

償還 運用報告書（全体版）

第178期<償還日2024年10月29日>

D I AM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ <円コース>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	2009年10月29日から2024年10月29日までです。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主要投資対象	主として円建ての外国投資信託である「ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス（J P Y）」の投資信託証券へ投資を行います。また、証券投資信託である「D I AMマネーマザーファンド」受益証券への投資も行います。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。
運用方法	主として円建ての外国投資信託への投資を通じて、米ドル建ての新興国ソブリン債（国債および政府機関債等 ^(*) ）に実質的な投資を行います。外国投資信託への投資比率は、原則として高位を保ちますが、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案し決定します。 （*）各国政府および政府関係機関が発行する債券であるソブリン債、または政府が出資している企業や政府保証が付いた債券である準ソブリン債を含みます。 外国投資信託においては、米ドルを売り予約し、円を買い予約する為替取引を行います。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	決算日（原則として毎月5日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、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。原則として利子配当等収益等を中心に安定分配をめざします。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。また、毎年1月および7月の決算時には、基準価額水準を勘案し、安定分配に加えて委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。 「原則として利子配当等収益等を中心に安定分配をめざす」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。また、基準価額水準、運用の状況等によっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

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、「D I AM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>」は、この度、信託期間を満了し、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/>

D I AM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>

■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託 組入証券比率	純資産 総額
		(分配落)	税金 込 み 期 騰 落 中 率	分 配 金		
第 1 作成期	(設 定 日) 2009年10月29日	円 10,000		円 －	% －	百万円 290
	1 期(2010年 2 月 5 日)	10,100		50	1.5	786
	2 期(2010年 3 月 5 日)	10,245		50	1.9	871
	3 期(2010年 4 月 5 日)	10,299		50	1.0	931
第 2 作成期	4 期(2010年 5 月 6 日)	10,291		50	0.4	997
	5 期(2010年 6 月 7 日)	10,052		50	△1.8	952
	6 期(2010年 7 月 5 日)	10,209		60	2.2	954
	7 期(2010年 8 月 5 日)	10,662		60	5.0	894
	8 期(2010年 9 月 6 日)	10,748		60	1.4	716
	9 期(2010年10月 5 日)	10,897		60	1.9	678
第 3 作成期	10期(2010年11月 5 日)	11,142		60	2.8	647
	11期(2010年12月 6 日)	10,646		60	△3.9	632
	12期(2011年 1 月 5 日)	10,484		80	△0.8	608
	13期(2011年 2 月 7 日)	10,265		80	△1.3	671
	14期(2011年 3 月 7 日)	10,215		80	0.3	795
	15期(2011年 4 月 5 日)	10,224		80	0.9	948
第 4 作成期	16期(2011年 5 月 6 日)	10,267		80	1.2	1,090
	17期(2011年 6 月 6 日)	10,320		80	1.3	1,258
	18期(2011年 7 月 5 日)	10,322		80	0.8	1,429
	19期(2011年 8 月 5 日)	10,534		80	2.8	1,804
	20期(2011年 9 月 5 日)	10,459		80	0.0	2,642
	21期(2011年10月 5 日)	9,918		80	△4.4	4,705
第 5 作成期	22期(2011年11月 7 日)	10,319		80	4.8	6,109
	23期(2011年12月 5 日)	10,154		80	△0.8	8,459
	24期(2012年 1 月 5 日)	10,170		80	0.9	11,599
	25期(2012年 2 月 6 日)	10,236		80	1.4	15,263
	26期(2012年 3 月 5 日)	10,225		80	0.7	22,070
	27期(2012年 4 月 5 日)	10,044		80	△1.0	33,022
第 6 作成期	28期(2012年 5 月 7 日)	10,165		80	2.0	36,468
	29期(2012年 6 月 5 日)	9,858		80	△2.2	36,480
	30期(2012年 7 月 5 日)	10,023		80	2.5	36,947
	31期(2012年 8 月 6 日)	10,269		80	3.3	38,896
	32期(2012年 9 月 5 日)	10,216		80	0.3	39,984
	33期(2012年10月 5 日)	10,236		80	1.0	43,931

作成期	決算期	基準価額			投資信託 資産証比率	純資産 総額
		(分配落)	税分込 期騰落	中率		
第7作成期	34期(2012年11月5日)	円 10,038	円 80	% △1.2	% 99.4	百万円 47,240
	35期(2012年12月5日)	10,043	80	0.8	99.5	54,123
	36期(2013年1月7日)	9,814	80	△1.5	99.4	61,730
	37期(2013年2月5日)	9,478	80	△2.6	99.4	59,004
	38期(2013年3月5日)	9,437	80	0.4	99.4	53,565
	39期(2013年4月5日)	9,393	80	0.4	99.4	44,589
第8作成期	40期(2013年5月7日)	9,535	80	2.4	99.2	40,339
	41期(2013年6月5日)	8,926	60	△5.8	99.2	32,718
	42期(2013年7月5日)	8,459	60	△4.6	99.5	26,597
	43期(2013年8月5日)	8,375	60	△0.3	98.9	23,844
	44期(2013年9月5日)	7,990	60	△3.9	98.9	21,097
	45期(2013年10月7日)	8,244	60	3.9	99.0	20,250
第9作成期	46期(2013年11月5日)	8,306	60	1.5	99.0	18,878
	47期(2013年12月5日)	7,952	60	△3.5	99.0	16,969
	48期(2014年1月6日)	7,984	60	1.2	97.9	15,597
	49期(2014年2月5日)	7,851	60	△0.9	99.0	14,418
	50期(2014年3月5日)	8,017	60	2.9	99.0	13,838
	51期(2014年4月7日)	8,057	60	1.2	99.0	13,106
第10作成期	52期(2014年5月7日)	8,137	60	1.7	99.0	12,840
	53期(2014年6月5日)	8,215	60	1.7	99.0	12,613
	54期(2014年7月7日)	8,201	60	0.6	99.3	12,117
	55期(2014年8月5日)	8,109	60	△0.4	98.9	11,450
	56期(2014年9月5日)	8,150	60	1.2	99.0	11,290
	57期(2014年10月6日)	7,838	60	△3.1	99.0	10,549
第11作成期	58期(2014年11月5日)	7,853	60	1.0	99.0	10,356
	59期(2014年12月5日)	7,755	60	△0.5	99.0	9,836
	60期(2015年1月5日)	7,547	60	△1.9	97.0	9,307
	61期(2015年2月5日)	7,588	60	1.3	99.0	9,098
	62期(2015年3月5日)	7,522	60	△0.1	99.0	8,794
	63期(2015年4月6日)	7,628	60	2.2	99.0	8,661
第12作成期	64期(2015年5月7日)	7,567	60	△0.0	99.0	8,283
	65期(2015年6月5日)	7,351	60	△2.1	99.0	7,896
	66期(2015年7月6日)	7,267	60	△0.3	99.0	7,601
	67期(2015年8月5日)	7,168	60	△0.5	99.0	7,299
	68期(2015年9月7日)	6,991	60	△1.6	98.9	6,968
	69期(2015年10月5日)	6,934	40	△0.2	99.0	6,790

