

償還 運用報告書（全体版）

第178期<償還日2024年10月29日>

D I A M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>

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（BRL）」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、ブラジルリア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 A M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>」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<ブラジルリアルコース>

■設定以来の運用実績

作 成 期	決 算 期	基 準 価 額			投 資 信 託 受 益 証 入 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 3,506
	1 期(2010年 2 月 5 日)	9,276	120	△6.0	98.3	11,881
	2 期(2010年 3 月 5 日)	9,849	120	7.5	97.5	15,004
	3 期(2010年 4 月 5 日)	10,569	120	8.5	97.5	17,671
第 2 作成期	4 期(2010年 5 月 6 日)	10,818	120	3.5	97.3	19,998
	5 期(2010年 6 月 7 日)	9,684	120	△9.4	99.0	18,892
	6 期(2010年 7 月 5 日)	9,689	150	1.6	99.2	18,913
	7 期(2010年 8 月 5 日)	10,062	150	5.4	99.0	21,281
	8 期(2010年 9 月 6 日)	10,081	150	1.7	99.1	23,414
	9 期(2010年10月 5 日)	10,260	150	3.3	99.1	25,652
第 3 作成期	10期(2010年11月 5 日)	10,150	150	0.4	99.2	28,198
	11期(2010年12月 6 日)	9,833	150	△1.6	99.3	30,100
	12期(2011年 1 月 5 日)	9,658	150	△0.3	98.6	32,299
	13期(2011年 2 月 7 日)	9,392	160	△1.1	99.3	35,060
	14期(2011年 3 月 7 日)	9,521	160	3.1	99.2	43,845
	15期(2011年 4 月 5 日)	9,932	160	6.0	99.2	54,106
第 4 作成期	16期(2011年 5 月 6 日)	9,864	160	0.9	99.2	64,629
	17期(2011年 6 月 6 日)	9,722	160	0.2	99.4	75,585
	18期(2011年 7 月 5 日)	9,875	160	3.2	98.7	88,886
	19期(2011年 8 月 5 日)	9,710	160	△0.1	99.2	103,752
	20期(2011年 9 月 5 日)	8,996	160	△5.7	99.4	104,605
	21期(2011年10月 5 日)	7,238	160	△17.8	99.4	87,083
第 5 作成期	22期(2011年11月 7 日)	8,363	160	17.8	99.4	103,610
	23期(2011年12月 5 日)	7,907	160	△3.5	99.5	101,175
	24期(2012年 1 月 5 日)	7,660	160	△1.1	99.2	99,999
	25期(2012年 2 月 6 日)	8,111	160	8.0	99.5	107,809
	26期(2012年 3 月 5 日)	8,779	160	10.2	99.4	117,115
	27期(2012年 4 月 5 日)	8,230	160	△4.4	99.3	111,120
第 6 作成期	28期(2012年 5 月 7 日)	7,682	160	△4.7	99.5	105,784
	29期(2012年 6 月 5 日)	6,634	160	△11.6	99.4	96,243
	30期(2012年 7 月 5 日)	7,126	160	9.8	99.2	107,300
	31期(2012年 8 月 6 日)	7,108	160	2.0	99.5	115,848
	32期(2012年 9 月 5 日)	6,960	130	△0.3	99.5	123,289
	33期(2012年10月 5 日)	7,063	130	3.3	99.4	130,612

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 7,094	円 130	% 2.3	% 99.4	百万円 133,150
	35期(2012年12月5日)	6,997	130	0.5	99.4	136,137
	36期(2013年1月7日)	7,792	130	13.2	99.5	161,369
	37期(2013年2月5日)	8,077	130	5.3	99.4	170,160
	38期(2013年3月5日)	8,116	130	2.1	99.4	168,776
	39期(2013年4月5日)	8,103	130	1.4	99.3	157,699
第8作成期	40期(2013年5月7日)	8,368	130	4.9	99.2	154,120
	41期(2013年6月5日)	7,457	130	△9.3	99.3	132,818
	42期(2013年7月5日)	6,626	130	△9.4	99.2	114,823
	43期(2013年8月5日)	6,385	130	△1.7	98.9	108,199
	44期(2013年9月5日)	5,913	130	△5.4	98.9	97,323
	45期(2013年10月7日)	6,316	130	9.0	99.0	102,692
第9作成期	46期(2013年11月5日)	6,272	130	1.4	99.0	100,528
	47期(2013年12月5日)	5,869	130	△4.4	98.9	93,209
	48期(2014年1月6日)	6,044	130	5.2	97.9	93,363
	49期(2014年2月5日)	5,587	130	△5.4	98.9	85,013
	50期(2014年3月5日)	5,859	130	7.2	99.0	87,174
	51期(2014年4月7日)	6,173	130	7.6	99.0	87,983
第10作成期	52期(2014年5月7日)	6,192	130	2.4	99.0	84,339
	53期(2014年6月5日)	6,070	130	0.1	98.9	79,164
	54期(2014年7月7日)	6,176	130	3.9	98.9	77,741
	55期(2014年8月5日)	5,978	130	△1.1	99.5	74,064
	56期(2014年9月5日)	6,189	130	5.7	99.0	76,046
	57期(2014年10月6日)	5,552	130	△8.2	99.0	67,578
第11作成期	58期(2014年11月5日)	5,652	130	4.1	99.0	68,294
	59期(2014年12月5日)	5,705	130	3.2	99.0	68,587
	60期(2015年1月5日)	5,313	130	△4.6	96.9	63,746
	61期(2015年2月5日)	5,082	130	△1.9	99.0	61,127
	62期(2015年3月5日)	4,666	130	△5.6	98.9	56,130
	63期(2015年4月6日)	4,461	100	△2.3	98.8	53,147
第12作成期	64期(2015年5月7日)	4,597	100	5.3	98.9	54,793
	65期(2015年6月5日)	4,429	100	△1.5	99.0	52,733
	66期(2015年7月6日)	4,343	100	0.3	99.0	51,241
	67期(2015年8月5日)	3,857	100	△8.9	98.9	44,737
	68期(2015年9月7日)	3,259	100	△12.9	98.7	36,972
	69期(2015年10月5日)	3,091	70	△3.0	98.8	34,167

