

## 運用報告書 (全体版)

### D I A M世界好配当株オープン(毎月決算コース)

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/株式	
信託期間	2005年6月1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	D I A M世界好配当株オープン(毎月決算コース)	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンドにおける組入銘柄の選定に当たっては、配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄を選定し、安定的な配当収入およびキャピタルゲインを享受することをめざします。 実質外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。 株式の実質組入比率は、原則として高位を維持します。	
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には制限を設けません。 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	決算日(原則として毎月26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。)の中から、原則として配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。 また、毎年3月、6月、9月および12月の決算時には、原則として配当等収益に売買益(評価益を含みます。)等を加えた額から分配を行います。分配金額につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。	

愛称：世界配当倶楽部

第185期	<決算日	2020年12月28日>
第186期	<決算日	2021年1月26日>
第187期	<決算日	2021年2月26日>
第188期	<決算日	2021年3月26日>
第189期	<決算日	2021年4月26日>
第190期	<決算日	2021年5月26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、「D I A M世界好配当株オープン(毎月決算コース)」は、2021年5月26日に第190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

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

# DIAM世界好配当株オープン (毎月決算コース)

## ■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	株式先物率	純資産額
		(分配落)	税金 込 配 金	期騰 落 率			
第28作成期	161期(2018年12月26日)	円 6,949	円 20	% △8.9	% 95.8	% -	百万円 12,533
	162期(2019年1月28日)	7,383	20	6.5	95.8	-	13,275
	163期(2019年2月26日)	7,786	20	5.7	97.2	-	13,945
	164期(2019年3月26日)	7,717	20	△0.6	97.5	-	13,627
	165期(2019年4月26日)	7,909	20	2.7	96.6	-	13,770
	166期(2019年5月27日)	7,613	20	△3.5	96.3	-	13,197
第29作成期	167期(2019年6月26日)	7,636	20	0.6	95.9	-	13,208
	168期(2019年7月26日)	7,774	20	2.1	96.0	-	13,355
	169期(2019年8月26日)	7,156	20	△7.7	95.4	-	12,243
	170期(2019年9月26日)	7,624	20	6.8	96.1	-	12,965
	171期(2019年10月28日)	7,867	20	3.4	97.2	-	13,308
	172期(2019年11月26日)	7,975	20	1.6	96.8	-	13,313
第30作成期	173期(2019年12月26日)	8,266	20	3.9	96.9	-	13,471
	174期(2020年1月27日)	8,184	20	△0.8	96.7	-	13,190
	175期(2020年2月26日)	7,864	20	△3.7	95.8	-	12,591
	176期(2020年3月26日)	6,126	20	△21.8	95.2	-	9,667
	177期(2020年4月27日)	6,454	20	5.7	95.5	-	10,155
	178期(2020年5月26日)	6,567	20	2.1	95.7	-	10,329
第31作成期	179期(2020年6月26日)	6,855	20	4.7	96.2	-	10,754
	180期(2020年7月27日)	7,055	20	3.2	95.5	-	11,042
	181期(2020年8月26日)	7,255	20	3.1	96.2	-	11,288
	182期(2020年9月28日)	6,860	20	△5.2	96.7	-	10,610
	183期(2020年10月26日)	6,992	20	2.2	97.4	-	10,789
	184期(2020年11月26日)	7,330	20	5.1	97.7	-	11,228
第32作成期	185期(2020年12月28日)	7,307	20	△0.0	96.1	-	11,046
	186期(2021年1月26日)	7,561	20	3.7	97.3	-	11,262
	187期(2021年2月26日)	7,660	20	1.6	96.9	-	11,347
	188期(2021年3月26日)	8,039	20	5.2	97.2	-	11,843
	189期(2021年4月26日)	8,271	20	3.1	97.1	-	12,181
	190期(2021年5月26日)	8,564	20	3.8	96.6	-	12,500

(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」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) 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5) △(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	株 式 先 物 率
		円	騰 落 率		
第 185 期	(期 首) 2020 年 11 月 26 日	7,330	—	97.7	—
	11 月 末	7,315	△0.2	97.6	—
第 186 期	(期 末) 2020 年 12 月 28 日	7,327	△0.0	96.1	—
	(期 首) 2020 年 12 月 28 日	7,307	—	96.1	—
第 187 期	12 月 末	7,378	1.0	96.1	—
	(期 末) 2021 年 1 月 26 日	7,581	3.7	97.3	—
第 188 期	(期 首) 2021 年 1 月 26 日	7,561	—	97.3	—
	1 月 末	7,497	△0.8	97.3	—
第 189 期	(期 末) 2021 年 2 月 26 日	7,680	1.6	96.9	—
	(期 首) 2021 年 2 月 26 日	7,660	—	96.9	—
第 190 期	(期 末) 2021 年 3 月 26 日	8,059	5.2	97.2	—
	(期 首) 2021 年 3 月 26 日	8,039	—	97.2	—
第 189 期	3 月 末	8,245	2.6	97.2	—
	(期 末) 2021 年 4 月 26 日	8,291	3.1	97.1	—
第 190 期	(期 首) 2021 年 4 月 26 日	8,271	—	97.1	—
	4 月 末	8,366	1.1	96.9	—
第 190 期	(期 末) 2021 年 5 月 26 日	8,584	3.8	96.6	—

