

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179期	<決算日	2020年6月26日>
第180期	<決算日	2020年7月27日>
第181期	<決算日	2020年8月26日>
第182期	<決算日	2020年9月28日>
第183期	<決算日	2020年10月26日>
第184期	<決算日	2020年11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11月26日に第184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 株比	株式先物率 株比	純資産額
		(分配落)	税金 込	み 騰			
第27作成期	155期(2018年6月26日)	円 7,777	円 20	% △1.9	% 96.1	% -	百万円 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
第31作成期	179期(2020年6月26日)	6,855	20	4.7	96.2	-	10,754
	180期(2020年7月27日)	7,055	20	3.2	95.5	-	11,042
	181期(2020年8月26日)	7,255	20	3.1	96.2	-	11,288
	182期(2020年9月28日)	6,860	20	△5.2	96.7	-	10,610
	183期(2020年10月26日)	6,992	20	2.2	97.4	-	10,789
	184期(2020年11月26日)	7,330	20	5.1	97.7	-	11,228

(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179期	(期首) 2020年5月26日	6,567	—	95.7	—
	5月末	6,800	3.5	96.2	—
	(期末) 2020年6月26日	6,875	4.7	96.2	—
第180期	(期首) 2020年6月26日	6,855	—	96.2	—
	6月末	6,880	0.4	96.0	—
	(期末) 2020年7月27日	7,075	3.2	95.5	—
第181期	(期首) 2020年7月27日	7,055	—	95.5	—
	7月末	6,969	△1.2	95.4	—
	(期末) 2020年8月26日	7,275	3.1	96.2	—
第182期	(期首) 2020年8月26日	7,255	—	96.2	—
	8月末	7,185	△1.0	96.1	—
	(期末) 2020年9月28日	6,880	△5.2	96.7	—
第183期	(期首) 2020年9月28日	6,860	—	96.7	—
	9月末	6,961	1.5	96.7	—
	(期末) 2020年10月26日	7,012	2.2	97.4	—
第184期	(期首) 2020年10月26日	6,992	—	97.4	—
	10月末	6,601	△5.6	97.2	—
	(期末) 2020年11月26日	7,350	5.1	97.7	—

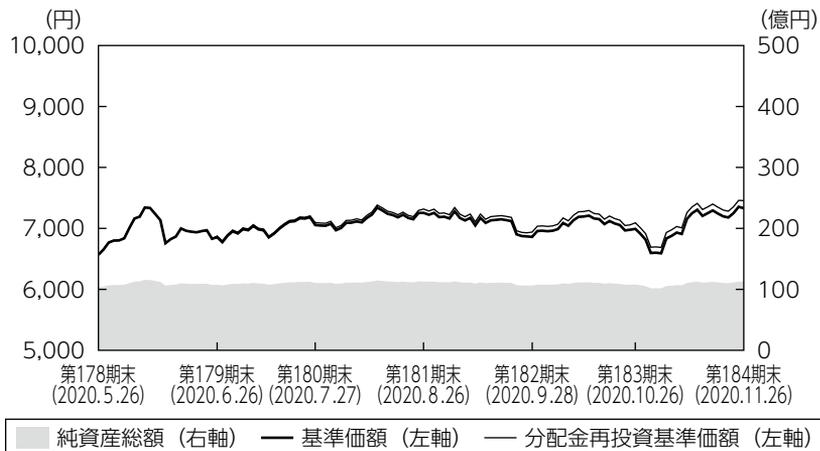
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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179期～第184期の運用経過（2020年5月27日から2020年11月26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

外国株式市場は、作成期初から夏場にかけては新型コロナウイルスの感染拡大が一服する中、各国の金融政策や財政政策を好感して堅調に推移しました。2020年9月以降は欧米で新型コロナウイルスの感染再拡大や米国の大統領選挙を控えたリスク回避的な動きが見られましたが、11月以降はワクチン開発期待から相場が反発色を強めたことなどを背景に、基準価額は前作成期末比で上昇しました。

投資環境

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

為替市場では、米国金利の低下を受けて米ドルが主要通貨に対して下落し、ドル／円については作成期初比円高となりました。ユーロ／円とポンド／円については、欧州における積極的な財政支援への期待感などを背景に作成期初比円安となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