作成期	決算期	基準 (分配落)	価額			投資信託 組入証比率	純資産 総額
			税分	込配	み金 期騰落 中率		
第13作成期	70期(2015年11月5日)	円 3,354		円 70	% 10.8	% 97.7	百万円 35,337
	71期(2015年12月7日)	3,331		70	1.4	98.6	33,163
	72期(2016年 1 月5日)	2,911		70	△10.5	95.2	27,991
	73期(2016年 2 月5日)	2,931		70	3.1	96.7	27,634
	74期(2016年 3 月7日)	3,015		70	5.3	97.8	28,004
	75期(2016年 4 月5日)	3,080		50	3.8	97.9	28,145
第14作成期	76期(2016年 5 月6日)	3,045		50	0.5	98.5	26,928
	77期(2016年 6 月6日)	3,037		50	1.4	97.7	26,358
	78期(2016年 7 月5日)	3,264		50	9.1	98.7	27,681
	79期(2016年 8 月5日)	3,249		50	1.1	98.3	26,679
	80期(2016年 9 月5日)	3,330		50	4.0	98.7	26,497
	81期(2016年10月5日)	3,294		50	0.4	98.3	25,683
第15作成期	82期(2016年11月7日)	3,188		50	△1.7	97.8	24,604
	83期(2016年12月5日)	3,079		50	△1.9	98.6	23,457
	84期(2017年 1 月5日)	3,467		50	14.2	95.8	25,955
	85期(2017年 2 月6日)	3,469		50	1.5	97.3	25,473
	86期(2017年 3 月6日)	3,509		50	2.6	97.8	25,287
	87期(2017年 4 月5日)	3,416		50	△1.2	98.4	24,119
第16作成期	88期(2017年 5 月8日)	3,441		50	2.2	98.4	23,966
	89期(2017年 6 月5日)	3,319		50	△2.1	97.9	22,880
	90期(2017年 7 月5日)	3,268		50	△0.0	98.1	22,379
	91期(2017年 8 月7日)	3,386		50	5.1	98.4	22,789
	92期(2017年 9 月5日)	3,364		50	0.8	98.4	22,548
	93期(2017年10月5日)	3,413		50	2.9	98.1	22,628
第17作成期	94期(2017年11月6日)	3,263		50	△2.9	98.1	21,210
	95期(2017年12月5日)	3,180		50	△1.0	97.9	20,076
	96期(2018年 1 月5日)	3,168		50	1.2	95.6	19,634
	97期(2018年 2 月5日)	3,034		50	△2.7	97.7	18,598
	98期(2018年 3 月5日)	2,779		50	△6.8	98.0	16,849
	99期(2018年 4 月5日)	2,702		50	△1.0	97.9	16,276
第18作成期	100期(2018年 5 月7日)	2,513		50	△5.1	98.1	14,992
	101期(2018年 6 月5日)	2,307		50	△6.2	96.6	13,687
	102期(2018年 7 月5日)	2,178		50	△3.4	97.7	12,909
	103期(2018年 8 月6日)	2,277		50	6.8	96.5	13,407
	104期(2018年 9 月5日)	1,932		50	△13.0	96.6	11,373
	105期(2018年10月5日)	2,071		50	9.8	97.4	12,210

