

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3月8日から2028年2月24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	USストラテジック・インカム・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)	円建て外国投資信託である「D I A Mケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジありクラス」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D I A Mマネーマザーファンド受益証券への投資も行います。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	D I A Mケイマン・ファンド-Janus USコアプラス・ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジありクラス	米ドル建て米国債券 <sup>(*)</sup> 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、米ドル建て非米国社債等に投資する場合があります。
	D I A Mマネーマザーファンド	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C D、C P、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。
運用方法	円建て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。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を行いません。	
組入制限	USストラテジック・インカム・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)	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。
	D I A Mマネーマザーファンド	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。
分配方針	決算日（原則として毎月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。	

<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。

## 運用報告書 (全体版)

### USストラテジック・インカム・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)

愛称：債券王

第150期	<決算日	2025年9月24日>
第151期	<決算日	2025年10月23日>
第152期	<決算日	2025年11月25日>
第153期	<決算日	2025年12月23日>
第154期	<決算日	2026年1月23日>
第155期	<決算日	2026年2月24日>

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・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)」は、2026年2月24日に第155期の決算を行いました。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。

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・ファンド Bコース (為替ヘッジなし)

## ■最近5作成期の運用実績

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 騰 落 中 率		
第22作成期	126期(2023年9月25日)	円 7,776	円 25	% 1.3	% 97.9	百万円 7,977
	127期(2023年10月23日)	7,591	25	△2.1	98.5	7,733
	128期(2023年11月24日)	7,895	25	4.3	97.7	8,024
	129期(2023年12月25日)	7,822	25	△0.6	98.3	7,813
	130期(2024年1月23日)	8,048	25	3.2	98.1	8,052
	131期(2024年2月26日)	8,074	25	0.6	98.0	8,542
第23作成期	132期(2024年3月25日)	8,195	25	1.8	98.1	8,669
	133期(2024年4月23日)	8,146	25	△0.3	98.0	8,701
	134期(2024年5月23日)	8,368	25	3.0	98.8	8,867
	135期(2024年6月24日)	8,619	25	3.3	98.6	9,056
	136期(2024年7月23日)	8,501	25	△1.1	98.0	8,887
	137期(2024年8月23日)	8,129	25	△4.1	98.1	8,473
第24作成期	138期(2024年9月24日)	8,125	25	0.3	97.9	8,366
	139期(2024年10月23日)	8,253	25	1.9	98.6	8,438
	140期(2024年11月25日)	8,375	25	1.8	98.5	8,466
	141期(2024年12月23日)	8,413	25	0.8	97.6	7,936
	142期(2025年1月23日)	8,397	25	0.1	97.8	7,904
	143期(2025年2月25日)	8,121	25	△3.0	97.9	7,632
第25作成期	144期(2025年3月24日)	8,138	25	0.5	97.9	7,646
	145期(2025年4月23日)	7,570	25	△6.7	98.1	7,086
	146期(2025年5月23日)	7,704	25	2.1	97.9	7,152
	147期(2025年6月23日)	7,911	25	3.0	98.1	7,255
	148期(2025年7月23日)	7,974	25	1.1	98.7	7,274
	149期(2025年8月25日)	8,045	25	1.2	98.0	7,295
第26作成期	150期(2025年9月24日)	8,170	25	1.9	97.8	6,900
	151期(2025年10月23日)	8,483	25	4.1	98.3	7,130
	152期(2025年11月25日)	8,673	25	2.5	98.0	7,236
	153期(2025年12月23日)	8,672	25	0.3	98.5	7,196
	154期(2026年1月23日)	8,742	25	1.1	98.9	7,223
	155期(2026年2月24日)	8,616	25	△1.2	98.8	7,051

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(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。

(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、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

