

DIAMバランス・インカム・オープン（毎月分配型）

追加型投信／内外／資産複合

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。

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、実質的に外国債券および国内株式を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。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。

作成対象期間 2021年2月9日～2021年8月10日

第172期	決算日：2021年3月8日	
第173期	決算日：2021年4月8日	
第174期	決算日：2021年5月10日	
第175期	決算日：2021年6月8日	
第176期	決算日：2021年7月8日	
第177期	決算日：2021年8月10日	
第177期末 (2021年8月10日)	基準価額	8,509円
	純資産総額	181百万円
第172期～ 第177期	騰落率	△1.0%
	分配金合計	60円

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △(白三角) はマイナスを意味しています(以下同じ)。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書(全体版)を電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書(全体版)は、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書(全体版)は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

■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)

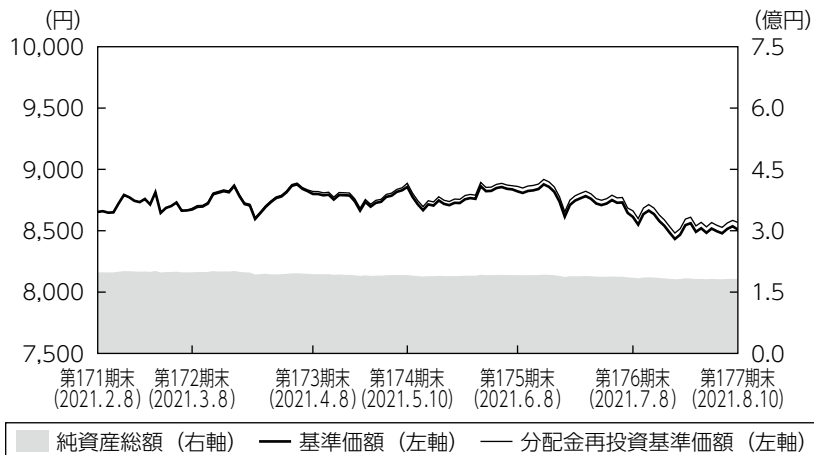
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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/>

運用経過の説明

基準価額等の推移



第172期首：8,654円
 第177期末：8,509円
 (既払分配金60円)
 騰落率：△1.0%
 (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

各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感等から日本を除く多くの国の金利が上昇（価格は下落）する中、多くの組入通貨に対し円安現地通貨高となったこと等がプラスに寄与した一方、国内での新型コロナウイルス感染再拡大に伴い国内株式市場が下落したことがマイナスに寄与し、基準価額は下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
高金利ソブリン・マザーファンド	1.2%
日経225インデックスファンド・マザーファンド	△4.3%
インデックス225 マザーファンド	△4.4%

(注) インデックス225 マザーファンドは2021年6月3日より組入れております。

1 万口当たりの費用明細

項目	第172期～第177期		項目の概要
	(2021年2月9日～2021年8月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	50円	0.578%	(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8,718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)	(24)	(0.275)	
(販売会社)	(24)	(0.275)	
(受託会社)	(2)	(0.027)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	1	0.017	(c) 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)	(0.016)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	52	0.596	

(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、売買委託手数料およびその他費用は、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。

