

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218期	<決算日	2024年1月26日>
第219期	<決算日	2024年2月26日>
第220期	<決算日	2024年3月26日>
第221期	<決算日	2024年4月26日>
第222期	<決算日	2024年5月27日>
第223期	<決算日	2024年6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世界インカム・オープン（毎月決算コース）」は、2024年6月26日に第223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

<https://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・証券組入率	純資産額
		(分配落)	税金込み	期中騰落率						
第34作成期	194期(2022年1月26日)	円 9,239	円 20	% △3.1	% 24.4	% -	% 49.2	% -	% 23.1	百万円 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
第35作成期	200期(2022年7月26日)	9,752	20	2.9	24.7	-	50.1	-	22.0	3,766
	201期(2022年8月26日)	9,716	20	△0.2	25.3	-	48.4	-	22.2	3,734
	202期(2022年9月26日)	9,237	20	△4.7	24.4	-	50.1	-	21.2	3,520
	203期(2022年10月26日)	9,488	20	2.9	25.8	-	48.8	-	21.1	3,607
	204期(2022年11月28日)	9,616	20	1.6	25.8	-	48.3	-	21.4	3,638
	205期(2022年12月26日)	8,978	20	△6.4	25.4	-	49.0	-	21.4	3,379
第36作成期	206期(2023年1月26日)	9,245	20	3.2	25.0	-	49.3	-	21.8	3,479
	207期(2023年2月27日)	9,308	20	0.9	24.5	-	49.1	-	22.1	3,485
	208期(2023年3月27日)	8,857	20	△4.6	24.0	-	51.1	-	20.6	3,306
	209期(2023年4月26日)	9,236	20	4.5	25.2	-	49.2	-	21.7	3,439
	210期(2023年5月26日)	9,285	20	0.7	24.7	-	49.5	-	21.6	3,443
	211期(2023年6月26日)	9,638	20	4.0	25.2	-	49.6	-	21.4	3,556
第37作成期	212期(2023年7月26日)	9,784	20	1.7	24.7	-	48.8	-	22.8	3,576
	213期(2023年8月28日)	9,605	20	△1.6	24.4	-	48.8	-	22.5	3,506
	214期(2023年9月26日)	9,596	20	0.1	24.5	-	48.9	-	22.5	3,484
	215期(2023年10月26日)	9,238	20	△3.5	25.1	-	49.3	-	22.0	3,333
	216期(2023年11月27日)	9,818	20	6.5	24.8	-	48.7	-	23.1	3,508
	217期(2023年12月26日)	9,989	20	1.9	24.0	-	48.7	-	23.8	3,532
第38作成期	218期(2024年1月26日)	10,092	20	1.2	24.5	-	48.3	-	23.8	3,542
	219期(2024年2月26日)	10,295	20	2.2	24.7	-	48.4	-	24.1	3,528
	220期(2024年3月26日)	10,431	20	1.5	24.6	-	48.5	-	23.2	3,542
	221期(2024年4月26日)	10,413	20	0.0	24.5	-	48.9	-	22.6	3,506
	222期(2024年5月27日)	10,748	20	3.4	24.5	-	49.0	-	23.0	3,601
	223期(2024年6月26日)	11,018	20	2.7	24.5	-	48.8	-	23.2	3,643

(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 証 券 組 入 率 比
		円	騰 落 率					
第218期	(期 首) 2023年12月26日	9,989	—	24.0	—	48.7	—	23.8
	12 月 末	10,065	0.8	23.9	—	48.8	—	23.9
	(期 末) 2024年1月26日	10,112	1.2	24.5	—	48.3	—	23.8
第219期	(期 首) 2024年1月26日	10,092	—	24.5	—	48.3	—	23.8
	1 月 末	10,146	0.5	24.5	—	48.4	—	23.8
	(期 末) 2024年2月26日	10,315	2.2	24.7	—	48.4	—	24.1
第220期	(期 首) 2024年2月26日	10,295	—	24.7	—	48.4	—	24.1
	2 月 末	10,233	△0.6	24.2	—	48.3	—	24.0
	(期 末) 2024年3月26日	10,451	1.5	24.6	—	48.5	—	23.2
第221期	(期 首) 2024年3月26日	10,431	—	24.6	—	48.5	—	23.2
	3 月 末	10,491	0.6	24.6	—	48.3	—	23.4
	(期 末) 2024年4月26日	10,433	0.0	24.5	—	48.9	—	22.6
第222期	(期 首) 2024年4月26日	10,413	—	24.5	—	48.9	—	22.6
	4 月 末	10,535	1.2	24.6	—	48.7	—	22.6
	(期 末) 2024年5月27日	10,768	3.4	24.5	—	49.0	—	23.0
第223期	(期 首) 2024年5月27日	10,748	—	24.5	—	49.0	—	23.0
	5 月 末	10,676	△0.7	24.4	—	48.4	—	23.1
	(期 末) 2024年6月26日	11,038	2.7	24.5	—	48.8	—	23.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

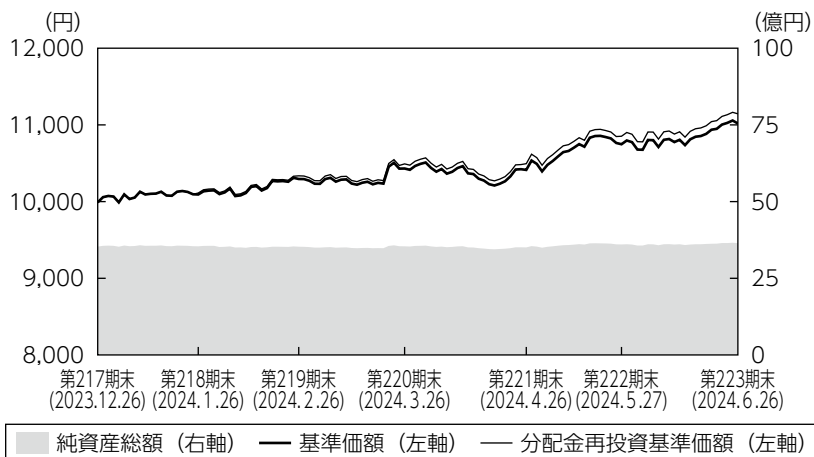
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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218期～第223期の運用経過（2023年12月27日から2024年6月26日まで）

基準価額等の推移



第218期首：9,989円
 第223期末：11,018円
 (既払分配金120円)
 騰落率：11.6%
 (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

金融政策正常化の動きやそれに伴う需給懸念等を背景に主要国の長期金利が上昇したこと、長期金利の上昇等が嫌気されて外国リートが下落したことがマイナスに寄与した一方、日銀による緩和的な金融政策の継続が意識されたことや米経済のソフトランディング（軟着陸）期待等から主要通貨に対して円安となったこと、米国の底堅い景況感や主要企業の良好な決算が好感されたことや、米欧の利下げ観測等を背景に外国株式市場が上昇した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	9.9%
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	21.3%
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	9.5%
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	8.8%

投資環境

外国債券市場では、全ての投資国の10年国債利回りが上昇（価格は下落）しました。米国では2023年末にかけて早期に利下げが開始されるとの見通しが強まる形で国債利回りの低下（価格は上昇）が進みましたが、2024年に入ると米国の雇用や物価関連の指標が市場予想を上回り、早期利下げ観測が後退したことで利回りは上昇に転じました。こうした中、投資国の国債利回りも米国の動きに概ね連れる形で上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。主要各国におけるインフレの高止まりや中東の情勢などから一時下落する局面もありましたが、中国当局の経済対策による景気回復期待や、半導体関連など米国主要企業の決算が堅調なことなどを背景に大手ハイテク関連株が好調に推移し、外国株式市場は概ね上昇基調で推移しました。

米国リート市場は下落しました。作成期初こそFRB（米連邦準備理事会）による利下げ期待から上昇しましたが、2024年に入ると堅調な経済指標やCPI（消費者物価指数）の上振れなどを受けて、過度な利下げ観測が後退すると下落に転じました。セクター別では、工業やホテル・リゾートなどが下落しました。

米国以外のリート市場については、概ね下落する展開となりました。欧州リート市場は、2024年6月にECB（欧州中央銀行）が利下げを行いました。米国での利下げ期待の後退などを受けて下落しました。一方で、オーストラリアリート市場は、利下げ観測や消費減税への期待などを受けて上昇しました。アジアリート市場では、中国景気への懸念などから香港やシンガポールが下落しました。

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、米国の利下げ観測が円高ドル安材料となった一方、日銀による緩和的な金融政策の継続が意識されたことや米経済のソフトランディング期待等の円安ドル高材料が優勢となり、円安ドル高となりました。その他主要通貨においても、日銀による緩和的な金融政策の継続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、投資国および世界経済見通し、主要国および投資国のインフレ動向や金融政策を勘案して、調整を行いました。当作成期末のデュレーションは、インフレの止まりから高金利政策が長期化することを見込み、前作成期末と比較して短期化しました。

*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、情報技術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。

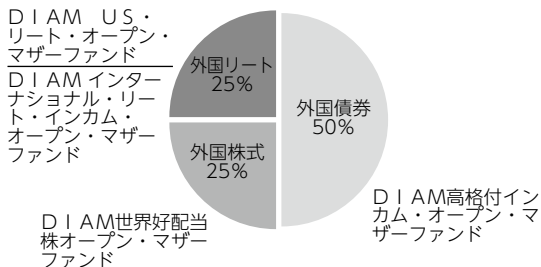
●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

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。その他や工業などの組入比率を引き上げた一方、小売り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。国・地域別では、香港やイギリスなどの組入比率を引き上げた一方、ベルギー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、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、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



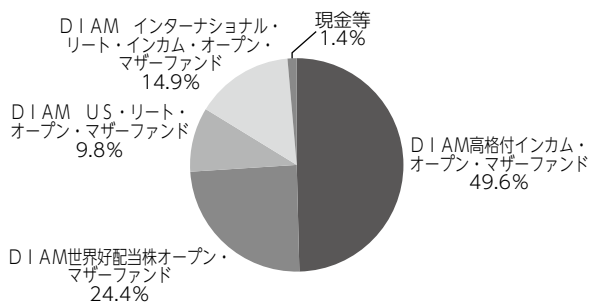
*基本資産配分比率は、市場動向等により変更する場合があります。

*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。

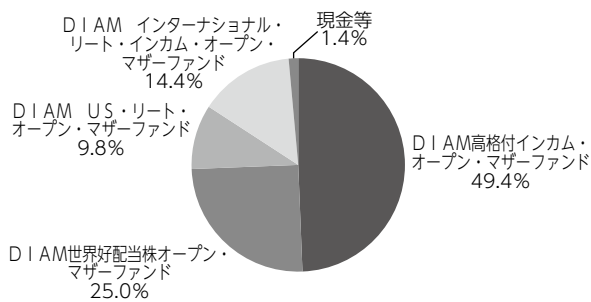
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

前作成期末



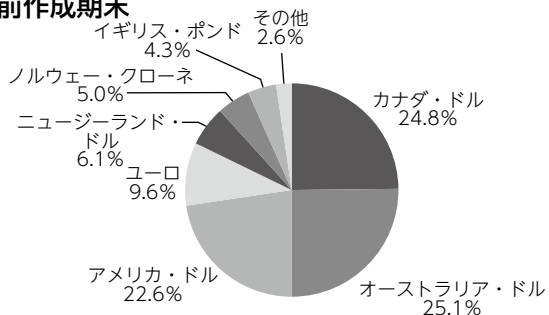
当作成期末



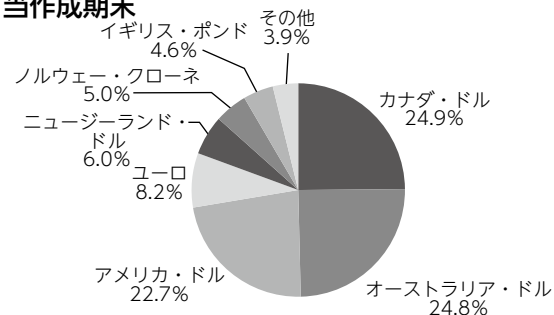
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○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218期	第219期	第220期	第221期	第222期	第223期
	2023年12月27日 ~2024年1月26日	2024年1月27日 ~2024年2月26日	2024年2月27日 ~2024年3月26日	2024年3月27日 ~2024年4月26日	2024年4月27日 ~2024年5月27日	2024年5月28日 ~2024年6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	0.20%	0.19%	0.19%	0.19%	0.19%	0.18%
当期の収益	20円	20円	20円	14円	20円	20円
当期の収益以外	-円	-円	-円	5円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	530円	531円	640円	634円	957円	1,227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。デフレ抑制については、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も想定され、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

