2018年5月23日〕〔自 2018年5月24日 至 2018年6月23日〕〔自 2018年6月24日 至 2018年7月23日〕〔自 2018年7月24日 至 2018年8月23日〕〔自 2018年8月24日 至 2018年9月23日〕〔自 2018年9月24日 至 2018年10月23日〕

項 目	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(A) 配 当 等 収 益	12,257,543円	12,238,893円	12,174,750円	11,835,232円	11,772,681円	11,590,631円
受 取 配 当 金	12,259,107	12,240,690	12,176,287	11,836,678	11,773,887	11,591,770
受 取 利 息	3	2	1	9	3	-
支 払 利 息	△1,567	△1,799	△1,538	△1,455	△1,209	△1,139
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△42,558,428	△43,736,553	△869,667	△65,634,446	7,178,562	58,071,144
売 買 益	149,169	197,699	126,541	499,598	7,203,970	58,776,058
売 買 損	△42,707,597	△43,934,252	△996,208	△66,134,044	△25,408	△704,914
(C) 信 託 報 酬 等	△949,037	△980,747	△804,519	△870,903	△838,710	△755,060
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	△31,249,922	△32,478,407	10,500,564	△54,670,117	18,112,533	68,906,715
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△755,192,012	△790,369,980	△822,821,538	△790,618,614	△840,006,952	△815,196,447
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△186,629,912	△187,748,920	△188,233,643	△183,758,854	△185,138,159	△185,688,664
(配 当 等 相 当 額)	(62,872,513)	(63,005,685)	(62,888,230)	(61,121,243)	(61,066,648)	(60,831,467)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△249,502,425)	(△250,754,605)	(△251,121,873)	(△244,880,097)	(△246,204,807)	(△246,520,131)
(G) 合 計 (D+E+F)	△973,071,846	△1,010,597,307	△1,000,554,617	△1,029,047,585	△1,007,032,578	△931,978,396
(H) 収 益 分 配 金	△9,064,538	△9,027,447	△8,951,575	△8,640,085	△8,535,546	△8,412,671
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△982,136,384	△1,019,624,754	△1,009,506,192	△1,037,687,670	△1,015,568,124	△940,391,067
追 加 信 託 差 損 益 金	△186,629,912	△187,748,920	△188,233,643	△183,758,854	△185,138,159	△185,688,664
(配 当 等 相 当 額)	(62,872,513)	(63,005,685)	(62,888,230)	(61,121,243)	(61,066,648)	(60,831,467)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△249,502,425)	(△250,754,605)	(△251,121,873)	(△244,880,097)	(△246,204,807)	(△246,520,131)
分 配 準 備 積 立 金	164,918,442	166,085,279	166,697,078	162,800,298	162,863,146	162,928,615
繰 越 損 益 金	△960,424,914	△997,961,113	△987,969,627	△1,016,729,114	△993,293,111	△917,631,018

(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 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(a) 経費控除後の配当等収益	11,309,500円	11,259,145円	11,371,075円	10,965,261円	11,252,577円	11,465,723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	62,872,513	63,005,685	62,888,230	61,121,243	61,066,648	60,831,467
(d) 分 配 準 備 積 立 金	162,673,480	163,853,581	164,277,578	160,475,122	160,146,115	159,875,563
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	236,855,493	238,118,411	238,536,883	232,561,626	232,465,340	232,172,753
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,306.50	1,318.86	1,332.37	1,345.83	1,361.75	1,379.90
(g) 分 配 金	9,064,538	9,027,447	8,951,575	8,640,085	8,535,546	8,412,671
(h) 1万口当たり分配金	50	50	50	50	50	50

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
1 万口当たり分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50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。

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年7月24日)

世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）〈中国元コース〉

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託証券組入比率	純資産総額
		(分配落)	税込み	騰落率		
		円	円	%	%	百万円
第14作成期	76期(2016年5月23日)	11,020	55	△1.3	97.9	465
	77期(2016年6月23日)	10,390	55	△5.2	97.8	433
	78期(2016年7月25日)	10,458	55	1.2	97.6	422
	79期(2016年8月23日)	9,972	55	△4.1	97.8	392
	80期(2016年9月23日)	9,918	55	0.0	97.6	389
	81期(2016年10月24日)	10,080	55	2.2	97.7	386
第15作成期	82期(2016年11月24日)	10,431	55	4.0	98.0	388
	83期(2016年12月26日)	10,989	55	5.9	97.3	394
	84期(2017年1月23日)	10,888	55	△0.4	98.1	387
	85期(2017年2月23日)	10,801	55	△0.3	97.8	380
	86期(2017年3月23日)	10,560	55	△1.7	97.4	367
	87期(2017年4月24日)	10,412	55	△0.9	97.6	359
第16作成期	88期(2017年5月23日)	10,700	55	3.3	98.2	364
	89期(2017年6月23日)	10,802	55	1.5	97.6	368
	90期(2017年7月24日)	10,884	55	1.3	97.7	360
	91期(2017年8月23日)	10,882	55	0.5	97.6	358
	92期(2017年9月25日)	11,215	55	3.6	98.2	358
	93期(2017年10月23日)	11,276	55	1.0	97.9	354
第17作成期	94期(2017年11月24日)	11,142	55	△0.7	98.2	347
	95期(2017年12月25日)	11,345	55	2.3	98.2	350
	96期(2018年1月23日)	11,410	55	1.1	97.6	339
	97期(2018年2月23日)	10,965	55	△3.4	97.5	307
	98期(2018年3月23日)	10,762	55	△1.3	97.7	301
	99期(2018年4月23日)	11,019	55	2.9	97.4	306
第18作成期	100期(2018年5月23日)	11,136	55	1.6	97.5	300
	101期(2018年6月25日)	10,777	55	△2.7	97.6	285
	102期(2018年7月23日)	10,504	55	△2.0	97.5	276
	103期(2018年8月23日)	10,294	55	△1.5	97.5	270
	104期(2018年9月25日)	10,427	55	1.8	97.5	274
	105期(2018年10月23日)	10,261	55	△1.1	97.7	269

