

償還 運用報告書（全体版）

第21期 <償還日 2023年7月14日>

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

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／国内／株式 |
| 信託期間 | 2013年7月31日から2023年7月14日までです。 |
| 運用方針 | 信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 円建て外国投資信託である「D I AMケイマン・ファンドー・ジャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション 円クラス」の投資信託証券を主要投資対象とします。また、証券投資信託である「D I AM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、短期金融資産等に直接投資する場合があります。 |
| 運用方法 | 円建て外国投資信託への投資を通じて、実質的にわが国の株式に投資します。外国投資信託の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。 |
| 組入制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | 決算日（原則として毎年5月21日および11月21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、「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」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/>

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

■設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) (参考指数) | | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|---------------------|---------------------|--------|--------|------------------------------|--------|------------|------------|
| | (分配落) | 税金込み | 期騰落率 | 期騰落 | 騰落率 | | |
| (設定日) 2013年7月31日 | 円 10,000 | 円 - | % - | ポイント (7月30日) 1,527.32 | % - | % - | 百万円 603 |
| 1期(2013年11月21日) | 10,563 | 10 | 5.7 | 1,668.91 | 9.3 | 95.0 | 1,660 |
| 2期(2014年5月21日) | 9,811 | 10 | △7.0 | 1,557.03 | △6.7 | 95.0 | 3,504 |
| 3期(2014年11月21日) | 11,370 | 300 | 18.9 | 1,913.00 | 22.9 | 95.9 | 3,234 |
| 4期(2015年5月21日) | 11,878 | 500 | 8.9 | 2,271.36 | 18.7 | 97.2 | 2,665 |
| 5期(2015年11月24日) | 10,991 | 800 | △0.7 | 2,235.86 | △1.6 | 95.8 | 2,054 |
| 6期(2016年5月23日) | 10,059 | 0 | △8.5 | 1,886.07 | △15.6 | 95.6 | 1,696 |
| 7期(2016年11月21日) | 9,818 | 0 | △2.4 | 2,054.15 | 8.9 | 95.9 | 1,509 |
| 8期(2017年5月22日) | 10,759 | 0 | 9.6 | 2,256.15 | 9.8 | 96.5 | 1,318 |
| 9期(2017年11月21日) | 10,808 | 800 | 7.9 | 2,574.33 | 14.1 | 96.1 | 930 |
| 10期(2018年5月21日) | 10,904 | 530 | 5.8 | 2,665.56 | 3.5 | 95.2 | 862 |
| 11期(2018年11月21日) | 9,785 | 0 | △10.3 | 2,399.27 | △10.0 | 95.4 | 729 |
| 12期(2019年5月21日) | 9,515 | 0 | △2.8 | 2,333.08 | △2.8 | 95.6 | 643 |
| 13期(2019年11月21日) | 10,048 | 0 | 5.6 | 2,573.11 | 10.3 | 95.9 | 637 |
| 14期(2020年5月21日) | 9,499 | 0 | △5.5 | 2,303.91 | △10.5 | 96.0 | 304 |
| 15期(2020年11月24日) | 10,731 | 650 | 19.8 | 2,749.88 | 19.4 | 95.7 | 294 |
| 16期(2021年5月21日) | 11,194 | 920 | 12.9 | 3,003.66 | 9.2 | 95.5 | 273 |
| 17期(2021年11月22日) | 11,150 | 1,080 | 9.3 | 3,254.65 | 8.4 | 95.6 | 258 |
| 18期(2022年5月23日) | 9,710 | 0 | △12.9 | 3,058.56 | △6.0 | 95.8 | 216 |
| 19期(2022年11月21日) | 10,006 | 0 | 3.0 | 3,227.07 | 5.5 | 96.0 | 214 |
| 20期(2023年5月22日) | 10,540 | 150 | 6.8 | 3,611.02 | 11.9 | 95.7 | 215 |
| (償還日) 2023年7月14日 | (償還価額) 10,951.83 | 0 | 3.9 | 3,722.70 | 3.1 | - | 217 |

(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) 東証株価指数 (TOPIX) の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません (以下同じ)。

(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)。

■当期中の基準価額と市況の推移

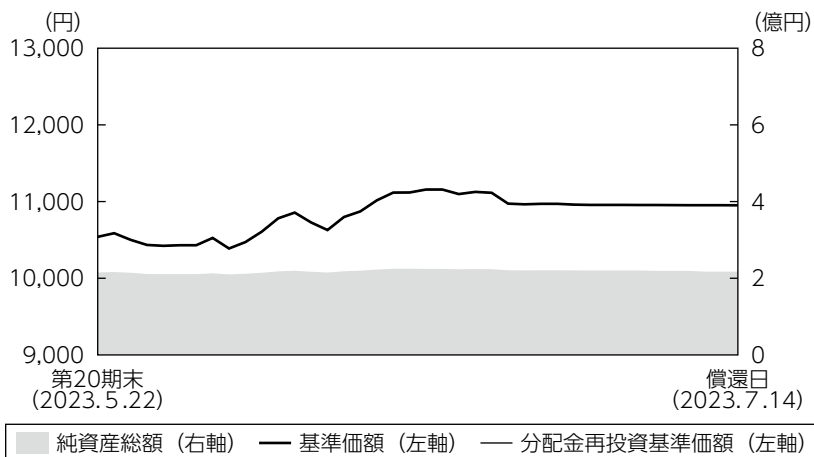
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東 証 株 価 指 数 (TOPIX) (配当込み) (参考指数) | 価 指 数 | | 投 資 組 資 益 入 信 証 比 託 券 率 |
|-------------------------|---------------------|--------|--|--------|-----------|----------------------------------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | |
| (期 首) 2023年 5 月 22 日 | 円 10,540 | % - | ポイント 3,611.02 | % - | % 95.7 | |
| 5 月 末 | 10,526 | △0.1 | 3,537.93 | △2.0 | 95.6 | |
| 6 月 末 | 10,960 | 4.0 | 3,805.00 | 5.4 | 95.7 | |
| (償還日) 2023年 7 月 14 日 | (償還価額) 10,951.83 | 3.9 | 3,722.70 | 3.1 | - | |