米国では、CPIの上振れなどを受けて2024年の利下げ期待が後退し、年初から長期金利が上昇しています。また、業績見通しを下方修正したリートもあり、足元では金利の高止まりや不動産ファンダメンタルズに対する懸念が高まっています。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

ECBでは利下げが始まりましたが、リート市場においてオフィスなどでは引き続き厳しいファンダメンタルズが予想されます。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。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218期～第223期		項目の概要
	(2023年12月27日 ～2024年6月26日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	68円	0.656%	(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10,410円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(36)	(0.350)	
(販売会社)	(28)	(0.273)	
(受託会社)	(3)	(0.033)	
(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	1	0.005	(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)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.004)	
(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 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.007)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.002)	
合計	71	0.679	

(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。

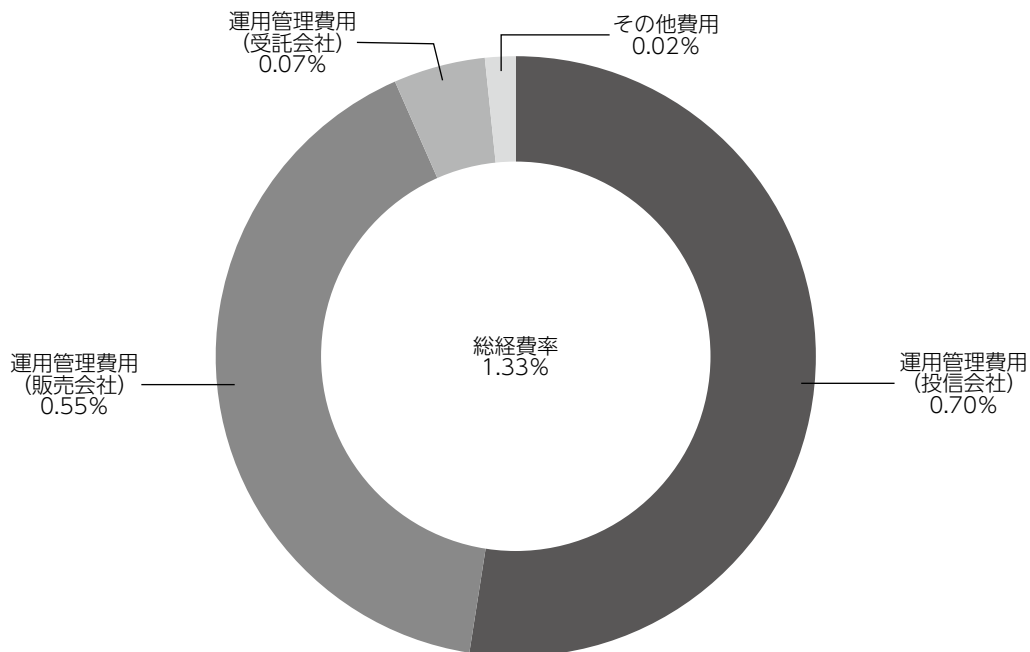
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2023年12月27日から2024年6月26日まで）

	第 218 期 ~ 第 223 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	—	—	42,899	120,000
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	24,971	120,000
D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	3,664	20,000
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	—	—	11,984	45,000

■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 218 期 ~ 第 223 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	11,462,006千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	38,453,822千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.29

(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（2023年12月27日から2024年6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 37 作 成 期 末	第 38 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	651,913	609,014	1,798,844
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	195,537	170,566	911,540
D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	65,803	62,138	356,686
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	144,757	132,772	524,146

<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 (33,718,638,789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	2024 年 6 月 26 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 350,700	千カナダ・ドル 337,132	千円 39,417,539	% 39.6	% -	% 18.5	% 6.9	% 14.2
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 411,000	千オーストラリア・ドル 371,060	千円 39,365,816	39.5	-	25.2	6.7	7.7
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 120,500	千ニュージーランド・ドル 101,379	千円 9,909,893	10.0	-	6.5	2.3	1.2
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 692,000	千ノルウェー・クローネ 642,716	千円 9,660,031	9.7	-	6.6	1.7	1.3
合 計	-	-	千円 98,353,280	98.8	-	56.8	17.7	24.3

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6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) 組入比率は、2024年6月26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	2024 年 6 月 26 日 現 在						償 還 年 月 日
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				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 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	47,000	44,183	5,165,920	2026/03/01	
CANADA 3.75 05/01/25	国債証券	3.7500	72,000	71,585	8,369,756	2025/05/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	10,900	12,878	1,505,776	2033/06/01	
CANADA 5.00 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,527	997,044	2037/06/01	
CANADA 4.00 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,419	633,629	2041/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	44,000	39,050	4,565,818	2030/06/01	
CANADA 1.50 06/01/31	国債証券	1.5000	14,000	12,394	1,449,197	2031/06/01	
CANADA 2.00 06/01/32	国債証券	2.0000	20,000	18,100	2,116,327	2032/06/01	
CANADA 3.25 09/01/28	国債証券	3.2500	39,000	38,696	4,524,441	2028/09/01	
CANADA 3.50 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,334	1,442,135	2045/12/01	
CANADA 2.00 12/01/51	国債証券	2.0000	12,000	9,222	1,078,285	2051/12/01	
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	7,500	5,357	626,373	2053/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,506	526,946	2064/12/01	
CANADA 3.25 12/01/33	国債証券	3.2500	30,000	29,707	3,473,401	2033/12/01	
KOMBANK 4.90 10/05/26	特殊債券	4.9000	20,000	20,325	2,376,414	2026/10/05	

銘 柄	2024 年 6 月 26 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	
CANHOU 1.95 12/15/25	特 殊 債 券	1.9500	5,000	4,841	566,068	2025/12/15
小 計	—	—	350,700	337,132	39,417,539	—
(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	10,000	7,765	823,878	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国 債 証 券	3.2500	26,000	25,779	2,734,966	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国 債 証 券	4.7500	8,000	8,174	867,201	2027/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国 債 証 券	3.2500	13,000	12,613	1,338,148	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国 債 証 券	3.7500	8,000	7,569	803,075	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国 債 証 券	2.5000	43,000	39,665	4,208,059	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国 債 証 券	2.7500	4,000	3,181	337,492	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国 債 証 券	1.2500	26,000	20,999	2,227,858	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国 債 証 券	3.7500	7,000	6,746	715,766	2034/05/21
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	国 債 証 券	4.7500	4,000	4,114	436,554	2054/06/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国 債 証 券	3.2500	5,000	4,373	464,018	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国 債 証 券	2.7500	11,000	9,570	1,015,314	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国 債 証 券	1.7500	12,000	6,735	714,583	2051/06/21
AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	国 債 証 券	4.2500	15,000	15,069	1,598,741	2034/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国 債 証 券	2.7500	3,000	2,825	299,737	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国 債 証 券	3.0000	8,000	7,268	771,097	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国 債 証 券	1.0000	30,000	24,124	2,559,417	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国 債 証 券	0.2500	26,000	25,583	2,714,145	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国 債 証 券	1.0000	17,000	14,091	1,494,946	2030/12/21
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国 債 証 券	3.5000	10,000	9,393	996,537	2034/12/21
NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36	地 方 債 証 券	4.2500	14,000	12,915	1,370,210	2036/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29	地 方 債 証 券	3.0000	23,000	21,707	2,302,918	2029/04/20
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地 方 債 証 券	1.7500	6,500	5,222	554,104	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地 方 債 証 券	3.7000	11,000	10,816	1,147,569	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地 方 債 証 券	1.7500	4,000	3,443	365,276	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地 方 債 証 券	2.5000	16,000	13,548	1,437,360	2032/10/22
TREASURY CORP VICTORIA 4.25 12/20/32	地 方 債 証 券	4.2500	9,000	8,640	916,713	2032/12/20
KOMBNK 4.35 01/18/28	特 殊 債 券	4.3500	10,000	9,939	1,054,450	2028/01/18
KOMBNK 4.4 02/17/26	特 殊 債 券	4.4000	10,000	9,966	1,057,322	2026/02/17
NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特 殊 債 券	2.3350	4,500	3,480	369,213	2036/06/30
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特 殊 債 券	1.4650	7,000	5,722	607,127	2031/08/18
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28	特 殊 債 券	4.5000	10,000	10,010	1,062,005	2028/09/06
小 計	—	—	411,000	371,060	39,365,816	—
(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	6,000	5,989	585,514	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国 債 証 券	3.5000	10,000	9,269	906,091	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国 債 証 券	2.7500	11,000	8,933	873,276	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国 債 証 券	3.0000	7,500	7,045	688,737	2029/04/20

銘 柄	2024 年 6 月 26 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 2.75 05/15/51	国 債 証 券	2.7500	11,000	7,497	732,855	2051/05/15
NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	国 債 証 券	5.0000	4,000	4,052	396,177	2054/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国 債 証 券	1.7500	23,000	14,810	1,447,757	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国 債 証 券	1.5000	4,000	3,302	322,790	2031/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国 債 証 券	2.0000	10,000	8,363	817,536	2032/05/15
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,703	166,529	2028/05/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28	地 方 債 証 券	2.2500	10,000	9,103	889,862	2028/05/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 4.5 05/15/30	地 方 債 証 券	4.5000	7,000	6,885	673,052	2030/05/15
HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30	特 殊 債 券	2.1830	3,000	2,603	254,506	2030/04/24
KOMBANK 4.0 08/20/25	特 殊 債 券	4.0000	12,000	11,817	1,155,203	2025/08/20
小 計	—	—	120,500	101,379	9,909,893	—
(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	90,000	86,475	1,299,724	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国 債 証 券	1.7500	72,000	68,497	1,029,518	2027/02/17
NORWAY 2.0 04/26/28	国 債 証 券	2.0000	50,000	47,182	709,152	2028/04/26
NORWAY 3.625 04/13/34	国 債 証 券	3.6250	45,000	45,261	680,280	2034/04/13
NORWAY 2.125 05/18/32	国 債 証 券	2.1250	70,000	63,059	947,780	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国 債 証 券	1.3750	85,000	74,752	1,123,535	2030/08/19
NORWAY 3.0 08/15/33	国 債 証 券	3.0000	95,000	90,810	1,364,874	2033/08/15
NORWAY 1.75 09/06/29	国 債 証 券	1.7500	70,000	64,001	961,940	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国 債 証 券	1.2500	85,000	72,522	1,090,018	2031/09/17
NORWAY 3.5 10/06/42	国 債 証 券	3.5000	30,000	30,153	453,206	2042/10/06
小 計	—	—	692,000	642,716	9,660,031	—
合 計	—	—	-	-	98,353,280	—

