

償還 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） ブラジルリアルコース

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 ブラジルリアルクラス」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、ブラジルレア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。

<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。

第119期 <決算日 2023年6月21日>
第120期 <償還日 2023年7月14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）ブラジルリアルコース」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。

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）ブラジルリアルコース

■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額			東証株価指数		ブラジルレアル/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		
		円	円	%	ポイント (7月30日)	%	円 (7月30日)	%	%	百万円
第1作成期	(設定日) 2013年7月31日	10,000	-	-	1,527.32	-	43.22	-	-	230
	1期(2013年8月21日)	9,235	0	△7.7	1,491.73	△2.3	40.74	△5.7	94.8	293
	2期(2013年9月24日)	11,065	0	19.8	1,616.07	8.3	44.94	10.3	95.0	420
	3期(2013年10月21日)	11,192	0	1.1	1,623.40	0.5	45.18	0.5	95.0	521
	4期(2013年11月21日)	10,971	70	△1.3	1,668.91	2.8	44.19	△2.2	94.9	490
第2作成期	5期(2013年12月24日)	11,177	70	2.5	1,684.88	1.0	44.23	0.1	95.3	667
	6期(2014年1月21日)	11,492	70	3.4	1,737.68	3.1	44.58	0.8	95.1	812
	7期(2014年2月21日)	10,448	70	△8.5	1,639.06	△5.7	43.24	△3.0	95.4	797
	8期(2014年3月24日)	10,233	70	△1.4	1,560.14	△4.8	44.02	1.8	94.6	737
	9期(2014年4月21日)	10,778	70	6.0	1,585.89	1.7	45.85	4.2	94.7	807
	10期(2014年5月21日)	10,585	70	△1.1	1,557.03	△1.8	45.71	△0.3	94.9	979
第3作成期	11期(2014年6月23日)	11,776	70	11.9	1,717.68	10.3	45.78	0.2	95.0	1,139
	12期(2014年7月22日)	11,521	70	△1.6	1,726.82	0.5	45.68	△0.2	94.8	1,116
	13期(2014年8月21日)	12,132	70	5.9	1,751.26	1.4	45.89	0.5	95.1	1,166
	14期(2014年9月22日)	12,529	70	3.8	1,805.57	3.1	46.02	0.3	95.1	1,093
	15期(2014年10月21日)	11,337	70	△9.0	1,646.77	△8.8	43.35	△5.8	94.9	1,003
	16期(2014年11月21日)	12,643	110	12.5	1,913.00	16.2	45.86	5.8	95.8	1,278
第4作成期	17期(2014年12月22日)	12,267	110	△2.1	1,931.06	0.9	44.90	△2.1	92.3	1,312
	18期(2015年1月21日)	11,732	110	△3.5	1,902.42	△1.5	45.39	1.1	94.9	1,276
	19期(2015年2月23日)	11,472	110	△1.3	2,056.09	8.1	41.50	△8.6	94.8	1,219
	20期(2015年3月23日)	10,516	110	△7.4	2,179.25	6.0	37.13	△10.5	94.9	1,097
	21期(2015年4月21日)	11,203	110	7.6	2,219.01	1.8	39.35	6.0	94.5	1,183
	22期(2015年5月21日)	11,791	110	6.2	2,271.36	2.4	40.32	2.5	94.6	1,232
第5作成期	23期(2015年6月22日)	11,961	110	2.4	2,275.80	0.2	39.62	△1.7	95.4	1,209
	24期(2015年7月21日)	12,122	110	2.3	2,312.61	1.6	38.91	△1.8	95.0	1,204
	25期(2015年8月21日)	10,840	110	△9.7	2,173.40	△6.0	35.70	△8.2	95.5	1,050
	26期(2015年9月24日)	8,464	110	△20.9	1,972.19	△9.3	28.76	△19.4	94.3	858
	27期(2015年10月21日)	8,632	110	3.3	2,125.62	7.8	30.71	6.8	95.2	1,105
	28期(2015年11月24日)	9,705	110	13.7	2,235.86	5.2	32.92	7.2	95.6	1,863
第6作成期	29期(2015年12月21日)	8,949	110	△6.7	2,132.86	△4.6	30.43	△7.6	95.1	2,353
	30期(2016年1月21日)	6,998	110	△20.6	1,814.99	△14.9	28.64	△5.9	93.9	2,150
	31期(2016年2月22日)	6,602	110	△4.1	1,813.06	△0.1	28.05	△2.1	94.3	2,312
	32期(2016年3月22日)	7,765	110	19.3	1,911.34	5.4	30.93	10.3	95.3	2,984
	33期(2016年4月21日)	8,087	110	5.6	1,963.50	2.7	31.09	0.5	95.3	3,759
	34期(2016年5月23日)	7,974	110	△0.0	1,886.07	△3.9	31.19	0.3	95.3	4,613

