

## 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)(為替ヘッジあり)

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	2018年4月5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)(為替ヘッジあり)	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。 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。 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	第7期(2018年11月21日)以降の決算日(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。	

<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。

愛称：ハッピーインカム(為替ヘッジあり)

第27期	<決算日	2020年7月21日>
第28期	<決算日	2020年8月21日>
第29期	<決算日	2020年9月23日>
第30期	<決算日	2020年10月21日>
第31期	<決算日	2020年11月24日>
第32期	<決算日	2020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)(為替ヘッジあり)」は、2020年12月21日に第32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。

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/>

## 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）

### ■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基 準 価 額 (分配落)	準 価 額			株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	純 資 産 額 純 総
			税 分	込 配	期 騰 落 中 率			
第2作成期	3期(2018年7月23日)	円 10,229		円 0	% 0.3	% 95.4	% -	百万円 68
	4期(2018年8月21日)	10,333		0	1.0	94.3	-	76
	5期(2018年9月21日)	10,262		0	△0.7	97.6	-	74
	6期(2018年10月22日)	9,975		0	△2.8	97.0	-	76
	7期(2018年11月21日)	9,844		15	△1.2	93.7	-	77
	8期(2018年12月21日)	9,353		15	△4.8	91.1	-	77
第3作成期	9期(2019年1月21日)	9,780		15	4.7	93.8	-	80
	10期(2019年2月21日)	10,112		15	3.5	96.0	-	88
	11期(2019年3月22日)	10,257		15	1.6	96.8	-	96
	12期(2019年4月22日)	10,312		15	0.7	96.7	-	105
	13期(2019年5月21日)	10,170		15	△1.2	94.3	-	100
第4作成期	14期(2019年6月21日)	10,382		15	2.2	94.3	-	95
	15期(2019年7月22日)	10,404		15	0.4	95.3	-	79
	16期(2019年8月21日)	10,060		15	△3.2	95.2	-	78
	17期(2019年9月24日)	10,433		15	3.9	96.1	-	84
	18期(2019年10月21日)	10,436		15	0.2	98.6	-	83
	19期(2019年11月21日)	10,611		15	1.8	95.3	-	86
第5作成期	20期(2019年12月23日)	10,988		15	3.7	95.9	-	88
	21期(2020年1月21日)	11,059		15	0.8	96.5	-	97
	22期(2020年2月21日)	10,983		15	△0.6	97.7	-	95
	23期(2020年3月23日)	7,860		15	△28.3	91.6	-	63
	24期(2020年4月21日)	9,019		15	14.9	91.8	-	76
	25期(2020年5月21日)	9,155		15	1.7	93.6	-	95
第6作成期	26期(2020年6月22日)	9,611		15	5.1	94.4	-	99
	27期(2020年7月21日)	9,786		15	2.0	93.8	-	105
	28期(2020年8月21日)	9,775		15	0.0	95.7	-	105
	29期(2020年9月23日)	9,570		15	△1.9	94.6	-	103
	30期(2020年10月21日)	9,694		15	1.5	95.9	-	105
	31期(2020年11月24日)	10,003		15	3.3	95.5	-	109
	32期(2020年12月21日)	10,171		15	1.8	94.6	-	111

(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		株式組入比率	株式先物比率
		円	騰 落 率		
第 27 期	(期 首) 2020年 6 月 22 日	9,611	-	94.4	-
	6 月 末	9,476	△1.4	94.2	-
	(期 末) 2020年 7 月 21 日	9,801	2.0	93.8	-
第 28 期	(期 首) 2020年 7 月 21 日	9,786	-	93.8	-
	7 月 末	9,638	△1.5	93.5	-
	(期 末) 2020年 8 月 21 日	9,790	0.0	95.7	-
第 29 期	(期 首) 2020年 8 月 21 日	9,775	-	95.7	-
	8 月 末	9,826	0.5	95.7	-
	(期 末) 2020年 9 月 23 日	9,585	△1.9	94.6	-
第 30 期	(期 首) 2020年 9 月 23 日	9,570	-	94.6	-
	9 月 末	9,597	0.3	95.4	-
	(期 末) 2020年 10 月 21 日	9,709	1.5	95.9	-
第 31 期	(期 首) 2020年 10 月 21 日	9,694	-	95.9	-
	10 月 末	9,225	△4.8	93.9	-
	(期 末) 2020年 11 月 24 日	10,018	3.3	95.5	-
第 32 期	(期 首) 2020年 11 月 24 日	10,003	-	95.5	-
	11 月 末	10,148	1.4	95.1	-
	(期 末) 2020年 12 月 21 日	10,186	1.8	94.6	-

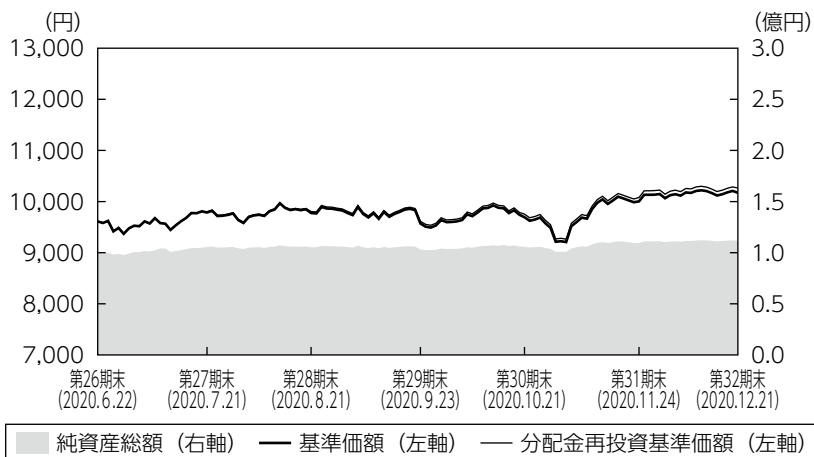
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■第27期～第32期の運用経過（2020年6月23日から2020年12月21日まで）