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

●D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

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

【運用状況】

(注1) 組入比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

(注2) 国・地域別配分は、発行国・地域を表示しています。

(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	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%



当作成期末

国・地域		組入比率
北米	米国	42.9%
	カナダ	7.2%
	計	50.1%
欧州	フィンランド	1.9%
	フランス	6.0%
	ドイツ	11.1%
	アイルランド	1.5%
	オランダ	1.0%
	スペイン	3.6%
	スウェーデン	0.6%
	スイス	4.4%
	英国	14.3%
計	44.4%	
アジア・オセアニア	オーストラリア	0.8%
	香港	1.7%
	シンガポール	0.7%
	計	3.2%
株式計		97.7%
現金など		2.3%
合計		100%

○組入上位10業種

前作成期末

No.	業種	組入比率
1	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	20.2%
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



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	19.0%
2	公益事業	18.2
3	食品・飲料・タバコ	8.1
4	資本財	7.0
5	家庭用品・パーソナル用品	6.8
6	素材	6.2
7	保険	5.2
8	銀行	4.5
9	電気通信サービス	4.4
10	エネルギー	3.7

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179期	第180期	第181期	第182期	第183期	第184期
	2020年5月27日 ～2020年6月26日	2020年6月27日 ～2020年7月27日	2020年7月28日 ～2020年8月26日	2020年8月27日 ～2020年9月28日	2020年9月29日 ～2020年10月26日	2020年10月27日 ～2020年11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	0.29%	0.28%	0.27%	0.29%	0.29%	0.27%
当期の収益	20円	20円	20円	12円	12円	12円
当期の収益以外	-円	-円	-円	7円	7円	7円
翌期繰越分配対象額	527円	540円	543円	536円	528円	520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、新型コロナウイルスを巡る動向と世界経済への影響度合い、特に企業業績への影響を睨みながら、値動きの荒い相場環境が続くことを想定します。一方で、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざす当ファンドにとっては、比較的銘柄選別を行いやすい市場環境だと考えます。配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄を選別する運用方針を継続します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第179期～第184期 (2020年5月27日 ～2020年11月26日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	43円	
(投信会社)	(20)	(0.288)	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)	(20)	(0.288)	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)	(2)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	2	0.023	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株式)	(2)	(0.023)	売買委託手数料は、組入の有価証券等の売買の際に発生する手数料
(c) 有価証券取引税	0	0.006	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.006)	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	1	0.011	(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)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	46	0.649	

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

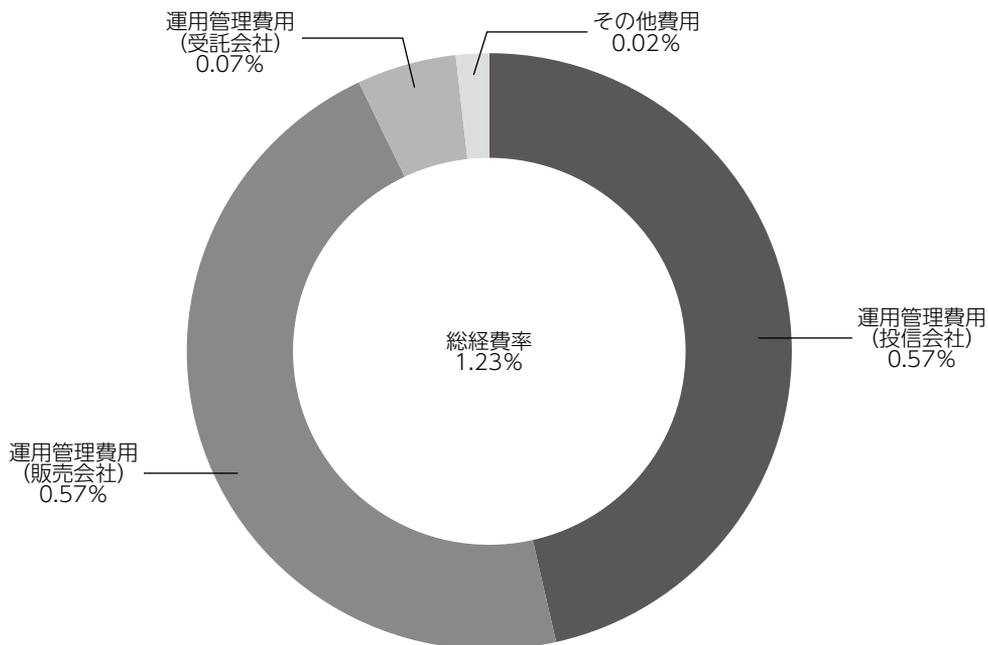
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.23%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年5月27日から2020年11月26日まで）

