

運用報告書 (全体版)

第16期<決算日2021年6月7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。 株主への投資は、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、2021年6月7日に第16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 債比	債券先物率 債比	純資産額 総
	円 税分	円 込配	円 み金			
12期 (2017年6月5日)	14,264	0	2.7	97.9	—	百万円 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
16期 (2021年6月7日)	16,372	0	9.5	97.9	—	2,955

(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
	円 騰	率 落		
(期首) 2020年6月5日	14,948	—	98.4	—
6月 末	14,733	△1.4	98.7	—
7月 末	14,931	△0.1	98.8	—
8月 末	15,236	1.9	98.4	—
9月 末	15,051	0.7	97.8	—
10月 末	14,776	△1.2	98.4	—
11月 末	15,243	2.0	98.9	—
12月 末	15,457	3.4	98.3	—
2021年1月 末	15,530	3.9	98.6	—
2月 末	15,608	4.4	97.7	—
3月 末	16,002	7.1	98.8	—
4月 末	16,220	8.5	99.0	—
5月 末	16,355	9.4	98.5	—
(期末) 2021年6月7日	16,372	9.5	97.9	—

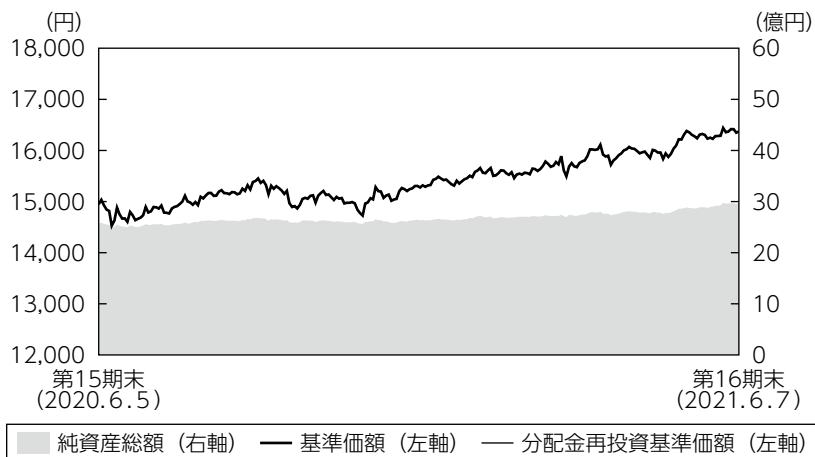
(注1) 騰落率は期首比です。

(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6月6日から2021年6月7日まで）

基準価額等の推移



第16期首： 14,948円
第16期末： 16,372円
(既払分配金0円)
騰落率： 9.5%
(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

当期は、主要な中央銀行が新型コロナウイルスの感染拡大による景気下押し圧力を和らげるため、緩和的な金融政策を継続する環境の下、新型コロナウイルスワクチンの開発や接種の進展を受けて将来の景気回復への期待が強まったことで、投資家のリスク選好度が強まりました。この結果、株式等のリスク資産や資源価格と共に当ファンドの投資対象国の通貨が対円で大きく上昇し、基準価額も投資対象国の通貨の上昇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10年国債利回りが上昇（価格は下落）しました。各国の中央銀行の金融緩和姿勢の差異などから残存年数の短い国債利回りの動きは、まちまちであったものの、新型コロナウイルスワクチンの開発や接種進展から、世界経済の正常化が進むとの見方が強まったことを背景に、10年国債など残存年限の長い債券利回りは上昇しました。

為替市場では、いずれの投資対象通貨も大きく上昇しました。新型コロナウイルスワクチンの接種進展などから、世界経済の回復期待が強まる一方で、足元の経済は回復途上にあることなどから、主要な中央銀行が緩和的な金融政策を継続しました。こうした環境の中で投資家のリスク選好が強まり、資源価格や株式などリスク性資産の上昇が続いたことで、当ファンドの投資対象である高格付資源国通貨も大きく上昇しました。

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、世界経済の回復から国債利回りが上昇しやすいと予想し、当期末は期初と比較して短期化しました。

