

運用報告書 (全体版)

自然環境保護ファンド

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／資産種別 |
| 信託期間 | 2006年5月26日から無期限です。 |
| 運用方針 | 安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 自然環境保護ファンド D I A M S R I ・ マザーファンド D I A M S R I ・ マザーファンド D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド |
| | D I A M S R I ・ マザーファンド D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド |
| | D I A M S R I ・ マザーファンド D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド |
| 運用方法 | 自然環境保護ファンド |
| | D I A M S R I ・ マザーファンド |
| | D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド |
| 組入制限 | マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎決算時（原則として、奇数月の各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（繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する利子、配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下、「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の中から、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ことがあります。 |

愛称：尾瀬紀行

第102期 <決算日 2023年7月5日>
第103期 <決算日 2023年9月5日>
第104期 <決算日 2023年11月6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、「自然環境保護ファンド」は、2023年11月6日に第104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。

<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/>

自然環境保護ファンド

■最近5作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 | | | 株式組入率 | 株式先物比率 | 債券組入率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|--------|------------------|-------------|---------|----------|-----------|--------|-----------|--------|--------------|
| | | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | | | | |
| 第31作成期 | 90期(2021年7月5日) | 円 10,460 | 円 40 | % 0.6 | % 47.3 | % - | % 48.3 | % - | 百万円 1,677 |
| | 91期(2021年9月6日) | 10,602 | 40 | 1.7 | 49.0 | - | 46.6 | - | 1,711 |
| | 92期(2021年11月5日) | 10,667 | 40 | 1.0 | 47.7 | - | 47.6 | - | 1,705 |
| 第32作成期 | 93期(2022年1月5日) | 10,687 | 40 | 0.6 | 47.0 | - | 48.4 | - | 1,699 |
| | 94期(2022年3月7日) | 9,843 | 40 | △7.5 | 43.9 | - | 51.0 | - | 1,583 |
| | 95期(2022年5月6日) | 10,237 | 40 | 4.4 | 45.0 | - | 49.0 | - | 1,625 |
| 第33作成期 | 96期(2022年7月5日) | 10,192 | 40 | △0.0 | 46.2 | - | 50.4 | - | 1,622 |
| | 97期(2022年9月5日) | 10,257 | 40 | 1.0 | 46.1 | - | 48.7 | - | 1,673 |
| | 98期(2022年11月7日) | 10,182 | 40 | △0.3 | 47.7 | - | 48.1 | - | 1,691 |
| 第34作成期 | 99期(2023年1月5日) | 9,665 | 40 | △4.7 | 48.0 | - | 47.8 | - | 1,604 |
| | 100期(2023年3月6日) | 10,108 | 40 | 5.0 | 49.9 | - | 46.4 | - | 1,684 |
| | 101期(2023年5月8日) | 10,383 | 40 | 3.1 | 48.5 | - | 47.0 | - | 1,775 |
| 第35作成期 | 102期(2023年7月5日) | 11,155 | 40 | 7.8 | 47.8 | - | 48.6 | - | 1,907 |
| | 103期(2023年9月5日) | 11,181 | 40 | 0.6 | 48.8 | - | 46.6 | - | 1,958 |
| | 104期(2023年11月6日) | 11,159 | 40 | 0.2 | 47.6 | - | 47.4 | - | 1,986 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドは積極的にCSR*1(企業の社会責任)へ取り組むわが国の上場企業の株式および比較的高金利の期待できる高格付資源国*2の公社債を主要投資対象としております。当ファンドのコンセプトに適っ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。

*1 「CSR」とは、Corporate Social Responsibilityの略です。また、CSR(企業の社会責任)を重視して投資することをSRI(Socially Responsible Investment 社会的責任投資)といいます。

*2 当ファンドにおいて「資源国」とは、「石油、鉱物資源、ガス、石炭等の資源を産出する国で、その資源がその国の経済もしくは世界経済に影響を与えると考えられる国」と定義します。

(注6) △(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 | | 株 式 組 入 率 比 | 株 式 先 物 率 比 | 債 券 組 入 率 比 | 債 券 先 物 率 比 |
|-------|-------------------------|---------|------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | | 円 | 騰 落 率 % | | | | |
| 第102期 | (期 首) 2023年 5 月 8 日 | 10,383 | - | 48.5 | - | 47.0 | - |
| | 5 月 末 | 10,506 | 1.2 | 47.1 | - | 48.0 | - |
| | 6 月 末 | 11,124 | 7.1 | 47.4 | - | 48.2 | - |
| | (期 末) 2023年 7 月 5 日 | 11,195 | 7.8 | 47.8 | - | 48.6 | - |
| 第103期 | (期 首) 2023年 7 月 5 日 | 11,155 | - | 47.8 | - | 48.6 | - |
| | 7 月 末 | 11,001 | △1.4 | 49.0 | - | 47.5 | - |
| | 8 月 末 | 11,115 | △0.4 | 48.1 | - | 47.1 | - |
| | (期 末) 2023年 9 月 5 日 | 11,221 | 0.6 | 48.8 | - | 46.6 | - |
| 第104期 | (期 首) 2023年 9 月 5 日 | 11,181 | - | 48.8 | - | 46.6 | - |
| | 9 月 末 | 11,122 | △0.5 | 48.0 | - | 47.0 | - |
| | 10 月 末 | 10,798 | △3.4 | 47.2 | - | 47.6 | - |
| | (期 末) 2023年 11 月 6 日 | 11,199 | 0.2 | 47.6 | - | 47.4 | - |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

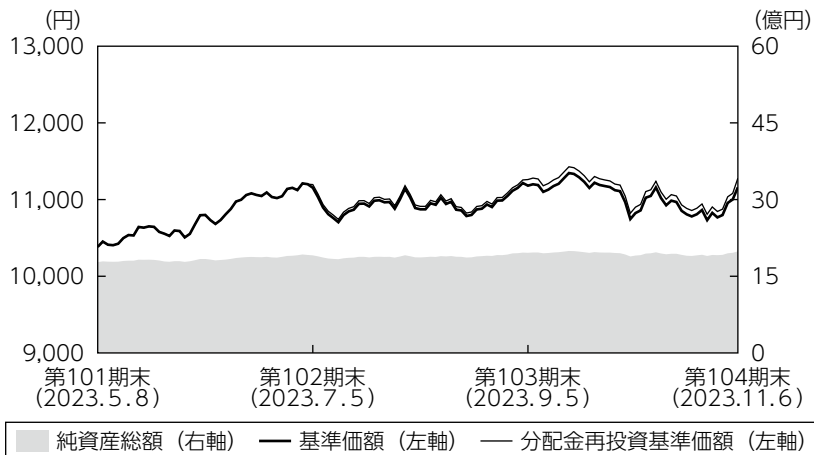
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第102期～第104期の運用経過（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

インフレの抑制を目的とした主要国の金融引き締めや投資対象国のインフレ継続等を背景に、投資対象国の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと等がマイナスに寄与しました。一方、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から投資対象国を含む主要通貨に対して円安となったこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内株式市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、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 S R I ・ マザーファンド | 17.2% |
| D I A M 高格付インカム ・ オープン ・ マザーファンド | 2.4% |

投資環境

国内株式市場は上昇しました。F R B（米連邦準備理事会）の利上げ継続動向や、日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）修正などの内外金融政策動向、イスラエルを巡る地政学リスク、中国景気の減速などが意識されましたが、底堅い国内経済活動や円安恩恵を背景とした良好な企業決算、米国景気の軟着陸期待、日銀の金融緩和姿勢が概ね維持されたことなどから、期を通じては上昇しました。

外国債券市場では、いずれの投資対象国でも国債利回りは上昇（価格は下落）しました。米国では、インフレは低下しているものの目標を上回る水準が続いていること、景気も堅調さを保っていることからF R Bが高金利の長期化を示唆したことを背景に、将来の利下げ織り込みが剥落したことを主因に、国債利回りが上昇しました。投資対象国の国債利回りもインフレが目標を上回る水準が続く中、米国情債利回りに連れて上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。ドル／円相場は、内外金利差の拡大や内外の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安ドル高基調の動きとなりました。D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンドの組入対象通貨においても、内外金利差の拡大等を背景に円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

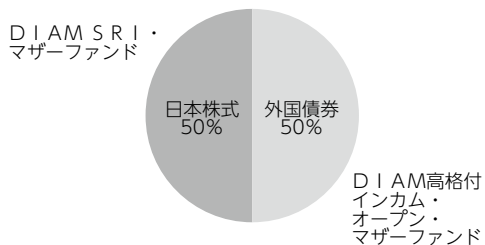
●当ファンド

D I A M S R I ・マザーファンド50%、D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド50%を基本配分比率とし、各マザーファンドの組入比率が基本配分比率に近づくよう運用を行いました。

●D I A M S R I ・マザーファンド

C S R（企業の社会責任）評価の高い企業のうち、足元の業績が堅調な銘柄、底堅い国内経済活動等を支えに業績が今後回復に向かうと予想される銘柄、環境・社会問題への取り組みなどで中期成長性が高い銘柄、予想P E R（株価収益率）など株価バリュエーションに割安感がある銘柄、株主還元積極的に銘柄などを選別してポートフォリオを構築しました。

<基本配分比率>



※ただし、時価の変動などにより各マザーファンドの時価構成比が基本配分から乖離した場合には、定期的に基本配分に修正します。また、上記の基本配分は、市場動向等を勘案し、変更する場合があります。

●D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

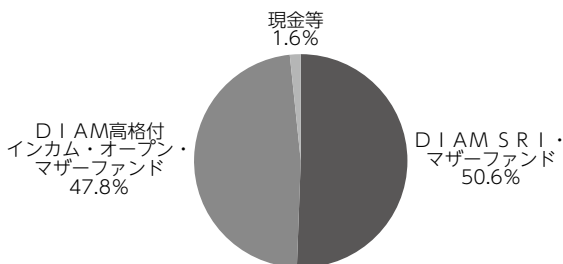
基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション*については、投資対象国および世界経済・インフレ見通し、主要国および投資対象国の金融政策を勘案して、機動的に調整を行いました。当作成期末のデュレーションは、主要国の景気が堅調を保っていることから高金利局面の長期化による利回り上昇を警戒し、作成期初と比較して短期化しました。

