

## 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203期	<決算日	2022年6月27日>
第204期	<決算日	2022年7月26日>
第205期	<決算日	2022年8月26日>
第206期	<決算日	2022年9月26日>
第207期	<決算日	2022年10月26日>
第208期	<決算日	2022年11月28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、2022年11月28日に第208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31作成期	179期(2020年6月26日)	円 6,855	円 20	% 4.7	% 96.2	% -	百万円 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
第33作成期	191期(2021年6月28日)	8,627	20	1.0	97.3	-	12,519
	192期(2021年7月26日)	8,540	20	△0.8	97.3	-	12,278
	193期(2021年8月26日)	8,671	20	1.8	97.7	-	12,253
	194期(2021年9月27日)	8,441	20	△2.4	97.9	-	11,845
	195期(2021年10月26日)	8,804	20	4.5	98.6	-	12,233
	196期(2021年11月26日)	8,937	20	1.7	98.2	-	12,299
第34作成期	197期(2021年12月27日)	9,060	20	1.6	98.3	-	12,390
	198期(2022年1月26日)	8,826	20	△2.4	97.9	-	11,987
	199期(2022年2月28日)	8,858	20	0.6	97.8	-	11,969
	200期(2022年3月28日)	9,316	20	5.4	98.0	-	12,577
	201期(2022年4月26日)	9,392	20	1.0	98.4	-	12,525
	202期(2022年5月26日)	9,331	20	△0.4	97.8	-	12,436
第35作成期	203期(2022年6月27日)	9,341	20	0.3	97.8	-	12,445
	204期(2022年7月26日)	9,334	20	0.1	97.0	-	12,567
	205期(2022年8月26日)	9,477	20	1.7	97.4	-	12,728
	206期(2022年9月26日)	8,954	20	△5.3	97.9	-	11,985
	207期(2022年10月26日)	9,709	20	8.7	97.5	-	12,947
	208期(2022年11月28日)	9,986	20	3.1	98.5	-	13,250

(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203期	(期首) 2022年5月26日	9,331	—	97.8	—
	5月末	9,542	2.3	97.8	—
第204期	(期末) 2022年6月27日	9,361	0.3	97.8	—
	(期首) 2022年6月27日	9,341	—	97.8	—
第204期	6月末	9,401	0.6	97.3	—
	(期末) 2022年7月26日	9,354	0.1	97.0	—
第205期	(期首) 2022年7月26日	9,334	—	97.0	—
	7月末	9,339	0.1	97.4	—
第205期	(期末) 2022年8月26日	9,497	1.7	97.4	—
	(期首) 2022年8月26日	9,477	—	97.4	—
第206期	8月末	9,315	△1.7	97.4	—
	(期末) 2022年9月26日	8,974	△5.3	97.9	—
第207期	(期首) 2022年9月26日	8,954	—	97.9	—
	9月末	8,895	△0.7	97.8	—
第207期	(期末) 2022年10月26日	9,729	8.7	97.5	—
	(期首) 2022年10月26日	9,709	—	97.5	—
第208期	10月末	9,933	2.3	98.3	—
	(期末) 2022年11月28日	10,006	3.1	98.5	—

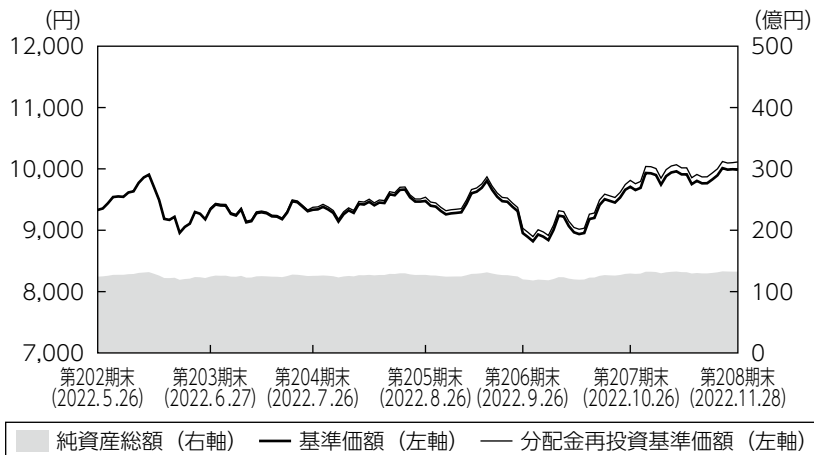
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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203期～第208期の運用経過（2022年5月27日から2022年11月28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

主要各国におけるインフレ指標の軟化や金融政策に対する警戒感の後退、好調な企業決算を背景に株式市場が小幅に上昇したことや、内外金利差の拡大などを背景として主要通貨に対し円安に進んだことから、基準価額は上昇しました。

## 投資環境

外国株式市場は小幅に上昇しました。作成期初こそ主要各国の金融政策に対する警戒感などから下落しましたが、2022年8月中旬にかけては好調な企業決算や米インフレ指標の軟化を背景に上昇しました。その後は、金融政策や景気に対する懸念が再燃したことで下落する局面もありましたが、10月中旬以降には企業の好決算やインフレ指標の軟化に加え、中国のゼロコロナ政策緩和期待などから反発して作成期末を迎えました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。米欧各国の経済指標の発表などを受けて円高に進行する局面も見られましたが、日銀と主要先進国の金融政策スタンスを受けた内外金利差拡大を背景に概ね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、ヘルスケアや金融セクターに対する投資比率を高位に維持しました。

