

## 運用報告書 (全体版)

### DIAM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	DIAM世界好配当株式ファンド(毎月決算型)	DIAM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。
	DIAM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155期	<決算日	2023年1月23日>
第156期	<決算日	2023年2月21日>
第157期	<決算日	2023年3月22日>
第158期	<決算日	2023年4月21日>
第159期	<決算日	2023年5月22日>
第160期	<決算日	2023年6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、「DIAM世界好配当株式ファンド(毎月決算型)」は、2023年6月21日に第160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23作成期	131期(2021年1月21日)	円 6,990	円 85	% 3.2	% 97.2	% -	百万円 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
第27作成期	155期(2023年1月23日)	7,714	45	1.9	98.0	-	20,196
	156期(2023年2月21日)	7,986	45	4.1	97.8	-	20,938
	157期(2023年3月22日)	7,614	45	△4.1	97.3	-	19,931
	158期(2023年4月21日)	8,089	45	6.8	97.2	-	21,175
	159期(2023年5月22日)	8,182	45	1.7	97.6	-	21,499
	160期(2023年6月21日)	8,434	45	3.6	98.2	-	22,114

(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155期	(期首) 2022年12月21日	円 7,618	% -	% -	% 97.9	% -
	12月 末	7,760	1.9	97.6	-	
	(期末) 2023年1月23日	7,759	1.9	98.0	-	
第156期	(期首) 2023年1月23日	7,714	-	98.0	-	
	1月 末	7,782	0.9	97.9	-	
	(期末) 2023年2月21日	8,031	4.1	97.8	-	
第157期	(期首) 2023年2月21日	7,986	-	97.8	-	
	2月 末	7,963	△0.3	97.6	-	
	(期末) 2023年3月22日	7,659	△4.1	97.3	-	
第158期	(期首) 2023年3月22日	7,614	-	97.3	-	
	3月 末	7,865	3.3	97.3	-	
	(期末) 2023年4月21日	8,134	6.8	97.2	-	
第159期	(期首) 2023年4月21日	8,089	-	97.2	-	
	4月 末	8,079	△0.1	97.4	-	
	(期末) 2023年5月22日	8,227	1.7	97.6	-	
第160期	(期首) 2023年5月22日	8,182	-	97.6	-	
	5月 末	8,123	△0.7	97.7	-	
	(期末) 2023年6月21日	8,479	3.6	98.2	-	

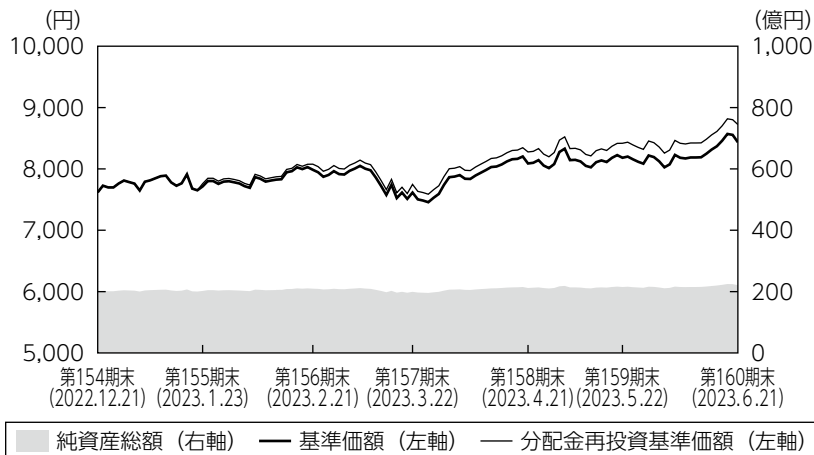
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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155期～第160期の運用経過（2022年12月22日から2023年6月21日まで）

### 基準価額等の推移



第155期首： 7,618円  
第160期末： 8,434円  
(既払分配金270円)  
騰落率： 14.5%  
(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

2023年3月には米地銀の破綻などをを受けて下落する局面も見られましたが、堅調な企業決算や中国のゼロコロナ政策解除を受けた景気回復期待、米欧におけるインフレ鈍化を背景とした利上げ停止期待の高まりなどを受け株式市場全体が上昇したことから、基準価額は上昇しました。また、為替市場において、主要通貨に対して円安が進行したことも基準価額にプラスとなりました。

