

D | AMグローバル・アクティブ・バランスファンド

<愛称：クラシックエイト>

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、実質的に国内外の債券、株式、不動産投資信託証券へ分散投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしました。

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。

作成対象期間 2022年11月9日～2023年2月8日

第187期	決算日：2022年12月8日	
第188期	決算日：2023年1月10日	
第189期	償還日：2023年2月8日	
償還日 (2023年2月8日)	償還価額	8,533.53円
	純資産総額	1,518百万円
第187期～ 第189期	騰落率	△0.6%
	分配金合計	20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)

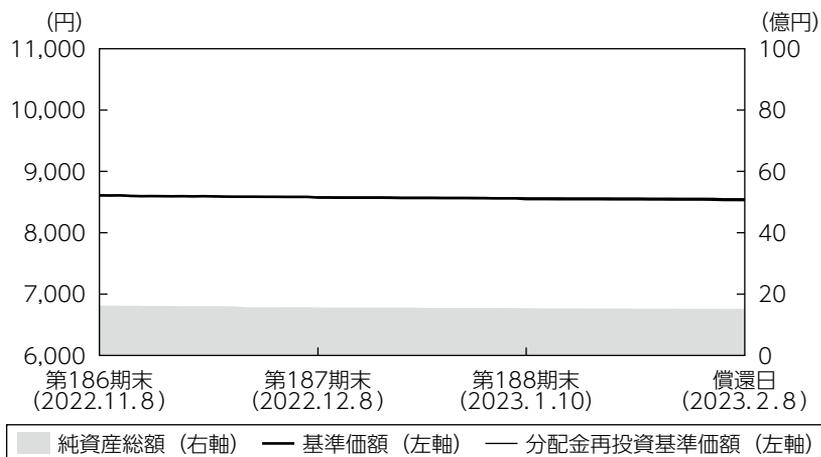
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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187期首： 8,609円
 償還日： 8,533.53円
 (既払分配金20円)
 騰落率： △0.6%
 (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、実質的にキャッシュのみの運用を行いました。

当ファンドの基準価額は設定来で38.7%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金3,480円）。

設定来では、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世界的に株式市場やリート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、組入れている全ての資産が上昇し、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
国内債券アクティブ・マザーファンド	△0.0%
高金利ソブリン・マザーファンド*	—
D I A M日本好配当株オープン・マザーファンド	0.0%
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド*	—
J-R E I Tオープン・アクティブ・マザーファンド	△0.0%
D I A M US・リート・オープン・マザーファンド*	—
D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド*	—
D I A M新興国債券マザーファンド	△0.2%
D I A M B R I C S 株式マザーファンド	△5.3%

(注) 組入ファンドの騰落率は、当ファンドが保有していた期間（2023年2月7日）までの騰落率です。

*2022年10月26日付で売却済みです。

1 万口当たりの費用明細

項目	第187期～第189期 (2022年11月9日 ～2023年2月8日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	28円	
(投信会社)	(13)	(0.152)	
(販売会社)	(14)	(0.161)	
(受託会社)	(2)	(0.019)	
(b) その他費用	8	0.098	(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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(8)	(0.098)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	37	0.431	

(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。

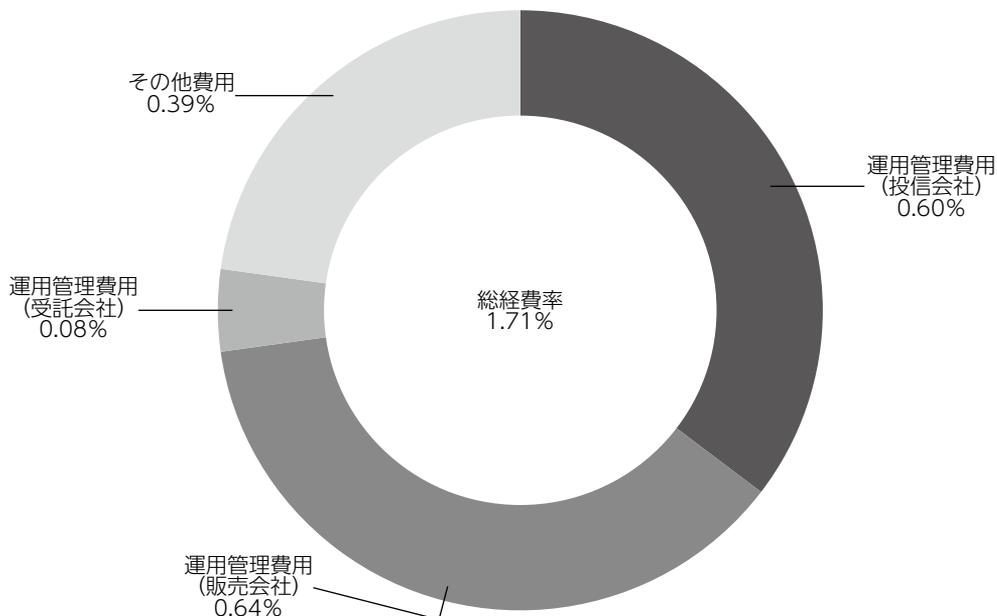
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.71%です。