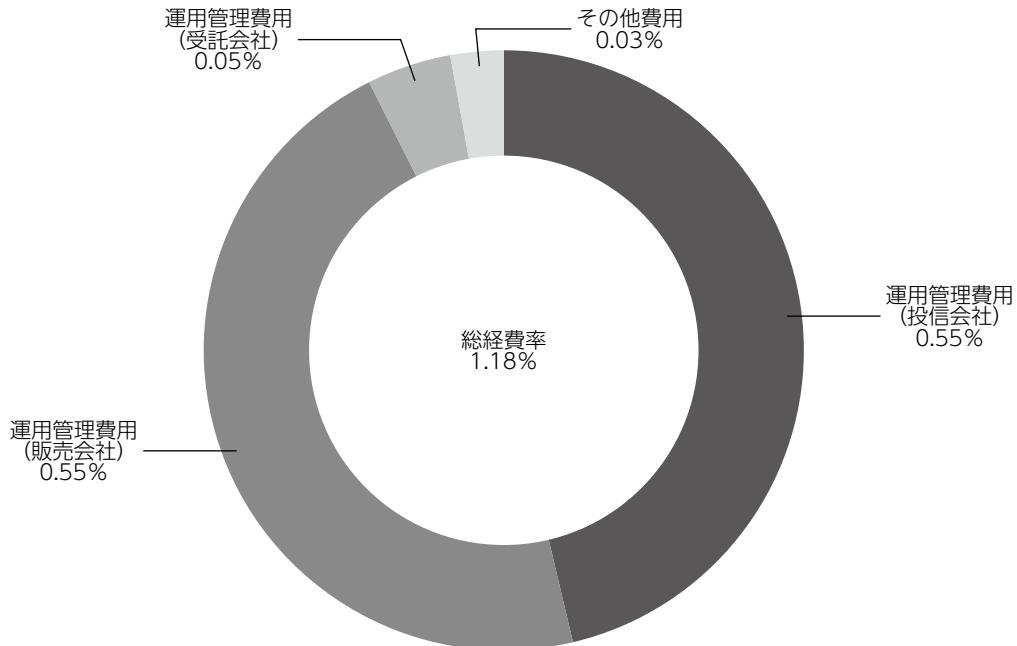
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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

当作成期中の運用・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1.18%です。



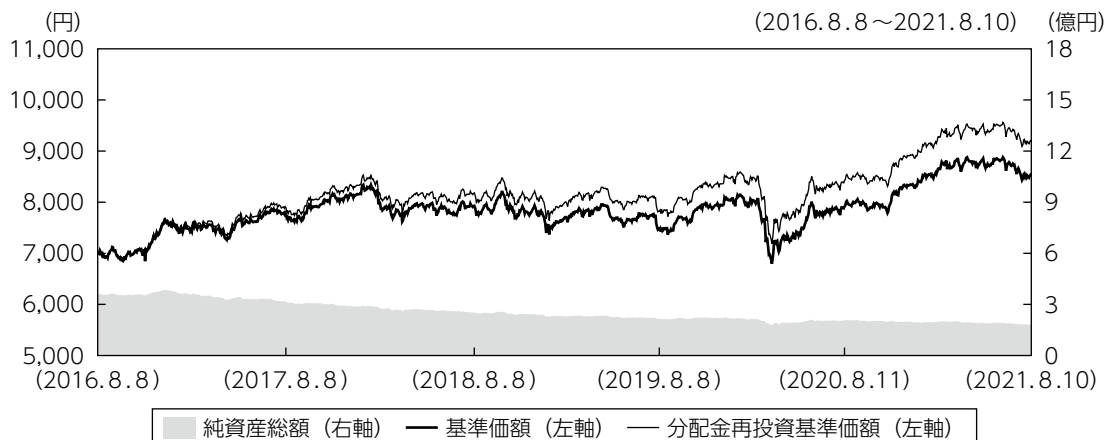
（注1）1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

（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。

最近5年間の基準価額等の推移



- (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、2016年8月8日の基準価額に合わせて指数化しています。

	2016年8月8日 期首	2017年8月8日 決算日	2018年8月8日 決算日	2019年8月8日 決算日	2020年8月11日 決算日	2021年8月10日 決算日
基準価額 (分配落) (円)	6,970	7,769	7,930	7,467	7,915	8,509
期間分配金合計 (税引前) (円)	—	120	120	120	120	120
分配金再投資基準価額の騰落率 (%)	—	13.3	3.6	△4.4	7.7	9.0
純資産総額 (百万円)	358	317	252	213	205	181

- (注) 当ファンドのコンセプトは、リスク分散を図りながら、国内の株式市場全体と特定の高金利国のエクスポージャーの取得をめざしたものです。前記のコンセプトに適った一般に公表された指数が存在しないため、また当ファンド全体で特定の指数等を意識した運用を行うものではないことから、当ファンドではベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

