

運用報告書 (全体版)

DIAM ワールド・リート・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/不動産投信
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	<p>DIAM US・リート・オープン・マザーファンド受益証券およびDIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>DIAM US・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基準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。</p> <p>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 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基準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。</p>
運用方法	<p>実質外貨建資産については、対円で為替ヘッジは行いません。マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>各マザーファンドへの投資割合は、世界各国のリート市場の市場規模等を参考として決定します。また、各マザーファンドの運用状況などを勘案し、投資割合を変更する場合があります。</p> <p>DIAM US・リート・オープン・マザーファンドの運用指図に関する権限は、デビッド・セレクテッド・アドバイザーズに、DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの運用指図に関する権限はファースト・センティア・インベスターズ(オーストラリア) アイエム・エルティエディーにそれぞれ委託します。</p>
組入制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>決算日(原則として毎月9日。休業日の場合は翌営業日)に、経費控除後の配当等収益および売買益等のみ原則として配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年6月および12月の決算時には、原則として配当等収益に売買益(評価益を含みます。)等を加えた額から分配を行います。分配金額につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。</p>

<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。

愛称：世界家主倶楽部

第235期	<決算日	2024年1月9日>
第236期	<決算日	2024年2月9日>
第237期	<決算日	2024年3月11日>
第238期	<決算日	2024年4月9日>
第239期	<決算日	2024年5月9日>
第240期	<決算日	2024年6月10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、「DIAM ワールド・リート・インカム・オープン(毎月決算コース)」は、2024年6月10日に第240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。

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 ワールド・リート・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			投資信託 受益証券 投入比率	純資産額		
		(分配落)	税 分	込 配			み 金	期 騰
第37作成期	211期 (2022年 1月11日)	円 5,790		円 15		% 1.6	% 93.6	百万円 66,451
	212期 (2022年 2月 9日)	5,468		15		△5.3	92.0	62,454
	213期 (2022年 3月 9日)	5,409		15		△0.8	92.4	61,607
	214期 (2022年 4月11日)	6,167		15		14.3	93.3	69,761
	215期 (2022年 5月 9日)	5,762		15		△6.3	94.4	64,536
	216期 (2022年 6月 9日)	5,826		15		1.4	93.6	64,881
第38作成期	217期 (2022年 7月11日)	5,445		15		△6.3	93.5	60,272
	218期 (2022年 8月 9日)	5,674		15		4.5	93.3	62,539
	219期 (2022年 9月 9日)	5,724		15		1.1	93.3	62,799
	220期 (2022年10月11日)	4,826		15		△15.4	92.1	52,772
	221期 (2022年11月 9日)	5,186		15		7.8	92.9	56,547
	222期 (2022年12月 9日)	5,081		15		△1.7	92.5	55,202
第39作成期	223期 (2023年 1月10日)	4,941		15		△2.5	91.9	53,506
	224期 (2023年 2月 9日)	5,220		15		6.0	91.4	56,325
	225期 (2023年 3月 9日)	5,147		15		△1.1	91.0	55,391
	226期 (2023年 4月10日)	4,884		15		△4.8	91.4	52,462
	227期 (2023年 5月 9日)	5,055		15		3.8	92.9	54,104
	228期 (2023年 6月 9日)	5,093		15		1.0	92.1	54,173
第40作成期	229期 (2023年 7月10日)	5,162		15		1.6	92.4	54,550
	230期 (2023年 8月 9日)	5,231		15		1.6	91.1	55,029
	231期 (2023年 9月11日)	5,190		15		△0.5	91.4	54,217
	232期 (2023年10月10日)	4,910		15		△5.1	92.6	51,093
	233期 (2023年11月 9日)	5,010		15		2.3	93.3	51,987
	234期 (2023年12月11日)	5,242		15		4.9	94.2	53,974
第41作成期	235期 (2024年 1月 9日)	5,439		15		4.0	95.2	55,518
	236期 (2024年 2月 9日)	5,475		15		0.9	94.5	55,373
	237期 (2024年 3月11日)	5,509		15		0.9	94.5	54,992
	238期 (2024年 4月 9日)	5,570		15		1.4	93.8	55,130
	239期 (2024年 5月 9日)	5,605		15		0.9	93.6	55,197
	240期 (2024年 6月10日)	5,682		15		1.6	93.6	55,554

