

## 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191期	<決算日	2021年6月28日>
第192期	<決算日	2021年7月26日>
第193期	<決算日	2021年8月26日>
第194期	<決算日	2021年9月27日>
第195期	<決算日	2021年10月26日>
第196期	<決算日	2021年11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11月26日に第196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 比	株式先物率 比	純資産額
		(分配落)	税金 込 配 金	期騰 落 率			
第29作成期	167期(2019年6月26日)	円 7,636	円 20	% 0.6	% 95.9	% -	百万円 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
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

(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191期	(期首) 2021年5月26日	8,564	—	96.6	—
	5月末	8,650	1.0	97.1	—
	(期末) 2021年6月28日	8,647	1.0	97.3	—
第192期	(期首) 2021年6月28日	8,627	—	97.3	—
	6月末	8,581	△0.5	97.6	—
	(期末) 2021年7月26日	8,560	△0.8	97.3	—
第193期	(期首) 2021年7月26日	8,540	—	97.3	—
	7月末	8,566	0.3	97.5	—
	(期末) 2021年8月26日	8,691	1.8	97.7	—
第194期	(期首) 2021年8月26日	8,671	—	97.7	—
	8月末	8,646	△0.3	97.7	—
	(期末) 2021年9月27日	8,461	△2.4	97.9	—
第195期	(期首) 2021年9月27日	8,441	—	97.9	—
	9月末	8,451	0.1	97.9	—
	(期末) 2021年10月26日	8,824	4.5	98.6	—
第196期	(期首) 2021年10月26日	8,804	—	98.6	—
	10月末	8,834	0.3	98.2	—
	(期末) 2021年11月26日	8,957	1.7	98.2	—

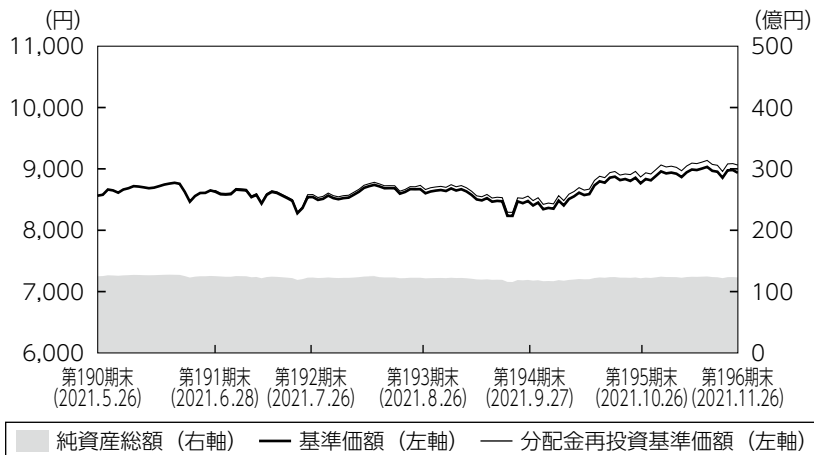
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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191期～第196期の運用経過（2021年5月27日から2021年11月26日まで）

### 基準価額等の推移



第191期首： 8,564円  
第196期末： 8,937円  
（既払分配金120円）  
騰落率： 5.8%  
（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変異株の感染拡大や、FOMC（米連邦公開市場委員会）のタカ派化への警戒感、中国不動産大手を巡る懸念から外国株式市場は一時軟調に推移する局面も見られましたが、堅調な企業決算や経済指標、新型コロナウイルス経口薬の開発進展などを背景と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。

## 投資環境

外国株式市場は上昇しました。作成期初から2021年8月にかけては新型コロナウイルス変異株の感染拡大などから一時的に調整する局面が見られつつも、米欧企業の好決算や金融緩和継続の観測などから上昇基調となりました。9月はFOMCのタカ派化への警戒感や中国不動産大手を巡る懸念から下落しましたが、10月以降は新型コロナウイルス経口薬の開発進展や堅調な企業決算などから再び上昇しました。

