

償還 運用報告書 (全体版)

DIAMバランス・インカム・オープン(毎月分配型)

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 / 内外 / 資産複合	
信託期間	2006年9月28日から2024年2月8日(当初無期限)までです。	
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	DIAM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	高金利国債のソブリン債券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	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、日経平均株価(225種・東証)に採用されている(または採用予定の)銘柄を主要投資対象とします。
運用方法	DIAM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、主として高金利国債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。
	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。
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。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。	

第202期	<決算日	2023年9月8日>
第203期	<決算日	2023年10月10日>
第204期	<決算日	2023年11月8日>
第205期	<決算日	2023年12月8日>
第206期	<決算日	2024年1月9日>
第207期	<償還日	2024年2月8日>

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バランス・インカム・オープン(毎月分配型)」は、この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容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/>

DIAMバランス・インカム・オープン（毎月分配型）

■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額 (分配落)	標準額		株式比率	株先比率	債券比率	債券比率	債券比率	純資産額
			税込み 分配金	騰落率						
第1作成期	(設定日) 2006年9月28日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 1,044
	1期(2006年12月8日)	10,216	100	3.2	28.4	1.5	67.4	-	1,429	
	2期(2007年1月9日)	10,241	200	2.2	29.3	0.6	67.6	-	1,599	
	3期(2007年2月8日)	10,307	70	1.3	28.2	0.5	67.1	-	2,238	
第2作成期	4期(2007年3月8日)	9,957	25	△3.2	28.8	1.5	66.9	-	2,806	
	5期(2007年4月9日)	10,412	125	5.8	28.9	0.7	67.6	-	3,416	
	6期(2007年5月8日)	10,572	25	1.8	29.2	0.6	66.3	-	3,751	
	7期(2007年6月8日)	10,464	50	△0.5	29.1	0.9	67.5	-	3,885	
	8期(2007年7月9日)	10,738	125	3.8	29.0	0.5	65.4	-	4,068	
	9期(2007年8月8日)	10,237	25	△4.4	29.4	0.3	67.6	-	4,030	
第3作成期	10期(2007年9月10日)	9,543	25	△6.5	28.9	0.5	67.0	-	3,825	
	11期(2007年10月9日)	10,135	275	9.1	28.9	0.6	65.6	-	4,081	
	12期(2007年11月8日)	9,839	25	△2.7	27.8	0.7	68.8	-	3,994	
	13期(2007年12月10日)	9,678	25	△1.4	29.3	0.8	67.0	-	3,929	
	14期(2008年1月8日)	9,235	25	△4.3	28.2	0.7	66.4	-	3,752	
	15期(2008年2月8日)	8,799	25	△4.5	28.5	1.0	67.1	-	3,502	
第4作成期	16期(2008年3月10日)	8,574	25	△2.3	27.8	1.0	67.2	-	3,405	
	17期(2008年4月8日)	8,848	25	3.5	28.7	0.9	66.6	-	3,394	
	18期(2008年5月8日)	9,021	25	2.2	29.5	0.9	65.4	-	3,450	
	19期(2008年6月9日)	9,087	25	1.0	29.5	0.7	66.0	-	3,470	
	20期(2008年7月8日)	9,054	25	△0.1	27.5	0.9	68.9	-	3,410	
	21期(2008年8月8日)	9,198	25	1.9	28.4	0.9	67.6	-	3,398	
第5作成期	22期(2008年9月8日)	8,559	25	△6.7	29.5	0.6	66.3	-	3,127	
	23期(2008年10月8日)	7,092	25	△16.8	25.7	0.9	68.8	-	2,550	
	24期(2008年11月10日)	6,504	25	△7.9	29.2	1.2	63.8	-	2,314	
	25期(2008年12月8日)	5,868	25	△9.4	29.4	1.1	66.1	-	2,082	
	26期(2009年1月8日)	6,249	25	6.9	28.0	0.8	67.6	-	2,187	
	27期(2009年2月9日)	5,765	25	△7.3	27.4	0.8	68.1	-	2,004	
第6作成期	28期(2009年3月9日)	5,615	25	△2.2	27.1	0.8	66.7	-	1,936	
	29期(2009年4月8日)	6,458	25	15.5	28.0	1.1	67.4	-	2,206	
	30期(2009年5月8日)	6,744	25	4.8	28.3	1.6	66.2	-	2,312	
	31期(2009年6月8日)	6,931	25	3.1	28.9	1.0	65.7	-	2,365	
	32期(2009年7月8日)	6,655	25	△3.6	28.0	1.1	67.2	-	2,262	
	33期(2009年8月10日)	7,190	25	8.4	29.1	1.1	66.3	-	2,434	

作成期	決算期	基準価額			株組比	式入率	株先比	式物率	債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
		(分配)	税分	込み									
第7作成期	34期 (2009年9月8日)	円 7,012	円 25	% △2.1	% 28.4	% 0.8	% 66.1	% -	百万円 2,307				
	35期 (2009年10月8日)	6,789	25	△2.8	28.3	0.9	67.9	-	2,194				
	36期 (2009年11月9日)	6,872	25	1.6	27.7	1.2	67.8	-	2,207				
	37期 (2009年12月8日)	6,927	25	1.2	29.1	0.8	67.2	-	2,215				
	38期 (2010年1月8日)	7,189	25	4.1	29.1	1.1	66.7	-	2,263				
	39期 (2010年2月8日)	6,600	25	△7.8	28.6	1.0	66.2	-	2,041				
第8作成期	40期 (2010年3月8日)	6,898	25	4.9	28.3	1.4	66.4	-	2,075				
	41期 (2010年4月8日)	7,206	25	4.8	27.4	1.8	66.8	-	2,066				
	42期 (2010年5月10日)	6,828	25	△4.9	27.7	2.0	67.2	-	1,939				
	43期 (2010年6月8日)	6,386	25	△6.1	27.1	1.9	66.2	-	1,797				
	44期 (2010年7月8日)	6,414	25	0.8	27.2	1.3	66.7	-	1,788				
	45期 (2010年8月9日)	6,486	25	1.5	27.8	1.4	68.2	-	1,778				
第9作成期	46期 (2010年9月8日)	6,206	25	△3.9	27.9	0.9	67.1	-	1,675				
	47期 (2010年10月8日)	6,500	25	5.1	27.5	1.8	67.1	-	1,720				
	48期 (2010年11月8日)	6,551	25	1.2	26.3	3.7	67.0	-	1,706				
	49期 (2010年12月8日)	6,554	25	0.4	26.6	3.0	67.2	-	1,665				
	50期 (2011年1月11日)	6,584	25	0.8	25.7	3.9	67.7	-	1,645				
	51期 (2011年2月8日)	6,607	25	0.7	27.4	2.3	67.5	-	1,605				
第10作成期	52期 (2011年3月8日)	6,614	25	0.5	24.6	4.0	68.1	-	1,580				
	53期 (2011年4月8日)	6,747	25	2.4	24.9	4.3	68.1	-	1,576				
	54期 (2011年5月9日)	6,564	25	△2.3	25.7	4.4	66.8	-	1,518				
	55期 (2011年6月8日)	6,523	25	△0.2	25.5	3.6	67.6	-	1,489				
	56期 (2011年7月8日)	6,721	25	3.4	23.9	5.8	67.4	-	1,509				
	57期 (2011年8月8日)	6,288	25	△6.1	24.2	4.1	68.6	-	1,394				
第11作成期	58期 (2011年9月8日)	6,161	25	△1.6	25.1	4.4	67.4	-	1,347				
	59期 (2011年10月11日)	5,882	25	△4.1	25.7	3.5	67.6	-	1,259				
	60期 (2011年11月8日)	5,950	25	1.6	23.0	6.2	68.5	-	1,244				
	61期 (2011年12月8日)	5,859	25	△1.1	23.2	6.0	68.0	-	1,169				
	62期 (2012年1月10日)	5,668	25	△2.8	24.0	5.3	67.6	-	1,108				
	63期 (2012年2月8日)	5,999	25	6.3	26.3	3.6	67.6	-	1,093				
第12作成期	64期 (2012年3月8日)	6,319	25	5.8	23.3	5.5	67.3	-	1,127				
	65期 (2012年4月9日)	6,228	25	△1.0	25.0	4.3	66.7	-	1,091				
	66期 (2012年5月8日)	6,078	25	△2.0	24.8	4.2	67.7	-	1,058				
	67期 (2012年6月8日)	5,731	25	△5.3	24.6	4.3	68.1	-	982				
	68期 (2012年7月9日)	5,840	25	2.3	21.4	7.6	67.8	-	989				
	69期 (2012年8月8日)	5,877	25	1.1	21.8	7.8	67.7	-	969				