(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、「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) 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4) △ (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

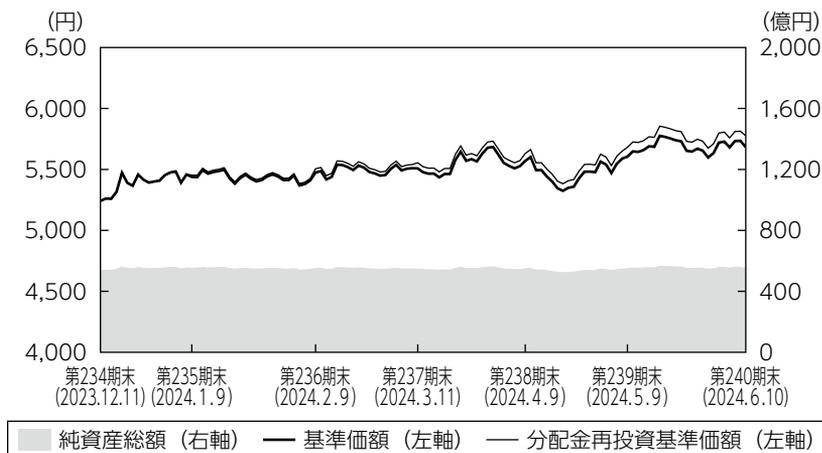
決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		投資信託受益証券、 投資証券組入比率
			騰	落	
第 235 期	(期 首) 2023 年 12 月 11 日	円 5,242		% -	% 94.2
	12 月 末	5,484		4.6	95.0
	(期 末) 2024 年 1 月 9 日	5,454		4.0	95.2
第 236 期	(期 首) 2024 年 1 月 9 日	5,439		-	95.2
	1 月 末	5,442		0.1	94.3
	(期 末) 2024 年 2 月 9 日	5,490		0.9	94.5
第 237 期	(期 首) 2024 年 2 月 9 日	5,475		-	94.5
	2 月 末	5,449		△0.5	95.0
	(期 末) 2024 年 3 月 11 日	5,524		0.9	94.5
第 238 期	(期 首) 2024 年 3 月 11 日	5,509		-	94.5
	3 月 末	5,678		3.1	94.9
	(期 末) 2024 年 4 月 9 日	5,585		1.4	93.8
第 239 期	(期 首) 2024 年 4 月 9 日	5,570		-	93.8
	4 月 末	5,564		△0.1	93.0
	(期 末) 2024 年 5 月 9 日	5,620		0.9	93.6
第 240 期	(期 首) 2024 年 5 月 9 日	5,605		-	93.6
	5 月 末	5,634		0.5	94.2
	(期 末) 2024 年 6 月 10 日	5,697		1.6	93.6

(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、「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。

■第235期～第240期の運用経過（2023年12月12日から2024年6月10日まで）

基準価額等の推移



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

F R B（米連邦準備理事会）や E C B（欧州中央銀行）などによる利下げ期待などから米国リート市場や欧州リート市場が上昇したことなどが基準価額にプラスに寄与しました。また、米ドルやユーロなど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。

◆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 US・リート・オープン・マザーファンド	10.4%
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	12.0%

投資環境

米国リート市場は上昇しました。作成期初からF R Bによる利下げ期待から上昇しました。2024年に入ると堅調な経済指標やC P I（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し、上昇幅を縮小して作成期末を迎えました。セクター別では、住居施設やヘルスケアなどが上昇しました。

