

運用報告書(全体版)

第9期<決算日2024年5月8日>

D I A M新興国債券インデックスファンド <為替ヘッジなし> (ファンドラップ)

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／債券（インデックス型）	
信託期間	2015年10月13日から無期限です。	
運用方針	J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	エマージング債券パッシブ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国の公社債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。 実質組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが実質的に保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。	
組入制限	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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5月8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、「D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）」は、2024年5月8日に第9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

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

D I AM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)

■最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			J Pモルガン・エマージング・マーケット・ ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	期 騰 落 中 率			
5 期 (2020年 5 月 8 日)	円 10,470	円 0	% 0.1	ポイント 87,984.87	% △4.5	% 105.4	% －	百万円 274
6 期 (2021年 5 月10日)	11,566	0	10.5	99,070.46	12.6	98.6	－	415
7 期 (2022年 5 月 9 日)	10,674	0	△7.7	91,394.40	△7.7	87.3	－	294
8 期 (2023年 5 月 8 日)	11,150	0	4.5	94,935.67	3.9	98.0	－	199
9 期 (2024年 5 月 8 日)	13,025	0	16.8	119,726.93	26.1	98.4	－	135

- (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 J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) 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) J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス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 (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)。

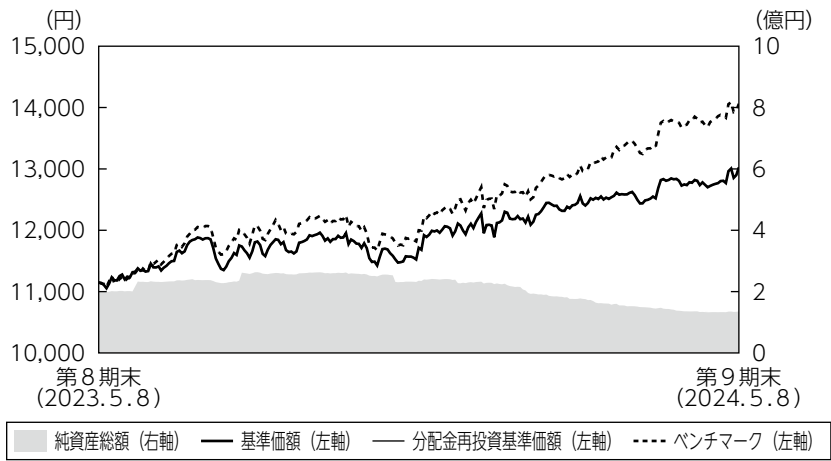
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		JPMorgan・エマージング・マーケット・ ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 率	債券先物 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2023 年 5 月 8 日	円 11,150	% －	ポイント 94,935.67	% －	% 98.0	% －
5 月 末	11,351	1.8	96,860.26	2.0	97.8	－
6 月 末	11,872	6.5	102,541.84	8.0	95.9	－
7 月 末	11,655	4.5	101,562.43	7.0	97.4	－
8 月 末	11,917	6.9	103,973.59	9.5	97.6	－
9 月 末	11,711	5.0	102,072.50	7.5	86.8	－
10 月 末	11,523	3.3	100,626.42	6.0	97.6	－
11 月 末	12,048	8.1	105,978.47	11.6	97.6	－
12 月 末	12,190	9.3	107,454.17	13.2	96.0	－
2024 年 1 月 末	12,406	11.3	109,899.73	15.8	97.6	－
2 月 末	12,587	12.9	113,752.19	19.8	97.7	－
3 月 末	12,830	15.1	117,275.84	23.5	97.8	－
4 月 末	12,962	16.3	119,675.62	26.1	97.4	－
(期 末) 2024 年 5 月 8 日	13,025	16.8	119,726.93	26.1	98.4	－

(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（2023年5月9日から2024年5月8日まで）

基準価額等の推移



第9期首： 11,150円
第9期末： 13,025円
(既払分配金0円)
騰落率： 16.8%
(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

スプレッドの縮小や円安米ドル高となったことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

新興国債券市場は上昇しました。米国でのインフレの高止まりなどに伴い米長期金利が上昇したものの、堅調な米経済指標などを受けて軟着陸期待が高まり、リスク選好度が改善したことなどから対米国債スプレッドは縮小しました。

為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。米経済指標が堅調な中、インフレ抑制に向けF R B（米連邦準備理事会）の金融引き締めが長期化するとの見方などが強まった一方、日銀がマイナス金利を解除したものの緩和的な金融環境を維持したことで日米における金融政策の違いが意識され、米ドルは対円で上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