## 【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	42.8%
	カナダ	7.1%
	計	50.0%
中南米	ケイマン	0.8%
	計	0.8%
欧州	フィンランド	1.8%
	フランス	9.1%
	ドイツ	8.2%
	アイルランド	1.3%
	オランダ	1.8%
	スペイン	2.2%
	スウェーデン	0.4%
	スイス	3.6%
	英国	14.9%
	計	43.4%
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.4%
	香港	1.2%
	シンガポール	1.0%
	計	3.6%
	株式計	97.8%
	現金など	2.2%
	合計	100%



#### 当作成期末

	国・地域	組入比率
北米	米国	50.0%
	カナダ	4.9%
	計	54.9%
欧州	フィンランド	0.7%
	フランス	10.4%
	ドイツ	9.2%
	アイルランド	0.7%
	オランダ	1.0%
	スペイン	2.1%
	スウェーデン	0.3%
	スイス	3.7%
	英国	12.5%
計	40.5%	
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.0%
	香港	1.0%
	シンガポール	1.1%
	計	3.1%
	株式計	98.5%
	現金など	1.5%
	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	19.2%
2	公益事業	12.1
3	銀行	10.9
4	ソフトウェア・サービス	7.3
5	資本財	6.5
6	保険	5.9
7	エネルギー	5.5
8	素材	4.7
9	電気通信サービス	4.6
10	食品・飲料・タバコ	4.1



#### 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	19.6%
2	銀行	10.4
3	公益事業	9.7
4	保険	7.5
5	ソフトウェア・サービス	7.3
6	資本財	7.1
7	エネルギー	6.2
8	食品・飲料・タバコ	5.5
9	素材	4.4
10	消費者サービス	4.2

## 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203期	第204期	第205期	第206期	第207期	第208期
	2022年5月27日 ～2022年6月27日	2022年6月28日 ～2022年7月26日	2022年7月27日 ～2022年8月26日	2022年8月27日 ～2022年9月26日	2022年9月27日 ～2022年10月26日	2022年10月27日 ～2022年11月28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	0.21%	0.21%	0.21%	0.22%	0.21%	0.20%
当期の収益	20円	8円	20円	13円	20円	20円
当期の収益以外	-円	11円	-円	6円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,094円	1,082円	1,148円	1,141円	1,381円	1,658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

外国株式市場は、各国の金融政策を巡る思惑や企業業績への懸念などから短期的には不安定な相場展開も想定され、銘柄選択の重要性がより高まると考えます。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203期～第208期 (2022年5月27日 ～2022年11月28日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	58円	
(投信会社)	(28)	(0.291)	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)	(28)	(0.291)	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)	(0.033)	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	0.014	(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
(株式)	( 1)	(0.014)	
(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	2	0.016	(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)	(0.012)	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)	(0.001)	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)	(0.003)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	62	0.652	

(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。

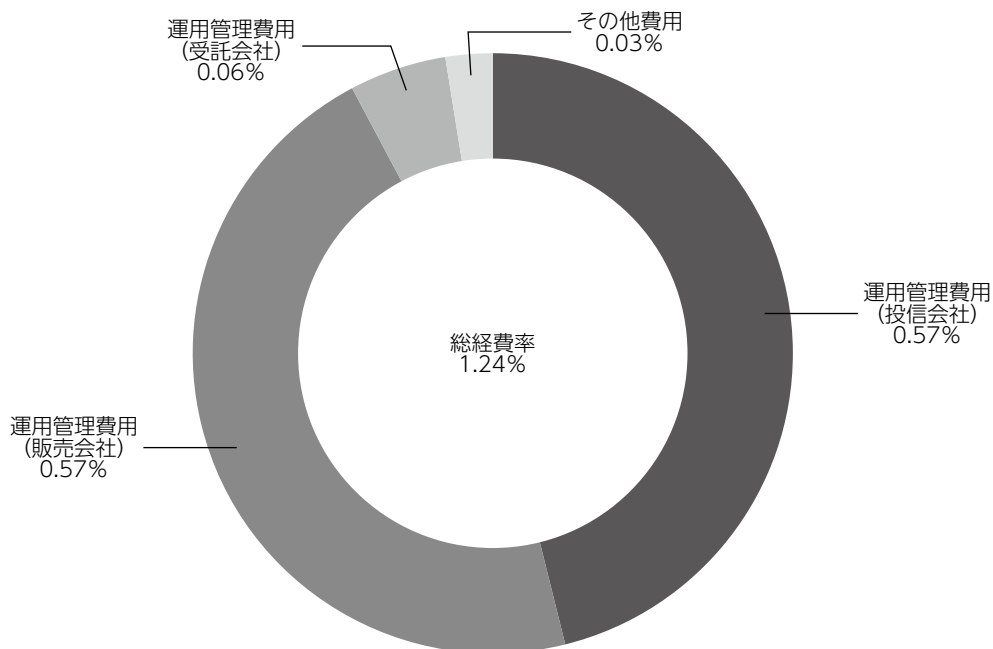
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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1.24%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5月27日から2022年11月28日まで）

	第 203 期 ~ 第 208 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□ 24,892	千円 90,000	千□ 91,774	千円 340,000

■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 203 期 ~ 第 208 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	10,667,151千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	34,467,761千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.30

