

# 運用報告書 (全体版)

第5期<決算日 2021年3月15日>

## One世界分散セレクト (A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/内外/資産複合
信託期間	2018年9月28日から無期限です。
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を図ることを目的として、運用を行います。
主要投資対象	別に定める投資信託証券*と「DIAマネーマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、別に定める投資信託証券については、適宜見直しを行います。 ※別に定める投資信託証券：「Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンドI Aクラス」
運用方法	主として、わが国を含む世界の株式、債券、不動産投資信託証券、コモディティおよびそれらを投資対象とする上場投資信託証券(ETF)を実質的な投資対象とする別に定める投資信託証券に投資します。なお、別に定める投資信託証券には、国内外の有価証券先物取引、オプション取引、スワップ取引等のデリバティブ取引および外国為替予約取引等を活用するものを含みます。 別に定める投資信託証券への投資割合は、原則として高位とすることを基本とします。 別に定める投資信託証券やその配分比率については、適宜見直しを行います。この際、投資対象として定められていた別に定める投資信託証券が投資対象から除外されたり、わが国を含む世界各国の様々な資産への分散投資に資すると判断される投資信託証券が新たな投資対象として定められることがあります。 1万口当たりの基準価額(過去に支払った収益分配金の金額は含みません。)が2,000円を下回った場合には、投資対象ファンドの売却を行い、一定期間後に繰上償還を行います。
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。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	決算日(原則として毎年3月および9月の各15日。休業日の場合は翌営業日。)に、繰越分を含めた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、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。

愛称：100年ギフト

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、「One世界分散セレクト(Aコース)」は、2021年3月15日に第5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/>

# One世界分散セレクト (Aコース)

## ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			騰落率	投資信託受益証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税金込	み入金			
(設定日) 2018年9月28日	円 10,000	円 -	円 -	% -	% -	百万円 1,248
1期 (2019年3月15日)	9,838	0	0	△1.6	97.9	1,259
2期 (2019年9月17日)	9,932	0	0	1.0	98.9	2,032
3期 (2020年3月16日)	9,321	0	0	△6.2	96.9	2,378
4期 (2020年9月15日)	9,879	0	0	6.0	97.7	2,610
5期 (2021年3月15日)	10,463	0	0	5.9	98.9	2,739

(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) 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) 「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4) △ (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

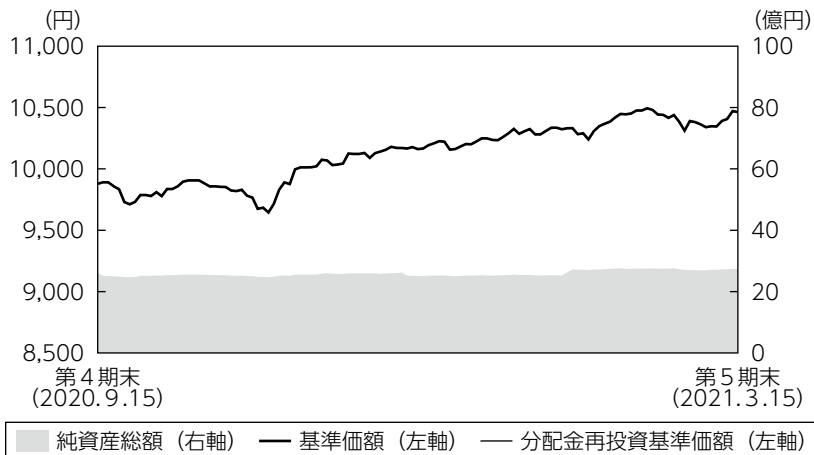
年月日	基準価額		騰落率	投資信託受益証券組入比率
	円	%		
(期首) 2020年9月15日	9,879	-		97.7
9月末	9,787	△0.9		98.7
10月末	9,684	△2.0		99.2
11月末	10,130	2.5		99.1
12月末	10,249	3.7		98.1
2021年1月末	10,290	4.2		98.6
2月末	10,384	5.1		99.3
(期末) 2021年3月15日	10,463	5.9		98.9

(注1) 騰落率は期首比です。

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

## ■当期の運用経過（2020年9月16日から2021年3月15日まで）

### 基準価額等の推移



第5期首： 9,879円  
 第5期末： 10,463円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率： 5.9%  
 (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

