

償還 運用報告書（全体版）

第10期＜償還日 2023年8月23日＞

USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型

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／内外／債券
信託期間	2013年11月25日から2023年8月23日までです。
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て外国投資信託である「D I AMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス」の投資信託証券を主要投資対象とします。また、証券投資信託である「国内マネー・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	米ドル建ての外国投資信託への投資を通じて、実質的に米ドル建て米国債券に投資します。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。外国投資信託の対円での為替変動リスクについては、委託会社独自の手法により、円高・米ドル安が予想される局面においては、為替予約取引を活用して為替ヘッジを行います。
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。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	決算日（原則として毎年8月23日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の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。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。

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、「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」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/>

USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額				投 資 信 託 純 資 産 受 益 証 券 総 額
	(分 配 落)	税 込 分	み 金 騰 落	中 率	
(設 定 日) 2013年11月25日	円 10,000	円 －		% －	百万円 197
1期(2014年8月25日)	10,475	0		4.8	1,260
2期(2015年8月24日)	11,700	0		11.7	1,492
3期(2016年8月23日)	10,004	0		△14.5	1,205
4期(2017年8月23日)	10,802	0		8.0	1,012
5期(2018年8月23日)	10,856	0		0.5	803
6期(2019年8月23日)	11,813	0		8.8	752
7期(2020年8月24日)	12,782	0		8.2	508
8期(2021年8月23日)	13,179	0		3.1	431
9期(2022年8月23日)	13,640	0		3.5	383
(償 還 日) 2023年8月23日	(償還価額) 13,608.98	0		△0.2	332

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

(注3) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

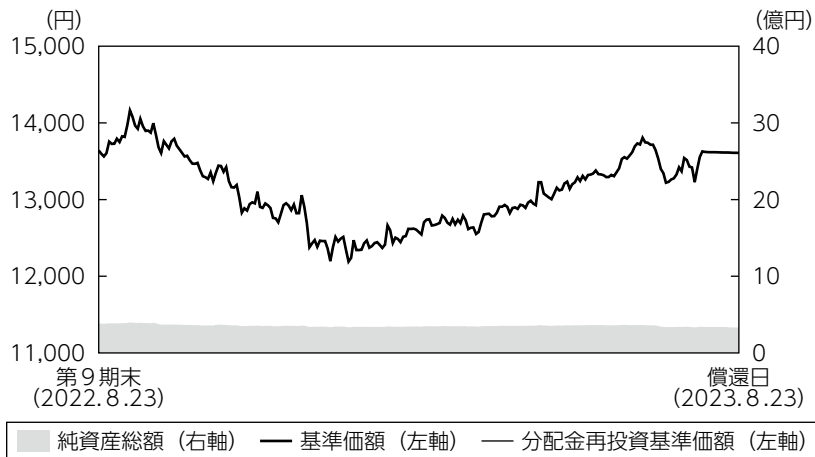
■当期中の基準価額の推移

年	月	日	基 準	価 額		投資信託受益証券 組 入 比 率
				騰	落 率	
(期 首)			円		%	%
2022 年	8 月	23 日	13,640		—	96.8
	8 月	末	13,728		0.6	95.7
	9 月	末	13,714		0.5	95.7
	10 月	末	13,443		△1.4	96.7
	11 月	末	12,890		△5.5	94.8
	12 月	末	12,361		△9.4	94.1
2023 年	1 月	末	12,444		△8.8	96.2
	2 月	末	12,738		△6.6	96.2
	3 月	末	12,807		△6.1	95.3
	4 月	末	12,927		△5.2	95.4
	5 月	末	13,320		△2.3	96.2
	6 月	末	13,746		0.8	96.9
	7 月	末	13,400		△1.8	97.2
(償還日)			(償還価額)			
2023 年	8 月	23 日	13,608.98		△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（2013年11月25日から2023年8月23日まで）

第10期の基準価額等の推移



第10期首： 13,640円
償還日： 13,608.98円
(既払分配金0円)
騰落率： △0.2%
(分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は下落しました。債券部分は、クレジット・スプレッド（米国債と社債の利回り格差）は縮小したものの、米国債利回りが大幅に上昇した環境下、国債、MBS（モーゲージ債）などを組入れたことがマイナス寄与となりました。為替部分は、米ドルが対円で上昇したことからプラス寄与となりました。為替部分はプラス寄与となったものの、債券部分や為替ヘッジコストのマイナス寄与が上回り、基準価額は下落しました。

当期は、2023年3月に為替ヘッジを行っていた間に為替市場が円高に推移し、為替ヘッジ効果はプラスに寄与したものの、2022年9月から10月にかけて為替ヘッジを行っていた間に為替市場が円安に推移し、為替ヘッジ効果はマイナスとなり、トータルで為替ヘッジ効果はマイナスとなりました。

設定来、基準価額は上昇しました。米国債利回りが大幅に上昇する一方、クレジット・スプレッドが2020年の新型コロナウイルス感染拡大時に一時的な拡大をしたものの、概ね安定的に推移した環境下、投資適格社債、ハイイールド社債、MBSなどを組入れたことがプラス寄与となりました。また、為替部分もプラス寄与となりました。

設定来の為替ヘッジ効果はマイナス寄与しました。

2013年11月末から2014年末にかけて、為替ヘッジ効果はマイナスに寄与しました。

2014年末から2015年末にかけて為替ヘッジ効果はマイナスに寄与しました。

2015年末から2016年末にかけて為替ヘッジ効果はプラスに寄与しました。

2016年末から2017年末にかけて為替ヘッジ効果はマイナスに寄与しました。

2017年末から2018年末にかけて為替ヘッジ効果はプラスに寄与しました。

2018年末から2019年末にかけて為替ヘッジ効果はプラスに寄与しました。

2019年末から2020年末にかけて為替ヘッジ効果はプラスに寄与しました。

2020年末から2021年末にかけて為替ヘッジ効果はマイナスに寄与しました。

2021年末から2022年末にかけて為替ヘッジ効果はマイナスに寄与しました。

2022年末から2023年7月末にかけて為替ヘッジ効果はプラスに寄与しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
D I A Mケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス	△1.6%
国内マネー・マザーファンド	△0.0%

(注1) D I A Mケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラスの騰落率は米ドルベースで、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（D I A Mケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス、国内マネー・マザーファンド共に2023年7月31日まで）の騰落率です。なお、2023年7月31日までの米ドルのT T M（東京の対顧客電信売買相場の仲値）の騰落率は2.7%となりました。

設定来の投資環境

設定来、米国債券市場は、10年国債利回りが上昇（価格は下落）しました。設定来以降、2016年の米大統領選や英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感などから米金利は低下（価格は上昇）傾向で推移しました。その後、堅調な米国経済を背景にFRB（米連邦準備理事会）による段階的な政策金利の引き上げが実施され、米金利は上昇（価格は下落）に転じました。

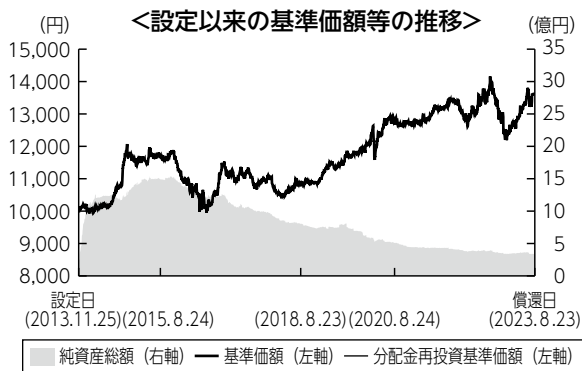
2019年に入り、米中貿易摩擦の激化、2020年の新型コロナウイルスの感染拡大を受けて景気が悪化し、FRBの大規模な金融緩和策により、米金利は急低下しました。その後、主要国での大規模な財政政策や景気回復を受け、インフレが強まったことから、FRBが金融引き締め姿勢を強め、米金利は大幅に上昇しました。足元でも、インフレが鈍化傾向となったものの、底堅い米労働市場への警戒感からFRBがタカ派姿勢を維持しており、10年国債利回りは設定来で大幅な上昇をして、償還を迎えました。