(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5月27日から2022年11月28日まで）

### 【D I A M世界好配当株オープン（毎月決算コース）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	第 203 期 ~ 第 208 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 0.023	百万円 0.023	% 100.0	百万円 0.023	百万円 0.023	% 100.0

### 【D I A M世界好配当株オープン・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	第 203 期 ~ 第 208 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 0.02	百万円 0.02	% 100.0	百万円 0.02	百万円 0.02	% 100.0

平均保有割合 35.7%

(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、みずほ信託銀行です。

## ■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世界好配当株オープン・マザーファンド	千□ 3,454,328	千□ 3,387,445	千円 13,200,874

<補足情報>

■D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド (9,329,252,008口) の内容です。  
外国株式

銘 柄	2022年5月26日現在		2022年11月28日現在		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		
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	346.85	346.85	2,748	382,307	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	322.44	454.05	6,208	863,627	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	779.8	779.8	3,774	524,995	通信機器	
CUMMINS INC	89.92	112.15	2,808	390,656	機械	
BANK OF AMERICA CORP	815.83	1,348.22	5,082	707,016	銀行	
EATON CORP PLC	116.51	116.51	1,935	269,206	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	326.8	507.76	4,333	602,751	電力	
GILEAD SCIENCES INC	250.74	340.71	2,938	408,809	バイオテクノロジー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	52.43	34.11	780	108,501	航空宇宙・防衛	
JOHNSON & JOHNSON	354.66	311.61	5,522	768,245	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	308.36	356.58	4,814	669,752	家庭用品	
LOCKHEED MARTIN CORP	18.28	25.69	1,242	172,763	航空宇宙・防衛	
MCDONALD'S CORPORATION	404.64	404.64	11,127	1,547,849	ホテル・レストラン・レジャー	
METLIFE INC	1,218.2	1,218.2	9,374	1,303,930	保険	
MERCK & CO.INC.	822.24	879.27	9,452	1,314,794	医薬品	
MICROSOFT CORP	330.31	260.46	6,446	896,655	ソフトウェア	
PACCAR INC	304.73	304.73	3,200	445,200	機械	
PAYCHEX INC	347.06	524.48	6,462	898,880	情報技術サービス	
PPL CORPORATION	636.97	831.02	2,429	337,883	電力	
PEPSICO INC	-	112.98	2,080	289,338	飲料	
PFIZER INC	855.26	855.26	4,208	585,434	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	184.41	139.35	2,044	284,395	家庭用品	
QUALCOMM INC	100.07	-	-	-	半導体・半導体製造装置	
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	-	-	-	ガス	
TRUIST FINANCIAL CORP	774.53	440.86	2,068	287,730	銀行	
AT&T INC	1,593.32	1,593.32	3,046	423,758	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	371.82	371.82	6,830	950,099	石油・ガス・消耗燃料	
TEXAS INSTRUMENTS INC	46.97	-	-	-	半導体・半導体製造装置	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	346.59	346.59	1,443	200,845	食品・生活必需品小売り	
CME GROUP INC	-	127.92	2,238	311,389	資本市場	
MASTERCARD INC	217.61	176.93	6,215	864,558	情報技術サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	428.18	591.84	5,814	808,842	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,559	356,029	化学	
ABBVIE INC	269.58	269.58	4,303	598,552	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	41.71	21	1,112	154,792	半導体・半導体製造装置	
DOW INC	-	174.51	899	125,158	化学	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	262.63	-	-	-	コンピュータ・周辺機器	
小 計	株 数 ・ 金 額	14,075.77	14,673.71	135,548	18,854,756	
	銘 柄 数 < 比 率 >	34銘柄	33銘柄	-	<51.9%>	

銘 柄	2022年5月26日現在		2022 年 11 月 28 日 現 在		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	757.71	717.64	7,113	737,931	銀行
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	2,036.59	656.38	672	69,720	総合公益事業
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	962.28	595.75	3,878	402,299	銀行
RUSSEL METALS INC	1,216.48	651.98	1,892	196,261	商社・流通業
CAPITAL POWER CORP	842.72	842.72	3,847	399,138	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 >	5,815.78 5銘柄	3,464.47 5銘柄	17,404 -	1,805,351 <5.0%>
<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	743.7	743.7	3,287	307,217	金属・鉱業
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	134.38	134.38	510	47,687	石油・ガス・消耗燃料
AGL ENERGY LTD	2,265.01	-	-	-	総合公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3,143.09 3銘柄	878.08 2銘柄	3,797 -	354,904 <1.0%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,495	5,045	12,662	225,400	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,540	4,780	8,374	149,067	不動産管理・開発
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	804	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	3,960	-	-	-	専門小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	13,799 4銘柄	9,825 2銘柄	21,037 -	374,467 <1.0%>
<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	3,953	399,439	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,953 -	399,439 <1.1%>
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
NATIONAL GRID PLC	2,744.83	2,744.83	2,798	469,871	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	448.5	448.5	1,504	252,694	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,155.92	1,155.92	2,457	412,636	タバコ
UNILEVER PLC	287.09	287.09	1,180	198,292	パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,757.89	3,024.85	3,219	540,662	水道
RIO TINTO PLC	618.76	453.25	2,438	409,369	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	14,990.87	4,350.61	404	67,937	無線通信サービス
SSE PLC	1,437.68	1,437.68	2,479	416,416	電力
BP PLC	5,964.93	5,964.93	2,912	489,067	石油・ガス・消耗燃料
3I GROUP PLC	1,790.74	572.23	776	130,384	資本市場
GSK PLC	2,670.2	2,136.16	2,974	499,429	医薬品
ASTRAZENECA PLC	367.04	367.04	4,020	675,091	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	35,234.45 12銘柄	22,943.09 12銘柄	27,168 -	4,561,854 <12.5%>
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	99.01	99.01	3,083	453,287	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	730.45	730.45	6,064	891,665	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	829.46 2銘柄	829.46 2銘柄	9,148 -	1,344,953 <3.7%>

