

運用報告書 (全体版)

D I A M世界好配当株式ファンド(毎月決算型)

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	2010年2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世界好配当株式ファンド(毎月決算型)	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21日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。原則として利子配当等収益等を中心に安定分配を行うことを基本とします。 ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

愛称：ハッピーインカム

第149期	<決算日	2022年7月21日>
第150期	<決算日	2022年8月22日>
第151期	<決算日	2022年9月21日>
第152期	<決算日	2022年10月21日>
第153期	<決算日	2022年11月21日>
第154期	<決算日	2022年12月21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世界好配当株式ファンド(毎月決算型)」は、2022年12月21日に第154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世界好配当株式ファンド（毎月決算型）

■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)	税分 込配 み金	期騰 落 中率			
第22作成期	125期(2020年7月21日)	円 6,998	円 85	% 3.5	% 95.6	% -	百万円 19,761
	126期(2020年8月21日)	6,943	85	0.4	95.7	-	19,776
	127期(2020年9月23日)	6,619	85	△3.4	96.2	-	18,979
	128期(2020年10月21日)	6,698	85	2.5	97.1	-	19,294
	129期(2020年11月24日)	6,814	85	3.0	97.6	-	19,713
	130期(2020年12月21日)	6,857	85	1.9	96.2	-	19,869
第23作成期	131期(2021年1月21日)	6,990	85	3.2	97.2	-	20,332
	132期(2021年2月22日)	6,977	85	1.0	96.3	-	20,250
	133期(2021年3月22日)	7,268	85	5.4	96.7	-	21,049
	134期(2021年4月21日)	7,391	85	2.9	96.7	-	21,247
	135期(2021年5月21日)	7,642	85	4.5	96.0	-	21,935
	136期(2021年6月21日)	7,461	85	△1.3	97.3	-	21,329
第24作成期	137期(2021年7月21日)	7,304	85	△1.0	97.2	-	21,008
	138期(2021年8月23日)	7,502	45	3.3	97.6	-	21,579
	139期(2021年9月21日)	7,138	45	△4.3	98.7	-	19,749
	140期(2021年10月21日)	7,664	45	8.0	98.3	-	20,956
	141期(2021年11月22日)	7,621	45	0.0	98.0	-	20,601
	142期(2021年12月21日)	7,522	45	△0.7	97.6	-	20,270
第25作成期	143期(2022年1月21日)	7,751	45	3.6	97.5	-	20,690
	144期(2022年2月21日)	7,672	45	△0.4	97.5	-	20,393
	145期(2022年3月22日)	7,714	45	1.1	97.9	-	20,468
	146期(2022年4月21日)	8,251	45	7.5	97.9	-	21,756
	147期(2022年5月23日)	7,708	45	△6.0	98.0	-	20,246
	148期(2022年6月21日)	7,642	45	△0.3	98.1	-	20,045
第26作成期	149期(2022年7月21日)	7,908	45	4.1	97.6	-	20,736
	150期(2022年8月22日)	8,052	45	2.4	97.1	-	21,076
	151期(2022年9月21日)	7,789	45	△2.7	97.8	-	20,356
	152期(2022年10月21日)	7,815	45	0.9	97.4	-	20,446
	153期(2022年11月21日)	8,152	45	4.9	98.2	-	21,328
	154期(2022年12月21日)	7,618	45	△6.0	97.9	-	19,877

