

## 運用報告書 (全体版)

第15期<決算日2023年6月5日>

### DIAM高格付インカム・オープン (1年決算コース)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2008年9月29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	DIAM高格付インカム・オープン (1年決算コース)	DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド	高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンド受益証券への投資を通じて、高格付資源国の公社債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。実質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。	
組入制限	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。株主への投資は、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、実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。	
分配方針	決算日（原則として6月5日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）の中から、原則として、1万口当たり10円を限度として基準価額の水準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。

愛称：ハッピークローバー 1年

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM高格付インカム・オープン（1年決算コース）」は、2023年6月5日に第15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

<http://www.am-one.co.jp/>

## DIAM高格付インカム・オープン（1年決算コース）

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入率 債比	債券先物率 債比	純資産額 純総
	円	円	騰落率 %			
11期 (2019年6月5日)	12,437	0	△0.8	96.4	—	百万円 1,553
12期 (2020年6月5日)	12,940	0	4.0	98.4	—	1,548
13期 (2021年6月7日)	14,178	0	9.6	97.9	—	1,289
14期 (2022年6月6日)	14,220	0	0.3	97.9	—	1,229
15期 (2023年6月5日)	14,037	0	△1.3	98.6	—	1,173

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 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、コンセプトに合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4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

### ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
	円	騰落率 %		
(期首) 2022年6月6日	14,220	—	97.9	—
6月 末	14,119	△0.7	98.8	—
7月 末	14,483	1.8	97.9	—
8月 末	14,305	0.6	98.2	—
9月 末	14,013	△1.5	97.8	—
10月 末	14,375	1.1	98.1	—
11月 末	14,016	△1.4	97.6	—
12月 末	13,349	△6.1	97.7	—
2023年1月 末	13,727	△3.5	98.1	—
2月 末	13,635	△4.1	98.1	—
3月 末	13,771	△3.2	98.4	—
4月 末	13,685	△3.8	98.5	—
5月 末	13,810	△2.9	99.0	—
(期末) 2023年6月5日	14,037	△1.3	98.6	—

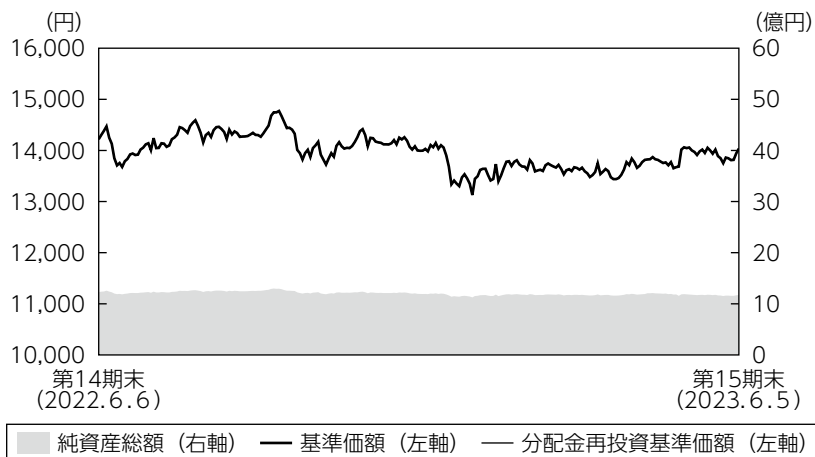
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「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) 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）

### 基準価額等の推移



第15期首： 14,220円  
第15期末： 14,037円  
(既払分配金0円)  
騰落率：  $\Delta 1.3\%$   
(分配金再投資ベース)

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

### 基準価額の主な変動要因

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。こうした中、信託報酬等の運用経費や投資対象国の通貨の下落を主因に基準価額が下落しました。

