Asset Management One

運 用 報 告 書（全体版）

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>

第148期　<決算日　2022年５月６日>
第149期　<決算日　2022年６月６日>
第150期　<決算日　2022年７月５日>
第151期　<決算日　2022年８月５日>
第152期　<決算日　2022年９月５日>
第153期　<決算日　2022年10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、「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>」は、2022年10月５日に第153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。

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「ＤＩＡＭ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、基準価額の水準、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。

<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/

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>

■最近５作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託証券組入比率	純資産総額
		(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		
		円	円	%	%	百万円
	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
第22作成期	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
	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
第23作成期	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
	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
第24作成期	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
	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
第25作成期	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
	148期(2022年５月６日)	2,871	10	△9.0	98.0	485
	149期(2022年６月６日)	2,958	10	3.4	98.5	498
第26作成期	150期(2022年７月５日)	2,675	10	△9.2	97.9	434
	151期(2022年８月５日)	2,804	10	5.2	98.5	453
	152期(2022年９月５日)	2,787	10	△0.2	98.6	450
	153期(2022年10月５日)	2,599	10	△6.4	98.5	411

(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) 。

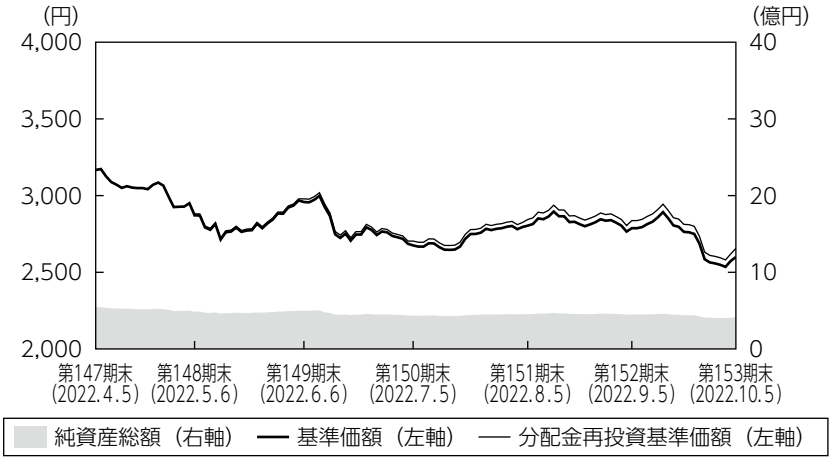
■過去６ヶ月間の基準価額の推移

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	
	(期首)	円	%	%
	2022年4月5日	3,167	－	97.9
第148期	4月末	2,928	△7.5	97.7
	(期末)			
	2022年5月6日	2,881	△9.0	98.0
	(期首)			
	2022年5月6日	2,871	－	98.0
第149期	5月末	2,882	0.4	97.6
	(期末)			
	2022年6月6日	2,968	3.4	98.5
	(期首)			
	2022年6月6日	2,958	－	98.5
第150期	6月末	2,728	△7.8	97.3
	(期末)			
	2022年7月5日	2,685	△9.2	97.9
	(期首)			
	2022年7月5日	2,675	－	97.9
第151期	7月末	2,787	4.2	98.1
	(期末)			
	2022年8月5日	2,814	5.2	98.5
	(期首)			
	2022年8月5日	2,804	－	98.5
第152期	8月末	2,823	0.7	98.1
	(期末)			
	2022年9月5日	2,797	△0.2	98.6
	(期首)			
	2022年9月5日	2,787	－	98.6
第153期	9月末	2,549	△8.5	98.1
	(期末)			
	2022年10月5日	2,609	△6.4	98.5

（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148期～第153期の運用経過（2022年４月６日から2022年10月５日まで）

基準価額等の推移



第148期首：　3,167円
第153期末：　2,599円
（既払分配金60円）
騰　落　率：　△16.1%
（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

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）	△15.9%
ＤＩＡＭマネーマザーファンド	△0.0%

