

運用報告書 (全体版)

D I A M世界インカム・オープン(毎月決算コース)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／資産複合	
信託期間	2005年9月29日から無期限です。	
運用方針	安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。	
主要投資対象	D I A M世界インカム・オープン(毎月決算コース)	以下の各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高格付インカム・オープン・マザーファンド	高格付資産国の公社債を主要投資対象とします。
	D I A M世界対応株オープン・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。
	D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
運用方法	各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に外国債券、外国不動産投資信託証券および外国株式に投資を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。中長期的なリスク水準等を勘案し、各マザーファンド受益証券への基本配分を決定し、投資を行います。各マザーファンド受益証券の時価の変動等により、時価構成比が変化した場合には、定期的に基本配分に修正します。実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。	
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。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
分配方針	決算日（原則として毎月26日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等のうち、原則として利子・配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年6月および12月の決算時には、原則として利子・配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。	

愛称：世界三重奏

第194期	<決算日	2022年1月26日>
第195期	<決算日	2022年2月28日>
第196期	<決算日	2022年3月28日>
第197期	<決算日	2022年4月26日>
第198期	<決算日	2022年5月26日>
第199期	<決算日	2022年6月27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世界インカム・オープン（毎月決算コース）」は、2022年6月27日に第199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世界インカム・オープン（毎月決算コース）

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	投資信託・債券・投資受託証券組入率	純資産額
		(分配落)	税金込み	期中騰落率						
第30作成期	170期(2020年1月27日)	円 8,842	円 20	% 0.8	% 23.9	% -	% 48.9	% -	% 23.4	百万円 4,380
	171期(2020年2月26日)	8,744	20	△0.9	23.5	-	49.6	-	23.4	4,299
	172期(2020年3月26日)	7,209	20	△17.3	23.3	-	50.7	-	20.1	3,461
	173期(2020年4月27日)	7,444	20	3.5	24.2	-	50.9	-	20.2	3,550
	174期(2020年5月26日)	7,622	20	2.7	24.1	-	51.3	-	20.3	3,633
	175期(2020年6月26日)	7,907	20	4.0	24.4	-	50.3	-	21.4	3,681
第31作成期	176期(2020年7月27日)	8,049	20	2.0	24.8	-	50.0	-	21.2	3,724
	177期(2020年8月26日)	8,260	20	2.9	24.7	-	49.1	-	22.0	3,805
	178期(2020年9月28日)	7,934	20	△3.7	24.3	-	49.4	-	21.9	3,624
	179期(2020年10月26日)	8,035	20	1.5	24.4	-	49.2	-	22.4	3,650
	180期(2020年11月26日)	8,352	20	4.2	24.9	-	47.8	-	23.8	3,771
	181期(2020年12月28日)	8,360	20	0.3	23.8	-	48.0	-	24.1	3,720
第32作成期	182期(2021年1月26日)	8,466	20	1.5	24.3	-	48.2	-	24.0	3,735
	183期(2021年2月26日)	8,608	20	1.9	24.5	-	47.5	-	24.3	3,745
	184期(2021年3月26日)	8,856	20	3.1	25.1	-	47.8	-	23.6	3,818
	185期(2021年4月26日)	9,034	20	2.2	25.0	-	47.5	-	23.6	3,854
	186期(2021年5月26日)	9,277	20	2.9	25.1	-	47.3	-	24.1	3,947
	187期(2021年6月28日)	9,401	20	1.6	25.0	-	47.0	-	24.3	3,958
第33作成期	188期(2021年7月26日)	9,303	20	△0.8	24.7	-	47.2	-	24.7	3,900
	189期(2021年8月26日)	9,290	20	0.1	24.6	-	47.1	-	24.1	3,872
	190期(2021年9月27日)	9,223	20	△0.5	24.5	-	48.0	-	24.6	3,805
	191期(2021年10月26日)	9,606	20	4.4	24.7	-	48.4	-	24.0	3,902
	192期(2021年11月26日)	9,504	20	△0.9	24.8	-	47.6	-	24.3	3,838
	193期(2021年12月27日)	9,551	20	0.7	24.4	-	48.3	-	24.1	3,831
第34作成期	194期(2022年1月26日)	9,239	20	△3.1	24.4	-	49.2	-	23.1	3,686
	195期(2022年2月28日)	9,257	20	0.4	24.5	-	49.2	-	23.1	3,683
	196期(2022年3月28日)	9,845	20	6.6	24.5	-	48.6	-	23.6	3,893
	197期(2022年4月26日)	9,890	20	0.7	24.8	-	48.2	-	23.3	3,858
	198期(2022年5月26日)	9,523	20	△3.5	25.6	-	48.4	-	21.8	3,701
	199期(2022年6月27日)	9,499	20	△0.0	25.4	-	49.6	-	21.9	3,663

(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、「株式組入率」、「株式先物比率」、「債券組入率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入率」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) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドは、外国債券、外国不動産投資信託証券（リート）、外国株式に投資を行い、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

上記資産を組み合わせた適切な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6) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %					
第194期	(期 首) 2021年12月27日	9,551	-	24.4	-	48.3	-	24.1
	12月 末	9,707	1.6	24.5	-	48.0	-	24.3
	(期 末) 2022年1月26日	9,259	△3.1	24.4	-	49.2	-	23.1
第195期	(期 首) 2022年1月26日	9,239	-	24.4	-	49.2	-	23.1
	1月 末	9,304	0.7	24.9	-	48.9	-	23.0
	(期 末) 2022年2月28日	9,277	0.4	24.5	-	49.2	-	23.1
第196期	(期 首) 2022年2月28日	9,257	-	24.5	-	49.2	-	23.1
	(期 末) 2022年3月28日	9,865	6.6	24.5	-	48.6	-	23.6
第197期	(期 首) 2022年3月28日	9,845	-	24.5	-	48.6	-	23.6
	3月 末	9,975	1.3	24.7	-	48.3	-	23.3
	(期 末) 2022年4月26日	9,910	0.7	24.8	-	48.2	-	23.3
第198期	(期 首) 2022年4月26日	9,890	-	24.8	-	48.2	-	23.3
	4月 末	9,853	△0.4	24.8	-	48.5	-	23.1
	(期 末) 2022年5月26日	9,543	△3.5	25.6	-	48.4	-	21.8
第199期	(期 首) 2022年5月26日	9,523	-	25.6	-	48.4	-	21.8
	5月 末	9,708	1.9	25.7	-	48.2	-	22.1
	(期 末) 2022年6月27日	9,519	△0.0	25.4	-	49.6	-	21.9

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

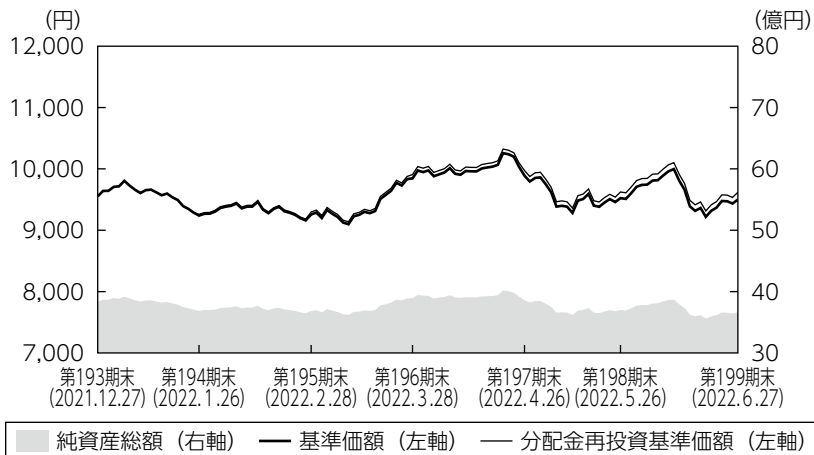
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■第194期～第199期の運用経過（2021年12月28日から2022年6月27日まで）

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (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

インフレ懸念や主要国の金融政策の早期正常化観測等から長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、長期金利の上昇やFRB（米連邦準備理事会）の積極的な金融引き締め姿勢を嫌気し世界的に株式市場やリート市場が下落したことがマイナスに寄与しました。一方、海外主要国の長期金利が大きく上昇し内外金利差が拡大する中、主要通貨に対して円安が進んだことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド	1.5%
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	5.1%
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	△2.1%
DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	△3.8%

投資環境

外国債券市場では、いずれの投資国でも10年国債利回りが上昇しました。新型コロナウイルスの変異株に対する懸念が後退し、景気見通しが改善したこと、景気回復やウクライナ情勢の緊迫化などによるエネルギー資源高を受けてインフレが強まったことなどを背景に、投資国の中央銀行が量的緩和策の停止や利上げなどを進めたことなどが利回りの上昇要因となりました。

外国株式市場は下落しました。欧米など主要国における金融引き締め加速への懸念や、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。

米国リート市場は下落しました。作成期初は新型コロナウイルスに対する警戒感の後退などから堅調な動きとなりました。しかし2022年に入ると、徐々に利上げ見通しが強まる中で米長期金利が上昇し、米国リート市場は弱含みしました。利上げペース鈍化観測から一時値を戻す局面もありましたが、ウクライナ情勢の長期化などを受けてインフレが高止まりするとの懸念から、値を下げて作成期末を迎えました。セクター別では、オフィスや工業などが大きく下落しました。

米国以外のリート市場については、世界的な利上げ局面が嫌気されて下落しました。欧州リート市場は、利上げが進められた英国が大きく下落したほか、大陸欧州でもECB（欧州中央銀行）のタカ派スタンスが警戒され下落しました。アジアリート市場では、経済正常化期待からシンガポールはほぼ横ばい、香港は中国の景気対策期待などから相対的に下落幅は限定的となりました。オーストラリアリート市場は、RBA（オーストラリア準備銀行）の市場予想以上の利上げなどが嫌気され大幅に下落しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。ドル／円相場は、米国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大したことや、米国が金融政策の正常化を進める一方で日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示したことで日米の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を材料に、円安ドル高の動きとなりました。その他の主要通貨においても、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

当ファンドでは、外国債券（D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド）50%、外国株式（D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド）25%、外国リート（D I A M US・リート・オープン・マザーファンド、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド）25%を基本資産配分比率とし、各資産の組入比率が概ね基本資産配分比率に維持されるように資産配分を行いました。

●D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション*については、新型コロナウイルスの感染動向と投資国および世界経済見通し、主要国と投資国の金融政策を勘案しつつ、機動的に調整を行いました。当作成期末のデュレーションは、利回り上昇が一定程度進んだとの判断などから、作成期初と比較して小幅に長期化しました。

*金利変動に対する債券価格の変動性。

●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、金融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。

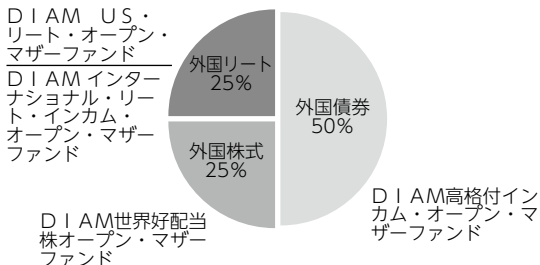
●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

適正価格に到達したと見られる銘柄については、適宜入れ替えを行いました。また、米国景気の先行きや金利の動向も注視しつつ、保守的な財務体質かつ長期的に見て成長見込みがある銘柄や、割安な水準にある銘柄を選別して投資しました。その他（データセンター、倉庫等）やヘルスケアなどの組入比率を引き上げた一方、住居施設やオフィスなどの組入比率を引き下げました。

●D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

保守的な財務体質かつ配当成長の見込めるキャッシュフローの安定した銘柄を選別して投資を行いました。また、適正価格に到達した銘柄は適宜入れ替えを行いました。地域別では、フランスやカナダなどの組入比率を引き上げた一方、ドイツやオーストラリアなどの組入比率を引き下げました。また、用途別では、小売りなどの組入比率を引き上げた一方、オフィスや混合型などの組入比率を引き下げました。

