

## 運用報告書 (全体版)

第9期<決算日 2022年4月18日>

### DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド <DC年金>

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/内外/債券   |
| 信託期間   | 2013年4月2日から無期限です。   |
| 運用方針   | 信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。   |
| 主要投資対象 | 円建て外国籍投資信託「DIAMケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラスJPY2」受益証券を主要投資対象とします。また、証券投資信託である「DIAMマネーマザーファンド」受益証券への投資も行います。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。 |
| 運用方法   | 主として円建ての外国投資信託への投資を通じて、実質的に内外債券に投資します。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。実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。       |
| 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（原則として毎年4月18日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の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。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。           |

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-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>」は、2022年4月18日に第9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/>

## DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>

### ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額        |        |          | 投資信託受益証券組入比率 | 純資産総額      |
|-----------------|-------------|--------|----------|--------------|------------|
|                 | (分配落)       | 税金込    | み金騰落     |              |            |
| 5期 (2018年4月18日) | 円<br>12,158 | 円<br>0 | %<br>4.3 | %<br>97.4    | 百万円<br>194 |
| 6期 (2019年4月18日) | 12,149      | 0      | △0.1     | 96.8         | 191        |
| 7期 (2020年4月20日) | 12,430      | 0      | 2.3      | 97.0         | 186        |
| 8期 (2021年4月19日) | 13,334      | 0      | 7.3      | 97.3         | 206        |
| 9期 (2022年4月18日) | 13,735      | 0      | 3.0      | 97.7         | 219        |

(注1) 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。

(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

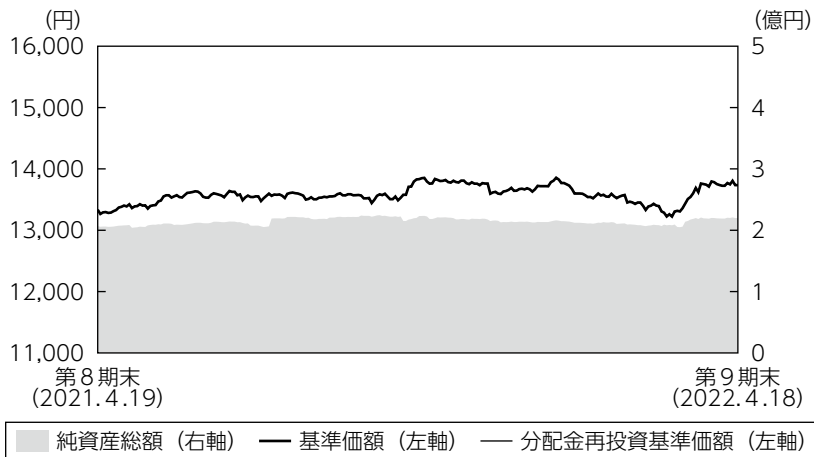
| 年月日                | 基準価額        |        | 投資信託受益証券組入比率 |
|--------------------|-------------|--------|--------------|
|                    | 騰落          | 率      |              |
| (期首)<br>2021年4月19日 | 円<br>13,334 | %<br>- | %<br>97.3    |
| 4月 末               | 13,370      | 0.3    | 97.3         |
| 5月 末               | 13,570      | 1.8    | 97.0         |
| 6月 末               | 13,537      | 1.5    | 96.8         |
| 7月 末               | 13,579      | 1.8    | 97.1         |
| 8月 末               | 13,551      | 1.6    | 97.3         |
| 9月 末               | 13,595      | 2.0    | 97.5         |
| 10月 末              | 13,802      | 3.5    | 96.9         |
| 11月 末              | 13,616      | 2.1    | 97.8         |
| 12月 末              | 13,784      | 3.4    | 97.7         |
| 2022年1月 末          | 13,567      | 1.7    | 97.3         |
| 2月 末               | 13,386      | 0.4    | 98.0         |
| 3月 末               | 13,742      | 3.1    | 98.0         |
| (期末)<br>2022年4月18日 | 13,735      | 3.0    | 97.7         |

(注1) 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。

## ■当期の運用経過（2021年4月20日から2022年4月18日まで）

### 基準価額等の推移



第9期首：13,334円  
 第9期末：13,735円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：3.0%  
 (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

米国やドイツの国債の利回りが上昇（価格は下落）し、グローバル社債のクレジット・スプレッド（米国債と社債の利回り格差）が拡大した環境下、金利上昇の影響を受けて軟調に推移した国債、投資適格社債、ハイイールド債の保有が主な下落要因となりました。一方、対円で主要国通貨は上昇しました。このような中、前期末比では、為替のプラス要因が債券のマイナス要因を上回り、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド   | 騰落率   |
|--|-------|
| DIAMケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス JPY 2 | 3.9%  |
| DIAMマネーマザーファンド                                     | △0.1% |

- (注) DIAMケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス JPY 2の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

## 投資環境

当期のグローバル債券市場は下落しました。期初は、社債を中心にリスク性資産が堅調に推移したため、小幅な上昇となりました。しかし、2021年9月以降、F R B（米連邦準備理事会）を始めとして、主要国の金融当局が金融政策の正常化を進めるとの姿勢を示したことから幅広い国・セクターの債券の金利が上昇し、グローバル債券市場は下落しました。その後も、F R Bが早期の利上げを実施するとの見方や2022年2月にロシアがウクライナ侵攻を実施したことから、市場のリスク回避姿勢が強まり、一段と下落しました。

為替市場では、世界的にインフレ率が高騰し、日銀を除く金融当局が金融政策の正常化を進めたことなどが主因となり、内外金利差が拡大したことから、対円で主要通貨は上昇しました。

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

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

D I A Mケイマン・ファンドー J a n u s グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2 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。

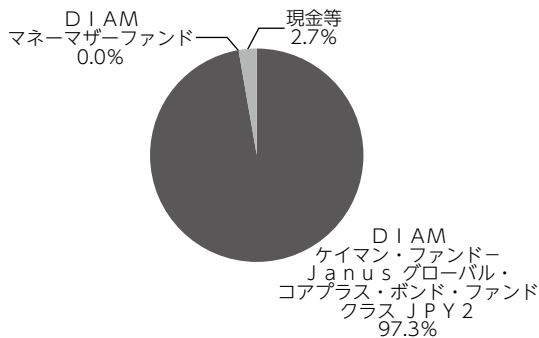
### ●D I A Mケイマン・ファンドー J a n u s グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2

期中は、国債の組入比率を引き上げた一方、インフレ率の高騰を受け金融当局が金融政策の正常化を加速させるとの見通しにより債券市場のボラティリティが高まったことから、社債の組入比率を引き下げました。社債セクター内では相対的に割高感のある投資適格社債を中心に組入比率を引き下げました。通貨については、引き続き米ドルを中心に保有しつつ、早期利上げ観測が強まった局面で、米ドルの比率を引き上げました。

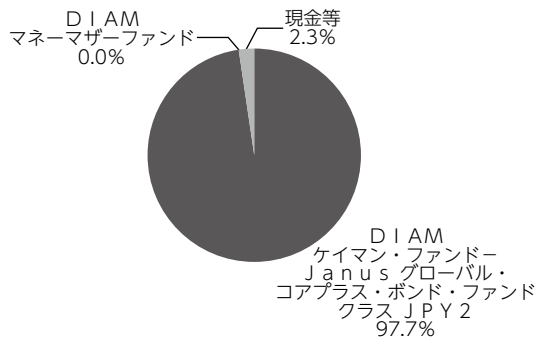
### ●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

**ポートフォリオ構成** ※比率は純資産総額に対する割合です。  
**期首 (前期末)**



**期末**



**分配金**

当期の収益分配金につきましては基準価額水準、市況動向等を勘案し、無分配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          | 当期                        |
|-------------|---------------------------|
|             | 2021年4月20日<br>～2022年4月18日 |
| 当期分配金 (税引前) | －円                        |
| 対基準価額比率     | －%                        |
| 当期の収益       | －円                        |
| 当期の収益以外     | －円                        |
| 翌期繰越分配対象額   | 3,735円                    |

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

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

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

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

引き続き、D I A Mケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2 を高位に組入れることを基本とした運用を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。また、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行います。

### ●D I A Mケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2

世界経済の景気減速リスクについて注視しています。特に、ロシアへのエネルギー依存度が高いユーロ圏は、米国よりもリスクに対して脆弱性があると見ています。主要先進国の金融当局が金融政策の正常化を進めていますが、実際に景気が減速すれば引き締めペースが緩和され、イーールドカーブの正常化を促すと考えます。社債市場では、企業の信用状況は引き続き堅調と見ています。今後も銘柄選択を重視し、機動的にデュレーション\*を調整しつつ、元本保全を重視したポートフォリオを維持していく方針です。