（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。

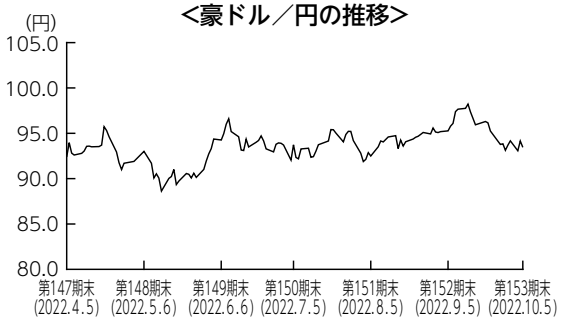
投資環境

当作成期の新興国債券市場は下落しました。世界的にインフレ懸念が高まる中、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）をはじめとして、各国の金融当局が積極的な金融引き締め策に舵を切りました。このような背景をもとに投資家のリスク回避姿勢が強まり、新興国市場からの資金シフトに対する警戒感が広がり、新興国債券市場は軟調に推移しました。

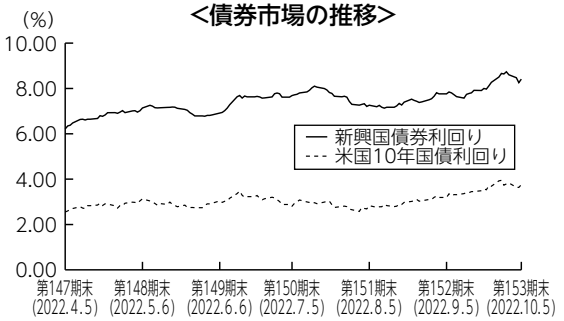
豪ドル／円相場は、豪ドル高円安となりました。オーストラリア経済の回復が継続し、国内のインフレ圧力が高まる中で、オーストラリア準備銀行が利上げを実施したことなどがプラス要因となり、豪ドルは対円で上昇しました。

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。

<豪ドル／円の推移>



<債券市場の推移>



※新興国債券利回りは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・プラスの最終利回りです。

※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、ＤＩＡＭ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）

当作成期の組入れ状況については、地域別では、アフリカ、中南米をオーバーウェイト、欧州をアンダーウェイトとしました。国別では、ロシアを組入れから外し、トルコのウェイトを引き下げた一方、オマーン、インド、マレーシア、コスタリカを新たに組入れました。ベンチマーク構成国のウェイト調整が続いておりますが、サウジアラビア、中国の非保有は継続しております。

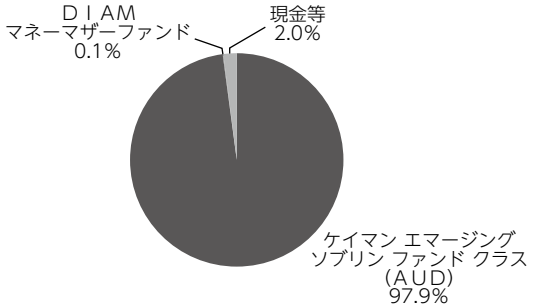
また、米ドルを売り予約し、豪ドルを買い予約する為替取引を行いました。

●ＤＩＡＭマネーマザーファンド

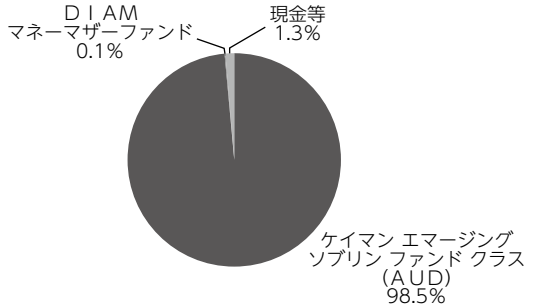
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

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した。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148期	第149期	第150期	第151期	第152期	第153期
	2022年4月6日 ～2022年5月6日	2022年5月7日 ～2022年6月6日	2022年6月7日 ～2022年7月5日	2022年7月6日 ～2022年8月5日	2022年8月6日 ～2022年9月5日	2022年9月6日 ～2022年10月5日
当期分配金（税引前）	10円	10円	10円	10円	10円	10円
対基準価額比率	0.35%	0.34%	0.37%	0.36%	0.36%	0.38%
当期の収益	10円	10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	3,503円	3,506円	3,507円	3,510円	3,511円	3,512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、ＤＩＡＭ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）