## 投資環境

外国株式市場は上昇しました。2023年3月には米地銀の破綻などを受けて下落する局面も見られましたが、堅調な企業決算や中国のゼロコロナ政策解除を受けた景気回復期待、米欧におけるインフレ鈍化を背景とした利上げ停止期待の高まりなどを受け、概ね上昇基調で推移しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。作成期初から2023年3月頃までは主要先進国におけるインフレ指標の伸び鈍化や米中堅銀行の経営破綻が円高圧力となった一方で、米欧の堅調な経済指標が円安圧力となり、一進一退で推移しました。その後、米欧での利上げ継続の観測などから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 AM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 AM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	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%



#### 当作成期末

	国・地域	組入比率
北米	米国	46.9%
	カナダ	4.8%
	計	51.7%
欧州	フィンランド	0.6%
	フランス	10.1%
	ドイツ	12.9%
	アイルランド	0.9%
	オランダ	1.0%
	スペイン	0.9%
	スウェーデン	0.7%
	スイス	3.3%
	英国	11.3%
	計	41.6%
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.0%
	香港	1.6%
	シンガポール	1.0%
	計	3.7%
	小計	97.0%
	現金など	3.0%
	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	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



#### 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	14.7%
2	公益事業	7.7
3	半導体・半導体製造装置	7.4
4	銀行	7.2
5	資本財	5.9
6	食品・飲料・タバコ	5.9
7	消費者サービス	5.5
8	ソフトウェア・サービス	5.4
9	エネルギー	5.2
10	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.9

## 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155期	第156期	第157期	第158期	第159期	第160期
	2022年12月22日 ~2023年1月23日	2023年1月24日 ~2023年2月21日	2023年2月22日 ~2023年3月22日	2023年3月23日 ~2023年4月21日	2023年4月22日 ~2023年5月22日	2023年5月23日 ~2023年6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	0.58%	0.56%	0.59%	0.55%	0.55%	0.53%
当期の収益	16円	15円	24円	45円	45円	45円
当期の収益以外	28円	29円	20円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	2,263円	2,234円	2,214円	2,265円	2,358円	2,610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155期～第160期 (2022年12月22日 ～2023年6月21日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	48円	
(投信会社)	(23)	(0.284)	
(販売会社)	(23)	(0.284)	
(受託会社)	( 3)	(0.032)	
(b) 売買委託手数料	1	0.009	(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)	(0.009)	
(c) 有価証券取引税	0	0.004	(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)	( 0)	(0.004)	
(d) その他費用	1	0.009	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(保管費用)	( 1)	(0.008)	
(監査費用)	( 0)	(0.002)	
合計	50	0.623	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

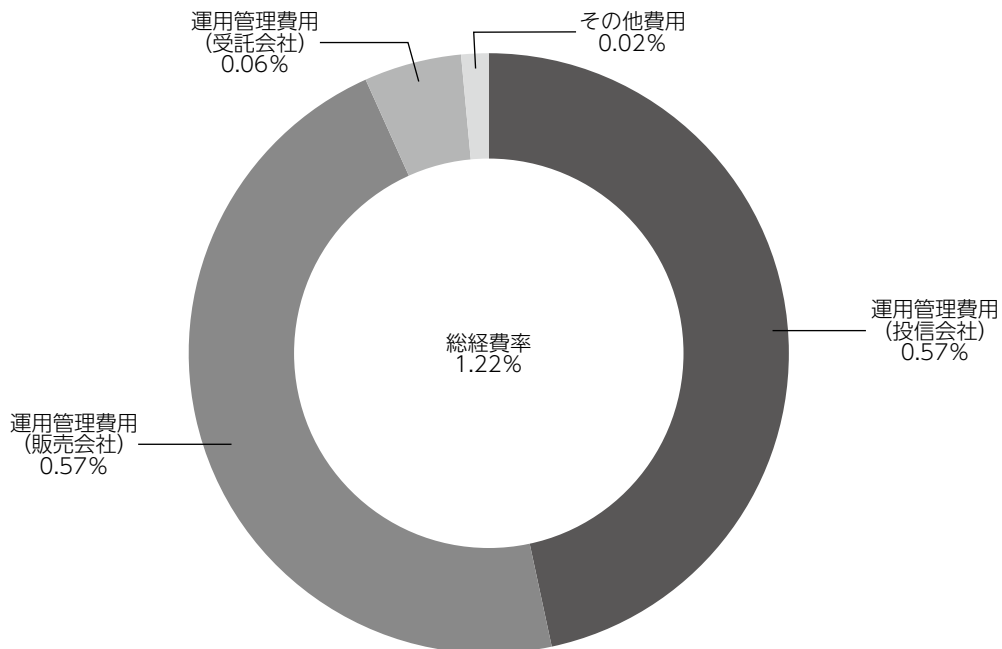
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (参考情報)

### ◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.22%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年12月22日から2023年6月21日まで）

