

運用報告書 (全体版)

第17期<決算日2022年6月6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・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド	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に、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、2022年6月6日に第17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	円	騰落率			
13期 (2018年6月5日)	14,490	0	1.6	97.0	—	百万円 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
17期 (2022年6月6日)	16,424	0	0.3	97.9	—	2,663

(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	騰落率		
(期首) 2021年 6月 7日	16,372	—	97.9	—
6月 末	16,097	△1.7	97.9	—
7月 末	15,956	△2.5	98.6	—
8月 末	15,838	△3.3	98.4	—
9月 末	15,708	△4.1	98.6	—
10月 末	16,329	△0.3	98.5	—
11月 末	15,679	△4.2	98.6	—
12月 末	16,094	△1.7	98.5	—
2022年 1月 末	15,573	△4.9	98.7	—
2月 末	15,558	△5.0	98.8	—
3月 末	16,519	0.9	98.4	—
4月 末	16,266	△0.6	98.5	—
5月 末	16,224	△0.9	98.3	—
(期末) 2022年 6月 6日	16,424	0.3	97.9	—

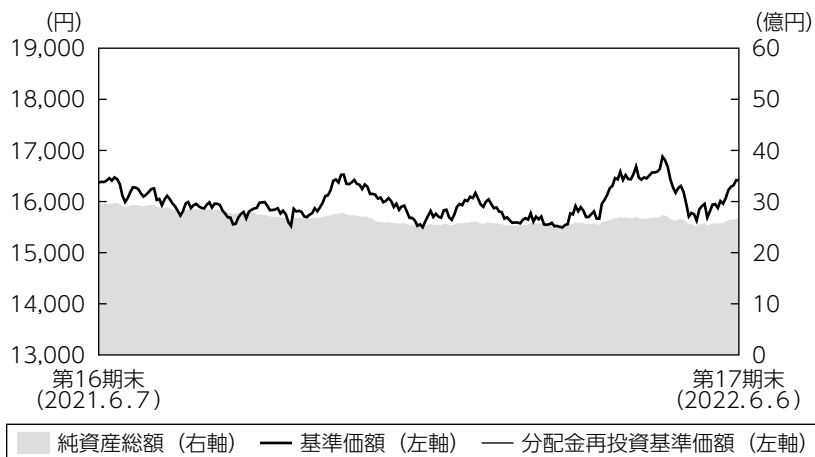
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

基準価額等の推移



第17期首：16,372円
第17期末：16,424円
(既払分配金0円)
騰落率：0.3%
(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はありません。
- (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

新型コロナウイルス禍から世界経済の正常化が見込まれたことや、資源価格の上昇などからインフレが高進したことを背景に、主要中央銀行が金融引き締めへ転じたことなどによって国債利回りは上昇（価格は下落）し、基準価額にマイナスに寄与しました。一方、為替市場では、内外金利差の拡大見通しなどから投資対象国の通貨が対円で上昇し、基準価額に対してプラスとなりました。この結果、投資対象国の通貨の上昇を主因に基準価額が上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、いずれの投資対象国でも10年国債利回りが上昇しました。新型コロナウイルスの変異株に対する懸念などから国債利回りが低下（価格は上昇）する場面もありましたが、その後変異株に対する懸念が後退し、景気見通しが改善したこと、インフレの高進などを背景に、投資対象国の中央銀行が量的緩和策の停止や利上げなどを発表したことなどから国債利回りが上昇しました。

為替市場では、全ての投資対象国の通貨が対円で上昇しました。景気回復やインフレの高進から、投資対象国の政策金利の引き上げが見込まれたことで内外金利差の拡大が意識されたこと、エネルギー価格の高騰などから日本の経常収支悪化が意識されたことなどを背景に、投資対象国の通貨に対して円安が大きく進みました。

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（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%）を概ね維持しました。デュレーション*については、新型コロナウイルスの感染動向と投資対象国および世界経済見通し、主要国および投資対象国の金融政策を勘案して、機動的に調整を行いました。当期末のデュレーションは、利回り上昇が一定程度進んだとの判断から、前期末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
	2021年6月8日 ～2022年6月6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	9,406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。デフレーションについては、中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第17期		項目の概要
	(2021年6月8日 ～2022年6月6日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	175円	1.097%	(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15,984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)	(88)	(0.548)	
(販売会社)	(79)	(0.494)	
(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	177	1.110	