為替市場では、ドル／円については米金融政策の正常化観測から作成期初比で円安となりました。ユーロ／円とポンド／円については、欧州における新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などからリスク回避姿勢が強まり、作成期初比で円高となりました。

## 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、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に対する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	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%



#### 当作成期末

	国・地域	組入比率
北米	米国	41.6%
	カナダ	7.0%
	計	48.6%
中南米	ケイマン	1.5%
	計	1.5%
欧州	フィンランド	2.2%
	フランス	9.0%
	ドイツ	10.8%
	アイルランド	2.5%
	オランダ	2.2%
	スペイン	2.9%
	スウェーデン	0.4%
	スイス	4.1%
	英国	11.5%
計	45.6%	
アジア・オセアニア	オーストラリア	0.6%
	香港	1.0%
	シンガポール	0.9%
	計	2.5%
	株式計	98.2%
	現金など	1.8%
	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	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



#### 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	17.4%
2	銀行	12.3
3	公益事業	9.5
4	資本財	8.9
5	半導体・半導体製造装置	7.1
6	ソフトウェア・サービス	6.3
7	保険	6.0
8	消費者サービス	3.6
9	電気通信サービス	3.6
10	素材	3.6

## 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191期	第192期	第193期	第194期	第195期	第196期
	2021年5月27日 ～2021年6月28日	2021年6月29日 ～2021年7月26日	2021年7月27日 ～2021年8月26日	2021年8月27日 ～2021年9月27日	2021年9月28日 ～2021年10月26日	2021年10月27日 ～2021年11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	0.23%	0.23%	0.23%	0.24%	0.23%	0.22%
当期の収益	20円	3円	20円	7円	14円	20円
当期の収益以外	-円	16円	-円	12円	5円	-円
翌期繰越分配対象額	555円	538円	549円	537円	532円	607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、引き続き世界的に潤沢な流動性や経済正常化への期待が支えとなるものの、新型コロナウイルス変異株の感染状況やインフレ過熱に対する懸念などに揺さぶられやすい相場展開を想定します。運用方針としては、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への選別投資を継続します。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第191期～第196期 (2021年5月27日 ～2021年11月26日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	53円	
(投信会社)	(25)	(0.288)	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)	(25)	(0.288)	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	2	0.021	(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)	( 2)	(0.021)	
(c) 有価証券取引税	1	0.014	(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)	(0.014)	
(d) その他費用	1	0.013	(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)	(0.011)	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)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	57	0.657	

(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。

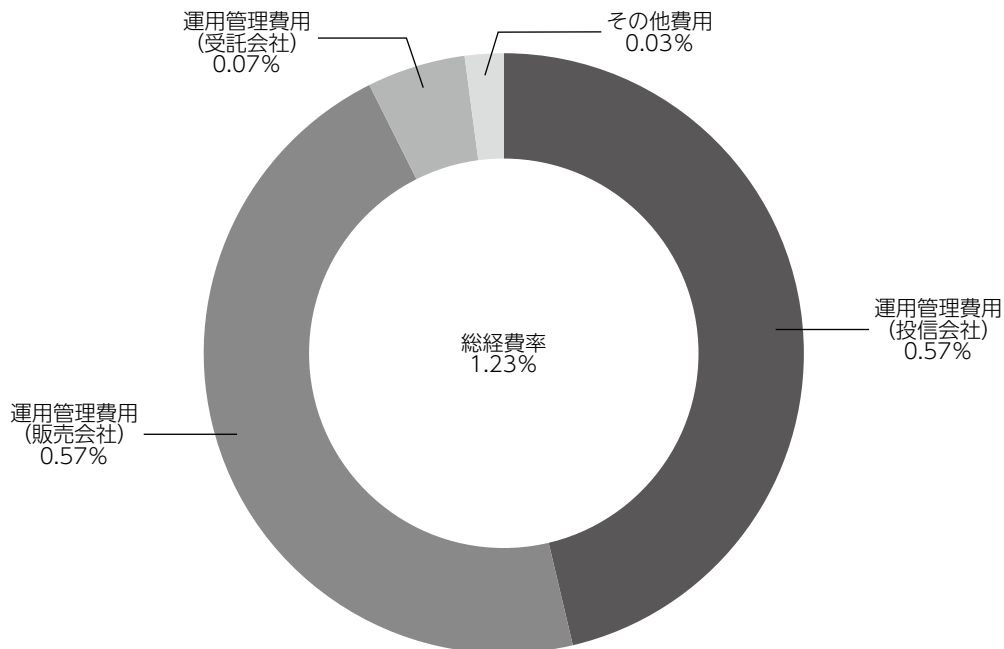
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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1.23%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（2021年5月27日から2021年11月26日まで）

