

# 運用報告書 (全体版)

第13期<決算日2021年10月12日>

## DIAMコモディティパッシブ・ファンド

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/海外/その他資産 (商品) (インデックス型)	
信託期間	2009年1月30日から無期限です。	
運用方針	海外の代表的な商品指数の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	DIAMコモディティパッシブ・ファンド	コモディティインデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	コモディティインデックス・マザーファンド	S&P、GSCI商品指数に連動するユーロドル債 (証券を含みます。) を主要投資対象とします。
運用方法	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。ただし、マザーファンド受益証券での運用が困難であると委託会社が判断した場合には、直接、海外の商品指数の動きに連動する債券 (証券を含みます。) 等に投資する場合があります。実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。マザーファンドにおいては、ユーロドル債 (証券を含みます。) の組入比率は、原則として高位を維持します。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。外貨建資産への実質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10月12日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の剰余金等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAMコモディティパッシブ・ファンド」は、2021年10月12日に第13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/>

# D I A M コモディティパッシブ・ファンド

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S & P G S C I 商品指数		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(円換算ベース) ベンチマーク)	期中 騰落率			
9期 (2017年10月12日)	円 7,753	円 0	% 6.3	ポイント 25,058.03	% 6.7	% 99.0	% -	百万円 3,247
10期 (2018年10月12日)	9,262	0	19.5	29,816.35	19.0	99.2	-	3,816
11期 (2019年10月15日)	7,643	0	△17.5	24,034.87	△19.4	99.0	-	3,855
12期 (2020年10月12日)	5,359	0	△29.9	17,076.16	△29.0	99.4	-	4,086
13期 (2021年10月12日)	9,117	0	70.1	29,597.67	73.3	99.2	-	4,341

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) ベンチマークはS & P G S C I 商品指数 (円換算ベース) であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています (以下同じ)。

(注4) S & P G S C I 商品指数 (「当インデックス」) は、S & P Globalの一部門であるS & P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社 (「S P D J I」) 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。Standard & Poor's®およびS & P®は、S & P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがS P D J Iに付与されています。S & P®、S & P G S C I®およびS & P G S C I 商品指数はS & Pの商標であり、これらを利用するライセンスがS P D J Iとその関連会社に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。S & P G S C I 商品指数は、Goldman Sachs & Co.またはその関連会社によって所有、保証、または承認されたものではなく、これら会社とは一切関係がありません。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、S P D J I、Dow Jones、S & P、それぞれの関連会社、または第三者のライセンサーのいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行いません (以下同じ)。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P G S C I 商品指数		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比
	円	騰 落 率	(円換算ベース) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2020年10月12日	5,359	—	ポイント 17,076.16	% —	% 99.4	% —
10月末	5,002	△6.7	15,940.33	△6.7	99.0	—
11月末	5,584	4.2	17,830.36	4.4	99.5	—
12月末	5,782	7.9	18,484.84	8.2	99.5	—
2021年 1 月末	6,185	15.4	19,791.52	15.9	99.6	—
2 月末	7,127	33.0	22,824.82	33.7	98.8	—
3 月末	7,111	32.7	22,788.95	33.5	99.7	—
4 月末	7,582	41.5	24,321.26	42.4	99.7	—
5 月末	7,785	45.3	24,985.95	46.3	99.8	—
6 月末	8,082	50.8	25,961.32	52.0	99.6	—
7 月末	8,249	53.9	26,509.64	55.2	99.7	—
8 月末	8,078	50.7	26,003.96	52.3	99.7	—
9 月末	8,638	61.2	27,795.16	62.8	99.4	—
(期 末) 2021年10月12日	9,117	70.1	29,597.67	73.3	99.2	—

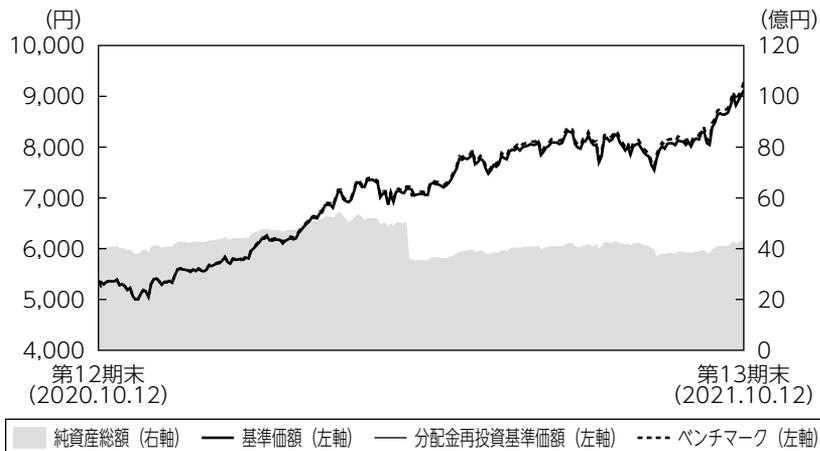
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

