

運用報告書 (全体版)

DIAM世界3資産オープン(毎月決算型)

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 | 2007年6月22日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | DIAM世界3資産オープン(毎月決算型) | 以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | DIAM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。 |
| | DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド | 日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。 |
| | 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。 |
| | 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 | 各マザーファンドの受益証券への投資を通じ、実質的に外国債券、外国株式、外国不動産投資信託証券の3資産へ分散投資を行います。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。各資産への投資は、原則として3分の1を基本資産配分比率とし、各マザーファンド受益証券を通じて行います。ただし、外国不動産投資信託証券への投資については、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の純資産総額を合算して資産配分を算出します。なお、時価変動等により各マザーファンド受益証券の時価構成比率が基本資産配分比率から乖離した場合は、原則として定期的に基本資産配分比率に近づけるものとします。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。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。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8日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。原則として、利子配当等収益を中心に安定的に分配を行うことをめざし、売買益(評価益を含みます。)等については、決算時の基準価額水準を勘案して分配することとします。なお、原則として四半期毎(2月、5月、8月、11月)の決算時には、利子配当等収益に売買益(評価益を含みます。)等を加えた額から分配を行うこととします。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。 | |

<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：ハッピーハーモニー

| | | |
|-------|------|--------------|
| 第192期 | <決算日 | 2023年6月8日> |
| 第193期 | <決算日 | 2023年7月10日> |
| 第194期 | <決算日 | 2023年8月8日> |
| 第195期 | <決算日 | 2023年9月8日> |
| 第196期 | <決算日 | 2023年10月10日> |
| 第197期 | <決算日 | 2023年11月8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世界3資産オープン(毎月決算型)」は、2023年11月8日に第197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世界3資産オープン（毎月決算型）

■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 受益証券、 投資証券 組入比率 | 純資産額 |
|--------|--------------------|------------|------------|-----------|-----------|--------|-----------|--------|-------------------------------|--------------|
| | | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | | | | | | |
| 第29作成期 | 168期 (2021年6月8日) | 円 9,480 | 円 15 | % 2.0 | % 33.2 | % - | % 31.1 | % - | % 32.2 | 百万円 2,014 |
| | 169期 (2021年7月8日) | 9,392 | 15 | △0.8 | 32.7 | - | 31.0 | - | 32.3 | 1,985 |
| | 170期 (2021年8月10日) | 9,437 | 15 | 0.6 | 33.2 | - | 31.2 | - | 32.0 | 1,961 |
| | 171期 (2021年9月8日) | 9,510 | 15 | 0.9 | 32.3 | - | 31.1 | - | 32.6 | 1,968 |
| | 172期 (2021年10月8日) | 9,355 | 15 | △1.5 | 32.6 | - | 31.9 | - | 32.0 | 1,929 |
| | 173期 (2021年11月8日) | 9,806 | 15 | 5.0 | 33.3 | - | 31.4 | - | 31.9 | 1,970 |
| 第30作成期 | 174期 (2021年12月8日) | 9,611 | 15 | △1.8 | 32.7 | - | 32.0 | - | 32.0 | 1,901 |
| | 175期 (2022年1月11日) | 9,884 | 15 | 3.0 | 33.3 | - | 31.8 | - | 31.1 | 1,937 |
| | 176期 (2022年2月8日) | 9,636 | 15 | △2.4 | 33.6 | - | 32.5 | - | 30.1 | 1,874 |
| | 177期 (2022年3月8日) | 9,264 | 15 | △3.7 | 31.4 | - | 33.4 | - | 31.1 | 1,792 |
| | 178期 (2022年4月8日) | 10,227 | 15 | 10.6 | 32.6 | - | 32.1 | - | 31.1 | 1,939 |
| | 179期 (2022年5月9日) | 9,942 | 15 | △2.6 | 34.2 | - | 32.3 | - | 29.3 | 1,864 |
| 第31作成期 | 180期 (2022年6月8日) | 10,298 | 15 | 3.7 | 33.4 | - | 32.8 | - | 29.4 | 1,913 |
| | 181期 (2022年7月8日) | 9,811 | 15 | △4.6 | 33.0 | - | 34.1 | - | 28.8 | 1,819 |
| | 182期 (2022年8月8日) | 10,045 | 15 | 2.5 | 33.1 | - | 33.9 | - | 29.4 | 1,856 |
| | 183期 (2022年9月8日) | 10,206 | 15 | 1.8 | 33.5 | - | 33.3 | - | 29.6 | 1,868 |
| | 184期 (2022年10月11日) | 9,276 | 15 | △9.0 | 34.8 | - | 33.7 | - | 27.5 | 1,687 |
| | 185期 (2022年11月8日) | 9,946 | 15 | 7.4 | 35.3 | - | 32.4 | - | 28.2 | 1,808 |
| 第32作成期 | 186期 (2022年12月8日) | 9,734 | 15 | △2.0 | 35.1 | - | 32.4 | - | 27.9 | 1,763 |
| | 187期 (2023年1月10日) | 9,511 | 15 | △2.1 | 35.2 | - | 32.7 | - | 28.1 | 1,713 |
| | 188期 (2023年2月8日) | 9,646 | 15 | 1.6 | 33.5 | - | 32.6 | - | 29.2 | 1,724 |
| | 189期 (2023年3月8日) | 9,725 | 15 | 1.0 | 34.6 | - | 32.3 | - | 28.8 | 1,736 |
| | 190期 (2023年4月10日) | 9,589 | 15 | △1.2 | 34.3 | - | 33.4 | - | 27.8 | 1,707 |
| | 191期 (2023年5月8日) | 9,856 | 15 | 2.9 | 33.7 | - | 33.3 | - | 28.6 | 1,752 |
| 第33作成期 | 192期 (2023年6月8日) | 9,918 | 15 | 0.8 | 33.5 | - | 33.3 | - | 29.3 | 1,744 |
| | 193期 (2023年7月10日) | 10,029 | 15 | 1.3 | 32.9 | - | 33.0 | - | 29.8 | 1,733 |
| | 194期 (2023年8月8日) | 10,192 | 15 | 1.8 | 32.5 | - | 33.0 | - | 29.8 | 1,737 |
| | 195期 (2023年9月8日) | 10,150 | 15 | △0.3 | 32.8 | - | 32.8 | - | 30.1 | 1,732 |
| | 196期 (2023年10月10日) | 9,893 | 15 | △2.4 | 33.1 | - | 33.0 | - | 29.7 | 1,685 |
| | 197期 (2023年11月8日) | 10,049 | 15 | 1.7 | 33.0 | - | 33.1 | - | 30.1 | 1,703 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「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。