当ファンドの基本資産配分比率



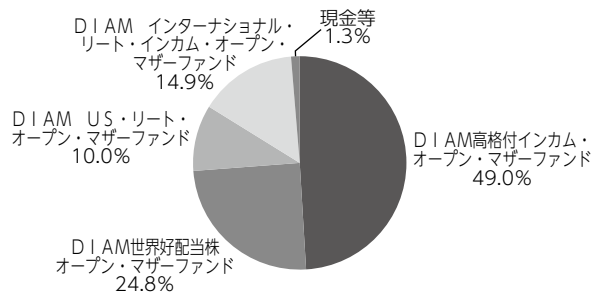
*基本資産配分比率は、市場動向等により変更する場合があります。

*上記外国債券、外国株式、外国リートは、各マザーファンドの主要投資対象を示します。

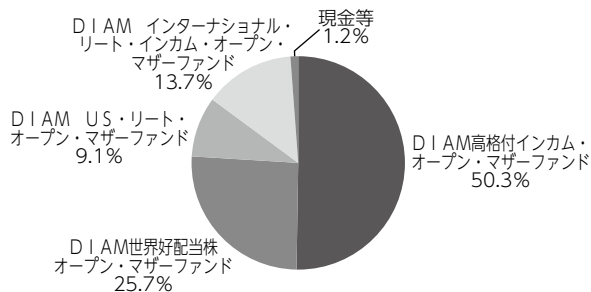
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

前作成期末



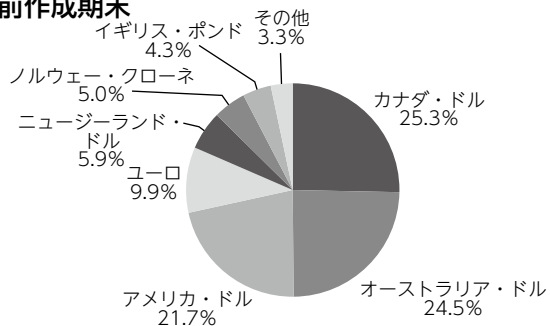
当作成期末



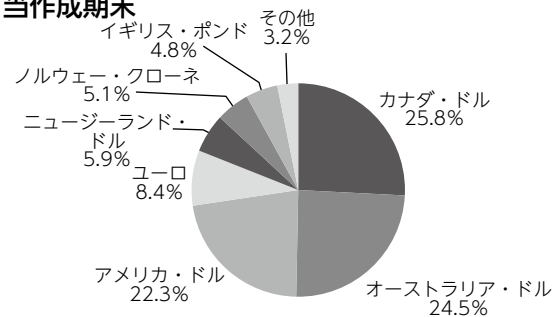
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



(注1) 比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券の時価総額に対する割合です。

(注2) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

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194期	第195期	第196期	第197期	第198期	第199期
	2021年12月28日 ~2022年1月26日	2022年1月27日 ~2022年2月28日	2022年3月1日 ~2022年3月28日	2022年3月29日 ~2022年4月26日	2022年4月27日 ~2022年5月26日	2022年5月27日 ~2022年6月27日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.22%	0.22%	0.20%	0.20%	0.21%	0.21%
当期の収益	7円	15円	20円	16円	19円	12円
当期の収益以外	12円	4円	-円	3円	0円	7円
翌期繰越分配対象額	560円	555円	561円	558円	557円	550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

各マザーファンドを基本資産配分比率に従い配分します。また、時価の変動などにより時価構成比が変化した場合には、定期的に基本資産配分比率に修正します。マザーファンドの組入比率についても高位組入れを維持します。

●D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。デュレーションについては、中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

●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、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。運用方針としては、配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄への選別投資を継続します。

●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

新型コロナウイルス感染の沈静化および経済活動の正常化が進む一方で、ウクライナ情勢やインフレの進行などが懸念材料となっており、米国リート市場は目先神経質な展開が予想されます。引き続き財務体質が良好で、長期的な成長が期待できる銘柄を選別して投資する方針です。また、割安な水準にある銘柄にも投資することにより、比較的高い配当利回りを維持できるポートフォリオを構築していきます。

●D I A Mインターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

新型コロナウイルス対策の制限緩和が進む一方で、ウクライナ情勢や主要国における金融引き締め懸念によって、リート市場は不安定な展開になることが予想されます。欧州リート市場では、安定したキャッシュフローが期待できる銘柄を中心に投資を行う方針です。オーストラリアリート市場は、倉庫や小売り等のうち財務体質や成長性、配当利回りといった点に優れる銘柄を選別し投資する方針です。アジアリート市場は、優れた収益成長見通しと健全な財務体質を有する銘柄に厳選して投資を行う方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第194期～第199期 (2021年12月28日 ～2022年6月27日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	63円	
(投信会社)	(34)	(0.350)	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)	(26)	(0.274)	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)	(0.032)	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	0.006	(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)	(0)	(0.005)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(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)	(0.003)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	1	0.008	(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)	(0.006)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	65	0.675	

(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。

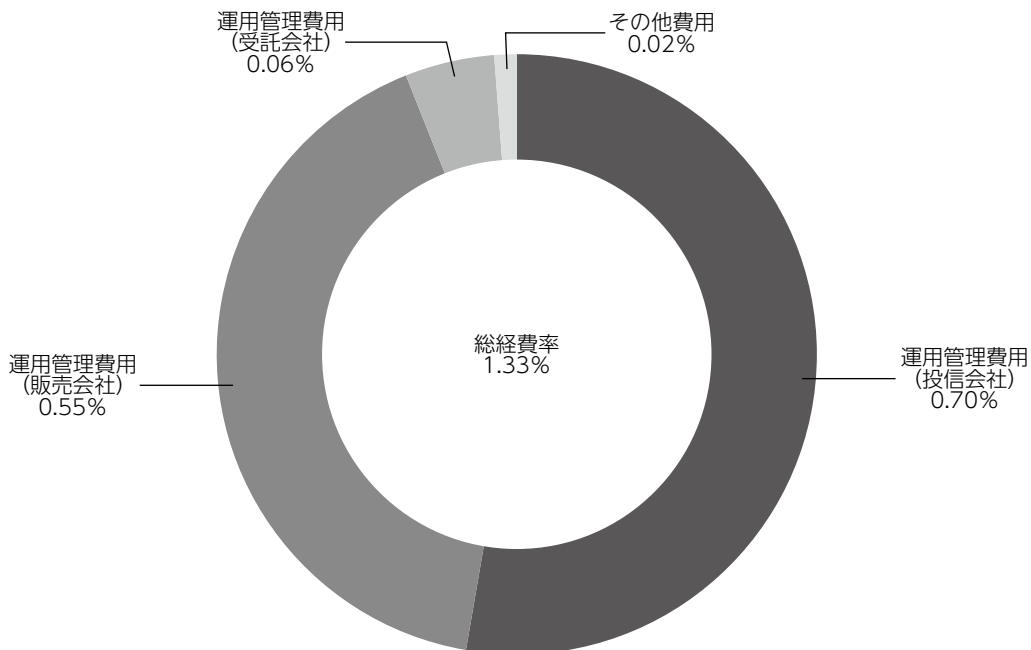
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.33%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年12月28日から2022年6月27日まで）

	第 194 期 ~ 第 199 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
D I A M 高 格 付 イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	26,368	65,000
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	15,129	55,000
D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	8,324	45,000
D I A M イ ン タ ー ナ シ ョ ナ ル ・ リ ー ト ・ イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	13,584	50,000

■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 194 期 ~ 第 199 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	13,908,244千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	34,896,874千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.39

(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12月28日から2022年6月27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 33 作 成 期 末	第 34 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
D I A M 高 格 付 イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	766,189	739,820	1,840,896
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	277,772	262,643	942,181
D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	76,036	67,712	334,871
D I A M イ ン タ ー ナ シ ョ ナ ル ・ リ ー ト ・ イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	162,532	148,947	502,087

<補足情報>

■D I A M 高格付インカム・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 高格付インカム・オープン・マザーファンド (43,958,503,586口) の内容です。
 公社債

(A) 債券種類別開示

外国 (外貨建) 公社債

区 分	2022 年 6 月 27 日 現 在							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 433,300	千カナダ・ドル 415,794	千円 43,334,087	% 39.6	% -	% 14.6	% 10.1	% 14.9
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 508,500	千オーストラリア・ドル 463,079	千円 43,043,194	39.4	-	21.9	9.6	7.8
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 145,500	千ニュージーランド・ドル 128,056	千円 10,852,752	9.9	-	6.1	2.9	0.9
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 845,000	千ノルウェー・クローネ 791,825	千円 10,776,740	9.9	-	4.3	3.6	2.0
合 計	-	-	千円 108,006,775	98.7	-	46.9	26.2	25.7

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月27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) 組入比率は、2022年6月27日現在のマザーファンド純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

外国 (外貨建) 公社債銘柄別

銘 柄	2022 年 6 月 27 日 現 在						
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	16,000	15,790	1,645,707	2024/03/01	
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	25,000	24,434	2,546,613	2023/05/01	
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	15,100	18,394	1,917,123	2027/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	8,000	9,241	963,153	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	15,900	19,365	2,018,308	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,668	903,407	2037/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,431	566,095	2041/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	4,000	3,741	389,967	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,000	976	101,733	2025/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	27,000	23,237	2,421,792	2031/06/01	
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	10,000	8,902	927,851	2032/06/01	
CANADA 2.75 08/01/24	国債証券	2.7500	32,000	31,749	3,308,929	2024/08/01	
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	63,000	62,898	6,555,256	2022/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	34,000	31,307	3,262,836	2025/09/01	
CANADA 0.25 11/01/22	国債証券	0.2500	38,000	37,728	3,932,015	2022/11/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,276	1,279,417	2045/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	56,000	42,407	4,419,740	2051/12/01	

銘 柄	2022 年 6 月 27 日 現 在					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,373	455,842	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	19,000	15,100	1,573,752	2030/12/01
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 7.875 11/30/23	地方債証券	7.8750	15,000	15,947	1,662,095	2023/11/30
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	25,000	23,819	2,482,447	2025/12/15
小 計	—	—	433,300	415,794	43,334,087	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	8,000	6,855	637,206	2047/03/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	30,000	31,756	2,951,746	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,000	9,288	863,330	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	25,000	24,680	2,294,035	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	21,000	19,586	1,820,583	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	38,000	35,030	3,256,107	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	14,000	11,825	1,099,204	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	25,000	19,930	1,852,557	2032/05/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	18,000	11,397	1,059,406	2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	18,000	15,968	1,484,243	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	13,000	12,269	1,140,440	2029/11/21
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	70,000	70,124	6,518,028	2022/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	15,000	13,936	1,295,353	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	20,000	16,594	1,542,470	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	20,000	15,727	1,461,850	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	17,000	15,341	1,425,995	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	4,500	4,212	391,546	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	32,000	25,784	2,396,654	2030/12/21
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,157	479,401	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	1,000	977	90,850	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,351	311,484	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,652	1,269,007	2032/10/22
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	12,746	1,184,822	2032/11/22
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 4.25 11/27/24	地方債証券	4.2500	10,000	10,043	933,496	2024/11/27
KOMBNK 4.5 04/17/23	特殊債券	4.5000	12,000	12,137	1,128,164	2023/04/17
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.8 05/31/23	特殊債券	2.8000	10,000	9,969	926,663	2023/05/31
NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,523	327,514	2036/06/30
KOMMUNALBANKEN AS 5.25 07/15/24	特殊債券	5.2500	25,000	25,652	2,384,399	2024/07/15
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,558	516,623	2031/08/18
小 計	—	—	508,500	463,079	43,043,194	—
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	10,000	10,305	873,359	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,540	808,552	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	9,288	787,238	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	11,500	10,879	922,067	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	6,000	4,502	381,620	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	19,000	12,850	1,089,059	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	10,000	8,174	692,746	2031/05/15