(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、ベンチマークおよ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)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

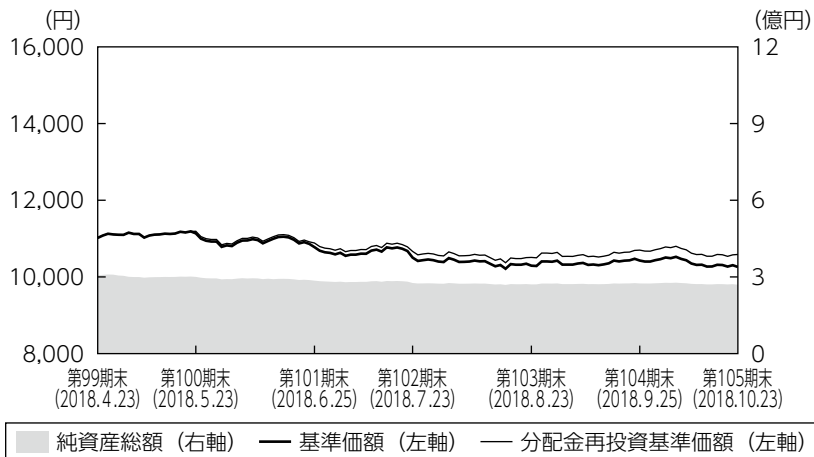
決算期	年 月 日	基準 価 額		投資信託受益証券 組 入 比 率
		円	騰 落 率	
第100期	(期 首) 2018 年 4 月 23 日	11,019	% -	% 97.4
	4 月 末	11,101	0.7	97.6
	(期 末) 2018 年 5 月 23 日	11,191	1.6	97.5
第101期	(期 首) 2018 年 5 月 23 日	11,136	-	97.5
	5 月 末	10,822	△2.8	97.5
	(期 末) 2018 年 6 月 25 日	10,832	△2.7	97.6
第102期	(期 首) 2018 年 6 月 25 日	10,777	-	97.6
	6 月 末	10,590	△1.7	97.6
	(期 末) 2018 年 7 月 23 日	10,559	△2.0	97.5
第103期	(期 首) 2018 年 7 月 23 日	10,504	-	97.5
	7 月 末	10,389	△1.1	97.5
	(期 末) 2018 年 8 月 23 日	10,349	△1.5	97.5
第104期	(期 首) 2018 年 8 月 23 日	10,294	-	97.5
	8 月 末	10,321	0.3	97.4
	(期 末) 2018 年 9 月 25 日	10,482	1.8	97.5
第105期	(期 首) 2018 年 9 月 25 日	10,427	-	97.5
	9 月 末	10,436	0.1	97.3
	(期 末) 2018 年 10 月 23 日	10,316	△1.1	97.7

(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100期～第105期の運用経過（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

基準価額等の推移



第100期首：11,019円
 第105期末：10,261円
 (既払分配金330円)
 騰落率：△3.9%
 (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

ハイブリッド証券利回りと国債利回りの格差を示す信用スプレッドが拡大するとともに、米国の金利上昇を背景にハイブリッド証券価格が下落したことに加えて、中国元が米中の貿易摩擦悪化に対する投資家のリスク回避の動きなどを背景に対円で下落したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆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
ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (CNY)	△3.4%
D I A M マネー マザー ファンド	△0.0%

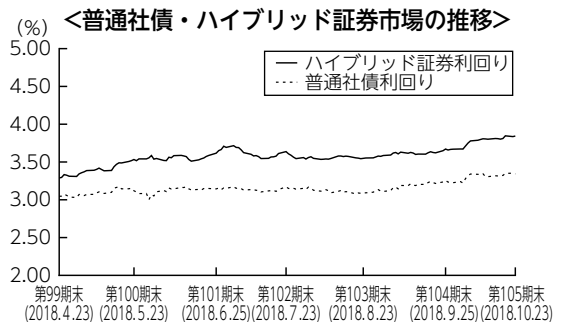
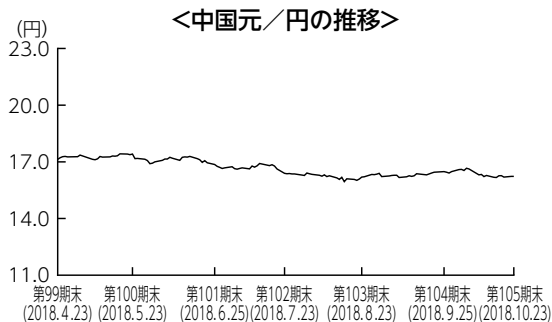
(注) ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (CNY) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

投資環境

ハイブリッド証券市場は下落しました。好調な米国経済を背景に米国債利回りが短期ゾーンを中心に上昇（価格は下落）する一方で、ドイツ国債利回りは、2018年5月下旬のイタリア政情不安により大きく低下（価格は上昇）した後、作成期初を下回る水準で推移しました。イタリアの財政運営に対する不透明感、トルコリラの急落、欧州の銀行が保有するトルコ企業株や投資回収に対する懸念等を受けリスク回避の動きが広がったことから、信用スプレッドは拡大しました。