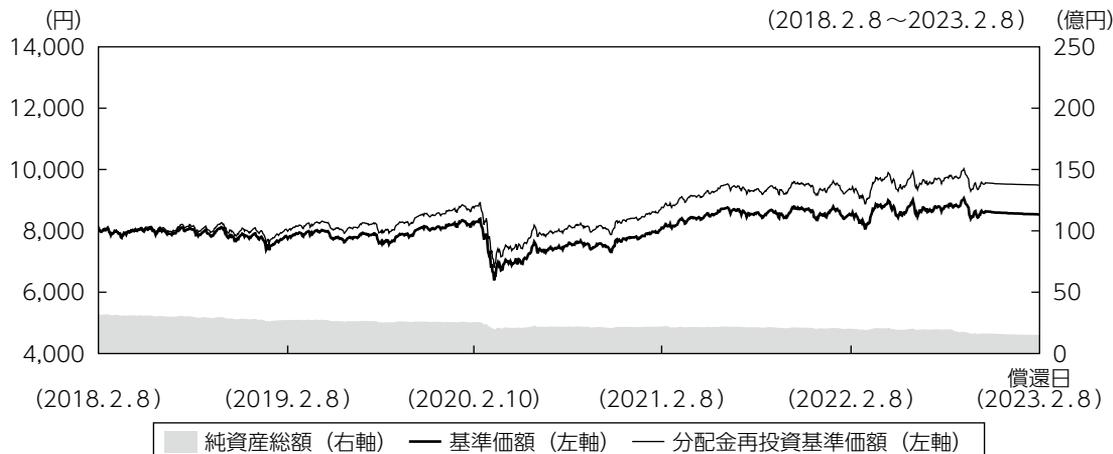
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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、2018年2月8日の基準価額に合わせて指数化しています。

	2018年2月8日 期首	2019年2月8日 決算日	2020年2月10日 決算日	2021年2月8日 決算日	2022年2月8日 決算日	2023年2月8日 償還日
基準価額 (分配落) (円)	8,133	7,744	8,230	8,103	8,507	(償還価額) 8,533.53
期間分配金合計 (税引前) (円)	—	240	240	140	120	110
分配金再投資基準価額の騰落率 (%)	—	△1.8	9.5	0.3	6.5	1.6
純資産総額 (百万円)	3,224	2,711	2,545	2,215	2,004	1,518

(注) 運用方針に合った適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

設定来の投資環境

国内債券市場では、当ファンド設定以降、2008年のリーマンショック、2011年の東日本大震災等を背景に日本経済が長期低迷に陥る中、設定時に1.8%台にあった長期金利（10年国債利回り）は一貫して低下し、2016年には△0.30%まで低下する局面もありました。しかしその後、2019年に発生した新型コロナウイルス感染症の世界的な拡大や2022年2月のロシアによるウクライナ侵攻等で世界的にインフレ圧力が高まる中、足元では0.50%程度まで上昇（債券価格は下落）するに至りました。

外国債券市場では、2008年の金融危機を受けて主要中央銀行が政策金利の引き下げや量的緩和策を導入したことなどを背景に、投資国の国債利回りは低下基調が続きました。しかし2021年以降は、新型コロナウイルス禍からの経済回復局面で商品や労働力の供給不足から各国でインフレが高進したことを背景に、主要中央銀行が積極的な利上げなど金融引き締めを進めた結果、利回りは上昇に転じました。

国内株式市場は、設定から2009年3月までは、米国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）問題を背景にした世界的な金融システム不安や景気悪化懸念から、大幅下落しました。2009年4月以降は、各国政府による景気対策や金融政策などを受け、株式市場は底打ちしたものの、その後は、欧州債務問題と政策期待とが綱引きするかたちで、ボックス圏での推移となりました。2012年12月以降、日銀による大規模な金融緩和策に対する期待から、株式市場は上昇基調となりました。その後2018年から2019年にかけては、米中貿易摩擦に対する懸念から株式市場は調整局面となり、2020年3月の新型コロナウイルスの感染拡大懸念から大幅下落となりました。しかしその後、2021年12月までは、世界的な金融政策、財政政策を受け、上昇基調となりました。2022年1月以降は、インフレ動向を受けた米欧の金融引き締め政策やそれに伴う先行きの景気減速などの懸念から、ボックス圏での推移となりました。

外国株式市場は2008年の世界金融危機、2011年から2012年半ばにかけての欧州債務危機、2020年初における新型コロナウイルスの感染拡大など、一時的に下落する局面はあったものの、世界各国の経済成長などを背景に運用期間を通じて上昇しました。

国内リート市場は設定来で上昇しました。2007年半ばから2009年前半にかけては、世界的な金融危機を背景に軟調に推移しました。しかし、その後は緩和的な金融環境が継続したことに加え、不動産ファンダメンタルズが改善を示したことなどから、2019年末にかけて上昇傾向を継続しました。2020年以降は、新型コロナウイルスの感染拡大や米国長期金利の動向などに左右され、揉み合いでの推移となりました。

米国リート市場は上昇しました。リーマンショックやコロナショックによって大きく下落する場面もありましたが、F R B（米連邦準備理事会）による持続的な低金利政策のもとで米国の景気は堅調に推移し、米国リートは上昇しました。2022年になるとF R Bによる継続的な利上げが行われたことなどから、先行き不透明感が高まり上げ幅を縮小しました。

米国以外の海外リート市場は、概ね上昇しました。リーマンショックやコロナショックによって大きく下落する場面もありましたが、各国中央銀行の緩和的な金融政策などが追い風となり、堅調に推移しました。2022年になると各国中央銀行による継続的な利上げが行われたことなどから、先行き不透明感が高まり上げ幅を縮小しました。