作成期	決算期	基準価額			東証株価指数		ブラジルレアル/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7作成期	35期(2016年6月21日)	円 7,417	円 110	% △5.6	ポイント 1,823.02	% △3.3	円 30.59	% △1.9	% 95.1	百万円 5,235
	36期(2016年7月21日)	7,866	110	7.5	1,889.70	3.7	32.91	7.6	95.3	6,472
	37期(2016年8月22日)	7,079	110	△8.6	1,839.58	△2.7	31.40	△4.6	94.8	6,444
	38期(2016年9月21日)	7,115	110	2.1	1,909.26	3.8	31.22	△0.6	95.0	7,143
	39期(2016年10月21日)	7,691	110	9.6	1,943.55	1.8	33.14	6.1	95.2	8,104
	40期(2016年11月21日)	7,718	110	1.8	2,054.15	5.7	32.76	△1.1	95.3	9,137
第8作成期	41期(2016年12月21日)	8,865	110	16.3	2,199.32	7.1	35.20	7.4	95.7	10,082
	42期(2017年1月23日)	9,095	110	3.8	2,158.90	△1.8	35.89	2.0	95.7	9,970
	43期(2017年2月21日)	9,328	110	3.8	2,218.01	2.7	36.73	2.3	94.6	10,266
	44期(2017年3月21日)	9,298	110	0.9	2,229.95	0.5	36.57	△0.4	95.6	9,988
	45期(2017年4月21日)	8,549	110	△6.9	2,142.28	△3.9	34.72	△5.1	95.3	8,771
	46期(2017年5月22日)	8,482	110	0.5	2,256.15	5.3	34.26	△1.3	95.4	8,261
第9作成期	47期(2017年6月21日)	9,120	110	8.8	2,321.00	2.9	33.47	△2.3	96.0	8,279
	48期(2017年7月21日)	9,486	110	5.2	2,350.15	1.3	35.89	7.2	95.9	7,978
	49期(2017年8月21日)	8,951	110	△4.5	2,300.19	△2.1	34.75	△3.2	95.8	6,623
	50期(2017年9月21日)	9,208	110	4.1	2,406.92	4.6	35.90	3.3	95.8	5,947
	51期(2017年10月23日)	9,359	110	2.8	2,536.63	5.4	35.66	△0.7	95.7	5,625
	52期(2017年11月21日)	9,102	110	△1.6	2,574.33	1.5	34.58	△3.0	95.8	5,192
第10作成期	53期(2017年12月21日)	9,350	110	3.9	2,649.92	2.9	34.35	△0.7	95.8	4,762
	54期(2018年1月22日)	9,943	110	7.5	2,754.01	3.9	34.64	0.8	95.9	4,755
	55期(2018年2月21日)	8,918	110	△9.2	2,564.55	△6.9	33.05	△4.6	95.5	4,098
	56期(2018年3月22日)	8,523	110	△3.2	2,515.61	△1.9	32.27	△2.4	95.3	3,823
	57期(2018年4月23日)	8,268	110	△1.7	2,572.96	2.3	31.59	△2.1	95.4	3,641
	58期(2018年5月21日)	8,016	110	△1.7	2,665.56	3.6	29.72	△5.9	95.3	3,741
第11作成期	59期(2018年6月21日)	7,658	110	△3.1	2,574.74	△3.4	29.26	△1.5	95.2	3,590
	60期(2018年7月23日)	7,649	110	1.3	2,560.28	△0.6	29.43	0.6	95.3	3,601
	61期(2018年8月21日)	6,824	110	△9.3	2,482.06	△3.1	27.68	△5.9	95.1	3,252
	62期(2018年9月21日)	7,001	110	4.2	2,657.50	7.1	27.61	△0.3	95.5	3,336
	63期(2018年10月22日)	7,324	110	6.2	2,517.07	△5.3	30.30	9.7	95.5	3,385
	64期(2018年11月21日)	6,752	70	△6.9	2,399.27	△4.7	30.02	△0.9	95.1	3,207
第12作成期	65期(2018年12月21日)	6,133	70	△8.1	2,210.66	△7.9	28.95	△3.6	94.9	2,875
	66期(2019年1月21日)	6,298	70	3.8	2,330.66	5.4	29.21	0.9	95.2	2,966
	67期(2019年2月21日)	6,549	70	5.1	2,401.03	3.0	29.67	1.6	95.3	3,190
	68期(2019年3月22日)	6,503	70	0.4	2,407.37	0.3	29.18	△1.7	95.2	3,360
	69期(2019年4月22日)	6,258	70	△2.7	2,435.83	1.2	28.50	△2.3	95.0	3,379
	70期(2019年5月21日)	5,668	70	△8.3	2,333.08	△4.2	26.89	△5.6	94.9	3,095
第13作成期	71期(2019年6月21日)	5,866	70	4.7	2,327.60	△0.2	27.96	4.0	95.1	3,081
	72期(2019年7月22日)	5,988	70	3.3	2,346.77	0.8	28.80	3.0	95.1	3,117
	73期(2019年8月21日)	5,232	70	△11.5	2,258.27	△3.8	26.22	△9.0	95.1	2,713
	74期(2019年9月24日)	5,367	70	3.9	2,448.20	8.4	25.85	△1.4	95.1	2,701
	75期(2019年10月21日)	5,429	70	2.5	2,480.43	1.3	26.37	2.0	95.3	2,723
	76期(2019年11月21日)	5,494	70	2.5	2,573.11	3.7	25.82	△2.1	95.2	2,654

