

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 <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 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、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<豪ドルコース>」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<豪ドルコース>

■設定以来の運用実績

作 成 期	決 算 期	基 準 価 額			投 資 信 託 資 金 組 入 証 書 比 率	純 資 産 総 額
		(分 配 落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率		
第 1 作成期	(設 定 日) 2009年10月29日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 177
	1 期(2010年 2 月 5 日)	9,474	80	△4.5	98.3	748
	2 期(2010年 3 月 5 日)	9,958	80	6.0	99.1	814
	3 期(2010年 4 月 5 日)	10,852	80	9.8	97.5	880
第 2 作成期	4 期(2010年 5 月 6 日)	10,961	80	1.7	99.1	855
	5 期(2010年 6 月 7 日)	9,324	80	△14.2	99.1	729
	6 期(2010年 7 月 5 日)	9,212	110	△0.0	98.9	718
	7 期(2010年 8 月 5 日)	10,273	110	12.7	99.0	824
	8 期(2010年 9 月 6 日)	10,123	110	△0.4	99.0	795
	9 期(2010年10月 5 日)	10,669	110	6.5	99.3	853
第 3 作成期	10期(2010年11月 5 日)	11,049	110	4.6	99.0	790
	11期(2010年12月 6 日)	10,560	110	△3.4	98.7	763
	12期(2011年 1 月 5 日)	10,456	120	0.2	98.5	785
	13期(2011年 2 月 7 日)	10,337	120	0.0	99.2	843
	14期(2011年 3 月 7 日)	10,293	120	0.7	98.8	1,176
	15期(2011年 4 月 5 日)	10,770	120	5.8	98.9	1,619
第 4 作成期	16期(2011年 5 月 6 日)	11,059	120	3.8	99.0	1,854
	17期(2011年 6 月 6 日)	10,772	120	△1.5	99.2	2,182
	18期(2011年 7 月 5 日)	10,857	120	1.9	98.5	2,905
	19期(2011年 8 月 5 日)	10,618	120	△1.1	99.1	3,548
	20期(2011年 9 月 5 日)	10,400	120	△0.9	99.2	4,600
	21期(2011年10月 5 日)	8,709	120	△15.1	99.2	5,300
第 5 作成期	22期(2011年11月 7 日)	10,130	120	17.7	99.3	6,841
	23期(2011年12月 5 日)	9,781	120	△2.3	99.2	7,392
	24期(2012年 1 月 5 日)	9,766	120	1.1	99.2	8,182
	25期(2012年 2 月 6 日)	10,193	120	5.6	99.3	9,130
	26期(2012年 3 月 5 日)	10,855	120	7.7	99.3	9,878
	27期(2012年 4 月 5 日)	10,326	120	△3.8	99.1	9,337
第 6 作成期	28期(2012年 5 月 7 日)	10,203	120	△0.0	99.4	9,552
	29期(2012年 6 月 5 日)	9,095	120	△9.7	99.4	8,794
	30期(2012年 7 月 5 日)	9,988	120	11.1	99.5	10,024
	31期(2012年 8 月 6 日)	10,343	120	4.8	99.5	10,940
	32期(2012年 9 月 5 日)	9,931	120	△2.8	99.5	10,573
	33期(2012年10月 5 日)	9,961	120	1.5	99.4	11,928