	第 179 期 ～ 第 184 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□ 217,108	千円 550,000

■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 179 期 ～ 第 184 期
	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	6,461,897千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	30,735,144千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.21

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年5月27日から2020年11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30作成期末	第 31 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□ 4,437,836	千□ 4,220,728	千円 11,121,618

<補足情報>

■D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド（12,556,385,725口）の内容です。
外国株式

銘柄	2020年5月26日現在		2020年11月26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	204.89	204.89	2,544	265,517	情報技術サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	-	677.38	3,420	356,923	食品
AMEREN CORP	284.99	284.99	2,296	239,611	総合公益事業
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	-	406.41	2,553	266,471	医薬品
CAMPBELL SOUP CO	1,004.22	1,004.22	4,912	512,585	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	334.74	334.74	1,952	203,762	コンピュータ・周辺機器
CISCO SYSTEMS INC	906.48	1,315.95	5,592	583,551	通信機器
COLOROX COMPANY	-	140.7	2,824	294,713	家庭用品
CUMMINS INC	89.92	89.92	2,071	216,157	機械
DTE ENERGY CO	153.23	153.23	2,026	211,425	総合公益事業
EATON CORP PLC	239.5	239.5	2,926	305,345	電気設備
EXXON MOBIL CORP	733.11	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
GILEAD SCIENCES INC	294.44	449.44	2,674	279,022	バイオテクノロジー
HP INC	491.28	491.28	1,093	114,053	コンピュータ・周辺機器
CENTERPOINT ENERGY INC	1,177.52	1,177.52	2,886	301,135	総合公益事業
JOHNSON & JOHNSON	270.33	270.33	3,884	405,267	医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	165.28	165.28	2,325	242,641	家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	118.09	118.09	4,467	466,172	航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	413.08	413.08	9,060	945,372	ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	1,063.33	1,063.33	5,078	529,886	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	597.02	-	-	-	半導体・半導体製造装置
MERCK & CO.INC.	1,086.11	1,086.11	8,695	907,277	医薬品
MICROSOFT CORP	347.09	347.09	7,423	774,538	ソフトウェア
PACWEST BANCORP	307.15	-	-	-	銀行
WELLS FARGO & CO	1,013.77	-	-	-	銀行
PACCAR INC	621.61	621.61	5,521	576,075	機械
PPL CORPORATION	893.92	893.92	2,627	274,125	電力
PFIZER INC	1,325.42	1,325.42	4,841	505,189	医薬品
ALTRIA GROUP INC	433.64	433.64	1,751	182,703	タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	852.83	852.83	11,827	1,234,034	家庭用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	640.1	640.1	3,679	383,964	食品
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	1,088	113,575	ガス
TRUIST FINANCIAL CORP	1,195.07	1,195.07	5,797	604,888	銀行
AT&T INC	1,256.74	1,256.74	3,643	380,140	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	245.8	245.8	2,264	236,309	石油・ガス・消耗燃料
TEXAS INSTRUMENTS INC	-	123.78	1,950	203,543	半導体・半導体製造装置