為替市場は、設定来で米ドルが対円で大幅に上昇しました。設定来、FRBが段階的に政策金利を引き上げた一方、日本銀行はアベノミクスにより大規模な金融緩和に舵を切ったことから、政策スタンスの違いが意識され、米ドルは対円で大幅に上昇しました。2016年の米大統領選や英国のEU離脱など、不透明感が高まる局面で、米ドルは対円で、一時的に下落しましたが、2016年末にはほぼ値を戻し、その後は概ね横ばいの動きで推移しました。

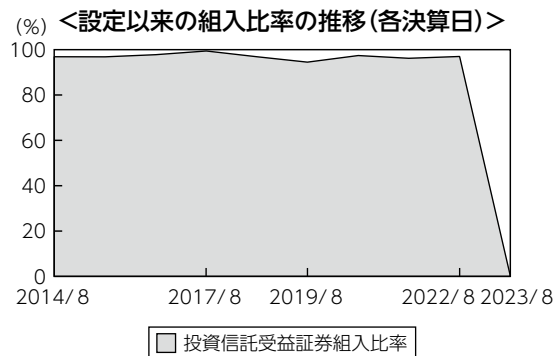
2020年の新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、米ドルは対円で下落しました。しかし、2021年後半、米景気の回復およびインフレが強まったことから、FRBが金融引き締めを実施する一方、日本銀行は量的緩和策を維持したことから、米ドルは対円で大幅に上昇しました。

2022年後半、日本の金融当局が、米ドル売り円買いの為替介入を実施したことや、日本銀行が金融政策の一部修正を実施したことから、一時的に上昇幅を縮小させる局面もありました。しかし、日本銀行の植田新総裁就任後も日米の金融政策のスタンスに大きな変化が無かったことから、米ドルは対円で再び上昇に転じ償還を迎えました。

国内短期金融市場では、日本銀行の大規模な金融緩和政策の影響で、3ヵ月物国庫短期証券利回りは2013年から0.10%以下の水準で推移しました。その後、2016年にはマイナス金利政策が導入されたことにより、同金利はマイナス金利で推移することになりました。

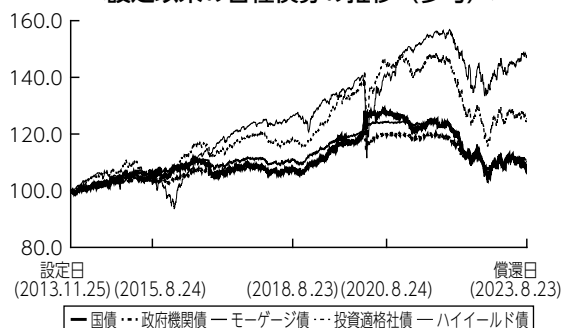


- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。



(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

<設定以来の各種債券の推移（参考）>



※設定日の値を100として指数化しています。

※上記の各種債券として使用している債券指数は以下の通りです。

国債：ブルームバーグ・米国国債インデックス

政府機関債：ブルームバーグ・米国政府機関債インデックス

モーゲージ債：ブルームバーグ・米国MBSインデックス

投資適格社債：ブルームバーグ・米国社債インデックス

ハイイールド債：ブルームバーグ・米国ハイイールド社債インデックス

※「Bloomberg®」およびブルームバーグ・米国国債インデックス、ブルームバーグ・米国政府機関債インデックス、ブルームバーグ・米国MBSインデックス、ブルームバーグ・米国社債インデックス、ブルームバーグ・米国ハイイールド社債インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはアセットマネジメントOne株式会社とは提携しておらず、また、当ファンドを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、当ファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

設定来のポートフォリオについて

●当ファンド

D I A M ケイマン・ファンドー Janus US コアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラスの組入比率は原則として高位を維持し、D I A M マネーマーケットマザーファンドへの投資も行いました。2021年12月1日にD I A M マネーマーケットマザーファンドから国内マネー・マザーファンドへの入れ替えを実施しました。

為替ヘッジ戦略については、市場の変動率が高まっていた下記期間に為替ヘッジを実施しました。

為替ヘッジ期間：2013年12月～2014年4月、2014年7月～10月、2014年12月～2015年2月、2015年6月～10月、2015年12月～2016年2月、2016年6月、2016年9月～11月、2017年4月～5月、2017年7月～2018年4月、2018年9月～2019年1月、2019年5月～6月、2019年8月～10月、2020年1月～4月、2020年9月～11月、2021年1月～3月、2021年5月、2021年7月～2022年6月、2022年9月～10月、2023年3月

※為替ヘッジ取得および為替ヘッジ解消のオペレーションは原則として東京時間午前中に実施しています。

●D I A M ケイマン・ファンドー Janus US コアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス

設定来、2016年の米大統領選や英国のE U 離脱を巡る不透明感を受けて国債比率を高め維持し、社債セクターではハイイールド債の比率を引き下げました。2017年以降は米国経済の緩やかな拡大継続を受け、概ね国債を低位、社債の比率を高位に維持しました。

2020年初めに新型コロナウイルスの感染拡大による急速な景気悪化から社債比率を引き下げましたが、2020年3月下旬以降、F R B の量的緩和による流動性の改善、割安なバリュエーションに鑑み、社債比率を引き上げました。その後社債価格が上昇し、割高感が台頭したため2021年初から社債比率を徐々に引き下げ、低位に維持しました。2021年にF R B が金融引き締め姿勢を強めた際、一時的にM B S 比率を引き下げましたが、その後、金利上昇を受け国債比率を引き下げ、証券化商品の比率を引き上げました。

●国内マネー・マザーファンド

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

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。

<設定以来の為替ヘッジ戦略>



■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第10期		項目の概要
	(2022年8月24日 ～2023年8月23日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	130円	0.990%	(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13,118円です。
（投信会社）	（ 51）	(0.385)	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）	（ 74）	(0.561)	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）	（ 6）	(0.044)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	22	0.166	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	（ 21）	(0.162)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
（監査費用）	（ 0）	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
（その他）	（ 0）	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	152	1.156	

(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。

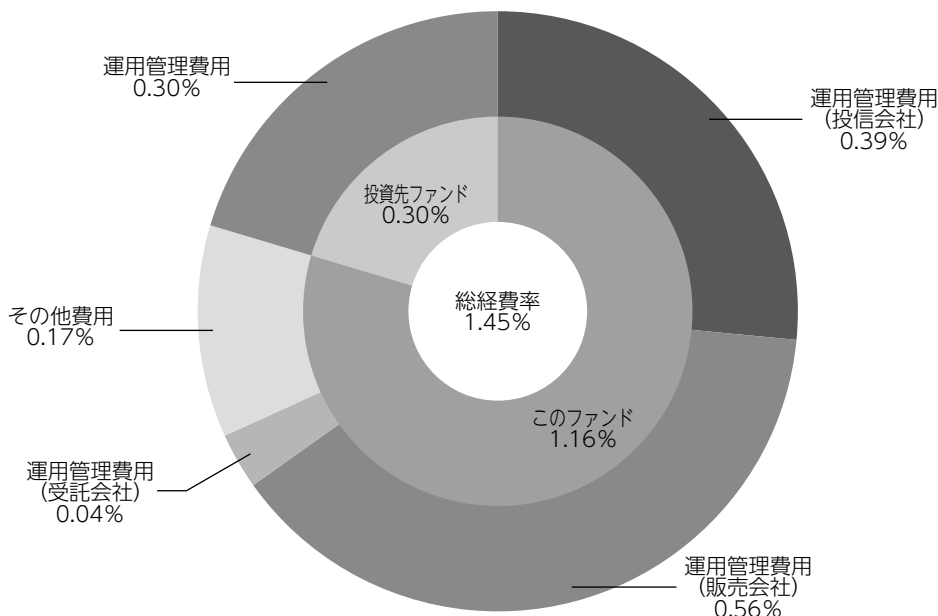
(注3) 比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.45%です。



