

## 償還 運用報告書 (全体版)

DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・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	2011年8月9日から2021年5月19日までです。
運用方針	高水準のインカムゲインの確保と、信託財産の成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	主として外国投資信託である「DIAM ケイマン・トラスト・グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション 円建円クラス」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 マネーメーカー・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	主として外国投資信託への投資を通じて、世界のハイイールド債券 <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、外国投資信託の流動性および当ファンドの資金動向等を勘案の上決定します。 ※外国投資信託において、米ドル建以外の通貨建資産に投資を行った場合には、原則として対米ドルでの為替取引を行います。 (*) ハイイールド債券とは、S & P、ムーディーズ、フィッチのいずれかの格付会社によって、BB格相当以下に格付けされている債券をさします。 外国投資信託においては、原則とし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。
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。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
分配方針	決算日（原則として毎月19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。 「原則として利子配当等収益等を中心に安定分配を行うことを基本とする」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、基準価額の水準、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112期	<決算日	2020年12月21日>
第113期	<決算日	2021年1月19日>
第114期	<決算日	2021年2月19日>
第115期	<決算日	2021年3月19日>
第116期	<決算日	2021年4月19日>
第117期	<償還日	2021年5月19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 グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・通貨選択シリーズ 円コース」は、この度、信託期間を満了し、償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

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

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

# DIAM グローバル・ハイールド・ボンド・ファンド・通貨選択シリーズ 円コース

## ■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託 組入証比率	純資産 総額
		(分配落)	税込 み金	期騰 落率		
第 1 作成期	(設定日) 2011年8月9日	円 10,000	円 -	% -	% -	百万円 795
	1期(2011年9月20日)	9,973	0	△0.3	98.0	1,267
	2期(2011年10月19日)	9,797	0	△1.8	97.4	1,321
	3期(2011年11月21日)	9,893	60	1.6	97.8	1,497
第 2 作成期	4期(2011年12月19日)	9,879	60	0.5	97.7	1,699
	5期(2012年1月19日)	10,059	60	2.4	97.8	2,107
	6期(2012年2月20日)	10,269	60	2.7	97.4	2,414
	7期(2012年3月19日)	10,379	60	1.7	97.9	2,402
	8期(2012年4月19日)	10,260	60	△0.6	97.9	2,415
第 3 作成期	9期(2012年5月21日)	10,182	60	△0.2	97.9	2,697
	10期(2012年6月19日)	10,110	60	△0.1	98.1	3,040
	11期(2012年7月19日)	10,241	60	1.9	97.8	2,992
	12期(2012年8月20日)	10,302	60	1.2	98.1	3,015
	13期(2012年9月19日)	10,509	60	2.6	98.0	3,126
	14期(2012年10月19日)	10,486	60	0.4	98.0	3,349
	15期(2012年11月19日)	10,335	60	△0.9	98.0	3,981
第 4 作成期	16期(2012年12月19日)	10,574	60	2.9	98.0	4,490
	17期(2013年1月21日)	10,694	60	1.7	97.9	5,408
	18期(2013年2月19日)	10,581	60	△0.5	97.7	5,531
	19期(2013年3月19日)	10,671	60	1.4	98.0	5,895
	20期(2013年4月19日)	10,698	60	0.8	98.5	6,046
	21期(2013年5月20日)	10,798	60	1.5	98.5	6,272
第 5 作成期	22期(2013年6月19日)	10,510	60	△2.1	98.4	6,162
	23期(2013年7月19日)	10,436	60	△0.1	98.4	6,198
	24期(2013年8月19日)	10,324	60	△0.5	98.4	6,045
	25期(2013年9月19日)	10,329	60	0.6	98.4	5,831
	26期(2013年10月21日)	10,450	60	1.8	98.5	5,669
	27期(2013年11月19日)	10,474	60	0.8	98.5	5,501
第 6 作成期	28期(2013年12月19日)	10,465	60	0.5	95.2	5,350
	29期(2014年1月20日)	10,563	60	1.5	98.5	5,290
	30期(2014年2月19日)	10,585	60	0.8	98.4	5,010
	31期(2014年3月19日)	10,628	60	1.0	98.5	4,695
	32期(2014年4月21日)	10,623	60	0.5	98.6	4,429
	33期(2014年5月19日)	10,650	60	0.8	98.4	4,256

作成期	決算期	基準価額			投資組 資本金 信託比	証券 利率	純資産 総額
		(分配落)	税分 込配	み金 期騰 落			
第7作成期	34期(2014年6月19日)	円 10,683	円 60	% 0.9	% 98.4	百万円 4,088	
	35期(2014年7月22日)	10,557	60	△0.6	98.4	3,909	
	36期(2014年8月19日)	10,456	60	△0.4	98.4	3,820	
	37期(2014年9月19日)	10,347	60	△0.5	98.4	3,609	
	38期(2014年10月20日)	10,042	60	△2.4	98.4	3,419	
	39期(2014年11月19日)	10,099	60	1.2	98.4	3,281	
第8作成期	40期(2014年12月19日)	9,679	60	△3.6	97.0	3,040	
	41期(2015年1月19日)	9,751	60	1.4	98.4	3,011	
	42期(2015年2月19日)	9,850	60	1.6	98.4	2,913	
	43期(2015年3月19日)	9,823	60	0.3	98.4	2,821	
	44期(2015年4月20日)	9,890	60	1.3	98.4	2,773	
	45期(2015年5月19日)	9,808	60	△0.2	98.5	2,721	
第9作成期	46期(2015年6月19日)	9,682	60	△0.7	98.4	2,631	
	47期(2015年7月21日)	9,661	60	0.4	98.4	2,523	
	48期(2015年8月19日)	9,522	60	△0.8	98.3	2,279	
	49期(2015年9月24日)	9,418	60	△0.5	98.4	2,096	
	50期(2015年10月19日)	9,255	60	△1.1	97.8	1,999	
	51期(2015年11月19日)	9,198	60	0.0	97.6	1,885	
第10作成期	52期(2015年12月21日)	8,936	60	△2.2	95.3	1,780	
	53期(2016年1月19日)	8,787	60	△1.0	96.3	1,706	
	54期(2016年2月19日)	8,591	60	△1.5	97.8	1,611	
	55期(2016年3月22日)	8,807	60	3.2	98.2	1,590	
	56期(2016年4月19日)	8,819	60	0.8	98.1	1,556	
	57期(2016年5月19日)	8,819	60	0.7	98.1	1,538	
第11作成期	58期(2016年6月20日)	8,816	60	0.6	97.4	1,504	
	59期(2016年7月19日)	8,935	60	2.0	97.7	1,513	
	60期(2016年8月19日)	9,004	60	1.4	97.4	1,511	
	61期(2016年9月20日)	8,905	60	△0.4	97.3	1,435	
	62期(2016年10月19日)	8,958	60	1.3	98.4	1,428	
	63期(2016年11月21日)	8,798	60	△1.1	98.0	1,296	
第12作成期	64期(2016年12月19日)	8,877	60	1.6	97.2	1,240	
	65期(2017年1月19日)	8,926	60	1.2	97.3	1,242	
	66期(2017年2月20日)	8,911	60	0.5	98.0	1,231	
	67期(2017年3月21日)	8,822	60	△0.3	97.3	1,197	
	68期(2017年4月19日)	8,827	60	0.7	98.3	1,152	
	69期(2017年5月19日)	8,836	60	0.8	97.3	1,127	