銘柄	2020年5月26日現在		2020年11月26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	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	—	734.05	2,867	299,240	食品・生活必需品小売り
VALLEY NATIONAL BANCORP	1,286.38	—	—	—	銀行
LAS VEGAS SANDS CORP	528.45	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	637.34	637.34	4,900	511,318	タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	369.16	369.16	3,297	344,082	化学
GENERAL MOTORS CO	710.63	—	—	—	自動車
ABBVIE INC	655.93	655.93	6,834	713,142	バイオテクノロジー
VIATRIS INC	—	164.45	280	29,289	医薬品
AVANGRID INC	361.59	361.59	1,696	177,021	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,751.59 39銘柄	21,386.32 38銘柄	145,582 —	15,190,079 <45.9%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	400.66	400.66	2,949	236,680	銀行
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	3,140.56	3,140.56	6,347	509,289	総合公益事業
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	193.26	193.26	2,154	172,858	銀行
RUSSEL METALS INC	768.67	768.67	1,624	130,325	商社・流通業
GIBSON ENERGY INC	2,382.76	2,382.76	5,125	411,255	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL POWER CORP	860.16	860.16	2,792	224,105	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NORHLAND POWER INC	2,042.99	2,042.99	8,958	718,830	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>	9,789.06 7銘柄	9,789.06 7銘柄	29,951 —	2,403,345 <7.3%>
(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	2,293	176,247	金属・鉱業
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	285.97	—	—	—	銀行
AGL ENERGY LTD	776.72	776.72	1,081	83,138	総合公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,643.96 3銘柄	1,357.99 2銘柄	3,375 —	259,385 <0.8%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,620	7,620	19,392	261,028	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	21,880	5,470	22,563	303,708	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,500 2銘柄	13,090 2銘柄	41,956 —	564,736 <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	3,037	236,709	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,037 —	236,709 <0.7%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
NATIONAL GRID PLC	5,418.8	5,418.8	4,924	687,770	総合公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	401.83	401.83	1,071	149,586	タバコ
IMPERIAL BRANDS PLC	1,637.2	1,637.2	2,441	340,919	タバコ
UNILEVER PLC	808.44	808.44	3,686	514,854	パーソナル用品

銘柄	2020年5月26日現在		2020年11月26日現在		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	3,384.49	3,384.49	3,107	434,012	水道	
RIO TINTO PLC	906.4	906.4	4,458	622,622	金属・鉱業	
VODAFONE GROUP PLC	10,084.8	10,084.8	1,253	175,069	無線通信サービス	
SSE PLC	1,179.15	1,179.15	1,634	228,246	電力	
BP PLC	4,168.37	4,168.37	1,115	155,726	石油・ガス・消耗燃料	
3I GROUP PLC	2,194.47	2,194.47	2,359	329,465	資本市場	
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,670.2	2,670.2	3,681	514,107	医薬品	
ASTRAZENECA PLC	558.09	558.09	4,353	607,954	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33,412.24 12銘柄	33,412.24 12銘柄	34,085 -	4,760,336 <14.4%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	203.38	203.38	6,104	701,706	医薬品	
NOVARTIS AG-REG SHS	824.79	824.79	6,679	767,768	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,028.17 2銘柄	1,028.17 2銘柄	12,783 -	1,469,474 <4.4%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
DNB ASA	1,340.75	-	-	-	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,340.75 1銘柄	- -銘柄	- -	- <-%>	
(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	-	1,488.25	16,422	201,672	無線通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- -銘柄	1,488.25 1銘柄	16,422 -	201,672 <0.6%>	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NN GROUP NV	284.71	-	-	-	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	284.71 1銘柄	- -銘柄	- -	- <-%>	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AXA SA	2,250.72	2,636.52	5,238	651,597	保険	
DANONE	-	416.6	2,175	270,586	食品	
TOTAL SE	918.14	918.14	3,468	431,383	石油・ガス・消耗燃料	
SANOFI	620.01	620.01	5,221	649,478	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,788.87 3銘柄	4,591.27 4銘柄	16,104 -	2,003,046 <6.1%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	1,706.71	1,706.71	6,893	857,401	航空貨物・物流サービス	
RWE AG	988.86	-	-	-	総合公益事業	
E.ON SE	4,209.62	4,209.62	3,846	478,458	総合公益事業	
SIEMENS AG-REG	275.79	275.79	3,098	385,425	コングロマリット	
DAIMLER AG	199.9	-	-	-	自動車	
BASF SE	256.47	256.47	1,544	192,068	化学	