主要国での金融引き締め策の継続、インフレ高騰、地政学リスクの上昇は、新興国市場に逆風となっています。しかし、外貨準備、政治的な安定および効率的に政策を行う新興国を中心に中期的には先進国市場と比較して良好なパフォーマンスになると見ています。投資戦略は分散投資のメリットに重点をおき、メキシコやインドネシアなどファンダメンタルズが底堅い銘柄を選考します。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。

●ＤＩＡＭ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

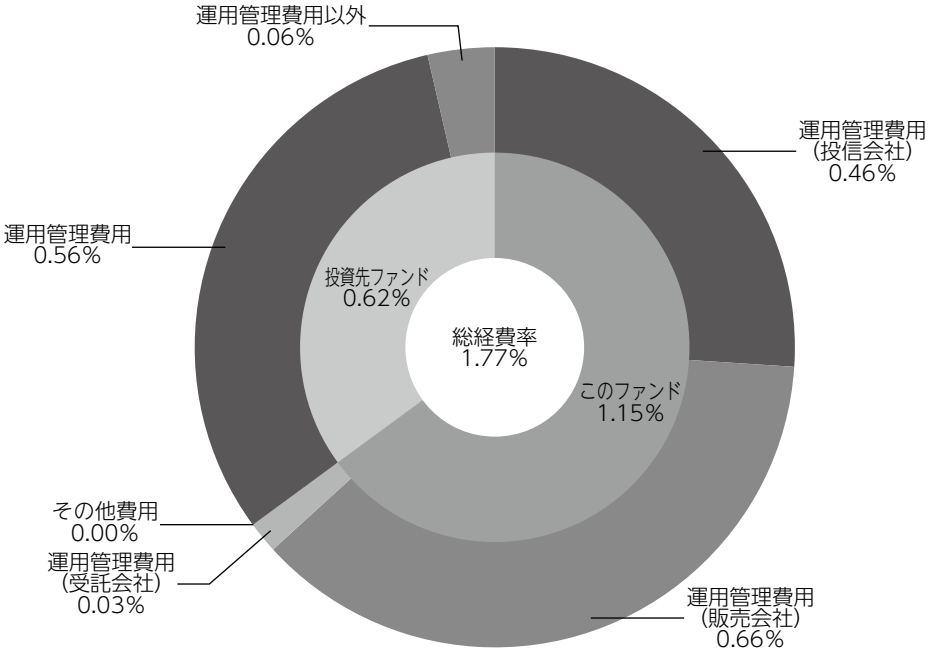
項目	第148期～第153期 (2022年４月６日 ～2022年10月５日)		項目の概要
	金額	比率	
(ａ) 信託報酬	16円	0.576%	(ａ) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は2,821円です。
(投信会社)	(7)	(0.231)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(9)	(0.330)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(0)	(0.015)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(ｂ) その他費用	0	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)	(0)	(0.000)	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	16	0.576	

(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1.77%です。



総経費率（①＋②＋③）	1.77%
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	0.56%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

（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（2022年４月６日から2022年10月５日まで）

投資信託受益証券

		第　148　期　～　第　153　期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国邦貨建	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 12	千円 33,283

（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（2022年４月６日から2022年10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（2022年４月６日から2022年10月５日まで）

【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>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　148　期　～　第　153　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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.000	0.000	100.0	0.000	0.000	100.0

【ＤＩＡＭ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　148　期　～　第　153　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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	0.028	0.028	100.0	0.028	0.028	100.0

平均保有割合　0.0%

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

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、みずほ信託銀行です。

■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25作成期末	第26作成期末		
	口数	口数	評価額	比率
	千口	千口	千円	%
ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス(AUD)	176.70317	164.70317	405,169	98.5
合計	176.70317	164.70317	405,169	98.5

(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25作成期末	第26作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ＤＩＡＭマネーマザーファンド	530	530	533