総経費率 (①+②)	1.45%
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	0.30%

(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②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買及び取引の状況（2022年8月24日から2023年8月23日まで）
 投資信託受益証券

		買付		売付	
		□数	金額	□数	金額
外国	D I A Mケイマン・ファンドー J a n u s U Sコアプラス・ ボ ン ド ・ フ ァ ン ド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
		0.33577	39	23.12785	2,698

（注）金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年8月24日から2023年8月23日まで）

		設定		解約	
		□数	金額	□数	金額
国内マネー・マザーファンド		千□	千円	千□	千円
		－	－	2,375	2,394

■利害関係人との取引状況等（2022年8月24日から2023年8月23日まで）
【USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型における利害関係人との取引状況等】
 期中の利害関係人との取引等はありません。

【国内マネー・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	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 450	百万円 50	% 11.1	百万円 －	百万円 －	% －

平均保有割合 0.6%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当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

償還時における有価証券の組入れはありません。前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外貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	期 首（前期末）
	□ 数
DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラス	千□ 22.79208
合 計	22.79208

(2) 親投資信託残高

	期 首（前期末）
	□ 数
国 内 マ ネ ー ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 2,375

■投資信託財産の構成

2023年8月23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 335,821	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	335,821	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

(2023年8月23日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	335,821,480円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	335,821,480
(B) 負 債	3,034,735
未 払 解 約 金	1,311,125
未 払 信 託 報 酬	1,722,978
未 払 利 息	632
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	332,786,745
元 本	244,534,665
償 還 差 損 益 金	88,252,080
(D) 受 益 権 総 口 数	244,534,665口
1万口当たり償還価額(C／D)	13,608円98銭

(注) 期首における元本額は281,334,978円、当期中における追加設定元本額は8,238,943円、同解約元本額は45,039,256円です。

■損益の状況

当期 自2022年8月24日 至2023年8月23日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△17,834円
受 取 利 息	740
支 払 利 息	△18,574
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,776,005
売 買 益	24,660,048
売 買 損	△20,884,043
(C) 信 託 報 酬 等	△4,112,675
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	△354,504
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	65,407,724
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,198,860
(配 当 等 相 当 額)	(13,698,169)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,500,691)
(G) 合 計(D＋E＋F)	88,252,080
償 還 差 損 益 金(G)	88,252,080

(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	2013 年 11 月 25 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023 年 8 月 23 日		資産総額	335,821,480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	3,034,735円
				純資産総額	332,786,745円
受益権口数	197,481,436口	244,534,665口	47,053,229口	受益権口数	244,534,665口
元本額	197,481,436円	244,534,665円	47,053,229円	1万口当たり償還金	13,608円98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	1,203,811,846円	1,260,988,026円	10,475円	0円	0.00%
第2期	1,275,571,257	1,492,419,765	11,700	0	0.00
第3期	1,204,559,341	1,205,052,902	10,004	0	0.00
第4期	937,396,370	1,012,575,102	10,802	0	0.00
第5期	740,245,082	803,589,340	10,856	0	0.00
第6期	636,887,611	752,342,483	11,813	0	0.00
第7期	398,070,499	508,801,208	12,782	0	0.00
第8期	327,035,352	431,012,006	13,179	0	0.00
第9期	281,334,978	383,727,730	13,640	0	0.00

償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税引前）	13,608円98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。

《お知らせ》

その他のお知らせ

■当ファンドが主要投資対象とする「D I AMケイマン・ファンドー J a n u s U S コアプラス・ボンド・ファンド」の関係法人である管理事務代行会社が以下のとおりに変更されました。

変更前：Mizuho Bank (USA)

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

(2022年9月20日)

DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド

<米ドル建てアルファ年1回決算クラス>

当ファンドは「USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」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	ケイマン籍米ドル建て外国投資信託
主要投資対象	米ドル建て米国債券 ^(*) を主要投資対象とします。 (*) 主要投資対象となる米ドル建て米国債券の主な債券種類は、米国の国債、政府機関債、モーゲージ債、投資適格社債、ハイイールド債等です。なお、米国以外の企業が発行した米ドル建て社債等に投資する場合があります。
投資態度	①主として米ドル建て米国債券への投資を通じて、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。 ・「ブルームバーグ・米国総合インデックス」^(注)をベンチマークとし、ベンチマークを上回る成果をめざします。 ・企業ファンダメンタルズに基づくクレジット・リサーチにより、銘柄選択を行います。 ・各種債券セクターへの投資比率を機動的に変更します。 ②ポートフォリオのデュレーションは、ベンチマーク対比で125%から60%の範囲を目安とします。 ③投資する証券の平均格付^(*)は、BBB-格相当以上とします。 (*) 平均格付は時価加重平均で判定します。 ④ハイイールド債券^(*)への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の35%以内とします。 (*) ハイイールド債券とは、格付会社3社のうち1社以上によって、BB+格相当以下に格付されている債券をさします。 ⑤同一発行体の発行する債券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。ただし、米国国債、米国政府機関債、およびモーゲージ債を除きます。なお、同一の政府支援機関が発行または保証等を行う債券（モーゲージ債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の35%以内とします。 ⑥原則として、現金および現金等価物への投資は信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑦組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑧デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定しません。米国債先物をファンド全体のデュレーション・コントロールに活用する場合等があります。 ⑨ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・US・エルエルシーに運用の指図にかかる権限を委託します。 (注) 「Bloomberg[®]」およびブルームバーグ・米国総合インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited (以下「BISI」)をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはアセットマネジメントOne株式会社とは提携しておらず、また、DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラスを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 米ドル建てアルファ年1回決算クラスに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。
主な投資制限	①原則として、株式への投資は行いません。（ただし、コーポレートアクション等により取得した場合、可能な限り速やかに売却することとします。） ②転換社債への投資は可としますが、原則として株式への転換は不可とします。 ③有価証券の空売りは行いません。 ④流動性に欠ける資産への投資は、信託財産の純資産総額の15%を超えないものとします。 ⑤信託財産の純資産総額の10%を超える借入は行いません。 ⑥投資信託証券（上場投資信託証券を含みます。）への投資は行いません。 ⑦金融商品取引法上の有価証券および有価証券関連デリバティブ取引への投資比率は信託財産総額の50%以上とします。
投資顧問会社	アセットマネジメントOne株式会社
副投資顧問会社	ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・US・エルエルシー
受託会社	ファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド
管理事務代行会社	ルクセンブルグみずほ信託銀行
保管銀行	米国みずほ銀行

D I A Mケイマン・ファンドー J a n u s U S コアプラス・ボンド・ファンドはケイマン籍外国投資信託で、2022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。以下は、2022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（J a n u s U S コアプラス・ボンド・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
2022年12月31日期（2022年12月31日終了）

	日本円
投資損益の部	
債券利息	2,323,482,905
投資ディスカウント増加およびプレミアム償却	(149,620,713)
投資有価証券払戻による損失	(103,336,568)
その他収益	1,214,401
収益合計	2,071,740,025
費用の部	
投資運用報酬	238,309,517
管理事務報酬	73,399,691
保管報酬	21,537,358
受託報酬	11,582,902
専門報酬	5,985,142
その他費用	492,369
費用合計	351,306,979
純投資収益	1,720,433,046
投資有価証券売却による実現純利益	7,480,839,802
為替先渡契約による実現純損失	(8,811,055,038)
外貨取引による実現純損失	(74,351,468)
期中実現純損失	(1,404,566,704)
投資有価証券による未実現損益の純変動	(5,712,972,735)
為替先渡契約による未実現純損益の変動	344,990,597
外貨取引による未実現純損益の変動	(28,952,417)
期中未実現減少分の純変動額	(5,396,934,555)
運用による純資産の純減額	(5,081,068,213)

	発行済受益権口数	一口当たり純資産価額 (日本円)
クラス AUNHDUSD	21,032.87	15,101
クラス MJPHDJPY	159,151.73	6,652
クラス MUNHDJPY	920,821.79	6,775
クラス MUNHDUSD	106,174.08	9,286
クラス NJPHDJPY	100,000.00	9,326
クラス NUNHDJPY	1,012,898.60	12,181
クラス SUNHDJPY	879,235.12	12,326
クラス YJPHDJPY	16,452.59	9,725
クラス YUNHDJPY	67,855.22	14,580