### 基準価額等の推移



第13期首： 5,359円  
第13期末： 9,117円  
(既払分配金0円)  
騰落率： 70.1%  
(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およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

原油価格が上昇したことや、為替が円安米ドル高となったことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

## 投資環境

原油価格は上昇しました。バイデン新政権による追加経済対策への期待や米欧での新型コロナウイルスワクチン接種の進展、株価上昇などによりリスク選好の動きが高まったことなどが上昇要因となりました。

為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。FOMC（米連邦公開市場委員会）で早期にテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）が開始される可能性が示されたことや米国債の金利上昇により円安米ドル高が進行しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

コモディティインデックス・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持しました。

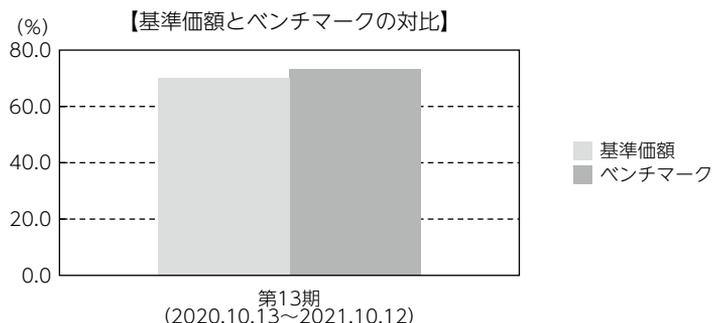
### ●コモディティインデックス・マザーファンド

S & P G S C I 商品指数に連動するユーロドル債（証券を含みます。）の高位組入れを維持しました。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で73.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを3.2%下回りました。この差異は、信託報酬や米国祝日によるユーロドル債とベンチマークの評価差などによるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、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10月13日 ～2021年10月12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	4,438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、コモディティインデックス・マザーファンドの組入比率を高位に維持し、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざします。

### ●コモディティインデックス・マザーファンド

引き続き、S & P G S C I 商品指数に連動するユーロドル債（証書を含みます。）の高位組入れを維持します。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第13期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	19円	0.275%	(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7,067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)	(16)	(0.220)	
(販売会社)	( 2)	(0.022)	
(受託会社)	( 2)	(0.033)	
(b) その他費用	1	0.017	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 1)	(0.013)	
(監査費用)	( 0)	(0.004)	
(その他)	( 0)	(0.000)	
合計	21	0.292	

(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。

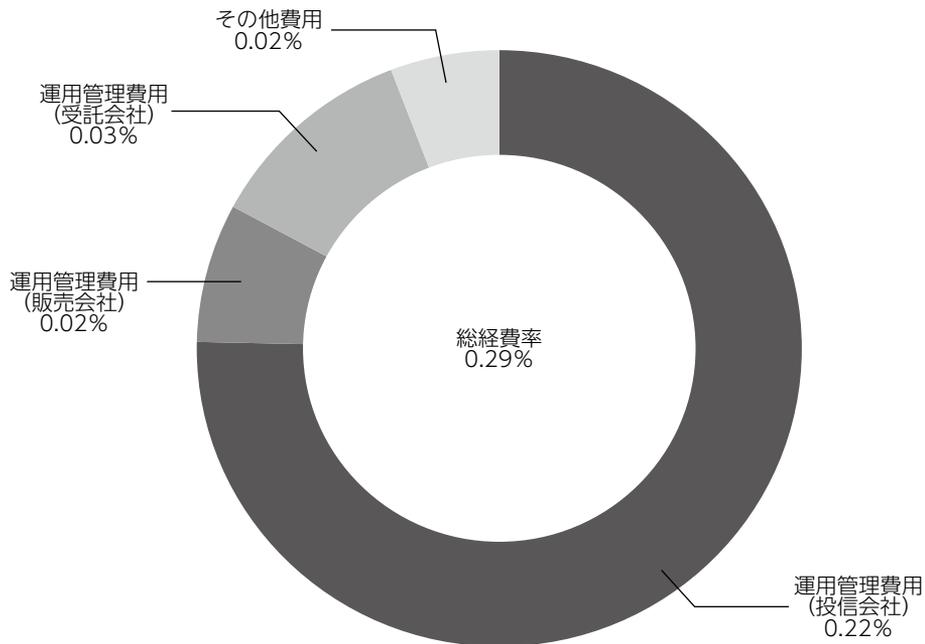
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

## (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0.29%です。



(注1) 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) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
コモディティインデックス・マザーファンド	千□ 1,403,260	千円 514,100	千□ 6,954,083	千円 2,581,394

