

運用報告書 (全体版)

D I A M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>

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 (AUD)」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 A M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、豪ドル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であ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。

第142期	<決算日	2021年11月5日>
第143期	<決算日	2021年12月6日>
第144期	<決算日	2022年1月5日>
第145期	<決算日	2022年2月7日>
第146期	<決算日	2022年3月7日>
第147期	<決算日	2022年4月5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、「D I A M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>」は、2022年4月5日に第147期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

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

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

D I AM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>

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託 組入比率	純資産 総額
		(分配落)	税込 み金	期騰 落率		
第21作成期	118期(2019年11月5日)	円 3,528	円 35	% 2.9	% 98.7	百万円 1,012
	119期(2019年12月5日)	3,472	35	△0.6	98.5	984
	120期(2020年1月6日)	3,607	35	4.9	95.5	1,011
	121期(2020年2月5日)	3,526	35	△1.3	97.8	966
	122期(2020年3月5日)	3,416	35	△2.1	97.9	921
	123期(2020年4月6日)	2,626	35	△22.1	97.6	703
第22作成期	124期(2020年5月7日)	2,826	20	8.4	97.8	755
	125期(2020年6月5日)	3,387	20	20.6	98.0	903
	126期(2020年7月6日)	3,330	20	△1.1	97.9	855
	127期(2020年8月5日)	3,497	20	5.6	98.1	877
	128期(2020年9月7日)	3,560	20	2.4	98.0	873
	129期(2020年10月5日)	3,337	20	△5.7	98.7	803
第23作成期	130期(2020年11月5日)	3,346	20	0.9	98.0	756
	131期(2020年12月7日)	3,530	20	6.1	97.9	787
	132期(2021年1月5日)	3,620	20	3.1	98.0	797
	133期(2021年2月5日)	3,575	20	△0.7	97.9	778
	134期(2021年3月5日)	3,565	20	0.3	98.7	770
	135期(2021年4月5日)	3,500	20	△1.3	98.1	751
第24作成期	136期(2021年5月6日)	3,533	20	1.5	98.1	734
	137期(2021年6月7日)	3,578	20	1.8	98.3	741
	138期(2021年7月5日)	3,526	20	△0.9	97.9	725
	139期(2021年8月5日)	3,431	20	△2.1	98.5	686
	140期(2021年9月6日)	3,474	20	1.8	98.8	683
	141期(2021年10月5日)	3,298	20	△4.5	97.8	638
第25作成期	142期(2021年11月5日)	3,417	20	4.2	98.2	650
	143期(2021年12月6日)	3,157	20	△7.0	97.7	590
	144期(2022年1月5日)	3,309	10	5.1	98.6	614
	145期(2022年2月7日)	3,070	10	△6.9	98.4	544
	146期(2022年3月7日)	2,813	10	△8.0	98.0	495
	147期(2022年4月5日)	3,167	10	12.9	97.9	544

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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) 「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4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

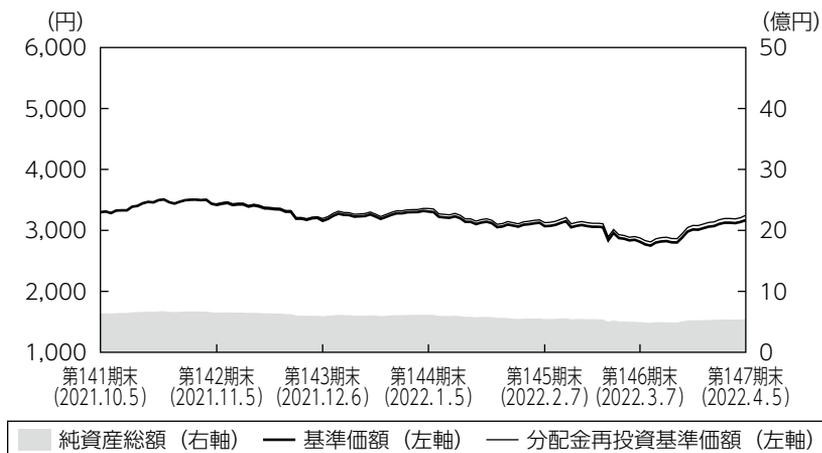
決算期	年 月 日	基準 価 額		投資信託受益証券 組 入 比 率
		騰	落 率	
第142期	(期 首) 2021 年 10 月 5 日	円 3,298	% -	% 97.8
	10 月 末	3,504	6.2	97.3
	(期 末) 2021 年 11 月 5 日	3,437	4.2	98.2
第143期	(期 首) 2021 年 11 月 5 日	3,417	-	98.2
	11 月 末	3,192	△6.6	98.1
	(期 末) 2021 年 12 月 6 日	3,177	△7.0	97.7
第144期	(期 首) 2021 年 12 月 6 日	3,157	-	97.7
	12 月 末	3,302	4.6	98.3
	(期 末) 2022 年 1 月 5 日	3,319	5.1	98.6
第145期	(期 首) 2022 年 1 月 5 日	3,309	-	98.6
	1 月 末	3,061	△7.5	97.4
	(期 末) 2022 年 2 月 7 日	3,080	△6.9	98.4
第146期	(期 首) 2022 年 2 月 7 日	3,070	-	98.4
	2 月 末	2,959	△3.6	97.5
	(期 末) 2022 年 3 月 7 日	2,823	△8.0	98.0
第147期	(期 首) 2022 年 3 月 7 日	2,813	-	98.0
	3 月 末	3,126	11.1	97.5
	(期 末) 2022 年 4 月 5 日	3,177	12.9	97.9

