

豪州インフラ関連好配当資産ファンド（毎月決算型） ＜愛称：インフラ・DE・豪（GO）毎月＞

追加型投信／海外／資産複合

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。

当ファンドは、主として「LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）」への投資を通じて、オーストラリアの証券取引所に上場している株式および不動産投資信託（リート）等に実質的な投資を行い、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。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

作成対象期間 2020年11月14日～2021年5月13日

| | | |
|-----------------------|-----------------|-----------|
| 第65期 | 決算日：2020年12月14日 | |
| 第66期 | 決算日：2021年1月13日 | |
| 第67期 | 決算日：2021年2月15日 | |
| 第68期 | 決算日：2021年3月15日 | |
| 第69期 | 決算日：2021年4月13日 | |
| 第70期 | 決算日：2021年5月13日 | |
| 第70期末 (2021年5月13日) | 基準価額 | 8,757円 |
| | 純資産総額 | 10,255百万円 |
| 第65期～ 第70期 | 騰落率 | 13.5% |
| | 分配金合計 | 300円 |

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書（全体版）を電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書（全体版）は、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書（全体版）は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

■運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター **0120-104-694**

（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

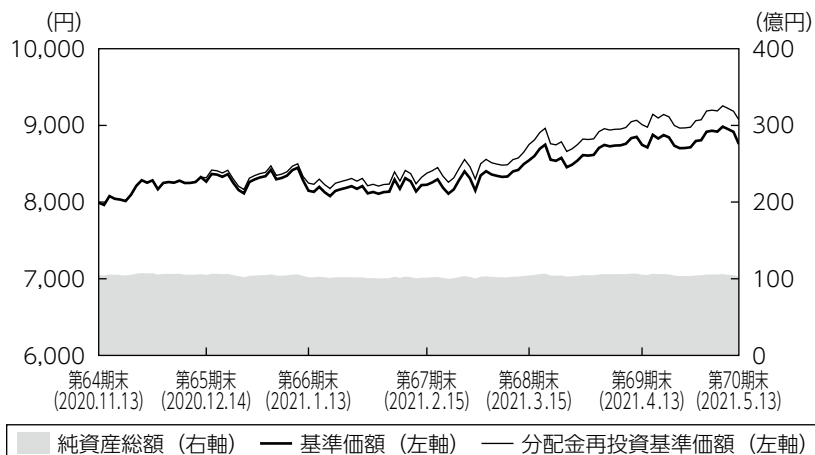
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2 <http://www.am-one.co.jp/>

運用経過の説明

基準価額等の推移



第65期首： 7,993円
 第70期末： 8,757円
 (既払分配金300円)
 騰落率： 13.5%
 (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はありません。
- (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

当作成期の基準価額は上昇しました。オーストラリアの債券利回りが上昇（価格が下落）したことなどを受けて公益事業セクターが下落したことはマイナス要因となったものの、主に保有銘柄の配当を確実に獲得したことから、株式要因は小幅のプラス寄与となりました。新型コロナウイルスのワクチンの普及などによるオーストラリアの景気回復期待を背景に豪ドル高円安が大きく進んだことから、為替要因もプラスとなりました。

◆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 |
|----------------------------|-------|
| LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用） | 14.5% |
| DIAMマネーマーケットマザーファンド | △0.0% |

(注) LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）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。

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第65期～第70期 | | 項目の概要 |
|---------------------|------------------------------|------------------|---|
| | (2020年11月14日 ～2021年5月13日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 50円 | 0.599% | (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8,415円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、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 |
| (投信会社) | (17) | (0.196) | |
| (販売会社) | (32) | (0.382) | |
| (受託会社) | (2) | (0.022) | |
| (b) その他費用 (監査費用) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| 合計 | 51 | 0.600 | |