(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、ベンチマークおよ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	騰 落 率		株式組入比率	株式先物比率
			騰	落		
第149期	(期首) 2022年6月21日	円 7,642	% -	% -	% 98.1	% -
	6 月 末	7,905	3.4	97.7	-	
	(期末) 2022年7月21日	7,953	4.1	97.6	-	
第150期	(期首) 2022年7月21日	7,908	-	97.6	-	
	7 月 末	7,825	△1.0	97.3	-	
	(期末) 2022年8月22日	8,097	2.4	97.1	-	
第151期	(期首) 2022年8月22日	8,052	-	97.1	-	
	8 月 末	7,778	△3.4	97.0	-	
	(期末) 2022年9月21日	7,834	△2.7	97.8	-	
第152期	(期首) 2022年9月21日	7,789	-	97.8	-	
	9 月 末	7,401	△5.0	97.5	-	
	(期末) 2022年10月21日	7,860	0.9	97.4	-	
第153期	(期首) 2022年10月21日	7,815	-	97.4	-	
	10 月 末	8,228	5.3	98.0	-	
	(期末) 2022年11月21日	8,197	4.9	98.2	-	
第154期	(期首) 2022年11月21日	8,152	-	98.2	-	
	11 月 末	8,153	0.0	98.1	-	
	(期末) 2022年12月21日	7,663	△6.0	97.9	-	

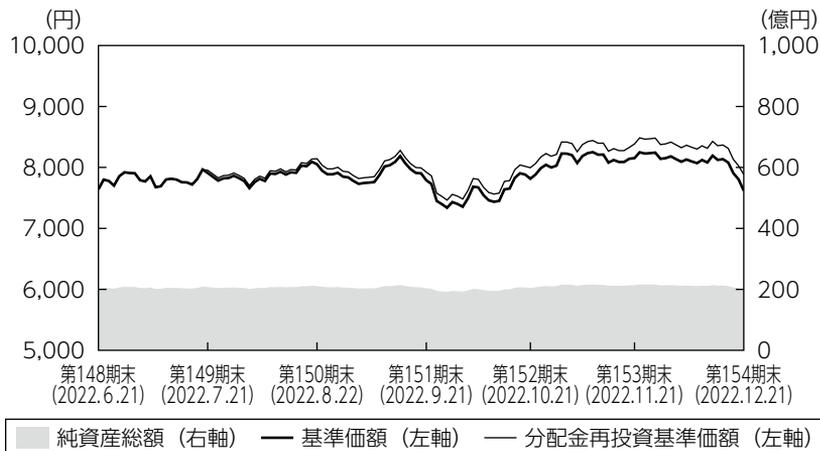
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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149期～第154期の運用経過（2022年6月22日から2022年12月21日まで）

基準価額等の推移



第149期首： 7,642円
 第154期末： 7,618円
 (既払分配金270円)
 騰落率： 3.1%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

主要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上昇したことに加え、配当利回りの高い銘柄が選好されたことから基準価額は上昇しました。一方で主要通貨に対して円高が進行したことが、基準価額の低下圧力となりました。

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から下落しましたが、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再び上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円高が進みました。対米ドルでは、F R B（米連邦準備理事会）の積極的な金融引き締めスタンスを背景に2022年10月中旬まで円安基調で推移しましたが、その後は利上げ幅縮小への期待に加え、日銀が長期金利の許容変動幅拡大を決定したことから円高に転じました。対ユーロとポンドでは、作成期中は概ね一進一退の推移となりましたが、日銀の金融政策変更を受け、作成期末にかけて円高が進みました。

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しました。

●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、ヘルスケアセクター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・地域を表示しております。

(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	43.2%
	カナダ	7.1%
	計	50.3%
中南米	ケイマン	0.9%
	計	0.9%
欧州	フィンランド	1.8%
	フランス	9.2%
	ドイツ	8.3%
	アイルランド	1.3%
	オランダ	1.7%
	スペイン	2.1%
	スウェーデン	0.4%
	スイス	3.6%
	英国	14.6%
	計	43.1%
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.5%
	香港	1.4%
	シンガポール	1.0%
	計	3.8%
	小計	98.1%
	現金など	1.9%
	合計	100%