(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。

■設定以来の運用経過（2013年7月31日から2023年7月14日まで）

第21期の基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (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

日本経済の脱デフレへの期待などを背景に日本株への関心が高まり、海外投資家による日本株買いがけん引する形で国内株式市場が上昇したことから、当期の基準価額は上昇しました。

また、当ファンドは設定来で、81.1%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金5,750円）。

約10年間にわたっての運用期間において国内株式市場が上昇した中で、折々の相場局面における局面判断、株式市況動向の分析などを踏まえ運用を行ったことがプラスに寄与し、設定来の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

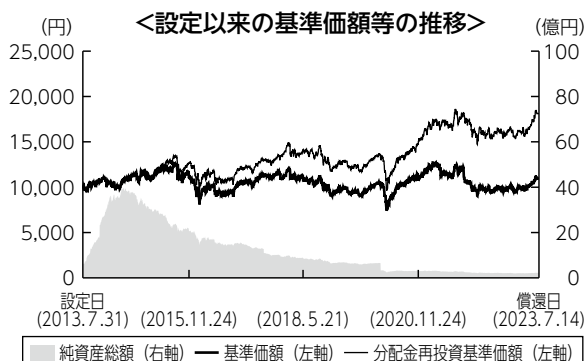
| 組入ファンド | 騰落率 |
|--|-------|
| D I A Mケイマン・ファンドージャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション 円クラス | 4.3% |
| D I A Mマネーマザーファンド | △0.0% |

- (注1) D I A Mケイマン・ファンドージャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション 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・ファンドージャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション 円クラス、D I A Mマネーマザーファンド共に2023年6月30日まで）の騰落率です。

設定来の投資環境

国内株式市場は上昇しました。2013年以降は、アベノミクスによる大規模な金融緩和政策を背景に上昇基調となりました。2020年には、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて一時急落したものの、主要国による財政・金融の政策対応に支えられ、回復に転じました。2023年には、日本経済の脱デフレへの期待が高まり、上値を切り上げる形となりました。

国内短期金融市場では、日銀の大規模な金融緩和政策の影響で、3ヵ月物国庫短期証券利回りは2013年から0.10%以下の水準で推移しました。その後、2016年にはマイナス金利政策が導入されたことにより、同金利はマイナス金利で推移することになりました。



(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

- (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。

【参考】



設定来のポートフォリオについて

●当ファンド

D I AMケイマン・ファンドージャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション 円クラスの組入比率は、原則として高位を維持し、D I AMマネーマザーファンドへの投資も行いました。

●D I AMケイマン・ファンドージャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション 円クラス

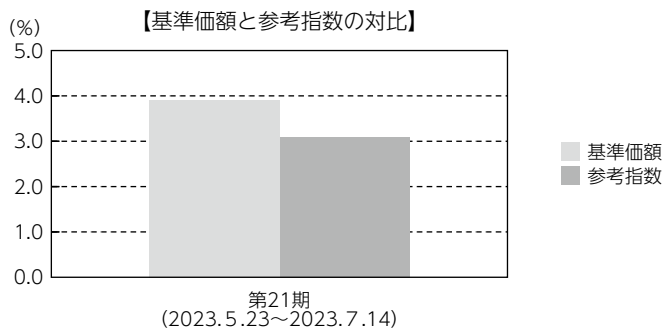
国内外の経済状況や金融政策の分析などを踏まえてマーケットの相場局面を判断し、その局面に応じたポートフォリオの投資スタイルや組入銘柄の決定、並びに調整を行いました。株式組入比率については、先行きの下落リスクが高いと判断した局面では引き下げるなど、機動的な比率の調整を行いました。

●D I AM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。

参考指数との差異

当ファンドはベンチマークを定めておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数である東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

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21期 | | 項目の概要 |
|----------|-----------------------------|---------|--|
| | (2023年5月23日 ～2023年7月14日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 22円 | 0.202% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,840円です。 |
| (投信会社) | (9) | (0.086) | 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) | (12) | (0.111) | 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) | (1) | (0.005) | 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 |
| 合計 | 22 | 0.202 | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

