

# D I A M世界3資産オープン（毎月決算型）

## <愛称：ハッピーハーモニー>

追加型投信／海外／資産複合

### 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。

当ファンドは、実質的に外国債券、外国株式、外国不動産投資信託証券の3資産へ分散投資を行い、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。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。

作成対象期間 2022年11月9日～2023年5月8日

第186期	決算日：2022年12月8日	
第187期	決算日：2023年1月10日	
第188期	決算日：2023年2月8日	
第189期	決算日：2023年3月8日	
第190期	決算日：2023年4月10日	
第191期	決算日：2023年5月8日	
第191期末 (2023年5月8日)	基準価額	9,856円
	純資産総額	1,752百万円
第186期～ 第191期	騰落率	0.0%
	分配金合計	90円

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書(全体版)を電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書(全体版)は、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書(全体版)は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

### ■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)

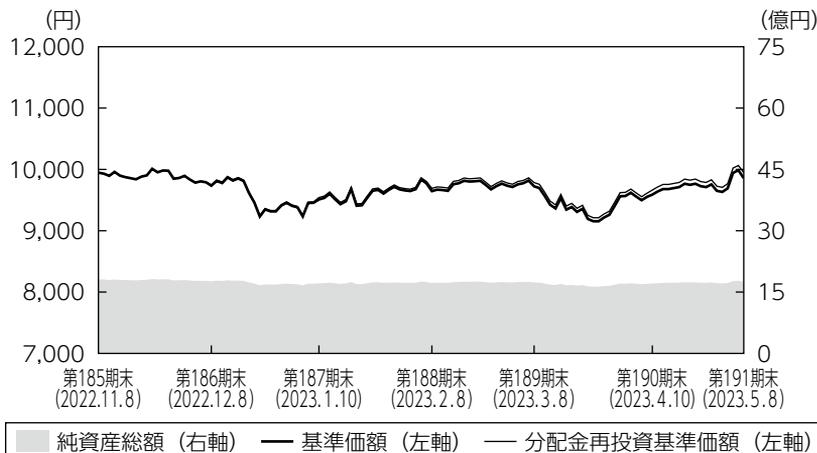
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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/>

## 運用経過の説明

### 基準価額等の推移



第186期首：9,946円  
 第191期末：9,856円  
 (既払分配金90円)  
 騰落率：0.0%  
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

日銀が2022年12月の金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を拡大したことや内外金利差の縮小等から主要通貨に対して円高が進んだことがマイナスに寄与しました。一方、インフレ鈍化により米国で利上げペース減速観測が強まったことや、米地方銀行の破綻等から金融不安が広がったことなどを背景に主要国の長期金利が低下（債券価格は上昇）したこと、米国の利上げペース減速観測や長期金利の低下を好感したことなどから外国リートが上昇したことがプラスに寄与し、基準価額は概ね横ばいとなりました。

### ◆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
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	△0.8%
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	3.0%
D I A M US・リート・オープン・マザーファンド	△4.3%
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	2.4%

## 1万口当たりの費用明細

項目	第186期～第191期 (2022年11月9日 ～2023年5月8日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	63円	
(投信会社)	(30)	(0.316)	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)	(29)	(0.305)	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	0.008	(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)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.003)	
(投資証券)	( 0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(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)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.002)	
(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)	(0.007)	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)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	65	0.674	