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)	税込 分配	み騰 金落	中率	
第19作成期	106期(2018年11月5日)	円 2,153	円 25	% 5.2	% 97.6	百万円 12,806
	107期(2018年12月5日)	2,041	25	△4.0	98.2	11,809
	108期(2019年 1 月7日)	2,047	25	1.5	94.6	11,610
	109期(2019年 2 月5日)	2,159	25	6.7	97.8	12,044
	110期(2019年 3 月5日)	2,095	25	△1.8	97.8	11,452
	111期(2019年 4 月5日)	2,052	25	△0.9	97.8	11,108
第20作成期	112期(2019年 5 月7日)	1,977	25	△2.4	97.8	10,599
	113期(2019年 6 月5日)	1,963	25	0.6	97.9	10,396
	114期(2019年 7 月5日)	2,025	25	4.4	98.2	10,594
	115期(2019年 8 月5日)	1,963	25	△1.8	97.2	10,148
	116期(2019年 9 月5日)	1,801	25	△7.0	97.8	9,251
	117期(2019年10月7日)	1,798	25	1.2	97.8	9,024
第21作成期	118期(2019年11月5日)	1,827	25	3.0	97.8	9,113
	119期(2019年12月5日)	1,723	25	△4.3	97.9	8,411
	120期(2020年 1 月6日)	1,816	25	6.8	94.4	8,624
	121期(2020年 2 月5日)	1,752	25	△2.1	97.8	8,274
	122期(2020年 3 月5日)	1,613	25	△6.5	97.8	7,473
	123期(2020年 4 月6日)	1,174	25	△25.7	95.7	5,388
第22作成期	124期(2020年 5 月7日)	1,139	15	△1.7	96.0	5,225
	125期(2020年 6 月5日)	1,356	15	20.4	96.9	6,187
	126期(2020年 7 月6日)	1,270	15	△5.2	96.5	5,688
	127期(2020年 8 月5日)	1,283	15	2.2	97.7	5,657
	128期(2020年 9 月7日)	1,286	15	1.4	97.5	5,609
	129期(2020年10月5日)	1,132	15	△10.8	98.0	4,886
第23作成期	130期(2020年11月5日)	1,127	15	0.9	97.2	4,820
	131期(2020年12月7日)	1,251	15	12.3	98.5	5,223
	132期(2021年 1 月5日)	1,217	15	△1.5	97.9	4,972
	133期(2021年 2 月5日)	1,166	15	△3.0	97.6	4,703
	134期(2021年 3 月5日)	1,096	15	△4.7	97.8	4,387
	135期(2021年 4 月5日)	1,072	15	△0.8	97.9	4,269
第24作成期	136期(2021年 5 月6日)	1,111	15	5.0	97.5	4,367
	137期(2021年 6 月7日)	1,192	15	8.6	97.6	4,615
	138期(2021年 7 月5日)	1,211	15	2.9	97.9	4,658
	139期(2021年 8 月5日)	1,149	15	△3.9	98.3	4,385
	140期(2021年 9 月6日)	1,164	15	2.6	97.4	4,415
	141期(2021年10月5日)	1,071	15	△6.7	97.6	4,030

作成期	決算期	基準 (分配落)	価額			投資信託 組入証比率	純資産 総額
			税分 込配	み金 期騰	落中率		
第25作成期	142期(2021年11月5日)	円 1,059		円 15	% 0.3	% 97.5	百万円 3,921
	143期(2021年12月6日)	1,012		15	△3.0	97.8	3,717
	144期(2022年 1 月5日)	1,036		3	2.7	98.0	3,751
	145期(2022年 2 月7日)	1,058		3	2.4	98.4	3,496
	146期(2022年 3 月7日)	984		3	△6.7	97.6	3,183
	147期(2022年 4 月5日)	1,202		3	22.5	98.0	3,798
第26作成期	148期(2022年 5 月6日)	1,079		3	△10.0	98.1	3,276
	149期(2022年 6 月6日)	1,153		3	7.1	97.6	3,445
	150期(2022年 7 月5日)	1,010		3	△12.1	97.8	2,966
	151期(2022年 8 月5日)	1,062		3	5.4	97.8	3,085
	152期(2022年 9 月5日)	1,092		3	3.1	97.9	3,136
	153期(2022年10月5日)	1,089		3	0.0	98.2	3,078
第27作成期	154期(2022年11月7日)	1,121		3	3.2	98.3	3,125
	155期(2022年12月5日)	1,088		3	△2.7	98.0	3,004
	156期(2023年 1 月5日)	1,019		3	△6.1	97.5	2,759
	157期(2023年 2 月6日)	1,118		3	10.0	97.7	2,988
	158期(2023年 3 月6日)	1,097		3	△1.6	98.4	2,905
	159期(2023年 4 月5日)	1,116		3	2.0	97.9	2,930
第28作成期	160期(2023年 5 月8日)	1,155		3	3.8	97.9	3,002
	161期(2023年 6 月5日)	1,200		3	4.2	98.0	3,082
	162期(2023年 7 月5日)	1,316		3	9.9	98.1	3,309
	163期(2023年 8 月7日)	1,280		3	△2.5	98.1	3,175
	164期(2023年 9 月5日)	1,290		3	1.0	98.6	3,145
	165期(2023年10月5日)	1,186		3	△7.8	98.5	2,861
第29作成期	166期(2023年11月6日)	1,262		3	6.7	98.3	3,019
	167期(2023年12月5日)	1,328		3	5.5	97.9	3,122
	168期(2024年 1 月5日)	1,341		3	1.2	98.4	3,066
	169期(2024年 2 月5日)	1,371		3	2.5	98.0	3,108
	170期(2024年 3 月5日)	1,411		3	3.1	97.8	3,130
	171期(2024年 4 月5日)	1,425		3	1.2	98.3	3,022
第30作成期	172期(2024年 5 月7日)	1,391		3	△2.2	97.7	2,898
	173期(2024年 6 月5日)	1,376		3	△0.9	98.1	2,816
	174期(2024年 7 月5日)	1,363		3	△0.7	98.5	2,746
	175期(2024年 8 月5日)	1,247		3	△8.3	98.1	2,464
	176期(2024年 9 月5日)	1,262		3	1.4	98.0	2,437
	177期(2024年10月7日)	1,322		3	5.0	97.9	2,434

