

運用報告書 (全体版)

第15期<決算日2020年6月5日>

DIAM高格付インカム・オープン<DC年金>

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	
信託期間	2005年11月11日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。	
主要投資対象	DIAM高格付インカム・オープン<DC年金> DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド	DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券への投資を通じて、高格付資源国の公社債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。 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	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使等により取得するものに限り、実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。	
分配方針	決算日（原則として6月5日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子、配当収入および売買益（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ことがあります。	

愛称：ハッピークローバー<DC年金>

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高格付インカム・オープン<DC年金>」は、2020年6月5日に第15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 AM高格付インカム・オープン<DC年金>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入率	債券先物率	純資産額
	税分	込配	み金			
11期 (2016年6月6日)	円		円	%	%	百万円
	13,886		0	△13.6	98.0	2,352
12期 (2017年6月5日)	14,264		0	2.7	97.9	2,489
13期 (2018年6月5日)	14,490		0	1.6	97.0	2,552
14期 (2019年6月5日)	14,368		0	△0.8	96.4	2,541
15期 (2020年6月5日)	14,948		0	4.0	98.4	2,569

(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) 当ファンドは高格付資源国の公社債を投資対象としており、コンセプトに合った指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

(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			債券組入比率	債券先物比率
	騰	落	率		
(期首)				%	%
2019年6月5日	円		円	%	%
	14,368		0	96.4	—
6月末	14,595		1.6	96.4	—
7月末	14,559		1.3	96.5	—
8月末	14,250		△0.8	97.0	—
9月末	14,394		0.2	96.7	—
10月末	14,567		1.4	98.3	—
11月末	14,580		1.5	98.7	—
12月末	14,760		2.7	98.8	—
2020年1月末	14,615		1.7	98.3	—
2月末	14,519		1.1	98.4	—
3月末	13,514		△5.9	98.2	—
4月末	13,985		△2.7	98.6	—
5月末	14,365		△0.0	98.4	—
(期末)					
2020年6月5日	14,948		4.0	98.4	—

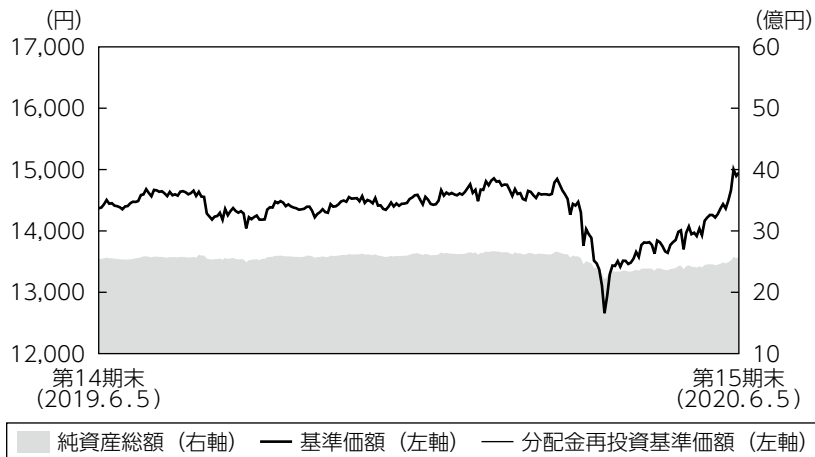
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2019年6月6日から2020年6月5日まで）

基準価額等の推移



第15期首： 14,368円
第15期末： 14,948円
(既払分配金0円)
騰落率： 4.0%
(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

米中の通商面等での対立や新型コロナウイルスの感染拡大により世界経済の減速懸念が強まったことを背景に、各国の中央銀行が緩和的な金融政策を強化したことから、投資対象国の国債利回りは低下（価格は上昇）しました。為替市場においては、新型コロナウイルスの感染動向や資源価格が乱高下したこと等を背景に、当ファンドの投資対象国の通貨は対円でまちまちな動きとなりました。こうした中、基準価額は投資対象国の国債利回り低下を主因に前期末比で上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、投資対象国の国債利回りが低下しました。2019年は米中通商対立の激化から世界経済の先行き不透明感が強まり、F R B（米連邦準備理事会）が利下げに転じるなど主要国の中央銀行が緩和的な金融政策を強化したことが利回り低下要因となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの罹患者数の大幅増加を背景に世界の経済活動が制限され、主要国の中央銀行が過去にない規模の金融緩和策を実施したことで利回りが一段と低下しました。