銘 柄	2020年5月26日現在		2020年11月26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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ALLIANZ SE	222.89	222.89	4,439	552,243	保険	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,718.47	3,718.47	5,613	698,148	各種電気通信サービス	
SIEMENS ENERGY AG	—	137.89	345	42,979	電気設備	
COVESTRO AG	—	877.92	4,123	512,892	化学	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,578.71	11,405.76	29,905	3,719,618	
	銘 柄 数<比 率>	8銘柄	8銘柄	—	<11.2%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	5,817.73	5,817.73	6,574	817,678	電力	
REPSOL SA	2,641.02	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	423.32	—	—	—	建設・土木	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	752.35	752.35	1,281	159,408	電力	
FERROVIAL SA	739.38	739.38	1,747	217,403	建設・土木	
FERROVIAL SA-RTS	739.38	—	—	—	建設・土木	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,113.18	7,309.46	9,603	1,194,490	
	銘 柄 数<比 率>	6銘柄	3銘柄	—	<3.6%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	653.83	653.83	1,769	220,061	紙製品・林産品	
FORTUM OYJ	1,774.25	1,774.25	3,315	412,342	電力	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,428.08	2,428.08	5,084	632,403	
	銘 柄 数<比 率>	2銘柄	2銘柄	—	<1.9%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	130,966.32	108,593.6	—	32,635,300	
	銘 柄 数<比 率>	87銘柄	82銘柄	—	<98.6%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月26日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、2020年11月26日現在のマザーファンド純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

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

■投資信託財産の構成

2020年11月26日現在

項 目	第 31 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	11,121,618	98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	155,950	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	11,277,569	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11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32,869,357千円、99.3%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11月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.34円、1カナダ・ドル=80.24円、1オーストラリア・ドル=76.84円、1香港・ドル=13.46円、1シンガポール・ドル=77.93円、1台湾・ドル=3.66円、1イギリス・ポンド=139.66円、1スイス・フラン=114.95円、1ノルウェー・クローネ=11.83円、1スウェーデン・クローナ=12.28円、1ユーロ=124.38円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月26日)、(2020年7月27日)、(2020年8月26日)、(2020年9月28日)、(2020年10月26日)、(2020年11月26日)現在

項 目	第 179 期 末	第 180 期 末	第 181 期 末	第 182 期 末	第 183 期 末	第 184 期 末
(A) 資 産	10,798,230,298円	11,088,014,592円	11,337,824,612円	10,667,014,084円	10,840,316,286円	11,277,569,447円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	173,685,515	207,550,004	203,114,959	152,363,659	179,665,336	155,950,936
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	10,624,544,783	10,880,464,588	11,134,709,653	10,514,650,425	10,660,650,950	11,121,618,511
(B) 負 債	43,953,855	45,181,360	49,201,991	56,141,409	50,832,281	49,555,977
未 払 収 益 分 配 金	31,375,812	31,305,935	31,120,363	30,936,728	30,862,464	30,637,719
未 払 解 約 金	1,327,802	2,549,393	6,957,902	13,076,651	9,816,508	7,791,447
未 払 信 託 報 酬	11,217,116	11,292,683	11,090,971	12,092,319	10,123,839	11,094,547
そ の 他 未 払 費 用	33,125	33,349	32,755	35,711	29,470	32,264
(C) 純資産総額(A-B)	10,754,276,443	11,042,833,232	11,288,622,621	10,610,872,675	10,789,484,005	11,228,013,470
元 本	15,687,906,407	15,652,967,701	15,560,181,672	15,468,364,295	15,431,232,302	15,318,859,703
次 期 繰 越 損 益 金	△4,933,629,964	△4,610,134,469	△4,271,559,051	△4,857,491,620	△4,641,748,297	△4,090,846,233
(D) 受 益 権 総 口 数	15,687,906,407口	15,652,967,701口	15,560,181,672口	15,468,364,295口	15,431,232,302口	15,318,859,703口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,855円	7,055円	7,255円	6,860円	6,992円	7,330円

(注) 第178期末における元本額は15,729,154,672円、当作成期間(第179期~第184期)中における追加設定元本額は191,020,916円、同解約元本額は601,315,885円です。