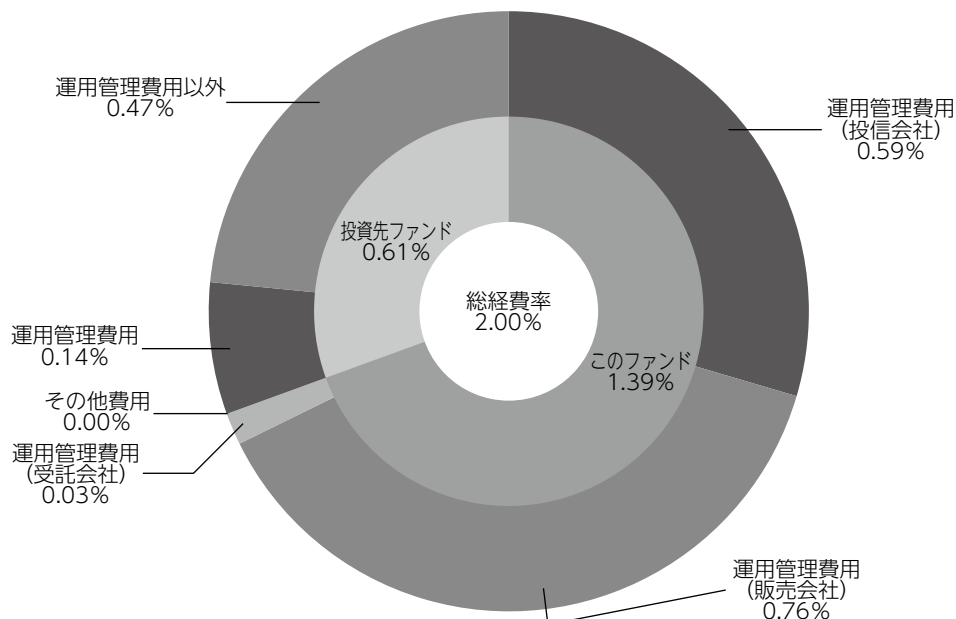
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.00%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 2.00% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.39% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.14% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.47% |

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

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

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

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買及び取引の状況 (2023年5月23日から2023年7月14日まで)

投資信託受益証券

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---|-----|-----|----------|---------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外国 邦貨建 | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| D I A Mケイマン・ファンド - ジャパニーズ・エクイティ・ファンド・ - カレンシー・セレクション 円クラス | - | - | 12.51161 | 214,803 |

(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 (2023年5月23日から2023年7月14日まで)

| | 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□ | 千円 |
| | - | - | 9 | 9 |

■利害関係人との取引状況等 (2023年5月23日から2023年7月14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。前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 | 期 首 (前期末) | |
|---|-----------|-----|
| | □ 数 | 金 額 |
| D I A Mケイマン・ファンド - ジャパニーズ・エクイティ・ - ファンド・カレンシー・ - セレクション 円クラス | 12.51161 | 千□ |
| 合 計 | 12.51161 | 千□ |

(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) | |
|-----------------------------|-----------|-----|
| | □ 数 | 金 額 |
| D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド | 9 | 千□ |

■投資信託財産の構成

2023年7月14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 219,754 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 219,754 | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年7月14日)現在

| 項 目 | 償 還 時 |
|--------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 219,754,087円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 219,754,087 |
| (B) 負 債 | 2,557,502 |
| 未 払 解 約 金 | 2,107,191 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 449,755 |
| 未 払 利 息 | 556 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 217,196,585 |
| 元 本 | 198,319,938 |
| 償 還 差 損 益 金 | 18,876,647 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 198,319,938口 |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 10,951円83銭 |

(注) 期首における元本額は204,178,513円、当期中における追加設定元本額は456円、同解約元本額は5,859,031円です。

■損益の状況

当期 自2023年5月23日 至2023年7月14日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △2,372円 |
| 受 取 利 息 | 39 |
| 支 払 利 息 | △2,411 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 8,625,206 |
| 売 買 益 | 8,695,571 |
| 売 買 損 | △70,365 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △449,755 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 8,173,079 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △786,262 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 11,489,830 |
| (配 当 等 相 当 額) | (13,394,761) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△1,904,931) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 18,876,647 |
| 償 還 差 損 益 金(G) | 18,876,647 |

(注1) (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2) (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。

■投資信託財産運用総括表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2013年7月31日 | | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|----------|----------------|----------------|----------------|-----------|--------------|--------------|
| | 投資信託契約終了日 | 2023年7月14日 | | | 資産総額 | 219,754,087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 | 2,557,502円 | |
| | | | | 純資産総額 | 217,196,585円 | |
| 受益権口数 | 603,615,000口 | 198,319,938口 | △405,295,062口 | 受益権口数 | 198,319,938口 | |
| 元本額 | 603,615,000円 | 198,319,938円 | △405,295,062円 | 1万口当たり償還金 | 10,951円83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 | 1,572,382,708円 | 1,660,940,254円 | 10,563円 | 10円 | 0.10% | |
| 第2期 | 3,571,945,481 | 3,504,264,811 | 9,811 | 10 | 0.10 | |
| 第3期 | 2,845,236,087 | 3,234,903,500 | 11,370 | 300 | 3.00 | |
| 第4期 | 2,244,355,716 | 2,665,956,933 | 11,878 | 500 | 5.00 | |
| 第5期 | 1,869,439,795 | 2,054,674,337 | 10,991 | 800 | 8.00 | |
| 第6期 | 1,686,652,075 | 1,696,657,064 | 10,059 | 0 | 0.00 | |
| 第7期 | 1,537,431,506 | 1,509,426,973 | 9,818 | 0 | 0.00 | |
| 第8期 | 1,225,528,212 | 1,318,605,717 | 10,759 | 0 | 0.00 | |
| 第9期 | 861,338,808 | 930,935,825 | 10,808 | 800 | 8.00 | |
| 第10期 | 791,170,234 | 862,654,192 | 10,904 | 530 | 5.30 | |
| 第11期 | 745,916,228 | 729,910,107 | 9,785 | 0 | 0.00 | |
| 第12期 | 675,882,675 | 643,074,075 | 9,515 | 0 | 0.00 | |
| 第13期 | 634,109,757 | 637,173,498 | 10,048 | 0 | 0.00 | |
| 第14期 | 320,356,675 | 304,307,553 | 9,499 | 0 | 0.00 | |
| 第15期 | 274,347,418 | 294,401,470 | 10,731 | 650 | 6.50 | |
| 第16期 | 244,431,433 | 273,625,035 | 11,194 | 920 | 9.20 | |
| 第17期 | 231,544,300 | 258,165,989 | 11,150 | 1,080 | 10.80 | |
| 第18期 | 222,948,590 | 216,487,205 | 9,710 | 0 | 0.00 | |
| 第19期 | 214,423,916 | 214,559,328 | 10,006 | 0 | 0.00 | |
| 第20期 | 204,178,513 | 215,198,271 | 10,540 | 150 | 1.50 | |