■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（7,852,310,230口）の内容です。

外国株式

銘柄	2023年12月26日現在		2024年6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	—	204.77	3,534	564,715	情報技術サービス	
AMGEN INC	54.23	41.34	1,320	210,914	バイオテクノロジー	
APPLE INC	289.22	149.73	3,130	500,176	コンピュータ・周辺機器	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	146.65	101.29	427	68,280	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	376	299.68	5,935	948,416	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	781.14	368.59	1,746	279,036	通信機器	
BANK OF AMERICA CORP	449.28	449.28	1,769	282,693	銀行	
EATON CORP PLC	196.05	196.05	6,327	1,011,041	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	771.56	656.69	4,792	765,749	電力	
GILEAD SCIENCES INC	164.97	101.52	706	112,913	バイオテクノロジー	
JOHNSON & JOHNSON	155.46	155.46	2,288	365,611	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	299.81	260.01	3,599	575,057	家庭用品	
LAM RESEARCH CORP	56.75	56.75	5,975	954,718	半導体・半導体製造装置	
MCDONALD'S CORPORATION	193.52	38.06	979	156,518	ホテル・レストラン・レジャー	
MERCK & CO.INC.	201.18	261.32	3,473	554,990	医薬品	
MICROSOFT CORP	284.07	300.79	13,564	2,167,275	ソフトウェア	
3M CO	222.9	283.03	2,888	461,495	コンプロマリット	
PAYCHEX INC	524.48	—	—	—	専門サービス	
PPL CORPORATION	577.29	577.29	1,604	256,425	電力	
PEPSICO INC	196.56	143.16	2,395	382,798	飲料	
PFIZER INC	475.45	475.45	1,330	212,632	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	91.51	91.51	1,526	243,959	家庭用品	
AT&T INC	2,394.41	2,394.41	4,475	715,039	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	323.7	383.91	6,083	972,011	石油・ガス・消耗燃料	
STARBUCKS CORP	574.76	102.14	809	129,384	ホテル・レストラン・レジャー	
CME GROUP INC	369.05	347.32	6,741	1,077,153	資本市場	
TRANSDIGM GROUP INC	—	24.22	3,197	510,962	航空宇宙・防衛	
MASTERCARD INC	107.45	113.39	5,166	825,521	金融サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	669.41	669.41	6,830	1,091,402	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,815	449,908	化学	
ABBVIE INC	188.43	334.65	5,714	913,006	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	102.66	93.3	14,748	2,356,558	半導体・半導体製造装置	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,532.86 30銘柄	9,969.43 31銘柄	125,900 —	20,116,370 <47.9%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	376.1	445.77	4,838	565,756	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	573.6	573.6	3,798	444,106	銀行	
RUSSEL METALS INC	1,406.01	1,406.01	5,179	605,615	商社・流通業	
CAPITAL POWER CORP	842.72	842.72	3,374	394,517	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>	3,198.43 4銘柄	3,268.1 4銘柄	17,191 —	2,009,995 <4.8%>	

銘柄	2023年12月26日現在		2024年6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	
(オーストラリア) BHP GROUP LTD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	百株 743.7 134.38	百株 743.7 134.38	千オーストラリア・ドル 3,221 375	千円 341,791 39,860	金属・鉱業 石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	878.08 2銘柄	878.08 2銘柄	3,597 -	381,651 <0.9%>
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	百株 7,280 24,480 -	百株 12,690 28,140 2,656	千香港・ドル 30,709 30,222 21,394	千円 628,322 618,349 437,722	銀行 建設・土木 繊維・アパレル・贅沢品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31,760 2銘柄	43,486 3銘柄	82,326 -	1,684,394 <4.0%>
(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 4,038	千円 476,316	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	4,038 -	476,316 <1.1%>
(イギリス) NATIONAL GRID PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC IMPERIAL BRANDS PLC UNILEVER PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC RIO TINTO PLC SSE PLC BP PLC 3I GROUP PLC GSK PLC	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 264.5 2,153.01 453.25 854.22 5,964.93 829.3 2,235.93	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 264.5 2,153.01 453.25 -	千イギリス・ポンド 2,456 1,127 2,375 1,171 2,165 2,374 -	千円 497,957 228,641 481,496 237,403 439,033 481,326 -	総合公益事業 タバコ タバコ パーソナルケア用品 水道 金属・鉱業 電力 石油・ガス・消耗燃料 資本市場 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,104.39 10銘柄	16,360.72 9銘柄	20,987 -	4,254,216 <10.1%>
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 86.78 607.3	百株 51.98 624.38	千スイス・フラン 1,317 5,987	千円 234,996 1,068,172	医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	694.08 2銘柄	676.36 2銘柄	7,304 -	1,303,169 <3.1%>
(デンマーク) NOVO NORDISK A/S-B	百株 243.84	百株 348.52	千デンマーク・クローネ 35,827	千円 821,891	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	243.84 1銘柄	348.52 1銘柄	35,827 -	821,891 <2.0%>
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 2,475.68	百株 2,475.68	千スウェーデン・クローナ 26,167	千円 397,752	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,475.68 1銘柄	2,475.68 1銘柄	26,167 -	397,752 <0.9%>
(ユーロ…オランダ) FERROVIAL SE	百株 1,029	百株 1,029	千ユーロ 3,770	千円 645,015	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,029 1銘柄	1,029 1銘柄	3,770 -	645,015 <1.5%>
(ユーロ…フランス) AXA SA	百株 1,500.56	百株 1,692.38	千ユーロ 5,205	千円 890,601	保険

銘柄	2023年12月26日現在		2024年6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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DANONE	336.69	160.31	932	159,508	食品
BNP PARIBAS	541.55	599.13	3,628	620,734	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33.32	15.03	1,107	189,455	繊維・アパレル・贅沢品
TOTALENERGIES SE	864.34	923.86	5,809	993,843	石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,276.46 5銘柄	3,390.71 5銘柄	16,683 -	2,854,144 <6.8%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,576.58	602.52	2,295	392,731	航空貨物・物流サービス
SAP SE	286.32	337.31	6,129	1,048,651	ソフトウェア
E.ON SE	2,473.24	2,473.24	3,113	532,710	総合公益事業
SIEMENS AG-REG	364.06	449.4	7,620	1,303,787	コンプロマリット
BASF SE	244.71	244.71	1,135	194,295	化学
ALLIANZ SE	112.5	120.72	3,141	537,385	保険
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,955.37	2,706.4	6,311	1,079,741	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	381.74	-	-	-	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,394.52 8銘柄	6,934.3 7銘柄	29,748 -	5,089,303 <12.1%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	2,169.47	2,169.47	2,700	462,085	電力
AMADEUS IT GROUP SA	538.26	411.73	2,639	451,512	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,707.73 2銘柄	2,581.2 2銘柄	5,340 -	913,597 <2.2%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	477.99	399.54	1,331	227,821	紙製品・林産品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	477.99 1銘柄	399.54 1銘柄	1,331 -	227,821 <0.5%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	85,080.06 70銘柄	93,104.64 70銘柄	- -	41,175,641 <98.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6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、2024年6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。

■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 (4,167,147,315円) の内容です。

外国投資証券

銘柄	2023年12月26日現在		2024年6月26日現在		比率
	□数	金額	□数	金額	
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千円	千口	千アメリカ・ドル	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	65.084	64,644	64.644	7,516	5.0
BOSTON PROPERTIES INC	70.87	70.4	70.4	4,344	2.9
SL GREEN	38.51	-	-	-	-
PROLOGIS INC	87.737	105.007	105.007	11,532	7.7
AVALONBAY COMMUNITIES INC	34.03	26.39	26.39	5,391	3.6
CAMDEN PROPERTY TRUST	17.02	28.64	28.64	3,148	2.1
EQUINIX INC	7.91	7.51	7.51	5,578	3.7
COUSINS PROPERTIES INC	318.645	316.515	316.515	7,188	4.8
CROWN CASTLE INC	19.13	19	19	1,817	1.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24.451	19.971	19.971	5,504	3.7
EQUITY RESIDENTIAL	63.915	49.165	49.165	3,372	2.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	30.35	30.15	30.15	2,993	2.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	145.016	121.226	121.226	2,326	1.6
HIGHWOODS PROPERTIES INC	78.84	78.31	78.31	2,018	1.3
WELLTOWER INC	57.21	39.45	39.45	3,981	2.7
REGENCY CENTERS CORP	56.12	55.74	55.74	3,417	2.3
UDR INC	95.75	95.11	95.11	3,882	2.6
SIMON PROPERTY GROUP INC	48.26	35.7	35.7	5,278	3.5
PUBLIC STORAGE	25.26	25.2	25.2	7,297	4.9
SUN COMMUNITIES INC	23.05	12.96	12.96	1,542	1.0
VENTAS INC	123.95	123.12	123.12	6,142	4.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	17.855	26.605	26.605	4,182	2.8
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	372.36	353.37	353.37	3,597	2.4
CUBESMART	31.03	-	-	-	-
DIGITAL REALTY TRUST INC	46.71	46.4	46.4	6,794	4.5
DOUGLAS EMMETT INC	115.3	56.73	56.73	760	0.5
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	268.12	266.32	266.32	3,254	2.2
TERRENO REALTY CORP	93.973	75.173	75.173	4,386	2.9
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	305.163	539.223	539.223	2,545	1.7
AMERICAN TOWER CORP	26.75	34.99	34.99	6,741	4.5
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	70.98	93.1	93.1	4,134	2.8
AMERICAN HOMES 4 RENT	111.95	95.58	95.58	3,464	2.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	316.88	249.81	249.81	5,593	3.7
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	100.07	99.4	99.4	2,266	1.5
VICI PROPERTIES INC	63.24	60.02	60.02	1,677	1.1
合計	□数	金額	□数	金額	比率
	35銘柄	3,371.489	33銘柄	3,320.929	96.0
		<97.7%>		<96.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6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、2024年6月26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 (8,934,339,394円) の内容です。

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	2023年12月26日現在		2024年6月26日現在		
		口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
不動産ファンド		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール)						
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		12,484.5	14,435.4	8,372	1,337,763	3.8
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	12,484.5 1銘柄<3.2%>	14,435.4 1銘柄<3.8%>	8,372 -	1,337,763 -	- 3.8
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT		421.539	421.539	18,796	2,197,677	6.2
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		819.87	733.47	12,160	1,421,856	4.0
CROMBIE REAL ESTATE INV		576.2	576.2	7,185	840,095	2.4
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		771.8	771.8	10,195	1,192,055	3.4
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV		1,162.95	1,162.95	19,746	2,308,806	6.5
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	3,752.359 5銘柄<23.0%>	3,665.959 5銘柄<22.6%>	68,084 -	7,960,491 -	- 22.6
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL RETAIL REIT		3,230.658	2,724.945	9,210	977,122	2.8
GPT GROUP		2,757.12	485.603	2,126	225,647	0.6
STOCKLAND		944.822	944.822	4,280	454,069	1.3
INGENIA COMMUNITIES GROUP		2,199.852	2,199.852	10,537	1,117,901	3.2
GOODMAN GROUP		597.337	597.337	21,205	2,249,687	6.4
VICINITY CENTRES		6,302.094	6,302.094	11,973	1,270,319	3.6
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA		2,991.532	-	-	-	-
REGION RE LTD		8,722.312	8,722.312	19,537	2,072,784	5.9
NATIONAL STORAGE REIT		7,135.696	7,135.696	16,911	1,794,151	5.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	34,881.423 9銘柄<29.9%>	29,112.661 8銘柄<28.8%>	95,783 -	10,161,683 -	- 28.8
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT		-	1,856	58,556	1,198,072	3.4
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄<-%>	1,856 1銘柄<3.4%>	58,556 -	1,198,072 -	- 3.4
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPLAND ASCENDAS REIT		1,109.991	-	-	-	-
PARKWAY LIFE REIT		2,517	2,517	9,010	1,062,740	3.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	3,626.991 2銘柄<3.7%>	2,517 1銘柄<3.0%>	9,010 -	1,062,740 -	- 3.0
(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		10,701.792	10,701.792	21,992	2,149,735	6.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	10,701.792 1銘柄<5.9%>	10,701.792 1銘柄<6.1%>	21,992 -	2,149,735 -	- 6.1
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
UNITE GROUP PLC		984.214	318.475	2,864	580,671	1.6

銘柄	2023年12月26日現在		2024年6月26日現在			
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(イギリス)	千□		千□	千イギリス・ポンド	千円	%
SEGRO PLC	649.531		649.531	5,860	1,187,835	3.4
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	3,425.318		4,792.979	6,647	1,347,521	3.8
TRITAX BIG BOX REIT PLC	-		4,830.553	7,400	1,500,062	4.3
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	5,059.063 3銘柄<10.6%>	10,591.538 4銘柄<13.1%>	22,773 -	4,616,091 -	- 13.1
(オランダ)	千□		千□	千ユーロ	千円	%
VASTNED RETAIL	452.507		452.507	10,566	1,807,637	5.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	452.507 1銘柄<4.1%>	452.507 1銘柄<5.1%>	10,566 -	1,807,637 -	- 5.1
(ベルギー)	千□		千□	千ユーロ	千円	%
COFINIMMO SA	34.726		15.778	899	153,860	0.4
WAREHOUSES DE PAUW	690.172		320.887	8,092	1,384,511	3.9
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	724.898 2銘柄<9.8%>	336.665 2銘柄<4.4%>	8,992 -	1,538,371 -	- 4.4
(フランス)	千□		千□	千ユーロ	千円	%
GECINA SA	32.875		32.875	3,027	517,993	1.5
ICADE	45.296		-	-	-	-
KLEPIERRE	285.887		285.887	7,295	1,248,171	3.5
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	364.058 3銘柄<5.4%>	318.762 2銘柄<5.0%>	10,323 -	1,766,165 -	- 5.0
(スペイン)	千□		千□	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	174.863		174.863	956	163,638	0.5
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	174.863 1銘柄<0.5%>	174.863 1銘柄<0.5%>	956 -	163,638 -	- 0.5
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	72,222.454 28銘柄<96.1%>	74,163.147 27銘柄<95.7%>	- -	33,762,390 -	- 95.7