為替市場では、オーストラリアドルとカナダドルが対円で小幅に上昇したものの、他の投資対象国の通貨は対円で下落しました。新型コロナウイルスの感染拡大や、O P E C（石油輸出国機構）による協調減産の枠組みが崩壊したこと等から原油等の資源価格が急落したことなどを背景に、2020年3月上旬にかけて投資対象国の通貨の下落が進みました。しかしその後は、新型コロナウイルス感染拡大ペースが主要先進国で鈍化したこと等を背景に、投資対象国の通貨は買い戻される動きとなりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドを高位に組み入れました。

●D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率を概ね維持しました。基本国別投資比率は、カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%となっています。デュレーション*については、世界経済の減速と国債利回りの低位推移を見込み、期末は期初と比較して長期化しました。

*金利変動に対する債券価格の変動性。

※運用状況については13ページをご参照ください。

※各国の為替・金利動向については14ページをご参照ください。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準、市場動向等を勘案し、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
	2019年6月6日 ～2020年6月5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	8,902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、D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドを高位に組入れることで、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

●D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。新型コロナウイルスの感染収束後に世界経済が急速に回復するのは難しいと見ており、利回り上昇（価格は下落）はあっても一時的と予想します。こうした認識の下、デフレーションは長期化を基本に利回り上昇が進んだ局面ではさらに長期化することで期待収益率の向上をめざします。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第15期		項目の概要
	(2019年6月6日 ～2020年6月5日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	157円	1.093%	(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14,335円です。 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)	(78)	(0.547)	
(販売会社)	(71)	(0.492)	
(受託会社)	(8)	(0.055)	
(b) その他費用	2	0.013	(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)	(0.009)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	159	1.106	

(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。

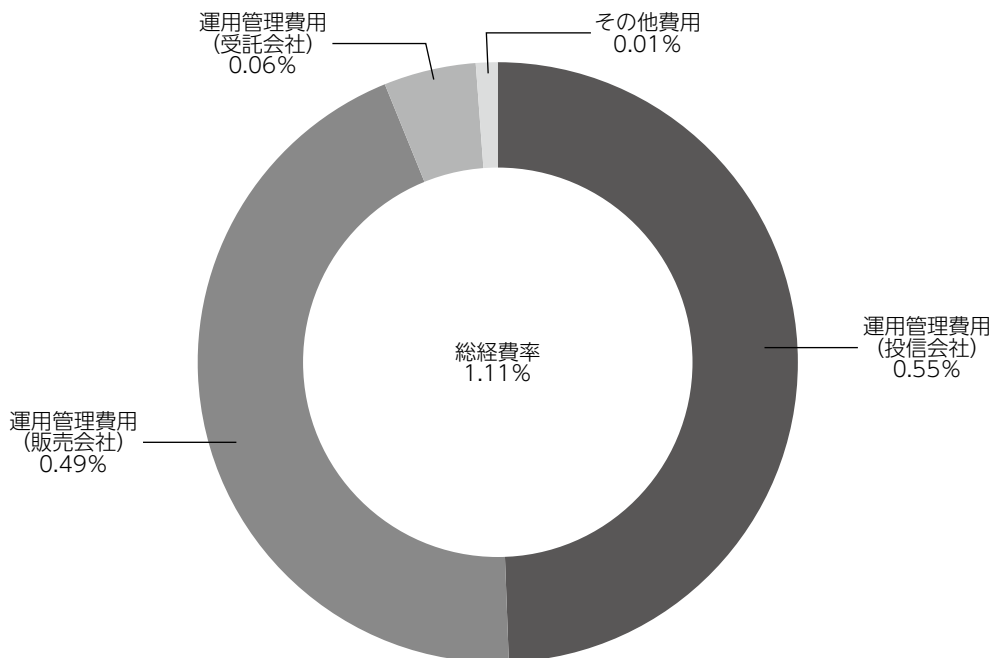
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.11%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（2019年6月6日から2020年6月5日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	千□ 186,636	千円 404,220	千□ 231,697	千円 497,420