	第 155 期 ~ 第 160 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□ 18,882	千円 70,000	千□ 207,049	千円 812,641

## ■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 155 期 ~ 第 160 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	10,679,396千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	34,430,598千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.31

(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12月22日から2023年6月21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26作成期末	第 27 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□ 5,429,328	千□ 5,241,161	千円 21,897,571

<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 (8,853,301,901口) の内容です。  
外国株式

銘柄	2022年12月21日現在		2023年6月21日現在		業種等	
	株数	株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
APPLE INC	—	289.22	5,350	757,949	コンピュータ・周辺機器	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	346.85	346.85	2,290	324,413	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	339.51	339.51	4,839	685,449	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	892.49	1,465.97	7,557	1,070,459	通信機器	
CUMMINS INC	42.81	42.81	998	141,370	機械	
BANK OF AMERICA CORP	962.17	266.41	769	108,946	銀行	
EATON CORP PLC	116.51	116.51	2,262	320,550	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	535.19	272.69	2,038	288,772	電力	
GILEAD SCIENCES INC	340.71	164.97	1,281	181,592	バイオテクノロジー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34.11	—	—	—	航空宇宙・防衛	
JOHNSON & JOHNSON	311.61	264.67	4,344	615,331	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	356.58	299.81	4,089	579,222	家庭用品	
LAM RESEARCH CORP	—	40.56	2,491	352,923	半導体・半導体製造装置	
LOCKHEED MARTIN CORP	25.69	—	—	—	航空宇宙・防衛	
MCDONALD'S CORPORATION	424.25	349.38	10,238	1,450,245	ホテル・レストラン・レジャー	
METLIFE INC	1,218.2	—	—	—	保険	
MERCK & CO. INC.	879.27	556.9	6,138	869,548	医薬品	
MICROSOFT CORP	260.46	302.41	10,222	1,448,083	ソフトウェア	
PACCAR INC	304.73	457.09	3,554	503,535	機械	
PAYCHEX INC	524.48	524.48	5,886	833,860	専門サービス	
PPL CORPORATION	831.02	577.29	1,541	218,334	電力	
PEPSICO INC	155.27	138.01	2,557	362,264	飲料	
PFIZER INC	855.26	586.82	2,308	327,006	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	139.35	91.51	1,355	192,050	家庭用品	
TRUIST FINANCIAL CORP	440.86	—	—	—	銀行	
AT&T INC	1,593.32	1,593.32	2,514	356,144	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	371.82	323.7	4,974	704,655	石油・ガス・消耗燃料	
STARBUCKS CORP	—	421.29	4,266	604,336	ホテル・レストラン・レジャー	
TEXAS INSTRUMENTS INC	—	214.53	3,740	529,848	半導体・半導体製造装置	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	346.59	346.59	1,122	159,016	生活必需品流通・小売り	
CME GROUP INC	127.92	204.94	3,744	530,344	資本市場	
MASTERCARD INC	130.31	130.31	4,881	691,489	金融サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	669.41	669.41	6,347	899,101	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,637	373,668	化学	
ABBVIE INC	269.58	188.43	2,596	367,856	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	21	109.84	9,534	1,350,553	半導体・半導体製造装置	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,162.24 32銘柄	11,991.14 32銘柄	128,478 —	18,198,926 <49.2%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	717.64	717.64	7,044	754,591	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	374.96	374.96	2,142	229,506	銀行	