償還金のお知らせ

| | |
|----------------|------------|
| 1万口当たり償還金（税引前） | 10,951円83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。

DIAMケイマン・ファンド ジャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション

円クラス／米ドルクラス／豪ドルクラス／メキシコペソクラス／トルコリラクラス／ブラジルリアルクラス

当ファンドは「みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）」が投資対象とする外国投資信託です。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-----------------|--|
| 形 態 | ケイマン籍円建て外国投資信託 |
| 主 要 投 資 対 象 | 日本の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。 |
| 投 資 態 度 | <ul style="list-style-type: none"> ①主として日本の株式に投資し、中長期的な信託財産の成長を目的として積極的な運用を行います。 ②景気動向、金融情勢等の調査に基づいたトップダウンアプローチにより、相場局面の判断を重視した運用を行います。 ③銘柄選定にあたっては、投資対象市場、株式規模および業種等を考慮し、値上がり期待の高い銘柄を選定します。 ④実質的な株式組入比率は高位に保ちますが、株式市場の下落リスクが高いと考えられる場合等には、株式の実質組入比率を50～100%の範囲で弾力的に引き下げることが出来ます。株式の実質組入比率の調整は、株価指数先物取引等のデリバティブ取引を活用することや、保有株式を売却して短期金融資産等を保有することで行います。 ⑤各クラス（円クラスを除きます。）において、円建て資産について、原則として、円売り／各クラス通貨買いの為替取引を行います。 ⑥資金動向、市況動向等により、上記のような運用ができない場合があります。 |
| 主 な 投 資 制 限 | <ul style="list-style-type: none"> ①有価証券の空売りは行いません。 ②デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ③ファンドの純資産価額の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。） ④投資信託証券への投資は行いません。 ⑤流動性に欠ける資産への投資は、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、ファンドの純資産の15%を超えないものとします。 ⑥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。 |
| 投 資 顧 問 会 社 | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 為 替 管 理 会 社 | State Street Bank and Trust Company |
| 受 託 銀 行 | FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited. |
| 管 理 事 務 代 行 会 社 | State Street Cayman Trust Company,Limited |
| 保 管 銀 行 | State Street Bank and Trust Company |

D I A Mケイマン・ファンドー・ジャパニーズ・エクイティ・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、2021年12月31日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下は、2021年12月31日現在の財務諸表の原文の一部を抜粋・翻訳したものです。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（ジャパニーズ・エクイティ・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。

損益計算書
2021年12月31日終了の会計年度
（日本円建て）

| | (円) |
|-----------------------------|----------------------|
| 投資収益 | |
| 受取配当金（源泉徴収税9,603,632円控除後） | 53,111,816 |
| 投資収益合計 | 53,111,816 |
| 費用 | |
| 管理事務代行報酬 | 10,152,395 |
| 保管報酬 | 7,587,825 |
| 投資運用報酬および通貨運用報酬 | 6,334,263 |
| 専門家報酬 | 3,858,827 |
| 受託者報酬 | 2,316,843 |
| 支払利息 | 1,329,844 |
| その他の費用 | 1,086,529 |
| 費用合計 | 32,666,526 |
| 正味投資利益 | 20,445,290 |
| デリバティブ取引に係る正味実現利益 | 288,431,672 |
| 投資有価証券に係る正味実現利益 | 764,894,604 |
| 当期正味実現利益 | 1,053,326,276 |
| デリバティブ取引に係る未実現利益／（損失）の正味増減額 | (41,397,029) |
| 投資有価証券に係る未実現利益／（損失）の正味増減額 | (339,374,359) |
| 当期末実現利益／（損失）の正味増減額 | (380,771,388) |
| 運用による純資産の純増加額 | 693,000,178 |

| | 発行済受益権口数 | 1口当たり純資産価額（日本円） |
|-----------|------------|-----------------|
| クラス J P Y | 14,428.07 | 16,018.38 |
| クラス U S D | 82,780.30 | 17,312.18 |
| クラス A U D | 8,314.82 | 13,797.44 |
| クラス M X N | 4,878.04 | 11,258.23 |
| クラス T R Y | 124,043.11 | 2,547.04 |
| クラス B R L | 223,451.28 | 5,179.02 |