## ■過去6ヶ月間の基準価額の推移

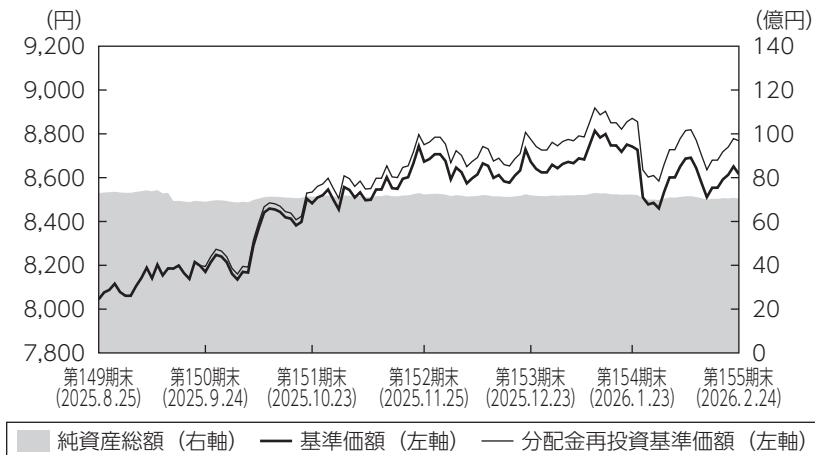
決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		投資信託受益証券組入比率
第150期	(期首) 2025年8月25日	円 8,045	% -		% 98.0
	8月 末	8,078	0.4		98.0
	(期末) 2025年9月24日	8,195	1.9		97.8
第151期	(期首) 2025年9月24日	8,170	-		97.8
	9月 末	8,214	0.5		97.8
	(期末) 2025年10月23日	8,508	4.1		98.3
第152期	(期首) 2025年10月23日	8,483	-		98.3
	10月 末	8,557	0.9		98.4
	(期末) 2025年11月25日	8,698	2.5		98.0
第153期	(期首) 2025年11月25日	8,673	-		98.0
	11月 末	8,707	0.4		98.2
	(期末) 2025年12月23日	8,697	0.3		98.5
第154期	(期首) 2025年12月23日	8,672	-		98.5
	12月 末	8,643	△0.3		98.5
	(期末) 2026年1月23日	8,767	1.1		98.9
第155期	(期首) 2026年1月23日	8,742	-		98.9
	1月 末	8,460	△3.2		98.0
	(期末) 2026年2月24日	8,641	△1.2		98.8

(注1) 期末基準価額は分配金込み、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。

## ■第150期～第155期の運用経過（2025年8月26日から2026年2月24日まで）

### 基準価額等の推移



第150期首： 8,045円  
 第155期末： 8,616円  
 （既払分配金150円）  
 騰落率： 9.0%  
 （分配金再投資ベース）

- 純資産総額（右軸） — 基準価額（左軸） — 分配金再投資基準価額（左軸）
- (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

債券部分は、米国債利回りが低下（価格は上昇）し、信用スプレッドがほぼ横ばいの環境下、社債やモーゲージ債などの保有がプラス寄与となりました。また、為替部分も、米ドルが対円で上昇しプラス寄与となったことから、基準価額は上昇しました。

### ◆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 円建て為替ヘッジなしクラス	9.6%
D I A Mマネーマザーファンド	0.3%

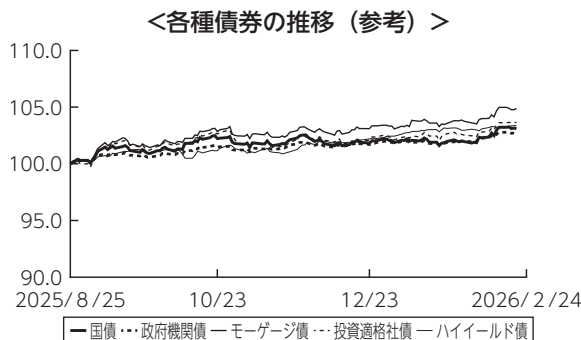
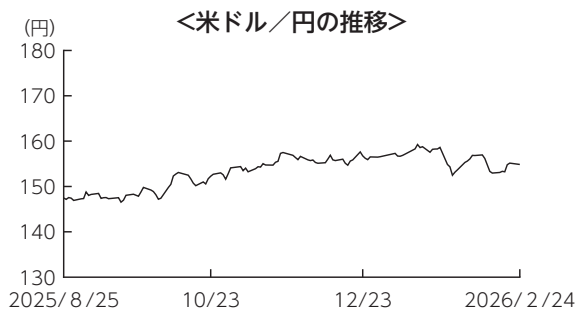
- (注) D I A Mケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジなしクラスの騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

## 投資環境

米国債券市場は10年国債利回りが前作成期末比で低下しました。2025年11月下旬までは、米政府機関閉鎖による景気下押し懸念やAI（人工知能）への過剰投資に対する警戒感から10年国債利回りは低下しました。その後、2026年の利下げペース減速の可能性が意識されたことなどにより上昇（価格は下落）しました。作成期末にかけては、地政学リスクの高まりや次期FRB（米連邦準備理事会）議長に利下げ推進派のウォーシュ氏が指名されたことなどから低下しました。

為替市場では、米ドルが対円で前作成期末比で上昇しました。自民党総裁選での高市氏勝利を受けて、日銀の利上げ観測が後退したことなどから2025年11月にかけて米ドルは対円で上昇しました。その後、1月に日米当局によるレートチェックとみられる動きから、急速に円高米ドル安が進行する局面もありましたが、作成期末にかけては、ほぼ横ばいでした。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは0.4%近辺の水準で始まりましたが、日銀が2025年12月に政策金利を引き上げたことから、当作成期末にかけて同利回りは上昇しました。



(注1) 前作成期末の値を100として指数化しています。

(注2) 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。

## 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 円建て為替ヘッジなしクラスの組入比率は原則として高位を維持し、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行いました。