作成期	決算期	基準価額			東証株価指数		ブラジルレアル/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14作成期	77期(2019年12月23日)	円 5,855	円 70	% 7.8	ポイント 2,634.37	% 2.4	円 26.71	% 3.4	% 95.5	百万円 2,738
	78期(2020年1月21日)	5,750	70	△0.6	2,646.68	0.5	26.32	△1.5	95.7	2,657
	79期(2020年2月21日)	5,283	70	△6.9	2,553.90	△3.5	25.53	△3.0	95.4	2,404
	80期(2020年3月23日)	3,281	70	△36.6	1,972.16	△22.8	21.87	△14.3	94.0	1,459
	81期(2020年4月21日)	3,680	70	14.3	2,187.46	10.9	20.28	△7.3	95.6	1,589
	82期(2020年5月21日)	3,529	35	△3.2	2,303.91	5.3	18.92	△6.7	95.6	1,507
第15作成期	83期(2020年6月22日)	3,989	35	14.0	2,439.36	5.9	20.10	6.2	95.3	1,640
	84期(2020年7月21日)	3,992	35	1.0	2,448.55	0.4	20.11	0.0	95.6	1,524
	85期(2020年8月21日)	3,884	35	△1.8	2,481.51	1.3	19.01	△5.5	95.2	1,417
	86期(2020年9月23日)	4,165	35	8.1	2,544.03	2.5	19.21	1.1	95.5	1,469
	87期(2020年10月21日)	3,992	35	△3.3	2,555.04	0.4	18.80	△2.1	95.4	1,392
	88期(2020年11月24日)	4,209	35	6.3	2,749.88	7.6	19.25	2.4	95.7	1,461
第16作成期	89期(2020年12月21日)	4,579	35	9.6	2,791.98	1.5	20.33	5.6	95.7	1,566
	90期(2021年1月21日)	4,564	35	0.4	2,907.38	4.1	19.52	△4.0	95.3	1,508
	91期(2021年2月22日)	4,679	35	3.3	3,029.02	4.2	19.58	0.3	95.7	1,523
	92期(2021年3月22日)	4,862	35	4.7	3,111.20	2.7	19.83	1.3	95.8	1,497
	93期(2021年4月21日)	4,744	35	△1.7	2,977.10	△4.3	19.41	△2.1	95.9	1,430
	94期(2021年5月21日)	4,793	35	1.8	3,003.66	0.9	20.60	6.2	95.6	1,378
第17作成期	95期(2021年6月21日)	5,241	35	10.1	2,997.62	△0.2	21.65	5.1	95.8	1,475
	96期(2021年7月21日)	4,773	35	△8.3	3,008.95	0.4	21.05	△2.8	95.4	1,336
	97期(2021年8月23日)	4,552	35	△3.9	3,026.19	0.6	20.42	△3.0	95.1	1,242
	98期(2021年9月21日)	5,320	35	17.6	3,263.34	7.8	20.56	0.7	95.9	1,409
	99期(2021年10月21日)	5,009	35	△5.2	3,187.32	△2.3	20.41	△0.7	95.8	1,303
	100期(2021年11月22日)	5,117	35	2.9	3,254.65	2.1	20.33	△0.4	95.8	1,318
第18作成期	101期(2021年12月21日)	4,611	35	△9.2	3,139.30	△3.5	19.81	△2.6	95.2	1,140
	102期(2022年1月21日)	4,703	35	2.8	3,075.33	△2.0	20.93	5.7	95.4	1,159
	103期(2022年2月21日)	4,873	35	4.4	3,049.29	△0.8	22.38	6.9	95.5	1,173
	104期(2022年3月22日)	5,126	35	5.9	3,087.43	1.3	24.31	8.6	95.6	1,228
	105期(2022年4月21日)	5,998	35	17.7	3,112.36	0.8	27.75	14.1	95.9	1,423
	106期(2022年5月23日)	5,558	35	△6.8	3,058.56	△1.7	26.18	△5.7	95.8	1,280
第19作成期	107期(2022年6月21日)	5,519	35	△0.1	2,999.49	△1.9	26.04	△0.5	95.4	1,232
	108期(2022年7月21日)	5,529	35	0.8	3,156.42	5.2	25.31	△2.8	95.6	1,205
	109期(2022年8月22日)	5,897	35	7.3	3,224.73	2.2	26.53	4.8	95.9	1,236
	110期(2022年9月21日)	6,091	35	3.9	3,109.51	△3.6	27.92	5.2	95.9	1,227
	111期(2022年10月21日)	6,115	35	1.0	3,078.70	△1.0	28.79	3.1	95.9	1,225
	112期(2022年11月21日)	5,760	35	△5.2	3,227.07	4.8	26.07	△9.5	95.8	1,149
第20作成期	113期(2022年12月21日)	5,365	35	△6.3	3,098.65	△4.0	25.32	△2.9	95.5	1,057
	114期(2023年1月23日)	5,481	35	2.8	3,189.24	2.9	24.83	△1.9	95.6	1,080
	115期(2023年2月21日)	5,734	35	5.3	3,274.90	2.7	26.00	4.7	95.9	1,129
	116期(2023年3月22日)	5,359	35	△5.9	3,219.53	△1.7	25.28	△2.8	94.9	1,053
	117期(2023年4月21日)	6,053	35	13.6	3,377.11	4.9	26.58	5.1	95.3	1,166
	118期(2023年5月22日)	6,703	35	11.3	3,611.02	6.9	27.54	3.6	95.8	1,278