(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) 「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。

■第142期～第147期の運用経過（2021年10月6日から2022年4月5日まで）

基準価額等の推移



第142期首： 3,298円
 第147期末： 3,167円
 (既払分配金80円)
 騰落率： △1.5%
 (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

為替市場において豪ドル／円相場が豪ドル高円安となりましたが、新興国債券市場の下落によるマイナス要因が上回り、基準価額は下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (AUD)	△0.9%
D I A M マネー マザー ファンド	△0.1%

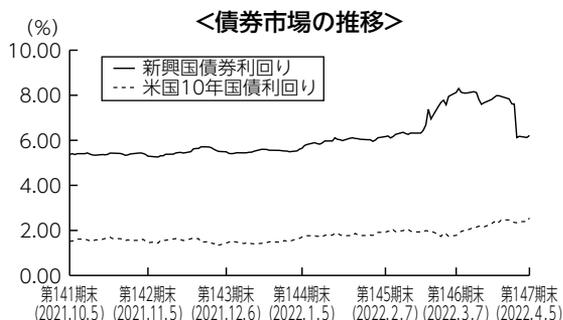
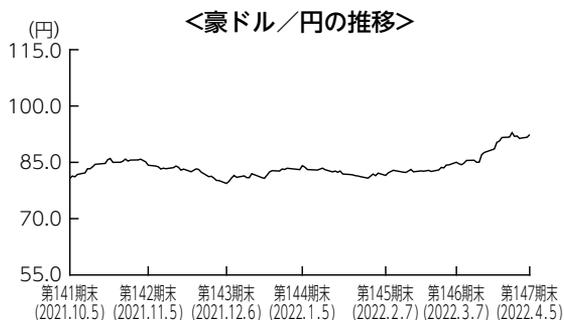
(注) ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (AUD) の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

投資環境

当作成期の新興国債券市場は下落しました。作成期前半から半ばにかけては、新型コロナウイルスの感染再拡大に対する懸念が広がったことや、米金融政策の正常化ペースが速まるとの見方が強まったことなどから、新興国債券市場は上値の重い展開となりました。作成期の後半は、ロシアがウクライナに侵攻したことを受けてリスク回避姿勢が強まる中、新興国債券市場は下落しましたが、停戦協議への期待が高まると、下落幅を縮小しました。

豪ドル／円相場は、豪ドル高円安となりました。新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大を受けてリスク回避姿勢が意識され、豪ドル安円高となる場面も見られましたが、オーストラリア経済の回復期待が高まる中、オーストラリア準備銀行による金融政策の正常化観測が広がったことなどから、豪ドルは対円で上昇しました。

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ている影響により、マイナス圏で推移しました。



※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。

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 (AUD) 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 (AUD)

海外債券への投資については、新興国の国債を中心にポートフォリオを構成しました。地域別では、アフリカ、アジアの比率を高め、欧州、中南米の比率を低めにしました。国別では、中国、ハンガリーを組入れから外し、ロシア、ウクライナのウェイトを引き下げた一方、カタールを新たに組入れ、メキシコ、インドネシアなどのウェイトを引き上げました。2022年3月にベンチマーク構成国の変更があり、国別配分を調整しました。

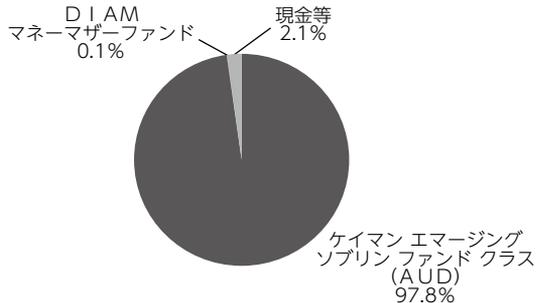
また、米ドルを売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行いました。