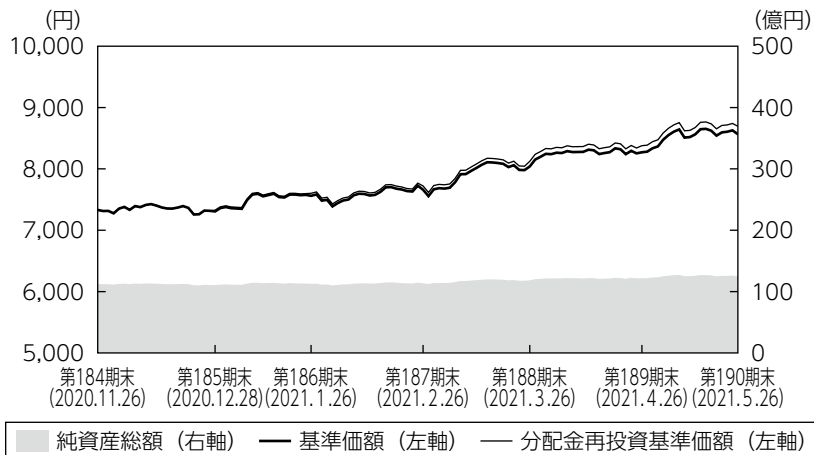
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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」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。

## ■第185期～第190期の運用経過（2020年11月27日から2021年5月26日まで）

### 基準価額等の推移



第185期首： 7,330円  
第190期末： 8,564円  
（既払分配金120円）  
騰落率： 18.6%  
（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

新型コロナウイルス感染再拡大や米長期金利上昇が嫌気され、一時軟調に推移する局面も見られましたが、米バイデン政権による経済対策や新型コロナウイルスワクチンの早期普及に対する期待感、良好な経済指標および企業業績を背景にした株式市場の上昇に支えられ、基準価額は上昇しました。また、為替市場において、主要通貨に対して円安が進行したことも基準価額にプラスとなりました。

## 投資環境

外国株式市場は上昇しました。新型コロナウイルス感染再拡大や米長期金利上昇が嫌気され、一時軟調に推移する局面も見られましたが、米バイデン政権による経済対策や新型コロナウイルスワクチンの早期普及に対する期待感、良好な経済指標と企業業績に支えられながら、作成期を通じて上昇基調で推移しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。米欧各国における積極的な財政政策や新型コロナウイルスワクチンの接種進展に対する期待、米国を中心とした金利上昇などを背景に作成期を通じて円安基調で推移しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの組入比率を作成期を通じて高位に維持するよう運用を行いました。

### ●D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

銘柄選択においては、「地域の分散」、「業種の分散」に着目し、世界の好配当株への投資を通じて、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざした運用を行いました。地域別では、概ね前作成期末と同様の資産配分を維持しました。業種別では、幅広い業種に分散投資を行う中、生活必需品や公益セクターのウェイトを引き下げた一方で、情報技術や金融セクターのウェイトを引き上げました。

## 【運用状況】

(注1) 組入比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

(注2) 国・地域別配分は、発行国・地域を表示しています。

(注3) 業種は各決算日時点でのG I C S（世界産業分類基準）によるものです。

### ○国・地域別配分

#### 前作成期末

国・地域		組入比率
北米	米国	42.9%
	カナダ	7.2%
	計	50.1%
欧州	フィンランド	1.9%
	フランス	6.0%
	ドイツ	11.1%
	アイルランド	1.5%
	オランダ	1.0%
	スペイン	3.6%
	スウェーデン	0.6%
	スイス	4.4%
	英国	14.3%
	計	44.4%
アジア・オセアニア	オーストラリア	0.8%
	香港	1.7%
	シンガポール	0.7%
計	3.2%	
株式計		97.7%
現金など		2.3%
合計		100%



#### 当作成期末

国・地域		組入比率
北米	米国	38.8%
	カナダ	7.6%
	計	46.4%
中南米	ケイマン	1.0%
	計	1.0%
欧州	フィンランド	2.3%
	フランス	7.4%
	ドイツ	12.1%
	アイルランド	2.1%
	オランダ	1.2%
	スペイン	2.4%
	スウェーデン	0.6%
	スイス	3.9%
	英国	14.5%
	計	46.4%
アジア・オセアニア	オーストラリア	0.8%
	香港	1.2%
	シンガポール	0.8%
計	2.8%	
株式計		96.6%
現金など		3.4%
合計		100%