	第 191 期 ~ 第 196 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□ 289,112	千円 930,000

■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 191 期 ~ 第 196 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	18,755,131千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	35,008,632千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.53

(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2021年11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32作成期末	第 33 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□ 3,928,789	千□ 3,639,676	千円 12,217,301

<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（10,466,804,630口）の内容です。  
外国株式

銘柄	2021年5月26日現在		2021年11月26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	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	181.48	36.16	422	48,511	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	260.72	1,481	170,228	医薬品
CAMPBELL SOUP CO	668.83	—	—	—	食品
JPMORGAN CHASE & CO	—	365.29	6,098	700,944	銀行
CISCO SYSTEMS INC	1,560.07	917.66	5,096	585,761	通信機器
CLOROX COMPANY	67.38	—	—	—	家庭用品
CUMMINS INC	89.92	89.92	2,030	233,415	機械
DTE ENERGY CO	71.05	—	—	—	総合公益事業
BANK OF AMERICA CORP	—	983.39	4,683	538,319	銀行
EATON CORP PLC	239.5	239.5	4,094	470,552	電気設備
GILEAD SCIENCES INC	449.44	449.44	3,149	361,940	バイオテクノロジー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	147.36	3,223	370,459	航空宇宙・防衛
HP INC	945.45	344.2	1,219	140,196	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	223.11	3,575	410,887	医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	165.28	201.97	2,731	313,901	家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	91.18	18.28	628	72,183	航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	413.08	435.29	11,191	1,286,266	ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	1,309.04	1,097.39	6,872	789,908	保険
MERCK & CO.INC.	847.56	640.48	5,269	605,666	医薬品
MICROSOFT CORP	347.09	276.07	9,328	1,072,145	ソフトウェア
PACCAR INC	255.42	255.42	2,266	260,441	機械
PAYCHEX INC	—	387.14	4,842	556,530	情報技術サービス
PPL CORPORATION	893.92	636.97	1,825	209,811	電力
PFIZER INC	1,325.42	1,325.42	6,745	775,210	医薬品
ALTRIA GROUP INC	433.64	—	—	—	タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	239.48	165.83	2,465	283,328	家庭用品
QUALCOMM INC	—	322.88	5,834	670,589	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	136.66	—	—	—	食品
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	1,088	125,052	ガス
TRUIST FINANCIAL CORP	1,195.07	911.06	5,729	658,509	銀行
AT&T INC	1,256.74	1,125.66	2,754	316,573	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	301.37	301.37	3,531	405,904	石油・ガス・消耗燃料
TEXAS INSTRUMENTS INC	184.12	153.72	2,976	342,033	半導体・半導体製造装置
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	734.05	346.59	1,615	185,704	食品・生活必需品小売り
MASTERCARD INC	—	136.77	4,650	534,445	情報技術サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	637.34	325.8	2,933	337,110	タバコ