### 基準価額等の推移



第27期首： 9,611円  
第32期末： 10,171円  
（既払分配金90円）  
騰落率： 6.8%  
（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はありません。
- (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

外国株式市場は、作成期初から2020年8月にかけては新型コロナウイルスの感染拡大が一服する中、各国の経済対策を好感して堅調に推移しました。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が見られました。2020年11月以降はワクチンの開発期待などから相場は反発基調となり、前作成期末対比で上昇して終えました。為替市場は円高米ドル安が進行しましたが、株式市場の上昇がプラス要因となり基準価額は上昇しました。

## 投資環境

外国株式市場は、作成期初から2020年8月にかけては新型コロナウイルスの感染が欧米で抑制される中、主要中央銀行による金融緩和策や各国政府による積極的な財政政策を受けて、堅調に推移しました。9月以降、欧米で新型コロナウイルスの感染が再び拡大傾向を強めたことや、米国の大統領選挙を控えてリスク回避的な動きも見られましたが、11月以降は反発色を強め、株価は上昇して作成期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

DIAM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。また、実質組入外貨建資産に対して対円で為替ヘッジを行いました。

### ●DIAM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、公益やヘルスケアセクターに対する高めの投資比率を継続しました。

## 【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	41.0%
	カナダ	6.1%
	計	47.2%
欧州	フィンランド	1.8%
	フランス	5.6%
	ドイツ	9.9%
	アイルランド	1.3%
	オランダ	1.1%
	スペイン	4.5%
	スイス	4.8%
	英国	14.2%
	ノルウェー	0.6%
	計	43.8%
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.2%
	香港	1.7%
	シンガポール	0.6%
	計	3.5%
	小計	94.4%
	現金など	5.6%
	合計	100%



#### 当作成期末

	国・地域	組入比率
北米	米国	41.3%
	カナダ	6.0%
	計	47.3%
欧州	フィンランド	2.0%
	フランス	5.9%
	ドイツ	11.3%
	アイルランド	1.5%
	オランダ	1.0%
	スペイン	3.6%
	スウェーデン	0.6%
	スイス	4.5%
	英国	14.2%
	計	44.7%
アジア・オセアニア	オーストラリア	0.8%
	香港	1.1%
	シンガポール	0.7%
	計	2.6%
	小計	94.6%
	現金など	5.4%
	合計	100%

### ○組入上位10業種

#### 前作成期末

No.	業種	組入比率
1	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19.3%
2	公益事業	17.8
3	資本財	6.5
4	銀行	6.4
5	食品・飲料・タバコ	6.3
6	エネルギー	5.7
7	家庭用品・パーソナル用品	5.6
8	電気通信サービス	4.6
9	保険	4.6
10	素材	4.0



#### 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	18.7%
2	公益事業	17.7
3	食品・飲料・タバコ	8.3
4	素材	6.7
5	家庭用品・パーソナル用品	6.6
6	資本財	6.1
7	保険	5.1
8	電気通信サービス	4.4
9	銀行	3.9
10	ソフトウェア・サービス	3.1

## 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27期	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期
	2020年6月23日 ~2020年7月21日	2020年7月22日 ~2020年8月21日	2020年8月22日 ~2020年9月23日	2020年9月24日 ~2020年10月21日	2020年10月22日 ~2020年11月24日	2020年11月25日 ~2020年12月21日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.15%	0.15%	0.16%	0.15%	0.15%	0.15%
当期の収益	15円	15円	11円	15円	15円	15円
当期の収益以外	-円	-円	3円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,185円	1,196円	1,193円	1,198円	1,201円	1,213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。また、実質組入外貨建資産に対して対円で為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。

### ●D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

今後の外国株式市場は、新型コロナウイルスを巡る動向と世界経済への影響度合い、特に企業業績への影響を睨みながら、値動きの荒い相場環境が続くことを想定します。一方で、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す当ファンドにとっては、比較的銘柄選別を行いやすい市場環境だと考えます。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27期～第32期		項目の概要
	(2020年6月23日 ～2020年12月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	59円	0.603%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,793円です。 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
(投信会社)	(28)	(0.285)	
(販売会社)	(28)	(0.285)	
(受託会社)	( 3)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	2	0.023	(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)	(0.023)	
(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	0.010	(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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 1)	(0.008)	
(監査費用)	( 0)	(0.001)	
(その他)	( 0)	(0.001)	
合計	63	0.639	

