

運用報告書 (全体版)

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

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・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 豪ドルクラス」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、豪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。

第65期 <決算日 2018年12月21日>
 第66期 <決算日 2019年1月21日>
 第67期 <決算日 2019年2月21日>
 第68期 <決算日 2019年3月22日>
 第69期 <決算日 2019年4月22日>
 第70期 <決算日 2019年5月21日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「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」は、2019年5月21日に第70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）豪ドルコース

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			東証株価指数		豪ドル/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	期中 騰落率	(TOPIX) (配当込み 参考指数)	期中 騰落率	(参考)	期中 騰落率		
第8作成期	41期(2016年12月21日)	円 10,779	円 40	% 11.0	ポイント 2,199.32	% 7.1	円 85.68	% 5.3	% 95.4	百万円 596
	42期(2017年1月23日)	10,916	40	1.6	2,158.90	△1.8	86.19	0.6	95.7	681
	43期(2017年2月21日)	11,040	40	1.5	2,218.01	2.7	87.06	1.0	95.5	673
	44期(2017年3月21日)	11,153	40	1.4	2,229.95	0.5	86.89	△0.2	95.4	581
	45期(2017年4月21日)	10,156	40	△8.6	2,142.28	△3.9	82.17	△5.4	95.4	491
	46期(2017年5月22日)	10,693	40	5.7	2,256.15	5.3	83.03	1.0	95.8	498
第9作成期	47期(2017年6月21日)	11,525	40	8.2	2,321.00	2.9	84.29	1.5	96.0	513
	48期(2017年7月21日)	11,991	40	4.4	2,350.15	1.3	88.95	5.5	95.9	467
	49期(2017年8月21日)	11,502	40	△3.7	2,300.19	△2.1	86.64	△2.6	95.8	423
	50期(2017年9月21日)	11,911	40	3.9	2,406.92	4.6	90.19	4.1	95.7	377
	51期(2017年10月23日)	12,004	40	1.1	2,536.63	5.4	88.98	△1.3	95.9	331
	52期(2017年11月21日)	11,630	40	△2.8	2,574.33	1.5	85.05	△4.4	95.6	313
第10作成期	53期(2017年12月21日)	12,308	40	6.2	2,649.92	2.9	86.75	2.0	91.4	330
	54期(2018年1月22日)	13,413	40	9.3	2,754.01	3.9	88.53	2.1	95.8	333
	55期(2018年2月21日)	12,057	40	△9.8	2,564.55	△6.9	84.86	△4.1	95.4	245
	56期(2018年3月22日)	11,525	40	△4.1	2,515.61	△1.9	82.05	△3.3	95.3	230
	57期(2018年4月23日)	11,568	40	0.7	2,572.96	2.3	82.67	0.8	95.4	231
	58期(2018年5月21日)	11,998	40	4.1	2,665.56	3.6	83.47	1.0	95.6	239
第11作成期	59期(2018年6月21日)	11,535	40	△3.5	2,574.74	△3.4	81.39	△2.5	95.1	209
	60期(2018年7月23日)	11,876	40	3.3	2,560.28	△0.6	82.40	1.2	95.4	207
	61期(2018年8月21日)	10,810	40	△8.6	2,482.06	△3.1	80.75	△2.0	95.0	188
	62期(2018年9月21日)	11,707	40	8.7	2,657.50	7.1	82.12	1.7	95.5	176
	63期(2018年10月22日)	10,962	40	△6.0	2,517.07	△5.3	79.80	△2.8	95.2	165
	64期(2018年11月21日)	10,395	40	△4.8	2,399.27	△4.7	81.44	2.1	95.4	179
第12作成期	65期(2018年12月21日)	9,570	40	△7.6	2,210.66	△7.9	79.17	△2.8	94.7	156
	66期(2019年1月21日)	9,640	40	1.1	2,330.66	5.4	78.57	△0.8	94.8	157
	67期(2019年2月21日)	9,958	40	3.7	2,401.03	3.0	79.64	1.4	95.4	160
	68期(2019年3月22日)	10,014	40	1.0	2,407.37	0.3	78.69	△1.2	95.4	161
	69期(2019年4月22日)	10,127	40	1.5	2,435.83	1.2	80.05	1.7	95.2	163
	70期(2019年5月21日)	9,274	40	△8.0	2,333.08	△4.2	76.23	△4.8	94.8	149

(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（株東京証券取引所）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、(株東京証券取引所)が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)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) 豪ドル/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）。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