■投資信託財産の構成

2022年10月５日現在

項目	第26作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	405,169	98.0
ＤＩＡＭマネーマザーファンド	533	0.1
コール・ローン等、その他	7,680	1.9
投資信託財産総額	413,383	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨てております。％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５月６日)、(2022年６月６日)、(2022年７月５日)、(2022年８月５日)、(2022年９月５日)、(2022年10月５日)現在

項目	第148期末	第149期末	第150期末	第151期末	第152期末	第153期末
(A)資産	**488,038,223円**	**502,689,786円**	**438,063,751円**	**455,578,952円**	**452,553,059円**	**413,383,720円**
コール・ローン等	11,263,619	11,414,872	11,727,549	8,590,660	8,419,174	7,680,318
投資信託受益証券(評価額)	476,240,841	490,741,204	425,802,439	446,454,529	443,600,175	405,169,798
ＤＩＡＭマネーマザーファンド(評価額)	533,763	533,710	533,763	533,763	533,710	533,604
(B)負債	**2,254,279**	**4,510,659**	**3,100,991**	**2,376,398**	**2,457,161**	**2,235,765**
未払収益分配金	1,691,922	1,684,299	1,625,914	1,616,477	1,615,189	1,582,181
未払解約金	55,032	2,355,991	1,054,277	326,605	392,169	239,795
未払信託報酬	506,058	469,192	419,746	432,232	448,678	412,753
その他未払費用	1,267	1,177	1,054	1,084	1,125	1,036
(C)純資産総額(A－B)	**485,783,944**	**498,179,127**	**434,962,760**	**453,202,554**	**450,095,898**	**411,147,955**
元本	1,691,922,481	1,684,299,708	1,625,914,025	1,616,477,600	1,615,189,212	1,582,181,765
次期繰越損益金	△1,206,138,537	△1,186,120,581	△1,190,951,265	△1,163,275,046	△1,165,093,314	△1,171,033,810
(D)受益権総口数	**1,691,922,481口**	**1,684,299,708口**	**1,625,914,025口**	**1,616,477,600口**	**1,615,189,212口**	**1,582,181,765口**
1万口当たり基準価額(C／D)	**2,871円**	**2,958円**	**2,675円**	**2,804円**	**2,787円**	**2,599円**

（注）第147期末における元本額は1,717,873,386円、当作成期間（第148期～第153期）中における追加設定元本額は17,020,745円、同解約元本額は152,712,366円です。

■損益の状況

項目	第148期 自 2022年4月6日 至 2022年5月6日	第149期 自 2022年5月7日 至 2022年6月6日	第150期 自 2022年6月7日 至 2022年7月5日	第151期 自 2022年7月6日 至 2022年8月5日	第152期 自 2022年8月6日 至 2022年9月5日	第153期 自 2022年9月6日 至 2022年10月5日
(A) 配当等収益	**2,267,270円**	**2,261,426円**	**2,178,105円**	**2,181,381円**	**2,180,894円**	**2,139,664円**
受取配当金	2,267,405	2,261,595	2,178,460	2,181,437	2,181,064	2,140,031
受取利息	−	−	34	4	−	9
支払利息	△135	△169	△389	△60	△170	△376
(B) 有価証券売買損益	**△50,129,005**	**14,491,550**	**△46,071,037**	**20,629,734**	**△2,864,074**	**△29,888,994**
売買益	358,186	14,521,078	146,258	20,652,149	1,465	135,827
売買損	△50,487,191	△29,528	△46,217,295	△22,415	△2,865,539	△30,024,821
(C) 信託報酬等	**△507,325**	**△470,369**	**△420,800**	**△433,316**	**△449,803**	**△413,789**
(D) 当期損益金(A+B+C)	**△48,369,060**	**16,282,607**	**△44,313,732**	**22,377,799**	**△1,132,983**	**△28,163,119**
(E) 前期繰越損益金	**△699,463,656**	**△744,469,296**	**△703,479,785**	**△743,726,318**	**△721,191,918**	**△707,954,839**
(F) 追加信託差損益金	**△456,613,899**	**△456,249,593**	**△441,531,834**	**△440,310,050**	**△441,153,224**	**△433,333,671**
(配当等相当額)	(502,073,872)	(500,014,674)	(482,817,825)	(480,172,846)	(479,935,108)	(470,270,582)
(売買損益相当額)	(△958,687,771)	(△956,264,267)	(△924,349,659)	(△920,482,896)	(△921,088,332)	(△903,604,253)
(G) 合計(D+E+F)	**△1,204,446,615**	**△1,184,436,282**	**△1,189,325,351**	**△1,161,658,569**	**△1,163,478,125**	**△1,169,451,629**
(H) 収益分配金	**△1,691,922**	**△1,684,299**	**△1,625,914**	**△1,616,477**	**△1,615,189**	**△1,582,181**
次期繰越損益金(G+H)	**△1,206,138,537**	**△1,186,120,581**	**△1,190,951,265**	**△1,163,275,046**	**△1,165,093,314**	**△1,171,033,810**
追加信託差損益金	△456,613,899	△456,249,593	△441,531,834	△440,310,050	△441,153,224	△433,333,671
(配当等相当額)	(502,073,872)	(500,014,674)	(482,817,825)	(480,172,846)	(479,935,108)	(470,270,582)
(売買損益相当額)	(△958,687,771)	(△956,264,267)	(△924,349,659)	(△920,482,896)	(△921,088,332)	(△903,604,253)
分配準備積立金	90,714,469	90,616,279	87,471,114	87,330,122	87,231,852	85,449,387
繰越損益金	△840,239,107	△820,487,267	△836,890,545	△810,295,118	△811,171,942	△823,149,526