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	み金騰落率		
第31作成期	(償還日) 2024年10月29日	円 (償還価額) 1,320.23	円	0	% △0.1	% －	百万円 2,292

(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

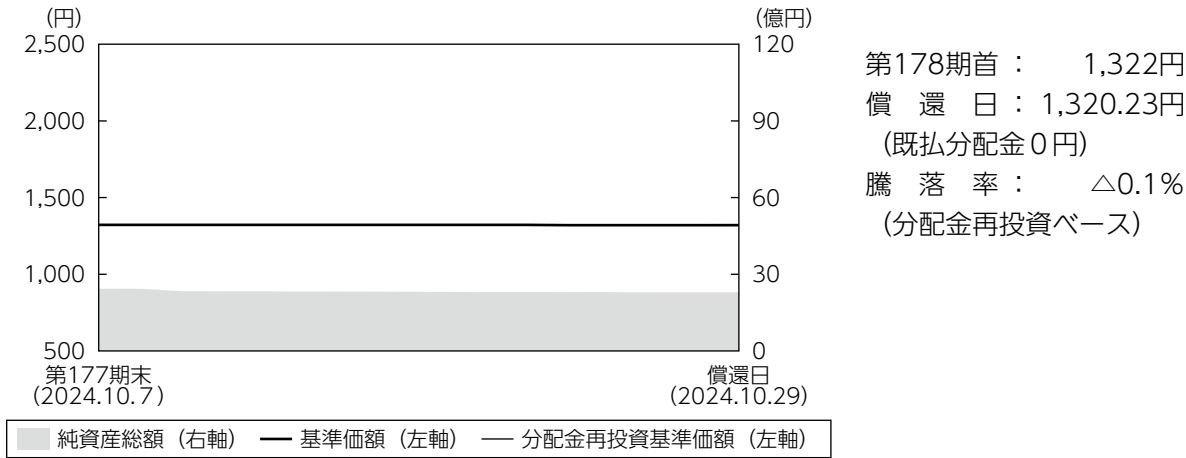
決算期	年 月 日	基準価額	騰落率		投資信託受益証券組入比率
			騰	落 率	
第178期	(期首) 2024 年 10 月 7 日	円 1,322		% －	% 97.9
	(償還日) 2024 年 10 月 29 日	(償還価額) 1,320.23		△0.1	－

(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、2021年以降、為替がブラジルレアル高円安となったことも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67.2%上昇しました（分配金再投資ベース、設定来の分配金12,142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 (B R L)	0.0%
D I A M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 (B R L) 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 (B R L) は2024年10月22日、D I A M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。

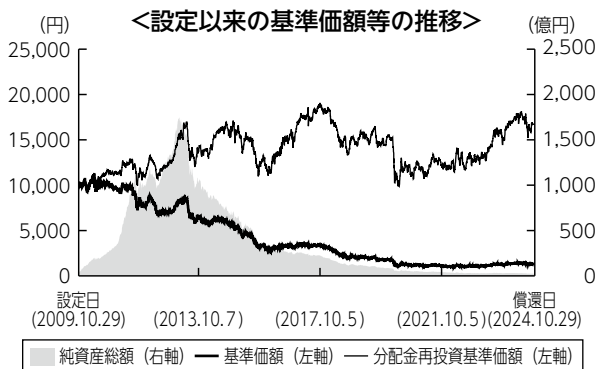
設定来の投資環境

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。

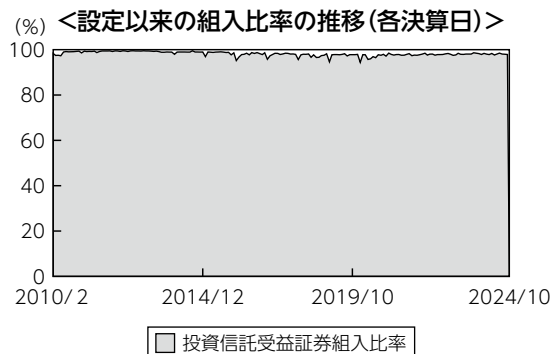
2015年は、原油価格の大幅下落により、一部産油国への信用懸念が高まる局面もありましたが、新興国経済が全般的に堅調に成長したことから、上昇幅を拡大しました。2016年はトランプ大統領が就任し、中国との貿易摩擦が強まり、一時的に上昇幅を縮小する局面もありましたが、世界経済が好調に推移したことから、再び上昇しました。2020年1月に新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や都市封鎖により、新興国債券市場も大幅に上昇幅を縮小しましたが、主要国が大規模な金融緩和や財政政策を実施したことが下支えとなり、更にワクチン開発に成功したことから、再び上昇幅を拡大しました。2022年に入り、ロシアがウクライナに軍事侵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

ブラジルリアル／円相場は、設定来でブラジルリアル安円高となりました。前半は、中国景気の減速懸念やブラジル国債の格下げ、ブラジル国内の政局不安などを背景にブラジルリアルは対円で下落しました。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幅が拡大しましたが、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、下落幅は縮小しました。