作成期	決算期	基準価額			株組比	式入率	株先比	式物率	債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
		(分配)	税込	み									
		円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
第13作成期	70期 (2012年 9月10日)	5,900	25	0.8	22.5	6.4	68.3	-	-	-	-	-	958
	71期 (2012年10月 9日)	5,882	25	0.1	22.9	6.7	67.7	-	-	-	-	-	933
	72期 (2012年11月 8日)	5,955	25	1.7	22.6	6.5	68.8	-	-	-	-	-	924
	73期 (2012年12月10日)	6,257	25	5.5	23.7	6.1	67.9	-	-	-	-	-	942
	74期 (2013年 1月 8日)	6,722	25	7.8	24.8	4.8	67.7	-	-	-	-	-	990
	75期 (2013年 2月 8日)	7,152	25	6.8	24.6	4.6	68.5	-	-	-	-	-	1,034
第14作成期	76期 (2013年 3月 8日)	7,354	25	3.2	20.8	8.8	67.5	-	-	-	-	-	1,048
	77期 (2013年 4月 8日)	7,779	25	6.1	21.7	7.9	68.1	-	-	-	-	-	1,066
	78期 (2013年 5月 8日)	8,012	25	3.3	24.3	5.5	67.7	-	-	-	-	-	1,077
	79期 (2013年 6月10日)	7,588	25	△5.0	18.7	10.4	68.0	-	-	-	-	-	948
	80期 (2013年 7月 8日)	7,607	25	0.6	20.1	10.2	67.4	-	-	-	-	-	939
	81期 (2013年 8月 8日)	7,401	25	△2.4	19.7	9.1	68.6	-	-	-	-	-	870
第15作成期	82期 (2013年 9月 9日)	7,489	25	1.5	28.8	1.4	67.6	-	-	-	-	-	865
	83期 (2013年10月 8日)	7,472	25	0.1	26.6	1.8	68.9	-	-	-	-	-	845
	84期 (2013年11月 8日)	7,545	25	1.3	28.5	1.8	68.3	-	-	-	-	-	827
	85期 (2013年12月 9日)	8,002	25	6.4	20.9	8.7	67.8	-	-	-	-	-	857
	86期 (2014年 1月 8日)	8,089	25	1.4	24.9	5.3	67.4	-	-	-	-	-	827
	87期 (2014年 2月10日)	7,734	25	△4.1	22.6	6.1	68.5	-	-	-	-	-	776
第16作成期	88期 (2014年 3月10日)	7,898	25	2.4	24.6	3.9	66.5	-	-	-	-	-	777
	89期 (2014年 4月 8日)	7,835	25	△0.5	24.0	4.7	67.8	-	-	-	-	-	755
	90期 (2014年 5月 8日)	7,742	25	△0.9	23.8	4.7	68.7	-	-	-	-	-	738
	91期 (2014年 6月 9日)	7,929	25	2.7	24.5	4.5	67.3	-	-	-	-	-	733
	92期 (2014年 7月 8日)	7,889	25	△0.2	23.2	6.2	67.4	-	-	-	-	-	717
	93期 (2014年 8月 8日)	7,733	25	△1.7	22.9	5.8	68.3	-	-	-	-	-	686
第17作成期	94期 (2014年 9月 8日)	8,011	25	3.9	23.8	6.0	68.1	-	-	-	-	-	690
	95期 (2014年10月 8日)	7,992	25	0.1	24.6	4.1	68.0	-	-	-	-	-	655
	96期 (2014年11月10日)	8,390	25	5.3	22.6	6.4	66.9	-	-	-	-	-	653
	97期 (2014年12月 8日)	8,773	20	4.8	24.5	5.3	68.0	-	-	-	-	-	624
	98期 (2015年 1月 8日)	8,431	20	△3.7	21.0	8.0	67.4	-	-	-	-	-	568
	99期 (2015年 2月 9日)	8,367	20	△0.5	22.9	6.9	67.8	-	-	-	-	-	552
第18作成期	100期 (2015年 3月 9日)	8,479	20	1.6	25.4	5.8	66.0	-	-	-	-	-	547
	101期 (2015年 4月 8日)	8,670	20	2.5	22.3	8.8	66.2	-	-	-	-	-	553
	102期 (2015年 5月 8日)	8,575	20	△0.9	22.0	7.4	67.4	-	-	-	-	-	538
	103期 (2015年 6月 8日)	8,799	20	2.8	23.2	7.3	67.3	-	-	-	-	-	524
	104期 (2015年 7月 8日)	8,521	20	△2.9	24.4	5.5	68.3	-	-	-	-	-	502
	105期 (2015年 8月10日)	8,649	20	1.7	25.5	5.8	66.8	-	-	-	-	-	506

作成期	決算期	基準価額			株組比	式入率	株先比	式物率	債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
		(分配)	税分	込配									
第19作成期	106期 (2015年 9月 8日)	円 7,796	円 20	% △9.6	% 24.0	% 5.5	% 67.9	% -	百万円 443				
	107期 (2015年10月 8日)	8,036	20	3.3	22.9	6.3	68.3	-	454				
	108期 (2015年11月 9日)	8,237	20	2.8	24.4	6.7	66.7	-	461				
	109期 (2015年12月 8日)	8,246	20	0.4	23.1	5.8	69.5	-	455				
	110期 (2016年 1月 8日)	7,670	15	△6.8	22.9	5.5	69.0	-	422				
	111期 (2016年 2月 8日)	7,617	15	△0.5	22.9	4.5	69.0	-	419				
第20作成期	112期 (2016年 3月 8日)	7,487	15	△1.5	25.5	2.6	69.2	-	405				
	113期 (2016年 4月 8日)	7,250	15	△3.0	24.6	3.1	68.8	-	390				
	114期 (2016年 5月 9日)	7,207	15	△0.4	25.1	3.6	69.1	-	385				
	115期 (2016年 6月 8日)	7,260	15	0.9	25.8	3.8	67.5	-	388				
	116期 (2016年 7月 8日)	6,725	10	△7.2	23.4	4.4	68.5	-	355				
	117期 (2016年 8月 8日)	6,970	10	3.8	26.0	4.3	67.7	-	358				
第21作成期	118期 (2016年 9月 8日)	7,050	10	1.3	26.1	3.9	67.3	-	362				
	119期 (2016年10月11日)	7,017	10	△0.3	26.0	3.6	67.5	-	356				
	120期 (2016年11月 8日)	7,050	10	0.6	23.4	5.9	67.4	-	357				
	121期 (2016年12月 8日)	7,450	10	5.8	25.2	5.1	66.6	-	378				
	122期 (2017年 1月10日)	7,518	10	1.0	26.3	3.9	67.0	-	372				
	123期 (2017年 2月 8日)	7,440	10	△0.9	24.7	4.6	67.5	-	358				
第22作成期	124期 (2017年 3月 8日)	7,502	10	1.0	23.6	5.2	69.1	-	349				
	125期 (2017年 4月10日)	7,414	10	△1.0	25.4	3.9	68.6	-	337				
	126期 (2017年 5月 8日)	7,608	10	2.8	24.1	6.5	66.1	-	341				
	127期 (2017年 6月 8日)	7,611	10	0.2	23.9	5.3	67.6	-	330				
	128期 (2017年 7月10日)	7,845	10	3.2	23.4	5.9	68.3	-	333				
	129期 (2017年 8月 8日)	7,769	10	△0.8	28.0	2.6	67.5	-	317				
第23作成期	130期 (2017年 9月 8日)	7,658	10	△1.3	24.9	4.5	67.8	-	302				
	131期 (2017年10月10日)	7,902	10	3.3	27.4	2.9	66.9	-	306				
	132期 (2017年11月 8日)	8,138	10	3.1	24.2	5.3	68.3	-	300				
	133期 (2017年12月 8日)	8,137	10	0.1	24.3	6.0	66.8	-	290				
	134期 (2018年 1月 9日)	8,340	10	2.6	27.8	2.2	67.7	-	292				
	135期 (2018年 2月 8日)	7,977	10	△4.2	24.5	3.4	68.9	-	279				
第24作成期	136期 (2018年 3月 8日)	7,760	10	△2.6	24.5	4.1	68.4	-	266				
	137期 (2018年 4月 9日)	7,872	10	1.6	25.2	3.7	68.4	-	270				
	138期 (2018年 5月 8日)	7,885	10	0.3	26.1	4.2	66.3	-	267				
	139期 (2018年 6月 8日)	7,882	10	0.1	26.9	2.5	67.3	-	263				
	140期 (2018年 7月 9日)	7,836	10	△0.5	26.7	2.2	67.7	-	260				
	141期 (2018年 8月 8日)	7,930	10	1.3	26.7	2.4	68.0	-	252				

作成期	決算期	基準価額			株組比	式入率	株先比	式物率	債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
		(分配)	税分	込配									
第25作成期	142期 (2018年9月10日)	円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
	143期 (2018年10月9日)	7,782	10	△1.7	26.1	3.4	67.0	-	-	-	-	246	
	144期 (2018年11月8日)	7,978	10	2.6	25.6	3.9	67.6	-	-	-	-	250	
	145期 (2018年12月10日)	7,916	10	△0.7	25.9	2.8	68.0	-	-	-	-	246	
	146期 (2019年1月8日)	7,734	10	△2.2	23.9	4.2	68.7	-	-	-	-	237	
	147期 (2019年2月8日)	7,517	10	△2.7	23.3	4.3	69.4	-	-	-	-	230	
第26作成期	148期 (2019年3月8日)	7,607	10	1.3	25.2	2.9	69.6	-	-	-	-	227	
	149期 (2019年4月8日)	7,729	10	1.7	25.5	3.3	68.0	-	-	-	-	230	
	149期 (2019年4月8日)	7,858	10	1.8	26.6	3.2	65.1	-	-	-	-	231	
	150期 (2019年5月8日)	7,753	10	△1.2	27.4	1.9	67.3	-	-	-	-	227	
	151期 (2019年6月10日)	7,669	10	△1.0	24.8	4.4	68.2	-	-	-	-	223	
	152期 (2019年7月8日)	7,743	10	1.1	26.3	2.6	69.0	-	-	-	-	222	
第27作成期	153期 (2019年8月8日)	7,467	10	△3.4	23.9	4.8	68.4	-	-	-	-	213	
	154期 (2019年9月9日)	7,590	10	1.8	25.8	3.5	67.7	-	-	-	-	217	
	155期 (2019年10月8日)	7,642	10	0.8	25.5	3.2	68.7	-	-	-	-	215	
	156期 (2019年11月8日)	7,974	10	4.5	28.1	1.9	67.5	-	-	-	-	223	
	157期 (2019年12月9日)	7,936	10	△0.4	28.2	2.4	66.9	-	-	-	-	220	
	158期 (2020年1月8日)	7,920	10	△0.1	26.5	2.8	67.7	-	-	-	-	214	
第28作成期	159期 (2020年2月10日)	7,989	10	1.0	26.1	4.0	67.6	-	-	-	-	212	
	160期 (2020年3月9日)	7,219	10	△9.5	26.5	1.6	69.1	-	-	-	-	189	
	161期 (2020年4月8日)	7,272	10	0.9	26.9	1.9	66.3	-	-	-	-	191	
	162期 (2020年5月8日)	7,365	10	1.4	28.3	1.5	65.4	-	-	-	-	193	
	163期 (2020年6月8日)	8,010	10	8.9	28.8	2.6	66.1	-	-	-	-	210	
	164期 (2020年7月8日)	7,819	10	△2.3	27.1	2.8	65.8	-	-	-	-	204	
第29作成期	165期 (2020年8月11日)	7,915	10	1.4	27.7	2.4	67.2	-	-	-	-	205	
	166期 (2020年9月8日)	7,998	10	1.2	26.3	2.7	68.1	-	-	-	-	204	
	167期 (2020年10月8日)	7,972	10	△0.2	27.5	2.3	67.3	-	-	-	-	203	
	168期 (2020年11月9日)	8,027	10	0.8	27.9	2.7	67.1	-	-	-	-	203	
	169期 (2020年12月8日)	8,291	10	3.4	25.0	2.5	68.6	-	-	-	-	197	
	170期 (2021年1月8日)	8,518	10	2.9	25.8	1.9	70.4	-	-	-	-	195	
第30作成期	171期 (2021年2月8日)	8,654	10	1.7	26.8	1.8	67.5	-	-	-	-	198	
	172期 (2021年3月8日)	8,673	10	0.3	26.7	1.1	68.8	-	-	-	-	198	
	173期 (2021年4月8日)	8,800	10	1.6	27.2	1.9	69.1	-	-	-	-	193	
	174期 (2021年5月10日)	8,857	10	0.8	27.1	1.6	69.0	-	-	-	-	192	
	175期 (2021年6月8日)	8,821	10	△0.3	27.3	0.5	68.7	-	-	-	-	191	
	176期 (2021年7月8日)	8,613	10	△2.2	27.5	0.9	68.5	-	-	-	-	185	
177期 (2021年8月10日)	8,509	10	△1.1	27.9	0.8	69.2	-	-	-	-	181		