作 成 期	決 算 期	基 準 価 額			投 資 信 託 券 率 組 入 証 比	純 資 産 総 額
		(分 配 落)	税 込 分 配	み 金 期 騰 落 中 率		
第13作成期	70期(2015年11月5日)	円 7,115	円 40	% 3.2	% 98.9	百万円 6,673
	71期(2015年12月7日)	6,923	40	△2.1	98.1	6,333
	72期(2016年 1 月5日)	6,805	40	△1.1	95.8	5,752
	73期(2016年 2 月5日)	6,777	40	0.2	98.0	5,601
	74期(2016年 3 月7日)	6,936	40	2.9	98.7	5,624
	75期(2016年 4 月5日)	7,021	40	1.8	98.0	5,609
第14作成期	76期(2016年 5 月6日)	7,073	40	1.3	98.2	5,581
	77期(2016年 6 月6日)	7,094	40	0.9	98.8	5,563
	78期(2016年 7 月5日)	7,321	40	3.8	98.2	5,650
	79期(2016年 8 月5日)	7,279	40	△0.0	98.9	5,461
	80期(2016年 9 月5日)	7,345	40	1.5	97.9	5,305
	81期(2016年10月5日)	7,340	40	0.5	98.8	5,070
第15作成期	82期(2016年11月7日)	7,071	40	△3.1	97.9	4,742
	83期(2016年12月5日)	6,633	40	△5.6	98.4	4,376
	84期(2017年 1 月5日)	6,743	40	2.3	96.1	4,346
	85期(2017年 2 月6日)	6,819	40	1.7	98.2	4,306
	86期(2017年 3 月6日)	6,829	40	0.7	98.4	4,252
	87期(2017年 4 月5日)	6,817	40	0.4	98.3	4,146
第16作成期	88期(2017年 5 月8日)	6,911	40	2.0	98.6	4,148
	89期(2017年 6 月5日)	6,930	40	0.9	98.0	4,025
	90期(2017年 7 月5日)	6,789	40	△1.5	98.5	3,838
	91期(2017年 8 月7日)	6,806	40	0.8	98.3	3,746
	92期(2017年 9 月5日)	6,845	40	1.2	99.4	3,679
	93期(2017年10月5日)	6,785	40	△0.3	97.3	3,754
第17作成期	94期(2017年11月6日)	6,735	40	△0.1	98.6	3,641
	95期(2017年12月5日)	6,625	40	△1.0	98.9	3,529
	96期(2018年 1 月5日)	6,598	40	0.2	95.7	3,446
	97期(2018年 2 月5日)	6,468	40	△1.4	98.2	3,347
	98期(2018年 3 月5日)	6,277	40	△2.3	98.9	3,225
	99期(2018年 4 月5日)	6,272	40	0.6	98.7	3,192
第18作成期	100期(2018年 5 月7日)	6,038	40	△3.1	98.9	3,037
	101期(2018年 6 月5日)	5,918	40	△1.3	98.0	2,921
	102期(2018年 7 月5日)	5,795	40	△1.4	98.2	2,777
	103期(2018年 8 月6日)	5,836	40	1.4	97.9	2,744
	104期(2018年 9 月5日)	5,582	40	△3.7	98.1	2,578
	105期(2018年10月5日)	5,618	40	1.4	97.9	2,451

作成期	決算期	基準価額			投資信託 資金証比率	純資産 総額
		(分配落)	税分込 期騰落	中率		
第19作成期		円	円	%	%	百万円
	106期(2018年11月5日)	5,559	20	△0.7	98.6	2,406
	107期(2018年12月5日)	5,492	20	△0.8	98.7	2,325
	108期(2019年 1 月7日)	5,586	20	2.1	95.4	2,327
	109期(2019年 2 月5日)	5,754	20	3.4	98.9	2,373
	110期(2019年 3 月5日)	5,687	20	△0.8	97.9	2,317
第20作成期	111期(2019年 4 月5日)	5,739	20	1.3	98.0	2,265
	112期(2019年 5 月7日)	5,638	20	△1.4	98.5	2,212
	113期(2019年 6 月5日)	5,698	20	1.4	98.8	2,227
	114期(2019年 7 月5日)	5,902	20	3.9	98.4	2,293
	115期(2019年 8 月5日)	5,855	20	△0.5	98.7	2,267
	116期(2019年 9 月5日)	5,739	20	△1.6	98.5	2,200
第21作成期	117期(2019年10月7日)	5,659	20	△1.0	98.2	2,149
	118期(2019年11月5日)	5,606	20	△0.6	97.9	2,111
	119期(2019年12月5日)	5,565	20	△0.4	98.8	2,076
	120期(2020年 1 月6日)	5,689	20	2.6	95.3	2,102
	121期(2020年 2 月5日)	5,781	20	2.0	98.2	2,130
	122期(2020年 3 月5日)	5,849	20	1.5	98.5	2,121
第22作成期	123期(2020年 4 月6日)	4,945	20	△15.1	97.9	1,780
	124期(2020年 5 月7日)	5,070	20	2.9	98.2	1,820
	125期(2020年 6 月5日)	5,526	20	9.4	98.2	1,985
	126期(2020年 7 月6日)	5,538	20	0.6	98.1	1,968
	127期(2020年 8 月5日)	5,729	20	3.8	98.0	2,017
	128期(2020年 9 月7日)	5,722	20	0.2	98.3	1,933
第23作成期	129期(2020年10月5日)	5,515	20	△3.3	98.8	1,832
	130期(2020年11月5日)	5,562	20	1.2	98.4	1,836
	131期(2020年12月7日)	5,704	20	2.9	98.1	1,868
	132期(2021年 1 月5日)	5,748	20	1.1	98.8	1,869
	133期(2021年 2 月5日)	5,610	20	△2.1	97.9	1,782
	134期(2021年 3 月5日)	5,352	20	△4.2	98.2	1,676
第24作成期	135期(2021年 4 月5日)	5,258	20	△1.4	98.4	1,623
	136期(2021年 5 月6日)	5,301	20	1.2	98.6	1,612
	137期(2021年 6 月7日)	5,356	20	1.4	98.9	1,625
	138期(2021年 7 月5日)	5,366	20	0.6	97.9	1,605
	139期(2021年 8 月5日)	5,400	20	1.0	98.6	1,603
	140期(2021年 9 月6日)	5,426	20	0.9	98.6	1,587
	141期(2021年10月5日)	5,212	20	△3.6	98.5	1,505

作成期	決算期	基準価額			投資信託 資産証比率	純資産 総額
		(分配落)	税分込 期騰落	中率		
第25作成期	142期(2021年11月5日)	円 5,201	円 20	% 0.2	% 98.6	百万円 1,479
	143期(2021年12月6日)	5,105	20	△1.5	98.5	1,436
	144期(2022年 1 月5日)	5,047	15	△0.8	98.5	1,395
	145期(2022年 2 月7日)	4,836	15	△3.9	98.4	1,321
	146期(2022年 3 月7日)	4,277	15	△11.2	97.7	1,158
	147期(2022年 4 月5日)	4,388	15	2.9	97.8	1,165
第26作成期	148期(2022年 5 月6日)	4,010	15	△8.3	98.4	1,043
	149期(2022年 6 月6日)	4,024	15	0.7	98.2	1,038
	150期(2022年 7 月5日)	3,749	15	△6.5	98.4	962
	151期(2022年 8 月5日)	3,875	15	3.8	97.8	984
	152期(2022年 9 月5日)	3,727	15	△3.4	97.8	944
	153期(2022年10月5日)	3,547	15	△4.4	98.0	883
第27作成期	154期(2022年11月7日)	3,466	15	△1.9	98.0	849
	155期(2022年12月5日)	3,739	15	8.3	98.7	910
	156期(2023年 1 月5日)	3,693	15	△0.8	98.3	892
	157期(2023年 2 月6日)	3,820	15	3.8	98.6	919
	158期(2023年 3 月6日)	3,615	15	△5.0	98.5	857
	159期(2023年 4 月5日)	3,674	15	2.0	97.8	857
第28作成期	160期(2023年 5 月8日)	3,604	15	△1.5	97.9	839
	161期(2023年 6 月5日)	3,553	15	△1.0	98.0	825
	162期(2023年 7 月5日)	3,593	15	1.5	97.9	825
	163期(2023年 8 月7日)	3,563	15	△0.4	98.7	811
	164期(2023年 9 月5日)	3,508	15	△1.1	97.8	794
	165期(2023年10月5日)	3,256	15	△6.8	97.7	729
第29作成期	166期(2023年11月6日)	3,312	15	2.2	98.0	738
	167期(2023年12月5日)	3,470	15	5.2	97.8	766
	168期(2024年 1 月5日)	3,515	15	1.7	98.7	768
	169期(2024年 2 月5日)	3,501	15	0.0	98.4	757
	170期(2024年 3 月5日)	3,501	15	0.4	98.0	751
	171期(2024年 4 月5日)	3,520	15	1.0	98.2	745
第30作成期	172期(2024年 5 月7日)	3,430	15	△2.1	97.7	718
	173期(2024年 6 月5日)	3,451	15	1.0	98.3	717
	174期(2024年 7 月5日)	3,424	15	△0.3	97.8	707
	175期(2024年 8 月5日)	3,402	15	△0.2	97.9	689
	176期(2024年 9 月5日)	3,506	15	3.5	98.2	708
	177期(2024年10月7日)	3,548	15	1.6	97.7	703

作成期	決算期	基準価額 (分配落)	税込み騰落率			投資信託証券組入比率	純資産総額
			税分	込金	騰落率		
第31作成期	(償還日) 2024年10月29日	円 (償還価額) 3,541.50		円 0	% △0.2	% －	百万円 691

(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標を定めておりません。

(注4) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注5) △（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