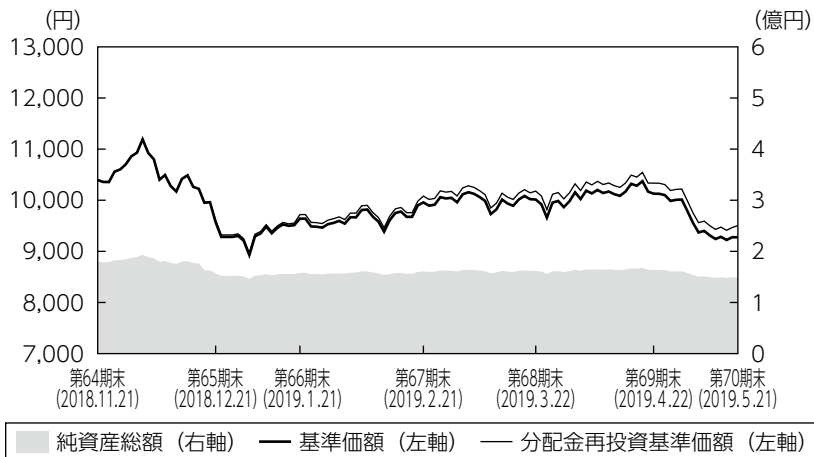
決算期	年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数		豪ドル／円レート		投資信託 受益証券 組入比率
			騰 落 率	(TOPIX) (配当込み) (参考指数)	騰 落 率	(参 考)	騰 落 率	
第 65 期	(期 首) 2018年 11月 21日	円	%	ポイント	%	円	%	%
	11 月 末	10,395	-	2,399.27	-	81.44	-	95.4
	(期 末) 2018年 12月 21日	10,859	4.5	2,475.92	3.2	83.08	2.0	95.6
第 66 期	(期 首) 2018年 12月 21日	9,610	△7.6	2,210.66	△7.9	79.17	△2.8	94.7
	12 月 末	9,570	-	2,210.66	-	79.17	-	94.7
	(期 末) 2019年 1月 21日	9,304	△2.8	2,223.11	0.6	78.18	△1.3	94.6
第 67 期	(期 首) 2019年 1月 21日	9,680	1.1	2,330.66	5.4	78.57	△0.8	94.8
	1 月 末	9,640	-	2,330.66	-	78.57	-	94.8
	(期 末) 2019年 2月 21日	9,541	△1.0	2,332.52	0.1	78.96	0.5	94.7
第 68 期	(期 首) 2019年 2月 21日	9,998	3.7	2,401.03	3.0	79.64	1.4	95.4
	2 月 末	9,958	-	2,401.03	-	79.64	-	95.4
	(期 末) 2019年 3月 22日	10,047	0.9	2,393.08	△0.3	79.34	△0.4	95.4
第 69 期	(期 首) 2019年 3月 22日	10,054	1.0	2,407.37	0.3	78.69	△1.2	95.4
	3 月 末	10,014	-	2,407.37	-	78.69	-	95.4
	(期 末) 2019年 4月 22日	9,865	△1.5	2,395.21	△0.5	78.64	△0.1	95.4
第 70 期	(期 首) 2019年 4月 22日	10,167	1.5	2,435.83	1.2	80.05	1.7	95.2
	4 月 末	10,127	-	2,435.83	-	80.05	-	95.2
	(期 末) 2019年 5月 21日	10,008	△1.2	2,434.82	△0.0	78.41	△2.0	95.1
		9,314	△8.0	2,333.08	△4.2	76.23	△4.8	94.8

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

■第65期～第70期の運用経過（2018年11月22日から2019年5月21日まで）

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

米国株式市場の急落や、米中の対立激化を背景とした世界経済の先行き不透明感などを背景に国内株式市場が下落したことに加え、豪ドルが円に対して下落したことがマイナスに寄与し、基準価額は下落しました。なお、オーストラリアと日本との金利差から、円売り豪ドル買いの為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）を獲得したことはプラスに寄与しました。

◆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 豪ドルクラス	△8.3%
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 豪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。

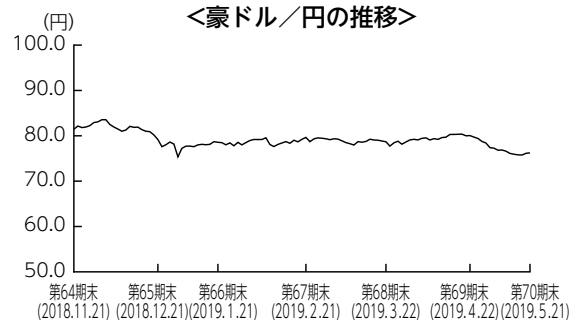
投資環境

国内株式市場は下落しました。前作成期末から2018年12月にかけては、米中貿易戦争による世界経済の先行き不透明感などを背景に世界的に株式市場が調整する展開となり、国内株式市場も大幅に下落しました。2019年1月から4月にかけては、米国が金融引き締め政策を見直したことを受けて回復に転じ、緩やかに上昇する展開となりました。しかしながら、5月に入ると米中の対立が激化し、再び軟調な推移となりました。

オーストラリアでは、政策金利は据え置かれましたが、2018年10-12月期の経済成長率が減速したことや、米中の対立激化で最大の輸出相手国である中国の経済の先行きが懸念されたことなどから、前作成期末比では豪ドルは円に対して下落しました。

日米欧の中央銀行は米中の貿易問題などの影響を見極めるため金融政策を据え置いています。そのため、国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは△0.3%台～△0.1%台で推移するなど、レンジ内での推移となりました。

【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 豪ドルクラス
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 豪ドルクラス

市場動向の変化に応じて機動的な運用を行いました。組入銘柄については、2018年末にかけての調整局面では
ディフェンシブ銘柄中心の構成としましたが、その後2019年4月にかけては世界経済の回復期待が高まったと判断
し景気敏感銘柄のウェイトを引き上げました。株式組入比率については、株式市場の下落リスクが高まったと判断
した局面では引き下げるなど柔軟なコントロールを実施しました。