■利害関係人との取引状況等（2019年6月6日から2020年6月5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
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	千□ 1,178,876	千□ 1,133,815	千円 2,566,845

■投資信託財産の構成

2020年6月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	2,566,845	99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19,817	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	2,586,663	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、D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドは2020年6月5日現在136,834,380千円、99.3%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、2020年6月5日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=80.76円、1オーストラリア・ドル=75.66円、1ニュージーランド・ドル=70.50円、1ノルウェー・クローネ=11.68円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,586,663,343円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,597,702
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド(評価額)	2,566,845,641
未 収 入 金	17,220,000
(B) 負 債	17,219,993
未 払 解 約 金	3,319,628
未 払 信 託 報 酬	13,853,723
そ の 他 未 払 費 用	46,642
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,569,443,350
元 本	1,718,959,130
次 期 繰 越 損 益 金	850,484,220
(D) 受 益 権 総 口 数	1,718,959,130口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,948円

(注) 期首における元本額は1,768,790,344円、当期中における追加設定元本額は281,024,594円、同解約元本額は330,855,808円です。

■損益の状況

当期 自2019年6月6日 至2020年6月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,131円
受 取 利 息	128
支 払 利 息	△1,259
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	127,811,529
売 買 益	135,526,064
売 買 損	△7,714,535
(C) 信 託 報 酬 等	△27,955,040
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	99,855,358
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	81,749,513
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	668,879,349
(配 当 等 相 当 額)	(1,072,795,464)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△403,916,115)
(G) 合 計(D+E+F)	850,484,220
次 期 繰 越 損 益 金(G)	850,484,220
追 加 信 託 差 損 益 金	668,879,349
(配 当 等 相 当 額)	(1,073,060,767)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△404,181,418)
分 配 準 備 積 立 金	457,211,766
繰 越 損 益 金	△275,606,895

(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	61,988,207円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	1,073,060,767
(d) 分 配 準 備 積 立 金	395,223,559
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	1,530,272,533
(f) 1万口当たり当期分配対象額	8,902.32
(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基準価額水準、市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2020年6月5日）

（計算期間 2019年6月6日～2020年6月5日）

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドの第17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	2003年7月15日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主要投資対象	高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使等により取得するものに限り、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率			
13期 (2016年6月6日)	20,167	△12.7%	98.1%	—%	244,548 百万円
14期 (2017年6月5日)	20,934	3.8	98.0	—	211,988
15期 (2018年6月5日)	21,494	2.7	97.1	—	186,790
16期 (2019年6月5日)	21,536	0.2	96.5	—	156,810
17期 (2020年6月5日)	22,639	5.1	98.5	—	137,252

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドは高格付資源国の公社債を投資対象としており、コンセプトに合った指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

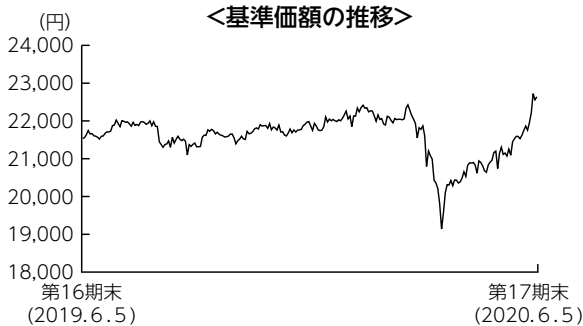
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
(期 首) 2019年 6 月 5 日	円 21,536	% -	% 96.5	% -
6 月 末	21,892	1.7	96.4	-
7 月 末	21,859	1.5	96.5	-
8 月 末	21,414	△0.6	96.9	-
9 月 末	21,650	0.5	96.4	-
10 月 末	21,929	1.8	98.0	-
11 月 末	21,967	2.0	98.2	-
12 月 末	22,259	3.4	98.9	-
2020年 1 月 末	22,061	2.4	98.2	-
2 月 末	21,934	1.8	98.2	-
3 月 末	20,435	△5.1	97.9	-
4 月 末	21,164	△1.7	98.2	-
5 月 末	21,756	1.0	98.0	-
(期 末) 2020年 6 月 5 日	22,639	5.1	98.5	-