\*金利変動に対する債券価格の変動性。

### ●D I A Mマネーマザーファンド

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

## ■1万口当たりの費用明細

| 項目        | 第9期                         |         | 項目の概要  |
|-----------|-----------------------------|---------|--|
|           | (2021年4月20日<br>～2022年4月18日) |         |  |
|           | 金額                          | 比率      |  |
| (a) 信託報酬  | 106円                        | 0.779%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は13,583円です。 |
| (投信会社)    | ( 33)                       | (0.241) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価         |
| (販売会社)    | ( 67)                       | (0.494) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社)    | ( 6)                        | (0.044) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価             |
| (b) その他費用 | 0                           | 0.003   | (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)    | ( 0)                        | (0.003) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用                     |
| 合計        | 106                         | 0.782   |  |

(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。

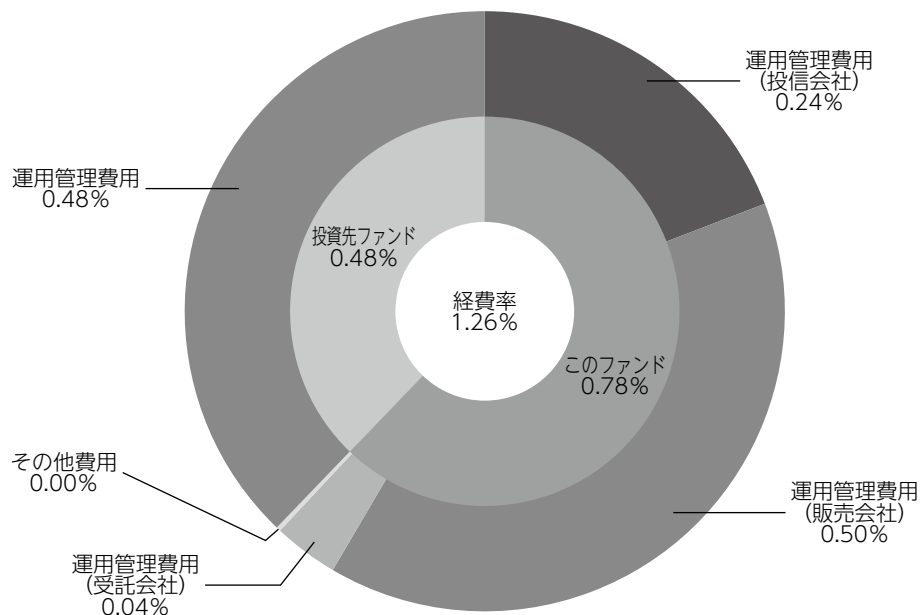
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.26%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) | 1.26% |
| ①このファンドの費用の比率                     | 0.78% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率                | 0.48% |

(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 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

投資信託受益証券

|               |  | 買 付     |        | 売 付 |        |
|---------------|--|---------|--------|-----|--------|
|               |  | □ 数     | 金 額    | □ 数 | 金 額    |
| 外国<br>邦貨<br>建 | DIAMケイマン・ファンドーJanus<br>グローバル・コアプラス・<br>ボンド・ファンド クラス JPY2 | 千□      | 千円     | 千□  | 千円     |
|               |  | 2.29355 | 33,500 | 1.9 | 27,739 |

(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 (2021年4月20日から2022年4月18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 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

【DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>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。

【DIAM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 | 当          |                    |           | 期         |                    |        |
|-------|------------|--------------------|-----------|-----------|--------------------|--------|
|       | 買付額等<br>A  | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A       | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C    |
| 公 社 債 | 百万円<br>911 | 百万円<br>400         | %<br>44.0 | 百万円<br>-  | 百万円<br>-           | %<br>- |

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<br>ア<br>ン<br>ド<br>名                                 | 期首(前期末)  | 当 期 末    |         |      |
|---|----------|----------|---------|------|
|   | □ 数      | □ 数      | 評 価 額   | 比 率  |
|   | 千□       | 千□       | 千円      | %    |
| DIAMケイマン・ファンドーJanus グローバル・<br>コアプラス・ボンド・ファンド グラス JPY2 | 14.06293 | 14.45648 | 214,765 | 97.7 |
| 合 計   | 14.06293 | 14.45648 | 214,765 | 97.7 |

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

### (2) 親投資信託残高

|                             | 期 首 (前期末) | 当 期 末 |       |    |
|-----------------------------|-----------|-------|-------|----|
|                             | □ 数       | □ 数   | 評 価 額 | 千円 |
|                             | 千□        | 千□    | 千円    |    |
| D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド | 9         | 9     | 10    |    |

## ■投資信託財産の構成

2022年4月18日現在

| 項 目                | 当 期 末   |       |
|--------------------|---------|-------|
|                    | 評 価 額   | 比 率   |
|                    | 千円      | %     |
| 投資信託受益証券           | 214,765 | 97.3  |
| D I A M マネーマザーファンド | 10      | 0.0   |
| コール・ローン等、その他       | 5,971   | 2.7   |
| 投資信託財産総額           | 220,746 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月18日)現在

| 項 目                        | 当 期 末        |
|----------------------------|--------------|
| (A) 資 産                    | 220,746,680円 |
| コール・ローン等                   | 5,971,208    |
| 投資信託受益証券(評価額)              | 214,765,466  |
| D I A M マネーマザーファンド(評価額)    | 10,006       |
| (B) 負 債                    | 835,481      |
| 未 払 解 約 金                  | 1,102        |
| 未 払 信 託 報 酬                | 831,344      |
| そ の 他 未 払 費 用              | 3,035        |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)       | 219,911,199  |
| 元 本                        | 160,106,876  |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | 59,804,323   |
| (D) 受 益 権 総 口 数            | 160,106,876口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 13,735円      |

(注) 期首における元本額は155,081,663円、当期中における追加設定元本額は47,499,779円、同解約元本額は42,474,566円です。

## ■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

| 項 目                      | 当 期          |
|--------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益            | △1,103円      |
| 受 取 利 息                  | 174          |
| 支 払 利 息                  | △1,277       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益      | 7,207,129    |
| 買 入 益                    | 7,904,380    |
| 売 出 損                    | △697,251     |
| (C) 信 託 報 酬 等            | △1,677,137   |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 5,528,889    |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金        | 14,105,006   |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金      | 40,170,428   |
| (配 当 等 相 当 額)            | (39,469,734) |
| (売 買 損 益 相 当 額)          | (700,694)    |
| (G) 合 計(D + E + F)       | 59,804,323   |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G)         | 59,804,323   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金          | 40,170,428   |
| (配 当 等 相 当 額)            | (39,469,734) |
| (売 買 損 益 相 当 額)          | (700,694)    |
| 分 配 準 備 積 立 金            | 19,634,998   |
| 繰 越 損 益 金                | △1,103       |

(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                           | 当 期        |
|-------------------------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益               | 0円         |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益           | 5,528,685  |
| (c) 収 益 調 整 金                 | 40,170,428 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金             | 14,106,313 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d)    | 59,805,426 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 3,735.34   |
| (g) 分 配 金                     | 0          |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金         | 0          |

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準、市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

### 《お知らせ》

- 当ファンドが投資対象とする外国投資信託受益証券「D I A Mケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2」において、副投資顧問会社の社名が「ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー」から「ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・U S ・エルエルシー」に変更されたため、約款に所要の変更を行いました。

(2022年1月1日)