作成期	決算期	基準価額			東証株価指数		ブラジルリアル/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21作成期	119期(2023年6月21日)	円 7,534	円 35	% 12.9	ポイント 3,810.90	% 5.5	円 29.57	% 7.4	% 95.8	百万円 1,424
	(償還日) 2023年7月14日	(償還価額) 7,553.07	0	0.3	3,722.70	△2.3	28.72	△2.9	-	1,426

(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) ブラジルリアル/円レート：対顧客電信売買相場仲値 (以下同じ)。

(注5) 「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6) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当作成期中の基準価額と市況の推移

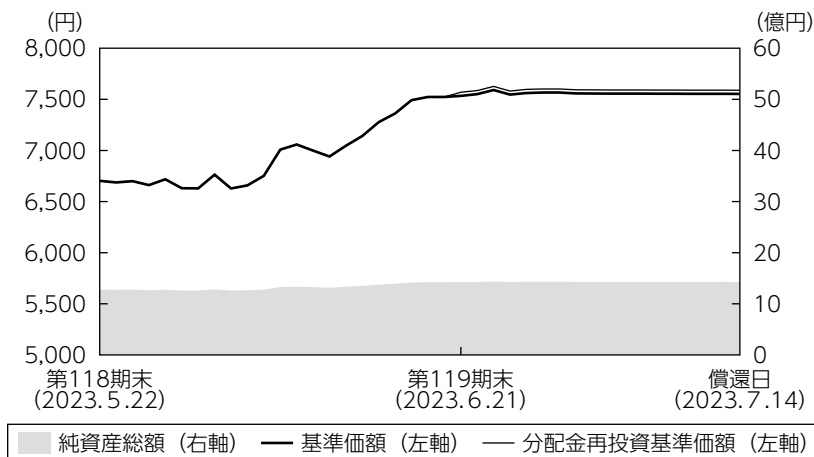
決算期	年月日	基準価額		東証株価指数		ブラジルリアル/円レート		投資信託 受益証券 組入比率
		騰落率	(TOPIX) (配当込み) (参考指数)	騰落率	(参考)	騰落率		
第119期	(期首) 2023年5月22日	円 6,703	% -	ポイント 3,611.02	% -	円 27.54	% -	% 95.8
	5月末	6,763	0.9	3,537.93	△2.0	27.74	0.7	95.7
	(期末) 2023年6月21日	7,569	12.9	3,810.90	5.5	29.57	7.4	95.8
第120期	(期首) 2023年6月21日	7,534	-	3,810.90	-	29.57	-	95.8
	6月末	7,558	0.3	3,805.00	△0.2	29.83	0.9	95.8
	(償還日) 2023年7月14日	(償還価額) 7,553.07	0.3	3,722.70	△2.3	28.72	△2.9	-

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

■設定以来の運用経過（2013年7月31日から2023年7月14日まで）

第21作成期の基準価額等の推移



第119期首： 6,703円
 償還日： 7,553.07円
 (既払分配金35円)
 騰落率： 13.2%
 (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

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に加え、ブラジルレアルが円に対して上昇したことがプラスに寄与し、当作成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、143.3%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金8,710円）。ブラジルレアルが円に対して下落したことはマイナスに寄与しましたが、約10年間にわたる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い、設定来では基準価額は上昇しました。

なお、ブラジルと日本との金利差から、円売りブラジルレア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 ブラジルレアルクラス	14.1%
D I A Mマネーマザーファンド	△0.0%