(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6月6日から2020年6月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は22,639円となり、前期末比で5.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米中の通商面等での対立や新型コロナウイルスの感染拡大により世界経済の減速懸念が強まったことを背景に、各国の中央銀行が緩和的な金融政策を強化したことから、投資対象国の国債利回りは低下（価格は上昇）しました。為替市場においては、新型コロナウイルスの感染動向や資源価格が乱高下したこと等を背景に、当ファンドの投資対象国の通貨は対円でまちまちな動きとなりました。こうした中、基準価額は投資対象国の国債利回り低下を主因に前期末比で上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、投資対象国の国債利回りが低下しました。2019年は米中通商対立の激化から世界経済の先行き不透明感が強まり、F R B（米連邦準備理事会）が利下げに転じるなど主要国の中央銀行が緩和的な金融政策を強化したことが利回り低下要因となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの罹患患者数の大幅増加を背景に世界の経済活動が制限され、主要国の中央銀行が過去にない規模の金融緩和策を実施したことで利回りが一段と低下しました。

為替市場では、オーストラリアドルとカナダドルが対円で小幅に上昇したものの、他の投資対象国の通貨は対円で下落しました。新型コロナウイルスの感染拡大や、O P E C（石油輸出国機構）による協調減産の枠組みが崩壊したこと等から原油等の資源価格が急落したことなどを背景に、2020年3月上旬にかけて投資対象国の通貨の下落が進みました。しかしその後は、新型コロナウイルス感染拡大ペースが主要先進国で鈍化したこと等を背景に、投資対象国の通貨は買い戻される動きとなりました。

ポートフォリオについて

基本国別投資比率を概ね維持しました。基本国別投資比率は、カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%となっています。デュレーション^{*}については、世界経済の減速と国債利回りの低位推移を見込み、期末は期初と比較して長期化しました。

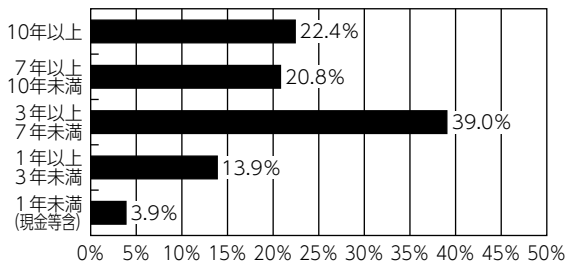
^{*}金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

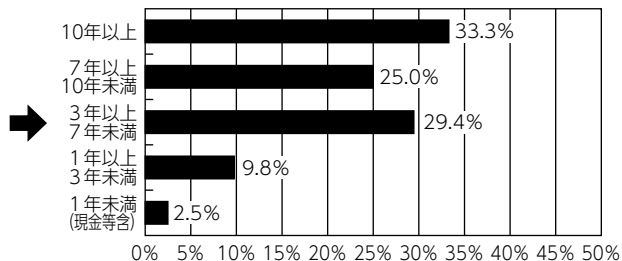
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

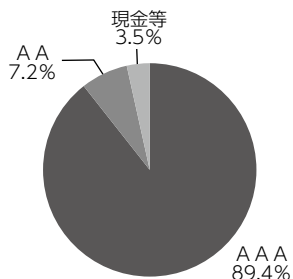


期末

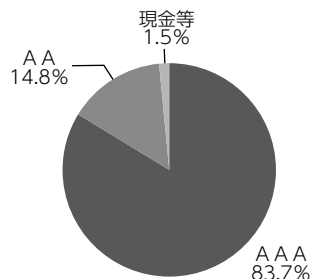


○格付別構成比

期首 (前期末)

