

運用報告書 (全体版)

第16期<決算日 2021年5月21日>

**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**

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 米ドルクラス」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。外国投資信託においては、原則として円を売り予約し、米ドルを買い予約する為替取引を行います。 |
| 組入制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | 決算日(原則として毎年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) 米ドルコース」は、2021年5月21日に第16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/>

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 東証株価指数 | | 米ドル/円レート | | 投資信託 受益証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|------------------|------------|------------|-----------|-----------------------------|-----------|-------------|-----------|----------------------|--------------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期騰 落率 | (TOPIX) (配当込み) (参考指数) | 期騰 落率 | (参考) | 期騰 落率 | | |
| 12期(2019年5月21日) | 円 9,579 | 円 80 | % △3.5 | ポイント 2,333.08 | % △2.8 | 円 110.17 | % △2.4 | % 95.6 | 百万円 2,618 |
| 13期(2019年11月21日) | 10,092 | 0 | 5.4 | 2,573.11 | 10.3 | 108.42 | △1.6 | 95.9 | 2,442 |
| 14期(2020年5月21日) | 9,535 | 0 | △5.5 | 2,303.91 | △10.5 | 107.75 | △0.6 | 95.9 | 1,892 |
| 15期(2020年11月24日) | 10,538 | 520 | 16.0 | 2,749.88 | 19.4 | 104.58 | △2.9 | 95.3 | 1,751 |
| 16期(2021年5月21日) | 11,365 | 1,150 | 18.8 | 3,003.66 | 9.2 | 108.90 | 4.1 | 95.5 | 1,690 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）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TOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

(注3) 米ドル/円レート：対顧客電信売買相場仲値（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

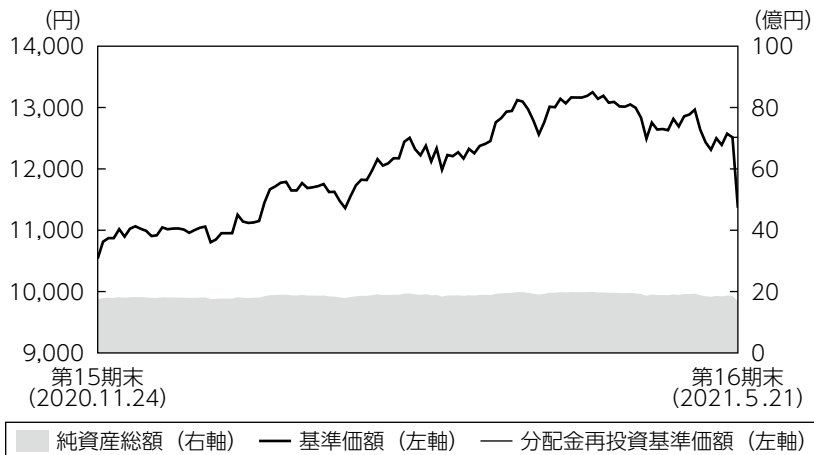
| 年月日 | 基準価額 | | 東証株価指数 | | 米ドル/円レート | | 投資信託 受益証券 組入比率 |
|---------------------|-------------|-----------------------------|------------------|--------|-------------|--------|----------------------|
| | 騰落率 | (TOPIX) (配当込み) (参考指数) | 騰落率 | (参考) | 騰落率 | | |
| (期首) 2020年11月24日 | 円 10,538 | % - | ポイント 2,749.88 | % - | 円 104.58 | % - | % 95.3 |
| 11月末 | 11,017 | 4.5 | 2,738.72 | △0.4 | 103.89 | △0.7 | 95.6 |
| 12月末 | 11,253 | 6.8 | 2,819.93 | 2.5 | 103.50 | △1.0 | 96.2 |
| 2021年1月末 | 11,477 | 8.9 | 2,826.50 | 2.8 | 104.48 | △0.1 | 95.7 |
| 2月末 | 12,334 | 17.0 | 2,914.58 | 6.0 | 106.25 | 1.6 | 96.2 |
| 3月末 | 13,143 | 24.7 | 3,080.87 | 12.0 | 110.71 | 5.9 | 96.4 |
| 4月末 | 12,816 | 21.6 | 2,993.46 | 8.9 | 108.93 | 4.2 | 96.5 |
| (期末) 2021年5月21日 | 12,515 | 18.8 | 3,003.66 | 9.2 | 108.90 | 4.1 | 95.5 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■当期の運用経過（2020年11月25日から2021年5月21日まで）

基準価額等の推移



第16期首：10,538円
 第16期末：11,365円
 （既払分配金1,150円）
 騰落率：18.8%
 （分配金再投資ベース）

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

主要国による大規模な財政支出や金融緩和が経済や金融市場を支えたことや、停滞していた経済活動が再開に向かい世界経済や企業業績の回復が進んだことを背景に国内株式市場が上昇したことに加え、米ドルが円に対して上昇したことがプラスに寄与し、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 米ドルクラス | 20.4% |
| D I A Mマネーマザーファンド | △0.0% |