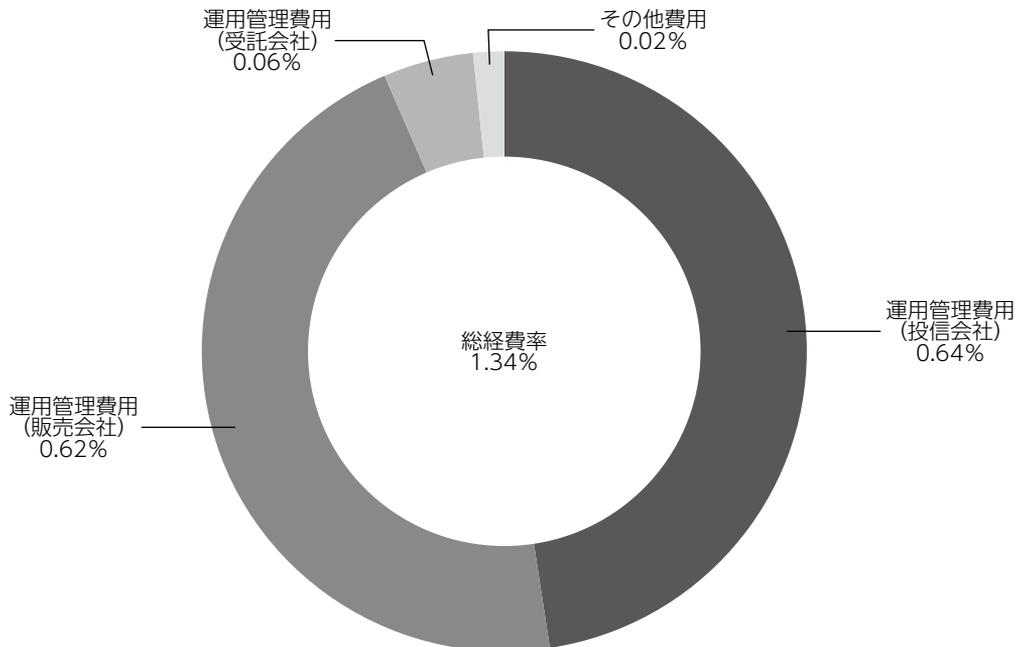
(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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1.34%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。

## 最近5年間の基準価額等の推移



- (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す。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2018年5月8日の基準価額に合わせて指数化しています。

		2018年5月8日 期首	2019年5月8日 決算日	2020年5月8日 決算日	2021年5月10日 決算日	2022年5月9日 決算日	2023年5月8日 決算日
基準価額 (分配落)	(円)	8,317	8,353	7,187	9,311	9,942	9,856
期間分配金合計 (税引前)	(円)	—	180	180	180	180	180
分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	2.6	△12.0	32.4	8.8	1.0
純資産総額	(百万円)	2,629	2,335	1,787	2,017	1,864	1,752

(注) 運用方針に合った適切な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。

## 投資環境

外国債券市場では、いずれの投資国でも国債利回りが低下しました。米国でのインフレ減速などから当局の積極的な金融引き締め姿勢が後退し、将来の利上げ幅の縮小や利上げ休止が意識されたこと、ここまでの積極的な利上げによる高金利が景気を下押しすると見込まれたこと、米地方銀行の破綻や欧州大手行の救済合併などから金融不安が広がったことなどが、主要国および投資国の国債利回りの低下要因となりました。

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

米国リート市場は上昇しました。作成期初からF R B（米連邦準備理事会）による利上げ緩和への期待感から上昇しました。作成期中ではF R B高官によるタカ派発言や、米地方銀行の破綻などを受けて上げ幅を縮小する局面もありましたが、米長期金利が低下したことなどから上昇しました。セクター別では、工業や倉庫などが大きく上昇しました。

米国以外の海外リート市場は、上昇しました。欧州市場はインフレの鎮静化期待や、中国経済正常化への期待などから上昇しました。アジア市場では中国でゼロコロナ政策が変更されたことなどを背景に、香港、シンガポールが上昇しました。オーストラリア市場では、同国中央銀行による利上げペース減速期待などから上昇しました。

ドル／円相場は、日銀が2022年12月の金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を拡大したことや、米国の利上げペース鈍化観測、内外金利差の縮小等を背景に、円高米ドル安の動きとなりました。その他主要通貨においては、利上げ観測により主要通貨に対してユーロが強含む中、ユーロ／円相場は円安ユーロ高となるなど、通貨によってまちまちの動きとなりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