(注) D I A Mケイマン・ファンドー J a n u s U S コアプラス・ボンド・ファンドは複数のクラスで構成されています。
上記のクラスMJPHDJPYは、「U S 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）」が投資する日本円建て日本円ヘッジあり・毎月決算クラス、
クラスMUNHDJPYは、「U S 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）」が投資する日本円建て為替ヘッジなし・毎月決算クラス、
クラスAUNHDUSDは、「U S ストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型」が投資する米ドル建て為替ヘッジなし・年1回決算クラス、
クラスMUNHDUSDは、「U S ストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型」が投資する米ドル建て為替ヘッジなし・毎月決算クラス、
クラスYJPHDJPYは、「U S ストラテジック・インカム・ファンド（年1回決算型）為替ヘッジあり」が投資する日本円建て日本円ヘッジあり・年1回決算クラス、
クラスYUNHDJPYは、「U S ストラテジック・インカム・ファンド（年1回決算型）為替ヘッジなし」が投資する日本円建て為替ヘッジなし・年1回決算クラスです。

投資有価証券明細表（要約版）
2022年12月31日現在

投資タイプ・ 国・業種	銘柄	通貨	口数	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産 %
FRN（変動利付債）						
オーストラリア 銀行	WESTPAC BANKING CORP BDS FTV 20-15/11/35	USD	808,000	85,177,685	79,590,361	0.24%
カナダ 銀行	BANK OF MONTREAL BDS FTV 22-10/1/37	USD	1,567,000	181,442,930	157,354,512	0.46%
フランス 銀行	BNP PARIBAS SA BDS FTF 22-20/1/28	USD	618,000	70,977,300	71,943,507	0.21%
	BNP PARIBAS SA BDS FTF 22-20/1/33	USD	519,000	59,622,274	54,425,832	0.16%
日本 銀行	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC BDS FTV 22-18/7/25	USD	394,000	54,153,330	51,520,828	0.15%
スイス 銀行	CREDIT SUISSE GROUP AG BDS FTF 22-15/11/33	USD	706,000	103,277,209	95,918,887	0.28%
米国 銀行	BANK OF AMERICA CORP BDS FTF 17-24/4/28	USD	1,102,000	123,014,945	134,970,147	0.40%
	BANK OF AMERICA CORP BDS FTF 22-10/11/28	USD	219,000	32,108,304	29,845,146	0.09%
	BANK OF AMERICA CORP BDS FTF 22-27/4/28	USD	1,548,000	198,925,740	195,927,244	0.58%
	JPMORGAN CHASE & CO BDS FTF 20-13/5/31	USD	1,445,000	154,121,458	157,973,915	0.47%
	JPMORGAN CHASE & CO BDS FTF 22-14/9/33	USD	296,000	42,770,520	38,522,978	0.11%
	MORGAN STANLEY BDS FTF 21-4/5/27	USD	693,000	74,864,790	80,413,375	0.24%
	MORGAN STANLEY BDS FTF 22-21/1/33	USD	1,187,000	135,874,649	127,549,370	0.38%
	US BANCORP BDS FTF 22-22/7/33	USD	698,000	96,229,770	87,950,132	0.26%
電力	CMS ENERGY CORP BDS FTV 20-1/6/50	USD	773,000	83,661,526	88,475,195	0.26%
情報技術サービス	AMERICAN EXPRESS CO BDS FTF 22-26/5/33	USD	515,000	66,165,872	65,737,218	0.19%
FRN（変動率期債） 合計			13,088,000	1,562,388,302	1,518,118,647	4.48%
モーゲージ						
ケイマン諸島 総合型金融サービス	ARES LX CLO LTD 60A A CLO MTGE FRN 21-18/7/34	USD	250,000	32,317,594	31,834,139	0.09%
	BAYVIEW MSR OPPORTUNITY MASTE 2 A1 MTGE FRN 22-25/12/51	USD	3,097,106	354,396,157	343,108,624	1.01%
	CBAM 2019-11R LTD 11RA B CLO MTGE FRN 21-20/1/35	USD	727,919	82,717,076	92,836,880	0.27%
	CIFC FUND. 2021-VII LTD 7A A1 CLO MTGE FRN 21-23/1/35	USD	2,059,000	235,209,865	262,069,692	0.77%
	ELMWOOD CLO II LTD 2A AR CLO MTGE FRN 21-20/4/34	USD	321,000	41,614,958	41,379,053	0.12%
	OCTAGON INV. PART. 48 LTD 3A BR CLO MTGE FRN 21-20/10/34	USD	431,000	49,080,125	54,852,370	0.16%
	SOUND POINT CLO XXII LTD 1A AR CLO MTGE FRN 21-20/1/32	USD	925,000	120,089,073	119,886,902	0.35%
米国 総合型金融サービス	ACC AUTO TRUST 2021-A A A MTGE 1.08% 21-15/4/27	USD	242,939	26,859,895	31,644,631	0.09%
	ACC AUTO TRUST 2022-A A A MTGE 4.58% 22-15/7/26	USD	582,871	75,749,855	75,601,964	0.22%
	ACM AUTO TRUST 2022-1 1A A MTGE 3.23% 22-20/4/29	USD	245,606	31,561,409	32,324,632	0.10%