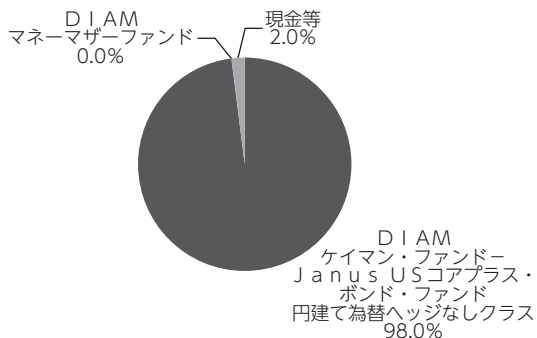
### ●D I A Mケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジなしクラス

投資適格社債については、信用スプレッドが過去と比較して大幅に縮小しているため、保有比率を引き下げました。その一方で、信用スプレッドの縮小余地があり、格付けの高い証券化商品を選好しました。また、2026年年初に投資妙味の高い社債の新規発行が増加すると予測し、2025年12月から2026年1月にかけて一時的に資金待機を目的として国債の保有比率を引き上げました。

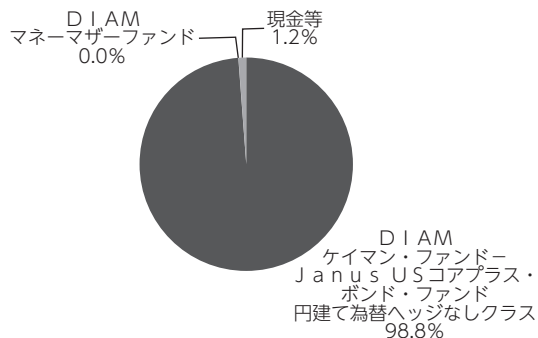
### ●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

## ポートフォリオ構成 前作成期末



## 当作成期末



(注) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 分配金

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150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
	2025年8月26日 ～2025年9月24日	2025年9月25日 ～2025年10月23日	2025年10月24日 ～2025年11月25日	2025年11月26日 ～2025年12月23日	2025年12月24日 ～2026年1月23日	2026年1月24日 ～2026年2月24日
当期分配金（税引前）	25円	25円	25円	25円	25円	25円
対基準価額比率	0.31%	0.29%	0.29%	0.29%	0.29%	0.29%
当期の収益	25円	25円	25円	25円	25円	25円
当期の収益以外	-円	-円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	2,624円	2,630円	2,636円	2,637円	2,642円	2,643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

引き続き、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 円建て為替ヘッジなしクラス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、D I A Mマネーマザーファンドへの投資も行います。

### ●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 円建て為替ヘッジなしクラス

米国経済は全体としては堅調を維持しており、利下げなどを支えに緩やかな成長が続くと見えています。インフレ率は継続的に上昇する可能性は低く、物価上昇は一時的なものに留まると考えます。セクター別では、証券化商品を中心にクレジット市場の見通しは概ねポジティブと捉えていますが、社債の信用スプレッドが過去対比で大幅に縮小していることから、短期的な債券市場のボラティリティ上昇に備え、質の高い銘柄を選好しています。今後も機動的に資産配分を調整しながら、元本保全とリスク調整後リターンの獲得を目指す方針です。

### ●D I A Mマネーマザーファンド

日銀は2026年1月の金融政策決定会合で、政策金利を0.75%とする金融政策を維持しました。日銀は今後も政策金利の引き上げを行うと見られますが、欧米で見られた形の急激な金利引き上げは回避すると想定されます。そのため、今後も公社債等への投資を通じ、安定的な運用を目指します。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第150期～第155期 (2025年8月26日 ～2026年2月24日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	35円	
(投信会社)	(12)	(0.138)	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)	(21)	(0.248)	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)	( 2)	(0.022)	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 (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	35	0.409	

(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。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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。

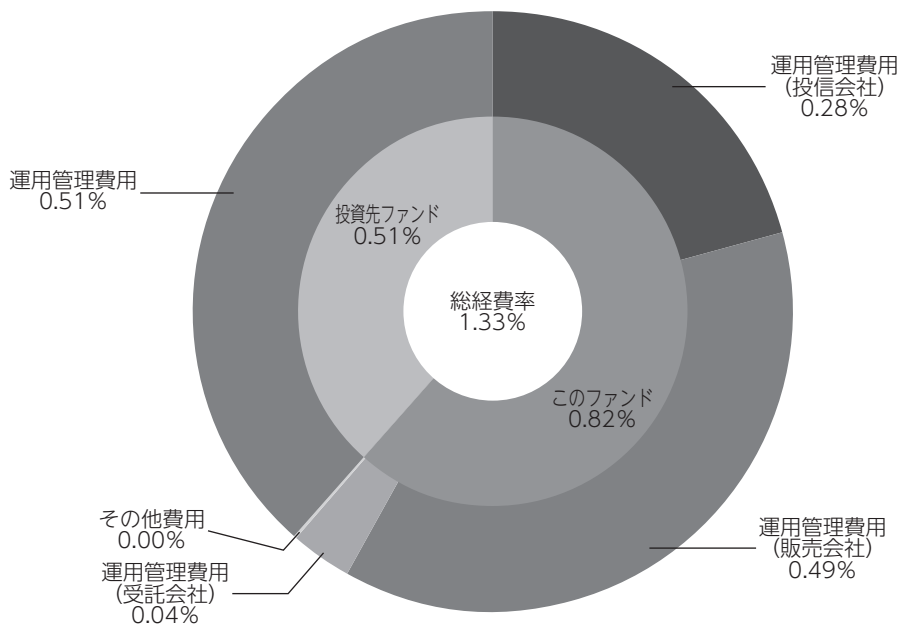
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.33%です。