銘柄	2021年5月26日現在		2021年11月26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>(アメリカ)</b>	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	369.16	294.91	2,700	310,333	化学
ABBVIE INC	655.93	566.29	6,719	772,283	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	79.24	90.7	5,067	582,428	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	391.45	343.55	3,471	398,948	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	14,857.72 35銘柄	138,314 -	15,896,528 <45.2%>
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	584.27	738.91	7,687	697,497	銀行
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	3,140.56	2,036.59	3,586	325,397	総合公益事業
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	390.39	509.98	7,617	691,095	銀行
RUSSEL METALS INC	1,573.75	1,216.48	4,266	387,071	商社・流通業
MAGNA INTERNATIONAL INC	388.94	164.37	1,722	156,276	自動車部品
CAPITAL POWER CORP	860.16	623.43	2,492	226,142	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NORTHLAND POWER INC	276.64	-	-	-	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	5,289.76 6銘柄	27,372 -	2,483,481 <7.1%>
<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	2,244	184,931	金属・鉱業
AGL ENERGY LTD	776.72	776.72	417	34,424	総合公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,357.99 2銘柄	1,357.99 2銘柄	2,662 -	219,356 <0.6%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,490	7,495	18,400	271,219	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	5,470	1,540	5,020	74,000	不動産管理・開発
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	-	804	12,751	187,956	繊維・アパレル・贅沢品
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	6,720	6,180	22,927	337,955	専門小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,680 3銘柄	16,019 4銘柄	59,099 -	871,132 <2.5%>
<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	3,602	302,611	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,602 -	302,611 <0.9%>
<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	2,466.1	2,483	379,855	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	401.83	401.83	1,049	160,513	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,637.2	1,155.92	1,842	281,834	タバコ
UNILEVER PLC	696.17	287.09	1,140	174,511	パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,384.49	2,255.44	2,451	375,006	水道
RIO TINTO PLC	906.4	507.48	2,368	362,349	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	10,084.8	10,084.8	1,150	176,007	無線通信サービス
SSE PLC	1,179.15	1,179.15	1,891	289,301	電力
BP PLC	5,964.93	5,964.93	2,056	314,502	石油・ガス・消耗燃料
3I GROUP PLC	2,194.47	2,037.33	2,942	450,149	資本市場

銘 柄	2021年5月26日現在		2021 年 11 月 26 日 現 在		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,670.2	2,670.2	4,112	628,988	医薬品
ASTRAZENECA PLC	321.44	367.04	3,122	477,659	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	34,859.88 12銘柄	29,377.31 12銘柄	26,612 -	4,070,679 <11.6%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	168.48	168.48	6,099	750,521	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	824.79	730.45	5,593	688,169	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	993.27 2銘柄	898.93 2銘柄	11,692 -	1,438,691 <4.1%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
TELE2 AB-B SHS	1,488.25	836.54	10,933	137,981	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	10,933 -	137,981 <0.4%>
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
STMICROELECTRONICS NV	-	825.46	3,591	463,043	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	- 1銘柄	825.46 1銘柄	3,591 -	463,043 <1.3%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AXA SA	3,479.79	2,934.49	7,474	963,492	保険
DANONE	416.6	227.94	1,278	164,813	食品
BNP PARIBAS	-	654.66	3,844	495,635	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	-	55.63	4,087	526,872	繊維・アパレル・贅沢品
TOTALENERGIES SE	1,181.28	902.13	3,886	501,050	石油・ガス・消耗燃料
SANOFI	620.01	469.31	4,066	524,221	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	5,697.68 4銘柄	5,244.16 6銘柄	24,638 -	3,176,086 <9.0%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,706.71	1,409.02	7,796	1,004,996	航空貨物・物流サービス
E.ON SE	4,209.62	2,473.24	2,734	352,557	総合公益事業
SIEMENS AG-REG	393.08	393.08	6,036	778,219	コングロマリット
BASF SE	256.47	256.47	1,580	203,692	化学
ALLIANZ SE	297.39	145.66	2,951	380,516	保険
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,718.47	2,955.37	4,979	641,945	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	-	878.76	3,630	467,963	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	10,581.74 6銘柄	8,511.6 7銘柄	29,709 -	3,829,891 <10.9%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	2,361.49	2,074.81	2,129	274,551	電力
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	752.35	752.35	1,388	178,986	電力
FERROVIAL SA	1,106.4	1,671.43	4,534	584,553	建設・土木
FERROVIAL SA-RTS	971.52	-	-	-	建設・土木
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	5,191.76 4銘柄	4,498.59 3銘柄	8,052 -	1,038,092 <3.0%>