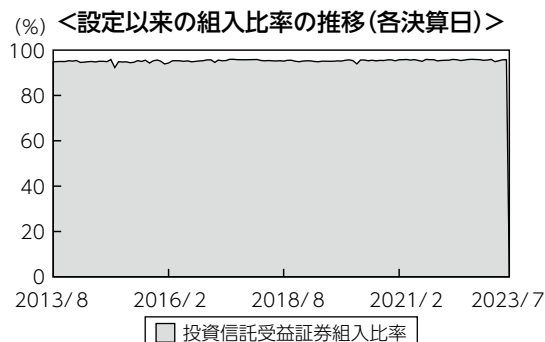
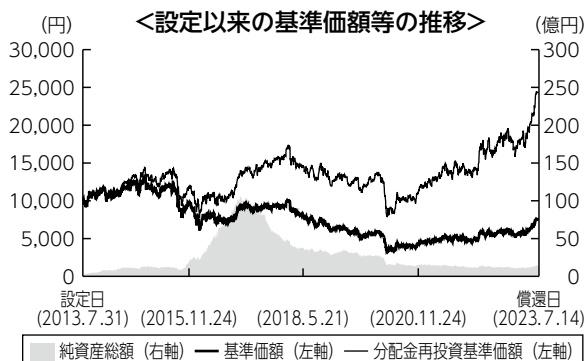
- (注1) D I A Mケイマン・ファンドージャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション ブラジルレアルクラスの騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。
- (注2) 組入ファンドの騰落率は、当ファンドが保有している期間（D I A Mケイマン・ファンドージャパニーズ・エクイティ・ファンド・カレンシー・セレクション ブラジルレアルクラス、D I A Mマネーマザーファンド共に2023年6月30日まで）の騰落率です。

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。

ブラジルでは、2021年以降にインフレ対応のために大幅な利上げが進められた一方で、日本では日銀が政策金利を低位に抑え続けました。他方で、ブラジル政治は安定せず、財政悪化が懸念される状況が長く続きました。こうした中で、為替市場ではブラジルレアルは円に対して下落しました。

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 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 ブラジルリア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 ブラジルリアルクラス

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。

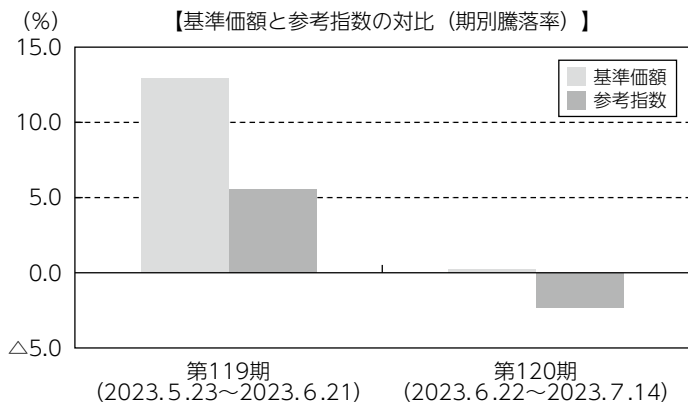
また、円を売り予約し、ブラジルレアルを買い予約する為替取引を行いました。

●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債、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。

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しました。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第119期
	2023年5月23日 ～2023年6月21日
当期分配金（税引前）	35円
対基準価額比率	0.46%
当期の収益	35円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	4,602円

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

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

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

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

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第119期～第120期 (2023年5月23日 ～2023年7月14日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	15円	
(投信会社)	(6)	(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)	(8)	(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)	(0)	(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	15	0.201	

(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。

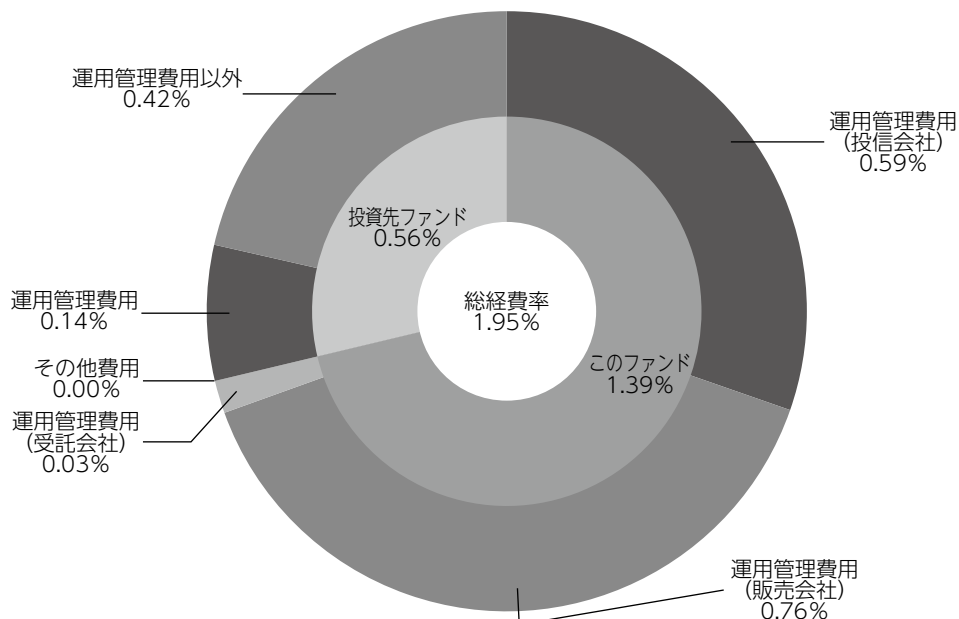
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.95%です。