作成期	決算期	基準価額			株式組 比率	株式入 率	株式先 物率	債券組 比率	債券入 率	債券先 物率	純資 産額
		(分配落)	税込 分配 金	期騰 落 率							
第31作成期	178期 (2021年 9月 8日)	円 8,753	円 10	% 3.0	% 30.1	% 0.7	% 67.1	% -	百万円 180		
	179期 (2021年10月 8日)	8,527	10	△2.5	28.0	1.0	68.6	-	174		
	180期 (2021年11月 8日)	8,706	10	2.2	28.9	0.7	68.4	-	177		
	181期 (2021年12月 8日)	8,475	10	△2.5	28.1	0.5	69.5	-	166		
	182期 (2022年 1月11日)	8,494	10	0.3	28.0	0.4	68.8	-	163		
	183期 (2022年 2月 8日)	8,380	10	△1.2	27.1	0.7	68.7	-	161		
第32作成期	184期 (2022年 3月 8日)	8,056	10	△3.7	26.1	0.5	70.4	-	153		
	185期 (2022年 4月 8日)	8,557	10	6.3	26.6	0.8	69.3	-	163		
	186期 (2022年 5月 9日)	8,448	10	△1.2	26.6	0.7	69.0	-	160		
	187期 (2022年 6月 8日)	8,815	5	4.4	27.8	0.4	68.8	-	166		
	188期 (2022年 7月 8日)	8,584	5	△2.6	27.5	0.4	69.3	-	157		
	189期 (2022年 8月 8日)	8,801	5	2.6	28.6	0.4	68.8	-	161		
第33作成期	190期 (2022年 9月 8日)	8,960	5	1.9	26.5	0.6	69.4	-	160		
	191期 (2022年10月11日)	8,509	5	△5.0	27.2	0.4	69.2	-	150		
	192期 (2022年11月 8日)	8,821	5	3.7	27.7	0.5	68.8	-	155		
	193期 (2022年12月 8日)	8,681	5	△1.5	27.8	0.6	68.0	-	152		
	194期 (2023年 1月10日)	8,454	5	△2.6	27.3	0.5	68.7	-	148		
	195期 (2023年 2月 8日)	8,527	5	0.9	28.4	0.7	67.7	-	149		
第34作成期	196期 (2023年 3月 8日)	8,654	5	1.5	29.5	0.5	67.1	-	149		
	197期 (2023年 4月10日)	8,650	5	0.0	28.7	0.8	67.9	-	149		
	198期 (2023年 5月 8日)	8,926	5	3.2	28.6	1.0	67.5	-	154		
	199期 (2023年 6月 8日)	9,151	5	2.6	28.3	0.8	67.9	-	153		
	200期 (2023年 7月10日)	9,314	5	1.8	28.8	0.6	67.8	-	154		
	201期 (2023年 8月 8日)	9,428	5	1.3	28.2	0.6	68.7	-	153		
第35作成期	202期 (2023年 9月 8日)	9,410	5	△0.1	29.0	0.5	67.7	-	150		
	203期 (2023年10月10日)	9,348	5	△0.6	28.6	0.6	68.0	-	149		
	204期 (2023年11月 8日)	9,530	5	2.0	28.5	0.6	68.4	-	152		
	205期 (2023年12月 8日)	9,399	5	△1.3	27.6	0.8	67.1	-	140		
	206期 (2024年 1月 9日)	9,703	5	3.3	28.8	0.7	66.6	-	140		
	(償還日) 2024年 2月 8日	(償還価額) 9,923.26	0	2.3	-	-	-	-	143		

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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4) 株式組入比率は、新株予約権証券を含みます。

(注5) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注6) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注7) 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合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。

(注8) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当作成期中の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		円	騰 落 率				
第202期	(期首) 2023年8月8日	9,428	—	28.2	0.6	68.7	—
	8月末	9,501	0.8	28.4	0.7	68.5	—
	(期末) 2023年9月8日	9,415	△0.1	29.0	0.5	67.7	—
第203期	(期首) 2023年9月8日	9,410	—	29.0	0.5	67.7	—
	9月末	9,396	△0.1	28.3	0.8	68.1	—
	(期末) 2023年10月10日	9,353	△0.6	28.6	0.6	68.0	—
第204期	(期首) 2023年10月10日	9,348	—	28.6	0.6	68.0	—
	10月末	9,273	△0.8	28.0	0.5	68.6	—
	(期末) 2023年11月8日	9,535	2.0	28.5	0.6	68.4	—
第205期	(期首) 2023年11月8日	9,530	—	28.5	0.6	68.4	—
	11月末	9,740	2.2	27.5	0.5	68.0	—
	(期末) 2023年12月8日	9,404	△1.3	27.6	0.8	67.1	—
第206期	(期首) 2023年12月8日	9,399	—	27.6	0.8	67.1	—
	12月末	9,701	3.2	28.7	0.6	66.8	—
	(期末) 2024年1月9日	9,708	3.3	28.8	0.7	66.6	—
第207期	(期首) 2024年1月9日	9,703	—	28.8	0.7	66.6	—
	1月末	9,932	2.4	—	—	—	—
	(償還日) 2024年2月8日	(償還価額) 9,923.26	2.3	—	—	—	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

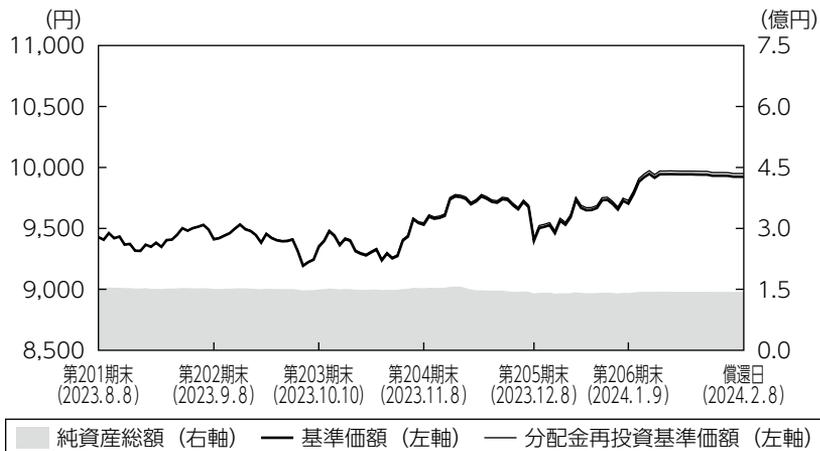
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■設定以来の運用経過（2006年9月28日から2024年2月8日まで）

第35作成期の基準価額等の推移



第202期首： 9,428円
 償還日： 9,923.26円
 (既払分配金25円)
 騰落率： 5.5%
 (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

当作成期は、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から主要通貨に対して円安となったこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内株式市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

当ファンドの基準価額は設定来で71.9%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金4,330円）。

設定後、世界金融危機や欧州債務危機等を背景に株式市場が大きく下落し、また為替市場で円高が進んだことで基準価額が大きく下落する場面が見られたものの、その後は主要中央銀行による金融緩和政策に支えられた世界景気回復等を背景に国内株式市場が上昇したことや、主要中央銀行による金融緩和政策等を背景に世界的に長期金利が低下（債券価格は上昇）したこと等から、基準価額は上昇しました。

◆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	4.3%
インデックス225 マザーファンド	11.0%

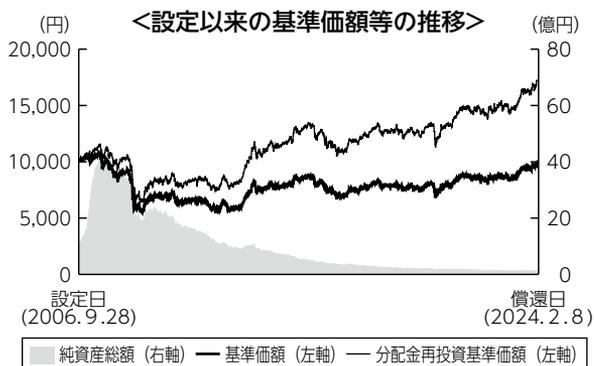
(注) 高金利ソブリン・マザーファンドの騰落率は、当ファンドが保有していた期間（2024年2月7日）まで、インデックス225 マザーファンドの騰落率は、当ファンドが保有していた期間（2024年1月16日）までの騰落率です。

設定来の投資環境

外国債券市場では、設定来は多くの投資国の残存年数5年程度の国債利回りが低下しました。2008年の金融危機発生後、主要先進国の中央銀行が大規模な金融緩和を長期的に実施したことなどを背景に、世界的に債券利回りの低下が大きく進みました。しかし、新型コロナウイルス流行後に主要国の景気回復が見られた2021年以降、中央銀行がインフレ高騰に対応するため大幅な利上げを実施したことなどから、世界的に債券利回りが上昇（債券価格は下落）し、設定来の低下幅は大きく縮小しました。

国内株式市場では、2007年後半から2008年にかけて、サブプライムローン（信用力の低い個人向けの住宅ローン）問題を背景とした米大手金融機関の経営破綻を契機に世界的に金融システム不安が高まり、大幅に下落しました。2013年から2019年にかけては、政府・日銀による積極的な金融緩和策や為替の円安、堅調な企業業績を背景に、上昇基調を辿りました。2020年に入ると新型コロナウイルス感染拡大を背景に、企業業績の先行き不透明感が増して急落しましたが、各国による大規模な金融緩和により市場心理が改善したことから、上昇に転じました。2022年には、インフレ加速により欧米主要国が金融引き締めを進める一方で、円安が進行したことから、一進一退の展開となりました。その後は、インフレが鈍化傾向に転じ、米国経済の底堅さも好感されたことなどから、国内株は一段高の展開となりました。