エマージング債券パッシブ・マザーファンドを期を通じて高位に組入れました。

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

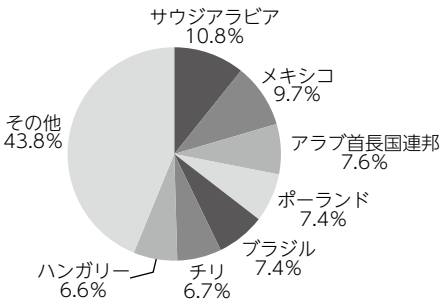
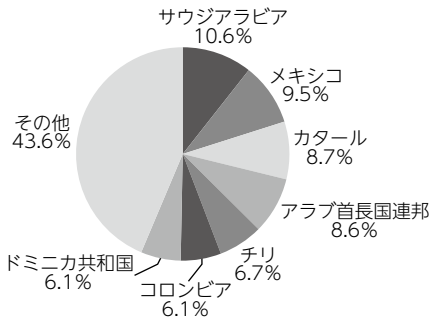
ベンチマークであるJ P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

【エマージング債券パッシブ・マザーファンドの運用状況】 2024年5月8日現在

○国別配分

期首（前期末）

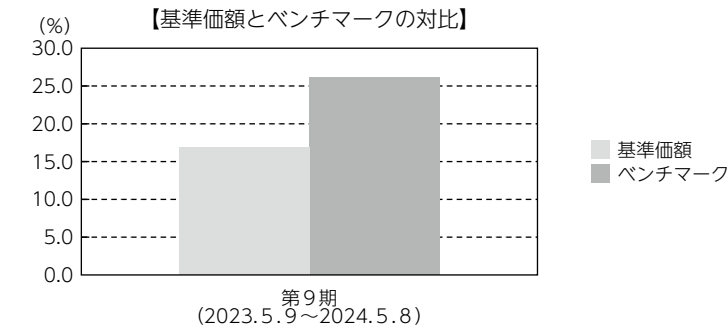
期末



(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) 発行国（地域）を表示しています。また、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。

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26.1%上昇しました。
当ファンドはベンチマークを9.3%下回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。



(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
	2023年5月9日 ～2024年5月8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	3,816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、エマージング債券パッシブ・マザーファンドを高位に組入れます。

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	(2023年5月9日 ～2024年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	26円	0.214%	(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12,014円です。
（投信会社）	(19)	(0.159)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
（販売会社）	(1)	(0.011)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
（受託会社）	(5)	(0.044)	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	2	0.016	(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）	(1)	(0.012)	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）	(0)	(0.003)	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)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	28	0.230	

(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。

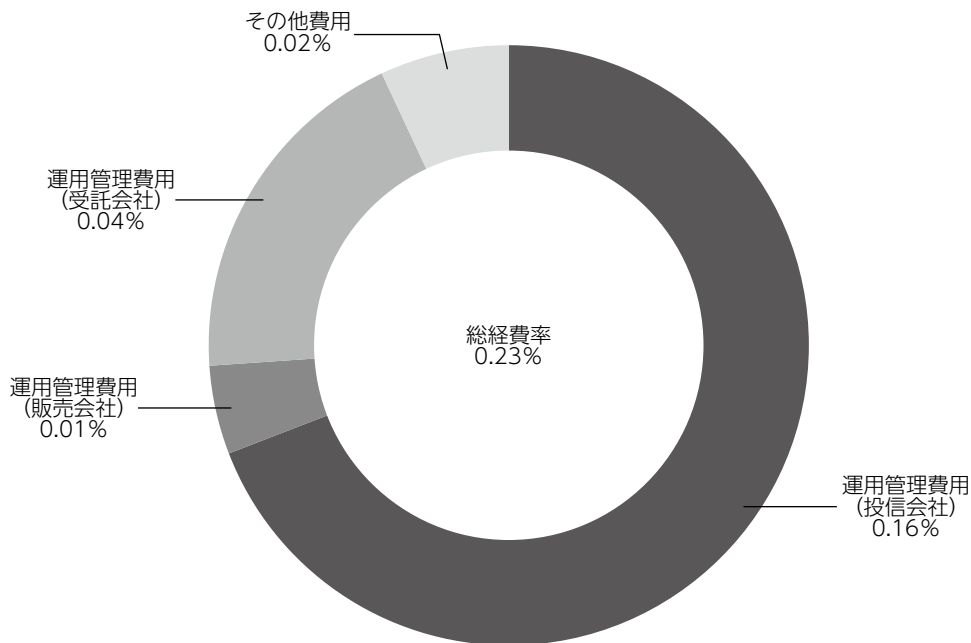
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.23%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（2023年5月9日から2024年5月8日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
エマージェンシング債券 パッシブ・マザーファンド	千口 30,589	千円 65,215	千口 71,567	千円 160,544