(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148期	第149期	第150期	第151期	第152期	第153期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,759,975円	2,197,954円	1,757,321円	2,139,977円	1,731,101円	1,725,875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	502,073,872	500,014,674	482,817,825	480,172,846	479,935,108	470,270,582
(d) 分配準備積立金	90,646,416	90,102,624	87,339,707	86,806,622	87,115,940	85,305,693
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	594,480,263	592,315,252	571,914,853	569,119,445	568,782,149	557,302,150
(f) 1万口当たり当期分配対象額	3,513.64	3,516.69	3,517.50	3,520.74	3,521.46	3,522.36
(g) 分配金	1,691,922	1,684,299	1,625,914	1,616,477	1,615,189	1,582,181
(h) 1万口当たり分配金	10	10	10	10	10	10

■分配金のお知らせ

決　算　期	第 148 期	第 149 期	第 150 期	第 151 期	第 152 期	第 153 期
1万口当たり分配金	10円	10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。

《お知らせ》

■当ファンドが主要投資対象とする「ケイマン エマージング ソブリン ファンド」の関係法人である管理事務代行会社が以下のとおりに変更されました。

変更前：Mizuho Bank (USA)
変更後：Mizuho Trust & Banking (Luxembourg) S.A.

（2022年７月25日）

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。

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「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。 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Ｂ３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ＵＳＤ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、2021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、2021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2021年１月１日　至2021年12月31日
（日本円建て）

期首現在純資産	**8,161,057,782**
収益の部	
債券利息	231,849,099
その他収益	1,944,251
払戻による損失	(3,772,660)
収益合計	**230,020,690**
費用の部	
投資運用報酬	28,177,748
管理事務及び保管報酬	9,955,774
監査報酬	4,133,733
受託報酬	1,642,585
その他費用	389,280
費用合計	**44,299,120**
純投資収益	**185,721,570**
投資有価証券売却による実現純利益	229,771,506
為替先渡契約および外貨取引による実現純損失	(153,560,444)
期中実現純利益額	**76,211,062**
投資有価証券による未実現純損益の変動	(185,569,939)
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	(187,395,375)
期中未実現純減の変動額	**(372,965,314)**
運用による純資産の純減	**(111,032,682)**
受益権口発行収入	19,000,000
受益権口償還コスト	(853,936,920)
受益者取引による純支払額合計	**(834,936,920)**
受益者に支払われた分配金	(1,083,942,069)
期末現在純資産額	**6,131,146,111**