米国以外のリート市場については、まちまちの展開となりました。欧州リート市場はインフレの沈静化、E C BやB O E（イングランド銀行）による利下げ期待などから上昇しました。アジアリート市場では中国景気に対する懸念などから、香港やシンガポールは下落しました。オーストラリアリート市場では、R B A（オーストラリア準備銀行）による利下げや減税政策に対する期待などを受けて上昇しました。

為替市場は、円安の展開となりました。過度な利下げ観測が後退したことにより多くの国で長期金利が上昇した一方、日銀はマイナス金利政策を解除したものの、緩和姿勢を維持したことから、米ドルをはじめ幅広い通貨に対して円安となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

D I A M US・リート・オープン・マザーファンド40%、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60%を基本配分比率とし、概ねこの割合となるよう、各マザーファンドの組入れを行いました。

●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。工業などの組入比率を引き上げた一方、オフィスなどの組入比率を引き下げました。

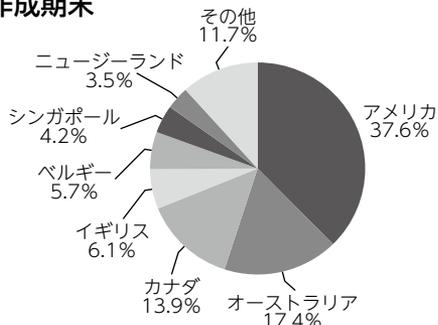
●D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド

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

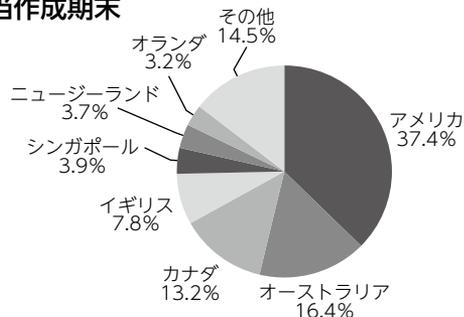
【運用状況】

○発行国別配分

前作成期末



当作成期末



※1 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

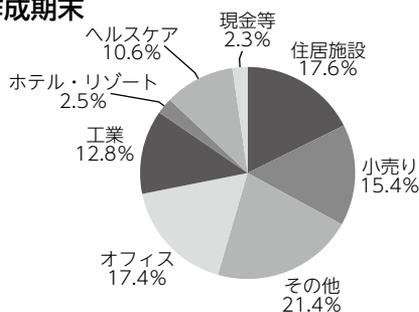
※2 現金等はその他として表示しています。

※3 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。

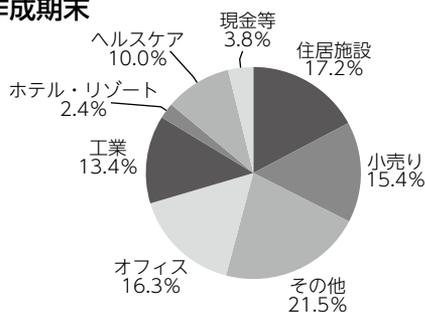
○各マザーファンドにおける用途別組入比率（純資産総額比）

DIAM US・リート・オープン・マザーファンドにおける用途別組入比率

前作成期末



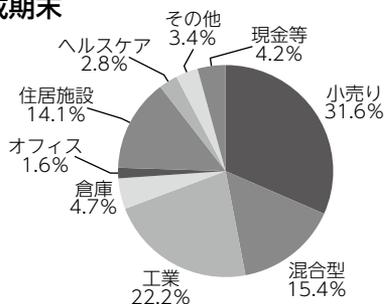
当作成期末



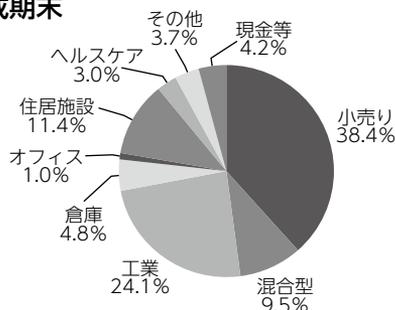
※用途分類は、運用指図に関する権限を委託しているデービス・セレクトド・アドバイザーズ社独自の分類方法によるものです。

DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドにおける用途別組入比率

前作成期末



当作成期末



※用途分類は、運用指図に関する権限を委託しているファースト・センティア・インベスターズ（オーストラリア）アイエム・エルティエディー社独自の分類方法によるものです。

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235期	第236期	第237期	第238期	第239期	第240期
	2023年12月12日 ～2024年1月9日	2024年1月10日 ～2024年2月9日	2024年2月10日 ～2024年3月11日	2024年3月12日 ～2024年4月9日	2024年4月10日 ～2024年5月9日	2024年5月10日 ～2024年6月10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	0.28%	0.27%	0.27%	0.27%	0.27%	0.26%
当期の収益	15円	6円	15円	15円	15円	9円
当期の収益以外	-円	8円	-円	-円	-円	5円
翌期繰越分配対象額	1,965円	1,957円	1,958円	1,964円	1,966円	1,961円

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

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドおよびDIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドを高位に組入れることを基本とした運用を行います。

●DIAM 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、年初からは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。

●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

一部では利下げ期待がありますが、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、工業、住居施設リートなど、安定したキャッシュフローが期待しやすい銘柄を中心に投資を行っていく方針です。オーストラリアリート市場は、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た銘柄を選別し投資する方針です。アジアリート市場は、優れた収益成長見通しと健全な財務体質を有する銘柄に厳選して投資を行う方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第235期～第240期 (2023年12月12日 ～2024年6月10日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	48円	
(投信会社)	(30)	(0.547)	
(販売会社)	(15)	(0.275)	
(受託会社)	(2)	(0.043)	
(b) 売買委託手数料	0	0.007	(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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.002)	
(投資証券)	(0)	(0.005)	
(c) 有価証券取引税	1	0.017	(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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(1)	(0.017)	
(d) その他費用	1	0.018	(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)	(0)	(0.007)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(1)	(0.009)	
合計	50	0.907	

(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。

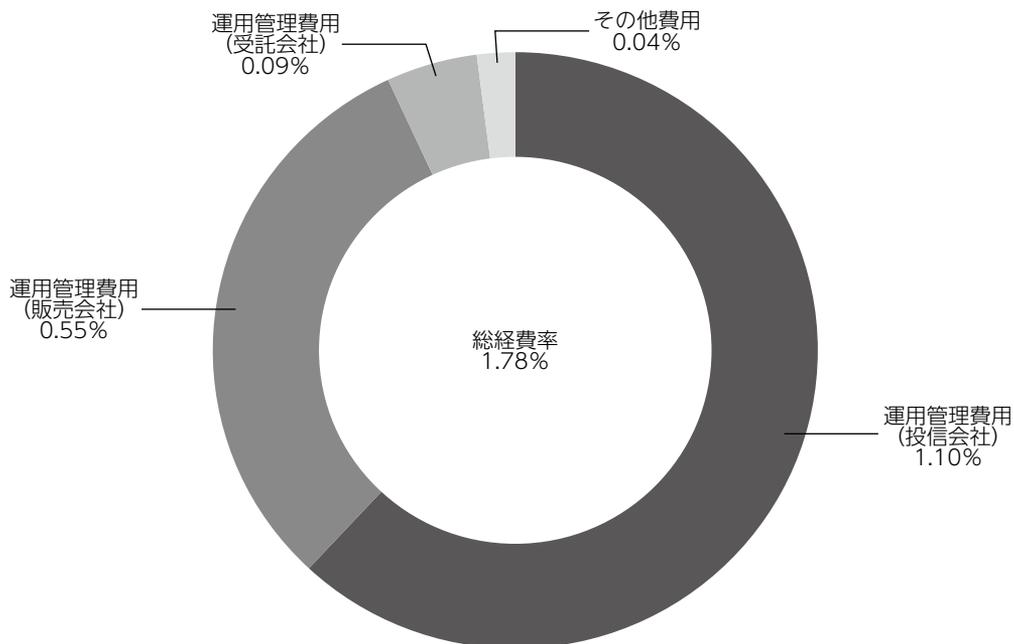
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.78%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12日から2024年6月10日まで）