*金利変動に対する債券価格の変動性。

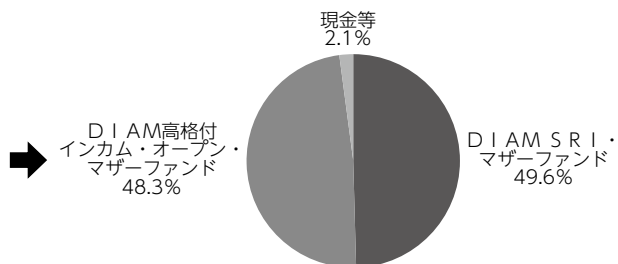
【運用状況】

○マザーファンド組入比率 ※組入比率は純資産総額に対する割合です。

前作成期末

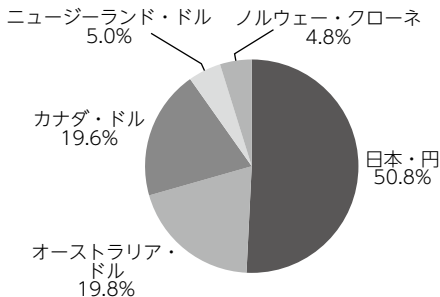


当作成期末

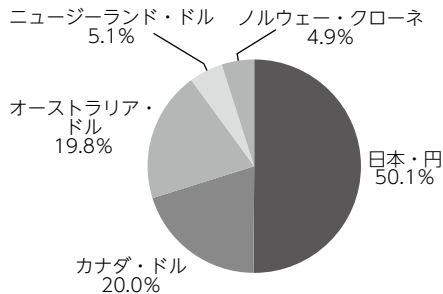


○通貨別構成比 ※組入比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券評価額に対する割合です。

前作成期末



当作成期末



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102期 | 第103期 | 第104期 |
|------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2023年5月9日 ～2023年7月5日 | 2023年7月6日 ～2023年9月5日 | 2023年9月6日 ～2023年11月6日 |
| 当期分配金（税引前） | 40円 | 40円 | 40円 |
| 対基準価額比率 | 0.36% | 0.36% | 0.36% |
| 当期の収益 | 40円 | 40円 | 40円 |
| 当期の収益以外 | -円 | -円 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,953円 | 2,989円 | 2,998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、各資産の基本配分比率を維持するよう、各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率につきましても、高位組入れを維持します。

●D I A M S R I ・マザーファンド

組入銘柄は、C S R 評価の高い企業のうち、業績が堅調もしくは今後回復に向かい市場予想を上回ると予想される銘柄、今期の業績伸び率が高いと予想される銘柄、中期成長性の高い製品群を有する銘柄、今期P E R など株価バリュエーションに割安感がある銘柄、キャッシュフローの状況などから株主還元への期待度が高いと推測される銘柄などに引き続き注目して投資します。

●D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。デュレーションについては、主要国および投資対象国の中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資対象国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第102期～第104期 (2023年5月9日 ～2023年11月6日) | | 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) | 80円 (38) (39) (4) | |
| (b) 売買委託手数料 (株式) | 2 (2) | 0.014 (0.014) | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他) | 0 (0) (0) (0) | 0.004 (0.002) (0.002) (0.000) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 82 | 0.753 | |

(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、売買委託手数料およびその他費用は、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。

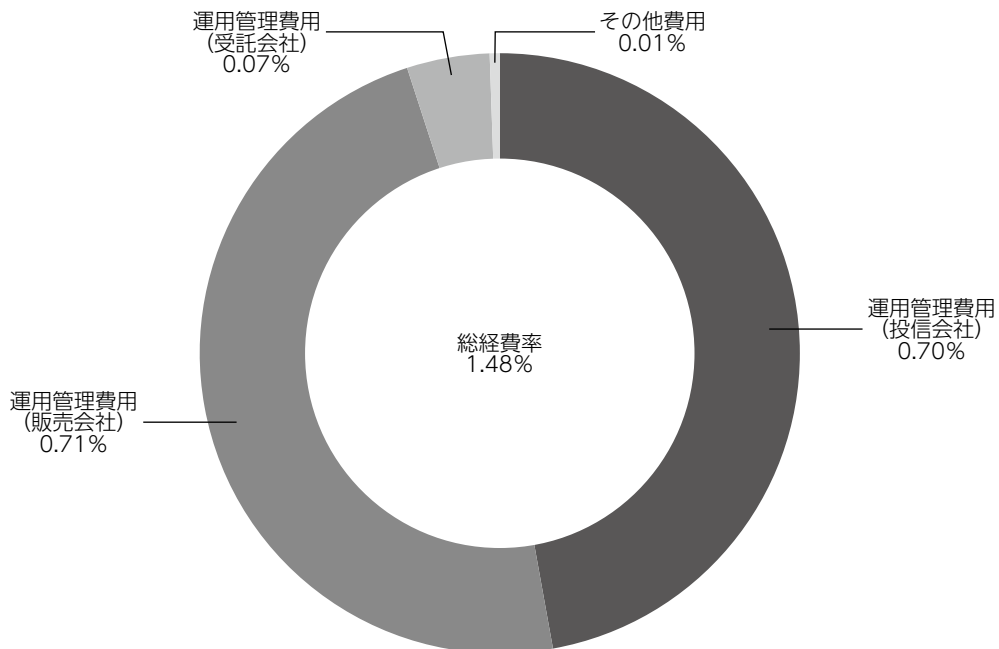
●当ファンドの販売会社および委託会社は、收受した運用管理費用の一部を(公財)尾瀬保護財団へ寄付を行い、尾瀬国立公園の自然環境保護に貢献いたします。
なお、当作成期に行った販売会社と委託会社の寄付金額の合計は3,334千円です。

| 寄付金額 | |
|------|--|
| 委託会社 | 毎年5月の決算期末を基準に、前1年間に收受した運用管理費用の中から、当該期間中の日々の純資産総額に年10,000分の10の率を乗じて得た金額。(ただし、将来的には状況によって寄付金額が変更になることがあります。) |
| 販売会社 | 各販売会社が、毎年5月の決算期末を基準に、前1年間に收受した運用管理費用の中から、各販売会社の取扱い純資産額に応じて、当該期間中の日々の純資産額に年10,000分の10の率を乗じて得た金額。(ただし、将来的には状況によって寄付金額が変更になることがあります。) |

(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1.48%です。



(注1) 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) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況等（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

| | 第 102 期 ~ 第 104 期 | | | |
|----------------------------------|-------------------|---------|--------------|--------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| D I A M S R I ・ マザーファンド | 千□ - | 千円 - | 千□ 26,761 | 千円 60,000 |
| D I A M 高格付インカム・ オープン・マザーファンド | 35,194 | 90,000 | - | - |

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 第 102 期 ~ 第 104 期 |
|-------------------------------|-------------------------|
| | D I A M S R I ・ マザーファンド |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 497,913千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 907,744千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)/(b) | 0.54 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

【自然環境保護ファンドにおける利害関係人との取引状況等】

- (1) 期中の利害関係人との取引状況
期中の利害関係人との取引はありません。

- (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 第 102 期 ~ 第 104 期 |
|-----------------------------|-------------------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 267千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 27千円 |
| (B) / (A) | 10.3% |

(注) 売買委託手数料総額は、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。

【D I A M S R I ・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 | 第 102 期 ~ | | | 第 104 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 |
| 株 式 | 百万円 223 | 百万円 26 | % 11.9 | 百万円 274 | 百万円 23 | % 8.5 |

平均保有割合 100.0%

(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。

【D I A M高格付インカム・オープン・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等はありません。

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、当作成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

親投資信託残高

| | 第 34 作 成 期 末 | 第 35 作 成 期 末 | |
|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| D I A M S R I ・ マ ザ ー フ ァ ン ド | 千□ 417,481 | 千□ 390,720 | 千円 984,537 |
| D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド | 334,747 | 369,942 | 960,110 |

<補足情報>

■D I A M S R I ・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I A M S R I ・マザーファンド（390,720,365口）の内容です。

国内株式

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月6日現在 | |
|------------------------|-------------|-----|--------------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 鉱業 (0.7%) | | | | |
| INPEX | 3.7 | 2.9 | 6,293 | |
| 建設業 (4.0%) | | | | |
| 鹿島建設 | — | 3.5 | 8,907 | |
| 住友林業 | 1.4 | 2.1 | 7,436 | |
| 大気社 | 1 | 2.4 | 10,860 | |
| インフロンティア・ホールディングス | 6 | 6.6 | 10,233 | |
| 食料品 (4.3%) | | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 2.9 | 4.1 | 9,056 | |
| 森永乳業 | 1 | 1.3 | 7,332 | |
| 日清オイリオグループ | 1 | 1.7 | 7,148 | |
| 味の素 | — | 1.8 | 10,767 | |
| ニチレイ | 3.9 | 2.1 | 6,774 | |
| 化学 (6.1%) | | | | |
| クレハ | 0.6 | — | — | |
| 信越化学工業 | 2.5 | 1.2 | 5,805 | |
| 三井化学 | 2.4 | 2.4 | 9,456 | |
| J S R | 1.4 | — | — | |
| 三菱ケミカルグループ | 4 | 6.7 | 6,488 | |
| A D E K A | 5 | 4.7 | 12,302 | |
| 花王 | 0.6 | — | — | |
| 富士フィルムホールディングス | 2.6 | 2.3 | 19,849 | |
| ユニ・チャーム | 1.6 | 0.7 | 3,712 | |
| 医薬品 (6.4%) | | | | |
| アステラス製薬 | 6.3 | 7.8 | 13,919 | |
| 塩野義製薬 | 1.3 | 1.3 | 9,258 | |
| 中外製薬 | 2.6 | 2.1 | 9,846 | |
| ロート製薬 | 1 | 1.9 | 6,847 | |
| 参天製薬 | 1.6 | 4.8 | 6,326 | |
| 第一三共 | 3.5 | 2.3 | 9,321 | |
| サワイグループホールディングス | — | 1 | 4,791 | |
| ゴム製品 (0.9%) | | | | |
| 横浜ゴム | 2.1 | 2.8 | 8,117 | |
| ガラス・土石製品 (0.8%) | | | | |
| ニチアス | 3.1 | 2.4 | 7,392 | |
| 鉄鋼 (1.0%) | | | | |
| 日本製鉄 | 3.5 | 3 | 9,750 | |
| 非鉄金属 (1.3%) | | | | |
| 三井金属鉱業 | 0.8 | 1.6 | 6,265 | |
| 住友電気工業 | 3.5 | 3.5 | 6,305 | |