マザーファンドを通じて外国債券、外国株式、外国リートの3資産に投資を行いました。また、組入れる3資産の保有比率が均等とな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、投資国および世界経済・インフレ見通し、主要国および投資国の金融政策を勘案して、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、主要国でインフレがピークアウトし、近い将来に利上げ休止されることや高金利による景気減速を見込み、作成期初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。

### ●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、ヘルスケアセクターや金融セクターに対する投資比率を高位に維持しました。

### ●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米長期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。ヘルスケア、住居施設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。

### ●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、イギリスやシンガポールなどの組入比率を引き上げた一方、カナダなどの組入比率を引き下げました。また、セクター別では、小売りなどの組入比率を引き上げた一方、複合などの組入比率を引き下げました。

## 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186期	第187期	第188期	第189期	第190期	第191期
	2022年11月9日 ～2022年12月8日	2022年12月9日 ～2023年1月10日	2023年1月11日 ～2023年2月8日	2023年2月9日 ～2023年3月8日	2023年3月9日 ～2023年4月10日	2023年4月11日 ～2023年5月8日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.15%	0.16%	0.16%	0.15%	0.16%	0.15%
当期の収益	12円	15円	11円	15円	15円	15円
当期の収益以外	2円	-円	3円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,204円	1,209円	1,206円	1,215円	1,226円	1,237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

今後も各資産の保有比率が均等になるように各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率につきましては、高位組入れを維持します。

### ●D I AM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、主要国および投資国の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、各国の金融政策を巡る思惑や企業業績への懸念などから短期的には不安定な相場展開が想定され、銘柄選択の重要性がより高まると考えます。配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄を選別する運用方針を継続します。

● D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

経済活動の正常化が進む一方で、インフレの進行や金利の上昇により米国経済の成長鈍化懸念が強まっており、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。

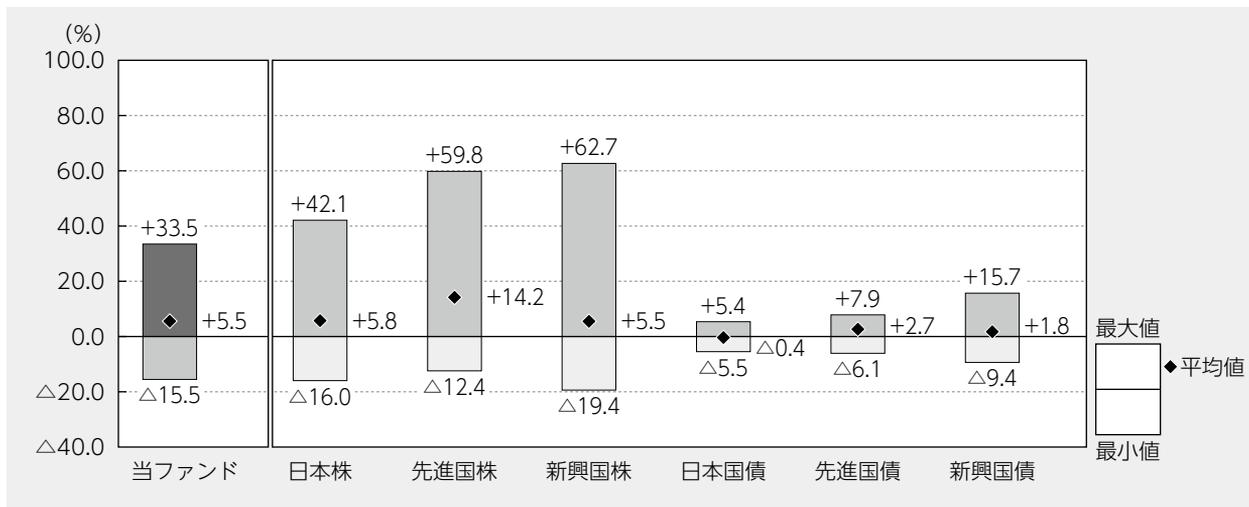
● D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