- (注) 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 米ドルクラスの騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

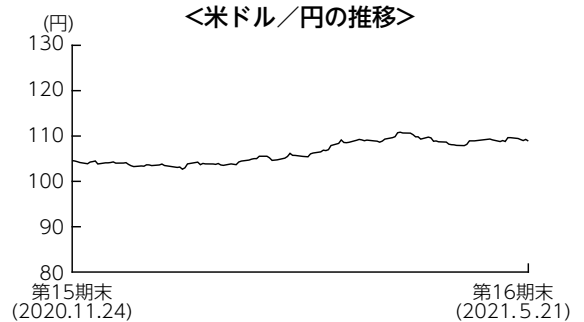
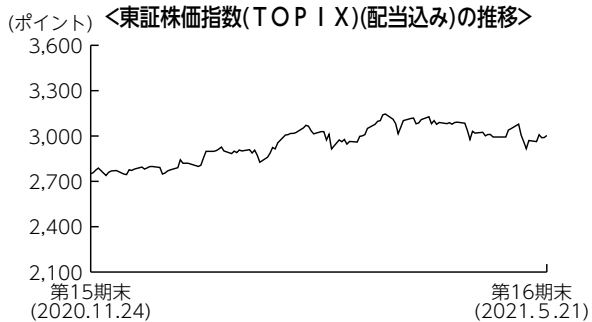
投資環境

国内株式市場は上昇しました。前期末から2021年3月にかけては、主要国による大規模な財政支出や金融緩和に支えられたことに加え、新型コロナウイルスのワクチンの接種が進むことによる経済正常化への期待が高まり、上昇基調となりました。その後、当期末にかけては、変異株の感染拡大や米国のインフレ率上昇が懸念材料となり、やや軟調な推移となりました。

米国では、F R B（米連邦準備理事会）は金融緩和政策を継続する姿勢を維持しましたが、バイデン米政権が大規模な財政政策を進める方針であることや、新型コロナウイルスワクチンの接種が進み経済回復が鮮明となったことを背景に金利水準が上昇したことから、為替市場では米ドルは円に対して上昇しました。

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の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力がかかっていることが要因となりました。

【参考】



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・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 米ドルクラスの組入比率は、原則として高位を維持し、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行いました。

●D I A Mケイマン・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 米ドルクラス

株式市場の物色動向の変化に対応し、ポートフォリオ構成の調整を進めました。組入銘柄については、世界的に経済正常化の期待が高まったことを踏まえ、業績成長期待の高いグロース銘柄のウェイトを引き下げ、景気敏感株を中心にバリュー株のウェイトを引き上げました。株式組入比率については、株式市場の堅調さを踏まえ、期を通じて概ね高位で推移しました。

また、円を売り予約し、米ドルを買い予約する為替取引を行いました。

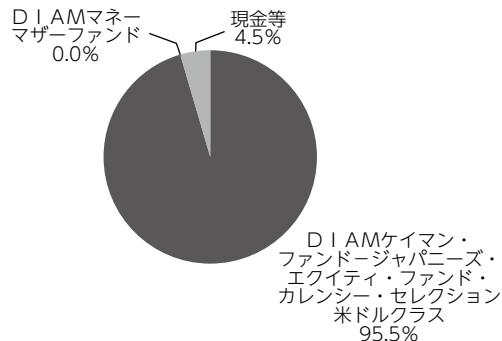
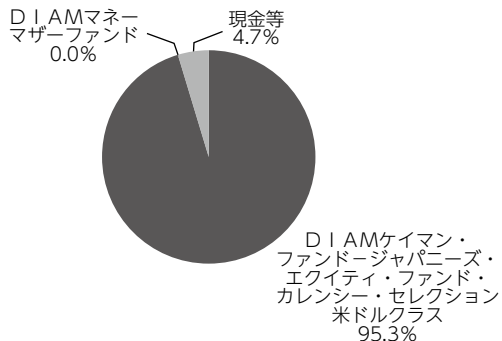
●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債や政府保証債などで運用を行いました。

ポートフォリオ構成 ※比率は純資産総額に対する割合です。

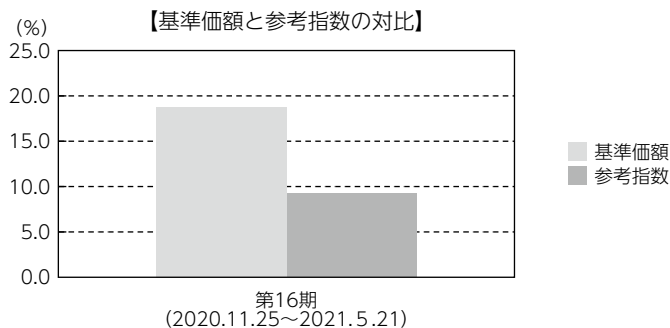
期首 (前期末)