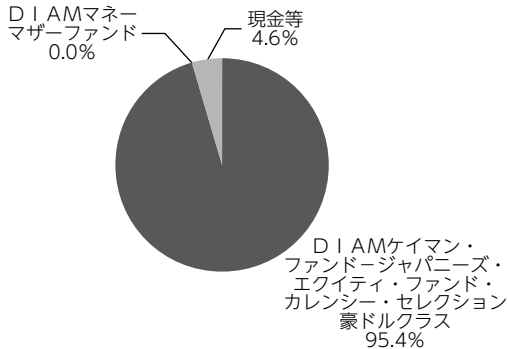
また、円を売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行いました。

●D I A Mマネーマザーファンド

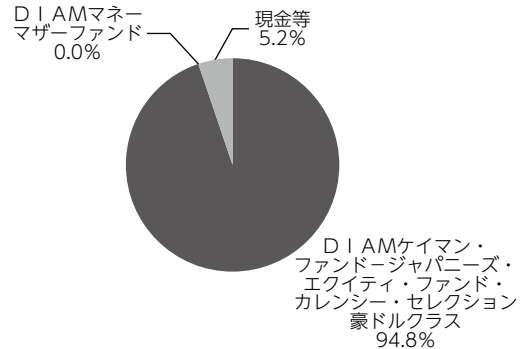
残存期間の短い国債や政府保証債、地方債などで運用を行いました。

ポートフォリオ構成 ※比率は純資産総額に対する割合です。

前作成期末

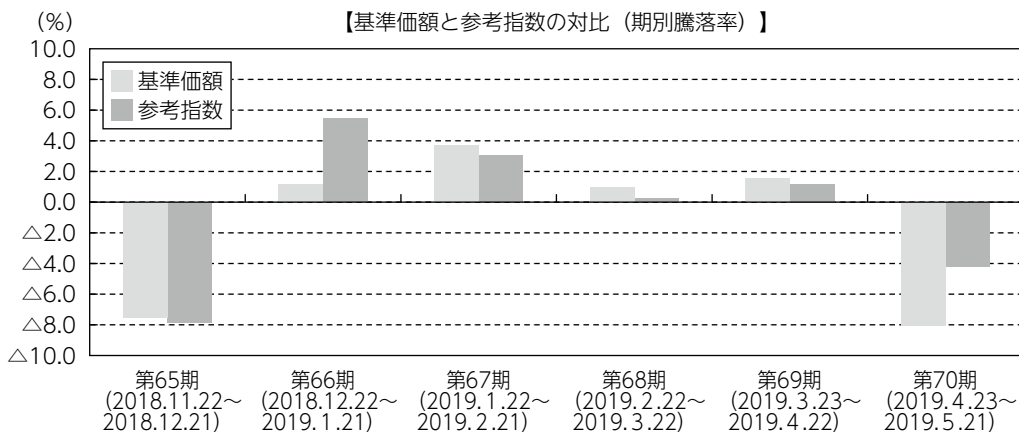


当作成期末



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

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

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期
	2018年11月22日 ~2018年12月21日	2018年12月22日 ~2019年1月21日	2019年1月22日 ~2019年2月21日	2019年2月22日 ~2019年3月22日	2019年3月23日 ~2019年4月22日	2019年4月23日 ~2019年5月21日
当期分配金（税引前）	40円	40円	40円	40円	40円	40円
対基準価額比率	0.42%	0.41%	0.40%	0.40%	0.39%	0.43%
当期の収益	33円	40円	40円	40円	40円	34円
当期の収益以外	6円	-円	-円	-円	-円	5円
翌期繰越分配対象額	5,974円	5,975円	5,979円	5,980円	5,982円	5,976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 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 豪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 AMマネーマザーファンドへの投資も行います。

●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 豪ドルクラス

当面の株式市場は、米中対立が波乱要因となり神経質な展開を予想します。中期的な基本シナリオとしては、世界経済の回復が軌道に乗り、企業の自社株買いや日銀のETF（上場投資信託）買い入れのサポートもあり堅調な展開を想定していますが、米中交渉の動向次第では世界経済を大きく下押ししてしまうリスクも想定すべきと考えます。

運用方針としては、海外要因や市場動向を見極めつつ株式組入比率、組入銘柄ともに機動的に調整する方針で臨みます。加えて、円を売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行います。

●D I AMマネーマザーファンド

日銀の物価目標である2%まではまだ距離があるため、当面は金融政策を据え置くと予想されています。今後もマイナス金利が継続すると考えられるため、国債や政府保証債、地方債などを組入れた運用を行っていきます。

■1万口当たりの費用明細

項目	第65期～第70期		項目の概要
	(2018年11月22日～2019年5月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	67円	0.678%	(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9,858円です。
(投信会社)	(28)	(0.289)	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)	(37)	(0.374)	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
(受託銀行)	(2)	(0.016)	受託銀行分は、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 (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	67	0.680	