# D I A Mケイマン・ファンド Janus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2

当ファンドは「D I A M-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>」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       | ケイマン籍建て外国投資信託  |
| 主要投資対象   | 世界の公社債 <sup>(※1)</sup> を主要投資対象とします。<br>(※1) 主要投資対象となる公社債の主な債券種類は、国債、政府機関債、モーゲージ債、投資適格社債、ハイイールド債等になります。なお、新興国の債券等に投資する場合があります。  |
| 投資態度     | <p>①主として内外債券への投資を通じて、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス」<sup>(※2)</sup>をベンチマークとし、ベンチマークを上回る成果をめざします。</li> <li>・企業ファンダメンタルズに基づくクレジット・リサーチにより、銘柄選択を行います。</li> <li>・各種債券セクターへの投資比率を機動的に変更します。</li> </ul> <p>②ポートフォリオのデュレーションは、ベンチマーク対比で125%から60%の範囲を目安とします。</p> <p>③投資する証券の平均格付<sup>(※2)</sup>は、BBB-格相当以上とします。</p> <p>(※2) 平均格付は時価加重平均で判定します。S&amp;P、Moody's、Fitch（以下、総称して「格付会社」といいます。）による格付が異なる場合は次の対応とします。(a) 格付会社3社の格付が全て異なる場合は中央の格付、(b) 格付会社3社のうち2社の格付が同じ場合は、同2社が付与している格付、(c) 格付会社3社のうち2社のみ格付を付与している場合は、低い方の格付とします。</p> <p>④ハイイールド債券<sup>(※3)</sup>への投資は、信託財産の純資産総額の35%以内とします。</p> <p>(※3) ハイイールド債券とは、格付会社3社のうち1社以上によって、BB+格相当以下に格付けされている債券をさします。また、無格付債券を含みます。</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米ドル建債券への投資割合は、純資産総額の25%以上とします。</p> <p>⑦新興国の発行体が発行する有価証券への投資割合は、純資産総額の30%以内とします。</p> <p>⑧同一発行体の発行する債券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。ただし、各国政府の発行する債券、米国の政府機関および政府支援機関の発行する債券を除きます。</p> <p>⑨通貨配分を調整するために、為替予約取引を行います。ただし、米ドルへの投資割合の合計は、純資産総額の25%以上とします。</p> <p>⑩原則として、現金および現金等価物への投資は信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑪デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定しません。各国の国債先物をファンド全体のデュレーション・コントロールに活用する場合等があります。</p> <p>⑫ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・U S ・エルエルシーに運用の指図にかかる権限を委託します。</p> <p>(注) 「Bloomberg<sup>®</sup>」およびブルームバーグ・グローバル総合インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはアセットマネジメントOne株式会社とは提携しておらず、また、D I A Mケイマン・ファンド・Janus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2を承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、D I A Mケイマン・ファンド・Janus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンド クラス J P Y 2に関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。</p> |
| 主な投資制限   | <p>①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>②転換社債への投資は可としますが、原則として株式への転換は不可とします。</p> <p>③有価証券の空売りは行いません。</p> <p>④流動性に欠ける資産への投資は、純資産総額の15%を超えないものとします。</p> <p>⑤信託財産の純資産総額の10%を超える借入は行いません。</p> <p>⑥投資信託証券（上場投資信託証券を含みます。）への投資は行いません。</p> <p>⑦金融商品取引法上の有価証券および有価証券関連デリバティブ取引への投資比率は信託財産総額の50%以上とします。</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・ヘンダーソン・インベスターズ・U S ・エルエルシー  |
| 受託会社     | FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited.  |
| 管理事務代行会社 | 米国みずほ銀行  |
| 保管銀行     | 米国みずほ銀行  |

D I A Mケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンドはケイマン籍外国投資信託で、2020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。以下は2020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（Janus グローバル・コアプラス・ボンド・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**  
**(自2020年1月1日 至2020年12月31日)**  
(日本円建て)

| 収益の部               | 単位：日本円               |
|--------------------|----------------------|
| 利息収入               | 874,861,799          |
| <b>収益合計</b>        | <b>784,861,799</b>   |
| <br>               |                      |
| 費用の部               |                      |
| 投資運用報酬             | 154,705,839          |
| 管理事務報酬             | 35,051,824           |
| 保管報酬               | 15,396,067           |
| 監査報酬               | 4,140,475            |
| 受託報酬               | 4,362,382            |
| その他費用              | 455,913              |
| <b>費用合計</b>        | <b>214,112,500</b>   |
| <b>純投資収益</b>       | <b>570,749,299</b>   |
| <br>               |                      |
| 投資有価証券による実現純利益     | 1,912,179,348        |
| 為替先渡契約による実現純利益     | 70,515,257           |
| 外貨取引による実現純損失       | (185,904,458)        |
| <b>期中実現純利益額</b>    | <b>1,796,790,147</b> |
| <br>               |                      |
| 投資有価証券による未実現損益の純変動 | 632,060,706          |
| 為替先渡による未実現損益の変動    | 247,390,347          |
| 外貨取引による未実現損益の純変動   | (21,808,937)         |
| <b>期中未実現純増額の変動</b> | <b>857,642,116</b>   |
| <b>運用による純資産の純増</b> | <b>3,225,181,562</b> |

|           | 発行済受益権口数     | 一口当たり純資産価額 (日本円) |
|-----------|--------------|------------------|
| クラス JPY 1 | 3,914,470.00 | 11,370           |
| クラス JPY 2 | 13,326.00    | 14,012           |

(注) D I A Mケイマン・ファンドーJanus グローバル・コアプラス・ボンド・ファンドは複数のクラスで構成されています。  
上記のクラス JPY 2は、「D I A Mージャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>」が投資するクラス JPY2です。

投資有価証券明細表  
2020年12月31日現在

| 国・地域/<br>投資タイプ                                | 銘柄                                    | 通貨   | 口数         | 償却原価<br>(日本円)        | 公正価値<br>(日本円)        | 対純資産%        |
|---|---------------------------------------|------|------------|----------------------|----------------------|--------------|
| <b>政府系発行体</b>                                 |                                       |      |            |                      |                      |              |
| <b>米国</b>                                     |                                       |      |            |                      |                      |              |
| FNMA SF 15年物                                  | FN BO4725 2.500% 11/01/34             | USD  | 922,630    | 101,569,495          | 101,638,511          | 0.23%        |
|   | FR QN0951 2.500% 11/01/34             | USD  | 774,584    | 85,271,506           | 85,376,795           | 0.19%        |
|   | FR ZK9085 3.000% 12/01/32             | USD  | 955,440    | 106,889,529          | 104,714,972          | 0.23%        |
|   | FR ZS7403 3.000% 05/01/31             | USD  | 644,489    | 71,863,809           | 70,539,936           | 0.16%        |
|   | FR ZS8087 2.500% 04/01/33             | USD  | 886,005    | 96,697,944           | 95,549,685           | 0.21%        |
| FNMA SF 30年物                                  | FN AB7563 3.000% 01/01/43             | USD  | 21,024     | 2,350,668            | 2,314,755            | 0.01%        |
|   | FN AS6811 3.000% 03/01/46             | USD  | 4,867,965  | 548,531,942          | 529,374,194          | 1.18%        |
|   | FN BM4896 3.000% 02/01/47             | USD  | 6,045,120  | 678,681,473          | 663,776,823          | 1.49%        |
|   | FN CA5327 2.500% 03/01/50             | USD  | 1,260,721  | 139,485,967          | 138,919,104          | 0.31%        |
|   | FN FM1743 3.000% 01/01/47             | USD  | 208,673    | 23,252,769           | 22,901,624           | 0.05%        |
|   | FNMA POOL# BJ9181 5.000% 05/01/48     | USD  | 471,238    | 55,105,365           | 54,023,333           | 0.12%        |
|   | FR QA4841 3.000% 11/01/49             | USD  | 118,726    | 13,098,454           | 12,871,054           | 0.03%        |
|   | FR QA4865 3.000% 11/01/49             | USD  | 309,176    | 34,257,561           | 33,536,910           | 0.08%        |
|   | FR QA4936 3.000% 12/01/49             | USD  | 154,846    | 17,157,358           | 16,794,328           | 0.04%        |
|   | FR SD7509 3.000% 11/01/49             | USD  | 15,572,753 | 1,816,985,415        | 1,727,447,568        | 3.87%        |
| GNMA2 SF 30年物                                 | GNMA2 POOL# MA5192 4.000% 05/20/48    | USD  | 1,658,691  | 188,316,158          | 184,265,490          | 0.41%        |
|   | GNMA2 POOL# MA5264 4.000% 06/20/48    | USD  | 154,369    | 17,511,126           | 17,128,628           | 0.04%        |
|   | GNMA2 POOL# MA5876 4.000% 04/20/49    | USD  | 1,174,131  | 134,177,629          | 129,691,532          | 0.28%        |
| <b>政府機関系発行体 合計</b>                            |                                       |      |            | <b>4,131,204,168</b> | <b>3,990,865,242</b> | <b>8.93%</b> |
| <b>CMO (不動産抵当証券担保債券)・CMBS (商業用不動産担保証券)</b>    |                                       |      |            |                      |                      |              |
| <b>オーストラリア</b>                                |                                       |      |            |                      |                      |              |
| WL担保付CMOその他                                   | RESI 2018-1NCA A1 FLOAT 12/05/59      | USD  | 468,625    | 51,902,598           | 48,251,166           | 0.11%        |
| <b>イギリス</b>                                   |                                       |      |            |                      |                      |              |
| WL担保付CMOその他                                   | MFD 2008-1 A1 FLOAT 03/13/46          | GBP  | 744,514    | 113,920,414          | 105,273,220          | 0.24%        |
|   | RMACS 2006-NS2X A2A FLOAT 06/12/44    | GBP  | 362,275    | 50,331,033           | 49,061,049           | 0.11%        |
|   | RMACS 2006-NS3X A2A FLOAT 06/12/44    | GBP  | 1,242,719  | 171,726,612          | 167,683,830          | 0.38%        |
|   | RMACS 2006-NS4X A3A FLOAT 06/12/44    | GBP  | 1,249,198  | 173,948,114          | 169,217,917          | 0.38%        |
|   | STRA 2018-1 A FLOAT 03/12/44          | GBP  | 1,426,282  | 213,327,004          | 201,378,273          | 0.45%        |
| <b>米国</b>                                     |                                       |      |            |                      |                      |              |
| WL担保サポート債                                     | JPMMT 2019-1 A15 FLOAT 05/25/49       | USD  | 1,219,807  | 132,009,283          | 128,921,158          | 0.28%        |
|   | JPMMT 2019-LTV2 A15 FLOAT 12/25/49    | USD  | 1,117,383  | 120,056,023          | 118,754,605          | 0.26%        |
| <b>CMO (不動産抵当証券担保債券)・CMBS (商業用不動産担保証券) 合計</b> |                                       |      |            | <b>1,027,221,081</b> | <b>988,541,218</b>   | <b>2.21%</b> |
| <b>社債</b>                                     |                                       |      |            |                      |                      |              |
| <b>ベルギー</b>                                   |                                       |      |            |                      |                      |              |
| 電力-送電   | ELIA TRANS BE 0.875% 04/28/30 EMTN    | EURO | 300,000    | 34,691,013           | 39,979,336           | 0.09%        |
| 不動産投資法人-総合型                                   | COFINIMMO 0.875% 12/02/30             | EURO | 500,000    | 61,643,205           | 64,315,356           | 0.14%        |
| <b>バミューダ</b>                                  |                                       |      |            |                      |                      |              |
| 石油会社-探査・生産                                    | TENGIZCH FIN INT 2.625% 08/15/25 REGS | USD  | 1,180,000  | 125,329,901          | 126,981,984          | 0.28%        |
| <b>ブラジル</b>                                   |                                       |      |            |                      |                      |              |
| 金融-投資銀行                                       | BANCO PACTUAL/KY 4.500% 01/10/25 REGS | USD  | 1,200,000  | 128,662,017          | 132,567,819          | 0.30%        |
| <b>英領バージン諸島</b>                               |                                       |      |            |                      |                      |              |
| カジノホテル  | STUDIO CITY FIN 7.250% 02/11/24 REGS  | USD  | 1,200,000  | 129,221,944          | 129,673,036          | 0.29%        |
| 半導体部品 内蔵部品                                    | TSMC GLOBAL LTD 0.750% 09/28/25 REGS  | USD  | 2,100,000  | 220,892,878          | 216,091,424          | 0.48%        |
| <b>ケイマン諸島</b>                                 |                                       |      |            |                      |                      |              |
| カジノホテル  | MELCO RESORTS 5.750% 07/21/28 REGS    | USD  | 1,200,000  | 126,839,195          | 132,163,925          | 0.30%        |
| 商業銀行(米国外)                                     | DIB SUKUK LTD 2.950% 01/16/26 EMTN    | USD  | 1,313,000  | 140,264,167          | 141,826,842          | 0.32%        |
| 多角的事業   | CK HUTCHISON CAP FxtoVA PERP REGS     | USD  | 800,000    | 85,238,827           | 84,558,398           | 0.19%        |
| 電力-総合   | SAUDI ELEC 1.740% 09/17/25            | USD  | 1,259,000  | 133,680,620          | 130,892,623          | 0.29%        |
|   | SAUDI ELEC GLOBA 5.060% 04/08/43 REGS | USD  | 600,000    | 76,047,994           | 79,034,027           | 0.18%        |
| 電子部品 その他                                      | FOXCONN FAR EAST 1.625% 10/28/25      | USD  | 1,570,000  | 165,253,557          | 165,880,857          | 0.37%        |