## 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

### ●当ファンド

D I AM高格付インカム・オープン・マザーファンドを高位に組入れました。

### ●D I AM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。

※運用状況については13ページをご参照ください。

※各国の為替・金利動向については14ページをご参照ください。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配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	当期
	2022年6月7日 ～2023年6月5日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	7,083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 AM高格付インカム・オープン・マザーファンドを高位に組入れることで、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

### ●D I AM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。デフレ抑制については、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	第15期		項目の概要
	(2022年6月7日 ～2023年6月5日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	153円	1.099%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,960円です。 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)	( 77)	(0.550)	
(販売会社)	( 69)	(0.495)	
(受託会社)	( 8)	(0.055)	
(b) その他費用	2	0.013	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、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
(保管費用)	( 1)	(0.009)	
(監査費用)	( 1)	(0.004)	
(その他)	( 0)	(0.000)	
合計	155	1.112	

(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。

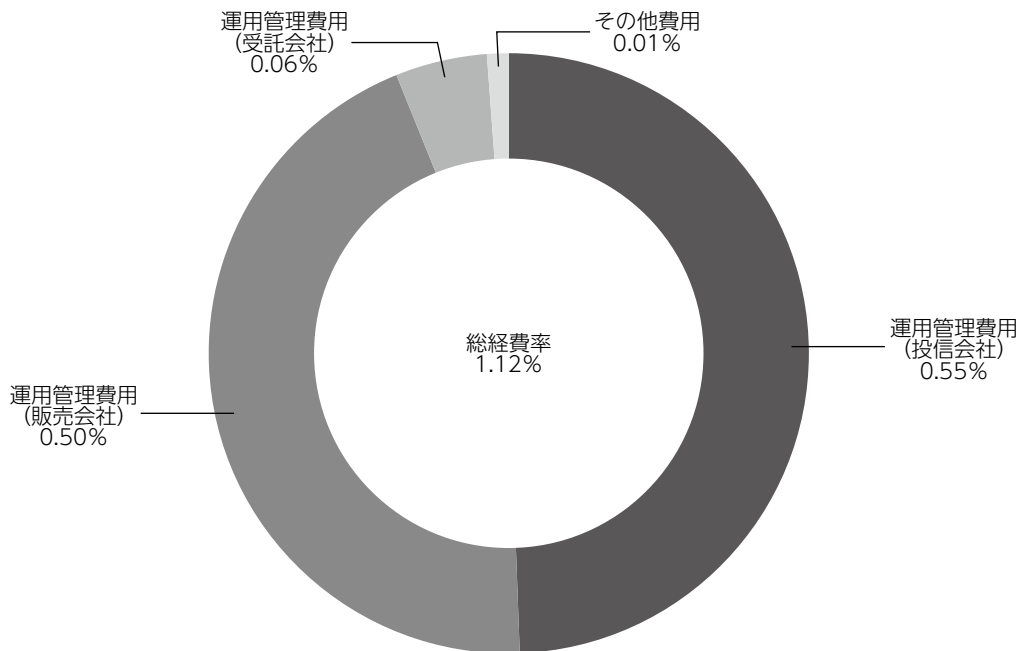
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.12%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（2022年6月7日から2023年6月5日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	千□ 58,565	千円 146,900	千□ 79,211	千円 199,140

## ■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）

### 【D I A M高格付インカム・オープン（1年決算コース）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 区 分	当 期			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 0.000	百万円 0.000	% 100.0	百万円 0.000	百万円 0.000	% 100.0

### 【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状況

決 算 期 区 分	当 期			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

平均保有割合 1.2%

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

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

## ■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	千□ 483,281	千□ 462,635	千円 1,172,595



## ■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
	千円	%
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	1,172,595	99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,375	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,181,970	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6月5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	1,181,970,505円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,225,310
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)	1,172,595,195
未 収 入 金	3,150,000
(B) 負 債	8,213,148
未 払 解 約 金	1,786,296
未 払 信 託 報 酬	6,405,877
そ の 他 未 払 費 用	20,975
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,173,757,357
元 本	836,168,681
次 期 繰 越 損 益 金	337,588,676
(D) 受 益 権 総 口 数	836,168,681口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	14,037円