投資有価証券およびその他純資産明細書
2021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	86,556,121	1.41%
400,000	BANCO NACIONAL 4.38% 10/14/25	USD	44,278,645	50,387,097	0.82%
400,000	COMISION FEDERAL 3.348% 02/09/31 REGS	USD	43,050,860	45,223,711	0.74%
200,000	COMISION FEDERAL 4.677% 02/09/51 REGS	USD	21,660,618	21,701,875	0.35%
200,000	ENA MASTER TRUST 4.000% 05/19/48	USD	21,735,973	23,162,148	0.38%
1,020,000	ESKOM HOLDINGS 6.350% 08/10/28 REGS	USD	108,963,689	126,940,912	2.07%
800,000	HUTAMA KARYA PER 3.750% 05/11/30 REGS	USD	90,839,055	98,604,052	1.61%
400,000	INDONESIA ASAHAN 6.757% 11/15/48 REGS	USD	44,246,837	58,998,418	0.96%
200,000	KAZMUNAYGAS NAT 5.750% 04/19/47 REGS	USD	24,684,496	28,221,599	0.46%
200,000	PEMEX MASTER TR 6.625% 6/15/35	USD	21,508,139	22,156,750	0.36%
500,000	PERTAMINA 4.300% 05/20/23 REGS	USD	55,643,612	59,973,833	0.98%
200,000	PERUSAHAAN LISTR 4.125% 05/15/27 REGS	USD	22,717,257	24,592,036	0.40%
200,000	PERUSAHAAN LISTR 5.450% 05/21/28 REGS	USD	25,384,262	26,408,084	0.43%
200,000	PETROLEOS DEL PE 4.750% 06/19/32 REGS	USD	23,683,056	24,060,044	0.39%
1,000,000	PETROLEOS DEL PE 5.625% 06/19/47 REGS	USD	113,122,044	114,153,878	1.86%
400,000	PETROLEOS MEXICA 4.500% 01/23/26	USD	38,819,718	46,633,686	0.76%
	社債合計		784,943,743	857,774,244	13.98%
ソブリン債					
200,000	ARAB REP EGYPT 6.588% 02/21/28 REGS	USD	23,699,090	22,444,960	0.37%
4,206,114	ARGENTINA 0.125% 01/09/38	USD	455,289,032	183,967,014	3.00%
3,686,000	ARGENTINA 0.125% 07/09/30	USD	402,921,853	149,555,399	2.44%
1,164,000	ARGENTINA 07/09/35	USD	142,519,017	43,041,258	0.70%
436,643	ARGENTINA 1.000% 07/09/29	USD	50,082,585	18,344,530	0.30%
200,000	ARMENIA 7.150% 03/26/25 REGS	USD	24,928,178	25,746,811	0.42%
800,000	BRAZIL REP OF 3.875% 06/12/30	USD	87,309,505	89,478,740	1.46%
800,000	BRAZIL REP OF 4.625% 01/13/28	USD	89,405,056	96,310,616	1.57%
2,200,000	BRAZIL REP OF 5.00% 01/27/45	USD	234,625,272	238,153,410	3.88%
170,000	BRAZIL REP OF 5.63% 01/07/41	USD	15,862,527	20,027,607	0.33%
600,000	COLOMBIA REP OF 3.000% 01/30/30	USD	65,255,542	63,250,327	1.03%
600,000	COLOMBIA REP OF 3.125% 04/15/31	USD	64,757,916	62,118,089	1.01%
200,000	COLOMBIA REP OF 3.250% 04/22/32	USD	21,005,634	20,746,775	0.34%
1,900,000	COLOMBIA REP OF 5.000% 06/15/45	USD	216,852,489	198,187,812	3.23%
300,000	COLOMBIA REP OF 5.200% 05/15/49	USD	32,735,149	31,844,947	0.52%
500,000	CORP FINANCIERA FXtoFL 07/15/29 REGS	USD	57,383,490	59,538,640	0.97%
200,000	FIN DEPT SHARJAH 4.000% 07/28/50 REGS	USD	22,457,258	20,899,398	0.34%
500,000	INDONESIA 5.25% 01/17/42	USD	47,431,874	72,337,300	1.18%
1,400,000	INDONESIA (REP) 4.750% 07/18/47 REGS	USD	159,497,697	195,344,060	3.19%
1,900,000	INDONESIA (REP) 6.63% 02/17/37 REGS	USD	168,885,676	305,878,860	4.99%
200,000	JORDAN 7.375% 10/10/47 REGS	USD	25,397,026	23,326,741	0.38%
200,000	PANAMA 2.252% 09/29/32	USD	21,190,287	21,886,265	0.36%
200,000	PANAMA 3.870% 07/23/60	USD	23,678,561	23,106,325	0.38%
400,000	PANAMA 4.30% 04/29/53	USD	36,092,768	49,597,050	0.81%
200,000	PANAMA 4.500% 05/15/47	USD	23,316,542	25,437,100	0.41%
180,000	PANAMA 6.70% 1/26/36	USD	24,174,714	27,799,309	0.45%
235,000	PHILIPPINES(REP) 3.700% 02/02/42	USD	25,555,516	29,574,181	0.48%
1,080,000	PHILIPPINES(REP) 3.700% 03/01/41	USD	122,731,205	135,917,994	2.22%
790,000	REP OF PHILIPPINES 6.375%10/23/2034	USD	89,728,967	126,468,054	2.06%

