

# 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＞

追加型投信／内外／資産複合

## 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。

当ファンドは、主としてシラー・バークレイズ・ケープ®米国セクターII ER USD指数を活用した米国株式戦略およびダブルラインの債券戦略を活用して、トータルリターンの向上を目指します。原則として対円での為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。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。

作成対象期間 2024年4月26日～2025年4月25日

| 第8期                  | 決算日：2025年4月25日 |         |
|----------------------|----------------|---------|
| 第8期末<br>(2025年4月25日) | 基準価額           | 14,718円 |
|                      | 純資産総額          | 752百万円  |
| 第8期                  | 騰落率            | 3.6%    |
|                      | 分配金合計          | 0円      |

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書(全体版)を電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書(全体版)は、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書(全体版)は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

## ■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)

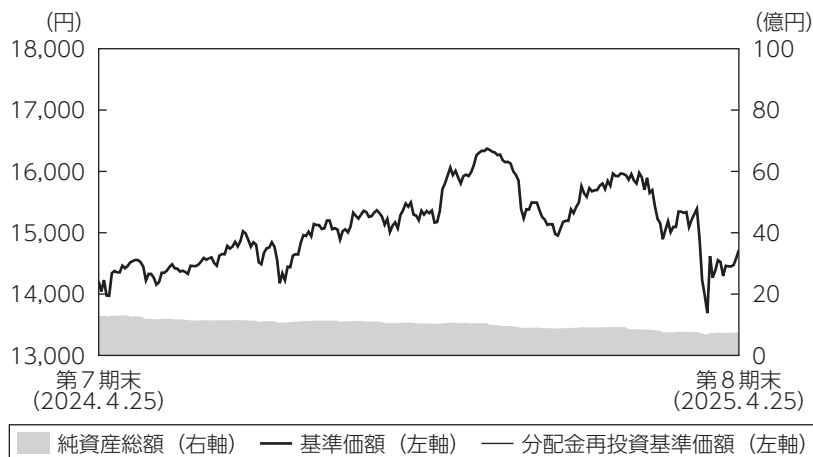
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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 <https://www.am-one.co.jp/>

## 運用経過の説明

### 基準価額等の推移



第8期首：14,204円  
 第8期末：14,718円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：3.6%  
 (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

「ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルグ）ーダブルライン・シラー・エンハnst・ケープ クラスⅠ」（以下、「ダブルライン・ファンド」という場合があります。）等への投資を通じ米国株式、債券を中心に投資を行いました。上記の運用の結果、米国株式、米国債券がともに上昇したことを背景に基準価額は前期末対比上昇しました。

## 1 万口当たりの費用明細

| 項目        | 第8期                         |         | 項目の概要                                            |
|-----------|-----------------------------|---------|--------------------------------------------------|
|           | (2024年4月26日<br>～2025年4月25日) |         |                                                  |
|           | 金額                          | 比率      |                                                  |
| (a) 信託報酬  | 188円                        | 1.243%  | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は15,117円です。 |
| (投信会社)    | ( 58)                       | (0.385) | 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)    | (125)                       | (0.825) | 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)    | ( 5)                        | (0.033) | 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             |
| (b) その他費用 | 4                           | 0.024   | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                    |
| (保管費用)    | ( 3)                        | (0.020) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用                           |
| (監査費用)    | ( 1)                        | (0.004) | 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                     |
| (その他)     | ( 0)                        | (0.001) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等                             |
| 合計        | 192                         | 1.267   |                                                  |

(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。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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。