投資環境

外国債券市場では、各国で新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済制限措置が次第に緩和される等、経済活動の正常化が進んだため、多くの国で債券利回りは上昇しました。消費者物価の上昇が進むポーランドや、中央銀行の見通しなどから早期利上げ観測が強まったノルウェー、ニュージーランド、カナダ、金融政策の正常化が意識された米国などでの利回り上昇が相対的に大きなものとなりました。一方、感染が拡大するタイでは利回りが低下（価格は上昇）しました。

国内株式市場は下落しました。米英での新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による世界的な経済正常化への期待や堅調な国内企業業績などを背景に、2021年2月には、日経平均株価が1990年以来となる3万円台に達しました。しかし、その後は、国内での新型コロナウイルス感染再拡大に伴い、緊急事態宣言の発出・解除が繰り返されたことや米長期金利上昇により米国でのインフレ加速懸念が強く意識されたことなどから、下落基調での推移となりました。

為替市場では多くの通貨に対して円安となりました。ドル/円相場は、米国で金融政策の正常化が意識され米金利が上昇したこと等を背景に、円安ドル高となりました。一方、その他の主要高金利通貨に対しても、経済活動の正常化に対する期待感等から日本を除く多くの国の金利が上昇する中、多くの通貨に対して円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

2021年6月初まで高金利ソブリン・マザーファンド70%、日経225インデックスファンド・マザーファンド30%を基本配分比率とし、概ねこの割合となるよう、各マザーファンドの組入れを行いました。その後、日経225インデックスファンド・マザーファンドが繰上償還することに伴い、約款変更を実施し、投資対象をインデックス225 マザーファンドに切り替え、引き続き、基本配分比率を維持するよう運用しました。

●高金利ソブリン・マザーファンド

原油価格の回復を見込み、ノルウェーやニュージーランドを始めとしたコモディティ通貨を高めの比率としました。一方、英国やポーランドは割高感が見られたことから低めの比率とし、マレーシアやタイは新型コロナウイルスのワクチン接種状況が芳しくないことなどから低めの比率としました。

●日経225インデックスファンド・マザーファンド

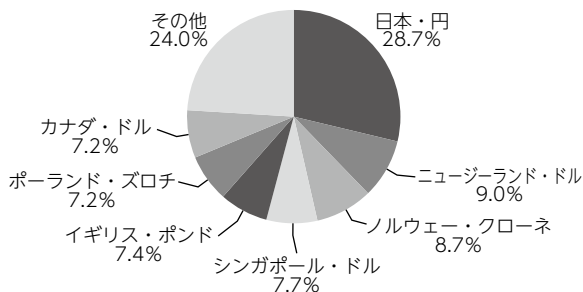
日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。具体的には、日経平均株価の計算手法に合わせて、現物株式では原則として日経平均株価の採用銘柄に等株数投資を行いました。また、連動性を維持するため、日経平均株価指数先物取引を積極的に活用し、株式実質組入比率を高位に保つように努めました。その結果、ファンドの投資成果がほぼ日経平均株価に連動する運用を行うことが出来ました。

なお、2021年6月3日に現物株式をすべて売却し、以降は先物を中心とした運用に切り替えました。

●インデックス225 マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。具体的には、日経平均株価の計算手法に合わせて、現物株式では原則として日経平均株価の採用銘柄に等株数投資を行いました。また、連動性を維持するため、日経平均株価指数先物取引を積極的に活用し、株式実質組入比率を高位に保つように努めました。その結果、ファンドの投資成果がほぼ日経平均株価に連動する運用を行うことが出来ました。

○通貨別構成比



(注1) 比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券評価額に対する割合です。

(注2) 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。

■分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通り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	第172期	第173期	第174期	第175期	第176期	第177期
	2021年2月9日 ～2021年3月8日	2021年3月9日 ～2021年4月8日	2021年4月9日 ～2021年5月10日	2021年5月11日 ～2021年6月8日	2021年6月9日 ～2021年7月8日	2021年7月9日 ～2021年8月10日
当期分配金（税引前）	10円	10円	10円	10円	10円	10円
対基準価額比率	0.12%	0.11%	0.11%	0.11%	0.12%	0.12%
当期の収益	7円	10円	8円	0円	2円	-円
当期の収益以外	2円	-円	1円	9円	7円	10円
翌期繰越分配対象額	231円	244円	243円	234円	226円	216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