当作成期末

	国・地域	組入比率
北米	米国	48.0%
	カナダ	4.2%
	計	52.2%
欧州	フィンランド	0.7%
	フランス	10.7%
	ドイツ	9.6%
	アイルランド	0.7%
	オランダ	0.9%
	スペイン	2.1%
	スウェーデン	0.3%
	スイス	3.8%
	英国	12.9%
	計	41.7%
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.0%
	香港	1.8%
	シンガポール	1.2%
	計	4.0%
	小計	97.9%
	現金など	2.1%
	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	11.8
3	銀行	11.1
4	ソフトウェア・サービス	7.4
5	資本財	6.5
6	保険	6.1
7	エネルギー	5.3
8	電気通信サービス	4.8
9	素材	4.5
10	食品・飲料・タバコ	4.2



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	20.6%
2	公益事業	9.8
3	銀行	8.8
4	保険	7.4
5	ソフトウェア・サービス	7.0
6	資本財	6.3
7	食品・飲料・タバコ	6.3
8	エネルギー	6.1
9	消費者サービス	4.4
10	素材	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149期	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期
	2022年6月22日 ~2022年7月21日	2022年7月22日 ~2022年8月22日	2022年8月23日 ~2022年9月21日	2022年9月22日 ~2022年10月21日	2022年10月22日 ~2022年11月21日	2022年11月22日 ~2022年12月21日
当期分配金（税引前）	45円	45円	45円	45円	45円	45円
対基準価額比率	0.57%	0.56%	0.57%	0.57%	0.55%	0.59%
当期の収益	18円	23円	8円	13円	45円	17円
当期の収益以外	27円	21円	36円	31円	-円	28円
翌期繰越分配対象額	2,342円	2,320円	2,284円	2,253円	2,319円	2,292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・マザーファンドを高位に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149期～第154期 (2022年6月22日 ～2022年12月21日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	48円	
(投信会社)	(23)	(0.286)	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)	(23)	(0.286)	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	0.016	(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
(株式)	(1)	(0.016)	売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(c) 有価証券取引税	1	0.008	(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
(株式)	(1)	(0.008)	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
(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)	(0.002)	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	51	0.642	

(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。

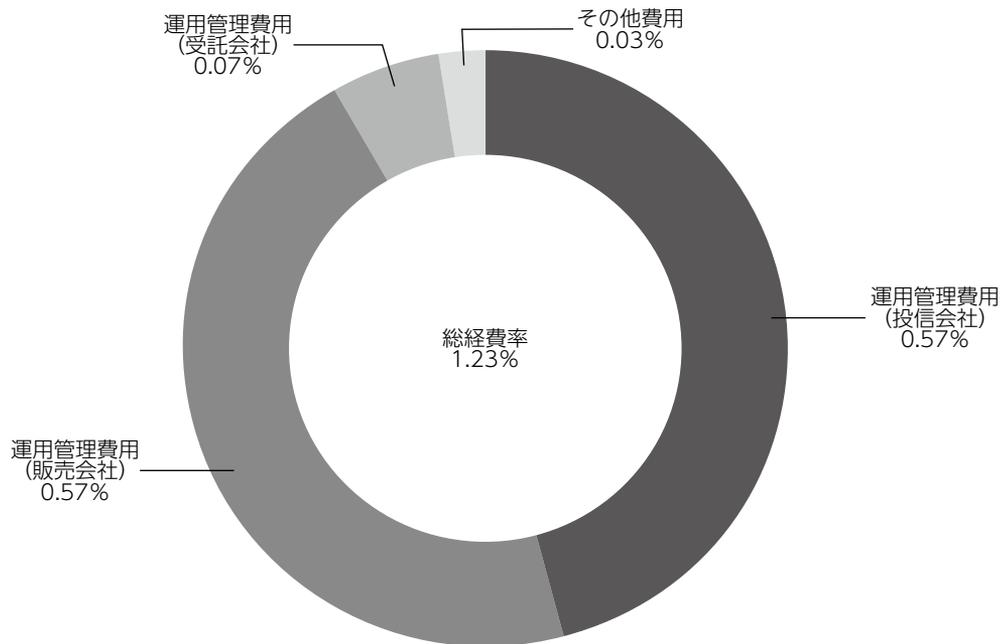
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2022年6月22日から2022年12月21日まで）

	第 149 期 ~ 第 154 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□ 263,609	千円 970,000