米ドル建て新興国債券市場では、基準金利となる米国国債との利回りスプレッド（利回り格差）が拡大しました。2007年の設定後、2008年の世界金融危機局面において急拡大しました。その後は一定のスプレッド縮小が見られたものの、2011年以降、主要新興国の信用格付が相次いで引き下げられる中で、スプレッドは拡大基調を辿りました。また、2022年のロシアによるウクライナ侵攻など、市場ショック時には一時的にスプレッドが大きく拡大する局面が見られました。

新興国株式市場では、2008年の世界金融危機、2011年から2012年半ばにかけての欧州債務危機、2015年の資源価格の下落や米国での金利引き上げによる新興国からの資金流出、2020年初における新型コロナウイルスの感染拡大など、一時的に株式市場が下落する局面はあったものの、新興国の経済成長などを背景に運用期間を通じて新興国株式市場は上昇しました。

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で主要通貨に対して急速にドル高が進み、対円でも急速にドル高が進みました。一方ユーロは、欧州債務問題やイギリスのEU（欧州連合）離脱等を背景にユーロ安が進み、対円でもユーロ安となりました。

設定来のポートフォリオについて

当ファンドでは、マザーファンドを通じて国内外の株式、債券およびリートと、新興国の株式・債券の8資産に投資を行いました。また、組入れる8資産の保有比率が基本資産配分比率に維持されるように資産配分を行いました。

2022年10月下旬以降、2023年2月8日の繰上償還（信託終了）に向け、高金利ソブリン・マザーファンド、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド、D I A M US・リート・オープン・マザーファンドおよびD I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドを売却しました。また、保有を継続していたマザーファンドにおいても、保有有価証券の売却を行いました。

●国内債券アクティブ・マザーファンド

デュレーション*・イールドカーブ戦略とクレジット戦略の両戦略を超過収益の源泉としてきました。リーマンショックが発生した2008年度はクレジット戦略で大きなマイナスとなりましたが、2009年度以降は両戦略から着実に超過収益を獲得し、設定来でベンチマークに対して超過収益を獲得することができました。なお、当マザーファンドは繰上償還に向け、2022年10月25日に全ての有価証券を売却しました。

*金利変動に対する債券価格の変動性。

●高金利ソブリン・マザーファンド

一定程度の信用格付けを有する国の中から、債券および為替市場の流動性、投資規制、市場規模等を勘案した上で、相対的に高い金利水準の通貨を選定して組入れました。組入通貨は定期的に見直しを実施したほか、信用格付けの引き下げに際して変更を行いました。選定した通貨の運用については、分散投資を基本に、足元の投資国のファンダメンタルズや市場のリスク選好度などを考慮し、一定の範囲で各通貨の投資比率の調整を実施しました。

●D I A M日本好配当株オープン・マザーファンド

予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断した銘柄を中心に投資を行いました。銘柄の選定にあたっては業績動向、財務内容の健全性などに留意した上で、高水準かつ安定的な配当が予想される銘柄を中心に選別しました。なお、当マザーファンドは繰上償還に向け、2022年10月25日に全ての有価証券を売却しました。

●D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

銘柄選択においては、「地域の分散」、「業種の分散」に着目し、世界の好配当株への投資を通じて、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざした運用を行いました。国別配分については米国を、業種配分では金融やヘルスケアセクターを高め維持しました。

● J-R E I T オープン・アクティブ・マザーファンド

相対的に割安な銘柄や業績安定感がある銘柄を中心に運用を行いました。なお、当マザーファンドは繰上償還に向け、2022年10月25日に全ての有価証券を売却しました。

● D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド

適正価格に到達したと見られる銘柄については、適宜入れ替えを行いました。また、米国景気の先行きや米長期金利の動向も注視しつつ、保守的な財務体質かつ長期的に見て成長見込みがある銘柄や、割安な水準にある銘柄を選別して投資しました。設定来では、通信タワーやトランクルーム関連などのその他、住居施設などの組入比率を引き上げた一方、オフィスや小売りなどの組入比率を引き下げました。

● D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

保守的な財務体質かつ配当成長の見込めるキャッシュフローの安定した銘柄を選別して投資を行いました。また、適正価格に到達した銘柄は適宜入れ替えを行いました。設定来で、地域別では、カナダなどの組入比率を引き上げた一方、オーストラリアなどの組入比率を引き下げました。また、セクター別では、工業などの組入比率を引き上げた一方、小売りなどの組入比率を引き下げました。

● D I A M 新興国債券マザーファンド

主として、ブラジル、メキシコ、トルコ、南アフリカ、ロシアが発行する米ドル建て国債を保有したほか、一部南アフリカとメキシコの現地通貨建て国債等を保有しました。ロシアが発行する米ドル建て国債については、2022年2月のロシアによるウクライナ侵攻を受け、保有を解消しました。なお、当マザーファンドでは繰上償還に向け、2022年10月25日に全ての有価証券を売却しました。

● D I A M B R I C s 株式マザーファンド

計量モデルを活用し、割安性・成長性を中心に企業ファンダメンタルズを総合的に評価の上、投資魅力度の高い銘柄の選定を行いました。国別配分についてはブラジルを、業種配分については金融を高めに維持しました。ロシア株については、経済制裁のリスクが高まったことから、2022年2月下旬に全て売却しました。なお、当マザーファンドでは繰上償還に向け、2022年10月25日に全ての有価証券を売却しました。