(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。

■売買及び取引の状況（2018年11月22日から2019年5月21日まで）

投資信託受益証券

		第 65 期 ~ 第 70 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦貨 建	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 豪ドルクラス	千□ -	千円 -	千□ 1.15563	千円 12,000

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2018年11月22日から2019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（2018年11月22日から2019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	第11作成期末	第 12 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
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 豪ドルクラス	千□ 15.68797	千□ 14.53234	千円 141,283	% 94.8
合 計	15.68797	14.53234	141,283	94.8

(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

	第11作成期末	第 12 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 9	千□ 9	千円 10

■投資信託財産の構成

2019年5月21日現在

項 目	第 12 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	141,283	94.3
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	8,563	5.7
投資信託財産総額	149,857	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年12月21日)、(2019年1月21日)、(2019年2月21日)、(2019年3月22日)、(2019年4月22日)、(2019年5月21日)現在

項 目	第 65 期 末	第 66 期 末	第 67 期 末	第 68 期 末	第 69 期 末	第 70 期 末
(A) 資 産	166,653,237円	158,772,871円	161,576,132円	162,553,782円	164,461,330円	149,857,416円
コール・ローン等	18,172,016	8,306,701	8,193,139	8,173,624	7,919,240	8,563,987
投資信託受益証券(評価額)	148,471,200	149,715,496	153,372,972	154,370,138	155,798,857	141,283,409
D I A M マネーマザーファンド(評価額)	10,021	10,021	10,021	10,020	10,022	10,020
未 収 配 当 金	-	740,653	-	-	733,211	-
(B) 負 債	9,940,801	834,486	829,237	821,958	835,980	813,152
未払収益分配金	655,033	655,351	645,713	646,021	646,306	642,814
未 払 解 約 金	9,081,709	-	-	-	-	-
未 払 信 託 報 酬	203,616	178,752	183,122	175,560	189,269	169,973
その他未払費用	443	383	402	377	405	365
(C) 純資産総額(A-B)	156,712,436	157,938,385	160,746,895	161,731,824	163,625,350	149,044,264
元 本	163,758,262	163,837,878	161,428,258	161,505,412	161,576,575	160,703,610
次 期 繰 越 損 益 金	△7,045,826	△5,899,493	△681,363	226,412	2,048,775	△11,659,346
(D) 受 益 権 総 口 数	163,758,262口	163,837,878口	161,428,258口	161,505,412口	161,576,575口	160,703,610口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,570円	9,640円	9,958円	10,014円	10,127円	9,274円

(注) 第64期末における元本額は172,575,687円、当作成期間(第65期~第70期)中における追加設定元本額は706,285円、同解約元本額は12,578,362円です。

■損益の状況

〔自 2018年11月22日 至 2018年12月21日〕〔自 2018年12月22日 至 2019年 1月21日〕〔自 2019年 1月22日 至 2019年 2月21日〕〔自 2019年 2月22日 至 2019年 3月22日〕〔自 2019年 3月23日 至 2019年 4月22日〕〔自 2019年 4月23日 至 2019年 5月21日〕

項 目	第 65 期	第 66 期	第 67 期	第 68 期	第 69 期	第 70 期
(A) 配 当 等 収 益	752,905円	739,947円	732,653円	732,893円	731,978円	726,156円
受 取 配 当 金	753,491	740,653	733,211	733,211	732,486	726,617
受 取 利 息	-	-	6	-	-	-
支 払 利 息	△586	△706	△564	△318	△508	△461
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△13,402,135	1,244,296	5,227,924	997,165	1,926,946	△13,610,057
売 買 益	185,804	1,244,296	5,223,223	997,166	1,928,721	2,490
売 買 損	△13,587,939	-	4,701	△1	△1,775	△13,612,547
(C) 信 託 報 酬 等	△204,059	△179,135	△183,524	△175,937	△189,674	△170,338
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△12,853,289	1,805,108	5,777,053	1,554,121	2,469,250	△13,054,239
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△5,413,220	△18,921,542	△17,500,865	△12,369,525	△11,447,256	△9,567,784
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,875,716	11,872,292	11,688,162	11,687,837	11,673,087	11,605,491
(配 当 等 相 当 額)	(59,846,182)	(59,893,748)	(59,033,306)	(59,079,439)	(59,168,359)	(58,866,317)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△47,970,466)	(△48,021,456)	(△47,345,144)	(△47,391,602)	(△47,495,272)	(△47,260,826)
(G) 合 計 (D+E+F)	△6,390,793	△5,244,142	△35,650	872,433	2,695,081	△11,016,532
(H) 収 益 分 配 金	△655,033	△655,351	△645,713	△646,021	△646,306	△642,814
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△7,045,826	△5,899,493	△681,363	226,412	2,048,775	△11,659,346
追 加 信 託 差 損 益 金	11,875,716	11,872,292	11,688,162	11,687,837	11,673,087	11,605,491
(配 当 等 相 当 額)	(59,846,182)	(59,893,748)	(59,033,306)	(59,079,439)	(59,168,359)	(58,866,317)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△47,970,466)	(△48,021,456)	(△47,345,144)	(△47,391,602)	(△47,495,272)	(△47,260,826)
分 配 準 備 積 立 金	37,986,626	38,004,424	37,489,456	37,501,801	37,488,892	37,181,708
繰 越 損 益 金	△56,908,168	△55,776,209	△49,858,981	△48,963,226	△47,113,204	△60,446,545