為替市場では、まちまちの動きとなりました。ドル/円相場は、世界金融危機や欧州債務危機など金融不安が継続する中で、米国の長期金利低下による内外金利差縮小等を背景に大きく円高が進みました。その後は、日銀による大規模な量的緩和政策や世界景気回復に伴い円は反落し、2022年に入ると米国の金融政策の正常化が進む中主要通貨に対して急速にドル高が進み、対円でも急速に円安ドル高が進みました。一方ポンドは、世界金融危機による英国金融機関への打撃やEU（欧州連合）からの離脱等を背景にポンド安が進み対円でもポンド安となるなど、国によってまちまちの動きとなりました。

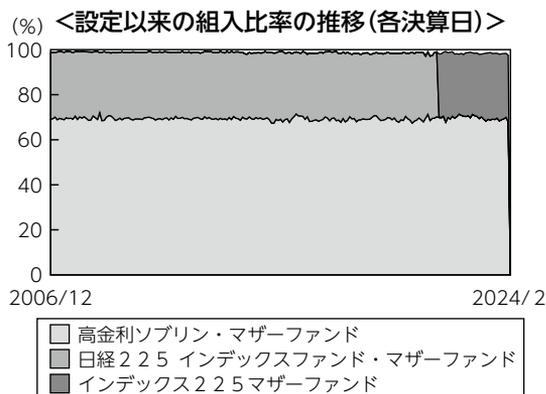


（注1） 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

（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） 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。

（注4） 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。



（注） 組入比率は純資産総額に対する割合です。

設定来の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

投資通貨の選定について、定期的に一定の信用格付を有する国の中から為替市場の流動性、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ました。また、各国の金融政策、財政状況やファンダメンタルズなどを注視し、投資対象国の組入比率と債券デュレーション^{*}の調整を機動的に行いました。

^{*}金利変動に対する債券価格の変動性。

●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、ベンチマークとの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。

●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。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入れ替え等にも適宜対応しました。

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202期	第203期	第204期	第205期	第206期
	2023年8月9日 ～2023年9月8日	2023年9月9日 ～2023年10月10日	2023年10月11日 ～2023年11月8日	2023年11月9日 ～2023年12月8日	2023年12月9日 ～2024年1月9日
当期分配金（税引前）	5円	5円	5円	5円	5円
対基準価額比率	0.05%	0.05%	0.05%	0.05%	0.05%
当期の収益	5円	5円	5円	5円	5円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	305円	323円	331円	349円	362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。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第202期～第207期		項目の概要
	(2023年8月9日 ～2024年2月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	55円	0.580%	(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9,572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)	(26)	(0.276)	
(販売会社)	(26)	(0.276)	
(受託会社)	(3)	(0.027)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(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
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	19	0.203	(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
(保管費用)	(19)	(0.203)	
(監査費用)	(0)	(0.000)	
合計	75	0.783	

(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。

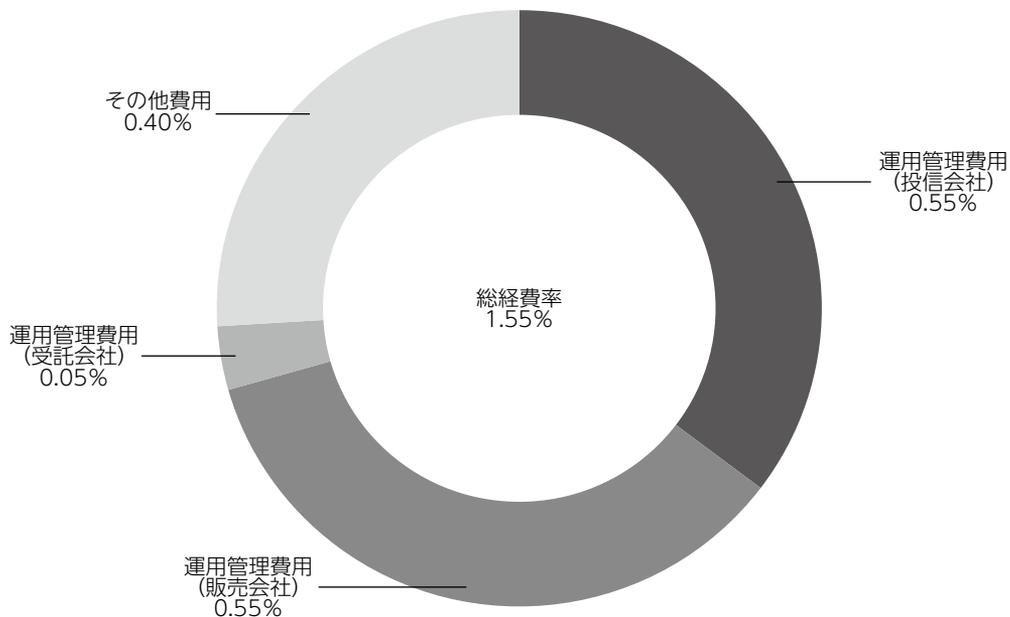
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.55%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8月9日から2024年2月8日まで）

	第 202 期 ~ 第 207 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
高金利ソブリン・マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 64,563	千円 111,393
インデックス225 マザーファンド	-	-	16,280	48,856

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 202 期 ~ 第 207 期
	インデックス225 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	47,940,909千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	152,625,616千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.31

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年8月9日から2024年2月8日まで）

【DIAMバランス・インカム・オープン（毎月分配型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 202 期 ~ 第 207 期
売買委託手数料総額 (A)	0.254千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.254千円
(B) / (A)	100.0%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

【高金利ソブリン・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【インデックス225 マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	第 202 期 ~ 第 207 期			第 202 期 ~ 第 207 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 30,081	百万円 4,485	% 14.9	百万円 17,859	百万円 142	% 0.8
株 式 先 物 取 引	54,043	54,043	100.0	54,220	54,220	100.0

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 202 期 ~ 第 207 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 7	百万円 4	百万円 42

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 202 期 ~ 第 207 期	
	買	付 額
株 式		百万円 21

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あり、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

償還時における有価証券の組入れはありません。第34作成期末の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

	第 34 作 成 期 末	
	□	数
高 金 利 ソ ブ リ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド		千口 64,563
イ ン デ ッ ク ス 2 2 5 マ ザ ー フ ァ ン ド		16,280

■投資信託財産の構成

2024年2月8日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 143,906	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	143,906	100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年9月8日)、(2023年10月10日)、(2023年11月8日)、(2023年12月8日)、(2024年1月9日)、(2024年2月8日)現在

項 目	第 202 期 末	第 203 期 末	第 204 期 末	第 205 期 末	第 206 期 末	償 還 時
(A) 資 産	151,148,963円	150,108,413円	153,115,592円	140,227,427円	141,132,175円	143,906,060円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,275,288	2,998,213	2,872,944	2,517,353	3,714,245	143,906,060
高金利ソブリン・マザーファンド(評価額)	103,222,442	103,334,864	105,889,350	97,993,884	95,846,915	—
インデックス225マザーファンド(評価額)	44,651,233	43,775,336	44,353,298	39,716,190	41,571,015	—
(B) 負 債	229,842	232,510	249,639	216,746	225,812	140,723
未払収益分配金	80,186	80,161	80,202	74,482	72,606	—
未払解約金	119	29	31,770	111	10,924	—
未払信託報酬	149,351	152,128	137,493	141,973	142,282	140,700
未払利息	—	—	—	—	—	23
その他未払費用	186	192	174	180	—	—
(C) 純資産総額(A-B)	150,919,121	149,875,903	152,865,953	140,010,681	140,906,363	143,765,337
元 本	160,373,801	160,323,673	160,405,265	148,965,978	145,213,224	144,877,092
次期繰越損益金	△9,454,680	△10,447,770	△7,539,312	△8,955,297	△4,306,861	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△1,111,755
(D) 受益権総口数	160,373,801口	160,323,673口	160,405,265口	148,965,978口	145,213,224口	144,877,092口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,410円	9,348円	9,530円	9,399円	9,703円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	9,923円26銭

(注) 第201期末における元本額は163,249,434円、第202期～償還時における追加設定元本額は291,082円、同解約元本額は18,663,424円です。

■損益の状況

〔自 2023年8月9日 至 2023年9月8日〕〔自 2023年9月9日 至 2023年10月10日〕〔自 2023年10月11日 至 2023年11月8日〕〔自 2023年11月9日 至 2023年12月8日〕〔自 2023年12月9日 至 2024年1月9日〕〔自 2024年1月10日 至 2024年2月8日〕

項 目	第 202 期	第 203 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期
(A) 配 当 等 収 益	△148円	△110円	△23円	△27円	△44円	△233円
受 取 利 息	4	4	—	2	—	15
支 払 利 息	△152	△114	△23	△29	△44	△248
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△56,808	△763,374	3,131,927	△1,739,085	4,637,674	3,326,072
売 買 益	362,323	112,423	3,132,467	448,781	4,707,856	3,330,063
売 買 損	△419,131	△875,797	△540	△2,187,866	△70,182	△3,991
(C) 信 託 報 酬 等	△149,537	△152,320	△137,667	△142,153	△142,282	△140,700
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△206,493	△915,804	2,994,237	△1,881,265	4,495,348	3,185,139
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△9,096,158	△9,378,629	△10,371,847	△6,920,483	△8,652,004	△4,219,421
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△71,843	△73,176	△81,500	△79,067	△77,599	△77,473
(配当等相当額)	(2,210,065)	(2,209,747)	(2,213,186)	(2,057,741)	(2,006,256)	(2,001,660)
(売買損益相当額)	(△2,281,908)	(△2,282,923)	(△2,294,686)	(△2,136,808)	(△2,083,855)	(△2,079,133)
(G) 合 計 (D+E+F)	△9,374,494	△10,367,609	△7,459,110	△8,880,815	△4,234,255	△1,111,755
(H) 収 益 分 配 金	△80,186	△80,161	△80,202	△74,482	△72,606	—
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△9,454,680	△10,447,770	△7,539,312	△8,955,297	△4,306,861	—
追 加 信 託 差 損 益 金	△71,843	△73,176	△81,500	△79,067	△77,599	—
(配当等相当額)	(2,210,070)	(2,209,766)	(2,213,305)	(2,057,881)	(2,006,264)	(—)
(売買損益相当額)	(△2,281,913)	(△2,282,942)	(△2,294,805)	(△2,136,948)	(△2,083,863)	(—)
償 還 差 損 益 金	—	—	—	—	—	△1,111,755
分 配 準 備 積 立 金	2,695,083	2,971,728	3,100,786	3,149,228	3,255,729	—
繰 越 損 益 金	△12,077,920	△13,346,322	△10,558,598	△12,025,458	△7,484,991	—