●D I A Mマネーマザーファンド

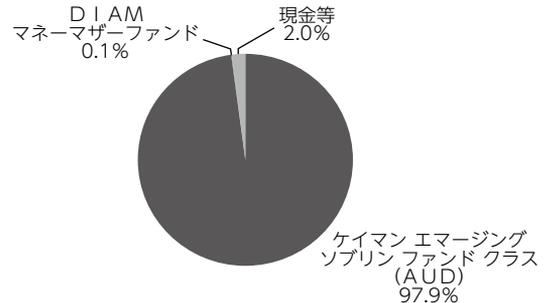
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

ポートフォリオ構成 ※比率は純資産総額に対する割合です。

前作成期末



当作成期末



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142期	第143期	第144期	第145期	第146期	第147期
	2021年10月6日 ~2021年11月5日	2021年11月6日 ~2021年12月6日	2021年12月7日 ~2022年1月5日	2022年1月6日 ~2022年2月7日	2022年2月8日 ~2022年3月7日	2022年3月8日 ~2022年4月5日
当期分配金（税引前）	20円	20円	10円	10円	10円	10円
対基準価額比率	0.58%	0.63%	0.30%	0.32%	0.35%	0.31%
当期の収益	20円	20円	10円	10円	10円	10円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	3,492円	3,495円	3,498円	3,499円	3,499円	3,503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。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (AUD) を高位に組入れることを基本とした運用を行い、高水準の利子収入の獲得と中長期的な信託財産の成長をめざします。また、D I A M マネーマザーファンドへの投資も行います。

●ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (AUD)

ロシアのウクライナ侵攻後、投資環境は大きな不確実性に直面しています。エネルギーと商品価格の高止まりの可能性とインフレ率上昇への懸念に課題があるものの、新興国市場は長期的には先進国市場と比較して優位な資産となると考えています。投資戦略はフィリピンをアンダーウェイト、インドネシア、メキシコをオーバーウェイトとしつつ分散投資のメリットに重点をおき、地域配分ではアフリカ、アジア（除く中東）をオーバーウェイト、欧州をアンダーウェイトとします。ロシア国債に関しては、ウクライナへの侵攻とそれに伴う欧米諸国からの経済制裁強化など、不透明感が強まっていることや、2022年3月末に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」から除外されることが決定したため、ポジションは解消する方針です。経済制裁により流動性が低下し、取引制限を受ける場合もあるため、投資方針どおりの運用が実施できない場合もあります。引き続き、資本規制の動向や、バリュエーション、市場での流動性等を総合的に判断し、適切な対応に努めます。加えて、米ドルを売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行います。

●D I A M マネーマザーファンド

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。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

項目	第142期～第147期 (2021年10月6日 ～2022年4月5日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	18円	
(投信会社)	(7)	(0.230)	
(販売会社)	(10)	(0.329)	
(受託会社)	(0)	(0.015)	
(b) その他費用 (監査費用)	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 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
合計	18	0.574	

(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。

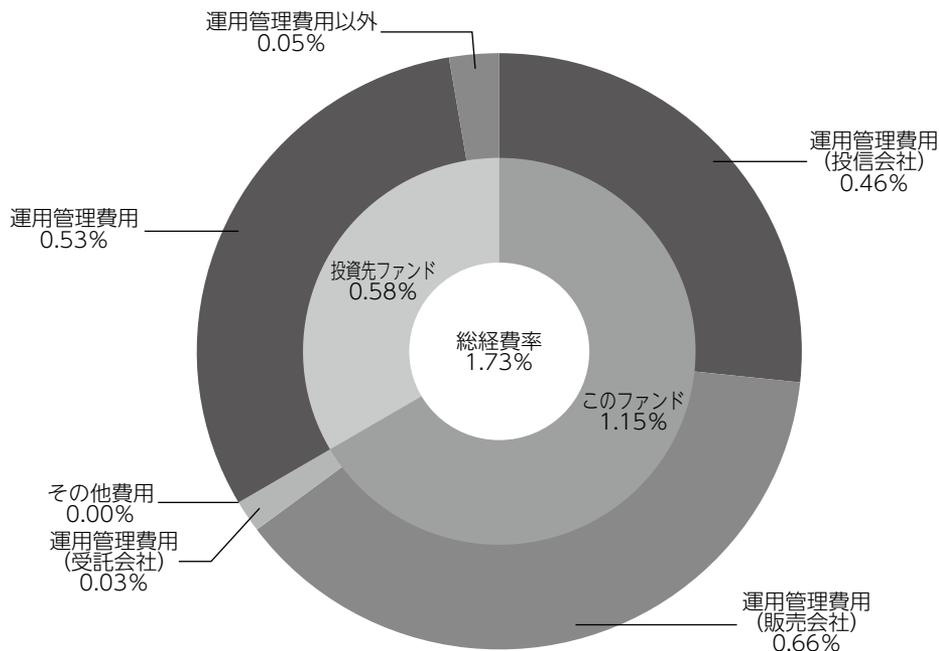
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.73%です。