(注5) 運用方針に合った適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(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、 投 資 証 券 組 入 比 率 |
|-------|----------------------|---------|--------|----------------|----------------|----------------|----------------|---|
| | | 円 | 騰 落 率 | | | | | |
| 第192期 | (期 首) 2023年5月8日 | 9,856 | % - | % 33.7 | % - | % 33.3 | % - | % 28.6 |
| | 5 月 末 | 9,762 | △1.0 | 33.7 | - | 33.5 | - | 28.5 |
| | (期 末) 2023年6月8日 | 9,933 | 0.8 | 33.5 | - | 33.3 | - | 29.3 |
| 第193期 | (期 首) 2023年6月8日 | 9,918 | - | 33.5 | - | 33.3 | - | 29.3 |
| | 6 月 末 | 10,256 | 3.4 | 33.6 | - | 33.0 | - | 28.9 |
| | (期 末) 2023年7月10日 | 10,044 | 1.3 | 32.9 | - | 33.0 | - | 29.8 |
| 第194期 | (期 首) 2023年7月10日 | 10,029 | - | 32.9 | - | 33.0 | - | 29.8 |
| | 7 月 末 | 10,219 | 1.9 | 33.3 | - | 32.5 | - | 29.9 |
| | (期 末) 2023年8月8日 | 10,207 | 1.8 | 32.5 | - | 33.0 | - | 29.8 |
| 第195期 | (期 首) 2023年8月8日 | 10,192 | - | 32.5 | - | 33.0 | - | 29.8 |
| | 8 月 末 | 10,297 | 1.0 | 32.9 | - | 32.7 | - | 29.9 |
| | (期 末) 2023年9月8日 | 10,165 | △0.3 | 32.8 | - | 32.8 | - | 30.1 |
| 第196期 | (期 首) 2023年9月8日 | 10,150 | - | 32.8 | - | 32.8 | - | 30.1 |
| | 9 月 末 | 10,019 | △1.3 | 33.0 | - | 32.8 | - | 29.5 |
| | (期 末) 2023年10月10日 | 9,908 | △2.4 | 33.1 | - | 33.0 | - | 29.7 |
| 第197期 | (期 首) 2023年10月10日 | 9,893 | - | 33.1 | - | 33.0 | - | 29.7 |
| | 10 月 末 | 9,630 | △2.7 | 33.5 | - | 33.6 | - | 29.2 |
| | (期 末) 2023年11月8日 | 10,064 | 1.7 | 33.0 | - | 33.1 | - | 30.1 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

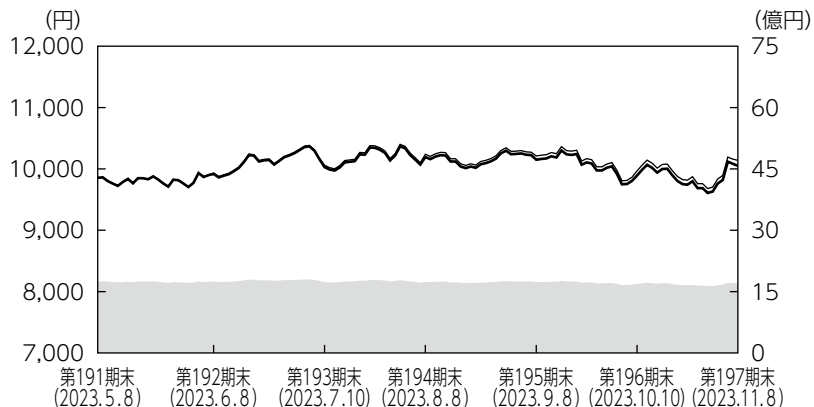
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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192期～第197期の運用経過（2023年5月9日から2023年11月8日まで）

基準価額等の推移



第192期首： 9,856円
 第197期末： 10,049円
 (既払分配金90円)
 騰落率： 2.9%
 (分配金再投資ベース)

■ 純資産総額 (右軸) — 基準価額 (左軸) — 分配金再投資基準価額 (左軸)

- (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。

基準価額の変動要因

インフレの抑制を目的とした主要国の金融引き締め等を背景に、主要国の長期金利が上昇（債券価格は下落）したことや外国リートが下落したこと等がマイナスに寄与しました。一方、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から主要通貨に対して円安となったこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から外国株式市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、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 | 2.1% |
| DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド | 7.5% |
| DIAM US・リート・オープン・マザーファンド | 3.5% |
| 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 | △0.3% |

投資環境

外国債券市場では、いずれの投資国でも国債利回りが上昇（価格は下落）しました。米国では、インフレ率は低下しているものの目標を上回る水準が続いていること、景気も堅調さを保っていることからFRB（米連邦準備理事会）が高金利の長期化を示唆したことを背景に、将来の利下げ織り込みが剥落したことから国債利回りが上昇しました。投資国の国債利回りもインフレが目標を上回る水準が続く中、米国国債利回りに連れて上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。作成期初から2023年7月までは、企業の堅調な4－6月期決算が好感されたことや、インフレ懸念の後退などもあり上昇しました。8月以降は、原油高の影響や堅調な米経済指標などをを受けて長期金利が上昇し、さらに中東情勢への不安感から株価は軟調に推移しました。作成期末にかけては、米雇用統計が市場予想を下回ったことで米金融引き締め懸念が和らぎ、株価は反転しました。

米国リート市場は下落しました。作成期初から2023年7月にかけては、S L グリーンの物件売却を受けてオフィス市場への過度な懸念が後退したことなどから、上昇する局面もありました。しかし、米長期金利が上昇したことなどから米国リート市場は下落に転じて作成期末を迎えました。セクター別では、工業や倉庫などが大きく下落しました。

米国以外のリート市場は、下落しました。欧州市場は長期金利の上昇などをを受けて下落しました。アジア市場では中国の景気減速懸念から香港が大きく下落し、シンガポールも同様の理由や米国長期金利の上昇などをを受けて下落しました。オーストラリア市場でも、オーストラリア長期金利が米国長期金利に連れ高したことなどから下落しました。

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。米ドル／円相場は、内外金利差の拡大や内外の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安米ドル高基調の動きとなりました。その他主要通貨に対しても、内外金利差の拡大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

マザーファンドを通じて外国債券、外国株式、外国REITの3資産に投資を行いました。また、組入れる3資産の保有比率が均等となるように資産配分を行いました。

●DIAM高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション[※]については、投資国および世界経済・インフレ見通し、主要国および投資国の金融政策を勘案して、機動的に調整を行いました。当作成期末のデュレーションは、主要国の景気が堅調を保っていることから高金利局面の長期化による利回り上昇を警戒し、作成期初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。

●DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド

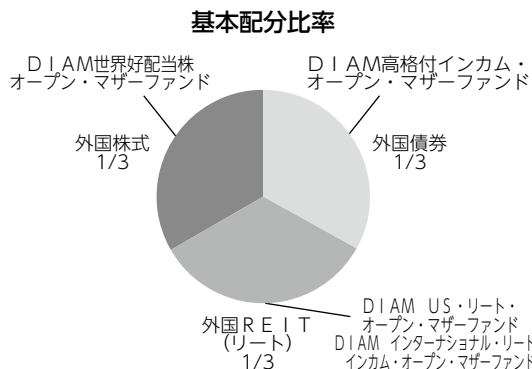
銘柄選択においては、「地域の分散」、「業種の分散」に着目し、世界の好配当株への投資を通じて、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざした運用を行いました。地域別では、概ね前作成期末と同様の資産配分を維持しました。業種別では、幅広い業種に分散投資を行う中、情報技術セクターや金融セクターに対する投資比率を高位に維持しました。

●DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

適正価格に到達したと見られる銘柄については、適宜入れ替えを行いました。また、米国景気の先行きや米長期金利の動向も注視しつつ、保守的な財務体質かつ長期的に見て成長見込みがある銘柄や、割安な水準にある銘柄を選別して投資しました。小売りなどの組入比率を引き上げた一方、工業などの組入比率を引き下げました。

●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

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、オーストラリアなどの組入比率を引き上げた一方、イギリスなどの組入比率を引き下げました。また、セクター別では、住居施設などの組入比率を引き上げた一方、工業などの組入比率を引き下げました。