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 10,157	円 120	% 3.2	% 99.4	百万円 12,462
	35期(2012年12月5日)	10,444	120	4.0	99.3	13,249
	36期(2013年1月7日)	10,991	120	6.4	99.3	12,251
	37期(2013年2月5日)	11,138	120	2.4	99.3	11,469
	38期(2013年3月5日)	10,896	120	△1.1	99.3	10,544
	39期(2013年4月5日)	11,401	120	5.7	99.2	10,144
第8作成期	40期(2013年5月7日)	11,642	120	3.2	99.2	9,688
	41期(2013年6月5日)	10,456	120	△9.2	99.1	7,863
	42期(2013年7月5日)	9,259	120	△10.3	99.2	6,751
	43期(2013年8月5日)	8,858	120	△3.0	98.9	6,096
	44期(2013年9月5日)	8,734	120	△0.0	98.9	5,860
	45期(2013年10月7日)	9,005	120	4.5	99.0	5,754
第9作成期	46期(2013年11月5日)	9,166	120	3.1	99.0	5,929
	47期(2013年12月5日)	8,643	120	△4.4	98.9	5,346
	48期(2014年1月6日)	8,768	120	2.8	98.0	5,191
	49期(2014年2月5日)	8,313	120	△3.8	99.0	4,881
	50期(2014年3月5日)	8,495	120	3.6	99.0	4,877
	51期(2014年4月7日)	8,938	120	6.6	99.0	4,992
第10作成期	52期(2014年5月7日)	8,872	120	0.6	99.0	4,845
	53期(2014年6月5日)	8,964	120	2.4	99.0	4,894
	54期(2014年7月7日)	8,955	120	1.2	98.6	4,932
	55期(2014年8月5日)	8,815	120	△0.2	98.9	4,871
	56期(2014年9月5日)	9,094	120	4.5	99.0	4,885
	57期(2014年10月6日)	8,419	120	△6.1	99.0	4,496
第11作成期	58期(2014年11月5日)	8,762	120	5.5	99.0	4,612
	59期(2014年12月5日)	8,760	120	1.3	99.0	4,586
	60期(2015年1月5日)	8,246	120	△4.5	96.9	4,229
	61期(2015年2月5日)	7,736	120	△4.7	98.9	3,599
	62期(2015年3月5日)	7,827	120	2.7	99.0	3,606
	63期(2015年4月6日)	7,612	120	△1.2	99.1	3,567
第12作成期	64期(2015年5月7日)	7,783	120	3.8	98.9	3,594
	65期(2015年6月5日)	7,651	120	△0.2	98.9	3,464
	66期(2015年7月6日)	7,393	120	△1.8	99.0	3,302
	67期(2015年8月5日)	7,099	120	△2.4	99.0	3,141
	68期(2015年9月7日)	6,115	120	△12.2	98.8	2,667
	69期(2015年10月5日)	6,147	70	1.7	98.9	2,615

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	率		
第13作成期	70期(2015年11月5日)	円 6,524	円 70	% 7.3	% 98.7	百万円 2,669
	71期(2015年12月7日)	6,577	70	1.9	98.0	2,572
	72期(2016年1月5日)	6,105	70	△6.1	95.8	2,352
	73期(2016年2月5日)	5,962	70	△1.2	97.4	2,255
	74期(2016年3月7日)	6,098	70	3.5	98.6	2,277
	75期(2016年4月5日)	6,154	70	2.1	98.3	2,279
第14作成期	76期(2016年5月6日)	5,959	70	△2.0	98.4	2,202
	77期(2016年6月6日)	5,745	70	△2.4	98.5	2,120
	78期(2016年7月5日)	5,766	70	1.6	97.8	2,122
	79期(2016年8月5日)	5,749	70	0.9	98.8	2,093
	80期(2016年9月5日)	5,887	70	3.6	98.4	2,109
	81期(2016年10月5日)	5,830	70	0.2	97.9	2,099
第15作成期	82期(2016年11月7日)	5,640	70	△2.1	98.4	2,017
	83期(2016年12月5日)	5,639	70	1.2	98.4	1,992
	84期(2017年1月5日)	5,750	70	3.2	96.0	2,016
	85期(2017年2月6日)	5,854	70	3.0	97.4	2,023
	86期(2017年3月6日)	5,848	70	1.1	97.7	2,014
	87期(2017年4月5日)	5,633	70	△2.5	98.3	1,927
第16作成期	88期(2017年5月8日)	5,716	70	2.7	97.9	1,943
	89期(2017年6月5日)	5,566	70	△1.4	98.0	1,886
	90期(2017年7月5日)	5,726	70	4.1	98.5	1,908
	91期(2017年8月7日)	5,776	70	2.1	97.9	1,885
	92期(2017年9月5日)	5,787	70	1.4	98.5	1,876
	93期(2017年10月5日)	5,763	70	0.8	98.0	1,842
第17作成期	94期(2017年11月6日)	5,655	70	△0.7	97.9	1,787
	95期(2017年12月5日)	5,386	70	△3.5	98.3	1,693
	96期(2018年1月5日)	5,515	70	3.7	94.2	1,746
	97期(2018年2月5日)	5,314	70	△2.4	98.0	1,692
	98期(2018年3月5日)	4,806	70	△8.2	98.2	1,522
	99期(2018年4月5日)	4,776	70	0.8	97.7	1,503
第18作成期	100期(2018年5月7日)	4,586	70	△2.5	97.8	1,422
	101期(2018年6月5日)	4,547	70	0.7	97.8	1,393
	102期(2018年7月5日)	4,300	70	△3.9	98.7	1,301
	103期(2018年8月6日)	4,334	70	2.4	97.5	1,313
	104期(2018年9月5日)	3,991	70	△6.3	98.6	1,206
	105期(2018年10月5日)	4,014	70	2.3	98.0	1,246