(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	第 202 期	第 203 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期
(a) 経費控除後の配当等収益	80,385円	358,014円	210,049円	346,331円	258,660円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	2,210,070	2,209,766	2,213,305	2,057,881	2,006,264
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,694,884	2,693,875	2,970,939	2,877,379	3,069,675
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	4,985,339	5,261,655	5,394,293	5,281,591	5,334,599
(f) 1万口当たり当期分配対象額	310.86	328.19	336.29	354.55	367.36
(g) 分 配 金	80,186	80,161	80,202	74,482	72,606
(h) 1万口当たり分配金	5	5	5	5	5

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 202 期	第 203 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期
1 万口当たり分配金	5円	5円	5円	5円	5円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2006年9月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年2月8日		資産総額	143,906,060円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	140,723円
				純資産総額	143,765,337円
受益権口数	1,044,850,000口	144,877,092口	△899,972,908口	受益権口数	144,877,092口
元本額	1,044,850,000円	144,877,092円	△899,972,908円	1万口当たり償還金	9,923円26銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	1,399,470,000円	1,429,701,170円	10,216円	100円	1.00%
第2期	1,561,670,000	1,599,244,580	10,241	200	2.00
第3期	2,172,300,000	2,238,934,204	10,307	70	0.70
第4期	2,818,290,000	2,806,268,236	9,957	25	0.25
第5期	3,281,690,000	3,416,854,196	10,412	125	1.25
第6期	3,548,753,074	3,751,776,498	10,572	25	0.25
第7期	3,712,864,677	3,885,015,930	10,464	50	0.50
第8期	3,788,774,307	4,068,289,315	10,738	125	1.25
第9期	3,937,530,607	4,030,900,237	10,237	25	0.25
第10期	4,008,580,510	3,825,256,549	9,543	25	0.25
第11期	4,027,344,993	4,081,620,520	10,135	275	2.75
第12期	4,060,009,781	3,994,764,638	9,839	25	0.25
第13期	4,060,948,601	3,929,984,317	9,678	25	0.25
第14期	4,062,933,605	3,752,154,607	9,235	25	0.25
第15期	3,980,440,464	3,502,436,626	8,799	25	0.25
第16期	3,972,307,667	3,405,994,815	8,574	25	0.25
第17期	3,836,333,502	3,394,274,658	8,848	25	0.25
第18期	3,824,452,019	3,450,060,913	9,021	25	0.25
第19期	3,819,233,984	3,470,348,696	9,087	25	0.25
第20期	3,766,956,061	3,410,453,661	9,054	25	0.25
第21期	3,694,719,007	3,398,307,211	9,198	25	0.25
第22期	3,654,746,691	3,127,973,859	8,559	25	0.25
第23期	3,596,536,417	2,550,748,913	7,092	25	0.25
第24期	3,559,299,427	2,314,943,207	6,504	25	0.25
第25期	3,548,061,654	2,082,118,760	5,868	25	0.25
第26期	3,501,345,275	2,187,952,370	6,249	25	0.25
第27期	3,477,782,143	2,004,895,411	5,765	25	0.25
第28期	3,448,403,540	1,936,317,258	5,615	25	0.25

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 29 期	3,417,026,009円	2,206,656,356円	6,458円	25円	0.25%
第 30 期	3,428,923,888	2,312,537,407	6,744	25	0.25
第 31 期	3,412,632,184	2,365,199,441	6,931	25	0.25
第 32 期	3,399,998,747	2,262,643,834	6,655	25	0.25
第 33 期	3,386,270,727	2,434,567,986	7,190	25	0.25
第 34 期	3,291,085,077	2,307,653,082	7,012	25	0.25
第 35 期	3,232,832,532	2,194,612,962	6,789	25	0.25
第 36 期	3,212,629,405	2,207,694,352	6,872	25	0.25
第 37 期	3,197,613,792	2,215,070,246	6,927	25	0.25
第 38 期	3,148,316,996	2,263,408,148	7,189	25	0.25
第 39 期	3,093,182,970	2,041,428,933	6,600	25	0.25
第 40 期	3,009,090,449	2,075,545,896	6,898	25	0.25
第 41 期	2,867,678,821	2,066,558,361	7,206	25	0.25
第 42 期	2,840,802,337	1,939,730,852	6,828	25	0.25
第 43 期	2,814,856,337	1,797,556,375	6,386	25	0.25
第 44 期	2,788,968,075	1,788,928,339	6,414	25	0.25
第 45 期	2,742,313,198	1,778,622,044	6,486	25	0.25
第 46 期	2,700,251,511	1,675,671,731	6,206	25	0.25
第 47 期	2,647,467,969	1,720,794,188	6,500	25	0.25
第 48 期	2,604,504,102	1,706,102,726	6,551	25	0.25
第 49 期	2,540,633,698	1,665,243,730	6,554	25	0.25
第 50 期	2,499,054,909	1,645,256,891	6,584	25	0.25
第 51 期	2,429,992,420	1,605,535,533	6,607	25	0.25
第 52 期	2,389,033,721	1,580,120,852	6,614	25	0.25
第 53 期	2,337,346,793	1,576,908,992	6,747	25	0.25
第 54 期	2,313,704,613	1,518,748,423	6,564	25	0.25
第 55 期	2,283,525,047	1,489,559,377	6,523	25	0.25
第 56 期	2,246,688,673	1,509,921,360	6,721	25	0.25
第 57 期	2,217,023,660	1,394,150,690	6,288	25	0.25
第 58 期	2,186,387,540	1,347,076,968	6,161	25	0.25
第 59 期	2,140,830,607	1,259,315,328	5,882	25	0.25
第 60 期	2,092,319,135	1,244,831,699	5,950	25	0.25
第 61 期	1,996,236,543	1,169,647,091	5,859	25	0.25
第 62 期	1,954,832,020	1,108,056,252	5,668	25	0.25
第 63 期	1,822,839,046	1,093,555,501	5,999	25	0.25
第 64 期	1,784,756,594	1,127,728,072	6,319	25	0.25
第 65 期	1,753,141,061	1,091,798,679	6,228	25	0.25
第 66 期	1,741,965,902	1,058,840,062	6,078	25	0.25

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 67 期	1,713,817,673円	982,158,645円	5,731円	25円	0.25%
第 68 期	1,694,937,201	989,815,452	5,840	25	0.25
第 69 期	1,649,214,861	969,277,350	5,877	25	0.25
第 70 期	1,624,932,246	958,636,915	5,900	25	0.25
第 71 期	1,587,544,372	933,856,094	5,882	25	0.25
第 72 期	1,551,824,139	924,103,193	5,955	25	0.25
第 73 期	1,506,292,270	942,440,720	6,257	25	0.25
第 74 期	1,472,847,639	990,049,471	6,722	25	0.25
第 75 期	1,445,909,918	1,034,078,664	7,152	25	0.25
第 76 期	1,425,416,629	1,048,188,357	7,354	25	0.25
第 77 期	1,370,422,989	1,066,099,583	7,779	25	0.25
第 78 期	1,344,864,915	1,077,568,052	8,012	25	0.25
第 79 期	1,249,609,954	948,193,236	7,588	25	0.25
第 80 期	1,234,977,555	939,485,610	7,607	25	0.25
第 81 期	1,176,056,771	870,354,473	7,401	25	0.25
第 82 期	1,156,112,827	865,858,603	7,489	25	0.25
第 83 期	1,130,911,809	845,026,496	7,472	25	0.25
第 84 期	1,096,638,382	827,458,970	7,545	25	0.25
第 85 期	1,071,896,488	857,723,485	8,002	25	0.25
第 86 期	1,022,634,932	827,236,393	8,089	25	0.25
第 87 期	1,004,558,995	776,885,417	7,734	25	0.25
第 88 期	984,285,120	777,371,341	7,898	25	0.25
第 89 期	964,588,789	755,744,263	7,835	25	0.25
第 90 期	953,656,435	738,279,394	7,742	25	0.25
第 91 期	924,583,642	733,086,865	7,929	25	0.25
第 92 期	910,133,237	717,973,970	7,889	25	0.25
第 93 期	888,247,600	686,869,341	7,733	25	0.25
第 94 期	862,313,950	690,764,650	8,011	25	0.25
第 95 期	820,196,512	655,503,582	7,992	25	0.25
第 96 期	778,709,848	653,319,705	8,390	25	0.25
第 97 期	712,102,973	624,703,008	8,773	20	0.20
第 98 期	673,706,560	568,032,029	8,431	20	0.20
第 99 期	660,461,850	552,597,403	8,367	20	0.20
第 100 期	645,441,872	547,246,659	8,479	20	0.20
第 101 期	638,358,550	553,484,557	8,670	20	0.20
第 102 期	627,940,219	538,445,299	8,575	20	0.20
第 103 期	595,740,920	524,172,440	8,799	20	0.20
第 104 期	589,229,453	502,068,502	8,521	20	0.20