作成期	決算期	基準価額			投資組 資本金 信託比	証券 比率	純資産 総額
		(分配落)	税分 込配	み金 期騰			
第13作成期	70期(2017年6月19日)	円 8,763	円 60	% △0.1	% 97.3	百万円 1,098	
	71期(2017年7月19日)	8,703	60	0.0	97.3	1,078	
	72期(2017年8月21日)	8,630	60	△0.1	97.9	1,062	
	73期(2017年9月19日)	8,611	60	0.5	98.1	1,042	
	74期(2017年10月19日)	8,638	60	1.0	97.3	1,028	
	75期(2017年11月20日)	8,518	60	△0.7	97.5	994	
第14作成期	76期(2017年12月19日)	8,474	60	0.2	98.3	980	
	77期(2018年1月19日)	8,443	60	0.3	95.0	974	
	78期(2018年2月19日)	8,283	60	△1.2	97.8	949	
	79期(2018年3月19日)	8,192	60	△0.4	98.1	935	
	80期(2018年4月19日)	8,178	60	0.6	97.8	930	
	81期(2018年5月21日)	8,011	60	△1.3	97.8	905	
第15作成期	82期(2018年6月19日)	7,952	60	0.0	97.6	857	
	83期(2018年7月19日)	7,861	60	△0.4	98.0	836	
	84期(2018年8月20日)	7,831	60	0.4	98.2	819	
	85期(2018年9月19日)	7,805	60	0.4	97.3	799	
	86期(2018年10月19日)	7,685	60	△0.8	97.2	786	
	87期(2018年11月19日)	7,521	30	△1.7	97.4	767	
第16作成期	88期(2018年12月19日)	7,392	30	△1.3	97.9	750	
	89期(2019年1月21日)	7,466	30	1.4	95.3	745	
	90期(2019年2月19日)	7,527	30	1.2	97.3	750	
	91期(2019年3月19日)	7,581	30	1.1	97.2	746	
	92期(2019年4月19日)	7,653	30	1.3	97.9	748	
	93期(2019年5月20日)	7,598	30	△0.3	97.2	730	
第17作成期	94期(2019年6月19日)	7,636	30	0.9	97.3	725	
	95期(2019年7月19日)	7,665	30	0.8	98.2	713	
	96期(2019年8月19日)	7,610	30	△0.3	97.6	701	
	97期(2019年9月19日)	7,718	30	1.8	98.5	705	
	98期(2019年10月21日)	7,653	30	△0.5	98.1	693	
	99期(2019年11月19日)	7,625	30	0.0	98.2	682	
第18作成期	100期(2019年12月19日)	7,741	30	1.9	97.3	672	
	101期(2020年1月20日)	7,779	30	0.9	97.9	667	
	102期(2020年2月19日)	7,759	30	0.1	98.2	626	
	103期(2020年3月19日)	6,103	30	△21.0	97.0	487	
	104期(2020年4月20日)	6,579	30	8.3	97.6	522	
	105期(2020年5月19日)	6,515	30	△0.5	97.7	516	

作成期	決算期	基準価額			投資信託 受益組 証比率	純資産 総額
		(分配落)	税 分 込 配	み 金 騰 落		
第19作成期	106期(2020年6月19日)	円 6,893	円 30	% 6.3	% 97.7	百万円 546
	107期(2020年7月20日)	6,877	30	0.2	98.0	527
	108期(2020年8月19日)	7,030	30	2.7	97.9	531
	109期(2020年9月23日)	7,061	30	0.9	98.0	532
	110期(2020年10月19日)	7,050	30	0.3	97.2	520
	111期(2020年11月19日)	7,186	30	2.4	97.0	513
第20作成期	112期(2020年12月21日)	7,293	30	1.9	97.4	519
	113期(2021年1月19日)	7,309	30	0.6	97.7	518
	114期(2021年2月19日)	7,358	30	1.1	98.1	519
	115期(2021年3月19日)	7,230	30	△1.3	97.9	503
	116期(2021年4月19日)	7,316	30	1.6	97.0	497
	(償還日) 2021年5月19日	(償還価額) 7,293.04	0	△0.3	-	496

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

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 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4) 「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5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当作成期中の基準価額の推移

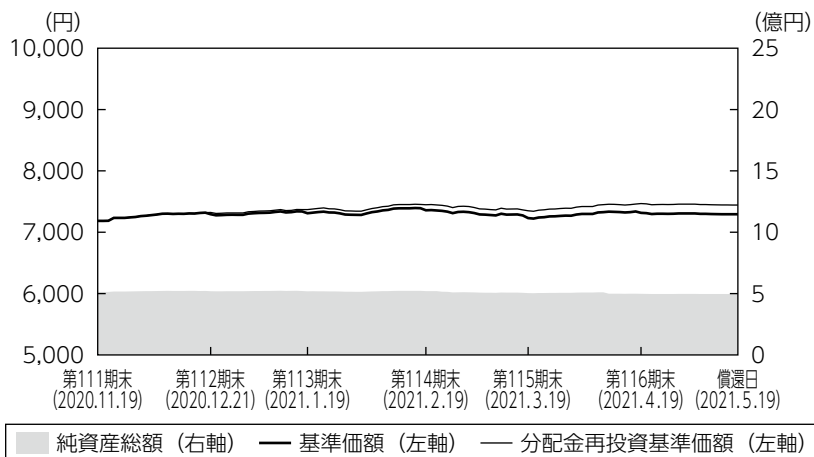
決算期	年 月 日	基 準	価 額		投資信託受益証券 組 入 比 率
			騰	落 率	
第112期	(期首) 2020年11月19日	円		%	%
		7,186		-	97.0
	11月 末	7,242		0.8	97.1
第113期	(期末) 2020年12月21日	7,323		1.9	97.4
	(期首) 2020年12月21日	7,293		-	97.4
	12月 末	7,304		0.2	97.4
第114期	(期末) 2021年1月19日	7,339		0.6	97.7
	(期首) 2021年1月19日	7,309		-	97.7
	1月 末	7,286		△0.3	98.0
第115期	(期末) 2021年2月19日	7,388		1.1	98.1
	(期首) 2021年2月19日	7,358		-	98.1
	2月 末	7,335		△0.3	97.3
第116期	(期末) 2021年3月19日	7,260		△1.3	97.9
	(期首) 2021年3月19日	7,230		-	97.9
	3月 末	7,270		0.6	97.9
第117期	(期末) 2021年4月19日	7,346		1.6	97.0
	(期首) 2021年4月19日	7,316		-	97.0
	4月 末	7,306		△0.1	19.3
	(償還日) 2021年5月19日	(償還価額) 7,293.04		△0.3	-

(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。

## ■設定以来の運用経過（2011年8月9日から2021年5月19日まで）

### 第20作成期の基準価額等の推移



第112期首： 7,186円  
償還日： 7,293.04円  
(既払分配金150円)  
騰落率： 3.6%  
(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

当作成期の基準価額は上昇しました。主要国で大規模な財政・金融政策が維持されたことや、新型コロナウイルス用のワクチン接種の進展などを背景に、世界のハイイールド債券市場が堅調に推移したことが主な上昇要因となりました。業種別では、経済活動再開により需要回復が期待されるエネルギーや、都市封鎖の段階的な緩和による業績改善が期待されるカジノなどがプラスに影響しました。

また、当ファンドは設定来で40.4%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金5,940円）。低金利環境下で投資家が高い利回りを求める動きを継続したことなどを背景に、ハイイールド債券市場が堅調に推移したことが主な上昇要因となりました。業種別では、世界的な景気回復やオンライン化の恩恵を受けてリターンが堅調に推移したカジノや、ハイテク技術に対する需要増加を背景に成長が加速したテクノロジーなどがプラスに影響しました。

### ◆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
D I A M ケイマン・トラストーグローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション 円建円クラス	4.2%
D I A M マネーマザーファンド	△0.0%

(注1) D I A M ケイマン・トラストーグローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション 円建円クラスの騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

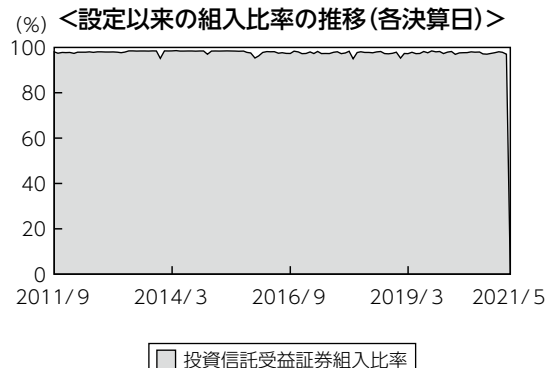
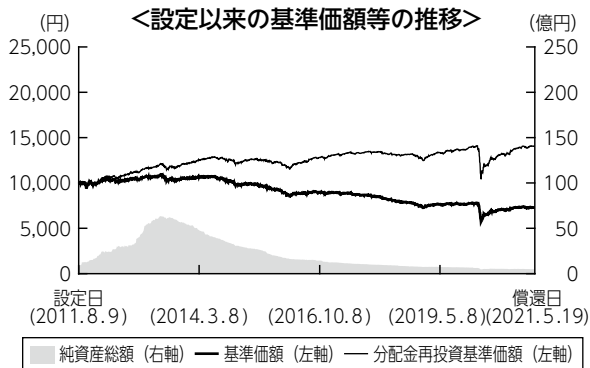
(注2) 組入ファンドの騰落率は、当ファンドが保有していた期間（D I A M ケイマン・トラストーグローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション 円建円クラスは2021年5月12日まで、D I A M マネーマザーファンドは2021年5月10日まで）の騰落率です。