期末



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。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|----------------------------|
| | 2020年11月25日 ～2021年5月21日 |
| 当期分配金（税引前） | 1,150円 |
| 対基準価額比率 | 9.19% |
| 当期の収益 | 1,150円 |
| 当期の収益以外 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,283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・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 米ドルクラスを高位に組入れることを基本とした運用を行います。また、D I 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・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 米ドルクラス

米国の金融政策が引き締め方向へ見直される可能性が不透明要因となり、当面は不安定な相場展開になり得ると見ています。一方で、世界経済や企業業績が回復基調にあるなど株式市場を巡る基本的な環境は良好と見ており、次第に堅調な展開に移行していくと予想します。

運用方針としては、国内外の感染状況や金融政策運営などを踏まえ、市場動向を注視しつつ株式組入比率、組入銘柄共に柔軟に調整していく方針で臨みます。加えて、円を売り予約し、米ドルを買い予約する為替取引を行います。

●D I A Mマネーマザーファンド

日銀は新型コロナウイルスによる景気落ち込みに対処するため、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、今後も公社債を中心に投資を行い、安定的な運用をめざしていきます。

■1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第16期 | | 項目の概要 |
|---------------------|------------------------------|------------------|--|
| | (2020年11月25日 ～2021年5月21日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 82円 | 0.681% | (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12,062円です。 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 |
| (投信会社) | (35) | (0.290) | |
| (販売会社) | (45) | (0.375) | |
| (受託会社) | (2) | (0.016) | |
| (b) その他費用 (監査費用) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| 合計 | 82 | 0.683 | |

(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。

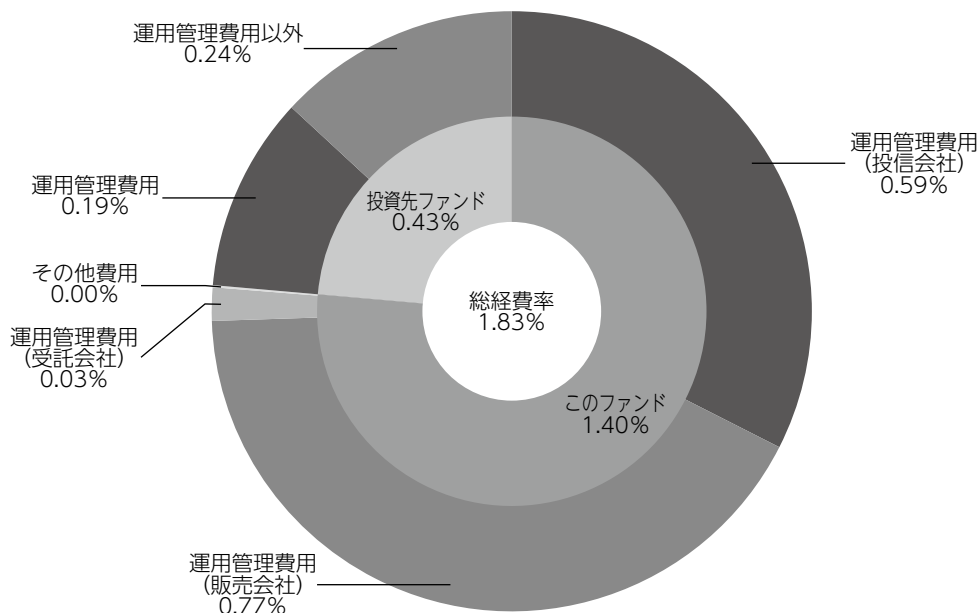
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.83%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 1.83% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.40% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.19% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.24% |

(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 (2020年11月25日から2021年5月21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 |
| 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 米ドルクラス | — | — | 25.49896 | 385,518 |

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2020年11月25日から2021年5月21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 (2020年11月25日から2021年5月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 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-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 米ドルクラス | 129.08525 | 103.58629 | 1,613,460 | 95.5 |
| 合 計 | 129.08525 | 103.58629 | 1,613,460 | 95.5 |

(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□ | 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

2021年5月21日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 1,613,460 | 86.0 |
| 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 | 261,565 | 13.9 |
| 投資信託財産総額 | 1,875,035 | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年5月21日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,875,035,265円 |
| コール・ローン等 | 90,547,208 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 1,613,460,053 |
| D I A M マネーマザーファンド(評価額) | 10,004 |
| 未 収 入 金 | 171,018,000 |
| (B) 負 債 | 184,874,642 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 171,018,347 |
| 未 払 解 約 金 | 1,047,038 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 12,782,480 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 26,777 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 1,690,160,623 |
| 元 本 | 1,487,116,067 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 203,044,556 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,487,116,067口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 11,365円 |

