

運用報告書 (全体版)

D I A M世界好配当株オープン(毎月決算コース)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式	
信託期間	2005年6月1日から無期限です。	
運用方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。	
主要投資対象	D I A M世界好配当株オープン(毎月決算コース)	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンドにおける組入銘柄の選定に当たっては、配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄を選定し、安定的な配当収入およびキャピタルゲインを享受することをめざします。 実質外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。 株式の実質組入比率は、原則として高位を維持します。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
分配方針	決算日(原則として毎月26日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)の中から、原則として配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。 また、毎年3月、6月、9月および12月の決算時には、原則として配当等収益に売買益(評価益を含みます。)等を加えた額から分配を行います。分配金額につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。	

愛称：世界配当倶楽部

第173期	<決算日	2019年12月26日>
第174期	<決算日	2020年1月27日>
第175期	<決算日	2020年2月26日>
第176期	<決算日	2020年3月26日>
第177期	<決算日	2020年4月27日>
第178期	<決算日	2020年5月26日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「D I A M世界好配当株オープン(毎月決算コース)」は、2020年5月26日に第178期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

DIAM世界好配当株オープン（毎月決算コース）

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組入率	株式先物率	純資産額
		(分配落)	税金 込配 み金	期騰 落中 率			
第26作成期	149期(2017年12月26日)	円 8,555	円 20	% 3.2	% 96.2	% -	百万円 16,672
	150期(2018年1月26日)	8,678	20	1.7	95.8	-	16,904
	151期(2018年2月26日)	8,079	20	△6.7	96.3	-	15,658
	152期(2018年3月26日)	7,566	20	△6.1	95.1	-	14,472
	153期(2018年4月26日)	7,990	20	5.9	95.0	-	15,220
	154期(2018年5月28日)	7,952	20	△0.2	97.2	-	15,047
第27作成期	155期(2018年6月26日)	7,777	20	△1.9	96.1	-	14,612
	156期(2018年7月26日)	8,002	20	3.2	96.5	-	14,916
	157期(2018年8月27日)	7,999	20	0.2	96.9	-	14,809
	158期(2018年9月26日)	8,150	20	2.1	97.3	-	15,014
	159期(2018年10月26日)	7,555	20	△7.1	96.4	-	13,761
	160期(2018年11月26日)	7,651	20	1.5	96.0	-	13,896
第28作成期	161期(2018年12月26日)	6,949	20	△8.9	95.8	-	12,533
	162期(2019年1月28日)	7,383	20	6.5	95.8	-	13,275
	163期(2019年2月26日)	7,786	20	5.7	97.2	-	13,945
	164期(2019年3月26日)	7,717	20	△0.6	97.5	-	13,627
	165期(2019年4月26日)	7,909	20	2.7	96.6	-	13,770
	166期(2019年5月27日)	7,613	20	△3.5	96.3	-	13,197
第29作成期	167期(2019年6月26日)	7,636	20	0.6	95.9	-	13,208
	168期(2019年7月26日)	7,774	20	2.1	96.0	-	13,355
	169期(2019年8月26日)	7,156	20	△7.7	95.4	-	12,243
	170期(2019年9月26日)	7,624	20	6.8	96.1	-	12,965
	171期(2019年10月28日)	7,867	20	3.4	97.2	-	13,308
	172期(2019年11月26日)	7,975	20	1.6	96.8	-	13,313
第30作成期	173期(2019年12月26日)	8,266	20	3.9	96.9	-	13,471
	174期(2020年1月27日)	8,184	20	△0.8	96.7	-	13,190
	175期(2020年2月26日)	7,864	20	△3.7	95.8	-	12,591
	176期(2020年3月26日)	6,126	20	△21.8	95.2	-	9,667
	177期(2020年4月27日)	6,454	20	5.7	95.5	-	10,155
	178期(2020年5月26日)	6,567	20	2.1	95.7	-	10,329