銘柄	2022年12月21日現在		2023年6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) RUSSEL METALS INC CAPITAL POWER CORP	百株 651.98 842.72	百株 1,056.82 842.72	千カナダ・ドル 3,902 3,782	千円 418,071 405,231	商社・流通業 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> 2,587.3 4銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 2,992.14 4銘柄	16,872 -	1,807,401 <4.9%>	
(オーストラリア) BHP GROUP LTD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	百株 743.7 134.38	百株 743.7 134.38	千オーストラリア・ドル 3,474 487	千円 333,975 46,900	金属・鉱業 石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 878.08 2銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 878.08 2銘柄	3,962 -	380,875 <1.0%>	
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD NEW WORLD DEVELOPMENT	百株 7,280 7,700	百株 7,280 7,700	千香港・ドル 17,763 15,477	千円 321,513 280,133	銀行 不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 14,980 2銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 14,980 2銘柄	33,240 -	601,647 <1.6%>	
(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 3,646	千円 384,453	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 1,307 1銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 1,307 1銘柄	3,646 -	384,453 <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 SSE PLC BP PLC 3I GROUP PLC GSK PLC ASTRAZENECA PLC	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	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 438.39 2,153.01 453.25 854.22 5,964.93 829.3 2,235.93 174.37	千イギリス・ポンド 2,886 1,152 2,017 1,777 2,245 2,335 1,588 2,707 1,644 3,044 2,028	千円 521,707 208,352 364,607 321,331 405,912 422,182 287,123 489,404 297,335 550,313 366,756	総合公益事業 タバコ タバコ パーソナルケア用品 水道 金属・鉱業 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> 19,052.28 11銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 17,452.65 11銘柄	23,429 -	4,235,026 <11.4%>	
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 99.01 730.45	百株 86.78 607.3	千スイス・フラン 2,391 5,505	千円 377,164 868,261	医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 829.46 2銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 694.08 2銘柄	7,897 -	1,245,426 <3.4%>	
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 836.54	百株 2,133.28	千スウェーデン・クローナ 19,720	千円 258,924	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 836.54 1銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 2,133.28 1銘柄	19,720 -	258,924 <0.7%>	
(ユーロ圏…オランダ) FERROVIAL SE	百株 -	百株 1,029	千ユーロ 3,037	千円 469,766	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率> - 1銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 1,029 1銘柄	3,037 -	469,766 <1.3%>	
(ユーロ圏…フランス) AXA SA	百株 2,624.8	百株 1,240.33	千ユーロ 3,262	千円 504,574	保険

銘柄	2022年12月21日現在		2023年6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		
DANONE	353.68	422.11	2,327	359,884	食品	
BNP PARIBAS	240.76	240.76	1,365	211,225	銀行	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	94.65	103.16	8,727	1,349,682	繊維・アパレル・贅沢品	
TOTALENERGIES SE	902.13	864.34	4,594	710,590	石油・ガス・消耗燃料	
SANOFI	469.31	412.25	4,038	624,602	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,685.33 6銘柄	3,282.95 6銘柄	24,316 -	3,760,561 <10.2%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	1,576.58	1,576.58	6,943	1,073,774	航空貨物・物流サービス	
SAP SE	117.66	286.32	3,566	551,632	ソフトウェア	
E.ON SE	2,473.24	2,473.24	2,823	436,608	総合公益事業	
SIEMENS AG-REG	328.85	328.85	5,311	821,436	コンプロマリット	
BASF SE	244.71	244.71	1,043	161,425	化学	
ALLIANZ SE	132.27	112.5	2,354	364,055	保険	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,955.37	2,955.37	5,686	879,451	各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	281.18	911.82	3,405	526,683	半導体・半導体製造装置	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,109.86 8銘柄	8,889.39 8銘柄	31,135 -	4,815,068 <13.0%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	2,413.68	1,776.33	2,121	328,140	電力	
FERROVIAL SA	1,029	-	-	-	建設・土木	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,442.68 2銘柄	1,776.33 1銘柄	2,121 -	328,140 <0.9%>	
(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	1,351	209,049	紙製品・林産品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	477.99 1銘柄	477.99 1銘柄	1,351 -	209,049 <0.6%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	71,348.76 72銘柄	67,884.03 72銘柄	- -	36,695,267 <99.2%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6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、2023年6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

2023年6月21日現在

項 目	第 27 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	21,897,571	98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	362,638	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	22,260,210	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) D I A M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、2023年6月21日現在、36,846,929千円、98.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年6月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=141.65円、1カナダ・ドル=107.12円、1オーストラリア・ドル=96.12円、1香港・ドル=18.10円、1シンガポール・ドル=105.43円、1台湾・ドル=4.578円、1イギリス・ポンド=180.76円、1スイス・フラン=157.70円、1ノルウェー・クローネ=13.20円、1スウェーデン・クローナ=13.13円、1ユーロ=154.65円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年1月23日)、(2023年2月21日)、(2023年3月22日)、(2023年4月21日)、(2023年5月22日)、(2023年6月21日)現在