新型コロナウイルスの感染拡大を受けた各国の金融緩和や財政政策が継続される中、ワクチン接種の進展により景気回復期待が高まり、先進国、新興国ともに株式市場が上昇基調で推移したことがプラスに寄与しました。また、ハイイールド債券の利回りが低下（価格が上昇）したことや、原油価格の回復などもプラスに寄与し、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
Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンドI Aクラス	6.4%
DIAMマネーマザーファンド	△0.0%

(注) Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンドI A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

2020年9月以降、各国の金融緩和や財政政策の継続に加え、新型コロナウイルスのワクチン開発および接種の進展により景気回復期待が高まり、先進国、新興国ともに株式市場が上昇基調で推移し、ハイイールド債券の利回りが低下（価格が上昇）しました。経済正常化の期待に伴い、原油価格も回復しました。米国等主要国の国債利回りは、2021年1月に入り、金融緩和の影響によるインフレ懸念が高まったこと等から上昇（価格が下落）しました。

為替市場では、2020年9月以降、米国の金融緩和が長期化すると観測等から、引き続き円高米ドル安の局面となりましたが、2021年に入ると、米国の景気回復期待およびインフレ懸念による米金利上昇の影響を受け、円安米ドル高の展開となりました。

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本銀行の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日本銀行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。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンド I Aクラスの組入比率は原則として高位を維持し、DIAMマネーマザーファンドへの投資も行いました。

### ●Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンド I Aクラス

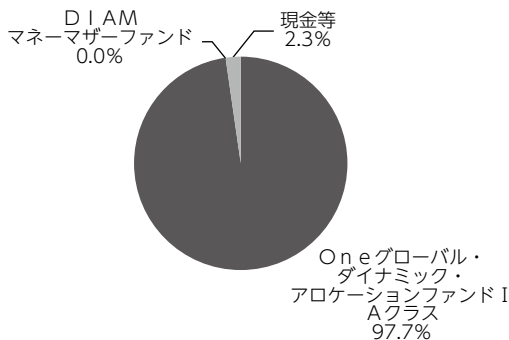
2020年9月以降、市場環境が安定化し、経済環境も回復傾向となったことから、国債等のインカム資産と株式等の収益追求資産をバランス良く保有しました。11月以降、株式等のリスクの低下を受け、株式等の収益追求資産の比率を小幅に引き上げ、相場上昇の恩恵を享受しました。

### ●DIAMマネーマザーファンド

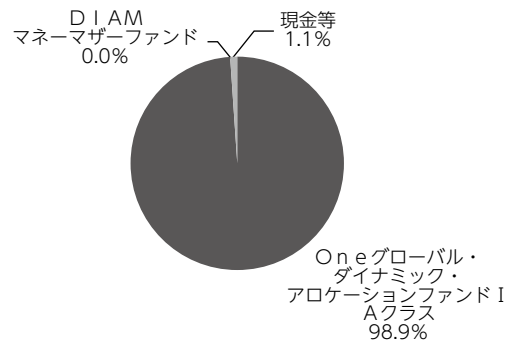
残存期間の短い国債や政府保証債などで運用を行いました。

## 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



## 分配金

当期の収益分配金につきましては分配方針に基づき、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年9月16日 ～2021年3月15日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	553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、Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンドI Aクラスの組入比率は高位を維持します。また、DIAMマネーマザーファンドへの投資も行います。

### ●Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンドI Aクラス

世界の幅広い資産にバランス良く分散投資するとともに、状況に応じた適切な資産配分を行うことにより、基準価額の相対的に安定した値動きと収益の確保をめざします。

### ●DIAMマネーマザーファンド

日本銀行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5期		項目の概要
	(2020年9月16日 ～2021年3月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	39円	0.382%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,128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)	(12)	(0.120)	
(販売会社)	(25)	(0.245)	
(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	39	0.383	