総経費率 (①+②)	1.33%
①このファンドの費用の比率	0.82%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.51%

(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 (2025年8月26日から2026年2月24日まで)

投資信託受益証券

		第 150 期		第 155 期	
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 (邦貨建)	DIAMケイマン・ファンドー Janus USコアプラス・ ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジなしクラス	千口 -	千円 -	千口 86.1	千円 664,280

(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 (2025年8月26日から2026年2月24日まで)

期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

## ■利害関係人との取引状況等 (2025年8月26日から2026年2月24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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第25作成期末	第 26 作 成 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジなしクラス	千口 953.24506	千口 867.14506	千円 6,967,510	% 98.8
合 計	953.24506	867.14506	6,967,510	98.8

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	第25作成期末	第 26 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 1,987	千口 1,987	千円 2,009

## ■投資信託財産の構成

2026年2月24日現在

項 目	第 26 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 6,967,510	% 98.0
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ェ ン ド	2,009	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	139,856	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	7,109,376	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

(2025年9月24日)、(2025年10月23日)、(2025年11月25日)、(2025年12月23日)、(2026年1月23日)、(2026年2月24日)現在

項 目	第 150 期 末	第 151 期 末	第 152 期 末	第 153 期 末	第 154 期 末	第 155 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>6,941,859,970円</b>	<b>7,171,277,844円</b>	<b>7,278,547,989円</b>	<b>7,223,816,907円</b>	<b>7,264,269,473円</b>	<b>7,109,376,664円</b>
コール・ローン等	193,773,331	160,183,329	109,429,859	131,302,469	114,791,413	139,856,965
投資信託受益証券(評価額)	6,746,082,267	7,009,089,149	7,092,260,570	7,090,507,880	7,147,470,309	6,967,510,557
DIAMマネーマザーファンド(評価額)	2,004,372	2,005,366	2,006,360	2,006,558	2,007,751	2,009,142
未 収 入 金	—	—	74,851,200	—	—	—
<b>(B) 負 債</b>	<b>41,089,859</b>	<b>40,803,036</b>	<b>42,349,615</b>	<b>27,494,491</b>	<b>40,524,444</b>	<b>57,840,577</b>
未 払 収 益 分 配 金	21,117,238	21,013,364	20,859,226	20,745,651	20,658,825	20,461,167
未 払 解 約 金	15,151,051	15,234,079	16,189,848	2,247,345	14,864,685	32,307,763
未 払 信 託 報 酬	4,804,247	4,539,230	5,281,500	4,485,329	4,982,969	5,053,429
そ の 他 未 払 費 用	17,323	16,363	19,041	16,166	17,965	18,218
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>6,900,770,111</b>	<b>7,130,474,808</b>	<b>7,236,198,374</b>	<b>7,196,322,416</b>	<b>7,223,745,029</b>	<b>7,051,536,087</b>
元 本	8,446,895,352	8,405,345,676	8,343,690,709	8,298,260,799	8,263,530,378	8,184,467,052
次 期 繰 越 損 益 金	△1,546,125,241	△1,274,870,868	△1,107,492,335	△1,101,938,383	△1,039,785,349	△1,132,930,965
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>8,446,895,352□</b>	<b>8,405,345,676□</b>	<b>8,343,690,709□</b>	<b>8,298,260,799□</b>	<b>8,263,530,378□</b>	<b>8,184,467,052□</b>
1万円当たり基準価額(C/D)	8,170円	8,483円	8,673円	8,672円	8,742円	8,616円

(注) 第149期末における元本額は9,069,166,823円、当作成期間(第150期～第155期)中における追加設定元本額は68,463,182円、同解約元本額は953,162,953円です。

## ■損益の状況

〔自 2025年8月26日 至 2025年9月24日〕〔自 2025年9月25日 至 2025年10月23日〕〔自 2025年10月24日 至 2025年11月25日〕〔自 2025年11月26日 至 2025年12月23日〕〔自 2025年12月24日 至 2026年1月23日〕〔自 2026年1月24日 至 2026年2月24日〕