(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。

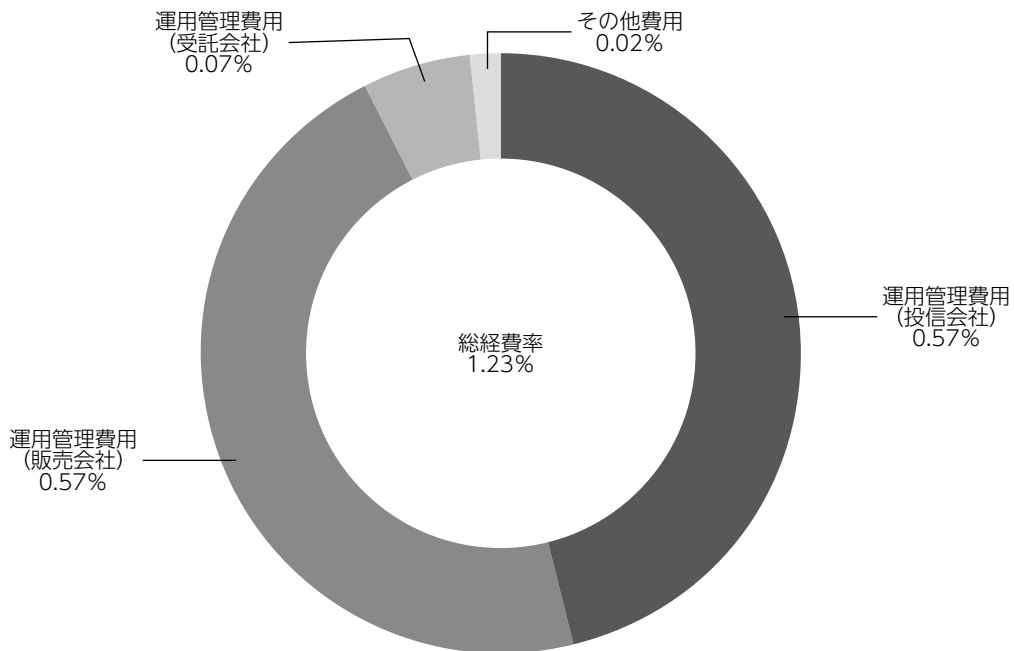
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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（2020年6月23日から2020年12月21日まで）

	第 27 期 ~ 第 32 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□ 2,421	千円 6,000	千□ 1,215	千円 3,000

## ■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 27 期 ~ 第 32 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	6,449,384千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	31,080,104千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.20

(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6月23日から2020年12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 5 作 成 期 末	第 6 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□ 39,594	千□ 40,801	千円 108,131

<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 (12,316,462,403口) の内容です。  
外国株式

銘柄	2020年6月22日現在		2020年12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	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	204.89	204.89	2,578	266,621	情報技術サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	-	677.38	3,365	347,964	食品
AMEREN CORP	284.99	284.99	2,247	232,384	総合公益事業
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	-	406.41	2,565	265,247	医薬品
CAMPBELL SOUP CO	1,004.22	1,004.22	4,777	493,949	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	334.74	334.74	2,166	224,009	コンピュータ・周辺機器
CISCO SYSTEMS INC	906.48	1,315.95	5,979	618,298	通信機器
CLOROX COMPANY	-	140.7	2,858	295,579	家庭用品
CUMMINS INC	89.92	89.92	2,016	208,557	機械
DTE ENERGY CO	153.23	153.23	1,864	192,821	総合公益事業
EATON CORP PLC	239.5	239.5	2,780	287,463	電気設備
EXXON MOBIL CORP	733.11	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
GILEAD SCIENCES INC	449.44	449.44	2,655	274,557	バイオテクノロジー
HP INC	491.28	491.28	1,201	124,252	コンピュータ・周辺機器
CENTERPOINT ENERGY INC	1,177.52	1,177.52	2,575	266,279	総合公益事業
JOHNSON & JOHNSON	270.33	270.33	4,176	431,888	医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	165.28	165.28	2,232	230,851	家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	118.09	118.09	4,204	434,730	航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	413.08	413.08	8,884	918,659	ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	1,063.33	1,063.33	4,854	501,914	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	837.69	-	-	-	半導体・半導体製造装置
MERCK & CO.INC.	1,086.11	1,086.11	8,637	893,151	医薬品
MICROSOFT CORP	347.09	347.09	7,587	784,499	ソフトウェア
PACWEST BANCORP	307.15	-	-	-	銀行
WELLS FARGO & CO	1,013.77	-	-	-	銀行
PACCAR INC	621.61	398.54	3,427	354,438	機械
PPL CORPORATION	893.92	893.92	2,409	249,102	電力
PFIZER INC	1,325.42	1,325.42	4,994	516,398	医薬品
ALTRIA GROUP INC	433.64	433.64	1,898	196,302	タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	852.83	852.83	11,857	1,226,091	家庭用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	640.1	640.1	3,733	385,998	食品
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	983	101,735	ガス
TRUIST FINANCIAL CORP	1,195.07	1,195.07	5,485	567,187	銀行
AT&T INC	1,256.74	1,256.74	3,694	382,043	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	245.8	245.8	2,143	221,599	石油・ガス・消耗燃料
TEXAS INSTRUMENTS INC	-	123.78	2,030	209,990	半導体・半導体製造装置
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	-	734.05	2,986	308,840	食品・生活必需品小売り
VALLEY NATIONAL BANCORP	1,286.38	-	-	-	銀行
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	637.34	637.34	5,486	567,341	タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	369.16	369.16	3,356	347,090	化学
GENERAL MOTORS CO	710.63	-	-	-	自動車
ABBVIE INC	655.93	655.93	6,851	708,412	バイオテクノロジー
AVANGRID INC	361.59	361.59	1,628	168,359	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,618.81 38銘柄	20,998.8 37銘柄	143,178 -	14,804,616 <45.4%>

