

償還 運用報告書（全体版）

第178期<償還日2024年10月29日>

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>

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（B R L）」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、または政府が公債と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、ブラジルレ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」方針とされていますが、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る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

お客様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。

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<ブラジルレアルコース>」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。

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/>

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>

■設定以来の運用実績

作成期	決算期	基準価額					投資組入	信託証券率	純資産総額
		(分配落)	税分	込配み金	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					投資信託組入比率	純資産総額
		(分配落)	税分	込配	み金	期騰落		
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	基準価額				投資信託組入比率	純資産総額
		(分配落)	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					投資信託組入比率	純資産総額
		(分配落)	税分	込配み金	期騰落	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	基準価額					投資信託組入比率	純資産額
		(分配落)	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				投資信託証券組入比率	純資産総額
		分配額	税分	込配金	期騰落率		
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

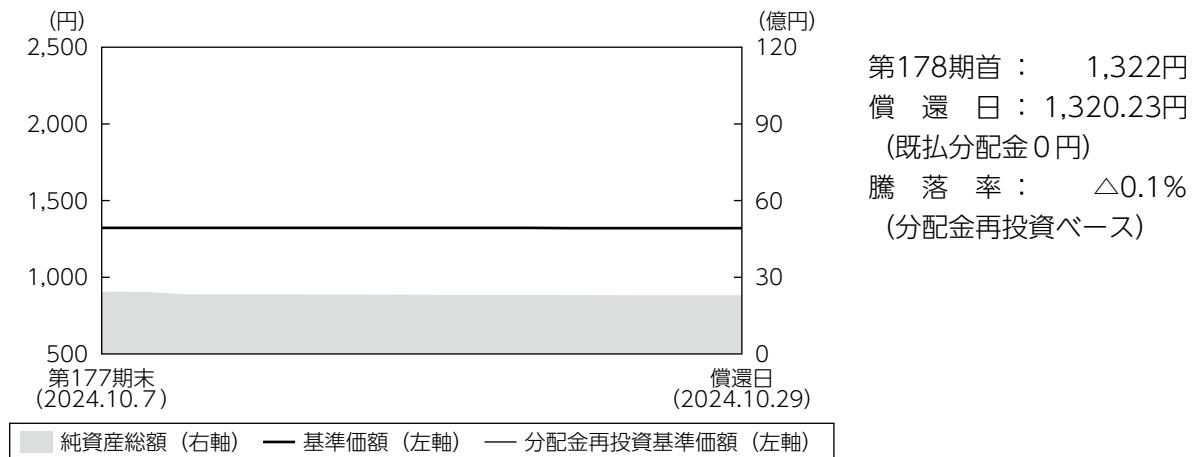
決算期	年月日	基準価額			投資信託受益証券組入比率
		騰	落	率	
第178期	(期首) 2024年10月7日	円 1,322		% -	% 97.9
	(償還日) 2024年10月29日	(償還価額) 1,320.23		△0.1	-

(注1) 謄落率は期首比です。

(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



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 IAM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 IAM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。