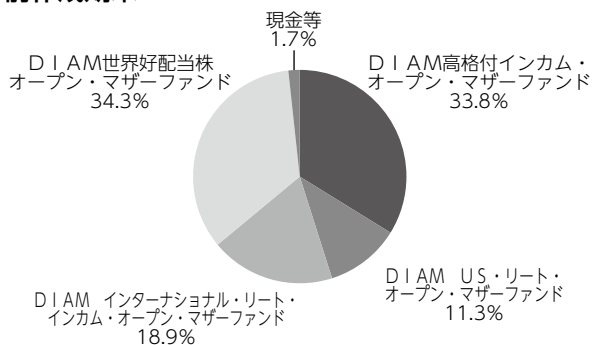


※各マザーファンドの時価の変動などにより、時価構成比率が変化した場合には、定期的に基本配分比率に修正します。

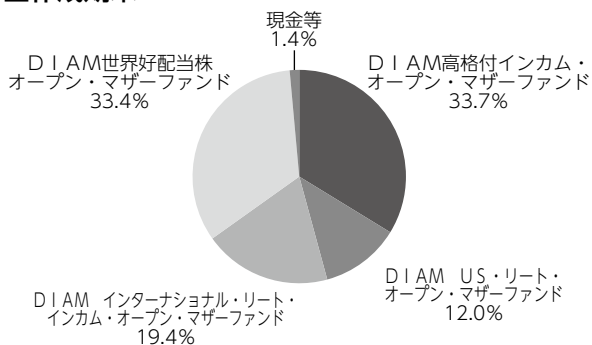
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

前作成期末



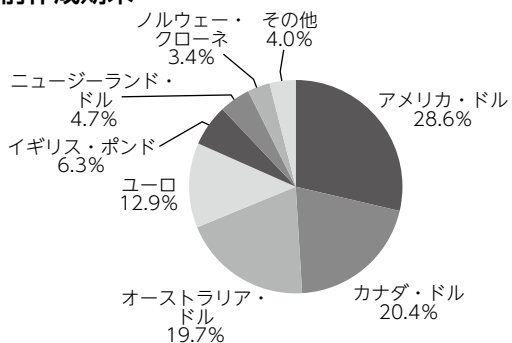
当作成期末



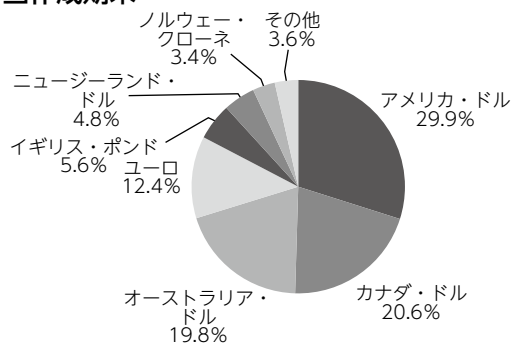
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



(注1) 組入比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券評価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192期 | 第193期 | 第194期 | 第195期 | 第196期 | 第197期 |
|------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-------------------------|---------------------------|----------------------------|
| | 2023年5月9日 ~2023年6月8日 | 2023年6月9日 ~2023年7月10日 | 2023年7月11日 ~2023年8月8日 | 2023年8月9日 ~2023年9月8日 | 2023年9月9日 ~2023年10月10日 | 2023年10月11日 ~2023年11月8日 |
| 当期分配金（税引前） | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 |
| 対基準価額比率 | 0.15% | 0.15% | 0.15% | 0.15% | 0.15% | 0.15% |
| 当期の収益 | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 | 15円 | 11円 |
| 当期の収益以外 | -円 | -円 | -円 | -円 | -円 | 3円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,248円 | 1,268円 | 1,270円 | 1,272円 | 1,276円 | 1,272円 |

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

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

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

●D I 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。デフレーションについては、主要国および投資国の中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

●D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド

外国株式市場は、インフレ懸念やそれに伴う金利の先行き不透明感などもあり、短期的には不安定な動きも想定されます。一方、来年以降にかけては企業業績の底打ちが期待できる状況にあります。そのような変化の大きい環境下、配当利回りが市場平均以上であり、利益およびキャッシュフローの成長性が高く、将来的にも十分な配当が期待できる銘柄を選別する運用方針を継続します。

●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

経済活動の正常化が進む一方で、インフレの高止まりや金利の上昇により米国経済の成長鈍化懸念が強まっており、米国リート市場は目先神経質な展開が予想されます。引き続き財務体質が良好で、長期的な成長が期待できる銘柄を選別して投資する方針です。また、割安な水準にある銘柄にも投資することにより、比較的高い配当利回りを維持できるポートフォリオを構築していきます。

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

世界的なインフレの高止まりや金利上昇に対する警戒感から、リート市場は不安定な展開になることが予想されます。こうした中、欧州市場は、工業、住居施設など、安定したキャッシュフローが期待しやすい銘柄に重点的に投資を行っていく方針です。オーストラリア市場は、工業や小売り等のうち財務体質や成長性、配当利回りなどで選別し投資する方針です。アジア市場は、優れた収益成長見通しと健全な資本管理を持つ銘柄を選別し投資を行っていく方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第192期～第197期 | | 項目の概要 |
|-------------|------------------------|---------|--|
| | (2023年5月9日～2023年11月8日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 67円 | 0.663% | (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10,038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) | (32) | (0.320) | |
| (販売会社) | (31) | (0.309) | |
| (受託会社) | (3) | (0.033) | |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.008 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (1) | (0.005) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.001) | |
| (投資証券) | (0) | (0.002) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.004 | (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) | (0.003) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.001) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.009 | (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) | (0.002) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 69 | 0.684 | |

(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。

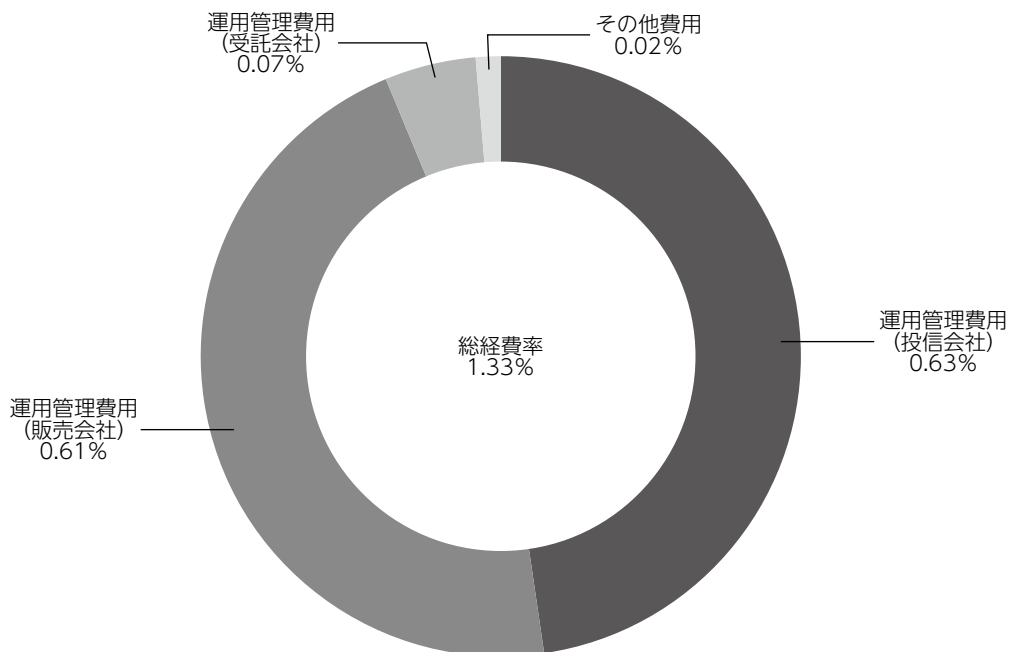
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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5月9日から2023年11月8日まで）

| | 第 192 期 ~ 第 197 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 | — | — | 11,586 | 30,000 |
| D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド | — | — | 18,064 | 75,000 |
| D I A M U S ・ 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 | — | — | — | — |