(注) 期首における元本額は1,661,993,306円、当期中における追加設定元本額は1,875,210円、同解約元本額は176,752,449円です。

■損益の状況

当期 自2020年11月25日 至2021年5月21日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △6,257円 |
| 受 取 利 息 | 422 |
| 支 払 利 息 | △6,679 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 306,880,041 |
| 売 買 益 | 329,250,102 |
| 売 買 損 | △22,370,061 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △12,809,257 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 294,064,527 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △19,874,007 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 99,872,383 |
| (配 当 等 相 当 額) | (236,463,353) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△136,590,970) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 374,062,903 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △171,018,347 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H) | 203,044,556 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 99,872,383 |
| (配 当 等 相 当 額) | (236,463,353) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△136,590,970) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 103,178,421 |
| 繰 越 損 益 金 | △6,248 |

(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 | 274,196,768 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 236,463,353 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 0 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d) | 510,660,121 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 3,433.90 |
| (g) 分 配 金 | 171,018,347 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 1,150 |

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 1,150円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

- 当ファンドが投資対象とする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・セレクション米ドルクラスにおいてAsset Management One International Ltd.が行っていた為替管理業務について、2021年8月21日より契約先をState Street Bank and Trust Companyへ変更する予定です。

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 | Asset Management One International Ltd. |
| 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、2019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、2019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
2019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16,976,654円控除後） | 90,465,364 |
| 収益合計 | 90,465,364 |
| 費用 | |
| 投資運用報酬および準投資運用報酬 | 11,704,579 |
| 管理事務代行報酬 | 10,094,956 |
| 保管報酬 | 8,408,960 |
| 受託者報酬 | 2,209,852 |
| 専門家報酬 | 227,150 |
| その他の費用 | 705,189 |
| 費用合計 | 33,350,686 |
| 正味投資利益 | 57,114,678 |
| デリバティブ取引に係る正味実現利益 | 52,390,265 |
| 投資有価証券に係る正味実現損失 | (16,347,987) |
| 当期正味実現利益 | 36,042,278 |
| デリバティブ取引に係る未実現利益の正味増減額 | 129,112,234 |
| 投資有価証券に係る未実現利益の正味増減額 | 927,727,628 |
| 当期末未実現利益の正味増減額 | 1,056,839,862 |
| 運用による純資産の純増加額 | 1,149,996,818 |

| | 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 | 51,472.01 | 12,047.86 |
| クラスU S D | 187,170.06 | 12,130.90 |
| クラスA U D | 13,651.67 | 10,434.95 |
| クラスM X N | 9,806.10 | 9,570.38 |
| クラスT R Y | 248,350.92 | 4,218.46 |
| クラスB R L | 414,910.03 | 6,329.96 |