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19作成期	106期(2018年11月5日)	円 3,989	円 35	% 0.2	% 97.4	百万円 1,268
	107期(2018年12月5日)	4,009	35	1.4	98.5	1,244
	108期(2019年 1 月7日)	3,781	35	△4.8	94.8	1,167
	109期(2019年 2 月5日)	3,993	35	6.5	98.7	1,223
	110期(2019年 3 月5日)	3,918	35	△1.0	98.5	1,188
	111期(2019年 4 月5日)	3,952	35	1.8	97.7	1,150
第20作成期	112期(2019年 5 月7日)	3,830	35	△2.2	97.9	1,109
	113期(2019年 6 月5日)	3,715	35	△2.1	97.7	1,087
	114期(2019年 7 月5日)	3,840	35	4.3	98.5	1,113
	115期(2019年 8 月5日)	3,635	35	△4.4	98.4	1,052
	116期(2019年 9 月5日)	3,528	35	△2.0	98.2	1,020
	117期(2019年10月7日)	3,464	35	△0.8	98.2	1,000
第21作成期	118期(2019年11月5日)	3,528	35	2.9	98.7	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

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	期騰落率		
第25作成期	142期(2021年11月5日)	円 3,417	円 20	% 4.2	% 98.2	百万円 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
第26作成期	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
	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
第27作成期	154期(2022年11月7日)	2,574	10	△0.6	98.2	403
	155期(2022年12月5日)	2,695	10	5.1	97.8	418
	156期(2023年 1 月5日)	2,632	10	△2.0	98.0	407
	157期(2023年 2 月6日)	2,743	10	4.6	98.1	424
	158期(2023年 3 月6日)	2,632	10	△3.7	98.3	406
	159期(2023年 4 月5日)	2,593	10	△1.1	97.8	397
第28作成期	160期(2023年 5 月8日)	2,614	10	1.2	98.6	397
	161期(2023年 6 月5日)	2,626	10	0.8	97.8	393
	162期(2023年 7 月5日)	2,778	10	6.2	99.1	410
	163期(2023年 8 月7日)	2,688	10	△2.9	97.7	397
	164期(2023年 9 月5日)	2,674	10	△0.1	97.7	395
	165期(2023年10月5日)	2,493	10	△6.4	97.7	367
第29作成期	166期(2023年11月6日)	2,608	10	5.0	98.5	383
	167期(2023年12月5日)	2,766	10	6.4	98.0	400
	168期(2024年 1 月5日)	2,806	10	1.8	98.2	400
	169期(2024年 2 月5日)	2,798	10	0.1	98.3	392
	170期(2024年 3 月5日)	2,850	10	2.2	98.3	395
	171期(2024年 4 月5日)	2,942	10	3.6	97.8	395
第30作成期	172期(2024年 5 月7日)	2,891	10	△1.4	98.4	386
	173期(2024年 6 月5日)	2,984	10	3.6	98.3	399
	174期(2024年 7 月5日)	3,140	10	5.6	98.4	407
	175期(2024年 8 月5日)	2,830	10	△9.6	98.6	365
	176期(2024年 9 月5日)	2,908	10	3.1	97.9	369
	177期(2024年10月7日)	3,021	10	4.2	98.0	364

作成期	決算期	基準価額 (分配落)	価額			投資信託証券 組入比率	純資産 総額
			税金 込配	み金	期騰落 率		
第31作成期	(償還日) 2024年10月29日	円 (償還価額) 3,016.27	円 0		% △0.2	% －	百万円 360

(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

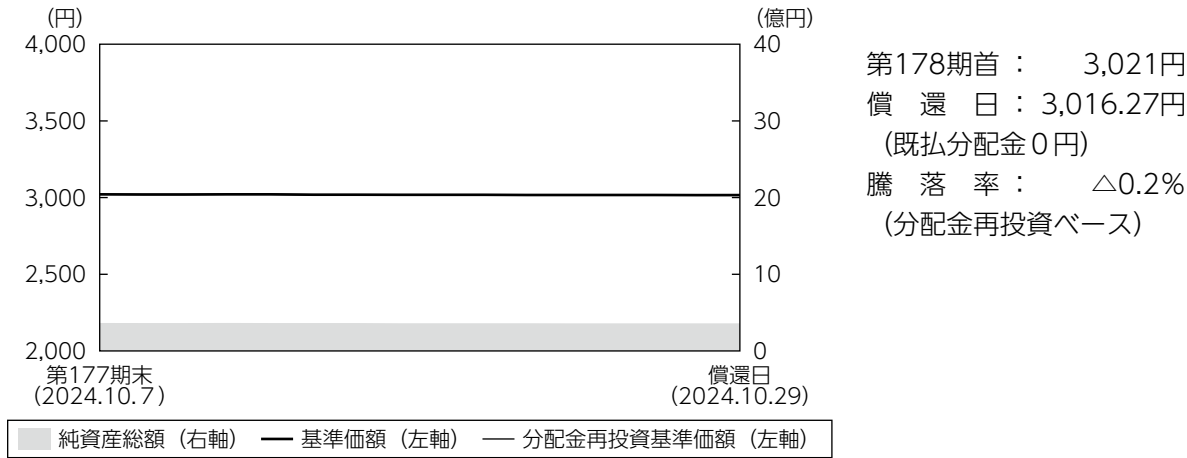
決算期	年 月 日	基準価額	騰落率		投資信託受益証券 組入比率
			騰落	率	
第178期	(期首) 2024 年 10 月 7 日	円 3,021		% －	% 98.0
	(償還日) 2024 年 10 月 29 日	(償還価額) 3,016.27		△0.2	－