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12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

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
コモディティインデックス・マザーファンド	千□ 14,721,853	千□ 9,171,030	千円 4,341,565

## ■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コモディティインデックス・マザーファンド	4,341,565	99.8
コール・ローン等、その他	9,172	0.2
投資信託財産総額	4,350,738	100.0

(注1) 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。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、コモディティインデックス・マザーファンドは4,397,846千円、99.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,350,738,208円
コール・ローン等	6,833,250
コモディティインデックス・マザーファンド(評価額)	4,341,565,958
未 収 入 金	2,339,000
(B) 負 債	8,915,420
未 払 解 約 金	3,338,705
未 払 信 託 報 酬	5,498,511
そ の 他 未 払 費 用	78,204
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,341,822,788
元 本	4,762,345,694
次 期 繰 越 損 益 金	△420,522,906
(D) 受 益 権 総 口 数	4,762,345,694口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	9,117円

(注) 期首における元本額は7,624,695,637円、当期中における追加設定元本額は942,883,986円、同解約元本額は3,805,233,929円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,447円
受 取 利 息	1,091
支 払 利 息	△5,538
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,679,774,330
売 買 益	2,231,323,429
売 買 損	△551,549,099
(C) 信 託 報 酬 等	△15,996,877
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,663,773,006
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△706,030,832
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,378,265,080
(配 当 等 相 当 額)	(1,153,767,269)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,532,032,349)
(G) 合 計(D+E+F)	△420,522,906
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△420,522,906
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,378,265,080
(配 当 等 相 当 額)	(1,156,188,657)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,534,453,737)
分 配 準 備 積 立 金	957,742,174

(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	146,584,874円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	667,046,895
(c) 収 益 調 整 金	1,156,188,657
(d) 分 配 準 備 積 立 金	144,110,405
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,113,930,831
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	4,438.84
(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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

## 《お知らせ》

■信託報酬率を年率0.25%（税込み0.275%）に引き下げる所要の約款変更を行いました。

(2021年1月13日)

# コモディティインデックス・マザーファンド

## 運用報告書

第14期（決算日 2021年1月20日）

（計算期間 2020年1月21日～2021年1月20日）

コモディティインデックス・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	2007年2月28日から無期限です。
運用方針	主としてS & P G S C I商品指数（以下「G S C I」ということがあります。）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	G S C Iに連動するユーロドル債（証券を含みます。）を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産の投資割合には、制限を設けません。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P G S C I商品指数		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	(円換算ベース) (ベンチマーク)	騰落率			
10期(2017年1月20日)	4,140	22.4	26,413.65	22.0	99.2	—	百万円 2,736
11期(2018年1月22日)	4,335	4.7	27,581.43	4.4	99.7	—	3,857
12期(2019年1月21日)	3,984	△8.1	24,954.09	△9.5	99.1	—	3,551
13期(2020年1月20日)	4,155	4.3	25,627.44	2.7	99.3	—	4,253
14期(2021年1月20日)	3,202	△22.9	19,768.83	△22.9	99.7	—	4,838

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) S & P G S C I商品指数（「当インデックス」）は、S & P Globalの一部門であるS & P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「S P D J I」）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。Standard & Poor's®およびS & P®は、S & P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがS P D J Iに付与されています。S & P®、S & P G S C I®およびS & P G S C I商品指数はS & Pの商標であり、これらを利用するライセンスがS P D J Iとその関連会社に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。S & P G S C I商品指数は、Goldman Sachs & Co.またはその関連会社によって所有、保証、または承認されたものではなく、これら会社とは一切関係がありません。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、S P D J I、Dow Jones、S & P、それぞれの関連会社、または第三者のライセンサーのいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

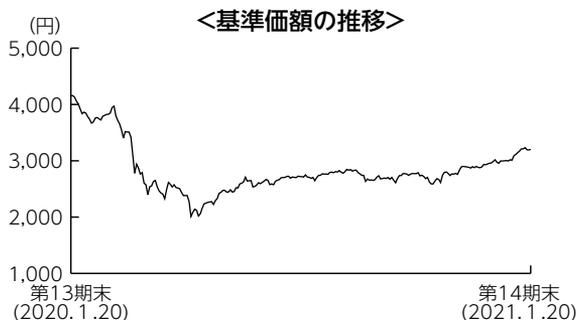
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P G S C I 商品指数		債券組入率 比	債券先物率 比
	円	騰 落 率	(円換算ベース) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 1 月 20 日	4,155	% -	ポイント 25,627.44	% -	% 99.3	% -
1 月 末	3,784	△8.9	23,291.51	△9.1	99.4	-
2 月 末	3,545	△14.7	21,768.15	△15.1	99.4	-
3 月 末	2,427	△41.6	14,826.16	△42.1	99.0	-
4 月 末	2,060	△50.4	12,630.38	△50.7	99.5	-
5 月 末	2,454	△40.9	15,069.26	△41.2	99.5	-
6 月 末	2,637	△36.5	16,217.26	△36.7	99.0	-
7 月 末	2,647	△36.3	16,290.03	△36.4	99.5	-
8 月 末	2,817	△32.2	17,347.48	△32.3	99.3	-
9 月 末	2,671	△35.7	16,450.78	△35.8	99.4	-
10 月 末	2,588	△37.7	15,940.33	△37.8	99.0	-
11 月 末	2,891	△30.4	17,830.36	△30.4	99.5	-
12 月 末	2,995	△27.9	18,484.84	△27.9	99.6	-
(期 末) 2021 年 1 月 20 日	3,202	△22.9	19,768.83	△22.9	99.7	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年1月21日から2021年1月20日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は3,202円となり、前期末比で22.9%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