項 目	第155期末	第156期末	第157期末	第158期末	第159期末	第160期末
(A) 資 産	20,340,702,068円	21,085,563,719円	20,072,937,336円	21,353,235,574円	21,654,769,795円	22,260,210,839円
コール・ローン等	284,741,671	359,679,601	281,382,159	247,008,038	264,533,034	169,997,953
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	20,055,960,397	20,725,884,118	19,791,555,177	21,006,227,536	21,290,236,761	21,897,571,886
未 収 入 金	-	-	-	100,000,000	100,000,000	192,641,000
(B) 負 債	143,787,235	146,647,977	141,778,879	177,411,914	154,928,231	145,781,428
未 払 収 益 分 配 金	117,820,602	117,992,173	117,792,902	117,796,248	118,239,502	117,986,735
未 払 解 約 金	3,701,222	8,856,603	4,188,707	39,144,367	14,697,508	6,316,576
未 払 信 託 報 酬	22,201,311	19,742,532	19,740,672	20,412,879	21,929,522	21,418,126
そ の 他 未 払 費 用	64,100	56,669	56,598	58,420	61,699	59,991
(C) 純資産総額(A-B)	20,196,914,833	20,938,915,742	19,931,158,457	21,175,823,660	21,499,841,564	22,114,429,411
元 本	26,182,356,214	26,220,482,963	26,176,200,523	26,176,944,117	26,275,445,017	26,219,274,590
次 期 繰 越 損 益 金	△5,985,441,381	△5,281,567,221	△6,245,042,066	△5,001,120,457	△4,775,603,453	△4,104,845,179
(D) 受 益 権 総 口 数	26,182,356,214口	26,220,482,963口	26,176,200,523口	26,176,944,117口	26,275,445,017口	26,219,274,590口
1口当たり基準価額(C/D)	7,714円	7,986円	7,614円	8,089円	8,182円	8,434円

(注) 第154期末における元本額は26,093,364,437円、当作成期間(第155期～第160期)中における追加設定元本額は1,116,517,020円、同解約元本額は990,606,867円です。

## ■損益の状況

〔自 2022年12月22日 至 2023年1月23日〕〔自 2023年1月24日 至 2023年2月21日〕〔自 2023年2月22日 至 2023年3月22日〕〔自 2023年3月23日 至 2023年4月21日〕〔自 2023年4月22日 至 2023年5月22日〕〔自 2023年5月23日 至 2023年6月21日〕

項 目	第 155 期	第 156 期	第 157 期	第 158 期	第 159 期	第 160 期
(A) 配 当 等 収 益	△8,560円	△3,373円	△3,786円	△1,869円	△11,163円	△12,348円
受 取 利 息	365	164	120	209	23	53
支 払 利 息	△8,925	△3,537	△3,906	△2,078	△11,186	△12,401
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	389,744,701	848,727,297	△832,128,975	1,380,046,777	384,123,170	799,478,682
売 買 益	391,475,923	849,927,397	1,866,472	1,385,184,843	384,262,734	800,323,345
売 買 損	△1,731,222	△1,200,100	△833,995,447	△5,138,066	△139,564	△844,663
(C) 信 託 報 酬 等	△22,265,411	△19,799,201	△19,797,270	△20,471,299	△21,991,221	△21,478,117
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	367,470,730	828,924,723	△851,930,031	1,359,573,609	362,120,786	777,988,217
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	345,146,931	591,836,195	1,291,926,501	320,336,117	1,554,165,343	1,781,306,026
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△6,580,238,440	△6,584,335,966	△6,567,245,634	△6,563,233,935	△6,573,650,080	△6,546,152,687
(配 当 等 相 当 額)	(4,339,762,963)	(4,356,382,627)	(4,359,082,591)	(4,367,777,331)	(4,398,105,479)	(4,401,901,068)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,920,001,403)	(△10,940,718,593)	(△10,926,328,225)	(△10,931,011,266)	(△10,971,755,559)	(△10,948,053,755)
(G) 合 計 (D + E + F)	△5,867,620,779	△5,163,575,048	△6,127,249,164	△4,883,324,209	△4,657,363,951	△3,986,858,444
(H) 収 益 分 配 金	△117,820,602	△117,992,173	△117,792,902	△117,796,248	△118,239,502	△117,986,735
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△5,985,441,381	△5,281,567,221	△6,245,042,066	△5,001,120,457	△4,775,603,453	△4,104,845,179
追 加 信 託 差 損 益 金	△6,580,238,440	△6,584,335,966	△6,567,245,634	△6,563,233,935	△6,573,650,080	△6,546,152,687
(配 当 等 相 当 額)	(4,339,854,518)	(4,356,474,449)	(4,359,283,732)	(4,367,844,711)	(4,398,407,811)	(4,401,991,533)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,920,092,958)	(△10,940,810,415)	(△10,926,529,366)	(△10,931,078,646)	(△10,972,057,891)	(△10,948,144,220)
分 配 準 備 積 立 金	1,586,641,323	1,502,281,690	1,437,137,336	1,562,113,478	1,798,046,627	2,441,307,508
繰 越 損 益 金	△991,844,264	△199,512,945	△1,114,933,768	-	-	-