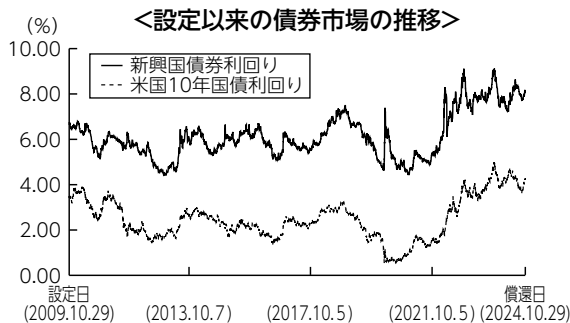
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは0.1%程度で始まりしました。2013年4月に日銀による大規模な「量的・質的金融緩和政策」が導入され同利回りは低下傾向となりました。2016年1月にはマイナス金利政策が導入されたことにより、同金利は一段と低下しマイナス圏で推移することになりましたが、2024年3月にマイナス金利政策が解除されたことを受けて、その後は概ねプラス圏での推移となりました。



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。



(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。



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

※J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

設定来のポートフォリオについて

●当ファンド

ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス（ＢＲＬ）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（ＢＲＬ）

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。

●ＤＩＡＭ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

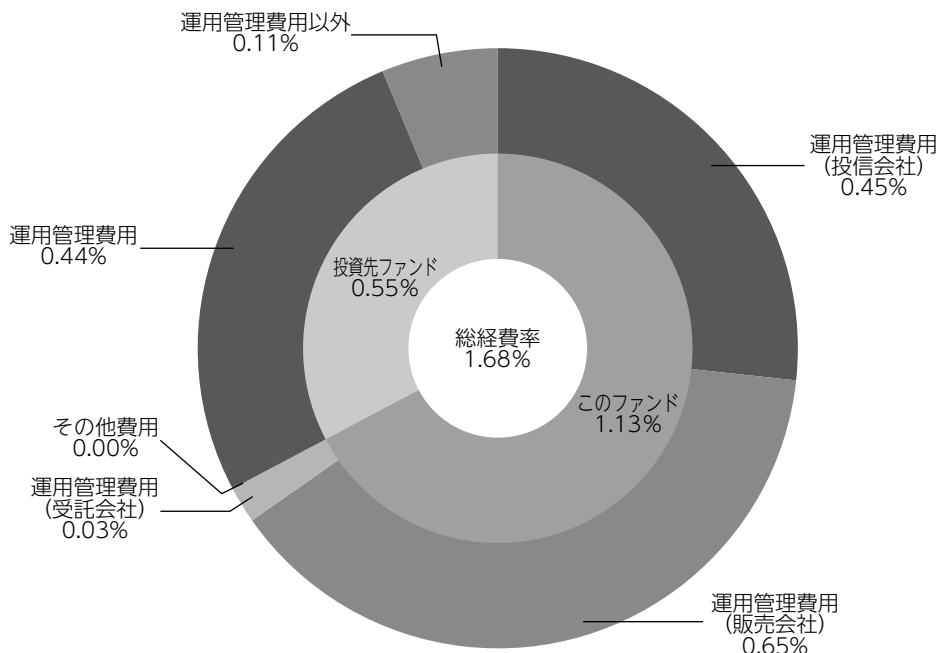
項目	第178期		項目の概要
	(2024年10月8日 ～2024年10月29日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	1円	0.068%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は1,321円です。
(投信会社)	(0)	(0.027)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(1)	(0.039)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(0)	(0.002)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
合計	1	0.068	

- (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1.68%です。



総経費率 (①+②+③)	1.68%
①このファンドの費用の比率	1.13%
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 (B R L)	千□ －	千円 －	千□ 3,264.11362	千円 2,381,056

（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□ －	千円 －	千□ 10,530	千円 10,591

■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(B R L)	千□ 3,264.11362
合 計	3,264.11362

(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□ 10,530

■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 2,298,853	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	2,298,853	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	2,298,853,361円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,298,839,568
未 収 利 息	13,793
(B) 負 債	5,955,191
未 払 解 約 金	4,264,300
未 払 信 託 報 酬	1,690,891
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	2,292,898,170
元 本	17,367,409,297
償 還 差 損 益 金	△15,074,511,127
(D) 受 益 権 総 口 数	17,367,409,297口
1 万口当たり償還価額(C／D)	1,320円23銭

(注) 第177期末における元本額は18,414,771,336円、当作成期における追加設定元本額は7,891,523円、同解約元本額は1,055,253,562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	89,639円
受 取 利 息	89,639
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,609,593
売 買 益	△14,361
売 買 損	△1,595,232
(C) 信 託 報 酬 等	△1,690,891
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	△3,210,845
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△6,180,442,948
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△8,890,857,334
(配 当 等 相 当 額)	(2,350,350,762)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△11,241,208,096)
(G) 合 計(D＋E＋F)	△15,074,511,127
償 還 差 損 益 金(G)	△15,074,511,127