総経費率 (①+②+③)	1.95%
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	0.42%

(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

		第 119 期 ~ 第 120 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦貨建	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 ブラジルリアルクラス	千□ -	千円 -	千□ 170.02962	千円 1,386,756

(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)

		第 119 期 ~ 第 120 期			
		設 定		解 約	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
	D I A M マネーマザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 9	千円 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。第20作成期末の組入れは以下の通りでした。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第 20 作 成 期 末	
	□ 数	
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 ブラジルリアルクラス	千□ 170.02962	
合 計	千□ 170.02962	

(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 20 作 成 期 末	
	□ 数	
D I A M マネーマザーファンド	千□ 9	

■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	1,429,146	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,429,146	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6月21日)、(2023年7月14日)現在

項 目	第 119 期 末	償 還 時
(A) 資 産	1,432,991,853円	1,429,146,152円
コール・ローン等	62,887,822	1,429,146,152
投資信託受益証券(評価額)	1,364,094,045	-
D I A M マネー マザーファンド(評価額)	9,986	-
未 収 入 金	6,000,000	-
(B) 負 債	8,576,036	2,837,859
未 払 収 益 分 配 金	6,616,999	-
未 払 解 約 金	450,000	1,524,930
未 払 信 託 報 酬	1,509,037	1,309,293
未 払 利 息	-	3,636
(C) 純資産総額(A-B)	1,424,415,817	1,426,308,293
元 本	1,890,571,198	1,888,382,598
次期繰越損益金	△466,155,381	-
償還差損益金	-	△462,074,305
(D) 受益権総口数	1,890,571,198口	1,888,382,598口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,534円	-
1万口当たり償還価額(C/D)	-	7,553円7銭

(注) 第118期末における元本額は1,907,042,357円、第119期～償還時における追加設定元本額は218,233円、同解約元本額は18,877,992円です。

■損益の状況

[自 2023年5月23日 至 2023年6月21日] [自 2023年6月22日 至 2023年7月14日]

項 目	第 119 期	第 120 期
(A) 配 当 等 収 益	7,573,065円	△12,174円
受 取 配 当 金	7,576,170	-
受 取 利 息	7	139
支 払 利 息	△3,112	△12,313
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	157,770,605	4,862,879
売 買 益	157,917,713	4,862,184
売 買 損	△147,108	695
(C) 信 託 報 酬 等	△1,509,037	△1,309,293
(D) 当 期 繰 越 損 益 金	163,834,633	3,541,412
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△177,353,837	△20,111,796
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△446,019,178	△445,503,921
(配当等相当額)	(721,087,241)	(720,260,556)
(売買損益相当額)	(△1,167,106,419)	(△1,165,764,477)
(G) 合 計 (D + E + F)	△459,538,382	△462,074,305
(H) 収 益 分 配 金	△6,616,999	-
次期繰越損益金(G+H)	△466,155,381	-
追加信託差損益金	△446,019,178	-
(配当等相当額)	(721,087,241)	(-)
(売買損益相当額)	(△1,167,106,419)	(-)
償還差損益金	-	△462,074,305
分配準備積立金	149,133,788	-
繰 越 損 益 金	△169,269,991	-

(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 119 期
(a) 経費控除後の配当等収益	7,503,951円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	721,087,241
(d) 分 配 準 備 積 立 金	148,246,836
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	876,838,028
(f) 1万口当たり当期分配対象額	4,637.95
(g) 分 配 金	6,616,999
(h) 1万口当たり分配金	35

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 119 期
1 万 口 当 た り 分 配 金	35円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

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

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	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	1,429,146,152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	2,837,859円
				純資産総額	1,426,308,293円
受益権口数	230,374,461口	1,888,382,598口	1,658,008,137口	受益権口数	1,888,382,598口
元本額	230,374,461円	1,888,382,598円	1,658,008,137円	1万口当たり償還金	7,553円7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	317,867,345円	293,562,816円	9,235円	0円	0.00%
第2期	380,035,659	420,517,056	11,065	0	0.00
第3期	465,800,011	521,345,627	11,192	0	0.00
第4期	446,850,299	490,225,699	10,971	70	0.70
第5期	597,094,215	667,347,971	11,177	70	0.70
第6期	707,008,380	812,516,013	11,492	70	0.70
第7期	763,159,668	797,342,400	10,448	70	0.70
第8期	720,337,924	737,126,386	10,233	70	0.70
第9期	749,463,000	807,756,102	10,778	70	0.70
第10期	924,941,337	979,012,103	10,585	70	0.70
第11期	967,880,636	1,139,731,766	11,776	70	0.70
第12期	969,024,885	1,116,446,964	11,521	70	0.70
第13期	961,205,482	1,166,135,014	12,132	70	0.70
第14期	873,003,545	1,093,764,370	12,529	70	0.70
第15期	885,341,447	1,003,719,824	11,337	70	0.70
第16期	1,010,861,349	1,278,056,626	12,643	110	1.10
第17期	1,069,532,220	1,312,027,516	12,267	110	1.10
第18期	1,088,140,969	1,276,559,918	11,732	110	1.10
第19期	1,062,676,254	1,219,124,136	11,472	110	1.10
第20期	1,043,518,357	1,097,401,106	10,516	110	1.10
第21期	1,056,366,727	1,183,405,104	11,203	110	1.10
第22期	1,045,662,690	1,232,955,667	11,791	110	1.10
第23期	1,011,537,448	1,209,901,250	11,961	110	1.10
第24期	993,865,804	1,204,810,448	12,122	110	1.10
第25期	969,378,780	1,050,824,768	10,840	110	1.10