■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 149 期 ~ 第 154 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	12,741,455千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	34,501,276千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.36

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年6月22日から2022年12月21日まで）

【D I A M世界好配当株式ファンド（毎月決算型）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 149 期 ~ 第 154 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 0.021	百万円 0.021	% 100.0	百万円 0.021	百万円 0.021	% 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 149 期 ~ 第 154 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 58.4%

(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25作成期末	第 26 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□ 5,692,937	千□ 5,429,328	千円 19,664,484

<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 (9,223,295,190口) の内容です。
外国株式

銘柄	2022年6月21日現在		2022年12月21日現在		業種等	
	株数	金額	株数	金額		
(アメリカ)	百株	千円	百株	千円		
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	346.85	2,519	346.85	332,067	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	322.44	4,437	339.51	584,715	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	779.8	4,227	892.49	557,129	通信機器	
CUMMINS INC	89.92	1,016	42.81	133,963	機械	
BANK OF AMERICA CORP	815.83	3,097	962.17	408,152	銀行	
EATON CORP PLC	116.51	1,816	116.51	239,379	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	326.8	4,469	535.19	589,044	電力	
GILEAD SCIENCES INC	250.74	2,888	340.71	380,606	バイオテクノロジー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	52.43	701	34.11	92,417	航空宇宙・防衛	
JOHNSON & JOHNSON	354.66	5,474	311.61	721,370	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	308.36	4,827	356.58	636,152	家庭用品	
LOCKHEED MARTIN CORP	18.28	1,248	25.69	164,582	航空宇宙・防衛	
MCDONALD'S CORPORATION	404.64	11,338	424.25	1,494,132	ホテル・レストラン・レジャー	
METLIFE INC	1,218.2	8,745	1,218.2	1,152,476	保険	
MERCK & CO.INC.	822.24	9,646	879.27	1,271,211	医薬品	
MICROSOFT CORP	330.31	6,297	260.46	829,940	ソフトウェア	
PACCAR INC	304.73	3,929	304.73	399,203	機械	
PAYCHEX INC	347.06	5,992	524.48	789,719	情報技術サービス	
PPL CORPORATION	636.97	2,423	831.02	319,336	電力	
PEPSICO INC	-	2,813	155.27	370,823	飲料	
PFIZER INC	855.26	4,389	855.26	578,408	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	184.41	2,096	139.35	276,297	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	1,812	440.86	238,892	銀行	
AT&T INC	1,593.32	2,879	1,593.32	379,411	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	371.82	6,420	371.82	846,056	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	1,370	346.59	180,547	食品・生活必需品小売り	
CME GROUP INC	-	2,164	127.92	285,208	資本市場	
MASTERCARD INC	217.61	4,468	130.31	588,922	情報技術サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	428.18	6,755	669.41	890,264	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	2,381	294.91	313,820	化学	
ABBVIE INC	269.58	4,328	269.58	570,464	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	41.71	1,142	21	150,551	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	262.63	-	-	-	コンピュータ・周辺機器	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,075.77 34銘柄	14,162.24 32銘柄	127,221 <50.2%>	16,765,271	
(カナダ)	百株	千円	百株	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	757.71	6,605	717.64	640,109	銀行	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	2,036.59	-	-	-	総合公益事業	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	962.28	2,069	374.96	200,525	銀行	
RUSSEL METALS INC	1,216.48	1,817	651.98	176,073	商社・流通業	