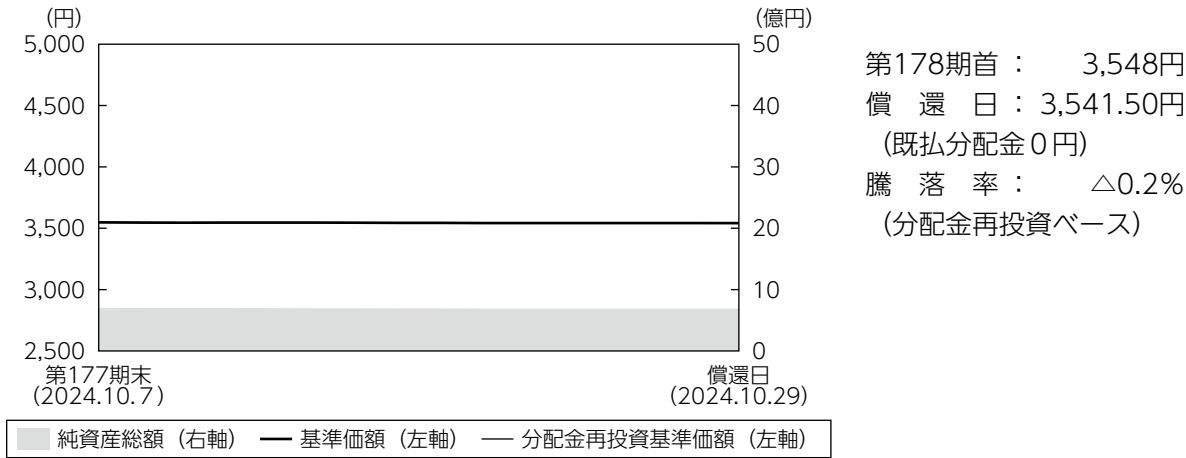
決算期	年 月 日	基準価額	騰落率		投資信託受益証券組入比率
			騰	落率	
第178期	(期首) 2024 年 10 月 7 日	円 3,548		% －	% 97.7
	(償還日) 2024 年 10 月 29 日	(償還価額) 3,541.50		△0.2	－

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■設定以来の運用経過（2009年10月29日から2024年10月29日まで）

第31作成期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す。
- (注 2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注 3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注 4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

当作成期中は、償還対応のため、基準価額の変動は限定的となりましたが、信託報酬などの影響で若干の下落となりました。

設定来では、新興国債券市場は、リーマンショック後の世界的な景気回復により安定的に上昇しました。その後、トランプ米大統領の第一期就任後の米中貿易摩擦や新型コロナウイルスの世界的な感染拡大などにより、一時的に軟調となった局面もありましたが、主要国の金融財政政策のサポートなどもあり、上昇幅が拡大したことは、基準価額のプラス要因となりました。しかし、ヘッジコストの上昇や信託報酬などのマイナス要因がプラス要因を上回り、基準価額は下落し、償還日を迎えました。当ファンドの基準価額は設定来で4.0%下落しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金7,360円）。

◆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
ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (JPY)	△0.1%
D I AMマネーマザーファンド	0.0%

- (注 1) ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (JPY) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。
- (注 2) 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（ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (JPY) は2024年10月22日、D I AMマネーマザーファンドは2024年10月21日まで）の騰落率です。

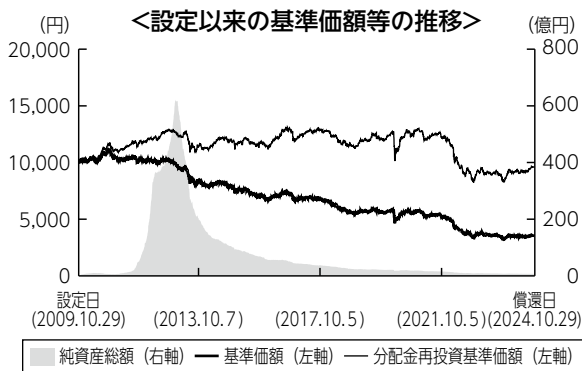
設定来の投資環境

新興国債券市場では、リーマンショックによる景気後退に対応するため、中国が2008年に4兆元の景気対策を打ち出したことへの期待感などから、2009年の新興国債券市場は上昇しました。2010年～2012年にかけては、世界的な金融緩和とそれに続く景気回復により、上昇を継続しました。2013年～2014年は、バーナンキF R B（米連邦準備理事会）議長が、金融緩和の縮小を示唆したことから、上昇幅を縮小する局面もありました。

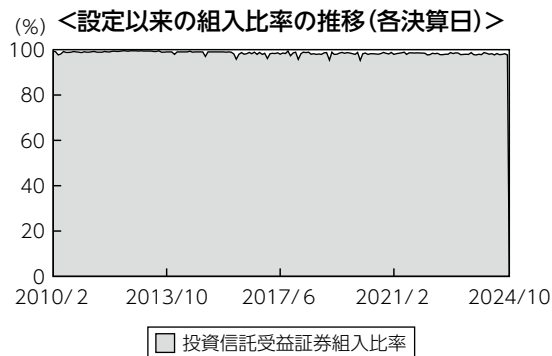
2015年は、原油価格の大幅下落により、一部産油国への信用懸念が高まる局面もありましたが、新興国経済が全般的に堅調に成長したことから、上昇幅を拡大しました。2016年はトランプ大統領が就任し、中国との貿易摩擦が強まり、一時的に上昇幅を縮小する局面もありましたが、世界経済が好調に推移したことから、再び上昇しました。2020年1月に新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や都市封鎖により、新興国債券市場も大幅に上昇幅を縮小しましたが、主要国が大規模な金融緩和や財政政策を実施したことが下支えとなり、更にワクチン開発に成功したことから、再び上昇幅を拡大しました。2022年に入り、ロシアがウクライナに軍事侵攻を開始したことやF R Bが金融引き締めに転じたことから、世界景気の先行きの不透明感が高まり、大幅に上昇幅を縮小しました。2023年に米景気が堅調に推移し、大幅な景気後退が回避されとの楽観論が高まったことやF R Bの利下げ期待感が高まったことから、上昇幅を拡大し、2024年もリスク性資産全般が堅調に推移したことから、新興国債券市場も設定来で上昇し、償還日を迎えました。

米ドル／円相場は、設定来で米ドル高円安となりました。前半は、日銀が大規模な金融緩和政策を開始し、米ドルは対円で上昇しました。後半は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大後、世界的な景気回復により、米国のインフレが高進し、F R Bが金融引き締め政策を進める一方、日銀が緩和的な政策を継続したことから、上昇幅は拡大しました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは0.1%程度で始まりしました。2013年4月に日銀による大規模な「量的・質的金融緩和政策」が導入され同利回りは低下傾向となりました。2016年1月にはマイナス金利政策が導入されたことにより、同金利は一段と低下しマイナス圏で推移することになりましたが、2024年3月にマイナス金利政策が解除されたことを受けて、その後は概ねプラス圏での推移となりました。



- (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。



※新興国債券利回りはJ P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスの最終利回りです。

※J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス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。

設定来のポートフォリオについて

●当ファンド

ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス（ＪＰＹ）の組入比率は原則として高位を維持し、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行いました。

●ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス（ＪＰＹ）

設定来、米ドル建の新興国の国債を中心にポートフォリオを構成し、新興国債券の高水準の利子収入の獲得と長期的な信託財産の成長を図りました。また、各通貨クラスにおいては、米ドルに対して各クラスの通貨にて為替取引を行いました（米ドルクラスを除く）。加えて国別配分・デューレーション[※]配分によってベンチマークを上回る運用を図りました。

※金利変動に対する債券価格の変動性。

●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債、政府保証債、地方債などで運用を行いました。

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

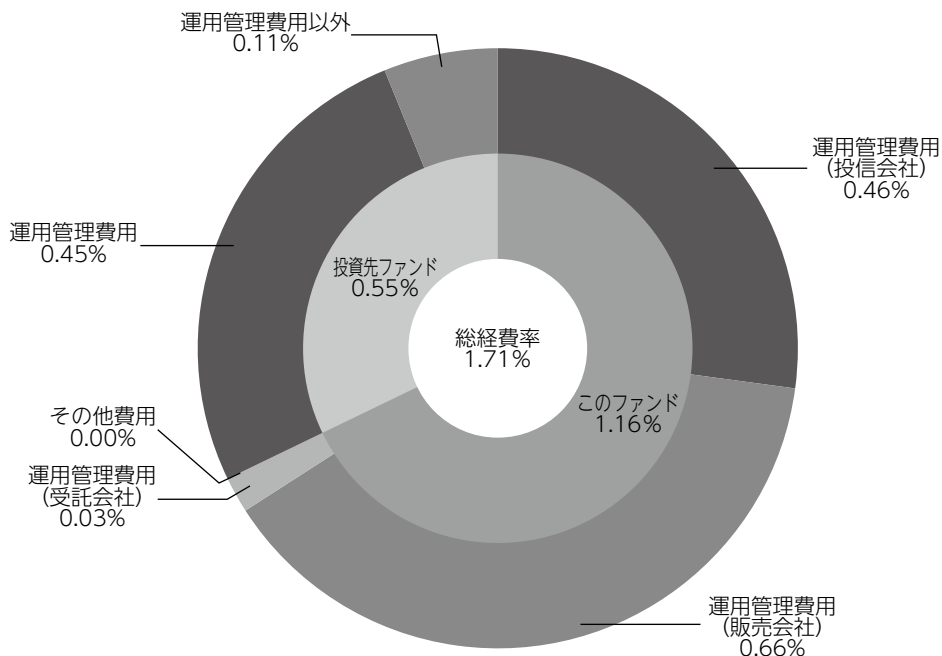
項目	第178期		項目の概要
	(2024年10月8日 ～2024年10月29日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	2円	0.069%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は3,544円です。
(投信会社)	(1)	(0.028)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(1)	(0.040)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(0)	(0.002)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
合計	2	0.069	