■利害関係人との取引状況等（2023年5月9日から2024年5月8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
エマージェンシング債券パッシブ・マザーファンド	千口 97,262	千口 56,284	千円 135,313

■投資信託財産の構成

2024年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	135,313	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	231	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	135,544	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、2024年5月8日現在、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは120,232,979千円、98.0%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、2024年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.95円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	135,544,911円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	231,819
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	135,313,092
(B) 負 債	194,095
未 払 信 託 報 酬	190,955
そ の 他 未 払 費 用	3,140
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	135,350,816
元 本	103,920,143
次 期 繰 越 損 益 金	31,430,673
(D) 受 益 権 総 口 数	103,920,143口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C／D)	13,025円

(注) 期首における元本額は179,174,406円、当期中における追加設定元本額は58,109,481円、同解約元本額は133,363,744円です。

■損益の状況

当期 自2023年5月9日 至2024年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△38円
受 取 利 息	79
支 払 利 息	△117
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	18,733,332
売 買 益	27,528,848
売 買 損	△8,795,516
(C) 信 託 報 酬 等	△458,789
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	18,274,505
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,494,262
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,661,906
(配 当 等 相 当 額)	(19,715,946)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,054,040)
(G) 合 計(D＋E＋F)	31,430,673
次 期 繰 越 損 益 金(G)	31,430,673
追 加 信 託 差 損 益 金	11,661,906
(配 当 等 相 当 額)	(19,891,231)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△8,229,325)
分 配 準 備 積 立 金	19,768,767

(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	5,928,070円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	865,298
(c) 収 益 調 整 金	19,891,231
(d) 分 配 準 備 積 立 金	12,975,399
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	39,659,998
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	3,816.39
(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した。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2024年4月18日）

（計算期間 2023年4月19日～2024年4月18日）

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第16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	2008年3月6日から無期限です。
運 用 方 針	主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主 要 投 資 対 象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 率 比	純 資 産 総 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
12期 (2020年4月20日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
12期 (2020年4月20日)	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	－	78,076
13期 (2021年4月19日)	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4	－	152,776
14期 (2022年4月18日)	19,947	△5.4	93,033.64	△5.3	97.6	－	137,292
15期 (2023年4月18日)	20,300	1.8	93,922.40	1.0	96.8	－	136,262
16期 (2024年4月18日)	23,481	15.7	117,190.62	24.8	98.2	－	112,310

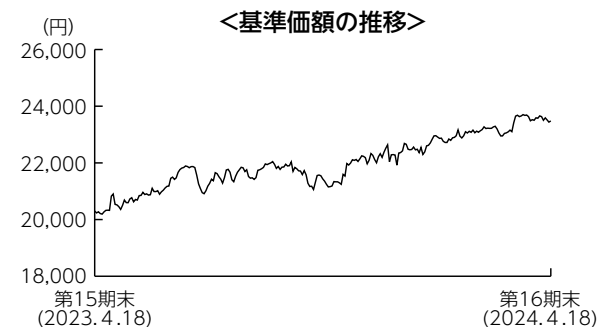
(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
(注2) ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はＪ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します（以下同じ）。
(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ＪＰモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2023 年 4 月 18 日	円 20,300	% －	ポイント 93,922.40	% －	% 96.8	% －
4 月 末	20,326	0.1	93,661.07	△0.3	98.6	－
5 月 末	20,908	3.0	96,860.26	3.1	97.9	－
6 月 末	21,872	7.7	102,541.84	9.2	95.9	－
7 月 末	21,475	5.8	101,562.43	8.1	97.5	－
8 月 末	21,963	8.2	103,973.59	10.7	97.6	－
9 月 末	21,586	6.3	102,072.50	8.7	86.8	－
10 月 末	21,245	4.7	100,626.42	7.1	97.7	－
11 月 末	22,216	9.4	105,978.47	12.8	97.7	－
12 月 末	22,482	10.7	107,454.17	14.4	96.0	－
2024 年 1 月 末	22,885	12.7	109,899.73	17.0	97.7	－
2 月 末	23,224	14.4	113,752.19	21.1	97.7	－
3 月 末	23,677	16.6	117,275.84	24.9	97.8	－
(期 末) 2024 年 4 月 18 日	23,481	15.7	117,190.62	24.8	98.2	－