(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	2,298,853,361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	5,955,191円
				純資産総額	2,292,898,170円
受益権口数	3,506,406,307口	17,367,409,297口	13,861,002,990口	受益権口数	17,367,409,297口
元本額	3,506,406,307円	17,367,409,297円	13,861,002,990円	1万口当たり償還金	1,320円23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	12,807,999,271円	11,881,106,759円	9,276円	120円	1.20%
第2期	15,235,234,633	15,004,596,735	9,849	120	1.20
第3期	16,720,438,051	17,671,947,894	10,569	120	1.20
第4期	18,485,938,131	19,998,150,260	10,818	120	1.20
第5期	19,509,112,422	18,892,642,566	9,684	120	1.20
第6期	19,520,261,317	18,913,980,609	9,689	150	1.50
第7期	21,149,693,913	21,281,812,019	10,062	150	1.50
第8期	23,226,859,415	23,414,288,153	10,081	150	1.50
第9期	25,002,878,252	25,652,522,241	10,260	150	1.50
第10期	27,782,841,205	28,198,550,519	10,150	150	1.50
第11期	30,612,305,114	30,100,797,271	9,833	150	1.50
第12期	33,444,671,878	32,299,785,967	9,658	150	1.50
第13期	37,328,321,331	35,060,530,691	9,392	160	1.60
第14期	46,052,608,821	43,845,001,805	9,521	160	1.60
第15期	54,479,779,233	54,106,628,510	9,932	160	1.60
第16期	65,522,320,176	64,629,547,350	9,864	160	1.60
第17期	77,744,110,898	75,585,094,001	9,722	160	1.60
第18期	90,014,091,653	88,886,979,482	9,875	160	1.60
第19期	106,854,097,784	103,752,625,159	9,710	160	1.60
第20期	116,276,674,028	104,605,078,875	8,996	160	1.60
第21期	120,308,448,203	87,083,914,957	7,238	160	1.60
第22期	123,891,085,808	103,610,708,189	8,363	160	1.60
第23期	127,964,476,876	101,175,153,748	7,907	160	1.60
第24期	130,552,806,125	99,999,302,937	7,660	160	1.60
第25期	132,922,312,993	107,809,980,337	8,111	160	1.60
第26期	133,411,153,065	117,115,060,350	8,779	160	1.60
第27期	135,020,105,600	111,120,336,605	8,230	160	1.60
第28期	137,707,618,016	105,784,762,251	7,682	160	1.60

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第 29 期	145,066,505,197円	96,243,424,242円	6,634円	160円	1.60%
第 30 期	150,583,343,996	107,300,996,471	7,126	160	1.60
第 31 期	162,975,618,208	115,848,443,929	7,108	160	1.60
第 32 期	177,128,570,371	123,289,734,713	6,960	130	1.30
第 33 期	184,915,466,817	130,612,274,468	7,063	130	1.30
第 34 期	187,692,897,180	133,150,626,059	7,094	130	1.30
第 35 期	194,556,455,356	136,137,952,138	6,997	130	1.30
第 36 期	207,106,922,451	161,369,451,787	7,792	130	1.30
第 37 期	210,673,763,266	170,160,149,931	8,077	130	1.30
第 38 期	207,965,479,356	168,776,101,288	8,116	130	1.30
第 39 期	194,626,793,883	157,699,095,180	8,103	130	1.30
第 40 期	184,184,843,497	154,120,513,556	8,368	130	1.30
第 41 期	178,111,584,139	132,818,124,668	7,457	130	1.30
第 42 期	173,295,818,656	114,823,309,231	6,626	130	1.30
第 43 期	169,456,293,505	108,199,912,118	6,385	130	1.30
第 44 期	164,585,812,345	97,323,118,135	5,913	130	1.30
第 45 期	162,586,305,138	102,692,705,028	6,316	130	1.30
第 46 期	160,292,904,365	100,528,257,678	6,272	130	1.30
第 47 期	158,819,125,575	93,209,254,564	5,869	130	1.30
第 48 期	154,485,558,328	93,363,561,472	6,044	130	1.30
第 49 期	152,171,452,930	85,013,949,361	5,587	130	1.30
第 50 期	148,782,862,801	87,174,776,933	5,859	130	1.30
第 51 期	142,522,108,509	87,983,313,226	6,173	130	1.30
第 52 期	136,204,885,341	84,339,193,868	6,192	130	1.30
第 53 期	130,421,271,914	79,164,221,000	6,070	130	1.30
第 54 期	125,873,349,293	77,741,007,973	6,176	130	1.30
第 55 期	123,903,016,132	74,064,699,280	5,978	130	1.30
第 56 期	122,872,866,967	76,046,816,766	6,189	130	1.30
第 57 期	121,716,022,439	67,578,697,697	5,552	130	1.30
第 58 期	120,839,777,326	68,294,844,117	5,652	130	1.30
第 59 期	120,223,863,107	68,587,171,872	5,705	130	1.30
第 60 期	119,972,323,992	63,746,715,068	5,313	130	1.30
第 61 期	120,290,914,354	61,127,124,412	5,082	130	1.30
第 62 期	120,291,305,395	56,130,987,361	4,666	130	1.30
第 63 期	119,150,279,681	53,147,707,521	4,461	100	1.00
第 64 期	119,197,511,618	54,793,945,253	4,597	100	1.00
第 65 期	119,051,718,724	52,733,772,832	4,429	100	1.00
第 66 期	117,995,970,085	51,241,569,209	4,343	100	1.00