投資有価証券明細書
2019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 (%) |
|---|--------|---------------|---------------|-------------|
| 普通株式 | | | | |
| 日本 | | | | |
| 素材 | | | | |
| DKS Co Ltd | 16,200 | 58,695,849 | 71,442,000 | 1.05% |
| Fuso Chemical Co Ltd | 14,400 | 43,624,060 | 46,584,000 | 0.68% |
| Hodogaya Chemical Co Ltd | 9,200 | 36,425,078 | 38,916,000 | 0.57% |
| Ishihara Sangyo Kaisha Ltd | 18,300 | 22,790,720 | 19,141,800 | 0.28% |
| Kumiai Chemical Industry Co Ltd | 35,300 | 31,069,402 | 35,405,900 | 0.52% |
| Mitsubishi Chemical Holdings Corp | 56,600 | 48,816,434 | 46,270,500 | 0.68% |
| Mitsui Chemicals Inc | 30,100 | 80,444,124 | 80,668,000 | 1.19% |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 5,300 | 59,602,379 | 63,918,000 | 0.94% |
| Sumitomo Metal Mining Co Ltd | 31,900 | 111,790,800 | 113,053,600 | 1.66% |
| Tokuyama Corp | 38,900 | 110,002,104 | 111,370,700 | 1.64% |
| | | 603,260,950 | 626,770,500 | 9.21% |
| 通信 | | | | |
| BASE Inc | 46,600 | 81,510,698 | 81,783,000 | 1.20% |
| M3 Inc | 27,600 | 61,800,595 | 91,218,000 | 1.34% |
| Oricon Inc | 10,400 | 17,065,724 | 18,699,200 | 0.28% |
| SoftBank Corp. | 18,500 | 94,682,321 | 87,986,000 | 1.29% |
| Uzabase Inc | 36,800 | 81,519,001 | 83,683,200 | 1.23% |
| ValueCommerce Co Ltd | 69,200 | 125,233,739 | 162,204,800 | 2.39% |
| | | 461,812,078 | 525,574,200 | 7.73% |
| 一般消費財、景気循環型 | | | | |
| Bushiroad Inc | 8,800 | 33,687,617 | 33,132,000 | 0.49% |
| Fast Retailing Co Ltd | 800 | 39,080,396 | 52,000,000 | 0.77% |
| ITOCHU Corp | 18,200 | 43,281,324 | 46,127,900 | 0.68% |
| Mitsubishi Corp | 14,300 | 44,559,688 | 41,470,000 | 0.61% |
| Nintendo Co Ltd | 1,500 | 58,944,134 | 65,955,000 | 0.97% |
| Nitori Holdings Co Ltd | 4,200 | 67,192,001 | 72,345,000 | 1.06% |
| Open House Co Ltd | 33,100 | 80,863,360 | 103,603,000 | 1.52% |
| Pan Pacific International Holdings Corp | 40,000 | 46,780,737 | 72,440,000 | 1.07% |
| QB Net Holdings Co Ltd | 5,200 | 12,292,932 | 13,473,200 | 0.20% |
| Sony Corp. | 36,500 | 199,630,155 | 270,136,500 | 3.97% |
| Subaru Corp | 12,200 | 36,012,121 | 33,104,700 | 0.49% |
| Sumitomo Electric Industries Ltd | 36,800 | 61,483,095 | 60,793,600 | 0.89% |
| Sundrug Co Ltd | 9,600 | 31,405,490 | 37,968,000 | 0.56% |
| Sushiro Global Holdings Ltd | 11,500 | 81,280,513 | 107,755,000 | 1.58% |
| Toyota Industries Corp | 8,700 | 55,093,525 | 55,071,000 | 0.81% |
| Toyota Motor Corp | 17,500 | 119,517,628 | 134,995,000 | 1.98% |
| Welcia Holdings Co Ltd | 3,500 | 17,807,050 | 24,325,000 | 0.36% |
| | | 1,028,911,766 | 1,224,694,900 | 18.01% |

| | 株数 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 対純資産 (%) |
|--------------------------------------|---------|--------------------|--------------------|---------------|
| 普通株式 | | | | |
| 日本 (つづき) | | | | |
| 一般消費財、生活必需品 | | | | |
| Asahi Intecc Co., Ltd. | 6,500 | 7,455,079 | 20,800,000 | 0.31% |
| Chugai Pharmaceutical Co Ltd | 2,800 | 24,830,692 | 28,224,000 | 0.41% |
| Dai Nippon Printing Co Ltd | 10,700 | 30,763,856 | 31,672,000 | 0.47% |
| Daiichi Sankyo Co Ltd | 4,600 | 12,269,951 | 33,248,800 | 0.49% |
| Eisai Co Ltd | 3,200 | 26,097,807 | 26,252,800 | 0.39% |
| GMO Payment Gateway Inc | 13,300 | 94,334,632 | 99,484,000 | 1.46% |
| IBJ Inc | 51,500 | 58,246,312 | 63,963,000 | 0.94% |
| JCR Pharmaceuticals Co Ltd | 7,300 | 39,942,067 | 64,678,000 | 0.95% |
| Milbon Co Ltd | 5,400 | 27,600,034 | 33,480,000 | 0.49% |
| Morinaga Milk Industry Co Ltd | 12,400 | 48,566,165 | 55,180,000 | 0.81% |
| PeptiDream Inc. | 21,500 | 104,139,003 | 120,400,000 | 1.77% |
| Riso Kyoiku Co Ltd | 246,300 | 99,795,073 | 95,071,800 | 1.40% |
| Sosei Group Corp | 6,500 | 16,021,472 | 14,111,500 | 0.21% |
| StemRIM Inc | 72,600 | 68,151,166 | 66,792,000 | 0.98% |
| Takara Bio Inc | 20,400 | 53,492,744 | 41,962,800 | 0.62% |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd | 7,400 | 30,252,165 | 32,056,800 | 0.47% |
| | | <u>741,958,218</u> | <u>827,377,500</u> | <u>12.17%</u> |
| エネルギー | | | | |
| Idemitsu Kosan Co Ltd | 8,500 | 29,163,190 | 25,755,000 | 0.38% |
| Inpex Corp. | 46,000 | 51,963,030 | 52,279,000 | 0.77% |
| | | <u>81,126,220</u> | <u>78,034,000</u> | <u>1.15%</u> |
| 金融 | | | | |
| Chiba Bank Ltd/The | 80,400 | 49,162,906 | 50,893,200 | 0.75% |
| Dai-ichi Life Holdings Inc | 69,700 | 118,856,824 | 126,610,050 | 1.86% |
| Fukuoka Financial Group Inc | 22,900 | 49,443,339 | 48,204,500 | 0.71% |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc. | 225,700 | 144,362,056 | 133,885,240 | 1.97% |
| Mitsui Fudosan Co Ltd | 8,300 | 23,106,100 | 22,177,600 | 0.33% |
| ORIX Corp | 23,700 | 41,193,095 | 42,920,700 | 0.63% |
| SBI Holdings Inc/Japan | 28,000 | 68,917,336 | 64,820,000 | 0.95% |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc. | 29,700 | 123,552,156 | 119,928,600 | 1.76% |
| | | <u>618,593,812</u> | <u>609,439,890</u> | <u>8.96%</u> |