(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。

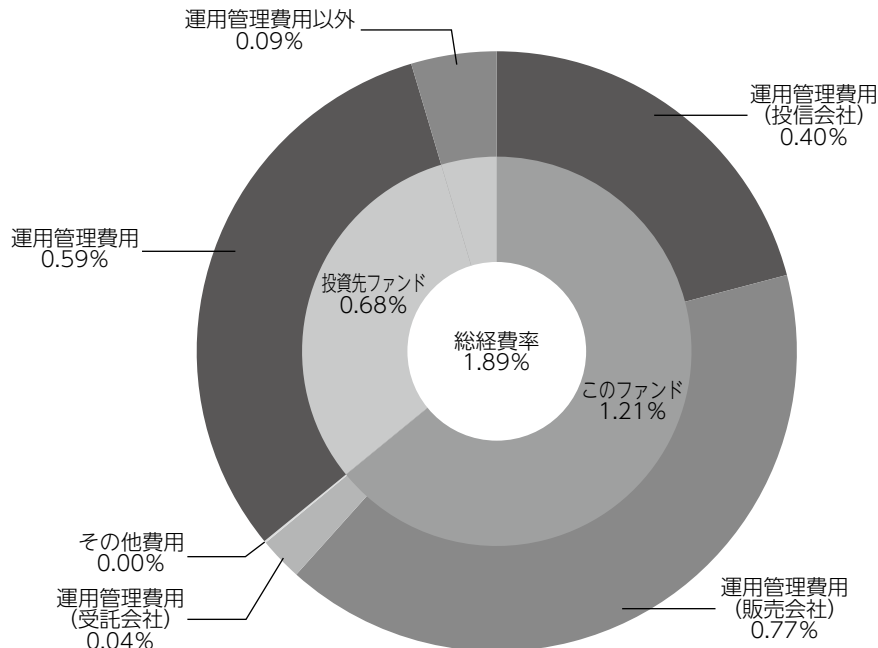
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.89%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 1.89% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.21% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.59% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.09% |

(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。

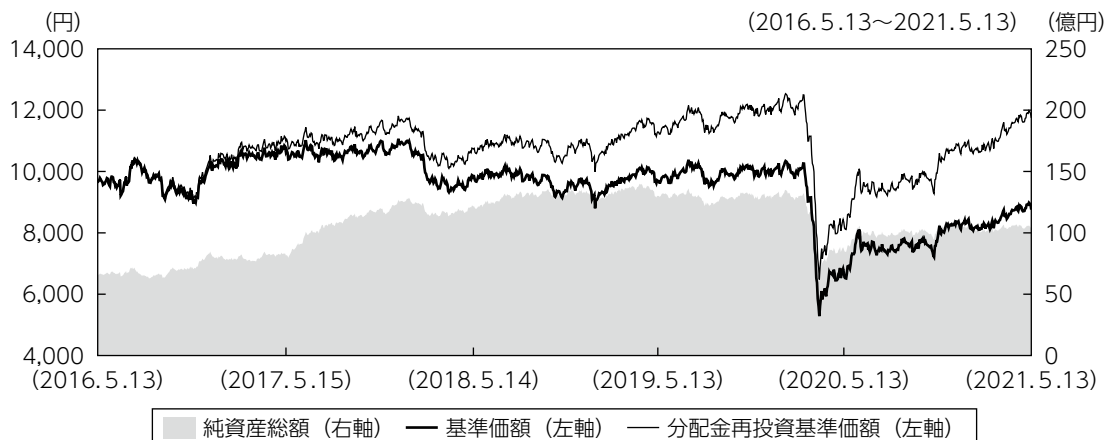
(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(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。

最近5年間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はありません。
- (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、2016年5月13日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2016年5月13日 期首 | 2017年5月15日 決算日 | 2018年5月14日 決算日 | 2019年5月13日 決算日 | 2020年5月13日 決算日 | 2021年5月13日 決算日 |
|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落) (円) | 9,730 | 10,638 | 9,809 | 9,696 | 6,705 | 8,757 |
| 期間分配金合計 (税引前) (円) | — | 325 | 600 | 600 | 600 | 600 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | — | 12.9 | △2.3 | 5.1 | △26.1 | 40.8 |
| 純資産総額 (百万円) | 6,598 | 8,139 | 12,147 | 13,003 | 8,677 | 10,255 |

(注) 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。

投資環境

当作成期のオーストラリア株式市場全体は上昇しました。新型コロナウイルスのワクチン接種が進んだことや、経済活動の再開とともに国内の景気回復期待が強まったことなどが、株価のサポート要因となりました。一方、米国債利回りの上昇を受けて、オーストラリアの債券利回りが上昇したことなどは、株価を抑える要因となりました。このような中、当ファンドが主要投資対象としているREIT（リート）は小幅上昇した一方、公益事業セクターは下落しました。