■ 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187期	第188期
	2022年11月9日 ~2022年12月8日	2022年12月9日 ~2023年1月10日
当期分配金（税引前）	10円	10円
対基準価額比率	0.12%	0.12%
当期の収益	-円	-円
当期の収益以外	10円	10円
翌期繰越分配対象額	264円	254円

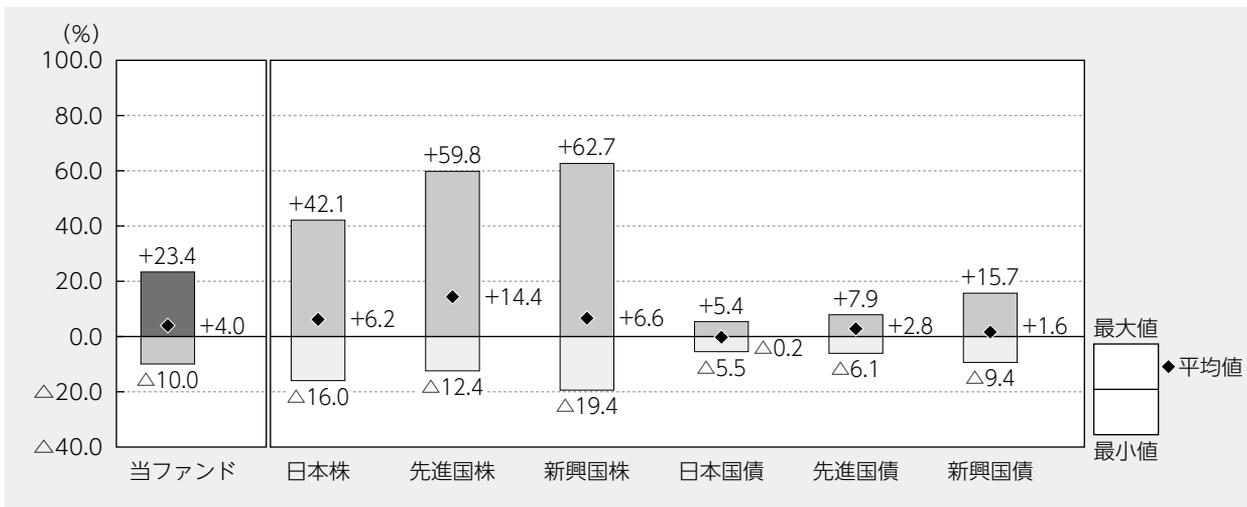
- (注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。
- (注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。
- (注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

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。

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	2007年5月23日から2023年2月8日（当初無期限）までです。	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。	
主要投資対象	D I A M グローバル・アクティブ・バランスファンド	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券アクティブ・マザーファンド	国債、国内企業の発行による普通社債、転換社債等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。
	D I A M 日本好配当株オープン・マザーファンド	主としてわが国の証券取引所（新興市場を含む）に上場している全銘柄を投資対象とします。
	D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
	J-R E I T オープン・アクティブ・マザーファンド	東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
	D I A M 新興国債券マザーファンド	新興国のソブリン債券を主要投資対象とします。
D I A M B R I C S 株式マザーファンド	ブラジル、ロシア、インド、中国の株式を主要投資対象とします。	
運用方法	<p>各マザーファンドの受益証券への投資を通じ、実質的に国内外の債券、株式、不動産投資信託証券への分散投資を行います。</p> <p>各マザーファンド受益証券の組入比率については、委託会社が定める基本資産配分比率に基づき投資を行います。ただし、国外の不動産投資信託証券へ投資するマザーファンドについては、各マザーファンドの純資産総額を合算して資産配分を算出します。</p> <p>各マザーファンド受益証券の時価の変動等により各マザーファンドの純資産総額が基本資産配分比率から一定量以上乖離した場合には、各マザーファンド受益証券への投資割合を基本資産配分比率に近づけることとします。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。</p>	
分配方針	<p>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。原則として、毎月の収益分配については、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、四半期（1月、4月、7月、10月）の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。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。</p>	

代表的な資産クラスとの騰落率の比較



2018年2月～2023年1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。

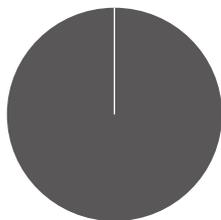
※各指数については後掲の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

当ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容（2023年2月8日現在）

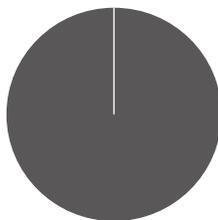
当ファンドに組入れておりました親投資信託受益証券は全て解約いたしました。

◆資産別配分



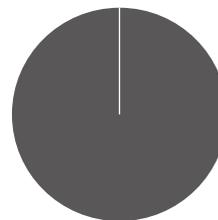
その他
100.0%

◆国別配分



その他
100.0%

◆通貨別配分



その他
100.0%

(注1) 比率は償還時における純資産総額に対する割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。

純資産等

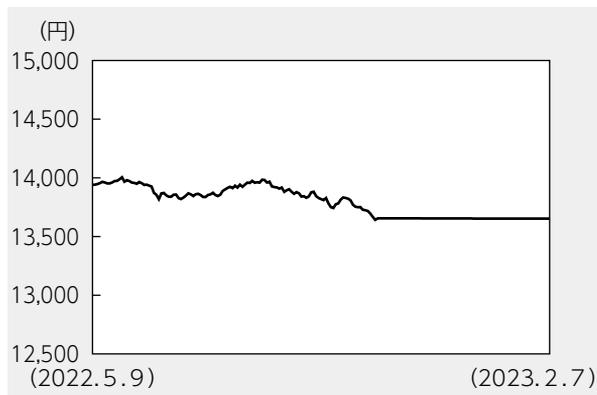
項目	第187期末	第188期末	償還時
	2022年12月8日	2023年1月10日	2023年2月8日
純資産総額	1,563,971,644円	1,540,419,603円	1,518,371,584円
受益権総口数	1,824,222,314口	1,801,815,564口	1,779,300,698口
1万口当たり基準（償還）価額	8,573円	8,549円	8,533.53円

(注) 第187期～償還時における追加設定元本額は42,518円、同解約元本額は105,368,948円です。

組入ファンドの概要 ※償還時における組入ファンドはありません。

【国内債券アクティブ・マザーファンド】（計算期間 2022年5月10日～2023年2月7日（償還日））
当ファンドに組入れておりました有価証券は期中に全て売却いたしました。

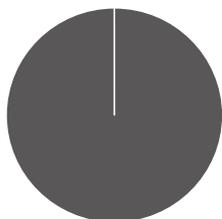
◆基準価額の推移



◆1万口当たりの費用明細

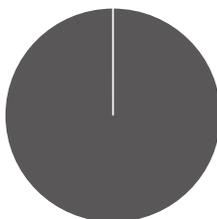
計算期間中に発生した費用はありません。

◆資産別配分



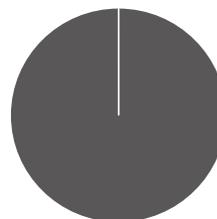
その他
100.0%

◆国別配分



その他
100.0%

◆通貨別配分



その他
100.0%

(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) 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償還日現在のものです。

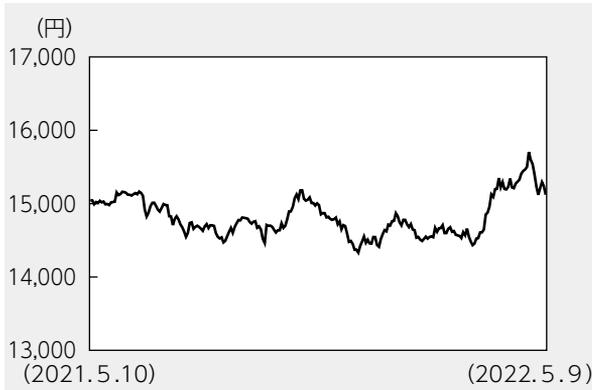
(注3) 比率は償還時における純資産総額に対する割合です。

(注4) 現金等はその他として表示しています。

(注5) 計算期間中の運用経過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。

【高金利ソブリン・マザーファンド】（計算期間 2021年5月11日～2022年5月9日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄

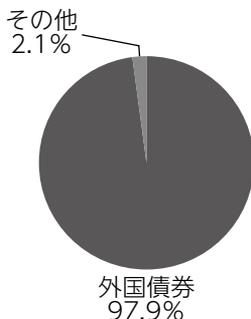
銘柄名	通貨	比率
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	オーストラリア・ドル	8.8%
UK TREASURY 4.25 12/07/27	イギリス・ポンド	6.4
US T N/B 0.375 01/31/26	アメリカ・ドル	5.9
CANADA 1.0 06/01/27	カナダ・ドル	5.8
MALAYSIA 3.906 07/15/26	マレーシア・リンギット	5.7
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	ニュージーランド・ドル	5.7
THAILAND 2.125 12/17/26	タイ・バーツ	5.1
NORWAY 1.5 02/19/26	ノルウェー・クローネ	5.1
SINGAPORE 2.625 05/01/28	シンガポール・ドル	4.6
POLAND 2.5 07/25/26	ポーランド・ズロチ	4.5
組入銘柄数	24銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

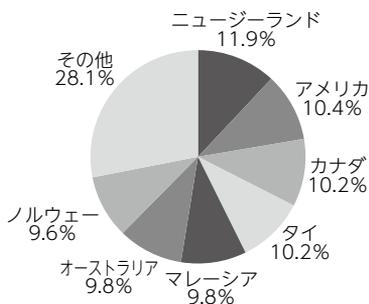
項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用 (保管費用) (その他)	9円 (9) (0)	0.060% (0.060) (0.000)
合計	9	0.060