## 設定来の投資環境

世界のハイイールド債券市場は設定来で上昇しました。世界のハイイールド債券市場は、欧州債務問題、F R B（米連邦準備理事会）の量的緩和政策の縮小、2014年～2015年にかけての資源価格の大幅下落など、一時的に軟調となる局面はありましたが、概ね堅調に推移しました。2020年2月下旬に新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて大幅に下落しましたが、その後の各国における大規模な財政・金融政策、新型コロナウイルス用のワクチン普及などを受けて上昇に転じ、償還日を迎えました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは2011年からは概ね0.10%近辺で推移しました。その後、2013年に日本銀行総裁に就任した黒田総裁の下で大規模な「量的・質的金融緩和政策」が導入され、同金利は低下傾向となりました。2016年にはマイナス金利政策が導入されたことにより、同金利は一段と低下し、以降はマイナス金利で推移することになりました。



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

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

## 設定来のポートフォリオについて

### ●当ファンド

D I A M ケイマン・トラストグローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション 円建円クラスの組入比率は、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。

### ●D I A M ケイマン・トラストグローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション 円建円クラス

設定来の国別配分は、米国を中心にユーロ圏および欧州周辺国のほか、一部新興国などを組入れました。セクター配分は、景気循環消費財や非景気循環消費財、通信などを中心に配分しました。

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、政府保証債、地方債などで運用を行いました。

## 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した。

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
	2020年11月20日 ~2020年12月21日	2020年12月22日 ~2021年1月19日	2021年1月20日 ~2021年2月19日	2021年2月20日 ~2021年3月19日	2021年3月20日 ~2021年4月19日
当期分配金（税引前）	30円	30円	30円	30円	30円
対基準価額比率	0.41%	0.41%	0.41%	0.41%	0.41%
当期の収益	30円	30円	30円	30円	30円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,239円	1,245円	1,253円	1,257円	1,266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。

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第112期～第117期 (2020年11月20日 ～2021年5月19日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	40円	
(投信会社)	(10)	(0.139)	
(販売会社)	(28)	(0.387)	
(受託会社)	( 1)	(0.016)	
合計	40	0.541	

(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。

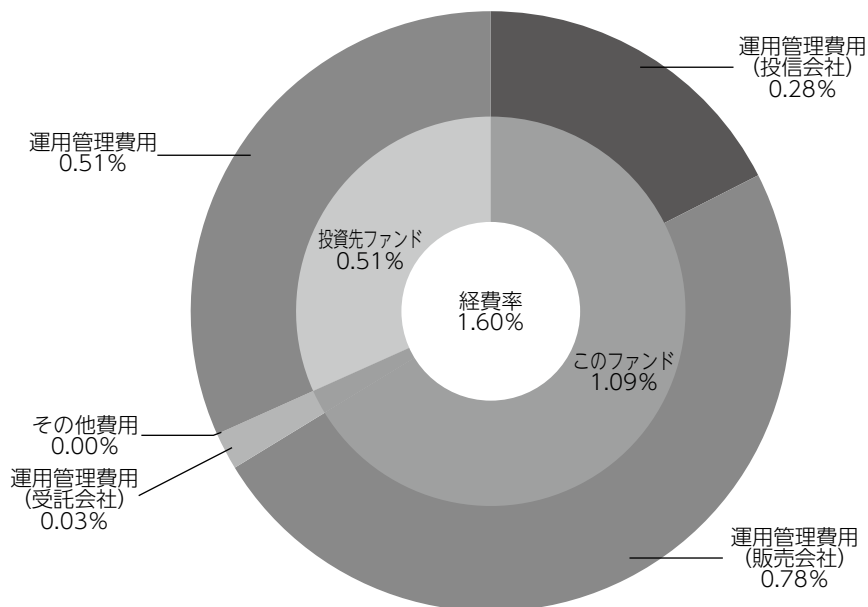
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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)

### ◆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経費率（年率）は1.60%です。



経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く） (①+②)	1.60%
①このファンドの費用の比率	1.09%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.51%

(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②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がありますが、上記には含まれておりません。

(注8) 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 (2020年11月20日から2021年5月19日まで)

投資信託受益証券

		第 112 期 ~ 第 117 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦貨建	D I A M ケイマン・トラストー グローバル・ハイイールド・ ボンド・ファンド・カレンシー・ セレクション 円建円クラス	千□ -	千円 -	千□ 72.16828	千円 505,278

(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 (2020年11月20日から2021年5月19日まで)

		第 112 期 ~ 第 117 期			
		設 定		解 約	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
	D I A M マネーマザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 997	千円 1,005

## ■利害関係人との取引状況等 (2020年11月20日から2021年5月19日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

償還時における有価証券の組入れはありません。第19作成期末の組入れは以下の通りでした。

### (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 19 作 成 期 末	
	□ 数	金 額
D I A M ケイマン・トラストーグローバル・ハイイールド・ ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション 円建円クラス	千□ 72.16828	千円 505,278
合 計	千□ 72.16828	千円 505,278

### (2) 親投資信託残高

	第 19 作 成 期 末	
	□ 数	金 額
D I A M マネーマザーファンド	千□ 997	千円 1,005

## ■投資信託財産の構成

2021年5月19日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 496,957	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	496,957	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

(2020年12月21日)、(2021年1月19日)、(2021年2月19日)、(2021年3月19日)、(2021年4月19日)、(2021年5月19日)現在

項 目	第 112 期 末	第 113 期 末	第 114 期 末	第 115 期 末	第 116 期 末	償 還 時
<b>(A) 資 産</b>	<b>524,090,092円</b>	<b>523,469,021円</b>	<b>522,536,820円</b>	<b>506,153,939円</b>	<b>500,483,314円</b>	<b>496,957,235円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,185,165	15,698,074	11,590,569	12,219,164	16,298,377	496,957,235
投資信託受益証券(評価額)	505,899,642	506,765,662	509,941,066	492,929,590	483,179,852	-
D I A M マ ネ ー マザーファンド(評価額)	1,005,285	1,005,285	1,005,185	1,005,185	1,005,085	-
<b>(B) 負 債</b>	<b>4,461,972</b>	<b>4,637,751</b>	<b>2,602,295</b>	<b>2,519,613</b>	<b>2,510,717</b>	<b>462,273</b>
未払収益分配金	2,137,617	2,129,580	2,119,912	2,089,784	2,042,093	-
未払解約金	1,826,250	2,055,200	-	-	-	-
未払信託報酬	498,105	452,971	482,383	429,829	468,624	462,089
未払利息	-	-	-	-	-	184
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>519,628,120</b>	<b>518,831,270</b>	<b>519,934,525</b>	<b>503,634,326</b>	<b>497,972,597</b>	<b>496,494,962</b>
元 本	712,539,071	709,860,208	706,637,534	696,594,982	680,697,919	680,779,327
次期繰越損益金	△192,910,951	△191,028,938	△186,703,009	△192,960,656	△182,725,322	-
償還差損益金	-	-	-	-	-	△184,284,365
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>712,539,071口</b>	<b>709,860,208口</b>	<b>706,637,534口</b>	<b>696,594,982口</b>	<b>680,697,919口</b>	<b>680,779,327口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	7,293円	7,309円	7,358円	7,230円	7,316円	-
1万口当たり償還価額(C/D)	-	-	-	-	-	7,293円4銭

(注) 第111期末における元本額は714,915,879円、第112期～償還時における追加設定元本額は622,990円、同解約元本額は34,759,542円です。

## ■損益の状況

〔自 2020年11月20日 至 2020年12月21日〕〔自 2020年12月22日 至 2021年1月19日〕〔自 2021年1月20日 至 2021年2月19日〕〔自 2021年2月20日 至 2021年3月19日〕〔自 2021年3月20日 至 2021年4月19日〕〔自 2021年4月20日 至 2021年5月19日〕