投資有価証券明細書
2021年12月31日現在
(日本円建て)

| | 株数 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 対純資産 (%) |
|-------------------------------------|--------|-------------|-------------|-------------|
| 投資有価証券 | | | | |
| 普通株式 | | | | |
| 日本 | | | | |
| 素材 | | | | |
| ADEKA Corp | 12,400 | 28,323,980 | 31,830,800 | 0.96% |
| KeePer Technical Laboratory Co Ltd | 1,200 | 3,432,733 | 2,668,800 | 0.08% |
| Keiwa Inc | 2,700 | 16,766,786 | 16,308,000 | 0.49% |
| Mitsubishi Gas Chemical Co Inc | 7,000 | 18,063,011 | 13,636,000 | 0.41% |
| Nippon Steel Corp | 5,800 | 6,178,449 | 10,895,300 | 0.33% |
| Osaka Organic Chemical Industry Ltd | 3,900 | 10,282,080 | 12,948,000 | 0.39% |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 2,500 | 34,600,673 | 49,800,000 | 1.51% |
| 素材合計 | | 117,647,712 | 138,086,900 | 4.17% |
| 通信 | | | | |
| CyberAgent Inc | 3,700 | 8,137,784 | 7,081,800 | 0.22% |
| IPS Inc | 7,700 | 16,475,495 | 17,017,000 | 0.52% |
| KDDI Corp | 8,400 | 28,265,457 | 28,240,800 | 0.85% |
| Minkabu The Infonoid Inc | 5,100 | 19,597,671 | 14,014,800 | 0.42% |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp | 10,900 | 34,635,782 | 34,335,000 | 1.04% |
| SoftBank Corp. | 5,500 | 28,609,259 | 29,887,000 | 0.90% |
| Trend Micro Inc/Japan | 3,200 | 18,618,596 | 20,448,000 | 0.62% |
| Z Holdings Corp | 30,900 | 19,320,731 | 20,622,660 | 0.62% |
| 通信合計 | | 173,660,775 | 171,647,060 | 5.19% |
| 一般消費財、景気循環型 | | | | |
| Airtrip Corp | 3,000 | 9,005,567 | 9,210,000 | 0.28% |
| Denso Corp | 7,900 | 43,360,923 | 75,279,100 | 2.28% |
| Food & Life Cos Ltd | 3,000 | 15,002,965 | 13,050,000 | 0.39% |
| H2O Retailing Corp | 6,000 | 5,711,651 | 4,860,000 | 0.15% |
| Honda Motor Co Ltd | 4,900 | 14,175,143 | 15,827,000 | 0.48% |
| Isuzu Motors Ltd | 3,300 | 4,651,356 | 4,722,300 | 0.14% |
| ITOCHU Corp | 8,500 | 26,632,615 | 29,903,000 | 0.90% |
| Iwatani Corp | 1,000 | 4,730,345 | 5,800,000 | 0.18% |
| Japan Airlines Co Ltd | 4,500 | 9,572,273 | 9,882,000 | 0.30% |
| Mitsubishi Corp | 9,700 | 30,875,913 | 35,424,400 | 1.07% |
| Nintendo Co Ltd | 800 | 35,042,851 | 42,920,000 | 1.30% |
| Round One Corp | 22,000 | 32,468,980 | 30,008,000 | 0.91% |
| Sony Corp. | 8,100 | 58,116,150 | 117,247,500 | 3.55% |
| Toray Industries Inc | 43,200 | 27,398,057 | 29,453,760 | 0.89% |
| Toyota Motor Corp | 46,500 | 71,540,908 | 97,905,750 | 2.96% |
| Welcia Holdings Co Ltd | 1,300 | 5,048,234 | 4,667,000 | 0.14% |
| 一般消費財、景気循環型合計 | | 393,333,931 | 526,159,810 | 15.92% |