■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 192 期 ~ 第 197 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 | 12,993,552千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 36,191,583千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 0.35 |

(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9日から2023年11月8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 32 作 成 期 末 | 第 33 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 | 233,775 | 222,188 | 574,602 |
| D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド | 150,952 | 132,888 | 569,200 |
| D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド | 43,332 | 43,332 | 204,914 |
| 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 | 98,557 | 98,557 | 329,951 |

<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 (36,922,999,085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 | 2023 年 11 月 8 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 372,200 | 千カナダ・ドル 344,300 | 千円 37,663,078 | % 39.4 | % - | % 17.1 | % 13.6 | % 8.7 |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 447,000 | 千オーストラリア・ドル 383,357 | 千円 37,105,165 | 38.9 | - | 27.8 | 4.5 | 6.6 |
| ニュージーランド | 千ニュージーランド・ドル 133,500 | 千ニュージーランド・ドル 107,832 | 千円 9,632,658 | 10.1 | - | 6.6 | 1.7 | 1.8 |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 752,000 | 千ノルウェー・クローネ 686,877 | 千円 9,238,505 | 9.7 | - | 4.6 | 3.6 | 1.5 |
| 合 計 | - | - | 千円 93,639,407 | 98.1 | - | 56.1 | 23.4 | 18.6 |

(注1) 邦貨換算金額は、2023年11月8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、2023年11月8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 | 2023 年 11 月 8 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 | | |
| CANADA 0.25 03/01/26 | 国債証券 | 0.2500 | 25,000 | 22,809 | 2,495,127 | 2026/03/01 | |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 20,900 | 24,164 | 2,643,380 | 2033/06/01 | |
| CANADA 5.00 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 7,300 | 8,216 | 898,762 | 2037/06/01 | |
| CANADA 4.00 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 5,000 | 5,191 | 567,876 | 2041/06/01 | |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 2,000 | 1,708 | 186,872 | 2030/06/01 | |
| CANADA 1.50 06/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 2,000 | 1,700 | 186,053 | 2031/06/01 | |
| CANADA 2.75 08/01/24 | 国債証券 | 2.7500 | 67,000 | 65,944 | 7,213,677 | 2024/08/01 | |
| CANADA 0.50 09/01/25 | 国債証券 | 0.5000 | 11,000 | 10,248 | 1,121,079 | 2025/09/01 | |
| CANADA 2.75 09/01/27 | 国債証券 | 2.7500 | 25,000 | 23,941 | 2,618,925 | 2027/09/01 | |
| CANADA 3.50 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 12,000 | 11,737 | 1,284,012 | 2045/12/01 | |
| CANADA 2.00 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 37,000 | 26,681 | 2,918,641 | 2051/12/01 | |
| CANADA 1.75 12/01/53 | 国債証券 | 1.7500 | 6,000 | 4,008 | 438,498 | 2053/12/01 | |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 5,000 | 4,133 | 452,183 | 2064/12/01 | |
| BRITISH COLUMBIA PROVINCE 3.20 06/18/32 | 地方債証券 | 3.2000 | 10,000 | 9,095 | 994,927 | 2032/06/18 | |
| PROVINCE OF QUEBEC 2.75 09/01/28 | 地方債証券 | 2.7500 | 50,000 | 46,879 | 5,128,161 | 2028/09/01 | |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.90 09/01/30 | 地方債証券 | 1.9000 | 30,000 | 25,749 | 2,816,724 | 2030/09/01 | |

| 銘 柄 | 2023 年 11 月 8 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 | |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.25 09/01/32 | 地方債証券 | 3.2500 | 12,000 | 10,942 | 1,196,974 | 2032/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.5 09/01/31 | 地方債証券 | 1.5000 | 20,000 | 16,210 | 1,773,285 | 2031/09/01 |
| KOMBNK 4.9 10/05/26 | 特殊債券 | 4.9000 | 20,000 | 20,193 | 2,208,977 | 2026/10/05 |
| CANHOU 1.95 12/15/25 | 特殊債券 | 1.9500 | 5,000 | 4,743 | 518,937 | 2025/12/15 |
| 小 計 | — | — | 372,200 | 344,300 | 37,663,078 | — |
| (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 | 13,000 | 9,359 | 905,881 | 2047/03/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 41,000 | 40,703 | 3,939,729 | 2024/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 13,000 | 12,296 | 1,190,216 | 2029/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 8,000 | 7,153 | 692,402 | 2037/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 5,000 | 4,580 | 443,307 | 2028/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 23,000 | 20,449 | 1,979,348 | 2030/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 9,000 | 6,656 | 644,241 | 2041/05/21 |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 11,000 | 8,397 | 812,828 | 2032/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34 | 国債証券 | 3.7500 | 21,000 | 19,349 | 1,872,804 | 2034/05/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 06/21/54 | 国債証券 | 4.7500 | 20,000 | 19,158 | 1,854,309 | 2054/06/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 5,000 | 4,091 | 396,044 | 2039/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 9,051 | 876,064 | 2035/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 国債証券 | 1.7500 | 22,000 | 11,256 | 1,089,564 | 2051/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 3,000 | 2,736 | 264,851 | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33 | 国債証券 | 3.0000 | 18,000 | 15,584 | 1,508,416 | 2033/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31 | 国債証券 | 1.0000 | 30,000 | 22,798 | 2,206,645 | 2031/11/21 |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/24 | 国債証券 | 0.2500 | 25,000 | 23,948 | 2,317,981 | 2024/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 国債証券 | 1.0000 | 17,000 | 13,382 | 1,295,315 | 2030/12/21 |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 8,948 | 866,141 | 2034/12/21 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36 | 地方債証券 | 4.2500 | 14,000 | 12,357 | 1,196,071 | 2036/02/20 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29 | 地方債証券 | 3.0000 | 23,000 | 21,087 | 2,041,044 | 2029/04/20 |
| SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32 | 地方債証券 | 1.7500 | 6,500 | 4,955 | 479,612 | 2032/05/24 |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26 | 地方債証券 | 3.7000 | 11,000 | 10,654 | 1,031,265 | 2026/05/20 |
| AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30 | 地方債証券 | 1.7500 | 4,000 | 3,298 | 319,252 | 2030/05/17 |
| AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 16,000 | 12,885 | 1,247,189 | 2032/10/22 |
| TREASURY CORP VICTORIA 2.25 11/20/34 | 地方債証券 | 2.2500 | 11,000 | 8,013 | 775,631 | 2034/11/20 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 15,000 | 12,082 | 1,169,461 | 2032/11/22 |
| KOMBNK 4.35 01/18/28 | 特殊債券 | 4.3500 | 10,000 | 9,755 | 944,228 | 2028/01/18 |
| KOMBNK 4.4 02/17/26 | 特殊債券 | 4.4000 | 10,000 | 9,894 | 957,642 | 2026/02/17 |
| NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36 | 特殊債券 | 2.3350 | 4,500 | 3,264 | 315,954 | 2036/06/30 |
| EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31 | 特殊債券 | 1.4650 | 7,000 | 5,390 | 521,748 | 2031/08/18 |
| EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28 | 特殊債券 | 4.5000 | 10,000 | 9,814 | 949,963 | 2028/09/06 |
| 小 計 | — | — | 447,000 | 383,357 | 37,105,165 | — |
| (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 | 8,000 | 7,869 | 703,004 | 2027/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 8,746 | 781,317 | 2033/04/14 |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 8,281 | 739,782 | 2037/04/15 |