- (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。
- (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。
- (注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く）が支払った費用を含みません。

(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。



総経費率 (①+②+③)	1.71%
①このファンドの費用の比率	1.16%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.45%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11%

(注1) ①の費用は、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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 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。

■売買及び取引の状況（2024年10月8日から2024年10月29日まで）
投資信託受益証券

		第 178 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦建	ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (J P Y)	千口 －	千円 －	千口 183.64237	千円 686,477

（注）金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2024年10月8日から2024年10月29日まで）

		第 178 期			
		設 定		解 約	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
D I A Mマネーマザーファンド		千口 －	千円 －	千口 870	千円 875

■利害関係人との取引状況等（2024年10月8日から2024年10月29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。第30作成期末の組入れは以下の通りでした。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 30 作 成 期 末
	□ 数
ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス(J P Y)	千□ 183.64237
合 計	183.64237

(2) 親投資信託残高

	第 30 作 成 期 末
	□ 数
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 870

■投資信託財産の構成

2024年10月29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 692,177	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	692,177	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10月29日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	692,177,538円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	692,173,385
未 収 利 息	4,153
(B) 負 債	505,921
未 払 信 託 報 酬	505,921
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	691,671,617
元 本	1,953,046,901
償 還 差 損 益 金	△1,261,375,284
(D) 受 益 権 総 口 数	1,953,046,901口
1 万口当たり償還価額(C／D)	3,541円50銭

(注) 第177期末における元本額は1,982,310,925円、当作成期における追加設定元本額は4,333,300円、同解約元本額は33,597,324円です。

■損益の状況

[自 2024年10月 8 日
至 2024年10月29日]

項 目	第 178 期
(A) 配 当 等 収 益	26,183円
受 取 利 息	26,183
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△693,910
売 買 益	4,136
売 買 損	△698,046
(C) 信 託 報 酬 等	△505,921
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	△1,173,648
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,043,462,550
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△216,739,086
(配 当 等 相 当 額)	(105,227,938)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△321,967,024)
(G) 合 計(D＋E＋F)	△1,261,375,284
償 還 差 損 益 金(G)	△1,261,375,284

(注1) (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2) (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。

■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2009 年 10 月 29 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024 年 10 月 29 日		資産総額	692,177,538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	505,921円
				純資産総額	691,671,617円
受益権口数	290,527,758口	1,953,046,901口	1,662,519,143口	受益権口数	1,953,046,901口
元本額	290,527,758円	1,953,046,901円	1,662,519,143円	1万口当たり償還金	3,541円50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	778,305,465円	786,073,681円	10,100円	50円	0.50%
第2期	850,260,067	871,118,724	10,245	50	0.50
第3期	904,552,782	931,587,514	10,299	50	0.50
第4期	969,261,738	997,492,367	10,291	50	0.50
第5期	947,580,167	952,477,975	10,052	50	0.50
第6期	934,594,595	954,154,305	10,209	60	0.60
第7期	838,667,102	894,183,971	10,662	60	0.60
第8期	667,088,451	716,975,943	10,748	60	0.60
第9期	622,711,392	678,590,887	10,897	60	0.60
第10期	581,129,213	647,484,398	11,142	60	0.60
第11期	594,513,887	632,927,866	10,646	60	0.60
第12期	580,372,677	608,441,940	10,484	80	0.80
第13期	654,234,773	671,570,681	10,265	80	0.80
第14期	778,266,781	795,001,634	10,215	80	0.80
第15期	928,197,463	948,947,958	10,224	80	0.80
第16期	1,062,489,676	1,090,850,574	10,267	80	0.80
第17期	1,219,400,495	1,258,480,557	10,320	80	0.80
第18期	1,385,233,050	1,429,852,183	10,322	80	0.80
第19期	1,713,108,133	1,804,645,992	10,534	80	0.80
第20期	2,526,462,503	2,642,428,272	10,459	80	0.80
第21期	4,744,171,983	4,705,249,711	9,918	80	0.80
第22期	5,920,235,280	6,109,107,006	10,319	80	0.80
第23期	8,331,230,675	8,459,337,760	10,154	80	0.80
第24期	11,405,926,857	11,599,921,117	10,170	80	0.80
第25期	14,911,730,249	15,263,883,029	10,236	80	0.80
第26期	21,585,069,441	22,070,165,347	10,225	80	0.80
第27期	32,879,324,595	33,022,992,603	10,044	80	0.80
第28期	35,874,676,719	36,468,231,045	10,165	80	0.80

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	37,007,028,004円	36,480,405,836円	9,858円	80円	0.80%
第 30 期	36,861,605,216	36,947,799,797	10,023	80	0.80
第 31 期	37,875,412,393	38,896,031,297	10,269	80	0.80
第 32 期	39,137,813,103	39,984,919,809	10,216	80	0.80
第 33 期	42,920,267,154	43,931,239,870	10,236	80	0.80
第 34 期	47,063,156,374	47,240,436,997	10,038	80	0.80
第 35 期	53,889,884,442	54,123,768,894	10,043	80	0.80
第 36 期	62,899,613,573	61,730,657,411	9,814	80	0.80
第 37 期	62,255,252,048	59,004,507,725	9,478	80	0.80
第 38 期	56,758,702,835	53,565,648,854	9,437	80	0.80
第 39 期	47,468,854,630	44,589,435,416	9,393	80	0.80
第 40 期	42,307,667,877	40,339,795,582	9,535	80	0.80
第 41 期	36,652,834,318	32,718,097,323	8,926	60	0.60
第 42 期	31,441,578,684	26,597,679,078	8,459	60	0.60
第 43 期	28,472,874,771	23,844,917,247	8,375	60	0.60
第 44 期	26,405,012,667	21,097,017,557	7,990	60	0.60
第 45 期	24,563,994,823	20,250,603,930	8,244	60	0.60
第 46 期	22,730,254,641	18,878,688,692	8,306	60	0.60
第 47 期	21,340,211,102	16,969,612,786	7,952	60	0.60
第 48 期	19,536,031,059	15,597,694,436	7,984	60	0.60
第 49 期	18,364,675,557	14,418,770,988	7,851	60	0.60
第 50 期	17,260,899,745	13,838,712,314	8,017	60	0.60
第 51 期	16,266,683,380	13,106,137,642	8,057	60	0.60
第 52 期	15,780,274,771	12,840,509,794	8,137	60	0.60
第 53 期	15,354,347,473	12,613,643,766	8,215	60	0.60
第 54 期	14,774,841,258	12,117,212,470	8,201	60	0.60
第 55 期	14,120,539,300	11,450,976,661	8,109	60	0.60
第 56 期	13,853,470,795	11,290,966,945	8,150	60	0.60
第 57 期	13,460,172,130	10,549,808,979	7,838	60	0.60
第 58 期	13,187,534,354	10,356,401,269	7,853	60	0.60
第 59 期	12,683,386,854	9,836,012,406	7,755	60	0.60
第 60 期	12,334,012,489	9,307,944,085	7,547	60	0.60
第 61 期	11,990,566,112	9,098,838,342	7,588	60	0.60
第 62 期	11,692,442,855	8,794,855,554	7,522	60	0.60
第 63 期	11,354,294,007	8,661,556,332	7,628	60	0.60
第 64 期	10,947,052,659	8,283,557,531	7,567	60	0.60
第 65 期	10,741,716,002	7,896,128,728	7,351	60	0.60
第 66 期	10,460,816,740	7,601,822,933	7,267	60	0.60