投資タイプ・
国・業種

モーゲージ
米国

総合型金融サービス

銘柄	通貨	口数	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産 %
AFFIRM ASSET SECURITIZATION B A MTGE 1.03% 21-17/8/26	USD	1,248,000	137,032,261	156,226,560	0.46%
AFFIRM ASSET SECURITIZATION Z2 A MTGE 1.9% 20-15/1/25	USD	136,975	14,345,877	17,586,234	0.05%
ANGEL OAK MTGE TRUST 2019-5 5 A1 MTGE FRN 19-25/10/49	USD	164,397	17,449,794	20,678,509	0.06%
ANGEL OAK MTGE TRUST 2019-6 6 A1 MTGE FRN 19-25/11/59	USD	142,053	14,969,505	17,906,461	0.05%
ANGEL OAK MTGE TRUST 2020-2 2 A1A MTGE FRN 20-26/1/65	USD	398,132	42,830,889	47,777,857	0.14%
ANGEL OAK MTGE TRUST 2020-3 3 A2 MTGE FRN 20-25/4/65	USD	343,084	36,508,793	40,760,404	0.12%
AQUA FIN. TRUST 2021-A A A MTGE 1.54% 21-17/7/46	USD	564,079	63,118,115	68,121,660	0.20%
ARIVO ACCEPTANCE AUTO LOAN 1A A MTGE 3.93% 22-15/5/28	USD	509,329	63,019,218	65,278,001	0.19%
ATALAYA EQUIPMENT LEAS. TRU 1A A2 MTGE 1.23% 21-15/5/26	USD	693,480	79,450,704	88,891,586	0.26%
BAYVIEW MSR OPPORTUNITY MASTE 1 A1 MTGE FRN 21-25/12/51	USD	1,586,972	186,302,982	176,384,036	0.52%
BAYVIEW MSR OPPORTUNITY MASTE 4 A11 MTGE FRN 21-25/10/51	USD	1,603,596	177,525,792	192,018,999	0.57%
BBCMS 2017-DELC MTGE TRUST DELC A MTGE FRN 17-15/8/36	USD	825,000	82,911,284	107,021,774	0.32%
BPR TRUST 2022-OANA OANA A MTGE FRN 22-15/4/24	USD	1,463,000	180,862,128	188,837,494	0.56%
BX COMM. MTGE TRUST 2019-XL XL A MTGE FRN 19-15/10/36	USD	2,427,326	273,510,805	316,542,693	0.93%
BX COMM. MTGE TRUST 2019-XL XL B MTGE FRN 19-15/10/36	USD	684,250	80,607,343	88,770,126	0.26%
BX COMM. MTGE TRUST 2020-VKNG VKNG A MTGE FRN 20-15/10/37	USD	130,598	16,092,699	16,835,259	0.05%
BX COMM. MTGE TRUST 2021-VINO VINO A MTGE FRN 21-15/5/38	USD	186,000	22,754,661	23,659,467	0.07%
BX COMM. MTGE TRUST 2021-VINO VINO G MTGE FRN 21-15/5/38	USD	1,500,000	163,033,553	183,036,220	0.54%
BX TRUST 2022-FOX2 FOX2 A2 MTGE FRN 22-15/4/24	USD	460,000	57,333,020	56,048,023	0.17%
CF HIPPOLYTA ISSUER LLC 1A A1 MTGE 5.97% 22-15/8/62	USD	954,182	126,060,627	123,469,073	0.36%
CF HIPPOLYTA ISSUER LLC 1A A2 MTGE 6.11% 22-15/8/62	USD	2,320,823	306,584,637	289,212,542	0.85%
CF HIPPOLYTA LLC 1A B1 MTGE 1.98% 21-15/3/61	USD	702,370	76,292,081	77,558,300	0.23%
COLT 2020-2 MTGE LOAN TRUST 2 A1 MTGE FRN 20-25/3/65	USD	32,817	3,564,259	4,242,881	0.01%
COLT 2020-3 MTGE LOAN TRUST 3 A1 MTGE FRN 20-27/4/65	USD	119,126	12,549,360	14,759,739	0.04%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R02 1M2 MTGE FRN 19-25/8/31	USD	29,750	3,218,585	3,920,915	0.01%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R03 1M2 MTGE FRN 19-25/9/31	USD	99,041	10,599,031	13,037,846	0.04%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R03 1M2 MTGE FRN 21-25/12/41	USD	1,014,000	115,307,010	126,385,116	0.37%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R04 1M1 MTGE FRN 22-25/3/42	USD	885,287	108,646,797	116,452,041	0.34%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R06 1M1 MTGE FRN 22-25/5/42	USD	591,267	77,654,106	79,029,204	0.23%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R07 1M2 MTGE FRN 18-25/4/31	USD	67,260	7,087,374	8,854,345	0.03%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R07 1M2 MTGE FRN 19-25/10/39	USD	42,547	4,258,400	5,600,912	0.02%
CONNECTICUT AVENUE SEC. TRUST R08 1M1 MTGE FRN 22-25/7/42	USD	259,919	34,265,164	34,427,022	0.10%
CONN'S RECEIVABLES FUND. 20 A A MTGE 1.05% 21-15/5/26	USD	1,004	115,010	132,140	0.00%
CP EF ASSET SECURITIZATION 1A A MTGE 5.96% 22-15/4/30	USD	406,349	55,200,411	52,771,756	0.16%
CSMC 2021-WEHO WEHO A MTGE FRN 21-15/4/23	USD	1,335,304	144,326,378	168,889,860	0.50%
EXETER AUTO. RECEIVABLES TRU 1A E MTGE 5.2% 19-15/1/26	USD	850,000	94,832,422	111,212,687	0.33%
FANNIE MAE CONNECTICUT AVENUE C02 1M2 MTGE FRN 15-25/5/25	USD	176,182	19,294,917	23,380,781	0.07%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 2.5% 19-1/11/34	USD	408,696	44,772,256	49,764,470	0.15%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 2.5% 19-1/12/33	USD	379,859	40,760,745	46,974,089	0.14%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 2.5% 20-1/10/50	USD	6,769,979	748,828,592	772,483,711	2.28%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 18-1/1/33	USD	245,426	26,906,422	30,880,882	0.09%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 18-1/10/32	USD	563,504	61,530,444	70,788,918	0.21%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 18-1/10/46	USD	2,417,671	268,924,705	287,612,913	0.85%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 18-1/5/31	USD	1,003,941	110,731,241	127,303,800	0.38%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 18-1/6/43	USD	134,137	14,508,581	15,936,120	0.05%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 18-1/8/45	USD	301,251	33,559,506	35,744,211	0.11%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 18-1/9/32	USD	416,273	45,385,089	52,372,053	0.15%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 19-1/12/49	USD	316,422	35,010,016	37,057,697	0.11%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 19-1/4/47	USD	1,052,742	121,324,446	123,913,415	0.37%

投資タイプ・
国・業種

モーゲージ

米国

総合型金融サービス

銘柄	通貨	口数	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産 %
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3% 19-1/8/49	USD	110,551	12,008,897	12,946,282	0.04%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3.5% 18-1/12/47	USD	4,495,015	515,976,873	552,473,840	1.63%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3.5% 18-1/4/47	USD	2,519,530	292,998,039	309,348,134	0.91%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3.5% 18-1/7/42	USD	259,711	28,356,750	32,097,478	0.09%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 3.5% 18-1/8/42	USD	556,663	60,769,480	68,812,300	0.20%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 4.5% 18-1/3/48	USD	259,726	29,756,153	33,547,930	0.10%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 4.5% 18-1/5/44	USD	192,774	25,453,131	25,035,176	0.07%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 4.5% 22-1/3/52	USD	11,969	1,686,845	1,523,731	0.00%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 4.5% 22-1/8/52	USD	1,753,776	235,921,536	223,794,672	0.66%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 4.5% 22-1/9/50	USD	825,300	115,235,176	106,596,404	0.31%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 5% 18-1/9/48	USD	17,635	2,090,657	2,319,934	0.01%
FEDERAL HOME LOAN BANK MTGE 6% 18-1/4/40	USD	236,313	24,521,689	32,662,083	0.10%
FLAGSTAR MTGE TRUST 2021-13IN 13IN A2 MTGE FRN 21-30/12/51	USD	3,701,997	432,247,537	410,120,578	1.21%
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST DNA6 M1A MTGE FRN 22-25/9/42	USD	149,579	21,296,340	19,755,921	0.06%
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST DNA6 M2 MTGE FRN 20-25/12/50	USD	1,342,128	139,688,640	175,961,955	0.52%
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST HQA1 M1A MTGE FRN 22-25/3/42	USD	966,409	114,215,007	125,942,315	0.37%
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST HQA4 M2 MTGE FRN 20-25/9/50	USD	7,135	746,032	941,919	0.00%
FREDDIE MAC STACR TRUST 2019- DNA4 M2 MTGE FRN 19-25/10/49	USD	31,563	3,264,430	4,165,307	0.01%
FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY DNA2 M2 MTGE FRN 21-25/8/33	USD	743,000	79,296,675	96,990,894	0.29%
FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY HQA5 M2 MTGE FRN 20-25/11/50	USD	1,500,337	156,927,791	197,658,146	0.58%
GCAT 2022-INV1 TRUST INV1 A1 MTGE FRN 22-25/12/51	USD	3,910,832	457,593,862	433,256,036	1.28%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATI MTGE 4.5% 18-20/3/48	USD	468,663	52,050,198	59,424,154	0.18%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATI MTGE 4.5% 18-20/6/48	USD	459,124	52,852,439	58,230,094	0.17%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATI MTGE 4.5% 18-20/8/48	USD	499,586	57,765,012	64,104,850	0.19%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 17-15/11/47	USD	55,592	6,657,192	7,180,633	0.02%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 17-15/12/47	USD	157,917	18,627,505	20,071,160	0.06%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 17-20/8/47	USD	199,814	23,200,499	25,141,996	0.07%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 18-20/4/48	USD	1,335,200	150,693,870	168,247,856	0.50%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 18-20/5/48	USD	1,181,455	133,433,762	149,628,031	0.44%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 18-20/6/48	USD	527,831	59,923,015	66,542,286	0.20%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 18-20/7/48	USD	2,693,648	306,468,385	339,175,331	1.00%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 19-20/4/49	USD	1,278,054	145,104,979	161,553,017	0.48%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 5% 18-20/8/48	USD	490,980	57,215,598	64,704,787	0.19%
JP MORGAN CHASE COMM. MTG ACE A MTGE 3.2865% 20-10/1/37	USD	454,000	56,923,960	55,620,281	0.16%
JP MORGAN CHASE COMM. MTG ACE B MTGE 3.6401% 20-10/1/37	USD	620,000	82,381,664	74,292,477	0.22%
JP MORGAN MTGE TRUST 2015-4 4 AM MTGE FRN 15-25/6/45	USD	344,176	37,249,949	38,976,209	0.12%
JPMORGAN CHASE BK NA - CACL 2 B MTGE .889% 21-26/12/28	USD	732,743	80,832,587	92,425,612	0.27%
LAD AUTO RECEIVABLES TRUST 1A A MTGE 5.21% 22-15/6/27	USD	739,546	99,790,196	96,057,706	0.28%
LAD AUTO RECEIVABLES TRUST 2 1A A MTGE 1.3% 21-17/8/26	USD	570,007	64,898,113	73,106,430	0.22%
LENDBUZZ SECURITIZATION TRU 1A A MTGE 4.22% 22-17/5/27	USD	1,300,608	162,787,537	164,324,672	0.49%
LIFE 2021-BMR MTGE TRUST BMR C MTGE FRN 21-15/3/38	USD	1,731,010	188,636,862	217,509,562	0.64%
MED TRUST 2021-MDLN MDLN F MTGE 5.21% 21-15/11/38	USD	1,372,000	156,442,300	167,349,823	0.49%
MELLO MTGE CAP. ACCEPTANCE 20 INV1 A2 MTGE FRN 22-25/3/52	USD	2,690,060	307,622,087	298,014,594	0.88%
MELLO MTGE CAP. ACCEPTANCE 20 INV3 A11 MTGE FRN 21-25/10/51	USD	1,459,194	161,513,931	176,812,597	0.52%
MELLO MTGE CAP. ACCEPTANCE 20 INV4 A3 MTGE FRN 21-25/12/51	USD	611,238	69,535,219	65,242,303	0.19%
MERCURY FIN. CRED. CARD MAS 1A A MTGE 1.54% 21-20/3/26	USD	1,651,000	179,325,277	207,672,933	0.61%
NEW RESID. MTGE LOAN TRUST 20 2A A1 MTGE FRN 18-25/2/58	USD	331,488	36,754,655	42,181,556	0.12%
NRZ EXCESS SPREAD-COLLATER FHT1 A MTGE 3.104% 21-25/7/26	USD	1,074,471	118,119,163	124,044,453	0.37%
NRZ EXCESS SPREAD-COLLATER PLS1 A MTGE 3.844% 20-25/12/25	USD	359,920	37,460,357	43,358,421	0.13%