(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（2023年4月19日から2024年4月18日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は23,481円となり、前期末比で15.7%上昇しました。

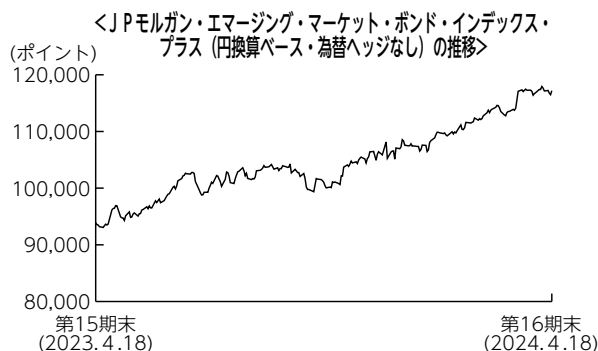
基準価額の主な変動要因

対米国債スプレッド（利回り格差）の縮小や米ドルが対円で上昇したことなどを主因に、基準価額は上昇しました。

投資環境

新興国債券市場は上昇しました。期初から2023年10月末は米金融引き締めの長期化観測などから米長期国債が下落し、それに連れて新興国債券も下落したものの、12月末にかけて米経済指標の下振れなどから早期の利下げ観測が強まり、米長期国債の上昇に連れて大きく上昇し、その後は横ばいで推移しました。対米国債スプレッドは縮小しました。米景気の軟着陸期待の高まりなどからリスク選考の改善などに伴い縮小しました。

為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。



期初から2023年10月にかけては、米国が利上げを続ける一方で日銀は緩和を続けたことにより、日米金融政策の違いが意識され、大幅に円安が進みました。その後は米国の早期利下げ観測が強まったことなどに伴い円高となる局面があったものの、日銀が2024年3月の金融政策決定会合にてマイナス金利を解除しつつも緩和的な金融環境を維持する方針を示したことで再び円安基調となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

【運用状況】

○国別構成比

期首（前期末）

国	ファンド	ベンチマーク	差
中南米			
アルゼンチン	－	3.5%	△3.5%
ブラジル	5.1%	4.2%	0.8%
チリ	6.4%	5.5%	0.9%
メキシコ	9.2%	7.9%	1.3%
パナマ	5.7%	4.8%	0.9%
ペルー	3.8%	2.9%	0.9%
ベネズエラ	－	0.0%	△0.0%
エクアドル	－	2.2%	△2.2%
コロンビア	5.9%	5.0%	0.9%
ドミニカ共和国	5.8%	4.9%	1.0%
ウルグアイ	2.6%	1.8%	0.7%
計	44.5%	42.8%	1.6%
欧州			
ハンガリー	4.6%	3.2%	1.4%
トルコ	－	10.0%	△10.0%
ウクライナ	－	0.4%	△0.4%
ルーマニア	2.9%	1.2%	1.7%
計	7.4%	14.8%	△7.4%
アジア・オセアニア			
中国	0.6%	3.4%	△2.8%
インドネシア	4.4%	3.0%	1.4%
フィリピン	2.9%	1.6%	1.2%
スリランカ	－	0.4%	△0.4%
計	7.9%	8.4%	△0.6%
中近東			
カタール	9.7%	8.5%	1.2%
アラブ首長国連邦	8.7%	7.3%	1.4%
サウジアラビア	11.4%	10.1%	1.3%
オマーン	3.3%	2.8%	0.5%
計	33.1%	28.6%	4.5%
アフリカ			
南アフリカ	3.9%	2.1%	1.9%
エジプト	－	2.8%	△2.8%
ナイジェリア	－	0.4%	△0.4%
計	3.9%	5.3%	△1.4%
現金など	3.2%	－	－
合計	100.0%	100.0%	－