(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。また、為替が豪ドル高円安となったことも、基準価額のプラス要因となりました。当ファンドの基準価額は設定来で68.5%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金11,860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 (AUD)	△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 (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。
- (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 (AUD) 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。

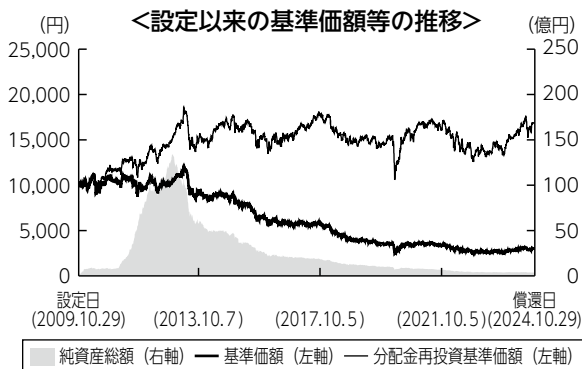
設定来の投資環境

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。

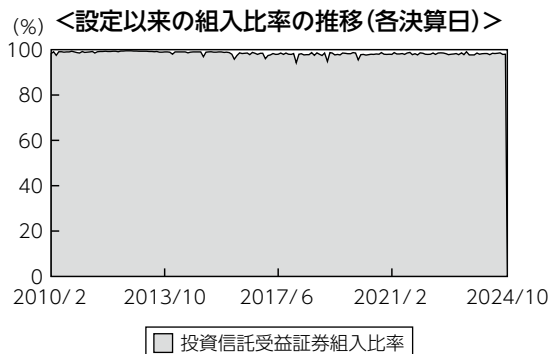
2015年は、原油価格の大幅下落により、一部産油国への信用懸念が高まる局面もありましたが、新興国経済が全般的に堅調に成長したことから、上昇幅を拡大しました。2016年はトランプ大統領が就任し、中国との貿易摩擦が強まり、一時的に上昇幅を縮小する局面もありましたが、世界経済が好調に推移したことから、再び上昇しました。2020年1月に新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や都市封鎖により、新興国債券市場も大幅に上昇幅を縮小しましたが、主要国が大規模な金融緩和や財政政策を実施したことが下支えとなり、更にワクチン開発に成功したことから、再び上昇幅を拡大しました。2022年に入り、ロシアがウクライナに軍事侵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る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。

豪ドル／円相場は、設定来で豪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、豪ドルは対円で上昇しました。その後、トランプ大統領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を背景に下落に転じる局面もありましたが、新型コロナウイルスのワクチンの普及などにより、世界的に景気が回復したことから、市場のリスク選好姿勢が改善し、再び上昇に転じました。

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（AUD）の組入比率は原則として高位を維持し、D I AM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）

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 AM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