銘柄	2020年6月22日現在		2020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	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	400.66	400.66	2,869	231,603	銀行
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	3,140.56	3,140.56	6,413	517,530	総合公益事業
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	193.26	193.26	2,164	174,644	銀行
RUSSEL METALS INC	768.67	768.67	1,700	137,214	商社・流通業
GIBSON ENERGY INC	2,382.76	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL POWER CORP	860.16	860.16	2,998	241,980	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NORTHLAND POWER INC	2,042.99	2,042.99	8,772	707,948	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>	7,406.3	24,918	2,010,922	
<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	2,508	196,892	金属・鉱業
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	285.97	—	—	—	銀行
AGL ENERGY LTD	776.72	776.72	1,026	80,605	総合公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,357.99	3,535	277,497	
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,620	3,490	8,253	110,106	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	21,880	5,470	20,457	272,907	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,500	8,960	383,013	
<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	2,965	230,425	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,307	2,965	230,425	
<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	4,701	651,795	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	401.83	401.83	1,119	155,151	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,637.2	1,637.2	2,575	357,041	タバコ
UNILEVER PLC	808.44	808.44	3,515	487,333	パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,384.49	3,384.49	3,078	426,807	水道
RIO TINTO PLC	906.4	906.4	5,124	710,500	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	10,084.8	10,084.8	1,269	176,027	無線通信サービス
SSE PLC	1,179.15	1,179.15	1,747	242,273	電力
BP PLC	4,168.37	4,168.37	1,130	156,785	石油・ガス・消耗燃料
3I GROUP PLC	2,194.47	2,194.47	2,540	352,159	資本市場
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,670.2	2,670.2	3,621	502,134	医薬品
ASTRAZENECA PLC	558.09	558.09	4,190	580,920	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33,412.24	34,614	4,798,930	
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	203.38	203.38	6,303	736,279	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	824.79	824.79	6,640	775,596	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,028.17	12,944	1,511,876	
<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	—	—	
<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	16,593	207,092	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	16,593	207,092	

銘柄	2020年6月22日現在		2020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…オランダ) NN GROUP NV	百株 284.71	百株 —	千ユーロ —	千円 —	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	—	—	<—%>
(ユーロ…フランス) AXA SA DANONE TOTAL SE ORANGE SANOFI	百株 2,250.72 — 918.14 1,982.66 620.01	百株 2,636.52 416.6 918.14 — 620.01	千ユーロ 5,242 2,252 3,304 — 4,898	千円 662,122 284,550 417,343 — 618,705	保険 食品 石油・ガス・消耗燃料 各種電気通信サービス 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,771.53 4銘柄	4,591.27 4銘柄	15,698 —	1,982,722 <6.1%>
(ユーロ…ドイツ) DEUTSCHE POST AG-REG RWE AG E.ON SE SIEMENS AG-REG DAIMLER AG BASF SE ALLIANZ SE DEUTSCHE TELEKOM AG-REG COVESTRO AG	百株 1,706.71 988.86 4,209.62 275.79 199.9 256.47 222.89 3,718.47 —	百株 1,706.71 — 4,209.62 275.79 — 256.47 222.89 3,718.47 877.92	千ユーロ 7,026 — 3,798 3,249 — 1,654 4,457 5,613 4,459	千円 887,450 — 479,783 410,393 — 208,994 562,963 708,925 563,276	航空貨物・物流サービス 総合公益事業 総合公益事業 コングロマリット 自動車 化学 保険 各種電気通信サービス 化学
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,578.71 8銘柄	11,267.87 7銘柄	30,259 —	3,821,788 <11.7%>
(ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA REPSOL SA ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV RED ELECTRICA DE CORPORACION SA FERROVIAL SA REPSOL SA-RTS	百株 5,817.73 2,641.02 423.32 752.35 739.38 2,641.02	百株 5,817.73 — — 752.35 739.38 —	千ユーロ 6,638 — — 1,250 1,688 —	千円 838,383 — — 157,878 213,288 —	電力 石油・ガス・消耗燃料 建設・土木 電力 建設・土木 石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,014.82 6銘柄	7,309.46 3銘柄	9,576 —	1,209,550 <3.7%>
(ユーロ…フィンランド) UPM-KYMMENE OYJ FORTUM OYJ	百株 653.83 1,774.25	百株 653.83 1,774.25	千ユーロ 1,974 3,414	千円 249,387 431,256	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	2,428.08 2銘柄	5,389 —	680,644 <2.1%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	134,717.84 87銘柄	101,555.43 79銘柄	—	31,919,081 <97.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2020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、2020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

2020年12月21日現在

項 目	第 6 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	108,131 千円	96.5 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,958	3.5
投 資 信 託 財 産 総 額	112,089	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、2020年12月21日現在、32,362,384千円、98.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年12月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.40円、1カナダ・ドル=80.70円、1オーストラリア・ドル=78.50円、1香港・ドル=13.34円、1シンガポール・ドル=77.70円、1台湾・ドル=3.67円、1イギリス・ポンド=138.64円、1スイス・フラン=116.80円、1ノルウェー・クローネ=11.99円、1スウェーデン・クローナ=12.48円、1ユーロ=126.30円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年7月21日)、(2020年8月21日)、(2020年9月23日)、(2020年10月21日)、(2020年11月24日)、(2020年12月21日)現在