■損益の状況

〔自 2020年5月27日 至 2020年6月26日〕〔自 2020年6月27日 至 2020年7月27日〕〔自 2020年7月28日 至 2020年8月26日〕〔自 2020年8月27日 至 2020年9月28日〕〔自 2020年9月29日 至 2020年10月26日〕〔自 2020年10月27日 至 2020年11月26日〕

項 目	第 179 期	第 180 期	第 181 期	第 182 期	第 183 期	第 184 期
(A) 配 当 等 収 益	△7,433円	△6,401円	△5,251円	△8,196円	△2,390円	△4,029円
受 取 利 息	18	12	20	36	3	21
支 払 利 息	△7,451	△6,413	△5,271	△8,232	△2,393	△4,050
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	493,502,658	354,856,497	353,361,731	△567,936,865	244,822,298	559,002,352
売 買 益	497,549,830	355,923,392	354,367,513	1,818,721	246,000,525	561,390,335
売 買 損	△4,047,172	△1,066,895	△1,005,782	△569,755,586	△1,178,227	△2,387,983
(C) 信 託 報 酬 等	△11,250,241	△11,326,032	△11,123,726	△12,128,030	△10,153,309	△11,126,811
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	482,244,984	343,524,064	342,232,754	△580,073,091	234,666,599	547,871,512
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△3,180,283,032	△2,717,667,571	△2,386,637,491	△2,059,253,327	△2,659,181,022	△2,432,957,581
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,204,216,104	△2,204,685,027	△2,196,033,951	△2,187,228,474	△2,186,371,410	△2,175,122,445
(配 当 等 相 当 額)	(320,544,730)	(320,915,438)	(320,036,683)	(319,184,656)	(319,326,419)	(317,926,912)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,524,760,834)	(△2,525,600,465)	(△2,516,070,634)	(△2,506,413,130)	(△2,505,697,829)	(△2,493,049,357)
(G) 合 計 (D+E+F)	△4,902,254,152	△4,578,828,534	△4,240,438,688	△4,826,554,892	△4,610,885,833	△4,060,208,514
(H) 収 益 分 配 金	△31,375,812	△31,305,935	△31,120,363	△30,936,728	△30,862,464	△30,637,719
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△4,933,629,964	△4,610,134,469	△4,271,559,051	△4,857,491,620	△4,641,748,297	△4,090,846,233
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,204,216,104	△2,204,685,027	△2,196,033,951	△2,187,228,474	△2,186,371,410	△2,175,122,445
(配 当 等 相 当 額)	(320,575,143)	(320,944,739)	(320,052,880)	(319,200,540)	(319,335,920)	(317,936,625)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,524,791,247)	(△2,525,629,766)	(△2,516,086,831)	(△2,506,429,014)	(△2,505,707,330)	(△2,493,059,070)
分 配 準 備 積 立 金	507,723,546	525,347,983	526,244,634	509,920,946	495,774,035	479,579,606
繰 越 損 益 金	△3,237,137,406	△2,930,797,425	△2,601,769,734	△3,180,184,092	△2,951,150,922	△2,395,303,394

(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 179 期	第 180 期	第 181 期	第 182 期	第 183 期	第 184 期
(a) 経費控除後の配当等収益	40,310,988円	51,115,410円	36,125,525円	18,738,710円	18,831,824円	18,970,052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	320,575,143	320,944,739	320,052,880	319,200,540	319,335,920	317,936,625
(d) 分 配 準 備 積 立 金	498,788,370	505,538,508	521,239,472	522,118,964	507,804,675	491,247,273
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	859,674,501	877,598,657	877,417,877	860,058,214	845,972,419	828,153,950
(f) 1万口当たり当期分配対象額	547.99	560.66	563.89	556.01	548.22	540.61
(g) 分 配 金	31,375,812	31,305,935	31,120,363	30,936,728	30,862,464	30,637,719
(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 179 期	第 180 期	第 181 期	第 182 期	第 183 期	第 184 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 36,995
12期 (2017年5月26日)	21,948	△13.2		98.3	—	35,150
13期 (2018年5月28日)	25,040	14.1		97.1	—	36,097
14期 (2019年5月27日)	25,679	2.6		97.8	—	36,715
15期 (2020年5月26日)	25,645	△0.1		97.7	—	30,171
	23,045	△10.1		96.6	—	