投資タイプ・ 国・業種	銘柄	通貨	口数	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産 %
モーゲージ						
米国						
総合型金融サービス						
	OBX 2022-INV1 TRUST INV1 A18 MTGE FRN 22-25/12/51	USD	1,322,790	149,914,694	139,806,507	0.41%
	PAGAYA AI DEBT SELECTION TR 1 A MTGE 1.18% 21-15/11/27	USD	499,659	72,498,688	64,947,139	0.19%
	PAGAYA AI DEBT TRUST 2022-1 1 A MTGE 2.03% 22-15/10/29	USD	778,069	89,329,312	98,606,541	0.29%
	PRPM 2021-10 LLC 10 A1 MTGE 2.487% 21-25/10/26	USD	1,549,002	176,702,245	190,163,010	0.56%
	PRPM 2021-RPL2 LLC RPL2 A1 MTGE FRN 21-25/10/51	USD	1,791,830	199,830,947	211,828,331	0.63%
	SANTANDER BK AUTO CREDIT-L A B MTGE 5.281% 22-15/5/32	USD	584,811	74,004,968	75,362,144	0.22%
	SANTANDER BK NA - SBCLN 1A B MTGE 1.833% 21-15/12/31	USD	342,293	38,875,951	43,452,838	0.13%
	SEQUOIA MTGE TRUST 2013-5 5 A1 MTGE FRN 13-25/5/43	USD	168,465	18,497,002	18,727,618	0.06%
	SMRT 2022-MINI MINI A MTGE FRN 22-15/1/24	USD	321,000	41,788,034	40,940,493	0.12%
	SPRUCE HILL MTGE LOAN TRUST 2 SH1 A1 MTGE FRN 20-28/1/50	USD	16,109	1,702,034	2,101,935	0.01%
	SPRUCE HILL MTGE LOAN TRUST 2 SH1 A2 MTGE FRN 20-28/1/50	USD	71,723	7,578,132	9,355,858	0.03%
	SREIT TRUST 2021-MFP MFP A MTGE FRN 21-15/11/38	USD	213,000	26,918,313	27,072,281	0.08%
	TESLA AUTO LEASE TRUST 2021- B B MTGE .91% 21-22/9/25	USD	448,000	49,127,394	55,183,310	0.16%
	TESLA AUTO LEASE TRUST 2021-B B A3 MTGE .6% 21-22/9/25	USD	873,000	95,718,768	108,581,159	0.32%
	THEOREM FUND. TRUST 2021-1 1A A MTGE 1.21% 21-15/12/27	USD	544,750	69,412,436	70,730,287	0.21%
	TPI RE-REMIC TRUST 2022-FRR1 FRR1 AK33 MTGE 0% 22-25/7/46	USD	811,000	89,701,235	102,857,166	0.30%
	TPI RE-REMIC TRUST 2022-FRR1 FRR1 AK34 MTGE 0% 22-25/7/46	USD	668,000	73,884,617	84,720,822	0.25%
	TPI RE-REMIC TRUST 2022-FRR1 FRR1 AK35 MTGE 0% 22-25/8/46	USD	905,000	99,775,219	114,086,486	0.34%
	TRICOLOR AUTO SECURITIZATION 1A A MTGE 3.3% 22-18/2/25	USD	168,094	21,777,529	21,942,060	0.06%
	UNIFY AUTO RECEIVABLES TRUST 1A A4 MTGE .98% 21-15/7/26	USD	1,022,000	111,372,450	129,337,423	0.38%
	UPSTART SECURITIZATION TRUS 1 A MTGE 3.12% 22-20/3/32	USD	1,477,865	179,849,481	187,970,891	0.56%
	UPSTART SECURITIZATION TRUS 2 A MTGE 4.37% 22-20/5/32	USD	1,031,354	130,777,293	133,085,223	0.39%
	UPSTART SECURITIZATION TRUS 5 A MTGE 1.31% 21-20/11/31	USD	368,763	42,157,459	46,590,711	0.14%
	UPSTART SECURITIZATION TRUST 4 A MTGE .84% 21-20/9/31	USD	565,030	62,129,429	72,185,639	0.21%
	VASA TRUST 2021-VASA VASA A MTGE FRN 21-15/7/39	USD	971,000	107,392,600	118,444,474	0.35%
	VCAT 2021-NPL1 LLC NPL1 A1 MTGE 2.2891% 21-26/12/50	USD	260,207	27,044,592	32,568,206	0.10%
	VMC FIN. 2021-HT1 LLC HT1 A MTGE FRN 21-18/1/37	USD	998,727	113,490,293	127,642,346	0.38%
	WESTGATE RESORTS 2022-1 LL 1A A MTGE 1.788% 22-20/8/36	USD	523,819	59,102,417	65,187,754	0.19%
パーソナル用品						
	GREAT WOLF TRUST 2019-WOLF WOLF A MTGE FRN 19-15/12/36	USD	526,000	57,069,490	67,477,148	0.20%
	GREAT WOLF TRUST 2019-WOLF WOLF B MTGE FRN 19-15/12/36	USD	589,000	63,904,337	75,021,873	0.22%
	GREAT WOLF TRUST 2019-WOLF WOLF C MTGE FRN 19-15/12/36	USD	657,000	71,432,915	82,915,685	0.24%
貯蓄・抵当金融						
	CHASE MTGE FIN. CORP CL1 M1 MTGE FRN 21-25/2/50	USD	833,386	91,784,953	94,603,535	0.28%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 2.5% 19-1/11/34	USD	402,475	43,848,723	49,013,748	0.14%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 12-1/1/43	USD	35,387	3,920,381	4,259,763	0.01%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 13-1/2/43	USD	337,685	37,355,730	40,580,669	0.12%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 13-1/5/43	USD	161,994	16,711,428	19,148,334	0.06%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 17-1/2/57	USD	5,208,661	550,653,383	606,799,420	1.79%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 18-1/2/47	USD	5,584,555	624,338,408	672,320,215	1.99%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 18-1/5/58	USD	102,868	11,146,207	11,984,898	0.04%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 18-1/6/57	USD	91,896	9,957,317	10,706,556	0.03%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 18-1/9/57	USD	17,034	1,851,896	1,984,552	0.01%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 19-1/1/47	USD	2,128,539	236,015,638	256,252,711	0.76%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 19-1/8/49	USD	438,156	47,738,938	51,322,272	0.15%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 19-1/9/46	USD	345,124	38,340,500	41,549,296	0.12%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3% 22-1/12/51	USD	826,646	102,346,362	96,571,270	0.29%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3.5% 15-1/3/45	USD	417,603	44,692,490	51,054,400	0.15%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3.5% 16-1/7/46	USD	781,330	87,338,434	95,990,813	0.28%