総経費率 (①+②+③)	1.73%
①このファンドの費用の比率	1.15%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.53%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.05%

(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（2021年10月6日から2022年4月5日まで）

投資信託受益証券

		第 142 期 ~ 第 147 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(AUD)	千口 -	千円 -	千口 21.6	千円 63,968

(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（2021年10月6日から2022年4月5日まで）

期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2021年10月6日から2022年4月5日まで）

【D I AM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>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。

【D I AMマネー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状況

決 算 期		第 142 期 ~ 第 147 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	
公 社 債	百万円 400	百万円 100		% 25.0	百万円 -	百万円 -	% -

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。

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、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(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 24 作 成 期 末	第 25 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
	千□	千□	千円	%
ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス(AUD)	198.30317	176.70317	532,583	97.9
合 計	198.30317	176.70317	532,583	97.9

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第 24 作 成 期 末	第 25 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
D I A M マ ネ ー マ ザ ー ファ ン ド	530	530	533

■投資信託財産の構成

2022年4月5日現在

項 目	第 25 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 532,583	% 97.5
D I A M マネーマザーファンド	533	0.1
コール・ローン等、その他	13,155	2.4
投資信託財産総額	546,272	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

(2021年11月5日)、(2021年12月6日)、(2022年1月5日)、(2022年2月7日)、(2022年3月7日)、(2022年4月5日)現在

項 目	第 142 期末	第 143 期末	第 144 期末	第 145 期末	第 146 期末	第 147 期末
(A) 資 産	658,350,827円	602,169,224円	616,708,031円	549,747,770円	498,616,508円	546,272,155円
コール・ローン等	18,520,465	24,665,671	10,788,114	13,201,195	12,924,719	13,155,038
投資信託受益証券(評価額)	639,296,334	576,969,525	605,385,995	536,012,759	485,157,973	532,583,354
D I A M マネーマザーファンド(評価額)	534,028	534,028	533,922	533,816	533,816	533,763
(B) 負 債	7,492,703	11,651,816	2,646,052	5,239,114	3,601,029	2,199,052
未払収益分配金	3,809,256	3,741,382	1,855,526	1,773,775	1,759,828	1,717,873
未払解約金	3,034,901	7,287,554	212,470	2,860,942	1,369,025	6,255
未払信託報酬	646,919	621,313	576,602	602,881	470,993	473,736
その他未払費用	1,627	1,567	1,454	1,516	1,183	1,188
(C) 純資産総額(A-B)	650,858,124	590,517,408	614,061,979	544,508,656	495,015,479	544,073,103
元 本	1,904,628,061	1,870,691,420	1,855,526,096	1,773,775,559	1,759,828,023	1,717,873,386
次期繰越損益金	△1,253,769,937	△1,280,174,012	△1,241,464,117	△1,229,266,903	△1,264,812,544	△1,173,800,283
(D) 受益権総口数	1,904,628,061口	1,870,691,420口	1,855,526,096口	1,773,775,559口	1,759,828,023口	1,717,873,386口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,417円	3,157円	3,309円	3,070円	2,813円	3,167円

(注) 第141期末における元本額は1,934,743,040円、当作成期間(第142期～第147期)中における追加設定元本額は30,056,263円、同解約元本額は246,925,917円です。

■損益の状況

〔自 2021年10月6日 至 2021年11月5日〕〔自 2021年11月6日 至 2021年12月6日〕〔自 2021年12月7日 至 2022年1月5日〕〔自 2022年1月6日 至 2022年2月7日〕〔自 2022年2月8日 至 2022年3月7日〕〔自 2022年3月8日 至 2022年4月5日〕