項 目	第 27 期 末	第 28 期 末	第 29 期 末	第 30 期 末	第 31 期 末	第 32 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>205,872,925円</b>	<b>207,699,671円</b>	<b>203,210,970円</b>	<b>208,559,930円</b>	<b>215,421,827円</b>	<b>217,000,381円</b>
コール・ローン等	5,388,939	1,618,750	1,852,496	2,953,028	3,768,905	3,562,329
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	102,107,586	103,671,959	100,134,489	102,745,770	106,030,273	108,131,539
未 収 入 金	98,376,400	102,408,962	101,223,985	102,861,132	105,622,649	105,306,513
<b>(B) 負 債</b>	<b>100,273,894</b>	<b>102,464,241</b>	<b>100,023,519</b>	<b>102,895,684</b>	<b>105,924,975</b>	<b>105,262,162</b>
未 払 金	100,014,280	102,194,090	99,745,930	102,634,440	105,046,990	104,991,330
未 払 収 益 分 配 金	161,857	161,492	161,739	163,506	164,192	164,793
未 払 解 約 金	-	8	22	3	593,576	6,119
未 払 信 託 報 酬	97,486	108,341	115,498	97,456	119,883	99,650
そ の 他 未 払 費 用	271	310	330	279	334	270
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>105,599,031</b>	<b>105,235,430</b>	<b>103,187,451</b>	<b>105,664,246</b>	<b>109,496,852</b>	<b>111,738,219</b>
元 本	107,904,987	107,661,630	107,826,385	109,004,014	109,461,969	109,862,663
次 期 繰 越 損 益 金	△2,305,956	△2,426,200	△4,638,934	△3,339,768	34,883	1,875,556
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>107,904,987口</b>	<b>107,661,630口</b>	<b>107,826,385口</b>	<b>109,004,014口</b>	<b>109,461,969口</b>	<b>109,862,663口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	9,786円	9,775円	9,570円	9,694円	10,003円	10,171円

(注) 第26期末における元本額は103,662,571円、当作成期間(第27期~第32期)中における追加設定元本額は9,715,320円、同解約元本額は3,515,228円です。

## ■損益の状況

〔自 2020年6月23日 至 2020年7月21日〕〔自 2020年7月22日 至 2020年8月21日〕〔自 2020年8月22日 至 2020年9月23日〕〔自 2020年9月24日 至 2020年10月21日〕〔自 2020年10月22日 至 2020年11月24日〕〔自 2020年11月25日 至 2020年12月21日〕

項 目	第 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期	第 31 期	第 32 期
(A) 配 当 等 収 益	△105円	△106円	△81円	△26円	△92円	△59円
受 取 利 息	1	—	—	—	—	1
支 払 利 息	△106	△106	△81	△26	△92	△60
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,135,341	145,082	△1,931,553	1,580,570	3,669,286	2,097,655
売 買 益	4,057,757	1,855,503	2,196,289	3,287,789	4,189,209	3,286,247
売 買 損	△1,922,416	△1,710,421	△4,127,842	△1,707,219	△519,923	△1,188,592
(C) 信 託 報 酬 等	△97,757	△108,651	△115,828	△97,735	△120,217	△99,920
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	2,037,479	36,325	△2,047,462	1,482,809	3,548,977	1,997,676
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△3,104,483	△1,223,182	△1,347,921	△3,556,490	△2,224,578	1,158,231
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,077,095	△1,077,851	△1,081,812	△1,102,581	△1,125,324	△1,115,558
(配 当 等 相 当 額)	(6,602,114)	(6,610,808)	(6,632,631)	(6,774,391)	(6,865,195)	(6,924,622)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△7,679,209)	(△7,688,659)	(△7,714,443)	(△7,876,972)	(△7,990,519)	(△8,040,180)
(G) 合 計 (D+E+F)	△2,144,099	△2,264,708	△4,477,195	△3,176,262	199,075	2,040,349
(H) 収 益 分 配 金	△161,857	△161,492	△161,739	△163,506	△164,192	△164,793
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△2,305,956	△2,426,200	△4,638,934	△3,339,768	34,883	1,875,556
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,077,095	△1,077,851	△1,081,812	△1,102,581	△1,125,324	△1,115,558
(配 当 等 相 当 額)	(6,611,114)	(6,610,937)	(6,632,678)	(6,774,895)	(6,865,796)	(6,925,075)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△7,688,209)	(△7,688,788)	(△7,714,490)	(△7,877,476)	(△7,991,120)	(△8,040,633)
分 配 準 備 積 立 金	6,185,852	6,275,445	6,240,962	6,286,341	6,281,263	6,403,954
繰 越 損 益 金	△7,414,713	△7,623,794	△9,798,084	△8,523,528	△5,121,056	△3,412,840

(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 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期	第 31 期	第 32 期
(a) 経費控除後の配当等収益	463,744円	279,645円	129,225円	209,992円	194,542円	298,184円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	6,611,114	6,610,937	6,632,678	6,774,895	6,865,796	6,925,075
(d) 分 配 準 備 積 立 金	5,883,965	6,157,292	6,273,476	6,239,855	6,250,913	6,270,563
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	12,958,823	13,047,874	13,035,379	13,224,742	13,311,251	13,493,822
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,200.95	1,211.93	1,208.92	1,213.23	1,216.06	1,228.24
(g) 分 配 金	161,857	161,492	161,739	163,506	164,192	164,793
(h) 1万口当たり分配金	15	15	15	15	15	15

## ■分配金のお知らせ

決算期	第 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期	第 31 期	第 32 期
1万口当たり分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15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15期（決算日 2020年5月26日）

（計算期間 2019年5月28日～2020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15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	中率 落			
11期 (2016年5月26日)	円		%	%	%	百万円 36,995
12期 (2017年5月26日)	21,948	△13.2		98.3	—	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
	23,045	△10.1		96.6	—	