外国債券および国内株式に分散投資する商品性の観点から、今後も各資産の基本配分比率を維持するよう、各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率につきましては、高位組入れを維持します。

●高金利ソブリン・マザーファンド

新型コロナウイルスの感染による経済の下押し圧力が、引き続き金融市場のリスク要因となると見ているものの、ワクチン接種の進展などから、そのリスクは後退し、経済回復から金利は上昇、投資通貨は対円で上昇しやすいと見ています。今後も一定の信用格付以上を有する国の中から、為替予約取引の流動性、投資規制、市場規模等を勘案し、相対的に金利の高い通貨を選定し、各国の財政状況やファンダメンタルズ、インフレリスクを注視した運用を継続します。

●日経225インデックスファンド・マザーファンド

2021年9月の繰上償還に向けて、先物の売却を実施し安定運用に切り替える予定です。

●インデックス225 マザーファンド

引き続き、日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行います。原則として日経平均株価の計算手法に合わせて等株数投資を行います。日経平均株価指数先物取引を積極的に活用して株式の実質組入比率を高位に保ちます。最適な取引手法の選択により運用の効率性を高め、取引コストを最小限に抑制することで、日経平均株価と同等の騰落率を実現するように努めます。日経平均株価の構成銘柄が変更される場合にも、指数算出基準に則り適切に対処していく方針です。

お知らせ

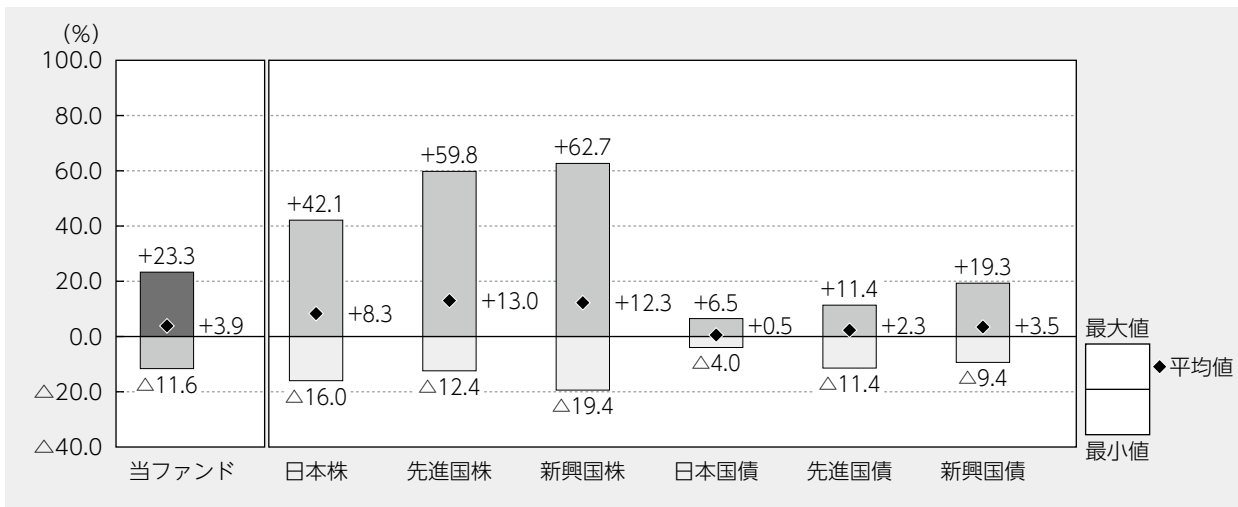
■当ファンドの主要投資対象に「インデックス225 マザーファンド」を追加することに伴い、約款に所要の変更を行いました。

(2021年6月2日)