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注5) △(白三角) はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		円	騰 落 率		
第 173 期	(期 首) 2019 年 11 月 26 日	7,975	—	96.8	—
	11 月 末	8,038	0.8	96.8	—
	(期 末) 2019 年 12 月 26 日	8,286	3.9	96.9	—
第 174 期	(期 首) 2019 年 12 月 26 日	8,266	—	96.9	—
	12 月 末	8,315	0.6	96.9	—
	(期 末) 2020 年 1 月 27 日	8,204	△0.8	96.7	—
第 175 期	(期 首) 2020 年 1 月 27 日	8,184	—	96.7	—
	1 月 末	8,096	△1.1	96.1	—
	(期 末) 2020 年 2 月 26 日	7,884	△3.7	95.8	—
第 176 期	(期 首) 2020 年 2 月 26 日	7,864	—	95.8	—
	2 月 末	7,540	△4.1	95.7	—
	(期 末) 2020 年 3 月 26 日	6,146	△21.8	95.2	—
第 177 期	(期 首) 2020 年 3 月 26 日	6,126	—	95.2	—
	3 月 末	6,252	2.1	95.1	—
	(期 末) 2020 年 4 月 27 日	6,474	5.7	95.5	—
第 178 期	(期 首) 2020 年 4 月 27 日	6,454	—	95.5	—
	4 月 末	6,689	3.6	95.6	—
	(期 末) 2020 年 5 月 26 日	6,587	2.1	95.7	—

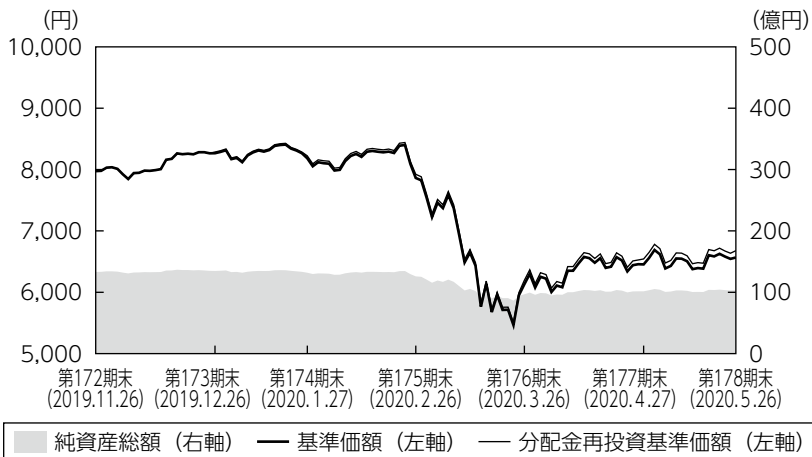
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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173期～第178期の運用経過（2019年11月27日から2020年5月26日まで）

基準価額等の推移



第173期首： 7,975円
 第178期末： 6,567円
 （既払分配金120円）
 騰落率： △16.3%
 （分配金再投資ベース）

- （注1） 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- （注2） 分配金を再投資するか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、前作成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作成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、作成期初から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、前作成期末比では下落して作成期末を終えました。

為替市場では主要通貨に対して前作成期末比で円高が進みました。米ドルについては、作成期初から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

●当ファンド

D I AM世界好配当株オープン・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用を行いました。

●D I AM世界好配当株オープン・マザーファンド

銘柄選択においては、「地域の分散」、「業種の分散」に着目し、世界の好配当株への投資を通じて、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざした運用を行いました。地域別では、概ね前作成期末と同様の資産配分を維持しました。業種別では、幅広い業種に分散投資を行う中、ヘルスケアや公益、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。

【運用状況】

- (注1) 組入比率は純資産総額に対する実質組入比率です。
 (注2) 国・地域別配分は、発行国・地域を表示しています。
 (注3) 業種は各決算日時点でのG I C S（世界産業分類基準）によるものです。

○国・地域別配分

前作成期末

	国・地域	組入比率
北米	米国	42.3%
	カナダ	5.7%
	計	48.0%
欧州	フィンランド	1.0%
	フランス	8.6%
	ドイツ	7.6%
	アイルランド	1.2%
	オランダ	2.4%
	スペイン	5.2%
	スイス	3.9%
	英国	14.9%
	ノルウェー	0.7%
	計	45.4%
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.1%
	香港	1.6%
	シンガポール	0.7%
	計	3.4%
	株式計	96.8%
	現金など	3.2%
	合計	100%