銘 柄	2022 年 6 月 27 日 現 在					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国 債 証 券	2.0000	10,000	8,384	710,562	2032/05/15
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,622	137,517	2028/05/15
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国 債 証 券	0.5000	1,000	882	74,831	2026/05/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 04/15/24	地 方 債 証 券	2.2500	12,000	11,595	982,729	2024/04/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25	地 方 債 証 券	2.7500	15,000	14,364	1,217,424	2025/04/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28	地 方 債 証 券	2.2500	10,000	8,815	747,142	2028/05/15
HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30	特 殊 債 券	2.1830	6,000	5,036	426,848	2030/04/24
KOMBANK 4.0 08/20/25	特 殊 債 券	4.0000	12,000	11,811	1,001,050	2025/08/20
小 計	—	—	145,500	128,056	10,852,752	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国 債 証 券	1.5000	120,000	113,534	1,545,199	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国 債 証 券	1.7500	72,000	67,883	923,892	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国 債 証 券	3.0000	160,000	160,335	2,182,169	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国 債 証 券	1.7500	110,000	106,293	1,446,655	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国 債 証 券	2.0000	5,000	4,723	64,280	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国 債 証 券	2.1250	50,000	45,695	621,908	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国 債 証 券	1.3750	70,000	61,277	833,984	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国 債 証 券	1.7500	205,000	186,943	2,544,305	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国 債 証 券	1.2500	53,000	45,139	614,345	2031/09/17
小 計	—	—	845,000	791,825	10,776,740	—
合 計	—	—	—	—	108,006,775	—

■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 (9,736,695,766口) の内容です。

外国株式

銘柄	2021年12月27日現在		2022年6月27日現在		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36.16	-	-	-	情報技術サービス	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	260.72	346.85	2,738	368,660	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	342.5	216.15	2,535	341,353	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	917.66	779.8	3,438	462,912	通信機器	
CUMMINS INC	89.92	89.92	1,753	236,054	機械	
BANK OF AMERICA CORP	876.89	815.83	2,635	354,824	銀行	
EATON CORP PLC	239.5	116.51	1,535	206,754	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	-	326.8	2,549	343,214	電力	
GILEAD SCIENCES INC	449.44	250.74	1,581	212,908	バイオテクノロジー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	147.36	52.43	1,224	164,830	航空宇宙・防衛	
HP INC	344.2	-	-	-	コンピュータ・周辺機器	
JOHNSON & JOHNSON	223.11	354.66	6,465	870,266	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	201.97	308.36	4,146	558,121	家庭用品	
LOCKHEED MARTIN CORP	18.28	18.28	766	103,111	航空宇宙・防衛	
MCDONALD'S CORPORATION	435.29	404.64	10,031	1,350,276	ホテル・レストラン・レジャー	
METLIFE INC	1,039.64	1,218.2	7,823	1,053,091	保険	
MERCK & CO.INC.	640.48	822.24	7,657	1,030,778	医薬品	
MICROSOFT CORP	276.07	330.31	8,842	1,190,275	ソフトウェア	
PACCAR INC	255.42	304.73	2,566	345,426	機械	
PAYCHEX INC	387.14	347.06	4,249	571,965	情報技術サービス	
PPL CORPORATION	636.97	636.97	1,724	232,190	電力	
PFIZER INC	1,325.42	855.26	4,412	593,937	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	165.83	184.41	2,661	358,326	家庭用品	
QUALCOMM INC	322.88	100.07	1,251	168,514	半導体・半導体製造装置	
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	1,500	201,962	ガス	
TRUIST FINANCIAL CORP	835.66	774.53	3,812	513,165	銀行	
AT&T INC	1,125.66	1,593.32	3,344	450,186	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	301.37	371.82	5,382	724,583	石油・ガス・消耗燃料	
TEXAS INSTRUMENTS INC	153.72	46.97	732	98,601	半導体・半導体製造装置	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	346.59	346.59	1,443	194,315	食品・生活必需品小売り	
CME GROUP INC	-	360.24	7,565	1,018,330	資本市場	
MASTERCARD INC	136.77	236.64	7,820	1,052,778	情報技術サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	325.8	428.18	4,427	595,969	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,631	354,263	化学	
ABBVIE INC	566.29	269.58	4,106	552,813	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	90.7	41.71	2,123	285,832	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	343.55	262.63	1,947	262,139	コンピュータ・周辺機器	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,595.28 35銘柄	14,348.75 35銘柄	129,431 -	17,422,741 <49.9%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	675.25	663.08	5,543	577,727	銀行	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	2,036.59	2,036.59	3,637	379,084	総合公益事業	

銘 柄	2021年12月27日現在		2022 年 6 月 27 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)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	509.98	494.98	3,130	326,286	銀行
RUSSEL METALS INC	1,216.48	1,216.48	3,121	325,321	商社・流通業
CAPITAL POWER CORP	623.43	842.72	3,817	397,862	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 >	5,061.73 5銘柄	5,253.85 5銘柄	19,250 -	2,006,282 <5.7%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BHP GROUP LTD	581.27	743.7	2,976	276,645	金属・鉱業
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	-	134.38	411	38,233	石油・ガス・消耗燃料
AGL ENERGY LTD	776.72	-	-	-	総合公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,357.99 2銘柄	878.08 2銘柄	3,387 -	314,879 <0.9%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,495	7,495	23,234	398,471	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,540	1,540	4,335	74,346	不動産管理・開発
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	804	804	7,758	133,059	繊維・アパレル・贅沢品
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	6,180	-	-	-	専門小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	16,019 4銘柄	9,839 3銘柄	35,328 -	605,878 <1.7%>
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,307	1,307	3,450	335,145	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,450 -	335,145 <1.0%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
NATIONAL GRID PLC	2,466.1	2,744.83	2,884	476,369	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	401.83	448.5	1,583	261,471	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,155.92	1,155.92	2,125	350,927	タバコ
UNILEVER PLC	287.09	287.09	1,072	177,160	パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,255.44	2,757.89	2,790	460,875	水道
RIO TINTO PLC	507.48	618.76	3,080	508,733	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	10,084.8	14,990.87	1,896	313,143	無線通信サービス
SSE PLC	1,179.15	1,437.68	2,371	391,598	電力
BP PLC	5,964.93	5,964.93	2,305	380,698	石油・ガス・消耗燃料
3I GROUP PLC	2,037.33	572.23	642	106,067	資本市場
GSK PLC	2,670.2	2,670.2	4,689	774,361	医薬品
ASTRAZENECA PLC	367.04	367.04	3,955	653,125	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	29,377.31 12銘柄	34,015.94 12銘柄	29,398 -	4,854,533 <13.9%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	168.48	99.01	3,156	443,700	医薬品
NOVARTIS AG-REG SHS	730.45	730.45	5,887	827,595	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	898.93 2銘柄	829.46 2銘柄	9,043 -	1,271,296 <3.6%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
TELE2 AB-B SHS	836.54	836.54	9,544	126,756	無線通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	836.54 1銘柄	836.54 1銘柄	9,544 -	126,756 <0.4%>

銘柄	2021年12月27日現在		2022年6月27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) STMICROELECTRONICS NV	百株 825.46	百株 480.86	千ユーロ 1,528	千円 217,114	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(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 2,934.49 227.94 654.66 55.63 902.13 469.31 -	百株 2,624.8 353.68 240.76 66.02 902.13 469.31 20.4	千ユーロ 5,896 1,860 1,154 3,878 4,470 4,719 29	千円 837,495 264,176 163,914 550,794 634,945 670,293 4,142	保険 食品 銀行 繊維・アパレル・贅沢品 石油・ガス・消耗燃料 医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(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 1,409.02 2,473.24 393.08 256.47 145.66 2,955.37 878.76	百株 1,155.42 2,473.24 328.85 256.47 132.27 2,955.37 480.72	千ユーロ 4,148 2,127 3,374 1,082 2,396 5,579 1,156	千円 589,216 302,166 479,302 153,774 340,407 792,490 164,273	航空貨物・物流サービス 総合公益事業 コングロマリット 化学 保険 各種電気通信サービス 半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA RED ELECTRICA DE CORPORACION SA FERROVIAL SA	百株 2,074.81 752.35 1,671.43	百株 2,413.68 -	千ユーロ 2,426 -	千円 344,700 -	電力 電力 建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド) UPM-KYMMENE OYJ FORTUM OYJ	百株 477.99 1,774.25	百株 477.99 1,774.25	千ユーロ 1,394 2,830	千円 198,031 402,060	紙製品・林産品 電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月27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6月27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。

■DIAM US・リート・オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、DIAM US・リート・オープン・マザーファンド (5,154,570,804口) の内容です。

外国投資証券

銘柄	2021年12月27日現在		2022年6月27日現在		比率
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	38.284	44.064	6,324	851,341	3.3
BOSTON PROPERTIES INC	30.97	30.81	2,834	381,554	1.5
SL GREEN	26.926	26.466	1,309	176,312	0.7
PROLOGIS INC	98.97	90.48	11,091	1,493,086	5.9
AVALONBAY COMMUNITIES INC	33.65	33.47	6,531	879,228	3.4
CAMDEN PROPERTY TRUST	23.59	23.47	3,171	426,852	1.7
EQUINIX INC	11.38	11.33	7,808	1,051,074	4.1
COUSINS PROPERTIES INC	162.975	162.095	4,890	658,297	2.6
DUKE REALTY TRUST	-	19.89	1,142	153,816	0.6
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	34.28	37.34	6,534	879,558	3.5
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20.901	20.781	5,438	732,089	2.9
EQUITY RESIDENTIAL	87.235	86.765	6,231	838,817	3.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37.9	37.69	3,751	504,960	2.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	145.376	144.596	3,773	508,012	2.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	85.66	85.2	2,938	395,557	1.6
WELLTOWER INC	112.33	110.53	9,213	1,240,267	4.9
ACADIA REALTY TRUST	91.42	90.92	1,471	198,145	0.8
HOST HOTELS & RESORTS INC	239.3	238	3,829	515,478	2.0
UDR INC	75.55	75.15	3,468	466,850	1.8
SIMON PROPERTY GROUP INC	55.86	53.93	5,372	723,193	2.8
LIFE STORAGE INC	20.66	12.11	1,366	183,878	0.7
PUBLIC STORAGE	25.38	25.24	7,930	1,067,478	4.2
SUN COMMUNITIES INC	15.03	14.96	2,435	327,841	1.3
VENTAS INC	94.2	92.69	4,748	639,196	2.5
VORNADO REALTY TRUST	47.116	-	-	-	-
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	179.085	-	-	-	-
EXTRA SPACE STORAGE INC	20.98	20.86	3,595	484,008	1.9
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	443.89	441.5	4,516	607,972	2.4
DIGITAL REALTY TRUST INC	49.11	48.32	6,706	902,804	3.5
DOUGLAS EMMETT INC	136.89	136.15	3,124	420,608	1.6
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	301.47	268.2	4,398	592,079	2.3
TERRENO REALTY CORP	114.713	97.883	5,769	776,595	3.0
AMERICOLD REALTY TRUST	40.2	40.2	1,195	160,878	0.6
CORESITE REALTY CORP	11.255	-	-	-	-
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	144.633	96.163	1,544	207,888	0.8
AMERICAN TOWER CORP	35	34.81	9,108	1,226,032	4.8
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	128.1	75.8	2,104	283,247	1.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	117.66	100.13	5,960	802,375	3.1
AMERICAN HOMES 4 RENT	106.63	106.05	3,736	502,922	2.0