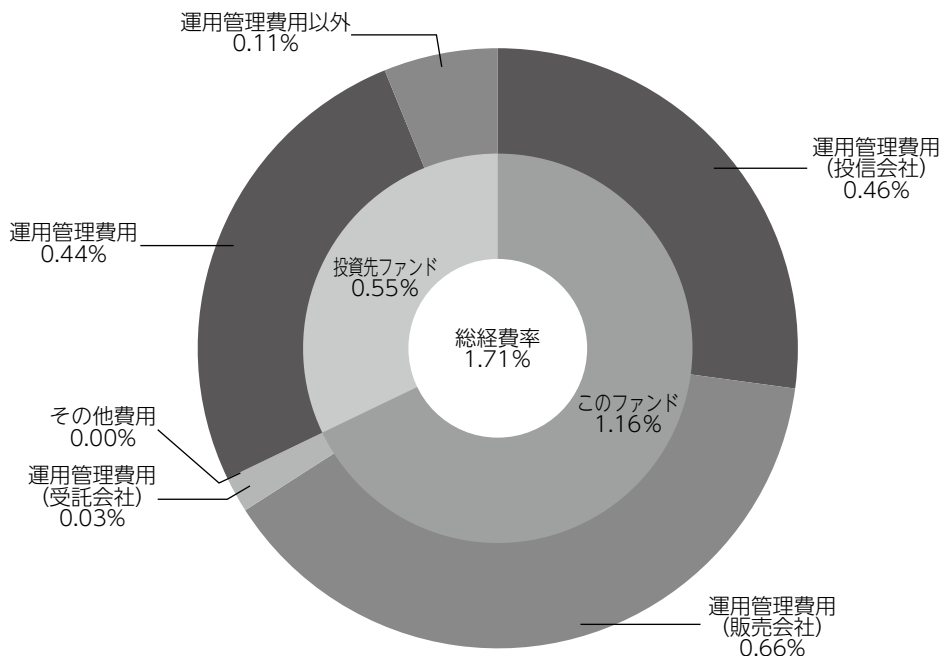
項目	第178期		項目の概要
	(2024年10月8日 ～2024年10月29日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	2円	0.070%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は3,018円です。
(投信会社)	(1)	(0.028)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(1)	(0.040)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(0)	(0.002)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
合計	2	0.070	

- (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	0.44%
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 (A U D)	千口 －	千円 －	千口 125.72893	千円 357,009

（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 530	千円 533

■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(AUD)	千□ 125.72893
合 計	125.72893

(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□ 530

■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 360,430	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	360,430	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	360,430,002円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	360,427,840
未 収 利 息	2,162
(B) 負 債	263,578
未 払 解 約 金	10
未 払 信 託 報 酬	263,568
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	360,166,424
元 本	1,194,080,774
償 還 差 損 益 金	△833,914,350
(D) 受 益 権 総 口 数	1,194,080,774口
1 万口当たり償還価額(C／D)	3,016円27銭

(注) 第177期末における元本額は1,206,933,083円、当作成期における追加設定元本額は1,602,533円、同解約元本額は14,454,842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	13,641円
受 取 利 息	13,641
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△305,207
売 買 益	1,414
売 買 損	△306,621
(C) 信 託 報 酬 等	△263,568
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	△555,134
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△474,600,223
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△358,758,993
(配 当 等 相 当 額)	(358,918,223)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△717,677,216)
(G) 合 計(D＋E＋F)	△833,914,350
償 還 差 損 益 金(G)	△833,914,350

(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	360,430,002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	263,578円
				純資産総額	360,166,424円
受益権口数	177,030,099口	1,194,080,774口	1,017,050,675口	受益権口数	1,194,080,774口
元 本 額	177,030,099円	1,194,080,774円	1,017,050,675円	1万口当たり償還金	3,016円27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	789,931,850円	748,418,679円	9,474円	80円	0.80%
第 2 期	817,438,761	814,018,857	9,958	80	0.80
第 3 期	811,214,668	880,362,732	10,852	80	0.80
第 4 期	780,154,718	855,096,403	10,961	80	0.80
第 5 期	782,479,103	729,613,815	9,324	80	0.80
第 6 期	779,895,924	718,458,299	9,212	110	1.10
第 7 期	802,130,636	824,004,745	10,273	110	1.10
第 8 期	786,117,070	795,823,712	10,123	110	1.10
第 9 期	800,336,481	853,869,791	10,669	110	1.10
第 10 期	715,354,051	790,402,074	11,049	110	1.10
第 11 期	722,728,136	763,207,861	10,560	110	1.10
第 12 期	751,572,552	785,820,153	10,456	120	1.20
第 13 期	815,739,633	843,235,497	10,337	120	1.20
第 14 期	1,142,667,579	1,176,171,229	10,293	120	1.20
第 15 期	1,503,885,957	1,619,719,632	10,770	120	1.20
第 16 期	1,677,290,836	1,854,939,122	11,059	120	1.20
第 17 期	2,026,168,927	2,182,537,588	10,772	120	1.20
第 18 期	2,675,987,942	2,905,329,096	10,857	120	1.20
第 19 期	3,342,179,818	3,548,881,552	10,618	120	1.20
第 20 期	4,423,638,166	4,600,643,107	10,400	120	1.20
第 21 期	6,086,549,854	5,300,633,578	8,709	120	1.20
第 22 期	6,753,612,362	6,841,334,962	10,130	120	1.20
第 23 期	7,558,510,473	7,392,810,328	9,781	120	1.20
第 24 期	8,378,292,000	8,182,347,480	9,766	120	1.20
第 25 期	8,958,157,000	9,130,874,288	10,193	120	1.20
第 26 期	9,100,715,189	9,878,630,632	10,855	120	1.20
第 27 期	9,043,035,307	9,337,669,180	10,326	120	1.20
第 28 期	9,362,950,589	9,552,719,052	10,203	120	1.20