項 目	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期	第 117 期
(A) 配 当 等 収 益	2,877,713円	2,876,728円	2,886,643円	2,842,579円	2,784,290円	△3,043円
受 取 配 当 金	2,878,108	2,876,923	2,886,731	2,842,731	2,784,418	-
受 取 利 息	4	5	1	-	-	-
支 払 利 息	△399	△200	△89	△152	△128	△3,043
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,340,038	862,543	3,174,330	△9,234,051	5,557,940	△1,072,061
売 買 益	7,361,164	865,946	3,176,876	12,452	5,655,970	-
売 買 損	△21,126	△3,403	△2,546	△9,246,503	△98,030	△1,072,061
(C) 信 託 報 酬 等	△498,105	△452,971	△482,383	△429,829	△468,624	△462,089
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	9,719,646	3,286,300	5,578,590	△6,821,301	7,873,606	△1,537,193
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△219,989,960	△211,573,370	△209,432,666	△203,018,804	△207,062,547	△201,231,034
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	19,496,980	19,387,712	19,270,979	18,969,233	18,505,712	18,483,862
(配 当 等 相 当 額)	(46,971,142)	(46,801,551)	(46,594,756)	(45,938,224)	(44,895,821)	(44,906,131)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△27,474,162)	(△27,413,839)	(△27,323,777)	(△26,968,991)	(△26,390,109)	(△26,422,269)
(G) 合 計 (D+E+F)	△190,773,334	△188,899,358	△184,583,097	△190,870,872	△180,683,229	△184,284,365
(H) 収 益 分 配 金	△2,137,617	△2,129,580	△2,119,912	△2,089,784	△2,042,093	-
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△192,910,951	△191,028,938	△186,703,009	△192,960,656	△182,725,322	-
追 加 信 託 差 損 益 金	19,496,980	19,387,712	19,270,979	18,969,233	18,505,712	-
(配 当 等 相 当 額)	(46,971,142)	(46,801,551)	(46,594,756)	(45,938,224)	(44,895,821)	(-)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△27,474,162)	(△27,413,839)	(△27,323,777)	(△26,968,991)	(△26,390,109)	(-)
償 還 差 損 益 金	-	-	-	-	-	△184,284,365
分 配 準 備 積 立 金	41,375,713	41,612,234	41,955,086	41,676,597	41,305,503	-
繰 越 損 益 金	△253,783,644	△252,028,884	△247,929,074	△253,606,486	△242,536,537	-

(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 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,737,950円	2,528,669円	2,657,358円	2,413,241円	2,628,176円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	46,971,142	46,801,551	46,594,756	45,938,224	44,895,821
(d) 分 配 準 備 積 立 金	40,775,380	41,213,145	41,417,640	41,353,140	40,719,420
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	90,484,472	90,543,365	90,669,754	89,704,605	88,243,417
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,269.89	1,275.51	1,283.12	1,287.76	1,296.37
(g) 分 配 金	2,137,617	2,129,580	2,119,912	2,089,784	2,042,093
(h) 1万口当たり分配金	30	30	30	30	30

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期
1 万口当たり分配金	30円	30円	30円	30円	30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。



## ■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年8月9日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年5月19日		資産総額	496,957,235円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	462,273円
				純資産総額	496,494,962円
受益権口数	795,150,000口	680,779,327口	△114,370,673口	受益権口数	680,779,327口
元本額	795,150,000円	680,779,327円	△114,370,673円	1万口当たり償還金	7,293円4銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	1,270,716,964円	1,267,272,465円	9,973円	0円	0.00%
第2期	1,348,941,281	1,321,506,301	9,797	0	0.00
第3期	1,514,066,459	1,497,799,429	9,893	60	0.60
第4期	1,720,199,443	1,699,389,647	9,879	60	0.60
第5期	2,094,806,375	2,107,261,159	10,059	60	0.60
第6期	2,351,367,663	2,414,609,999	10,269	60	0.60
第7期	2,314,317,694	2,402,087,567	10,379	60	0.60
第8期	2,354,260,434	2,415,390,582	10,260	60	0.60
第9期	2,649,679,499	2,697,970,424	10,182	60	0.60
第10期	3,007,414,943	3,040,505,716	10,110	60	0.60
第11期	2,921,689,882	2,992,183,265	10,241	60	0.60
第12期	2,927,197,801	3,015,692,421	10,302	60	0.60
第13期	2,975,113,984	3,126,445,627	10,509	60	0.60
第14期	3,194,179,163	3,349,325,327	10,486	60	0.60
第15期	3,852,352,551	3,981,374,206	10,335	60	0.60
第16期	4,246,699,728	4,490,532,950	10,574	60	0.60
第17期	5,057,668,386	5,408,867,141	10,694	60	0.60
第18期	5,227,972,420	5,531,600,098	10,581	60	0.60
第19期	5,524,924,518	5,895,734,576	10,671	60	0.60
第20期	5,651,950,722	6,046,272,875	10,698	60	0.60
第21期	5,809,636,074	6,272,965,927	10,798	60	0.60
第22期	5,864,096,989	6,162,963,010	10,510	60	0.60
第23期	5,939,658,752	6,198,673,705	10,436	60	0.60
第24期	5,855,560,419	6,045,199,881	10,324	60	0.60
第25期	5,646,015,864	5,831,624,451	10,329	60	0.60
第26期	5,425,012,990	5,669,390,385	10,450	60	0.60
第27期	5,252,552,690	5,501,361,634	10,474	60	0.60
第28期	5,112,579,225	5,350,499,772	10,465	60	0.60

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 29 期	5,008,277,761円	5,290,423,564円	10,563円	60円	0.60%
第 30 期	4,733,234,329	5,010,351,184	10,585	60	0.60
第 31 期	4,418,455,908	4,695,849,751	10,628	60	0.60
第 32 期	4,169,811,748	4,429,605,355	10,623	60	0.60
第 33 期	3,997,145,345	4,256,994,197	10,650	60	0.60
第 34 期	3,827,307,397	4,088,812,695	10,683	60	0.60
第 35 期	3,703,589,418	3,909,919,219	10,557	60	0.60
第 36 期	3,654,174,962	3,820,641,240	10,456	60	0.60
第 37 期	3,488,253,077	3,609,377,515	10,347	60	0.60
第 38 期	3,405,629,171	3,419,873,172	10,042	60	0.60
第 39 期	3,249,677,561	3,281,884,642	10,099	60	0.60
第 40 期	3,141,823,481	3,040,862,745	9,679	60	0.60
第 41 期	3,088,320,152	3,011,391,815	9,751	60	0.60
第 42 期	2,958,340,289	2,913,828,008	9,850	60	0.60
第 43 期	2,872,712,773	2,821,954,853	9,823	60	0.60
第 44 期	2,804,823,753	2,773,869,070	9,890	60	0.60
第 45 期	2,774,405,383	2,721,174,494	9,808	60	0.60
第 46 期	2,717,997,738	2,631,656,227	9,682	60	0.60
第 47 期	2,612,003,826	2,523,474,122	9,661	60	0.60
第 48 期	2,393,609,809	2,279,278,248	9,522	60	0.60
第 49 期	2,226,216,916	2,096,648,529	9,418	60	0.60
第 50 期	2,160,316,322	1,999,314,546	9,255	60	0.60
第 51 期	2,050,079,560	1,885,702,787	9,198	60	0.60
第 52 期	1,992,076,995	1,780,169,237	8,936	60	0.60
第 53 期	1,942,461,123	1,706,847,807	8,787	60	0.60
第 54 期	1,875,332,637	1,611,056,564	8,591	60	0.60
第 55 期	1,805,622,260	1,590,206,471	8,807	60	0.60
第 56 期	1,764,388,056	1,556,022,036	8,819	60	0.60
第 57 期	1,744,217,538	1,538,228,454	8,819	60	0.60
第 58 期	1,706,810,011	1,504,788,683	8,816	60	0.60
第 59 期	1,694,285,198	1,513,873,302	8,935	60	0.60
第 60 期	1,678,177,294	1,511,066,755	9,004	60	0.60
第 61 期	1,611,528,338	1,435,131,971	8,905	60	0.60
第 62 期	1,594,585,700	1,428,387,277	8,958	60	0.60
第 63 期	1,473,992,475	1,296,749,461	8,798	60	0.60
第 64 期	1,396,830,271	1,240,027,264	8,877	60	0.60
第 65 期	1,391,508,194	1,242,003,039	8,926	60	0.60
第 66 期	1,381,812,071	1,231,312,301	8,911	60	0.60