銘柄		2021年5月26日現在	2021年11月26日現在		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(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 1,577 4,593	千円 203,338 592,152	紙製品・林産品 電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,428.08 2銘柄	2,252.24 2銘柄	6,170 -	795,490 <2.3%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	105,282.77 82銘柄	91,276.3 82銘柄	- -	34,723,066 <98.8%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月26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、2021年11月26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

2021年11月26日現在

項 目	第 33 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	12,217,301	99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	129,160	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	12,346,461	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11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34,907,326千円、99.4%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11月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=114.93円、1カナダ・ドル=90.73円、1オーストラリア・ドル=82.38円、1香港・ドル=14.74円、1シンガポール・ドル=84.01円、1台湾・ドル=4.133円、1イギリス・ポンド=152.96円、1スイス・フラン=123.04円、1ノルウェー・クローネ=12.80円、1スウェーデン・クローナ=12.62円、1ユーロ=128.91円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月28日)、(2021年7月26日)、(2021年8月26日)、(2021年9月27日)、(2021年10月26日)、(2021年11月26日)現在

項 目	第 191 期 末	第 192 期 末	第 193 期 末	第 194 期 末	第 195 期 末	第 196 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>12,566,849,546円</b>	<b>12,320,144,167円</b>	<b>12,295,955,448円</b>	<b>11,902,552,394円</b>	<b>12,289,426,228円</b>	<b>12,346,461,440円</b>
コール・ローン等	170,667,617	59,389,309	136,766,117	136,759,928	136,874,943	129,160,303
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	12,396,181,929	12,160,754,858	12,159,189,331	11,765,792,466	12,152,551,285	12,217,301,137
未 収 入 金	-	100,000,000	-	-	-	-
<b>(B) 負 債</b>	<b>47,169,714</b>	<b>41,150,856</b>	<b>42,427,197</b>	<b>56,972,217</b>	<b>56,126,681</b>	<b>46,613,605</b>
未 払 収 益 分 配 金	29,025,846	28,756,652	28,263,755	28,065,813	27,789,368	27,524,146
未 払 解 約 金	4,299,978	949,062	1,486,431	16,111,416	16,759,057	6,376,361
未 払 信 託 報 酬	13,803,748	11,411,955	12,640,254	12,757,890	11,544,683	12,676,235
そ の 他 未 払 費 用	40,142	33,187	36,757	37,098	33,573	36,863
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>12,519,679,832</b>	<b>12,278,993,311</b>	<b>12,253,528,251</b>	<b>11,845,580,177</b>	<b>12,233,299,547</b>	<b>12,299,847,835</b>
元 本	14,512,923,404	14,378,326,128	14,131,877,750	14,032,906,616	13,894,684,470	13,762,073,009
次 期 繰 越 損 益 金	△1,993,243,572	△2,099,332,817	△1,878,349,499	△2,187,326,439	△1,661,384,923	△1,462,225,174
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>14,512,923,404口</b>	<b>14,378,326,128口</b>	<b>14,131,877,750口</b>	<b>14,032,906,616口</b>	<b>13,894,684,470口</b>	<b>13,762,073,009口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	8,627円	8,540円	8,671円	8,441円	8,804円	8,937円

(注) 第190期末における元本額は14,596,870,665円、当作成期間(第191期~第196期)中における追加設定元本額は187,517,369円、同解約元本額は1,022,315,025円です。

## ■損益の状況

〔自 2021年5月27日 至 2021年6月28日〕〔自 2021年6月29日 至 2021年7月26日〕〔自 2021年7月27日 至 2021年8月26日〕〔自 2021年8月27日 至 2021年9月27日〕〔自 2021年9月28日 至 2021年10月26日〕〔自 2021年10月27日 至 2021年11月26日〕