| 銘 柄 | 2023 年 11 月 8 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 3.0 04/20/29 | 国 債 証 券 | 3.0000 | 7,500 | 6,775 | 605,271 | 2029/04/20 |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国 債 証 券 | 2.7500 | 11,000 | 6,957 | 621,484 | 2051/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国 債 証 券 | 1.7500 | 21,000 | 12,409 | 1,108,502 | 2041/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31 | 国 債 証 券 | 1.5000 | 10,000 | 7,766 | 693,736 | 2031/05/15 |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32 | 国 債 証 券 | 2.0000 | 10,000 | 7,837 | 700,126 | 2032/05/15 |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 国 債 証 券 | 0.2500 | 2,000 | 1,618 | 144,561 | 2028/05/15 |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25 | 地 方 債 証 券 | 2.7500 | 8,000 | 7,683 | 686,379 | 2025/04/15 |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28 | 地 方 債 証 券 | 2.2500 | 10,000 | 8,719 | 778,873 | 2028/05/15 |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 4.5 05/15/30 | 地 方 債 証 券 | 4.5000 | 7,000 | 6,562 | 586,259 | 2030/05/15 |
| HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30 | 特 殊 債 券 | 2.1830 | 6,000 | 4,908 | 438,505 | 2030/04/24 |
| KOMBANK 4.0 08/20/25 | 特 殊 債 券 | 4.0000 | 12,000 | 11,696 | 1,044,850 | 2025/08/20 |
| 小 計 | — | — | 133,500 | 107,832 | 9,632,658 | — |
| (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 | 120,000 | 113,742 | 1,529,829 | 2026/02/19 |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国 債 証 券 | 1.7500 | 72,000 | 67,394 | 906,461 | 2027/02/17 |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国 債 証 券 | 1.7500 | 110,000 | 106,660 | 1,434,583 | 2025/03/13 |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国 債 証 券 | 2.0000 | 80,000 | 74,268 | 998,904 | 2028/04/26 |
| NORWAY 2.125 05/18/32 | 国 債 証 券 | 2.1250 | 70,000 | 61,777 | 830,911 | 2032/05/18 |
| NORWAY 1.375 08/19/30 | 国 債 証 券 | 1.3750 | 85,000 | 73,162 | 984,035 | 2030/08/19 |
| NORWAY 3.0 08/15/33 | 国 債 証 券 | 3.0000 | 60,000 | 56,265 | 756,764 | 2033/08/15 |
| NORWAY 1.75 09/06/29 | 国 債 証 券 | 1.7500 | 70,000 | 62,811 | 844,807 | 2029/09/06 |
| NORWAY 1.25 09/17/31 | 国 債 証 券 | 1.2500 | 85,000 | 70,796 | 952,207 | 2031/09/17 |
| 小 計 | — | — | 752,000 | 686,877 | 9,238,505 | — |
| 合 計 | — | — | — | — | 93,639,407 | — |

■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 (8,610,936,431口) の内容です。

外国株式

| 銘 | 柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月8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 | |
| AMGEN INC | | — | 85.61 | 2,320 | 349,700 | バイオテクノロジー |
| APPLE INC | | 258.78 | 289.22 | 5,258 | 792,312 | コンピュータ・周辺機器 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | | 346.85 | 196.8 | 1,029 | 155,049 | 医薬品 |
| JPMORGAN CHASE & CO | | 339.51 | 376 | 5,414 | 815,844 | 銀行 |
| CISCO SYSTEMS INC | | 1,268 | 1,465.97 | 7,788 | 1,173,523 | 通信機器 |
| CUMMINS INC | | 42.81 | 42.81 | 940 | 141,671 | 機械 |
| BANK OF AMERICA CORP | | 516.73 | 449.28 | 1,265 | 190,623 | 銀行 |
| EATON CORP PLC | | 116.51 | 168.71 | 3,641 | 548,655 | 電気設備 |
| NEXTERA ENERGY INC | | 344.18 | 453.48 | 2,651 | 399,432 | 電力 |
| GILEAD SCIENCES INC | | 340.71 | 164.97 | 1,329 | 200,364 | 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 | 2,345 | 353,455 | 医薬品 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | | 299.81 | 299.81 | 3,610 | 543,920 | 家庭用品 |
| LAM RESEARCH CORP | | — | 56.75 | 3,639 | 548,310 | 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 | 193.52 | 5,199 | 783,378 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MERCK & CO.INC. | | 754.49 | 234.67 | 2,440 | 367,720 | 医薬品 |
| MICROSOFT CORP | | 260.46 | 284.07 | 10,241 | 1,543,098 | ソフトウェア |
| 3M CO | | — | 222.9 | 2,076 | 312,838 | コンプロマリット |
| PACCAR INC | | 457.09 | — | — | — | 機械 |
| PAYCHEX INC | | 524.48 | 524.48 | 5,901 | 889,250 | 専門サービス |
| PPL CORPORATION | | 831.02 | 577.29 | 1,496 | 225,539 | 電力 |
| PEPSICO INC | | 155.27 | 196.56 | 3,286 | 495,115 | 飲料 |
| PFIZER INC | | 586.82 | 586.82 | 1,833 | 276,300 | 医薬品 |
| PROCTER & GAMBLE CO | | 91.51 | 91.51 | 1,378 | 207,630 | 家庭用品 |
| AT&T INC | | 1,593.32 | 1,593.32 | 2,523 | 380,263 | 各種電気通信サービス |
| CHEVRON CORP | | 338.7 | 323.7 | 4,674 | 704,314 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| STARBUCKS CORP | | 421.29 | 542.96 | 5,629 | 848,183 | 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 | 369.05 | 7,837 | 1,180,822 | 資本市場 |
| MASTERCARD INC | | 130.31 | 130.31 | 5,067 | 763,499 | 金融サービス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | | 669.41 | 669.41 | 6,110 | 920,650 | タバコ |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | | 294.91 | 294.91 | 2,686 | 404,838 | 化学 |
| ABBVIE INC | | 269.58 | 188.43 | 2,678 | 403,602 | バイオテクノロジー |
| BROADCOM INC | | 99.57 | 102.66 | 9,217 | 1,388,728 | 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 | 11,331.44 31銘柄 | 121,514 — | 18,308,642 <49.6%> | |
| (カナダ) | | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | | 717.64 | 737.8 | 6,435 | 704,015 | 銀行 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | | 374.96 | 573.6 | 2,965 | 324,397 | 銀行 |
| RUSSEL METALS INC | | 1,056.82 | 1,406.01 | 5,103 | 558,306 | 商社・流通業 |