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6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、2024年6月26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

2024年6月26日現在

項 目	第 38 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	1,798,844	49.2
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	911,540	24.9
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	356,686	9.8
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	524,146	14.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	64,767	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	3,655,985	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、2024年6月26日現在、DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンドは99,123,140千円、95.5％、DIAM世界好配当株オープン・マザーファンドは41,645,810千円、99.2％、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドは23,447,948千円、98.0％、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34,229,261千円、97.0％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、2024年6月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.78円、1カナダ・ドル=116.92円、1オーストラリア・ドル=106.09円、1香港・ドル=20.46円、1シンガポール・ドル=117.94円、1ニュージーランド・ドル=97.75円、1台湾・ドル=4.922円、1イギリス・ポンド=202.70円、1スイス・フラン=178.41円、1デンマーク・クローネ=22.94円、1ノルウェー・クローネ=15.03円、1スウェーデン・クローナ=15.20円、1ユーロ=171.08円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月26日)、(2024年2月26日)、(2024年3月26日)、(2024年4月26日)、(2024年5月27日)、(2024年6月26日)現在

項 目	第 218 期 末	第 219 期 末	第 220 期 末	第 221 期 末	第 222 期 末	第 223 期 末
(A) 資 産	3,554,638,296円	3,545,206,656円	3,557,100,706円	3,518,960,476円	3,611,988,532円	3,655,985,999円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	43,365,855	53,358,552	48,805,638	56,211,224	55,913,226	64,767,035
DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド(評価額)	1,734,163,923	1,735,645,137	1,754,520,484	1,757,624,149	1,792,234,167	1,798,844,938
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	877,462,713	881,068,160	884,058,603	873,303,026	902,189,811	911,540,196
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド(評価額)	350,580,507	353,410,051	334,988,109	333,167,453	341,394,577	356,686,837
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)	524,065,298	521,724,756	509,727,872	498,654,624	520,256,751	524,146,993
未 収 入 金	25,000,000	—	25,000,000	—	—	—
(B) 負 債	12,245,822	16,981,936	14,874,765	12,938,819	10,712,559	12,196,491
未 払 収 益 分 配 金	7,020,320	6,854,370	6,791,999	6,734,043	6,701,506	6,614,297
未 払 解 約 金	1,239,712	6,172,970	4,403,377	2,260,148	—	1,656,599
未 払 信 託 報 酬	3,975,204	3,944,093	3,669,616	3,934,151	4,000,398	3,915,169
そ の 他 未 払 費 用	10,586	10,503	9,773	10,477	10,655	10,426
(C) 純資産総額(A-B)	3,542,392,474	3,528,224,720	3,542,225,941	3,506,021,657	3,601,275,973	3,643,789,508
元 本	3,510,160,283	3,427,185,495	3,395,999,954	3,367,021,955	3,350,753,342	3,307,148,867
次 期 繰 越 損 益 金	32,232,191	101,039,225	146,225,987	138,999,702	250,522,631	336,640,641
(D) 受 益 権 総 口 数	3,510,160,283口	3,427,185,495口	3,395,999,954口	3,367,021,955口	3,350,753,342口	3,307,148,867口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,092円	10,295円	10,431円	10,413円	10,748円	11,018円

(注) 第217期末における元本額は3,536,798,192円、当作成期間(第218期～第223期)中における追加設定元本額は5,337,273円、同解約元本額は234,986,598円です。

■損益の状況

〔自 2023年12月27日 至 2024年1月26日〕〔自 2024年1月27日 至 2024年2月26日〕〔自 2024年2月27日 至 2024年3月26日〕〔自 2024年3月27日 至 2024年4月26日〕〔自 2024年4月27日 至 2024年5月27日〕〔自 2024年5月28日 至 2024年6月26日〕

項 目	第 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期	第 222 期	第 223 期
(A) 配 当 等 収 益	△798円	△224円	243円	3,028円	2,966円	3,254円
受 取 利 息	3	20	424	3,028	2,966	3,254
支 払 利 息	△801	△244	△181	-	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	47,238,459	80,377,518	56,576,248	4,698,020	122,899,260	99,914,478
売 買 益	48,533,064	80,593,606	56,559,653	17,696,215	123,326,054	100,150,254
売 買 損	△1,294,605	△216,088	16,595	△12,998,195	△426,794	△235,776
(C) 信 託 報 酬 等	△3,985,790	△3,954,596	△3,679,389	△3,944,628	△4,011,053	△3,925,595
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	43,251,871	76,422,698	52,897,102	756,420	118,891,173	95,992,137
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△14,690,495	21,027,689	89,724,001	134,639,028	128,012,403	237,034,489
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,691,135	10,443,208	10,396,883	10,338,297	10,320,561	10,228,312
(配 当 等 相 当 額)	(84,204,867)	(82,234,928)	(81,539,439)	(80,876,231)	(80,514,114)	(79,508,697)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△73,513,732)	(△71,791,720)	(△71,142,556)	(△70,537,934)	(△70,193,553)	(△69,280,385)
(G) 合 計 (D+E+F)	39,252,511	107,893,595	153,017,986	145,733,745	257,224,137	343,254,938
(H) 収 益 分 配 金	△7,020,320	△6,854,370	△6,791,999	△6,734,043	△6,701,506	△6,614,297
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	32,232,191	101,039,225	146,225,987	138,999,702	250,522,631	336,640,641
追 加 信 託 差 損 益 金	10,691,135	10,443,208	10,396,883	10,338,297	10,320,561	10,228,312
(配 当 等 相 当 額)	(84,205,636)	(82,235,225)	(81,540,957)	(80,876,703)	(80,514,728)	(79,508,867)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△73,514,501)	(△71,792,017)	(△71,144,074)	(△70,538,406)	(△70,194,167)	(△69,280,555)
分 配 準 備 積 立 金	101,914,177	99,901,650	135,829,104	132,632,361	240,202,070	326,412,329
繰 越 損 益 金	△80,373,121	△9,305,633	-	△3,970,956	-	-

(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218期から第223期まででD I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド862,136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1,295,861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 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期	第 222 期	第 223 期
(a) 経費控除後の配当等収益	8,697,392円	7,270,659円	10,439,116円	4,727,376円	11,445,623円	9,217,811円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	33,241,921	0	103,494,624	86,774,326
(c) 収 益 調 整 金	84,205,636	82,235,225	81,540,957	80,876,703	80,514,728	79,508,867
(d) 分 配 準 備 積 立 金	100,237,105	99,485,361	98,940,066	134,639,028	131,963,329	237,034,489
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	193,140,133	188,991,245	224,162,060	220,243,107	327,418,304	412,535,493
(f) 1万口当たり当期分配対象額	550.23	551.45	660.08	654.12	977.15	1,247.41
(g) 分 配 金	7,020,320	6,854,370	6,791,999	6,734,043	6,701,506	6,614,297
(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 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期	第 222 期	第 223 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21期（決算日 2024年6月5日）

（計算期間 2023年6月6日～2024年6月5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21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			
17期（2020年6月5日）	円 22,639	% 5.1	% 98.5	% -	百万円 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
20期（2023年6月5日）	25,346	△0.2	98.7	-	98,072
21期（2024年6月5日）	28,558	12.7	98.0	-	97,439

（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）。

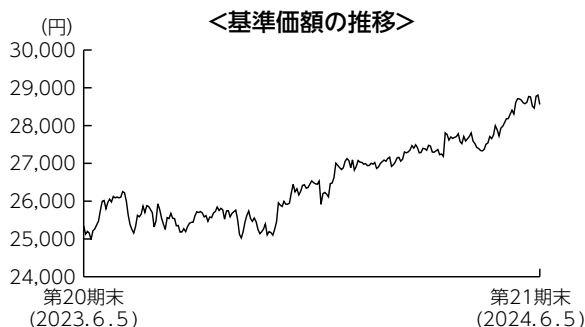
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		騰	落		
(期 首) 2023年 6 月 5 日	円 25,346	% -		% 98.7	% -
6 月 末	26,088	2.9		99.1	-
7 月 末	25,469	0.5		98.7	-
8 月 末	25,717	1.5		98.0	-
9 月 末	25,722	1.5		98.1	-
10 月 末	25,099	△1.0		98.5	-
11 月 末	26,450	4.4		98.4	-
12 月 末	27,074	6.8		98.3	-
2024年 1 月 末	27,088	6.9		98.7	-
2 月 末	27,279	7.6		97.8	-
3 月 末	27,709	9.3		97.9	-
4 月 末	27,998	10.5		97.5	-
5 月 末	28,461	12.3		98.6	-
(期 末) 2024年 6 月 5 日	28,558	12.7		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（2023年6月6日から2024年6月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は28,558円となり、前期末比で12.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日銀の緩和的な金融政策姿勢や、主要国や投資国での高インフレ長期化から内外金利差が意識されたことなどを背景に投資国通貨が対円で上昇しました。この結果、投資国通貨の上昇を主因に基準価額が上昇しました。債券保有についても主要国や投資国のインフレ高止まりから国債利回りが上昇（価格は下落）したものの、投資債券の金利収入が上回り基準価額にプラスに寄与しました。

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。2023年10～12月には主要国および投資国でインフレがピークアウトしたことなどを背景に早期利下げが意識され、利回りが低下（価格は上昇）する場面はあったものの、その時期を除けばインフレ高止まりを示す経済指標や堅調な経済指標の発表などから高金利の長期化が意識されたことで利回りが上昇しました。

為替市場では、全ての投資国通貨が対円で上昇しました。日銀がマイナス金利の解除に踏み切るなど緩和的な金融政策の修正を進めたものの、その動きは緩やかに留まるとの見方や、米国でインフレ高止まりを示す経済指標が相次いだことから内外金利差が意識されたことなどを背景に米ドル高円安が進みました。当ファンドの投資国通貨についても、米ドル高円安の進展や工業金属などを中心に資源価格が上昇したことなどに連れていずれも対円で上昇しました。

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、投資国および世界経済見通し、主要国および投資国のインフレ動向や金融政策を勘案して調整を行いました。当期末のデュレーションは、高金利の長期化が見込まれる中で利回り上昇のリスクが強まったとの判断などから、前期末と比較して短期化しました。

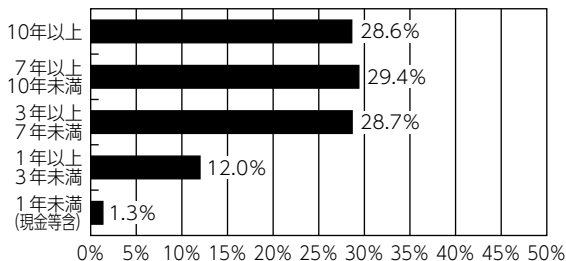
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

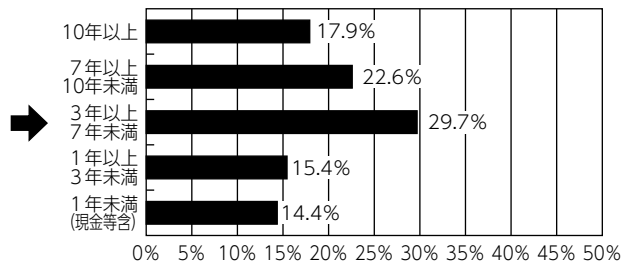
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