*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
	2020年6月6日 ～2021年6月7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	9,236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 AM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 AM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。主要な中央銀行による緩和策の終了が意識されやすく、景気回復期待とあわせて利回りが上昇しやすいと見ています。その一方で、世界経済の成長加速の可能性は低く、利回り上昇余地は大きくないとも見ています。こうした認識の下、デュレーションの短期化戦略を利回り上昇が一定程度進んだと判断した局面で解消する方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第16期		項目の概要
	(2020年6月6日 ～2021年6月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	171円	1.106%	(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15,428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)	(85)	(0.553)	
(販売会社)	(77)	(0.498)	
(受託会社)	(9)	(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	173	1.119	

(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。

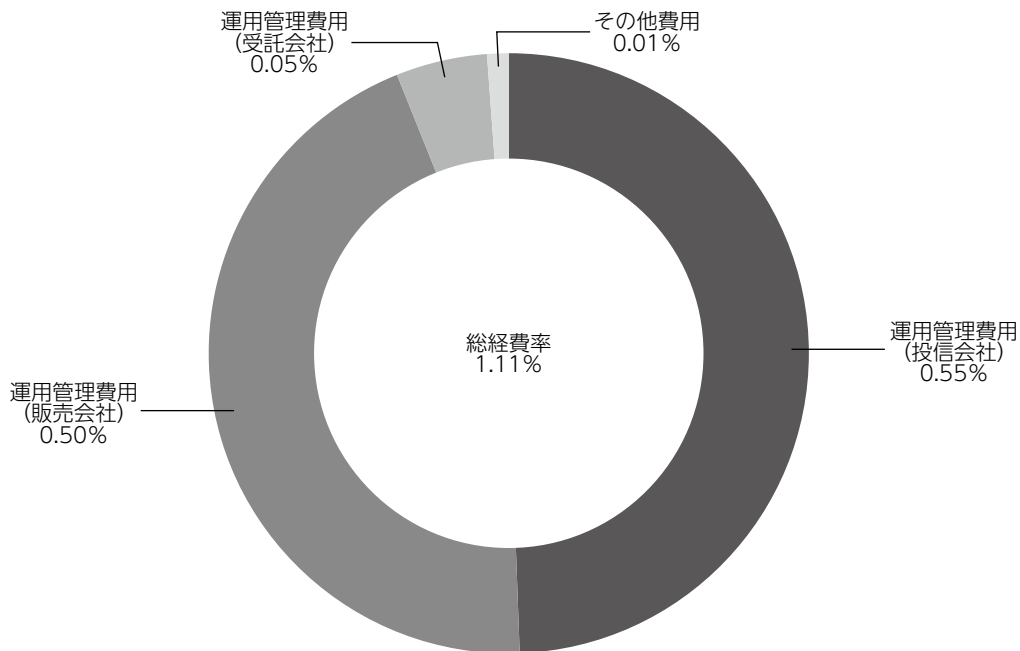
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2020年6月6日から2021年6月7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□ 250,412	千円 593,950	千□ 206,076	千円 485,520

■利害関係人との取引状況等（2020年6月6日から2021年6月7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□ 1,133,815	千□ 1,178,151	千円 2,952,683

■投資信託財産の構成

2021年6月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	2,952,683	99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,351	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	2,976,035	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2021年6月7日現在124,551,543千円、98.8%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6月7日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=84.77円、1ニュージーランド・ドル=78.97円、1ノルウェー・クローネ=13.19円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,976,035,003円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,051,626
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)	2,952,683,377
未 収 入 金	20,300,000
(B) 負 債	20,156,077
未 払 解 約 金	4,970,761
未 払 信 託 報 酬	15,135,613
そ の 他 未 払 費 用	49,703
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,955,878,926
元 本	1,805,438,657
次 期 繰 越 損 益 金	1,150,440,269
(D) 受 益 権 総 口 数	1,805,438,657口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	16,372円