項 目	第 142 期	第 143 期	第 144 期	第 145 期	第 146 期	第 147 期
(A) 配 当 等 収 益	4,931,293円	4,827,701円	2,493,027円	2,452,699円	2,380,107円	2,316,647円
受 取 配 当 金	4,931,529	4,828,051	2,493,212	2,452,794	2,380,187	2,316,667
受 取 利 息	-	-	-	16	5	1
支 払 利 息	△236	△350	△185	△111	△85	△21
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	22,164,301	△49,151,579	28,264,993	△42,566,293	△45,357,284	60,731,797
売 買 益	22,674,762	772,111	28,416,470	1,838,821	121,229	61,483,949
売 買 損	△510,461	△49,923,690	△151,477	△44,405,114	△45,478,513	△752,152
(C) 信 託 報 酬 等	△648,546	△622,880	△578,056	△604,397	△472,176	△474,924
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	26,447,048	△44,946,758	30,179,964	△40,717,991	△43,449,353	62,573,520
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△771,948,508	△733,507,460	△773,500,289	△711,437,002	△746,874,902	△771,998,599
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△504,459,221	△497,978,412	△496,288,266	△475,338,135	△472,728,461	△462,657,331
(配 当 等 相 当 額)	(563,966,145)	(554,253,434)	(550,060,248)	(525,945,132)	(521,951,015)	(509,650,757)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,068,425,366)	(△1,052,231,846)	(△1,046,348,514)	(△1,001,283,267)	(△994,679,476)	(△972,308,088)
(G) 合 計 (D+E+F)	△1,249,960,681	△1,276,432,630	△1,239,608,591	△1,227,493,128	△1,263,052,716	△1,172,082,410
(H) 収 益 分 配 金	△3,809,256	△3,741,382	△1,855,526	△1,773,775	△1,759,828	△1,717,873
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,253,769,937	△1,280,174,012	△1,241,464,117	△1,229,266,903	△1,264,812,544	△1,173,800,283
追 加 信 託 差 損 益 金	△504,459,221	△497,978,412	△496,288,266	△475,338,135	△472,728,461	△462,657,331
(配 当 等 相 当 額)	(563,966,145)	(554,253,434)	(550,060,248)	(525,945,132)	(521,951,015)	(509,650,757)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,068,425,366)	(△1,052,231,846)	(△1,046,348,514)	(△1,001,283,267)	(△994,679,476)	(△972,308,088)
分 配 準 備 積 立 金	101,301,943	99,628,906	99,112,025	94,699,148	93,961,260	92,159,984
繰 越 損 益 金	△850,612,659	△881,824,506	△844,287,876	△848,627,916	△886,045,343	△803,302,936

(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 142 期	第 143 期	第 144 期	第 145 期	第 146 期	第 147 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,813,311円	4,204,842円	2,446,173円	1,848,333円	1,907,959円	2,299,245円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	563,966,145	554,253,434	550,060,248	525,945,132	521,951,015	509,650,757
(d) 分 配 準 備 積 立 金	100,297,888	99,165,446	98,521,378	94,624,590	93,813,129	91,578,612
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	669,077,344	657,623,722	651,027,799	622,418,055	617,672,103	603,528,614
(f) 1万口当たり当期分配対象額	3,512.90	3,515.40	3,508.59	3,509.00	3,509.84	3,513.23
(g) 分 配 金	3,809,256	3,741,382	1,855,526	1,773,775	1,759,828	1,717,873
(h) 1万口当たり分配金	20	20	10	10	10	10

■分配金のお知らせ

決算期	第 142 期	第 143 期	第 144 期	第 145 期	第 146 期	第 147 期
1万口当たり分配金	20円	20円	10円	10円	10円	10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。

ケイマン エマージング ソブリン ファンド

クラスJPY/クラスUSD/クラスAUD/クラスZAR/クラスBRL/クラスCNY

当ファンドは「DIAM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。

<p>形 態</p> <p>投資方針および 主要投資対象</p>	<p>ケイマン籍円建外国投資信託</p> <p>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。</p> <p>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「JP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。</p> <p>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。</p> <p>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B3格相当以上を取得している債券とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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USDを除く）。</p> <p>[*]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。</p>
<p>投資顧問会社</p>	<p>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</p>
<p>受託銀行</p>	<p>FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited.</p>
<p>管理事務代行会社、 保管銀行</p>	<p>Mizuho Bank (USA)</p>

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、2020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、2020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2020年1月1日 至2020年12月31日
(日本円建て)

期首現在純資産	12,044,172,936
収益の部	
債券利息	435,937,687
払戻による損失	(2,980,340)
収益合計	432,957,347
費用の部	
投資運用報酬	36,445,023
管理事務及び保管報酬	11,733,382
監査報酬	3,917,106
受託報酬	1,697,253
その他費用	377,270
費用合計	54,170,034
純投資収益	378,787,313
投資有価証券売却による実現純利益	141,163,964
為替先渡契約および外貨取引による実現純損失	(1,361,841,971)
期中実現純損失	(1,220,678,007)
投資有価証券による未実現純損益の変動	(410,827,329)
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	(252,668,935)
期中未実現純減の変動額	(663,496,264)
運用による純資産の純減	(1,505,386,958)
受益権口発行収入	868,300,000
受益権口償還コスト	(1,185,108,170)
受益者取引による純支払額合計	(316,808,170)
受益者に支払われた分配金	(2,060,920,026)
期末現在純資産額	8,161,057,782