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 29 期	9,669,039,188円	8,794,212,765円	9,095円	120円	1.20%
第 30 期	10,035,870,479	10,024,195,435	9,988	120	1.20
第 31 期	10,577,439,830	10,940,059,562	10,343	120	1.20
第 32 期	10,647,261,021	10,573,378,499	9,931	120	1.20
第 33 期	11,975,056,061	11,928,564,912	9,961	120	1.20
第 34 期	12,270,229,735	12,462,553,215	10,157	120	1.20
第 35 期	12,686,206,969	13,249,184,966	10,444	120	1.20
第 36 期	11,146,693,917	12,251,248,878	10,991	120	1.20
第 37 期	10,297,006,329	11,469,142,313	11,138	120	1.20
第 38 期	9,677,643,140	10,544,960,243	10,896	120	1.20
第 39 期	8,897,765,841	10,144,134,656	11,401	120	1.20
第 40 期	8,322,312,487	9,688,611,722	11,642	120	1.20
第 41 期	7,520,446,440	7,863,126,727	10,456	120	1.20
第 42 期	7,292,309,728	6,751,733,943	9,259	120	1.20
第 43 期	6,883,043,362	6,096,797,838	8,858	120	1.20
第 44 期	6,710,060,068	5,860,324,902	8,734	120	1.20
第 45 期	6,390,705,925	5,754,926,874	9,005	120	1.20
第 46 期	6,468,713,537	5,929,504,026	9,166	120	1.20
第 47 期	6,186,304,769	5,346,529,993	8,643	120	1.20
第 48 期	5,921,342,871	5,191,770,310	8,768	120	1.20
第 49 期	5,871,709,799	4,881,423,405	8,313	120	1.20
第 50 期	5,742,274,009	4,877,887,945	8,495	120	1.20
第 51 期	5,586,207,046	4,992,984,747	8,938	120	1.20
第 52 期	5,461,622,398	4,845,453,612	8,872	120	1.20
第 53 期	5,459,610,140	4,894,033,596	8,964	120	1.20
第 54 期	5,507,849,046	4,932,201,612	8,955	120	1.20
第 55 期	5,526,044,023	4,871,353,937	8,815	120	1.20
第 56 期	5,372,837,272	4,885,800,872	9,094	120	1.20
第 57 期	5,341,382,592	4,496,863,746	8,419	120	1.20
第 58 期	5,263,844,490	4,612,001,619	8,762	120	1.20
第 59 期	5,235,371,020	4,586,235,763	8,760	120	1.20
第 60 期	5,129,554,377	4,229,848,705	8,246	120	1.20
第 61 期	4,653,668,144	3,599,932,307	7,736	120	1.20
第 62 期	4,608,009,381	3,606,663,479	7,827	120	1.20
第 63 期	4,686,155,378	3,567,044,505	7,612	120	1.20
第 64 期	4,618,706,604	3,594,670,171	7,783	120	1.20
第 65 期	4,527,419,461	3,464,049,832	7,651	120	1.20
第 66 期	4,467,540,891	3,302,688,819	7,393	120	1.20