(注 1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注 2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注 4) 分配金の計算過程

項 目	第 65 期	第 66 期	第 67 期	第 68 期	第 69 期	第 70 期
(a) 経費控除後の配当等収益	548,847円	673,149円	710,099円	658,366円	679,761円	555,818円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	59,846,182	59,893,748	59,033,306	59,079,439	59,168,359	58,866,317
(d) 分 配 準 備 積 立 金	38,092,812	37,986,626	37,425,070	37,489,456	37,455,437	37,268,704
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	98,487,841	98,553,523	97,168,475	97,227,261	97,303,557	96,690,839
(f) 1万口当たり当期分配対象額	6,014.22	6,015.31	6,019.30	6,020.06	6,022.13	6,016.72
(g) 分 配 金	655,033	655,351	645,713	646,021	646,306	642,814
(h) 1万口当たり分配金	40	40	40	40	40	40

■分配金のお知らせ

決算期	第 65 期	第 66 期	第 67 期	第 68 期	第 69 期	第 70 期
1万口当たり分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

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

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	CIBC 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、2017年12月31日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下は、2017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
2017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21,793,755円控除後）	112,989,733
収益合計	112,989,733
費用	
保管報酬	9,654,612
運用管理報酬および準運用管理報酬	25,094,872
専門家報酬	4,211,480
管理事務代行報酬	11,181,641
受託者報酬	2,302,649
その他の費用	787,580
費用合計	53,232,834
正味投資利益	59,756,899
デリバティブ取引に係る正味実現利益	942,750,621
投資有価証券に係る正味実現利益	1,434,806,110
当期正味実現利益	2,377,556,731
デリバティブ取引に係る評価損の正味増減額	(954,401,843)
投資有価証券に係る評価益の正味増減額	1,000,111,373
外貨に係る評価損の正味増減額	(805)
当期末実現利益の正味増減額	45,708,725
運用による純資産の純増加額	2,483,022,355

	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	74,403.84	12,104.10
クラスU S D	346,982.98	12,187.08
クラスA U D	23,396.96	13,190.22
クラスM X N	22,116.94	9,622.45
クラスT R Y	230,321.21	7,456.57
クラスB R L	440,587.39	9,956.54

投資有価証券明細書
2017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				
JFE Holdings Inc.	16,400	31,117,992	44,378,400	0.38%
Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	20,100	138,619,035	132,459,000	1.13%
Nippon Kodoshi Corp	39,600	96,338,902	111,909,600	0.95%
Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	44,800	118,830,877	129,516,800	1.10%
Rasa Industries Ltd	24,600	56,750,038	56,235,600	0.48%
Sumitomo Bakelite Co Ltd	89,000	86,867,415	84,372,000	0.72%
Sumitomo Chemical Co Ltd	181,000	148,535,630	146,610,000	1.25%
Sumitomo Metal Mining Co. Ltd.	21,000	67,257,216	108,738,000	0.93%
Tokai Carbon Co Ltd	71,200	87,344,867	99,324,000	0.84%
Toray Industries Inc	79,500	86,792,314	84,468,750	0.72%
		918,454,286	998,012,150	8.50%
通信				
Allied Architects Inc	67,700	81,130,146	64,992,000	0.55%
Dip Corp	26,500	64,023,993	77,168,000	0.66%
Gunosy Inc	27,400	87,013,985	94,119,000	0.80%
Istyle Inc	151,000	121,091,752	132,880,000	1.13%
SBI Holdings Inc/Japan	65,700	153,829,357	154,789,200	1.32%
SoftBank Corp.	15,500	142,611,167	138,260,000	1.18%
Uzabase Inc	106,400	95,029,786	168,963,200	1.44%
		744,730,186	831,171,400	7.08%
一般消費財、景気循環型				
ANA Holdings Inc	11,400	53,153,863	53,648,400	0.46%
Denso Corp	11,500	65,011,088	77,774,500	0.66%
Don Quijote Holdings Co Ltd	54,400	223,569,066	320,416,000	2.73%
Gunze Ltd	29,300	147,568,239	188,985,000	1.61%
H2O Retailing Corp	18,100	42,985,511	42,697,900	0.36%
Honda Motor Co., Ltd.	15,400	57,825,098	59,474,800	0.51%
Isuzu Motors Ltd	58,800	107,505,433	110,955,600	0.94%
McDonald's Holdings Co Japan Ltd	39,400	119,575,834	195,227,000	1.66%
Mitsubishi Motors Corp.	134,600	102,975,136	109,564,400	0.93%
Nintendo Co Ltd	3,200	124,769,133	131,808,000	1.12%
Nitori Holdings Co Ltd	4,200	73,105,684	67,473,000	0.57%
Nitto Boseki Co Ltd	32,700	108,459,701	106,275,000	0.90%
Round One Corp	164,400	200,457,872	311,702,400	2.65%
Sony Corp.	24,400	125,793,365	124,025,200	1.06%
Suzuki Motor Corp.	16,600	108,125,980	108,464,400	0.92%
Toridoll Holdings Corp	37,100	104,230,751	155,820,000	1.33%
Toyota Industries Corp	7,100	52,316,645	51,404,000	0.44%
		1,817,428,399	2,215,715,600	18.85%