世界的なインフレの進行や金利上昇に対する警戒感から、リート市場は不安定な展開になることが予想されます。こうした中、欧州市場は、工業、住居施設など、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。オーストラリア市場は、住居施設や工業、小売り等のうち財務体質や成長性、配当利回りなどで選別し投資する方針です。アジア市場は、優れた収益成長見通しと健全な資本管理を持つ銘柄を選別し投資を行っていく方針です。

## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／海外／資産複合	
信託期間	2007年6月22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めざして運用を行います。	
主要投資対象	D I A M 世界3資産オープン（毎月決算型）	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	高格付資源国の公社債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。
	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	<p>各マザーファンドの受益証券への投資を通じ、実質的に外国債券、外国株式、外国不動産投資信託証券の3資産へ分散投資を行います。</p> <p>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。</p> <p>各資産への投資は、原則として3分の1を基本資産配分比率とし、各マザーファンド受益証券を通じて行います。ただし、外国不動産投資信託証券への投資については、D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド受益証券およびD I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド受益証券の純資産総額を合算して資産配分を算出します。なお、時価変動等により各マザーファンド受益証券の時価構成比率が基本資産配分比率から乖離した場合は、原則として定期的に基本資産配分比率に近づけるものとします。</p> <p>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。</p>	
分配方針	<p>決算日（原則として毎月8日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。原則として、利子配当等収益を中心に安定的に分配を行うことをめざし、売買益（評価益を含みます。）等については、決算時の基準価額水準を勘案して分配することとします。なお、原則として四半期毎（2月、5月、8月、11月）の決算時には、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うこととします。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。</p>	

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較



2018年5月～2023年4月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

### \*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※各指数については後掲の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

## 当ファンドのデータ

### 当ファンドの組入資産の内容（2023年5月8日現在）

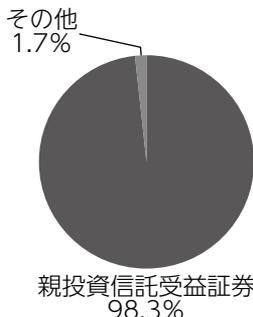
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

	第191期末
	2023年5月8日
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	34.3%
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	33.8
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	18.9
D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド	11.3
その他	1.7

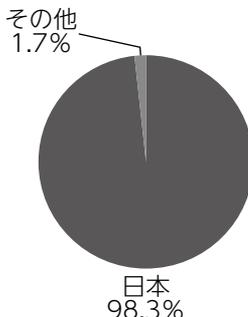
(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

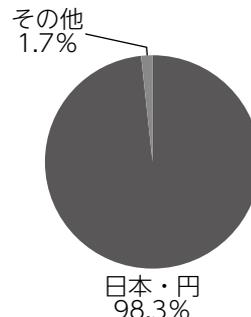
#### ◆資産別配分



#### ◆国別配分



#### ◆通貨別配分



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

### 純資産等

項目	第186期末	第187期末	第188期末	第189期末	第190期末	第191期末
	2022年12月8日	2023年1月10日	2023年2月8日	2023年3月8日	2023年4月10日	2023年5月8日
純資産総額	1,763,286,442円	1,713,870,509円	1,724,087,400円	1,736,019,144円	1,707,442,123円	1,752,504,755円
受益権総口数	1,811,491,434口	1,802,082,408口	1,787,313,139口	1,785,171,912口	1,780,677,952口	1,778,178,402口
1万口当たり基準価額	9,734円	9,511円	9,646円	9,725円	9,589円	9,856円