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月6日現在 | |
|---------------------|-------------|------|--------------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 金属製品 (0.8%) | | | | |
| リンナイ | — | 2.6 | 7,389 | |
| 機械 (5.0%) | | | | |
| 小松製作所 | 2.2 | — | — | |
| クボタ | — | 4.2 | 8,977 | |
| 荏原製作所 | 0.4 | 1.1 | 7,827 | |
| ダイキン工業 | 1 | 0.6 | 13,854 | |
| ダイフク | 0.9 | — | — | |
| T H K | 4.6 | 5.9 | 16,815 | |
| キッツ | 3.1 | — | — | |
| 電気機器 (19.6%) | | | | |
| イビデン | 1 | 1 | 7,129 | |
| 日立製作所 | 3.6 | 3.2 | 31,027 | |
| 安川電機 | 1.3 | 0.9 | 4,921 | |
| オムロン | 1.5 | 0.4 | 2,366 | |
| I D E C | — | 1.3 | 3,757 | |
| 日本電気 | 2.7 | 2.1 | 15,968 | |
| ソニーグループ | 3.4 | 3.5 | 45,797 | |
| T D K | 3.4 | 4 | 24,200 | |
| 横河電機 | 0.7 | — | — | |
| アズビル | 0.3 | — | — | |
| ローム | 0.5 | 3.6 | 9,360 | |
| 太陽誘電 | 1.3 | 3.4 | 12,739 | |
| 村田製作所 | 0.9 | — | — | |
| 東京エレクトロン | 1.5 | 1.3 | 27,963 | |
| 輸送用機器 (9.5%) | | | | |
| デンソー | 1.7 | 7.6 | 18,179 | |
| いすゞ自動車 | — | 3.2 | 5,584 | |
| トヨタ自動車 | 13.9 | 16.3 | 46,389 | |
| 本田技研工業 | 6.7 | 12 | 19,452 | |
| 精密機器 (3.0%) | | | | |
| テルモ | 4.3 | 3.7 | 15,847 | |
| 島津製作所 | 0.5 | — | — | |
| ニコン | 2.4 | 5.9 | 8,841 | |
| 朝日インテック | 1.4 | 1.4 | 3,722 | |
| その他製品 (2.2%) | | | | |
| リンテック | 1.2 | 2.4 | 6,194 | |
| 任天堂 | 3.7 | 2.3 | 14,793 | |
| 陸運業 (3.0%) | | | | |
| 東急 | 2.8 | 4 | 6,974 | |

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月6日現在 | |
|------------------------|-------------|-------|--------------|----|
| | 株数 | 千株 | 株数 | 千株 |
| 東日本旅客鉄道 | 0.5 | — | — | — |
| 西日本旅客鉄道 | 0.8 | 2 | 12,132 | — |
| S Gホールディングス | 3.5 | 4.3 | 9,122 | — |
| 空運業 (0.8%) | | | | |
| 日本航空 | 2.1 | 2.7 | 7,531 | — |
| 情報・通信業 (6.6%) | | | | |
| NECネットエスアイ | 3.1 | 3.1 | 6,643 | — |
| 野村総合研究所 | 5.5 | 2.2 | 9,248 | — |
| LINEヤフー | 15.3 | 20.8 | 8,528 | — |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 2.5 | — | — | — |
| BIPROGY | — | 2.4 | 9,931 | — |
| 日本電信電話 | 3.4 | 115.5 | 20,431 | — |
| KDDI | 2.5 | 1.6 | 7,480 | — |
| ソフトバンクグループ | 0.6 | — | — | — |
| 卸売業 (4.9%) | | | | |
| 伊藤忠商事 | 3.4 | 3.4 | 19,352 | — |
| 丸紅 | 4.5 | 4.5 | 10,512 | — |
| 三菱商事 | 2.8 | 2.4 | 16,795 | — |
| 小売業 (3.2%) | | | | |
| アスクル | — | 4.3 | 8,780 | — |
| セブン&アイ・ホールディングス | 3.8 | 3.9 | 21,918 | — |
| 丸井グループ | 2.6 | — | — | — |
| 銀行業 (7.1%) | | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 29.8 | 26.6 | 33,768 | — |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 3.5 | 3.5 | 25,690 | — |
| ふくおかフィナンシャルグループ | — | 1.9 | 7,505 | — |
| 証券、商品先物取引業 (-%) | | | | |
| 野村ホールディングス | 11.2 | — | — | — |

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月6日現在 | |
|----------------------|-------------|-------|--------------|---------|
| | 株数 | 千株 | 株数 | 千株 |
| 保険業 (3.3%) | | | | |
| 第一生命ホールディングス | 2.6 | 1.6 | 5,107 | — |
| 東京海上ホールディングス | 7.6 | 7.6 | 26,554 | — |
| その他金融業 (2.2%) | | | | |
| オリックス | 7.5 | 7.5 | 20,332 | — |
| 不動産業 (2.1%) | | | | |
| パーク24 | — | 2.6 | 4,508 | — |
| 三井不動産 | 5.7 | 4.5 | 15,565 | — |
| 三菱地所 | 1.8 | — | — | — |
| イオンモール | 6 | — | — | — |
| サービス業 (1.2%) | | | | |
| 日本工営 | 2.6 | — | — | — |
| アウトソーシング | 3 | — | — | — |
| エスプール | — | 7 | 2,681 | — |
| オリエンタルランド | 2.1 | — | — | — |
| ID&Eホールディングス | — | 2.6 | 8,736 | — |
| セコム | 0.4 | — | — | — |
| イオンデベロッパー | 1.8 | — | — | — |
| 合計 | 株数・金額 | 286.3 | 417.4 | 945,491 |
| | 銘柄数<比率> | 87銘柄 | 78銘柄 | <96.0%> |

(注1) 銘柄欄の()内は、2023年11月6日現在の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、2023年11月6日現在のマザーファンド純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

■D I AM高格付インカム・オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I AM高格付インカム・オープン・マザーファンド（36,950,316,348円）の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分 | 2023 年 11 月 6 日 現 在 | | | | | | | |
|----------|--------------------------|--------------------------|------------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|----------|
| | 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 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 372,200 | 千カナダ・ドル 344,649 | 千円 37,752,873 | % 39.4 | % - | % 17.1 | % 13.6 | % 8.7 |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 447,000 | 千オーストラリア・ドル 382,567 | 千円 37,300,370 | 38.9 | - | 27.8 | 4.5 | 6.6 |
| ニュージーランド | 千ニューージーランド・ドル 133,500 | 千ニューージーランド・ドル 107,430 | 千円 9,631,124 | 10.0 | - | 6.5 | 1.7 | 1.8 |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 752,000 | 千ノルウェー・クローネ 686,572 | 千円 9,303,051 | 9.7 | - | 4.6 | 3.6 | 1.5 |
| 合 計 | - | - | 千円 93,987,419 | 98.0 | - | 56.0 | 23.4 | 18.6 |

(注1) 邦貨換算金額は、2023年11月6日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、2023年11月6日現在のマザーファンド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

外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 2023 年 11 月 6 日 現 在 | | | | | |
|--|---------------------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CANADA 0.25 03/01/26 | 国債証券 | 0.2500 | 25,000 | 22,826 | 2,500,365 | 2026/03/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 20,900 | 24,221 | 2,653,190 | 2033/06/01 |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 7,300 | 8,225 | 901,056 | 2037/06/01 |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 5,000 | 5,189 | 568,469 | 2041/06/01 |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 2,000 | 1,711 | 187,494 | 2030/06/01 |
| CANADA 1.5 06/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 2,000 | 1,704 | 186,676 | 2031/06/01 |
| CANADA 2.75 08/01/24 | 国債証券 | 2.7500 | 67,000 | 65,958 | 7,225,048 | 2024/08/01 |
| CANADA 0.5 09/01/25 | 国債証券 | 0.5000 | 11,000 | 10,255 | 1,123,437 | 2025/09/01 |
| CANADA 2.75 09/01/27 | 国債証券 | 2.7500 | 25,000 | 23,986 | 2,627,429 | 2027/09/01 |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 12,000 | 11,736 | 1,285,613 | 2045/12/01 |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 37,000 | 26,638 | 2,917,957 | 2051/12/01 |
| CANADA 1.75 12/01/53 | 国債証券 | 1.7500 | 6,000 | 4,001 | 438,323 | 2053/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 5,000 | 4,125 | 451,927 | 2064/12/01 |
| BRITISH COLUMBIA PROVINCE 3.2 06/18/32 | 地方債証券 | 3.2000 | 10,000 | 9,114 | 998,418 | 2032/06/18 |
| PROVINCE OF QUEBEC 2.75 09/01/28 | 地方債証券 | 2.7500 | 50,000 | 46,980 | 5,146,289 | 2028/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.9 09/01/30 | 地方債証券 | 1.9000 | 30,000 | 25,798 | 2,826,005 | 2030/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.25 09/01/32 | 地方債証券 | 3.2500 | 12,000 | 10,964 | 1,201,098 | 2032/09/01 |