中国元／円相場は円高中国元安となりました。当作成期は、中国経済に減速の兆しが現れたことや米中の貿易摩擦問題に対する懸念の高まり等が中国元安の要因となりました。PBOC（中国人民銀行）が緩和的な金融政策を実施したことにより、投資家の中国経済減速への懸念はやや後退しましたが、中国元が上昇に転じるには至りませんでした。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは概ね $\Delta 0.33\% \sim \Delta 0.12\%$ 近辺で推移し、利回りは低下しました。7月31日の日銀金融政策決定会合において政策調整を行うとの観測記事によって国債市場のボラティリティ（価格の変動性）が高まりましたが、国内短期金融市場への影響は限定的でした。



※普通社債利回りはブルームバーグ・パークレイズ・グローバル総合：社債インデックスの利回り (*)、ハイブリッド証券利回りはブルームバーグ・パークレイズ・グローバル優先証券インデックスの利回り (*) です。

(*) 利回りは、繰上償還利回りを表示しています。繰上償還利回りとは、債券の満期前に発行体により償還（コール）もしくは、買い戻され、繰上償還日に投資家が額面の支払いを受ける場合の利回りをいいます。繰上償還の実施は発行体の任意で行われるため、必ず繰上償還日に償還されるとは限りません。

※ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

ポートフォリオについて

●当ファンド

ダイアム フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (CNY) 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。

●ダイアム フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス (CNY)

世界の主要金融機関が発行するハイブリッド証券を中心にポートフォリオを構成しました。発行体の業績動向や信用力に加えて、ハイブリッド証券特有のリスクを評価し、分散投資を基本としました。国別配分においては、フランス、米国、英国のウェイトを高く維持しました。債券種別においては、期限付劣後債のみのポートフォリオとしました。

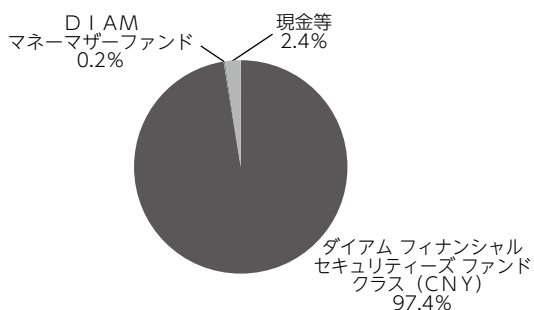
また、ユーロ、米ドルなど複数通貨 (以下、「原資産通貨」といいます。) を売り予約し、中国元を買い予約する為替取引を行いました。

●D I A Mマネーマザーファンド

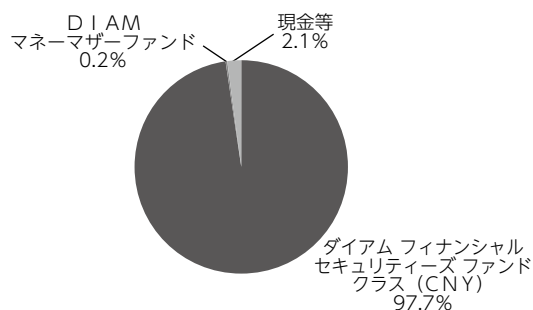
残存期間の短い政府保証債などで運用を行いました。

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100期	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期
	2018年4月24日 ~2018年5月23日	2018年5月24日 ~2018年6月25日	2018年6月26日 ~2018年7月23日	2018年7月24日 ~2018年8月23日	2018年8月24日 ~2018年9月25日	2018年9月26日 ~2018年10月23日
当期分配金（税引前）	55円	55円	55円	55円	55円	55円
対基準価額比率	0.49%	0.51%	0.52%	0.53%	0.52%	0.53%
当期の収益	55円	49円	52円	51円	55円	52円
当期の収益以外	-円	5円	2円	3円	-円	2円
翌期繰越分配対象額	3,160円	3,155円	3,153円	3,149円	3,153円	3,151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、ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（CNY）を高位に組入れることを基本とした運用を行います。また、D I AMマネーマザーファンドへの投資も行います。

●ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス（CNY）

主要先進国の国債利回りが低水準で推移する中、高い利回りを享受できるハイブリッド証券に対する投資家の需要は根強く、市場は堅調に推移すると思われます。引き続き、発行国、発行体、銘柄の分散を十分に図りながら、世界の主要金融機関に継続して投資します。銘柄選択においては、繰上償還延期リスク、利息・配当繰延リスクなど、ハイブリッド証券特有のリスクが債券価格に十分織り込まれた銘柄を厳選します。加えて、「原資産通貨」を売り予約し、中国元を買い予約する為替取引を行います。

●D I AMマネーマザーファンド

日銀の金融政策の物価目標2%までは依然として距離があるため、当面は政策の据え置きが予想されます。マイナス金利政策が継続されると考えられるため、政府保証債や地方債などを組入れて運用を行っていきます。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第100期～第105期 (2018年4月24日 ～2018年10月23日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	72円	
(投信会社)	(26)	(0.249)	
(販売会社)	(43)	(0.406)	
(受託銀行)	(2)	(0.021)	
(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 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
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	72	0.677	