(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)。

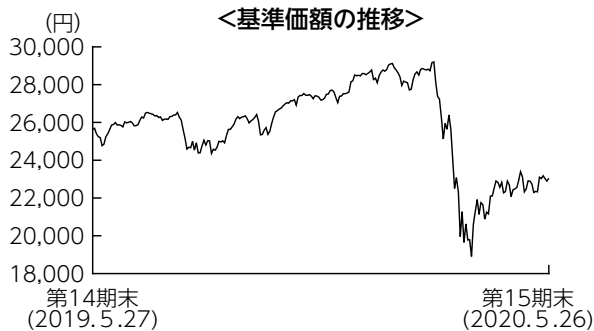
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 円	価 額	株 式 組 入 率 %	株 式 先 物 率 %
		騰 落 率 %		
(期 首) 2019年 5 月27日	25,645	—	97.7	—
5 月 末	25,199	△1.7	97.6	—
6 月 末	25,877	0.9	97.4	—
7 月 末	26,269	2.4	97.3	—
8 月 末	24,998	△2.5	97.5	—
9 月 末	26,270	2.4	97.6	—
10 月 末	27,206	6.1	98.2	—
11 月 末	27,709	8.0	98.0	—
12 月 末	28,776	12.2	98.3	—
2020年 1 月 末	28,109	9.6	97.4	—
2 月 末	26,232	2.3	97.4	—
3 月 末	21,755	△15.2	96.4	—
4 月 末	23,388	△8.8	97.0	—
(期 末) 2020年 5 月26日	23,045	△10.1	96.6	—

(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（2019年5月28日から2020年5月26日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,045円となり、前期末比で10.1%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

外国株式市場は、期初から2020年2月中旬にかけては米中貿易摩擦の懸念緩和などから上昇しましたが、2月下旬以降には新型コロナウイルスの感染が米国や欧州へと波及したことから大きく下落しました。その後は、先進国を中心に感染拡大ペースが鈍化傾向となったことや、経済活動再開への期待感などから反発しましたが、前期末比で外国株式市場は下落しました。為替市場では主要通貨に対して前期末比で円高が進行しました。こうした中、当ファンドの基準価額は下落しました。

## 投資環境

外国株式市場は、期初から2020年2月中旬にかけては米中貿易摩擦の懸念緩和や堅調な米国経済を好感し上昇しました。しかし、2月下旬には新型コロナウイルスの感染が米国や欧州へと波及したことから下落に転じ、世界経済の悪化懸念や原油先物市場の急落等から外国株式市場は更に下落しました。その後、先進国での感染拡大ペースの鈍化傾向や、経済活動の再開期待等から外国株式市場は上昇に転じましたが、前期末比では下落して期末を終えました。

為替市場では主要通貨に対して前期末比で円高が進みました。米ドルについては、期初から2020年2月中旬にかけては米中貿易摩擦の懸念緩和や堅調な米国経済が好感され買われる展開となりました。その後、新型コロナウイルスの感染拡大が米国へと波及したことから一転し、円高が進みました。ユーロ、英ポンドについても同様で、2月中旬の新型コロナウイルスの感染拡大が欧州にも波及したことから円高が進行しました。

## 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、生活必需品セクターに対する投資比率を高めとしました。

## 今後の運用方針

今後の外国株式市場は、目先は新型コロナウイルスが世界経済へ与える悪影響の度合い、特に企業業績への影響を睨みながら、値動きの荒い相場環境が続くことを想定します。一方で、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す当ファンドにとっては、比較的銘柄選別を行いやすい市場環境だと考えます。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	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式)	6円 ( 6)	0.025% (0.025)
(b) 有価証券取引税 (株 式)	0 ( 0)	0.000 (0.000)
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	5 ( 4) ( 0)	0.018 (0.017) (0.001)
合 計	11	0.043

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(25,740円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2019年5月28日から2020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 2,026.44 (-)	千アメリカ・ドル 12,973 (-)	百株 2,451.92	千アメリカ・ドル 13,146
	カ ナ ダ	百株 - (-)	千カナダ・ドル - (-)	百株 630.56	千カナダ・ドル 2,074
	イ ギ リ ス	百株 - (-)	千イギリス・ポンド - (-)	百株 19,757.24	千イギリス・ポンド 5,285
	ス イ ス	百株 - (-)	千スイス・フラン - (-)	百株 164.95	千スイス・フラン 948
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 - (-)	千スウェーデン・クローナ - (-)	百株 2,064.09	千スウェーデン・クローナ 28,755
国	ユ	百株 284.71 (-)	千ユーロ 1,027 (-)	百株 3,273.87	千ユーロ 1,645
	イ	- (-)	- (-)	9,724.56	8,642
	ロ	5,921.62 (-)	6,547 (-)	1,900.34	5,280
	-	- (19,242.9)	- (-)	30,068.9	1,660
	フィンランド	1,135.8 (-)	1,723 (-)	-	-

(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	7,324,493千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	35,101,917千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.20