(注) 期首における元本額は1,718,959,130円、当期中における追加設定元本額は369,848,513円、同解約元本額は283,368,986円です。

■損益の状況

当期 自2020年6月6日 至2021年6月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△597円
受 取 利 息	53
支 払 利 息	△650
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	264,574,302
売 買 益	278,098,135
売 買 損	△13,523,833
(C) 信 託 報 酬 等	△29,717,203
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	234,856,502
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	154,256,181
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	761,327,586
(配 当 等 相 当 額)	(1,218,901,710)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△457,574,124)
(G) 合 計(D+E+F)	1,150,440,269
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,150,440,269
追 加 信 託 差 損 益 金	761,327,586
(配 当 等 相 当 額)	(1,219,263,211)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△457,935,625)
分 配 準 備 積 立 金	448,347,032
繰 越 損 益 金	△59,234,349

(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	59,988,833円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	1,219,263,211
(d) 分 配 準 備 積 立 金	388,358,199
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	1,667,610,243
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	9,236.59
(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18期（決算日 2021年6月7日）

（計算期間 2020年6月6日～2021年6月7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18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
	期 騰 落	中 率			
14期 (2017年6月5日)	円 20,934	% 3.8	% 98.0	% -	百万円 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
18期 (2021年6月7日)	25,062	10.7	98.0	-	125,601

(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、コンセプトに適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)。

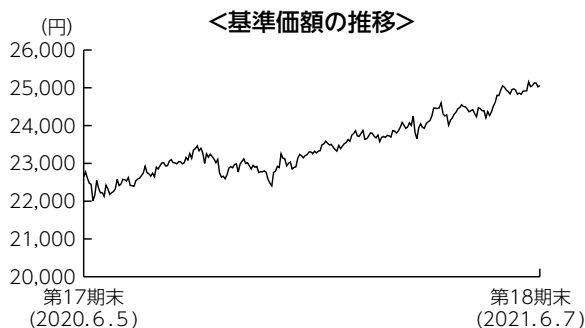
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年 6 月 5 日	円 22,639	% -	% -	% 98.5	% -
6 月 末	22,330	△1.4		98.8	-
7 月 末	22,650	0.0		98.8	-
8 月 末	23,135	2.2		98.3	-
9 月 末	22,875	1.0		97.6	-
10 月 末	22,477	△0.7		98.0	-
11 月 末	23,206	2.5		98.5	-
12 月 末	23,553	4.0		98.3	-
2021年 1 月 末	23,686	4.6		98.6	-
2 月 末	23,821	5.2		97.6	-
3 月 末	24,447	8.0		98.6	-
4 月 末	24,801	9.5		98.7	-
5 月 末	25,031	10.6		98.1	-
(期 末) 2021年 6 月 7 日	25,062	10.7		98.0	-

(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6月6日から2021年6月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は25,062円となり、前期末比で10.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

当期は、主要な中央銀行が新型コロナウイルスの感染拡大による景気下押し圧力を和らげるため、緩和的な金融政策を継続する環境の下、新型コロナウイルスワクチンの開発や接種の進展を受けて将来の景気回復への期待が強まったことで、投資家のリスク選好度が強まりました。この結果、株式等のリスク性資産や資源価格と共に当ファンドの投資対象国の通貨が対円で大きく上昇し、基準価額も投資対象国の通貨の上昇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10年国債利回りが上昇（価格は下落）しました。各国の中央銀行の金融緩和姿勢の差異などから残存年数の短い国債利回りの動きは、まちまちであったものの、新型コロナウイルスワクチンの開発や接種進展から、世界経済の正常化が進むとの見方が強まったことを背景に、10年国債など残存年限の長い債券利回りは上昇しました。

為替市場では、いずれの投資対象通貨も大きく上昇しました。新型コロナウイルスワクチンの接種進展などから、世界経済の回復期待が強まる一方で、足元の経済は回復途上にあることなどから、主要な中央銀行が緩和的な金融政策を継続しました。こうした環境の中で投資家のリスク選好が強まり、資源価格や株式などリスク性資産の上昇が続いたことで、当ファンドの投資対象である高格付資源国通貨も大きく上昇しました。