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	10,184,182,807円	7,299,704,881円	7,168円	60円	0.60%
第 68 期	9,966,862,713	6,968,079,571	6,991	60	0.60
第 69 期	9,793,190,468	6,790,376,024	6,934	40	0.40
第 70 期	9,380,247,179	6,673,890,649	7,115	40	0.40
第 71 期	9,148,045,174	6,333,523,779	6,923	40	0.40
第 72 期	8,453,379,155	5,752,578,285	6,805	40	0.40
第 73 期	8,265,822,636	5,601,730,857	6,777	40	0.40
第 74 期	8,110,306,059	5,624,942,207	6,936	40	0.40
第 75 期	7,989,715,971	5,609,771,015	7,021	40	0.40
第 76 期	7,890,397,049	5,581,092,659	7,073	40	0.40
第 77 期	7,842,347,379	5,563,336,416	7,094	40	0.40
第 78 期	7,717,804,811	5,650,381,690	7,321	40	0.40
第 79 期	7,502,286,334	5,461,063,390	7,279	40	0.40
第 80 期	7,224,222,438	5,305,975,308	7,345	40	0.40
第 81 期	6,908,148,733	5,070,384,321	7,340	40	0.40
第 82 期	6,706,939,350	4,742,556,081	7,071	40	0.40
第 83 期	6,598,168,285	4,376,762,874	6,633	40	0.40
第 84 期	6,445,687,641	4,346,171,623	6,743	40	0.40
第 85 期	6,315,540,551	4,306,474,453	6,819	40	0.40
第 86 期	6,227,371,593	4,252,850,390	6,829	40	0.40
第 87 期	6,081,766,972	4,146,074,673	6,817	40	0.40
第 88 期	6,003,004,227	4,148,902,650	6,911	40	0.40
第 89 期	5,807,791,894	4,025,082,063	6,930	40	0.40
第 90 期	5,654,670,356	3,838,785,649	6,789	40	0.40
第 91 期	5,505,119,645	3,746,787,141	6,806	40	0.40
第 92 期	5,375,389,611	3,679,446,146	6,845	40	0.40
第 93 期	5,532,957,906	3,754,108,766	6,785	40	0.40
第 94 期	5,405,976,003	3,641,001,958	6,735	40	0.40
第 95 期	5,327,719,116	3,529,836,360	6,625	40	0.40
第 96 期	5,224,237,251	3,446,816,434	6,598	40	0.40
第 97 期	5,175,959,729	3,347,968,553	6,468	40	0.40
第 98 期	5,138,250,798	3,225,109,026	6,277	40	0.40
第 99 期	5,090,880,285	3,192,960,902	6,272	40	0.40
第 100 期	5,031,044,575	3,037,805,492	6,038	40	0.40
第 101 期	4,936,062,347	2,921,131,525	5,918	40	0.40
第 102 期	4,793,043,810	2,777,772,386	5,795	40	0.40
第 103 期	4,703,577,214	2,744,958,903	5,836	40	0.40
第 104 期	4,619,687,492	2,578,708,297	5,582	40	0.40

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	4,364,522,553円	2,451,827,736円	5,618円	40円	0.40%
第 106 期	4,329,034,133	2,406,687,461	5,559	20	0.20
第 107 期	4,234,656,269	2,325,534,591	5,492	20	0.20
第 108 期	4,165,742,444	2,327,000,222	5,586	20	0.20
第 109 期	4,125,877,787	2,373,961,886	5,754	20	0.20
第 110 期	4,074,609,752	2,317,215,274	5,687	20	0.20
第 111 期	3,946,897,546	2,265,170,726	5,739	20	0.20
第 112 期	3,924,027,191	2,212,224,785	5,638	20	0.20
第 113 期	3,909,440,356	2,227,553,964	5,698	20	0.20
第 114 期	3,886,685,519	2,293,735,567	5,902	20	0.20
第 115 期	3,872,453,157	2,267,496,326	5,855	20	0.20
第 116 期	3,834,426,637	2,200,593,653	5,739	20	0.20
第 117 期	3,799,177,822	2,149,841,078	5,659	20	0.20
第 118 期	3,766,504,011	2,111,405,713	5,606	20	0.20
第 119 期	3,731,026,204	2,076,186,401	5,565	20	0.20
第 120 期	3,696,351,230	2,102,988,954	5,689	20	0.20
第 121 期	3,685,512,945	2,130,462,181	5,781	20	0.20
第 122 期	3,626,689,263	2,121,116,266	5,849	20	0.20
第 123 期	3,601,342,813	1,780,765,033	4,945	20	0.20
第 124 期	3,591,354,406	1,820,802,791	5,070	20	0.20
第 125 期	3,593,204,925	1,985,731,514	5,526	20	0.20
第 126 期	3,555,481,254	1,968,970,543	5,538	20	0.20
第 127 期	3,522,460,731	2,017,943,377	5,729	20	0.20
第 128 期	3,378,734,315	1,933,293,172	5,722	20	0.20
第 129 期	3,322,937,241	1,832,520,418	5,515	20	0.20
第 130 期	3,300,775,328	1,836,049,530	5,562	20	0.20
第 131 期	3,275,979,862	1,868,641,637	5,704	20	0.20
第 132 期	3,252,114,060	1,869,328,928	5,748	20	0.20
第 133 期	3,178,211,429	1,782,934,853	5,610	20	0.20
第 134 期	3,132,218,718	1,676,397,357	5,352	20	0.20
第 135 期	3,087,532,419	1,623,393,936	5,258	20	0.20
第 136 期	3,042,962,360	1,612,946,755	5,301	20	0.20
第 137 期	3,034,221,764	1,625,026,073	5,356	20	0.20
第 138 期	2,992,650,070	1,605,984,649	5,366	20	0.20
第 139 期	2,970,334,542	1,603,889,461	5,400	20	0.20
第 140 期	2,925,920,434	1,587,527,769	5,426	20	0.20
第 141 期	2,889,521,014	1,505,905,827	5,212	20	0.20
第 142 期	2,845,078,116	1,479,743,298	5,201	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 143 期	2,814,139,409円	1,436,665,114円	5,105円	20円	0.20%
第 144 期	2,764,110,376	1,395,046,846	5,047	15	0.15
第 145 期	2,732,957,690	1,321,525,920	4,836	15	0.15
第 146 期	2,709,491,429	1,158,959,637	4,277	15	0.15
第 147 期	2,656,338,306	1,165,568,772	4,388	15	0.15
第 148 期	2,601,233,071	1,043,212,281	4,010	15	0.15
第 149 期	2,580,110,537	1,038,212,058	4,024	15	0.15
第 150 期	2,567,675,183	962,497,594	3,749	15	0.15
第 151 期	2,539,854,605	984,249,939	3,875	15	0.15
第 152 期	2,535,492,478	944,937,098	3,727	15	0.15
第 153 期	2,491,607,041	883,709,767	3,547	15	0.15
第 154 期	2,451,988,847	849,806,996	3,466	15	0.15
第 155 期	2,435,448,666	910,674,189	3,739	15	0.15
第 156 期	2,415,928,344	892,264,554	3,693	15	0.15
第 157 期	2,407,271,697	919,606,122	3,820	15	0.15
第 158 期	2,372,051,862	857,525,651	3,615	15	0.15
第 159 期	2,333,072,266	857,202,660	3,674	15	0.15
第 160 期	2,327,884,882	839,036,617	3,604	15	0.15
第 161 期	2,322,398,418	825,212,237	3,553	15	0.15
第 162 期	2,296,452,306	825,045,504	3,593	15	0.15
第 163 期	2,277,024,025	811,401,090	3,563	15	0.15
第 164 期	2,264,614,087	794,335,721	3,508	15	0.15
第 165 期	2,239,009,495	729,065,425	3,256	15	0.15
第 166 期	2,229,179,424	738,195,391	3,312	15	0.15
第 167 期	2,209,920,784	766,752,384	3,470	15	0.15
第 168 期	2,186,903,614	768,756,610	3,515	15	0.15
第 169 期	2,165,277,875	757,962,487	3,501	15	0.15
第 170 期	2,147,151,821	751,691,101	3,501	15	0.15
第 171 期	2,118,551,060	745,697,982	3,520	15	0.15
第 172 期	2,094,558,370	718,462,952	3,430	15	0.15
第 173 期	2,080,593,418	717,931,648	3,451	15	0.15
第 174 期	2,066,359,005	707,551,713	3,424	15	0.15
第 175 期	2,025,815,397	689,093,124	3,402	15	0.15
第 176 期	2,019,655,898	708,007,453	3,506	15	0.15
第 177 期	1,982,310,925	703,227,522	3,548	15	0.15

償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税引前）	3,541円50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。