| 国・地域/<br>投資タイプ       | 銘柄                                    | 通貨  | 口数        | 償却原価<br>(日本円) | 公正価値<br>(日本円) | 対純資産% |
|----------------------|---------------------------------------|-----|-----------|---------------|---------------|-------|
| <b>社債 (続き)</b>       |                                       |     |           |               |               |       |
| <b>ケイマン諸島 (続き)</b>   |                                       |     |           |               |               |       |
| インターネットコンテンツ<br>情報   | TENCENT HOLD 3.240% 06/03/50 REGS     | USD | 255,000   | 27,482,251    | 27,252,280    | 0.06% |
|                      | TENCENT MUSIC 1.375% 09/03/25         | USD | 437,000   | 46,351,968    | 45,207,624    | 0.10% |
|                      | TENCENT MUSIC 2.000% 09/03/30         | USD | 625,000   | 66,071,945    | 64,226,972    | 0.14% |
| 不動産運用・開発             | COUNTRY GARDEN 4.800% 08/06/30        | USD | 2,021,000 | 221,441,671   | 225,258,153   | 0.50% |
| <b>フランス</b>          |                                       |     |           |               |               |       |
| 化学 - 特殊化学品           | FIRMENICH 1.375% 10/30/26             | EUR | 905,000   | 106,411,571   | 122,474,566   | 0.27% |
|                      | FIRMENICH 1.750% 04/30/30             | EUR | 330,000   | 38,205,775    | 46,388,218    | 0.10% |
| 総合型銀行                | CREDIT AGRICOLE FXtoFL 06/16/26 144A  | USD | 620,000   | 66,783,300    | 66,464,452    | 0.15% |
| 電力 - 発電事業者           | ENGIE 1.750% 03/27/28 EMTN            | EUR | 800,000   | 100,801,979   | 113,101,253   | 0.25% |
| 生命保険・健康保険            | CRDT AGR ASSR 2.000% 07/17/30         | EUR | 700,000   | 84,616,777    | 94,942,520    | 0.21% |
| 石油会社 - 総合            | TOTAL CAP INTL 3.127% 05/29/50        | USD | 1,200,000 | 129,114,000   | 134,662,495   | 0.30% |
| リート (不動産投資法人) - 総合型  | URW 1.375% 12/04/31 EMTN              | EUR | 700,000   | 86,748,420    | 89,178,090    | 0.20% |
| <b>ドイツ</b>           |                                       |     |           |               |               |       |
| 自動車・小型トラック           | VOLKSWAGEN LEAS 1.625% 08/15/25 EMTN  | EUR | 811,000   | 101,836,971   | 108,992,760   | 0.24% |
| 化学 - 総合型             | BASF SE 0.250% 06/05/27 EMTN          | EUR | 700,000   | 83,099,460    | 90,510,873    | 0.20% |
| 電子部品 - 半導体           | INFINEON TECH 1.125% 06/24/26 EMTN    | EUR | 700,000   | 83,769,613    | 93,425,011    | 0.21% |
| 不動産運用・開発             | PEACH PROPERTY 4.375% 11/15/25 REGS   | EUR | 930,000   | 114,555,726   | 123,085,721   | 0.28% |
| 運輸 - 鉄道              | DEUTSCH BAHN FIN 0.375% 06/23/29 EMTN | EUR | 680,000   | 82,006,853    | 89,271,437    | 0.20% |
| <b>イギリス</b>          |                                       |     |           |               |               |       |
| 航空宇宙産業・防衛            | BAE SYSTEMS PLC 3.400% 04/15/30 144A  | USD | 373,000   | 40,368,923    | 43,696,155    | 0.10% |
| 商業銀行 (米国外)           | STANDARD CHART FXtoVA 09/09/30        | EUR | 530,000   | 64,264,899    | 71,821,781    | 0.16% |
| 総合型銀行                | NATWEST GROUP FXtoVA PERP             | GBP | 230,000   | 31,877,908    | 34,022,226    | 0.08% |
|                      | ROYAL BK SCOTLND FXtoVA 08/14/30      | GBP | 430,000   | 56,372,570    | 65,388,093    | 0.15% |
|                      | HSBC HOLDINGS FXtoFL 06/04/26         | USD | 2,000,000 | 215,250,000   | 214,798,951   | 0.48% |
| 電力 - 送電              | NATL GRID ELECT 0.823% 07/07/32 EMTN  | EUR | 810,000   | 97,885,827    | 107,308,267   | 0.24% |
| 食品 - 小売              | TESCO CORP TREAS 2.750% 04/27/30 EMTN | GBP | 1,587,000 | 214,606,158   | 249,076,755   | 0.56% |
| 生命保険・健康保険            | AVIVA PLC FXtoVA 06/03/55             | GBP | 210,000   | 27,398,178    | 34,415,976    | 0.08% |
| 複合種目保険               | DIRECT LINE INS 4.000% 06/05/32       | GBP | 200,000   | 26,533,071    | 33,114,903    | 0.07% |
| マルチメディア              | PEARSON FUNDING 3.750% 06/04/30       | GBP | 160,000   | 21,055,079    | 26,083,117    | 0.06% |
| 石油会社 - 探査・生産         | GAZPROM PJSC 3.000% 06/29/27          | USD | 2,035,000 | 216,188,225   | 215,614,382   | 0.48% |
| 水                    | THAMES WATER UTL 2.375% 04/22/40 EMTN | GBP | 813,000   | 108,661,892   | 126,462,488   | 0.28% |
| <b>香港</b>            |                                       |     |           |               |               |       |
| コンピューター              | LENOVO GROUP LTD 3.421% 11/02/30 REGS | USD | 342,000   | 35,682,570    | 37,158,681    | 0.08% |
| 生命保険・健康保険            | AIA GROUP 3.375% 04/07/30 144A        | USD | 901,000   | 96,981,489    | 104,672,364   | 0.23% |
| <b>マン島</b>           |                                       |     |           |               |               |       |
| 金鉱山                  | ANGLOGOLD HOLDS 3.750% 10/01/30       | USD | 360,000   | 37,902,560    | 40,031,675    | 0.09% |
| <b>日本</b>            |                                       |     |           |               |               |       |
| 医療 - 医薬品             | TAKEDA PHARM 2.000% 07/09/40          | EUR | 660,000   | 79,390,308    | 95,076,746    | 0.21% |
|                      | TAKEDA PHARMA 3.000% 11/21/30 REGS    | EUR | 864,000   | 120,613,032   | 134,623,334   | 0.30% |
| <b>チャネル諸島 ジャージー島</b> |                                       |     |           |               |               |       |
| 空港開発・メンテナンス          | HEATHROW FNDG 2.750% 10/13/29 EMTN    | GBP | 300,000   | 40,762,467    | 45,543,855    | 0.10% |
| <b>ルクセンブルク大公国</b>    |                                       |     |           |               |               |       |
| 携帯電話通信               | MILLICOM INTL 4.500% 04/27/31 REGS    | USD | 1,200,000 | 128,420,571   | 133,960,387   | 0.30% |
| ダイヤモンド・宝石            | ALROSA FINANCE S 3.100% 06/25/27 REGS | USD | 1,020,000 | 109,424,326   | 108,666,653   | 0.24% |
| 食品 - ケータリング          | ARAMARK INTL FIN 3.125% 04/01/25 REGS | EUR | 1,100,000 | 131,765,788   | 140,116,849   | 0.31% |
| 医療機器                 | MEDTRONIC GLOBAL 0.250% 07/02/25      | EUR | 460,000   | 55,649,403    | 59,045,017    | 0.13% |
| 不動産運用・開発             | CPI PROPERTY GRO 2.750% 05/12/26 EMTN | EUR | 870,000   | 97,538,930    | 119,462,909   | 0.27% |
| 小売 - 地域のデパート         | JSM GLOBAL SARL 4.750% 10/20/30 REGS  | USD | 1,200,000 | 129,278,630   | 133,574,458   | 0.30% |
| 衛星通信                 | SES 2.000% 07/02/28 GMTN              | EUR | 890,000   | 106,420,383   | 121,214,293   | 0.27% |
| <b>モーリシャス</b>        |                                       |     |           |               |               |       |
| 携帯電話通信               | MTN MU INVST 4.755% 11/11/24 REGS     | USD | 1,200,000 | 129,342,113   | 131,117,020   | 0.29% |
| 金属加工・工場              | HTA GROUP LTD 7.000% 12/18/25 REGS    | USD | 1,200,000 | 132,173,134   | 134,040,919   | 0.30% |
| <b>メキシコ</b>          |                                       |     |           |               |               |       |
| 飲料 - ソフトドリンク         | FEMSA 3.500% 01/16/50                 | USD | 790,000   | 86,636,325    | 90,885,856    | 0.20% |
| 消費財 - その他            | KIMBERLY-CLA MEX 2.431% 07/01/31      | USD | 700,000   | 74,674,146    | 74,793,414    | 0.17% |