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 67 期	4,424,915,655円	3,141,320,019円	7,099円	120円	1.20%
第 68 期	4,362,455,491	2,667,459,026	6,115	120	1.20
第 69 期	4,255,309,159	2,615,780,781	6,147	70	0.70
第 70 期	4,092,545,255	2,669,900,999	6,524	70	0.70
第 71 期	3,911,224,374	2,572,601,697	6,577	70	0.70
第 72 期	3,853,067,519	2,352,402,961	6,105	70	0.70
第 73 期	3,783,510,207	2,255,901,158	5,962	70	0.70
第 74 期	3,735,406,787	2,277,991,970	6,098	70	0.70
第 75 期	3,705,049,426	2,279,980,122	6,154	70	0.70
第 76 期	3,696,755,840	2,202,969,357	5,959	70	0.70
第 77 期	3,690,806,115	2,120,245,965	5,745	70	0.70
第 78 期	3,680,633,990	2,122,175,576	5,766	70	0.70
第 79 期	3,642,035,208	2,093,778,004	5,749	70	0.70
第 80 期	3,583,048,411	2,109,289,065	5,887	70	0.70
第 81 期	3,600,322,894	2,099,155,187	5,830	70	0.70
第 82 期	3,577,503,909	2,017,750,369	5,640	70	0.70
第 83 期	3,532,778,213	1,992,152,563	5,639	70	0.70
第 84 期	3,507,683,181	2,016,933,337	5,750	70	0.70
第 85 期	3,456,129,505	2,023,356,402	5,854	70	0.70
第 86 期	3,445,578,370	2,014,943,304	5,848	70	0.70
第 87 期	3,421,877,938	1,927,382,815	5,633	70	0.70
第 88 期	3,399,747,647	1,943,212,221	5,716	70	0.70
第 89 期	3,390,271,893	1,886,947,546	5,566	70	0.70
第 90 期	3,332,942,017	1,908,437,457	5,726	70	0.70
第 91 期	3,265,296,373	1,885,939,821	5,776	70	0.70
第 92 期	3,242,260,798	1,876,184,375	5,787	70	0.70
第 93 期	3,198,155,058	1,842,964,512	5,763	70	0.70
第 94 期	3,160,721,405	1,787,343,957	5,655	70	0.70
第 95 期	3,144,524,821	1,693,649,122	5,386	70	0.70
第 96 期	3,167,358,793	1,746,784,615	5,515	70	0.70
第 97 期	3,184,401,950	1,692,294,105	5,314	70	0.70
第 98 期	3,167,017,799	1,522,059,422	4,806	70	0.70
第 99 期	3,147,604,399	1,503,189,420	4,776	70	0.70
第 100 期	3,102,719,757	1,422,757,544	4,586	70	0.70
第 101 期	3,064,167,149	1,393,161,974	4,547	70	0.70
第 102 期	3,028,109,669	1,301,986,219	4,300	70	0.70
第 103 期	3,029,676,264	1,313,049,737	4,334	70	0.70
第 104 期	3,024,445,659	1,206,936,351	3,991	70	0.70

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	3,106,270,683円	1,246,813,177円	4,014円	70円	0.70%
第 106 期	3,180,206,161	1,268,429,224	3,989	35	0.35
第 107 期	3,104,932,596	1,244,626,219	4,009	35	0.35
第 108 期	3,087,119,470	1,167,155,614	3,781	35	0.35
第 109 期	3,063,286,217	1,223,197,352	3,993	35	0.35
第 110 期	3,033,719,775	1,188,479,405	3,918	35	0.35
第 111 期	2,910,507,415	1,150,110,234	3,952	35	0.35
第 112 期	2,896,216,527	1,109,303,359	3,830	35	0.35
第 113 期	2,926,112,101	1,087,073,478	3,715	35	0.35
第 114 期	2,900,981,833	1,113,903,487	3,840	35	0.35
第 115 期	2,895,023,351	1,052,311,244	3,635	35	0.35
第 116 期	2,893,672,216	1,020,904,763	3,528	35	0.35
第 117 期	2,887,642,474	1,000,395,366	3,464	35	0.35
第 118 期	2,869,929,756	1,012,579,902	3,528	35	0.35
第 119 期	2,835,958,343	984,712,391	3,472	35	0.35
第 120 期	2,803,996,758	1,011,460,529	3,607	35	0.35
第 121 期	2,741,974,174	966,867,174	3,526	35	0.35
第 122 期	2,698,736,685	921,754,247	3,416	35	0.35
第 123 期	2,679,466,566	703,633,082	2,626	35	0.35
第 124 期	2,673,108,385	755,464,290	2,826	20	0.20
第 125 期	2,668,295,037	903,883,917	3,387	20	0.20
第 126 期	2,570,493,170	855,925,100	3,330	20	0.20
第 127 期	2,508,554,215	877,239,208	3,497	20	0.20
第 128 期	2,454,069,935	873,702,665	3,560	20	0.20
第 129 期	2,407,035,154	803,232,786	3,337	20	0.20
第 130 期	2,260,611,247	756,379,921	3,346	20	0.20
第 131 期	2,229,804,432	787,035,163	3,530	20	0.20
第 132 期	2,203,457,575	797,561,368	3,620	20	0.20
第 133 期	2,178,993,934	778,914,711	3,575	20	0.20
第 134 期	2,160,612,745	770,186,944	3,565	20	0.20
第 135 期	2,147,992,737	751,832,035	3,500	20	0.20
第 136 期	2,078,814,208	734,421,645	3,533	20	0.20
第 137 期	2,072,880,357	741,646,352	3,578	20	0.20
第 138 期	2,056,785,676	725,207,852	3,526	20	0.20
第 139 期	2,002,478,974	686,979,020	3,431	20	0.20
第 140 期	1,966,844,518	683,219,961	3,474	20	0.20
第 141 期	1,934,743,040	638,072,366	3,298	20	0.20
第 142 期	1,904,628,061	650,858,124	3,417	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	1,870,691,420円	590,517,408円	3,157円	20円	0.20%
第 144 期	1,855,526,096	614,061,979	3,309	10	0.10
第 145 期	1,773,775,559	544,508,656	3,070	10	0.10
第 146 期	1,759,828,023	495,015,479	2,813	10	0.10
第 147 期	1,717,873,386	544,073,103	3,167	10	0.10
第 148 期	1,691,922,481	485,783,944	2,871	10	0.10
第 149 期	1,684,299,708	498,179,127	2,958	10	0.10
第 150 期	1,625,914,025	434,962,760	2,675	10	0.10
第 151 期	1,616,477,600	453,202,554	2,804	10	0.10
第 152 期	1,615,189,212	450,095,898	2,787	10	0.10
第 153 期	1,582,181,765	411,147,955	2,599	10	0.10
第 154 期	1,569,181,620	403,875,958	2,574	10	0.10
第 155 期	1,553,677,610	418,701,966	2,695	10	0.10
第 156 期	1,548,491,012	407,503,679	2,632	10	0.10
第 157 期	1,547,455,482	424,516,369	2,743	10	0.10
第 158 期	1,542,472,498	406,046,485	2,632	10	0.10
第 159 期	1,531,500,804	397,064,905	2,593	10	0.10
第 160 期	1,518,647,202	397,018,540	2,614	10	0.10
第 161 期	1,498,467,309	393,432,700	2,626	10	0.10
第 162 期	1,479,270,074	410,872,909	2,778	10	0.10
第 163 期	1,478,294,437	397,384,547	2,688	10	0.10
第 164 期	1,478,244,125	395,244,191	2,674	10	0.10
第 165 期	1,475,401,953	367,858,281	2,493	10	0.10
第 166 期	1,471,725,312	383,789,715	2,608	10	0.10
第 167 期	1,448,839,654	400,730,793	2,766	10	0.10
第 168 期	1,428,588,170	400,909,171	2,806	10	0.10
第 169 期	1,404,564,874	392,953,523	2,798	10	0.10
第 170 期	1,389,500,509	395,959,652	2,850	10	0.10
第 171 期	1,344,776,046	395,650,341	2,942	10	0.10
第 172 期	1,336,145,562	386,305,219	2,891	10	0.10
第 173 期	1,338,079,007	399,289,258	2,984	10	0.10
第 174 期	1,296,974,569	407,313,443	3,140	10	0.10
第 175 期	1,291,410,975	365,491,938	2,830	10	0.10
第 176 期	1,271,882,095	369,854,909	2,908	10	0.10
第 177 期	1,206,933,083	364,604,176	3,021	10	0.10