ケイマン エマージング ソブリン ファンド

クラス J P Y / クラス U S D / クラス A U D / クラス Z A R / クラス B R L / クラス C N Y

当ファンドは「D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ」が投資対象とする外国投資信託です。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン籍円建外国投資信託
投 資 方 針 お よ び 主 要 投 資 対 象	①主として米ドル建ての新興国のソブリン債（国債および政府機関債等）に投資し、信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。 ②ポートフォリオの運用に関しては、新興国の米ドル建て国債の代表的指数である「J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（米ドルベース・為替ヘッジなし）」をベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざします。なお、ベンチマークは市場の構造変化等によっては今後見直す場合があります。 ③銘柄選定にあたっては、投資対象国のファンダメンタルズ分析や個別銘柄のバリュエーション分析等により決定します。 ④組入債券は、当初組入時において、S & P もしくは Moody's の外貨建て長期格付が B - 格もしくは B 3 格相当以上を取得している債券とします。 ⑤原則として、ポートフォリオの平均格付※は B - 格相当以上とします。 ⑥原則として、ポートフォリオの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーションに対して±2年以内とします。 ⑦米ドル建て以外の資産への投資は、純資産総額の20%以内を基本とします。但し、この場合は原則として対米ドルで為替取引することとします。 ⑧有価証券先物取引、金利スワップ等のデリバティブ取引を活用する場合があります。 ⑨各クラスは、米ドルに対して各クラスの通貨で為替取引を行います（クラス U S D を除く）。 ※平均格付とは、各組入債券にかかる信用格付を加重平均したものであり、外国投資信託にかかる信用格付ではありません。
投 資 顧 問 会 社	ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
受 託 銀 行	FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited.
管 理 事 務 代 行 会 社	Mizuho Trust & Banking (Luxembourg) S.A.
保 管 銀 行	Mizuho Bank (USA)

ケイマン エマージング ソブリン ファンドはケイマン籍外国投資信託で、2023年12月31日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下の「運用計算書および純資産変動計算書（損益計算書）」および「投資有価証券およびその他純資産明細書」等は、2023年12月31日現在の財務諸表の原文の翻訳を抜粋したものです。なお、クラス分けされたものがないため、シリーズ・トラスト単位（ケイマン エマージング ソブリン ファンド）で掲載しています。シリーズ・トラストは複数のクラスで構成されています。

運用計算書および純資産変動計算書
自2023年1月1日 至2023年12月31日
(日本円建て)

期首現在純資産	4,298,788,678
収益の部	
投資有価証券による純利息収入	241,317,375
収益合計	241,317,375
費用の部	
投資運用報酬	17,965,841
管理事務	8,559,162
監査報酬	4,156,471
受託報酬	2,112,278
保管報酬	1,756,939
その他費用	3,023,009
費用合計	37,573,700
純投資収益	203,743,675
投資有価証券売却による実現純利益	63,579,218
為替先渡契約および外貨取引による実現純利益	360,721,220
期中実現純利益額	424,300,438
投資有価証券による未実現純損益の変動	475,793,959
為替先渡契約および外貨取引による未実現純損益の変動	(42,238,718)
期中未実現純増額の変動	433,555,241
運用による純資産の純増	1,061,599,354
受益権口発行収入	50,500,000
受益権口償還コスト	(647,511,460)
受益者取引による純支払額合計	(597,011,460)
受益者に支払われた分配金	(260,866,782)
期末現在純資産額	4,502,509,790

投資有価証券およびその他純資産明細書
2023年12月31日現在
(日本円建て)

公認の証券取引所への上場を許可された譲渡性のある有価証券

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
変動利付債					
200,000	ARGENTINA (REPUBLIC OF) BDS STP 20-9/1/38	USD	21,608,561	11,221,324	0.25%
2,640,000	ARGENTINA (REPUBLIC OF) BDS STP 20-9/7/30	USD	289,111,264	150,105,468	3.33%
1,164,000	ARGENTINA (REPUBLIC OF) BDS STP 20-9/7/35	USD	142,519,017	56,679,339	1.26%
200,000	BANCO NCL DE COMERCIO EXTERIOR SNC/CAYMAN BDS FTV 21-11/8/31	USD	22,976,350	24,080,890	0.54%
	変動利付債合計		476,215,192	242,087,021	5.38%

普通債券

200,000	ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC BDS 3.65% 17-2/11/29	USD	26,017,742	26,811,227	0.60%
800,000	ABU DHABI GOVT INTL BOND BDS 1.7% 20-2/3/31	USD	91,556,864	95,661,207	2.13%
600,000	ABU DHABI GOVT INTL BOND BDS 3.125% 19-30/9/49	USD	62,650,476	62,329,222	1.38%
115,600	ARGENTINA (REPUBLIC OF) BDS 1% 20-9/7/29	USD	11,542,159	6,548,257	0.15%
200,000	BANCO NCL DE COMERCIO EXTERIOR SNC/CA BDS 4.375% 15-14/10/25	USD	22,087,460	27,633,987	0.61%
200,000	BANCO NCL DE PANAMA BDS 2.5% 20-11/8/30	USD	21,151,370	20,944,440	0.47%
200,000	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO BDS 5.375% 23-22/5/33	USD	27,150,500	28,634,885	0.64%
200,000	BRAZIL (FED. REPUBLIC OF) BDS 3.75% 21-12/9/31	USD	23,641,259	25,201,316	0.56%
800,000	BRAZIL (FED. REPUBLIC OF) BDS 3.875% 20-12/6/30	USD	87,276,547	103,470,967	2.30%
200,000	BRAZIL (FED. REPUBLIC OF) BDS 4.625% 17-13/1/28	USD	22,492,420	27,995,672	0.62%
200,000	BRAZIL (FED. REPUBLIC OF) BDS 4.75% 19-14/1/50	USD	21,230,304	21,774,047	0.48%
600,000	BRAZIL (FED. REPUBLIC OF) BDS 5% 14-27/1/45	USD	63,988,711	69,240,129	1.54%
400,000	CHILE (REPUBLIC OF) BDS 2.55% 21-27/7/33	USD	44,498,597	46,772,399	1.04%
400,000	CHILE (REPUBLIC OF) BDS 3.1% 21-22/1/61	USD	35,933,062	38,001,107	0.84%
800,000	CHILE (REPUBLIC OF) BDS 3.1% 21-7/5/41	USD	82,631,773	86,097,381	1.91%
400,000	COLOMBIA (REPUBLIC OF) BDS 3% 20-30/1/30	USD	43,503,695	47,702,544	1.06%
400,000	COLOMBIA (REPUBLIC OF) BDS 3.125% 20-15/4/31	USD	43,308,189	46,029,059	1.02%
400,000	COLOMBIA (REPUBLIC OF) BDS 3.25% 21-22/4/32	USD	40,127,340	44,918,105	1.00%
400,000	COLOMBIA (REPUBLIC OF) BDS 5% 15-15/6/45	USD	45,630,445	43,906,711	0.98%
300,000	COLOMBIA (REPUBLIC OF) BDS 5.2% 19-15/5/49	USD	32,735,149	33,161,772	0.74%
400,000	COLOMBIA (REPUBLIC OF) BDS 7.5% 23-2/2/34	USD	54,279,148	59,634,634	1.32%
200,000	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD BDS 4.677% 21-9/2/51	USD	21,660,618	20,094,566	0.45%
200,000	CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE BDS 3% 19-30/9/29	USD	23,313,016	25,166,463	0.56%
200,000	CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE BDS 3.625% 17-1/8/27	USD	25,221,821	26,761,083	0.59%
200,000	DOMINICAN REPUBLIC BDS 4.5% 20-30/1/30	USD	22,247,348	26,034,532	0.58%
400,000	DOMINICAN REPUBLIC BDS 4.875% 20-23/9/32	USD	45,062,801	51,465,968	1.14%
750,000	DOMINICAN REPUBLIC BDS 5.3% 21-21/1/41	USD	78,138,534	91,679,569	2.04%
200,000	DOMINICAN REPUBLIC BDS 5.5% 22-22/2/29	USD	24,643,622	27,618,360	0.61%
350,000	DOMINICAN REPUBLIC BDS 5.875% 20-30/1/60	USD	36,012,523	42,781,333	0.95%
200,000	DOMINICAN REPUBLIC BDS 5.95% 17-25/1/27	USD	26,141,233	28,348,274	0.63%
100,000	DOMINICAN REPUBLIC BDS 6.85% 15-27/1/45	USD	11,133,986	14,073,386	0.31%
200,000	DP WORLD LTD/UNITED ARAB EMIRATES BDS 4.7% 19-30/9/49	USD	23,012,762	23,908,735	0.53%
200,000	EGYPT (ARAB REPUBLIC OF) BDS 3.875% 21-16/2/26	USD	21,952,364	23,108,535	0.51%
200,000	EGYPT (ARAB REPUBLIC OF) BDS 5.8% 21-30/9/27	USD	19,867,886	21,804,780	0.48%
400,000	EGYPT (ARAB REPUBLIC OF) BDS 5.875% 21-16/2/31	USD	39,931,764	37,074,267	0.82%
200,000	EGYPT (ARAB REPUBLIC OF) BDS 7.625% 20-29/5/32	USD	17,949,680	19,657,734	0.44%
800,000	EGYPT (ARAB REPUBLIC OF) BDS 7.903% 18-21/2/48	USD	70,601,047	68,294,117	1.52%
200,000	EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL ESTAD BDS 3.068% 20-18/8/50	USD	16,807,095	17,188,082	0.38%
200,000	ENA MASTER TRUST BDS 4% 20-19/5/48	USD	21,722,129	19,803,350	0.44%
200,000	ESKOM HOLDINGS SOC LTD BDS 4.314% 21-23/7/27	USD	24,804,762	26,401,602	0.59%
200,000	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA BDS 3.375% 16-5/8/26	USD	24,796,008	27,094,034	0.60%