| 国・地域/<br>投資タイプ   | 銘柄                               | 通貨  | 口数        | 償却原価<br>(日本円) | 公正価値<br>(日本円) | 対純資産% |
|------------------|----------------------------------|-----|-----------|---------------|---------------|-------|
| <b>社債 (続き)</b>   |                                  |     |           |               |               |       |
| <b>メキシコ (続き)</b> |                                  |     |           |               |               |       |
| 食品 - 製パン         | GRUPO BIMBO SAB 4.000%           | USD | 569,000   | 61,735,661    | 66,715,061    | 0.15% |
| 石油会社 - 総合        | PETROLEOS MEXICA 6.500%          | USD | 1,300,000 | 133,295,336   | 141,592,464   | 0.32% |
| <b>オランダ</b>      |                                  |     |           |               |               |       |
| 化学 - 特殊化学品       | GIVAUDAN FIN EUR 1.625%          | EUR | 150,000   | 17,526,665    | 21,652,995    | 0.05% |
| 総合型製造業           | SIEMENS FINAN 0.875%             | GBP | 500,000   | 65,639,390    | 71,596,219    | 0.16% |
|                  | SIEMENS FINAN 0.250%             | EUR | 400,000   | 47,242,411    | 51,432,629    | 0.12% |
|                  | SIEMENS FINAN 0.375%             | EUR | 300,000   | 35,479,376    | 39,029,811    | 0.09% |
| 電力 - 総合          | ENEXIS HOLDING 0.750%            | EUR | 845,000   | 103,883,902   | 113,565,966   | 0.25% |
| インターネットコンテンツ・情報  | PROSUS NV 4.027%                 | USD | 730,000   | 78,864,419    | 79,315,842    | 0.18% |
| 照明システム・製品        | SIGNIFY NV 2.375%                | EUR | 912,000   | 108,153,797   | 127,842,558   | 0.29% |
| 石油会社 - 総合        | LUKOIL SECURITIS 3.875%          | USD | 1,800,000 | 192,510,000   | 201,289,962   | 0.45% |
|                  | PETROBRAS GLOB 5.600%            | USD | 1,163,000 | 133,186,002   | 138,181,085   | 0.31% |
| 小売 - 石油製品        | VIVO ENERGY INVE 5.125%          | USD | 1,325,000 | 138,747,375   | 145,874,912   | 0.33% |
| <b>ノルウェイ</b>     |                                  |     |           |               |               |       |
| 石油会社 - 総合        | EQUINOR ASA 3.000%               | USD | 2,000,000 | 213,171,704   | 230,218,385   | 0.52% |
| <b>ポーランド</b>     |                                  |     |           |               |               |       |
| 容器 - 金属・ガラス      | CANPACK EASTERN 2.375%           | EUR | 410,000   | 50,503,062    | 53,541,442    | 0.12% |
| <b>サウジアラビア</b>   |                                  |     |           |               |               |       |
| 石油会社 - 総合        | SAUDI ARAB OIL 3.250%            | USD | 635,000   | 65,549,172    | 66,608,757    | 0.15% |
| <b>シンガポール</b>    |                                  |     |           |               |               |       |
| 通信サービス           | SINGTEL GROUP TR 1.875%          | USD | 815,000   | 88,083,058    | 85,951,429    | 0.19% |
| <b>スペイン</b>      |                                  |     |           |               |               |       |
| 電力 - 供給会社        | IE2 HOLDCO 2.875%                | EUR | 800,000   | 107,363,455   | 115,087,290   | 0.26% |
| <b>超国家機関</b>     |                                  |     |           |               |               |       |
| ソブリン債            | EUROPEAN UNION 0.000%            | EUR | 9,227,000 | 1,171,658,500 | 1,214,665,923 | 2.72% |
|                  | EUROPEAN UNION 0.1%              | EUR | 1,732,000 | 215,453,791   | 226,174,474   | 0.51% |
| <b>スウェーデン</b>    |                                  |     |           |               |               |       |
| 不動産運用・開発         | AKELIUS RESIDENT 1.125%          | EUR | 1,100,000 | 136,212,167   | 143,146,688   | 0.32% |
| <b>スイス</b>       |                                  |     |           |               |               |       |
| 総合型銀行            | CREDIT SUISSE FxtoVA 06/09/28    | GBP | 720,000   | 97,863,883    | 107,872,695   | 0.24% |
| <b>タイ</b>        |                                  |     |           |               |               |       |
| 石油会社 - 探索・生産     | PTTEP TREASURY 2.587%            | USD | 505,000   | 55,047,525    | 54,543,154    | 0.12% |
| <b>トルコ</b>       |                                  |     |           |               |               |       |
| 家電               | ARCELIK 5.000%                   | USD | 1,200,000 | 126,823,371   | 128,899,318   | 0.29% |
| <b>アラブ首長国連邦</b>  |                                  |     |           |               |               |       |
| 地方銀行 (米国外)       | EMIRATES NBD FxtoVA PERP         | USD | 1,200,000 | 130,262,199   | 132,814,987   | 0.30% |
| <b>米国</b>        |                                  |     |           |               |               |       |
| 農業               | ARCHER-DANIELS 2.750%            | USD | 985,000   | 108,458,387   | 110,737,433   | 0.25% |
| 運動靴              | NIKE INC 2.750%                  | USD | 295,000   | 32,869,051    | 33,730,214    | 0.08% |
| 自動車・小型トラック       | GENERAL MOTORS C 5.400%          | USD | 1,031,000 | 109,754,252   | 119,268,457   | 0.27% |
| 飲料・ソフトドリンク       | COCA-COLA CO/THE 1.000%          | USD | 2,100,000 | 221,700,218   | 218,329,600   | 0.49% |
| CATV・衛星放送        | COMCAST CORP 2.800%              | USD | 1,037,000 | 110,572,291   | 111,840,060   | 0.25% |
| 化学 - 特殊化学品       | ECOLAB INC 4.800%                | USD | 198,000   | 22,024,597    | 26,104,165    | 0.06% |
| 商業銀行 米国西部        | SVB FINANCIAL GR 3.125%          | USD | 463,000   | 50,236,143    | 53,931,042    | 0.12% |
| 商業サービス - 金融      | GLOBAL PAY INC 2.900%            | USD | 1,402,000 | 148,915,578   | 157,740,757   | 0.35% |
|                  | PAYPAL HOLDING 2.300%            | USD | 573,000   | 61,540,176    | 63,454,179    | 0.14% |
| コンピュータ           | APPLE INC 2.650%                 | USD | 1,000,000 | 105,397,042   | 109,802,400   | 0.25% |
| コンピュータ製品-その他     | CLOROX CO 1.800%                 | USD | 463,000   | 48,918,334    | 49,435,557    | 0.11% |
| 化粧品・トイレットリー      | PROCTER & GAMBLE 3.000%          | USD | 1,024,000 | 113,753,854   | 122,014,459   | 0.27% |
| データ処理・管理         | FISERV INC 1.625%                | EUR | 826,000   | 103,483,378   | 115,045,859   | 0.26% |
| 歯科用消耗品・機材        | DENTSPLY SIRONA 3.250%           | USD | 1,445,000 | 154,914,459   | 166,355,759   | 0.37% |
| 総合型銀行            | BANK OF AMER CRP FxtoFL 03/31/29 | EUR | 777,000   | 106,836,669   | 122,165,963   | 0.27% |
|                  | JPMORGAN CHASE FxtoFL 03/11/27   | EUR | 818,000   | 102,818,074   | 108,819,155   | 0.24% |
|                  | CITIGROUP INC FxtoFL 03/26/41    | USD | 754,000   | 82,985,240    | 109,914,133   | 0.25% |