項 目	第 150 期	第 151 期	第 152 期	第 153 期	第 154 期	第 155 期
(A) 配 当 等 収 益	26,907,235円	26,542,242円	26,536,574円	26,286,181円	26,268,735円	25,962,879円
受 取 配 当 金	26,829,109	26,481,385	26,484,224	26,234,701	26,197,687	25,875,663
受 取 利 息	78,126	60,857	52,350	51,480	71,048	87,216
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	104,598,282	262,170,257	157,621,718	△1,511,040	56,931,744	△103,459,091
売 買 益	111,258,813	263,008,692	158,062,107	251,168	56,995,165	1,496,686
売 買 損	△6,660,531	△838,435	△440,389	△1,762,208	△63,421	△104,955,777
(C) 信 託 報 酬 等	△4,821,570	△4,555,593	△5,300,541	△4,501,495	△5,000,934	△5,071,647
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	126,683,947	284,156,906	178,857,751	20,273,646	78,199,545	△82,567,859
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,102,694,587	△989,291,681	△719,718,974	△558,234,397	△555,987,267	△492,994,098
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△548,997,363	△548,722,729	△545,771,886	△543,231,981	△541,338,802	△536,907,841
(配 当 等 相 当 額)	(1,637,796,555)	(1,631,494,639)	(1,620,408,431)	(1,612,027,703)	(1,605,675,612)	(1,591,125,615)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,186,793,918)	(△2,180,217,368)	(△2,166,180,317)	(△2,155,259,684)	(△2,147,014,414)	(△2,128,033,456)
(G) 合 計 (D + E + F)	△1,525,008,003	△1,253,857,504	△1,086,633,109	△1,081,192,732	△1,019,126,524	△1,112,469,798
(H) 収 益 分 配 金	△21,117,238	△21,013,364	△20,859,226	△20,745,651	△20,658,825	△20,461,167
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△1,546,125,241	△1,274,870,868	△1,107,492,335	△1,101,938,383	△1,039,785,349	△1,132,930,965
追 加 信 託 差 損 益 金	△548,997,363	△548,722,729	△545,771,886	△543,231,981	△541,338,802	△536,907,841
(配 当 等 相 当 額)	(1,637,796,555)	(1,631,494,639)	(1,620,408,431)	(1,612,027,703)	(1,605,675,612)	(1,591,125,615)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,186,793,918)	(△2,180,217,368)	(△2,166,180,317)	(△2,155,259,684)	(△2,147,014,414)	(△2,128,033,456)
分 配 準 備 積 立 金	578,961,620	579,522,573	579,306,181	576,750,718	577,975,741	572,084,445
繰 越 損 益 金	△1,576,089,498	△1,305,670,712	△1,141,026,630	△1,135,457,120	△1,076,422,288	△1,168,107,569

(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) (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。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	第 150 期	第 151 期	第 152 期	第 153 期	第 154 期	第 155 期
(a) 経費控除後の配当等収益	25,921,396円	26,124,240円	25,773,807円	21,785,382円	24,690,799円	20,892,277円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	1,637,796,555	1,631,494,639	1,620,408,431	1,612,027,703	1,605,675,612	1,591,125,615
(d) 分 配 準 備 積 立 金	574,157,462	574,411,697	574,391,600	575,710,987	573,943,767	571,653,335
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	2,237,875,413	2,232,030,576	2,220,573,838	2,209,524,072	2,204,310,178	2,183,671,227
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,649.35	2,655.49	2,661.38	2,662.64	2,667.52	2,668.07
(g) 分 配 金	21,117,238	21,013,364	20,859,226	20,745,651	20,658,825	20,461,167
(h) 1万口当たり分配金	25	25	25	25	25	25

## ■分配金のお知らせ

決算期	第 150 期	第 151 期	第 152 期	第 153 期	第 154 期	第 155 期
1 万口当たり分配金	25円	25円	25円	25円	25円	25円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

# DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド

<円建て為替ヘッジありクラス>

<円建て為替ヘッジなしクラス>

当ファンドは「USストラテジック・インカム・ファンド」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	ケイマン籍円建て外国投資信託
主 要 投 資 対 象	米ドル建て米国債券 <sup>(*)</sup> 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、米ドル建て非米国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。 ・「ブルームバーク・米国総合インデックス」 <sup>(注)</sup> 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 <sup>(*)</sup> 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 <sup>(*)</sup> 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、米国内債、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、円建て為替ヘッジありクラスでは、原則として米ドル売り円買いによる対円での為替ヘッジを行います。円建て為替ヘッジなしクラスでは、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・ハンダーソン・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 <sup>®</sup> 」およびブルームバーク・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「B I S L」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーク」)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。ブルームバーク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 円建て為替ヘッジありクラス、DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジなしクラスを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバークは、DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジありクラス、DIAMケイマン・ファンドーJanus USコアプラス・ボンド・ファンド 円建て為替ヘッジなし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 要 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・ハンダーソン・インベスターズ・US・エルエルシー
受 託 会 社	CIBC カリビアン・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	ステート・ストリート・バンク・インターナショナルGmbH、ルクセンブルク支店
保 管 銀 行	米国みずほ銀行