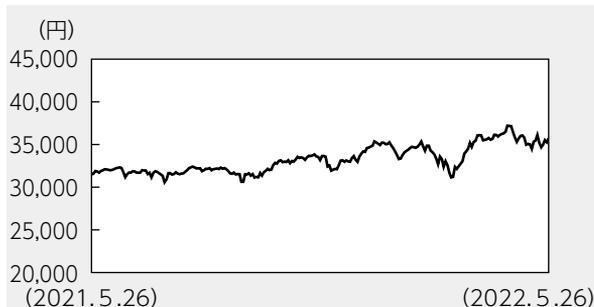
(注) 当作成期間（第186期～第191期）中における追加設定元本額は14,965,516円、同解約元本額は55,423,162円です。

## 組入ファンドの概要

[D I AM世界好配当株オープン・マザーファンド]

(計算期間 2021年5月27日～2022年5月26日)

### ◆基準価額の推移



### ◆組入上位10銘柄

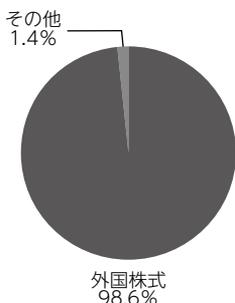
銘柄名	通貨	比率
MCDONALD'S CORPORATION	アメリカ・ドル	3.6%
MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	3.2
METLIFE INC	アメリカ・ドル	2.9
MERCK & CO.INC.	アメリカ・ドル	2.8
MASTERCARD INC	アメリカ・ドル	2.7
NOVARTIS AG-REG SHS	スイス・フラン	2.4
CHEVRON CORP	アメリカ・ドル	2.4
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ・ドル	2.3
GSK PLC	イギリス・ポンド	2.2
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ユーロ	2.2
組入銘柄数	82銘柄	

### ◆1万口当たりの費用明細

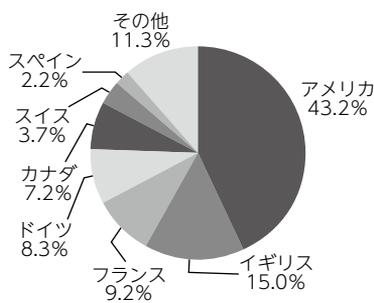
項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株式)	13円 (13)	0.038% (0.038)
(b) 有価証券取引税 (株式)	9 ( 9)	0.026 (0.026)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	6 ( 6) ( 0)	0.019 (0.018) (0.001)
合計	28	0.084

期中の平均基準価額は33,264円です。

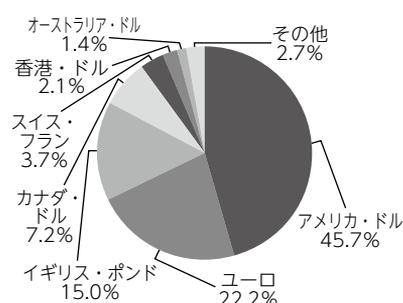
### ◆資産別配分



### ◆国別配分



### ◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 「1万口当たりの費用明細」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 国別配分は、発行国(地域)を表示しています。

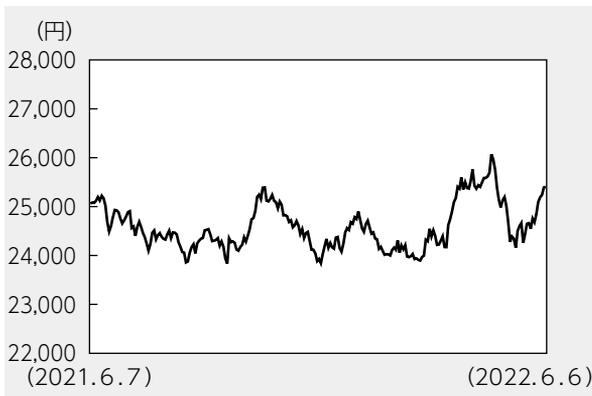
(注6) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

(注7) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注8) 計算期間中の運用経過や組入銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

【DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド】（計算期間 2021年6月8日～2022年6月6日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄

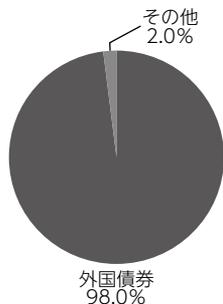
銘柄名	通貨	比率
CANADA 1.0 09/01/22	カナダ・ドル	6.0%
CANADA 2.0 12/01/51	カナダ・ドル	4.2
CANADA 0.25 11/01/22	カナダ・ドル	3.5
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	オーストラリア・ドル	3.0
CANADA 0.5 09/01/25	カナダ・ドル	2.9
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	オーストラリア・ドル	2.7
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	オーストラリア・ドル	2.7
CANADA 1.25 06/01/30	カナダ・ドル	2.4
NORWAY 1.75 09/06/29	ノルウェー・クローネ	2.4
CANADA 0.25 05/01/23	カナダ・ドル	2.3
組入銘柄数	75銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

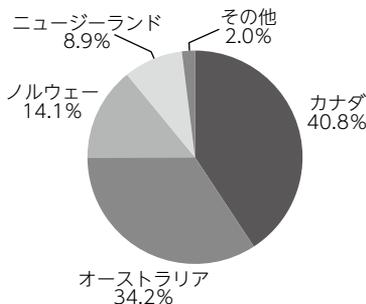
項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用 (保管費用) (その他)	2円 (2) (0)	0.010% (0.009) (0.000)
合計	2	0.010

期中の平均基準価額は24,592円です。

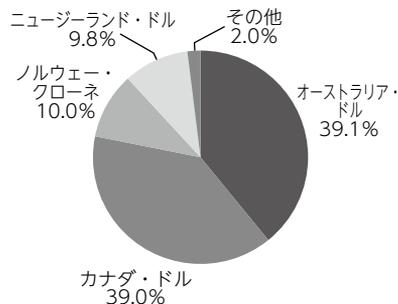
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものです。

(注2) 「1万口当たりの費用明細」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

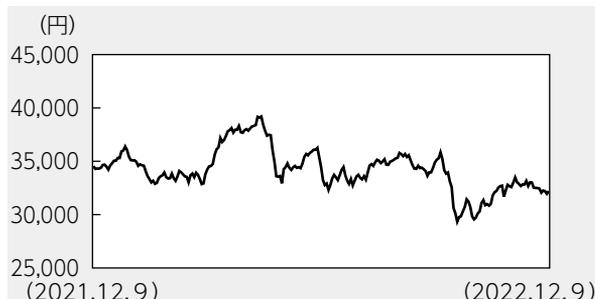
(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注6) 国別配分は、発行国（地域）を表示しています。また、国際機関の発行する債券については「国際機関」と表示しています。

(注7) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

[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] (計算期間 2021年12月10日~2022年12月9日)

◆基準価額の推移



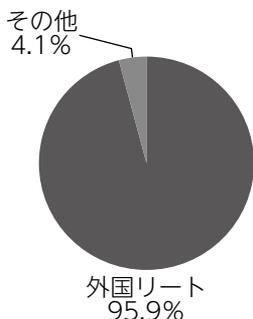
◆組入上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
WAREHOUSES DE PAUW	ユーロ	7.5%
GOODMAN PROPERTY TRUST	ニュージーランド・ドル	5.9
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	カナダ・ドル	5.5
CANADIAN APT PPTYS REIT	カナダ・ドル	5.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	オーストラリア・ドル	5.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	カナダ・ドル	4.9
VICINITY CENTRES	オーストラリア・ドル	4.8
SEGRO PLC	イギリス・ポンド	4.5
NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア・ドル	4.4
UNITE GROUP PLC	イギリス・ポンド	4.3
組入銘柄数	32銘柄	