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月8日現在 | | 業種等 |
|---|---|---|--|---|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) CAPITAL POWER CORP | 百株 842.72 | 百株 842.72 | 千カナダ・ドル 3,221 | 千円 352,423 | 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 | 3,560.13 4銘柄 | 17,726 - | 1,939,142 <5.3%> |
| (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 3,388 450 | 千円 327,953 43,624 | 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 | 3,839 - | 371,577 <1.0%> |
| (香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD NEW WORLD DEVELOPMENT CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD | 百株 7,280 7,700 - | 百株 7,280 6,320 11,600 | 千香港・ドル 15,360 9,429 9,790 | 千円 296,002 181,705 188,661 | 銀行 不動産管理・開発 建設・土木 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 14,980 2銘柄 | 25,200 3銘柄 | 34,580 - | 666,368 <1.8%> |
| (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 3,639 | 千円 404,803 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,307 1銘柄 | 1,307 1銘柄 | 3,639 - | 404,803 <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 | 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 1,155.92 343.71 2,153.01 453.25 854.22 5,964.93 829.3 2,235.93 - | 千イギリス・ポンド 2,717 1,131 2,084 1,337 2,300 2,370 1,419 2,869 1,652 3,185 - | 千円 503,170 209,403 385,940 247,524 425,889 438,934 262,752 531,162 305,981 589,778 - | 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 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 17,764.74 11銘柄 | 17,183.6 10銘柄 | 21,069 - | 3,900,538 <10.6%> |
| (スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS | 百株 86.78 607.3 | 百株 86.78 607.3 | 千スイス・フラン 2,051 5,112 | 千円 343,089 854,972 | 医薬品 医薬品 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 694.08 2銘柄 | 694.08 2銘柄 | 7,163 - | 1,198,062 <3.2%> |
| (デンマーク) NOVO NORDISK A/S-B | 百株 - | 百株 200.05 | 千デンマーク・クローネ 14,117 | 千円 304,797 | 医薬品 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | - 1銘柄 | 200.05 1銘柄 | 14,117 - | 304,797 <0.8%> |
| (スウェーデン) TELE2 AB-B SHS | 百株 2,133.28 | 百株 2,133.28 | 千スウェーデン・クローナ 17,441 | 千円 240,695 | 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 | 2,133.28 1銘柄 | 17,441 - | 240,695 <0.7%> |

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月8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…オランダ) FERROVIAL SE | 百株 - | 百株 1,029 | 千ユーロ 2,951 | 千円 475,433 | 建設・土木 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,029 1銘柄 | 2,951 - | 475,433 <1.3%> | |
| (ユーロ…フランス) AXA SA DANONE BNP PARIBAS LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE TOTALENERGIES SE SANOFI | 百株 1,240.33 353.68 240.76 103.16 864.34 412.25 | 百株 1,360.76 336.69 493.34 33.32 864.34 412.25 | 千ユーロ 3,731 1,914 2,760 2,324 5,293 3,480 | 千円 601,206 308,358 444,674 374,407 852,737 560,662 | 保険 食品 銀行 繊維・アパレル・贅沢品 石油・ガス・消耗燃料 医薬品 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,214.52 6銘柄 | 3,500.7 6銘柄 | 19,503 3,142,047 <8.5%> | |
| (ユーロ…ドイツ) DEUTSCHE POST AG-REG SAP SE E.ON SE SIEMENS AG-REG BASF SE ALLIANZ SE DEUTSCHE TELEKOM AG-REG INFINEON TECHNOLOGIES AG | 百株 1,576.58 170.25 2,473.24 328.85 244.71 132.27 2,955.37 531.86 | 百株 1,576.58 286.32 2,473.24 328.85 244.71 112.5 2,955.37 559.46 | 千ユーロ 5,853 3,772 2,809 4,238 1,063 2,462 6,274 1,650 | 千円 943,053 607,758 452,626 682,777 171,390 396,638 1,010,781 265,925 | 航空貨物・物流サービス ソフトウェア 総合公益事業 コングロマリット 化学 保険 各種電気通信サービス 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 | 8,537.03 8銘柄 | 28,125 4,530,951 <12.3%> | |
| (ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA FERROVIAL SA AMADEUS IT GROUP SA | 百株 1,776.33 1,029 - | 百株 2,169.47 - 277.34 | 千ユーロ 2,270 - 1,647 | 千円 365,753 - 265,485 | 電力 建設・土木 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 | 2,446.81 2銘柄 | 3,918 631,238 <1.7%> | |
| (ユーロ…フィンランド) UPM-KYMMENE OYJ | 百株 477.99 | 百株 477.99 | 千ユーロ 1,571 | 千円 253,112 | 紙製品・林産品 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 477.99 1銘柄 | 477.99 1銘柄 | 1,571 253,112 <0.7%> | |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 68,312.66 72銘柄 | 78,479.19 73銘柄 | - 36,367,414 <98.6%> | |

(注1) 邦貨換算金額は、2023年11月8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、2023年11月8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(4,497,721,149円)の内容です。

外国投資証券

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月8日現在 | | 比率 | |
|----------------------------------|-------------|-------------|--------------|-----------|------------|------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 | | |
| 不動産ファンド (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 52.324 | 65,084 | 6,482 | 976,698 | 4.6 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 55.71 | 70.87 | 3,933 | 592,628 | 2.8 | |
| SL GREEN | - | 38.51 | 1,265 | 190,663 | 0.9 | |
| PROLOGIS INC | 105.487 | 87,737 | 9,144 | 1,377,851 | 6.5 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 40.5 | 34.03 | 5,696 | 858,258 | 4.0 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 20.93 | 12.84 | 1,112 | 167,613 | 0.8 | |
| EQUINIX INC | 10.11 | 7.91 | 5,995 | 903,384 | 4.2 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 318.645 | 318.645 | 6,117 | 921,796 | 4.3 | |
| CROWN CASTLE INC | 33.32 | 19.13 | 1,847 | 278,316 | 1.3 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 27.811 | 24.451 | 5,119 | 771,399 | 3.6 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 63.915 | 63,915 | 3,442 | 518,675 | 2.4 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 21.44 | 22.53 | 2,096 | 315,867 | 1.5 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 84.946 | 145,016 | 2,373 | 357,677 | 1.7 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 75.02 | 78.84 | 1,494 | 225,103 | 1.1 | |
| WELLTOWER INC | 89.71 | 65.68 | 5,625 | 847,592 | 4.0 | |
| REGENCY CENTERS CORP | - | 56.12 | 3,374 | 508,435 | 2.4 | |
| UDR INC | 111.58 | 95.75 | 3,075 | 463,384 | 2.2 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 53.93 | 54.24 | 6,250 | 941,780 | 4.4 | |
| LIFE STORAGE INC | 19.95 | - | - | - | - | |
| PUBLIC STORAGE | 29.6 | 25.26 | 6,263 | 943,793 | 4.4 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 15.79 | 23.05 | 2,702 | 407,237 | 1.9 | |
| VENTAS INC | 107.65 | 107.65 | 4,712 | 710,095 | 3.3 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | - | 17,855 | 1,914 | 288,390 | 1.4 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 372.36 | 372.36 | 3,570 | 538,032 | 2.5 | |
| CUBESMART | 40.7 | 31.03 | 1,117 | 168,357 | 0.8 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 46.71 | 46.71 | 5,977 | 900,697 | 4.2 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 238.08 | 115.3 | 1,391 | 209,683 | 1.0 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | 283.12 | 297.54 | 3,656 | 550,965 | 2.6 | |
| TERRENO REALTY CORP | 103.323 | 93,973 | 5,117 | 771,094 | 3.6 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 290.373 | 305.163 | 1,562 | 235,412 | 1.1 | |
| AMERICAN TOWER CORP | 28.74 | 26.75 | 4,960 | 747,441 | 3.5 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 100.13 | 55.79 | 2,512 | 378,600 | 1.8 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 111.95 | 111.95 | 3,881 | 584,796 | 2.7 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 263.64 | 316.88 | 6,679 | 1,006,450 | 4.7 | |
| NETSTREIT CORP | 68.59 | - | - | - | - | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 22.56 | 100.07 | 2,697 | 406,490 | 1.9 | |
| VICI PROPERTIES INC | 63.24 | 63.24 | 1,818 | 273,940 | 1.3 | |
| 合計 | □数・金額 | 3,371.884 | 3,371.869 | 134,987 | 20,338,605 | - |
| | 銘柄数<比率> | 34銘柄<93.4%> | 35銘柄<95.6%> | - | - | 95.6 |