(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（2019年5月28日から2020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		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	204.89	2,425	261,416		情報技術サービス
AMEREN CORP	284.99	284.99	1,989	214,440		総合公益事業
CAMPBELL SOUP CO	1,004.22	1,004.22	4,855	523,266		食品
SEAGATE TECHNOLOGY	334.74	334.74	1,705	183,837		コンピュータ・周辺機器
CISCO SYSTEMS INC	906.48	906.48	4,070	438,634		通信機器
CUMMINS INC	89.92	89.92	1,394	150,244		機械
DTE ENERGY CO	153.23	153.23	1,564	168,636		総合公益事業
EATON CORP PLC	239.5	239.5	1,884	203,054		電気設備
EXXON MOBIL CORP	733.11	733.11	3,269	352,372		石油・ガス・消耗燃料
GILEAD SCIENCES INC	—	294.44	2,159	232,721		バイオテクノロジー
HP INC	491.28	491.28	835	90,006		コンピュータ・周辺機器
CENTERPOINT ENERGY INC	1,177.52	1,177.52	1,992	214,717		総合公益事業
JOHNSON & JOHNSON	—	270.33	3,902	420,599		医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	301.21	165.28	2,309	248,908		家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	118.09	118.09	4,357	469,610		航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	413.08	413.08	7,617	820,949		ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	377.18	1,063.33	3,545	382,059		保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	912.34	597.02	3,350	361,080		半導体・半導体製造装置
MERCK & CO.INC.	1,086.11	1,086.11	8,294	893,911		医薬品
MICROSOFT CORP	347.09	347.09	6,369	686,435		ソフトウェア
PACWEST BANCORP	307.15	307.15	500	53,988		銀行
WELLS FARGO & CO	1,013.77	1,013.77	2,450	264,066		銀行
PACCAR INC	1,062.39	621.61	4,253	458,351		機械
PPL CORPORATION	893.92	893.92	2,292	247,106		電力
PFIZER INC	1,325.42	1,325.42	4,970	535,651		医薬品
ALTRIA GROUP INC	433.64	433.64	1,636	176,325		タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	852.83	852.83	9,602	1,034,900		家庭用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,009.41	640.1	3,181	342,848		食品
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	1,205	129,963		ガス
TRUIST FINANCIAL CORP	1,195.07	1,195.07	3,978	428,750		銀行
AT&T INC	1,256.74	1,256.74	3,755	404,691		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	245.8	245.8	2,219	239,150		石油・ガス・消耗燃料
VALLEY NATIONAL BANCORP	1,286.38	1,286.38	972	104,806		銀行
LAS VEGAS SANDS CORP	528.45	528.45	2,478	267,100		ホテル・レストラン・レジャー
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	637.34	637.34	4,490	483,893		タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	369.16	369.16	2,230	240,377		化学
SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	1,125.69	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
GENERAL MOTORS CO	—	710.63	1,846	198,966		自動車
ABBVIE INC	655.93	655.93	6,041	651,050		バイオテクノロジー
AVANGRID INC	361.59	361.59	1,481	159,615		電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,177.07 37銘柄	23,751.59 39銘柄	127,479 —	13,738,511 <45.5%>	

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	
NATIONAL BANK OF CANADA	400.66	400.66	2,164	167,110	銀行
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	3,140.56	3,140.56	5,913	456,594	総合公益事業
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	193.26	193.26	1,596	123,267	銀行
RUSSEL METALS INC	768.67	768.67	1,163	89,854	商社・流通業
POWER FINANCIAL CORP	630.56	—	—	—	保険
GIBSON ENERGY INC	2,382.76	2,382.76	5,065	391,126	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL POWER CORP	860.16	860.16	2,280	176,060	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NORTHLAND POWER INC	2,042.99	2,042.99	6,222	480,473	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 >	10,419.62 8銘柄	9,789.06 7銘柄	24,407 —	1,884,488 <6.2%>
<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	2,020	142,909	金属・鉱業
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	285.97	285.97	1,686	119,317	銀行
AGL ENERGY LTD	776.72	776.72	1,284	90,866	総合公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,643.96 3銘柄	1,643.96 3銘柄	4,992 —	353,093 <1.2%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,620	7,620	16,611	230,901	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	21,880	21,880	17,372	241,480	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	29,500 2銘柄	29,500 2銘柄	33,984 —	472,382 <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	2,543	192,664	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	2,543 —	192,664 <0.6%>
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BT GROUP PLC	17,462.51	—	—	—	各種電気通信サービス
NATIONAL GRID PLC	5,418.8	5,418.8	4,771	628,350	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	769.32	401.83	1,262	166,279	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,637.2	1,637.2	2,475	325,966	タバコ
UNILEVER PLC	808.44	808.44	3,326	438,063	パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,384.49	3,384.49	2,985	393,169	水道
RIO TINTO PLC	906.4	906.4	3,863	508,749	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	10,084.8	10,084.8	1,311	172,635	無線通信サービス
SSE PLC	1,848.36	1,179.15	1,395	183,762	電力
BP PLC	4,168.37	4,168.37	1,292	170,156	石油・ガス・消耗燃料
3I GROUP PLC	3,452.5	2,194.47	1,784	234,988	資本市場
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,670.2	2,670.2	4,441	584,800	医薬品
ASTRAZENECA PLC	558.09	558.09	5,020	661,109	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	53,169.48 13銘柄	33,412.24 12銘柄	33,930 —	4,468,032 <14.8%>
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	203.38	203.38	7,097	787,802	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	824.79	824.79	6,854	760,817	医薬品