	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				
Ariake Japan Co., Ltd.	12,800	122,512,707	123,136,000	1.05%
Asahi Group Holdings Ltd	11,200	64,577,271	62,608,000	0.53%
Asahi Intecc Co., Ltd.	56,600	125,401,586	219,608,000	1.87%
Bengo4.com Inc	20,100	32,924,595	30,391,200	0.26%
Daiichi Sankyo Co Ltd	77,200	192,701,347	226,736,400	1.93%
GMO Payment Gateway Inc	40,700	212,168,116	379,324,000	3.23%
JCR Pharmaceuticals Co Ltd	16,200	84,565,559	86,022,000	0.73%
Kirin Holdings Co Ltd	22,700	64,751,559	64,479,350	0.55%
Lacto Japan Co Ltd	20,400	91,222,566	98,430,000	0.84%
Nichirei Corp	22,300	64,245,604	69,464,500	0.59%
Nihon M&A Center Inc	19,600	62,882,905	105,252,000	0.89%
Nipro Corp	24,200	34,866,324	40,462,400	0.34%
Paramount Bed Holdings Co Ltd	10,300	53,892,321	57,474,000	0.49%
PeptiDream Inc.	76,200	279,180,026	294,132,000	2.50%
SanBio Co Ltd	20,400	30,945,462	65,790,000	0.56%
Terumo Corp	4,900	21,439,358	26,166,000	0.22%
WDB Holdings Co Ltd	24,400	86,039,038	91,500,000	0.78%
		<u>1,624,316,344</u>	<u>2,040,975,850</u>	<u>17.36%</u>
エネルギー				
Inpex Corp.	81,600	99,854,988	114,974,400	0.98%
		<u>99,854,988</u>	<u>114,974,400</u>	<u>0.98%</u>
金融				
Anicom Holdings Inc	9,700	26,427,812	35,259,500	0.30%
Bank of Kyoto Ltd/The	13,800	70,979,305	81,006,000	0.69%
Chiba Bank Ltd/The	48,000	37,732,221	45,024,000	0.38%
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	359,200	260,583,918	296,842,880	2.53%
Sompo Holdings Inc	5,300	23,335,042	23,129,200	0.20%
Sparx Group Co., Ltd.	333,000	108,738,656	103,896,000	0.88%
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	43,000	190,473,060	209,324,000	1.78%
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc.	23,200	96,719,985	103,773,600	0.88%
Tokio Marine Holdings Inc.	14,200	73,499,181	73,002,200	0.62%
		<u>888,489,180</u>	<u>971,257,380</u>	<u>8.26%</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				
Central Japan Railway Co	3,800	70,151,557	76,684,000	0.65%
Cosel Co Ltd	17,500	32,244,102	32,392,500	0.28%
Daifuku Co Ltd	21,700	71,133,426	133,238,000	1.13%
FUJIFILM Holdings Corp	30,600	132,420,274	140,913,000	1.20%
Furukawa Electric Co Ltd	9,200	52,629,500	51,152,000	0.44%
Geostr Corp.	198,700	126,481,201	154,787,300	1.32%
Harmonic Drive Systems Inc	8,500	46,598,855	56,015,000	0.48%
Hirata Corp	1,200	12,634,308	13,980,000	0.12%
Hitachi Ltd	91,000	80,205,931	79,888,900	0.68%
Hosiden Corp	121,400	150,809,682	202,009,600	1.72%
Iriso Electronics Co., Ltd.	14,900	77,616,187	100,277,000	0.85%
Komatsu Ltd.	14,800	54,669,995	60,354,400	0.51%
Kyowa Exeo Corp	29,100	84,755,406	84,884,700	0.72%
Kyudenko Corp	15,100	65,715,807	82,295,000	0.70%
Maruwa Co Ltd/Aichi	6,900	54,116,544	52,095,000	0.44%
Mitsui OSK Lines Ltd	22,500	84,247,881	84,600,000	0.72%
Nidec Corp.	11,000	124,044,330	173,910,000	1.48%
Nippon Thompson Co Ltd	54,000	42,342,349	48,654,000	0.41%
Nittoku Engineering Co Ltd	11,700	43,504,741	55,867,500	0.47%
Noritake Co Ltd/Nagoya Japan	14,100	75,436,148	80,511,000	0.68%
Optex Group Co Ltd	19,500	99,138,692	116,025,000	0.99%
OSJB Holdings Corp	221,700	71,907,435	74,491,200	0.63%
Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	158,300	89,790,337	132,972,000	1.13%
SEMITEC Corp	7,300	32,133,807	48,326,000	0.41%
Shima Seiki Manufacturing Ltd	13,600	79,218,589	96,832,000	0.82%
Takeuchi Manufacturing Co Ltd	32,200	67,308,936	86,199,400	0.73%
Tamura Corp	97,000	54,927,448	82,353,000	0.70%
Tocalo Co Ltd	13,600	68,101,030	68,408,000	0.58%
Yamashin-Filter Corp	80,900	97,326,095	112,127,400	0.95%
Yaskawa Electric Corp	33,000	158,032,605	163,845,000	1.39%
		<u>2,299,643,198</u>	<u>2,746,087,900</u>	<u>23.33%</u>
テクノロジー				
Capcom Co Ltd	26,500	85,943,691	94,737,500	0.81%
Rohm Co Ltd	11,600	139,144,036	144,768,000	1.23%
Sumco Corp	10,900	32,283,733	31,479,200	0.27%
TDK Corp	28,100	255,725,469	252,619,000	2.15%
TIS Inc	13,600	53,520,496	53,516,000	0.46%
Tokyo Electron Ltd	5,300	87,339,647	108,120,000	0.92%
		<u>653,957,072</u>	<u>685,239,700</u>	<u>5.84%</u>
日本合計		<u>9,046,873,653</u>	<u>10,603,434,380</u>	<u>90.20%</u>
普通株式合計		<u>9,046,873,653</u>	<u>10,603,434,380</u>	<u>90.20%</u>
投資有価証券合計		<u>9,046,873,653</u>	<u>10,603,434,380</u>	<u>90.20%</u>