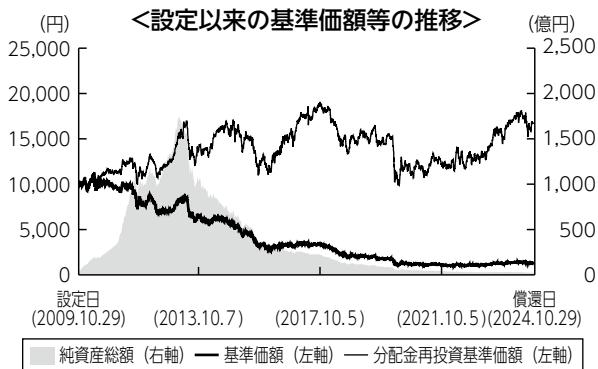
設定来の投資環境

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。

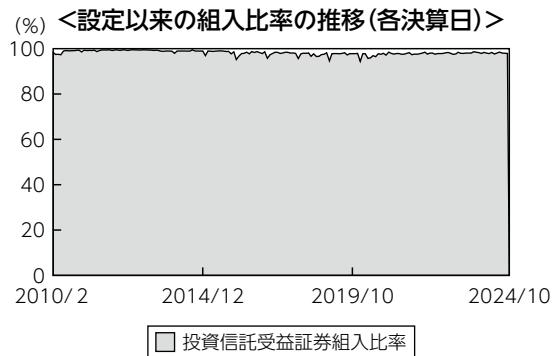
2015年は、原油価格の大幅下落により、一部産油国への信用懸念が高まる局面もありましたが、新興国経済が全般的に堅調に成長したことから、上昇幅を拡大しました。2016年はトランプ大統領が就任し、中国との貿易摩擦が強まり、一時的に上昇幅を縮小する局面もありましたが、世界経済が好調に推移したことから、再び上昇しました。2020年1月に新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や都市封鎖により、新興国債券市場も大幅に上昇幅を縮小しましたが、主要国が大規模な金融緩和や財政政策を実施したことが下支えとなり、更にワクチン開発に成功したことから、再び上昇幅を拡大しました。2022年に入り、ロシアがウクライナに軍事侵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

ブラジルレアル／円相場は、設定来でブラジルレ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レ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（B R L）の組入比率は原則として高位を維持し、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行いました。

●ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス（B R L）

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・デュレーション※配分によってベンチマークを上回る運用を図りました。

※金利変動に対する債券価格の変動性。

●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債、政府保証債、地方債などで運用を行いました。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第178期		項目の概要	
	(2024年10月8日 ～2024年10月29日)			
	金額	比率		
(a) 信託報酬	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おります。

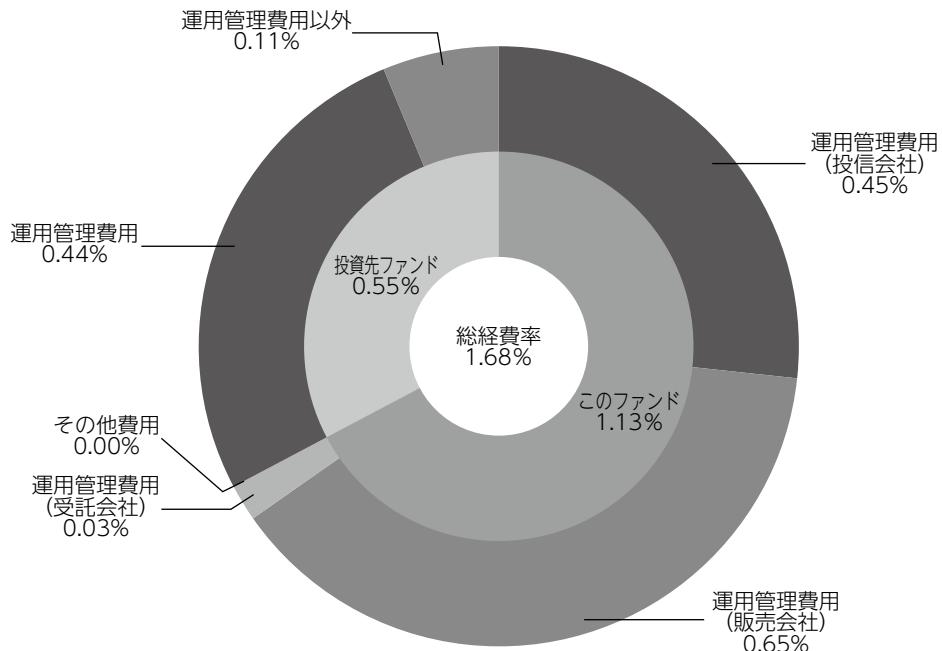
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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

当社成期中の運用・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。



項目	割合
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 資 本 企 業 投 資 信 託 受 益 證 券	ケイマン エマージング ソブリン ファンド クラス (B R L)	千口 —	千円 —	千口 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	千口 —	千円 —	千口 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　ア　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 コール・ローン等	2,298,853,361円 2,298,839,568
未 収 利 息	13,793
(B) 負 債 未 払 解 約 金	5,955,191 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 受 取 利 息	89,639円 89,639
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益 売 買 益	△1,609,593 △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 (配 当 等 相 當 額)	△8,890,857,334 (2,350,350,762)
(売 買 損 益 相 當 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
受益権口数	3,506,406,307口	17,367,409,297口	13,861,002,990口	純資産総額	2,292,898,170円
元本額	3,506,406,307円	17,367,409,297円	13,861,002,990円	受益権口数	17,367,409,297口
元本額				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「DIA 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「JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（米ドルベース・為替ヘッジなし）」をベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざします。なお、ベンチマークは市場の構造変化等によっては今後見直す場合があります。</p> <p>③銘柄選定にあたっては、投資対象国のファンダメンタルズ分析や個別銘柄のバリュエーション分析等により決定します。</p> <p>④組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がB-格もしくはB3格相当以上を取得している債券とします。</p> <p>⑤原則として、ポートフォリオの平均格付*はB-格相当以上とします。</p> <p>⑥原則として、ポートフォリオの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーションに対して±2年以内とします。</p> <p>⑦米ドル建て以外の資産への投資は、純資産総額の20%以内を基本とします。ただし、この場合は原則として対米ドルで為替取引することとします。</p> <p>⑧有価証券先物取引、金利スワップ等のデリバティブ取引を活用する場合があります。</p> <p>⑨各クラスは、米ドルに対して各クラスの通貨で為替取引を行います（クラスUSDを除く）。</p> <p>※平均格付とは、各組入債券にかかる信用格付を加重平均したものであり、外国投資信託にかかる信用格付ではありません。</p>
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	
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	
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	KAZTRANSGAS 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	50,417,992	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 ZIRAAAT 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