| | 株数 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 対純資産 (%) |
|--------------------------------------|--------|--------------------|--------------------|--------------|
| 投資有価証券 (つづき) | | | | |
| 普通株式 (つづき) | | | | |
| 日本 (つづき) | | | | |
| 一般消費財、生活必需品 | | | | |
| Ajinomoto Co Inc | 6,000 | 20,649,537 | 20,982,000 | 0.63% |
| Asahi Group Holdings Ltd | 3,500 | 18,663,168 | 15,659,000 | 0.47% |
| Asahi Intecc Co Ltd | 3,500 | 11,335,566 | 8,648,500 | 0.26% |
| AZOOM Co Ltd | 1,500 | 11,071,430 | 9,150,000 | 0.28% |
| Chugai Pharmaceutical Co Ltd | 3,300 | 12,379,680 | 12,325,500 | 0.37% |
| Daiichi Sankyo Co Ltd | 11,200 | 22,697,198 | 32,760,000 | 0.99% |
| GMO Payment Gateway Inc | 1,200 | 13,408,891 | 17,220,000 | 0.52% |
| Hyuga Primary Care Co Ltd | 3,000 | 14,712,377 | 18,000,000 | 0.54% |
| Life Corp | 2,700 | 12,901,135 | 9,193,500 | 0.28% |
| Morinaga Milk Industry Co Ltd | 1,700 | 10,520,776 | 9,282,000 | 0.28% |
| Nihon M&A Center Inc | 4,000 | 9,440,825 | 11,284,000 | 0.34% |
| Riso Kyoiku Co Ltd | 18,600 | 7,128,642 | 7,309,800 | 0.22% |
| Seven & i Holdings Co Ltd | 4,500 | 21,438,424 | 22,752,000 | 0.69% |
| Shionogi & Co Ltd | 3,700 | 26,578,806 | 30,062,500 | 0.91% |
| Sysmex Corp | 2,400 | 30,232,613 | 37,320,000 | 1.13% |
| Takara Bio Inc | 3,500 | 8,763,152 | 9,254,000 | 0.28% |
| 一般消費財、生活必需品合計 | | 251,922,220 | 271,202,800 | 8.19% |
| エネルギー | | | | |
| Inpex Corp. | 46,700 | 43,178,966 | 46,793,400 | 1.41% |
| エネルギー合計 | | 43,178,966 | 46,793,400 | 1.41% |
| 金融 | | | | |
| Dai-ichi Life Holdings Inc | 15,700 | 25,091,752 | 36,510,350 | 1.10% |
| JAFCO Group Co Ltd | 2,100 | 15,676,691 | 13,902,000 | 0.42% |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. | 76,500 | 43,668,860 | 47,804,850 | 1.46% |
| Mitsui Fudosan Co Ltd | 8,700 | 21,863,137 | 19,822,950 | 0.60% |
| MS&AD Insurance Group Holdings Inc | 6,000 | 19,556,040 | 21,294,000 | 0.65% |
| ORIX Corp | 12,700 | 24,396,890 | 29,813,250 | 0.90% |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. | 10,600 | 39,394,544 | 41,795,800 | 1.26% |
| Tokyo Tatemono Co Ltd | 15,600 | 26,296,209 | 26,208,000 | 0.79% |
| 金融合計 | | 215,944,123 | 237,151,200 | 7.18% |

| | 株数 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 対純資産 (%) |
|-------------------------------|--------|--------------------|--------------------|---------------|
| 投資有価証券 (つづき) | | | | |
| 普通株式 (つづき) | | | | |
| 日本 (つづき) | | | | |
| 資本財・サービス | | | | |
| Central Japan Railway Co | 2,300 | 34,524,498 | 35,293,500 | 1.07% |
| CKD Corp | 5,900 | 13,771,661 | 13,788,300 | 0.42% |
| Daikin Industries Ltd | 1,400 | 35,171,467 | 36,526,000 | 1.10% |
| Daiseki Co Ltd | 5,200 | 27,606,048 | 26,572,000 | 0.80% |
| EXEO Group Inc | 10,600 | 28,186,826 | 25,694,400 | 0.78% |
| FANUC Corp | 1,300 | 30,571,069 | 31,694,000 | 0.96% |
| Fuji Electric Co Ltd | 9,500 | 32,800,741 | 59,660,000 | 1.80% |
| Fujikura Ltd | 29,200 | 18,337,795 | 16,498,000 | 0.50% |
| Hioki EE Corp | 2,500 | 21,280,432 | 21,950,000 | 0.66% |
| Hitachi Ltd | 7,600 | 31,880,442 | 47,348,000 | 1.43% |
| Hoya Corp | 1,400 | 14,246,705 | 23,954,000 | 0.72% |
| Ibiden Co Ltd | 8,200 | 27,862,123 | 56,088,000 | 1.70% |
| JMDC Inc | 3,200 | 20,945,450 | 27,456,000 | 0.83% |
| JSR Corp | 1,800 | 7,899,118 | 7,875,000 | 0.24% |
| Katitas Co Ltd | 3,500 | 9,998,279 | 15,487,500 | 0.47% |
| Keyence Corp | 700 | 46,624,671 | 50,596,000 | 1.53% |
| Lixil Corp | 5,000 | 15,580,615 | 15,325,000 | 0.46% |
| Misumi Group Inc | 8,700 | 31,763,614 | 41,064,000 | 1.24% |
| Mitsui OSK Lines Ltd | 2,500 | 12,891,839 | 21,350,000 | 0.65% |
| Murata Manufacturing Co Ltd | 2,500 | 17,393,261 | 22,892,500 | 0.69% |
| Nidec Corp. | 2,800 | 22,979,121 | 37,856,000 | 1.14% |
| Nippon Pillar Packing Co Ltd | 3,000 | 11,081,493 | 11,160,000 | 0.34% |
| Olympus Corp | 13,100 | 32,087,688 | 34,708,450 | 1.05% |
| Raito Kogyo Co Ltd | 13,900 | 27,554,340 | 27,535,900 | 0.83% |
| River Eletec Corp | 3,000 | 4,114,668 | 3,861,000 | 0.12% |
| Seibu Holdings Inc | 3,800 | 4,699,748 | 4,088,800 | 0.12% |
| SMC Corp | 400 | 18,028,545 | 31,036,000 | 0.94% |
| TDK Corp | 7,700 | 29,619,358 | 34,573,000 | 1.05% |
| Toyota Industries Corp | 3,400 | 28,708,897 | 31,246,000 | 0.94% |
| Towa Corp | 8,800 | 28,494,548 | 28,556,000 | 0.86% |
| Yaskawa Electric Corp | 3,000 | 13,206,868 | 16,920,000 | 0.52% |
| 資本財・サービス合計 | | 699,911,928 | 858,653,350 | 25.96% |
| テクノロジー | | | | |
| BayCurrent Consulting Inc | 200 | 9,974,748 | 8,900,000 | 0.27% |
| Fujifilm Holdings Corp | 7,100 | 54,019,326 | 60,534,600 | 1.83% |
| Hamamatsu Photonics KK | 4,000 | 29,323,613 | 29,360,000 | 0.89% |
| Lasertec Corp | 800 | 5,713,971 | 28,232,000 | 0.85% |
| Livero Inc | 2,800 | 8,564,961 | 7,893,200 | 0.24% |
| NEC Corp | 2,000 | 11,758,256 | 10,620,000 | 0.32% |
| Nomura Research Institute Ltd | 10,400 | 34,605,561 | 51,324,000 | 1.55% |
| Recruit Holdings Co Ltd | 8,100 | 56,636,906 | 56,473,200 | 1.71% |
| Rohm Co Ltd | 2,300 | 23,607,109 | 24,081,000 | 0.73% |
| Simplex Holdings Inc | 11,900 | 32,234,224 | 33,855,500 | 1.02% |
| Square Enix Holdings Co Ltd | 1,500 | 9,632,653 | 8,850,000 | 0.27% |
| Tokyo Electron Ltd | 900 | 18,495,184 | 59,652,000 | 1.81% |
| テクノロジー合計 | | 294,566,512 | 379,775,500 | 11.49% |
| 公共事業 | | | | |
| eRex Co Ltd | 9,100 | 25,884,751 | 18,573,100 | 0.56% |
| West Holdings Corp | 8,700 | 43,548,672 | 49,851,000 | 1.51% |
| 公共事業合計 | | 69,433,423 | 68,424,100 | 2.07% |