	第 235 期 ~ 第 240 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	—	—	247,529	1,330,000
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	—	—	779,015	2,940,000

■利害関係人との取引状況等（2023年12月12日から2024年6月10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 40 作 成 期 末	第 41 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	4,109,602	3,862,072	21,571,221
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	9,056,447	8,277,432	32,610,599

<補足情報>

■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口)の内容です。
外国投資証券

銘柄	2023年12月11日現在		2024年6月10日現在		比率
	口数	金額	口数	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	7,401	5.0
BOSTON PROPERTIES INC	70.87		70.4	4,171	2.8
SL GREEN	38.51		-	-	-
PROLOGIS INC	87.737		105.007	11,571	7.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC	34.03		26.39	5,204	3.5
CAMDEN PROPERTY TRUST	17.02		28.64	3,055	2.1
EQUINIX INC	7.91		7.51	5,657	3.8
COUSINS PROPERTIES INC	318.645		316.515	7,216	4.9
CROWN CASTLE INC	19.13		19	1,911	1.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24.451		19.971	5,353	3.6
EQUITY RESIDENTIAL	63.915		49.165	3,199	2.2
FEDERAL REALTY INVS TRUST	30.35		30.15	3,045	2.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	145.016		121.226	2,338	1.6
HIGHWOODS PROPERTIES INC	78.84		78.31	1,974	1.3
WELLTOWER INC	57.21		39.45	4,095	2.8
REGENCY CENTERS CORP	56.12		55.74	3,413	2.3
UDR INC	95.75		95.11	3,773	2.5
SIMON PROPERTY GROUP INC	48.26		45.8	6,951	4.7
PUBLIC STORAGE	25.26		23.97	6,563	4.4
SUN COMMUNITIES INC	23.05		12.96	1,497	1.0
VENTAS INC	123.95		123.12	6,120	4.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	17.855		16.945	2,509	1.7
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	372.36		353.37	3,537	2.4
CUBESMART	31.03		-	-	-
DIGITAL REALTY TRUST INC	46.71		46.4	6,790	4.6
DOUGLAS EMMETT INC	115.3		114.53	1,531	1.0
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	268.12		266.32	3,331	2.2
TERRENO REALTY CORP	93.973		75.173	4,198	2.8
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	305.163		380.293	1,833	1.2
AMERICAN TOWER CORP	26.75		34.99	6,797	4.6
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	70.98		93.1	4,107	2.8
AMERICAN HOMES 4 RENT	111.95		95.58	3,407	2.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	316.88		266.73	6,025	4.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	100.07		99.4	2,319	1.6
VICI PROPERTIES INC	63.24		60.02	1,702	1.1
合計	3,371.489		3,235.929	142,607	-
	35銘柄<97.7%>		33銘柄<96.2%>	-	96.2