DIA 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)

DIA 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	債券組入比率		新株予約権付社債(転換社債)	債券先物比率	純資産額
		期騰落率	中率			
11期(2020年4月6日)	円 10,089	% △0.1	% 69.3	% —	% —	百万円 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標が存在しないため、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)。

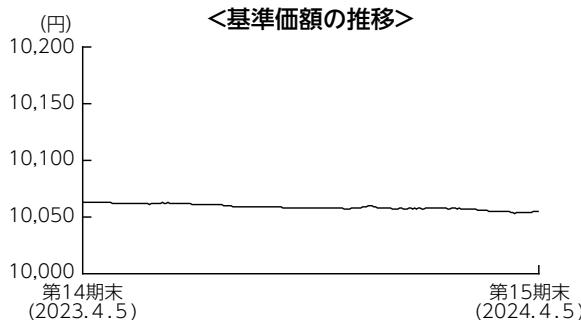
■当期中の基準価額の推移

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) 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) 謄落率は期首比です。

(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。

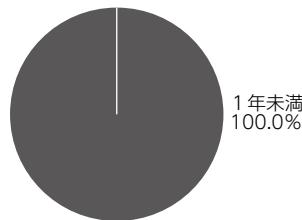
ポートフォリオについて

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

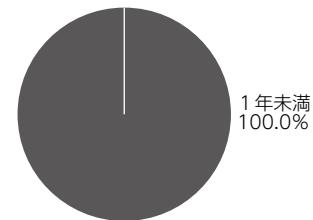
【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○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
国内	国債証券	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
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	
440回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,006	2024/09/01
441回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,004	2024/10/01
446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 一 ル 一 ノ ン 等	債(評価額)	183,875,306
公 社		299,992,000
未 収 利 息		546
前 払 費 用		438
(B) 負 債		—
(C) 純 資 産 総 額(A-B)		483,868,290
元 本		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

追加設定元本額 13,726,863円

一部解約元本額 778,151,914円

(注2) 期末における元本の内訳

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

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>

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>

クルーズコントロール 2,474,972円

D IAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース> 294,245,101円

D IAM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> 870,000円

D IAM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> 530,000円

D IAM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> 70,000円

D IAM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> 10,530,000円

D IAM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> 149,716円

USストラテジック・インカム・ファンドAコース 5,972円

USストラテジック・インカム・ファンドBコース 993,740円

D IAMマージナス・グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金> 1,987,479円

マシユーズ・アジア株式ファンド 9,935円

One世界分散セレクト (Aコース) 14,723,185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資本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ハイマーケット債券ファンド (毎月決算型) 188,380円

モルガン・スタンレーUSハイマーケット債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし)

モルガン・スタンレーUSハイマーケット債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり)

モルガン・スタンレーUSハイマーケット債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし)

ファンドスマス・グローバル・エクイティ・ファンド

PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり)

PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし)

One/ファーディティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)

One/ファーディティ・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)

期末元本合計

109,063円

297,442円

118,977円

99,255,584円

301,134円

1,493,740円

9,943,324円

1,988,665円

481,233,562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) 配当受支					△54,712円
取扱	利利	息息			26,392
					△81,104
(B) 有価証券売壳					△502,000
売	買	益			14,000
壳	買				△516,000
					△556,712
(C) 当期損益					△556,712
(D) 前期繰越損益					7,856,815
(E) 解約差損益					△4,744,512
(F) 追加信託差損益					79,137
(G) 合計(C+D+E+F)					2,634,728
次期繰越損益					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。