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	115,999,892,849円	44,737,264,326円	3,857円	100円	1.00%
第 68 期	113,440,649,872	36,972,922,503	3,259	100	1.00
第 69 期	110,522,280,869	34,167,134,832	3,091	70	0.70
第 70 期	105,345,744,862	35,337,847,503	3,354	70	0.70
第 71 期	99,545,658,319	33,163,038,144	3,331	70	0.70
第 72 期	96,149,941,206	27,991,468,946	2,911	70	0.70
第 73 期	94,297,439,890	27,634,313,731	2,931	70	0.70
第 74 期	92,889,466,202	28,004,077,451	3,015	70	0.70
第 75 期	91,394,179,073	28,145,625,207	3,080	50	0.50
第 76 期	88,423,216,836	26,928,858,099	3,045	50	0.50
第 77 期	86,777,241,577	26,358,195,438	3,037	50	0.50
第 78 期	84,809,855,480	27,681,522,300	3,264	50	0.50
第 79 期	82,113,336,853	26,679,225,713	3,249	50	0.50
第 80 期	79,574,362,480	26,497,170,451	3,330	50	0.50
第 81 期	77,959,707,209	25,683,330,021	3,294	50	0.50
第 82 期	77,173,192,004	24,604,446,417	3,188	50	0.50
第 83 期	76,196,596,120	23,457,640,215	3,079	50	0.50
第 84 期	74,860,681,819	25,955,517,275	3,467	50	0.50
第 85 期	73,436,391,396	25,473,585,018	3,469	50	0.50
第 86 期	72,062,475,695	25,287,876,284	3,509	50	0.50
第 87 期	70,606,443,564	24,119,241,128	3,416	50	0.50
第 88 期	69,655,105,582	23,966,031,642	3,441	50	0.50
第 89 期	68,948,541,732	22,880,763,765	3,319	50	0.50
第 90 期	68,476,596,935	22,379,632,106	3,268	50	0.50
第 91 期	67,297,750,555	22,789,092,440	3,386	50	0.50
第 92 期	67,033,057,781	22,548,740,666	3,364	50	0.50
第 93 期	66,303,257,709	22,628,217,738	3,413	50	0.50
第 94 期	65,002,476,512	21,210,159,705	3,263	50	0.50
第 95 期	63,139,150,924	20,076,006,528	3,180	50	0.50
第 96 期	61,971,723,813	19,634,267,273	3,168	50	0.50
第 97 期	61,290,775,521	18,598,174,898	3,034	50	0.50
第 98 期	60,634,122,649	16,849,358,702	2,779	50	0.50
第 99 期	60,241,424,986	16,276,163,512	2,702	50	0.50
第 100 期	59,667,739,111	14,992,143,664	2,513	50	0.50
第 101 期	59,326,113,737	13,687,187,998	2,307	50	0.50
第 102 期	59,273,132,442	12,909,583,054	2,178	50	0.50
第 103 期	58,871,151,835	13,407,842,038	2,277	50	0.50
第 104 期	58,867,543,070	11,373,850,815	1,932	50	0.50

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	58,961,053,296円	12,210,750,008円	2,071円	50円	0.50%
第 106 期	59,495,426,769	12,806,966,984	2,153	25	0.25
第 107 期	57,851,466,936	11,809,911,136	2,041	25	0.25
第 108 期	56,709,685,716	11,610,351,398	2,047	25	0.25
第 109 期	55,791,694,440	12,044,405,313	2,159	25	0.25
第 110 期	54,660,785,963	11,452,583,551	2,095	25	0.25
第 111 期	54,140,675,526	11,108,160,865	2,052	25	0.25
第 112 期	53,619,773,683	10,599,408,624	1,977	25	0.25
第 113 期	52,972,658,433	10,396,968,096	1,963	25	0.25
第 114 期	52,327,640,521	10,594,355,577	2,025	25	0.25
第 115 期	51,697,657,167	10,148,096,934	1,963	25	0.25
第 116 期	51,370,602,163	9,251,431,813	1,801	25	0.25
第 117 期	50,202,707,687	9,024,308,740	1,798	25	0.25
第 118 期	49,882,896,229	9,113,568,982	1,827	25	0.25
第 119 期	48,828,620,693	8,411,455,882	1,723	25	0.25
第 120 期	47,484,059,921	8,624,720,362	1,816	25	0.25
第 121 期	47,227,999,059	8,274,466,525	1,752	25	0.25
第 122 期	46,326,880,028	7,473,165,711	1,613	25	0.25
第 123 期	45,896,823,129	5,388,164,485	1,174	25	0.25
第 124 期	45,877,731,522	5,225,995,926	1,139	15	0.15
第 125 期	45,636,215,790	6,187,454,450	1,356	15	0.15
第 126 期	44,785,690,577	5,688,197,293	1,270	15	0.15
第 127 期	44,109,348,569	5,657,450,264	1,283	15	0.15
第 128 期	43,608,505,923	5,609,216,674	1,286	15	0.15
第 129 期	43,179,789,209	4,886,440,950	1,132	15	0.15
第 130 期	42,775,314,444	4,820,425,366	1,127	15	0.15
第 131 期	41,748,845,634	5,223,979,052	1,251	15	0.15
第 132 期	40,853,566,466	4,972,412,943	1,217	15	0.15
第 133 期	40,323,500,535	4,703,476,191	1,166	15	0.15
第 134 期	40,035,109,897	4,387,366,870	1,096	15	0.15
第 135 期	39,835,291,855	4,269,080,341	1,072	15	0.15
第 136 期	39,316,777,757	4,367,859,104	1,111	15	0.15
第 137 期	38,733,802,270	4,615,951,475	1,192	15	0.15
第 138 期	38,476,408,009	4,658,426,244	1,211	15	0.15
第 139 期	38,162,288,150	4,385,423,465	1,149	15	0.15
第 140 期	37,944,755,179	4,415,387,032	1,164	15	0.15
第 141 期	37,623,822,012	4,030,766,020	1,071	15	0.15
第 142 期	37,040,574,121	3,921,578,128	1,059	15	0.15