原油価格が下落したことや、為替が円高米ドル安に推移したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

### 投資環境

原油価格は下落しました。期初から2020年3月にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気減速懸念などから、原油価格は下落基調で推移しました。4月には、主要産油国による会合で合意された減産量が不十分との見方や、在庫急増による貯蔵先不足などへの懸念が広がる中、一時急落する場面もありました。その後は、世界的な経済活動再開による景気回復期待やワクチン開発への期待などを背景に、期末にかけて下落幅は縮小しました。

為替市場では、米ドルは対円で下落しました。



2020年3月上旬、F R B（米連邦準備理事会）による緊急利下げや新型コロナウイルスの感染拡大などを受けて、米ドルは一時急落しました。3月中旬には世界的な米ドル資金需要の高まりなどから下落幅は縮小しましたが、その後も新型コロナウイルスや米中対立、米国の経済対策や金融政策などの動向を睨みながら、期末にかけて下落基調で推移しました。

### ポートフォリオについて

S & P G S C I 商品指数に連動するユーロドル債（証書を含みます。）の高位組入れを維持しました。

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で22.9%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークにほぼ連動した運用成果となりました。

### 今後の運用方針

引き続き、S & P G S C I 商品指数に連動するユーロドル債（証書を含みます。）の高位組入れを維持します。

## ■ 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	0円	0.014%
（保 管 費 用）	(0)	(0.014)
（そ の 他）	(0)	(0.000)
合 計	0	0.014

(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(2,833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6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 (2020年1月21日から2021年1月20日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	社 債 券	千アメリカ・ドル 11,611	千アメリカ・ドル 421

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2020年1月21日から2021年1月20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

##### 外国（外貨建）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		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 56,560	千アメリカ・ドル 46,401	千円 4,822,541	% 99.7	% 99.7	% -	% 99.7	% -
合 計	-	-	千円 4,822,541	99.7	99.7	-	99.7	-

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 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3) 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

##### 外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末						償還年月日
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ) STAR HELIOS PLC	社 債 券	% -	千アメリカ・ドル 56,560	千アメリカ・ドル 46,401	千円 4,822,541	2024/03/19	
合 計	-	-	56,560	46,401	4,822,541	-	

## ■投資信託財産の構成

2021年1月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 4,822,541	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	15,935	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	4,838,476	100.0

(注1) 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。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、4,826,843千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2021年1月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.93円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,838,476,918円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	15,935,350
公 社 債(評価額)	4,822,541,568
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,838,476,918
元 本	15,110,318,090
次 期 繰 越 損 益 金	△10,271,841,172
(D) 受 益 権 総 口 数	15,110,318,090口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,202円

(注1) 期首元本額 10,236,227,414円  
追加設定元本額 5,789,041,033円  
一部解約元本額 914,950,357円

(注2) 期末における元本の内訳  
D I A M コモディティパッシブ・ファンド 14,828,606,600円  
M I T O ラップ型ファンド(安定型) 10,195,174円  
M I T O ラップ型ファンド(中立型) 29,953,476円  
M I T O ラップ型ファンド(積極型) 29,851,246円  
グローバル8資産ラップファンド(安定型) 85,690,189円  
グローバル8資産ラップファンド(中立型) 82,792,696円  
グローバル8資産ラップファンド(積極型) 43,228,709円  
期末元本合計 15,110,318,090円

## ■損益の状況

当期 自2020年1月21日 至2021年1月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	132,435,217円
受 取 利 息	132,446,750
支 払 利 息	△11,533
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△736,036,026
売 買 益	270,796,216
売 買 損	△1,006,832,242
(C) そ の 他 費 用	△567,387
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△604,168,196
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△5,983,179,300
(F) 解 約 差 損 益 金	656,890,357
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△4,341,384,033
(H) 合 計(D+E+F+G)	△10,271,841,172
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△10,271,841,172

(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。