### ○組入上位10業種

#### 前作成期末

No.	業種	組入比率
1	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19.0%
2	公益事業	18.2
3	食品・飲料・タバコ	8.1
4	資本財	7.0
5	家庭用品・パーソナル用品	6.8
6	素材	6.2
7	保険	5.2
8	銀行	4.5
9	電気通信サービス	4.4
10	エネルギー	3.7



#### 当作成期末

No.	業種	組入比率
1	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	16.7%
2	公益事業	13.7
3	保険	7.6
4	資本財	7.6
5	食品・飲料・タバコ	7.0
6	銀行	5.9
7	素材	5.5
8	電気通信サービス	4.6
9	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.4
10	ソフトウェア・サービス	3.4

## 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185期	第186期	第187期	第188期	第189期	第190期
	2020年11月27日 ~2020年12月28日	2020年12月29日 ~2021年1月26日	2021年1月27日 ~2021年2月26日	2021年2月27日 ~2021年3月26日	2021年3月27日 ~2021年4月26日	2021年4月27日 ~2021年5月26日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.27%	0.26%	0.26%	0.25%	0.24%	0.23%
当期の収益	16円	11円	20円	20円	13円	20円
当期の収益以外	3円	8円	-円	-円	6円	-円
翌期繰越分配対象額	517円	508円	509円	521円	514円	548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世界好配当株オープン・マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

### ●D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

今後の株式市場は、各国中央銀行の大規模金融緩和や各国政府の財政出動および新型コロナウイルス用ワクチン普及への期待が支えになる一方、一部地域における感染拡大状況に揺さぶられやすい相場展開を想定します。配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄を選別する運用方針を継続します。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第185期～第190期 (2020年11月27日 ～2021年5月26日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	47円	
(投信会社)	(22)	(0.283)	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)	(22)	(0.283)	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)	( 3)	(0.032)	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) 売買委託手数料	1	0.018	(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
(株式)	( 1)	(0.018)	
(c) 有価証券取引税	1	0.006	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	( 1)	(0.006)	
(d) その他費用	1	0.008	(d) 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)	( 1)	(0.006)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	( 0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	( 0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	50	0.631	

(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、有価証券取引税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。

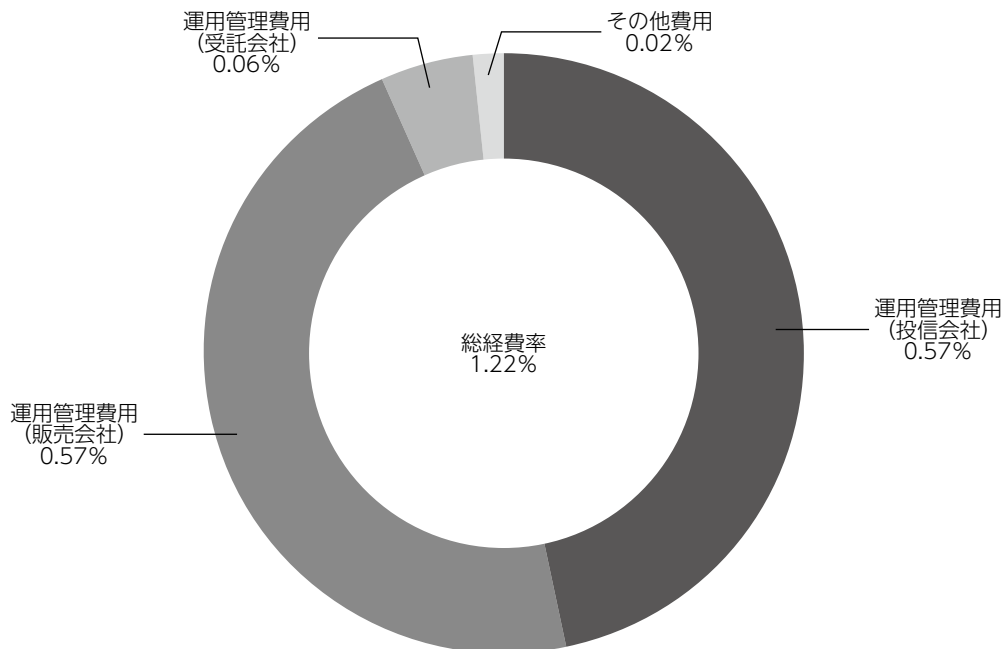
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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1.22%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（2020年11月27日から2021年5月26日まで）

	第 185 期 ~ 第 190 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
D I A M 世界好配当株 オープン・マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 291,939	千円 820,000

■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 185 期 ~ 第 190 期
	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	9,379,017千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	33,343,146千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.28

(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（2020年11月27日から2021年5月26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

親投資信託残高

	第31作成期末	第 32 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	千□ 4,220,728	千□ 3,928,789	千円 12,381,185