DIAMケイマン・ファンドーJanus US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、2024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、2024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（Janus US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**  
2024年12月31日期（2024年12月31日終了）

	日本円
<b>投資損益の部</b>	
債券利息	1,898,415,137
投資ディスカウント増加およびプレミアム償却の純額	(147,014,656)
投資有価証券払戻による損失	(181,037,983)
<b>収益合計</b>	<b>1,570,362,498</b>
<b>費用の部</b>	
投資運用報酬	113,342,786
管理事務報酬	28,203,916
保管報酬	25,633,231
受託報酬	3,865,124
専門報酬	5,503,825
その他費用	4,751,734
<b>費用合計</b>	<b>181,300,616</b>
<b>純投資収益</b>	<b>1,389,061,882</b>
投資有価証券売却による実現純利益	2,839,851,956
為替先渡契約による実現純損失	(213,382,210)
先物契約による実現純損失	(131,994,387)
外貨取引による実現純損失	(49,970,582)
<b>期中実現純利益額</b>	<b>2,444,504,777</b>
投資有価証券による未実現損益の純変動	663,746,318
為替先渡契約による未実現純損益の変動	(143,844,394)
先物契約による未実現純損益の変動	(309,700,643)
外貨取引による未実現純損益の変動	25,003,755
<b>期中未実現増加分の純変動額</b>	<b>235,205,036</b>
<b>運用による純資産の純増</b>	<b>4,068,771,695</b>

	発行済受益権口数	一口当たり純資産価額 (日本円)
クラス MJPHDJPY	192,350.09	5,641
クラス MUNHDJPY	985,545.06	7,896
クラス NJPHDJPY	100,000.00	8,937
クラス NUNHDJPY	846,372.91	15,698
クラス SUNHDJPY	882,691.89	13,701

(注) DIAMケイマン・ファンドーJanus US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、「USストラテジック・インカム・ファンドAコース（為替ヘッジあり）」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、「USストラテジック・インカム・ファンドBコース（為替ヘッジなし）」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NJPHDJPYは、日本円建て為替ヘッジありクラス、クラスNUNHDJPYは、日本円建て日本円ヘッジなしクラス、クラスSUNHDJPYは、日本円建て・年2回決算クラスです。

投資有価証券明細表（要約版）  
2024年12月31日現在

	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産%
コマーシャルペーパー			
その他	455,655,377	455,655,377	1.30%
<b>コマーシャルペーパー合計</b>	<b>455,709,690</b>	<b>455,709,690</b>	<b>1.30%</b>
<b>変動利付債</b>			
米国			
銀行	1,151,202,420	1,233,924,607	3.51%
資本市場	79,985,219	90,701,492	0.26%
電力	98,367,359	107,486,336	0.31%
情報技術サービス	367,883,602	382,562,715	1.09%
米国合計	1,697,438,600	1,814,675,150	5.17%
その他	70,977,300	92,329,052	0.26%
<b>変動利付債合計</b>	<b>1,768,415,900</b>	<b>1,907,004,202</b>	<b>5.43%</b>
<b>モーゲージ</b>			
米国			
自動車	14,616,117	17,582,911	0.05%
総合型金融サービス	10,837,448,632	12,164,882,195	34.62%
貯蓄・抵当金融	4,028,603,381	4,570,947,605	13.01%
米国合計	14,880,668,130	16,753,412,711	47.68%
ケイマン諸島			
総合型金融サービス	2,129,562,983	2,291,929,057	6.52%
インターネット ソフトウェア・サービス	91,700,760	89,472,461	0.25%
貯蓄・抵当金融	39,313,350	42,431,885	0.12%
ケイマン諸島合計	2,260,577,093	2,423,833,403	6.89%
その他	71,922,081	72,294,324	0.21%
<b>モーゲージ合計</b>	<b>17,213,167,304</b>	<b>19,249,540,438</b>	<b>54.78%</b>
<b>モーゲージ - TBA</b>			
その他	431,468,479	441,163,720	1.26%
<b>モーゲージ - TBA合計</b>	<b>431,468,479</b>	<b>441,163,720</b>	<b>1.26%</b>
<b>普通債券</b>			
米国			
航空宇宙・防衛	310,420,901	329,547,019	0.94%
自動車	239,865,796	248,655,730	0.71%
銀行	122,276,718	168,985,934	0.48%
建築関連製品	52,929,732	54,668,756	0.16%
資本市場	524,456,414	555,795,339	1.58%
商業サービス・用品	75,486,716	77,610,234	0.22%
容器包装	220,538,952	232,442,782	0.66%
総合型金融サービス	285,076,406	308,692,866	0.88%