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 105 期	585,865,941円	506,711,212円	8,649円	20円	0.20%
第 106 期	568,828,692	443,443,984	7,796	20	0.20
第 107 期	565,518,925	454,463,907	8,036	20	0.20
第 108 期	560,758,798	461,903,297	8,237	20	0.20
第 109 期	552,721,104	455,793,485	8,246	20	0.20
第 110 期	551,347,666	422,885,765	7,670	15	0.15
第 111 期	550,898,267	419,609,790	7,617	15	0.15
第 112 期	541,434,494	405,363,217	7,487	15	0.15
第 113 期	538,330,142	390,299,716	7,250	15	0.15
第 114 期	535,431,659	385,900,853	7,207	15	0.15
第 115 期	535,036,375	388,415,805	7,260	15	0.15
第 116 期	528,198,619	355,227,740	6,725	10	0.10
第 117 期	513,802,589	358,136,211	6,970	10	0.10
第 118 期	513,447,811	362,002,801	7,050	10	0.10
第 119 期	508,511,415	356,845,482	7,017	10	0.10
第 120 期	507,662,356	357,922,872	7,050	10	0.10
第 121 期	507,653,152	378,214,604	7,450	10	0.10
第 122 期	495,892,797	372,809,078	7,518	10	0.10
第 123 期	481,752,212	358,426,110	7,440	10	0.10
第 124 期	465,249,204	349,006,922	7,502	10	0.10
第 125 期	455,453,766	337,671,190	7,414	10	0.10
第 126 期	449,324,856	341,860,081	7,608	10	0.10
第 127 期	434,079,784	330,361,384	7,611	10	0.10
第 128 期	425,425,902	333,752,522	7,845	10	0.10
第 129 期	408,767,250	317,564,167	7,769	10	0.10
第 130 期	395,184,221	302,643,620	7,658	10	0.10
第 131 期	387,413,745	306,141,581	7,902	10	0.10
第 132 期	368,908,883	300,224,845	8,138	10	0.10
第 133 期	356,782,288	290,322,425	8,137	10	0.10
第 134 期	351,174,980	292,886,909	8,340	10	0.10
第 135 期	349,901,426	279,133,548	7,977	10	0.10
第 136 期	343,811,523	266,808,542	7,760	10	0.10
第 137 期	343,091,133	270,090,149	7,872	10	0.10
第 138 期	338,706,201	267,054,798	7,885	10	0.10
第 139 期	334,697,919	263,824,258	7,882	10	0.10
第 140 期	333,030,922	260,977,890	7,836	10	0.10
第 141 期	318,637,855	252,688,684	7,930	10	0.10
第 142 期	316,424,481	246,244,152	7,782	10	0.10

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 143 期	313,399,405円	250,017,972円	7,978円	10円	0.10%
第 144 期	310,816,474	246,049,210	7,916	10	0.10
第 145 期	307,143,981	237,558,705	7,734	10	0.10
第 146 期	306,663,957	230,513,870	7,517	10	0.10
第 147 期	299,650,821	227,948,766	7,607	10	0.10
第 148 期	298,143,033	230,443,175	7,729	10	0.10
第 149 期	294,920,307	231,749,327	7,858	10	0.10
第 150 期	293,930,704	227,872,711	7,753	10	0.10
第 151 期	290,996,509	223,153,652	7,669	10	0.10
第 152 期	287,024,730	222,253,223	7,743	10	0.10
第 153 期	285,980,624	213,532,170	7,467	10	0.10
第 154 期	286,077,830	217,135,118	7,590	10	0.10
第 155 期	282,121,373	215,599,672	7,642	10	0.10
第 156 期	280,701,863	223,839,649	7,974	10	0.10
第 157 期	277,257,891	220,045,313	7,936	10	0.10
第 158 期	270,838,959	214,491,196	7,920	10	0.10
第 159 期	266,127,044	212,599,164	7,989	10	0.10
第 160 期	263,044,037	189,891,290	7,219	10	0.10
第 161 期	263,021,320	191,271,158	7,272	10	0.10
第 162 期	262,994,484	193,688,993	7,365	10	0.10
第 163 期	263,041,684	210,687,210	8,010	10	0.10
第 164 期	261,196,822	204,238,406	7,819	10	0.10
第 165 期	260,134,981	205,903,491	7,915	10	0.10
第 166 期	256,278,422	204,965,186	7,998	10	0.10
第 167 期	255,281,436	203,507,622	7,972	10	0.10
第 168 期	253,096,777	203,151,846	8,027	10	0.10
第 169 期	237,977,752	197,314,635	8,291	10	0.10
第 170 期	230,001,511	195,922,597	8,518	10	0.10
第 171 期	229,032,609	198,206,389	8,654	10	0.10
第 172 期	228,779,594	198,409,300	8,673	10	0.10
第 173 期	220,301,475	193,860,904	8,800	10	0.10
第 174 期	216,829,221	192,037,442	8,857	10	0.10
第 175 期	216,964,827	191,389,383	8,821	10	0.10
第 176 期	214,951,169	185,127,669	8,613	10	0.10
第 177 期	213,712,702	181,852,118	8,509	10	0.10
第 178 期	206,373,449	180,640,101	8,753	10	0.10
第 179 期	204,377,472	174,274,522	8,527	10	0.10
第 180 期	204,384,547	177,945,935	8,706	10	0.10

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 たり 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 181 期	195,922,912円	166,043,707円	8,475円	10円	0.10%
第 182 期	192,423,302	163,443,371	8,494	10	0.10
第 183 期	192,515,895	161,329,255	8,380	10	0.10
第 184 期	190,640,760	153,586,553	8,056	10	0.10
第 185 期	190,655,926	163,153,234	8,557	10	0.10
第 186 期	189,605,361	160,169,740	8,448	10	0.10
第 187 期	188,616,897	166,270,701	8,815	5	0.05
第 188 期	183,949,975	157,910,527	8,584	5	0.05
第 189 期	183,866,119	161,820,427	8,801	5	0.05
第 190 期	179,647,551	160,967,069	8,960	5	0.05
第 191 期	176,709,797	150,354,087	8,509	5	0.05
第 192 期	176,761,743	155,929,797	8,821	5	0.05
第 193 期	175,821,525	152,623,760	8,681	5	0.05
第 194 期	175,827,198	148,639,443	8,454	5	0.05
第 195 期	175,714,400	149,829,949	8,527	5	0.05
第 196 期	172,714,267	149,458,585	8,654	5	0.05
第 197 期	172,725,213	149,415,668	8,650	5	0.05
第 198 期	172,718,717	154,169,543	8,926	5	0.05
第 199 期	167,693,910	153,459,636	9,151	5	0.05
第 200 期	166,243,300	154,835,063	9,314	5	0.05
第 201 期	163,249,434	153,916,986	9,428	5	0.05
第 202 期	160,373,801	150,919,121	9,410	5	0.05
第 203 期	160,323,673	149,875,903	9,348	5	0.05
第 204 期	160,405,265	152,865,953	9,530	5	0.05
第 205 期	148,965,978	140,010,681	9,399	5	0.05
第 206 期	145,213,224	140,906,363	9,703	5	0.05

償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金 (税引前)	9,923円26銭
------------------	-----------

償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置の適用を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは取扱販売会社までお問い合わせ下さい。

高金利ソブリン・マザーファンド

償還 運用報告書

(償還日 2024年2月7日)

この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。ここに運用経過と償還内容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	2006年7月20日から2024年2月7日（当初無期限）までです。
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	高金利国のソブリン債券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、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■設定以来の運用実績

決算期	基準 価額	期騰落		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額 総
		騰	落			
(設定日) 2006年7月20日	円 10,000	% -	% -	% -	百万円 573	
1期 (2007年5月8日)	11,414	14.1	95.7	-	6,869	
2期 (2008年5月8日)	11,122	△2.6	95.3	-	37,385	
3期 (2009年5月8日)	9,180	△17.5	96.5	-	30,366	
4期 (2010年5月10日)	9,571	4.3	97.4	-	24,463	
5期 (2011年5月9日)	9,991	4.4	97.1	-	18,512	
6期 (2012年5月8日)	9,895	△1.0	97.1	-	18,535	
7期 (2013年5月8日)	13,138	32.8	98.1	-	20,709	
8期 (2014年5月8日)	13,327	1.4	97.9	-	18,275	
9期 (2015年5月8日)	14,225	6.7	97.6	-	16,705	
10期 (2016年5月9日)	12,470	△12.3	98.1	-	12,468	
11期 (2017年5月8日)	12,774	2.4	96.6	-	6,447	
12期 (2018年5月8日)	13,109	2.6	97.5	-	5,722	
13期 (2019年5月8日)	13,378	2.1	98.0	-	2,208	
14期 (2020年5月8日)	13,113	△2.0	95.1	-	1,883	

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
		騰	落			
15期 (2021年5月10日)	円 15,048	% 14.8		% 98.2	% -	百万円 1,919
16期 (2022年5月9日)	15,122	0.5		97.9	-	1,397
17期 (2023年5月8日)	15,988	5.7		98.0	-	485
(償 還 日) 2024年2月7日	(償還価額) 17,303.99	8.2		-	-	96

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(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、日本を除く世界各国の中から、組入れ時の格付がA-/A3格以上で、相対的に金利の高いソブリン債券を主要投資対象として、安定したインカム収益の獲得と信託財産の成長を目指した運用を行います。

上記当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を定めておりません。

(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	期 騰 落 率		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰	落		
(期 首) 2023年5月8日	円 15,988	% -		% 98.0	% -
5 月 末	15,914	△0.5		98.2	-
6 月 末	16,572	3.7		98.1	-
7 月 末	16,450	2.9		98.5	-
8 月 末	16,737	4.7		99.0	-
9 月 末	16,620	4.0		98.8	-
10 月 末	16,564	3.6		98.7	-
11 月 末	17,217	7.7		98.5	-
12 月 末	17,154	7.3		98.0	-
2024年1月 末	17,320	8.3		-	-
(償 還 日) 2024年2月7日	(償還価額) 17,303.99	8.2		-	-

(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。

設定来のポートフォリオについて

投資通貨の選定について、定期的に一定の信用格付を有する国の中から為替市場の流動性、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ました。また、各国の金融政策、財政状況やファンダメンタルズなどを注視し、投資対象国の組入比率と債券デューレーション^{*}の調整を機動的に行いました。

^{*}金利変動に対する債券価格の変動性。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

■ 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)	42円	0.254%	(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)	(0)	(0.001)	
合 計	42	0.254	
期中の平均基準価額は16,668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5月9日から2024年2月7日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	ア	メ	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
	リ	カ	926	1,263
	カ	ナ	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル
	ダ	国	90	553
	オ	ス	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル
	ト	ラ	1,613	2,114
	シ	ン	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル
	ン	ガ	121	583
国	ニ	ュ	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル
	ー	ー	326	884
	イ	ギ	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド
	リ	ス	587	873
	ノ	ル	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ
	ウ	ェ	1,011	4,616
	マ	レ	千マレーシア・リングgit	千マレーシア・リングgit
	ー	シ	600	2,137
ポ	ー	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
ラ	ン	359	1,909	
ユ	ー	千ユーロ	千ユーロ	
ロ	ス	400	723	
ク	ス	千ユーロ	千ユーロ	
ク	ス	400	723	

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等（2023年5月9日から2024年2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