(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。

(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。

■ 売買及び取引の状況（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

投資信託受益証券

		第 100 期 ～ 第 105 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦 建	ダイヤモンド ファイナンシャル セキュリティーズ ファンド クラス(CNY)	千口	千円	千口	千円
		—	—	1.4	15,431

(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（2018年4月24日から2018年10月23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（2018年4月24日から2018年10月23日まで）

【世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜中国元コース＞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等はありません。

【D I A M マネー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 100 期 ~ 第 105 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
公 社 債	百万円 503	百万円 202	% 40.2	百万円 200	百万円 -	% -

平均保有割合 0.1%

(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、みずほ証券です。

■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 17 作 成 期 末		第 18 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
ダイヤモンドファイナンシャルセキュリティーズファンドクラス(CNY)	千□ 27.03482	千□ 25.63482	千円 263,295	% 97.7
合 計	27.03482	25.63482	263,295	97.7

(注) 比率は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第 17 作 成 期 末		第 18 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□ 654	千□ 654	千円 661	

■投資信託財産の構成

2018年10月23日現在

項 目	第 18 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	263,295	96.7
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	661	0.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,259	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	272,216	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

(2018年5月23日)、(2018年6月25日)、(2018年7月23日)、(2018年8月23日)、(2018年9月25日)、(2018年10月23日)現在

項 目	第 100 期 末	第 101 期 末	第 102 期 末	第 103 期 末	第 104 期 末	第 105 期 末
(A) 資 産	301,983,273円	287,239,066円	278,787,702円	272,495,257円	276,300,976円	272,216,114円
コール・ローン等	8,751,134	7,897,501	7,653,448	7,846,585	8,037,860	8,259,582
投資信託受益証券(評価額)	292,570,712	278,680,203	269,421,958	263,987,376	267,601,885	263,295,236
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	661,427	661,362	661,296	661,296	661,231	661,296
未 収 入 金	—	—	1,051,000	—	—	—
(B) 負 債	1,819,422	1,814,569	2,531,736	1,760,719	1,782,216	2,592,497
未払収益分配金	1,482,478	1,456,705	1,446,552	1,446,563	1,448,090	1,445,246
未払解約金	1,115	—	792,418	—	—	863,100
未払信託報酬	335,040	357,018	292,082	313,413	333,334	283,516
その他未払費用	789	846	684	743	792	635
(C) 純資産総額(A-B)	300,163,851	285,424,497	276,255,966	270,734,538	274,518,760	269,623,617
元 本	269,541,602	264,855,599	263,009,601	263,011,479	263,289,139	262,772,173
次期繰越損益金	30,622,249	20,568,898	13,246,365	7,723,059	11,229,621	6,851,444
(D) 受 益 権 総 口 数	269,541,602口	264,855,599口	263,009,601口	263,011,479口	263,289,139口	262,772,173口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,136円	10,777円	10,504円	10,294円	10,427円	10,261円

(注) 第99期末における元本額は277,760,628円、当作成期間(第100期~第105期)中における追加設定元本額は2,624,763円、同解約元本額は17,613,218円です。

■損益の状況

〔自 2018年4月24日 至 2018年5月23日〕〔自 2018年5月24日 至 2018年6月23日〕〔自 2018年6月24日 至 2018年7月23日〕〔自 2018年7月24日 至 2018年8月23日〕〔自 2018年8月24日 至 2018年9月23日〕〔自 2018年9月24日 至 2018年10月23日〕

項 目	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(A) 配 当 等 収 益	1,704,735円	1,678,696円	1,674,817円	1,664,878円	1,665,829円	1,660,886円
受 取 配 当 金	1,705,258	1,679,263	1,675,263	1,665,335	1,666,263	1,661,297
受 取 利 息	4	5	1	-	-	-
支 払 利 息	△527	△572	△447	△457	△434	△411
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,258,966	△9,385,021	△7,114,677	△5,427,079	3,614,730	△4,287,595
売 買 益	3,302,248	91,433	23,821	6,141	3,614,509	16,138
売 買 損	△43,282	△9,476,454	△7,138,498	△5,433,220	221	△4,303,733
(C) 信 託 報 酬 等	△335,829	△357,864	△292,766	△314,156	△334,126	△284,151
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	4,627,872	△8,064,189	△5,732,626	△4,076,357	4,946,433	△2,910,860
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	23,637,714	26,279,823	16,617,126	9,422,297	3,897,225	7,369,368
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,839,141	3,809,969	3,808,417	3,823,682	3,834,053	3,838,182
(配 当 等 相 当 額)	(10,096,580)	(10,026,672)	(10,066,515)	(10,188,067)	(10,315,644)	(10,410,257)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△6,257,439)	(△6,216,703)	(△6,258,098)	(△6,364,385)	(△6,481,591)	(△6,572,075)
(G) 合 計 (D+E+F)	32,104,727	22,025,603	14,692,917	9,169,622	12,677,711	8,296,690
(H) 収 益 分 配 金	△1,482,478	△1,456,705	△1,446,552	△1,446,563	△1,448,090	△1,445,246
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	30,622,249	20,568,898	13,246,365	7,723,059	11,229,621	6,851,444
追 加 信 託 差 損 益 金	3,839,141	3,809,969	3,808,417	3,823,682	3,834,053	3,838,182
(配 当 等 相 当 額)	(10,096,580)	(10,026,672)	(10,066,515)	(10,188,067)	(10,315,644)	(10,410,257)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△6,257,439)	(△6,216,703)	(△6,258,098)	(△6,364,385)	(△6,481,591)	(△6,572,075)
分 配 準 備 積 立 金	75,098,039	73,551,367	72,864,851	72,648,540	72,721,140	72,395,284
繰 越 損 益 金	△48,314,931	△56,792,438	△63,426,903	△68,749,163	△65,325,572	△69,382,022