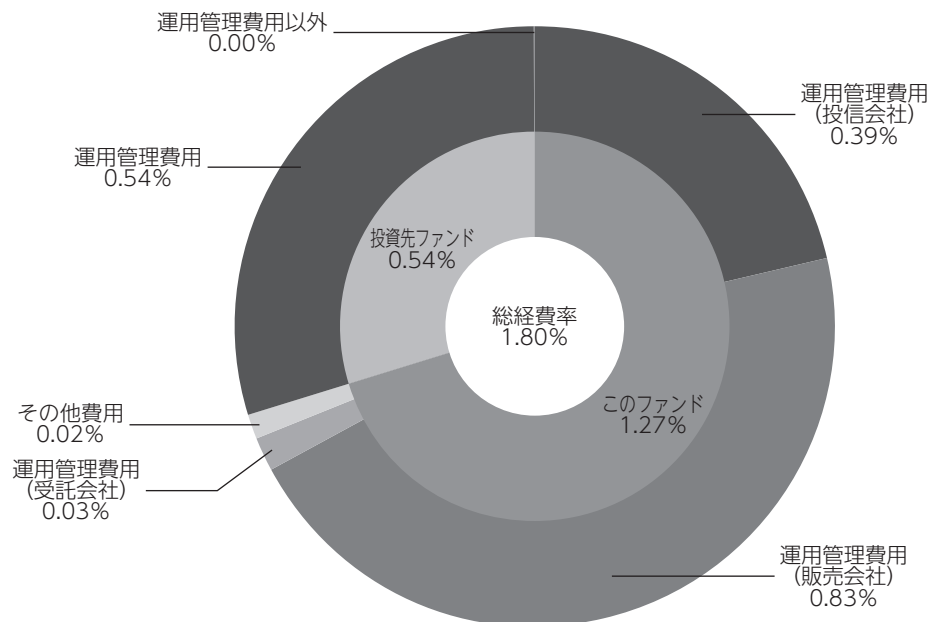
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.80%です。



|                      |       |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③)         | 1.80% |
| ①このファンドの費用の比率        | 1.27% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.54% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.00% |

(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。なお、投資先ファンドで行われるトータル・リターン・スワップに関連する費用は、総経費率の計算に含まれておりません。当該費用は、スワップ取引が参照する指数から差し引かれ、基準価額に反映されています。上記の総経費率に関しては、投資先ファンドも含め入手し得る情報において作成、計算されたものです。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

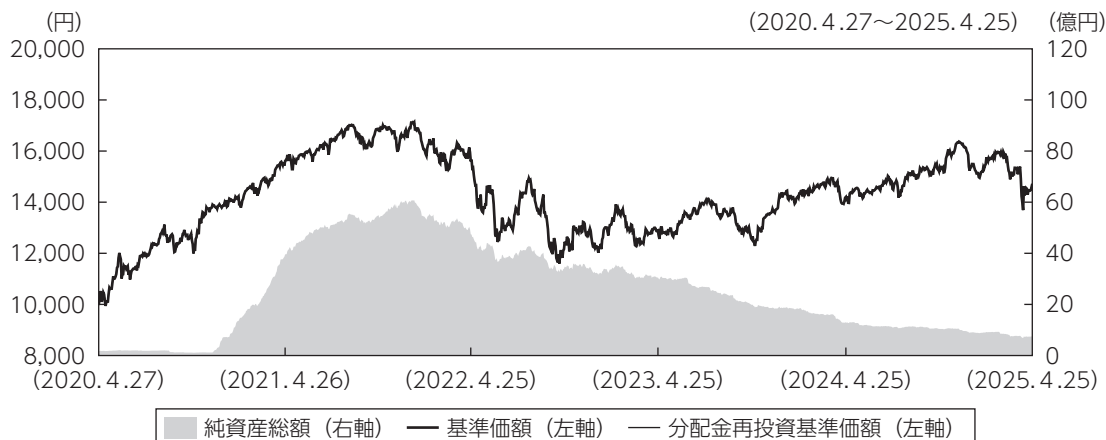
(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(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。

## 最近5年間の基準価額等の推移



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

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2020年4月27日の基準価額に合わせて指数化しています。

|                |       | 2020年4月27日<br>期首 | 2021年4月26日<br>決算日 | 2022年4月25日<br>決算日 | 2023年4月25日<br>決算日 | 2024年4月25日<br>決算日 | 2025年4月25日<br>決算日 |
|----------------|-------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落)     | (円)   | 9,976            | 15,607            | 15,591            | 12,885            | 14,204            | 14,718            |
| 期間分配金合計 (税引前)  | (円)   | —                | 0                 | 0                 | 0                 | 0                 | 0                 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 | (%)   | —                | 56.4              | △0.1              | △17.4             | 10.2              | 3.6               |
| 参考指数の騰落率       | (%)   | —                | 49.8              | 3.6               | △1.5              | 24.5              | 9.6               |
| 純資産総額          | (百万円) | 174              | 3,953             | 4,743             | 3,053             | 1,296             | 752               |