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 26 期	1,014,065,377円	858,293,465円	8,464円	110円	1.10%
第 27 期	1,281,061,675	1,105,872,747	8,632	110	1.10
第 28 期	1,919,851,258	1,863,289,804	9,705	110	1.10
第 29 期	2,630,021,167	2,353,547,576	8,949	110	1.10
第 30 期	3,072,973,235	2,150,496,272	6,998	110	1.10
第 31 期	3,502,952,468	2,312,623,899	6,602	110	1.10
第 32 期	3,843,684,745	2,984,737,413	7,765	110	1.10
第 33 期	4,649,307,755	3,759,902,818	8,087	110	1.10
第 34 期	5,784,961,061	4,613,175,106	7,974	110	1.10
第 35 期	7,058,982,864	5,235,903,142	7,417	110	1.10
第 36 期	8,228,607,039	6,472,494,507	7,866	110	1.10
第 37 期	9,103,800,411	6,444,288,771	7,079	110	1.10
第 38 期	10,040,100,300	7,143,180,016	7,115	110	1.10
第 39 期	10,537,624,564	8,104,771,251	7,691	110	1.10
第 40 期	11,839,065,136	9,137,424,174	7,718	110	1.10
第 41 期	11,373,256,130	10,082,792,327	8,865	110	1.10
第 42 期	10,962,751,675	9,970,165,187	9,095	110	1.10
第 43 期	11,005,437,408	10,266,354,098	9,328	110	1.10
第 44 期	10,742,362,577	9,988,629,156	9,298	110	1.10
第 45 期	10,259,788,762	8,771,242,158	8,549	110	1.10
第 46 期	9,741,010,721	8,261,870,278	8,482	110	1.10
第 47 期	9,078,003,990	8,279,071,672	9,120	110	1.10
第 48 期	8,410,154,758	7,978,121,174	9,486	110	1.10
第 49 期	7,399,881,851	6,623,454,135	8,951	110	1.10
第 50 期	6,458,882,869	5,947,018,649	9,208	110	1.10
第 51 期	6,010,137,515	5,625,173,165	9,359	110	1.10
第 52 期	5,704,504,600	5,192,434,217	9,102	110	1.10
第 53 期	5,094,135,676	4,762,801,073	9,350	110	1.10
第 54 期	4,782,627,327	4,755,253,664	9,943	110	1.10
第 55 期	4,595,649,812	4,098,454,950	8,918	110	1.10
第 56 期	4,486,351,378	3,823,924,261	8,523	110	1.10
第 57 期	4,404,326,755	3,641,604,790	8,268	110	1.10
第 58 期	4,667,378,697	3,741,494,828	8,016	110	1.10
第 59 期	4,688,606,168	3,590,473,858	7,658	110	1.10

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 60 期	4,709,188,975円	3,601,849,018円	7,649円	110円	1.10%
第 61 期	4,767,002,609	3,252,955,414	6,824	110	1.10
第 62 期	4,765,759,183	3,336,360,837	7,001	110	1.10
第 63 期	4,622,722,425	3,385,685,907	7,324	110	1.10
第 64 期	4,750,268,484	3,207,356,522	6,752	70	0.70
第 65 期	4,688,479,434	2,875,464,627	6,133	70	0.70
第 66 期	4,709,557,105	2,966,295,569	6,298	70	0.70
第 67 期	4,871,789,770	3,190,686,574	6,549	70	0.70
第 68 期	5,166,944,145	3,360,136,439	6,503	70	0.70
第 69 期	5,399,725,384	3,379,172,478	6,258	70	0.70
第 70 期	5,461,828,023	3,095,759,108	5,668	70	0.70
第 71 期	5,253,912,311	3,081,946,631	5,866	70	0.70
第 72 期	5,206,655,376	3,117,663,639	5,988	70	0.70
第 73 期	5,186,681,173	2,713,519,177	5,232	70	0.70
第 74 期	5,033,679,407	2,701,705,272	5,367	70	0.70
第 75 期	5,017,277,867	2,723,967,431	5,429	70	0.70
第 76 期	4,831,551,023	2,654,600,371	5,494	70	0.70
第 77 期	4,677,216,398	2,738,305,951	5,855	70	0.70
第 78 期	4,621,175,316	2,657,340,012	5,750	70	0.70
第 79 期	4,552,143,605	2,404,972,873	5,283	70	0.70
第 80 期	4,447,556,076	1,459,250,690	3,281	70	0.70
第 81 期	4,319,347,179	1,589,317,506	3,680	70	0.70
第 82 期	4,272,233,816	1,507,818,975	3,529	35	0.35
第 83 期	4,113,227,901	1,640,820,814	3,989	35	0.35
第 84 期	3,818,705,826	1,524,455,159	3,992	35	0.35
第 85 期	3,648,334,269	1,417,142,191	3,884	35	0.35
第 86 期	3,527,768,162	1,469,397,279	4,165	35	0.35
第 87 期	3,487,325,291	1,392,032,080	3,992	35	0.35
第 88 期	3,472,839,103	1,461,563,436	4,209	35	0.35
第 89 期	3,422,173,002	1,566,956,028	4,579	35	0.35
第 90 期	3,306,110,928	1,508,964,826	4,564	35	0.35
第 91 期	3,256,580,415	1,523,748,717	4,679	35	0.35
第 92 期	3,079,008,447	1,497,079,246	4,862	35	0.35
第 93 期	3,014,301,748	1,430,127,063	4,744	35	0.35