| | 株数 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 対純資産 (%) |
|---|--------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------|
| 普通株式 | | | | |
| 日本 (つづき) | | | | |
| 資本財・サービス | | | | |
| Anritsu Corp | 27,800 | 54,591,812 | 60,270,400 | 0.89% |
| COMSYS Holdings Corp | 25,500 | 70,763,212 | 79,942,500 | 1.18% |
| Daikin Industries Ltd | 2,700 | 34,971,001 | 41,715,000 | 0.61% |
| Fuji Electric Co Ltd | 26,600 | 90,412,422 | 88,977,000 | 1.31% |
| Hioki EE Corp | 8,600 | 31,816,860 | 32,680,000 | 0.48% |
| Hitachi Ltd | 30,800 | 117,097,131 | 142,480,800 | 2.09% |
| Hoya Corp | 5,000 | 49,299,439 | 52,250,000 | 0.77% |
| Ibiden Co Ltd | 39,900 | 77,842,878 | 103,939,500 | 1.53% |
| Katitas Co Ltd | 27,400 | 95,449,632 | 131,931,000 | 1.94% |
| Makino Milling Machine Co Ltd | 11,700 | 61,625,091 | 58,734,000 | 0.86% |
| Mitsui OSK Lines Ltd | 22,100 | 63,950,634 | 66,852,500 | 0.98% |
| Murata Manufacturing Co Ltd | 20,000 | 111,934,445 | 134,920,000 | 1.98% |
| Nidec Corp. | 2,900 | 32,880,527 | 43,514,500 | 0.64% |
| Nihon Flush Co Ltd | 12,500 | 34,557,952 | 37,137,500 | 0.55% |
| Nishimatsu Construction Co Ltd | 14,100 | 30,708,896 | 34,827,000 | 0.51% |
| Penta-Ocean Construction Co., Ltd. | 61,400 | 33,443,765 | 41,567,800 | 0.61% |
| SCREEN Holdings Co Ltd | 5,700 | 33,681,626 | 42,693,000 | 0.63% |
| Seibu Holdings Inc | 19,400 | 39,572,210 | 34,823,000 | 0.51% |
| Shimizu Corp | 50,800 | 48,591,038 | 56,692,800 | 0.83% |
| SMC Corp/Japan | 700 | 26,932,624 | 35,203,000 | 0.52% |
| Star Micronics Co Ltd | 28,800 | 43,655,972 | 45,360,000 | 0.67% |
| Taisei Corp | 12,300 | 51,370,357 | 55,903,500 | 0.82% |
| West Japan Railway Co | 2,300 | 18,283,891 | 21,714,300 | 0.32% |
| Yaskawa Electric Corp | 26,300 | 103,410,461 | 109,671,000 | 1.61% |
| | | <u>1,356,843,876</u> | <u>1,553,800,100</u> | <u>22.84%</u> |
| テクノロジー | | | | |
| Advantest Corp | 27,800 | 123,503,265 | 171,248,000 | 2.52% |
| Autonomous Control Systems Laboratory Ltd | 10,800 | 33,981,772 | 34,452,000 | 0.51% |
| Comture Corp | 19,000 | 40,649,781 | 44,650,000 | 0.66% |
| Itochu Techno-Solutions Corp | 9,800 | 30,524,972 | 30,135,000 | 0.44% |
| JMDC Inc | 13,800 | 56,263,479 | 62,031,000 | 0.91% |
| Rohm Co Ltd | 3,600 | 30,548,526 | 31,608,000 | 0.46% |
| Sansan Inc | 9,400 | 45,896,499 | 52,076,000 | 0.77% |
| Square Enix Holdings Co Ltd | 12,000 | 59,712,502 | 65,160,000 | 0.96% |
| Systema Corp | 20,800 | 31,769,945 | 36,940,800 | 0.54% |
| TDK Corp | 9,800 | 92,055,563 | 121,422,000 | 1.79% |
| TIS Inc | 5,000 | 23,250,863 | 32,150,000 | 0.47% |
| Tokyo Electron Ltd | 1,800 | 30,705,104 | 43,065,000 | 0.63% |
| | | <u>598,862,271</u> | <u>724,937,800</u> | <u>10.66%</u> |
| 日本合計 | | <u>5,491,369,191</u> | <u>6,170,628,890</u> | <u>90.73%</u> |
| 普通株式合計 | | <u>5,491,369,191</u> | <u>6,170,628,890</u> | <u>90.73%</u> |
| 投資有価証券合計 | | <u>5,491,369,191</u> | <u>6,170,628,890</u> | <u>90.73%</u> |