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 67 期	1,357,927,463円	1,197,910,265円	8,822円	60円	0.60%
第 68 期	1,305,171,429	1,152,073,403	8,827	60	0.60
第 69 期	1,275,611,045	1,127,191,494	8,836	60	0.60
第 70 期	1,253,561,002	1,098,483,706	8,763	60	0.60
第 71 期	1,239,264,828	1,078,586,975	8,703	60	0.60
第 72 期	1,231,492,518	1,062,756,247	8,630	60	0.60
第 73 期	1,211,155,406	1,042,943,804	8,611	60	0.60
第 74 期	1,191,121,445	1,028,908,591	8,638	60	0.60
第 75 期	1,167,083,805	994,146,282	8,518	60	0.60
第 76 期	1,157,560,254	980,884,888	8,474	60	0.60
第 77 期	1,154,548,706	974,734,325	8,443	60	0.60
第 78 期	1,146,593,421	949,761,308	8,283	60	0.60
第 79 期	1,142,122,315	935,677,872	8,192	60	0.60
第 80 期	1,138,005,917	930,657,467	8,178	60	0.60
第 81 期	1,130,292,086	905,482,892	8,011	60	0.60
第 82 期	1,078,344,950	857,535,744	7,952	60	0.60
第 83 期	1,064,506,567	836,833,398	7,861	60	0.60
第 84 期	1,047,008,693	819,902,998	7,831	60	0.60
第 85 期	1,023,870,660	799,084,569	7,805	60	0.60
第 86 期	1,024,086,406	786,987,853	7,685	60	0.60
第 87 期	1,020,595,969	767,575,862	7,521	30	0.30
第 88 期	1,014,720,659	750,059,200	7,392	30	0.30
第 89 期	999,010,455	745,883,220	7,466	30	0.30
第 90 期	997,233,031	750,632,749	7,527	30	0.30
第 91 期	984,577,962	746,421,832	7,581	30	0.30
第 92 期	978,378,599	748,765,106	7,653	30	0.30
第 93 期	962,019,937	730,971,115	7,598	30	0.30
第 94 期	949,866,368	725,339,434	7,636	30	0.30
第 95 期	930,266,961	713,041,553	7,665	30	0.30
第 96 期	922,083,594	701,681,301	7,610	30	0.30
第 97 期	914,209,262	705,621,509	7,718	30	0.30
第 98 期	906,422,637	693,721,651	7,653	30	0.30
第 99 期	894,635,196	682,134,632	7,625	30	0.30
第 100 期	868,251,478	672,089,886	7,741	30	0.30
第 101 期	857,568,981	667,143,093	7,779	30	0.30
第 102 期	807,176,244	626,323,024	7,759	30	0.30
第 103 期	798,259,641	487,190,544	6,103	30	0.30
第 104 期	794,127,872	522,450,938	6,579	30	0.30

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 105 期	792,984,697円	516,625,122円	6,515円	30円	0.30%
第 106 期	793,143,785	546,677,468	6,893	30	0.30
第 107 期	767,313,125	527,690,092	6,877	30	0.30
第 108 期	755,509,428	531,137,114	7,030	30	0.30
第 109 期	754,711,355	532,893,837	7,061	30	0.30
第 110 期	738,790,841	520,846,043	7,050	30	0.30
第 111 期	714,915,879	513,754,167	7,186	30	0.30
第 112 期	712,539,071	519,628,120	7,293	30	0.30
第 113 期	709,860,208	518,831,270	7,309	30	0.30
第 114 期	706,637,534	519,934,525	7,358	30	0.30
第 115 期	696,594,982	503,634,326	7,230	30	0.30
第 116 期	680,697,919	497,972,597	7,316	30	0.30

## 償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金 (税引前)	7,293円4銭
------------------	----------

### 償還乗換えの優遇措置の適用について

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

# D I A M ケイマン・トラスト グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション

円建資源国通貨バスケットクラス  
円建ブラジルリアルクラス  
円建円クラス

当ファンドは「D I A M グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・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。

形 態	ケイマン諸島籍外国投資信託
主要投資対象	世界のハイイールド債券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主として世界のハイイールド債券<sup>(*)</sup>へ投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と、信託財産の成長をめざして運用を行います。</p> <p>(*) ハイイールド債券とは、S &amp; P、ムーディーズ、フィッチ（以下個別または総称して「格付会社」といいます。）のいずれかによって、B B格相当以下に格付されている債券をさします。</p> <p>②ハイイールド債券の運用は、ジャナス・キャピタル・マネジメンツ・エルエルシーが行います。</p> <p>③原則として、ハイイールド債券への投資は純資産総額の90%以上とします。</p> <p>④CCC格相当<sup>(**)</sup>以下に格付されている債券への投資割合は、純資産総額の30%以内とします。</p> <p>(**) 格付会社の格付が異なる場合は、最も高い格付を採用します。</p> <p>⑤無格付債券（格付会社の格付が付されていないもの）への投資割合は、原則として純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑥新興国の発行体が発行する有価証券（社債に限りません。）への投資割合は、純資産総額の15%以内とします。</p> <p>⑦転換社債への投資割合は、純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑧原則として、株式への投資は行いません。ただし、コーポレートアクション等により取得した場合、可能な限り速やかに売却することとします。</p> <p>⑨米ドル建以外の通貨建資産に投資を行った場合には、原則として対米ドルでの為替取引を行います。</p> <p>⑩各クラスは、原則として以下の為替予約取引を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・円建資源国通貨バスケットクラス：米ドル売り資源国通貨バスケット（ブラジルリアル、豪ドル、南アフリカランド）買い</li> <li>・円建ブラジルリアルクラス：米ドル売りブラジルリアル買い</li> <li>・円建円クラス：米ドル売り円買い</li> </ul> <p>⑪ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。（注）上記における純資産総額とは、為替管理会社が行う為替取引前のポートフォリオの純資産総額をさします。</p>
主な投資制限	<p>①同一発行体の発行する有価証券への投資割合は、原則としてファンドの純資産総額の5%以内とします。</p> <p>②有価証券の空売りは行わないものとします。</p> <p>③流動性に欠ける資産への投資は、日本証券業協会の外国証券取引に関する規則（その後の改正または改定を含みます。）により要求される価格の透明性を確保する適切な措置が講じられない限り、純資産総額の15%を超えないものとします。</p> <p>④為替取引以外のデリバティブは使用しません。</p> <p>⑤純資産総額の10%を超える借入れは行いません。（ただし、合併等により一時的に10%を超える場合を除きます。）</p> <p>⑥投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、純資産総額の5%以内とします。</p> <p>⑦金融商品取引法第2条1項に定める「有価証券」の定義に該当しない資産への投資割合は、純資産総額の50%を超えないこととします。</p>
投資顧問会社	アセットマネジメントOne株式会社
副投資顧問会社	ジャナス・キャピタル・マネジメンツ・エルエルシー
為替管理会社	アセットマネジメントOneインターナショナル・リミテッド
受託銀行	ファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド
管理会社	クイーンズゲート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー・リミテッド
管理事務代行会社、 保管銀行	米国みずほ銀行

DIAM ケイマン・トラスト・グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションはケイマン諸島籍外国投資信託で、2020年1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。以下は、2020年1月31日現在の財務諸表の原文の一部を翻訳・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（グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション）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。

包括利益計算書  
自2019年2月1日 至2020年1月31日  
(米ドル建て)

**投資収益 / (損失)**

損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る受取利息	\$ 5,283,004
損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る未実現評価益の純変動額	3,204,551
先渡為替予約に係る未実現評価損の純変動額	(3,708,870)
先渡為替予約および為替取引に係る実現純損失	(4,080,616)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る実現純利益	2,129,481
配当収益	5,513
その他収益	56,704

**収益合計** 2,889,767

**費用**

投資運用報酬	686,323
販売報酬	400,549
管理事務代行報酬	78,551
保管報酬	38,923
代行協会員報酬	157,078
受託報酬	19,103
監査報酬	69,648
その他費用	24,680

**運用費用合計** 1,474,855

運用純収益 1,414,912

**財務費用**

受益者への分配 (18,078,855)

**税金**

源泉徴収税 (14,117)