	償却原価 (日本円)	公正価値 (日本円)	対純資産%
<b>普通債券</b>			
<b>米国</b>			
電力	136,465,518	155,077,060	0.44%
電子装置・機器・部品	119,902,468	124,276,794	0.35%
食品・生活必需品小売り	50,088,220	60,042,491	0.17%
ソブリン	4,725,449,878	4,702,502,790	13.38%
ヘルスケア機器・備品	389,471,569	406,972,703	1.16%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1,134,070,015	1,184,104,798	3.37%
家庭用耐久消費財	106,684,166	106,120,385	0.30%
独立系発電・再生可能エネルギー発電	69,875,583	73,691,891	0.21%
保険	423,572,057	442,924,571	1.26%
情報技術サービス	253,185,912	262,016,823	0.75%
レジャー用品	347,138,173	371,150,590	1.06%
機械	58,007,652	70,360,884	0.20%
メディア	211,244,223	225,643,588	0.64%
金属・鉱業	51,207,374	52,292,633	0.15%
石油・ガス・消耗燃料	1,065,981,484	1,105,606,655	3.15%
製薬	61,158,240	61,865,695	0.18%
不動産投資法人	226,617,375	255,694,990	0.73%
不動産管理・開発	198,741,548	216,410,513	0.62%
半導体・半導体製造装置	361,023,421	380,466,417	1.08%
ソフトウェア	104,728,021	105,651,322	0.30%
専門小売店	128,380,351	134,180,040	0.38%
商社・流通業	89,413,509	104,796,645	0.30%
無線通信サービス	52,455,499	56,892,919	0.16%
<b>米国合計</b>	<b>12,195,913,891</b>	<b>12,635,141,857</b>	<b>35.97%</b>
<b>その他</b>	<b>351,182,043</b>	<b>382,003,848</b>	<b>1.09%</b>
<b>普通債券合計</b>	<b>12,547,095,934</b>	<b>13,017,145,705</b>	<b>37.06%</b>
<b>投資有価証券公正価値合計</b>	<b>32,415,802,994</b>	<b>35,070,563,755</b>	<b>99.83%</b>

# D I A M マネーマザーファンド

## 運用報告書

第16期 (決算日 2025年4月7日)

(計算期間 2024年4月6日～2025年4月7日)

D I A M マネーマザーファンドの第16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	純資産総額
	円	騰落率				
12期(2021年4月5日)	10,080	△0.1	62.4	—	—	百万円 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
16期(2025年4月7日)	10,065	0.1	81.1	—	—	3,881

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

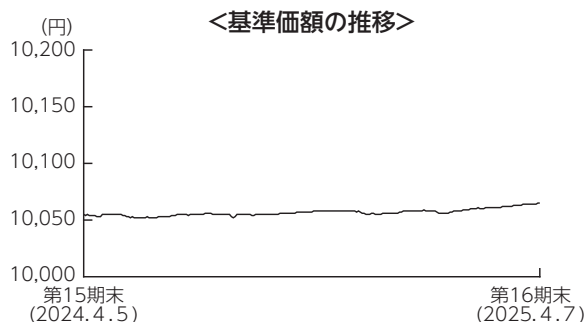
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比	券 率	新 株 予 約 権 付 社 債 ( 転 換 社 債 ) 組 入 比 率	債 先 物 比	券 率
	円	騰 落 率					
(期 首) 2024年 4 月 5 日	10,055	—	62.0	—	—	—	—
4 月 末	10,055	0.0	56.0	—	—	—	—
5 月 末	10,052	△0.0	79.1	—	—	—	—
6 月 末	10,055	0.0	82.7	—	—	—	—
7 月 末	10,053	△0.0	74.7	—	—	—	—
8 月 末	10,055	0.0	82.6	—	—	—	—
9 月 末	10,057	0.0	82.6	—	—	—	—
10 月 末	10,058	0.0	86.8	—	—	—	—
11 月 末	10,056	0.0	77.5	—	—	—	—
12 月 末	10,059	0.0	82.4	—	—	—	—
2025年 1 月 末	10,058	0.0	78.9	—	—	—	—
2 月 末	10,061	0.1	81.6	—	—	—	—
3 月 末	10,064	0.1	81.1	—	—	—	—
(期 末) 2025年 4 月 7 日	10,065	0.1	81.1	—	—	—	—

(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（2024年4月6日から2025年4月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は10,065円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