当作成期の豪ドル／円相場は豪ドル高円安となりました。新型コロナウイルスのワクチン普及が進みリスク回避姿勢が和らいだことや、経済活動の再開によりオーストラリアの景気回復期待が強まったことなどから、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。また、債券利回りの上昇により日豪金利差の拡大が意識されたことも、豪ドル買いにつながりました。その後、新型コロナウイルス感染再拡大などを背景に上値を抑えられる場面もありましたが、豪ドルは対円で概ね底堅く推移しました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力がかかっていることが要因となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）の組入比率は高位を維持しました。また、DIAM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。

●LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）

「LM・豪州インカム資産マザーファンド」への投資を通じて、主に配当利回りに着目し、相対的に配当利回りが高い銘柄を選別して投資し、ポートフォリオを構築しました。また、オーストラリア株式市場全体に比べて中長期的な値動きを小さく抑えることをめざして運用を行いました。個別銘柄では、ビシニティ・センターズ（店舗用不動産投資信託）などのウェイトを引き上げた一方、AGLEナジー（総合公益事業）などのウェイトを引き下げました。

●DIAMマネーマーケットマザーファンド

残存期間の短い国債や政府保証債などで運用を行いました。

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 第65期 | 第66期 | 第67期 | 第68期 | 第69期 | 第70期 |
|------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2020年11月14日 ~2020年12月14日 | 2020年12月15日 ~2021年1月13日 | 2021年1月14日 ~2021年2月15日 | 2021年2月16日 ~2021年3月15日 | 2021年3月16日 ~2021年4月13日 | 2021年4月14日 ~2021年5月13日 |
| 当期分配金（税引前） | 50円 | 50円 | 50円 | 50円 | 50円 | 50円 |
| 対基準価額比率 | 0.60% | 0.61% | 0.60% | 0.58% | 0.57% | 0.57% |
| 当期の収益 | 42円 | 35円 | 40円 | 42円 | 42円 | 38円 |
| 当期の収益以外 | 7円 | 14円 | 9円 | 7円 | 7円 | 11円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 957円 | 942円 | 933円 | 926円 | 918円 | 906円 |

（注1）「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

（注2）当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

（注3）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

主として、LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）を高位に組入れることを基本とした運用を行います。また、DIAMマネーマーケットマザーファンド受益証券への投資も行います。

●LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）

RBA（オーストラリア準備銀行）が長期にわたって低金利政策を維持する方針であることが株価を下支えすると見込まれます。「LM・豪州インカム資産マザーファンド」への投資を通じて、市場環境を注視しながら配当利回りに着目し、相対的に配当利回りの高い銘柄を選別して投資する方針です。また、個別銘柄や業種の選定を通じて、中長期的な値動きをオーストラリア株式市場全体に比べて小さく抑えることをめざします。

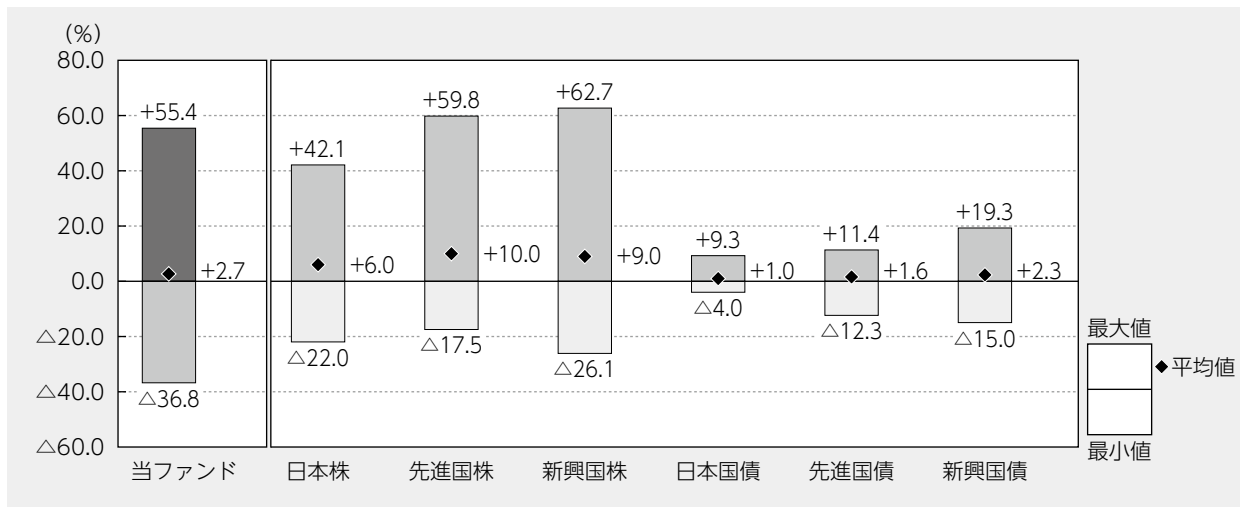
●DIAMマネーマーケットマザーファンド

日銀は新型コロナウイルスによる景気落ち込みに対処するため、緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。そのため、今後も公社債を中心に投資を行い、安定的な運用をめざしていきます。