(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 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,589,761円	1,321,211円	1,382,375円	1,351,081円	1,560,794円	1,377,020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	10,096,580	10,026,672	10,066,515	10,188,067	10,315,644	10,410,257
(d) 分 配 準 備 積 立 金	74,990,756	73,686,861	72,929,028	72,744,022	72,608,436	72,463,510
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	86,677,097	85,034,744	84,377,918	84,283,170	84,484,874	84,250,787
(f) 1万口当たり当期分配対象額	3,215.72	3,210.61	3,208.17	3,204.54	3,208.82	3,206.23
(g) 分 配 金	1,482,478	1,456,705	1,446,552	1,446,563	1,448,090	1,445,246
(h) 1万口当たり分配金	55	55	55	55	55	55

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 100 期	第 101 期	第 102 期	第 103 期	第 104 期	第 105 期
1 万口当たり分配金	55円	55円	55円	55円	55円	55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。

《お知らせ》

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(2018年7月24日)

ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンド

クラス (J P Y) / クラス (A U D) / クラス (B R L) / クラス (C N Y)

当ファンドは「世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）」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。

形 態	ケイマン籍円建外国投資信託
投資方針および 主要投資対象	<p>①主として先進国の金融機関が発行したハイブリッド証券に投資し、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銘柄選定にあたっては、個別企業のファンダメンタルズ分析、個別企業の属する国の政策、バリュエーション分析、流動性等を考慮し選定します。</p> <p>③取得時において、Moody's、S & PまたはFitch（複数の格付機関が付与している場合は最も高い格付）による個別銘柄格付が、B B B -相当以上の格付を有する銘柄を対象とします。ただし、保有期間中に上記基準未滿となった場合であっても、市場環境や個別銘柄に対する投資判断に基づき、継続保有することがあります。</p> <p>④原則として、ファンドの純資産総額に対する1発行体当たりの有価証券の時価総額の割合は4%以内とし、発行体に対する信用リスクの分散を図ります。</p> <p>⑤ファンドは、ユーロ、米ドルなど複数通貨（以下、「原資産通貨」といいます。）に投資しますが、この「原資産通貨」に対し、各クラスの対象通貨で為替取引を行います。</p>
投資顧問会社	Asset Management One International Ltd.
受託銀行	CIBC BANK AND TRUST COMPANY (CAYMAN) LIMITED
管理事務代行会社	Mizuho Bank (USA)
保管銀行	Mizuho Trust&Banking (Luxembourg) S.A.

ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ ファンドはケイマン籍外国投資信託で、2017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）」及び「投資有価証券・その他純資産明細書」等は、2017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（ダイヤモンド フィナンシャル セキュリティーズ 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
2017年12月期（2017年12月31日終了）

	日本円
期首現在純資産	2,748,418,924
収益の部	
税引後利息（源泉税控除1,321円）	87,276,088
収益合計	87,276,088
費用の部	
投資運用報酬	12,211,365
管理事務および保管報酬	7,560,522
監査報酬	3,837,517
受託報酬	1,863,632
その他費用	377,493
費用合計	25,850,529
純投資収益	61,425,559
投資有価証券売却による実現純利益	87,276,747
為替先渡契約および外貨取引による実現純利益	39,322,776
期中実現純利益額	126,599,523
投資有価証券による未実現純損益の変動	102,619,463
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	(119,619,584)
期中未実現純減額	(17,000,121)
運用による純資産の純増	171,024,961
受益権口発行収入	12,000,000
受益権口償還コスト	(400,335,600)
受益者取引による純支払額合計	(388,335,600)
受益者に支払われた分配金	(271,530,044)
期末現在純資産額	2,259,578,241

投資有価証券・その他純資産明細書
2017年12月31日現在
(日本円建て)