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	36,738,476,597円	3,717,090,762円	1,012円	15円	0.15%
第 144 期	36,231,590,474	3,751,796,967	1,036	3	0.03
第 145 期	33,049,330,692	3,496,194,272	1,058	3	0.03
第 146 期	32,342,769,176	3,183,122,606	984	3	0.03
第 147 期	31,597,337,892	3,798,838,803	1,202	3	0.03
第 148 期	30,372,028,936	3,276,593,204	1,079	3	0.03
第 149 期	29,882,766,882	3,445,306,995	1,153	3	0.03
第 150 期	29,370,345,592	2,966,123,081	1,010	3	0.03
第 151 期	29,057,754,340	3,085,682,169	1,062	3	0.03
第 152 期	28,706,772,475	3,136,203,041	1,092	3	0.03
第 153 期	28,278,273,985	3,078,652,903	1,089	3	0.03
第 154 期	27,875,724,111	3,125,839,996	1,121	3	0.03
第 155 期	27,616,580,507	3,004,206,292	1,088	3	0.03
第 156 期	27,071,302,988	2,759,558,171	1,019	3	0.03
第 157 期	26,726,337,428	2,988,952,969	1,118	3	0.03
第 158 期	26,489,976,249	2,905,867,751	1,097	3	0.03
第 159 期	26,269,651,387	2,930,793,397	1,116	3	0.03
第 160 期	25,995,094,276	3,002,814,867	1,155	3	0.03
第 161 期	25,679,953,388	3,082,207,815	1,200	3	0.03
第 162 期	25,158,619,994	3,309,618,182	1,316	3	0.03
第 163 期	24,814,237,242	3,175,645,753	1,280	3	0.03
第 164 期	24,393,259,134	3,145,697,803	1,290	3	0.03
第 165 期	24,122,009,546	2,861,728,012	1,186	3	0.03
第 166 期	23,927,933,458	3,019,153,605	1,262	3	0.03
第 167 期	23,504,608,778	3,122,080,772	1,328	3	0.03
第 168 期	22,857,048,418	3,066,188,386	1,341	3	0.03
第 169 期	22,673,436,562	3,108,144,665	1,371	3	0.03
第 170 期	22,189,910,119	3,130,500,062	1,411	3	0.03
第 171 期	21,203,181,790	3,022,120,427	1,425	3	0.03
第 172 期	20,835,993,034	2,898,662,415	1,391	3	0.03
第 173 期	20,463,653,042	2,816,280,668	1,376	3	0.03
第 174 期	20,147,300,377	2,746,030,732	1,363	3	0.03
第 175 期	19,762,957,613	2,464,830,694	1,247	3	0.03
第 176 期	19,306,646,439	2,437,400,297	1,262	3	0.03
第 177 期	18,414,771,336	2,434,588,519	1,322	3	0.03

償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税引前）	1,320円23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	<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「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。</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 B 3 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 U S D 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>
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 AM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 AMマネーマザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

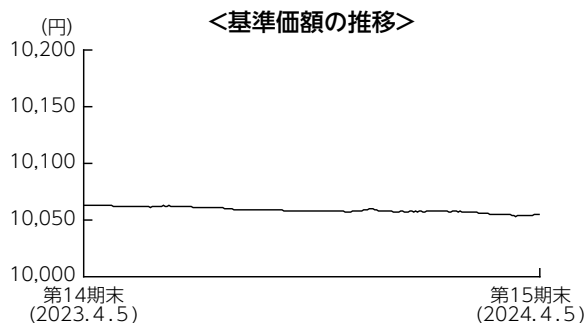
(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

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

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

■当期の運用経過（2023年4月6日から2024年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,055円となり、前期末比で0.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

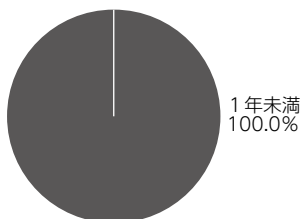
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは、日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続した影響によりマイナス圏で推移しましたが、当期末にかけては、マイナス金利政策の解除を受けて上昇の動きとなり、利回りはプラス水準に転じる局面がありました。

ポートフォリオについて

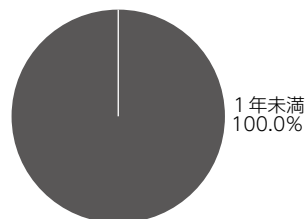
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比 期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

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

公社債

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

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

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

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D / C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公 社 債	500	200	40.0	600	－	－

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

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

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

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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

■投資信託財産の構成

2024年 4月 5日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率		
公 社 債	千円 299,992	% 62.0		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	183,876	38.0		
投 資 信 託 財 産 総 額	483,868	100.0		

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第 2 位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月5日)現在

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

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