投資有価証券およびその他純資産明細書
2020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
社債					
800,000	BANCO NAC DE PAN 2.500% 08/11/30 REGS	USD	84,605,482	82,758,380	1.01%
400,000	BANCO NACIONAL 4.38% 10/14/25	USD	44,451,516	45,760,431	0.56%
300,000	EMPRESA DE LOS FERRO 3.068% 08/18/50 REGS	USD	31,971,000	30,249,323	0.37%
200,000	ENA MASTER TRUST 4.000% 05/19/48	USD	21,759,102	22,263,242	0.27%
2,400,000	ESKOM HOLDINGS 6.350% 08/10/28 REGS	USD	251,789,199	273,994,216	3.36%
500,000	HUTAMA KARYA PER 3.750% 05/11/30 REGS	USD	55,549,468	57,863,792	0.71%
800,000	INDONESIA ASAHAN 6.757% 11/15/48 REGS	USD	88,493,674	113,130,499	1.39%
500,000	KAZMUNAYGAS NAT 5.750% 04/19/47 REGS	USD	61,886,833	69,332,071	0.85%
500,000	PERTAMINA 4.300% 05/20/23 REGS	USD	56,618,639	55,542,017	0.68%
200,000	PERUSAHAAN LISTR 4.125% 05/15/27 REGS	USD	23,081,142	22,878,461	0.28%
1,100,000	PETROLEOS DEL PE 5.625% 06/19/47 REGS	USD	123,823,932	139,134,792	1.70%
400,000	PETROLEOS MEXICA 4.500% 01/23/26	USD	38,202,443	41,193,035	0.50%
200,000	PETRONAS CAP LTD 4.800% 04/21/60 REGS	USD	21,418,000	29,928,712	0.37%
400,000	TC ZIRAAT BANKAS 5.125% 05/03/22 REGS	USD	44,115,150	41,647,732	0.51%
	社債合計		947,765,580	1,025,676,703	12.56%
ソブリン債					
200,000	ARAB REP EGYPT 5.750% 05/29/24 REGS	USD	21,989,200	22,144,161	0.27%
200,000	ARAB REP EGYPT 7.625% 05/29/32 REGS	USD	21,540,000	23,434,449	0.29%
4,206,114	ARGENTINA 0.125% 01/09/38	USD	456,703,451	178,277,372	2.18%
3,686,000	ARGENTINA 0.125% 07/09/30	USD	401,391,114	154,805,844	1.90%
1,164,000	ARGENTINA 07/09/35	USD	142,519,017	44,081,530	0.54%
436,643	ARGENTINA 1.000% 07/09/29	USD	50,945,605	19,634,122	0.24%
400,000	BRAZIL REP OF 3.875% 06/12/30	USD	43,118,340	43,618,413	0.53%
2,000,000	BRAZIL REP OF 4.625% 01/13/28	USD	218,460,665	231,598,604	2.84%
2,700,000	BRAZIL REP OF 5.00% 01/27/45	USD	287,949,197	310,457,073	3.80%
305,000	BRAZIL REP OF 5.63% 01/07/41	USD	28,714,957	37,287,578	0.46%
600,000	COLOMBIA REP OF 3.000% 01/30/30	USD	65,255,542	65,002,580	0.80%
890,000	COLOMBIA REP OF 3.125% 04/15/31	USD	95,864,381	97,624,963	1.20%
350,000	COLOMBIA REP OF 4.500% 03/15/29	USD	41,465,395	41,999,156	0.51%
1,900,000	COLOMBIA REP OF 5.000% 06/15/45	USD	217,031,129	239,929,649	2.94%
300,000	COLOMBIA REP OF 5.200% 05/15/49	USD	32,735,149	39,426,680	0.48%
267,000	CORP FINANCIERA 4.750% 07/15/25 REGS	USD	31,448,530	31,151,226	0.38%
500,000	CORP FINANCIERA FXtoFL 07/15/29 REGS	USD	58,325,937	56,223,071	0.69%
200,000	DOMINICAN REPUB 4.875% 09/23/32 REGS	USD	22,498,266	22,908,386	0.28%
200,000	DOMINICAN REPUB 5.500% 01/27/25 REGS	USD	22,116,561	23,295,349	0.29%
200,000	ETHIOPIA BOND 6.625% 12/11/24 REGS	USD	23,094,369	21,054,268	0.26%
200,000	FIN DEPT SHARJAH 4.000% 07/28/50 REGS	USD	22,483,292	21,045,600	0.26%
200,000	GHANA REP OF 10.750% 10/14/30	USD	26,070,897	27,683,607	0.34%
200,000	HONDURAS GOVT 5.625% 06/24/30 REGS	USD	21,808,810	23,682,105	0.29%
2,000,000	INDONESIA (REP) 4.750% 07/18/47 REGS	USD	228,051,569	259,258,684	3.18%
2,400,000	INDONESIA (REP) 6.63% 02/17/37 REGS	USD	213,019,438	353,382,823	4.33%
500,000	INDONESIA 5.25% 01/17/42	USD	47,660,216	67,028,354	0.82%
200,000	JORDAN 7.375% 10/10/47 REGS	USD	25,441,888	24,126,668	0.30%
200,000	PANAMA 2.252% 09/29/32	USD	21,215,739	21,334,532	0.26%
200,000	PANAMA 3.870% 07/23/60	USD	23,714,756	24,404,641	0.30%
400,000	PANAMA 4.30% 04/29/53	USD	36,029,538	52,627,313	0.64%
500,000	PANAMA 4.500% 05/15/47	USD	58,345,667	66,457,198	0.81%