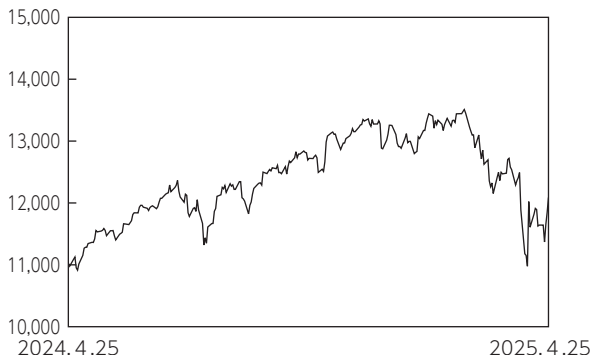
(注1) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。参考指数はS&P500® (配当込み) です。参考指数については後掲の＜当ファンドの参考指数について＞をご参照ください。

(注2) 参考指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています (以下同じ)。

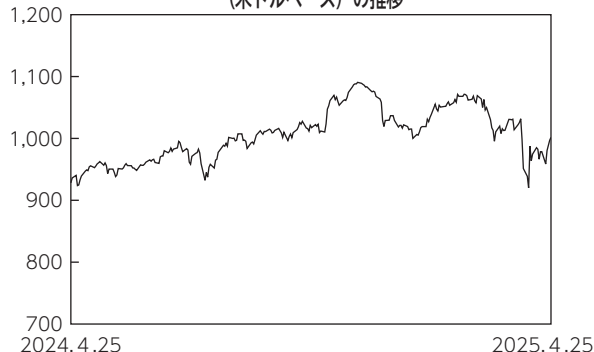
## 投資環境

株式市場は、F R B（米連邦準備理事会）の利下げやトランプ新政権による政策期待が強まったことなどから、2月下旬にかけて上昇基調となりましたが、期末にかけては相互関税による景気悪化懸念から上昇幅を縮小しました。債券市場は、9月にかけて米国経済指標が軟調な中、F R Bが利下げに踏み切り堅調に推移しました。その後、大統領選でのトランプ氏勝利による財政悪化懸念などから軟調となりましたが、期末にかけては、景気悪化懸念から堅調となりました。

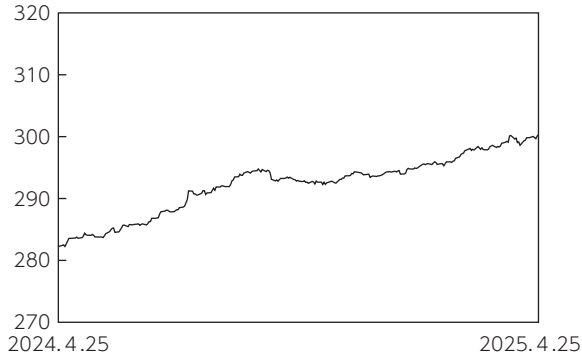
S&P500®（配当込み）の推移



シラー・パークレイズ・ケープ®米国セクターII ER USD指数  
（米ドルベース）の推移



ブルームバーグ米国総合1-3年指数（米ドルベース）の推移



（注）値は前営業日のものを用いております。

※「Bloomberg®」およびブルームバーグ米国総合1-3年指数（米ドルベース）は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、アセットマネジメントOne（株）による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはアセットマネジメントOne（株）とは提携しておらず、また、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>を承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、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>に関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