額面	銘柄	通貨	償却原価	公正価値	対純資産比率
200,000	REPUBLIC OF PER 8.75% 11/21/33	USD	20,109,388	35,951,715	0.59%
180,000	REPUBLIC OF PERU 2.392% 01/23/26	USD	19,389,886	21,070,413	0.34%
330,000	REPUBLIC OF PERU 2.783% 01/23/31	USD	35,548,217	37,888,422	0.62%
520,000	ROMANIA 3.000% 02/14/31 REGS	USD	57,349,379	60,929,456	0.99%
400,000	ROMANIA 4.000% 02/14/51 REGS	USD	46,713,678	46,183,092	0.75%
1,153,425	RUSSIA FOREIGN BOND 7.5% 03/31/2030	USD	143,228,017	150,700,962	2.46%
2,600,000	RUSSIA-EUROBOND 5.63% 04/04/42	USD	313,130,947	390,893,412	6.38%
200,000	SENEGAL REP OF 6.750% 03/13/48	USD	22,539,298	22,637,868	0.37%
700,000	SOUTH AFRICA 5.375% 07/24/44	USD	70,692,336	77,181,226	1.26%
300,000	SOUTH AFRICA 5.750% 09/30/49	USD	32,244,000	33,295,552	0.54%
200,000	TURK IHRACAT 5.750% 07/06/26 REGS	USD	22,056,693	21,168,501	0.35%
1,900,000	TURKEY REP OF 4.25% 04/14/26	USD	181,313,127	196,545,451	3.21%
200,000	TURKEY REP OF 4.875% 10/09/26	USD	21,299,869	20,921,405	0.34%
2,000,000	TURKEY REP OF 4.88% 04/16/43	USD	170,236,444	176,989,270	2.89%
510,000	TURKEY REP OF 6.000% 03/25/27	USD	58,733,876	55,495,338	0.91%
1,200,000	TURKEY REP OF 6.125% 10/24/28	USD	118,220,323	128,910,987	2.10%
700,000	TURKEY REP OF 6.350% 08/10/24	USD	75,262,659	79,450,077	1.30%
800,000	UKRAINE GOVT 7.375% 09/25/32	USD	84,042,878	82,423,570	1.34%
300,000	UKRAINE GOVT 8.994% 02/01/24 REGS	USD	32,908,897	34,579,999	0.56%
1,700,000	UKRAINE GOVT 9.750% 11/01/28 REGS	USD	184,625,027	198,524,825	3.24%
600,000	UNITED MEXICAN 2.659% 05/24/31	USD	64,310,089	67,541,371	1.10%
2,500,000	UNITED MEXICAN 4.60% 01/23/46	USD	281,337,034	308,614,752	5.03%
1,720,000	UNITED MEXICAN 4.75% 03/08/44	USD	179,983,169	216,394,284	3.54%
	ソブリン債合計		5,010,045,657	4,844,621,520	79.03%
	投資有価証券公正価値合計		**5,794,989,400**	**5,702,395,764**	**93.01%**