期中の平均基準価額は14,821円です。

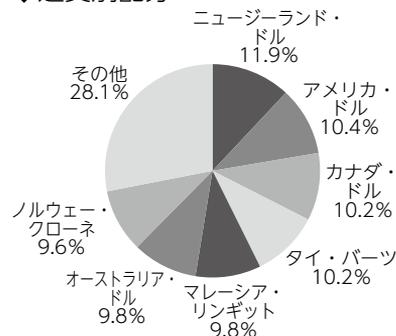
◆資産別配分



◆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。

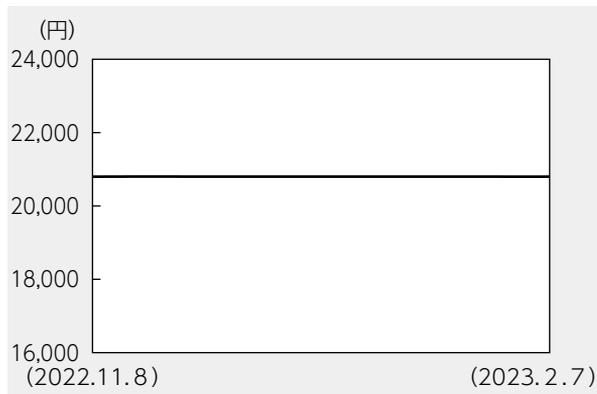
(注6) 国別配分は発行国（地域）を表示しています。

(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。

【DIAM日本好配当株オープン・マザーファンド】（計算期間 2022年11月9日～2023年2月7日（償還日））
当ファンドに組入れておりました有価証券は前期中に全て売却いたしました。

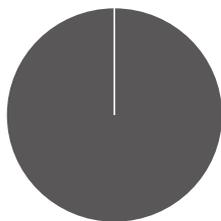
◆基準価額の推移



◆1万口当たりの費用明細

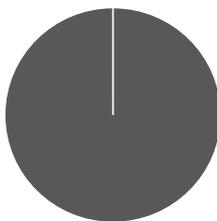
計算期間中に発生した費用はありません。

◆資産別配分



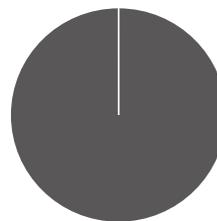
その他
100.0%

◆国別配分



その他
100.0%

◆通貨別配分



その他
100.0%

(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) 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償還日現在のものです。

(注3) 比率は償還時における純資産総額に対する割合です。

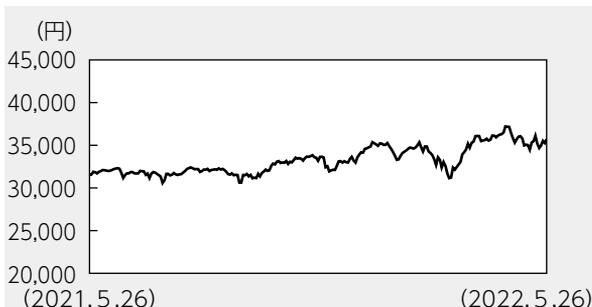
(注4) 現金等はその他として表示しています。

(注5) 計算期間中の運用経過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。

[D I AM世界好配当株オープン・マザーファンド]

(計算期間 2021年5月27日～2022年5月26日)

◆基準価額の推移



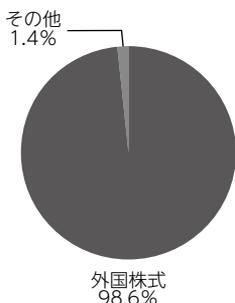
◆組入上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
MCDONALD'S CORPORATION	アメリカ・ドル	3.6%
MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	3.2
METLIFE INC	アメリカ・ドル	2.9
MERCK & CO.INC.	アメリカ・ドル	2.8
MASTERCARD INC	アメリカ・ドル	2.7
NOVARTIS AG-REG SHS	スイス・フラン	2.4
CHEVRON CORP	アメリカ・ドル	2.4
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	2.3
GSK PLC	イギリス・ポンド	2.2
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ユーロ	2.2
組入銘柄数	82銘柄	

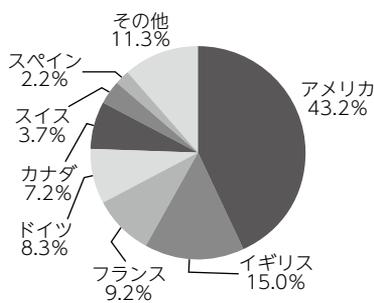
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株式)	13円 (13)	0.038% (0.038)
(b) 有価証券取引税 (株式)	9 (9)	0.026 (0.026)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	6 (6) (0)	0.019 (0.018) (0.001)
合計	28	0.084
期中の平均基準価額は33,264円です。		

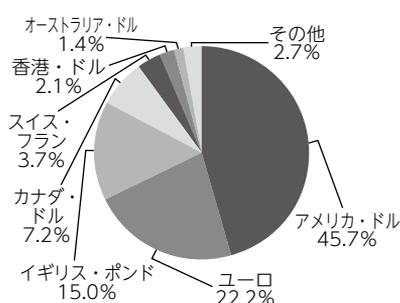
◆資産別配分



◆国別配分



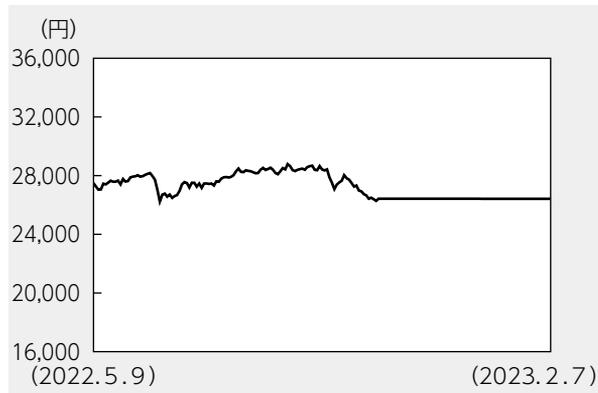
◆通貨別配分



- (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) 国別配分は、発行国(地域)を表示しています。
 (注6) 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7) 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。