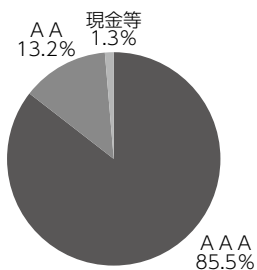


期末

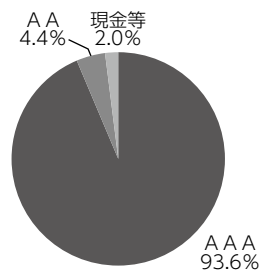


○格付別構成比

期首 (前期末)

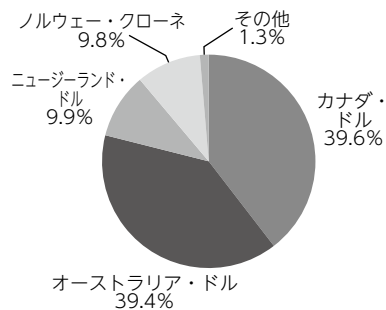


期末

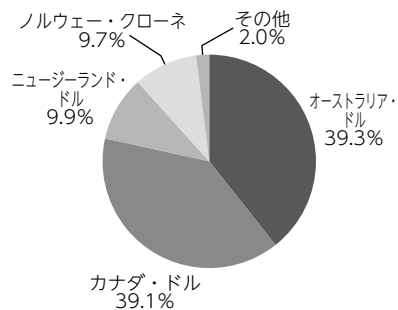


○通貨別構成比

期首 (前期末)

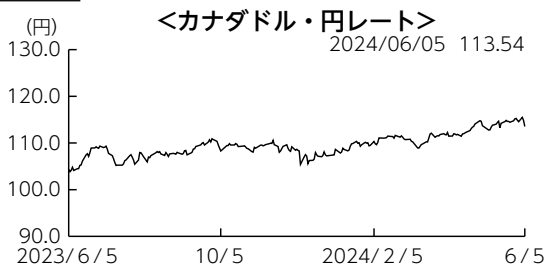


期末

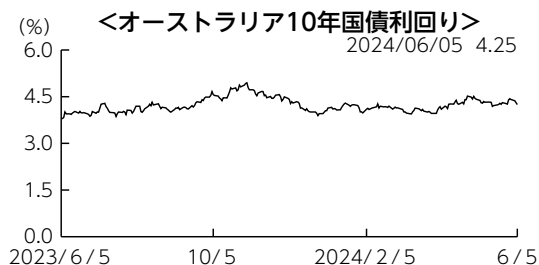
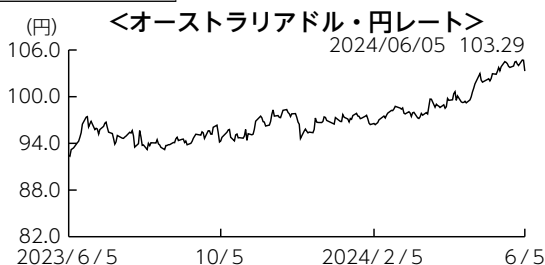


【各国の為替・金利動向】

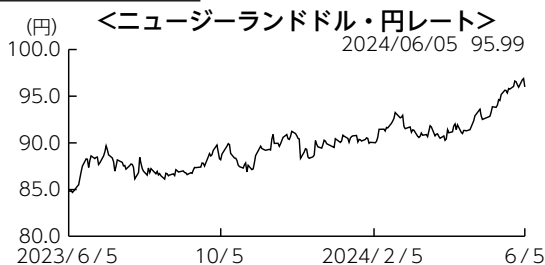
カナダ



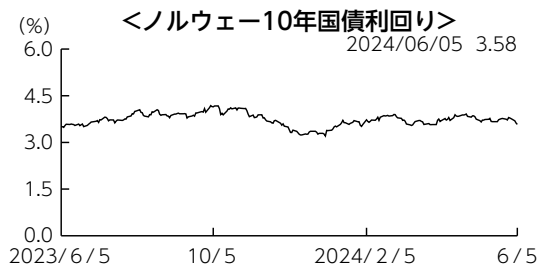
オーストラリア



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、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。

■ 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 (保 管 費 用)	2円	0.009%	(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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.009	
期中の平均基準価額は26,538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 (2023年6月6日から2024年6月5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 353,162	千カナダ・ドル 286,578 (-)
		地 方 債 証 券	35,380	145,805 (-)
		特 殊 債 券	19,954	9,409 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 320,413	千オーストラリア・ドル 357,638 (-)
		地 方 債 証 券	16,548	15,945 (-)
	国	ニュージーランド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 5,306
地 方 債 証 券			6,599	7,755 (-)
特 殊 債 券			-	2,568 (-)
ノルウェー		国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 107,821	千ノルウェー・クローネ 222,670 (-)

(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 (2023年6月6日から2024年6月5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 349,700	千カナダ・ドル 335,673	千円 38,112,385	% 39.1	% -	% 16.8	% 9.7	% 12.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 413,000	千オーストラリア・ドル 371,052	千円 38,325,970	39.3	-	24.9	6.8	7.6
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 120,500	千ニュージーランド・ドル 100,163	千円 9,614,696	9.9	-	6.4	2.3	1.2
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 692,000	千ノルウェー・クローネ 642,544	千円 9,451,829	9.7	-	6.6	1.7	1.3
合 計	-	-	千円 95,504,882	98.0	-	54.7	20.6	22.7

(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 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	47,000	44,035	4,999,738	2026/03/01
CANADA 3.75 05/01/25	国債証券	3.7500	60,000	59,605	6,767,579	2025/05/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	10,900	12,823	1,455,940	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,483	963,232	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,367	609,401	2041/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	30,000	26,477	3,006,214	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	14,000	12,322	1,399,116	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	20,000	17,989	2,042,502	2032/06/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	25,000	24,319	2,761,260	2027/09/01
CANADA 3.25 09/01/28	国債証券	3.2500	39,000	38,564	4,378,604	2028/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,203	1,385,567	2045/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	12,000	9,103	1,033,584	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	7,500	5,286	600,177	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,426	502,535	2064/12/01
CANADA 3.25 12/01/33	国債証券	3.2500	30,000	29,543	3,354,339	2033/12/01
KOMBANK 4.9 10/05/26	特殊債券	4.9000	20,000	20,292	2,304,043	2026/10/05
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	5,000	4,831	548,548	2025/12/15
小 計	-	-	349,700	335,673	38,112,385	-

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	
(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	10,000	7,647	789,934	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	26,000	25,765	2,661,270	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	10,000	10,210	1,054,615	2027/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	13,000	12,565	1,297,905	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	8,000	7,489	773,582	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	43,000	39,427	4,072,448	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	4,000	3,137	324,096	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	11,000	8,804	909,454	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	7,000	6,689	690,925	2034/05/21
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	国債証券	4.7500	4,000	4,051	418,507	2054/06/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	5,000	4,322	446,482	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	11,000	9,473	978,468	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	12,000	6,616	683,395	2051/06/21
AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	国債証券	4.2500	15,000	15,046	1,554,152	2034/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	3,000	2,811	290,401	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	8,000	7,204	744,130	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	30,000	23,915	2,470,260	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	26,000	25,540	2,638,103	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	17,000	13,980	1,444,048	2030/12/21
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	10,000	9,308	961,482	2034/12/21
NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36	地方債証券	4.2500	14,000	12,720	1,313,891	2036/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29	地方債証券	3.0000	23,000	21,531	2,223,947	2029/04/20
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,167	533,699	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	11,000	10,803	1,115,923	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,402	351,453	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,333	1,377,171	2032/10/22
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	12,519	1,293,159	2032/11/22
TREASURY CORP VICTORIA 4.25 12/20/32	地方債証券	4.2500	9,000	8,532	881,352	2032/12/20
KOMBANK 4.35 01/18/28	特殊債券	4.3500	10,000	9,923	1,025,038	2028/01/18
KOMBANK 4.4 02/17/26	特殊債券	4.4000	10,000	9,962	1,029,027	2026/02/17
NATIONAL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,463	357,772	2036/06/30
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,684	587,134	2031/08/18
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28	特殊債券	4.5000	10,000	9,998	1,032,732	2028/09/06
小計	—	—	413,000	371,052	38,325,970	—
(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	6,000	5,965	572,636	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,134	876,811	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	8,771	841,963	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	7,500	6,982	670,210	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	11,000	7,383	708,740	2051/05/15
NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	国債証券	5.0000	4,000	3,997	383,710	2054/05/15

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		
(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 1.75	05/15/41	国債証券	1.7500	23,000	14,547	1,396,421	2041/05/15	
NEW ZEALAND 1.5	05/15/31	国債証券	1.5000	4,000	3,256	312,620	2031/05/15	
NEW ZEALAND 2.0	05/15/32	国債証券	2.0000	10,000	8,239	790,927	2032/05/15	
NEW ZEALAND 0.25	05/15/28	国債証券	0.2500	2,000	1,686	161,903	2028/05/15	
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	2.25 05/15/28	地方債証券	2.2500	10,000	9,026	866,456	2028/05/15	
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	4.5 05/15/30	地方債証券	4.5000	7,000	6,809	653,687	2030/05/15	
HOUSING NEW ZEALAND LTD	2.183 04/24/30	特殊債券	2.1830	3,000	2,568	246,527	2030/04/24	
KOMBNK 4.0	08/20/25	特殊債券	4.0000	12,000	11,793	1,132,081	2025/08/20	
小	計	—	—	120,500	100,163	9,614,696	—	
(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	90,000	86,563	1,273,351	2026/02/19	
NORWAY 1.75	02/17/27	国債証券	1.7500	72,000	68,547	1,008,332	2027/02/17	
NORWAY 2.0	04/26/28	国債証券	2.0000	50,000	47,150	693,576	2028/04/26	
NORWAY 3.625	04/13/34	国債証券	3.6250	45,000	45,112	663,604	2034/04/13	
NORWAY 2.125	05/18/32	国債証券	2.1250	70,000	63,048	927,440	2032/05/18	
NORWAY 1.375	08/19/30	国債証券	1.3750	85,000	74,812	1,100,494	2030/08/19	
NORWAY 3.0	08/15/33	国債証券	3.0000	95,000	90,744	1,334,845	2033/08/15	
NORWAY 1.75	09/06/29	国債証券	1.7500	70,000	64,054	942,244	2029/09/06	
NORWAY 1.25	09/17/31	国債証券	1.2500	85,000	72,523	1,066,820	2031/09/17	
NORWAY 3.5	10/06/42	国債証券	3.5000	30,000	29,987	441,119	2042/10/06	
小	計	—	—	692,000	642,544	9,451,829	—	
合	計	—	—	—	—	95,504,882	—	

■投資信託財産の構成

2024年6月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	95,504,882	96.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,693,280	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	99,198,162	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、97,018,760千円、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、2024年6月5日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=113.54円、1オーストラリア・ドル=103.29円、1ニュージーランド・ドル=95.99円、1ノルウェー・クローネ=14.71円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	99,198,162,890円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	914,170,760
公 社 債(評価額)	95,504,882,214
未 収 入 金	2,309,437,446
未 収 利 息	409,831,558
前 払 費 用	59,840,912
(B) 負 債	1,759,045,860
未 払 金	1,543,725,860
未 払 解 約 金	215,320,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	97,439,117,030
元 本	34,120,247,584
次 期 繰 越 損 益 金	63,318,869,446
(D) 受 益 権 総 口 数	34,120,247,584口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,558円

(注1) 期首元本額 38,692,608,704円

追加設定元本額 374,679,233円

一部解約元本額 4,947,040,353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) 30,578,746,184円

DIA M高格付インカム・オープン<DC年金> 974,608,095円

DIA M高格付インカム・オープン(1年決算コース) 371,340,472円

尾瀬紀行 400,994,172円

DIA M世界インカム・オープン(毎月決算コース) 615,873,043円

DIA M世界3資産オープン(毎月決算型) 208,090,576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)

843,270,700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)

12,442,691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)

114,881,651円

期末元本合計 34,120,247,584円

■損益の状況

当期 自2023年6月6日 至2024年6月5日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,832,307,550円
受 取 利 息	2,832,449,855
支 払 利 息	△142,305
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,697,292,533
売 買 益	11,264,131,864
売 買 損	△2,566,839,331
(C) そ の 他 費 用	△8,822,790
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	11,520,777,293
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	59,379,501,033
(F) 解 約 差 損 益 金	△8,200,359,647
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	618,950,767
(H) 合 計(D+E+F+G)	63,318,869,446
次 期 繰 越 損 益 金(H)	63,318,869,446