銘柄	2022年6月21日現在		2022年12月21日現在		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ) CAPITAL POWER CORP	百株 842.72	百株 842.72	千カナダ・ドル 4,008	千円 388,454	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銘柄	株数 4銘柄	14,501	1,405,163 <4.2%>	
(オーストラリア) BHP GROUP LTD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD AGL ENERGY LTD	百株 743.7 134.38 2,265.01	百株 743.7 134.38 -	千オーストラリア・ドル 3,365 474 -	千円 296,408 41,807 -	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> 3銘柄	株数 2銘柄	3,840	338,216 <1.0%>	
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD NEW WORLD DEVELOPMENT SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	百株 7,495 1,540 804 3,960	百株 7,280 7,700 - -	千香港・ドル 19,292 16,786 - -	千円 326,420 284,019 - -	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> 4銘柄	株数 2銘柄	36,078	610,439 <1.8%>	
(シンガポール) UNITED OVERSEAS BANK LTD	百株 1,307	百株 1,307	千シンガポール・ドル 4,056	千円 395,712	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 1銘柄	株数 1銘柄	4,056	395,712 <1.2%>	
(イギリス) 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 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	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 287.09 3,024.85 453.25 - 1,437.68 5,964.93 572.23 2,595.96 367.04	千イギリス・ポンド 2,728 1,486 2,388 1,193 3,055 2,566 - 2,447 2,788 737 3,704 4,083	千円 438,065 238,680 383,438 191,594 490,526 412,118 - 392,994 447,642 118,383 594,784 655,676	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> 12銘柄	株数 11銘柄	27,179	4,363,906 <13.1%>	
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 99.01 730.45	百株 99.01 730.45	千スイス・フラン 2,932 6,105	千円 416,838 867,901	医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 2銘柄	株数 2銘柄	9,037	1,284,740 <3.8%>	
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 836.54	百株 836.54	千スウェーデン・クローナ 7,040	千円 88,989	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 1銘柄	株数 1銘柄	7,040	88,989 <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> 1銘柄	株数 1銘柄	-	- <- %>	

銘柄	2022年6月21日現在		2022年12月21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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AXA SA	2,249.23	2,624.8	6,926	969,204	保険
DANONE	353.68	353.68	1,726	241,570	食品
BNP PARIBAS	548.37	240.76	1,274	178,339	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	66.02	94.65	6,463	904,393	繊維・アパレル・贅沢品
TOTALENERGIES SE	902.13	902.13	5,169	723,275	石油・ガス・消耗燃料
SANOFI	469.31	469.31	4,167	583,178	医薬品
EUROAPI SASU	20.4	-	-	-	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	25,728 -	3,599,961 <10.8%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,155.42	1,576.58	5,454	763,258	航空貨物・物流サービス
SAP SE	-	117.66	1,150	160,991	ソフトウェア
E.ON SE	2,473.24	2,473.24	2,243	313,872	総合公益事業
SIEMENS AG-REG	328.85	328.85	4,202	587,950	コンプロマリット
BASF SE	256.47	244.71	1,120	156,818	化学
ALLIANZ SE	132.27	132.27	2,645	370,144	保険
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,955.37	2,955.37	5,580	780,882	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	480.72	281.18	825	115,470	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	8,109.86 8銘柄	23,223 -	3,249,389 <9.7%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	2,413.68	2,413.68	2,609	365,077	電力
FERROVIAL SA	1,182.77	1,029	2,505	350,585	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,596.45 2銘柄	3,442.68 2銘柄	5,114 -	715,663 <2.1%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	477.99	477.99	1,689	236,355	紙製品・林産品
FORTUM OYJ	1,774.25	-	-	-	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,252.24 2銘柄	477.99 1銘柄	1,689 -	236,355 <0.7%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	93,762.12 81銘柄	71,348.76 72銘柄	- -	33,053,809 <98.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年12月21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12月21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12月21日現在

項 目	第 26 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	19,664,484千円	98.2%
コール・ローン等、その他	362,922	1.8
投資信託財産総額	20,027,407	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) DIAM世界好配当株オープン・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年12月21日現在、33,230,206千円、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、2022年12月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=131.78円、1カナダ・ドル=96.90円、1オーストラリア・ドル=88.06円、1香港・ドル=16.92円、1シンガポール・ドル=97.54円、1台湾・ドル=4.292円、1イギリス・ポンド=160.56円、1スイス・フラン=142.16円、1ノルウェー・クローネ=13.33円、1スウェーデン・クローナ=12.64円、1ユーロ=139.92円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年7月21日)、(2022年8月22日)、(2022年9月21日)、(2022年10月21日)、(2022年11月21日)、(2022年12月21日)現在