| 銘 柄 | 2023 年 11 月 6 日 現 在 | | | | | |
|---|---------------------|--------|--------------|--------------|-------------|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.5 09/01/31 | 地方債証券 | 1.5000 | 20,000 | 16,241 | 1,779,137 | 2031/09/01 |
| KOMBNK 4.9 10/05/26 | 特殊債券 | 4.9000 | 20,000 | 20,218 | 2,214,770 | 2026/10/05 |
| CANHOU 1.95 12/15/25 | 特殊債券 | 1.9500 | 5,000 | 4,748 | 520,161 | 2025/12/15 |
| 小 計 | — | — | 372,200 | 344,649 | 37,752,873 | — |
| (オーストラリア) | | % | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47 | 国債証券 | 3.0000 | 13,000 | 9,328 | 909,556 | 2047/03/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 41,000 | 40,701 | 3,968,373 | 2024/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 13,000 | 12,274 | 1,196,725 | 2029/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 8,000 | 7,131 | 695,311 | 2037/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 5,000 | 4,572 | 445,818 | 2028/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 23,000 | 20,404 | 1,989,464 | 2030/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 9,000 | 6,632 | 646,689 | 2041/05/21 |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 11,000 | 8,376 | 816,721 | 2032/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34 | 国債証券 | 3.7500 | 21,000 | 19,301 | 1,881,855 | 2034/05/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 06/21/54 | 国債証券 | 4.7500 | 20,000 | 19,116 | 1,863,882 | 2054/06/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 5,000 | 4,080 | 397,836 | 2039/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 9,024 | 879,853 | 2035/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 国債証券 | 1.7500 | 22,000 | 11,233 | 1,095,283 | 2051/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 3,000 | 2,730 | 266,261 | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33 | 国債証券 | 3.0000 | 18,000 | 15,546 | 1,515,824 | 2033/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31 | 国債証券 | 1.0000 | 30,000 | 22,742 | 2,217,399 | 2031/11/21 |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/24 | 国債証券 | 0.2500 | 25,000 | 23,935 | 2,333,711 | 2024/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 国債証券 | 1.0000 | 17,000 | 13,351 | 1,301,748 | 2030/12/21 |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 8,925 | 870,252 | 2034/12/21 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36 | 地方債証券 | 4.2500 | 14,000 | 12,310 | 1,200,231 | 2036/02/20 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29 | 地方債証券 | 3.0000 | 23,000 | 21,046 | 2,052,078 | 2029/04/20 |
| SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32 | 地方債証券 | 1.7500 | 6,500 | 4,939 | 481,592 | 2032/05/24 |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26 | 地方債証券 | 3.7000 | 11,000 | 10,641 | 1,037,559 | 2026/05/20 |
| AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30 | 地方債証券 | 1.7500 | 4,000 | 3,288 | 320,616 | 2030/05/17 |
| AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 16,000 | 12,844 | 1,252,317 | 2032/10/22 |
| TREASURY CORP VICTORIA 2.25 11/20/34 | 地方債証券 | 2.2500 | 11,000 | 7,985 | 778,573 | 2034/11/20 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 15,000 | 12,046 | 1,174,522 | 2032/11/22 |
| KOMBNK 4.35 01/18/28 | 特殊債券 | 4.3500 | 10,000 | 9,744 | 950,102 | 2028/01/18 |
| KOMBNK 4.4 02/17/26 | 特殊債券 | 4.4000 | 10,000 | 9,887 | 963,983 | 2026/02/17 |
| NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36 | 特殊債券 | 2.3350 | 4,500 | 3,253 | 317,203 | 2036/06/30 |
| EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31 | 特殊債券 | 1.4650 | 7,000 | 5,375 | 524,154 | 2031/08/18 |
| EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28 | 特殊債券 | 4.5000 | 10,000 | 9,793 | 954,866 | 2028/09/06 |
| 小 計 | — | — | 447,000 | 382,567 | 37,300,370 | — |
| (ニュージーランド) | | % | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | |
| NEW ZEALAND 4.5 04/15/27 | 国債証券 | 4.5000 | 8,000 | 7,859 | 704,648 | 2027/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 8,722 | 781,945 | 2033/04/14 |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 8,242 | 738,927 | 2037/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.0 04/20/29 | 国債証券 | 3.0000 | 7,500 | 6,761 | 606,208 | 2029/04/20 |

| 銘柄 | 2023 年 11 月 6 日 現 在 | | | | | |
|--|---------------------|--------|--------------|--------------|-------------|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ニュージーランド) | | % | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 6,886 | 617,355 | 2051/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国債証券 | 1.7500 | 21,000 | 12,320 | 1,104,535 | 2041/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31 | 国債証券 | 1.5000 | 10,000 | 7,714 | 691,560 | 2031/05/15 |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32 | 国債証券 | 2.0000 | 10,000 | 7,814 | 700,553 | 2032/05/15 |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 2,000 | 1,615 | 144,803 | 2028/05/15 |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25 | 地方債証券 | 2.7500 | 8,000 | 7,678 | 688,382 | 2025/04/15 |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28 | 地方債証券 | 2.2500 | 10,000 | 8,696 | 779,618 | 2028/05/15 |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 4.5 05/15/30 | 地方債証券 | 4.5000 | 7,000 | 6,539 | 586,286 | 2030/05/15 |
| HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30 | 特殊債券 | 2.1830 | 6,000 | 4,893 | 438,661 | 2030/04/24 |
| KOMBANK 4.0 08/20/25 | 特殊債券 | 4.0000 | 12,000 | 11,685 | 1,047,639 | 2025/08/20 |
| 小 計 | — | — | 133,500 | 107,430 | 9,631,124 | — |
| (ノルウェー) | | % | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| NORWAY 1.5 02/19/26 | 国債証券 | 1.5000 | 120,000 | 113,823 | 1,542,309 | 2026/02/19 |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 72,000 | 67,435 | 913,746 | 2027/02/17 |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | 1.7500 | 110,000 | 106,674 | 1,445,437 | 2025/03/13 |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 80,000 | 74,178 | 1,005,117 | 2028/04/26 |
| NORWAY 2.125 05/18/32 | 国債証券 | 2.1250 | 70,000 | 61,691 | 835,916 | 2032/05/18 |
| NORWAY 1.375 08/19/30 | 国債証券 | 1.3750 | 85,000 | 73,119 | 990,763 | 2030/08/19 |
| NORWAY 3.0 08/15/33 | 国債証券 | 3.0000 | 60,000 | 56,163 | 761,008 | 2033/08/15 |
| NORWAY 1.75 09/06/29 | 国債証券 | 1.7500 | 70,000 | 62,791 | 850,823 | 2029/09/06 |
| NORWAY 1.25 09/17/31 | 国債証券 | 1.2500 | 85,000 | 70,695 | 957,927 | 2031/09/17 |
| 小 計 | — | — | 752,000 | 686,572 | 9,303,051 | — |
| 合 計 | — | — | — | — | 93,987,419 | — |

■投資信託財産の構成

2023年11月6日現在

| 項 目 | 第 35 作 成 期 末 | |
|------------------------------|--------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| D I A M S R I ・ マザーファンド | 984,537 | 49.2 |
| D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド | 960,110 | 48.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 55,630 | 2.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 2,000,278 | 100.0 |

(注1) 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。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2023年11月6日現在、D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンドは95,347,745千円、96.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2023年11月6日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=109.54円、1オーストラリア・ドル=97.50円、1ニュージーランド・ドル=89.65円、1ノルウェー・クローネ=13.55円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年7月5日)、 (2023年9月5日)、 (2023年11月6日)現在

| 項 目 | 第 102 期 末 | 第 103 期 末 | 第 104 期 末 |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| (A) 資 産 | 1,928,966,395円 | 1,970,660,279円 | 2,000,278,384円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 45,223,193 | 49,951,754 | 55,630,246 |
| D I A M S R I ・ マザーファンド(評価額) | 949,606,775 | 985,474,904 | 984,537,175 |
| D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド(評価額) | 934,136,427 | 935,233,621 | 960,110,963 |
| (B) 負 債 | 20,974,061 | 11,760,035 | 14,007,608 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 6,841,579 | 7,007,962 | 7,119,739 |
| 未 払 解 約 金 | 9,805,399 | — | 1,984,304 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 4,316,593 | 4,740,550 | 4,891,672 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 10,490 | 11,523 | 11,893 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 1,907,992,334 | 1,958,900,244 | 1,986,270,776 |
| 元 本 | 1,710,394,818 | 1,751,990,518 | 1,779,934,985 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 197,597,516 | 206,909,726 | 206,335,791 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,710,394,818口 | 1,751,990,518口 | 1,779,934,985口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 11,155円 | 11,181円 | 11,159円 |

(注) 第101期末における元本額は1,710,048,364円、当作成期間(第102期~第104期)中における追加設定元本額は203,516,463円、同解約元本額は133,629,842円です。

■損益の状況

[自 2023年5月9日]
至 2023年7月5日]

[自 2023年7月6日]
至 2023年9月5日]

[自 2023年9月6日]
至 2023年11月6日]

| 項 目 | 第 102 期 | 第 103 期 | 第 104 期 |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △4,391円 | △4,313円 | △2,672円 |
| 受 取 利 息 | 161 | 142 | 106 |
| 支 払 利 息 | △4,552 | △4,455 | △2,778 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 140,257,994 | 17,956,297 | 9,480,943 |
| 売 買 益 | 142,497,428 | 36,689,422 | 10,355,575 |
| 売 買 損 | △2,239,434 | △18,733,125 | △874,632 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △4,327,083 | △4,752,073 | △4,903,565 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 135,926,520 | 13,199,911 | 4,574,706 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 154,528,943 | 277,422,552 | 278,691,184 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △86,016,368 | △76,704,775 | △69,810,360 |
| (配 当 等 相 当 額) | (221,471,489) | (240,002,484) | (253,333,416) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△307,487,857) | (△316,707,259) | (△323,143,776) |
| (G) 合 計(D + E + F) | 204,439,095 | 213,917,688 | 213,455,530 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △6,841,579 | △7,007,962 | △7,119,739 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G + H) | 197,597,516 | 206,909,726 | 206,335,791 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △86,016,368 | △76,704,775 | △69,810,360 |
| (配 当 等 相 当 額) | (221,526,503) | (240,057,746) | (253,438,485) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△307,542,871) | (△316,762,521) | (△323,248,845) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 283,613,884 | 283,614,501 | 280,350,537 |
| 繰 越 損 益 金 | — | — | △4,204,386 |