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、世界経済の回復から国債利回りが上昇しやすいと予想し、当期末は期初と比較して短期化しました。

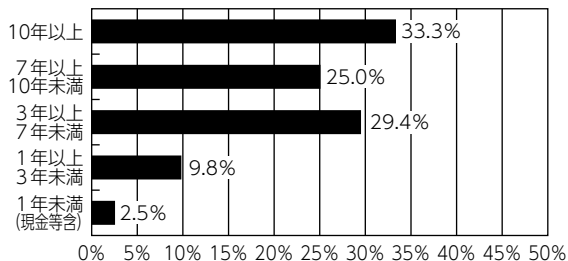
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

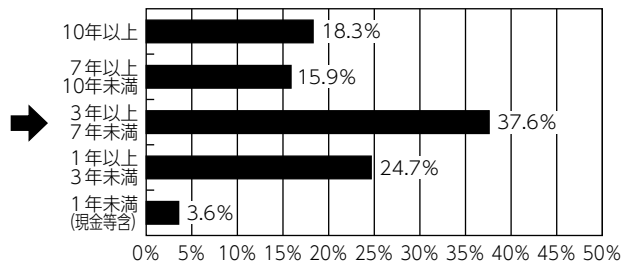
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

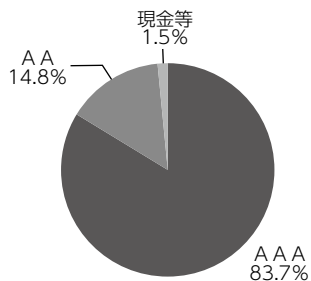


期末

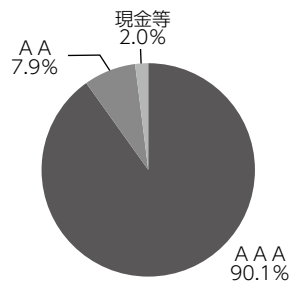


○格付別構成比

期首 (前期末)

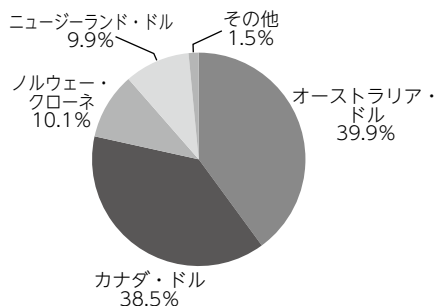


期末

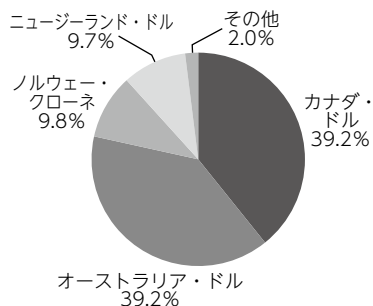


○通貨別構成比

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。主要な中央銀行による緩和策の終了が意識されやすく、景気回復期待とあわせて利回りが上昇しやすいと見ています。その一方で、世界経済の成長加速の可能性は低く、利回り上昇余地は大きくないとも見ています。こうした認識の下、デュレーションの短期化戦略を利回り上昇が一定程度進んだと判断した局面で解消する方針です。

■ 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 (保 管 費 用)	2円	0.009%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(2)	(0.009)	
合 計	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.009	
期中の平均基準価額は23,494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（2020年6月6日から2021年6月7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 317,688	千カナダ・ドル 274,584 (-)
		地 方 債 証 券	76,936	229,495 (-)
		特 殊 債 券	44,232	18,300 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 446,236	千オーストラリア・ドル 486,823 (-)
		地 方 債 証 券	123,944	193,613 (-)
		特 殊 債 券	37,084	57,294 (-)
国	ニュージーランド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 79,909	千ニュージーランド・ドル 106,547 (-)
		地 方 債 証 券	21,900	21,630 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 75,086	千ノルウェー・クローネ 278,787 (-)