社債	額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
	500,000	ABN AMRO BANK N 7.125% 07/06/2022	EUR	63,717,089	86,483,267	3.83%
	100,000	AUST & NZ BANK 5.125% 09/10/19	EUR	10,750,271	14,702,806	0.65%
	550,000	BANQ FED CRD MU 3.00% 05/21/24	EUR	72,543,695	82,517,976	3.65%
	200,000	BARCLAYS BK PLC 10.00% 05/21/21	GBP	28,973,854	38,262,166	1.69%
	300,000	BARCLAYS PLC 2.00% 02/07/28 EMTN	EUR	39,043,632	40,480,347	1.79%
	500,000	BBVA SUB CAP UNIPERS 3.5% 04/11/24	EUR	67,192,628	70,493,550	3.12%
	200,000	BNP PARIBAS 5.75% 01/24/22	GBP	27,945,388	35,256,891	1.56%
	300,000	BNP PARIBAS 2.875% 03/20/26	EUR	42,108,584	43,415,467	1.92%
	500,000	BPCE 4.63% 07/18/23	EUR	70,211,845	80,777,512	3.57%
	300,000	CITIGROUP INC 5.50% 09/13/25	USD	31,705,961	38,085,005	1.69%
	200,000	CITIGROUP INC 5.88% 07/01/24	GBP	25,750,070	37,033,273	1.64%
	100,000	COM BK AUSTRALI 5.50% 08/06/19	EUR	14,043,062	14,720,365	0.65%
	221,000	COMMERZBANK AG 4.000% 03/30/27 EMTN	EUR	21,931,028	34,120,379	1.51%
	300,000	COMMERZBANK AG 7.75% 03/16/21	EUR	39,837,719	49,260,099	2.18%
	300,000	CREDIT AGRICOLE 7.38% 12/18/23	GBP	43,196,203	59,187,743	2.62%
	200,000	CREDIT SUISSE 6.50% 08/08/23	USD	19,862,000	25,269,831	1.12%
	400,000	CREDIT SUISSE 5.75% 09/18/25	EUR	54,728,444	61,599,716	2.73%
	200,000	DANSKE BANK A/S 3.875% 10/04/23	EUR	26,520,694	27,852,788	1.23%
	100,000	DEUTSCHE BANK A 5.00% 06/24/20	EUR	11,527,297	14,910,674	0.66%
	350,000	GOLDMAN SACHS 4.75% 10/12/2021	EUR	47,027,690	54,525,715	2.41%
	200,000	GOLDMAN SACHS GP 4.250% 10/21/25	USD	21,891,744	23,555,140	1.04%
	200,000	HSBC HOLDINGS 4.25% 03/14/24	USD	20,330,925	23,542,722	1.04%
	100,000	HSBC HOLDINGS 3.375% 01/10/24	EUR	13,282,648	13,988,909	0.62%
	100,000	ING BANK NV 2.5% 02/25/26	EUR	13,114,724	14,804,965	0.66%
	300,000	ING GROEP NV 3.625% 02/15/29 EMTN	EUR	35,849,418	43,203,696	1.91%
	200,000	INTESA SANPAOLO 2.86% 04/23/25	EUR	25,604,002	27,973,807	1.24%
	400,000	INTESA SANPAOLO 3.93% 09/15/26	EUR	51,819,910	59,377,138	2.63%
	300,000	JPMORGAN CHASE 3.375% 05/01/23	USD	32,702,542	34,363,531	1.52%
	200,000	KBC GROEP NV 2.375% 11/25/24 EMTN	EUR	23,443,031	28,134,824	1.25%
	400,000	KBC GROUP NV 1.625% 09/18/29 EMTN	EUR	52,361,410	54,379,724	2.41%
	300,000	LLOYDS TSB BANK 6.50% 03/24/20	EUR	34,275,925	46,321,118	2.05%
	100,000	MERRILL LYNCH 5.50% 11/22/21	GBP	14,950,168	17,397,205	0.77%
	300,000	MORGAN STANLEY 4.10% 05/22/23	USD	30,575,600	35,221,519	1.56%
	200,000	MORGAN STANLEY 4.875% 11/01/22	USD	21,089,118	24,269,414	1.07%
	400,000	NATL AUSTRALIAB 2.00% 11/12/24	EUR	56,762,923	55,654,956	2.46%
	200,000	NAT'L WESTMINSTER BK 6.50% 09/07/21	GBP	27,729,327	35,416,478	1.57%
	200,000	NORDEA BANK AB 4.25% 09/21/22	USD	20,512,412	23,649,732	1.05%
	100,000	NORDEA BANK AB 4.50% 03/26/20	EUR	11,035,530	14,857,291	0.66%
	200,000	RABOBANK 3.88% 07/25/23	EUR	26,680,018	31,544,294	1.40%
	250,000	RABOBANK 4.63% 05/23/29	GBP	42,774,330	44,973,635	1.99%
	600,000	SANTANDER ISSUA 2.50% 03/18/25	EUR	65,839,234	85,264,724	3.77%

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
550,000	SKANDINAV ENSKI 2.50% 05/28/2026	EUR	74,459,336	78,961,756	3.49%
400,000	SOCIETE GENERAL 4.00% 06/07/23	EUR	52,072,014	62,704,772	2.78%
100,000	SOCIETE GENERAL 2.50% 09/16/26	EUR	13,590,775	14,367,346	0.64%
200,000	STANDARD CHART 3.63% 11/23/22	EUR	20,809,229	30,371,791	1.34%
300,000	STANDARD CHART 7.75% 04/03/18	GBP	35,113,937	46,510,849	2.06%
300,000	SUMITOMO MITSUI 4.00% 11/09/20	EUR	33,243,079	44,861,850	1.99%
300,000	SUMITOMO MITSUI 4.85% 03/01/22	USD	24,090,592	35,903,034	1.59%
200,000	SVENSKA HNDLSBK FXtoVA 01/15/24	EUR	27,590,772	27,780,761	1.23%
300,000	UBS AG 5.125% 05/15/24	USD	30,580,448	36,545,367	1.61%
100,000	UBS AG FXtoFL 02/12/2026	EUR	14,356,236	15,205,501	0.67%
250,000	UBS AG JERSEY FXtoFL 08/17/2022	USD	19,704,787	32,987,180	1.46%
300,000	UNICREDIT SPA FXtoVA 05/02/23	USD	29,817,001	34,256,971	1.52%
100,000	UNICREDIT SPA FXtoVA 10/28/25	EUR	15,156,251	15,079,495	0.67%
200,000	WELLS FARGO 5.25% 08/01/23	GBP	23,685,821	35,887,833	1.59%
400,000	WELLS FARGO CO 4.13% 08/15/23	USD	38,319,051	47,424,460	2.09%
社債合計			1,853,831,422	2,205,699,358	97.62%
投資有価証券公正価値合計			1,853,831,422	2,205,699,358	97.62%