(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 102 期 | 第 103 期 | 第 104 期 |
|----------------------------|-------------|-------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 5,088,887円 | 3,434,870円 | 8,779,092円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 107,045,790 | 9,765,041 | 0 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 221,526,503 | 240,057,746 | 253,438,485 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 178,320,786 | 277,422,552 | 278,691,184 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d) | 511,981,966 | 530,680,209 | 540,908,761 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額 | 2,993.36 | 3,029.01 | 3,038.92 |
| (g) 分 配 金 | 6,841,579 | 7,007,962 | 7,119,739 |
| (h) 1万口当たり分配金 | 40 | 40 | 40 |

■分配金のお知らせ

| 決 算 期 | 第 102 期 | 第 103 期 | 第 104 期 |
|------------|---------|---------|---------|
| 1 万口当たり分配金 | 40円 | 40円 | 40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 SRI・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2023年6月5日）

（計算期間 2022年6月7日～2023年6月5日）

DIAM SRI・マザーファンドの第18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 | 2005年12月22日から無期限です。 |
| 運用方針 | 信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の上場株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 東証株価指数 | | 株式組入率 比 | 株式先物率 比 | 純資産額 |
|----------------|--------|-------|-------------------|------------|------------|------------|------------|
| | 円 | 騰落率 | (TOPIX) ベンチマーク | 騰落率 | | | |
| 14期（2019年6月5日） | 13,314 | △12.2 | ポイント 1,530.08 | % △13.8 | % 92.0 | % - | 百万円 851 |
| 15期（2020年6月5日） | 15,010 | 12.7 | 1,612.48 | 5.4 | 96.7 | - | 893 |
| 16期（2021年6月7日） | 19,433 | 29.5 | 1,960.85 | 21.6 | 96.1 | - | 844 |
| 17期（2022年6月6日） | 19,931 | 2.6 | 1,939.11 | △1.1 | 93.3 | - | 796 |
| 18期（2023年6月5日） | 23,295 | 16.9 | 2,219.79 | 14.5 | 96.1 | - | 910 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

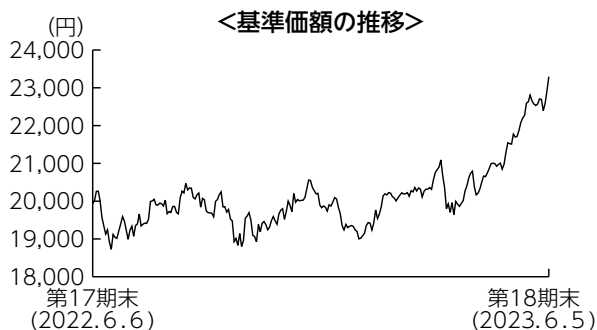
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東 証 株 価 指 数 (TOPIX) (ベンチマーク) | | 株 式 組 入 率 比 | 株 式 先 物 率 比 |
|----------------------|---------|------------|------------------------------------|------------|----------------|----------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | ポ イ ン ト | 騰 落 率 % | | |
| (期 首) 2022年 6月 6日 | 19,931 | — | 1,939.11 | — | 93.3 | — |
| 6 月 末 | 19,236 | △3.5 | 1,870.82 | △3.5 | 93.0 | — |
| 7 月 末 | 19,871 | △0.3 | 1,940.31 | 0.1 | 97.1 | — |
| 8 月 末 | 20,038 | 0.5 | 1,963.16 | 1.2 | 97.0 | — |
| 9 月 末 | 18,802 | △5.7 | 1,835.94 | △5.3 | 96.1 | — |
| 10 月 末 | 19,664 | △1.3 | 1,929.43 | △0.5 | 96.2 | — |
| 11 月 末 | 20,194 | 1.3 | 1,985.57 | 2.4 | 96.2 | — |
| 12 月 末 | 19,200 | △3.7 | 1,891.71 | △2.4 | 97.0 | — |
| 2023年 1 月 末 | 20,121 | 1.0 | 1,975.27 | 1.9 | 97.1 | — |
| 2 月 末 | 20,320 | 2.0 | 1,993.28 | 2.8 | 97.0 | — |
| 3 月 末 | 20,615 | 3.4 | 2,003.50 | 3.3 | 96.0 | — |
| 4 月 末 | 21,291 | 6.8 | 2,057.48 | 6.1 | 95.9 | — |
| 5 月 末 | 22,392 | 12.3 | 2,130.63 | 9.9 | 95.9 | — |
| (期 末) 2023年 6月 5日 | 23,295 | 16.9 | 2,219.79 | 14.5 | 96.1 | — |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年6月7日から2023年6月5日まで）

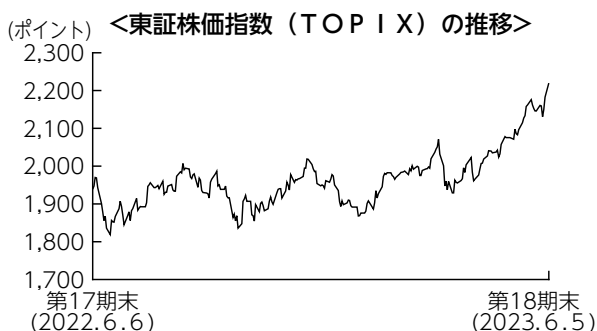


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,295円となり、前期末比で16.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

CSR（企業の社会責任）への取り組みに着目して、持続的な成長が期待できる銘柄に投資しました。物価・金利の上昇や内外景気の減速など、外部環境の変化によらず着実に利益を積み上げた銘柄が上昇する一方、外部環境への感応度が高い銘柄は低調に推移しました。第一三共、ダイキン工業、三井住友フィナンシャルグループといった銘柄がプラスに寄与する一方、東京エレクトロン、野村総合研究所、三井不動産といった銘柄がマイナスに影響しました。



投資環境

国内株式市場は、期の前半は米国の金融政策への思惑から乱高下する展開となりました。各種経済指標が発表されるたび、FRB（米連邦準備理事会）による金融引き締め姿勢の継続性に焦点があたり、株価も一進一退となりました。期の後半は、世界的な景気後退が懸念される中、米著名投資家が日本への投資を表明したことや、東証のPBR（株価純資産倍率）改革を契機とした日本企業の還元強化の流れなどから、日本の相対優位性が意識され、株価は上昇しました。

ポートフォリオについて

CSR評価の高い企業のうち、足元の業績が堅調な銘柄、業績が今後回復に向かうと予想される製造業を中心とした銘柄、モバイルワークや電動化シフトのビジネス拡大などで中期成長性が高い銘柄、予想PER（株価収益率）など株価バリュエーションに割安感がある銘柄、株主還元積極的に銘柄などを選別してポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で14.5%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを2.4%上回りました。ベンチマークと比べてパフォーマンスの良かった医薬品、機械などの銘柄を保有していたことがプラスに寄与しました。

今後の運用方針

組入銘柄は、C S R 評価の高い企業のうち、業績が堅調もしくは今後回復に向かい市場予想を上回ると予想される銘柄、今期の業績伸び率が高いと予想される銘柄、中期成長性の高い製品群を有する銘柄、今期 P E R など株価バリュエーションに割安感がある銘柄、キャッシュフローの状況などから株主還元への期待度が高いと推測される銘柄などに引き続き注目して投資します。

■ 1 万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------------|-----------|-------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 7円 (7) | 0.033% (0.033) | (a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| 合 計 | 7 | 0.033 | |
| 期中の平均基準価額は20,106円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■ 売買及び取引の状況 (2022年6月7日から2023年6月5日まで)

株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---------|--|----------------|----------------|------|---------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 上 場 | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 98.9 (14.7) | 259,622 (-) | 97.1 | 246,430 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-----------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 506,053千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 800,439千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b) | 0.63 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年6月7日から2023年6月5日まで）

(1) 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 |
| 株 式 | 百万円 259 | 百万円 23 | % 8.9 | 百万円 246 | 百万円 23 | % 9.4 |
| 金 銭 信 託 | 0.002 | 0.002 | 100.0 | 0.002 | 0.002 | 100.0 |

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 274千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 25千円 |
| (B)／(A) | 9.3% |