期末

国	ファンド	ベンチマーク	差
中南米			
アルゼンチン	－	5.9%	△5.9%
ブラジル	7.3%	5.8%	1.6%
チリ	6.7%	5.2%	1.4%
メキシコ	9.8%	7.6%	2.2%
パナマ	4.5%	3.5%	1.0%
ペルー	3.3%	2.6%	0.7%
ベネズエラ	－	0.0%	△0.0%
エクアドル	－	3.0%	△3.0%
コロンビア	4.5%	3.6%	1.0%
ドミニカ共和国	6.3%	4.9%	1.4%
ウルグアイ	1.1%	0.9%	0.2%
計	43.6%	42.9%	0.7%
欧州			
ポーランド	7.0%	5.8%	1.2%
ハンガリー	7.0%	4.1%	2.9%
トルコ	－	9.6%	△9.6%
ウクライナ	－	0.7%	△0.7%
ルーマニア	5.8%	3.2%	2.6%
計	19.8%	23.4%	△3.6%
アジア・オセアニア			
中国	1.2%	3.3%	△2.1%
インドネシア	3.7%	2.7%	0.9%
フィリピン	1.2%	0.9%	0.2%
スリランカ	－	0.6%	△0.6%
計	6.1%	7.6%	△1.5%
中近東			
カタール	3.8%	3.3%	0.5%
アラブ首長国連邦	7.1%	6.2%	0.9%
サウジアラビア	10.8%	9.6%	1.2%
オマーン	2.3%	2.1%	0.3%
計	24.0%	21.1%	2.9%
アフリカ			
南アフリカ	4.8%	2.0%	2.8%
エジプト	－	2.5%	△2.5%
ナイジェリア	－	0.5%	△0.5%
計	4.8%	5.0%	△0.2%
現金など	1.8%	－	－
合計	100.0%	100.0%	－

（注１）ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

（注２）ベンチマークは、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスです。

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24.8%上昇しました。
当ファンドはベンチマークを9.1%下回りました。運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.012%	(a) 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)	(0.012)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	3	0.012	
期中の平均基準価額は22,003円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注2) 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。

■ 売買及び取引の状況 (2023年 4 月 19 日から 2024 年 4 月 18 日まで)

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 770,013	千アメリカ・ドル 991,781 (1,380)

(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 (2023年 4 月 19 日から 2024 年 4 月 18 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 829,100	千アメリカ・ドル 714,199	千円 110,315,301	% 98.2	% 20.7	% 81.2	% 13.0	% 4.0
合 計	—	—	110,315,301	98.2	20.7	81.2	13.0	4.0

(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。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	国 債 証 券	3.1000	3,000	1,788	276,254	2061/01/22
PANAMA 4.5 01/19/63	国 債 証 券	4.5000	8,000	5,002	772,664	2063/01/19
PANAMA 7.125 01/29/26	国 債 証 券	7.1250	1,000	1,012	156,361	2026/01/29
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	国 債 証 券	3.7500	5,400	3,656	564,768	2055/01/21
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	国 債 証 券	5.8750	6,000	4,851	749,390	2060/01/30
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	国 債 証 券	5.0000	4,000	3,388	523,379	2053/01/18
INDONESIA 7.75 01/17/38	国 債 証 券	7.7500	500	600	92,769	2038/01/17
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	国 債 証 券	5.3000	3,000	2,435	376,183	2041/01/21
INDONESIA 4.125 01/15/25	国 債 証 券	4.1250	2,200	2,181	336,976	2025/01/15
INDONESIA 4.35 01/08/27	国 債 証 券	4.3500	1,600	1,564	241,604	2027/01/08
INDONESIA 4.75 01/08/26	国 債 証 券	4.7500	1,000	991	153,222	2026/01/08
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	国 債 証 券	5.2500	3,000	2,687	415,118	2050/01/16
PERU 3.0 01/15/34	国 債 証 券	3.0000	9,000	7,109	1,098,158	2034/01/15
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	国 債 証 券	3.5000	4,000	2,785	430,245	2050/01/25
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	国 債 証 券	3.5000	10,200	8,704	1,344,573	2034/01/31
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	国 債 証 券	5.7500	1,000	941	145,476	2054/01/16
PANAMA 3.16 01/23/30	国 債 証 券	3.1600	8,000	6,592	1,018,267	2030/01/23
BRAZIL 4.75 01/14/50	国 債 証 券	4.7500	7,000	4,964	766,892	2050/01/14
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	国 債 証 券	2.5500	8,200	6,769	1,045,598	2032/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国 債 証 券	4.5000	6,000	4,512	697,074	2050/01/31
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国 債 証 券	2.4500	1,200	1,005	155,328	2031/01/31
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	国 債 証 券	5.6250	5,000	4,939	762,894	2028/01/17
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	国 債 証 券	4.3750	5,000	4,821	744,662	2031/01/23
ROMANIA 7.125 01/17/33	国 債 証 券	7.1250	16,000	16,589	2,562,397	2033/01/17
ROMANIA 6.375 01/30/34	国 債 証 券	6.3750	2,000	1,963	303,204	2034/01/30
PERU 2.783 01/23/31	国 債 証 券	2.7830	9,000	7,522	1,161,962	2031/01/23
COLOMBIA 3.0 01/30/30	国 債 証 券	3.0000	8,000	6,451	996,565	2030/01/30