当作成期末

	国・地域	組入比率
北米	米国	43.0%
	カナダ	6.2%
	計	49.2%
欧州	フィンランド	1.7%
	フランス	4.6%
	ドイツ	9.7%
	アイルランド	1.3%
	オランダ	1.1%
	スペイン	4.4%
	スイス	5.1%
	英国	14.7%
	ノルウェー	0.6%
	計	43.1%
アジア・オセアニア	オーストラリア	1.2%
	香港	1.6%
	シンガポール	0.6%
	計	3.3%
	株式計	95.7%
	現金など	4.3%
	合計	100%

○組入上位10業種

前作成期末

No.	業種	組入比率
1	公益事業	14.6%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14.3
3	銀行	11.0
4	資本財	8.3
5	エネルギー	7.2
6	食品・飲料・タバコ	6.3
7	家庭用品・パーソナル用品	5.6
8	保険	5.0
9	消費者サービス	4.6
10	電気通信サービス	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	20.2%
2	公益事業	18.0
3	食品・飲料・タバコ	6.6
4	資本財	6.6
5	銀行	6.1
6	エネルギー	5.8
7	家庭用品・パーソナル用品	5.7
8	保険	4.2
9	素材	4.0
10	電気通信サービス	3.9

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第173期	第174期	第175期	第176期	第177期	第178期
	2019年11月27日 ~2019年12月26日	2019年12月27日 ~2020年1月27日	2020年1月28日 ~2020年2月26日	2020年2月27日 ~2020年3月26日	2020年3月27日 ~2020年4月27日	2020年4月28日 ~2020年5月26日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.24%	0.24%	0.25%	0.33%	0.31%	0.30%
当期の収益	20円	6円	13円	20円	18円	20円
当期の収益以外	-円	13円	6円	-円	1円	-円
翌期繰越分配対象額	539円	525円	519円	522円	521円	522円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

●D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

今後の外国株式市場は、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	第173期～第178期		項目の概要
	(2019年11月27日～2020年5月26日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	44円	0.602%	(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7,337円です。
(投信会社)	(21)	(0.285)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(21)	(0.285)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(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	0.018	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(1)	(0.018)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(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)	(0.000)	
(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)	(1)	(0.009)	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)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	46	0.630	

(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。

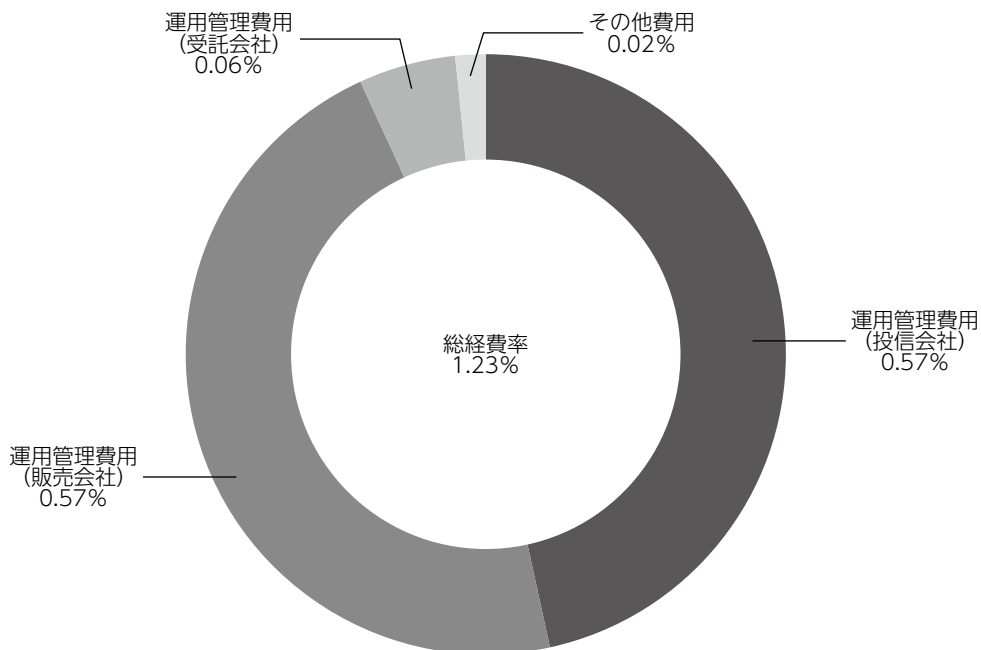
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2019年11月27日から2020年5月26日まで）

	第 173 期		第 178 期	
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
D I A M 世界好配当株 オープン・マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 345,770	千円 950,000