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、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-----|--------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 鉱業 (0.7%) | | | | |
| INPEX | 4 | 3.7 | 5,762 | |
| 建設業 (2.1%) | | | | |
| 五洋建設 | 4.5 | — | — | |
| 住友林業 | — | 1.4 | 4,477 | |
| 大気社 | — | 1.7 | 6,443 | |
| インフロニア・ホールディングス | 6 | 6 | 7,773 | |
| 食料品 (3.1%) | | | | |
| 日清製粉グループ本社 | — | 2.9 | 5,188 | |
| 森永乳業 | 1.5 | 1 | 5,074 | |
| 日清オイリオグループ | — | 1 | 3,365 | |
| 味の素 | — | 0.3 | 1,698 | |
| ニチレイ | 3 | 3.9 | 11,965 | |
| 化学 (8.9%) | | | | |
| クレハ | — | 0.6 | 5,064 | |
| 信越化学工業 | 0.5 | 2.5 | 11,317 | |
| 三井化学 | 2 | 2.4 | 8,908 | |
| J S R | 1.4 | 1.4 | 4,729 | |
| 三菱ケミカルグループ | 7 | 6.7 | 5,429 | |
| ADEKA | 4 | 5 | 12,692 | |
| 花王 | 0.9 | — | — | |
| 富士フィルムホールディングス | 1.8 | 2.1 | 18,494 | |
| ユニ・チャーム | 1.6 | 2 | 11,064 | |
| 医薬品 (6.4%) | | | | |
| アステラス製薬 | 3 | 6.3 | 14,411 | |
| 塩野義製薬 | 1.3 | 1.3 | 8,297 | |
| 日本新薬 | 0.3 | — | — | |
| 中外製薬 | 2.2 | 2.6 | 10,199 | |
| ロート製薬 | 0.9 | 1 | 3,082 | |
| 参天製薬 | 3.7 | 3.4 | 4,403 | |
| 第一三共 | 3.9 | 3.2 | 15,388 | |
| ゴム製品 (0.7%) | | | | |
| 横浜ゴム | — | 2.1 | 6,415 | |
| TOYO TIRE | 3.4 | — | — | |
| ガラス・土石製品 (0.4%) | | | | |
| ニチアス | 3.1 | 1.1 | 3,080 | |
| 鉄鋼 (1.1%) | | | | |
| 日本製鉄 | 2.7 | 3.5 | 9,999 | |
| 非鉄金属 (1.0%) | | | | |
| 三井金属鉱業 | 1.5 | 0.8 | 2,547 | |
| 住友電気工業 | — | 3.5 | 5,941 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|------|--------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| フジクラ | 7.5 | — | — | |
| 機械 (5.7%) | | | | |
| 小松製作所 | 1.5 | 2.2 | 7,741 | |
| 荏原製作所 | 0.4 | 0.8 | 5,232 | |
| ダイキン工業 | 0.8 | 0.7 | 20,240 | |
| ダイフク | 0.3 | — | — | |
| THK | 3.8 | 4.2 | 12,944 | |
| キッツ | — | 3.1 | 3,298 | |
| 電気機器 (20.2%) | | | | |
| イビデン | — | 1 | 7,548 | |
| 日立製作所 | 3.9 | 3.3 | 28,224 | |
| 安川電機 | 1.3 | 1.3 | 8,318 | |
| ニデック | 1 | — | — | |
| オムロン | 2.1 | 1.5 | 13,462 | |
| 日本電気 | 1.4 | 2.1 | 14,382 | |
| アンリツ | 5 | — | — | |
| ソニーグループ | 2.6 | 3.2 | 44,352 | |
| TDK | 2.7 | 3.1 | 17,139 | |
| 横河電機 | 4 | — | — | |
| アズビル | 0.9 | — | — | |
| ローム | 0.3 | 0.5 | 6,090 | |
| 太陽誘電 | 0.8 | 1.3 | 5,873 | |
| 村田製作所 | — | 0.9 | 7,678 | |
| 東京エレフロン | 0.4 | 1.2 | 23,304 | |
| 輸送用機器 (7.9%) | | | | |
| デンソー | 1.2 | 1.7 | 15,493 | |
| トヨタ自動車 | 11.4 | 15.2 | 30,833 | |
| 本田技研工業 | 4.8 | 5.5 | 23,017 | |
| 精密機器 (3.2%) | | | | |
| テルモ | 3 | 4 | 17,776 | |
| 島津製作所 | 1.7 | 0.5 | 2,252 | |
| ニコン | — | 2.4 | 3,829 | |
| オリンパス | 3 | — | — | |
| 朝日インテック | — | 1.4 | 4,020 | |
| その他製品 (2.9%) | | | | |
| ヤマハ | 0.8 | — | — | |
| リンテック | — | 1.2 | 2,703 | |
| 任天堂 | 0.4 | 3.7 | 22,507 | |
| 陸運業 (2.4%) | | | | |
| 東急 | 2.2 | 2.8 | 5,105 | |
| 東日本旅客鉄道 | 0.5 | 0.5 | 3,902 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|-------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 西日本旅客鉄道 | 0.6 | 0.8 | 4,719 |
| S Gホールディングス | 2.4 | 3.5 | 7,458 |
| 空運業 (0.7%) | | | |
| 日本航空 | — | 2.1 | 5,771 |
| 情報・通信業 (7.6%) | | | |
| NECネットエスアイ | 2.1 | 3.1 | 6,088 |
| 野村総合研究所 | 2.9 | 4 | 14,628 |
| Zホールディングス | 11 | 15.3 | 5,494 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 2.5 | 2.5 | 9,355 |
| 日本電信電話 | 3.4 | 3.7 | 15,036 |
| KDDI | 2.2 | 2.8 | 12,297 |
| SCSK | 3.6 | — | — |
| ソフトバンクグループ | 0.6 | 0.6 | 3,613 |
| 卸売業 (5.0%) | | | |
| 伊藤忠商事 | 3 | 3.4 | 17,190 |
| 丸紅 | 3 | 4.5 | 9,427 |
| 三菱商事 | 2.6 | 2.8 | 16,763 |
| 小売業 (2.4%) | | | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 3.5 | 3.5 | 21,045 |
| 丸井グループ | 2 | — | — |
| 銀行業 (5.6%) | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 25.6 | 29.8 | 29,060 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 3.2 | 3.5 | 20,223 |
| 証券・商品先物取引業 (0.7%) | | | |
| 野村ホールディングス | 15 | 11.2 | 5,729 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|----------------------|------------|-------|--------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 保険業 (3.3%) | | | | |
| 第一生命ホールディングス | 3 | 2.6 | 6,596 | |
| 東京海上ホールディングス | 2.1 | 7 | 22,491 | |
| その他金融業 (1.9%) | | | | |
| オリックス | 6.4 | 6.8 | 16,823 | |
| 不動産業 (2.9%) | | | | |
| 三井不動産 | 4.4 | 5.3 | 14,932 | |
| 三菱地所 | 4 | — | — | |
| イオンモール | 5 | 6 | 10,809 | |
| サービス業 (3.2%) | | | | |
| 日本工営 | 1.5 | 2.6 | 9,633 | |
| アウトソーシング | 5 | — | — | |
| エスプール | — | 3.2 | 1,875 | |
| オリエンタルランド | 0.4 | 2.1 | 11,314 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 3 | — | — | |
| セコム | 0.4 | — | — | |
| イオンディライト | 2.4 | 1.8 | 5,427 | |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 260.7 | 277.2 | 874,293 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 83銘柄 | 81銘柄 | <96.1%> |

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

■投資信託財産の構成

2023年6月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 874,293千円 | 95.3% |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 43,568 | 4.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 917,862 | 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6月5日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 917,862,617円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 27,764,033 |
| 株 式(評価額) | 874,293,870 |
| 未 収 入 金 | 8,095,846 |
| 未 収 配 当 金 | 7,708,868 |
| (B) 負 債 | 7,684,008 |
| 未 払 金 | 7,684,008 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 910,178,609 |
| 元 本 | 390,720,365 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 519,458,244 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 390,720,365口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 23,295円 |

(注1) 期首元本額 399,830,635円
追加設定元本額 25,409,336円
一部解約元本額 34,519,606円

(注2) 期末における元本の内訳 390,720,365円
自然環境保護ファンド 390,720,365円
期末元本合計

■損益の状況

当期 自2022年6月7日 至2023年6月5日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 20,791,681円 |
| 受 取 配 当 金 | 20,799,748 |
| 受 取 利 息 | 280 |
| そ の 他 収 益 金 | 3,844 |
| 支 払 利 息 | △12,191 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 117,468,353 |
| 売 買 益 | 136,184,797 |
| 売 買 損 | △18,716,444 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | 138,260,034 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 397,087,940 |
| (E) 解 約 差 損 益 金 | △40,480,394 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 24,590,664 |
| (G) 合 計(C+D+E+F) | 519,458,244 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 519,458,244 |

(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。

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2023年6月5日）

（計算期間 2022年6月7日～2023年6月5日）

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドの第20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 | 2003年7月15日から無期限です。 |
| 運用方針 | 信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 高格付資源国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、転換社債の転換、新株予約権の行使等により取得するものに限り、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | 債 券 組 入 率 比 | 債 券 先 物 率 比 | 純 資 産 額 |
|----------------|---------|------|----------------|----------------|---------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| 16期（2019年6月5日） | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 17期（2020年6月5日） | 21,536 | 0.2 | 96.5 | — | 156,810 |
| 18期（2021年6月7日） | 22,639 | 5.1 | 98.5 | — | 137,252 |
| 19期（2022年6月6日） | 25,062 | 10.7 | 98.0 | — | 125,601 |
| 20期（2023年6月5日） | 25,405 | 1.4 | 98.0 | — | 112,677 |
| | 25,346 | △0.2 | 98.7 | — | 98,072 |

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドは高格付資源国の公社債を投資対象としており、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

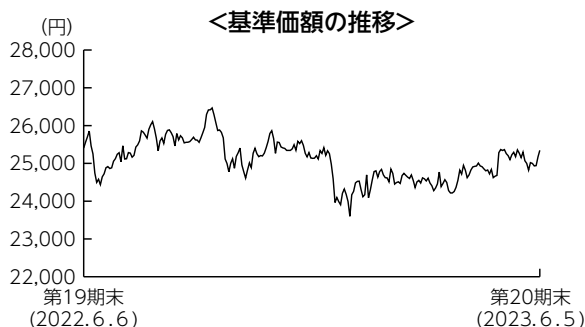
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 債 券 組 入 率 | 債 券 先 物 率 |
|------------------------|-------------|--------|---|-----------|-----------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (期 首) 2022年 6 月 6 日 | 円 25,405 | % - | | % 98.0 | % - |
| 6 月 末 | 25,242 | △0.6 | | 98.8 | - |
| 7 月 末 | 25,915 | 2.0 | | 97.8 | - |
| 8 月 末 | 25,621 | 0.9 | | 98.1 | - |
| 9 月 末 | 25,121 | △1.1 | | 97.6 | - |
| 10 月 末 | 25,791 | 1.5 | | 97.8 | - |
| 11 月 末 | 25,171 | △0.9 | | 97.2 | - |
| 12 月 末 | 23,991 | △5.6 | | 97.7 | - |
| 2023年 1 月 末 | 24,695 | △2.8 | | 98.1 | - |
| 2 月 末 | 24,550 | △3.4 | | 98.0 | - |
| 3 月 末 | 24,818 | △2.3 | | 98.4 | - |
| 4 月 末 | 24,681 | △2.8 | | 98.3 | - |
| 5 月 末 | 24,932 | △1.9 | | 98.8 | - |
| (期 末) 2023年 6 月 5 日 | 25,346 | △0.2 | | 98.7 | - |

(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6月7日から2023年6月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は25,346円となり、前期末比で0.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