(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。

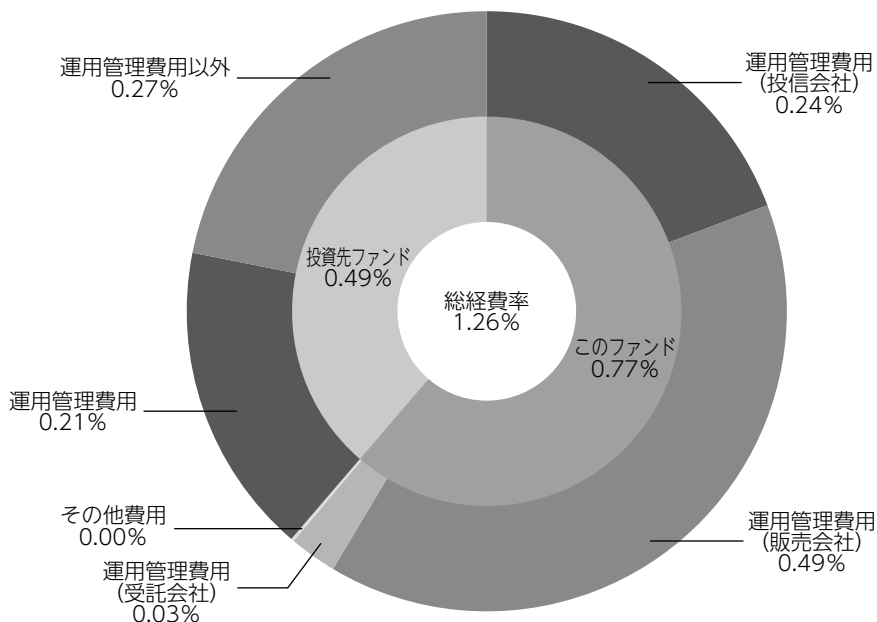
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.26%です。



総経費率 (①+②+③)	1.26%
①このファンドの費用の比率	0.77%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.21%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.27%

(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9月16日から2021年3月15日まで)

投資信託受益証券

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦建	Oneグローバル・ダイナミック・ アロケーションファンドI Aクラス	千口 24.692	千円 257,829	千口 24.942	千円 256,900

(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9月16日から2021年3月15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9月16日から2021年3月15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
	千口	千口	千円	%
Oneグローバル・ダイナミック・ アロケーションファンドI Aクラス	254.788	254.538	2,710,320	98.9
合 計	254.788	254.538	2,710,320	98.9

(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
	千口	千口	千円
D I A M マ ネ ー マ ザ ー ファ ン ド	99	99	99



## ■投資信託財産の構成

2021年3月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,710,320	98.4
D I A M マネーマザーファンド	99	0.0
コール・ローン等、その他	44,499	1.6
投資信託財産総額	2,754,920	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3月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,754,920,355円
コール・ローン等	44,499,889
投資信託受益証券(評価額)	2,710,320,624
D I A M マネーマザーファンド(評価額)	99,842
(B) 負 債	15,357,688
未 払 解 約 金	5,444,049
未 払 信 託 報 酬	9,876,024
そ の 他 未 払 費 用	37,615
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	2,739,562,667
元 本	2,618,341,378
次 期 繰 越 損 益 金	121,221,289
(D) 受 益 権 総 口 数	2,618,341,378口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	10,463円

(注) 期首における元本額は2,642,405,103円、当期中における追加設定元本額は454,850,727円、同解約元本額は478,914,452円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年9月16日 至2021年3月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△5,525円
受 取 利 息	586
支 払 利 息	△6,111
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	147,999,893
売 買 益	158,628,833
売 買 損	△10,628,940
(C) 信 託 報 酬 等	△9,913,639
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	138,080,729
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	26,680
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△16,886,120
(配 当 等 相 当 額)	(6,823,027)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,709,147)
(G) 合 計(D + E + F)	121,221,289
次 期 繰 越 損 益 金(G)	121,221,289
追 加 信 託 差 損 益 金	△16,886,120
(配 当 等 相 当 額)	(6,823,027)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,709,147)
分 配 準 備 積 立 金	138,112,642
繰 越 損 益 金	△5,233

(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	130,589,902
(c) 収 益 調 整 金	6,823,027
(d) 分 配 準 備 積 立 金	7,522,740
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	144,935,669
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	553.54
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては分配方針に基づき、無分配とさせていただきます。

# Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンド I

<Aクラス>

<Bクラス>

当ファンドは「One世界分散セレクト（Aコース）／（Bコース）」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	ケイマン籍外国投資信託／円建受益証券
主要投資対象	世界の株式、債券、不動産投資信託証券（リート）、コモディティなどに投資を行うために、上場投資信託証券（ETF）や、有価証券先物などの派生商品を主に活用します。
投資態度	①各資産への配分は、世界の景気動向や市場環境を勘案し、決定します。また、下落リスクが高まったと判断される場合は、短期金融資産や現金などの比率を引き上げることがあります。 ②為替ヘッジ比率は、為替予約取引を用いて適宜調整を行います。
主な投資制限	・有価証券の空売りは行いません。 ・信託財産の純資産総額の10%を超える借入は行いません。 ・流動性に欠ける資産への投資は純資産総額の15%を超えないものとします。
投資顧問会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託銀行	FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited.
管理事務代行会社	Mizuho Bank (USA)
保管銀行	Mizuho Trust & Banking (Luxembourg) S.A.

Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンドIはケイマン籍外国投資信託で、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翻訳・抜粋したものです。なお、クラス分けされたものがないため、シリーズ・トラスト単位（Oneグローバル・ダイナミック・アロケーションファンドI）で掲載しています。シリーズ・トラストは複数のクラスで構成されています。

**運用計算書**  
(自2018年9月28日 至2019年12月31日)

**収益の部**

	日本円
税引後配当金（源泉税控除7,859,027円）	104,559,478
<b>収益合計</b>	<b>104,559,478</b>

**費用の部**

投資運用報酬	7,840,674
管理事務報酬	6,694,071
保管報酬	1,103,767
監査報酬	3,820,300
受託報酬	2,298,256
設立費	2,414,838
法律顧問報酬	179,067
支払利息	314,693
その他費用	336,883
<b>費用合計</b>	<b>25,002,549</b>

**純投資収益**

	79,556,929
投資有価証券売却による実現純損失	(15,412,225)
デリバティブ契約による実現純利益	150,399,108
外貨取引による実現純損失	(18,341,160)
<b>期中実現純利益額</b>	<b>116,645,723</b>

投資有価証券による未実現損益の純変動	41,379,433
デリバティブ取引による未実現純損益の変動	(6,518,117)
外貨取引による未実現純損益の変動	(872,749)
<b>期中未実現純利益額</b>	<b>33,988,567</b>

**運用による純資産の純減**

**230,191,219**

	発行済受益権口数	一口当たり純資産価額（日本円）
クラス A	218,530	10,246
クラス B	568,194	9,580

投資有価証券明細表（要約版）  
2019年12月31日現在  
（日本円）

普通株式	銘柄	通貨	口数	取得原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産%
アイルランド	ISHARES JPM EM BND	USD	87,600	1,052,216,094	1,086,795,209	14.15%
	ISHARES HIGH YLD COR	EUR	59,700	765,455,070	768,976,670	10.01%
	ISHARES USD SHORT	USD	51,800	540,972,327	519,027,453	6.76%
米国	ISHARES GLOBAL REIT	USD	175,500	509,923,822	526,781,414	6.86%
	INVESCO DB OIL FUND	USD	130,500	163,633,305	151,322,874	1.97%
	ISHARES GOLD TRUST	USD	94,700	128,550,645	149,227,076	1.94%
				<b>3,160,751,263</b>	<b>3,202,130,696</b>	<b>41.68%</b>

# D I A Mマネーマザーファンド

## 運用報告書

第11期（決算日 2020年4月6日）

（計算期間 2019年4月6日～2020年4月6日）

D I A Mマネーマザーファンドの第11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				
7期(2016年4月5日)	10,098	0.1	80.6	—	—	百万円 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
11期(2020年4月6日)	10,089	△0.1	69.3	—	—	1,139

(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)。

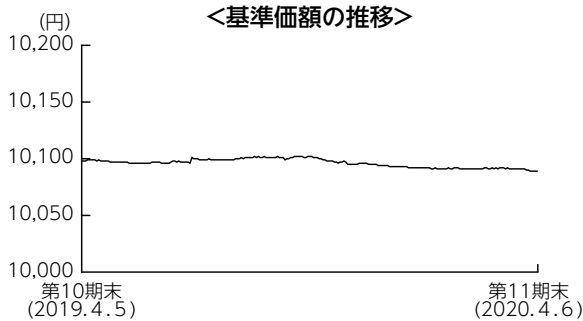
## ■当期中の基準価額の推移

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) 2019年 4 月 5 日	10,098	% -		% 79.4		% -	% -
4 月 末	10,097	△0.0		79.4	-	-	-
5 月 末	10,096	△0.0		79.4	-	-	-
6 月 末	10,097	△0.0		78.0	-	-	-
7 月 末	10,099	0.0		74.6	-	-	-
8 月 末	10,101	0.0		74.6	-	-	-
9 月 末	10,102	0.0		74.8	-	-	-
10 月 末	10,097	△0.0		73.9	-	-	-
11 月 末	10,094	△0.0		73.9	-	-	-
12 月 末	10,092	△0.1		73.3	-	-	-
2020年 1 月 末	10,092	△0.1		71.3	-	-	-
2 月 末	10,091	△0.1		69.9	-	-	-
3 月 末	10,089	△0.1		69.3	-	-	-
(期 末) 2020年 4 月 6 日	10,089	△0.1		69.3	-	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2019年4月6日から2020年4月6日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は10,089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。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