(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 155 期	第 156 期	第 157 期	第 158 期	第 159 期	第 160 期
(a) 経費控除後の配当等収益	43,232,940円	41,530,743円	65,151,232円	37,445,212円	99,746,524円	53,965,165円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	213,656,633	262,374,262	724,023,052
(c) 収 益 調 整 金	4,339,854,518	4,356,474,449	4,359,283,732	4,367,844,711	4,398,407,811	4,401,991,533
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,661,228,985	1,578,743,120	1,489,779,006	1,428,807,881	1,554,165,343	1,781,306,026
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	6,044,316,443	5,976,748,312	5,914,213,970	6,047,754,437	6,314,693,940	6,961,285,776
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,308.55	2,279.42	2,259.39	2,310.34	2,403.27	2,655.03
(g) 分 配 金	117,820,602	117,992,173	117,792,902	117,796,248	118,239,502	117,986,735
(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 155 期	第 156 期	第 157 期	第 158 期	第 159 期	第 160 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18期（決算日 2023年5月26日）

（計算期間 2022年5月27日～2023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18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			
14期（2019年5月27日）	円		%	%	%	百万円 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
18期（2023年5月26日）	35,715	13.3		98.6	—	35,489
	39,789	11.4		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）。

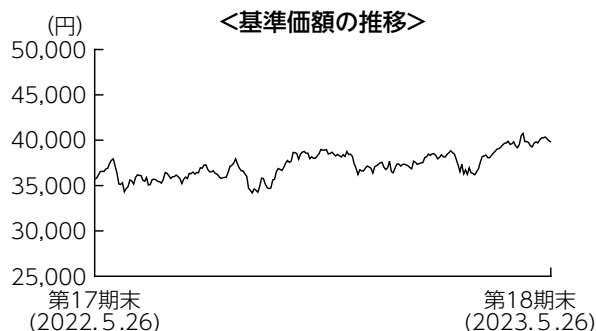
## ■当期中の基準価額の推移

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) 2022年 5 月26日	円 35,715	% -	% -	% 98.6	% -
5 月 末	36,536	2.3		98.6	-
6 月 末	36,108	1.1		98.6	-
7 月 末	35,984	0.8		98.2	-
8 月 末	36,006	0.8		98.2	-
9 月 末	34,480	△3.5		98.4	-
10 月 末	38,646	8.2		99.0	-
11 月 末	38,539	7.9		98.9	-
12 月 末	36,917	3.4		98.8	-
2023年 1 月 末	37,275	4.4		98.8	-
2 月 末	38,407	7.5		98.8	-
3 月 末	38,202	7.0		98.2	-
4 月 末	39,503	10.6		98.3	-
(期 末) 2023年 5 月26日	39,789	11.4		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（2022年5月27日から2023年5月26日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は39,789円となり、前期末比で11.4%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

期初から2022年10月中旬にかけては、インフレ高進などから軟調な推移となりましたが、その後は堅調な企業決算や中国のゼロコロナ政策解除を受けた景気回復期待、米欧におけるインフレ鈍化を受けた利上げ停止期待の高まりなどを背景に株式市場全体が上昇したことから、基準価額は上昇しました。また、為替市場において、主要通貨に対して円安が進行したことも基準価額にプラスとなりました。

## 投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2022年10月中旬にかけては、インフレ高進を背景に米欧の中央銀行がタカ派姿勢を強めたことや中国の行動制限措置が嫌気され下落しました。その後は堅調な企業決算や、中国のゼロコロナ政策解除を受けた景気回復期待、米欧におけるインフレ鈍化を受けた利上げ停止期待の高まりなどを背景に上昇基調で推移しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。期初から2022年10月末にかけては、日銀と米欧中央銀行の金融政策スタンスの違いを反映して内外金利差が拡大し、概ね円安基調で推移しました。その後、米欧における利上げ幅縮小への期待や日銀による金融政策の修正から円高に推移する局面が見られましたが、2023年1月下旬以降は利上げ観測の継続などから再び円安基調となりました。

## 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、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	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式)	8円 (8)	0.022% (0.022)	(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)	4 (4)	0.010 (0.010)	(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)	9 (8) (1)	0.024 (0.021) (0.003)	(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	21	0.056	
期中の平均基準価額は37,276円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■ 売買及び取引の状況 (2022年5月27日から2023年5月26日まで)