銘柄	2021年12月27日現在		2022年6月27日現在			
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	-	14.22	1,696	228,416	0.9	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	306.96	305.31	6,368	857,299	3.4	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	267.37	270.26	2,797	376,529	1.5	
NETSTREIT CORP	-	111.16	2,110	284,152	1.1	
STORE CAPITAL CORP	71.82	71.43	1,929	259,706	1.0	
VICI PROPERTIES INC	73.62	73.22	2,220	298,838	1.2	
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	4,164.329	3,879.643	182,491	24,565,244	-
		42銘柄<97.2%>	42銘柄<96.4%>	-	-	96.4

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月27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6月27日現在のマザーファンド純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(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。

■D I A M インターナショナル・リート・インカム・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 インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド (11,470,582,230円) の内容です。

外国投資信託受益証券、投資証券

銘	柄	2021年12月27日現在	2022 年 6 月 27 日 現 在			
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
不動産ファンド		千円	千円	千カナダ・ドル	千円	%
(カナダ)						
	CANADIAN APT PPTYS REIT	361.939	421.539	18,952	1,975,218	5.1
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	777.67	777.67	15,856	1,652,584	4.3
	ALLIED PROPERTIES REIT	303.9	303.9	10,387	1,082,564	2.8
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	326.6	326.6	6,424	669,532	1.7
	CROMBIE REAL ESTATE INV	576.2	576.2	9,248	963,827	2.5
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	318.8	318.8	5,435	566,491	1.5
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	771.8	771.8	12,510	1,303,883	3.4
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	1,110.75	1,110.75	19,004	1,980,694	5.1
小 計	□ 数 ・ 金 額	4,547.659	4,607.259	97,819	10,194,797	—
	銘 柄 数<比 率>	8銘柄<24.7%>	8銘柄<26.4%>	—	—	26.4
(オーストラリア)		千円	千円	千オーストラリア・ドル	千円	%
	MIRVAC GROUP	5,174.747	1,296.144	2,760	256,615	0.7
	CHARTER HALL RETAIL REIT	3,230.658	3,230.658	12,793	1,189,147	3.1
	STOCKLAND	3,075.869	3,075.869	11,842	1,100,722	2.8
	GOODMAN GROUP	791.805	791.805	14,790	1,374,815	3.6
	VICINITY CENTRES	5,853.855	9,650.042	17,949	1,668,366	4.3
	CHARTER HALL GROUP	732.518	291.519	3,308	307,547	0.8
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	9,252.813	9,252.813	33,032	3,070,374	7.9
	NATIONAL STORAGE REIT	7,135.696	7,135.696	16,412	1,525,504	3.9
小 計	□ 数 ・ 金 額	35,247.961	34,724.546	112,889	10,493,094	—
	銘 柄 数<比 率>	8銘柄<28.9%>	8銘柄<27.1%>	—	—	27.1
(香港)		千円	千円	千香港・ドル	千円	%
	LINK REIT	420.2	420.2	26,787	459,409	1.2
小 計	□ 数 ・ 金 額	420.2	420.2	26,787	459,409	—
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<1.0%>	1銘柄<1.2%>	—	—	1.2
(シンガポール)		千円	千円	千シンガポール・ドル	千円	%
	ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	1,570.591	1,570.591	4,429	430,195	1.1
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	4,719.542	4,719.542	8,023	779,295	2.0
	PARKWAY LIFE REIT	2,517	2,517	12,106	1,175,930	3.0
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,674.54	1,674.54	4,404	427,764	1.1
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	2,918.9	2,918.9	5,399	524,498	1.4
小 計	□ 数 ・ 金 額	13,400.573	13,400.573	34,363	3,337,684	—
	銘 柄 数<比 率>	5銘柄<7.3%>	5銘柄<8.6%>	—	—	8.6
(ニュージーランド)		千円	千円	千ニュージーランド・ドル	千円	%
	GOODMAN PROPERTY TRUST	11,602.872	11,602.872	23,031	1,951,936	5.0
小 計	□ 数 ・ 金 額	11,602.872	11,602.872	23,031	1,951,936	—
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<5.5%>	1銘柄<5.0%>	—	—	5.0

銘 柄	2021年12月27日現在		2022 年 6 月 27 日 現 在		比 率	
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	%	
UNITE GROUP PLC	629.834	629.834	6,871	1,134,688	2.9	
SEGRO PLC	1,185.138	1,185.138	12,171	2,009,857	5.2	
小 計	□ 数 ・ 金 額	1,814.972	1,814.972	19,042	3,144,546	-
	銘 柄 数<比 率>	2銘柄<8.5%>	2銘柄<8.1%>	-	-	8.1
(オランダ)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	452.507	452.507	10,113	1,436,424	3.7	
小 計	□ 数 ・ 金 額	452.507	452.507	10,113	1,436,424	-
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<3.2%>	1銘柄<3.7%>	-	-	3.7
(ベルギー)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
COFINIMMO SA	34.726	34.726	3,785	537,602	1.4	
WAREHOUSES DE PAUW	690.172	690.172	21,616	3,070,147	7.9	
小 計	□ 数 ・ 金 額	724.898	724.898	25,401	3,607,749	-
	銘 柄 数<比 率>	2銘柄<10.1%>	2銘柄<9.3%>	-	-	9.3
(フランス)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	43.793	43.793	4,092	581,251	1.5	
ICADE	90.256	90.256	4,464	634,030	1.6	
KLEPIERRE	-	285.887	5,920	840,919	2.2	
小 計	□ 数 ・ 金 額	134.049	419.936	14,477	2,056,202	-
	銘 柄 数<比 率>	2銘柄<3.4%>	3銘柄<5.3%>	-	-	5.3
(ドイツ)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	569.772	-	-	-	-	
小 計	□ 数 ・ 金 額	569.772	-	-	-	-
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<3.4%>	-銘柄<- %>	-	-	-
(スペイン)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	174.863	174.863	1,151	163,543	0.4	
小 計	□ 数 ・ 金 額	174.863	174.863	1,151	163,543	-
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<0.4%>	1銘柄<0.4%>	-	-	0.4
合 計	□ 数 ・ 金 額	69,090.326	68,342.626	-	36,845,389	-
	銘 柄 数<比 率>	32銘柄<96.3%>	32銘柄<95.3%>	-	-	95.3

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月27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6月27日現在のマザーファンド純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(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6月27日現在

項 目	第 34 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド	1,840,896	50.0
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	942,181	25.6
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	334,871	9.1
DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	502,087	13.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	58,974	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	3,679,010	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年6月27日現在、DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンドは108,866,303千円、96.0％、DIAM世界好配当株オープン・マザーファンドは34,699,732千円、99.3％、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドは24,788,103千円、97.2％、DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドは37,566,115千円、97.2％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6月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=134.61円、1カナダ・ドル=104.22円、1オーストラリア・ドル=92.95円、1香港・ドル=17.15円、1シンガポール・ドル=97.13円、1ニュージーランド・ドル=84.75円、1台湾・ドル=4.527円、1イギリス・ポンド=165.13円、1スイス・フラン=140.57円、1ノルウェー・クローネ=13.61円、1スウェーデン・クローナ=13.28円、1ユーロ=142.03円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年1月26日)、(2022年2月28日)、(2022年3月28日)、(2022年4月26日)、(2022年5月26日)、(2022年6月27日)現在

項 目	第 194 期 末	第 195 期 末	第 196 期 末	第 197 期 末	第 198 期 末	第 199 期 末
(A) 資 産	3,698,357,577円	3,698,382,473円	3,912,118,496円	3,873,799,010円	3,715,185,708円	3,679,010,917円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	64,745,928	45,048,655	54,330,667	70,900,742	73,827,997	58,974,781
DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド(評価額)	1,839,927,626	1,838,625,103	1,922,451,263	1,890,583,466	1,831,426,335	1,840,896,041
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	911,888,325	918,340,301	968,862,550	964,791,427	961,560,648	942,181,508
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド(評価額)	349,661,974	353,422,173	385,435,078	383,861,408	335,291,327	334,871,510
DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド(評価額)	532,133,724	542,946,241	581,038,938	563,661,967	513,079,401	502,087,077
(B) 負 債	12,215,868	14,567,868	19,071,257	15,084,691	14,168,394	15,897,640
未払収益分配金	7,979,643	7,958,740	7,908,754	7,803,481	7,773,100	7,712,283
未払解約金	60,177	2,161,855	7,367,278	3,151,476	2,326,389	3,880,811
未払信託報酬	4,164,955	4,435,464	3,785,145	4,118,763	4,058,106	4,293,113
その他未払費用	11,093	11,809	10,080	10,971	10,799	11,433
(C) 純資産総額(A-B)	3,686,141,709	3,683,814,605	3,893,047,239	3,858,714,319	3,701,017,314	3,663,113,277
元 本	3,989,821,751	3,979,370,319	3,954,377,181	3,901,740,816	3,886,550,074	3,856,141,608
次期繰越損益金	△303,680,042	△295,555,714	△61,329,942	△43,026,497	△185,532,760	△193,028,331
(D) 受益権総口数	3,989,821,751口	3,979,370,319口	3,954,377,181口	3,901,740,816口	3,886,550,074口	3,856,141,608口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,239円	9,257円	9,845円	9,890円	9,523円	9,499円

(注) 第193期末における元本額は4,010,959,518円、当作成期間(第194期～第199期)中における追加設定元本額は6,337,410円、同解約元本額は161,155,320円です。

■損益の状況

[自 2021年12月28日 至 2022年1月26日] [自 2022年1月27日 至 2022年2月28日] [自 2022年3月1日 至 2022年3月28日] [自 2022年3月29日 至 2022年4月26日] [自 2022年4月27日 至 2022年5月26日] [自 2022年5月27日 至 2022年6月27日]

項 目	第 194 期	第 195 期	第 196 期	第 197 期	第 198 期	第 199 期
(A) 配 当 等 収 益	△497円	△710円	△169円	△527円	△732円	△2,232円
受 取 利 息	69	5	13	3	1	7
支 払 利 息	△566	△715	△182	△530	△733	△2,239
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△112,531,756	19,733,895	244,073,195	29,402,101	△130,824,866	3,066,660
売 買 益	615,476	21,035,926	244,504,959	47,105,463	660,309	15,148,456
売 買 損	△113,147,232	△1,302,031	△431,764	△17,703,362	△131,485,175	△12,081,796
(C) 信 託 報 酬 等	△4,176,048	△4,447,273	△3,795,225	△4,129,734	△4,068,905	△4,304,546
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△116,708,301	15,285,912	240,277,801	25,271,840	△134,894,503	△1,240,118
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△194,191,045	△317,976,612	△308,632,222	△75,207,804	△57,503,157	△198,557,049
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,198,947	15,093,726	14,933,233	14,712,948	14,638,000	14,481,119
(配 当 等 相 当 額)	(94,184,039)	(93,964,738)	(93,401,922)	(92,227,306)	(91,894,897)	(91,205,887)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△78,985,092)	(△78,871,012)	(△78,468,689)	(△77,514,358)	(△77,256,897)	(△76,724,768)
(G) 合 計 (D+E+F)	△295,700,399	△287,596,974	△53,421,188	△35,223,016	△177,759,660	△185,316,048
(H) 収 益 分 配 金	△7,979,643	△7,958,740	△7,908,754	△7,803,481	△7,773,100	△7,712,283
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△303,680,042	△295,555,714	△61,329,942	△43,026,497	△185,532,760	△193,028,331
追 加 信 託 差 損 益 金	15,198,947	15,093,726	14,933,233	14,712,948	14,638,000	14,481,119
(配 当 等 相 当 額)	(94,184,230)	(93,965,017)	(93,402,662)	(92,228,944)	(91,895,163)	(91,206,311)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△78,985,283)	(△78,871,291)	(△78,469,429)	(△77,515,996)	(△77,257,163)	(△76,725,192)
分 配 準 備 積 立 金	129,510,625	127,250,153	128,819,162	125,722,972	124,964,917	121,118,113
繰 越 損 益 金	△448,389,614	△437,899,593	△205,082,337	△183,462,417	△325,135,677	△328,627,563