銘柄	2022年5月26日現在		2022年11月28日現在		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 836.54	百株 836.54	千ユーロ 7,993	千円 106,319	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	836.54 1銘柄	836.54 1銘柄	7,993 -	106,319 <0.3%>
(ユーロ…オランダ) STMICROELECTRONICS NV	百株 480.86	百株 -	千ユーロ -	千円 -	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	480.86 1銘柄	- -銘柄	- -	- <-%>
(ユーロ…フランス) AXA SA DANONE BNP PARIBAS LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE TOTALENERGIES SE SANOFI EUROAPI SASU	百株 2,249.23 353.68 548.37 66.02 902.13 469.31 20.4	百株 2,624.8 353.68 240.76 94.65 902.13 469.31 -	千ユーロ 7,157 1,785 1,283 6,627 5,272 4,108 -	千円 1,033,017 257,614 185,302 956,465 760,861 592,915 -	保険 食品 銀行 繊維・アパレル・贅沢品 石油・ガス・消耗燃料 医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,609.14 7銘柄	4,685.33 6銘柄	26,234 -	3,786,178 <10.4%>
(ユーロ…ドイツ) DEUTSCHE POST AG-REG E.ON SE SIEMENS AG-REG BASF SE ALLIANZ SE DEUTSCHE TELEKOM AG-REG INFINEON TECHNOLOGIES AG	百株 1,155.42 2,473.24 328.85 256.47 132.27 2,955.37 480.72	百株 1,576.58 2,473.24 328.85 244.71 132.27 2,955.37 281.18	千ユーロ 6,035 2,257 4,342 1,213 2,716 5,841 888	千円 870,992 325,741 626,751 175,187 391,996 843,057 128,232	航空貨物・物流サービス 総合公益事業 コングロマリット 化学 保険 各種電気通信サービス 半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,782.34 7銘柄	7,992.2 7銘柄	23,295 -	3,361,960 <9.2%>
(ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA FERROVIAL SA FERROVIAL SA-RTS	百株 2,413.68 1,182.77 1,182.77	百株 2,413.68 1,029 -	千ユーロ 2,611 2,662 -	千円 376,906 384,183 -	電力 建設・土木 建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,779.22 3銘柄	3,442.68 2銘柄	5,273 -	761,089 <2.1%>
(ユーロ…フィンランド) UPM-KYMMENE OYJ FORTUM OYJ	百株 477.99 1,774.25	百株 477.99 -	千ユーロ 1,658 -	千円 239,303 -	紙製品・林産品 電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,252.24 2銘柄	477.99 1銘柄	1,658 -	239,303 <0.7%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	94,944.89 82銘柄	71,355.55 74銘柄	- -	35,950,580 <98.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年11月28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) < >内は、2022年11月28日現在のマザーファンド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

2022年11月28日現在

項 目	第 35 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	13,200,874	99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	101,557	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	13,302,431	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、2022年11月28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36,165,588千円、99.5%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、2022年11月28日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=139.10円、1カナダ・ドル=103.73円、1オーストラリア・ドル=93.46円、1香港・ドル=17.80円、1シンガポール・ドル=101.03円、1台湾・ドル=4.508円、1イギリス・ポンド=167.91円、1スイス・フラン=147.02円、1ノルウェー・クローネ=14.03円、1スウェーデン・クローナ=13.30円、1ユーロ=144.32円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月27日)、(2022年7月26日)、(2022年8月26日)、(2022年9月26日)、(2022年10月26日)、(2022年11月28日)現在

項 目	第 203 期 末	第 204 期 末	第 205 期 末	第 206 期 末	第 207 期 末	第 208 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>12,488,567,157円</b>	<b>12,615,170,129円</b>	<b>12,770,548,299円</b>	<b>12,028,400,254円</b>	<b>12,987,574,927円</b>	<b>13,302,431,478円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	146,181,196	242,507,080	146,597,747	113,983,273	87,156,397	101,557,195
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	12,342,385,961	12,372,663,049	12,623,950,552	11,914,416,981	12,900,418,530	13,200,874,283
<b>(B) 負 債</b>	<b>42,610,948</b>	<b>47,661,713</b>	<b>41,651,281</b>	<b>42,635,031</b>	<b>40,214,774</b>	<b>51,940,652</b>
未 払 収 益 分 配 金	26,647,739	26,927,909	26,863,768	26,771,375	26,671,925	26,536,946
未 払 解 約 金	2,645,428	8,688,242	1,726,232	2,808,538	1,346,992	11,024,152
未 払 信 託 報 酬	13,279,169	12,010,638	13,023,414	13,017,265	12,160,498	14,337,860
そ の 他 未 払 費 用	38,612	34,924	37,867	37,853	35,359	41,694
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>12,445,956,209</b>	<b>12,567,508,416</b>	<b>12,728,897,018</b>	<b>11,985,765,223</b>	<b>12,947,360,153</b>	<b>13,250,490,826</b>
元 本	13,323,869,551	13,463,954,992	13,431,884,288	13,385,687,967	13,335,962,852	13,268,473,449
次 期 繰 越 損 益 金	△877,913,342	△896,446,576	△702,987,270	△1,399,922,744	△388,602,699	△17,982,623
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>13,323,869,551口</b>	<b>13,463,954,992口</b>	<b>13,431,884,288口</b>	<b>13,385,687,967口</b>	<b>13,335,962,852口</b>	<b>13,268,473,449口</b>
1万円当たり基準価額(C/D)	9,341円	9,334円	9,477円	8,954円	9,709円	9,986円