(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。

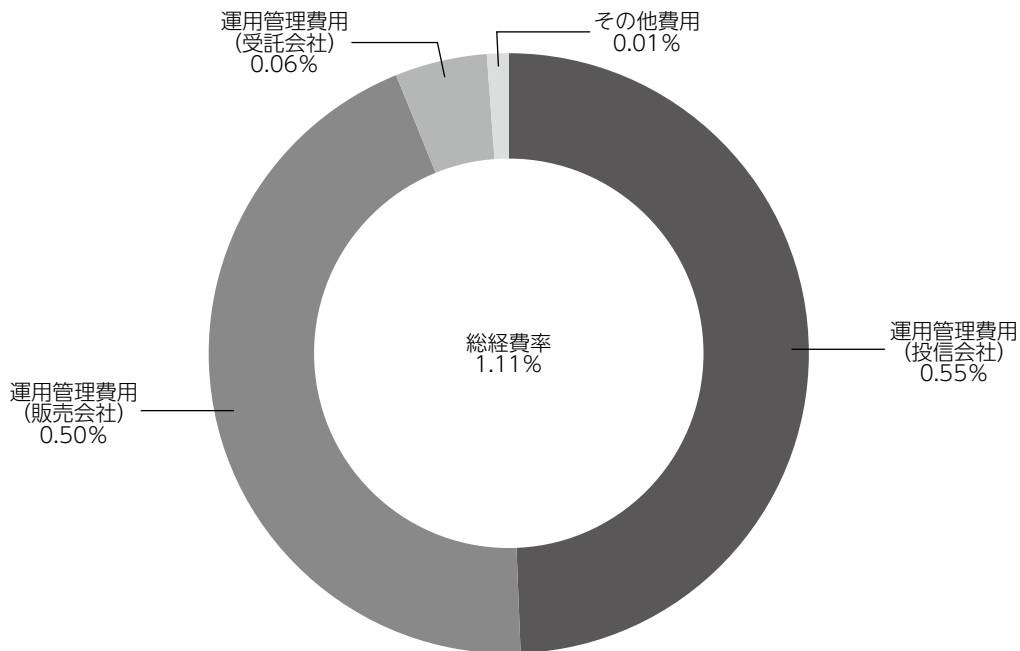
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2021年6月8日から2022年6月6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□ 193,080	千円 474,700	千□ 323,739	千円 796,100

■利害関係人との取引状況等（2021年6月8日から2022年6月6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□ 1,178,151	千□ 1,047,493	千円 2,661,156

■投資信託財産の構成

2022年6月6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	2,661,156	99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	22,052	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	2,683,209	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2022年6月6日現在112,185,351千円、97.1%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、2022年6月6日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=103.95円、1オーストラリア・ドル=94.26円、1ニュージーランド・ドル=85.11円、1ノルウェー・クローネ=13.85円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,683,209,077円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,752,926
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)	2,661,156,151
未 収 入 金	19,300,000
(B) 負 債	19,471,043
未 払 解 約 金	5,196,149
未 払 信 託 報 酬	14,228,161
そ の 他 未 払 費 用	46,733
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,663,738,034
元 本	1,621,812,826
次 期 繰 越 損 益 金	1,041,925,208
(D) 受 益 権 総 口 数	1,621,812,826口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	16,424円

(注) 期首における元本額は1,805,438,657円、当期中における追加設定元本額は295,688,939円、同解約元本額は479,314,770円です。

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△423円
受 取 利 息	47
支 払 利 息	△470
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	48,015,010
売 買 益	58,756,378
売 買 損	△10,741,368
(C) 信 託 報 酬 等	△29,465,431
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	18,549,156
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	293,120,308
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	730,255,744
(配 当 等 相 当 額)	(1,160,258,333)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△430,002,589)
(G) 合 計(D+E+F)	1,041,925,208
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,041,925,208
追 加 信 託 差 損 益 金	730,255,744
(配 当 等 相 当 額)	(1,160,513,361)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△430,257,617)
分 配 準 備 積 立 金	364,964,887
繰 越 損 益 金	△53,295,423