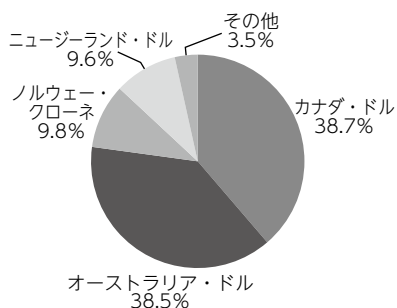


期末

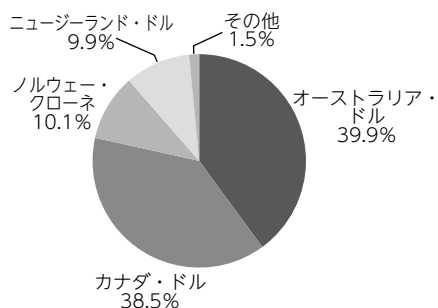


○通貨別構成比

期首 (前期末)

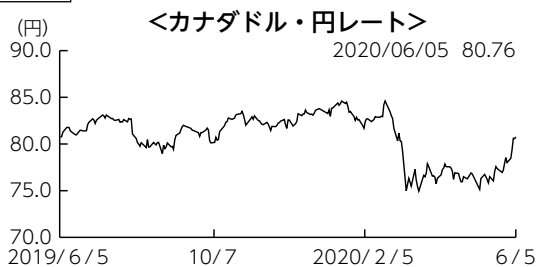


期末



【各国の為替・金利動向】

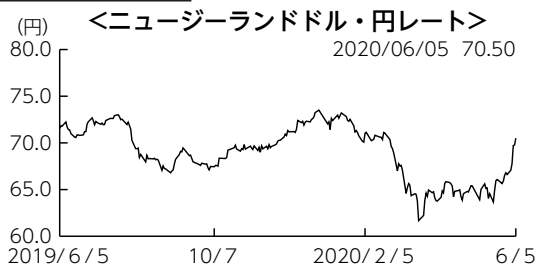
カナダ



オーストラリア



ニュージーランド



ノルウェー



今後の運用方針

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。新型コロナウイルスの感染収束後に世界経済が急速に回復するのは難しいと見ており、利回り上昇（価格は下落）はあっても一時的と予想します。こうした認識の下、デュレーションは長期化を基本に利回り上昇が進んだ局面ではさらに長期化することで期待収益率の向上をめざします。

■ 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	2円	0.009%
（保 管 費 用）	(2)	(0.009)
（そ の 他）	(0)	(0.000)
合 計	2	0.009

(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（21,602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5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（2019年6月6日から2020年6月5日まで）

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 117,484	千カナダ・ドル 241,058 (-)
		地 方 債 証 券	49,307	81,820 (-)
		特 殊 債 券	52,645	14,352 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 109,449	千オーストラリア・ドル 330,683 (-)
		地 方 債 証 券	87,250	16,403 (-)
		特 殊 債 券	68,894	4,304 (-)
国	ニュージーランド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 48,151	千ニュージーランド・ドル 114,544 (-)
		地 方 債 証 券	37,495	- (-)
		特 殊 債 券	2,299	- (-)
ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 334,752	千ノルウェー・クローネ 556,516 (-)	
	特 殊 債 券	153,645	- (-)	

(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（2019年6月6日から2020年6月5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BB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
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 501,300	千カナダ・ドル 654,719	千円 52,875,147	% 38.5	% -	% 28.4	% 7.5	% 2.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 613,299	千オーストラリア・ドル 724,512	千円 54,816,647	39.9	-	32.7	6.8	0.4
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 159,200	千ニュージーランド・ドル 192,910	千円 13,600,207	9.9	-	8.8	1.1	-
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,110,000	千ノルウェー・クローネ 1,186,661	千円 13,860,200	10.1	-	4.7	4.1	1.3
合 計	-	-	千円 135,152,202	98.5	-	74.6	19.6	4.3