（注）値は前営業日のものを用いております。

※パークレイズ・バンク・ピーエルシー及びその関連会社（以下「パークレイズ」と総称します。）は、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>（以下「本ファンド」といいます。）の発行者又は作成者ではなく、パークレイズは、本ファンドの投資家に対して何ら責任又は義務を負いません。シラー・パークレイズ・ケープ®米国セクターII ER USD指数（以下「本指数」といいます。）はパークレイズ・バンク・ピーエルシーの所有する商標であり、本ファンドによる使用のためにライセンスが付与されています。本ファンドは本指数について又は本指数に関連してパークレイズと取引をする場合がありますが、本ファンドの投資家は本ファンドに対する利益のみ取得し、投資家は、本ファンドへの投資にあたって、本指数に対するいかなる利益も取得せず、また、パークレイズとの間でいかなる種類の関係も取得しません。本ファンドはパークレイズによって出資、承認又は販売促進されておらず、パークレイズは、本ファンドの推奨度又は本指数若しくは本指数に含まれるいかなる情報の使用に関して何らの表明も行いません。パークレイズは、本指数又は本指数に含まれるいかなる情報の使用又は正確性に関して、本ファンド、投資家の皆様又はその他の第三者に対して、何らの責任も負わないものとします。シラー・パークレイズ指数は、その一部につき、RSBB-I, LLC（主たる研究者はロバート・J・シラー氏）により開発されています。RSBB-I, LLCは、投資助言業者ではなく、シラー・パークレイズ指数又はシラー・パークレイズ指数に含まれる若しくはシラー・パークレイズ指数が依拠するいかなる情報若しくは手法の正確性又は完全性についても保証しません。RSBB-I, LLC又はロバート・J・シラー氏並びにそのコンサルタントであるIndexVestLAB, LLC及びそのコンサルタントは、シラー・パークレイズ指数のいかなる誤り、欠落又は障害についても責任を負わないものとし、シラー・パークレイズ指数に含まれる又はシラー・パークレイズ指数が依拠する情報の使用によりいかなる当事者に生じた運用実績又は結果についても、明示又は黙示を問わず、何らの表明も行わず、それらについての全ての商品性又は特定の目的に適用していることの保証を明示的に否認します。また、RSBB-I, LLC又は上記当事者のいずれも、当該情報の使用に関連するいかなる性質の請求又は損害（逸失利益、懲罰的損害又は間接的な損害を含みますが、それらに限られません。）について、仮に当該請求又は損害の可能性についてRSBB-I, LLC又は上記当事者が知っていた場合であっても、責任を負わないものとします。

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りはゼロ%近辺で始まりましたが、その後日銀が2024年7月、2025年1月に政策金利を引き上げたことから、同金利は徐々に上昇しました。

## ■ ポートフォリオについて

### ● 当ファンド

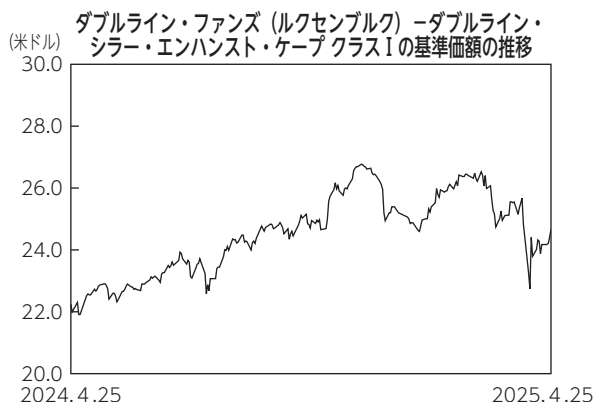
ダブルライン・ファンドへの投資配分については、当期を通して高位としました。また、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も継続しました。なお、外貨建て資産に対しては対円での為替ヘッジを実施しました。

### ● ダブルライン・ファンド

主要投資対象とした外国籍投信では、トータル・リターン・スワップを活用することでシラー・バークレイズ・ケープ®米国セクターII ER USD指数に概ね連動する投資成果の獲得を図る一方、米ドル建ての債券投資から得られる投資成果の確保を目指して運用を行いました。株式部分においては期末時点ではコミュニケーション・サービス、生活必需品、一般消費財、不動産セクターに投資しています。債券部分では米国国債、社債、資産担保証券等の債券を保有しております。