| 国・地域/<br>投資タイプ         | 銘柄                                    | 通貨  | 口数         | 償却原価<br>(日本円)         | 公正価値<br>(日本円)         | 対純資産%         |
|------------------------|---------------------------------------|-----|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|
| <b>社債 (続き)</b>         |                                       |     |            |                       |                       |               |
| <b>米国 (続き)</b>         |                                       |     |            |                       |                       |               |
| 総合型銀行                  | GOLDMAN SACHS GP 3.500% 04/01/25      | USD | 1,863,000  | 203,878,503           | 213,860,811           | 0.48%         |
|                        | JPMORGAN CHASE FxtoFL 03/24/31        | USD | 1,556,000  | 171,253,360           | 197,926,265           | 0.44%         |
| eコマース・ネット商品            | AMAZON.COM INC 2.700% 06/03/60        | USD | 1,004,000  | 106,706,675           | 111,254,866           | 0.25%         |
| 電力 - 総合                | AMEREN CORP 3.500% 01/15/31           | USD | 389,000    | 41,894,968            | 46,415,415            | 0.10%         |
|                        | BERKSHIRE HATHAW 3.700% 07/15/30 144A | USD | 324,000    | 36,099,163            | 39,679,157            | 0.09%         |
|                        | BLACK HILLS CORP 2.500% 06/15/30      | USD | 293,000    | 31,340,139            | 31,836,955            | 0.07%         |
|                        | PACIFICORP 3.300% 03/15/51            | USD | 444,000    | 48,054,461            | 52,844,334            | 0.12%         |
| 電力 - 送電                | AEP TRANSMISSION 3.650% 04/01/50 M    | USD | 385,000    | 41,597,744            | 48,419,766            | 0.11%         |
| 電子計測器                  | AGILENT TECH INC 2.100% 06/04/30      | USD | 2,000,000  | 214,705,593           | 214,088,006           | 0.48%         |
| エンタープライズ向けソフト          | INFOR INC 1.450% 07/15/23 144A        | USD | 285,000    | 30,937,132            | 29,918,809            | 0.07%         |
| エンターテインメントソフト          | ACTIVISIONBLIZZ1.350%09/15/30         | USD | 335,000    | 35,227,769            | 34,016,250            | 0.08%         |
|                        | ACTIVISIONBLIZZ2.500%09/15/50         | USD | 1,400,000  | 147,384,575           | 141,569,317           | 0.32%         |
| 金融 - クレジットカード          | VISA INC 1.900%04/15/27               | USD | 433,000    | 46,612,695            | 47,635,414            | 0.11%         |
| 食品 - 製菓                | HERSHEY COMPANY 1.700%06/01/30        | USD | 1,200,000  | 129,105,669           | 127,629,652           | 0.29%         |
| 食品 - その他・各種            | KELLOGG CO 2.100%06/01/30             | USD | 2,000,000  | 214,611,139           | 217,262,790           | 0.49%         |
|                        | MARS INC 4.125%04/01/54 144A          | USD | 878,000    | 103,579,227           | 120,233,444           | 0.27%         |
|                        | MCCORMICK 2.500%04/15/30              | USD | 388,000    | 41,658,220            | 42,966,867            | 0.10%         |
| 食品 - 卸売り・流通            | SYSCO CORP 5.950%04/01/30             | USD | 410,000    | 44,222,675            | 55,705,348            | 0.12%         |
| ガス - 販売                | EASTOHI OGASCO 2.000%06/15/30 144A    | USD | 170,000    | 18,402,964            | 18,229,425            | 0.04%         |
|                        | EASTOHI OGASCO 3.000%06/15/50 144A    | USD | 185,000    | 19,802,169            | 20,923,375            | 0.05%         |
| 保険会社                   | WILLIS NORTHAM 2.950%09/15/29         | USD | 674,000    | 74,496,743            | 76,279,811            | 0.17%         |
| 医療 - バイオメディカル          | BIODIAG INC 2.250%05/01/30            | USD | 1,900,000  | 203,615,509           | 205,167,142           | 0.46%         |
| 医療 - 医薬品               | UPJOHN INC 2.700%06/22/30 144A        | USD | 716,000    | 76,547,075            | 78,506,155            | 0.18%         |
| 医療 - HMO               | HEALTHCARE SVCS 2.200%06/01/30 144A   | USD | 2,000,000  | 214,386,847           | 216,284,027           | 0.48%         |
| 相互保険                   | MASS MUTUAL LIFE 3.375%04/15/50 144A  | USD | 935,000    | 100,317,208           | 105,756,747           | 0.24%         |
| リート - 総合型              | EQUINIX INC 2.150%07/15/30            | USD | 1,622,000  | 175,615,869           | 170,692,921           | 0.38%         |
| リート - 商業施設             | AGREE LP 2.900%10/01/30               | USD | 299,000    | 31,939,767            | 32,861,448            | 0.07%         |
| 小売 - 建築資材              | HOME DEPOT INC 2.700%04/15/30         | USD | 1,567,000  | 170,588,375           | 180,716,015           | 0.40%         |
| 小売 - ディスカウント           | DOLLAR GENERAL 3.500%04/03/30         | USD | 422,000    | 45,172,244            | 50,094,778            | 0.11%         |
| 半導体装置                  | APPLIED MATERIAL 1.750%06/01/30       | USD | 2,000,000  | 214,365,822           | 214,558,803           | 0.48%         |
| ソフトウェアツール              | VMWARE INC 4.650%05/15/27             | USD | 1,194,000  | 128,858,978           | 144,448,040           | 0.32%         |
| スーパーリージョナルバンク (大型地方銀行) | WELLS FARGO CO FxtoFL 06/02/24 MTN    | USD | 1,780,000  | 191,519,100           | 188,945,170           | 0.42%         |
|                        | WELLS FARGO CO FxtoFL 06/02/28 MTN    | USD | 2,000,000  | 215,190,000           | 220,030,375           | 0.49%         |
| 通信サービス                 | VERIZON COMMUNICATION 3.250%02/17/26  | EUR | 708,000    | 99,391,153            | 104,688,075           | 0.23%         |
| 電話 - 総合                | AT&T INC 2.750%06/01/31               | USD | 2,000,000  | 215,292,820           | 220,856,129           | 0.49%         |
|                        | AT&T INC 3.850%06/01/60               | USD | 967,000    | 103,817,784           | 105,084,198           | 0.24%         |
|                        | VERIZON COMMUNICATION 3.000%03/22/27  | USD | 553,000    | 59,354,213            | 63,431,516            | 0.14%         |
| タバコ                    | ALTRIA GROUP INC 3.400%05/06/30       | USD | 1,136,000  | 121,089,038           | 131,802,848           | 0.29%         |
|                        | BAT CAPITAL CORP 4.700%04/02/27       | USD | 638,000    | 68,958,230            | 77,559,392            | 0.17%         |
| 運輸 - サービス              | UNITED PARCEL 4.450%04/01/30          | USD | 553,000    | 60,633,726            | 71,500,223            | 0.16%         |
| ウェブポータル・ISP            | ALPHABET INC 1.100%08/15/30           | USD | 964,000    | 101,995,345           | 98,256,708            | 0.23%         |
| <b>社債合計</b>            |                                       |     |            | <b>15,239,837,153</b> | <b>16,030,435,601</b> | <b>35.87%</b> |
| <b>ソブリン債</b>           |                                       |     |            |                       |                       |               |
| <b>オーストラリア</b>         |                                       |     |            |                       |                       |               |
| ソブリン債                  | AUSTRALIAN GOVT 1.750%06/21/51 162    | AUD | 1,495,000  | 108,964,674           | 113,468,146           | 0.25%         |
| <b>ベルギー</b>            |                                       |     |            |                       |                       |               |
| ソブリン債                  | BELGIAN 03402.150%06/22/66 80         | EUR | 1,600,950  | 255,525,639           | 342,085,002           | 0.77%         |
| <b>カナダ</b>             |                                       |     |            |                       |                       |               |
| ソブリン債                  | CANADA-GOV'T 1.000%06/01/27           | CAD | 2,759,000  | 217,328,987           | 230,699,502           | 0.52%         |
|                        | CANADA-GOV'T 2.250%06/01/29           | CAD | 9,073,000  | 795,911,862           | 832,699,980           | 1.86%         |
| <b>中国</b>              |                                       |     |            |                       |                       |               |
| ソブリン債                  | CHINA GOVT BOND 2.200%02/13/22 11BK   | CNY | 45,010,000 | 692,122,068           | 707,126,312           | 1.58%         |
|                        | CHINA GOVT BOND 2.680%05/21/30 11BK   | CNY | 35,590,000 | 528,768,580           | 539,228,849           | 1.21%         |
|                        | CHINA GOVT BOND 3.290%05/23/29 1906   | CNY | 47,570,000 | 745,102,017           | 754,860,233           | 1.69%         |