償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税引前）	3,016円27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 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
		騰	落				
11期(2020年4月6日)	円	%		%	%	%	百万円 1,139
12期(2021年4月5日)	10,089	△0.1		69.3	—	—	1,064
13期(2022年4月5日)	10,080	△0.1		62.4	—	—	1,192
14期(2023年4月5日)	10,071	△0.1		76.3	—	—	1,253
15期(2024年4月5日)	10,063	△0.1		71.8	—	—	1,253
	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。

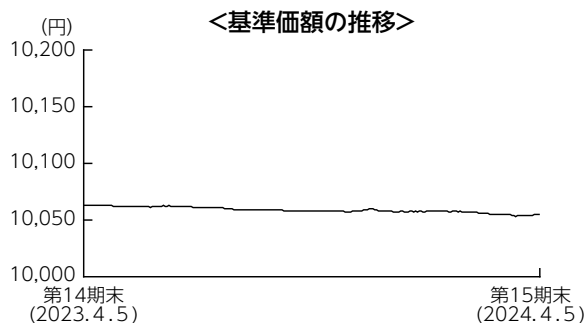
(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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

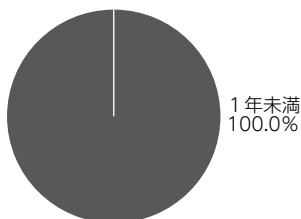
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは、日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続した影響によりマイナス圏で推移しましたが、当期末にかけては、マイナス金利政策の解除を受けて上昇の動きとなり、利回りはプラス水準に転じる局面がありました。

ポートフォリオについて

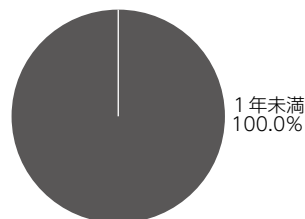
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【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	・	
公	司	183,875,306
社	債(評価額)	299,992,000
未	収	利
前	払	息
		用
		438
(B) 負	債	—
(C) 純	資 産 総 額(A－B)	483,868,290
元		481,233,562
次	期 繰 越 損 益 金	2,634,728
(D) 受	益 権 総 口 数	481,233,562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		
マシュエーズ・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。