### 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。当期間は、保有債券からの利息収入などがプラスに影響し、前期末比で基準価額は上昇しました。

## 投資環境

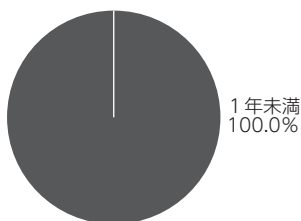
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りはゼロ近辺で始まりましたが、日銀が2024年7月、2025年1月に政策金利を引き上げたことから、同利回りは徐々に上昇しました。

## ポートフォリオについて

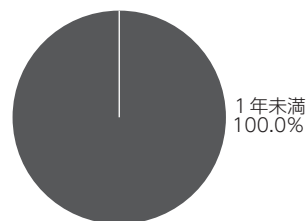
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【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2025年3月の金融政策決定会合で、政策金利を0.50%とする金融政策を維持しました。日銀は引き続き政策金利の引き上げを行うと見られますが、米国の関税政策の先行きなど、内外経済の不確実性が高い中では日銀は慎重に利上げを行うと見られ、今後の金利上昇は限定的なものとなることが見込まれます。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 (2024年4月6日から2025年4月7日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	11,312,467	3,666,456 (4,800,000)

(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 (2024年4月6日から2025年4月7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 11,312	百万円 1,099	% 9.7	百万円 3,666	百万円 199	% 5.4

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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	3,150,000	3,147,577	81.1	—	—	—	81.1
合 計	3,150,000	3,147,577	81.1	—	—	—	81.1

(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	
1 2 6 1回	国庫短期証券	—	100,000	99,997	2025/04/10
1 2 8 0回	国庫短期証券	—	300,000	299,979	2025/04/14
1 2 8 3回	国庫短期証券	—	400,000	399,908	2025/04/28
1 2 6 7回	国庫短期証券	—	400,000	399,844	2025/05/12
1 2 8 9回	国庫短期証券	—	500,000	499,730	2025/05/26
1 2 9 0回	国庫短期証券	—	400,000	399,752	2025/06/02
1 2 3 8回	国庫短期証券	—	50,000	49,960	2025/06/20
1 2 7 9回	国庫短期証券	—	300,000	299,715	2025/07/10
1 2 4 4回	国庫短期証券	—	100,000	99,900	2025/07/22
1 2 9 1回	国庫短期証券	—	400,000	399,372	2025/09/10
4 5 7回	利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	199,420	2026/02/01
合 計		—	3,150,000	3,147,577	—

## ■投資信託財産の構成

2025年4月7日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
	3,147,577	81.1		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	734,394	18.9		
投 資 信 託 財 産 総 額	3,881,972	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

(2025年4月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,881,972,229円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	734,359,151
公 社 債(評価額)	3,147,577,500
未 収 利 息	21,880
前 払 費 用	13,698
(B) 負 債	—
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	3,881,972,229
元 本	3,856,870,274
次 期 繰 越 損 益 金	25,101,955
(D) 受 益 権 総 口 数	3,856,870,274口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	10,065円

(注1) 期首元本額	481,233,562円	One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)	9,943,324円
追加設定元本額	9,658,635,020円	One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (毎月決算・予想分配金提示型)	1,988,665円
一部解約元本額	6,282,998,308円	期末元本合計	3,856,870,274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
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	11,377円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	98,027円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	989,197円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	395,083円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	494,102円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	494,102円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス <sup>ス</sup> 為替ヘッジあり <sup>レ</sup>	791,316円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス <sup>ス</sup> 為替ヘッジなし <sup>レ</sup>	2,474,972円
One/フェルマット・CAT債券ファンド (年4回決算型) (為替ヘッジなし)	4,968,204円
One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (毎月決算・予想分配金提示型)	9,939円
ウエルントン・トータル・リターン債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり)	9,940円
ウエルントン・トータル・リターン債券ファンド (年4回決算型) (為替ヘッジあり)	9,940円
ウエルントン・トータル・リターン債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし)	5,768,275円
ウエルントン・トータル・リターン債券ファンド (年4回決算型) (為替ヘッジなし)	2,884,138円
グループズコントロール	3,674,777,764円
USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり)	993,740円
USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし)	1,987,479円
マシューズ・アジア株式ファンド	14,723,185円
One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円
One世界分散セレクト (Cコース)	99,040円
世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型)	99,109円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり)	301,134円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし)	1,493,740円

## ■損益の状況

当期 自2024年4月6日 至2025年4月7日

項	目	当 期
(A) 配	当 等 収 益	3,728,764円
受	取 利 息	3,728,764
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	△700,961
売	買 益	737,456
売	買 損	△1,438,417
(C) 当	期 損 益 金(A+B)	3,027,803
(D) 前	期 繰 越 損 益 金	2,634,728
(E) 解	約 差 損 益 金	△35,655,556
(F) 追	加 信 託 差 損 益 金	55,094,980
(G) 合	計(C+D+E+F)	25,101,955
次	期 繰 越 損 益 金(G)	25,101,955

(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。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

(2025年4月1日)