**受益者に帰属する運用に伴う純資産の純減額** \$ (16,678,060)

投資有価証券の補足明細（未監査）  
2020年1月31日現在

数量	銘柄	償却原価	公正価値	対純資産 比率
<b>資産担保証券</b>				
213,722	SJETS 2017-1 B 5.680% 08/15/42	213,720	222,100	0.26%
		<b>213,720</b>	<b>222,100</b>	<b>0.26%</b>
<b>転換社債</b>				
399,000	DISH NETWORK 2.375% 03/15/24	362,493	368,722	0.43%
400,000	XERO INV/MNTS LTD 2.375% 10/04/23	401,118	558,517	0.65%
200,000	CELLNEX TELECOM 1.500% 01/16/26 CLNX	290,242	329,463	0.39%
300,000	CELLNEX TELECOM 0.500% 07/05/28 CLNX	359,755	407,869	0.48%
		<b>1,413,607</b>	<b>1,664,571</b>	<b>1.95%</b>
<b>社債</b>				
403,000	AMN HEALTHCAR 4.625% 10/01/27 144A	405,289	408,178	0.48%
919,103	ARD FINANCE SA 06/30/27 144A	918,225	950,582	1.11%
117,000	ALBERTSONS COS 5.875% 02/15/28 144A	119,084	125,114	0.15%
270,000	ALBERTSONS COS 4.875% 02/15/30 144A	270,000	277,771	0.32%
473,000	ALCOA NEDERLAND 6.750% 09/30/24 144A	496,948	497,875	0.58%
539,000	ALERIS INTL 10.750% 07/15/23 144	561,765	560,830	0.66%
393,000	ALLEGHENY TECH 5.875% 08/15/23	416,799	431,233	0.50%
410,000	ALLEGHENY TECH 5.875% 12/01/27	411,581	418,344	0.49%
367,000	ALLIANCE DATA 4.750% 12/15/24 144A	367,000	366,835	0.43%
362,000	ALTICE FINANCING 5.000% 01/15/28 144A	362,000	356,595	0.42%
221,000	ALTICE LX 7.625% 02/15/25 144A	229,444	229,840	0.27%
200,000	ALTICE LX 10.500% 05/15/27 144	202,361	231,630	0.27%
181,000	ARCHROCK LP/FIN 6.250% 04/01/28 144A	181,000	186,656	0.22%
301,000	ARDAGH PKG FIN 5.250% 08/15/27 144A	301,000	316,231	0.37%
660,000	BANCO PACTUAL/KY 4.500% 01/10/25 REGS	656,271	679,866	0.80%
211,000	BAUSCH HEALTH 7.000% 01/15/28 144A	225,663	228,933	0.27%
323,000	BAUSCH HEALTH 5.000% 01/30/28 144A	328,140	327,845	0.38%
441,000	BWAY HOLDING CO 7.250% 04/15/25 144a	421,644	439,893	0.51%
521,000	CCO HOLDINGS LLC 5.000% 02/01/28 144A	496,325	546,060	0.64%
212,000	CCO HOLDINGS LLC 5.375% 06/01/29 144A	216,052	227,232	0.27%
246,000	CHS/COMMUNITY 8.125% 06/30/24 144A	226,358	221,641	0.26%
218,000	CHS/COMMUNITY 6.625% 02/15/25 144A	218,000	221,248	0.26%
203,000	CSC HOLDINGS LLC 5.250% 06/01/24	208,405	219,663	0.26%
483,000	CSC HOLDINGS LLC 7.500% 04/01/28 144a	522,114	550,631	0.64%
250,000	CSC HOLDINGS LLC 5.750% 01/15/30 144A	259,851	269,068	0.31%
221,000	CALPINE CORP 5.125% 03/15/28 144A	221,000	219,895	0.26%
451,000	CARGO AIRCRAFT M 4.750% 02/01/28 144A	452,878	458,911	0.54%
302,000	CENTURYLINK INC 7.500% 04/01/24 Y	311,338	341,512	0.40%
483,000	CENTURYLINK INC 5.125% 12/15/26 144A	483,000	497,490	0.58%
789,000	CHANGE HLD / FIN 5.750% 03/01/25 144A	776,884	805,545	0.94%
102,000	Ortho-Clinical 6.625% 05/15/22 144A	101,010	101,872	0.12%
254,000	DCP MIDSTREAM OP 5.125% 05/15/29	256,033	268,440	0.31%
122,000	DELL INT / EMC 5.300% 10/01/29 144A	130,748	140,091	0.16%
441,000	DIAMOND SPORTS 5.375% 08/15/26 144A	448,996	440,107	0.51%
945,000	DOLE FOOD CO 7.250% 06/15/25 144A	968,535	924,130	1.08%
418,000	DOWNSTREAM DEVE 10.500% 02/15/23 144	433,849	435,938	0.51%

数量	銘柄	償却原価	公正価値	対純資産 比率
300,000	EXTENDED STAY AM 4.625% 10/01/27 144A	300,000	302,805	0.35%
222,000	EG GLOBAL 8.500% 10/30/25 144A	222,000	235,783	0.28%
210,000	ELANCO ANIMAL 4.900% 08/28/28	228,053	241,297	0.28%
341,000	ENDEAVOR ENERGY 5.750% 01/30/28 144A	354,404	355,271	0.42%
245,000	ENCOMPASS HLTH 4.500% 02/01/28	245,000	252,813	0.30%
615,000	ENLINK MIDSTREA 4.15% 06/01/25	579,703	568,620	0.67%
614,000	ENTERPRISE DEVEL 12.000% 07/15/24 144	596,408	705,845	0.83%
899,000	FIRST QUANTUM 7.250% 04/01/23 144A	924,249	896,379	1.05%
118,000	GCI LLC 6.875% 04/15/25	119,802	123,506	0.14%
1,591,000	GEN ELECTRIC CO FxtoFL PERP D	1,512,403	1,586,235	1.86%
644,000	GLB AIR LEASE CO 6.500% 09/15/24 144A	644,000	660,454	0.77%
814,000	GOLDEN ENTERTAIN 7.625% 04/15/26 144A	820,814	880,241	1.03%
1,020,000	GOLDEN NUGGET 8.750% 10/01/25 144A	1,052,576	1,074,325	1.26%
173,000	GOLDEN NUGGET 6.750% 10/15/24 144A	175,257	178,223	0.21%
622,000	GREAT LAKES DRED 8.000% 05/15/22	623,920	654,849	0.77%
933,000	GRT WRN PTRL 9.000% 09/30/21 144A	882,690	884,391	1.03%
669,000	HLF FIN SARL LLC 7.250% 08/15/26 144A	682,188	698,269	0.82%
152,000	HESS MIDSTREAM P 5.125% 06/15/28 144A	152,000	157,089	0.18%
42,000	HILCORP ENERGY I 5.000% 12/01/24 144A	38,967	38,342	0.04%
539,000	HILCORP ENERGY I 6.250% 11/01/28 144A	503,507	481,245	0.56%
214,000	HILL-ROM HLDGS 4.375% 09/15/27 144A	214,860	214,424	0.26%
218,000	HOLLY PAR/FIN 5.000% 02/01/28 144A	218,000	221,884	0.26%
281,000	HORIZON PHARMA 5.500% 08/01/27 144A	291,372	300,150	0.35%
581,000	HUB INTL LTD 7.000% 05/01/26 144A	590,268	604,255	0.71%
417,000	HUDBAY MINERALS 7.250% 01/15/23 144A	429,971	422,907	0.49%
239,000	HUDBAY MINERALS 7.625% 01/15/25 144A	244,631	241,888	0.28%
252,000	ISTAR INC 4.250% 08/01/25	252,000	253,890	0.30%
168,000	INFRABUILD AUSTR 12.000% 10/01/24 144	168,000	170,870	0.20%
351,000	INTELSAT CONNECT 9.500% 02/15/23 144A	286,943	181,643	0.21%
960,000	ITHACA ENERGY N 9.375% 07/15/24 144A	960,000	1,000,790	1.17%
314,000	JBS USA/FOOD/FIN 6.500% 04/15/29 144A	326,245	352,261	0.41%
489,000	JBS USA/FOOD/FIN 5.500% 01/15/30 144A	489,000	530,247	0.62%
570,000	JELD-WEN INC 4.875% 12/15/27 144A	589,204	591,573	0.69%
408,000	LABL ESCROW ISS 10.500% 07/15/27 144	409,659	429,348	0.50%
502,000	LABL ESCROW ISS 6.750% 07/15/26 144A	506,323	540,104	0.63%
683,000	LGI HOMES INC 6.875% 07/15/26 144A	696,901	723,364	0.85%
507,000	LCPR SR SECURED 6.750% 10/15/27 144A	511,382	537,111	0.63%
346,000	LADDER CAP FINAN 4.250% 02/01/27 144A	346,000	345,464	0.40%
452,000	LAMAR MEDIA CORP 3.750% 02/15/28 144A	452,000	456,000	0.53%
377,000	LEVEL 3 FIN INC 5.375% 01/15/24	372,088	384,696	0.45%
395,000	LIBERTY MEDIA 8.250% 02/01/30	402,435	401,656	0.47%
752,000	MAGNOLIA OIL 6.000% 08/01/26 144A	752,962	778,582	0.91%
204,000	MASONITE INTL 5.375% 02/01/28 144A	207,098	215,151	0.25%
467,000	MICHAELS STORES 8.000% 07/15/27 144A	463,047	418,245	0.49%
1,114,000	MOHEGAN TRIBAL 7.875% 10/15/24 144A	1,084,224	1,133,957	1.33%
200,000	MOTION BONDCO 6.625% 11/15/27 144A	200,000	213,500	0.25%
662,000	NGL ENRGY PART/F 6.125% 03/01/25	599,015	627,520	0.73%
267,000	NABORS INDS LTD 7.250% 01/15/26 144A	269,534	268,033	0.31%
210,000	NABORS INDS INC 5.750% 02/01/25 WI	200,900	174,391	0.20%
330,000	NETFLIX INC 4.375% 11/15/26	315,126	347,441	0.41%
333,000	NEXSTAR ESCROW 5.625% 07/15/27 144A	343,254	349,434	0.41%
678,000	NOVELIS CORP 5.875% 09/30/26 144A	676,582	721,950	0.84%