(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	27,223,081円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	1,160,513,361
(d) 分 配 準 備 積 立 金	337,741,806
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	1,525,478,248
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	9,406.01
(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19期（決算日 2022年6月6日）

（計算期間 2021年6月8日～2022年6月6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19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			
15期（2018年6月5日）	円	%	%	%	百万円
16期（2019年6月5日）	21,494	2.7	97.1	—	186,790
17期（2020年6月5日）	21,536	0.2	96.5	—	156,810
18期（2021年6月7日）	22,639	5.1	98.5	—	137,252
19期（2021年6月7日）	25,062	10.7	98.0	—	125,601
19期（2022年6月6日）	25,405	1.4	98.0	—	112,677

（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）。

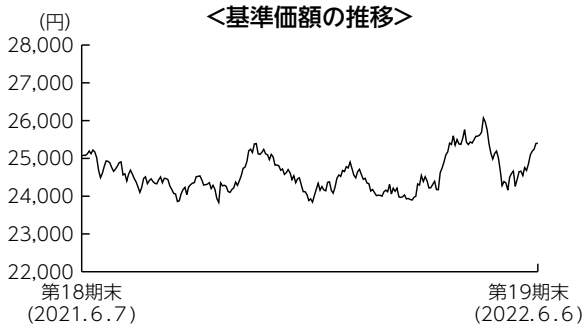
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		騰	落		
(期 首) 2021年 6 月 7 日	円 25,062	% -		% 98.0	% -
6 月 末	24,657	△1.6		97.9	-
7 月 末	24,459	△2.4		98.5	-
8 月 末	24,302	△3.0		98.2	-
9 月 末	24,122	△3.8		98.4	-
10 月 末	25,093	0.1		98.1	-
11 月 末	24,118	△3.8		98.1	-
12 月 末	24,781	△1.1		98.5	-
2022年 1 月 末	24,000	△4.2		98.7	-
2 月 末	23,997	△4.2		98.7	-
3 月 末	25,498	1.7		98.2	-
4 月 末	25,131	0.3		98.6	-
5 月 末	25,091	0.1		97.9	-
(期 末) 2022年 6 月 6 日	25,405	1.4		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（2021年6月8日から2022年6月6日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は25,405円となり、前期末比で1.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルス禍から世界経済の正常化が見込まれたことや、資源価格の上昇などからインフレが高進したことを背景に、主要中央銀行が金融引き締めへ転じたことなどによって国債利回りは上昇（価格は下落）し、基準価額にマイナスに寄与しました。一方、為替市場では、内外金利差の拡大見通しなどから投資対象国の通貨が対円で上昇し、基準価額に対してプラスとなりました。この結果、投資対象国の通貨の上昇を主因に基準価額が上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、いずれの投資対象国でも10年国債利回りが上昇しました。新型コロナウイルスの変異株に対する懸念などから国債利回りが低下（価格は上昇）する場面もありましたが、その後変異株に対する懸念が後退し、景気見通しが改善したこと、インフレの高進などを背景に、投資対象国の中央銀行が量的緩和策の停止や利上げなどを発表したことなどから国債利回りが上昇しました。

為替市場では、全ての投資対象国の通貨が対円で上昇しました。景気回復やインフレの高進から、投資対象国の政策金利の引き上げが見込まれたことで内外金利差の拡大が意識されたこと、エネルギー価格の高騰などから日本の経常収支悪化が意識されたことなどを背景に、投資対象国の通貨に対して円安が大きく進みました。

ポートフォリオについて

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%）を概ね維持しました。デュレーション*については、新型コロナウイルスの感染動向と投資対象国および世界経済見通し、主要国および投資対象国の金融政策を勘案して、機動的に調整を行いました。当期末のデュレーションは、利回り上昇が一定程度進んだとの判断から、前期末と比較して長期化しました。