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
200,000	FIN. DEPARTMENT GOVT OF SHARJAH BDS 3.625% 21-10/3/33	USD	21,782,137	24,046,517	0.53%
200,000	FIN. DEPARTMENT GOVT OF SHARJAH BDS 4% 20-28/7/50	USD	22,441,674	18,889,859	0.42%
500,000	FONDO MIVIVIENDA SA BDS 4.625% 22-12/4/27	USD	61,699,536	68,901,922	1.53%
600,000	HUNGARY (REPUBLIC OF) BDS 2.125% 21-22/9/31	USD	63,151,913	68,367,362	1.52%
200,000	HUNGARY (REPUBLIC OF) BDS 3.125% 21-21/9/51	USD	16,598,175	19,192,844	0.43%
400,000	HUTAMA KARYA PERSERO PT BDS 3.75% 20-11/5/30	USD	46,545,837	52,859,005	1.17%
200,000	INDONESIA (REPUBLIC OF) BDS 3.5% 20-14/2/50	USD	21,664,644	22,838,814	0.51%
400,000	INDONESIA (REPUBLIC OF) -REGS- BDS 4.75% 17-18/7/47	USD	45,546,943	55,936,854	1.24%
200,000	INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD BDS 6.75% 21-7/10/31	USD	26,468,144	28,453,110	0.63%
200,000	JORDAN (KINGDOM OF) BDS 5.85% 20-7/7/30	USD	25,167,075	26,279,687	0.58%
200,000	JORDAN (KINGDOM OF) BDS 7.375% 17-10/10/47	USD	25,369,619	25,127,240	0.56%
200,000	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC BDS 3.5% 20-14/4/33	USD	20,492,598	23,491,585	0.52%
200,000	KAZTRANS GAS JSC BDS 4.375% 17-26/9/27	USD	27,546,297	27,094,344	0.60%
200,000	MAGYAR EXPORT-IMPORT BANK ZRT BDS 6.125% 23-4/12/27	USD	26,551,929	28,716,331	0.64%
200,000	MDGH - GMTN BV BDS 3.95% 20-21/5/50	USD	24,901,132	23,500,265	0.52%
600,000	MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) BDS 2.659% 20-24/5/31	USD	64,306,136	71,680,534	1.59%
400,000	MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) BDS 3.5% 22-12/2/34	USD	46,902,173	47,826,103	1.06%
1,000,000	MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) BDS 4.6% 15-23/1/46	USD	112,442,339	118,061,199	2.62%
400,000	MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) BDS 4.75% 12-8/3/44	USD	41,856,551	48,632,146	1.08%
200,000	NIGERIA (FEDERAL REPUBLIC OF) BDS 8.375% 22-24/3/29	USD	23,684,000	27,126,443	0.60%
200,000	OMAN (SULTANATE OF) BDS 5.625% 18-17/1/28	USD	25,735,257	28,770,158	0.64%
600,000	OMAN (SULTANATE OF) BDS 6.25% 21-25/1/31	USD	80,392,098	89,106,411	1.98%
400,000	OMAN (SULTANATE OF) BDS 6.75% 18-17/1/48	USD	59,117,992	59,117,381	1.31%
600,000	PANAMA (REPUBLIC OF) BDS 2.252% 20-29/9/32	USD	64,398,881	61,853,687	1.37%
400,000	PANAMA (REPUBLIC OF) BDS 3.87% 19-23/7/60	USD	41,392,117	33,898,823	0.75%
400,000	PANAMA (REPUBLIC OF) BDS 4.3% 13-29/4/53	USD	36,131,030	37,895,602	0.84%
200,000	PANAMA (REPUBLIC OF) BDS 4.5% 17-15/5/47	USD	23,303,472	20,092,079	0.45%
200,000	PERTAMINA PERSERO PT BDS 4.15% 20-25/2/60	USD	20,126,560	22,275,973	0.50%
400,000	PERU (REPUBLIC OF) BDS 2.78% 20-1/12/60	USD	36,795,704	35,326,137	0.78%
80,000	PERU (REPUBLIC OF) BDS 2.783% 20-23/1/31	USD	8,617,742	9,843,521	0.22%
200,000	PERU (REPUBLIC OF) BDS 3% 21-15/1/34	USD	22,805,197	23,871,564	0.53%
100,000	PERU (REPUBLIC OF) BDS 3.55% 21-10/3/51	USD	10,364,900	10,743,824	0.24%
200,000	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT BDS 4.125% 17-15/5/27	USD	22,501,680	27,439,968	0.61%
200,000	PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT BDS 5.45% 18-21/5/28	USD	25,106,240	28,657,571	0.64%
200,000	PETROLEOS DEL PERU SA BDS 4.75% 17-19/6/32	USD	23,612,581	20,251,813	0.45%
300,000	PETROLEOS MEXICANOS BDS 4.5% 16-23/1/26	USD	29,528,845	39,586,119	0.88%
100,000	PETROLEOS MEXICANOS BDS 6.375% 14-23/1/45	USD	8,724,888	9,199,133	0.20%
200,000	PETRONAS CAPITAL LTD BDS 2.48% 21-28/1/32	USD	23,803,845	24,088,282	0.53%
400,000	PHILIPPINES (REPUBLIC OF) BDS 3.7% 16-1/3/41	USD	45,456,002	48,499,364	1.08%
150,000	POLAND (REPUBLIC OF) BDS 4.875% 23-4/10/33	USD	20,754,805	21,480,391	0.48%
1,000,000	QATAR (GOVT OF) BDS 4.4% 20-16/4/50	USD	127,206,621	130,165,613	2.89%
200,000	QATAR (GOVT OF) BDS 5.75% 11-20/1/42	USD	30,891,826	31,100,077	0.69%
800,000	QATAR PETROLEUM BDS 3.125% 21-12/7/41	USD	89,340,877	86,892,208	1.93%
200,000	QATAR PETROLEUM BDS 3.3% 21-12/7/51	USD	21,346,940	20,647,007	0.46%
200,000	REPUBLIC OF ARMENIA INTL BOND BDS 3.95% 19-26/9/29	USD	21,371,903	24,641,495	0.55%
400,000	ROMANIA (REPUBLIC OF) BDS 3% 20-14/2/31	USD	44,150,023	48,092,358	1.07%
400,000	ROMANIA (REPUBLIC OF) BDS 4% 20-14/2/51	USD	42,391,997	41,021,607	0.91%
200,000	SENEGAL (REPUBLIC OF) BDS 6.75% 18-13/3/48	USD	22,533,702	22,237,007	0.49%
200,000	SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) BDS 5.375% 14-24/7/44	USD	21,889,682	22,556,929	0.50%
600,000	SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF) BDS 5.75% 19-30/9/49	USD	64,904,251	67,772,074	1.51%
200,000	TC ZIRAAT BANKASI AS BDS 5.375% 21-2/3/26	USD	27,772,648	27,245,879	0.61%
200,000	TRANSNET SOC LTD BDS 8.25% 23-6/2/28	USD	26,465,581	28,460,015	0.63%
600,000	TURKEY (REPUBLIC OF) BDS 4.25% 15-14/4/26	USD	60,263,472	81,216,579	1.80%
400,000	TURKEY (REPUBLIC OF) BDS 4.875% 13-16/4/43	USD	36,124,275	41,304,666	0.92%
200,000	TURKEY (REPUBLIC OF) BDS 4.875% 16-9/10/26	USD	21,299,869	27,254,531	0.61%
200,000	TURKEY (REPUBLIC OF) BDS 6% 17-25/3/27	USD	22,999,727	27,905,816	0.62%
800,000	TURKEY (REPUBLIC OF) BDS 6.125% 18-24/10/28	USD	78,813,549	111,122,190	2.47%