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 94 期	2,875,859,918円	1,378,451,334円	4,793円	35円	0.35%
第 95 期	2,814,934,687	1,475,188,567	5,241	35	0.35
第 96 期	2,799,943,705	1,336,533,824	4,773	35	0.35
第 97 期	2,730,374,100	1,242,810,491	4,552	35	0.35
第 98 期	2,650,035,160	1,409,687,655	5,320	35	0.35
第 99 期	2,602,159,723	1,303,328,937	5,009	35	0.35
第 100 期	2,576,589,262	1,318,325,745	5,117	35	0.35
第 101 期	2,472,945,878	1,140,227,676	4,611	35	0.35
第 102 期	2,465,739,339	1,159,741,549	4,703	35	0.35
第 103 期	2,408,504,566	1,173,645,710	4,873	35	0.35
第 104 期	2,397,169,629	1,228,818,758	5,126	35	0.35
第 105 期	2,373,978,311	1,423,948,612	5,998	35	0.35
第 106 期	2,303,681,120	1,280,498,859	5,558	35	0.35
第 107 期	2,233,611,307	1,232,784,620	5,519	35	0.35
第 108 期	2,180,423,207	1,205,468,568	5,529	35	0.35
第 109 期	2,097,139,278	1,236,670,848	5,897	35	0.35
第 110 期	2,015,035,609	1,227,341,856	6,091	35	0.35
第 111 期	2,003,788,514	1,225,408,376	6,115	35	0.35
第 112 期	1,995,661,685	1,149,556,580	5,760	35	0.35
第 113 期	1,970,493,308	1,057,177,099	5,365	35	0.35
第 114 期	1,970,656,191	1,080,212,604	5,481	35	0.35
第 115 期	1,969,211,631	1,129,208,195	5,734	35	0.35
第 116 期	1,965,704,551	1,053,438,390	5,359	35	0.35
第 117 期	1,927,173,418	1,166,564,645	6,053	35	0.35
第 118 期	1,907,042,357	1,278,238,569	6,703	35	0.35
第 119 期	1,890,571,198	1,424,415,817	7,534	35	0.35

償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税引前）	7,553円7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	<u>53,111,816</u>
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	<u>32,666,526</u>
正味投資利益	<u>20,445,290</u>
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	<u>764,894,604</u>
当期正味実現利益	<u>1,053,326,276</u>
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	<u>(339,374,359)</u>
当期末実現利益／（損失）の正味増減額	<u>(380,771,388)</u>
運用による純資産の純増加額	<u>693,000,178</u>

	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）。

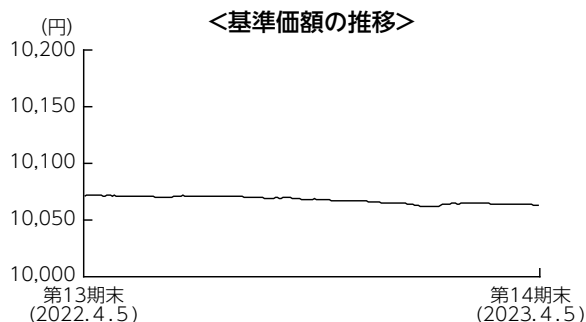
■当期中の基準価額の推移

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

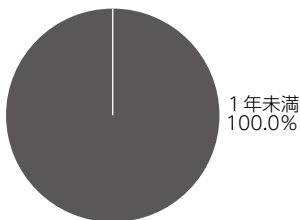
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

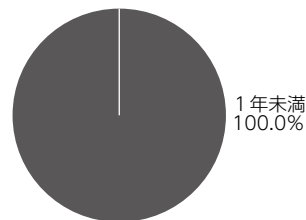
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【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	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
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。