数量	銘柄	償却原価	公正価値	対純資産 比率
885,000	NOVELIS CORP 4.750% 01/30/30 144A	889,676	893,297	1.04%
997,000	ALTICE FRANCE SA 7.375% 05/01/26 144A	991,979	1,063,729	1.24%
198,000	ORTHO-CLINICAL 7.250% 02/01/28 144A	201,171	202,097	0.24%
442,000	PBF HOLDING CO 7.250% 06/15/25	442,000	470,361	0.55%
248,000	PDC ENERGY INC 5.750% 05/15/26	251,649	240,008	0.28%
283,000	PARSLEY ENERGY 5.250% 08/15/25 144A	286,763	292,669	0.34%
243,000	PARSLEY ENERGY 5.625% 10/15/27 144A	247,827	258,030	0.30%
605,000	PLATFORM SPECIAL 5.875% 12/01/25 144A	602,956	626,847	0.73%
430,000	RANGE RESOURCES 5.000% 08/15/22 *	398,478	407,511	0.48%
675,000	RANGE RESOURCES 9.250% 02/01/26 144A	675,000	600,328	0.70%
400,000	OLIVETTI FINANCE 7.750% 01/24/33 EMTN	619,227	667,185	0.78%
386,000	SM ENERGY CO 6.750% 09/15/26	381,268	351,608	0.41%
590,000	SABLE INTL FIN 5.750% 09/07/27 144A	585,251	624,868	0.73%
409,000	SCIENTIFIC GAMES 7.000% 05/15/28 144A	410,963	431,229	0.50%
262,000	SMITHFIELD FOODS 5.200% 04/01/29 144A	262,930	299,286	0.35%
317,000	SURGERY CENTER 6.750% 07/01/25 144A	307,775	322,679	0.38%
238,000	SPRINGLEAF FIN 5.375% 11/15/29	238,000	247,937	0.29%
349,000	SPRINT CORP 7.875% 09/15/23	369,306	371,502	0.43%
494,000	SPRINT CORP 7.125% 06/15/24	510,423	511,258	0.60%
650,000	STATION CAS 4.500% 02/15/28 144A	650,000	650,618	0.76%
291,000	STERICYCLE INC 5.375% 07/15/24 144A	297,340	305,217	0.36%
750,000	SUMMIT MATERIALS 6.125% 07/15/23	761,765	758,438	0.89%
369,000	SURGERY CENTER 10.000% 04/15/27 144	369,000	411,563	0.48%
428,000	T-MOBILE USA IN 6.500% 01/15/24	437,988	440,301	0.51%
470,000	TALLGRASS NRG 5.500% 01/15/28 144A	469,074	471,092	0.55%
332,000	TARGA RES PRTRNS 6.500% 07/15/27	337,391	362,710	0.42%
328,000	TEGNA INC 4.625% 03/15/28 144A	328,000	330,291	0.39%
461,000	TENET HEALTHCAR 8.125% 04/01/22	481,839	504,482	0.59%
299,000	TENET HEALTHCARE 4.875% 01/01/26 144A	299,000	310,399	0.36%
192,000	TERRIER MEDIA BU 8.875% 12/15/27 144A	192,000	198,240	0.23%
324,000	TRANSDIGM INC 6.250% 03/15/26 144A	334,035	350,527	0.41%
117,736	TRANSOCEAN 5.875% 01/15/24	116,559	120,532	0.14%
176,220	TRANSOCEAN PONTUS LT 6.125% 08/01/25	179,673	181,945	0.21%
446,000	TRIVIUM PACK FIN 8.500% 08/15/27 144A	462,331	491,425	0.57%
450,000	TWIN RIVER WORLD 6.750% 06/01/27 144A	453,291	476,032	0.56%
182,000	UBER TECHNOLOGIE 8.000% 11/01/26 144A	191,561	194,063	0.23%
362,000	UNIVAR SOLUTIONS 5.125% 12/01/27 144A	364,858	376,245	0.44%
188,000	USA PART/USA FIN 6.875% 04/01/26	192,976	195,872	0.23%
306,000	USA PART/USA FIN 6.875% 09/01/27 144A	321,845	319,541	0.37%
583,000	VALARIS PLC 5.750% 10/01/44	417,935	242,490	0.28%
498,000	BAUSCH HLTH AMR 8.500% 01/31/27 144A	544,840	564,284	0.66%
402,000	VIPER ENERGY 5.375% 11/01/27 144A	402,000	419,829	0.49%
394,000	VISTRA OPERATION 5.000% 07/31/27 144A	394,000	406,549	0.48%
145,000	WENDY'S INTL 7.000% 12/15/25	155,323	155,259	0.18%
270,000	WEST STREET MERG 6.375% 09/01/25 144A	269,431	265,947	0.31%
425,000	TRI POINTE GROUP 5.875% 06/15/24	417,087	462,364	0.54%
218,000	ZAYO GROUP LLC 6.000% 04/01/23	223,019	223,087	0.26%
456,000	ZEKELMAN IND 9.875% 06/15/23 144A	478,515	480,795	0.56%
774,667	INTER MEDIA COMM 4.875% 12/31/22	900,664	884,202	1.03%
500,000	AUTOSTRAD PER L 5.875% 06/09/24 EMTN	639,730	651,943	0.76%
500,000	SELECTA GROUP BV 5.875% 02/01/24 REGS	571,364	561,420	0.66%
221,000	VERISURE MIDHOLD 5.750% 12/01/23 REGS	273,156	251,743	0.29%