(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) 信託財産の運用の指図に関わる権限を委託するために要する費用は、第194期から第199期まででD I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド895,357円、D I A M インターナショナル ・ リート ・ インカム ・ オープン ・ マザーファンド1,358,993円で、委託者報酬から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	第 194 期	第 195 期	第 196 期	第 197 期	第 198 期	第 199 期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,966,880円	6,064,762円	10,304,068円	6,489,960円	7,529,545円	4,872,905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	94,184,230	93,965,017	93,402,662	92,228,944	91,895,163	91,206,311
(d) 分 配 準 備 積 立 金	134,523,388	129,144,131	126,423,848	127,036,493	125,208,472	123,957,491
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	231,674,498	229,173,910	230,130,578	225,755,397	224,633,180	220,036,707
(f) 1万口当たり当期分配対象額	580.66	575.90	581.96	578.60	577.98	570.61
(g) 分 配 金	7,979,643	7,958,740	7,908,754	7,803,481	7,773,100	7,712,283
(h) 1万口当たり分配金	20	20	20	20	20	20

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 194 期	第 195 期	第 196 期	第 197 期	第 198 期	第 199 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2022年6月6日）

（計算期間 2021年6月8日～2022年6月6日）

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドの第19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	2003年7月15日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主要投資対象	高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使等により取得するものに限り、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	期騰落	中率			
15期（2018年6月5日）	円 21,494	% 2.7	% 97.1	% -	百万円 186,790
16期（2019年6月5日）	21,536	0.2	96.5	-	156,810
17期（2020年6月5日）	22,639	5.1	98.5	-	137,252
18期（2021年6月7日）	25,062	10.7	98.0	-	125,601
19期（2022年6月6日）	25,405	1.4	98.0	-	112,677

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドは高格付資源国の公社債を投資対象としており、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

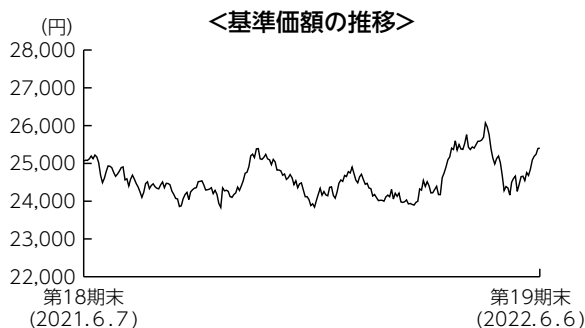
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 6 月 7 日	円 25,062	% -	% -	% 98.0	% -
6 月 末	24,657	△1.6		97.9	-
7 月 末	24,459	△2.4		98.5	-
8 月 末	24,302	△3.0		98.2	-
9 月 末	24,122	△3.8		98.4	-
10 月 末	25,093	0.1		98.1	-
11 月 末	24,118	△3.8		98.1	-
12 月 末	24,781	△1.1		98.5	-
2022年 1 月 末	24,000	△4.2		98.7	-
2 月 末	23,997	△4.2		98.7	-
3 月 末	25,498	1.7		98.2	-
4 月 末	25,131	0.3		98.6	-
5 月 末	25,091	0.1		97.9	-
(期 末) 2022年 6 月 6 日	25,405	1.4		98.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年6月8日から2022年6月6日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は25,405円となり、前期末比で1.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルス禍から世界経済の正常化が見込まれたことや、資源価格の上昇などからインフレが高進したことを背景に、主要中央銀行が金融引き締めへ転じたことなどによって国債利回りは上昇（価格は下落）し、基準価額にマイナスに寄与しました。一方、為替市場では、内外金利差の拡大見通しなどから投資対象国の通貨が対円で上昇し、基準価額に対してプラスとなりました。この結果、投資対象国の通貨の上昇を主因に基準価額が上昇しました。

投資環境

外国債券市場では、いずれの投資対象国でも10年国債利回りが上昇しました。新型コロナウイルスの変異株に対する懸念などから国債利回りが低下（価格は上昇）する場面もありましたが、その後変異株に対する懸念が後退し、景気見通しが改善したこと、インフレの高進などを背景に、投資対象国の中央銀行が量的緩和策の停止や利上げなどを発表したことなどから国債利回りが上昇しました。

為替市場では、全ての投資対象国の通貨が対円で上昇しました。景気回復やインフレの高進から、投資対象国の政策金利の引き上げが見込まれたことで内外金利差の拡大が意識されたこと、エネルギー価格の高騰などから日本の経常収支悪化が意識されたことなどを背景に、投資対象国の通貨に対して円安が大きく進みました。

ポートフォリオについて

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション*については、新型コロナウイルスの感染動向と投資対象国および世界経済見通し、主要国および投資対象国の金融政策を勘案して、機動的に調整を行いました。当期末のデュレーションは、利回り上昇が一定程度進んだとの判断から、前期末と比較して長期化しました。

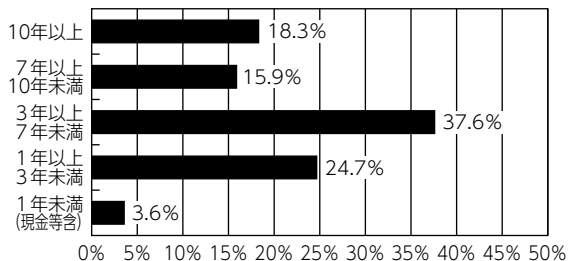
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

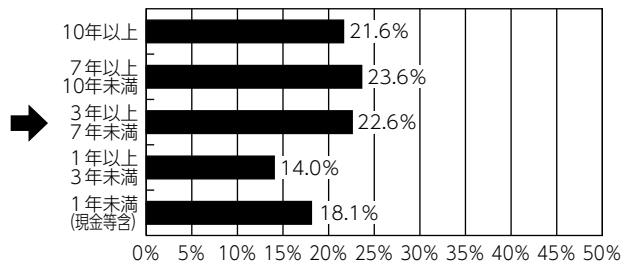
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

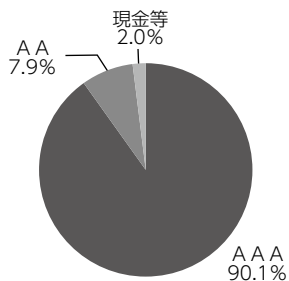


期末

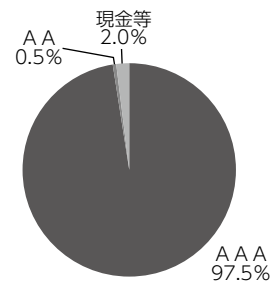


○格付別構成比

期首 (前期末)

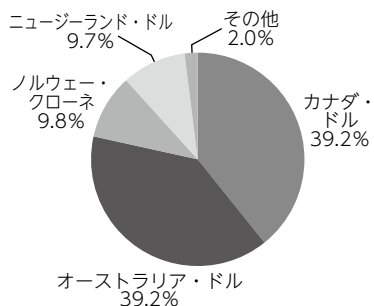


期末

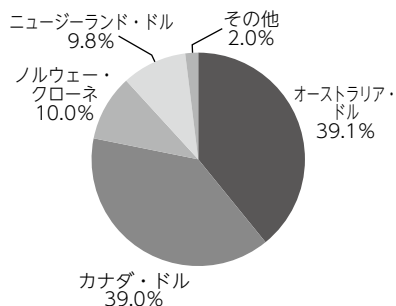


○通貨別構成比

期首 (前期末)



期末

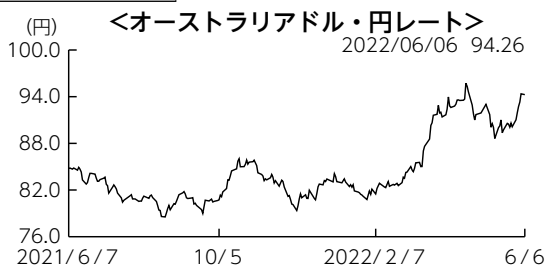


【各国の為替・金利動向】

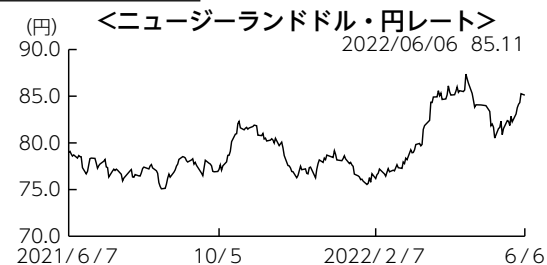
カナダ



オーストラリア



ニュージーランド



ノルウェー



今後の運用方針

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。デフレーションについては、中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

■ 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) そ の 他 費 用	2円	0.010%	(a) 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
（保 管 費 用）	(2)	(0.009)	
（そ の 他）	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.010	
期中の平均基準価額は24,592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6月8日から2022年6月6日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 479,812	千カナダ・ドル 457,153 (-)
		地方債証券	-	28,381 (-)
		特殊債証券	-	63,610 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 766,644	千オーストラリア・ドル 739,212 (-)
		地方債証券	108,540	162,065 (-)
		特殊債証券	22,965	41,242 (-)
国	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 56,876	千ニュージーランド・ドル 66,355 (-)
		地方債証券	9,933	9,211 (-)
		特殊債証券	5,481	- (-)
ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 267,823	千ノルウェー・クローネ 179,588 (-)	
	特殊債証券	-	- (150,000)	

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2021年6月8日から2022年6月6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

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 438,300	千カナダ・ドル 422,912	千円 43,961,742	% 39.0	% -	% 17.4	% 6.9	% 14.7
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 509,500	千オーストラリア・ドル 467,917	千円 44,105,941	39.1	-	23.8	11.9	3.5
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 145,500	千ニュージーランド・ドル 130,325	千円 11,091,974	9.8	-	6.1	2.9	0.9
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 853,000	千ノルウェー・クローネ 816,989	千円 11,315,308	10.0	-	4.3	2.7	3.0
合 計	-	-	千円 110,474,966	98.0	-	51.7	24.4	22.0

(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) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	16,000	15,840	1,646,604	2024/03/01
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	25,000	24,457	2,542,312	2023/05/01
CANADA 8.0 06/01/27	国債証券	8.0000	15,100	18,589	1,932,397	2027/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	8,000	9,369	973,931	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	15,900	19,782	2,056,357	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,959	931,352	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,659	588,283	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	4,000	3,783	393,313	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,000	981	102,029	2025/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	30,000	26,164	2,719,802	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	27,000	23,679	2,461,510	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	10,000	9,082	944,099	2032/06/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	65,000	64,880	6,744,371	2022/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	34,000	31,453	3,269,580	2025/09/01
CANADA 0.25 11/01/22	国債証券	0.2500	38,000	37,705	3,919,486	2022/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,935	1,344,652	2045/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	56,000	45,484	4,728,135	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,694	488,015	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	24,000	19,398	2,016,424	2030/12/01

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 7.875 11/30/23	地方債証券	7.8750	15,000	16,047	1,668,127	2023/11/30
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	25,000	23,962	2,490,951	2025/12/15
小計	—	—	438,300	422,912	43,961,742	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	8,000	6,950	655,169	2047/03/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	30,000	32,103	3,026,087	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	9,000	9,371	883,387	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	23,000	22,851	2,153,965	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	25,000	25,192	2,374,647	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	20,000	18,819	1,773,878	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	38,000	35,586	3,354,416	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	14,000	12,037	1,134,685	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	25,000	20,339	1,917,233	2032/05/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	18,000	11,403	1,074,846	2051/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	19,000	19,100	1,800,370	2022/07/15
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	18,000	16,093	1,516,993	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	13,000	12,411	1,169,870	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	15,000	14,259	1,344,080	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	20,000	16,951	1,597,865	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	20,000	16,044	1,512,368	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	17,000	15,435	1,454,964	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	34,500	32,401	3,054,121	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	32,000	26,241	2,473,481	2030/12/21
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,324	501,922	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	1,000	988	93,217	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,428	323,173	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,974	1,317,228	2032/10/22
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	13,170	1,241,493	2032/11/22
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 4.25 11/27/24	地方債証券	4.2500	10,000	10,118	953,722	2024/11/27
KOMBNK 4.5 04/17/23	特殊債券	4.5000	12,000	12,187	1,148,797	2023/04/17
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 2.8 05/31/23	特殊債券	2.8000	10,000	10,002	942,823	2023/05/31
NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,622	341,501	2036/06/30
KOMMUNALBANKEN AS 5.25 07/15/24	特殊債券	5.2500	25,000	25,846	2,436,267	2024/07/15
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,658	533,359	2031/08/18
小計	—	—	509,500	467,917	44,105,941	—
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	10,000	10,454	889,803	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,764	831,049	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	9,522	810,451	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	11,500	11,110	945,597	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	6,000	4,618	393,116	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	19,000	13,191	1,122,751	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	10,000	8,370	712,370	2031/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	10,000	8,611	732,915	2032/05/15