先物契約：

2019年12月31日現在、当ファンドの先物契約建玉は以下のとおりです。

| 取引相手 | 満期日 | 契約数 | 想定元本 (円) | 購入/売却 | 正味未実現利益/ (評価損) (円) |
|---|------------|-----|-------------|-------|--------------------------|
| Goldman Sachs Japan Topix Index Futures | 2020年3月18日 | 36 | 619,560,000 | 購入 | 790,000 |

為替先渡契約：

2019年12月31日現在、当ファンドは以下の為替先渡契約建玉は以下のとおりです。

| 取引相手 | 購入/ 売却 | 決済日 | 受取通貨 | 約定額 (円) | 引渡通貨 | 時価 (円) | 評価益 (円) | 対純資産 (%) |
|------------------------------|-----------|------------|------|---------------|------|---------------|--------------------|--------------|
| Goldman Sachs Inter-national | 購入 | 2020年1月14日 | BRL | 2,654,891,619 | JPY | 2,557,332,980 | 97,558,639 | 1.43% |
| J.P. Morgan Securities Plc | 購入 | 2020年1月14日 | USD | 2,351,742,168 | JPY | 2,347,607,177 | 4,134,991 | 0.06% |
| Natwest Markets Plc | 購入 | 2020年1月14日 | AUD | 140,121,055 | JPY | 136,657,611 | 3,463,444 | 0.05% |
| J.P. Morgan Securities Plc | 購入 | 2020年1月14日 | MXN | 90,868,560 | JPY | 88,442,864 | 2,425,696 | 0.04% |
| 為替先渡契約に係る評価益 | | | | | | | 107,582,770 | 1.58% |

| 取引相手 | 購入/ 売却 | 決済日 | 受取通貨 | 約定額 (円) | 引渡通貨 | 時価 (円) | 評価損 (円) | 対純資産 (%) |
|---------------------|-----------|------------|------|---------------|------|---------------|---------------------|----------------|
| Natwest Markets Plc | 購入 | 2020年1月14日 | TRY | 1,064,666,070 | JPY | 1,089,041,850 | (24,375,780) | (0.36)% |
| 為替先渡契約に係る評価損 | | | | | | | (24,375,780) | (0.36)% |

D I A M マネーマザーファンド

運用報告書

第12期 (決算日 2021年4月5日)

(計算期間 2020年4月7日～2021年4月5日)

D I A M マネーマザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 債券 組入比率 | 新株予約権 付社債 (転換社債) | 債券 先物比率 | 純資産 総額 |
|----------------|--------|------|------------|------------------------|------------|--------------|
| | 期騰 | 落率 | | | | |
| 8期(2017年4月5日) | 円 | % | % | % | % | 百万円 1,045 |
| 9期(2018年4月5日) | 10,104 | 0.1 | 71.2 | — | — | 1,030 |
| 10期(2019年4月5日) | 10,099 | △0.0 | 71.1 | — | — | 16,167 |
| 11期(2020年4月6日) | 10,098 | △0.0 | 79.4 | — | — | 1,139 |
| 12期(2021年4月5日) | 10,089 | △0.1 | 69.3 | — | — | 1,064 |
| | 10,080 | △0.1 | 62.4 | — | — | |