(注) 期首における元本額は864,439,312円、当期中における追加設定元本額は104,824,397円、同解約元本額は133,095,028円です。

## ■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	△642円
受 取 利 息	37
支 払 利 息	△679
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	330,928
売 買 益	3,502,857
売 買 損	△3,171,929
(C) 信 託 報 酬 等	△13,240,865
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△12,910,579
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	101,602,641
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	248,896,614
(配 当 等 相 当 額)	(450,343,288)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△201,446,674)
(G) 合 計(D+E+F)	337,588,676
次 期 繰 越 損 益 金(G)	337,588,676
追 加 信 託 差 損 益 金	248,896,614
(配 当 等 相 当 額)	(450,480,172)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△201,583,558)
分 配 準 備 積 立 金	141,801,464
繰 越 損 益 金	△53,109,402

(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	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	16,469,194円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	450,480,172
(d) 分 配 準 備 積 立 金	125,332,270
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	592,281,636
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	7,083.28
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

# 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 21,536	% 0.2	% 96.5	% -	百万円 156,810
17期（2020年6月5日）	22,639	5.1	98.5	-	137,252
18期（2021年6月7日）	25,062	10.7	98.0	-	125,601
19期（2022年6月6日）	25,405	1.4	98.0	-	112,677
20期（2023年6月5日）	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）。

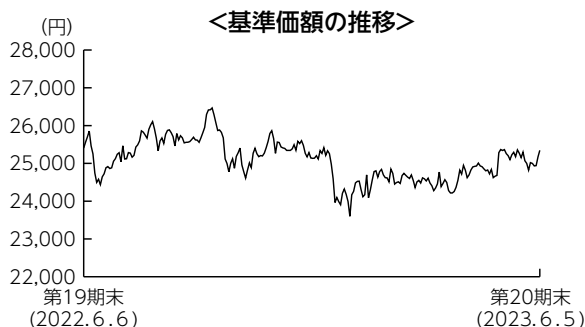
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(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。

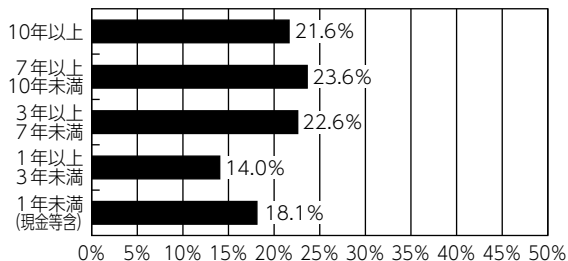
\*金利変動に対する債券価格の変動性。

## 【運用状況】

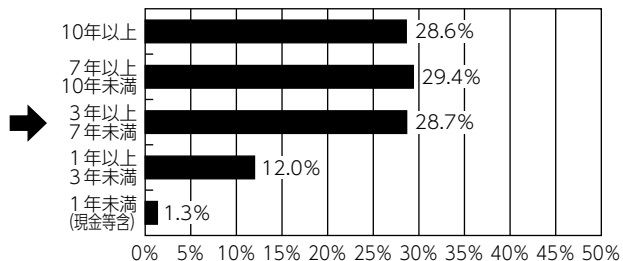
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○残存期間別構成比