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	
(スイス) ALCON INC	百株 164.95	百株 -	千スイス・フラン -	千円 -	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額 1,193.12 銘柄数<比率> 3銘柄	株数 1,028.17 2銘柄	13,952	1,548,620 <5.1%>	
(ノルウェー) DNB ASA	百株 1,340.75	百株 1,340.75	千ノルウェー・クローネ 16,377	千円 175,564	銀行
小計	株数・金額 1,340.75 銘柄数<比率> 1銘柄	株数 1,340.75 1銘柄	16,377	175,564 <0.6%>	
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 2,064.09	百株 -	千スウェーデン・クローナ -	千円 -	無線通信サービス
小計	株数・金額 2,064.09 銘柄数<比率> 1銘柄	株数 - -銘柄	-	- <-%>	
(ユーロ…オランダ) ING GROEP NV-CVA NN GROUP NV	百株 3,273.87 -	百株 - 284.71	千ユーロ - 747	千円 - 87,860	銀行 保険
小計	株数・金額 3,273.87 銘柄数<比率> 1銘柄	株数 284.71 1銘柄	747	87,860 <0.3%>	
(ユーロ…フランス) AXA BOUYGUES NATIXIS TOTAL SA SANOFI CREDIT AGRICOLE SA ENGIE	百株 2,250.72 971.28 3,965.72 1,166.89 620.01 3,096.68 1,442.13	百株 2,250.72 - - 918.14 620.01 - -	千ユーロ 3,419 - - 3,054 5,435 - -	千円 401,972 - - 359,050 639,012 - -	保険 建設・土木 資本市場 石油・ガス・消耗燃料 医薬品 銀行 総合公益事業
小計	株数・金額 13,513.43 銘柄数<比率> 7銘柄	株数 3,788.87 3銘柄	11,909	1,400,035 <4.6%>	
(ユーロ…ドイツ) DEUTSCHE POST AG-REG RWE AG E.ON SE SIEMENS AG-REG DAIMLER AG BASF SE ALLIANZ SE DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	百株 2,349.1 2,246.81 - 275.79 199.9 256.47 222.89 2,006.47	百株 1,706.71 988.86 4,209.62 275.79 199.9 256.47 222.89 3,718.47	千ユーロ 4,860 2,963 4,127 2,647 637 1,197 3,551 5,142	千円 571,425 348,402 485,282 311,185 74,907 140,833 417,517 604,569	航空貨物・物流サービス 総合公益事業 総合公益事業 コンプロマリット 自動車 化学 保険 各種電気通信サービス
小計	株数・金額 7,557.43 銘柄数<比率> 7銘柄	株数 11,578.71 8銘柄	25,128	2,954,122 <9.8%>	
(ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA REPSOL SA ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV RED ELECTRICA DE CORPORACION SA FERROVIAL SA CAIXABANK	百株 5,817.73 2,641.02 423.32 752.35 739.38 10,826	百株 5,817.73 2,641.02 423.32 752.35 739.38 -	千ユーロ 5,319 2,217 929 1,190 1,783 -	千円 625,387 260,739 109,235 139,966 209,654 -	電力 石油・ガス・消耗燃料 建設・土木 電力 建設・土木 銀行



銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等		
			株数	株数		期末	
						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-RTS	739.38		—	—	—	建設・土木	
FERROVIAL SA-RTS	—		739.38	24	2,937	建設・土木	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,939.18 7銘柄	11,113.18 6銘柄	11,465 —	1,347,921 <4.5%>		
(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	1,641	193,006	紙製品・林産品	
FORTUM OYJ	638.45		1,774.25	2,838	333,729	電力	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,292.28 2銘柄	2,428.08 2銘柄	4,480 —	526,735 <1.7%>		
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	172,391.28 93銘柄	130,966.32 87銘柄	— —	29,150,031 <96.6%>		

(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

2020年5月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	29,150,031	96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,021,207	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	30,171,238	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、29,459,312千円、97.6%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、2020年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.77円、1カナダ・ドル=77.21円、1オーストラリア・ドル=70.73円、1香港・ドル=13.90円、1シンガポール・ドル=75.75円、1台湾・ドル=3.58円、1イギリス・ポンド=131.68円、1スイス・フラン=110.99円、1ノルウェー・クローネ=10.72円、1スウェーデン・クローナ=11.15円、1ユーロ=117.56円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月26日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	30,171,238,858円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	961,873,705
株 式(評価額)	29,150,031,548
未 収 配 当 金	59,333,605
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	30,171,238,858
元 本	13,092,092,972
次 期 繰 越 損 益 金	17,079,145,886
(D) 受 益 権 総 口 数	13,092,092,972口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	23,045円

(注1) 期首元本額 14,316,761,394円  
追加設定元本額 336,835,930円  
一部解約元本額 1,561,504,352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) 4,437,836,821円  
D I A M 世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 7,742,368,314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) 39,977,395円  
D I A M 世界6資産バランスファンド 84,351,777円  
D I A M グローバル・アクティブ・バランスファンド 119,990,215円  
D I A M 世界インカム・オープン (毎月決算コース) 393,209,852円  
D I A M 世界3資産オープン (毎月決算型) 274,358,598円  
期末元本合計 13,092,092,972円

## ■損益の状況

当期 自2019年5月28日 至2020年5月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,294,930,075円
受 取 配 当 金	1,292,746,076
受 取 利 息	1,795,545
そ の 他 収 益 金	657,376
支 払 利 息	△268,922
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,411,733,234
売 買 益	1,964,234,283
売 買 損	△6,375,967,517
(C) そ の 他 費 用	△6,338,865
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△3,123,142,024
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	22,399,219,488
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,694,095,648
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	497,164,070
(H) 合 計(D+E+F+G)	17,079,145,886
次 期 繰 越 損 益 金(H)	17,079,145,886

(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。

## 《お知らせ》

■欧州地域の株式の銘柄選定に関する投資助言元を Asset Management One International Ltd.から Asset Management One USA Inc.に変更したため、約款に所要の変更を行いました。

(2019年6月26日)