投資タイプ・ 国・業種	銘柄	通貨	口数	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産 %
モーゲージ						
米国						
貯蓄・抵当金融						
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3.5% 17-1/1/47	USD	341,347	36,226,911	41,884,917	0.12%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3.5% 17-1/12/47	USD	621,908	67,366,126	76,225,756	0.23%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 3.5% 22-1/6/52	USD	2,474,246	322,330,569	300,402,479	0.89%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 15-1/7/45	USD	566,656	64,753,820	71,420,583	0.21%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 19-1/1/49	USD	660,642	75,062,134	83,301,271	0.25%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 19-1/2/49	USD	224,007	25,295,997	28,245,342	0.08%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 20-1/9/50	USD	838,554	113,279,898	104,907,185	0.31%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4% 21-1/3/51	USD	2,225,664	301,158,973	279,144,594	0.82%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 14-1/10/44	USD	249,277	33,210,120	32,535,444	0.10%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 15-1/3/45	USD	381,541	50,901,950	49,798,423	0.15%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 15-1/8/42	USD	952,931	117,049,375	123,646,901	0.37%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 18-1/3/48	USD	295,082	33,785,499	38,245,285	0.11%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 18-1/8/48	USD	167,025	19,085,524	21,561,368	0.06%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 22-1/4/52	USD	200,958	28,320,764	25,668,615	0.08%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 22-1/5/52	USD	76,971	10,847,425	9,843,752	0.03%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 22-1/7/52	USD	322,635	44,590,293	41,082,776	0.12%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 4.5% 22-1/8/52	USD	1,238,210	171,737,562	157,728,729	0.47%
	FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION MTGE 5% 18-1/5/48	USD	1,950,645	226,938,106	257,749,706	0.76%
モーゲージ合計			149,396,102	17,278,314,001	18,315,463,484	54.10%
普通債券						
オーストラリア						
銀行						
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA BDS 3.784% 22-14/3/32	USD	1,130,000	130,667,550	123,700,321	0.37%
カナダ						
化学						
	NUTRIEN LTD BDS 5% 19-1/4/49	USD	301,000	32,981,006	36,118,847	0.11%
イギリス						
バイオテクノロジー						
	CSL FIN. PLC BDS 3.85% 22-27/4/27	USD	262,000	33,425,205	33,172,597	0.10%
米国						
銀行						
	CITIGROUP INC BDS 4.45% 15-29/9/27	USD	651,000	73,623,280	82,226,183	0.24%
	GOLDMAN SACHS GROUP INC BDS 4.25% 15-21/10/25	USD	435,000	48,653,438	56,154,056	0.17%
バイオテクノロジー						
	ILLUMINA INC BDS 5.75% 22-13/12/27	USD	629,000	86,887,226	83,997,549	0.25%
建設・土木						
	COSTAR GROUP INC BDS 2.8% 20-15/7/30	USD	781,000	87,743,980	84,641,904	0.25%
	GXO LOGISTICS INC BDS 1.65% 22-15/7/26	USD	987,000	108,641,962	111,798,572	0.33%
総合型金融サービス						
	ARES CAPITAL CORP BDS 2.875% 22-15/6/27	USD	951,000	109,597,882	106,686,496	0.32%
	ARES CAPITAL CORP BDS 3.2% 21-15/11/31	USD	1,120,000	126,263,724	109,139,487	0.32%
	OWL ROCK CORE INCOME CORP BDS 4.7% 22-8/2/27	USD	107,000	13,736,986	12,766,872	0.04%
	OWL ROCK CORE INCOME CORP BDS 7.75% 22-16/9/27	USD	387,000	55,474,708	51,053,667	0.15%
	SUN COMMUNITIES OPERATING LP BDS 2.7% 21-15/7/31	USD	1,425,000	156,775,682	149,360,725	0.44%
電力						
	DUKE ENERGY CORP BDS 4.3% 22-15/3/28	USD	417,000	56,095,236	53,144,441	0.16%
	SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO BDS 5.85% 22-1/11/27	USD	534,000	79,087,562	72,778,670	0.21%

投資タイプ・ 国・業種	銘柄	通貨	口数	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産 %
普通債券						
米国						
食品						
	JBS USA LUX SA / JBS USA FOOD CO / JBS BDS 3.625% 22-15/1/32	USD	539,000	58,409,214	57,708,634	0.17%
	JBS USA LUX SA / JBS USA FOOD CO / JBS U BDS 5.5% 19-15/1/30	USD	792,000	88,707,966	99,679,312	0.29%
	PILGRIM'S PRIDE CORP BDS 3.5% 21-1/3/32	USD	1,287,000	141,216,075	133,124,221	0.39%
ソブリン						
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 1.125% 21-31/8/28	USD	21,006,000	2,348,620,357	2,372,022,941	7.01%
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 2.375% 22-15/2/42	USD	388,800	44,192,382	39,474,113	0.12%
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 3% 22-15/8/52	USD	13,954,000	1,594,024,697	1,531,615,407	4.52%
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 3.875% 22-30/11/27	USD	10,915,000	1,494,724,263	1,434,835,246	4.24%
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 3.875% 22-30/11/29	USD	4,748,000	657,578,662	623,831,915	1.84%
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 4% 22-15/11/42	USD	19,634,000	2,726,720,004	2,553,772,906	7.54%
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 4.125% 22-15/11/32	USD	7,710,800	1,099,799,188	1,042,200,662	3.08%
	UNITED STATES OF AMERICA BDS 4.5% 22-15/11/25	USD	3,206,000	440,810,032	425,956,938	1.26%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス						
	CENTENE CORP BDS 2.45% 21-15/7/28	USD	589,000	65,290,650	65,680,747	0.19%
	CENTENE CORP BDS 3% 20-15/10/30	USD	893,000	100,460,203	96,854,197	0.29%
	CENTENE CORP BDS 4.25% 20-15/12/27	USD	901,000	113,724,918	111,866,002	0.33%
	GE HEALTHCARE HOLDING LLC BDS 5.65% 22-15/11/27	USD	498,000	72,557,802	66,718,820	0.20%
	GE HEALTHCARE HOLDING LLC BDS 5.857% 22-15/3/30	USD	594,000	86,891,552	80,583,680	0.24%
	GE HEALTHCARE HOLDING LLC BDS 5.905% 22-22/11/32	USD	856,000	125,219,959	117,767,927	0.35%
	UNITEDHEALTH GROUP INC BDS 5.25% 22-15/2/28	USD	394,000	58,213,430	53,324,868	0.16%
保険						
	ATHENE GLOBAL FUNDING BDS 2.717% 22-7/1/29	USD	1,121,000	130,170,520	122,669,033	0.36%
	BROWN & BROWN INC BDS 4.2% 22-17/3/32	USD	315,000	37,047,940	36,265,729	0.11%
レジャー用品						
	HASBRO INC BDS 3.9% 19-19/11/29	USD	1,704,000	189,513,161	200,832,210	0.59%
	HASBRO INC BDS 5.1% 14-15/5/44	USD	697,000	81,351,981	79,192,192	0.23%
	HASBRO INC BDS 6.35% 10-15/3/40	USD	364,000	49,759,128	47,459,484	0.14%
メディア						
	VERISK ANALYTICS INC BDS 4% 15-15/6/25	USD	293,000	33,236,194	37,642,028	0.11%
石油・ガス・消耗燃料						
	ENERGY TRANSFER LP BDS 5.55% 22-15/2/28	USD	374,000	50,993,804	48,926,003	0.14%
	ENERGY TRANSFER LP BDS 5.75% 22-15/2/33	USD	374,000	51,001,485	48,374,546	0.14%
	EQT CORP BDS 3.125% 21-15/5/26	USD	1,170,000	129,744,186	142,065,042	0.42%
	EQT CORP BDS 5.7% 22-1/4/28	USD	308,000	44,202,155	40,472,888	0.12%
不動産投資法人						
	AGREE LP BDS 2.9% 20-1/10/30	USD	1,153,000	125,294,318	124,258,364	0.37%
	GLP CAPITAL LP / GLP FIN. II INC BDS 5.3% 18-15/1/29	USD	87,000	10,481,624	10,881,894	0.03%
貯蓄・抵当金融						
	ROCKET MORTGAGE LLC / ROCKET MORTGAGE CO-BDS 4% 21-15/10/33	USD	1,124,000	124,741,590	110,978,255	0.33%
普通債券合計			108,106,600	13,574,354,867	13,123,776,591	38.76%
投資有価証券公正価値合計			270,590,702	32,415,057,170	32,957,358,722	97.34%