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

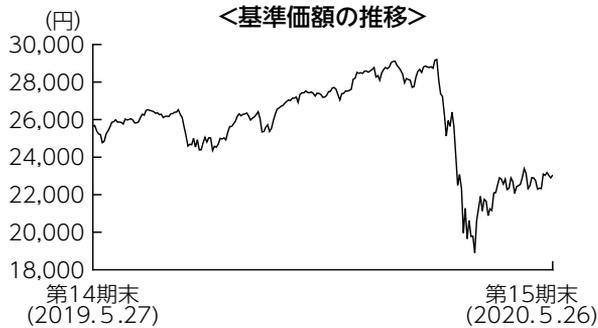
■当期中の基準価額の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2019年5月28日から2020年5月26日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は23,045円となり、前期末比で10.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

今後の運用方針

今後の外国株式市場は、目先は新型コロナウイルスが世界経済へ与える悪影響の度合い、特に企業業績への影響を睨みながら、値動きの荒い相場環境が続くことを想定します。一方で、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざす当ファンドにとっては、比較的銘柄選別を行いやすい市場環境だと考えます。配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄を選別する運用方針を継続します。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式)	6円 (6)	0.025% (0.025)
(b) 有価証券取引税 (株 式)	0 (0)	0.000 (0.000)
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	5 (4) (0)	0.018 (0.017) (0.001)
合 計	11	0.043

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,740円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2019年5月28日から2020年5月26日まで)

株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 2,026.44 (-)	千アメリカ・ドル 12,973 (-)	百株 2,451.92	千アメリカ・ドル 13,146
	カ ナ ダ	百株 - (-)	千カナダ・ドル - (-)	百株 630.56	千カナダ・ドル 2,074
	イ ギ リ ス	百株 - (-)	千イギリス・ポンド - (-)	百株 19,757.24	千イギリス・ポンド 5,285
	ス イ ス	百株 - (-)	千スイス・フラン - (-)	百株 164.95	千スイス・フラン 948
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 - (-)	千スウェーデン・クローナ - (-)	百株 2,064.09	千スウェーデン・クローナ 28,755
国	ユ	百株 284.71 (-)	千ユーロ 1,027 (-)	百株 3,273.87	千ユーロ 1,645
	イ	- (-)	- (-)	9,724.56	8,642
	ロ	5,921.62 (-)	6,547 (-)	1,900.34	5,280
	-	- (19,242.9)	- (-)	30,068.9	1,660
	フ ィ ン ラ ン ド	1,135.8 (-)	1,723 (-)	-	-