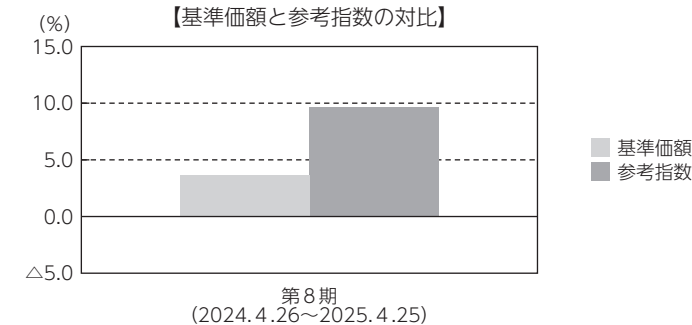
### ● D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債などで運用を行いました。



ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。  
グラフは、基準価額と参考指数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

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきました。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                        |
|------------|---------------------------|
|            | 2024年4月26日<br>～2025年4月25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  | 4,717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

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＞では、資金動向や市場動向に留意し、引き続きダブルライン・ファンドの高位組み入れ、ならびにD I A Mマネーマザーファンドへの投資を継続する方針です。また、外貨建て資産に対しては対円での為替ヘッジを実施する方針です。

### ●ダブルライン・ファンド

関税によって短期的にインフレリスクが高まるため、F R Bは労働市場が悪化するまで政策金利を据え置く可能性が高いと見えています。債券部分の運用は、トップダウン、ボトムアップの両面から慎重に投資機会を模索していき、株式部分はシラー・バークレイズ・ケープ<sup>®</sup>米国セクターII ER USD指数に概ね連動する投資成果の獲得を図る方針です。

### ●D I A Mマネーマザーファンド

日銀は2025年3月の金融政策決定会合で、政策金利を0.50%とする金融政策を維持しました。日銀は引き続き政策金利の引き上げを行うと見られますが、米国の関税政策の先行きなど、内外経済の不確実性が高い中では日銀は慎重に利上げを行うと見られ、今後の金利上昇は限定的なものとなることが見込まれます。そのため、今後も公社債等への投資を通じ、安定的な運用を目指します。

## お知らせ

### 約款変更のお知らせ

■当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「D I A Mマネーマザーファンド」において、投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

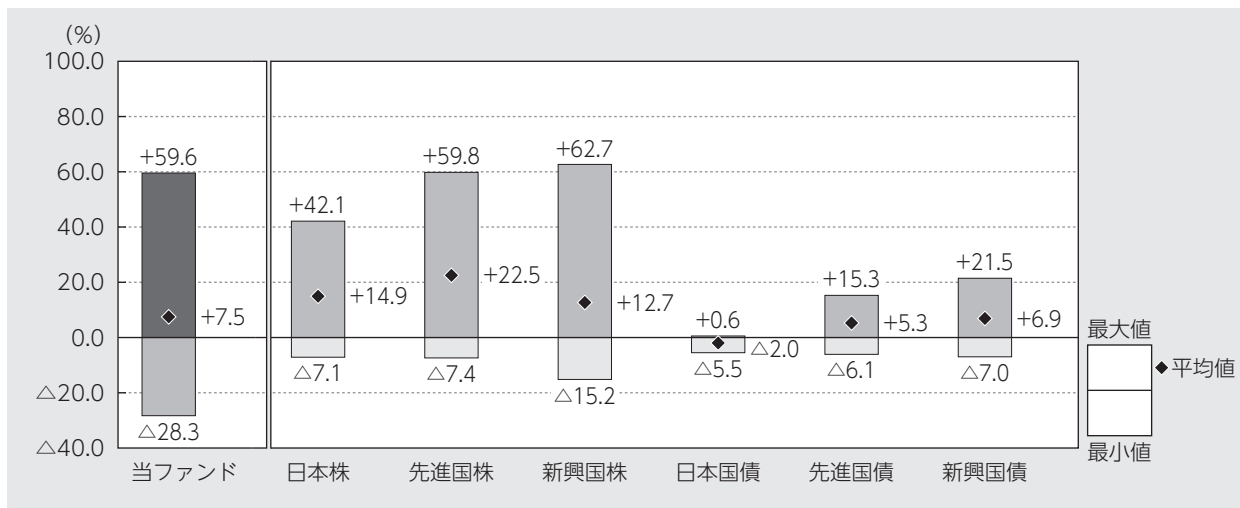
(2025年4月1日)