(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》 約款変更お知らせ

- 新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。
(2023年11月24日)

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19期（決算日 2024年5月27日）

（計算期間 2023年5月27日～2024年5月27日）

D I A M世界好配当株オープン・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	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	期騰落		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
		円	中率			
15期（2020年5月26日）	23,045	△10.1	%	%	%	百万円 30,171
16期（2021年5月26日）	31,514	36.7		96.6	—	36,299
17期（2022年5月26日）	35,715	13.3		97.5	—	35,042
18期（2023年5月26日）	39,789	11.4		98.6	—	35,489
19期（2024年5月27日）	52,023	30.7		97.7	—	41,171

（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）。

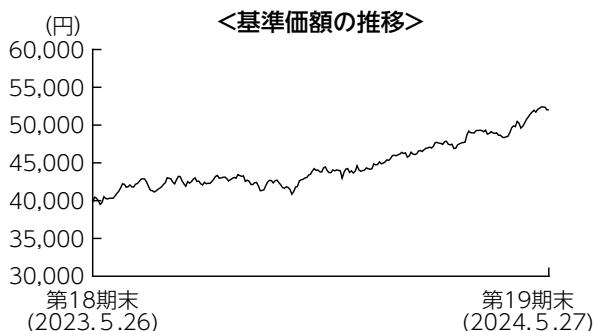
■当期中の基準価額の推移

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) 2023年 5 月26日	円 39,789	% -	% -	% 98.6	% -
5 月 末	39,987	0.5		98.6	-
6 月 末	42,522	6.9		98.3	-
7 月 末	42,768	7.5		98.1	-
8 月 末	43,337	8.9		98.6	-
9 月 末	42,395	6.5		98.3	-
10 月 末	41,210	3.6		98.4	-
11 月 末	43,731	9.9		98.7	-
12 月 末	44,154	11.0		98.5	-
2024年 1 月 末	46,322	16.4		99.1	-
2 月 末	47,577	19.6		98.5	-
3 月 末	49,283	23.9		98.5	-
4 月 末	50,493	26.9		98.5	-
(期 末) 2024年 5 月27日	52,023	30.7		97.7	-

(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（2023年5月27日から2024年5月27日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は52,023円となり、前期末比で30.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

基準価額は上昇しました。欧米の物価動向、金融政策への思惑や地政学リスクにより一進一退となる場面も見られましたが、米国の金融引き締めが最終局面との観測や米経済が2024年以降も底堅いとの見方が高まり、基準価額は上昇しました。また業績好調な半導体・ソフトウェア関連株の株価が大幅に上昇したこと、為替市場で主要通貨に対して前期末比で円安が進行したこともプラスに寄与しました。

投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2023年7月までは、主要企業の堅調な決算が好感され上昇しました。8月から10月にかけては、堅調な米経済指標を受けて長期金利が上昇する中、株価は下落しました。11月以降は、半導体・ソフトウェア関連株の大幅な上昇が牽引し上昇基調となりました。その後中東の情勢や主要国におけるインフレの高止まり懸念から下落する局面もありましたが、期末にかけ主要企業の堅調な決算を受け反発しました。

為替市場では主要通貨に対して円安が進みました。期初から2023年11月にかけては、日銀と米欧中央銀行の金融政策スタンスの違いを反映した内外金利差から、概ね円安基調で推移しました。その後、米欧における利下げ期待や日銀による金融政策の修正から円高に推移する局面も見られましたが、期末にかけ堅調な米経済指標の結果を受け、利下げ時期の後退観測などを背景に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、金融セクターや情報技術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、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も想定され、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。

■ 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)	19円 (19)	0.042% (0.042)	(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)	0.019 (0.019)	(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)	9 (9) (0)	0.019 (0.019) (0.000)	(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	36	0.080	
期中の平均基準価額は44,723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 (2023年5月27日から2024年5月27日まで)

株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 4,124.37 (55.72)	千アメリカ・ドル 46,418 (-)	百株 6,863.03	千アメリカ・ドル 68,451
	カ ナ ダ	百株 709.55 (-)	千カナダ・ドル 4,141 (-)	百株 433.59	千カナダ・ドル 3,802
	香 港	百株 36,206 (-)	千香港・ドル 56,234 (-)	百株 7,700	千香港・ドル 9,022
	イ ギ リ ス	百株 518.92 (800.57)	千イギリス・ポンド 1,452 (-)	百株 1,922.94	千イギリス・ポンド 6,683
	ス イ ス	百株 138.25 (121.46)	千スイス・フラン 1,293 (-)	百株 277.43	千スイス・フラン 2,167
	デ ン マ ー ク	百株 348.52 (-)	千デンマーク・クローネ 26,416 (-)	百株 -	千デンマーク・クローネ -
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 342.4 (-)	千スウェーデン・クローナ 2,927 (-)	百株 -	千スウェーデン・クローナ -
	ユ ー ロ	百株 - (1,029)	千ユーロ - (-)	百株 -	千ユーロ -
	1,044 (-)	5,978 (-)	867.81	12,812	

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユ ー ロ ー プ	ド イ ツ	百株 675.79 (-)	千ユーロ 5,788 (△227)	百株 2,154.62	千ユーロ 7,707
		ス ペ イ ン	1,115.13 (3,309.94)	5,043 (-)	4,649.2	1,803
	フ ィ ン ラ ン ド	- (-)	- (-)	78.45	226	

(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	28,038,431千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	37,078,284千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.75

(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 (2023年5月27日から2024年5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
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	—	204.77	3,499	548,937	情報技術サービス	
AMGEN INC	—	41.34	1,264	198,337	バイオテクノロジー	
APPLE INC	258.78	149.73	2,844	446,227	コンピュータ・周辺機器	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	346.85	101.29	417	65,527	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	339.51	299.68	6,014	943,553	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	1,268	368.59	1,710	268,403	通信機器	
CUMMINS INC	42.81	—	—	—	機械	
BANK OF AMERICA CORP	516.73	449.28	1,783	279,799	銀行	
EATON CORP PLC	116.51	196.05	6,683	1,048,385	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	344.18	656.69	5,030	789,197	電力	
GILEAD SCIENCES INC	340.71	101.52	666	104,598	バイオテクノロジー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34.11	—	—	—	航空宇宙・防衛	
JOHNSON & JOHNSON	264.67	155.46	2,284	358,415	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	299.81	260.01	3,430	538,153	家庭用品	
LAM RESEARCH CORP	—	56.75	5,507	864,037	半導体・半導体製造装置	
LOCKHEED MARTIN CORP	25.69	—	—	—	航空宇宙・防衛	
MCDONALD'S CORPORATION	424.25	38.06	982	154,103	ホテル・レストラン・レジャー	
MERCK & CO.INC.	754.49	261.32	3,383	530,821	医薬品	
MICROSOFT CORP	260.46	300.79	12,938	2,029,706	ソフトウェア	
3M CO	—	283.03	2,820	442,523	コングロメリット	
PACCAR INC	457.09	—	—	—	機械	
PAYCHEX INC	524.48	—	—	—	専門サービス	
PPL CORPORATION	831.02	577.29	1,655	259,724	電力	
PEPSICO INC	155.27	143.16	2,548	399,721	飲料	
PFIZER INC	586.82	475.45	1,373	215,398	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	91.51	91.51	1,512	237,334	家庭用品	
AT&T INC	1,593.32	2,394.41	4,190	657,319	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	338.7	383.91	6,056	950,032	石油・ガス・消耗燃料	
STARBUCKS CORP	421.29	102.14	805	126,371	ホテル・レストラン・レジャー	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	346.59	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
CME GROUP INC	204.94	347.32	7,464	1,170,972	資本市場	
TRANSDIGM GROUP INC	—	24.22	3,270	513,035	航空宇宙・防衛	
MASTERCARD INC	130.31	113.39	5,115	802,535	金融サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	669.41	669.41	6,689	1,049,368	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,906	455,870	化学	
ABBVIE INC	269.58	334.65	5,256	824,510	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	99.57	93.3	13,135	2,060,510	半導体・半導体製造装置	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,652.37 32銘柄	9,969.43 31銘柄	123,244 —	19,333,438 <47.0%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	717.64	445.77	5,113	586,816	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	374.96	573.6	3,808	437,021	銀行	
RUSSEL METALS INC	1,056.82	1,406.01	5,469	627,665	商社・流通業	
CAPITAL POWER CORP	842.72	842.72	3,201	367,403	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>	2,992.14 4銘柄	3,268.1 4銘柄	17,592 —	2,018,907 <4.9%>	

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	
(オーストラリア) BHP GROUP LTD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	百株 743.7 134.38	百株 743.7 134.38	千オーストラリア・ドル 3,319 375	千円 345,067 39,011	金属・鉱業 石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	878.08 2銘柄	878.08 2銘柄	3,695 -	384,079 <0.9%>
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD NEW WORLD DEVELOPMENT CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	百株 7,280 7,700 - -	百株 12,690 - 28,140 2,656	千香港・ドル 31,788 - 27,605 20,331	千円 638,312 - 554,315 408,260	銀行 不動産管理・開発 建設・土木 繊維・アパレル・贅沢品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,980 2銘柄	43,486 3銘柄	79,725 -	1,600,887 <3.9%>
(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 3,992	千円 464,132	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,992 -	464,132 <1.1%>
(イギリス) NATIONAL GRID PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC IMPERIAL BRANDS PLC UNILEVER PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC RIO TINTO PLC SSE PLC BP PLC 3I GROUP PLC GSK PLC ASTRAZENECA PLC NATIONAL GRID PLC-RTS	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 287.09 2,153.01 453.25 1,437.68 5,964.93 572.23 2,235.93 311.37 -	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 264.5 2,153.01 453.25 - 5,964.93 939.85 2,235.93 - 800.57	千イギリス・ポンド 2,441 1,071 2,237 1,136 2,169 2,563 - 2,881 2,772 3,967 - 160	千円 487,859 214,211 447,214 227,076 433,484 512,215 - 575,751 554,067 792,896 - 31,997	総合公益事業 タバコ タバコ パーソナルケア用品 水道 金属・鉱業 電力 石油・ガス・消耗燃料 資本市場 医薬品 医薬品 総合公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,764.74 11銘柄	17,161.29 10銘柄	21,400 -	4,276,775 <10.4%>
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 86.78 607.3	百株 51.98 624.38	千スイス・フラン 1,197 5,728	千円 205,391 982,362	医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	694.08 2銘柄	676.36 2銘柄	6,925 -	1,187,754 <2.9%>
(デンマーク) NOVO NORDISK A/S-B	百株 -	百株 348.52	千デンマーク・クローネ 32,370	千円 738,371	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	348.52 1銘柄	32,370 -	738,371 <1.8%>
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 2,133.28	百株 2,475.68	千スウェーデン・クローナ 25,016	千円 367,746	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,133.28 1銘柄	2,475.68 1銘柄	25,016 -	367,746 <0.9%>
(ユーロ…オランダ) FERROVIAL SE	百株 -	百株 1,029	千ユーロ 3,737	千円 635,981	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	1,029 1銘柄	3,737 -	635,981 <1.5%>
(ユーロ…フランス) AXA SA	百株 1,240.33	百株 1,692.38	千ユーロ 5,686	千円 967,654	保険

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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DANONE	353.68	160.31	948	161,442	食品
BNP PARIBAS	240.76	599.13	4,026	685,232	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	103.16	15.03	1,127	191,824	繊維・アパレル・贅沢品
TOTALENERGIES SE	864.34	923.86	6,096	1,037,450	石油・ガス・消耗燃料
SANOFI	412.25	—	—	—	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3,214.52 6銘柄	3,390.71 5銘柄	17,885 —	3,043,603 <7.4%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,576.58	602.52	2,346	399,255	航空貨物・物流サービス
SAP SE	170.25	337.31	6,073	1,033,545	ソフトウェア
E.ON SE	2,473.24	2,473.24	3,054	519,775	総合公益事業
SIEMENS AG-REG	328.85	449.4	7,967	1,355,891	コングロマリット
BASF SE	244.71	244.71	1,179	200,799	化学
ALLIANZ SE	132.27	120.72	3,197	544,182	保険
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,955.37	2,706.4	5,889	1,002,152	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	531.86	—	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,413.13 8銘柄	6,934.3 7銘柄	29,709 —	5,055,601 <12.3%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	1,776.33	2,169.47	2,607	443,752	電力
FERROVIAL SA	1,029	—	—	—	建設・土木
AMADEUS IT GROUP SA	—	411.73	2,634	448,270	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,805.33 2銘柄	2,581.2 2銘柄	5,241 —	892,022 <2.2%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	477.99	399.54	1,402	238,643	紙製品・林産品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	477.99 1銘柄	399.54 1銘柄	1,402 —	238,643 <0.6%>
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	68,312.66 72銘柄	93,905.21 71銘柄	— —	40,237,946 <97.7%>