(注) 第202期末における元本額は13,327,728,431円、当作成期間(第203期~第208期)中における追加設定元本額は555,000,284円、同解約元本額は614,255,266円です。

## ■損益の状況

〔自 2022年5月27日 至 2022年6月27日〕〔自 2022年6月28日 至 2022年7月26日〕〔自 2022年7月27日 至 2022年8月26日〕〔自 2022年8月27日 至 2022年9月26日〕〔自 2022年9月27日 至 2022年10月26日〕〔自 2022年10月27日 至 2022年11月28日〕

項 目	第 203 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,773円	△2,742円	△1,446円	△5,303円	△3,900円	△7,064円
受 取 利 息	18	599	61	11	95	32
支 払 利 息	△4,791	△3,341	△1,507	△5,314	△3,995	△7,096
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	51,401,053	30,699,680	230,987,786	△659,477,606	1,044,686,293	408,482,416
売 買 益	55,456,279	30,606,290	231,489,569	1,458,491	1,046,196,690	410,484,561
売 買 損	△4,055,226	93,390	△501,783	△660,936,097	△1,510,397	△2,002,145
(C) 信 託 報 酬 等	△13,317,781	△12,045,562	△13,061,281	△13,055,118	△12,195,857	△14,379,554
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	38,078,499	18,651,376	217,925,059	△672,538,027	1,032,486,536	394,095,798
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,007,534,080	1,014,318,435	999,462,458	1,184,134,509	481,784,914	1,469,060,161
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,896,878,182	△1,902,488,478	△1,893,511,019	△1,884,747,851	△1,876,202,224	△1,854,601,636
(配 当 等 相 当 額)	(327,423,723)	(348,034,549)	(351,910,401)	(353,049,922)	(354,755,969)	(363,991,039)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,224,301,905)	(△2,250,523,027)	(△2,245,421,420)	(△2,237,797,773)	(△2,230,958,193)	(△2,218,592,675)
(G) 合 計 (D + E + F)	△851,265,603	△869,518,667	△676,123,502	△1,373,151,369	△361,930,774	8,554,323
(H) 収 益 分 配 金	△26,647,739	△26,927,909	△26,863,768	△26,771,375	△26,671,925	△26,536,946
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△877,913,342	△896,446,576	△702,987,270	△1,399,922,744	△388,602,699	△17,982,623
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,896,878,182	△1,902,488,478	△1,893,511,019	△1,884,747,851	△1,876,202,224	△1,854,601,636
(配 当 等 相 当 額)	(327,553,895)	(348,125,052)	(351,965,759)	(353,064,708)	(354,775,838)	(364,088,571)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,224,432,077)	(△2,250,613,530)	(△2,245,476,778)	(△2,237,812,559)	(△2,230,978,062)	(△2,218,690,207)
分 配 準 備 積 立 金	1,130,195,853	1,109,827,159	1,190,523,749	1,174,911,934	1,487,599,525	1,836,619,013
繰 越 損 益 金	△111,231,013	△103,785,257	-	△690,086,827	-	-

(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 203 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 期
(a) 経費控除後の配当等収益	34,307,392円	11,712,826円	38,096,511円	17,548,800円	19,171,302円	37,092,699円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	76,722,037	0	327,555,740	357,003,099
(c) 収 益 調 整 金	327,553,895	348,125,052	351,965,759	353,064,708	354,775,838	364,088,571
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,122,536,200	1,125,042,242	1,102,568,969	1,184,134,509	1,167,544,408	1,469,060,161
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	1,484,397,487	1,484,880,120	1,569,353,276	1,554,748,017	1,869,047,288	2,227,244,530
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,114.09	1,102.86	1,168.38	1,161.50	1,401.51	1,678.60
(g) 分 配 金	26,647,739	26,927,909	26,863,768	26,771,375	26,671,925	26,536,946
(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 203 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 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17期（決算日 2022年5月26日）

（計算期間 2021年5月27日～2022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17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			
13期 (2018年5月28日)	円		%	%	%	百万円 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
17期 (2022年5月26日)	31,514	36.7		97.5	—	35,042
	35,715	13.3		98.6	—	