銘	柄	当				期		末								
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日	
									外	貨						建
(ニュージーランド)				%	千	ニュージーランド・ドル	千	ニュージーランド・ドル	千	円						
	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国	債	証	券	0.2500	2,000	1,652	140,603							2028/05/15
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国	債	証	券	0.5000	1,000	891	75,915							2026/05/15
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 04/15/24	地	方	債	証	券	2.2500	12,000	11,658	992,285						2024/04/15
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25	地	方	債	証	券	2.7500	15,000	14,485	1,232,844						2025/04/15
	NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28	地	方	債	証	券	2.2500	10,000	8,941	760,989						2028/05/15
	HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30	特	殊	債	証	券	2.1830	6,000	5,118	435,648						2030/04/24
	KOMBANK 4.0 08/20/25	特	殊	債	証	券	4.0000	12,000	11,933	1,015,631						2025/08/20
	小		計			—	—	145,500	130,325	11,091,974						—
(ノルウェー)				%	千	ノルウェー・クローネ	千	ノルウェー・クローネ	千	円						
	NORWAY 1.5 02/19/26	国	債	証	券	1.5000	120,000	115,172	1,595,144							2026/02/19
	NORWAY 3.0 03/14/24	国	債	証	券	3.0000	160,000	161,854	2,241,689							2024/03/14
	NORWAY 1.75 03/13/25	国	債	証	券	1.7500	110,000	107,549	1,489,557							2025/03/13
	NORWAY 2.0 04/26/28	国	債	証	券	2.0000	5,000	4,799	66,466							2028/04/26
	NORWAY 2.0 05/24/23	国	債	証	券	2.0000	80,000	80,081	1,109,130							2023/05/24
	NORWAY 2.125 05/18/32	国	債	証	券	2.1250	50,000	47,005	651,019							2032/05/18
	NORWAY 1.375 08/19/30	国	債	証	券	1.3750	70,000	62,801	869,806							2030/08/19
	NORWAY 1.75 09/06/29	国	債	証	券	1.7500	205,000	191,254	2,648,877							2029/09/06
	NORWAY 1.25 09/17/31	国	債	証	券	1.2500	53,000	46,470	643,616							2031/09/17
	小		計			—	—	853,000	816,989	11,315,308						—
	合		計			—	—	—	—	110,474,966						—

■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	110,474,966	95.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,035,476	4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	115,510,442	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、112,185,351千円、97.1％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6月6日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=103.95円、1オーストラリア・ドル=94.26円、1ニュージーランド・ドル=85.11円、1ノルウェー・クローネ=13.85円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	115,510,442,702円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,474,037,416
公 社 債(評価額)	110,474,966,219
未 収 入 金	3,050,093,036
未 収 利 息	418,263,896
前 払 費 用	93,082,135
(B) 負 債	2,832,751,588
未 払 金	2,553,861,588
未 払 解 約 金	278,890,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	112,677,691,114
元 本	44,353,039,204
次 期 繰 越 損 益 金	68,324,651,910
(D) 受 益 権 総 口 数	44,353,039,204口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,405円

(注1) 期首元本額 50,117,263,636円

追加設定元本額 1,055,748,093円

一部解約元本額 6,819,972,525円

(注2) 期末における元本の内訳

DIA M高格付インカム・オープン(毎月決算コース) 39,493,461,972円

DIA M高格付インカム・オープン<DC年金> 1,047,493,073円

DIA M高格付インカム・オープン(1年決算コース) 483,281,186円

自然環境保護ファンド 324,462,162円

DIA M世界インカム・オープン(毎月決算コース) 739,820,778円

DIA M世界3資産オープン(毎月決算型) 249,057,263円

DIA M高格付インカム私募オープン(3ヵ月決算コース) (適格機関投資家向け)

1,821,020,290円

DIA M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定) 24,203,758円

DIA M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) 170,238,722円

期末元本合計 44,353,039,204円

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,807,717,937円
受 取 利 息	2,807,851,621
支 払 利 息	△133,684
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,525,904,814
売 買 益	13,786,418,696
売 買 損	△15,312,323,510
(C) そ の 他 費 用	△11,157,389
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,270,655,734
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	75,484,733,744
(F) 解 約 差 損 益 金	△9,991,218,475
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,560,480,907
(H) 合 計(D+E+F+G)	68,324,651,910
次 期 繰 越 損 益 金(H)	68,324,651,910

(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。

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2022年5月26日）

（計算期間 2021年5月27日～2022年5月26日）

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2005年6月1日から無期限です。
運用方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
		期騰	中落率			
13期 (2018年5月28日)	円		%	%	%	百万円 36,097
14期 (2019年5月27日)	25,679		2.6	97.8	—	36,715
15期 (2020年5月26日)	25,645	△0.1		97.7	—	30,171
16期 (2021年5月26日)	23,045	△10.1		96.6	—	36,299
17期 (2022年5月26日)	31,514	36.7		97.5	—	35,042
	35,715	13.3		98.6	—	

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドは、日本を除く世界各国の好配当が期待できる銘柄を選別し、高水準で安定した分配金の確保と中長期的な株価値上がり益を追求することを目的に運用いたします。

上記当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

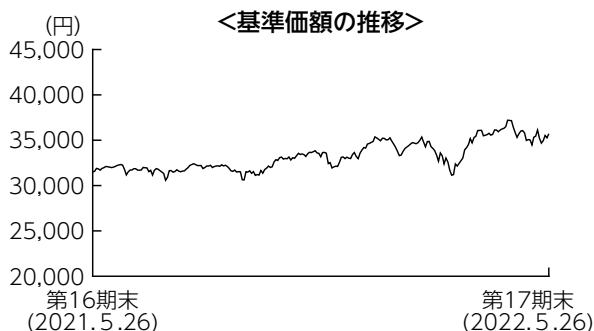
■当期中の基準価額の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年5月27日から2022年5月26日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は35,715円となり、前期末比で13.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

銘柄選択においては、「地域の分散」、「業種の分散」に着目し、世界の好配当株への投資を通じて、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり利益の確保をめざした運用を行いました。地域別では、概ね前期末と同様の資産配分を維持しました。業種別では、幅広い業種に分散投資を行う中、金融セクターやヘルスケアセクターに対する投資比率を高位に維持しました。

今後の運用方針

外国株式市場は、インフレなどを背景とした先行き不透明感の高まりから、値動きの荒い相場展開が予想され、銘柄選択の重要性がより高まると考えます。配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄を選別する運用方針を継続します。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式)	13円 (13)	0.038% (0.038)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (株 式)	9 (9)	0.026 (0.026)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	6 (6) (0)	0.019 (0.018) (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	28	0.084	
期中の平均基準価額は33,264円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年5月27日から2022年5月26日まで)

株 式

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ア メ リ カ	百株 7,005.04 (381.22)	千アメリカ・ドル 71,815 (-)	百株 11,792.9	千アメリカ・ドル 89,121	
	カ ナ ダ	百株 821.26 (481.14)	千カナダ・ドル 8,057 (-)	百株 2,701.33	千カナダ・ドル 13,047	
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 1,650.72 (134.38)	千オーストラリア・ドル 2,087 (-)	百株 -	千オーストラリア・ドル -	
	香 港	百株 5,649 (-)	千香港・ドル 29,887 (△219)	百株 7,530	千香港・ドル 23,325	
	イ ギ リ ス	百株 6,149.33 (-)	千イギリス・ポンド 3,265 (-)	百株 5,774.76	千イギリス・ポンド 8,666	
	ス イ ス	百株 -	千スイス・フラン -	百株 163.81	千スイス・フラン 3,278	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 -	千スウェーデン・クローナ -	百株 651.71	千スウェーデン・クローナ 8,018	
	国	ユ	百株 825.46 (-)	千ユーロ 2,989 (-)	百株 344.6	千ユーロ 1,192
		イ	1,658.07 (20.4)	12,733 (-)	2,767.01	9,660
		ド	914.2 (-)	3,889 (△189)	3,713.6	11,734
ス		1,733.3 (6,174.42)	2,725 (-)	8,320.26	3,700	
口		- (-)	- (-)	175.84	602	

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2021年5月27日から2022年5月26日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細
外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期			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 —	502,077 <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 —	730,917 <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 —	349,828 <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 —	1,287,790 <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 —	129,348 <0.4%>

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

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

■投資信託財産の構成

2022年5月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	34,558,235	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,041,220	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	35,599,455	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、34,826,380千円、97.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=127.51円、1カナダ・ドル=99.54円、1オーストラリア・ドル=90.60円、1香港・ドル=16.24円、1シンガポール・ドル=92.84円、1台湾・ドル=4.319円、1イギリス・ポンド=160.73円、1スイス・フラン=132.60円、1ノルウェー・クローネ=13.35円、1スウェーデン・クローナ=12.95円、1ユーロ=136.49円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年5月26日)現在

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

(注1) 期首元本額 11,518,532,199円
追加設定元本額 36,362,077円
一部解約元本額 1,743,270,198円

(注2) 期末における元本の内訳
D I AM世界好配当株オープン (毎月決算コース) 3,454,328,003円
D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 5,734,187,336円
D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) 37,708,836円
D I AM世界6資産バランスファンド 59,963,922円
D I AMグローバル・アクティブ・バランスファンド 76,127,060円
D I AM世界インカム・オープン (毎月決算コース) 269,231,597円
D I AM世界3資産オープン (毎月決算型) 180,077,324円
期末元本合計 9,811,624,078円

■損益の状況

当期 自2021年5月27日 至2022年5月26日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2021年12月9日）

（計算期間 2020年12月10日～2021年12月9日）

DIAM US・リート・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	2004年4月23日から無期限です。
運用方針	信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主要投資対象	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。 株式への投資は行いません。 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		投資 組入 証比	券率	純総 資産 産額
		期	騰落率			
14期 (2017年12月11日)	円		%		%	百万円
		32,493	8.1		94.5	35,615
15期 (2018年12月10日)		33,842	4.2		94.3	31,066
16期 (2019年12月9日)		38,048	12.4		97.0	29,121
17期 (2020年12月9日)		33,190	△12.8		96.5	23,446
18期 (2021年12月9日)		49,994	50.6		97.3	27,980

(注1) 当ファンドの信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得するというコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

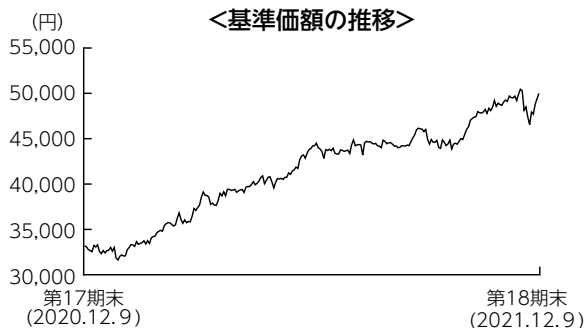
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年	月	日	基 準	価 額		投 資 証 比	券 率
				騰 落	率		
(期 首)			円		%		%
2020 年	12 月	9 日	33,190		-		96.5
	12 月	末	32,604	△1.8			96.2
2021 年	1 月	末	33,752	1.7			95.7
	2 月	末	36,088	8.7			96.5
	3 月	末	39,146	17.9			96.6
	4 月	末	40,903	23.2			96.7
	5 月	末	41,864	26.1			97.2
	6 月	末	43,312	30.5			95.8
	7 月	末	44,422	33.8			93.7
	8 月	末	45,086	35.8			95.0
	9 月	末	44,844	35.1			97.1
	10 月	末	48,344	45.7			97.4
	11 月	末	48,500	46.1			95.4
(期 末)							
2021 年	12 月	9 日	49,994	50.6			97.3