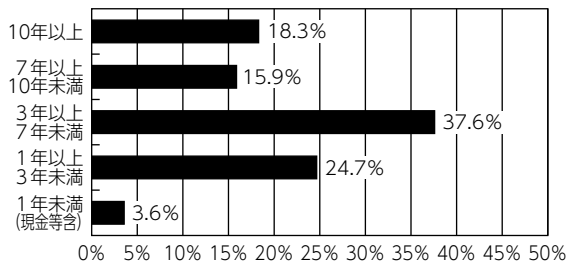
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

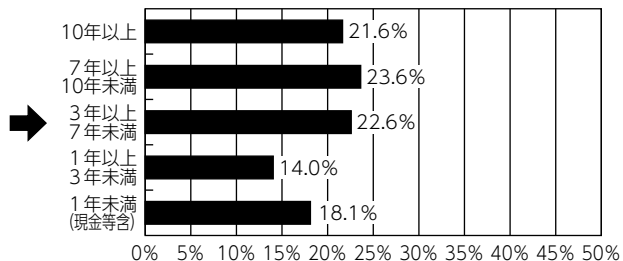
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

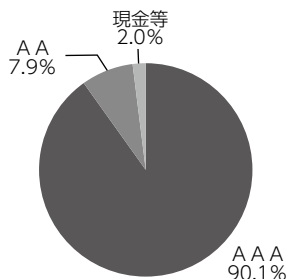


期末

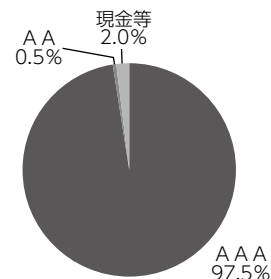


○格付別構成比

期首 (前期末)

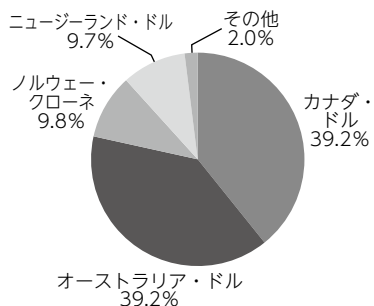


期末

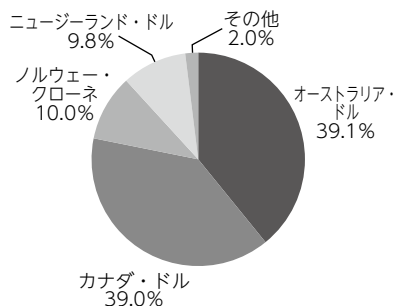


○通貨別構成比

期首 (前期末)



期末

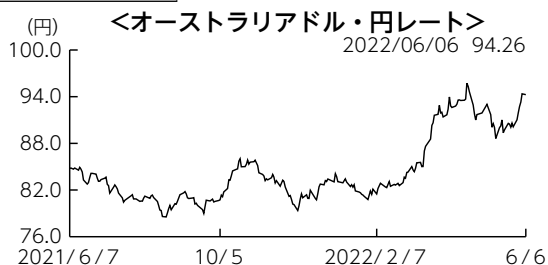


【各国の為替・金利動向】

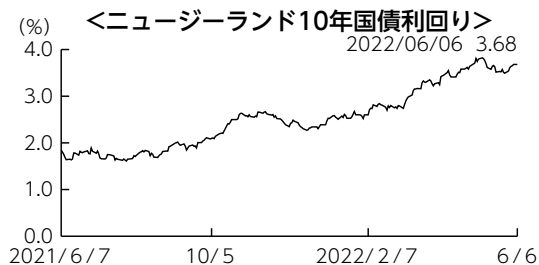
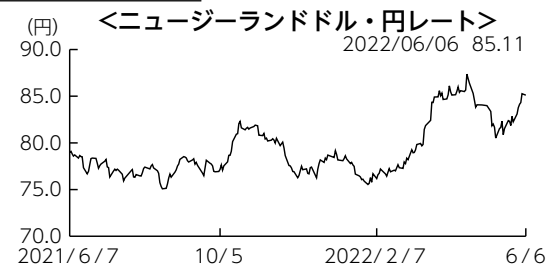
カナダ



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。デフレーションについては、中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