■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 173 期 ~ 第 178 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	5,323,385千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	33,839,997千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.15

(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11月27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

親投資信託残高

	第29作成期末	第 30 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□ 4,783,607	千□ 4,437,836	千円 10,226,994

■投資信託財産の構成

2020年5月26日現在

項 目	第 30 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	10,226,994	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	145,338	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	10,372,333	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、2020年5月26日現在、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドは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

(2019年12月26日)、(2020年1月27日)、(2020年2月26日)、(2020年3月26日)、(2020年4月27日)、(2020年5月26日)現在

項 目	第 173 期 末	第 174 期 末	第 175 期 末	第 176 期 末	第 177 期 末	第 178 期 末
(A) 資 産	13,572,740,131円	13,254,790,411円	12,653,877,425円	9,719,058,704円	10,198,915,595円	10,372,333,806円
コール・ローン等	296,692,942	163,462,061	279,883,587	170,034,923	190,262,213	145,338,853
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	13,276,047,189	13,091,328,350	12,373,993,838	9,549,023,781	10,008,653,382	10,226,994,953
(B) 負 債	101,678,831	64,340,539	62,852,953	52,045,165	43,019,347	43,184,821
未払収益分配金	32,595,204	32,233,726	32,021,316	31,558,501	31,469,303	31,458,309
未払解約金	55,738,223	17,814,021	17,690,810	10,392,641	888,776	1,822,658
未払信託報酬	13,304,055	14,249,946	13,102,133	10,064,302	10,629,875	9,874,693
その他未払費用	41,349	42,846	38,694	29,721	31,393	29,161
(C) 純資産総額(A-B)	13,471,061,300	13,190,449,872	12,591,024,472	9,667,013,539	10,155,896,248	10,329,148,985
元 本	16,297,602,085	16,116,863,035	16,010,658,175	15,779,250,687	15,734,651,642	15,729,154,672
次期繰越損益金	△2,826,540,785	△2,926,413,163	△3,419,633,703	△6,112,237,148	△5,578,755,394	△5,400,005,687
(D) 受益権総口数	16,297,602,085口	16,116,863,035口	16,010,658,175口	15,779,250,687口	15,734,651,642口	15,729,154,672口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,266円	8,184円	7,864円	6,126円	6,454円	6,567円

(注) 第172期末における元本額は16,694,049,168円、当作成期間(第173期～第178期)中における追加設定元本額は295,934,121円、同解約元本額は1,260,828,617円です。

■損益の状況

〔自 2019年11月27日 至 2019年12月26日〕〔自 2019年12月27日 至 2020年1月27日〕〔自 2020年1月28日 至 2020年2月26日〕〔自 2020年2月27日 至 2020年3月26日〕〔自 2020年3月27日 至 2020年4月27日〕〔自 2020年4月28日 至 2020年5月26日〕

項 目	第 173 期	第 174 期	第 175 期	第 176 期	第 177 期	第 178 期
(A) 配 当 等 収 益	△6,387円	△9,651円	△3,912円	△8,969円	△5,490円	△6,553円
受 取 利 息	100	97	16	54	9	3
支 払 利 息	△6,487	△9,748	△3,928	△9,023	△5,499	△6,556
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	519,349,591	△84,815,681	△467,179,994	△2,693,605,435	557,900,034	218,099,206
売 買 益	526,992,585	519,468	2,457,958	30,648,769	559,797,227	218,372,578
売 買 損	△7,642,994	△85,335,149	△469,637,952	△2,724,254,204	△1,897,193	△273,372
(C) 信 託 報 酬 等	△13,345,404	△14,292,792	△13,140,827	△10,094,023	△10,661,268	△9,903,854
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	505,997,800	△99,118,124	△480,324,733	△2,703,708,427	547,233,276	208,188,799
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,051,117,677	△569,347,503	△693,001,872	△1,182,977,556	△3,897,374,734	△3,373,963,809
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,248,825,704	△2,225,713,810	△2,214,285,782	△2,193,992,664	△2,197,144,633	△2,202,772,368
(配 当 等 相 当 額)	(322,704,554)	(321,042,973)	(321,263,359)	(318,746,495)	(319,163,417)	(320,029,617)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,571,530,258)	(△2,546,756,783)	(△2,535,549,141)	(△2,512,739,159)	(△2,516,308,050)	(△2,522,801,985)
(G) 合 計 (D + E + F)	△2,793,945,581	△2,894,179,437	△3,387,612,387	△6,080,678,647	△5,547,286,091	△5,368,547,378
(H) 収 益 分 配 金	△32,595,204	△32,233,726	△32,021,316	△31,558,501	△31,469,303	△31,458,309
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△2,826,540,785	△2,926,413,163	△3,419,633,703	△6,112,237,148	△5,578,755,394	△5,400,005,687
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,248,825,704	△2,225,713,810	△2,214,285,782	△2,193,992,664	△2,197,144,633	△2,202,772,368
(配 当 等 相 当 額)	(322,734,725)	(321,068,329)	(321,294,960)	(318,799,522)	(319,183,827)	(320,040,608)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,571,560,429)	(△2,546,782,139)	(△2,535,580,742)	(△2,512,792,186)	(△2,516,328,460)	(△2,522,812,976)
分 配 準 備 積 立 金	556,066,455	525,677,246	510,272,040	505,981,452	500,712,755	501,446,812
繰 越 損 益 金	△1,133,781,536	△1,226,376,599	△1,715,619,961	△4,424,225,936	△3,882,323,516	△3,698,680,131