主要国や投資国の政策金利の引き上げにより国債利回りが上昇（価格は下落）したものの、投資債券の金利収入が上回り、債券保有は基準価額にプラス寄与となりました。しかしながら、世界経済の下押しや、主要な資源消費国であり当ファンドの投資国の主要な輸出相手先である中国経済のコロナ禍からの回復期待が剥落したことなどを背景に、投資対象国の通貨の多くが対円で下落しました。この結果、投資対象国の通貨の下落を主因に基準価額は下落しました。

投資環境

外国債券市場では、いずれの投資対象国でも10年国債利回りが上昇しました。主要国および投資対象国でインフレが中央銀行の目標を大きく上回っていることで、各国が政策金利の引き上げを進めたことなどが、利回りの上昇要因となりました。期後半には多くの国でインフレの鈍化が見られたことや、高金利による景気下押しが意識されることで利回りが低下（価格は上昇）する場面もありましたが、堅調な景気指標などが利回り上昇の要因となり、揉み合いの動きとなりました。

為替市場では、カナダドルを除く投資対象国の通貨が対円で下落しました。期初は日銀が緩和的な金融政策を堅持する中で、米国がインフレ高進から積極的な利上げを進めたことなどを背景に米ドル高円安が進み、投資対象国の通貨の対円での動きも堅調でした。しかしながら、期中に米国のインフレが鈍化したことや日銀による金融緩和策の見直し、高金利による世界経済の減速懸念や中国経済の回復期待剥落などが、投資対象国の通貨の下押し要因となったことで、多くの投資通貨が対円で下落しました。

ポートフォリオについて

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション*については、投資対象国および世界経済見通し、主要国および投資対象国のインフレ動向や金融政策を勘案して、調整を行いました。当期末のデュレーションは、投資対象国の中央銀行が積極的な利上げを進めたため、インフレがピークアウトに向かうとの判断から、前期末と比較して長期化しました。

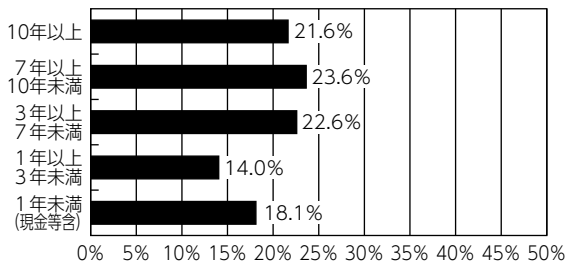
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

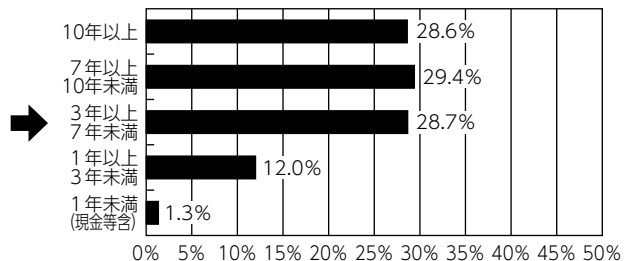
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

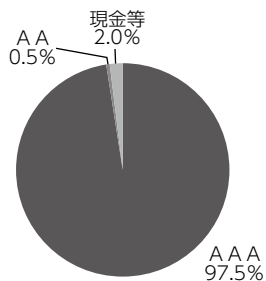


期末

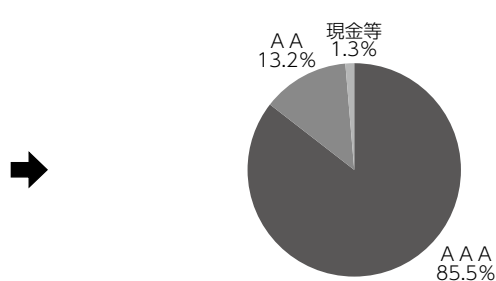


○格付別構成比

期首 (前期末)

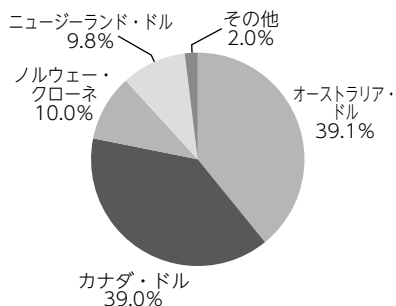


期末

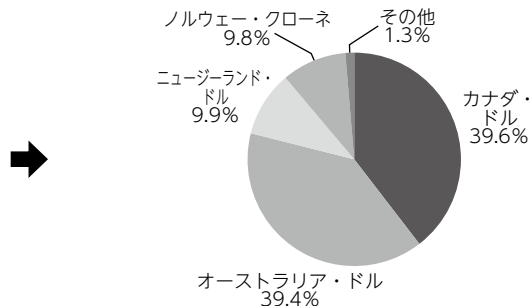


○通貨別構成比

期首 (前期末)



期末

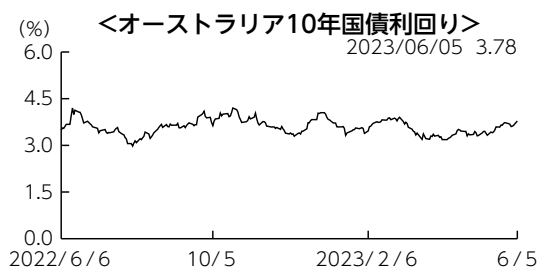
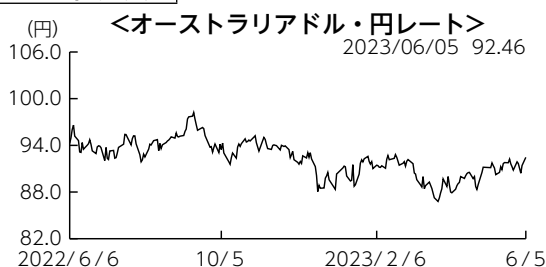


【各国の為替・金利動向】

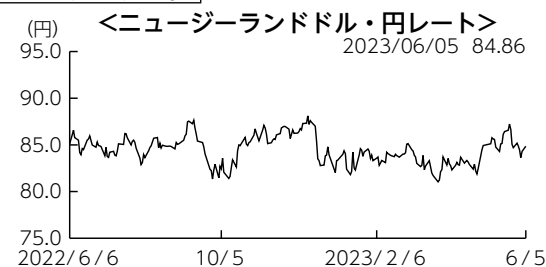
カナダ



オーストラリア



ニュージーランド



ノルウェー



今後の運用方針

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。デフレーションについては、主要国および投資国の中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------------|-----|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) | 2円 | 0.009% | (a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | |
| 合 計 | 2 | 0.009 | |
| 期中の平均基準価額は25,072円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■売買及び取引の状況 (2022年6月7日から2023年6月5日まで)
公社債

| | | | 買付額 | 売付額 |
|---|----------|-------|------------------------|------------------------------------|
| 外 | カナダ | 国債証券 | 千カナダ・ドル 414,865 | 千カナダ・ドル 484,596 (63,000) |
| | | 地方債証券 | 112,047 | 15,292 (-) |
| | | 特殊債証券 | - | 9,474 (-) |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル 332,967 | 千オーストラリア・ドル 348,408 (58,000) |
| | | 地方債証券 | 93,319 | 49,469 (-) |
| | | 特殊債証券 | 80,555 | 97,946 (-) |
| 国 | ニュージーランド | 国債証券 | 千ニュージーランド・ドル 20,094 | 千ニュージーランド・ドル 14,424 (-) |
| | | 地方債証券 | - | 18,223 (-) |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ 425,918 | 千ノルウェー・クローネ 464,728 (-) |

(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 (2022年6月7日から2023年6月5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 |
| 金銭信託 | 百万円 0.024 | 百万円 0.024 | % 100.0 | 百万円 0.024 | 百万円 0.024 | % 100.0 |

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、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|----------|--------------------------|--------------------------|------------------|-----------|--------------------|-----------|-----------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 402,200 | 千カナダ・ドル 371,654 | 千円 38,789,621 | % 39.6 | % - | % 29.5 | % 10.0 | % - |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 465,000 | 千オーストラリア・ドル 417,727 | 千円 38,623,044 | 39.4 | - | 34.6 | 4.7 | - |
| ニュージーランド | 千ニューージーランド・ドル 134,500 | 千ニューージーランド・ドル 114,578 | 千円 9,723,122 | 9.9 | - | 6.6 | 2.7 | 0.7 |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 817,000 | 千ノルウェー・クローネ 756,781 | 千円 9,626,262 | 9.8 | - | 5.0 | 3.5 | 1.4 |
| 合 計 | - | - | 千円 96,762,051 | 98.7 | - | 75.7 | 20.9 | 2.0 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 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

外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|---|-------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (カナダ) | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CANADA 0.25 03/01/26 | 国債証券 | 0.2500 | 25,000 | 22,645 | 2,363,532 | 2026/03/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 20,900 | 25,330 | 2,643,718 | 2033/06/01 |
| CANADA 5.00 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 7,300 | 8,727 | 910,854 | 2037/06/01 |
| CANADA 4.00 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 5,000 | 5,514 | 575,525 | 2041/06/01 |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 32,000 | 28,000 | 2,922,408 | 2030/06/01 |
| CANADA 1.50 06/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 22,000 | 19,299 | 2,014,338 | 2031/06/01 |
| CANADA 0.50 09/01/25 | 国債証券 | 0.5000 | 15,000 | 13,851 | 1,445,707 | 2025/09/01 |
| CANADA 2.75 09/01/27 | 国債証券 | 2.7500 | 45,000 | 43,566 | 4,547,018 | 2027/09/01 |
| CANADA 3.50 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 12,000 | 12,542 | 1,309,027 | 2045/12/01 |
| CANADA 2.00 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 37,000 | 28,894 | 3,015,716 | 2051/12/01 |
| CANADA 1.75 12/01/53 | 国債証券 | 1.7500 | 4,000 | 2,904 | 303,144 | 2053/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 5,000 | 4,521 | 471,861 | 2064/12/01 |
| CANADA 1.50 12/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 35,000 | 30,483 | 3,181,551 | 2031/12/01 |
| BRITISH COLUMBIA PROVINCE 3.20 06/18/32 | 地方債証券 | 3.2000 | 10,000 | 9,441 | 985,431 | 2032/06/18 |
| PROVINCE OF QUEBEC 2.75 09/01/28 | 地方債証券 | 2.7500 | 50,000 | 47,426 | 4,949,938 | 2028/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.90 09/01/30 | 地方債証券 | 1.9000 | 30,000 | 26,320 | 2,747,057 | 2030/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.25 09/01/32 | 地方債証券 | 3.2500 | 12,000 | 11,359 | 1,185,576 | 2032/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.50 09/01/31 | 地方債証券 | 1.5000 | 20,000 | 16,639 | 1,736,646 | 2031/09/01 |
| CANHOU 1.95 12/15/25 | 特殊債券 | 1.9500 | 15,000 | 14,185 | 1,480,568 | 2025/12/15 |
| 小 計 | - | - | 402,200 | 371,654 | 38,789,621 | - |