(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

2024年5月27日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	40,237,946千円	97.7%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	933,446	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	41,171,392	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、40,528,816千円、98.4%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、2024年5月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=156.87円、1カナダ・ドル=114.76円、1オーストラリア・ドル=103.94円、1香港・ドル=20.08円、1シンガポール・ドル=116.24円、1台湾・ドル=4.861円、1イギリス・ポンド=199.84円、1スイス・フラン=171.50円、1デンマーク・クローネ=22.81円、1ノルウェー・クローネ=14.81円、1スウェーデン・クローナ=14.70円、1ユーロ=170.17円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年5月27日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	41,171,392,837円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	877,924,429
株 式(評価額)	40,237,946,065
未 収 配 当 金	55,522,343
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	41,171,392,837
元 本	7,914,022,295
次 期 繰 越 損 益 金	33,257,370,542
(D) 受 益 権 総 口 数	7,914,022,295口
1万口当たり基準価額(C/D)	52,023円

(注1) 期首元本額 8,919,453,450円
追加設定元本額 2,960,307円
一部解約元本額 1,008,391,462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) 2,838,467,144円
D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 4,763,927,611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) 23,318,644円
D I AM世界インカム・オープン (毎月決算コース) 173,421,335円
D I AM世界3資産オープン (毎月決算型) 114,887,561円
期末元本合計 7,914,022,295円

■損益の状況

当期 自2023年5月27日 至2024年5月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,252,790,211円
受 取 配 当 金	1,247,251,643
受 取 利 息	5,596,359
そ の 他 収 益 金	62,830
支 払 利 息	△120,621
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,973,613,783
売 買 益	10,575,184,700
売 買 損	△1,601,570,917
(C) そ の 他 費 用	△7,331,262
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	10,219,072,732
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	26,570,095,655
(F) 解 約 差 損 益 金	△3,541,837,538
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,039,693
(H) 合 計(D+E+F+G)	33,257,370,542
次 期 繰 越 損 益 金(H)	33,257,370,542

(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まず。

(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20期 (決算日 2023年12月11日)

(計算期間 2022年12月10日～2023年12月11日)

DIAM US・リート・オープン・マザーファンドの第20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 額
		期 中 騰 落 率	額			
16期 (2019年12月9日)	円	%		%	百万円	
	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	
19期 (2022年12月9日)	46,794	△6.4		94.5	22,587	
20期 (2023年12月11日)	50,574	8.1		97.7	22,409	

(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。

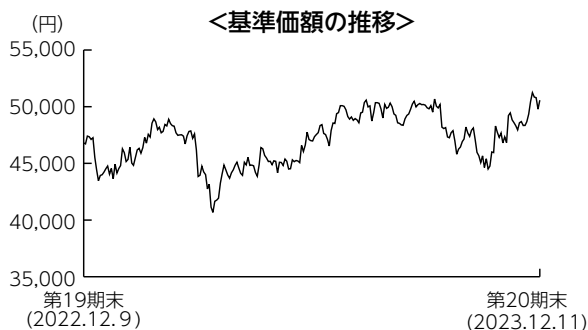
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		投 資 証 比	券 率
		騰	落		
(期 首) 2022 年 12 月 9 日	円 46,794	% -			% 94.5
12 月 末	44,549	△4.8			95.1
2023 年 1 月 末	46,781	△0.0			90.9
2 月 末	47,524	1.6			90.6
3 月 末	44,076	△5.8			89.6
4 月 末	44,894	△4.1			93.3
5 月 末	45,250	△3.3			92.1
6 月 末	49,383	5.5			91.7
7 月 末	49,462	5.7			92.6
8 月 末	50,473	7.9			93.4
9 月 末	47,703	1.9			96.3
10 月 末	44,766	△4.3			96.2
11 月 末	48,683	4.0			95.7
(期 末) 2023 年 12 月 11 日	50,574	8.1			97.7

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2022年12月10日から2023年12月11日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は50,574円となり、前期末比で8.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

F R B（米連邦準備理事会）による利上げへの警戒感が後退したことなどを受けて米国リート市場が上昇したことが、基準価額にプラスに影響しました。また、米ドル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、ウェルタワー（ヘルスケア）やデジタル・リアルティ（その他）などが主にプラスに影響しました。

投資環境

米国リート市場は上昇しました。期初は利上げの減速期待などから上昇しましたが、利上げ継続観測が高まる中で長期金利が上昇すると、米国リート市場は下落に転じました。イスラエル情勢などもマイナスに影響しましたが、期末にかけては2024年の利下げ期待が高まり上昇に転じました。セクター別では、工業やヘルスケアなどが上昇しました。

為替市場では、米ドルに対して円安が進みました。F R Bによる利上げが継続的に実施され米国長期金利は上昇しました。一方で、日銀はイールドカーブコントロールの変動幅を拡大しましたが、日本の長期金利は相対的に小幅な上昇に留まりました。長期金利の金利差が拡大したことなどから米ドルに対して円安が進行しました。

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。オフィスやヘルスケアなどの組入比率を引き上げる一方、その他や工業などの組入比率を引き下げました。

今後の運用方針

米国では、インフレの鈍化などを受けて2024年の利下げ期待が高まっています。一方で、オフィスなど厳しいファンダメンタルズが続くと予想されるセクターもあります。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)	15円 (15)	0.031% (0.031)	(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 (5) (0)	0.011 (0.011) (0.000)	(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	20	0.042	
期中の平均基準価額は47,083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 (2022年12月10日から2023年12月11日まで)

投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 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	21.02 (-)	2,412 (-)	- (-)	- (-)
BOSTON PROPERTIES INC	47.94 (-)	2,734 (-)	- (-)	- (-)
SL GREEN	38.51 (-)	1,570 (-)	- (-)	- (-)
PROLOGIS INC	5.56 (-)	692 (-)	17.75 (-)	2,126 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4.62 (-)	777 (-)	6.47 (-)	1,186 (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	5.28 (-)	491 (-)	11.73 (-)	1,097 (-)
EQUINIX INC	- (-)	- (-)	3.42 (-)	2,364 (-)
COUSINS PROPERTIES INC	171.13 (-)	4,077 (-)	- (-)	- (-)
CROWN CASTLE INC	6.26 (-)	653 (-)	24.47 (-)	2,809 (-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.1 (-)	1,124 (-)	5.08 (-)	1,185 (-)
EQUITY RESIDENTIAL	3.37 (-)	208 (-)	- (-)	- (-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10.04 (-)	959 (-)	7.75 (-)	848 (-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.15 (-)	2,586 (-)	44.56 (-)	691 (-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7.77 (-)	175 (-)	- (-)	- (-)
WELLTOWER INC	17.58 (-)	1,239 (-)	32.5 (-)	2,742 (-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	- (-)	- (-)	187.46 (-)	3,135 (-)
REGENCY CENTERS CORP	56.12 (-)	3,424 (-)	- (-)	- (-)
UDR INC	31.92 (-)	1,297 (-)	21.51 (-)	687 (-)

	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
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.66	403	9.33	1,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	-	-	-	-
	(△19.95)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	1.56	452	4.34	1,236
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	8.09	1,076	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	21.97	1,011	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	-	-	20.86	3,285
	(17.855)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	19.62	193	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	-	-	9.67	418
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.46	239	4.07	414
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	24.67	314	134.9	1,752
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	29.34	387	29.42	376
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	9.99	606	13.9	802
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	-	-	40.2	1,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	107.35	884	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	8.32	1,520	12.53	2,420
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	17.89	883	47.04	2,443
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	5.9	195	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	-	-	17.85	1,661
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	67.13	1,435	18.76	435
	(-)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	-	-	111.16	1,740
	(-)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	-	-	45.89	1,469
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	100.07	3,313	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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（2022年12月10日から2023年12月11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	44.064	65.084	7,773	1,130,286		5.0
BOSTON PROPERTIES INC	22.93	70.87	4,541	660,312		2.9
SL GREEN	—	38.51	1,636	237,916		1.1
PROLOGIS INC	99.927	87.737	10,515	1,528,921		6.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC	35.88	34.03	5,980	869,604		3.9
CAMDEN PROPERTY TRUST	23.47	17.02	1,593	231,756		1.0
EQUINIX INC	11.33	7.91	6,342	922,126		4.1
COUSINS PROPERTIES INC	147.515	318.645	7,156	1,040,593		4.6
CROWN CASTLE INC	37.34	19.13	2,220	322,848		1.4
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24.431	24.451	5,528	803,860		3.6
EQUITY RESIDENTIAL	60.545	63.915	3,759	546,628		2.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	28.06	30.35	3,008	437,405		2.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	69.426	145.016	2,719	395,349		1.8
HIGHWOODS PROPERTIES INC	71.07	78.84	1,696	246,690		1.1
WELLTOWER INC	72.13	57.21	5,018	729,684		3.3
HOST HOTELS & RESORTS INC	187.46	—	—	—		—
REGENCY CENTERS CORP	—	56.12	3,589	521,903		2.3
UDR INC	85.34	95.75	3,386	492,422		2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	53.93	48.26	6,412	932,419		4.2
LIFE STORAGE INC	19.95	—	—	—		—
PUBLIC STORAGE	28.04	25.26	6,916	1,005,650		4.5
SUN COMMUNITIES INC	14.96	23.05	2,942	427,781		1.9
VENTAS INC	101.98	123.95	5,790	842,003		3.8
EXTRA SPACE STORAGE INC	20.86	17.855	2,476	360,029		1.6
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	352.74	372.36	3,779	549,532		2.5
CUBESMART	40.7	31.03	1,308	190,306		0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	48.32	46.71	6,296	915,580		4.1
DOUGLAS EMMETT INC	225.53	115.3	1,649	239,901		1.1
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	268.2	268.12	3,598	523,173		2.3
TERRENO REALTY CORP	97.883	93.973	5,535	804,927		3.6
AMERICOLD REALTY TRUST	40.2	—	—	—		—
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	197.813	305.163	2,322	337,661		1.5
AMERICAN TOWER CORP	30.96	26.75	5,522	802,976		3.6
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	100.13	70.98	3,720	541,000		2.4
AMERICAN HOMES 4 RENT	106.05	111.95	3,927	571,015		2.5
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	17.85	—	—	—		—

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
(アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		268.51	316.88	7,196	1,046,348	4.7
NETSTREIT CORP		111.16	—	—	—	—
STORE CAPITAL CORP		45.89	—	—	—	—
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC		—	100.07	2,823	410,606	1.8
VICI PROPERTIES INC		63.24	63.24	1,929	280,542	1.3
合計	□ 数 ・ 金額 銘柄数 < 比率 >	3,275.814	3,371.489	150,617	21,899,770	—
		38銘柄<94.5%>	35銘柄<97.7%>	—	—	97.7

(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

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	21,899,770	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	509,913	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	22,409,684	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、21,979,626千円、98.1%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、2023年12月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=145.40円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	22,409,684,475円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	486,982,031
投 資 証 券(評価額)	21,899,770,655
未 収 配 当 金	22,931,789
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	22,409,684,475
元 本	4,431,085,977
次 期 繰 越 損 益 金	17,978,598,498
(D) 受 益 権 総 口 数	4,431,085,977口
1万口当たり基準価額(C/D)	50,574円

(注1) 期首元本額 4,826,944,885円
追加設定元本額 2,311,712円
一部解約元本額 398,170,620円

(注2) 期末における元本の内訳
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) 4,109,602,582円
D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 67,712,367円
D I A M ワールドREITアクティブファンド (毎月決算型) 102,776,256円
D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 43,332,460円
D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金> 107,662,312円
期末元本合計 4,431,085,977円