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2006年9月28日から無期限です。	
運用方針	実質的に外国債券および国内株式を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。	
主要投資対象	D I AMバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	高金利ソブリン・マザーファンド受益証券、日経225インデックスファンド・マザーファンド受益証券およびインデックス225 マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	高金利ソブリン・マザーファンド	高金利国のソブリン債券を主要投資対象とします。
	日経225インデックスファンド・マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	インデックス225マザーファンド	主として東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、原則として、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄の中から200銘柄以上に等株数投資を行います。
運用方法	D I AMバランス・インカム・オープン（毎月分配型）	各マザーファンド受益証券への投資に当たっては、委託会社が独自に定める基本配分比率に従い配分するものとします。 基本配分比率は、市場動向等を勘案し、変更する場合があります。
	高金利ソブリン・マザーファンド	景気・金利・為替動向、財政・金融政策を中心としたファンダメンタルズ分析に基づき、投資対象銘柄の発行規模やポートフォリオの地域分散を考慮した上で、主として高金利国のソブリン債に投資し、収益を追求します。なお、組入対象国および国別配分は特に限定しません。 運用指図に関する権限は、アセットマネジメントOne インターナショナル・リミテッドに委託します。
	日経225インデックスファンド・マザーファンド	原則として日経平均株価（225種・東証）採用銘柄の中から200銘柄以上に等株数投資します。
	インデックス225マザーファンド	日経平均株価（225種・東証）の動きに連動する投資成果をめざした運用を行います。株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。株価指数先物取引等を利用する場合があります。株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。
分配方針	決算日（原則として毎月8日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の利子、配当等収益および売買益（評価益を含む。）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。	

代表的な資産クラスとの騰落率の比較



2016年8月～2021年7月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※各指数については後掲の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

当ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容（2021年8月10日現在）

◆組入ファンド等

（組入ファンド数：3ファンド）

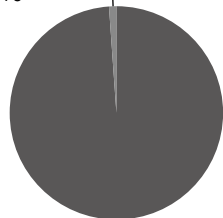
	第177期末
	2021年8月10日
高金利ソブリン・マザーファンド	70.2%
インデックス225 マザーファンド	28.4%
日経225インデックスファンド・マザーファンド	0.3%
その他	1.1%

（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。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

◆資産別配分

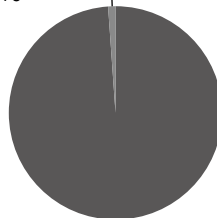
その他
1.1%



親投資信託受益証券
98.9%

◆国別配分

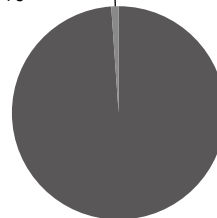
その他
1.1%



日本
98.9%

◆通貨別配分

その他
1.1%



日本・円
98.9%

（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。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

純資産等

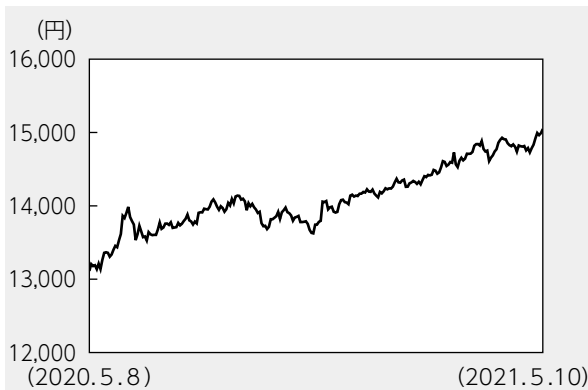
項目	第172期末	第173期末	第174期末	第175期末	第176期末	第177期末
	2021年3月8日	2021年4月8日	2021年5月10日	2021年6月8日	2021年7月8日	2021年8月10日
純資産総額	198,409,300円	193,860,904円	192,037,442円	191,389,383円	185,127,669円	181,852,118円
受益権総口数	228,779,594口	220,301,475口	216,829,221口	216,964,827口	214,951,169口	213,712,702口
1万口当たり基準価額	8,673円	8,800円	8,857円	8,821円	8,613円	8,509円

（注）当作成期間（第172期～第177期）中における追加設定元本額は524,903円、同解約元本額は15,844,810円です。

組入ファンドの概要

[高金利ソブリン・マザーファンド]（計算期間 2020年5月9日～2021年5月10日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄

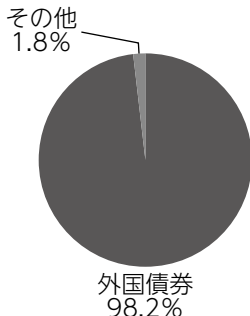
銘柄名	通貨	比率
NORWAY 1.5 02/19/26	ノルウェー・クローネ	12.1%
UK TREASURY 0.625 06/07/25	イギリス・ポンド	10.4
SINGAPORE 2.375 06/01/25	シンガポール・ドル	10.3
US T N/B 0.375 04/30/25	アメリカ・ドル	9.9
CANADA 1.25 03/01/25	カナダ・ドル	9.7
POLAND 2.5 07/25/26	ポーランド・ズロチ	9.2
THAILAND 1.45 12/17/24	タイ・バーツ	8.8
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	ニュージーランド・ドル	7.7
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	オーストラリア・ドル	5.6
MALAYSIA 3.906 07/15/26	マレーシア・リンギット	4.7
組入銘柄数	13銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

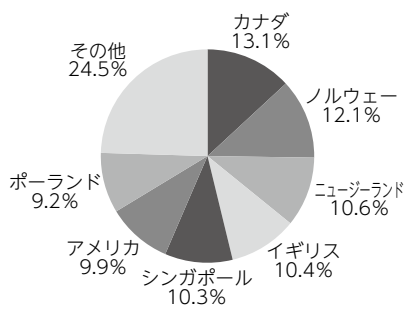
項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用 (保管費用) (その他)	7円 (7) (0)	0.047% (0.047) (0.000)
合計	7	0.047

期中の平均基準価額は14,111円です。

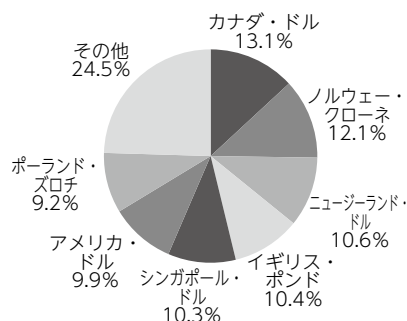
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 「1万口当たりの費用明細」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

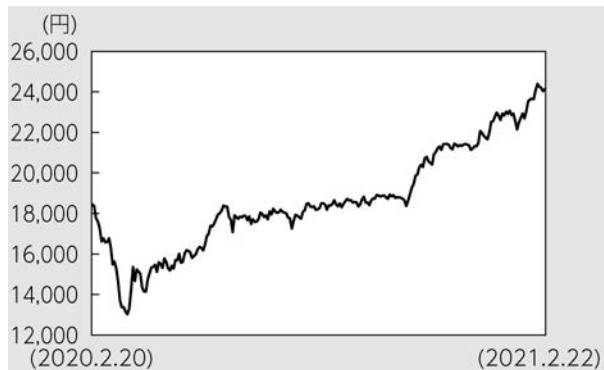
(注6) 国別配分は発行国（地域）を表示しています。

(注7) 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。

(注8) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

[インデックス225 マザーファンド] (計算期間 2020年2月21日～2021年2月22日)

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄 (現物)

銘柄名	通貨	比率
ファーストリテイリング	日本・円	12.2%
ソフトバンクグループ	日本・円	7.4
東京エレクトロン	日本・円	5.4
ファナック	日本・円	3.2
ダイキン工業	日本・円	2.6
エムスリー	日本・円	2.5
KDDI	日本・円	2.4
アドバンテス	日本・円	2.3
信越化学工業	日本・円	2.2
テルモ	日本・円	2.0
組入銘柄数	225銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

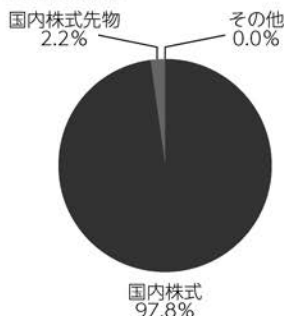
項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株式)	1円 (0)	0.005% (0.002)
(先物・オプション)	(1)	(0.003)
合計	1	0.005