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6月10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10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11日現在		2024年6月10日現在		
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
不動産ファンド		千口	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	8,228	1,291,906	3.7
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	12,484.5 1銘柄<3.4%>	14,435.4 1銘柄<3.7%>	8,228 -	1,291,906 -	- 3.7
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT		421.539	421.539	18,602	2,121,802	6.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		819.87	733.47	12,505	1,426,395	4.1
CROMBIE REAL ESTATE INV		576.2	576.2	7,329	835,975	2.4
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		771.8	771.8	10,535	1,201,630	3.4
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV		1,162.95	1,162.95	20,258	2,310,694	6.6
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3,752.359 5銘柄<23.5%>	3,665.959 5銘柄<22.4%>	69,231 -	7,896,499 -	- 22.4
(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	9,128	942,341	2.7
GPT GROUP		2,757.12	485.603	2,083	215,052	0.6
STOCKLAND		944.822	944.822	4,336	447,680	1.3
INGENIA COMMUNITIES GROUP		2,199.852	2,199.852	10,735	1,108,202	3.1
GOODMAN GROUP		597.337	597.337	21,091	2,177,324	6.2
VICINITY CENTRES		6,302.094	6,302.094	12,226	1,262,096	3.6
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA		2,991.532	-	-	-	-
REGION RE LTD		8,722.312	8,722.312	19,189	1,980,889	5.6
NATIONAL STORAGE REIT		7,135.696	7,135.696	16,269	1,679,488	4.8
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	34,881.423 9銘柄<29.4%>	29,112.661 8銘柄<27.9%>	95,060 -	9,813,076 -	- 27.9
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT		-	1,856	62,918	1,264,659	3.6
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄<-%>	1,856 1銘柄<3.6%>	62,918 -	1,264,659 -	- 3.6
(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	9,237	1,072,091	3.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3,626.991 2銘柄<3.8%>	2,517 1銘柄<3.0%>	9,237 -	1,072,091 -	- 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	22,901	2,193,766	6.2
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	10,701.792 1銘柄<5.9%>	10,701.792 1銘柄<6.2%>	22,901 -	2,193,766 -	- 6.2
(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	2,925	584,219	1.7
SEGRO PLC		649.531	649.531	5,878	1,174,005	3.3

銘柄	2023年12月11日現在		2024年6月10日現在			
	□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	%	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	3,425.318	4,792.979	6,873	1,372,701	3.9	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	-	4,830.553	7,622	1,522,388	4.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	5,059.063 3銘柄<10.3%>	10,591.538 4銘柄<13.2%>	23,299 -	4,653,314 -	- 13.2
(オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	452.507	452.507	11,493	1,945,075	5.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	452.507 1銘柄<4.1%>	452.507 1銘柄<5.5%>	11,493 -	1,945,075 -	- 5.5
(ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
COFINIMMO SA	34.726	15.778	934	158,070	0.4	
WAREHOUSES DE PAUW	690.172	320.887	8,343	1,411,896	4.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	724.898 2銘柄<9.7%>	336.665 2銘柄<4.5%>	9,277 -	1,569,966 -	- 4.5
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	32.875	32.875	3,277	554,674	1.6	
ICADE	45.296	-	-	-	-	
KLEPIERRE	285.887	285.887	7,627	1,290,795	3.7	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	364.058 3銘柄<5.4%>	318.762 2銘柄<5.2%>	10,905 -	1,845,470 -	- 5.2
(スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	174.863	174.863	1,095	185,394	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%>	1,095 -	185,394 -	- 0.5
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	72,222.454 28銘柄<95.8%>	74,163.147 27銘柄<95.8%>	- -	33,731,222 -	- 95.8

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6月10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10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10日現在

項 目	第 41 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	21,571,221	38.6
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	32,610,599	58.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,656,692	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	55,838,513	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10日現在、DIAM US・リート・オープン・マザーファンドは22,802,673千円、97.7％、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34,156,548千円、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10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=157.01円、1カナダ・ドル=114.06円、1オーストラリア・ドル=103.23円、1香港・ドル=20.10円、1シンガポール・ドル=116.06円、1ニュージーランド・ドル=95.79円、1イギリス・ポンド=199.72円、1ユーロ=169.23円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月9日)、(2024年2月9日)、(2024年3月11日)、(2024年4月9日)、(2024年5月9日)、(2024年6月10日)現在