		2017年12月31日
クラスAUD (日本円)		
期末現在純資産額		163,880,974
期末現在1口当たり純資産価額		8,323
クラスBRL (日本円)		
期末現在純資産額		964,729,297
期末現在1口当たり純資産価額		4,711
クラスCNY (日本円)		
期末現在純資産額		346,133,081
期末現在1口当たり純資産価額		11,410
クラスJPY (日本円)		
期末現在純資産額		784,834,889
期末現在1口当たり純資産価額		7,870

為替先渡契約

2017年12月31日現在、未決済の為替先渡契約は下記の通りです。

満期日	購入通貨	金額	売却通貨	金額	未実現利益
クラスAUD					
2018年1月24日	AUD	1,890,000	JPY	160,580,070	5,649,679
クラスBRL					
2018年1月24日	EUR	300,000	JPY	39,813,000	846,095
クラスCNY					
2018年1月24日	CNY	20,092,000	JPY	341,271,260	5,506,530
ファンド全体					
2018年1月24日	EUR	5,801,597	JPY	774,803,265	11,488,994
2018年1月24日	JPY	419,641,314	USD	3,710,000	2,062,859
					25,554,157

満期日	購入通貨	金額	売却通貨	金額	未実現損失
クラスAUD					
2018年1月24日	JPY	160,580,070	EUR	1,208,695	(3,234,736)
クラスBRL					
2018年1月24日	BRL	29,470,000	JPY	1,021,618,808	(23,282,036)
2018年1月24日	JPY	39,813,000	BRL	1,179,450	(142,491)
2018年1月24日	JPY	1,021,618,809	EUR	7,663,503	(17,018,146)
クラスCNY					
2018年1月24日	JPY	341,271,260	EUR	2,551,397	(4,520,446)
クラスJPY					
2018年1月24日	JPY	793,300,000	EUR	5,979,137	(17,054,389)
ファンド全体					
2018年1月24日	JPY	355,161,950	GBP	2,340,000	(1,453,006)
					(66,705,250)

注：米国みずほ銀行が上記オープン為替先渡契約の相手方となります。

D I A Mマネーマザーファンド

運用報告書

第9期（決算日 2018年4月5日）

（計算期間 2017年4月6日～2018年4月5日）

D I A Mマネーマザーファンドの第9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	騰落率				
5期(2014年4月7日)	10,080	0.1	93.9	—	—	百万円 10,998
6期(2015年4月6日)	10,090	0.1	82.8	—	—	9,524
7期(2016年4月5日)	10,098	0.1	80.6	—	—	3,158
8期(2017年4月5日)	10,104	0.1	71.2	—	—	1,045
9期(2018年4月5日)	10,099	△0.0	71.1	—	—	1,030

(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）。

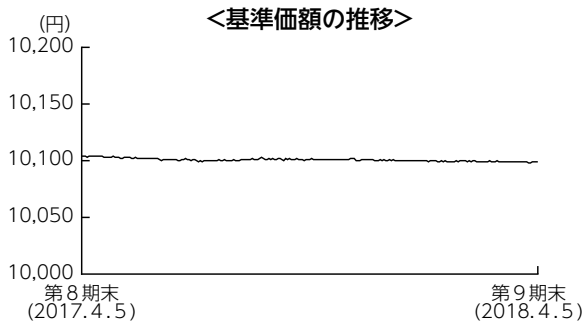
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比	券 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 比 率	債 先 物 比	券 率
	円	騰 落 率					
(期 首) 2017年 4 月 5 日	10,104	% -	71.2	%	-	-	% -
4 月 末	10,104	0.0	71.2	-	-	-	-
5 月 末	10,102	△0.0	80.2	-	-	-	-
6 月 末	10,100	△0.0	77.9	-	-	-	-
7 月 末	10,100	△0.0	76.1	-	-	-	-
8 月 末	10,102	△0.0	56.9	-	-	-	-
9 月 末	10,101	△0.0	65.2	-	-	-	-
10 月 末	10,101	△0.0	77.6	-	-	-	-
11 月 末	10,100	△0.0	77.6	-	-	-	-
12 月 末	10,100	△0.0	70.1	-	-	-	-
2018年 1 月 末	10,100	△0.0	70.1	-	-	-	-
2 月 末	10,099	△0.0	79.5	-	-	-	-
3 月 末	10,098	△0.1	71.1	-	-	-	-
(期 末) 2018年 4 月 5 日	10,099	△0.0	71.1	-	-	-	-

(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（2017年4月6日から2018年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,099円となり、前期末比で0.05%下落しました。

基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策の影響により残存期間の短い政府保証債等の利回りが上昇（価格は下落）したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

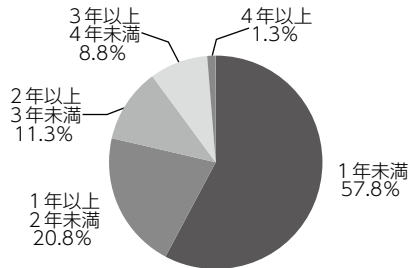
国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは△0.25%～△0.09%で推移しました。2017年8月から11月末の間には需給要因から利回りが上下する局面もありましたが、概ね△0.15%を中心としたレンジで推移しました。