償還時における有価証券の組入れはありません。

■投資信託財産の構成

2024年2月7日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 96,893	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	96,893	100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月7日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	96,893,968円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	96,893,968
(B) 負 債	18
未 払 利 息	18
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	96,893,950
元 本	55,995,160
償 還 差 損 益 金	40,898,790
(D) 受 益 権 総 口 数	55,995,160口
1万口当たり償還価額(C/D)	17,303円99銭

(注1) 期首元本額 303,647,040円
追加設定元本額 0円
一部解約元本額 247,651,880円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A Mバランス・インカム・オープン (毎月分配型)
55,995,160円
期末元本合計 55,995,160円

■損益の状況

当期 自2023年5月9日 至2024年2月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	7,167,964円
受 取 利 息	7,169,543
支 払 利 息	△1,579
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	29,772,160
売 買 益	42,358,332
売 買 損	△12,586,172
(C) そ の 他 費 用	△1,035,389
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	35,904,735
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	181,824,875
(F) 解 約 差 損 益 金	△176,830,820
(G) 合 計(D+E+F)	40,898,790
償 還 差 損 益 金(G)	40,898,790

(注) (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。

インデックス225 マザーファンド

運用報告書

第17期 (決算日 2023年2月20日)

(計算期間 2022年2月22日～2023年2月20日)

インデックス225 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	原則、無期限です。
運用方針	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。
主要投資対象	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、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銘柄以上に同指数における個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行います。
主な組入制限	株式への投資割合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		日経平均株価(225)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(ベンチマーク)	期騰落率			
13期(2019年2月20日)	円	%	円	%	%	%	百万円
13期(2019年2月20日)	16,485	△0.3	21,431.49	△2.3	97.4	5.3	34,447
14期(2020年2月20日)	18,448	11.9	23,479.15	9.6	93.3	6.6	25,144
15期(2021年2月22日)	24,143	30.9	30,156.03	28.4	97.8	2.2	89,076
16期(2022年2月21日)	21,886	△9.3	26,910.87	△10.8	98.3	1.6	127,373
17期(2023年2月20日)	22,882	4.6	27,531.94	2.3	97.4	2.6	130,473

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません（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）。

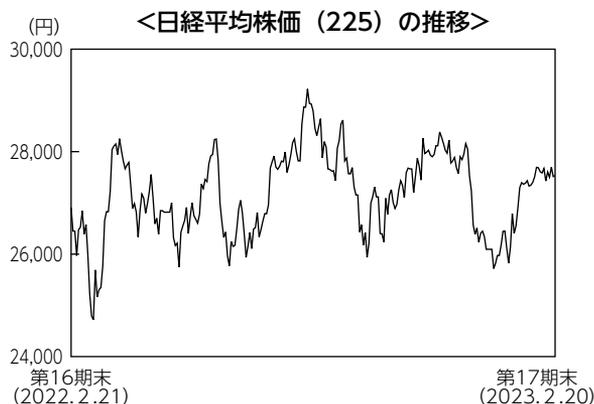
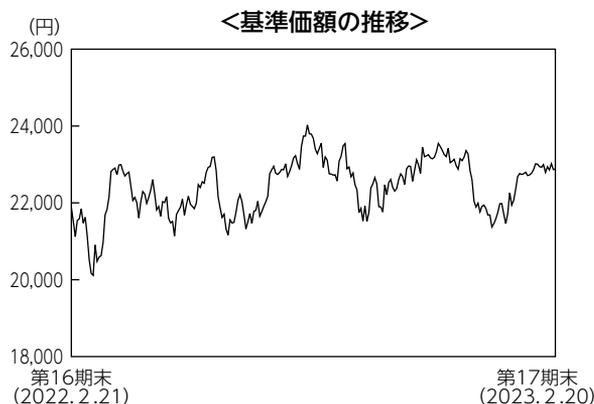
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 2 月 21 日	円 21,886	% -	円 26,910.87	% -	% 98.3	% 1.6
2 月 末	21,585	△1.4	26,526.82	△1.4	97.9	2.1
3 月 末	22,827	4.3	27,821.43	3.4	97.2	2.7
4 月 末	22,031	0.7	26,847.90	△0.2	97.5	2.3
5 月 末	22,401	2.4	27,279.80	1.4	96.9	2.6
6 月 末	21,702	△0.8	26,393.04	△1.9	97.6	2.4
7 月 末	22,860	4.5	27,801.64	3.3	98.4	1.5
8 月 末	23,112	5.6	28,091.53	4.4	97.9	2.1
9 月 末	21,517	△1.7	25,937.21	△3.6	97.3	2.7
10 月 末	22,884	4.6	27,587.46	2.5	97.5	2.5
11 月 末	23,206	6.0	27,968.99	3.9	98.1	1.9
12 月 末	21,686	△0.9	26,094.50	△3.0	97.5	2.5
2023年 1 月 末	22,711	3.8	27,327.11	1.5	98.4	1.5
(期 末) 2023年 2 月 20 日	22,882	4.6	27,531.94	2.3	97.4	2.6

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月22日から2023年2月20日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は22,882円（1万口あたり）となり、前期末比で4.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内株式への投資を行った結果、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2022年3月中旬にかけ、新型コロナウイルス新規感染者数の拡大、世界的な金融引き締めへの警戒感やロシアのウクライナ侵攻などを受けて下落基調で推移しました。その後、円安ドル高の進行により上昇に転じる場面もありましたが、高インフレを背景とした世界的な金融引き締めの動きが重しとなり、一進一退の展開となりました。期末にかけては、インフレ鈍化期待の高まりを受けた米株高を好感し、国内株も戻り歩調を辿りました。

ポートフォリオについて

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。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

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2.3%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.3%程度上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因によるものです。

今後の運用方針

今後の運用につきましても、財務リスク等を考慮しつつ、日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指します。

■ 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) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 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
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は22,398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 (2022年2月22日から2023年2月20日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		6,595.8 (390.8)	28,219,567 (-)	7,397	30,404,016

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内 株 式 先 物 取 引	百万円 73,572	百万円 72,474	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	58,623,583千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	123,633,591千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.47

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月22日から2023年2月20日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 28,219	百万円 -	% -	百万円 30,404	百万円 36	% 0.1
株 式 先 物 取 引	73,572	73,572	100.0	72,474	72,474	100.0
金 銭 信 託	0.193939	0.193939	100.0	0.193939	0.193939	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 5	百万円 6	百万円 33

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	1,778千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1,778千円
(B) / (A)	100.0%