| | 株数 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 対純資産 (%) |
|--------------|----|---------------|---------------|-------------|
| 投資有価証券 (つづき) | | | | |
| 普通株式 (つづき) | | | | |
| 日本 (つづき) | | | | |
| 日本合計 | | 2,259,599,590 | 2,697,894,120 | 81.58% |
| 普通株式合計 | | 2,259,599,590 | 2,697,894,120 | 81.58% |
| 投資有価証券合計 | | 2,259,599,590 | 2,697,894,120 | 81.58% |

先物契約：

2021年12月31日現在、当ファンドは以下の先物契約を所有しておりました。

| カウンターパーティ | 詳細 | 満期日 | 契約数 | 想定元本 (円) | プット/ コール | 正味未実現利益/ (損失) (円) | 対純資産 (%) |
|---------------|---------------------------|------------|-----|-------------|-------------|-------------------------|-------------|
| Goldman Sachs | Japan Topix Index Futures | 2022年3月10日 | 26 | 517,920,000 | プット | 5,095,000 | 0.15% |

為替先渡契約：

2021年12月31日現在、当ファンドは以下の為替先渡契約を所有しておりました。

| カウンター パーティ | 購入/ 売却 | 決済日 | 受取通貨 | 当初価値 (円) | 引渡通貨 | 現在価値 (円) | 未実現利益 (円) | 対純資産 (%) |
|---|-----------|-----------|------|---------------|------|---------------|--------------|-------------|
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | TRY | 517,777,921 | JPY | 380,856,668 | 136,921,253 | 4.14% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | BRL | 1,163,449,841 | JPY | 1,120,065,991 | 43,383,850 | 1.31% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | USD | 1,445,268,930 | JPY | 1,425,545,208 | 19,723,722 | 0.60% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | BRL | 1,252,033,548 | JPY | 1,234,824,395 | 17,209,153 | 0.52% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | USD | 1,441,364,874 | JPY | 1,424,641,970 | 16,722,904 | 0.51% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 75,746,874 | TRY | 65,407,854 | 10,339,020 | 0.31% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | AUD | 117,855,666 | JPY | 114,088,688 | 3,766,978 | 0.11% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | MXN | 60,270,408 | JPY | 58,275,945 | 1,994,463 | 0.06% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | MXN | 54,648,639 | JPY | 53,011,160 | 1,637,479 | 0.05% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | AUD | 126,001,153 | JPY | 124,591,540 | 1,409,613 | 0.04% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年2月2日 | JPY | 3,000,000 | TRY | 2,614,923 | 385,077 | 0.01% |

| カウンター パーティ | 購入/ 売却 | 決済日 | 受取通貨 | 当初価値 (円) | 引渡通貨 | 現在価値 (円) | 未実現利益 (円) | 対純資産 (%) |
|---|-----------|-----------|------|-------------|------|-------------|--------------------|--------------|
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | BRL | 11,949,523 | JPY | 11,727,503 | 222,020 | 0.01% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 800,000 | TRY | 690,805 | 109,195 | 0.01% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | USD | 5,092,508 | JPY | 5,000,000 | 92,508 | 0.00% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年2月2日 | JPY | 1,300,000 | TRY | 1,294,757 | 5,243 | 0.00% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | MXN | 89,238 | JPY | 86,254 | 2,984 | 0.00% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | AUD | 500,742 | JPY | 500,000 | 742 | 0.00% |
| 為替先渡契約に係る未実現利益 | | | | | | | 253,926,204 | 7.68% |