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2020年12月10日から2021年12月9日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は49,994円となり、前期末比で50.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済が正常化に向かうとの期待や、米国をはじめとする主要国における金融緩和姿勢の継続などを背景にリート市場が上昇したことが、基準価額にプラスに寄与しました。また、主要通貨に対して円安が進行したことも、基準価額にプラスに寄与しました。保有銘柄では、プロロジス（工業）やサイモン・プロパティ・グループ（小売り）などが主にプラスに寄与しました。

投資環境

米国リート市場は大きく上昇しました。当期前半は、新型コロナウイルスのワクチン接種が進み経済が正常化に向かうとの見方が広がったことなどを背景に上昇しました。当期後半は、テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）の開始時期について不透明感が広がったことなどを受けて下落する局面もありましたが、良好な経済指標の発表、企業の好決算を受けて米国株式市場が高値を更新する中、リートにも資金が流入しました。セクター別では、特に倉庫リートが大きく上昇しました。

為替市場では、米ドルに対して円安が進みました。当期前半は、米国などで新型コロナウイルスワクチンの接種が進み経済の正常化期待が強まったことから、安全通貨と見なされた円が売られる展開となりました。その後は、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念と、緩和的な金融政策への期待が交錯し方向感の定まらない展開となりましたが、当期後半には、金融緩和が早期に縮小されるとの見方が強まったことから、米ドルに対して一段の円安が進みました。

ポートフォリオについて

適正価格に到達したと見られる銘柄については、適宜入れ替えを行いました。また、米国景気の先行きや金利の動向も注視しつつ、保守的な財務体質かつ長期的に見て成長見込みがある銘柄や、割安な水準にある銘柄を選別して投資しました。住居施設などの組入比率を引き上げた一方、オフィスやホテル・リゾートなどの組入比率を引き下げました。

今後の運用方針

経済の正常化が進む一方で、新型コロナウイルスの新たな変異株の発生、インフレの進行などが懸念材料となっており、神経質な展開が予想されます。また、コロナ禍により広がった新たな生活様式がどの程度定着するかがリートの成長力を測るうえで重要になります。引き続き財務体質が良好で、長期的な成長が期待できる銘柄を選別して投資する方針です。また、割安な水準にある銘柄にも投資することにより、比較的高い配当利回りを維持できるポートフォリオを構築していきます。

■ 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 (投資証券)	14円 (14)	0.033% (0.033)	(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) その他費用 (保管費用) (その他)	5 (4) (1)	0.013 (0.011) (0.002)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	19	0.046	
期中の平均基準価額は41,422円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年12月10日から2021年12月9日まで)

投資証券

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
アメリカ		千口		千アメリカ・ドル		千口		千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		—		—		7.96		1,295
		(—)		(—)		(—)		(—)
BOSTON PROPERTIES INC		12.66		1,136		35.58		4,128
		(—)		(—)		(—)		(—)
SL GREEN		—		—		9.86		724
		(△0.044)		(59)		(—)		(—)
PROLOGIS INC		6.92		654		42.57		5,219
		(—)		(—)		(—)		(—)
AVALONBAY COMMUNITIES INC		9.58		1,592		13.79		2,942
		(—)		(—)		(—)		(—)
CAMDEN PROPERTY TRUST		—		—		36.1		3,615
		(—)		(—)		(—)		(—)
EQUINIX INC		—		—		4.1		3,152
		(—)		(—)		(—)		(—)
COUSINS PROPERTIES INC		11.51		439		10.08		346
		(—)		(—)		(—)		(—)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		34.28		5,977		42.89		7,399
		(—)		(—)		(—)		(—)
ESSEX PROPERTY TRUST INC		9.24		2,275		19.76		6,168
		(—)		(—)		(—)		(—)
EQUITY RESIDENTIAL		7.58		444		13.84		1,052
		(—)		(—)		(—)		(—)
FEDERAL REALTY INVS TRUST		—		—		13.46		1,551
		(—)		(—)		(—)		(—)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		—		—		48.16		1,583
		(—)		(—)		(—)		(—)
HIGHWOODS PROPERTIES INC		—		—		4.19		180
		(—)		(—)		(—)		(—)
WELLTOWER INC		25.81		1,978		55.53		3,822
		(—)		(—)		(—)		(—)
EAST GROUP		—		—		8.58		1,192
		(—)		(—)		(—)		(—)
ACADIA REALTY TRUST		—		—		100.27		2,115
		(—)		(—)		(—)		(—)
HOST HOTELS & RESORTS INC		76.25		1,267		410.25		6,819
		(—)		(—)		(—)		(—)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
UDR INC	58.55	2,221	2.73	120
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	23.3	2,152	21.26	2,912
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	-	-	36.34	4,029
	(19)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	-	-	19.77	5,478
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	15.03	2,447	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	-	-	27.19	1,335
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	-	-	2.31	106
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	51.23	2,506	8.52	367
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	-	-	19.21	2,576
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	145.93	1,702	126.06	1,480
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	8.07	1,245	2.25	323
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	-	-	6.7	211
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	21.29	361	28.46	461
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	-	-	50.58	3,100
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	40.2	1,246	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	-	-	16.625	2,357
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	-	-	131.42	3,539
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	35	9,696	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	-	-	69.415	5,859
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	128.1	3,706	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18.36	1,190	18.36	1,483
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	-	-	77.17	4,244
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	-	-	21.67	809
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	-	-	237.74	5,389
	(-)	(-)	(-)	(-)
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	267.37	2,460	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	36.36	1,240	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	77.23	1,964	3.61	105
	(-)	(-)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は、合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等（2020年12月10日から2021年12月9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

外国投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
不動産ファンド (アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40.644	32.684	6,939	789,850		2.8
BOSTON PROPERTIES INC	53.89	30.97	3,634	413,659		1.5
SL GREEN	36.83	26.926	2,053	233,684		0.8
PROLOGIS INC	149.77	114.12	18,195	2,070,988		7.4
AVALONBAY COMMUNITIES INC	37.86	33.65	8,259	940,122		3.4
CAMDEN PROPERTY TRUST	59.69	23.59	4,095	466,172		1.7
EQUINIX INC	15.48	11.38	9,268	1,054,946		3.8
COUSINS PROPERTIES INC	161.545	162.975	6,484	738,097		2.6
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	42.89	34.28	6,566	747,380		2.7
ESSEX PROPERTY TRUST INC	31.421	20.901	7,286	829,302		3.0
EQUITY RESIDENTIAL	93.495	87.235	7,640	869,688		3.1
FEDERAL REALTY INVTS TRUST	51.36	37.9	5,002	569,375		2.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	193.536	145.376	5,019	571,357		2.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	89.85	85.66	3,806	433,282		1.5
WELLTOWER INC	127.22	97.5	8,355	951,051		3.4
EAST GROUP	8.58	-	-	-		-
ACADIA REALTY TRUST	278.96	178.69	3,975	452,531		1.6
HOST HOTELS & RESORTS INC	573.3	239.3	4,053	461,396		1.6
UDR INC	-	55.82	3,298	375,424		1.3
SIMON PROPERTY GROUP INC	53.82	55.86	8,795	1,001,064		3.6
LIFE STORAGE INC	38	20.66	2,920	332,364		1.2
PUBLIC STORAGE	45.15	25.38	8,715	992,026		3.5
SUN COMMUNITIES INC	-	15.03	3,065	348,883		1.2
VENTAS INC	95.89	68.7	3,469	394,881		1.4
VORNADO REALTY TRUST	49.426	47.116	2,030	231,134		0.8
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	136.375	179.085	9,890	1,125,778		4.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	40.19	20.98	4,392	499,939		1.8
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	424.02	443.89	5,206	592,641		2.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	36.02	41.84	7,033	800,578		2.9
DOUGLAS EMMETT INC	143.59	136.89	4,759	541,745		1.9
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	308.64	301.47	5,685	647,149		2.3
TERRENO REALTY CORP	172.863	122.283	9,837	1,119,723		4.0
AMERICOLD REALTY TRUST	-	40.2	1,339	152,412		0.5
CORESITE REALTY CORP	35.1	18.475	3,141	357,564		1.3

銘柄	期首(前期末)	当期			期末	
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	278.59	147.17	3,854	438,705	1.6	
AMERICAN TOWER CORP	—	35	9,654	1,098,903	3.9	
CYRUSONE INC	69.415	—	—	—	—	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	—	128.1	4,419	503,021	1.8	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	202.9	125.73	9,496	1,080,878	3.9	
AMERICAN HOMES 4 RENT	128.3	106.63	4,505	512,772	1.8	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	544.7	306.96	7,554	859,828	3.1	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	—	267.37	2,077	236,457	0.8	
STORE CAPITAL CORP	—	36.36	1,259	143,316	0.5	
VICI PROPERTIES INC	—	73.62	2,120	241,327	0.9	
合計	□ 数 ・ 金額 銘柄数<比率>	4,849.31	4,183.756	239,161	27,221,408	—
		36銘柄<96.5%>	42銘柄<97.3%>	—	—	97.3

(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) 比率は、期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

■投資信託財産の構成

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	27,221,408	97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	758,670	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	27,980,079	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、27,288,905千円、97.5%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、2021年12月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.82円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年12月9日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	27,980,079,797円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	749,402,536
投 資 証 券(評価額)	27,221,408,944
未 収 配 当 金	9,268,317
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	27,980,079,797
元 本	5,596,677,309
次 期 繰 越 損 益 金	22,383,402,488
(D) 受 益 権 総 口 数	5,596,677,309口
1万口当たり基準価額(C/D)	49,994円

(注1) 期首元本額 7,064,439,934円
追加設定元本額 32,646,834円
一部解約元本額 1,500,409,459円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A M世界6資産バランスファンド 16,389,036円
D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド 18,296,707円
D I A M ワールド・リート・インカム・オープン (毎月決算コース) 5,158,127,114円
D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 77,045,034円
D I A M ワールドREITアクティブファンド (毎月決算型) 162,364,345円
D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 51,082,006円
D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金> 113,373,067円
期末元本合計 5,596,677,309円

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	676,241,122円
受 取 配 当 金	676,364,267
受 取 利 息	26,574
支 払 利 息	△149,719
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,066,263,731
売 買 益	10,182,219,708
売 買 損	△115,955,977
(C) そ の 他 費 用	△3,561,920
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	10,738,942,933
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	16,382,346,930
(F) 解 約 差 損 益 金	△4,840,240,541
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	102,353,166
(H) 合 計(D+E+F+G)	22,383,402,488
次 期 繰 越 損 益 金(H)	22,383,402,488

(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。

DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド 運用報告書

第18期 (決算日 2021年12月9日)

(計算期間 2020年12月10日～2021年12月9日)

DIAM インターナショナル・リート・インカム・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	2004年4月23日から無期限です。
運用方針	信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主要投資対象	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。 株式への投資は行いません。 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		投資信託受益証券、 投資証券組入比率	純総資産額
		期中騰落率			
14期 (2017年12月11日)	円	%		%	百万円
14期 (2017年12月11日)	25,713	20.2		95.8	54,616
15期 (2018年12月10日)	25,036	△2.6		95.4	45,994
16期 (2019年12月9日)	28,681	14.6		96.0	45,328
17期 (2020年12月9日)	26,456	△7.8		96.0	36,364
18期 (2021年12月9日)	34,547	30.6		96.3	41,464