【J-REITオープン・アクティブ・マザーファンド】（計算期間 2022年5月10日～2023年2月7日（償還日））
当ファンドに組入れておりました有価証券は期中に全て売却いたしました。

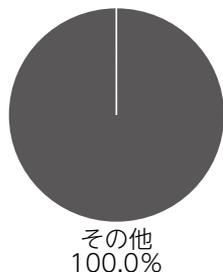
◆基準価額の推移



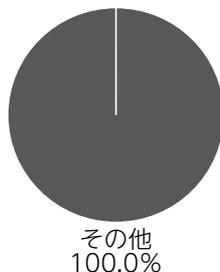
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (投資証券)	21円 (21)	0.077% (0.077)
合計	21	0.077
期中の平均基準価額は27,227円です。		

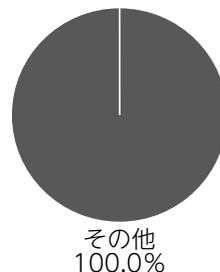
◆資産別配分



◆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) 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償還日現在のものです。

(注4) 比率は償還時における純資産総額に対する割合です。

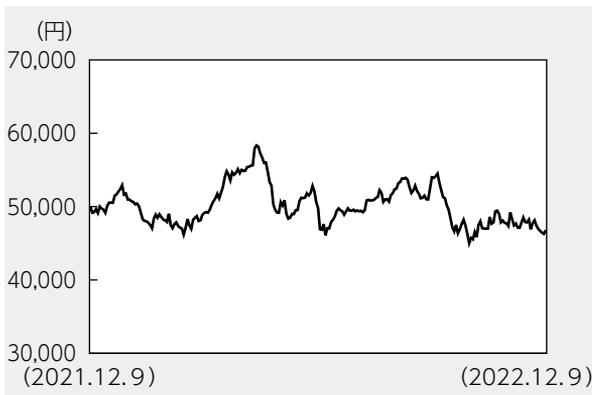
(注5) 現金等はその他として表示しています。

(注6) 計算期間中の運用経過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。

[DIAM US・リート・オープン・マザーファンド]

(計算期間 2021年12月10日～2022年12月9日)

◆基準価額の推移



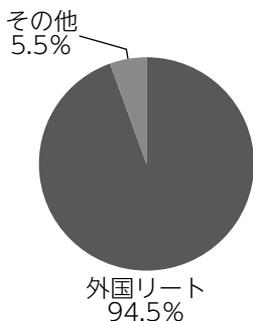
◆組入上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
PROLOGIS INC	アメリカ・ドル	7.1%
PUBLIC STORAGE	アメリカ・ドル	5.1
EQUINIX INC	アメリカ・ドル	4.7
AMERICAN TOWER CORP	アメリカ・ドル	4.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ・ドル	4.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ・ドル	3.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ・ドル	3.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	アメリカ・ドル	3.7
TERRENO REALTY CORP	アメリカ・ドル	3.4
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	アメリカ・ドル	3.3
組入銘柄数	38銘柄	

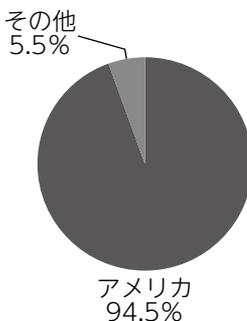
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (投資証券)	17円 (17)	0.034% (0.034)
(b) その他費用 (保管費用) (その他)	7 (6) (1)	0.015 (0.012) (0.003)
合計	25	0.049
期中の平均基準価額は50,088円です。		

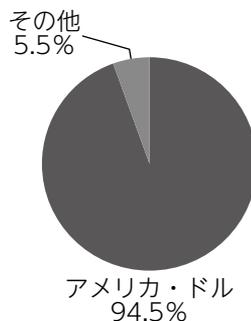
◆資産別配分



◆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。

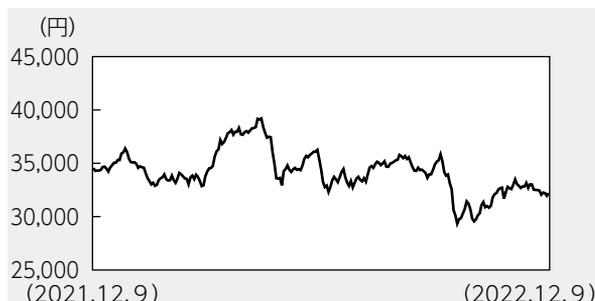
(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注6) 国別配分は、発行国(地域)を表示しています。

(注7) 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。

[DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド] (計算期間 2021年12月10日~2022年12月9日)

◆基準価額の推移



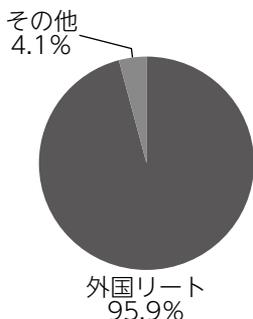
◆組入上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
WAREHOUSES DE PAUW	ユーロ	7.5%
GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド・ドル	5.9
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	カナダ・ドル	5.5
CANADIAN APT PPTYS REIT	カナダ・ドル	5.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	オーストラリア・ドル	5.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	カナダ・ドル	4.9
VICINITY CENTRES	オーストラリア・ドル	4.8
SEGRO PLC	イギリス・ポンド	4.5
NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア・ドル	4.4
UNITE GROUP PLC	イギリス・ポンド	4.3
組入銘柄数	32銘柄	