(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（2020年6月6日から2021年6月7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 491,300	千カナダ・ドル 543,388	千円 49,274,435	% 39.2	% -	% 17.9	% 9.9	% 11.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 563,599	千オーストラリア・ドル 581,205	千円 49,268,807	39.2	-	19.9	17.7	1.6
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 144,000	千ニュージーランド・ドル 154,888	千円 12,231,560	9.7	-	4.2	3.2	2.3
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 915,000	千ノルウェー・クローネ 936,133	千円 12,347,601	9.8	-	3.3	3.8	2.7
合 計	-	-	千円 123,122,406	98.0	-	45.3	34.6	18.1

(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		
(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	16,784	1,521,978	2024/03/01	
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	25,100	35,243	3,195,897	2027/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	23,000	30,796	2,792,644	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	20,900	30,264	2,744,357	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	17,300	25,205	2,285,643	2037/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	20,000	27,179	2,464,637	2041/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	10,000	10,567	958,271	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,000	1,062	96,324	2025/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	10,000	9,879	895,831	2030/06/01	
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	158,000	159,539	14,467,060	2022/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	34,000	33,610	3,047,818	2025/09/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	3,000	3,912	354,825	2045/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,000	2,008	182,137	2051/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	6,029	546,718	2064/12/01	
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	17,000	15,564	1,411,381	2030/12/01	
QUEBEC PROVINCE 3.0 09/01/23	地方債証券	3.0000	27,000	28,517	2,585,965	2023/09/01	
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 7.875 11/30/23	地方債証券	7.8750	15,000	17,687	1,603,889	2023/11/30	
CANHOU 1.1 03/15/31	特殊債証券	1.1000	10,000	9,361	848,918	2031/03/15	
CANHOU 2.35 06/15/27	特殊債証券	2.3500	20,000	21,239	1,925,963	2027/06/15	
CANHOU 1.25 06/15/26	特殊債証券	1.2500	20,000	20,149	1,827,198	2026/06/15	
CANADA HOUSING TRUST 3.15 09/15/23	特殊債証券	3.1500	12,000	12,727	1,154,141	2023/09/15	
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債証券	1.9500	25,000	26,056	2,362,830	2025/12/15	
小計	—	—	491,300	543,388	49,274,435	—	
(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 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	33,000	40,222	3,409,671	2027/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	13,000	14,003	1,187,096	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,000	10,526	892,324	2026/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	63,000	72,195	6,120,014	2029/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	3,000	3,659	310,242	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	15,000	15,879	1,346,128	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	15,000	12,436	1,054,242	2051/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	3,000	3,332	282,487	2029/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	10,000	9,982	846,209	2032/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	20,000	18,689	1,584,333	2031/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	102,000	100,353	8,506,938	2025/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	83,500	83,338	7,064,624	2024/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	10,000	9,484	804,022	2030/12/21	
NEW S WALES TREASURY CRP 1.5 02/20/32	地方債証券	1.5000	20,000	19,121	1,620,934	2032/02/20	
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	6,304	534,433	2032/05/24	
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	1,000	1,120	94,957	2026/05/20	
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,986	337,976	2030/05/17	