項 目	第149期末	第150期末	第151期末	第152期末	第153期末	第154期末
(A) 資 産	20,876,966,895円	21,229,237,581円	20,521,799,369円	20,592,616,380円	21,491,098,206円	20,027,407,011円
コール・ローン等	333,651,516	349,238,288	309,557,249	345,094,522	220,059,997	362,922,537
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	20,543,315,379	20,879,999,293	20,212,242,120	20,247,521,858	21,171,038,209	19,664,484,474
未 収 入 金	-	-	-	-	100,000,000	-
(B) 負 債	140,623,920	152,988,393	165,289,720	146,475,836	162,659,724	150,275,444
未払収益分配金	118,006,031	117,794,351	117,602,794	117,733,742	117,730,421	117,420,139
未払解約金	2,248,689	13,216,883	27,012,189	8,944,567	23,095,509	11,654,384
未払信託報酬	20,310,741	21,914,436	20,615,833	19,740,279	21,772,246	21,141,253
その他未払費用	58,459	62,723	58,904	57,248	61,548	59,668
(C) 純資産総額(A-B)	20,736,342,975	21,076,249,188	20,356,509,649	20,446,140,544	21,328,438,482	19,877,131,567
元 本	26,223,562,629	26,176,522,574	26,133,954,331	26,163,053,793	26,162,315,800	26,093,364,437
次期繰越損益金	△5,487,219,654	△5,100,273,386	△5,777,444,682	△5,716,913,249	△4,833,877,318	△6,216,232,870
(D) 受益権総口数	26,223,562,629口	26,176,522,574口	26,133,954,331口	26,163,053,793口	26,162,315,800口	26,093,364,437口
1口当たり基準価額(C/D)	7,908円	8,052円	7,789円	7,815円	8,152円	7,618円

(注) 第148期末における元本額は26,231,525,937円、当作成期間(第149期～第154期)中における追加設定元本額は927,639,691円、同解約元本額は1,065,801,191円です。

■損益の状況

〔自 2022年6月22日 至 2022年7月21日〕〔自 2022年7月22日 至 2022年8月22日〕〔自 2022年8月23日 至 2022年9月21日〕〔自 2022年9月22日 至 2022年10月21日〕〔自 2022年10月22日 至 2022年11月21日〕〔自 2022年11月22日 至 2022年12月21日〕

項 目	第 149 期	第 150 期	第 151 期	第 152 期	第 153 期	第 154 期
(A) 配 当 等 収 益	△5,311円	△2,321円	△11,437円	△10,227円	△14,921円	△12,540円
受 取 利 息	598	123	42	256	50	44
支 払 利 息	△5,909	△2,444	△11,479	△10,483	△14,971	△12,584
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	834,034,760	517,454,545	△545,677,901	208,617,450	1,018,531,747	△1,256,003,268
売 買 益	835,779,221	517,353,093	2,150,398	211,231,915	1,023,516,351	1,183,886
売 買 損	△1,744,461	101,452	△547,828,299	△2,614,465	△4,984,604	△1,257,187,154
(C) 信 託 報 酬 等	△20,369,200	△21,977,159	△20,674,737	△19,797,527	△21,833,794	△21,200,921
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	813,660,249	495,475,065	△566,364,075	188,809,696	996,683,032	△1,277,216,729
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	445,498,472	1,132,548,094	1,499,633,492	810,547,982	875,155,472	1,741,222,765
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△6,628,372,344	△6,610,502,194	△6,593,111,305	△6,598,537,185	△6,587,985,401	△6,562,818,767
(配 当 等 相 当 額)	(4,280,679,941)	(4,283,768,485)	(4,286,532,926)	(4,303,801,107)	(4,315,386,855)	(4,312,338,612)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,909,052,285)	(△10,894,270,679)	(△10,879,644,231)	(△10,902,338,292)	(△10,903,372,256)	(△10,875,157,379)
(G) 合 計 (D + E + F)	△5,369,213,623	△4,982,479,035	△5,659,841,888	△5,599,179,507	△4,716,146,897	△6,098,812,731
(H) 収 益 分 配 金	△118,006,031	△117,794,351	△117,602,794	△117,733,742	△117,730,421	△117,420,139
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△5,487,219,654	△5,100,273,386	△5,777,444,682	△5,716,913,249	△4,833,877,318	△6,216,232,870
追 加 信 託 差 損 益 金	△6,628,372,344	△6,610,502,194	△6,593,111,305	△6,598,537,185	△6,587,985,401	△6,562,818,767
(配 当 等 相 当 額)	(4,280,750,785)	(4,283,846,253)	(4,286,584,876)	(4,303,875,352)	(4,315,451,053)	(4,312,440,034)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,909,123,129)	(△10,894,348,447)	(△10,879,696,181)	(△10,902,412,537)	(△10,903,436,454)	(△10,875,258,801)
分 配 準 備 積 立 金	1,861,381,910	1,791,031,376	1,684,071,121	1,591,740,905	1,754,108,083	1,668,154,876
繰 越 損 益 金	△720,229,220	△280,802,568	△868,404,498	△710,116,969	-	△1,321,568,979