| 銘 | 柄 | 当 期 | | | | | 末 | |
|---|-------|--------|---------|--------------|--------------|-------------|-----------|--|
| | | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (オーストラリア) | | | % | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47 | 国債証券 | 3.0000 | 13,000 | 10,828 | 1,001,182 | 2047/03/21 | | |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 5,000 | 5,239 | 484,471 | 2027/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 13,000 | 12,848 | 1,187,973 | 2029/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 18,000 | 17,794 | 1,645,244 | 2037/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 15,000 | 14,144 | 1,307,777 | 2028/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 23,000 | 21,542 | 1,991,785 | 2030/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 24,000 | 20,059 | 1,854,721 | 2041/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 11,000 | 9,010 | 833,100 | 2032/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34 | 国債証券 | 3.7500 | 25,000 | 25,154 | 2,325,747 | 2034/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 10,000 | 9,150 | 846,033 | 2039/06/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 9,937 | 918,865 | 2035/06/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 国債証券 | 1.7500 | 17,000 | 10,176 | 940,891 | 2051/06/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 3,000 | 2,857 | 264,190 | 2029/11/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33 | 国債証券 | 3.0000 | 58,000 | 54,674 | 5,055,237 | 2033/11/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31 | 国債証券 | 1.0000 | 50,000 | 40,541 | 3,748,494 | 2031/11/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 国債証券 | 1.0000 | 17,000 | 14,133 | 1,306,751 | 2030/12/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 9,799 | 906,046 | 2034/12/21 | | |
| NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36 | 地方債証券 | 4.2500 | 14,000 | 13,455 | 1,244,067 | 2036/02/20 | | |
| NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29 | 地方債証券 | 3.0000 | 23,000 | 21,880 | 2,023,039 | 2029/04/20 | | |
| SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32 | 地方債証券 | 1.7500 | 6,500 | 5,287 | 488,877 | 2032/05/24 | | |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26 | 地方債証券 | 3.7000 | 11,000 | 10,818 | 1,000,292 | 2026/05/20 | | |
| AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30 | 地方債証券 | 1.7500 | 4,000 | 3,442 | 318,304 | 2030/05/17 | | |
| AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 16,000 | 13,814 | 1,277,289 | 2032/10/22 | | |
| TREASURY CORP VICTORIA 2.25 11/20/34 | 地方債証券 | 2.2500 | 11,000 | 8,677 | 802,292 | 2034/11/20 | | |
| NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 15,000 | 12,894 | 1,192,227 | 2032/11/22 | | |
| KOMBNK 4.35 01/18/28 | 特殊債券 | 4.3500 | 10,000 | 10,049 | 929,178 | 2028/01/18 | | |
| KOMBNK 4.4 02/17/26 | 特殊債券 | 4.4000 | 10,000 | 10,054 | 929,645 | 2026/02/17 | | |
| NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36 | 特殊債券 | 2.3350 | 4,500 | 3,601 | 333,009 | 2036/06/30 | | |
| EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31 | 特殊債券 | 1.4650 | 7,000 | 5,674 | 524,651 | 2031/08/18 | | |
| EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28 | 特殊債券 | 4.5000 | 10,000 | 10,184 | 941,652 | 2028/09/06 | | |
| 小 計 | - | - | 465,000 | 417,727 | 38,623,044 | - | | |
| (ニュージーランド) | | | % | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | | |
| NEW ZEALAND 4.5 04/15/27 | 国債証券 | 4.5000 | 8,000 | 8,047 | 682,914 | 2027/04/15 | | |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 9,340 | 792,655 | 2033/04/14 | | |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 9,063 | 769,098 | 2037/04/15 | | |
| NEW ZEALAND 3.0 04/20/29 | 国債証券 | 3.0000 | 8,500 | 7,944 | 674,211 | 2029/04/20 | | |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 8,048 | 682,995 | 2051/05/15 | | |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国債証券 | 1.7500 | 21,000 | 13,841 | 1,174,589 | 2041/05/15 | | |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31 | 国債証券 | 1.5000 | 10,000 | 8,082 | 685,838 | 2031/05/15 | | |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32 | 国債証券 | 2.0000 | 10,000 | 8,307 | 705,001 | 2032/05/15 | | |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 2,000 | 1,645 | 139,675 | 2028/05/15 | | |
| NEW ZEALAND 0.5 05/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 1,000 | 892 | 75,737 | 2026/05/15 | | |
| NEW ZEALAND 4.5 05/15/30 | 国債証券 | 4.5000 | 6,000 | 6,084 | 516,298 | 2030/05/15 | | |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25 | 地方債証券 | 2.7500 | 8,000 | 7,644 | 648,744 | 2025/04/15 | | |

| 銘 | 柄 | 当 | | | | 期 | | 末 | | |
|-------------------|--|---|---|---|---|--------|---------|---------|------------|------------|
| | | 種 | 類 | 利 | 率 | 額 | 評 | | 償 | |
| | | | | | | | 面 | 額 | | 外 |
| | | | | | | | | | | |
| (ニュージーランド) | | | | % | 千 | 千 | 千 | | | |
| | NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28 | 地 | 方 | 証 | 券 | 2.2500 | 10,000 | 8,875 | 753,133 | 2028/05/15 |
| | HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30 | 特 | 殊 | 債 | 券 | 2.1830 | 6,000 | 5,077 | 430,848 | 2030/04/24 |
| | KOMBANK 4.0 08/20/25 | 特 | 殊 | 債 | 券 | 4.0000 | 12,000 | 11,682 | 991,380 | 2025/08/20 |
| 小 | 計 | — | — | — | — | — | 134,500 | 114,578 | 9,723,122 | — |
| (ノルウェー) | | | | % | 千 | 千 | 千 | | | |
| | NORWAY 1.5 02/19/26 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.5000 | 120,000 | 114,268 | 1,453,493 | 2026/02/19 |
| | NORWAY 1.75 02/17/27 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 72,000 | 68,137 | 866,705 | 2027/02/17 |
| | NORWAY 1.75 03/13/25 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 110,000 | 106,785 | 1,358,308 | 2025/03/13 |
| | NORWAY 2.0 04/26/28 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.0000 | 90,000 | 84,802 | 1,078,687 | 2028/04/26 |
| | NORWAY 2.125 05/18/32 | 国 | 債 | 証 | 券 | 2.1250 | 70,000 | 63,358 | 805,915 | 2032/05/18 |
| | NORWAY 1.375 08/19/30 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.3750 | 95,000 | 83,226 | 1,058,643 | 2030/08/19 |
| | NORWAY 3.0 08/15/33 | 国 | 債 | 証 | 券 | 3.0000 | 80,000 | 77,288 | 983,103 | 2033/08/15 |
| | NORWAY 1.75 09/06/29 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.7500 | 95,000 | 86,693 | 1,102,737 | 2029/09/06 |
| | NORWAY 1.25 09/17/31 | 国 | 債 | 証 | 券 | 1.2500 | 85,000 | 72,222 | 918,668 | 2031/09/17 |
| 小 | 計 | — | — | — | — | — | 817,000 | 756,781 | 9,626,262 | — |
| 合 | 計 | — | — | — | — | — | — | — | 96,762,051 | — |

■投資信託財産の構成

2023年6月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 96,762,051 | 97.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,472,888 | 2.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 99,234,940 | 100.0 |

(注1) 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。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、97,802,718千円、98.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2023年6月5日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=104.37円、1オーストラリア・ドル=92.46円、1ニュージーランド・ドル=84.86円、1ノルウェー・クローネ=12.72円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月5日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 99,234,940,856円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 697,991,498 |
| 公 社 債(評価額) | 96,762,051,984 |
| 未 収 入 金 | 1,334,207,540 |
| 未 収 利 息 | 373,534,854 |
| 前 払 費 用 | 67,154,980 |
| (B) 負 債 | 1,162,831,119 |
| 未 払 金 | 948,281,119 |
| 未 払 解 約 金 | 214,550,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 98,072,109,737 |
| 元 本 | 38,692,608,704 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 59,379,501,033 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 38,692,608,704口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,346円 |

(注1) 期首元本額 44,353,039,204円

追加設定元本額 537,281,632円

一部解約元本額 6,197,712,132円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M高格付インカム・オープン (毎月決算コース) 34,913,146,384円

D I A M高格付インカム・オープン<DC年金> 1,007,340,121円

D I A M高格付インカム・オープン (1年決算コース) 462,635,207円

自然環境保護ファンド 346,653,026円

D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 696,339,655円

D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 233,775,095円

D I A M高格付インカム私募オープン (3ヵ月決算コース) (適格機関投資家向け)

865,533,935円

D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)

22,179,475円

D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)

145,005,806円

期末元本合計 38,692,608,704円

■損益の状況

当期 自2022年6月7日 至2023年6月5日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 2,651,486,811円 |
| 受 取 利 息 | 2,651,682,470 |
| そ の 他 収 益 金 | 18,872 |
| 支 払 利 息 | △214,531 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △3,041,851,942 |
| 売 買 損 益 | 1,129,503,241 |
| 売 買 損 益 | △4,171,355,183 |
| (C) そ の 他 費 用 | △9,481,246 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | △399,846,377 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 68,324,651,910 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △9,355,095,868 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 809,791,368 |
| (H) 合 計(D + E + F + G) | 59,379,501,033 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 59,379,501,033 |

(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) (F)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) (G)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。