	2021年12月31日
クラスＡＵＤ（日本円）	
発行済受益権口数	192,003.17
１口当たり純資産価額	3,161
クラスＢＲＬ（日本円）	
発行済受益権口数	6,254,213.62
１口当たり純資産価額	599
クラスＣＮＹ（日本円）	
発行済受益権口数	4,867.77
１口当たり純資産価額	10,360
クラスＪＰＹ（日本円）	
発行済受益権口数	250,242.37
１口当たり純資産価額	5,533
クラスＵＳＤ（日本円）	
発行済受益権口数	6,700.94
１口当たり純資産価額	9,105
クラスＺＡＲ（日本円）	
発行済受益権口数	164,721.00
１口当たり純資産価額	1,729

ＤＩＡＭ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）

ＤＩＡＭ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
		期中騰落率				
	円	%	%	%	%	百万円
9期(2018年４月５日)	10,099	△0.0	71.1	－	－	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）。

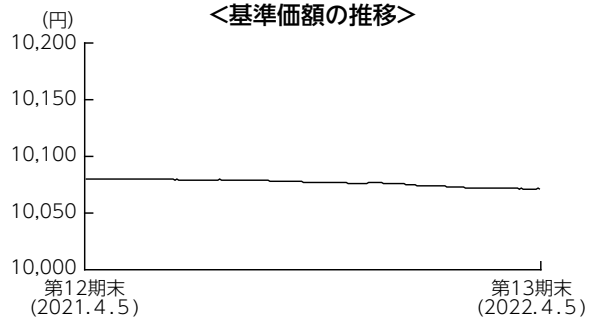
■当期中の基準価額の推移

年　月　日	基準価額		債券組入比率	新株予約権付社債(転換社債)組入比率	債券先物比率
		騰落率			
(期　首)	円	%	%	%	%
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>



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。

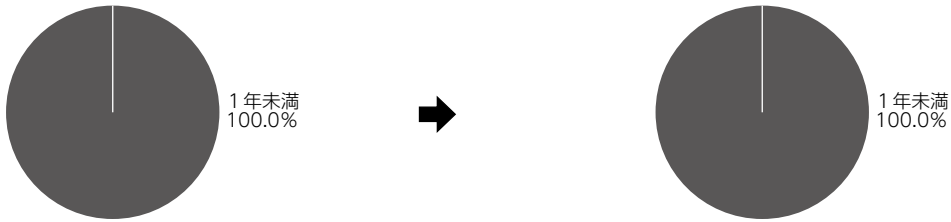
ポートフォリオについて

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)
	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	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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	911	400	44.0	－	－	－

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■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	
４１３回　利付国庫債券（２年）	0.1000	210,000	210,060	2022/06/01
４１５回　利付国庫債券（２年）	0.1000	200,000	200,120	2022/08/01
４１６回　利付国庫債券（２年）	0.1000	200,000	200,154	2022/09/01
４１８回　利付国庫債券（２年）	0.1000	200,000	200,216	2022/11/01
４１９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
	千円	%
公社債	910,671	76.3
コール・ローン等、その他	282,092	23.7
投資信託財産総額	1,192,764	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨てであります。%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
追加設定元本額 148,321,314円
一部解約元本額 20,056,104円

(注２) 期末における元本の内訳

短期ハイイールド債券ファンド（ヘッジあり）	990,775円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	15,843,407円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）	13,867,169円
新光バンクローン・ファンド・ネオ（円ヘッジ型）	5,049,059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
バンクローン・ファンド（ヘッジあり／年１回決算型）	98,095円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3,959,763円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド１月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド２月号	48,517円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド３月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド４月号	11,377円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド５月号	98,027円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド６月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド７月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド８月号	494,102円
新光ピムコ・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<ブラジルレアルコース>	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
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
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）ブラジルレアルコース	9,925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
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
マシューズ・アジア株式ファンド	29,641,137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
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
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
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
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
期末元本合計	1,184,299,773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。