国内マネー・マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2023年1月16日）

（計算期間 2022年1月18日～2023年1月16日）

国内マネー・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	原則、無期限です。
運 用 方 針	主として本邦通貨建ての短期公社債に投資することにより、安定した収益の確保を目指した運用を行います。
主 要 投 資 対 象	本邦通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。

■最近3期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		期 騰	中 落 率			
13期(2021年1月15日)	円		%	%	%	百万円
	10,093		0.0	81.3	—	312
14期(2022年1月17日)	10,091		△0.0	11.7	—	385
15期(2023年1月16日)	10,083		△0.1	64.6	—	387

（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、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

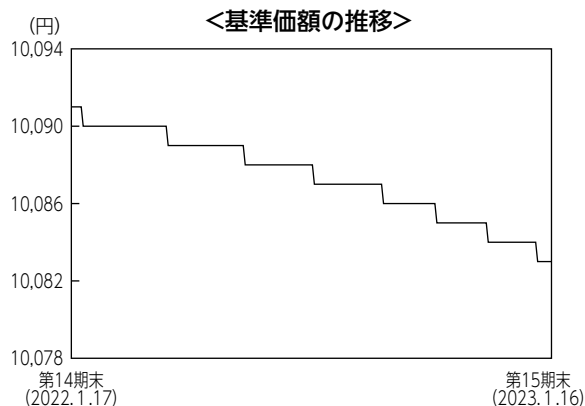
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準	価 額	債 組 入 比 券 率	債 先 物 比 券 率
		騰 落 率		
(期 首) 2022年 1 月17日	円	% —	% 11.7	% —
1 月 末	10,090	△0.0	11.7	—
2 月 末	10,090	△0.0	55.8	—
3 月 末	10,089	△0.0	55.8	—
4 月 末	10,089	△0.0	54.6	—
5 月 末	10,088	△0.0	54.6	—
6 月 末	10,088	△0.0	63.4	—
7 月 末	10,087	△0.0	63.4	—
8 月 末	10,087	△0.0	63.4	—
9 月 末	10,086	△0.0	63.4	—
10 月 末	10,085	△0.1	63.4	—
11 月 末	10,084	△0.1	64.6	—
12 月 末	10,084	△0.1	64.6	—
(期 末) 2023年 1 月16日	10,083	△0.1	64.6	—

(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（2022年1月18日から2023年1月16日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は1万口あたり10,083円となり、前期末の同10,091円から0.08%下落しました。

基準価額の主な変動要因

基準価額の変動要因として、保有債券からの利息収入などのプラス要因はありましたが、マイナス金利による影響が大きく、前期末比で基準価額は下落しました。

投資環境

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

ポートフォリオについて

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

今後の運用方針

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。そのため、今後も安定的な運用を目指し、公社債などへの投資につとめます。

■ 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 (2022年 1 月18日から2023年 1 月16日まで)

公社債

			買付額	売付額
			千円	千円
国	内	国債証券	430,495	— (225,000)

(注 1) 金額は受渡代金です (経過利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 (2022年 1 月18日から2023年 1 月16日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決算期 区分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D / C
公社債	百万円 430	百万円 60	% 14.0	百万円 —	百万円 —	% —

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

■ 組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内 (邦貨建) 公社債

区分	当				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 250,000	千円 250,138	% 64.6	% —	% —	% —	% 64.6
合計	250,000	250,138	64.6	—	—	—	64.6

(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 2 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	50,000	50,014	2023/05/01	
4 2 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	80,000	80,062	2023/08/01	
4 3 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	60,000	60,048	2023/11/01	
4 3 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	60,000	60,012	2023/12/01	
合計	—	250,000	250,138	—	

■投資信託財産の構成

2023年1月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 250,138	% 64.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	137,107	35.4
投 資 信 託 財 産 総 額	387,246	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

(2023年1月16日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	387,246,009円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	137,104,668
国 債 証 券(評価額)	250,138,186
未 収 利 息	2,264
前 払 費 用	891
(B) 負 債	－
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	387,246,009
元 本	384,050,119
次 期 繰 越 損 益 金	3,195,890
(D) 受 益 権 総 口 数	384,050,119口
1 万口当たり基準価額(C／D)	10,083円

- (注1) 期首元本額 382,066,191円
追加設定元本額 88,214,890円
一部解約元本額 86,230,962円
- (注2) 期末における元本の内訳
- | | |
|---|--------------|
| 世界高配当株セレクト (目標払出し型) 毎月決算・為替ヘッジなしコース | 64,422,677円 |
| 世界高配当株セレクト (目標払出し型) 毎月決算・為替ヘッジありコース | 7,925,502円 |
| グローバル・アロケーション・オープン Aコース (年1回決算・為替ヘッジなし) | 39,526,080円 |
| グローバル・アロケーション・オープン Bコース (年4回決算・為替ヘッジなし) | 188,580,850円 |
| グローバル・アロケーション・オープン Cコース (年1回決算・限定為替ヘッジ) | 5,939,129円 |
| グローバル・アロケーション・オープン Dコース (年4回決算・限定為替ヘッジ) | 4,945,108円 |
| USストラテジック・インカム・アルファ 毎月決算型 | 5,939,952円 |
| USストラテジック・インカム・アルファ 年1回決算型 | 2,375,387円 |
| 豪州インフラ関連好配当資産ファンド (毎月決算型) | 44,446,526円 |
| 豪州インフラ関連好配当資産ファンド (年2回決算型) | 19,753,462円 |
| 豪州インフラ関連好配当資産ファンド為替ヘッジあり (毎月決算型) | 97,723円 |
| 豪州インフラ関連好配当資産ファンド為替ヘッジあり (年2回決算型) | 97,723円 |
| 期末元本合計 | 384,050,119円 |

■損益の状況

当期 自2022年1月18日 至2023年1月16日

項 目	当 期
(A) 受 取 利 息 等 収 益	114,651円
受 取 利 息	160,800
支 払 利 息	△46,149
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△399,304
売 買 損	△399,304
(C) 当 期 損 益 金(A＋B)	△284,653
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	3,460,113
(E) 解 約 差 損 益 金	△764,680
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	785,110
(G) 合 計(C＋D＋E＋F)	3,195,890
次 期 繰 越 損 益 金(G)	3,195,890

- (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。