項 目	第 191 期	第 192 期	第 193 期	第 194 期	第 195 期	第 196 期
(A) 配 当 等 収 益	△2,385円	△2,239円	△3,024円	△1,403円	△1,414円	△1,912円
受 取 利 息	8	8	74	83	29	9
支 払 利 息	△2,393	△2,247	△3,098	△1,486	△1,443	△1,921
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	133,764,851	△84,243,226	225,808,332	△281,138,598	543,608,720	223,127,446
売 買 益	135,028,315	802,711	228,527,870	1,896,334	546,911,143	224,891,588
売 買 損	△1,263,464	△85,045,937	△2,719,538	△283,034,932	△3,302,423	△1,764,142
(C) 信 託 報 酬 等	△13,843,890	△11,445,142	△12,677,011	△12,794,988	△11,578,256	△12,713,098
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	119,918,576	△95,690,607	213,128,297	△293,934,989	532,029,050	210,412,436
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	14,416,561	104,150,942	△19,912,887	163,534,567	△156,679,685	343,217,416
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,098,552,863	△2,079,036,500	△2,043,301,154	△2,028,860,204	△2,008,944,920	△1,988,330,880
(配 当 等 相 当 額)	(321,719,651)	(319,603,861)	(314,931,355)	(313,487,209)	(311,036,165)	(309,342,331)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,420,272,514)	(△2,398,640,361)	(△2,358,232,509)	(△2,342,347,413)	(△2,319,981,085)	(△2,297,673,211)
(G) 合 計 (D + E + F)	△1,964,217,726	△2,070,576,165	△1,850,085,744	△2,159,260,626	△1,633,595,555	△1,434,701,028
(H) 収 益 分 配 金	△29,025,846	△28,756,652	△28,263,755	△28,065,813	△27,789,368	△27,524,146
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△1,993,243,572	△2,099,332,817	△1,878,349,499	△2,187,326,439	△1,661,384,923	△1,462,225,174
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,098,552,863	△2,079,036,500	△2,043,301,154	△2,028,860,204	△2,008,944,920	△1,988,330,880
(配 当 等 相 当 額)	(321,752,628)	(319,612,323)	(314,959,540)	(313,495,679)	(311,046,165)	(309,364,455)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,420,305,491)	(△2,398,648,823)	(△2,358,260,694)	(△2,342,355,883)	(△2,319,991,085)	(△2,297,695,335)
分 配 準 備 積 立 金	484,095,579	455,236,114	462,023,011	441,162,390	428,729,413	526,105,706
繰 越 損 益 金	△378,786,288	△475,532,431	△297,071,356	△599,628,625	△81,169,416	-

(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 191 期	第 192 期	第 193 期	第 194 期	第 195 期	第 196 期
(a) 経費控除後の配当等収益	38,791,563円	5,221,997円	43,650,754円	11,174,392円	20,330,066円	25,572,783円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	104,684,406
(c) 収 益 調 整 金	321,752,628	319,612,323	314,959,540	313,495,679	311,046,165	309,364,455
(d) 分 配 準 備 積 立 金	474,329,862	478,770,769	446,636,012	458,053,811	436,188,715	423,372,663
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	834,874,053	803,605,089	805,246,306	782,723,882	767,564,946	862,994,307
(f) 1万口当たり当期分配対象額	575.26	558.90	569.81	557.78	552.42	627.08
(g) 分 配 金	29,025,846	28,756,652	28,263,755	28,065,813	27,789,368	27,524,146
(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 191 期	第 192 期	第 193 期	第 194 期	第 195 期	第 196 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）。

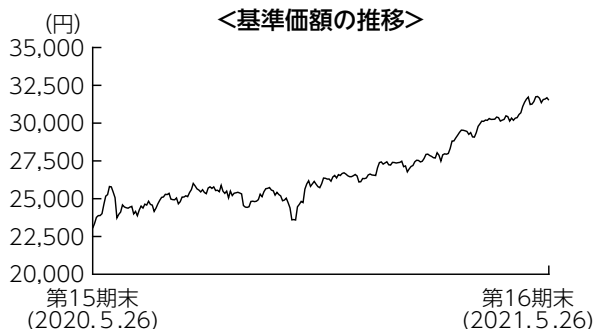
## ■当期中の基準価額の推移

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 ー ロ	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 284.71	千ユーロ 899
	イ ン ド	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		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	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	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	
<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。