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

## 当ファンドの概要

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                            |
|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／内外／資産複合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                            |
| 信 託 期 間 | 2027年4月26日まで                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                            |
| 運 用 方 針 | 投資信託証券を主要投資対象とします。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                            |
| 主要投資対象  | 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＞                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 投資信託証券。                                                    |
|         | ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）ーダブルライン・シラー・エンハンスト・ケープ クラス I                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 国債や社債、証券化商品を含む様々な債券。また実質的な株式への投資手段としてトータル・リターン・スワップを活用します。 |
|         | D I A M マネーマザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 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。     |
| 運 用 方 法 | <p>①主として、以下の投資信託証券に投資します。<br/>ルクセンブルク籍外国投資法人 ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）ーダブルライン・シラー・エンハンスト・ケープ クラス I（以下、「ダブルライン・ファンズ」といいます。）米ドル建投資証券<br/>内国証券投資信託（親投資信託） D I A M マネーマザーファンド受益証券</p> <p>②ダブルライン・ファンズは主としてトータル・リターン・スワップを活用することでロバート・シラー氏の理論を基に開発されたシラー・バークレイズ・ケープ®米国セクターII ER USD指数に概ね連動する投資成果の獲得を図る一方、米ドル建ての債券をはじめとするグローバルの様々な債券に投資し、経済環境や市場動向を勘案した債券種別アロケーションや個別銘柄選定等を実施することで得られる投資成果の確保を目指します。</p> <p>③各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向等を勘案して決定するものとし、ダブルライン・ファンズの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。</p> <p>④組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p> |                                                            |
| 分 配 方 針 | <p>分配対象額の範囲は、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。）等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準、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。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                            |

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較



2020年4月～2025年3月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

### \*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※各指数については後掲の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

## 当ファンドのデータ

### 当ファンドの組入資産の内容（2025年4月25日現在）

#### ◆組入ファンド等

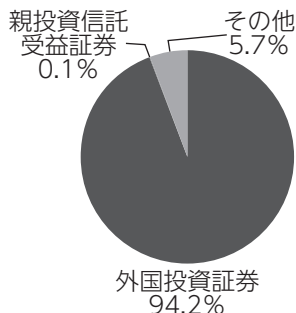
（組入ファンド数：2ファンド）

|                                                  | 当期末        |
|--------------------------------------------------|------------|
|                                                  | 2025年4月25日 |
| ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）ーダブルライン・シラー・エンハンスド・ケープ クラス I | 94.2%      |
| D I AMマネーマザーファンド                                 | 0.1        |
| その他                                              | 5.7        |

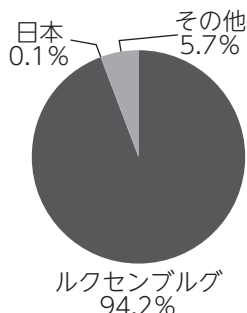
（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

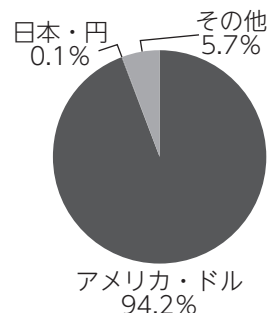
#### ◆資産別配分



#### ◆国別配分



#### ◆通貨別配分



（注1）比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）現金等はその他として表示しています。

（注3）国別配分につきましては発行国（地域）で表示しております。

（注4）組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。

### 純資産等

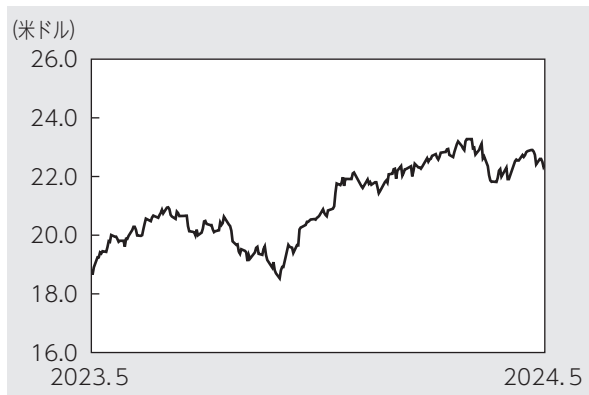
| 項目         | 当期末          |
|------------|--------------|
|            | 2025年4月25日   |
| 純資産総額      | 752,567,382円 |
| 受益権総口数     | 511,337,767口 |
| 1万口当たり基準価額 | 14,718円      |