## ■投資信託財産の構成

2021年5月26日現在

項 目	第 32 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	12,381,185	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	174,650	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	12,555,836	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、2021年5月26日現在、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドは35,710,156千円、98.4%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、2021年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.75円、1カナダ・ドル=90.14円、1オーストラリア・ドル=84.28円、1香港・ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=82.06円、1台湾・ドル=3.902円、1イギリス・ポンド=153.88円、1スイス・フラン=121.44円、1ノルウェー・クローネ=13.08円、1スウェーデン・クローナ=13.16円、1ユーロ=133.15円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年12月28日)、(2021年1月26日)、(2021年2月26日)、(2021年3月26日)、(2021年4月26日)、(2021年5月26日)現在

項 目	第 185 期 末	第 186 期 末	第 187 期 末	第 188 期 末	第 189 期 末	第 190 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>11,118,755,897円</b>	<b>11,339,505,208円</b>	<b>11,412,770,987円</b>	<b>11,891,143,013円</b>	<b>12,271,384,960円</b>	<b>12,555,836,376円</b>
コール・ローン等	289,237,124	135,774,059	219,633,078	166,542,508	212,423,448	174,650,539
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	10,829,518,773	11,103,731,149	11,193,137,909	11,724,600,505	12,058,961,512	12,381,185,837
未 収 入 金	-	100,000,000	-	-	-	-
<b>(B) 負 債</b>	<b>72,245,806</b>	<b>77,086,064</b>	<b>64,931,831</b>	<b>47,411,329</b>	<b>89,854,037</b>	<b>55,406,402</b>
未 払 収 益 分 配 金	30,235,039	29,789,339	29,627,418	29,465,805	29,454,405	29,193,741
未 払 解 約 金	30,089,762	36,410,202	23,663,435	7,071,147	47,902,978	13,751,773
未 払 信 託 報 酬	11,886,444	10,854,958	11,607,226	10,842,846	12,460,421	12,424,759
そ の 他 未 払 費 用	34,561	31,565	33,752	31,531	36,233	36,129
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>11,046,510,091</b>	<b>11,262,419,144</b>	<b>11,347,839,156</b>	<b>11,843,731,684</b>	<b>12,181,530,923</b>	<b>12,500,429,974</b>
元 本	15,117,519,866	14,894,669,943	14,813,709,262	14,732,902,678	14,727,202,685	14,596,870,665
次 期 繰 越 損 益 金	△4,071,009,775	△3,632,250,799	△3,465,870,106	△2,889,170,994	△2,545,671,762	△2,096,440,691
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>15,117,519,866□</b>	<b>14,894,669,943□</b>	<b>14,813,709,262□</b>	<b>14,732,902,678□</b>	<b>14,727,202,685□</b>	<b>14,596,870,665□</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	7,307円	7,561円	7,660円	8,039円	8,271円	8,564円

(注) 第184期末における元本額は15,318,859,703円、当作成期間(第185期~第190期)中における追加設定元本額は621,808,939円、同解約元本額は1,343,797,977円です。

## ■損益の状況

〔自 2020年11月27日 至 2020年12月28日〕〔自 2020年12月29日 至 2021年1月26日〕〔自 2021年1月27日 至 2021年2月26日〕〔自 2021年2月27日 至 2021年3月26日〕〔自 2021年3月27日 至 2021年4月26日〕〔自 2021年4月27日 至 2021年5月26日〕

項 目	第 185 期	第 186 期	第 187 期	第 188 期	第 189 期	第 190 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,867円	△2,762円	△1,822円	△2,528円	△1,646円	△1,404円
受 取 利 息	77	128	41	16	14	9
支 払 利 息	△4,944	△2,890	△1,863	△2,544	△1,660	△1,413
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,204,373	419,194,810	188,447,387	597,560,759	379,728,837	467,147,623
売 買 益	8,282,873	424,212,376	189,626,474	601,524,372	384,361,007	472,224,325
売 買 損	△78,500	△5,017,566	△1,179,087	△3,963,613	△4,632,170	△5,076,702
(C) 信 託 報 酬 等	△11,921,005	△10,886,523	△11,640,978	△10,874,377	△12,496,654	△12,460,888
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△3,721,499	408,305,525	176,804,587	586,683,854	367,230,537	454,685,331
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,886,421,786	△1,889,084,382	△1,487,299,485	△1,324,299,781	△754,958,600	△410,939,013
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,150,631,451	△2,121,682,603	△2,125,747,790	△2,122,089,262	△2,128,489,294	△2,110,993,268
(配 当 等 相 当 額)	(314,789,912)	(310,897,200)	(313,667,886)	(314,875,431)	(321,896,830)	(321,780,598)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,465,421,363)	(△2,432,579,803)	(△2,439,415,676)	(△2,436,964,693)	(△2,450,386,124)	(△2,432,773,866)
(G) 合 計 (D + E + F)	△4,040,774,736	△3,602,461,460	△3,436,242,688	△2,859,705,189	△2,516,217,357	△2,067,246,950
(H) 収 益 分 配 金	△30,235,039	△29,789,339	△29,627,418	△29,465,805	△29,454,405	△29,193,741
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△4,071,009,775	△3,632,250,799	△3,465,870,106	△2,889,170,994	△2,545,671,762	△2,096,440,691
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,150,631,451	△2,121,682,603	△2,125,747,790	△2,122,089,262	△2,128,489,294	△2,110,993,268
(配 当 等 相 当 額)	(314,811,522)	(310,903,521)	(313,782,266)	(315,030,175)	(321,961,726)	(321,848,977)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,465,442,973)	(△2,432,586,124)	(△2,439,530,056)	(△2,437,119,437)	(△2,450,451,020)	(△2,432,842,245)
分 配 準 備 積 立 金	467,048,179	446,836,138	441,586,013	453,296,090	436,256,214	478,805,056
繰 越 損 益 金	△2,387,426,503	△1,957,404,334	△1,781,708,329	△1,220,377,822	△853,438,682	△464,252,479