(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 173 期	第 174 期	第 175 期	第 176 期	第 177 期	第 178 期
(a) 経費控除後の配当等収益	47,882,237円	9,898,539円	22,390,898円	36,738,187円	28,895,616円	33,324,643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	322,734,725	321,068,329	321,294,960	318,799,522	319,183,827	320,040,608
(d) 分 配 準 備 積 立 金	540,779,422	548,012,433	519,902,458	500,801,766	503,286,442	499,580,478
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	911,396,384	878,979,301	863,588,316	856,339,475	851,365,885	852,945,729
(f) 1万口当たり当期分配対象額	559.22	545.38	539.38	542.70	541.08	542.27
(g) 分 配 金	32,595,204	32,233,726	32,021,316	31,558,501	31,469,303	31,458,309
(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 173 期	第 174 期	第 175 期	第 176 期	第 177 期	第 178 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

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

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

運用報告書

第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
	21,948	△	13.2	98.3	—	36,995
12期 (2017年5月26日)	25,040		14.1	97.1	—	35,150
13期 (2018年5月28日)	25,679		2.6	97.8	—	36,097
14期 (2019年5月27日)	25,645	△	0.1	97.7	—	36,715
15期 (2020年5月26日)	23,045	△	10.1	96.6	—	30,171

(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)。

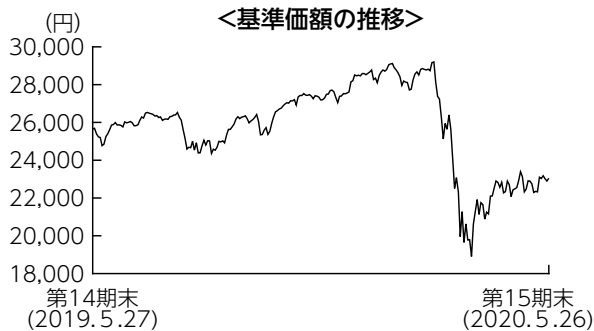
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 円	価 額	株 式 組 入 率 %	株 式 先 物 比 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		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	
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%>
(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	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%>
(香港)	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%>
(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	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%>
(イギリス)	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%>
(スイス)	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 末		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 銘 柄 数 < 比 率 >	1,193.12 3銘柄	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 銘 柄 数 < 比 率 >	1,340.75 1銘柄	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 銘 柄 数 < 比 率 >	2,064.09 1銘柄	- -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 銘 柄 数 < 比 率 >	3,273.87 1銘柄	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 銘 柄 数 < 比 率 >	13,513.43 7銘柄	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 銘 柄 数 < 比 率 >	7,557.43 7銘柄	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 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…スペイン) FERROVIAL SA-RTS FERROVIAL SA-RTS	百株 739.38 -	百株 -	百株 739.38	千ユーロ -	千円 -	建設・土木 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) UPM-KYMMENE OYJ FORTUM OYJ	百株 653.83 638.45	百株 -	百株 653.83 1,774.25	千ユーロ 1,641 2,838	千円 193,006 333,729	紙製品・林産品 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	29,150,031千円	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)