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
180,000	PANAMA 6.70% 1/26/36	USD	24,375,557	27,662,649	0.34%
235,000	PHILIPPINES(REP) 3.700% 02/02/42	USD	25,555,516	28,196,305	0.35%
1,793,000	PHILIPPINES(REP) 3.700% 03/01/41	USD	203,756,529	214,449,824	2.63%
200,000	REP OF NIGERIA 7.875% 02/16/32 REGS	USD	22,200,006	22,757,110	0.28%
1,190,000	REP OF PHILIPPINES 6.375% 10/23/2034	USD	136,296,970	180,597,943	2.21%
200,000	REPUBLIC OF PERU 8.75% 11/21/33	USD	20,591,002	35,336,384	0.43%
180,000	REPUBLIC OF PERU 2.392% 01/23/26	USD	19,389,947	19,846,718	0.24%
330,000	REPUBLIC OF PERU 2.783% 01/23/31	USD	35,548,273	37,449,797	0.46%
1,170,000	ROMANIA 3.000% 02/14/31 REGS	USD	128,237,875	129,830,082	1.59%
539,325	RUSSIA FOREIGN BOND 7.5% 03/31/2030	USD	66,385,876	64,728,273	0.79%
4,000,000	RUSSIA-EUROBOND 5.63% 04/04/42	USD	478,125,988	575,026,275	7.05%
300,000	SENEGAL REP OF 6.250% 07/30/24 REGS	USD	31,886,047	34,197,795	0.42%
700,000	SOUTH AFRICA 5.375% 07/24/44	USD	69,002,303	71,022,158	0.87%
300,000	SOUTH AFRICA 5.750% 09/30/49	USD	32,244,000	31,121,784	0.38%
4,000,000	TURKEY REP OF 4.25% 04/14/26	USD	383,937,452	410,218,637	5.03%
2,810,000	TURKEY REP OF 4.88% 04/16/43	USD	231,232,424	254,660,795	3.12%
200,000	TURKEY REP OF 5.750% 05/11/47	USD	18,155,420	19,708,980	0.24%
510,000	TURKEY REP OF 6.000% 03/25/27	USD	58,873,005	55,986,654	0.69%
1,200,000	TURKEY REP OF 6.125% 10/24/28	USD	118,220,323	132,338,079	1.62%
700,000	TURKEY REP OF 6.350% 08/10/24	USD	75,262,659	77,690,275	0.95%
1,000,000	UKRAINE GOVT 7.375% 09/25/32	USD	105,053,598	113,702,481	1.39%
500,000	UKRAINE GOVT 8.994% 02/01/24 REGS	USD	54,890,953	58,529,884	0.72%
2,000,000	UKRAINE GOVT 9.750% 11/01/28 REGS	USD	215,794,879	254,497,497	3.12%
800,000	UNITED MEXICAN 3.900% 04/27/25	USD	85,379,483	92,757,078	1.14%
4,000,000	UNITED MEXICAN 4.60% 01/23/46	USD	450,754,361	483,670,104	5.93%
2,320,000	UNITED MEXICAN 4.75% 03/08/44	USD	243,064,389	285,319,070	3.49%
765,000	US TREASURY N/B 03/31/24 COLLATERAL	USD	-	-	0.00%
	ソブリン債合計		6,341,223,450	6,356,288,630	77.89%
	投資金額合計		7,288,989,030	7,381,965,333	90.45%

2020年12月31日	
クラスAUD (日本円)	
発行済受益権口数	224,603.17
1口当たり純資産価額	3,501
クラスBRL (日本円)	
発行済受益権口数	6,725,313.62
1口当たり純資産価額	732
クラスCNY (日本円)	
発行済受益権口数	4,875.32
1口当たり純資産価額	10,186
クラスJPY (日本円)	
発行済受益権口数	293,542.37
1口当たり純資産価額	6,291
クラスUSD (日本円)	
発行済受益権口数	11,761.07
1口当たり純資産価額	9,283
クラスZAR (日本円)	
発行済受益権口数	231,021.00
1口当たり純資産価額	1,925

D I A Mマネーマザーファンド

運用報告書

第13期 (決算日 2022年4月5日)

(計算期間 2021年4月6日～2022年4月5日)

D I A Mマネーマザーファンドの第13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		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
	円	騰落 中率				
9期(2018年4月5日)	10,099	△0.0	71.1	—	—	百万円 1,030
10期(2019年4月5日)	10,098	△0.0	79.4	—	—	16,167
11期(2020年4月6日)	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