(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	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	16,000	17,108	1,381,706	2024/03/01
CANADA 8.0 06/01/23	国債証券	8.0000	1,000	1,228	99,179	2023/06/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	25,100	37,858	3,057,479	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	38,000	54,926	4,435,881	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	30,900	49,409	3,990,303	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	41,300	66,520	5,372,176	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	75,000	114,619	9,256,670	2041/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	1,000	1,048	84,680	2022/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	10,000	11,087	895,458	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,000	1,087	87,845	2025/06/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	4,000	5,975	482,576	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	10,000	13,580	1,096,769	2048/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	8,000	12,076	975,296	2064/12/01
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 9.95 05/15/21	地方債証券	9.9500	15,000	16,353	1,320,740	2021/05/15
PROVINCE OF QUEBEC 6.25 06/01/32	地方債証券	6.2500	15,000	22,379	1,807,396	2032/06/01
QUEBEC PROVINCE 2.75 09/01/25	地方債証券	2.7500	12,000	13,001	1,049,993	2025/09/01
QUEBEC PROVINCE 3.75 09/01/24	地方債証券	3.7500	20,000	22,403	1,809,298	2024/09/01
QUEBEC PROVINCE 3.0 09/01/23	地方債証券	3.0000	27,000	29,015	2,343,317	2023/09/01
QUEBEC PROVINCE 2.75 09/01/27	地方債証券	2.7500	15,000	16,551	1,336,682	2027/09/01
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 7.875 11/30/23	地方債証券	7.8750	15,000	18,567	1,499,481	2023/11/30
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 3.25 12/18/21	地方債証券	3.2500	25,000	26,071	2,105,514	2021/12/18
QUEBEC PROVINCE 3.5 12/01/22	地方債証券	3.5000	25,000	26,820	2,166,003	2022/12/01
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 2.95 12/18/28	地方債証券	2.9500	10,000	11,282	911,190	2028/12/18
CANHOU 2.35 06/15/27	特殊債券	2.3500	25,000	27,298	2,204,647	2027/06/15
CANADA HOUSING TRUST 3.15 09/15/23	特殊債券	3.1500	11,000	11,918	962,573	2023/09/15
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	25,000	26,526	2,142,280	2025/12/15
小 計	—	—	501,300	654,719	52,875,147	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	16,000	19,786	1,497,045	2047/03/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	56,000	71,264	5,391,847	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	22,000	26,715	2,021,280	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	167,000	199,651	15,105,646	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	45,000	59,863	4,529,263	2037/04/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	25,000	31,435	2,378,392	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	21,500	24,721	1,870,431	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	11,500	13,262	1,003,474	2029/11/21
NEW S WALES 6.0 03/01/22	地方債証券	6.0000	6,500	7,127	539,259	2022/03/01
NEW S WALES TREASURY CRP 2.0 03/08/33	地方債証券	2.0000	15,000	15,198	1,149,936	2033/03/08
NEW S WALES TREASURY CRP 4.0 04/20/23	地方債証券	4.0000	3,500	3,851	291,405	2023/04/20
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	6,436	486,963	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	1,000	1,139	86,242	2026/05/20