(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 185 期	第 186 期	第 187 期	第 188 期	第 189 期	第 190 期
(a) 経費控除後の配当等収益	25,039,032円	17,188,184円	31,260,328円	46,389,593円	19,578,532円	78,271,482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	314,811,522	310,903,521	313,782,266	315,030,175	321,961,726	321,848,977
(d) 分 配 準 備 積 立 金	472,244,186	459,437,293	439,953,103	436,372,302	446,132,087	429,727,315
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	812,094,740	787,528,998	784,995,697	797,792,070	787,672,345	829,847,774
(f) 1万口当たり当期分配対象額	537.19	528.73	529.91	541.50	534.84	568.51
(g) 分 配 金	30,235,039	29,789,339	29,627,418	29,465,805	29,454,405	29,193,741
(h) 1万口当たり分配金	20	20	20	20	20	20

## ■分配金のお知らせ

決算期	第 185 期	第 186 期	第 187 期	第 188 期	第 189 期	第 190 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20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。

# D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2021年5月26日）

（計算期間 2020年5月27日～2021年5月26日）

D I A M世界好配当株オープン・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	2005年6月1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	日本を除く世界各国の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		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
		期騰	中落率			
12期（2017年5月26日）	円		%	%	%	百万円 35,150
13期（2018年5月28日）	25,040		14.1	97.1	—	36,097
14期（2019年5月27日）	25,679		2.6	97.8	—	36,715
15期（2020年5月26日）	25,645		△0.1	97.7	—	30,171
16期（2021年5月26日）	23,045		△10.1	96.6	—	36,299
	31,514		36.7	97.5	—	

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドは、日本を除く世界各国の好配当が期待できる銘柄を選別し、高水準で安定した分配金の確保と中長期的な株価値上がり益を追求することを目的に運用いたします。

上記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）。

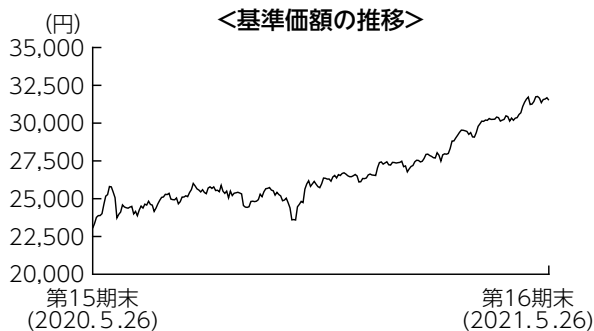
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年 5 月26日	円	%	%	%	%
	23,045	-		96.6	-
5 月 末	23,876	3.6		97.2	-
6 月 末	24,250	5.2		97.2	-
7 月 末	24,662	7.0		96.9	-
8 月 末	25,537	10.8		97.4	-
9 月 末	24,833	7.8		97.6	-
10 月 末	23,618	2.5		98.5	-
11 月 末	26,300	14.1		98.5	-
12 月 末	26,629	15.6		98.0	-
2021年 1 月 末	27,166	17.9		98.6	-
2 月 末	27,868	20.9		98.3	-
3 月 末	30,130	30.7		98.2	-
4 月 末	30,681	33.1		98.0	-
(期 末) 2021年 5 月26日	31,514	36.7		97.5	-

(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（2020年5月27日から2021年5月26日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は31,514円となり、前期末比で36.7%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

期初から2020年8月末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大の落ち着きや各国の積極的な財政・金融政策を背景にした株式市場の上昇に支えられ、基準価額は上昇しました。その後はリスク回避的な動きから一時軟調に推移しましたが、11月以降には米国新政権による経済対策や新型コロナウイルスワクチンの早期普及に対する期待