(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)。

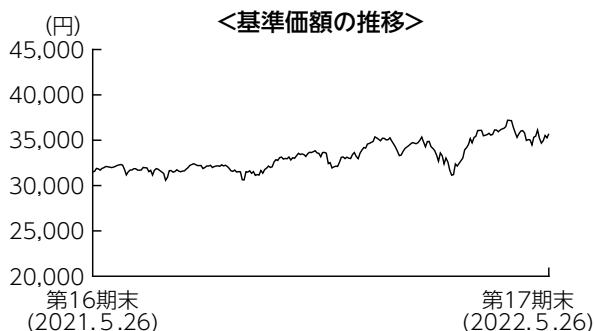
## ■当期中の基準価額の推移

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) 2021年 5 月26日	円 31,514	% -	% -	% 97.5	% -
5 月 末	31,841	1.0		98.1	-
6 月 末	31,689	0.6		98.2	-
7 月 末	31,742	0.7		98.3	-
8 月 末	32,147	2.0		98.4	-
9 月 末	31,527	0.0		98.7	-
10 月 末	33,070	4.9		99.0	-
11 月 末	32,531	3.2		98.8	-
12 月 末	34,761	10.3		98.8	-
2022年 1 月 末	34,239	8.6		98.6	-
2 月 末	33,591	6.6		98.3	-
3 月 末	36,082	14.5		98.6	-
4 月 末	35,711	13.3		99.1	-
(期 末) 2022年 5 月26日	35,715	13.3		98.6	-

(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（2021年5月27日から2022年5月26日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は35,715円となり、前期末比で13.3%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

期初から2021年末までは米国など主要国における経済活動正常化への期待などを背景に上昇しました。2022年1月以降は欧米など主要国における金融引き締め加速への懸念やロシアによるウクライナ侵攻などを受けて、株式市場全体が下落基調で推移する中、当ファンドは景気感応度が比較的低い銘柄を中心に保有していたことなどから堅調に推移し、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

外国株式市場は下落しました。期初から2021年末にかけては、米バイデン政権による経済対策や新型コロナウイルスのワクチン普及を背景にした経済活動正常化への期待感、良好な経済指標と企業業績等に支えられながら上昇しました。しかしその後は、インフレを背景とした欧米など主要国における金融引き締め加速への懸念に加え、ロシアによるウクライナ侵攻、さらには中国における行動制限措置などから景気減速に対する警戒感が強まり、下落基調で推移しました。

為替市場では主要通貨に対し円安が進みました。対米ドルでは、期初から2021年9月にかけては一進一退の推移となりましたが、その後は米国における良好な経済指標への好感や早期利上げ観測から円安基調で推移しました。対ユーロや対ポンドは、期初から2022年3月中旬にかけては欧州での新型コロナウイルス感染再拡大やウクライナ情勢の悪化から概ね円高基調で推移しましたが、その後は欧州の金融政策の正常化観測から円安基調で推移しました。

## 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利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、金融セクターやヘルスケアセクターに対する投資比率を高位に維持しました。

## 今後の運用方針

外国株式市場は、インフレなどを背景とした先行き不透明感の高まりから、値動きの荒い相場展開が予想され、銘柄選択の重要性がより高まると考えます。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)	13円 (13)	0.038% (0.038)	(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)	9 (9)	0.026 (0.026)	(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)	6 (6) (0)	0.019 (0.018) (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	28	0.084	
期中の平均基準価額は33,264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 (2021年5月27日から2022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 7,005.04 (381.22)	千アメリカ・ドル 71,815 (-)	百株 11,792.9	千アメリカ・ドル 89,121
	カ ナ ダ	百株 821.26 (481.14)	千カナダ・ドル 8,057 (-)	百株 2,701.33	千カナダ・ドル 13,047
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 1,650.72 (134.38)	千オーストラリア・ドル 2,087 (-)	百株 -	千オーストラリア・ドル -
	香 港	百株 5,649 (-)	千香港・ドル 29,887 (△219)	百株 7,530	千香港・ドル 23,325
	イ ギ リ ス	百株 6,149.33 (-)	千イギリス・ポンド 3,265 (-)	百株 5,774.76	千イギリス・ポンド 8,666
	ス イ ス	百株 -	千スイス・フラン -	百株 163.81	千スイス・フラン 3,278
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 -	千スウェーデン・クローナ -	百株 651.71	千スウェーデン・クローナ 8,018
国	ユ	百株 825.46 (-)	千ユーロ 2,989 (-)	百株 344.6	千ユーロ 1,192
	イ	1,658.07 (20.4)	12,733 (-)	2,767.01	9,660
	ド	914.2 (-)	3,889 (△189)	3,713.6	11,734
	ス	1,733.3 (6,174.42)	2,725 (-)	8,320.26	3,700
	口	- (-)	- (-)	175.84	602

(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	30,527,331千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	34,810,139千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.87