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2019年5月28日から2020年5月26日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細
外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	204.89	204.89	2,425	261,416		情報技術サービス
AMEREN CORP	284.99	284.99	1,989	214,440		総合公益事業
CAMPBELL SOUP CO	1,004.22	1,004.22	4,855	523,266		食品
SEAGATE TECHNOLOGY	334.74	334.74	1,705	183,837		コンピュータ・周辺機器
CISCO SYSTEMS INC	906.48	906.48	4,070	438,634		通信機器
CUMMINS INC	89.92	89.92	1,394	150,244		機械
DTE ENERGY CO	153.23	153.23	1,564	168,636		総合公益事業
EATON CORP PLC	239.5	239.5	1,884	203,054		電気設備
EXXON MOBIL CORP	733.11	733.11	3,269	352,372		石油・ガス・消耗燃料
GILEAD SCIENCES INC	—	294.44	2,159	232,721		バイオテクノロジー
HP INC	491.28	491.28	835	90,006		コンピュータ・周辺機器
CENTERPOINT ENERGY INC	1,177.52	1,177.52	1,992	214,717		総合公益事業
JOHNSON & JOHNSON	—	270.33	3,902	420,599		医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	301.21	165.28	2,309	248,908		家庭用品
LOCKHEED MARTIN CORP	118.09	118.09	4,357	469,610		航空宇宙・防衛
MCDONALD'S CORPORATION	413.08	413.08	7,617	820,949		ホテル・レストラン・レジャー
METLIFE INC	377.18	1,063.33	3,545	382,059		保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	912.34	597.02	3,350	361,080		半導体・半導体製造装置
MERCK & CO.INC.	1,086.11	1,086.11	8,294	893,911		医薬品
MICROSOFT CORP	347.09	347.09	6,369	686,435		ソフトウェア
PACWEST BANCORP	307.15	307.15	500	53,988		銀行
WELLS FARGO & CO	1,013.77	1,013.77	2,450	264,066		銀行
PACCAR INC	1,062.39	621.61	4,253	458,351		機械
PPL CORPORATION	893.92	893.92	2,292	247,106		電力
PFIZER INC	1,325.42	1,325.42	4,970	535,651		医薬品
ALTRIA GROUP INC	433.64	433.64	1,636	176,325		タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	852.83	852.83	9,602	1,034,900		家庭用品
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,009.41	640.1	3,181	342,848		食品
SOUTH JERSEY INDUSTRIES	441.41	441.41	1,205	129,963		ガス
TRUIST FINANCIAL CORP	1,195.07	1,195.07	3,978	428,750		銀行
AT&T INC	1,256.74	1,256.74	3,755	404,691		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	245.8	245.8	2,219	239,150		石油・ガス・消耗燃料
VALLEY NATIONAL BANCORP	1,286.38	1,286.38	972	104,806		銀行
LAS VEGAS SANDS CORP	528.45	528.45	2,478	267,100		ホテル・レストラン・レジャー
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	637.34	637.34	4,490	483,893		タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	369.16	369.16	2,230	240,377		化学
SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP	1,125.69	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
GENERAL MOTORS CO	—	710.63	1,846	198,966		自動車
ABBVIE INC	655.93	655.93	6,041	651,050		バイオテクノロジー
AVANGRID INC	361.59	361.59	1,481	159,615		電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,177.07 37銘柄	23,751.59 39銘柄	127,479 —	13,738,511 <45.5%>	

銘柄	期首(前期末)		当期		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		業種等		
			株数	株数		期末	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円		
FERROVIAL SA-RTS	739.38		—	—	—	建設・土木	
FERROVIAL SA-RTS	—		739.38	24	2,937	建設・土木	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,939.18 7銘柄	11,113.18 6銘柄	11,465 —	1,347,921 <4.5%>		
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	653.83		653.83	1,641	193,006	紙製品・林産品	
FORTUM OYJ	638.45		1,774.25	2,838	333,729	電力	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,292.28 2銘柄	2,428.08 2銘柄	4,480 —	526,735 <1.7%>		
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	172,391.28 93銘柄	130,966.32 87銘柄	— —	29,150,031 <96.6%>		

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

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

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

■投資信託財産の構成

2020年5月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	29,150,031	96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,021,207	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	30,171,238	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、29,459,312千円、97.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.77円、1カナダ・ドル=77.21円、1オーストラリア・ドル=70.73円、1香港・ドル=13.90円、1シンガポール・ドル=75.75円、1台湾・ドル=3.58円、1イギリス・ポンド=131.68円、1スイス・フラン=110.99円、1ノルウェー・クローネ=10.72円、1スウェーデン・クローナ=11.15円、1ユーロ=117.56円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月26日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	30,171,238,858円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	961,873,705
株 式(評価額)	29,150,031,548
未 収 配 当 金	59,333,605
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	30,171,238,858
元 本	13,092,092,972
次 期 繰 越 損 益 金	17,079,145,886
(D) 受 益 権 総 口 数	13,092,092,972口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,045円

(注1) 期首元本額 14,316,761,394円
追加設定元本額 336,835,930円
一部解約元本額 1,561,504,352円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A M世界好配当株オープン (毎月決算コース) 4,437,836,821円
D I A M世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 7,742,368,314円
D I A M世界好配当株式ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) 39,977,395円
D I A M世界6資産バランスファンド 84,351,777円
D I A Mグローバル・アクティブ・バランスファンド 119,990,215円
D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 393,209,852円
D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 274,358,598円
期末元本合計 13,092,092,972円

■損益の状況

当期 自2019年5月28日 至2020年5月26日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》

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

(2019年6月26日)