| カウンター パーティ | 購入/ 売却 | 決済日 | 受取通貨 | 当初価値 (円) | 引渡通貨 | 現在価値 (円) | 未実現損失 (円) | 対純資産 (%) |
|---|-----------|-----------|------|-------------|------|-------------|--------------|-------------|
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 248,352 | AUD | 257,295 | (8,943) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 292,682 | MXN | 306,099 | (13,417) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年2月2日 | TRY | 2,962,292 | JPY | 3,000,000 | (37,708) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年2月2日 | JPY | 2,962,411 | USD | 3,006,491 | (44,080) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 4,096,762 | USD | 4,146,462 | (49,700) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 1,379,035 | MXN | 1,434,038 | (55,003) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 4,254,500 | AUD | 4,311,115 | (56,615) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年2月2日 | JPY | 2,000,000 | BRL | 2,088,343 | (88,343) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年2月2日 | JPY | 2,557,978 | AUD | 2,649,863 | (91,885) | (0.00)% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | TRY | 3,821,623 | JPY | 4,000,000 | (178,377) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 5,000,000 | BRL | 5,179,593 | (179,593) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 6,000,000 | AUD | 6,202,299 | (202,299) | (0.01)% |

| カウンター パーティ | 購入/ 売却 | 決済日 | 受取通貨 | 当初価値 (円) | 引渡通貨 | 現在価値 (円) | 未実現損失 (円) | 対純資産 (%) |
|---|-----------|-----------|------|---------------|------|---------------|----------------------|----------------|
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 3,593,068 | MXN | 3,862,948 | (269,880) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 5,125,353 | TRY | 5,458,893 | (333,540) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 10,353,493 | BRL | 10,730,270 | (376,777) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 2,000,000 | TRY | 2,392,150 | (392,150) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 13,000,000 | BRL | 13,403,050 | (403,050) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 12,000,000 | BRL | 12,500,889 | (500,889) | (0.01)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 18,000,000 | BRL | 18,794,434 | (794,434) | (0.02)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 6,500,000 | TRY | 7,356,891 | (856,891) | (0.03)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年2月2日 | JPY | 29,471,467 | BRL | 30,700,553 | (1,229,086) | (0.04)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 20,881,709 | TRY | 22,410,367 | (1,528,658) | (0.05)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 53,097,414 | MXN | 54,667,323 | (1,569,909) | (0.05)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 68,132,414 | BRL | 70,985,614 | (2,853,200) | (0.09)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 111,530,710 | AUD | 115,230,444 | (3,699,734) | (0.11)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 1,422,582,797 | USD | 1,442,310,920 | (19,728,123) | (0.60)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 1,090,594,524 | BRL | 1,132,389,221 | (41,794,697) | (1.26)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年2月2日 | JPY | 147,807,693 | TRY | 202,999,798 | (55,192,105) | (1.67)% |
| State Street Bank and Trust Company | 購入 | 2022年1月4日 | TRY | 416,805,863 | JPY | 487,910,604 | (71,104,741) | (2.15)% |
| State Street Bank and Trust Company | 売却 | 2022年1月4日 | JPY | 233,048,975 | TRY | 316,910,527 | (83,861,552) | (2.54)% |
| 為替先渡契約に係る未実現損失 | | | | | | | (287,495,379) | (8.70)% |

D I A M マネーマザーファンド

運用報告書

第14期 (決算日 2023年4月5日)

(計算期間 2022年4月6日～2023年4月5日)

D I A M マネーマザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2009年10月29日から無期限です。 |
| 運用方針 | 安定した収益の確保をめざします。 |
| 主要投資対象 | 国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建て資産への投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

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

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

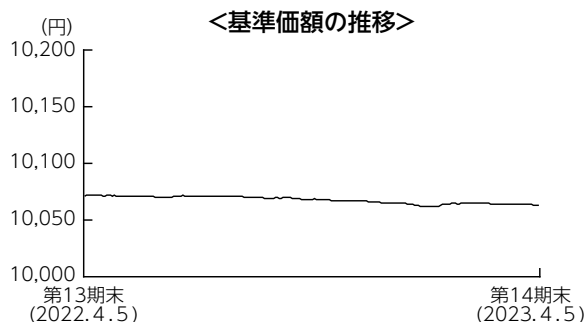
■当期中の基準価額の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年4月6日から2023年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,063円となり、前期末比で0.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

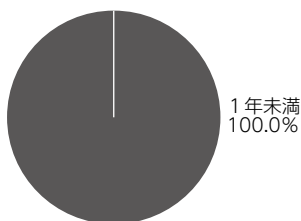
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

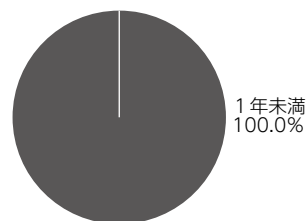
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比 期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2022年4月6日から2023年4月5日まで)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|-----------|---------|-----------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 内 国 債 証 券 | 901,029 | (910,000) |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

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

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|--------------|--------------|--------------------|-----|--------------|--------------------|-------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.028 | 百万円 0.028 | % | 百万円 0.028 | 百万円 0.028 | % |
| | | 100.0 | | | | 100.0 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 | | | | 末 | | |
|---------|---------|---------|---------|-----------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うち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 | 900,000 | 900,426 | 71.8 | — | — | — | 71.8 |
| 合 計 | 900,000 | 900,426 | 71.8 | — | — | — | 71.8 |

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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

■投資信託財産の構成

2023年4月5日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年4月5日)現在

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

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

■損益の状況

当期 自2022年4月6日 至2023年4月5日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (E)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。