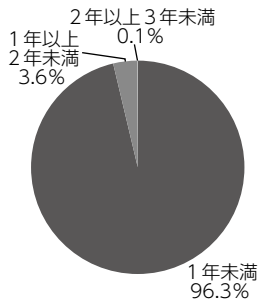
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が黒田総裁の第2期就任以降も「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を続けており、国債利回りには低下圧力がかかっていることが要因となりました。一方、国債を除く債券については、プラス利回りに対するニーズも強いことから、0%前後の利回りに張り付いた状態になりました。

### ポートフォリオについて

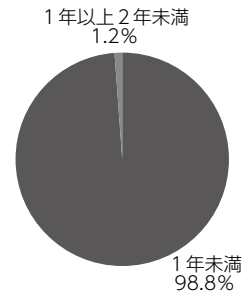
残存期間の短い国債や政府保証債、地方債などで運用を行いました。

【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 (2019年4月6日から2020年4月6日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 300,183	千円 11,723,868 (500,000)
	地 方 債 証 券	15,223	— (107,360)
	特 殊 債 券	—	— (21,000)

(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 (2019年4月6日から2020年4月6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

公社債

(A) 債券種類別開示

国内(邦貨建) 公社債

区 分	当 期				未		
	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
国 債 証 券	千円 700,000	千円 700,395	% 61.5	% —	% —	% —	% 61.5
地 方 債 証 券	43,470	43,649	3.8	3.8	—	—	3.8
特 殊 債 券	45,000	45,270	4.0	—	—	—	4.0
合 計	788,470	789,314	69.3	3.8	—	—	69.3

(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、BB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
<b>(国債証券)</b>														
388回	利付	国庫債券	(2年)	0.1000	100,000	100,025	2020/05/15							
389回	利付	国庫債券	(2年)	0.1000	300,000	300,108	2020/06/01							
391回	利付	国庫債券	(2年)	0.1000	200,000	200,162	2020/08/01							
392回	利付	国庫債券	(2年)	0.1000	100,000	100,100	2020/09/01							
小		計		—	700,000	700,395	—							
<b>(地方債証券)</b>														
27年度	2回	千葉県公募公債	0.1770	14,670	14,672	2020/05/25								
27年度		京都府京都みらい債	0.1000	13,800	13,794	2020/09/02								
474回		名古屋市公募公債 10年	1.3100	15,000	15,181	2021/03/19								
小		計		—	43,470	43,649	—							
<b>(特殊債券)</b>														
112回		政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1000	30,000	30,108	2020/07/31								
117回		政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	6,000	6,030	2020/09/30								
133回		政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	5,000	5,070	2021/04/30								
137回		政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2000	4,000	4,060	2021/06/30								
小		計		—	45,000	45,270	—							
合		計		—	788,470	789,314	—							

## ■投資信託財産の構成

2020年4月6日現在

項目	当		期		末
	評	価	額	比	率
公	社		債	千円	%
				789,314	69.3
コーポレート・ローン等、その他				350,454	30.7
投資信託財産総額				1,139,769	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

(2020年4月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,139,769,563円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	350,041,819
公 社 債(評価額)	789,314,782
未 収 利 息	319,264
前 払 費 用	93,698
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,139,769,563
元 本	1,129,674,818
次 期 繰 越 損 益 金	10,094,745
(D) 受 益 権 総 口 数	1,129,674,818口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,089円

## ■損益の状況

当期 自2019年4月6日 至2020年4月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,879,508円
受 取 利 息	5,642,396
支 払 利 息	△762,888
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△8,301,781
売 買 益	43,245
売 買 損	△8,345,026
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△3,422,273
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	156,380,359
(E) 解 約 差 損 益 金	△143,271,020
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	407,679
(G) 合 計(C+D+E+F)	10,094,745
次 期 繰 越 損 益 金(G)	10,094,745

(注1) 期首元本額 16,010,803,187円  
追加設定元本額 44,692,321円  
一部解約元本額 14,925,820,690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 資源国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
マシューズ・アジア株式ファンド	59,376,493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
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)	54,500,083円
期末元本合計	1,129,674,818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) (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。