(注1) 邦貨換算金額は、2023年11月8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、2023年11月8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 (9,848,673,655円) の内容です。

外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月8日現在 | | | |
|----------------------------------|------------------|--------------------------|--------------------------|--------------|----------------|-----------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| 不動産ファンド (シンガポール) | 千口 | 千円 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE | 12,484.5 | 12,484.5 | 12,484.5 | 7,303 | 1,100,408 | 3.3 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 12,484.5 1銘柄<2.0%> | 12,484.5 1銘柄<3.3%> | 7,303 - | 1,100,408 - | - 3.3 |
| (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 | 18,682 | 2,043,690 | 6.2 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 819.87 | 819.87 | 819.87 | 14,257 | 1,559,632 | 4.7 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 271.4 | 166.5 | 166.5 | 2,740 | 299,793 | 0.9 |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 576.2 | 576.2 | 576.2 | 7,738 | 846,499 | 2.6 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 771.8 | 771.8 | 771.8 | 10,627 | 1,162,562 | 3.5 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV | 1,162.95 | 1,162.95 | 1,162.95 | 19,328 | 2,114,314 | 6.4 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 4,023.759 6銘柄<24.4%> | 3,918.859 6銘柄<24.3%> | 73,375 - | 8,026.493 - | - 24.3 |
| (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 | 10,241 | 991,244 | 3.0 |
| GPT GROUP | 2,757.12 | 2,757.12 | 2,757.12 | 10,614 | 1,027,417 | 3.1 |
| STOCKLAND | 944.822 | 944.822 | 944.822 | 3,580 | 346,592 | 1.1 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | - | 2,199.852 | 2,199.852 | 9,041 | 875,116 | 2.7 |
| GOODMAN GROUP | 597.337 | 597.337 | 597.337 | 13,099 | 1,267,910 | 3.8 |
| VICINITY CENTRES | 6,302.094 | 6,302.094 | 6,302.094 | 11,343 | 1,097,963 | 3.3 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 3,578.152 | 2,991.532 | 2,991.532 | 6,491 | 628,324 | 1.9 |
| REGION RE LTD | 8,722.312 | 8,722.312 | 8,722.312 | 18,229 | 1,764,446 | 5.4 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 7,135.696 | 7,135.696 | 7,135.696 | 14,984 | 1,450,394 | 4.4 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 33,268.191 8銘柄<27.3%> | 34,881.423 9銘柄<28.7%> | 97,627 - | 9,449,409 - | - 28.7 |
| (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 | 1,570.591 | 1,570.591 | 4,303 | 478,583 | 1.5 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 4,282.242 | - | - | - | - | - |
| PARKWAY LIFE REIT | 2,517 | 2,517 | 2,517 | 8,910 | 990,901 | 3.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 1,674.54 | - | - | - | - | - |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 10,044.373 4銘柄<7.4%> | 4,087.591 2銘柄<4.5%> | 13,213 - | 1,469,484 - | - 4.5 |
| (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 | 11,602.872 | 11,602.872 | 23,553 | 2,104,063 | 6.4 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 11,602.872 1銘柄<6.0%> | 11,602.872 1銘柄<6.4%> | 23,553 - | 2,104,063 - | - 6.4 |
| (イギリス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| UNITE GROUP PLC | 984.214 | 984.214 | 984.214 | 9,079 | 1,680,864 | 5.1 |
| SEGRO PLC | 1,185.138 | 649.531 | 649.531 | 4,997 | 925,185 | 2.8 |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | - | 2,361.269 | 2,361.269 | 2,670 | 494,407 | 1.5 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 2,169.352 2銘柄<9.3%> | 3,995.014 3銘柄<9.4%> | 16,747 - | 3,100,457 - | - 9.4 |

| 銘 柄 | 2023年5月8日現在 | | 2023年11月8日現在 | | |
|--|---|---|---------------------------------|---------------------------------------|------------------------|
| | □ 数 | □ 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (オランダ) VASTNED RETAIL | 千□ 452.507 | 千□ 452.507 | 千ユーロ 8,715 | 千円 1,404,032 | % 4.3 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> 452.507 1銘柄<3.9%> | □数・金額 銘柄数<比率> 452.507 1銘柄<4.3%> | 8,715 - | 1,404,032 - | - 4.3 |
| (ベルギー) COFINIMMO SA WAREHOUSES DE PAUW | 千□ 34.726 690.172 | 千□ 34.726 690.172 | 千ユーロ 2,149 16,923 | 千円 346,290 2,726,298 | % 1.1 8.3 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> 724.898 2銘柄<9.1%> | □数・金額 銘柄数<比率> 724.898 2銘柄<9.3%> | 19,072 - | 3,072,588 - | - 9.3 |
| (フランス) GECINA SA ICADE KLEPIERRE | 千□ 43.793 90.256 285.887 | 千□ 28.669 57.838 285.887 | 千ユーロ 2,776 1,842 6,441 | 千円 447,309 296,861 1,037,650 | % 1.4 0.9 3.1 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> 419.936 3銘柄<6.1%> | □数・金額 銘柄数<比率> 372.394 3銘柄<5.4%> | 11,060 - | 1,781,821 - | - 5.4 |
| (スペイン) INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 千□ 174.863 | 千□ 174.863 | 千ユーロ 987 | 千円 159,162 | % 0.5 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> 174.863 1銘柄<0.4%> | □数・金額 銘柄数<比率> 174.863 1銘柄<0.5%> | 987 - | 159,162 - | - 0.5 |
| 合計 | □数・金額 銘柄数<比率> 75,365.251 29銘柄<95.9%> | □数・金額 銘柄数<比率> 72,694.921 29銘柄<96.0%> | - - | 31,667,922 - | - 96.0 |

(注1) 邦貨換算金額は、2023年11月8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、2023年11月8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