感、良好な経済指標と企業業績を支援材料に再び上昇して期末を迎えました。また、為替市場において、主要通貨に対し円安が進行したことも基準価額にプラスとなりました。

## 投資環境

外国株式市場は、期初から2020年8月末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大ペース鈍化や各国の積極的な財政・金融政策に支えられ、上昇基調で推移しました。その後、新型コロナウイルスの感染再拡大や米国大統領選挙を控えたリスク回避的な動きもあり軟調に推移する局面も見られましたが、11月以降は、米国新政権による経済対策や新型コロナウイルスワクチンの早期普及に対する期待感、良好な経済指標と企業業績を支援材料に再び上昇基調となり、前期末比で上昇して終わりました。

為替市場では主要通貨に対し円安が進みました。対ユーロや対ポンドは、期初から2020年9月中旬にかけては欧州各国における積極的な財政政策や新型コロナウイルスの感染拡大ペース鈍化を受け、円安基調で推移しました。その後一時リスク回避も見られましたが、11月以降は再び円安基調となりました。対米ドルでは、期初から12月末にかけ米金融緩和と政策の長期化観測などから円高基調で推移しました。2021年1月以降は米長期金利上昇などを背景に円安が進行し、前期末比で円安となりました。

## ポートフォリオについて

銘柄選択においては、「地域の分散」、「業種の分散」に着目し、世界の好配当株への投資を通じて、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざした運用を行いました。地域別では、概ね前期末と同様の資産配分を維持しました。業種別では、幅広い業種に分散投資を行う中、ヘルスケアや公益セクターのウェイトを引き下げた一方で、金融や情報技術セクターのウェイトを引き上げました。

## 今後の運用方針

今後の株式市場は、各国中央銀行の大規模金融緩和や各国政府の財政出動および新型コロナウイルス用ワクチン普及への期待が支えになる一方、一部地域における感染拡大状況に揺さぶられやすい相場展開を想定します。配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄を選別する運用方針を継続します。



## ■ 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)	11円 (11)	0.041% (0.041)	(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
(b) 有価証券取引税 (株 式)	3 (3)	0.013 (0.013)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	4 (4) (0)	0.017 (0.015) (0.001)	(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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	19	0.071	
期中の平均基準価額は26,747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 (2020年5月27日から2021年5月26日まで)

株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 4,110.86 (164.45)	千アメリカ・ドル 27,994 (-)	百株 9,544.49	千アメリカ・ドル 46,247
	カ ナ ダ	百株 1,574.76 (-)	千カナダ・ドル 10,441 (-)	百株 4,149.11	千カナダ・ドル 12,764
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 (-)	千オーストラリア・ドル (-)	百株 285.97	千オーストラリア・ドル 1,989
	香 港	百株 6,720 (△16,410)	千香港・ドル 25,136 (-)	百株 4,130	千香港・ドル 9,786
	イ ギ リ ス	百株 1,796.56 (-)	千イギリス・ポンド 546 (-)	百株 348.92	千イギリス・ポンド 2,105
	ス イ ス	百株 (-)	千スイス・フラン (-)	百株 34.9	千スイス・フラン 1,042
	ノ ル ウ ェ ー	百株 (-)	千ノルウェー・クローネ (-)	百株 1,340.75	千ノルウェー・クローネ 17,183
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 1,488.25 (-)	千スウェーデン・クローナ 18,898 (-)	百株 -	千スウェーデン・クローナ -
	ユ	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 284.71	千ユーロ 899
	イ	3,891.47 (-)	8,310 (-)	1,982.66	1,751
口	ド イ ツ	1,069.71 (137.89)	6,291 (△468)	2,204.57	9,214
	ス ペ イ ン	367.02 (16,410.7)	811 (-)	22,699.14	6,997

(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	15,910,254	千円
(b)	期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	32,039,145	千円
(c)	売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.49	