| 国・地域/<br>投資タイプ | 銘柄                                   | 通貨  | 口数              | 償却原価<br>(日本円)         | 公正価値<br>(日本円)         | 対純資産%         |
|----------------|--------------------------------------|-----|-----------------|-----------------------|-----------------------|---------------|
| ソブリン債 (続き)     |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| 中国 (続き)        |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | CHINAGOVTBOND4.280%10/23/471722      | CNY | 45,460,000      | 824,880,423           | 796,324,415           | 1.78%         |
| フランス           |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | FRANCEO.A.T.0.000%11/25/30           | EUR | 2,040,321       | 259,999,333           | 266,668,507           | 0.60%         |
|                | FRANCEO.A.T.4.000%04/25/60           | EUR | 290,899         | 69,557,704            | 84,484,710            | 0.19%         |
| イギリス           |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | UKTSYGILT1.500%07/22/47              | GBP | 3,153,413       | 432,928,160           | 526,816,029           | 1.18%         |
|                | UKTSYGILT1.625%10/22/28              | GBP | 7,110,948       | 1,096,284,805         | 1,126,402,179         | 2.52%         |
| インドネシア         |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | INDONESIAGOV'T8.375%03/15/34FR68     | IDR | 136,007,000,000 | 1,151,992,111         | 1,159,910,212         | 2.60%         |
| イタリア           |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | BTPS 0.950% 03/15/23                 | EUR | 2,226,000       | 273,019,560           | 289,661,377           | 0.65%         |
|                | BTPS 1.850% 07/01/25                 | EUR | 4,098,000       | 477,517,747           | 563,493,713           | 1.26%         |
|                | BTPS 3.000% 08/01/29                 | EUR | 2,232,000       | 313,512,736           | 344,299,271           | 0.77%         |
|                | BTPS 3.450% 03/01/48                 | EUR | 1,253,000       | 198,568,530           | 233,215,182           | 0.52%         |
| 日本             |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | JAPAN GOVT 10-YR 0.400% 06/20/25 339 | JPY | 793,750,000     | 808,526,836           | 812,272,950           | 1.82%         |
|                | JAPAN GOVT 20-YR 2.100% 12/20/29 114 | JPY | 1,827,800,000   | 2,175,907,957         | 2,175,471,321         | 4.87%         |
|                | JAPAN GOVT 30-YR 0.500% 09/20/46 52  | JPY | 141,000,000     | 132,923,964           | 139,734,102           | 0.31%         |
|                | JAPAN GOVT 30-YR 0.700% 06/20/48 59  | JPY | 421,550,000     | 405,855,693           | 433,958,324           | 0.97%         |
|                | JAPAN GOVT 40-YR 0.800% 03/20/58 11  | JPY | 33,950,000      | 31,978,863            | 35,383,369            | 0.08%         |
|                | JAPAN I/L-10YR 0.100% 03/10/29       | JPY | 1,917,299,992   | 1,992,790,130         | 1,927,078,222         | 4.31%         |
| メキシコ           |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | MEXICAN BONOS 8.00% 12/07/23         | MXN | 353,315,100     | 2,000,406,384         | 2,010,662,405         | 4.50%         |
|                | MEXICAN BONOS 8.000% 11/07/47 M      | MXN | 85,080,000      | 581,487,090           | 520,719,418           | 1.17%         |
|                | UNITED MEXICAN 3.900% 04/27/25       | USD | 850,000         | 90,707,286            | 98,606,925            | 0.22%         |
| スペイン           |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | SPANISH GOV'T 0.050% 10/31/21        | EUR | 8,201,000       | 1,025,733,342         | 1,041,576,544         | 2.32%         |
|                | SPANISH GOV'T 1.95% 07/30/30         | EUR | 10,611,000      | 1,333,927,888         | 1,590,560,682         | 3.56%         |
| アラブ首長国連邦       |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | ABU DHABI GOVT 2.700% 09/02/70 REGS  | USD | 810,000         | 86,305,500            | 78,243,196            | 0.18%         |
| 米国             |                                      |     |                 |                       |                       |               |
| ソブリン債          | US TREASURY N/B 0.375% 03/31/22      | USD | 12,643,000      | 1,367,766,678         | 1,309,686,326         | 2.93%         |
|                | US TREASURY N/B 1.750% 11/30/21      | USD | 3,934,200       | 425,365,600           | 412,221,192           | 0.92%         |
|                | US TREASURY N/B 2.500% 01/31/24      | USD | 356,000         | 39,644,471            | 39,386,967            | 0.09%         |
|                | US TREASURY N/B 2.875% 10/31/23      | USD | 858,000         | 96,157,234            | 95,381,985            | 0.20%         |
| ソブリン債合計        |                                      |     |                 | <b>21,037,469,852</b> | <b>21,632,387,547</b> | <b>48.40%</b> |
| 投資金額合計         |                                      |     |                 | <b>41,435,732,254</b> | <b>42,642,229,608</b> | <b>95.41%</b> |

# D I A Mマネーマザーファンド

## 運用報告書

第13期 (決算日 2022年4月5日)

(計算期間 2021年4月6日～2022年4月5日)

D I A Mマネーマザーファンドの第13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。<br>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<br>組入比率 | 新株予約権<br>付社債<br>(転換社債) | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額    |
|----------------|--------|----------|------------|------------------------|------------|--------------|
|                | 円      | 騰落<br>中率 |            |                        |            |              |
| 9期(2018年4月5日)  | 10,099 | △0.0     | 71.1       | —                      | —          | 百万円<br>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        |
| 13期(2022年4月5日) | 10,071 | △0.1     | 76.3       | —                      | —          | 1,192        |