先物契約：

2017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)	売買	正味評価益/ (評価損) (円)
Goldman Sachs	東証株価指数 (TOPIX) 先物取引	2018年3月8日	48	872,160,000	買建	1,730,000

DIAMマネーマザーファンド

運用報告書

第10期（決算日 2019年4月5日）

（計算期間 2018年4月6日～2019年4月5日）

DIAMマネーマザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券 組入比率	新株予約権 付社債 (転換社債)	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率				
6期(2015年4月6日)	10,090	0.1	82.8	—	—	百万円 9,524
7期(2016年4月5日)	10,098	0.1	80.6	—	—	3,158
8期(2017年4月5日)	10,104	0.1	71.2	—	—	1,045
9期(2018年4月5日)	10,099	△0.0	71.1	—	—	1,030
10期(2019年4月5日)	10,098	△0.0	79.4	—	—	16,167

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

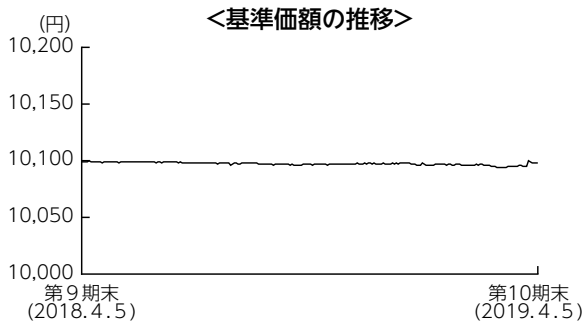
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比	券 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 比 率	債 先 物 比	券 率
	円	騰 落 率					
(期 首) 2018年 4 月 5 日	10,099	% -		% 71.1		% -	% -
4 月 末	10,099	0.0		71.0	-	-	-
5 月 末	10,099	0.0		73.6	-	-	-
6 月 末	10,098	△0.0		72.2	-	-	-
7 月 末	10,098	△0.0		72.2	-	-	-
8 月 末	10,097	△0.0		88.4	-	-	-
9 月 末	10,097	△0.0		79.1	-	-	-
10 月 末	10,097	△0.0		77.9	-	-	-
11 月 末	10,097	△0.0		78.2	-	-	-
12 月 末	10,096	△0.0		71.4	-	-	-
2019年 1 月 末	10,097	△0.0		71.4	-	-	-
2 月 末	10,095	△0.0		71.4	-	-	-
3 月 末	10,100	0.0		79.4	-	-	-
(期 末) 2019年 4 月 5 日	10,098	△0.0		79.4	-	-	-

(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（2018年4月6日から2019年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,098円となり、前期末比で0.01%下落しました。

基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策によってコールローンがマイナス利回りとなっているため、その影響を受けて基準価額は下落しました。

投資環境

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは概ね $\Delta 0.3\% \sim \Delta 0.1\%$ 台で推移しました。米国が

金融政策正常化のペースを落としたことや国債市場の需給要因から一時的に利回りが低下する局面もありましたが、米国や中国の景気が市場の見方ほど悪くないのではないかとの見通しが強まったことから期末にかけて利回りは上昇し、期を通して見るとレンジ内での推移となりました。

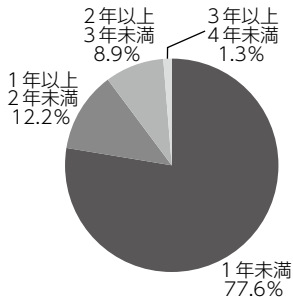
ポートフォリオについて

残存期間の短い政府保証債を中心とした運用を行いました。

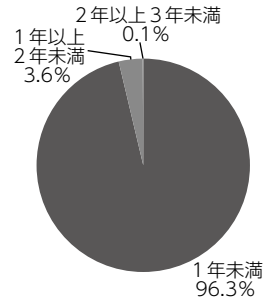
【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比