(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 (2020年5月27日から2021年5月26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  
外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期		業種等	
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル 千円		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	204.89	181.48	2,609	283,783	情報技術サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	-	389.63	2,594	282,156	食品
AMEREN CORP	284.99	97.24	814	88,532	総合公益事業
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	-	304.15	2,030	220,817	医薬品
CAMPBELL SOUP CO	1,004.22	668.83	3,237	352,111	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	334.74	-	-	-	コンピュータ・周辺機器
CISCO SYSTEMS INC	906.48	1,560.07	8,316	904,444	通信機器
CLOROX COMPANY	-	67.38	1,203	130,907	家庭用品
CUMMINS INC	89.92	89.92	2,287	248,723	機械
DTE ENERGY CO	153.23	71.05	985	107,223	総合公益事業
EATON CORP PLC	239.5	239.5	3,420	371,957	電気設備
EXXON MOBIL CORP	733.11	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
GILEAD SCIENCES INC	294.44	449.44	2,976	323,709	バイオテクノロジー
HP INC	491.28	945.45	3,012	327,577	コンピュータ・周辺機器
CENTERPOINT ENERGY INC	1,177.52	330.42	824	89,617	総合公益事業
JOHNSON & JOHNSON	270.33	194.14	3,301	359,085	医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	165.28	165.28	2,183	237,439	家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	118.09	91.18	3,518	382,602	航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	413.08	413.08	9,589	1,042,829	ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	1,063.33	1,309.04	8,380	911,376	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	597.02	-	-	-	半導体・半導体製造装置
MERCK & CO.INC.	1,086.11	847.56	6,568	714,334	医薬品
MICROSOFT CORP	347.09	347.09	8,736	950,143	ソフトウェア
PACWEST BANCORP	307.15	-	-	-	銀行
WELLS FARGO & CO	1,013.77	-	-	-	銀行
PACCAR INC	621.61	255.42	2,312	251,520	機械
PPL CORPORATION	893.92	893.92	2,602	282,989	電力
PFIZER INC	1,325.42	1,325.42	5,212	566,900	医薬品
ALTRIA GROUP INC	433.64	433.64	2,151	233,952	タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	852.83	239.48	3,315	360,519	家庭用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	640.1	136.66	870	94,684	食品
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	1,145	124,568	ガス
TRUIST FINANCIAL CORP	1,195.07	1,195.07	7,177	780,562	銀行
AT&T INC	1,256.74	1,256.74	3,709	403,451	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	245.8	301.37	3,130	340,423	石油・ガス・消耗燃料
TEXAS INSTRUMENTS INC	-	184.12	3,474	377,834	半導体・半導体製造装置
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	-	734.05	3,977	432,587	食品・生活必需品小売り
VALLEY NATIONAL BANCORP	1,286.38	-	-	-	銀行
LAS VEGAS SANDS CORP	528.45	-	-	-	ホテル・レストラン・レジャー
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	637.34	637.34	6,215	675,918	タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	369.16	369.16	4,056	441,166	化学
GENERAL MOTORS CO	710.63	-	-	-	自動車

銘柄	株数	株数	期 末		業 種 等
			期 首(前期末)		
			株数	株数	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ABBVIE INC	655.93	655.93	7,514	817,183	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	-	79.24	3,641	396,001	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	-	391.45	3,660	398,031	コンピュータ・周辺機器
AVANGRID INC	361.59	190.06	991	107,871	電力
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,751.59 39銘柄	18,482.41 38銘柄	141,752 -	15,415,540 <42.5%>
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	400.66	584.27	5,511	496,799	銀行
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	3,140.56	3,140.56	5,854	527,679	総合公益事業
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	193.26	390.39	5,293	477,137	銀行
RUSSEL METALS INC	768.67	1,573.75	5,248	473,095	商社・流通業
MAGNA INTERNATIONAL INC	-	388.94	4,470	403,003	自動車部品
GIBSON ENERGY INC	2,382.76	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL POWER CORP	860.16	860.16	3,425	308,743	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NORTHLAND POWER INC	2,042.99	276.64	1,109	100,044	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,789.06 7銘柄	7,214.71 7銘柄	30,913 -	2,786,504 <7.7%>
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BHP GROUP LTD	581.27	581.27	2,759	232,601	金属・鉱業
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	285.97	-	-	-	銀行
AGL ENERGY LTD	776.72	776.72	635	53,547	総合公益事業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,643.96 3銘柄	1,357.99 2銘柄	3,395 -	286,149 <0.8%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,620	3,490	9,702	135,927	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	21,880	5,470	22,509	315,351	不動産管理・開発
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	-	6,720	27,115	379,883	専門小売り
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,500 2銘柄	15,680 3銘柄	59,326 -	831,163 <2.3%>
<b>(シンガポール)</b>	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,307	1,307	3,383	277,676	銀行
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,383 -	277,676 <0.8%>
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
NATIONAL GRID PLC	5,418.8	5,418.8	5,131	789,651	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	401.83	401.83	1,115	171,619	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,637.2	1,637.2	2,716	418,081	タバコ
UNILEVER PLC	808.44	696.17	2,998	461,340	パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,384.49	3,384.49	3,358	516,743	水道
RIO TINTO PLC	906.4	906.4	5,352	823,610	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	10,084.8	10,084.8	1,289	198,481	無線通信サービス
SSE PLC	1,179.15	1,179.15	1,827	281,243	電力
BP PLC	4,168.37	5,964.93	1,849	284,543	石油・ガス・消耗燃料
3I GROUP PLC	2,194.47	2,194.47	2,729	420,080	資本市場