銘 柄	当			期		末
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	国 債 証 券	6.2500	5,000	5,058	781,316	2031/01/25
PERU 2.392 01/23/26	国 債 証 券	2.3920	2,000	1,892	292,378	2026/01/23
DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30	国 債 証 券	4.5000	9,000	7,996	1,235,186	2030/01/30
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	国 債 証 券	2.7500	6,200	5,769	891,156	2027/01/31
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28	国 債 証 券	4.7500	8,000	7,865	1,214,925	2028/01/18
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	国 債 証 券	4.8500	3,000	2,939	454,061	2029/01/22
ROMANIA 5.875 01/30/29	国 債 証 券	5.8750	6,000	5,897	910,866	2029/01/30
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	国 債 証 券	3.4500	2,000	1,236	191,054	2061/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	国 債 証 券	4.4000	3,000	2,179	336,645	2052/02/12
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	国 債 証 券	3.5000	9,000	7,257	1,120,941	2034/02/12
ROMANIA 4.0 02/14/51	国 債 証 券	4.0000	9,000	6,052	934,869	2051/02/14
COLOMBIA 7.5 02/02/34	国 債 証 券	7.5000	8,000	7,900	1,220,298	2034/02/02
PANAMA 6.4 02/14/35	国 債 証 券	6.4000	8,000	7,456	1,151,748	2035/02/14
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	国 債 証 券	6.3500	7,000	7,007	1,082,357	2035/02/09
ROMANIA 3.0 02/14/31	国 債 証 券	3.0000	3,000	2,467	381,139	2031/02/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	国 債 証 券	2.2500	12,000	9,355	1,445,069	2033/02/02
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国 債 証 券	6.0000	5,200	4,871	752,524	2033/02/22
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国 債 証 券	5.5000	12,000	11,396	1,760,315	2029/02/22
ROMANIA 6.625 02/17/28	国 債 証 券	6.6250	9,000	9,149	1,413,267	2028/02/17
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	国 債 証 券	5.5000	9,000	8,625	1,332,268	2054/03/18
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国 債 証 券	4.8170	8,000	7,070	1,092,121	2049/03/14
HUNGARY 5.5 03/26/36	国 債 証 券	5.5000	3,000	2,819	435,522	2036/03/26
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	国 債 証 券	4.3400	7,000	5,887	909,429	2042/03/07
PERU 3.55 03/10/51	国 債 証 券	3.5500	8,000	5,441	840,571	2051/03/10
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国 債 証 券	4.0000	8,000	7,674	1,185,464	2029/03/14
INDONESIA 3.05 03/12/51	国 債 証 券	3.0500	4,000	2,650	409,322	2051/03/12
INDONESIA 1.85 03/12/31	国 債 証 券	1.8500	3,200	2,547	393,540	2031/03/12
BRAZIL 6.125 03/15/34	国 債 証 券	6.1250	3,000	2,854	440,920	2034/03/15
ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	国 債 証 券	1.7000	7,000	5,654	873,436	2031/03/02
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	国 債 証 券	4.6250	6,000	5,877	907,770	2029/03/18
PANAMA 4.5 04/01/56	国 債 証 券	4.5000	9,000	5,706	881,456	2056/04/01
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	国 債 証 券	3.7500	4,000	2,390	369,248	2071/04/19
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	国 債 証 券	4.5000	4,000	3,095	478,053	2060/04/22
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	国 債 証 券	3.5000	5,000	3,455	533,813	2053/04/15
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	国 債 証 券	5.0000	7,000	5,628	869,360	2051/04/27
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	国 債 証 券	7.3000	10,000	8,437	1,303,256	2052/04/20
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国 債 証 券	4.5000	5,000	4,742	732,603	2029/04/22
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	国 債 証 券	5.5000	8,000	7,662	1,183,565	2053/04/04
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	国 債 証 券	4.7500	5,000	4,608	711,770	2032/04/27
COLOMBIA 3.25 04/22/32	国 債 証 券	3.2500	7,000	5,295	817,999	2032/04/22
COLOMBIA 8.0 04/20/33	国 債 証 券	8.0000	7,000	7,166	1,106,977	2033/04/20
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国 債 証 券	4.8750	1,400	1,354	209,158	2026/04/14
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国 債 証 券	4.3750	11,000	10,582	1,634,607	2029/04/16
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	国 債 証 券	4.5000	4,000	3,824	590,709	2030/04/17