(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 149 期	第 150 期	第 151 期	第 152 期	第 153 期	第 154 期
(a) 経費控除後の配当等収益	47,213,447円	61,479,137円	23,207,882円	35,971,757円	33,726,390円	44,352,250円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	258,049,792	0
(c) 収 益 調 整 金	4,280,750,785	4,283,846,253	4,286,584,876	4,303,875,352	4,315,451,053	4,312,440,034
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,932,174,494	1,847,346,590	1,778,466,033	1,673,502,890	1,580,062,322	1,741,222,765
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	6,260,138,726	6,192,671,980	6,088,258,791	6,013,349,999	6,187,289,557	6,098,015,049
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,387.22	2,365.74	2,329.64	2,298.41	2,364.96	2,337.00
(g) 分 配 金	118,006,031	117,794,351	117,602,794	117,733,742	117,730,421	117,420,139
(h) 1万口当たり分配金	45	45	45	45	45	45

■分配金のお知らせ

決算期	第 149 期	第 150 期	第 151 期	第 152 期	第 153 期	第 154 期
1 万口当たり分配金	45円	45円	45円	45円	45円	45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)。

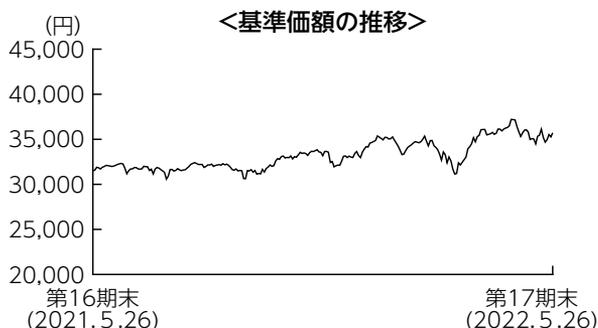
■当期中の基準価額の推移

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 オ ラ ン ダ	百株 825.46 (-)	千ユーロ 2,989 (-)	百株 344.6	千ユーロ 1,192
	フ ラ ン ス	1,658.07 (20.4)	12,733 (-)	2,767.01	9,660
	ド イ ツ	914.2 (-)	3,889 (△189)	3,713.6	11,734
	ス ペ イ ン	1,733.3 (6,174.42)	2,725 (-)	8,320.26	3,700
	口 フ ィ ン ラ ン ド	- (-)	- (-)	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			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	
(カナダ) 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%>	
(オーストラリア) 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 — <1.4%>	
(香港) 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 — <2.1%>	
(シンガポール) 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 — <1.0%>	
(イギリス) 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%>	
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN 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 — <3.7%>	
(スウェーデン) 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 — <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。