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,670.2	2,670.2	3,610	555,523	医薬品	
ASTRAZENECA PLC	558.09	321.44	2,598	399,810	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33,412.24 12銘柄	34,859.88 12銘柄	34,577 -	5,320,730 <14.7%>	
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	203.38	168.48	5,261	638,972	医薬品	
NOVARTIS AG-REG SHS	824.79	824.79	6,552	795,791	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,028.17 2銘柄	993.27 2銘柄	11,814 -	1,434,763 <4.0%>	
<b>(ノルウェー)</b>	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
DNB ASA	1,340.75	-	-	-	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,340.75 1銘柄	- -銘柄	- -	- <-%>	
<b>(スウェーデン)</b>	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円		
TELE2 AB-B SHS	-	1,488.25	16,698	219,747	無線通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- -銘柄	1,488.25 1銘柄	16,698 -	219,747 <0.6%>	
<b>(ユーロ…オランダ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円		
NN GROUP NV	284.71	-	-	-	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	284.71 1銘柄	- -銘柄	- -	- <-%>	
<b>(ユーロ…フランス)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円		
AXA SA	2,250.72	3,479.79	7,756	1,032,771	保険	
DANONE	-	416.6	2,513	334,707	食品	
TOTAL SE	918.14	1,181.28	4,527	602,882	石油・ガス・消耗燃料	
SANOFI	620.01	620.01	5,452	725,982	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,788.87 3銘柄	5,697.68 4銘柄	20,250 -	2,696,344 <7.4%>	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	1,706.71	1,706.71	9,147	1,218,051	航空貨物・物流サービス	
RWE AG	988.86	-	-	-	総合公益事業	
E.ON SE	4,209.62	4,209.62	4,234	563,873	総合公益事業	
SIEMENS AG-REG	275.79	393.08	5,321	708,559	コンプロマリット	
DAIMLER AG	199.9	-	-	-	自動車	
BASF SE	256.47	256.47	1,721	229,173	化学	
ALLIANZ SE	222.89	297.39	6,404	852,731	保険	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,718.47	3,718.47	6,384	850,111	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,578.71 8銘柄	10,581.74 6銘柄	33,214 -	4,422,502 <12.2%>	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	5,817.73	2,361.49	2,712	361,125	電力	
REPSOL SA	2,641.02	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	423.32	-	-	-	建設・土木	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	752.35	752.35	1,236	164,588	電力	

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
FERROVIAL SA	739.38	1,106.4	2,680	356,949	建設・土木	
FERROVIAL SA-RTS	—	971.52	19	2,600	建設・土木	
FERROVIAL SA-RTS	739.38	—	—	—	建設・土木	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	11,113.18 6銘柄	5,191.76 4銘柄	6,648 —	885,263 <2.4%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	653.83	653.83	2,096	279,193	紙製品・林産品	
FORTUM OYJ	1,774.25	1,774.25	4,137	550,914	電力	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,428.08 2銘柄	2,428.08 2銘柄	6,234 —	830,108 <2.3%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	130,966.32 87銘柄	105,282.77 82銘柄	— —	35,406,495 <97.5%>	

(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) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金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。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## ■投資信託財産の構成

2021年5月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	35,406,495	97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	893,498	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	36,299,994	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、35,710,156千円、98.4%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、2021年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.75円、1カナダ・ドル=90.14円、1オーストラリア・ドル=84.28円、1香港・ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=82.06円、1台湾・ドル=3.902円、1イギリス・ポンド=153.88円、1スイス・フラン=121.44円、1ノルウェー・クローネ=13.08円、1スウェーデン・クローナ=13.16円、1ユーロ=133.15円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年5月26日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	36,299,994,363円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	829,006,027
株 式(評価額)	35,406,495,663
未 収 配 当 金	64,492,673
(B) 負 債	—
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	36,299,994,363
元 本	11,518,532,199
次 期 繰 越 損 益 金	24,781,462,164
(D) 受 益 権 総 口 数	11,518,532,199口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,514円

(注1) 期首元本額 13,092,092,972円

追加設定元本額 88,965,208円

一部解約元本額 1,662,525,981円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M世界好配当株オープン (毎月決算コース) 3,928,789,058円

D I A M世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 6,843,259,186円

D I A M世界好配当株式ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) 37,620,545円

D I A M世界6資産バランスファンド 73,488,368円

D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド 99,867,287円

D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 322,201,014円

D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 213,306,741円

期末元本合計 11,518,532,199円

## ■損益の状況

当期 自2020年5月27日 至2021年5月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,353,831,548円
受 取 配 当 金	1,353,948,113
受 取 利 息	3,023
そ の 他 収 益 金	22,220
支 払 利 息	△141,808
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,111,997,686
売 買 益	10,002,777,715
売 買 損	△890,780,029
(C) そ の 他 費 用	△5,573,729
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	10,460,255,505
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,079,145,886
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,896,974,019
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	139,034,792
(H) 合 計(D+E+F+G)	24,781,462,164
次 期 繰 越 損 益 金(H)	24,781,462,164

(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。