当ファンドの概要

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／資産複合 |
| 信託期間 | 2015年6月30日から2025年11月13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「LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）」へ投資を行います。また、「DIAMマネーマーケットマザーファンド」受益証券への投資も行います。なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。 |
| 運用方法 | 主として「LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）」*への投資を通じて、オーストラリアの証券取引所に上場している株式および不動産投資信託を含む投資信託証券を中心に実質的な投資を行います。 *「LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）」は、「LM・豪州インカム資産マザーファンド」受益証券を主要投資対象とするファミリーファンド方式により運用を行います。 「LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）」への投資比率は、原則として高位を維持します。 実質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は行いません。 |
| 分配方針 | 決算日（原則として毎月13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。 |

代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンド : 2016年6月~2021年4月

代表的な資産クラス : 2016年5月~2021年4月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※各指数については後掲の<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>をご参照ください。

当ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容（2021年5月13日現在）

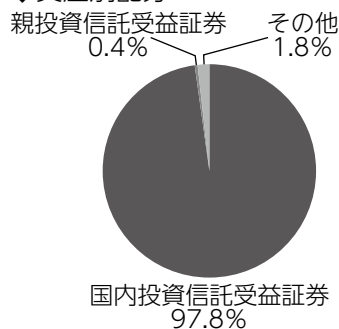
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：2ファンド)

| | 第70期末 |
|----------------------------|------------|
| | 2021年5月13日 |
| LM・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用） | 97.8% |
| DIAMマネーマーケットマザーファンド | 0.4 |
| その他 | 1.8 |

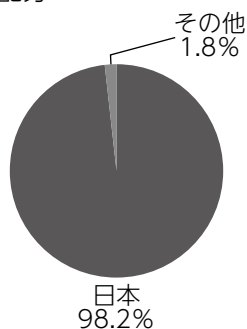
(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

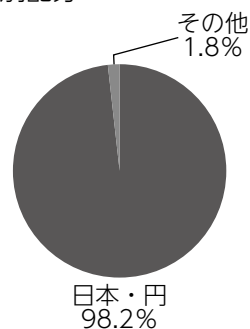
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

純資産等

| 項目 | 第65期末 | 第66期末 | 第67期末 | 第68期末 | 第69期末 | 第70期末 |
|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 2020年12月14日 | 2021年1月13日 | 2021年2月15日 | 2021年3月15日 | 2021年4月13日 | 2021年5月13日 |
| 純資産総額 | 10,517,914,823円 | 10,186,115,021円 | 10,138,991,876円 | 10,427,992,485円 | 10,527,458,512円 | 10,255,222,213円 |
| 受益権総口数 | 12,723,339,397口 | 12,500,697,641口 | 12,325,421,391口 | 12,204,489,635口 | 12,037,515,960口 | 11,710,925,273口 |
| 1万口当たり基準価額 | 8,267円 | 8,148円 | 8,226円 | 8,544円 | 8,746円 | 8,757円 |

(注) 当作成期間（第65期～第70期）中における追加設定元本額は374,812,835円、同解約元本額は1,734,439,574円です。

組入ファンドの概要

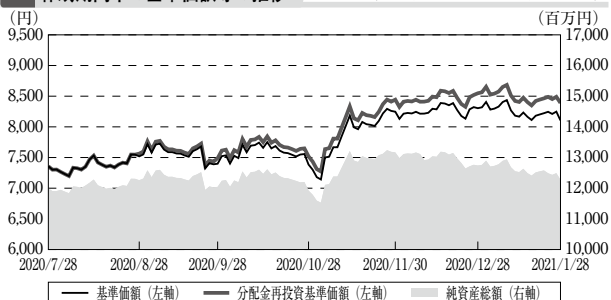
【L・M・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）】