#### 期首 (前期末)

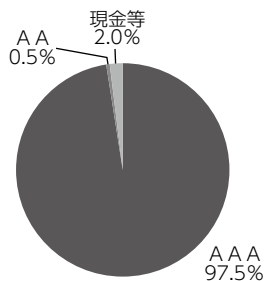


#### 期末

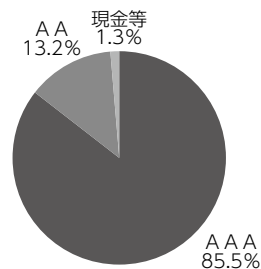


### ○格付別構成比

#### 期首 (前期末)

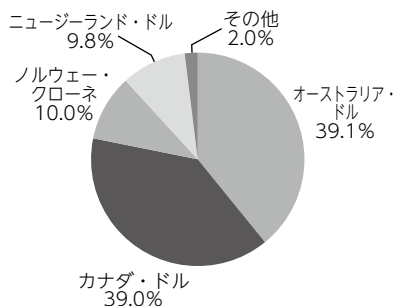


#### 期末

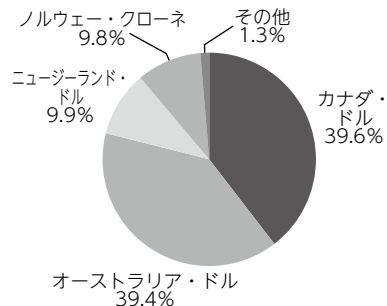


### ○通貨別構成比

#### 期首 (前期末)

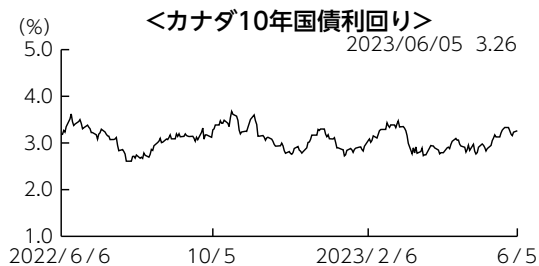
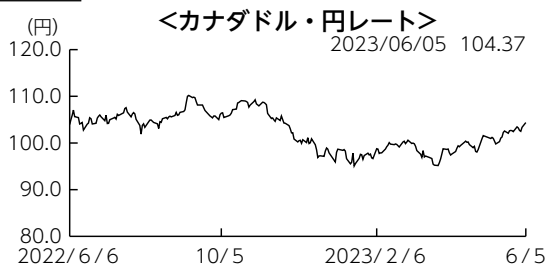


#### 期末

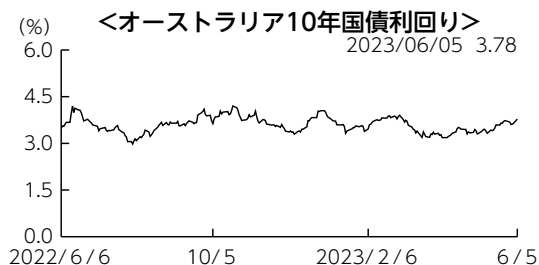
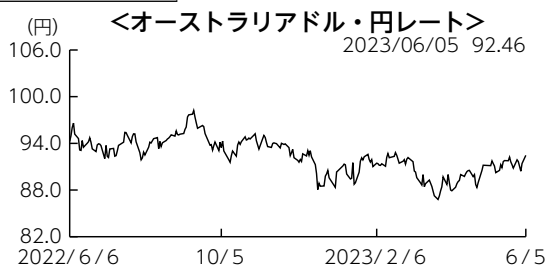


## 【各国の為替・金利動向】

### 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	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	
<b>(カナダ)</b>		%	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 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,727	910,854	2037/06/01
CANADA 4.0 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 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	22,000	19,299	2,014,338	2031/06/01
CANADA 0.5 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 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,542	1,309,027	2045/12/01
CANADA 2.0 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 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	35,000	30,483	3,181,551	2031/12/01
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 3.2 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 1.9 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 1.5 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		
<b>(オーストラリア)</b>			%	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	-		
<b>(ニュージーランド)</b>			%	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	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日	
																		外
<b>(ニュージーランド)</b>					%	千	ニュージーランド・ドル	千	ニュージーランド・ドル	千	円							
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	2.25 05/15/28	地	方	債	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			—					
<b>(ノルウェー)</b>					%	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	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。