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
(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			
TREASURY CORP VICTORIA 2.25 09/15/33	地方債証券	2.2500	10,000	10,088	855,240	2033/09/15		
TREASURY CORP VICTORIA 1.5 09/10/31	地方債証券	1.5000	20,000	19,258	1,632,571	2031/09/10		
TREASURY CORP VICTORIA 2.25 11/20/34	地方債証券	2.2500	5,000	4,973	421,563	2034/11/20		
TREASURY CORP VICTORIA 1.5 11/20/30	地方債証券	1.5000	7,500	7,310	619,670	2030/11/20		
NEW S WALES TREASURY CRP 1.25 11/20/30	地方債証券	1.2500	10,000	9,565	810,876	2030/11/20		
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 4.25 11/27/24	地方債証券	4.2500	10,000	11,206	949,932	2024/11/27		
TREASURY CORP VICTORIA 0.5 11/20/25	地方債証券	0.5000	13,300	13,158	1,115,433	2025/11/20		
KOMBNK 4.5 04/17/23	特殊債券	4.5000	12,000	12,941	1,097,088	2023/04/17		
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.8 05/31/23	特殊債券	2.8000	10,000	10,502	890,333	2023/05/31		
NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	4,529	383,997	2036/06/30		
KOMMUNALBANKEN AS 5.25 07/15/24	特殊債券	5.2500	25,000	28,637	2,427,600	2024/07/15		
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	10,299	10,172	862,311	2031/08/21		
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.5 08/20/32	特殊債券	1.5000	15,000	14,221	1,205,550	2032/08/20		
小計	—	—	563,599	581,205	49,268,807	—		
(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	18,000	21,341	1,685,355	2027/04/15		
NEW ZEALAND 5.5 04/15/23	国債証券	5.5000	34,000	37,273	2,943,505	2023/04/15		
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	11,507	908,727	2033/04/14		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	6,000	6,282	496,159	2037/04/15		
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	5,000	4,277	337,766	2041/05/15		
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	12,000	11,646	919,684	2031/05/15		
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	2,000	1,838	145,222	2028/05/15		
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国債証券	0.5000	10,000	9,732	768,577	2026/05/15		
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 4.5 04/15/27	地方債証券	4.5000	8,000	9,280	732,842	2027/04/15		
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 04/15/24	地方債証券	2.2500	12,000	12,476	985,247	2024/04/15		
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25	地方債証券	2.7500	15,000	15,906	1,256,143	2025/04/15		
KOMBNK 4.0 08/20/25	特殊債券	4.0000	12,000	13,325	1,052,327	2025/08/20		
小計	—	—	144,000	154,888	12,231,560	—		
(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	190,000	193,534	2,552,723	2026/02/19		
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	85,000	90,167	1,189,313	2024/03/14		
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	80,000	82,250	1,084,877	2025/03/13		
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	5,000	5,220	68,858	2028/04/26		
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	100,000	102,874	1,356,914	2023/05/24		
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	70,000	69,506	916,786	2030/08/19		
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	235,000	241,273	3,182,395	2029/09/06		
KOMBNK 1.5 04/19/22	特殊債券	1.5000	150,000	151,306	1,995,732	2022/04/19		
小計	—	—	915,000	936,133	12,347,601	—		
合計	—	—	—	—	123,122,406	—		

■投資信託財産の構成

2021年6月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	123,122,406	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,888,591	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	126,010,997	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、124,551,543千円、98.8%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6月7日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=84.77円、1ニュージーランド・ドル=78.97円、1ノルウェー・クローネ=13.19円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	126,010,997,380円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,400,474,410
公 社 債(評価額)	123,122,406,172
未 収 利 息	469,895,494
前 払 費 用	18,221,304
(B) 負 債	409,000,000
未 払 解 約 金	409,000,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	125,601,997,380
元 本	50,117,263,636
次 期 繰 越 損 益 金	75,484,733,744
(D) 受 益 権 総 口 数	50,117,263,636口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,062円

(注1) 期首元本額 60,626,853,456円

追加設定元本額 2,495,032,183円

一部解約元本額 13,004,622,003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) 45,239,470,431円

D I A M高格付インカム・オープン<DC年金> 1,178,151,535円

D I A M高格付インカム・オープン (1年決算コース) 513,744,562円

自然環境保護ファンド 335,539,820円

D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 764,948,974円

D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 255,308,045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)

1,573,453,701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)

29,382,416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)

227,264,152円

期末元本合計 50,117,263,636円

■損益の状況

当期 自2020年6月6日 至2021年6月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,540,681,027円
受 取 利 息	3,540,889,210
支 払 利 息	△208,183
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,471,368,184
売 買 益	15,771,149,898
売 買 損	△6,299,781,714
(C) そ の 他 費 用	△11,897,355
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	13,000,151,856
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	76,625,869,068
(F) 解 約 差 損 益 金	△17,548,459,997
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,407,172,817
(H) 合 計(D+E+F+G)	75,484,733,744
次 期 繰 越 損 益 金(H)	75,484,733,744

(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。