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	855,369,801円
受 取 配 当 金	814,914,726
受 取 利 息	40,709,492
支 払 利 息	△254,417
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	935,771,849
売 買 益	2,452,060,994
売 買 損	△1,516,289,145
(C) そ の 他 費 用	△2,379,486
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,788,762,164
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,760,077,426
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,577,929,380
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,688,288
(H) 合 計(D+E+F+G)	17,978,598,498
次 期 繰 越 損 益 金(H)	17,978,598,498

(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20期 (決算日 2023年12月11日)

(計算期間 2022年12月10日～2023年12月11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20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	純資産額
		期中騰落率			
16期 (2019年12月9日)	円		%	%	百万円
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
19期 (2022年12月9日)	32,197	△6.8		95.8	35,157
20期 (2023年12月11日)	35,186	9.3		95.8	34,367

(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。

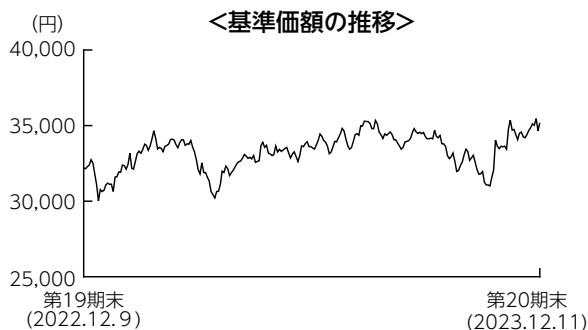
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■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) 2022 年 12 月 9 日	円 32,197	% -		% 95.8
12 月 末	31,123	△3.3		95.0
2023 年 1 月 末	33,689	4.6		94.9
2 月 末	34,059	5.8		94.5
3 月 末	31,985	△0.7		95.6
4 月 末	32,676	1.5		95.8
5 月 末	32,950	2.3		95.4
6 月 末	33,923	5.4		95.7
7 月 末	34,789	8.1		95.6
8 月 末	34,800	8.1		93.7
9 月 末	32,930	2.3		93.7
10 月 末	31,004	△3.7		95.1
11 月 末	34,389	6.8		96.0
(期 末) 2023 年 12 月 11 日	35,186	9.3		95.8

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2022年12月10日から2023年12月11日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は35,186円となり、前期末比で9.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

各国中央銀行による利上げへの警戒感が後退したことなどを受けて大陸欧州や英国、豪州などのリート市場が上昇したことは、基準価額にプラスに影響しました。また、各国で利上げが進む中、日本の長期金利は相対的に小幅な上昇に留まり円安が進行したことも、基準価額にプラスに影響し

ました。保有銘柄では、カナディアン・アパートメント・プロパティーズ（カナダ・居住施設）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影響しました。

投資環境

米国以外の市場について、リートは概ね上昇しました。欧州リート市場は、各国中央銀行による利上げへの警戒感が後退したことなどを受けて上昇しました。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）による利上げが一時停止したことなどを受けて上昇しました。一方で、アジアリート市場では、中国の不動産信用問題や中国景気への懸念などから香港の下げが目立ちました。

為替市場では、主要通貨に対して円安が進みました。米国をはじめとして各国中央銀行による利上げが行われ、各国長期金利が上昇しました。一方で、日銀はイールドカーブコントロールの変動幅を拡大したものの、緩和姿勢を継続したことから日本の長期金利は相対的に小幅な上昇に留まり、主要通貨に対して円安が進行しました。

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、英国やベルギーなどの組入比率を引き上げた一方、香港やカナダなどの組入比率を引き下げました。また、用途別では、住居施設やその他などの組入比率を引き上げた一方、工業やオフィスなどの組入比率を引き下げました。

今後の運用方針

利上げへの警戒感が後退したことなどを受けて足元のリート市場は上昇傾向にありますが、オフィスなどでは厳しいファンダメンタルズが予想されます。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、工業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	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)	5円 (4) (1)	0.016% (0.012) (0.004)	(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)	5 (1) (4)	0.015 (0.002) (0.013)	(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)	10 (7) (4)	0.031 (0.020) (0.011)	(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	21	0.062	
期中の平均基準価額は33,295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 (2022年12月10日から2023年12月11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
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	8,967.8 (-)	4,770 (△195)	- (-)	- (-)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
ALLIED PROPERTIES REIT	- (-)	- (-)	271.4 (-)	4,810 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	- (-)	- (-)	97 (-)	1,461 (-)
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
GPT GROUP	1,301.784 (-)	5,689 (-)	- (-)	- (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,199.852 (-)	8,726 (-)	- (-)	- (-)
GOODMAN GROUP	- (-)	- (-)	194.468 (-)	3,858 (-)
VICINITY CENTRES	- (-)	- (-)	2,945.062 (-)	5,892 (-)
CHARTER HALL GROUP	- (-)	- (-)	291.519 (-)	4,142 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	- (-)	- (-)	3,060.217 (-)	9,709 (-)
REGION RE LTD	3,121.977 (-)	8,042 (-)	- (-)	- (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	-	-	420.2	22,925
	(-)	(-)	(-)	(-)
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
CAPLAND ASCENDAS REIT	-	-	460.6	1,302
	(-)	(△33)	(-)	(-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	-	4,282.242	7,077
	(-)	(△123)	(-)	(-)
PARKWAY LIFE REIT	-	-	-	-
	(-)	(△89)	(-)	(-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	-	-	1,674.54	3,708
	(-)	(△1)	(-)	(-)
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
GOODMAN PROPERTY TRUST	-	-	901.08	1,907
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	-	-	535.607	3,918
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	3,425.318	3,975	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	4.206	425	15.124	1,494
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	-	-	44.96	1,735
	(-)	(△96)	(-)	(-)
KLEPIERRE	-	-	-	-
	(-)	(△241)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	-	-	-	-
	(-)	(△9)	(-)	(-)

(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（2022年12月10日から2023年12月11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	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	金額	□数	金額
(シンガポール)	千口	千円	千口	千円	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE	3,516.7	12,484.5	12,484.5	7,927	1,152,681	3.4
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3,516.7 1銘柄<0.8%>	12,484.5 1銘柄<3.4%>	7,927 -	1,152,681 -	- 3.4
(カナダ)	千口	千円	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT	421.539	421.539	421.539	21,296	2,279,114	6.6
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	819.87	819.87	819.87	14,692	1,572,345	4.6
ALLIED PROPERTIES REIT	271.4	-	-	-	-	-
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	97	-	-	-	-	-
CROMBIE REAL ESTATE INV	576.2	576.2	576.2	7,732	827,543	2.4
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	771.8	771.8	771.8	10,766	1,152,242	3.4
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	1,162.95	1,162.95	1,162.95	20,874	2,234,037	6.5
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	4,120.759 7銘柄<24.1%>	3,752.359 5銘柄<23.5%>	75,362 -	8,065,282 -	- 23.5
(オーストラリア)	千口	千円	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL RETAIL REIT	3,230.658	3,230.658	3,230.658	11,178	1,068,512	3.1
GPT GROUP	1,455.336	2,757.12	2,757.12	11,938	1,141,184	3.3
STOCKLAND	944.822	944.822	944.822	3,958	378,422	1.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP	-	2,199.852	2,199.852	8,975	857,958	2.5
GOODMAN GROUP	791.805	597.337	597.337	13,858	1,324,707	3.9
VICINITY CENTRES	9,247.156	6,302.094	6,302.094	12,100	1,156,640	3.4
CHARTER HALL GROUP	291.519	-	-	-	-	-
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	6,051.749	2,991.532	2,991.532	7,538	720,620	2.1
REGION RE LTD	5,600.335	8,722.312	8,722.312	19,276	1,842,622	5.4
NATIONAL STORAGE REIT	7,135.696	7,135.696	7,135.696	16,840	1,609,758	4.7
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	34,749.076 9銘柄<29.1%>	34,881.423 9銘柄<29.4%>	105,664 -	10,100,427 -	- 29.4
(香港)	千口	千円	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	420.2	-	-	-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	420.2 1銘柄<1.1%>	- -銘柄<-%>	- -	- -	- -
(シンガポール)	千口	千円	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,570.591	1,109.991	1,109.991	3,163	342,888	1.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	4,282.242	-	-	-	-	-
PARKWAY LIFE REIT	2,517	2,517	2,517	8,935	968,502	2.8
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,674.54	-	-	-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	10,044.373 4銘柄<7.0%>	3,626.991 2銘柄<3.8%>	12,098 -	1,311,391 -	- 3.8
(ニュージーランド)	千口	千円	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
GOODMAN PROPERTY TRUST	11,602.872	10,701.792	10,701.792	22,741	2,024,658	5.9
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	11,602.872 1銘柄<5.9%>	10,701.792 1銘柄<5.9%>	22,741 -	2,024,658 -	- 5.9

銘柄	期首(前期末)		当期			末
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
UNITE GROUP PLC	984.214	984.214	9,640	1,759,272	5.1	
SEGRO PLC	1,185.138	649.531	5,402	985,956	2.9	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	—	3,425.318	4,281	781,357	2.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,169.352 2銘柄<8.8%>	5,059.063 3銘柄<10.3%>	19,324 —	3,526,586 —	— 10.3
(オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	452.507	452.507	8,950	1,401,483	4.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	452.507 1銘柄<4.0%>	452.507 1銘柄<4.1%>	8,950 —	1,401,483 —	— 4.1
(ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
COFINIMMO SA	34.726	34.726	2,406	376,811	1.1	
WAREHOUSES DE PAUW	690.172	690.172	18,786	2,941,587	8.6	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	724.898 2銘柄<8.7%>	724.898 2銘柄<9.7%>	21,192 —	3,318,398 —	— 9.7
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	43.793	32.875	3,520	551,304	1.6	
ICADE	90.256	45.296	1,524	238,731	0.7	
KLEPIERRE	285.887	285.887	6,741	1,055,539	3.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	419.936 3銘柄<5.8%>	364.058 3銘柄<5.4%>	11,786 —	1,845,575 —	— 5.4
(スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	174.863	174.863	1,110	173,863	0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	174.863 1銘柄<0.4%>	174.863 1銘柄<0.5%>	1,110 —	173,863 —	— 0.5
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	68,395.536 32銘柄<95.9%>	72,222.454 28銘柄<95.8%>	— —	32,920,349 —	— 95.8

(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

2023年12月11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	32,920,349	95.8
コール・ローン等、その他	1,447,621	4.2
投資信託財産総額	34,367,970	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、33,299,038千円、96.9%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、2023年12月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=145.40円、1カナダ・ドル=107.02円、1オーストラリア・ドル=95.59円、1香港・ドル=18.62円、1シンガポール・ドル=108.39円、1ニュージーランド・ドル=89.03円、1イギリス・ポンド=182.49円、1ユーロ=156.58円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	34,367,970,817円
コール・ローン等	1,414,025,106
投資信託受益証券(評価額)	12,564,500,297
投資証券(評価額)	20,355,849,359
未 収 配 当 金	33,596,055
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	34,367,970,817
元 本	9,767,471,616
次 期 繰 越 損 益 金	24,600,499,201
(D) 受 益 権 総 口 数	9,767,471,616口
1万口当たり基準価額(C/D)	35,186円

(注1) 期首元本額 10,919,663,091円
追加設定元本額 1,092,440円
一部解約元本額 1,153,283,915円

(注2) 期末における元本の内訳
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) 9,056,447,407円
D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 148,947,485円
D I A M ワールドREITアクティブファンド (毎月決算型) 226,501,969円
D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 98,557,594円
D I A M ワールドREITアクティブファンド<DC年金> 237,017,161円
期末元本合計 9,767,471,616円

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,443,139,371円
受 取 配 当 金	1,424,264,239
受 取 利 息	19,203,510
そ の 他 収 益 金	76,881
支 払 利 息	△405,259
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,623,971,123
売 買 益	3,607,087,546
売 買 損	△1,983,116,423
(C) そ の 他 費 用	△11,038,708
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,056,071,786
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	24,238,335,940
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,696,216,085
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,307,560
(H) 合 計(D+E+F+G)	24,600,499,201
次 期 繰 越 損 益 金(H)	24,600,499,201

(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。