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
200,000	TURKEY (REPUBLIC OF) BDS 9.375% 23-14/3/29	USD	27,280,815	31,234,674	0.69%
300,000	UKRAINE (REPUBLIC OF) BDS 8.994% 18-1/2/24	USD	32,892,907	12,691,665	0.28%
1,000,000	UKRAINE (REPUBLIC OF) BDS 9.75% 18-1/11/28	USD	111,542,053	40,863,900	0.91%
240,000	URUGUAY (REPUBLIC OF) BDS 4.975% 18-20/4/55	USD	33,999,284	33,128,033	0.74%
200,000	VIETNAM (SOCIALIST REPUBLIC OF) BDS 4.8% 14-19/11/24	USD	27,202,012	27,900,172	0.62%
普通債券合計			3,876,226,911	4,065,302,298	90.29%
投資有価証券公正価値合計			4,352,442,103	4,307,389,319	95.67%

	2023年12月31日
クラスA U D (日本円)	
発行済受益権口数	148,828.93
1口当たり純資産価額	2,683
クラスB R L (日本円)	
発行済受益権口数	4,042,713.62
1口当たり純資産価額	753
クラスC N Y (日本円)	
発行済受益権口数	6,438.00
1口当たり純資産価額	7,957
クラスJ P Y (日本円)	
発行済受益権口数	203,142.37
1口当たり純資産価額	3,827
クラスU S D (日本円)	
発行済受益権口数	4,501.74
1口当たり純資産価額	8,512
クラスZ A R (日本円)	
発行済受益権口数	126,766.39
1口当たり純資産価額	1,504

D I A Mマネーマザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2024年4月5日）

（計算期間 2023年4月6日～2024年4月5日）

D I A Mマネーマザーファンドの第15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	2009年10月29日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保をめざします。
主要投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建て資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 中 騰 落 率	債 券 組 入 比 率	新株予約権 付 社 債 (転換社債)	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
11期(2020年4月6日)	円	%	%	%	%	百万円
	10,089	△0.1	69.3	—	—	1,139
12期(2021年4月5日)	10,080	△0.1	62.4	—	—	1,064
13期(2022年4月5日)	10,071	△0.1	76.3	—	—	1,192
14期(2023年4月5日)	10,063	△0.1	71.8	—	—	1,253
15期(2024年4月5日)	10,055	△0.1	62.0	—	—	483

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンド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標を定めておりません。

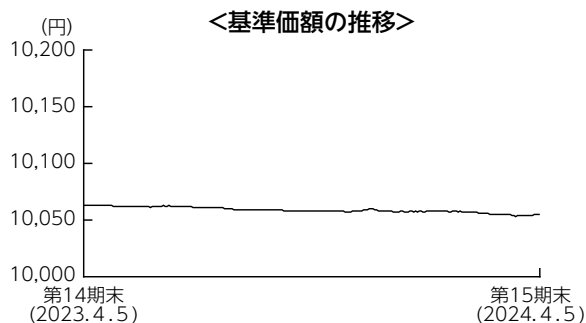
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 組 入 比 率	新株予約権付 社債(転換社債) 組入比率	債 先 物 比 率
(期 首) 2023年 4 月 5 日	円 10,063	% －	% 71.8	% －	% －
4 月 末	10,062	△0.0	71.8	－	－
5 月 末	10,062	△0.0	61.6	－	－
6 月 末	10,061	△0.0	61.6	－	－
7 月 末	10,060	△0.0	61.6	－	－
8 月 末	10,059	△0.0	61.6	－	－
9 月 末	10,058	△0.0	61.6	－	－
10 月 末	10,057	△0.1	61.6	－	－
11 月 末	10,058	△0.0	61.6	－	－
12 月 末	10,057	△0.1	60.2	－	－
2024年 1 月 末	10,057	△0.1	60.2	－	－
2 月 末	10,055	△0.1	60.1	－	－
3 月 末	10,054	△0.1	62.0	－	－
(期 末) 2024年 4 月 5 日	10,055	△0.1	62.0	－	－

(注 1) 騰落率は期首比です。
(注 2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年4月6日から2024年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,055円となり、前期末比で0.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざした運用を行いましたが、日銀のマイナス金利政策の影響が大きく基準価額は前期末比で下落して期末を迎えました。

投資環境

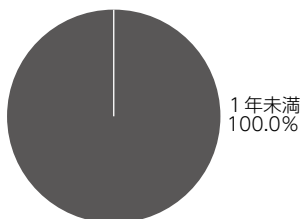
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは、日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続した影響によりマイナス圏で推移しましたが、当期末にかけては、マイナス金利政策の解除を受けて上昇の動きとなり、利回りはプラス水準に転じる局面がありました。

ポートフォリオについて

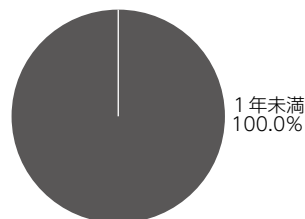
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比 期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

日銀は2024年3月の金融政策決定会合で、マイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策の解除を決定しました。声明文で日銀は「現時点の経済・物価見通しを前提にすれば、当面、緩和的な金融環境が継続すると考えている。」としており、今後はプラス圏ながらも金利は低位で推移するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

■ 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。

■ 売買及び取引の状況（2023年 4 月 6 日から2024年 4 月 5 日まで）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	内 国 債 証 券	500,341	600,273 (500,000)

（注 1）金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。
（注 2）（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2023年 4 月 6 日から2024年 4 月 5 日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
区 分	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
公 社 債	百万円 500	百万円 200	% 40.0	百万円 600	百万円 －	% －

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、みずほ証券です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国 債 証 券	千円 300,000	千円 299,992	% 62.0	% －	% －	% －	% 62.0
合 計	300,000	299,992	62.0	－	－	－	62.0

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第 2 位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末				
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
(国債証券)	%	千円	千円		
4 4 0 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,006	2024/09/01	
4 4 1 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,004	2024/10/01	
4 4 6 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	99,982	2025/03/01	
合 計	－	300,000	299,992	－	

■投資信託財産の構成

2024年 4月 5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 299,992	% 62.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	183,876	38.0
投 資 信 託 財 産 総 額	483,868	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4月5日)現在

項 目				当 期 末
(A) 資	産			483,868,290円
コ	ー	ル	・	等
公	社			183,875,306
未	収	利		債(評価額)
前	払	費		299,992,000
(B) 負	債			—
(C) 純	資	産	総	額(A－B)
元				483,868,290
次	期	繰	越	損
				益
(D) 受	益	権	総	口
1	万	口	当	た
			り	基
			準	価
			額	(C／D)
				10,055円

(注1) 期首元本額	1,245,658,613円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
追加設定元本額	13,726,863円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
一部解約元本額	778,151,914円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
(注2) 期末における元本の内訳		ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
バンクローン・ファンド (ヘッジなし)	15,843,407円	PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり)	301,134円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり)	13,867,169円	PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし)	1,493,740円
バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型)	1,088,285円	One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)	9,943,324円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり/年1回決算型)	98,095円	One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (毎月決算・予想分配金提示型)	1,988,665円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3,959,763円	期末元本合計	481,233,562円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	989,197円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	494,102円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号	494,102円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号	48,517円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	395,083円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	11,377円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	98,027円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	989,197円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	395,083円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	494,102円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	494,102円		
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>	791,316円		
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>	2,474,972円		
クルーズコントロール	294,245,101円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10,530,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円		
USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり)	993,740円		
USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし)	1,987,479円		
DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>	9,935円		
マシュエズ・アジア株式ファンド	14,723,185円		
One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円		
One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円		
One世界分散セレクト (Cコース)	99,040円		
世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型)	99,109円		
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円		

■損益の状況

当期 自2023年4月6日 至2024年4月5日

項 目					当 期
(A) 配 当 等 収 益					△54,712円
受 取 利 息					26,392
支 払 利 息					△81,104
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益					△502,000
売 買 益					14,000
売 買 損					△516,000
(C) 当 期 損 益 金(A + B)					△556,712
(D) 前 期 繰 越 損 益 金					7,856,815
(E) 解 約 差 損 益 金					△4,744,512
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金					79,137
(G) 合 計(C + D + E + F)					2,634,728
次 期 繰 越 損 益 金(G)					2,634,728

(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) (E)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) (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。