株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 3,961.76 (152.36)	千アメリカ・ドル 46,142 (-)	百株 5,537.52	千アメリカ・ドル 44,713
	カ ナ ダ	百株 983.83 (-)	千カナダ・ドル 3,122 (-)	百株 3,807.47	千カナダ・ドル 8,892
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 - (-)	千オーストラリア・ドル - (-)	百株 2,265.01	千オーストラリア・ドル 1,864
	香 港	百株 8,395 (-)	千香港・ドル 18,793 (-)	百株 7,214	千香港・ドル 23,032
	イ ギ リ ス	百株 1,995.46 (2,136.16)	千イギリス・ポンド 1,109 (-)	百株 21,601.33	千イギリス・ポンド 6,484
	ス イ ス	百株 - (-)	千スイス・フラン - (-)	百株 135.38	千スイス・フラン 1,321
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 1,296.74 (-)	千スウェーデン・クローナ 12,733 (-)	百株 -	千スウェーデン・クローナ -
	ユ ー ロ	百株 - (-)	千ユーロ - (-)	百株 480.86	千ユーロ 1,709
	412.71 (-)	3,359 (-)	1,807.33	6,054	

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユ ー ロ	ド イ ツ	百株 913.53 (-)	千ユーロ 4,742 (△206)	百株 282.74	千ユーロ 886
		ス ペ イ ン	(5,856.36)	(-)	7,830.25	1,042
	フ ィ ン ラ ン ド	(-)	(-)	1,774.25	2,207	

(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	19,141,752千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	34,479,608千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.55

(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2023年5月26日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.020	百万円 0.020	% 100.0	百万円 0.020	百万円 0.020	% 100.0

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

■組入資産の明細  
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	
APPLE INC	—	258.78	4,476	626,236	コンピュータ・周辺機器
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	346.85	346.85	2,239	313,250	医薬品
JPMORGAN CHASE & CO	322.44	339.51	4,606	644,351	銀行
CISCO SYSTEMS INC	779.8	1,268	6,217	869,696	通信機器
CUMMINS INC	89.92	42.81	903	126,337	機械
BANK OF AMERICA CORP	815.83	516.73	1,455	203,627	銀行
EATON CORP PLC	116.51	116.51	2,061	288,403	電気設備
NEXTERA ENERGY INC	326.8	344.18	2,525	353,353	電力
GILEAD SCIENCES INC	250.74	340.71	2,645	370,094	バイオテクノロジー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	52.43	34.11	601	84,167	航空宇宙・防衛
JOHNSON & JOHNSON	354.66	264.67	4,086	571,698	医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	308.36	299.81	4,108	574,751	家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	18.28	25.69	1,137	159,143	航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	404.64	424.25	12,113	1,694,513	ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	1,218.2	—	—	—	保険
MERCK & CO.INC.	822.24	754.49	8,472	1,185,277	医薬品
MICROSOFT CORP	330.31	260.46	8,488	1,187,513	ソフトウェア
PACCAR INC	304.73	457.09	3,246	454,118	機械
PAYCHEX INC	347.06	524.48	5,658	791,510	専門サービス
PPL CORPORATION	636.97	831.02	2,160	302,253	電力
PEPSICO INC	—	155.27	2,853	399,226	飲料
PFIZER INC	855.26	586.82	2,219	310,547	医薬品
PROCTER & GAMBLE CO	184.41	91.51	1,330	186,118	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	—	—	—	銀行
AT&T INC	1,593.32	1,593.32	2,413	337,677	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	371.82	338.7	5,234	732,316	石油・ガス・消耗燃料
STARBUCKS CORP	—	421.29	4,147	580,148	ホテル・レストラン・レジャー
TEXAS INSTRUMENTS INC	46.97	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	346.59	346.59	1,038	145,307	生活必需品流通・小売り
CME GROUP INC	—	204.94	3,627	507,499	資本市場
MASTERCARD INC	217.61	130.31	4,821	674,548	金融サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	428.18	669.41	6,075	849,910	タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,617	366,220	化学
ABBVIE INC	269.58	269.58	3,736	522,757	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	41.71	99.57	7,256	1,015,134	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	12,652.37 32銘柄	124,581 —	17,427,714 <49.1%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	757.71	717.64	7,121	729,563	銀行
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	2,036.59	—	—	—	総合公益事業