期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)
合 計	0	0.000

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(10,097円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2018年4月6日から2019年4月5日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	12,636,104	(-)
	地 方 債 証 券	40,605	(34,950)
	特 殊 債 券	-	200,019 (329,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利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 (2018年4月6日から2019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 12,676	百万円 202	% 1.6	百万円 200	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	12,600,000	12,631,008	78.1	—	—	—	78.1
地 方 債 証 券	135,830	136,409	0.8	0.6	—	—	0.8
特 殊 債 券	66,000	67,019	0.4	—	—	0.1	0.4
合 計	12,801,830	12,834,437	79.4	0.6	—	0.1	79.3

(注1) 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。

(注2) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(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
	%	千円	千円	
(国債証券)				
3 0 1 回 利付国庫債券（10年）	1.5000	200,000	200,658	2019/06/20
1 2 3 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	12,000,000	12,029,040	2020/03/20
3 8 8 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	100,000	100,281	2020/05/15
3 9 1 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,672	2020/08/01
3 9 2 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	100,000	100,357	2020/09/01
小 計	—	12,600,000	12,631,008	—
(地方債証券)				
2 6 年度 4 回 静岡県公募公債	0.2090	14,810	14,816	2019/06/24
2 6 年度 1 回 大阪市みおつくし債	0.2200	6,000	5,999	2019/06/27
2 1 年度 6 回 愛知県公募公債	1.4400	10,000	10,045	2019/07/30
2 6 年度 京都府京都みらい債	0.1600	9,200	9,194	2019/09/02
3 3 1 回 大阪府公募公債	1.4100	10,000	10,078	2019/10/29
2 6 年度 7 回 福岡県公募公債	0.2000	6,500	6,495	2019/12/25
2 1 年度 3 5 回 兵庫県公募公債	1.4600	40,000	40,457	2020/01/22
4 3 回 川崎市公募公債 5年	0.1370	10,850	10,863	2020/03/19
2 7 年度 2 回 千葉県公募公債	0.1770	14,670	14,697	2020/05/25
2 7 年度 京都府京都みらい債	0.1000	13,800	13,762	2020/09/02
小 計	—	135,830	136,409	—
(特殊債券)				
8 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	4,000	4,026	2019/09/30
9 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	8,000	8,075	2019/11/29

銘	柄	当 期			末
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券)		%	千円	千円	
1 0 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	9,000	9,117	2020/02/28
1 1 2 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1000	30,000	30,455	2020/07/31
1 1 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	6,000	6,093	2020/09/30
1 3 3 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	5,000	5,139	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	4,111	2021/06/30
小	計	—	66,000	67,019	—
合	計	—	12,801,830	12,834,437	—

■投資信託財産の構成

2019年4月5日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
12,834,437		79.4	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,332,745		20.6
投 資 信 託 財 産 総 額	16,167,183		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

(2019年4月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,167,183,546円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,330,773,596
公 社 債(評価額)	12,834,437,613
未 収 利 息	1,577,825
前 払 費 用	394,512
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	16,167,183,546
元 本	16,010,803,187
次 期 繰 越 損 益 金	156,380,359
(D) 受 益 権 総 口 数	16,010,803,187口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,098円

■損益の状況

当期 自2018年4月6日 至2019年4月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	6,929,090円
受 取 利 息	7,285,281
支 払 利 息	△356,191
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△10,516,322
売 買 損 益	73,746
売 買 損 益	△10,590,068
(C) そ の 他 費 用	△279
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△3,587,511
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	10,082,629
(F) 解 約 差 損 益 金	△48,033
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	149,933,274
(H) 合 計(D+E+F+G)	156,380,359
次 期 繰 越 損 益 金(H)	156,380,359

(注1) 期首元本額 1,020,388,428円
追加設定元本額 14,995,366,726円
一部解約元本額 4,951,967円

(注2) 期末における元本の内訳

クルーズコントロール	990,000,991円
ダイナミック・ナビゲーション	98,710円
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルレアルコース>	10,530,000円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型)<円コース>	1,281,836円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型)<豪ドルコース>	246,797円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型)<ブラジルレアルコース>	1,689,581円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ(毎月分配型)<中国元コース>	654,944円
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円
ネット証券専用ファンドシリーズ 新興市場日本株 レアル型	103,986円
DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 資源通貨バスケットコース	4,486,988円
DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド ブラジルレアルコース	4,586,699円
DIAM グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド 円コース	997,109円
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円
DIAM 米国リート・インカムプラス	994,728円
USストラテジック・インカム・ファンドAコース(為替ヘッジあり)	993,740円
USストラテジック・インカム・ファンドBコース(為替ヘッジなし)	1,987,479円
DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>	9,935円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)円コース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)米ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)豪ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)メキシコペソコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)トルコリラコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー(通貨選択型)ブラジルレアルコース	9,925円
USストラテジック・インカム・ファンド(年1回決算型)ヘッジあり	9,924円
USストラテジック・インカム・ファンド(年1回決算型)ヘッジなし	9,924円
米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジあり>	9,909円
米国株式リスクコントロール戦略ファンド<為替ヘッジなし>	9,909円
マッシュューズ・アジア株式ファンド	99,019,705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
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)	39,612,786円
USD/JPYダイナミックヘッジ戦略ファンド-2019(適格機関投資家限定)	14,851,485,149円
期末元本合計	16,010,803,187円

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (F)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) (G)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。