ポートフォリオについて

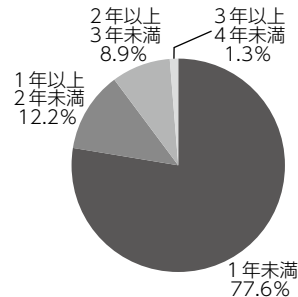
残存期間の短い政府保証債を中心とした運用を行いました。

【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

日銀の金融政策の物価目標2%までは依然として距離があるため、当面は政策の据え置きが予想されます。マイナス金利政策が継続されると考えられるため、政府保証債や地方債などを中心に運用を行います。

■ 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（2017年4月6日から2018年4月5日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	300,097	100,016 (200,000)
	地 方 債 証 券	17,719	— (68,770)
	特 殊 債 券	405,052	— (360,000)

(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（2017年4月6日から2018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

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BB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	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	130,780	131,175	12.7	—	—	2.8	10.0
特 殊 債 券	595,000	601,037	58.3	—	—	4.5	53.8
合 計	725,780	732,213	71.1	—	—	7.3	63.8

(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
(地方債証券)	%	千円	千円	
25年度6回 静岡県公募債	0.3420	13,250	13,265	2018/08/23
25年度 京都府京都みらい債	0.3000	6,000	5,999	2018/09/03
25年度1回 ぐんま県民債	0.2600	4,000	3,998	2018/10/30
2回 東京都公募債（東京グローバル都債（円貨））	0.1200	5,000	4,996	2018/12/07
25年度8回 福岡県公募債	0.2700	6,700	6,696	2018/12/25
26年度4回 静岡県公募債	0.2090	14,810	14,842	2019/06/24
26年度1回 大阪市みおつくし債	0.2200	6,000	5,992	2019/06/27
21年度6回 愛知県公募債	1.4400	10,000	10,185	2019/07/30
26年度 京都府京都みらい債	0.1600	9,200	9,179	2019/09/02
331回 大阪府公募債	1.4100	10,000	10,216	2019/10/29
26年度7回 福岡県公募債	0.2000	6,500	6,486	2019/12/25
43回 川崎市公募債 5年	0.1370	10,850	10,872	2020/03/19
27年度2回 千葉県公募債	0.1770	14,670	14,715	2020/05/25
27年度 京都府京都みらい債	0.1000	13,800	13,726	2020/09/02
小 計	—	130,780	131,175	—
(特殊債券)	%	千円	千円	
194回 政保中小企業債券	1.5000	100,000	100,695	2018/09/18
1回 政保地方公営企業金融機構債券	1.6000	100,000	100,865	2018/10/16
199回 政保預金保険機構債券	0.1000	100,000	100,068	2018/10/16
71回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	101,033	2018/12/25
15回 政保東日本高速道路債券	1.3000	100,000	101,187	2019/02/25
55回 政保関西国際空港債	1.3000	29,000	29,373	2019/03/25

銘	柄	当		期		末
		利	額	評	額	償
		率	面	価	額	還
		%	金	額	額	年月日
			額			
(特殊債券)			千円		千円	
89回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	4,000	4,079		2019/09/30
93回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	8,000	8,189		2019/11/29
100回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	9,000	9,244		2020/02/28
112回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1000	30,000	30,786		2020/07/31
117回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	6,000	6,153		2020/09/30
133回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	5,000	5,203		2021/04/30
137回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2000	4,000	4,158		2021/06/30
	小計	—	595,000	601,037		—
	合計	—	725,780	732,213		—

■投資信託財産の構成

2018年4月5日現在

項	目	当		期		末
		評	額	比	率	
			千円			%
公	社		732,213			71.1
コ	ー		298,257			28.9
ル	・					
ロ	ー					
ン	等					
、	そ					
の	の					
他	他					
投	資		1,030,471			100.0
信	託					
財	産					
総	額					

(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

(2018年4月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,030,471,057円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	296,878,113
公 社 債(評価額)	732,213,335
未 収 利 息	1,083,993
前 払 費 用	295,616
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,030,471,057
元 本	1,020,388,428
次 期 繰 越 損 益 金	10,082,629
(D) 受 益 権 総 口 数	1,020,388,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,099円

■損益の状況

当期 自2017年4月6日 至2018年4月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	6,427,083円
受 取 利 息	6,637,040
支 払 利 息	△209,957
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,932,206
売 買 益	21,813
売 買 損	△6,954,019
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△505,123
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	10,735,046
(E) 解 約 差 損 益 金	△201,483
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	54,189
(G) 合 計(C+D+E+F)	10,082,629
次 期 繰 越 損 益 金(G)	10,082,629

(注1) 期首元本額 1,034,991,821円
追加設定元本額 5,445,811円
一部解約元本額 20,049,204円

(注2) 期末における元本の内訳

クルーズコントロール	990,000,991円
ダイナミック・ナビゲーション	98,711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
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <円コース>	1,281,836円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <豪ドルコース>	246,797円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <ブラジルレアルコース>	1,689,581円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ (毎月分配型) <中国元コース>	654,944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
ネット証券専用ファンドシリーズ 新興市場日本株 レアル型	103,986円
DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 資源国通貨バスケットコース	4,486,988円
DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド ブラジルレアルコース	4,586,699円
DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 円コース	997,109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
DIAM 米国リート・インカムプラス	994,728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
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
USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジあり	9,924円
USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジなし	9,924円
米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジあり>	9,909円
米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジなし>	9,909円
期末元本合計	1,020,388,428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) (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。

《お知らせ》

■つみたてNISAの要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(平成29年9月29日)

■信用リスクを適正に管理する方法を規定する所要の約款変更を行いました。

(平成30年3月1日)