銘 柄	当			期		末
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	国債証券	3.2500	6,000	5,223	806,817	2030/04/16
COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	3.1250	8,000	6,220	960,820	2031/04/15
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	国債証券	4.4000	6,000	4,956	765,596	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	国債証券	3.8750	5,000	3,788	585,114	2050/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	国債証券	3.1250	6,000	5,399	834,080	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	国債証券	3.7500	2,000	1,876	289,829	2030/04/16
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	国債証券	3.4000	6,000	5,878	907,946	2025/04/16
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	国債証券	2.5000	6,000	5,822	899,293	2025/04/16
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	国債証券	3.7710	4,000	2,450	378,437	2061/05/24
UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	国債証券	6.4000	2,000	1,901	293,685	2054/05/07
UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	国債証券	6.3380	5,000	4,705	726,795	2053/05/04
BRAZIL 7.125 05/13/54	国債証券	7.1250	3,000	2,863	442,248	2054/05/13
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	国債証券	3.1000	9,000	6,405	989,445	2041/05/07
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	国債証券	2.6590	8,000	6,506	1,005,016	2031/05/24
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	国債証券	4.8750	6,000	5,514	851,750	2033/05/19
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	8,000	7,432	1,147,995	2029/05/30
HUNGARY 6.125 05/22/28	国債証券	6.1250	8,000	8,109	1,252,665	2028/05/22
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	2,000	1,835	283,434	2030/06/22
DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49	国債証券	6.4000	9,000	8,083	1,248,524	2049/06/05
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	9,000	7,892	1,219,078	2030/06/12
ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	国債証券	1.6250	5,000	4,344	671,051	2028/06/02
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	4,000	3,864	596,965	2025/06/06
HUNGARY 5.25 06/16/29	国債証券	5.2500	13,000	12,668	1,956,776	2029/06/16
PANAMA 3.87 07/23/60	国債証券	3.8700	4,000	2,244	346,614	2060/07/23
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	国債証券	2.5500	4,000	3,173	490,203	2033/07/27
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	国債証券	3.2000	7,000	4,762	735,583	2046/07/06
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	国債証券	4.8750	9,000	8,625	1,332,347	2033/07/18
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	国債証券	4.0500	5,000	4,682	723,243	2032/07/07
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	国債証券	4.2800	9,000	6,936	1,071,341	2041/08/14
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	国債証券	6.0000	7,000	7,032	1,086,280	2029/08/01
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	国債証券	2.7000	4,000	2,180	336,867	2070/09/02
HUNGARY 3.125 09/21/51	国債証券	3.1250	7,000	4,199	648,604	2051/09/21
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	200	182	28,153	2029/09/18
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32	国債証券	4.8750	7,000	6,089	940,602	2032/09/23
PANAMA 2.252 09/29/32	国債証券	2.2520	7,000	4,904	757,509	2032/09/29
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	国債証券	5.1250	9,000	8,725	1,347,768	2034/09/18
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	国債証券	3.1250	4,000	2,645	408,546	2049/09/30
UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33	国債証券	4.9170	4,000	3,974	613,901	2033/09/25
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	15,000	10,592	1,636,132	2049/09/30
HUNGARY 6.25 09/22/32	国債証券	6.2500	13,000	13,137	2,029,264	2032/09/22
BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	3.7500	14,000	11,846	1,829,761	2031/09/12
HUNGARY 2.125 09/22/31	国債証券	2.1250	13,000	10,064	1,554,574	2031/09/22
ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	国債証券	1.8750	7,000	5,650	872,847	2031/09/15
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	国債証券	2.5000	5,000	4,406	680,669	2029/09/30