（注）当期中における追加設定元本額は14,415,944円、同解約元本額は416,161,526円です。

## 組入ファンドの概要

【ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）－ダブルライン・シラー・エンハnst・ケープ クラスⅠ】（計算期間 2023年6月1日～2024年5月31日）

### ◆基準価額の推移



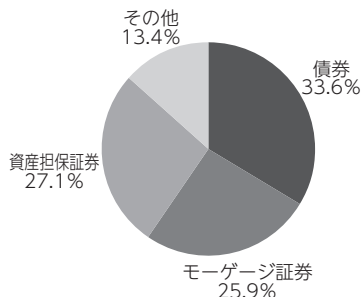
### ◆組入上位10銘柄

| 銘柄名                                                                           | 通貨      | 比率    |
|-------------------------------------------------------------------------------|---------|-------|
| United States Treasury Bill 5.29% 27/06/2024*                                 | アメリカ・ドル | 16.6% |
| Sound Point Clo XX Ltd FRN 26/07/2031 A Series 2018-2A                        | アメリカ・ドル | 2.4   |
| Sound Point CLO XVII FRN 20/10/2030 A2 Series 2017-3A                         | アメリカ・ドル | 1.7   |
| National Collegiate Student Loan Trust 2006-1 FRN 25/03/2033 A5 Series 2006-1 | アメリカ・ドル | 1.4   |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust FRN 25/05/2037 A1A Series 2006-RM2     | アメリカ・ドル | 1.2   |
| GSAA Home Equity Trust 2005-12 6.158%STEP 25/09/2035 AF5 Series 2005-12       | アメリカ・ドル | 1.1   |
| Alternative Loan Trust 2007-OA8 FRN 25/06/2047 1A1 Series 2007-OA8            | アメリカ・ドル | 1.1   |
| Atlas Senior Loan Fund XI Ltd FRN 26/07/2031 B Series 2018-11A                | アメリカ・ドル | 1.1   |
| Hayfin US XII Ltd FRN 20/04/2031 A Series 2018-8A                             | アメリカ・ドル | 1.1   |
| BNC Mortgage Loan Trust 2006-1 FRN 25/10/2036 A1 Series 2006-1                | アメリカ・ドル | 1.0   |
| 組入銘柄数                                                                         | 255銘柄   |       |