項 目	第 235 期 末	第 236 期 末	第 237 期 末	第 238 期 末	第 239 期 末	第 240 期 末
(A) 資 産	55,780,207,598円	55,646,109,538円	55,268,901,981円	55,381,116,276円	55,473,594,733円	55,838,513,582円
コール・ローン等	876,259,378	1,594,851,835	1,628,793,171	1,622,704,350	1,674,874,438	1,656,692,917
DIAM US・ リート・オープン・ マザーファンド(評価額)	21,703,336,984	21,382,821,436	21,273,012,856	21,386,013,388	21,166,493,656	21,571,221,646
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)	32,650,611,236	32,668,436,267	32,367,095,954	32,372,398,538	32,632,226,639	32,610,599,019
未 収 入 金	550,000,000	-	-	-	-	-
(B) 負 債	261,253,093	273,029,551	276,426,612	250,652,469	275,854,867	284,346,082
未 払 収 益 分 配 金	153,115,776	151,703,761	149,734,273	148,468,555	147,728,634	146,658,710
未 払 解 約 金	31,566,775	39,878,639	45,162,513	25,907,268	50,925,193	52,471,318
未 払 信 託 報 酬	76,465,235	81,334,988	81,417,582	76,171,558	77,094,056	85,099,031
そ の 他 未 払 費 用	105,307	112,163	112,244	105,088	106,984	117,023
(C) 純資産総額(A-B)	55,518,954,505	55,373,079,987	54,992,475,369	55,130,463,807	55,197,739,866	55,554,167,500
元 本	102,077,184,585	101,135,841,204	99,822,849,187	98,979,037,178	98,485,756,549	97,772,473,652
次 期 繰 越 損 益 金	△46,558,230,080	△45,762,761,217	△44,830,373,818	△43,848,573,371	△43,288,016,683	△42,218,306,152
(D) 受 益 権 総 口 数	102,077,184,585口	101,135,841,204口	99,822,849,187口	98,979,037,178口	98,485,756,549口	97,772,473,652口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,439円	5,475円	5,509円	5,570円	5,605円	5,682円

(注) 第234期末における元本額は102,966,348,775円、当作成期間(第235期~第240期)中における追加設定元本額は528,645,048円、同解約元本額は5,722,520,171円です。

■損益の状況

[自 2023年12月12日 至 2024年1月9日] [自 2024年1月10日 至 2024年2月9日] [自 2024年2月10日 至 2024年3月11日] [自 2024年3月12日 至 2024年4月9日] [自 2024年4月10日 至 2024年5月9日] [自 2024年5月10日 至 2024年6月10日]

項 目	第 235 期	第 236 期	第 237 期	第 238 期	第 239 期	第 240 期
(A) 配 当 等 収 益	△15,058円	△12,295円	△5,283円	42,189円	72,473円	76,935円
受 取 利 息	43	495	34	44,501	72,473	76,935
支 払 利 息	△15,101	△12,790	△5,317	△2,312	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,239,994,675	599,221,391	569,534,787	827,486,640	567,047,904	987,839,009
売 買 益	2,254,028,276	619,633,815	569,951,712	831,777,780	705,674,845	993,107,639
売 買 損	△14,033,601	△20,412,424	△416,925	△4,291,140	△138,626,941	△5,268,630
(C) 信 託 報 酬 等	△76,570,542	△81,447,151	△81,529,826	△76,276,646	△77,201,040	△85,216,054
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,163,409,075	517,761,945	487,999,678	751,252,183	489,919,337	902,699,890
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	6,974,291,064	8,892,275,764	9,130,819,365	9,381,773,944	9,926,636,459	10,186,814,929
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△55,542,814,443	△55,021,095,165	△54,299,458,588	△53,833,130,943	△53,556,843,845	△53,161,162,261
(配 当 等 相 当 額)	(4,459,031,572)	(4,434,402,790)	(4,388,996,863)	(4,363,564,999)	(4,354,236,161)	(4,333,937,506)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△60,001,846,015)	(△59,455,497,955)	(△58,688,455,451)	(△58,196,695,942)	(△57,911,080,006)	(△57,495,099,767)
(G) 合 計 (D + E + F)	△46,405,114,304	△45,611,057,456	△44,680,639,545	△43,700,104,816	△43,140,288,049	△42,071,647,442
(H) 収 益 分 配 金	△153,115,776	△151,703,761	△149,734,273	△148,468,555	△147,728,634	△146,658,710
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△46,558,230,080	△45,762,761,217	△44,830,373,818	△43,848,573,371	△43,288,016,683	△42,218,306,152
追 加 信 託 差 損 益 金	△55,542,814,443	△55,021,095,165	△54,299,458,588	△53,833,130,943	△53,556,843,845	△53,161,162,261
(配 当 等 相 当 額)	(4,459,096,867)	(4,434,418,643)	(4,389,035,897)	(4,363,655,719)	(4,354,300,617)	(4,333,976,145)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△60,001,911,310)	(△59,455,513,808)	(△58,688,494,485)	(△58,196,786,662)	(△57,911,144,462)	(△57,495,138,406)
分 配 準 備 積 立 金	15,608,057,404	15,361,159,097	15,157,674,686	15,082,010,871	15,016,186,448	14,842,988,994
繰 越 損 益 金	△6,623,473,041	△6,102,825,149	△5,688,589,916	△5,097,453,299	△4,747,359,286	△3,900,132,885