以下は、「L・M・豪州インカム資産ファンド（適格機関投資家専用）」の第67期から第72期（2020年7月29日～2021年1月28日）の計算期間のデータです。

作成期間中の基準価額等の推移

（2020年7月29日～2021年1月28日）

○組入ファンド



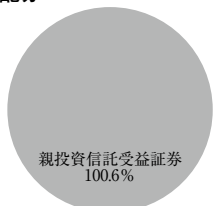
| 銘柄名 | 第72期末 |
|---------------------|--------|
| L・M・豪州インカム資産マザーファンド | 100.6% |
| 組入銘柄数 | 1銘柄 |

（注1）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

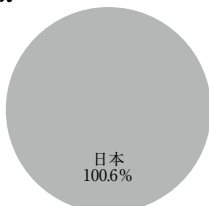
（注2）組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

- （注1）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に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）分配金再投資基準価額は、作成期首（2020年7月28日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- （注3）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

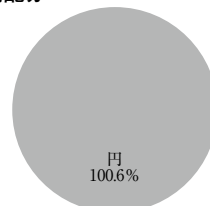
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



（注1）比率は組入資産（現金等を除く）の当ファンドの純資産総額に対する割合です。

（注2）国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

（注3）通貨別配分は組入資産（現金等を除く）を通貨で区分したものであり、通貨変動に伴うファンドの価格変動リスクと異なることがあります。

1万口当たりの費用明細

（2020年7月29日～2021年1月28日）

| 項目 | 第67期～第72期 | | 項目の概要 |
|--|-------------------------------|---|---|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社) | 23 (21) (0) (2) | 0.305 (0.277) (0.006) (0.022) | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売買委託手数料 (株式) (投資証券) | 2 (1) (2) | 0.031 (0.011) (0.020) | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (印刷等費用) (業務委託等費用) (その他) | 4 (1) (0) (0) (1) | 0.045 (0.017) (0.005) (0.004) (0.016) | (c) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 印刷等費用は、印刷業者等に支払う法定書類の作成、印刷、交付および届出に係る費用 計理及びこれに付随する業務の委託等の費用 配当に係る税金の支払い |
| 合計 | 29 | 0.381 | |

作成期間の平均基準価額は、7,697円です。

（注1）作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

（注3）売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

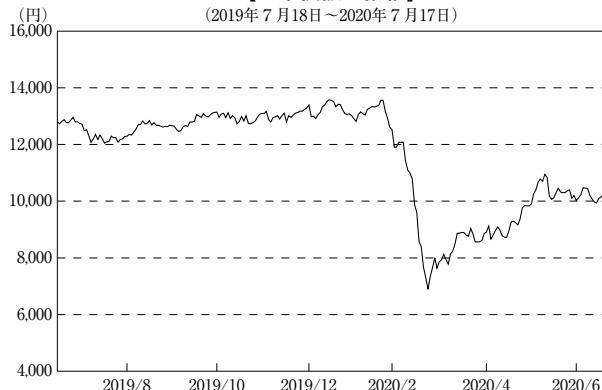
（注4）各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

L M・豪州インカム資産マザーファンド

以下は、「L M・豪州インカム資産マザーファンド」の計算期間（2019年7月18日～2020年7月17日）のデータです。

【基準価額の推移】

(2019年7月18日～2020年7月17日)



【1万口当たりの費用明細】

(2019年7月18日～2020年7月17日)

| 項目 | 当期 | |
|-------------------------------|------------------|-----------------------------|
| | 金額 | 比率 |
| | 円 | % |
| (a) 売買委託手数料 (株式) (投資証券) | 11 (6) (6) | 0.097 (0.048) (0.048) |
| (b) 有価証券取引税 (投資証券) | 1 (1) | 0.007 (0.007) |
| (c) その他費用 (保管費用) | 4 (4) | 0.037 (0.037) |
| 合計 | 16 | 0.141 |

期中の平均基準価額は、11,627円です。

- (注1) 上記項目の概要につきましては10ページをご参照ください。
 (注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
 (注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

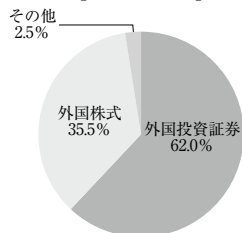
【組入上位10銘柄】

(2020年7月17日現在)