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)				
ニッスイ	164	158	85,952	
マルハニチロ	16.4	—	—	
鉱業 (0.1%)				
INPEX	65.6	63.2	90,123	
建設業 (1.7%)				
コムシスホールディングス	164	158	392,788	
大成建設	32.8	31.6	138,250	
大林組	164	158	154,524	
清水建設	164	158	115,814	
長谷工コーポレーション	32.8	31.6	48,632	
鹿島建設	82	79	126,953	
大和ハウス工業	164	158	492,012	
積水ハウス	164	158	402,189	
日揮ホールディングス	164	158	277,764	
食料品 (3.5%)				
日清製粉グループ本社	164	158	246,638	
明治ホールディングス	32.8	31.6	202,872	
日本ハム	82	79	297,830	
サッポロホールディングス	32.8	31.6	99,066	
アサヒグループホールディングス	164	158	744,338	
キリンホールディングス	164	158	317,027	
宝ホールディングス	164	158	168,586	
キッコーマン	164	158	1,030,160	
味の素	164	158	651,434	
ニチレイ	82	79	214,880	
日本たばこ産業	164	158	440,583	
繊維製品 (0.1%)				
東洋紡	16.4	15.8	16,542	
ユニチカ	16.4	—	—	
帝人	32.8	31.6	45,788	
東レ	164	158	126,700	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	164	158	85,004	
日本製紙	16.4	15.8	15,910	
化学 (7.1%)				
クラレ	164	158	191,022	
旭化成	164	158	150,747	
レゾナック・ホールディングス	16.4	15.8	36,482	
住友化学	164	158	75,366	
日産化学	164	158	930,620	
東ソー	82	79	141,094	
トクヤマ	32.8	31.6	66,865	
デンカ	32.8	31.6	93,030	
信越化学工業	164	158	3,035,180	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
三井化学	32.8	31.6	102,700	
三菱ケミカルグループ	82	79	64,187	
UBE	16.4	15.8	32,690	
花王	164	158	808,328	
DIC	16.4	15.8	38,378	
富士フィルムホールディングス	164	158	1,014,202	
資生堂	164	158	972,174	
日東電工	164	158	1,325,620	
医薬品 (7.4%)				
協和キリン	164	158	464,994	
武田薬品工業	164	158	673,554	
アステラス製薬	820	790	1,489,940	
住友ファーマ	164	158	137,144	
塩野義製薬	164	158	973,280	
中外製薬	492	474	1,692,180	
エーザイ	164	158	1,234,138	
第一三共	492	474	2,027,298	
大塚ホールディングス	164	158	657,912	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	65.6	63.2	194,340	
ENEOSホールディングス	164	158	73,090	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	82	79	192,839	
ブリヂストン	164	158	825,076	
ガラス・土石製品 (1.0%)				
AGC	32.8	31.6	157,368	
日本板硝子	16.4	15.8	10,996	
日本電気硝子	49.2	47.4	117,978	
住友大阪セメント	16.4	15.8	60,514	
太平洋セメント	16.4	15.8	38,868	
東海カーボン	164	158	205,084	
TOTO	82	79	361,030	
日本碍子	164	158	283,452	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	16.4	15.8	48,932	
神戸製鋼所	16.4	15.8	14,062	
JFEホールディングス	16.4	15.8	27,571	
大平洋金属	16.4	15.8	31,394	
非鉄金属 (0.9%)				
日本軽金属ホールディングス	16.4	15.8	22,878	
三井金属鉱業	16.4	15.8	53,483	
東邦亜鉛	16.4	15.8	32,927	
三菱マテリアル	16.4	15.8	33,843	
住友金属鉱山	82	79	411,037	
DOWAホールディングス	32.8	31.6	142,674	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
古河電気工業	16.4	15.8	38,346	
住友電気工業	164	158	263,781	
フジクラ	164	158	152,628	
金属製品 (0.0%)				
SUMCO	16.4	15.8	29,593	
機械 (5.7%)				
日本製鋼所	32.8	31.6	82,950	
オークマ	32.8	31.6	165,584	
アマダ	164	158	189,442	
SMC	-	15.8	1,057,652	
小松製作所	164	158	522,506	
住友重機械工業	32.8	31.6	93,093	
日立建機	164	158	492,170	
クボタ	164	158	329,588	
荏原製作所	32.8	31.6	176,644	
ダイキン工業	164	158	3,689,300	
日本精工	164	158	117,868	
NTN	164	158	53,404	
ジェイテクト	164	158	160,844	
三井E&Sホールディングス	16.4	15.8	6,746	
日立造船	32.8	31.6	28,313	
三菱重工業	16.4	15.8	79,726	
IHI	16.4	15.8	57,354	
電気機器 (23.5%)				
コニカミノルタ	164	158	95,116	
ミネベアミツミ	164	158	376,198	
日立製作所	32.8	31.6	222,780	
三菱電機	164	158	244,821	
富士電機	32.8	31.6	165,268	
安川電機	164	158	813,700	
日本電産	-	126.4	876,204	
オムロン	164	158	1,143,762	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32.8	31.6	78,336	
日本電気	16.4	15.8	75,524	
富士通	16.4	15.8	276,658	
沖電気工業	16.4	-	-	
セイコーエプソン	328	316	591,868	
パナソニック ホールディングス	164	158	186,519	
シャープ	164	158	154,366	
ソニーグループ	164	158	1,807,520	
TDK	492	474	2,156,700	
アルプスアルパイン	164	158	225,150	
横河電機	164	158	327,218	
アドバンテスト	328	316	3,182,120	
キーエンス	16.4	15.8	920,350	
カシオ計算機	164	158	213,616	
ファナック	164	158	3,586,600	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
京セラ	328	316	2,113,724	
太陽誘電	164	158	661,230	
村田製作所	131.2	126.4	935,739	
SCREENホールディングス	32.8	31.6	326,428	
キャノン	246	237	701,638	
リコー	164	158	168,428	
東京エレクトロン	164	158	7,185,840	
輸送用機器 (4.6%)				
デンソー	164	158	1,166,988	
川崎重工業	16.4	15.8	47,795	
日産自動車	164	158	82,823	
いすゞ自動車	82	79	129,639	
トヨタ自動車	820	790	1,502,975	
日野自動車	164	158	90,376	
三菱自動車工業	16.4	15.8	8,405	
マツダ	32.8	31.6	36,972	
本田技研工業	328	316	1,093,360	
スズキ	164	158	754,766	
SUBARU	164	158	347,284	
ヤマハ発動機	164	158	533,250	
精密機器 (4.1%)				
テルモ	656	632	2,341,560	
ニコン	164	158	204,452	
オリンパス	656	632	1,450,440	
HOYA	-	79	1,059,390	
シチズン時計	164	158	131,930	
その他製品 (2.7%)				
パンダイナムコホールディングス	164	158	1,354,850	
凸版印刷	82	79	189,758	
大日本印刷	82	79	287,560	
ヤマハ	164	158	782,890	
任天堂	16.4	158	863,312	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	16.4	15.8	7,584	
中部電力	16.4	15.8	22,910	
関西電力	16.4	15.8	20,903	
東京瓦斯	32.8	31.6	84,719	
大阪瓦斯	32.8	31.6	67,845	
陸運業 (1.4%)				
東武鉄道	32.8	31.6	94,958	
東急	82	79	128,849	
小田急電鉄	82	79	129,481	
京王電鉄	32.8	31.6	148,520	
京成電鉄	82	79	305,730	
東日本旅客鉄道	16.4	15.8	109,099	
西日本旅客鉄道	16.4	15.8	83,424	
東海旅客鉄道	16.4	15.8	241,740	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
ヤマトホールディングス	164	158	368,298	
NIPPON EXPRESSホールディングス	16.4	15.8	121,028	
海運業 (0.4%)				
日本郵船	16.4	47.4	157,794	
商船三井	16.4	47.4	162,108	
川崎汽船	16.4	47.4	154,050	
空運業 (0.0%)				
ANAホールディングス	16.4	15.8	44,445	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	82	79	246,085	
情報・通信業 (11.3%)				
ネクソン	328	316	970,120	
Zホールディングス	65.6	63.2	24,205	
トレンドマイクロ	164	158	1,027,000	
日本電信電話	65.6	63.2	251,030	
KDDI	984	948	3,828,972	
ソフトバンク	164	158	242,135	
東宝	16.4	15.8	74,734	
エヌ・ティ・ティ・データ	820	790	1,487,570	
コナミグループ	164	158	989,080	
ソフトバンクグループ	984	948	5,431,092	
卸売業 (2.8%)				
双日	16.4	15.8	40,700	
伊藤忠商事	164	158	649,064	
丸紅	164	158	277,843	
豊田通商	164	158	881,640	
三井物産	164	158	617,464	
住友商事	164	158	373,117	
三菱商事	164	158	738,650	
小売業 (12.0%)				
J. フロント リテイリング	82	79	101,436	
三越伊勢丹ホールディングス	164	158	222,938	
セブン&アイ・ホールディングス	164	158	969,172	
高島屋	82	79	150,416	
丸井グループ	164	158	326,428	
イオン	164	158	412,933	
ファーストリテイリング	164	158	13,061,860	
銀行業 (0.7%)				
しずおかフィナンシャルグループ	—	158	175,222	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	164	158	90,376	
SBI新生銀行	16.4	—	—	
あおぞら銀行	16.4	15.8	41,885	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	164	158	157,731	
りそなホールディングス	16.4	15.8	11,911	
三井住友トラスト・ホールディングス	16.4	15.8	78,383	
三井住友フィナンシャルグループ	16.4	15.8	94,800	
千葉銀行	164	158	156,420	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
ふくおかフィナンシャルグループ	32.8	31.6	97,802	
静岡銀行	164	—	—	
みずほフィナンシャルグループ	16.4	15.8	33,891	
証券・商品先物取引業 (0.3%)				
大和証券グループ本社	164	158	101,752	
野村ホールディングス	164	158	89,396	
松井証券	164	158	127,190	
保険業 (0.9%)				
SOMPOホールディングス	32.8	31.6	183,153	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	49.2	47.4	211,261	
第一生命ホールディングス	16.4	15.8	46,831	
東京海上ホールディングス	82	237	679,360	
T&Dホールディングス	32.8	31.6	68,414	
その他金融業 (0.8%)				
クレディセゾン	164	158	288,192	
オリックス	—	158	383,387	
日本取引所グループ	164	158	310,707	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	164	158	100,962	
三井不動産	164	158	392,709	
三菱地所	164	158	258,804	
東京建物	82	79	125,847	
住友不動産	164	158	489,800	
サービス業 (4.4%)				
エムスリー	393.6	379.2	1,253,256	
ディー・エヌ・エー	49.2	47.4	85,177	
電通グループ	164	158	688,880	
サイバーエージェント	131.2	126.4	151,680	
楽天グループ	164	158	109,178	
リクルートホールディングス	492	474	1,805,466	
日本郵政	164	158	192,681	
セコム	164	158	1,244,250	
合 計	株 数 ・ 金 額	30,651.6	30,241.2	127,034,597
	銘柄数 < 比率 >	225銘柄	225銘柄	< 97.4% >

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	日 経 平 均	百万円 3,412		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年2月20日現在

項 目		当 期		末
		評 価 額	比	率
株 式		千円 127,034,597		% 97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		3,762,330		2.9
投 資 信 託 財 産 総 額		130,796,928		100.0

(注) 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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	130,787,855,289円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,382,768,689
株 式(評価額)	127,034,597,520
未 収 入 金	12,409,080
未 収 配 当 金	211,880,000
差 入 委 託 証 拠 金	146,200,000
(B) 負 債	314,059,000
未 払 解 約 金	314,059,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	130,473,796,289
元 本	57,021,132,315
次 期 繰 越 損 益 金	73,452,663,974
(D) 受 益 権 総 口 数	57,021,132,315口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,882円

■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,714,728,243円
受 取 配 当 金	2,715,532,360
受 取 利 息	22,555
そ の 他 収 益	147,965
支 払 利 息	△974,637
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,998,126,587
売 買 益	10,721,704,842
売 買 損	△6,723,578,255
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	212,471,960
取 引 益	1,292,525,900
取 引 損	△1,080,053,940
(D) そ の 他 費 用	△1
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	6,925,326,789
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	69,175,399,253
(G) 解 約 差 損 益 金	△25,608,265,777
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	22,960,203,709
(I) 合 計(E+F+G+H)	73,452,663,974
次 期 繰 越 損 益 金(I)	73,452,663,974

(注1) 期首元本額 58,198,132,946円
 追加設定元本額 18,933,637,291円
 一部解約元本額 20,110,637,922円

(注2) 期末における元本の内訳

(適格機関投資家私募) インデックス225 (3ヵ月決算型)	3,051,800,365円
(適格機関投資家私募) インデックス225 マルチアセット・アロケーション戦略ファンド (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家私募)	1,207,871,918円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII (為替バリアブルヘッジ型) (適格機関投資家限定)	371,181,703円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII (為替バリアブルヘッジ型) (適格機関投資家限定)	35,830,501円
日米資産配分戦略ファンド (為替ヘッジ比率 調整型) 2017-03 (適格機関投資家限定)	59,695,443円
たわらノーロード 日経225	34,491,819,139円
DIAMバランス・インカム・オープン (毎月分配型)	18,989,535円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	269,442,807円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル建 日本政府保証償活用型) (適格機関投資家限定)	195,131,369円
低リスク・損失抑制型マルチアセット 戦略ファンド (適格機関投資家限定)	41,460,248円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド 2021-09 (適格機関投資家限定)	41,715,826円
DIAM日経225インデックスファンドVA	836,293,603円
国内株式パッシブ・ファクター日経 225型一 (適格機関投資家向け)	4,343,100,287円
DIAM日経225型パッシブ・ファンド (適格機関投資家向け)	3,483,947,801円
日米独マルチアセットアロケーション ファンド (適格機関投資家限定)	36,634,615円
日米英独マルチアセットアロケーション ファンド (適格機関投資家限定)	30,625,965円
日米資産配分戦略ファンド (TIPS活用型) (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家限定)	67,600,610円
MHAM日経225インデックスファンド [適格機関投資家限定]	6,017,605,205円
MHAMインデックス225 [適格機関投資家限定]	2,420,385,375円
期末元本合計	57,021,132,315円

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の
 評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)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) (H)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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■第22条（信託業務の委託等）の付表「I.外国での保管会社」を削除しました。

(2023年2月11日)