銘 柄	当			期		末
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国 債 証 券	4.8500	14,000	12,454	1,923,747	2029/09/30
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	国 債 証 券	3.2500	5,000	3,234	499,571	2061/10/19
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	国 債 証 券	5.7500	3,000	3,079	475,685	2034/10/28
INDONESIA 4.2 10/15/50	国 債 証 券	4.2000	8,000	6,357	982,051	2050/10/15
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	国 債 証 券	5.5000	11,000	11,051	1,707,086	2032/10/25
REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	国 債 証 券	4.8750	9,000	8,638	1,334,273	2033/10/04
BRAZIL 6.0 10/20/33	国 債 証 券	6.0000	12,000	11,452	1,768,987	2033/10/20
INDONESIA 3.85 10/15/30	国 債 証 券	3.8500	10,400	9,564	1,477,398	2030/10/15
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	国 債 証 券	1.2000	4,000	3,255	502,832	2030/10/21
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	国 債 証 券	3.2500	9,200	8,151	1,259,055	2030/10/22
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	国 債 証 券	2.9000	4,000	3,853	595,221	2025/10/22
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,658	565,076	2026/10/26
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	国 債 証 券	5.7500	6,000	6,121	945,526	2032/11/16
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	国 債 証 券	5.5000	5,000	5,050	780,158	2027/11/16
PERU 2.78 12/01/60	国 債 証 券	2.7800	4,000	2,130	329,128	2060/12/01
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	国 債 証 券	2.6500	6,000	3,741	577,867	2045/12/10
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	国 債 証 券	1.9500	2,000	1,957	302,375	2024/12/03
合 計	—	—	829,100	714,199	110,315,301	—

■投資信託財産の構成

2024年 4月18日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額		比 率	
	千円		%	
公 社 債	110,315,301		97.7	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,647,402		2.3	
投 資 信 託 財 産 総 額	112,962,704		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、112,350,092千円、99.5％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、2024年 4月18日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝154.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月18日)現在

項	目	当 期 末
(A)	資 産 等	113,312,304,596円
	コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,374,323,241
	公 社 債(評価額)	110,315,301,340
	未 収 入 金	350,000,000
	未 収 利 息	1,056,809,359
	前 払 費 用	215,870,656
(B)	負 債	1,002,018,226
	未 払 金	573,079,226
	未 払 解 約 金	428,939,000
(C)	純 資 産 総 額(A－B)	112,310,286,370
	元 本	47,831,274,931
	次 期 繰 越 損 益 金	64,479,011,439
(D)	受 益 権 総 口 数	47,831,274,931口
	1 万口当たり基準価額(C／D)	23,481円

- (注1) 期首元本額 67,123,867,342円
追加設定元本額 43,526,714,562円
一部解約元本額 62,819,306,973円
- (注2) 期末における元本の内訳
- | | |
|--|-----------------|
| DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし> | 56,545,881円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 3,402,228,783円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 185,898,554円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 611,432,709円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 288,880,377円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 488,065円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 5,013,325円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 66,432,394円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 7,270,485円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 8,800,979円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 62,340,964円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10) | 271,810,079円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20) | 409,557,576円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30) | 829,027,400円 |
| 投資のソムリエ | 12,760,704,368円 |
| グルーズコントロール | 175,172,226円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 1,299,821,204円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 377,434,623円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 1,188,460,901円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 3,769,475,205円 |
| ワールドアセットバランス (基本コース) | 332,991,505円 |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 755,680,455円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) | 79,148,286円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) | 40,307,356円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 10,742,825円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) | 261,787,480円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 641,380,664円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 222,835,935円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) | 96,645,355円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) | 43,884,243円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) | 27,134,290円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) | 6,707,467円 |
| Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け> | 2,067,283円 |
| Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け> | 19,919,297円 |
| エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定) | 15,421,084,811円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 194,553,833円 |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 726,463,768円 |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド2 (適格機関投資家限定) | 451,003,739円 |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 7,063,327円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 93,025,067円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 63,720,320円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 2,556,331,527円 |
| 期末元本合計 | 47,831,274,931円 |

■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

項	目	当 期
(A)	配 当 等 収 益	5,614,232,019円
	受 取 利 息	5,613,461,401
	の 他 収 益 金	1,112,433
	支 払 利 息	△341,815
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益	10,007,181,950
	買 益	18,663,475,866
	買 損	△8,656,293,916
(C)	そ の 他 費 用	△13,081,454
(D)	当 期 損 益 金(A+B+C)	15,608,332,515
(E)	前 期 繰 越 損 益 金	69,138,728,177
(F)	解 約 差 損 益 金	△72,993,928,691
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金	52,725,879,438
(H)	計(D+E+F+G)	64,479,011,439
	次 期 繰 越 損 益 金(H)	64,479,011,439

- (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。