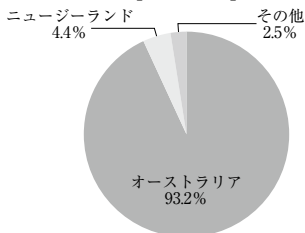
| | 銘柄名 | 業種／種別等 | 通貨 | 国（地域） | 比率 |
|----|------------------------------|--------|-----------|---------|-----|
| | | | | | % |
| 1 | APA GROUP | ガス | オーストラリアドル | オーストラリア | 7.6 |
| 2 | DEXUS | 投資証券 | オーストラリアドル | オーストラリア | 6.4 |
| 3 | STOCKLAND | 投資証券 | オーストラリアドル | オーストラリア | 6.3 |
| 4 | AUSNET SERVICES | 電力 | オーストラリアドル | オーストラリア | 6.2 |
| 5 | AGL ENERGY LTD | 総合公益事業 | オーストラリアドル | オーストラリア | 6.2 |
| 6 | AURIZON HOLDINGS LTD | 鉄道 | オーストラリアドル | オーストラリア | 6.2 |
| 7 | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 投資証券 | オーストラリアドル | オーストラリア | 6.1 |
| 8 | SCENTRE GROUP | 投資証券 | オーストラリアドル | オーストラリア | 5.4 |
| 9 | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 投資証券 | オーストラリアドル | オーストラリア | 4.6 |
| 10 | CHARTER HALL RETAIL REIT | 投資証券 | オーストラリアドル | オーストラリア | 4.5 |
| | 組入銘柄数 | | 32銘柄 | | |

- (注1) 比率は、純資産総額に対する割合です。
 (注2) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。
 (注3) 国（地域）につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

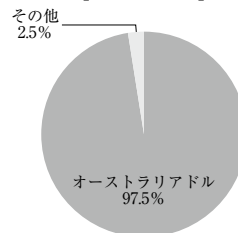
【資産別配分】



【国別配分】



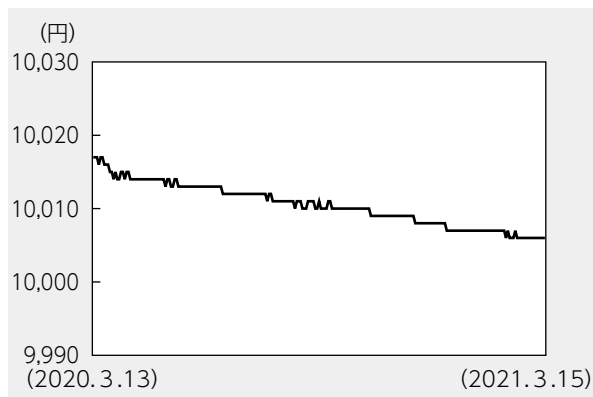
【通貨別配分】



- (注1) 比率は組入資産（現金等を除く）の当ファンドの純資産総額に対する割合です。
 (注2) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。
 (注3) 通貨別配分は組入資産（現金等を除く）を通貨で区分したものであり、通貨変動に伴うファンドの価格変動リスクと異なることがあります。
 ※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書（全体版）をご参照ください。

【DIAMマネーマーケットマザーファンド】（計算期間 2020年3月14日～2021年3月15日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-----------------|------|-------|
| 405回 利付国庫債券（2年） | 日本・円 | 27.3% |
| 402回 利付国庫債券（2年） | 日本・円 | 20.4 |
| 409回 利付国庫債券（2年） | 日本・円 | 13.6 |
| — | — | — |
| — | — | — |
| — | — | — |
| — | — | — |
| — | — | — |
| — | — | — |
| — | — | — |
| 組入銘柄数 | 3銘柄 | |

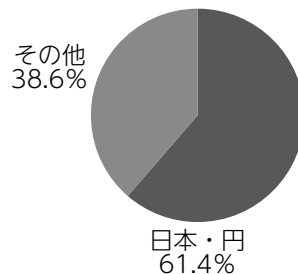
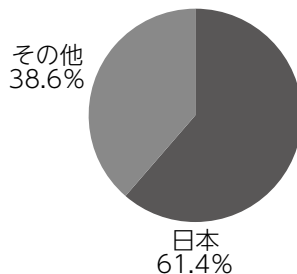
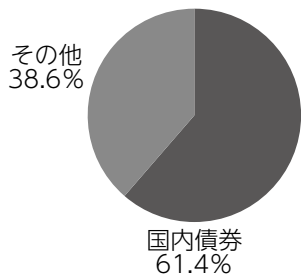
◆1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

◆資産別配分

◆国別配分

◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものです。

(注2) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注3) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注4) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注5) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(このページは白紙です)