■ 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 (保 管 費 用)	2円	0.010%	(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)	
	2	0.010	
期中の平均基準価額は24,592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 (2021年6月8日から2022年6月6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 479,812	千カナダ・ドル 457,153 (-)
		地方債証券	-	28,381 (-)
		特殊債証券	-	63,610 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 766,644	千オーストラリア・ドル 739,212 (-)
		地方債証券	108,540	162,065 (-)
		特殊債証券	22,965	41,242 (-)
国	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 56,876	千ニュージーランド・ドル 66,355 (-)
		地方債証券	9,933	9,211 (-)
		特殊債証券	5,481	- (-)
ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 267,823	千ノルウェー・クローネ 179,588 (-)	
	特殊債証券	-	- (150,000)	

(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 (2021年6月8日から2022年6月6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
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 438,300	千カナダ・ドル 422,912	千円 43,961,742	% 39.0	% -	% 17.4	% 6.9	% 14.7
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 509,500	千オーストラリア・ドル 467,917	千円 44,105,941	39.1	-	23.8	11.9	3.5
ニュージーランド	千ニューージーランド・ドル 145,500	千ニューージーランド・ドル 130,325	千円 11,091,974	9.8	-	6.1	2.9	0.9
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 853,000	千ノルウェー・クローネ 816,989	千円 11,315,308	10.0	-	4.3	2.7	3.0
合 計	-	-	千円 110,474,966	98.0	-	51.7	24.4	22.0

(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	
(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	15,840	1,646,604	2024/03/01
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	25,000	24,457	2,542,312	2023/05/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	15,100	18,589	1,932,397	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	8,000	9,369	973,931	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	15,900	19,782	2,056,357	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,959	931,352	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,659	588,283	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	4,000	3,783	393,313	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,000	981	102,029	2025/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	30,000	26,164	2,719,802	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	27,000	23,679	2,461,510	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	10,000	9,082	944,099	2032/06/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	65,000	64,880	6,744,371	2022/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	34,000	31,453	3,269,580	2025/09/01
CANADA 0.25 11/01/22	国債証券	0.2500	38,000	37,705	3,919,486	2022/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,935	1,344,652	2045/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	56,000	45,484	4,728,135	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,694	488,015	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	24,000	19,398	2,016,424	2030/12/01

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	
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 7.875 11/30/23	地方債証券	7.8750	15,000	16,047	1,668,127	2023/11/30
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	25,000	23,962	2,490,951	2025/12/15
小計	—	—	438,300	422,912	43,961,742	—
(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	8,000	6,950	655,169	2047/03/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	30,000	32,103	3,026,087	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,000	9,371	883,387	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	23,000	22,851	2,153,965	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	25,000	25,192	2,374,647	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	20,000	18,819	1,773,878	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	38,000	35,586	3,354,416	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	14,000	12,037	1,134,685	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	25,000	20,339	1,917,233	2032/05/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	18,000	11,403	1,074,846	2051/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	19,000	19,100	1,800,370	2022/07/15
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	18,000	16,093	1,516,993	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	13,000	12,411	1,169,870	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	15,000	14,259	1,344,080	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	20,000	16,951	1,597,865	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	20,000	16,044	1,512,368	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	17,000	15,435	1,454,964	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	34,500	32,401	3,054,121	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	32,000	26,241	2,473,481	2030/12/21
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,324	501,922	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	1,000	988	93,217	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,428	323,173	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,974	1,317,228	2032/10/22
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	13,170	1,241,493	2032/11/22
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 4.25 11/27/24	地方債証券	4.2500	10,000	10,118	953,722	2024/11/27
KOMBNK 4.5 04/17/23	特殊債券	4.5000	12,000	12,187	1,148,797	2023/04/17
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.8 05/31/23	特殊債券	2.8000	10,000	10,002	942,823	2023/05/31
NATIONAL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,622	341,501	2036/06/30
KOMMUNALBANKEN AS 5.25 07/15/24	特殊債券	5.2500	25,000	25,846	2,436,267	2024/07/15
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,658	533,359	2031/08/18
小計	—	—	509,500	467,917	44,105,941	—
(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	10,000	10,454	889,803	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,764	831,049	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	9,522	810,451	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	11,500	11,110	945,597	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	6,000	4,618	393,116	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	19,000	13,191	1,122,751	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	10,000	8,370	712,370	2031/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	10,000	8,611	732,915	2032/05/15