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>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	962.28	374.96	2,129	218,097	銀行
RUSSEL METALS INC	1,216.48	1,056.82	3,675	376,530	商社・流通業
CAPITAL POWER CORP	842.72	842.72	3,766	385,887	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 4銘柄	2,992.14 4銘柄	16,693 -	1,710,078 <4.8%>
<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	3,134	284,693	金属・鉱業
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	134.38	134.38	469	42,605	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	3,603 -	327,298 <0.9%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,495	7,280	17,253	307,976	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,540	7,700	14,614	260,870	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	14,980 2銘柄	31,868 -	568,847 <1.6%>
<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	3,680	380,160	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,680 -	380,160 <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	2,974	512,543	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	448.5	448.5	1,194	205,835	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,155.92	1,155.92	1,990	343,041	タバコ
UNILEVER PLC	287.09	287.09	1,196	206,195	パーソナルケア用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,757.89	2,153.01	2,156	371,606	水道
RIO TINTO PLC	618.76	453.25	2,156	371,662	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	14,990.87	-	-	-	無線通信サービス
SSE PLC	1,437.68	1,437.68	2,670	460,232	電力
BP PLC	5,964.93	5,964.93	2,832	488,195	石油・ガス・消耗燃料
3I GROUP PLC	1,790.74	572.23	1,089	187,719	資本市場
GSK PLC	2,670.2	2,235.93	3,095	533,542	医薬品
ASTRAZENECA PLC	367.04	311.37	3,624	624,727	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	35,234.45 12銘柄	17,764.74 11銘柄	24,981 -	4,305,300 <12.1%>
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	99.01	86.78	2,494	385,391	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	730.45	607.3	5,377	830,684	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	829.46 2銘柄	694.08 2銘柄	7,872 -	1,216,075 <3.4%>
<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	836.54	2,133.28	21,285	274,800	無線通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	836.54 1銘柄	2,133.28 1銘柄	21,285 -	274,800 <0.8%>

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 480.86	百株 -	千ユーロ -	千円 -	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	480.86 1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 1,240.33 353.68 240.76 103.16 864.34 412.25 -	千ユーロ 3,344 2,021 1,352 8,494 4,753 4,060 -	千円 501,615 303,204 202,861 1,273,959 712,985 609,018 -	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>	4,609.14 7銘柄	3,214.52 6銘柄	24,027 <10.2%>	
(ユーロ…ドイツ) DEUTSCHE POST AG-REG SAP SE 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 1,576.58 170.25 2,473.24 328.85 244.71 132.27 2,955.37 531.86	千ユーロ 6,509 2,056 2,757 5,052 1,123 2,719 6,247 1,760	千円 976,324 308,451 413,594 757,766 168,515 407,866 937,022 263,993	航空貨物・物流サービス ソフトウェア 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>	7,782.34 7銘柄	8,413.13 8銘柄	28,227 <11.9%>	
(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 1,776.33 1,029 -	千ユーロ 2,022 2,983 -	千円 303,312 447,400 -	電力 建設・土木 建設・土木
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	4,779.22 3銘柄	2,805.33 2銘柄	5,005 <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 1,391 -	千円 208,758 -	紙製品・林産品 電力
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	2,252.24 2銘柄	477.99 1銘柄	1,391 <0.6%>	
合 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	94,944.89 82銘柄	68,312.66 72銘柄	- <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

2023年5月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	35,006,926	98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	527,622	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	35,534,549	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、35,170,231千円、99.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=139.89円、1カナダ・ドル=102.44円、1オーストラリア・ドル=90.82円、1香港・ドル=17.85円、1シンガポール・ドル=103.29円、1台湾・ドル=4.538円、1イギリス・ポンド=172.34円、1スイス・フラン=154.47円、1ノルウェー・クローネ=12.63円、1スウェーデン・クローナ=12.91円、1ユーロ=149.98円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年5月26日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	35,534,549,105円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	480,491,746
株 式(評価額)	35,006,926,763
未 収 配 当 金	47,130,596
(B) 負 債	45,000,000
未 払 解 約 金	45,000,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	35,489,549,105
元 本	8,919,453,450
次 期 繰 越 損 益 金	26,570,095,655
(D) 受 益 権 総 口 数	8,919,453,450口
1万口当たり基準価額(C/D)	39,789円

(注1) 期首元本額 9,811,624,078円  
追加設定元本額 53,979,505円  
一部解約元本額 946,150,133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) 3,233,166,462円  
D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 5,287,004,088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) 35,519,774円  
D I AM世界インカム・オープン (毎月決算コース) 216,547,787円  
D I AM世界3資産オープン (毎月決算型) 147,215,339円  
期末元本合計 8,919,453,450円

## ■損益の状況

当期 自2022年5月27日 至2023年5月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,198,836,072円
受 取 配 当 金	1,195,554,461
受 取 利 息	3,375,835
そ の 他 収 益 金	13,198
支 払 利 息	△107,422
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,618,249,676
売 買 益	5,920,084,918
売 買 損	△3,301,835,242
(C) そ の 他 費 用	△8,294,184
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,808,791,564
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	25,230,930,258
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,613,646,662
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	144,020,495
(H) 合 計(D+E+F+G)	26,570,095,655
次 期 繰 越 損 益 金(H)	26,570,095,655

(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。