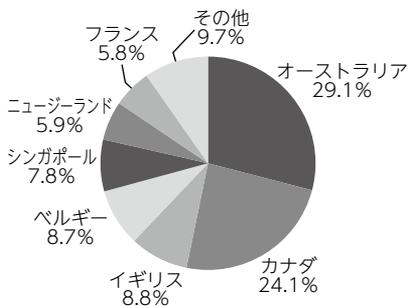
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券)	5円 (4) (1)	0.014% (0.011) (0.002)
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券)	5 (0) (5)	0.014 (0.001) (0.014)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	8 (6) (2)	0.024 (0.019) (0.005)
合計	18	0.052
期中の平均基準価額は34,197円です。		

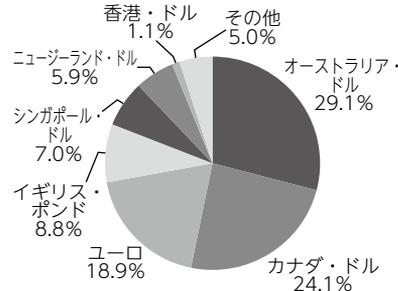
◆資産別配分



◆国別配分



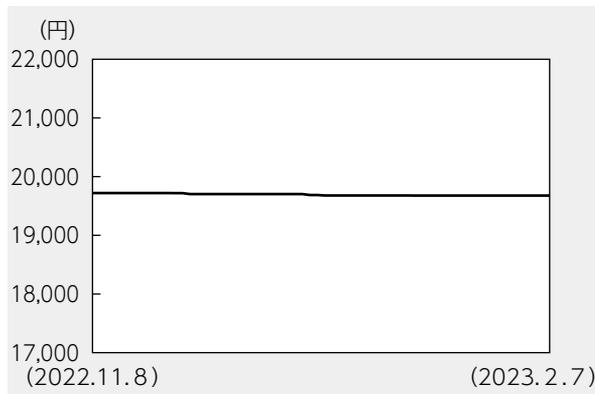
◆通貨別配分



- (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あります。
(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。

【D I AM新興国債券マザーファンド】（計算期間 2022年11月9日～2023年2月7日（償還日））
当ファンドに組入れておりました有価証券は前期中に全て売却いたしました。

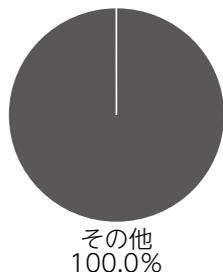
◆基準価額の推移



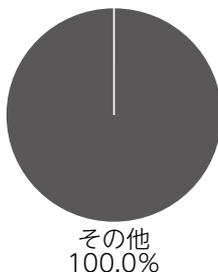
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用 (保管費用)	40円 (40)	0.204% (0.204)
合計	40	0.204
期中の平均基準価額は19,693円です。		

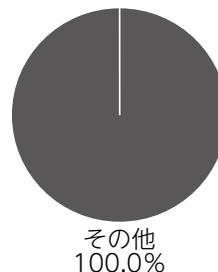
◆資産別配分



◆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) 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償還日現在のものです。

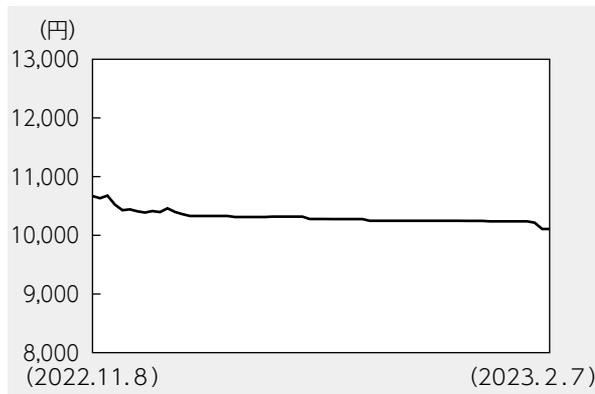
(注4) 比率は償還時における純資産総額に対する割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。

(注6) 計算期間中の運用経過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。

【DIAM BRICS 株式マザーファンド】（計算期間 2022年11月9日～2023年2月7日（償還日））
当ファンドに組入れておりました有価証券は前期中に全て売却いたしました。

◆基準価額の推移

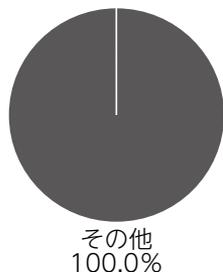


◆1万口当たりの費用明細

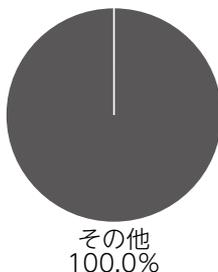
項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用 (保管費用)	284円 (177)	2.756% (1.719)
(その他)	(107)	(1.037)
合計	284	2.756

期中の平均基準価額は10,306円です。

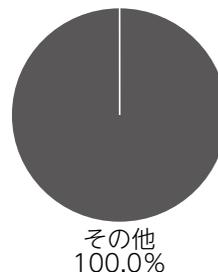
◆資産別配分



◆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) 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償還日現在のものです。

(注4) 比率は償還時における純資産総額に対する割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。

(注6) 計算期間中の運用経過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、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPX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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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。