銘	柄	当				期		末								
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日	
									外	貨						建
(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 0.25 05/15/28	国	債	証	券	0.2500	2,000	1,652	140,603							2028/05/15
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国	債	証	券	0.5000	1,000	891	75,915							2026/05/15
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 04/15/24	地	方	債	証	券	2.2500	12,000	11,658	992,285						2024/04/15
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25	地	方	債	証	券	2.7500	15,000	14,485	1,232,844						2025/04/15
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28	地	方	債	証	券	2.2500	10,000	8,941	760,989						2028/05/15
	HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30	特	殊	債	証	券	2.1830	6,000	5,118	435,648						2030/04/24
	KOMBANK 4.0 08/20/25	特	殊	債	証	券	4.0000	12,000	11,933	1,015,631						2025/08/20
	小					計	—	—	145,500	130,325	11,091,974					—
(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	120,000	115,172	1,595,144							2026/02/19
	NORWAY 3.0 03/14/24	国	債	証	券	3.0000	160,000	161,854	2,241,689							2024/03/14
	NORWAY 1.75 03/13/25	国	債	証	券	1.7500	110,000	107,549	1,489,557							2025/03/13
	NORWAY 2.0 04/26/28	国	債	証	券	2.0000	5,000	4,799	66,466							2028/04/26
	NORWAY 2.0 05/24/23	国	債	証	券	2.0000	80,000	80,081	1,109,130							2023/05/24
	NORWAY 2.125 05/18/32	国	債	証	券	2.1250	50,000	47,005	651,019							2032/05/18
	NORWAY 1.375 08/19/30	国	債	証	券	1.3750	70,000	62,801	869,806							2030/08/19
	NORWAY 1.75 09/06/29	国	債	証	券	1.7500	205,000	191,254	2,648,877							2029/09/06
	NORWAY 1.25 09/17/31	国	債	証	券	1.2500	53,000	46,470	643,616							2031/09/17
	小					計	—	—	853,000	816,989	11,315,308					—
	合					計	—	—	—	—	110,474,966					—

■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	110,474,966	95.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,035,476	4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	115,510,442	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、112,185,351千円、97.1％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、2022年6月6日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=103.95円、1オーストラリア・ドル=94.26円、1ニュージーランド・ドル=85.11円、1ノルウェー・クローネ=13.85円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	115,510,442,702円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,474,037,416
公 社 債(評価額)	110,474,966,219
未 収 入 金	3,050,093,036
未 収 利 息	418,263,896
前 払 費 用	93,082,135
(B) 負 債	2,832,751,588
未 払 金	2,553,861,588
未 払 解 約 金	278,890,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	112,677,691,114
元 本	44,353,039,204
次 期 繰 越 損 益 金	68,324,651,910
(D) 受 益 権 総 口 数	44,353,039,204口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,405円

(注1) 期首元本額 50,117,263,636円

追加設定元本額 1,055,748,093円

一部解約元本額 6,819,972,525円

(注2) 期末における元本の内訳

DIA M高格付インカム・オープン(毎月決算コース) 39,493,461,972円

DIA M高格付インカム・オープン<DC年金> 1,047,493,073円

DIA M高格付インカム・オープン(1年決算コース) 483,281,186円

自然環境保護ファンド 324,462,162円

DIA M世界インカム・オープン(毎月決算コース) 739,820,778円

DIA M世界3資産オープン(毎月決算型) 249,057,263円

DIA 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)

1,821,020,290円

DIA 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) 24,203,758円

DIA 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) 170,238,722円

期末元本合計 44,353,039,204円

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,807,717,937円
受 取 利 息	2,807,851,621
支 払 利 息	△133,684
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,525,904,814
売 買 益	13,786,418,696
売 買 損	△15,312,323,510
(C) そ の 他 費 用	△11,157,389
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,270,655,734
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	75,484,733,744
(F) 解 約 差 損 益 金	△9,991,218,475
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,560,480,907
(H) 合 計(D+E+F+G)	68,324,651,910
次 期 繰 越 損 益 金(H)	68,324,651,910

(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。