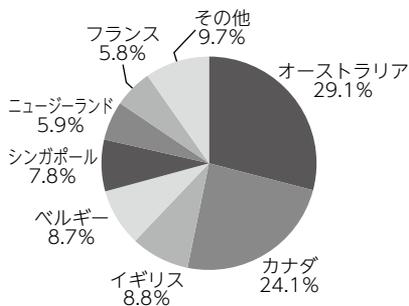
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券)	5円 ( 4 ) ( 1 )	0.014% (0.011) (0.002)
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券)	5 ( 0 ) ( 5 )	0.014 (0.001) (0.014)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	8 ( 6 ) ( 2 )	0.024 (0.019) (0.005)
合計	18	0.052
期中の平均基準価額は34,197円です。		

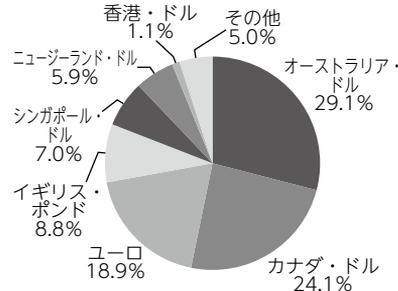
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分

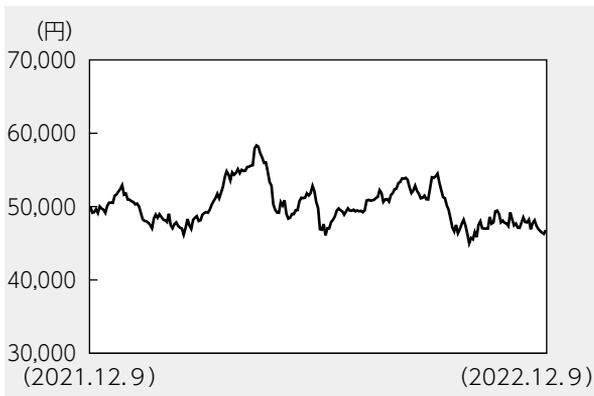


- (注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のもので、  
(注2) 「1万口当たりの費用明細」期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。  
(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のもので、  
(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。  
(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。  
(注6) 国別配分は、発行国(地域)を表示しています。  
(注7) 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。  
(注8) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

【DIAM US・リート・オープン・マザーファンド】

（計算期間 2021年12月10日～2022年12月9日）

◆基準価額の推移



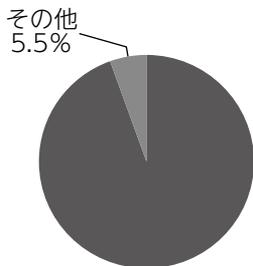
◆組入上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
PROLOGIS INC	アメリカ・ドル	7.1%
PUBLIC STORAGE	アメリカ・ドル	5.1
EQUINIX INC	アメリカ・ドル	4.7
AMERICAN TOWER CORP	アメリカ・ドル	4.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ・ドル	4.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ・ドル	3.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ・ドル	3.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	アメリカ・ドル	3.7
TERRENO REALTY CORP	アメリカ・ドル	3.4
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	アメリカ・ドル	3.3
組入銘柄数	38銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

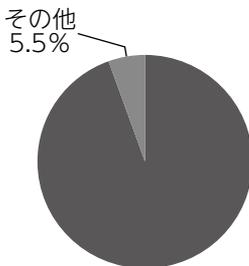
項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (投資証券)	17円 (17)	0.034% (0.034)
(b) その他費用 (保管費用) (その他)	7 (6) (1)	0.015 (0.012) (0.003)
合計	25	0.049
期中の平均基準価額は50,088円です。		

◆資産別配分



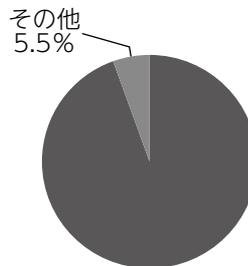
外国リート  
94.5%

◆国別配分



アメリカ  
94.5%

◆通貨別配分



アメリカ・ドル  
94.5%

(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものです。

(注2) 「1万口当たりの費用明細」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注6) 国別配分は、発行国（地域）を表示しています。

(注7) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

## <代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(このページは白紙です)

(このページは白紙です)