(注1) 当ファンドの信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得するというコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

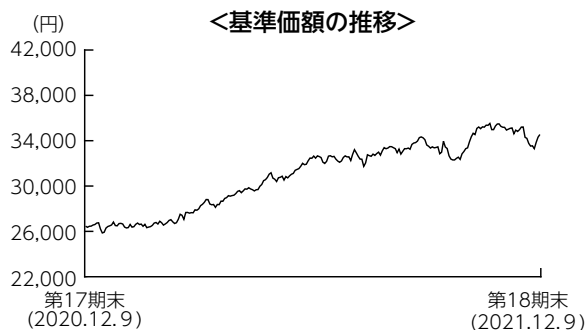
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		投資信託受益証券、 投資証券組入比率
		騰	落	
(期 首) 2020 年 12 月 9 日	円 26,456	% -		% 96.0
12 月 末	26,824		1.4	96.0
2021 年 1 月 末	26,384		△0.3	95.2
2 月 末	27,423		3.7	96.3
3 月 末	28,907		9.3	94.2
4 月 末	30,476		15.2	94.1
5 月 末	31,464		18.9	95.2
6 月 末	32,207		21.7	94.9
7 月 末	32,700		23.6	95.5
8 月 末	33,797		27.7	95.2
9 月 末	32,381		22.4	96.7
10 月 末	35,524		34.3	95.8
11 月 末	34,204		29.3	96.0
(期 末) 2021 年 12 月 9 日	34,547		30.6	96.3

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2020年12月10日から2021年12月9日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は34,547円となり、前期末比で30.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済が正常化に向かうとの期待や、主要国における金融緩和姿勢の継続などを背景にリート市場が上昇したことが、基準価額にプラスに寄与しました。また、主要通貨に対して円安が進行したこともプラスに寄与しました。保有銘柄では、セグロ（英・工業）や、ウェアハウス・ド・ポウ（ベルギー・工業）などが主にプラスに寄与しました。

投資環境

リート市場は上昇しました。欧州リート市場は、一部の国における都市封鎖を受けて下落する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和策の維持・強化が支援材料となりました。アジアリート市場では、大型の買収が市場を刺激し上昇する局面もあったものの、中国不動産開発大手の信用不安等が重しとなり、当期後半に上昇幅が縮小しました。オーストラリアリート市場は、好調な経済指標の発表が続いたことや資源価格の上昇などが支援材料となり上昇しました。

為替市場では、主要通貨に対して円安が進みました。当期前半は、世界的に新型コロナワクチンの接種が進み経済の正常化期待が強まったことから、安全通貨と見なされた円が売られる展開となりました。期後半には、インフレの高進を受けた主要国の金融緩和縮小観測と、オミクロン株の出現などによる感染再拡大への懸念が交錯し、方向感の定まらない展開となりました。

ポートフォリオについて

保守的な財務体質かつ配当成長の見込めるキャッシュフローの安定した銘柄を選別して投資を行いました。また、適正価格に到達した銘柄は適宜入れ替えを行いました。地域別では、オーストラリアやベルギーなどの組入比率を引き上げた一方、香港などの組入比率を引き下げました。また、用途別では、工業などの組入比率を引き上げた一方、小売りなどの組入比率を引き下げました。

今後の運用方針

新型コロナウイルスのワクチン接種が進む一方で、デルタ変異株の感染蔓延や新たな変異株の発生により、リーートの業績には不透明感が残っています。欧州リート市場は、物流をはじめ、安定したキャッシュフローが期待しやすい銘柄に重点的に投資を行っていく方針です。オーストラリアリート市場は、倉庫や物流、オフィス、小売り等のうち財務体質や成長性、配当利回りといった点に優れる銘柄を選別し投資する方針です。アジアリート市場は、物流など構造的な成長要因があるセクターに投資を行っていく方針です。

■ 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 (投資信託受益証券) (投資証券)	3円 (1) (2)	0.011% (0.004) (0.007)	(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 (投資信託受益証券) (投資証券)	2 (0) (2)	0.006 (0.001) (0.006)	(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) (1)	0.021 (0.018) (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	12	0.038	
期中の平均基準価額は30,977円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年12月10日から2021年12月9日まで)

投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	-	-	12.6	621
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	-	-	491.6	9,614
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	-	-	60.2	1,405
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	-	-	569.4	9,687
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	-	-	1,549.692	4,101
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	387.228	6,574	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	2,961.728	9,244	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT NEW	981.526	1,963	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
LINK REIT	-	-	1,919	135,385
	(-)	(-)	(-)	(-)
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	-	-	962.5	2,866
	(-)	(△39)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	—	1,033	2,053
	(-)	(△84)	(-)	(-)
PARKWAY LIFE REIT	—	—	—	—
	(-)	(△54)	(-)	(-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	—	—	—	—
	(-)	(△1)	(-)	(-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	2,918.9	6,261	—	—
	(-)	(△2)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	—	—	618.776	7,465
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	—	—	257.448	4,476
	(-)	(△438)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	—	—	—	—
	(-)	(△38)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、合併、分割等による増減分で、上段の数値には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2020年12月10日から2021年12月9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

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	期首(前期末)		当期		末
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT		374.539	361.939	20,873	1,877,110	4.5
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		1,269.27	777.67	17,093	1,537,190	3.7
ALLIED PROPERTIES REIT		303.9	303.9	13,225	1,189,389	2.9
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU		386.8	326.6	7,400	665,549	1.6
CROMBIE REAL ESTATE INV		1,145.6	576.2	10,325	928,572	2.2
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT		318.8	318.8	7,259	652,808	1.6
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		771.8	771.8	13,082	1,176,465	2.8
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV		1,110.75	1,110.75	25,369	2,281,481	5.5
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	5,681.459	4,547.659	114,628	10,308,569	—
		8銘柄<25.5%>	8銘柄<24.9%>	—	—	24.9
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
MIRVAC GROUP		6,724.439	5,174.747	15,265	1,244,291	3.0
CHARTER HALL RETAIL REIT		3,230.658	3,230.658	13,504	1,100,723	2.7
STOCKLAND		3,075.869	3,075.869	13,256	1,080,577	2.6
GOODMAN GROUP		404.577	791.805	20,016	1,631,571	3.9
VICINITY CENTRES		5,853.855	5,853.855	10,302	839,779	2.0
CHARTER HALL GROUP		732.518	732.518	14,569	1,187,583	2.9
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA		6,291.085	9,252.813	38,399	3,129,916	7.5
NATIONAL STORAGE REIT		6,154.17	7,135.696	18,124	1,477,341	3.6
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	32,467.171	35,247.961	143,439	11,691,785	—
		8銘柄<22.6%>	8銘柄<28.2%>	—	—	28.2
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT		2,339.2	420.2	28,216	411,959	1.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,339.2	420.2	28,216	411,959	—
		1銘柄<6.0%>	1銘柄<1.0%>	—	—	1.0
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
ASCENDAS REAL ESTATE INVT		2,533.091	1,570.591	4,664	389,778	0.9
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		5,752.542	4,719.542	8,872	741,406	1.8
PARKWAY LIFE REIT		2,517	2,517	12,610	1,053,705	2.5
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		1,674.54	1,674.54	4,504	376,397	0.9
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	2,918.9	5,954	497,562	1.2
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	12,477.173	13,400.573	36,606	3,058,850	—
		4銘柄<7.0%>	5銘柄<7.4%>	—	—	7.4
(ニュージーランド)		千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
GOODMAN PROPERTY TRUST		11,602.872	11,602.872	30,051	2,328,986	5.6
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	11,602.872	11,602.872	30,051	2,328,986	—
		1銘柄<5.6%>	1銘柄<5.6%>	—	—	5.6
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
UNITE GROUP PLC		629.834	629.834	7,047	1,059,079	2.6
SEGRO PLC		1,803.914	1,185.138	16,668	2,504,845	6.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,433.748	1,814.972	23,716	3,563,924	—
		2銘柄<8.9%>	2銘柄<8.6%>	—	—	8.6

銘柄	期首(前期末)	当期			期末	
		□数	□数	外貨建金額		邦貨換算金額
(オランダ) VASTNED RETAIL	千□ 452.507	千□ 452.507	千ユーロ 10,339	千円 1,334,245	% 3.2	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	452.507 1銘柄<3.7%>	452.507 1銘柄<3.2%>	10,339 -	1,334,245 -	- 3.2
(ベルギー) COFINIMMO SA WAREHOUSES DE PAUW	千□ 34.726 690.172	千□ 34.726 690.172	千ユーロ 4,778 28,007	千円 616,591 3,614,046	% 1.5 8.7	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	724.898 2銘柄<8.2%>	724.898 2銘柄<10.2%>	32,785 -	4,230,637 -	- 10.2
(フランス) GECINA SA ICADE	千□ 43.793 90.256	千□ 43.793 90.256	千ユーロ 5,110 5,672	千円 659,477 731,990	% 1.6 1.8	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	134.049 2銘柄<4.0%>	134.049 2銘柄<3.4%>	10,783 -	1,391,468 -	- 3.4
(ドイツ) ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千□ 827.22	千□ 569.772	千ユーロ 11,116	千円 1,434,441	% 3.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	827.22 1銘柄<4.2%>	569.772 1銘柄<3.5%>	11,116 -	1,434,441 -	- 3.5
(スペイン) INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	千□ 174.863	千□ 174.863	千ユーロ 1,391	千円 179,611	% 0.4	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	174.863 1銘柄<0.5%>	174.863 1銘柄<0.4%>	1,391 -	179,611 -	- 0.4
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	69,315.16 31銘柄<96.0%>	69,090.326 32銘柄<96.3%>	- -	39,934,481 -	- 96.3

(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) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

■投資信託財産の構成

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券及び投資証券	39,934,481	96.3
コール・ローン等、その他	1,529,878	3.7
投資信託財産総額	41,464,359	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、40,444,786千円、97.5%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、2021年12月9日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=89.93円、1オーストラリア・ドル=81.51円、1香港・ドル=14.60円、1シンガポール・ドル=83.56円、1ニュージーランド・ドル=77.50円、1イギリス・ポンド=150.27円、1ユーロ=129.04円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年12月9日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	41,464,359,479円
コール・ローン等	1,469,495,073
投資信託受益証券(評価額)	14,750,635,631
投資証券(評価額)	25,183,845,609
未 収 入 金	3,710,973
未 収 配 当 金	56,672,193
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	41,464,359,479
元 本	12,002,161,901
次 期 繰 越 損 益 金	29,462,197,578
(D) 受 益 権 総 口 数	12,002,161,901口
1万口当たり基準価額(C/D)	34,547円

(注1) 期首元本額 13,745,032,168円

追加設定元本額 70,815,210円

一部解約元本額 1,813,685,477円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM世界6資産バランスファンド 34,863,252円

DIAMグローバル・アクティブ・バランスファンド

44,042,836円

DIAM ワールド・リート・インカム・オープン (毎月決算コース)

11,049,886,441円

DIAM世界インカム・オープン (毎月決算コース)

163,981,958円

DIAM ワールドREITアクティブファンド (毎月決算型)

353,063,427円

DIAM世界3資産オープン (毎月決算型) 109,918,521円

DIAM ワールドREITアクティブファンド<DC年金>

246,405,466円

期末元本合計 12,002,161,901円

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,183,437,732円
受 取 配 当 金	1,183,637,999
受 取 利 息	27,241
支 払 利 息	△227,508
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,366,152,837
売 買 益	9,623,791,976
売 買 損	△257,639,139
(C) そ の 他 費 用	△8,362,148
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	10,541,228,421
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	22,619,448,890
(F) 解 約 差 損 益 金	△3,852,464,523
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	153,984,790
(H) 合 計(D+E+F+G)	29,462,197,578
次 期 繰 越 損 益 金(H)	29,462,197,578

(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。