(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)。

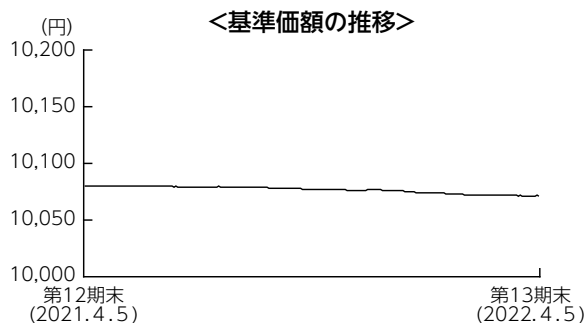
## ■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日                  | 基 準 価 額 |        | 債 組 入 比 | 券 率       | 新 株 予 約 権 付<br>社 債 ( 転 換 社 債 )<br>組 入 比 率 | 債 先 物 比 | 券 率    |
|------------------------|---------|--------|---------|-----------|---|---------|--------|
|                        | 円       | 騰 落 率  |         |           |   |         |        |
| (期 首)<br>2021年 4 月 5 日 | 10,080  | %<br>- |         | %<br>62.4 |   | %<br>-  | %<br>- |
| 4 月 末                  | 10,080  | 0.0    |         | 61.9      | -   | -       | -      |
| 5 月 末                  | 10,080  | 0.0    |         | 63.1      | -   | -       | -      |
| 6 月 末                  | 10,079  | △0.0   |         | 82.8      | -   | -       | -      |
| 7 月 末                  | 10,079  | △0.0   |         | 63.7      | -   | -       | -      |
| 8 月 末                  | 10,078  | △0.0   |         | 68.1      | -   | -       | -      |
| 9 月 末                  | 10,077  | △0.0   |         | 68.1      | -   | -       | -      |
| 10 月 末                 | 10,077  | △0.0   |         | 74.2      | -   | -       | -      |
| 11 月 末                 | 10,076  | △0.0   |         | 74.2      | -   | -       | -      |
| 12 月 末                 | 10,074  | △0.1   |         | 76.4      | -   | -       | -      |
| 2022年 1 月 末            | 10,073  | △0.1   |         | 76.4      | -   | -       | -      |
| 2 月 末                  | 10,072  | △0.1   |         | 76.4      | -   | -       | -      |
| 3 月 末                  | 10,071  | △0.1   |         | 76.4      | -   | -       | -      |
| (期 末)<br>2022年 4 月 5 日 | 10,071  | △0.1   |         | 76.3      | -   | -       | -      |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2021年4月6日から2022年4月5日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は10,071円となり、前期末比で0.1%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

## 投資環境

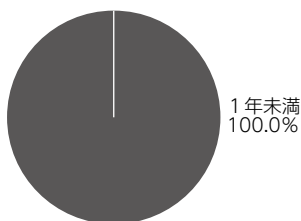
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

## ポートフォリオについて

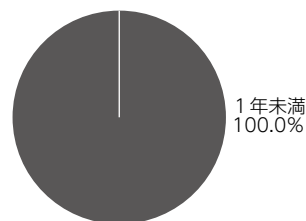
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

### ○残存年限別構成比 期首（前期末）



### 当期末



## 今後の運用方針

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

## ■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■ 売買及び取引の状況 (2021年4月6日から2022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 | 911,871 | (400,000) |
|    | 特殊債券 | —       | (263,000) |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月6日から2022年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

| 決算期<br>区分 | 当          |                    |           | 期         |                    |        |
|-----------|------------|--------------------|-----------|-----------|--------------------|--------|
|           | 買付額等<br>A  | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A       | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C    |
| 公社債       | 百万円<br>911 | 百万円<br>400         | %<br>44.0 | 百万円<br>—  | 百万円<br>—           | %<br>— |

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<br>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 | 910,000 | 910,671 | 76.3    | —               | —                 | —       | 76.3    |
| 合 計     | 910,000 | 910,671 | 76.3    | —               | —                 | —       | 76.3    |

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄                | 当 期    |         | 末       |            |
|--------------------|--------|---------|---------|------------|
|                    | 利 率    | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
| (国債証券)             | %      | 千円      | 千円      |            |
| 4 1 3 回 利付国庫債券（2年） | 0.1000 | 210,000 | 210,060 | 2022/06/01 |
| 4 1 5 回 利付国庫債券（2年） | 0.1000 | 200,000 | 200,120 | 2022/08/01 |
| 4 1 6 回 利付国庫債券（2年） | 0.1000 | 200,000 | 200,154 | 2022/09/01 |
| 4 1 8 回 利付国庫債券（2年） | 0.1000 | 200,000 | 200,216 | 2022/11/01 |
| 4 1 9 回 利付国庫債券（2年） | 0.1000 | 100,000 | 100,121 | 2022/12/01 |
| 合 計                | —      | 910,000 | 910,671 | —          |

## ■投資信託財産の構成

2022年4月5日現在

| 項 目                     | 当 期       |       | 末         |       |
|-------------------------|-----------|-------|-----------|-------|
|                         | 評 価 額     | 比 率   | 評 価 額     | 比 率   |
|                         | 千円        | %     | 千円        | %     |
| 公 社 債                   | 910,671   | 76.3  | 910,671   | 76.3  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 282,092   | 23.7  | 282,092   | 23.7  |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 1,192,764 | 100.0 | 1,192,764 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月5日)現在

| 項 目                      | 当 期 末          |
|--------------------------|----------------|
| (A) 資 産                  | 1,192,764,024円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等          | 281,847,683    |
| 公 社 債(評価額)               | 910,671,900    |
| 未 収 利 息                  | 221,428        |
| 前 払 費 用                  | 23,013         |
| (B) 負 債                  | —              |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)       | 1,192,764,024  |
| 元 本                      | 1,184,299,773  |
| 次 期 繰 越 損 益 金            | 8,464,251      |
| (D) 受 益 権 総 口 数          | 1,184,299,773口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 10,071円        |

|  |                |   |                |
|--|----------------|---|----------------|
| (注1) 期首元本額                             | 1,056,034,563円 | みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) ブラジルリアルコース     | 9,925円         |
| 追加設定元本額                                | 148,321,314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         |
| 一部解約元本額                                | 20,056,104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         |
| (注2) 期末における元本の内訳                       |                | マッシュューズ・アジア株式ファンド                           | 29,641,137円    |
| 短期ハイイールド債券ファンド (ヘッジあり)                 | 990,775円       | One世界分散セレクト (Aコース)                          | 99,040円        |
| バンクローン・ファンド (ヘッジなし)                    | 15,843,407円    | One世界分散セレクト (Bコース)                          | 99,040円        |
| バンクローン・ファンド (ヘッジあり)                    | 13,867,169円    | One世界分散セレクト (Cコース)                          | 99,040円        |
| 新光バンクローン・ファンド・ネオ (円ヘッジ型)               | 5,049,059円     | 世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型)                 | 99,109円        |
| バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型)             | 1,088,285円     | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり)  | 188,380円       |
| バンクローン・ファンド (ヘッジあり/年1回決算型)             | 98,095円        | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし)  | 109,063円       |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号            | 3,959,763円     | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり) | 297,442円       |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号            | 989,197円       | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし) | 118,977円       |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号            | 494,102円       | ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド                    | 99,255,584円    |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号             | 494,102円       | 期末元本合計                                      | 1,184,299,773円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号             | 48,517円        |   |                |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号             | 395,083円       |   |                |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号             | 11,377円        |   |                |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号             | 98,027円        |   |                |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号             | 989,197円       |   |                |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号             | 395,083円       |   |                |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号             | 494,102円       |   |                |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号             | 494,102円       |   |                |
| ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>         | 791,316円       |   |                |
| ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>         | 2,474,972円     |   |                |
| クルーズコントロール                             | 990,000,991円   |   |                |
| 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<ブラジルリアルコース>    | 10,530,000円    |   |                |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>        | 149,716円       |   |                |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>        | 5,972円         |   |                |
| USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり)      | 993,740円       |   |                |
| USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし)      | 1,987,479円     |   |                |
| DIAM・ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<D/C年金>     | 9,935円         |   |                |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 円コース      | 9,925円         |   |                |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 米ドルコース    | 9,925円         |   |                |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 豪ドルコース    | 9,925円         |   |                |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) メキシコペソコース | 9,925円         |   |                |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) トルコリラコース  | 9,925円         |   |                |



## ■損益の状況

当期 自2021年4月6日 至2022年4月5日

| 項   | 目           | 当 | 期          |
|-----|-------------|---|------------|
| (A) | 配当等収益       |   | 1,715,799円 |
|     | 受取利息        |   | 1,785,127  |
|     | 支払利息        |   | △69,328    |
| (B) | 有価証券売買損益    |   | △2,682,620 |
|     | 売却損         |   | △2,682,620 |
| (C) | 当期損益金(A+B)  |   | △966,821   |
| (D) | 前期繰越損益金     |   | 8,469,295  |
| (E) | 解約差損益金      |   | △160,435   |
| (F) | 追加信託差損益金    |   | 1,122,212  |
| (G) | 合計(C+D+E+F) |   | 8,464,251  |
|     | 次期繰越損益金(G)  |   | 8,464,251  |

(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。