期中の平均基準価額は18,650円です。

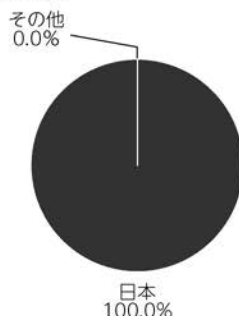
◆組入上位銘柄 (先物)

銘柄名	売買	比率
日経平均	買建	2.2%
組入銘柄数	1銘柄	

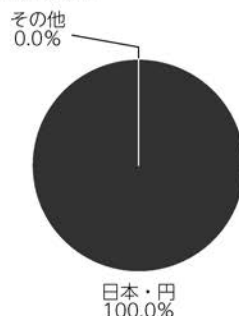
◆資産別配分



◆国別配分



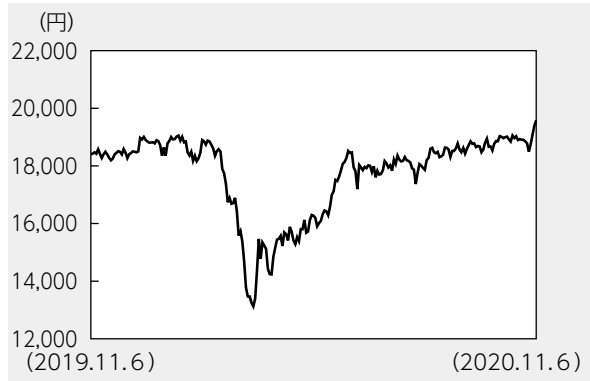
◆通貨別配分



- (注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。
 (注2) 「1万口当たりの費用明細」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。
 (注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。
 (注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。
 (注5) 国別配分、通貨別配分については、現物と先物の比率を合計して表示しています。
 (注6) その他は、純資産総額を100%として、現物と先物の比率を差し引いたものです。
 (注7) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

【日経225インデックスファンド・マザーファンド】

◆基準価額の推移



(計算期間 2019年11月7日～2020年11月6日)

◆組入上位10銘柄（現物）

銘柄名	通貨	比率
ファーストリテイリング	日本・円	10.6%
ソフトバンクグループ	日本・円	5.7
東京エレクトロン	日本・円	4.1
ファナック	日本・円	3.2
ダイキン工業	日本・円	3.1
エムスリー	日本・円	2.6
KDDI	日本・円	2.5
テルモ	日本・円	2.3
信越化学工業	日本・円	2.1
リクルートホールディングス	日本・円	1.9
組入銘柄数	225銘柄	

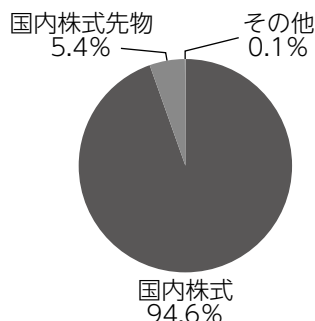
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料	1円	0.004%
(株式)	(0)	(0.001)
(先物・オプション)	(1)	(0.003)
合計	1	0.004

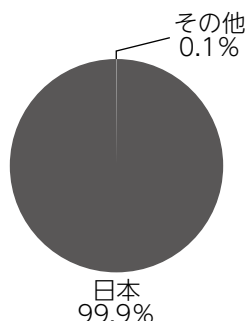
◆組入上位銘柄（先物）

銘柄名	売買	比率
日経225	買建	5.4%
組入銘柄数	1銘柄	

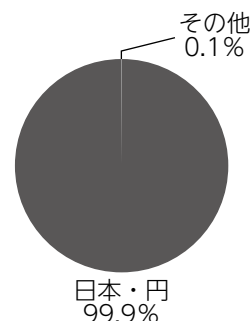
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のもので。

(注2) 1万口当たりの費用明細の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（17,744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2ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 国別配分、通貨別配分については、現物と先物の比率を合計して表示しています。

(注6) その他は、純資産総額を100%として、現物と先物の比率を差し引いたものです。

(注7) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所（株東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