(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)。

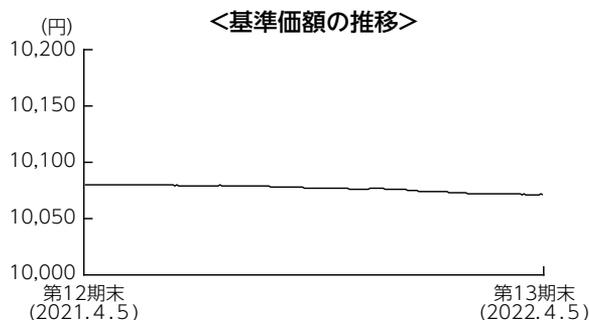
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		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
	円	騰 落 率			
(期 首) 2021年 4 月 5 日	10,080	% -	% 62.4	% -	% -
4 月 末	10,080	0.0	61.9	-	-
5 月 末	10,080	0.0	63.1	-	-
6 月 末	10,079	△0.0	82.8	-	-
7 月 末	10,079	△0.0	63.7	-	-
8 月 末	10,078	△0.0	68.1	-	-
9 月 末	10,077	△0.0	68.1	-	-
10 月 末	10,077	△0.0	74.2	-	-
11 月 末	10,076	△0.0	74.2	-	-
12 月 末	10,074	△0.1	76.4	-	-
2022年 1 月 末	10,073	△0.1	76.4	-	-
2 月 末	10,072	△0.1	76.4	-	-
3 月 末	10,071	△0.1	76.4	-	-
(期 末) 2022年 4 月 5 日	10,071	△0.1	76.3	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年4月6日から2022年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,071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

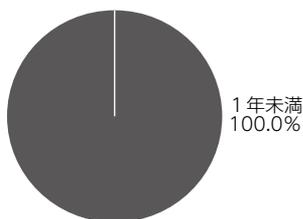
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

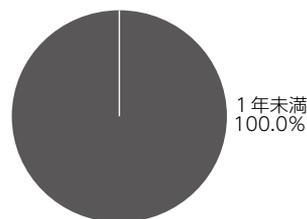
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【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

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。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 (2021年4月6日から2022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	911,871	(400,000)
	内 特殊債券	—	(263,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月6日から2022年4月5日まで)

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
公社債	百万円 911	百万円 400	% 44.0	百万円 —	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BB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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	910,000	910,671	76.3	—	—	—	76.3
合 計	910,000	910,671	76.3	—	—	—	76.3

(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 1 3 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	210,000	210,060	2022/06/01
4 1 5 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,120	2022/08/01
4 1 6 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,154	2022/09/01
4 1 8 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,216	2022/11/01
4 1 9 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	100,000	100,121	2022/12/01
合 計	—	910,000	910,671	—

■投資信託財産の構成

2022年4月5日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
	910,671	76.3	910,671	76.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	282,092	23.7	282,092	23.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,192,764	100.0	1,192,764	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

(2022年4月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,192,764,024円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	281,847,683
公 社 債(評価額)	910,671,900
未 収 利 息	221,428
前 払 費 用	23,013
(B) 負 債	—
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,192,764,024
元 本	1,184,299,773
次 期 繰 越 損 益 金	8,464,251
(D) 受 益 権 総 口 数	1,184,299,773口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,071円

(注1) 期首元本額	1,056,034,563円	みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) ブラジルリアルコース	9,925円
追加設定元本額	148,321,314円	USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジあり	9,924円
一部解約元本額	20,056,104円	USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジなし	9,924円
(注2) 期末における元本の内訳		マッシュューズ・アジア株式ファンド	29,641,137円
短期ハイイールド債券ファンド (ヘッジあり)	990,775円	One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円
バンクローン・ファンド (ヘッジなし)	15,843,407円	One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり)	13,867,169円	One世界分散セレクト (Cコース)	99,040円
新光バンクローン・ファンド・ネオ (円ヘッジ型)	5,049,059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
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	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
バンクローン・ファンド (ヘッジあり/年1回決算型)	98,095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
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	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
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	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
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	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
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	期末元本合計	1,184,299,773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	990,000,991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<D/C年金>	9,935円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 円コース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 米ドルコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 豪ドルコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) メキシコペソコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) トルコリラコース	9,925円		

■損益の状況

当期 自2021年4月6日 至2022年4月5日

項	目	当	期
(A)	配当等収益		1,715,799円
	受取利息		1,785,127
	支払利息		△69,328
(B)	有価証券売買損益		△2,682,620
	売却買損		△2,682,620
(C)	当期損益金(A+B)		△966,821
(D)	前期繰越損益金		8,469,295
(E)	解約差損益金		△160,435
(F)	追加信託差損益金		1,122,212
(G)	合計(C+D+E+F)		8,464,251
	次期繰越損益金(G)		8,464,251

(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。