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		
(オーストラリア)			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
QUEENSLAND 2.75 08/20/27	地方債証券	2.7500	17,300	19,277	1,458,504	2027/08/20		
QUEENSLAND TREASURY CORP 3.25 08/21/29	地方債証券	3.2500	6,000	6,938	524,998	2029/08/21		
TREASURY CORP VICTORIA 1.5 11/20/30	地方債証券	1.5000	7,500	7,475	565,576	2030/11/20		
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 4.25 11/27/24	地方債証券	4.2500	10,000	11,376	860,708	2024/11/27		
TREASURY CORP VICTORIA 5.5 12/17/24	地方債証券	5.5000	53,700	65,382	4,946,806	2024/12/17		
TREASURY CORP VICTORIA 4.25 12/20/32	地方債証券	4.2500	25,000	32,201	2,436,349	2032/12/20		
KOMBNK 4.5 04/17/23	特殊債券	4.5000	12,000	13,289	1,005,520	2023/04/17		
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.8 05/31/23	特殊債券	2.8000	10,000	10,623	803,764	2023/05/31		
KOMMUNALBANKEN AS 5.25 07/15/24	特殊債券	5.2500	10,000	11,747	888,785	2024/07/15		
KOMMUNALBANKEN AS 4.5 07/18/22	特殊債券	4.5000	7,000	7,566	572,446	2022/07/18		
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 07/20/34	特殊債券	1.7500	8,000	7,729	584,821	2034/07/20		
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	50,299	50,451	3,817,173	2031/08/21		
小 計	—	—	613,299	724,512	54,816,647	—		
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円		
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	43,000	54,196	3,820,855	2027/04/15		
NEW ZEALAND 5.5 04/15/23	国債証券	5.5000	9,200	10,566	744,968	2023/04/15		
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	12,963	913,907	2033/04/14		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	50,000	61,726	4,351,700	2037/04/15		
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 4.5 04/15/27	地方債証券	4.5000	15,000	18,448	1,300,613	2027/04/15		
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 1.5 04/20/29	地方債証券	1.5000	10,000	10,184	718,016	2029/04/20		
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25	地方債証券	2.7500	10,000	10,950	771,991	2025/04/15		
KOMBNK 4.0 08/20/25	特殊債券	4.0000	12,000	13,874	978,153	2025/08/20		
小 計	—	—	159,200	192,910	13,600,207	—		
(ノルウェー)			%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円		
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	205,000	217,607	2,541,655	2026/02/19		
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	115,000	126,705	1,479,924	2024/03/14		
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	80,000	85,342	996,796	2025/03/13		
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	5,000	5,548	64,800	2028/04/26		
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	260,000	273,517	3,194,683	2023/05/24		
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	295,000	324,727	3,792,813	2029/09/06		
KOMBNK 1.5 04/19/22	特殊債券	1.5000	150,000	153,213	1,789,527	2022/04/19		
小 計	—	—	1,110,000	1,186,661	13,860,200	—		
合 計	—	—	—	—	135,152,202	—		

■投資信託財産の構成

2020年6月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	135,152,202	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,661,550	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	137,813,752	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、136,834,380千円、99.3%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、2020年6月5日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=80.76円、1オーストラリア・ドル=75.66円、1ニュージーランド・ドル=70.50円、1ノルウェー・クローネ=11.68円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	138,154,177,524円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,947,031,943
公 社 債(評価額)	135,152,202,209
未 収 入 金	340,893,000
未 収 利 息	649,652,796
前 払 費 用	64,397,576
(B) 負 債	901,455,000
未 払 金	340,425,000
未 払 解 約 金	561,030,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	137,252,722,524
元 本	60,626,853,456
次 期 繰 越 損 益 金	76,625,869,068
(D) 受 益 権 総 口 数	60,626,853,456口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,639円

(注1) 期首元本額 72,813,554,366円

追加設定元本額 1,237,758,941円

一部解約元本額 13,424,459,851円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M高格付インカム・オープン (毎月決算コース) 54,805,787,843円

D I A M高格付インカム・オープン<DC年金> 1,133,815,823円

D I A M高格付インカム・オープン (1年決算コース) 683,421,838円

自然環境保護ファンド 375,197,725円

D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 858,173,005円

D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 283,793,166円

D I A M高格付インカム私募オープン (3ヵ月決算コース) (適格機関投資家向け) 2,155,664,588円

D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 40,995,652円

D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 290,003,816円

期末元本合計 60,626,853,456円

■損益の状況

当期 自2019年6月6日 至2020年6月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,646,201,289円
受 取 利 息	4,646,634,282
支 払 利 息	△432,993
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,181,141,676
売 買 益	4,810,799,219
売 買 損	△2,629,657,543
(C) そ の 他 費 用	△12,542,717
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	6,814,800,248
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	83,996,674,910
(F) 解 約 差 損 益 金	△15,621,162,149
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,435,556,059
(H) 合 計(D+E+F+G)	76,625,869,068
次 期 繰 越 損 益 金(H)	76,625,869,068

(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。