(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235期から第240期まではD I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド53,221,976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80,079,432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 235 期	第 236 期	第 237 期	第 238 期	第 239 期	第 240 期
(a) 経費控除後の配当等収益	270,529,938円	65,164,334円	157,818,359円	212,567,889円	169,396,004円	93,388,386円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	4,459,096,867	4,434,418,643	4,389,035,897	4,363,655,719	4,354,300,617	4,333,976,145
(d) 分 配 準 備 積 立 金	15,490,643,242	15,447,698,524	15,149,590,600	15,017,911,537	14,994,519,078	14,896,259,318
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a + b + c + d)	20,220,270,047	19,947,281,501	19,696,444,856	19,594,135,145	19,518,215,699	19,323,623,849
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,980.88	1,972.33	1,973.14	1,979.62	1,981.83	1,976.39
(g) 分 配 金	153,115,776	151,703,761	149,734,273	148,468,555	147,728,634	146,658,710
(h) 1万口当たり分配金	15	15	15	15	15	15

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 235 期	第 236 期	第 237 期	第 238 期	第 239 期	第 240 期
1 万口当たり分配金	15円	15円	15円	15円	15円	15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。

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。

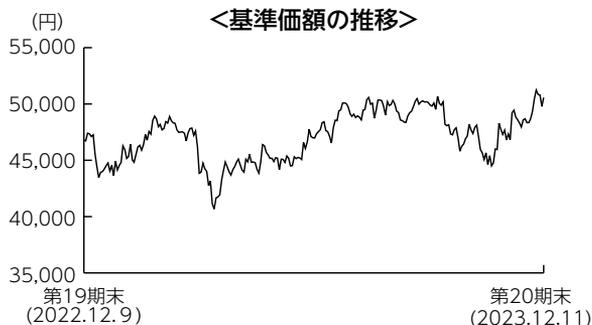
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■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)	千口	千口	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。

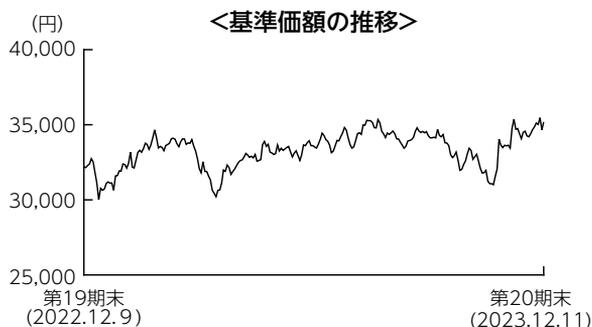
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

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