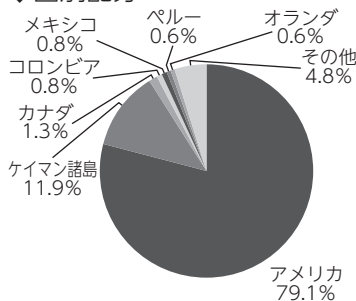
### ◆1万口当たりの費用明細

費用明細については開示されていないため、掲載しておりません。

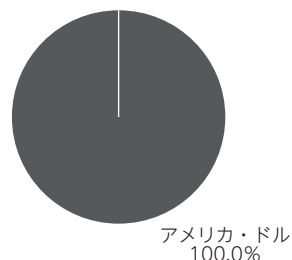
### ◆資産別配分



### ◆国別配分



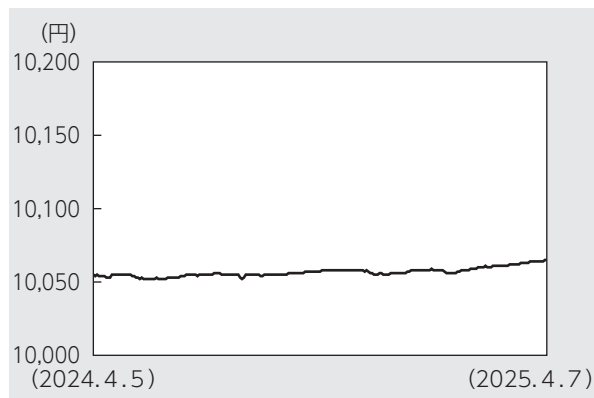
### ◆通貨別配分



- (注1) 基準価額の推移はダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）－ダブルライン・シラー・エンハnst・ケープ クラスⅠの計算期間のものであります。
- (注2) 組入上位10銘柄の略語は、F R N－変動利付債、S T E P－ステップアップ債です。
- (注3) 組入上位10銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分については、ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）－ダブルライン・シラー・エンハnst・ケープの決算日現在の状況を表示しております。
- (注4) 組入上位10銘柄、資産別配分の比率は、ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）－ダブルライン・シラー・エンハnst・ケープの純資産総額に対する評価額の割合です。
- (注5) 国別配分、通貨別配分の比率は、ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）－ダブルライン・シラー・エンハnst・ケープのポートフォリオ部分に対する評価額の割合です。
- (注6) 国別配分は、発行国もしくは投資国を表示してあります。
- (注7) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。
- (注8) 「ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）－ダブルライン・シラー・エンハnst・ケープ クラスⅠ」は、「ダブルライン・ファンズ（ルクセンブルク）－ダブルライン・シラー・エンハnst・ケープ」を構成する個別クラスとなっております。
- (注9) 組入全銘柄や費用の総額に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

【D I AMマネーマザーファンド】（計算期間 2024年4月6日～2025年4月7日）

◆基準価額の推移



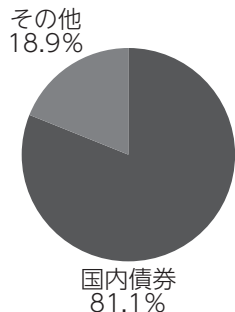
◆組入上位10銘柄

| 銘柄名               | 通貨   | 比率    |
|-------------------|------|-------|
| 1 2 8 9回 国庫短期証券   | 日本・円 | 12.9% |
| 1 2 8 3回 国庫短期証券   | 日本・円 | 10.3  |
| 1 2 6 7回 国庫短期証券   | 日本・円 | 10.3  |
| 1 2 9 0回 国庫短期証券   | 日本・円 | 10.3  |
| 1 2 9 1回 国庫短期証券   | 日本・円 | 10.3  |
| 1 2 8 0回 国庫短期証券   | 日本・円 | 7.7   |
| 1 2 7 9回 国庫短期証券   | 日本・円 | 7.7   |
| 4 5 7回 利付国庫債券（2年） | 日本・円 | 5.1   |
| 1 2 6 1回 国庫短期証券   | 日本・円 | 2.6   |
| 1 2 4 4回 国庫短期証券   | 日本・円 | 2.6   |
| 組入銘柄数             | 11銘柄 |       |

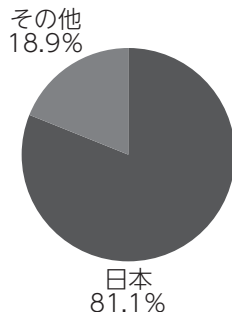
◆1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

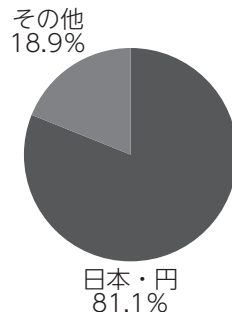
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものです。

(注2) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注3) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注4) 現金等はその他として表示しています。

(注5) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

## <当ファンドの参考指数について>

### ●S&P500<sup>®</sup>（配当込み）

S&P500<sup>®</sup>（配当込み）は米国の主要産業を代表する500社から構成される指数です。

S&P500<sup>®</sup>（配当込み）は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLCまたはその関連会社は、いかなる指数の資産クラスまたは市場セクターを正確に代表する能力に関して、明示または黙示を問わずいかなる表明または保証もしません。また、S&P500<sup>®</sup>（配当込み）のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

## <代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数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JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」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JPXが有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