(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 (2021年5月27日から2022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 末			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	181.48	—	—	—	情報技術サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	389.63	—	—	—	食品
AMEREN CORP	97.24	—	—	—	総合公益事業
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	304.15	346.85	2,679	341,608	医薬品
CAMPBELL SOUP CO	668.83	—	—	—	食品
JPMORGAN CHASE & CO	—	322.44	4,102	523,138	銀行
CISCO SYSTEMS INC	1,560.07	779.8	3,431	437,502	通信機器
CLOROX COMPANY	67.38	—	—	—	家庭用品
CUMMINS INC	89.92	89.92	1,821	232,317	機械
DTE ENERGY CO	71.05	—	—	—	総合公益事業
BANK OF AMERICA CORP	—	815.83	2,923	372,830	銀行
EATON CORP PLC	239.5	116.51	1,562	199,191	電気設備
NEXTERA ENERGY INC	—	326.8	2,444	311,651	電力
GILEAD SCIENCES INC	449.44	250.74	1,630	207,849	バイオテクノロジー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	52.43	1,240	158,208	航空宇宙・防衛
HP INC	945.45	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
CENTERPOINT ENERGY INC	330.42	—	—	—	総合公益事業
JOHNSON & JOHNSON	194.14	354.66	6,370	812,290	医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	165.28	308.36	4,050	516,533	家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	91.18	18.28	818	104,316	航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	413.08	404.64	9,873	1,258,985	ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	1,309.04	1,218.2	7,869	1,003,449	保険
MERCK & CO.INC.	847.56	822.24	7,708	982,910	医薬品
MICROSOFT CORP	347.09	330.31	8,671	1,105,677	ソフトウェア
PACCAR INC	255.42	304.73	2,545	324,526	機械
PAYCHEX INC	—	347.06	4,094	522,148	情報技術サービス
PPL CORPORATION	893.92	636.97	1,907	243,172	電力
PFIZER INC	1,325.42	855.26	4,593	585,730	医薬品
ALTRIA GROUP INC	433.64	—	—	—	タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	239.48	184.41	2,677	341,448	家庭用品
QUALCOMM INC	—	100.07	1,313	167,448	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	136.66	—	—	—	食品
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	1,526	194,630	ガス
TRUIST FINANCIAL CORP	1,195.07	774.53	3,688	470,296	銀行
AT&T INC	1,256.74	1,593.32	3,393	432,739	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	301.37	371.82	6,522	831,632	石油・ガス・消耗燃料
TEXAS INSTRUMENTS INC	184.12	46.97	798	101,821	半導体・半導体製造装置
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	734.05	346.59	1,471	187,646	食品・生活必需品小売り
MASTERCARD INC	—	217.61	7,502	956,621	情報技術サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	637.34	428.18	4,648	592,762	タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	369.16	294.91	3,214	409,920	化学
ABBVIE INC	655.93	269.58	4,096	522,349	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	79.24	41.71	2,217	282,744	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	391.45	262.63	2,170	276,811	コンピュータ・周辺機器
AVANGRID INC	190.06	—	—	—	電力
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	18,482.41 38銘柄	14,075.77 34銘柄	125,581 —	16,012,913 <45.7%>

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(カナダ)</b> NATIONAL BANK OF CANADA ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE RUSSEL METALS INC MAGNA INTERNATIONAL INC CAPITAL POWER CORP NORTHLAND POWER INC	百株 584.27 3,140.56 390.39 1,573.75 388.94 860.16 276.64	百株 757.71 2,036.59 962.28 1,216.48 — 842.72 —	千カナダ・ドル 7,166 3,800 6,745 3,813 — 3,822 —	千円 713,345 378,279 671,455 379,612 — 380,499 —	銀行 総合公益事業 銀行 商社・流通業 自動車部品 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 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 >	7,214.71 7銘柄	5,815.78 5銘柄	25,348 —	2,523,192 <7.2%>
<b>(オーストラリア)</b> BHP GROUP LTD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD AGL ENERGY LTD	百株 581.27 — 776.72	百株 743.7 134.38 2,265.01	千オーストラリア・ドル 3,199 392 1,950	千円 289,865 35,526 176,685	金属・鉱業 石油・ガス・消耗燃料 総合公益事業
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,357.99 2銘柄	3,143.09 3銘柄	5,541 —	502,077 <1.4%>
<b>(香港)</b> BOC HONG KONG HOLDINGS LTD NEW WORLD DEVELOPMENT SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	百株 3,490 5,470 — 6,720	百株 7,495 1,540 804 3,960	千香港・ドル 22,297 4,527 7,806 10,375	千円 362,113 73,528 126,783 168,493	銀行 不動産管理・開発 繊維・アパレル・贅沢品 専門小売り
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	15,680 3銘柄	13,799 4銘柄	45,007 —	730,917 <2.1%>
<b>(シンガポール)</b> UNITED OVERSEAS BANK LTD	百株 1,307	百株 1,307	千シンガポール・ドル 3,768	千円 349,828	銀行
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,768 —	349,828 <1.0%>
<b>(イギリス)</b> NATIONAL GRID PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC IMPERIAL BRANDS PLC UNILEVER PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC RIO TINTO PLC VODAFONE GROUP PLC SSE PLC BP PLC 3I GROUP PLC GSK PLC ASTRAZENECA PLC	百株 5,418.8 401.83 1,637.2 696.17 3,384.49 906.4 10,084.8 1,179.15 5,964.93 2,194.47 2,670.2 321.44	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 287.09 2,757.89 618.76 14,990.87 1,437.68 5,964.93 1,790.74 2,670.2 367.04	千イギリス・ポンド 3,367 1,605 2,128 1,002 3,068 3,493 1,951 2,684 2,551 2,213 4,739 3,890	千円 541,323 258,108 342,134 161,180 493,144 561,513 313,714 431,538 410,150 355,752 761,796 625,339	総合公益事業 タバコ タバコ パーソナル用品 水道 金属・鉱業 無線通信サービス 電力 石油・ガス・消耗燃料 資本市場 医薬品 医薬品
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	34,859.88 12銘柄	35,234.45 12銘柄	32,698 —	5,255,697 <15.0%>
<b>(スイス)</b> ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 168.48 824.79	百株 99.01 730.45	千スイス・フラン 3,297 6,414	千円 437,186 850,604	医薬品 医薬品
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	993.27 2銘柄	829.46 2銘柄	9,711 —	1,287,790 <3.7%>
<b>(スウェーデン)</b> TELE2 AB-B SHS	百株 1,488.25	百株 836.54	千スウェーデン・クローナ 9,988	千円 129,348	無線通信サービス
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,488.25 1銘柄	836.54 1銘柄	9,988 —	129,348 <0.4%>



銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ) STMICROELECTRONICS NV	百株 -	百株 480.86	千ユーロ 1,720	千円 234,866	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	- 1銘柄	- -	1,720 <0.7%>	
(ユーロ…フランス) AXA SA DANONE BNP PARIBAS LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE TOTALENERGIES SE SANOFI EUROAPI SASU	百株 3,479.79 416.6 - - 1,181.28 620.01 -	百株 2,249.23 353.68 548.37 66.02 902.13 469.31 20.4	千ユーロ 5,316 1,943 2,844 3,637 4,866 4,867 27	千円 725,588 265,312 388,231 496,509 664,295 664,390 3,689	保険 食品 銀行 繊維・アパレル・贅沢品 石油・ガス・消耗燃料 医薬品 医薬品
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	5,697.68 4銘柄	4,609.14 7銘柄	23,503 -	3,208,017 <9.2%>
(ユーロ…ドイツ) DEUTSCHE POST AG-REG E.ON SE SIEMENS AG-REG BASF SE ALLIANZ SE DEUTSCHE TELEKOM AG-REG INFINEON TECHNOLOGIES AG	百株 1,706.71 4,209.62 393.08 256.47 297.39 3,718.47 -	百株 1,155.42 2,473.24 328.85 256.47 132.27 2,955.37 480.72	千ユーロ 4,333 2,455 3,775 1,268 2,612 5,564 1,290	千円 591,544 335,142 515,366 173,155 356,521 759,561 176,139	航空貨物・物流サービス 総合公益事業 コングロマリット 化学 保険 各種電気通信サービス 半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	10,581.74 6銘柄	7,782.34 7銘柄	21,301 -	2,907,430 <8.3%>
(ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA RED ELECTRICA DE CORPORACION SA FERROVIAL SA FERROVIAL SA-RTS FERROVIAL SA-RTS	百株 2,361.49 752.35 1,106.4 971.52 -	百株 2,413.68 - 1,182.77 - 1,182.77	千ユーロ 2,755 - 2,855 - 31	千円 376,059 - 389,707 - 4,358	電力 電力 建設・土木 建設・土木 建設・土木
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	5,191.76 4銘柄	4,779.22 3銘柄	5,642 -	770,125 <2.2%>
(ユーロ…フィンランド) UPM-KYMMENE OYJ FORTUM OYJ	百株 653.83 1,774.25	百株 477.99 1,774.25	千ユーロ 1,599 3,133	千円 218,361 427,667	紙製品・林産品 電力
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	2,428.08 2銘柄	2,252.24 2銘柄	4,733 -	646,028 <1.8%>
合 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	105,282.77 82銘柄	94,944.89 82銘柄	- -	34,558,234 <98.6%>

(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

2022年5月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	34,558,235	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,041,220	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	35,599,455	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、34,826,380千円、97.8%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、2022年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=127.51円、1カナダ・ドル=99.54円、1オーストラリア・ドル=90.60円、1香港・ドル=16.24円、1シンガポール・ドル=92.84円、1台湾・ドル=4.319円、1イギリス・ポンド=160.73円、1スイス・フラン=132.60円、1ノルウェー・クローネ=13.35円、1スウェーデン・クローナ=12.95円、1ユーロ=136.49円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年5月26日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	35,599,455,179円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	311,692,836
株 式(評価額)	34,558,235,003
未 収 入 金	660,941,900
未 収 配 当 金	68,585,440
(B) 負 債	556,900,843
未 払 金	556,900,843
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	35,042,554,336
元 本	9,811,624,078
次 期 繰 越 損 益 金	25,230,930,258
(D) 受 益 権 総 口 数	9,811,624,078口
1万口当たり基準価額(C/D)	35,715円

(注1) 期首元本額 11,518,532,199円

追加設定元本額 36,362,077円

一部解約元本額 1,743,270,198円

(注2) 期末における元本の内訳

D I AM世界好配当株オープン (毎月決算コース) 3,454,328,003円

D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 5,734,187,336円

D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) 37,708,836円

D I AM世界6資産バランスファンド 59,963,922円

D I AMグローバル・アクティブ・バランスファンド 76,127,060円

D I AM世界インカム・オープン (毎月決算コース) 269,231,597円

D I AM世界3資産オープン (毎月決算型) 180,077,324円

期末元本合計 9,811,624,078円

## ■損益の状況

当期 自2021年5月27日 至2022年5月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,223,446,235円
受 取 配 当 金	1,223,502,261
受 取 利 息	4,264
支 払 利 息	△60,290
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,195,950,922
売 買 益	6,464,473,666
売 買 損	△3,268,522,744
(C) そ の 他 費 用	△6,837,184
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	4,412,559,973
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	24,781,462,164
(F) 解 約 差 損 益 金	△4,042,729,802
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	79,637,923
(H) 合 計(D+E+F+G)	25,230,930,258
次 期 繰 越 損 益 金(H)	25,230,930,258

(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。