数量	銘柄	償却原価	公正価値	対純資産 比率
500,000	TEVA PHARM FNC 4.500% 03/01/25	545,448	561,373	0.66%
300,000	ICELAND BONDCO 4.625% 03/15/25 REGS	339,402	327,204	0.38%
300,000	TEVA PHARM FNC 1.125% 10/15/24	283,291	296,141	0.35%
400,000	GKN HOLDINGS LTD 3.375% 05/12/32 EMTN	514,265	561,681	0.66%
410,000	TAKKO LUX 2 SCA 5.375% 11/15/23 REGS	431,808	436,821	0.51%
300,000	VALLOUREC SA 6.375% 10/15/23 REGS	280,279	291,341	0.34%
1,000,000	CPI PROPERTY GRO FXtoVA PERP	1,102,554	1,172,309	1.37%
394,000	STARFRUIT FINCO 6.500% 10/01/26 REGS	458,466	460,246	0.54%
305,000	IS BANKASI FXtoVA 01/22/30	305,000	310,688	0.36%
626,000	BRASKEM NL 4.500% 01/31/30 REGS	621,418	632,129	0.74%
340,000	HOUSE OF FINANCE 4.375% 07/15/26 REGS	382,602	377,536	0.44%
502,000	EG GLOBAL 4.375% 02/07/25 REGS	560,947	553,869	0.65%
840,000	ALTICE LX 8.000% 05/15/27 REGS	939,792	1,054,231	1.23%
300,000	AROUNDTOWN SA FXtoVA PERP EMTN	368,170	420,156	0.49%
540,000	LEASEPLAN CORP FXtoVA PERP	602,100	683,704	0.80%
200,000	VIVION 3.500% 11/01/25	218,890	234,577	0.27%
800,000	VICTORIA PLC 5.250% 07/15/24 REGS	897,760	931,859	1.09%
220,000	CHEPLAPHARM ARZN 3.500% 02/11/27 REGS	242,022	248,893	0.29%
490,000	ARD FINANCE SA 06/30/27 REGS	542,626	553,772	0.65%
1,100,000	VIVION 3.000% 08/08/24	1,223,794	1,271,218	1.49%
660,000	KAISA GROUP 10.500% 01/15/25	660,000	645,157	0.75%
1,260,000	HEIMSTADEN BOSTA FXtoVA PERP	1,387,638	1,424,259	1.67%
575,000	GLOBO COMMUN PAR 4.875% 01/22/30 REGS	577,964	587,823	0.69%
250,000	VICTORIA PLC 5.250% 07/15/24 FEB	290,745	291,088	0.34%
830,000	SUMMER BC HOLDCO 5.750% 10/31/26 REGS	922,628	962,651	1.13%
305,000	JOLLIBEE WORLDWI FXtoVA PERP	305,000	303,252	0.35%
350,000	CEMEX SAB 5.450% 11/19/29 REGS	350,000	373,030	0.44%
870,000	NIDDA HEALTHCARE 3.500% 09/30/24 NOV	975,460	976,600	1.14%
290,000	STENA INTERNATIO 3.750% 02/01/25 REGS	322,034	327,410	0.38%
600,000	CSN ISLANDS XI 6.750% 01/28/28 REGS	600,000	594,984	0.70%
610,000	UNITED GROUP 3.125% 02/15/26 REGS	673,806	672,091	0.79%
330,000	YPSO FINANCE 4.000% 02/15/28 REGS	364,518	362,321	0.42%
200,000	STRETFORD 6.750% 07/15/24 REGS	247,261	241,389	0.28%
200,000	VALLOUREC SA 2.250% 09/30/24	153,806	162,889	0.19%
500,000	TEVA PHARM FNC 1.250% 03/31/23	494,315	523,070	0.61%
1,150,000	ENQUEST PLC 04/15/22 EMTN (PIK)	1,003,380	1,014,622	1.19%
299,000	CENTURYLINK INC 5.80% 03/15/2022	296,010	315,687	0.37%
		<b>80,217,978</b>	<b>82,117,377</b>	<b>96.04%</b>
	<b>投資有価証券合計</b>	<b>\$ 81,845,306</b>	<b>84,004,048</b>	<b>98.24%</b>
	<b>その他資産・負債</b>		<b>1,500,970</b>	<b>1.76%</b>
	<b>純資産</b>		<b>85,505,019</b>	<b>100.00%</b>

※「投資有価証券の補足明細（未監査）」については管理事務代行会社である米国みずほ銀行のデータを基にアセットマネジメントOneが作成したものです。

クラス別内訳  
2020年1月31日現在

クラス	口数
HYAUDAUD	1,308,631
HYJPYBRL	320,363
HYJPYBS1	219,374
HYJPYJPY	81,868
HYUSDBRL	662,919
HYUSDBS1	221,442
HYUSDUSD	38,201

※D I AM ケイマン・トラスト・グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクションは複数のクラスで構成されています。  
上記クラスのHYJPYBS1には、資源国通貨バスケットコースが投資する円建資源国通貨バスケットクラス、HYJPYBRLにはブラジルリアルコースが投資する円建ブラジルリアルクラス、HYJPYJPYには円コースが投資する円建円クラスが含まれています。

# D I A M マネーマザーファンド

## 運用報告書

第12期 (決算日 2021年4月5日)

(計算期間 2020年4月7日～2021年4月5日)

D I A M マネーマザーファンドの第12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				
8期(2017年4月5日)	10,104	0.1	71.2	—	—	百万円 1,045
9期(2018年4月5日)	10,099	△0.0	71.1	—	—	1,030
10期(2019年4月5日)	10,098	△0.0	79.4	—	—	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

(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)。

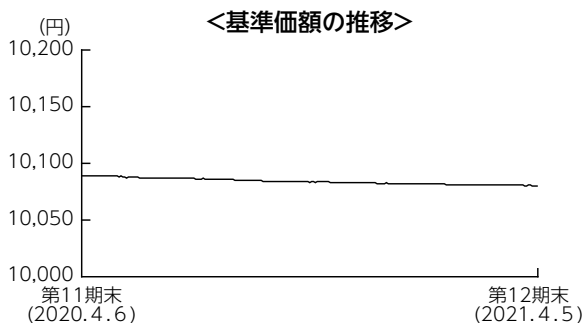
## ■当期中の基準価額の推移

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) 2020年 4 月 6 日	10,089	—	69.3	—	—
4 月 末	10,089	0.0	71.1	—	—
5 月 末	10,087	△0.0	89.9	—	—
6 月 末	10,087	△0.0	62.3	—	—
7 月 末	10,086	△0.0	77.8	—	—
8 月 末	10,084	△0.0	74.4	—	—
9 月 末	10,084	△0.0	63.2	—	—
10 月 末	10,083	△0.1	63.2	—	—
11 月 末	10,082	△0.1	64.0	—	—
12 月 末	10,082	△0.1	64.0	—	—
2021年 1 月 末	10,081	△0.1	63.9	—	—
2 月 末	10,081	△0.1	63.9	—	—
3 月 末	10,080	△0.1	62.4	—	—
(期 末) 2021年 4 月 5 日	10,080	△0.1	62.4	—	—

(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（2020年4月7日から2021年4月5日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は10,080円となり、前期末比で0.09%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。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の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。新型コロナウイルスへの影響に対する経済の下支えもあり、日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力がかかっていることなどが要因となりました。

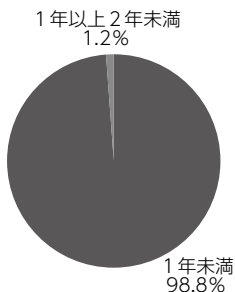
## ポートフォリオについて

残存期間の短い国債や政府保証債、地方債などで運用を行いました。

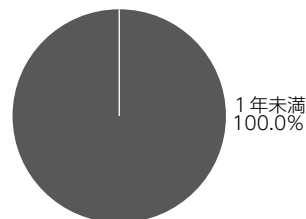
【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

### ○残存年限別構成比

期首（前期末）



当期末



## 今後の運用方針

引き続き短期公社債などを中心に投資を行い、安定した収益の確保をめざします。市場環境によっては、目標とする運用ができない場合があります。

## ■ 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 (2020年4月7日から2021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	400,802	(700,000)
	地方債証券	—	(43,470)
	特殊債証券	460,461	(236,000)

(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 (2020年4月7日から2021年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決算期	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
公社債	百万円 861	百万円 359	% 41.7	百万円 —	百万円 —	% —

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、みずほ証券です。

## ■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	%	%	%	%	%
国 債 証 券	400,000	400,342	37.6	—	—	—	37.6
特 殊 債 券	263,000	264,140	24.8	—	—	—	24.8
合 計	663,000	664,482	62.4	—	—	—	62.4

(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
<b>(国債証券)</b>	%	千円	千円	
4 0 2 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,088	2021/07/01
4 0 7 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,254	2021/12/01
小 計	—	400,000	400,342	—
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
1 3 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	5,000	5,004	2021/04/30
1 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2000	4,000	4,011	2021/06/30
2 7 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.0000	154,000	154,552	2021/08/13
1 4 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	100,000	100,572	2021/10/29
小 計	—	263,000	264,140	—
合 計	—	663,000	664,482	—

## ■投資信託財産の構成

2021年4月5日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率		
公 社 債	千円	%	664,482	62.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他			400,021	37.6
投 資 信 託 財 産 総 額			1,064,503	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

(2021年4月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,064,503,858円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	399,647,437
公 社 債(評価額)	664,482,620
未 収 利 息	319,007
前 払 費 用	54,794
(B) 負 債	—
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,064,503,858
元 本	1,056,034,563
次 期 繰 越 損 益 金	8,469,295
(D) 受 益 権 総 口 数	1,056,034,563口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,080円

(注1) 期首元本額 1,129,674,818円  
追加設定元本額 713,862円  
一部解約元本額 74,354,117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
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
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 資産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
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
マシユーズ・アジア株式ファンド	29,641,137円
One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Cコース)	99,040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
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
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
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
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
リスクコントロール型ETF分散投資ファンド (適格機関投資家限定)	9,881,322円
期末元本合計	1,056,034,563円

## ■損益の状況

当期 自2020年4月7日 至2021年4月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,639,477円
受 取 利 息	5,777,516
支 払 利 息	△138,039
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,625,182
売 買 益	5,382
売 買 損	△6,630,564
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△985,705
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	10,094,745
(E) 解 約 差 損 益 金	△645,883
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,138
(G) 合 計(C+D+E+F)	8,469,295
次 期 繰 越 損 益 金(G)	8,469,295

(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。