(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)。

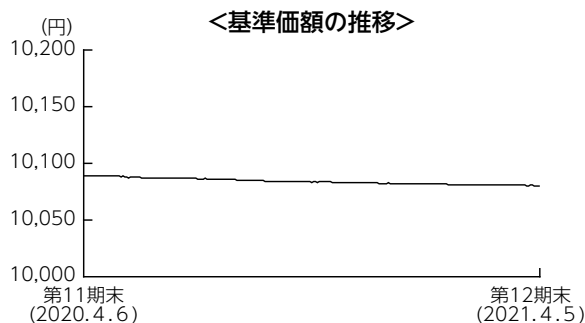
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 債 組 入 比 率 | 新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|------------------------|---------|--------|-----------|---|-----------|
| | 円 | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2020年 4 月 6 日 | 10,089 | % - | % 69.3 | % - | % - |
| 4 月 末 | 10,089 | 0.0 | 71.1 | - | - |
| 5 月 末 | 10,087 | △0.0 | 89.9 | - | - |
| 6 月 末 | 10,087 | △0.0 | 62.3 | - | - |
| 7 月 末 | 10,086 | △0.0 | 77.8 | - | - |
| 8 月 末 | 10,084 | △0.0 | 74.4 | - | - |
| 9 月 末 | 10,084 | △0.0 | 63.2 | - | - |
| 10 月 末 | 10,083 | △0.1 | 63.2 | - | - |
| 11 月 末 | 10,082 | △0.1 | 64.0 | - | - |
| 12 月 末 | 10,082 | △0.1 | 64.0 | - | - |
| 2021年 1 月 末 | 10,081 | △0.1 | 63.9 | - | - |
| 2 月 末 | 10,081 | △0.1 | 63.9 | - | - |
| 3 月 末 | 10,080 | △0.1 | 62.4 | - | - |
| (期 末) 2021年 4 月 5 日 | 10,080 | △0.1 | 62.4 | - | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年4月7日から2021年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,080円となり、前期末比で0.09%下落しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざした運用を行いましたが、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の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。新型コロナウイルスへの影響に対する経済の下支えもあり、日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力がかかっていることなどが要因となりました。

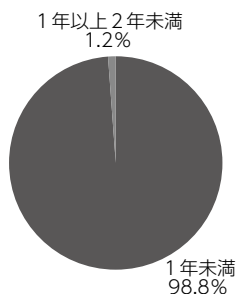
ポートフォリオについて

残存期間の短い国債や政府保証債、地方債などで運用を行いました。

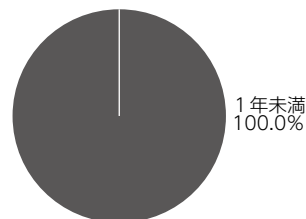
【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比

期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2020年4月7日から2021年4月5日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|-------|---------|-----------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 内 | | |
| | 国債証券 | 400,802 | (700,000) |
| | 地方債証券 | — | (43,470) |
| | 特殊債証券 | 460,461 | (236,000) |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年4月7日から2021年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 | 当 | | | 期 | | |
|-----|------------|--------------------|-----------|-----------|--------------------|--------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 公社債 | 百万円 861 | 百万円 359 | % 41.7 | 百万円 — | 百万円 — | % — |

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 | | | | 末 | | |
|---------|---------|---------|---------|--------------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 400,000 | 400,342 | 37.6 | — | — | — | 37.6 |
| 特 殊 債 券 | 263,000 | 264,140 | 24.8 | — | — | — | 24.8 |
| 合 計 | 663,000 | 664,482 | 62.4 | — | — | — | 62.4 |

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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

■投資信託財産の構成

2021年4月5日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 | |
|-------------------------|-------|-----|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 | | |
| 公 社 債 | 千円 | % | 664,482 | 62.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | | | 400,021 | 37.6 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | | | 1,064,503 | 100.0 |

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月5日)現在

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

(注1) 期首元本額 1,129,674,818円
追加設定元本額 713,862円
一部解約元本額 74,354,117円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|---|----------------|
| クルーズコントロール | 990,000,991円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース> | 870,000円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース> | 530,000円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース> | 70,000円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルレアルコース> | 10,530,000円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース> | 149,716円 |
| ネット証券専用ファンドシリーズ 新興市場日本株 レアル型 | 103,986円 |
| DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 資産通貨バスケットコース | 4,486,988円 |
| DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド ブラジルレアルコース | 4,586,699円 |
| DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 円コース | 997,109円 |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース> | 5,972円 |
| USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり) | 993,740円 |
| USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし) | 1,987,479円 |
| DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金> | 9,935円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 円コース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 米ドルコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 豪ドルコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) メキシコペソコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) トルコリラコース | 9,925円 |
| みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) ブラジルレアルコース | 9,925円 |
| USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジあり | 9,924円 |
| USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジなし | 9,924円 |
| マシユーズ・アジア株式ファンド | 29,641,137円 |
| One世界分散セレクト (Aコース) | 99,040円 |
| One世界分散セレクト (Bコース) | 99,040円 |
| One世界分散セレクト (Cコース) | 99,040円 |
| 世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型) | 99,109円 |
| モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) | 188,380円 |
| モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし) | 109,063円 |
| モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり) | 297,442円 |
| モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし) | 118,977円 |
| リスクコントロール型ETF分散投資ファンド (適格機関投資家限定) | 9,881,322円 |
| 期末元本合計 | 1,056,034,563円 |

■損益の状況

当期 自2020年4月7日 至2021年4月5日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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