2023年11月8日現在

| 項 目 | 第 33 作 成 期 末 | |
|---|--------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド | 574,602 | 33.6 |
| D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド | 569,200 | 33.3 |
| D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド | 204,914 | 12.0 |
| 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 | 329,951 | 19.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 29,184 | 1.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,707,853 | 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、2023年11月8日現在、D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドは95,006,899千円、96.6%、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドは36,519,786千円、99.0%、D I A M U S・リート・オープン・マザーファンドは20,811,924千円、97.4%、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドは32,314,300千円、97.4%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、2023年11月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.67円、1カナダ・ドル=109.39円、1オーストラリア・ドル=96.79円、1香港・ドル=19.27円、1シンガポール・ドル=111.21円、1ニュージーランド・ドル=89.33円、1台湾・ドル=4.673円、1イギリス・ポンド=185.13円、1スイス・フラン=167.24円、1デンマーク・クローネ=21.59円、1ノルウェー・クローネ=13.45円、1スウェーデン・クローナ=13.80円、1ユーロ=161.10円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月8日)、(2023年7月10日)、(2023年8月8日)、(2023年9月8日)、(2023年10月10日)、(2023年11月8日)現在

| 項 目 | 第192期末 | 第193期末 | 第194期末 | 第195期末 | 第196期末 | 第197期末 |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| (A) 資 産 | 1,749,226,439円 | 1,744,808,587円 | 1,744,282,944円 | 1,736,639,218円 | 1,689,926,312円 | 1,707,853,078円 |
| コール・ローン等 | 26,358,913 | 27,596,421 | 29,352,388 | 24,466,203 | 32,046,806 | 19,184,326 |
| D I A M 高格付 インカム・オープン・ マザーファンド(評価額) | 588,014,496 | 578,672,159 | 582,913,521 | 580,701,628 | 565,359,452 | 574,602,507 |
| D I A M 世界好配当株オープン・ マザーファンド(評価額) | 593,469,196 | 578,816,448 | 574,968,221 | 576,320,578 | 567,935,963 | 569,200,262 |
| D I A M U S・ リート・オープン・ マザーファンド(評価額) | 206,938,495 | 212,909,708 | 217,537,615 | 217,255,954 | 203,315,902 | 204,914,870 |
| 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(評価額) | 334,445,339 | 331,813,851 | 339,511,199 | 337,894,855 | 321,268,189 | 329,951,113 |
| 未 収 入 金 | - | 15,000,000 | - | - | - | 10,000,000 |
| (B) 負 債 | 4,876,435 | 10,857,731 | 6,612,462 | 4,585,441 | 4,543,262 | 4,701,792 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 2,638,192 | 2,593,528 | 2,557,347 | 2,559,776 | 2,555,519 | 2,542,248 |
| 未 払 解 約 金 | 294,358 | 6,216,578 | 2,217,694 | 82,433 | - | 402,663 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 1,938,151 | 2,041,589 | 1,832,002 | 1,937,498 | 1,981,880 | 1,751,697 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 5,734 | 6,036 | 5,419 | 5,734 | 5,863 | 5,184 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,744,350,004 | 1,733,950,856 | 1,737,670,482 | 1,732,053,777 | 1,685,383,050 | 1,703,151,286 |
| 純 資 本 | 1,758,794,673 | 1,729,018,744 | 1,704,898,361 | 1,706,517,653 | 1,703,679,503 | 1,694,832,186 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △14,444,669 | 4,932,112 | 32,772,121 | 25,536,124 | △18,296,453 | 8,319,100 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,758,794,673口 | 1,729,018,744口 | 1,704,898,361口 | 1,706,517,653口 | 1,703,679,503口 | 1,694,832,186口 |
| 1万口あたり基準価額(C/D) | 9,918円 | 10,029円 | 10,192円 | 10,150円 | 9,893円 | 10,049円 |

(注) 第191期末における元本額は1,778,178,402円、当作成期間(第192期～第197期)中における追加設定元本額は15,927,489円、同解約元本額は99,273,705円です。

■損益の状況

〔自 2023年5月9日 至 2023年6月8日〕〔自 2023年6月9日 至 2023年7月10日〕〔自 2023年7月11日 至 2023年8月8日〕〔自 2023年8月9日 至 2023年9月8日〕〔自 2023年9月9日 至 2023年10月10日〕〔自 2023年10月11日 至 2023年11月8日〕

| 項 目 | 第 192 期 | 第 193 期 | 第 194 期 | 第 195 期 | 第 196 期 | 第 197 期 |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △1,406円 | △1,591円 | △1,445円 | △1,575円 | △857円 | △321円 |
| 受 取 利 息 | 7 | 87 | 62 | 28 | 53 | — |
| 支 払 利 息 | △1,413 | △1,678 | △1,507 | △1,603 | △910 | △321 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 15,538,207 | 23,734,599 | 32,286,574 | △2,708,258 | △39,248,838 | 30,819,880 |
| 売 買 益 | 19,889,491 | 26,989,665 | 32,721,088 | 1,393,844 | 165,589 | 30,835,226 |
| 売 買 損 | △4,351,284 | △3,255,066 | △434,514 | △4,102,102 | △39,414,427 | △15,346 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △1,943,885 | △2,047,625 | △1,837,421 | △1,943,232 | △1,987,743 | △1,756,881 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | 13,592,916 | 21,685,383 | 30,447,708 | △4,653,065 | △41,237,438 | 29,062,678 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 105,812,092 | 114,637,817 | 131,658,539 | 159,146,347 | 151,489,082 | 107,050,455 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △131,211,485 | △128,797,560 | △126,776,779 | △126,397,382 | △125,992,578 | △125,251,785 |
| (配 当 等 相 当 額) | (27,345,754) | (27,135,403) | (27,054,048) | (27,739,309) | (27,938,109) | (27,947,375) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△158,557,239) | (△155,932,963) | (△153,830,827) | (△154,136,691) | (△153,930,687) | (△153,199,160) |
| (G) 合 計 (D+E+F) | △11,806,477 | 7,525,640 | 35,329,468 | 28,095,900 | △15,740,934 | 10,861,348 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △2,638,192 | △2,593,528 | △2,557,347 | △2,559,776 | △2,555,519 | △2,542,248 |
| 当 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △14,444,669 | 4,932,112 | 32,772,121 | 25,536,124 | △18,296,453 | 8,319,100 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △131,211,485 | △128,797,560 | △126,776,779 | △126,397,382 | △125,992,578 | △125,251,785 |
| (配 当 等 相 当 額) | (27,347,785) | (27,137,253) | (27,055,439) | (27,745,276) | (27,940,473) | (27,948,092) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△158,559,270) | (△155,934,813) | (△153,832,218) | (△154,142,658) | (△153,933,051) | (△153,199,877) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 192,256,830 | 192,194,550 | 189,513,339 | 189,344,422 | 189,465,225 | 187,713,909 |
| 繰 越 損 益 金 | △75,490,014 | △58,464,878 | △29,964,439 | △37,410,916 | △81,769,100 | △54,143,024 |

(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192期から第197期まででD I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド521,794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833,299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 192 期 | 第 193 期 | 第 194 期 | 第 195 期 | 第 196 期 | 第 197 期 |
|-----------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 4,624,534円 | 6,036,650円 | 2,852,741円 | 2,869,015円 | 3,230,178円 | 1,926,830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 | 27,347,785 | 27,137,253 | 27,055,439 | 27,745,276 | 27,940,473 | 27,948,092 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 190,270,488 | 188,751,428 | 189,217,945 | 189,035,183 | 188,790,566 | 188,329,327 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d) | 222,242,807 | 221,925,331 | 219,126,125 | 219,649,474 | 219,961,217 | 218,204,249 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額 | 1,263.61 | 1,283.53 | 1,285.27 | 1,287.12 | 1,291.10 | 1,287.47 |
| (g) 分 配 金 | 2,638,192 | 2,593,528 | 2,557,347 | 2,559,776 | 2,555,519 | 2,542,248 |
| (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 192 期 | 第 193 期 | 第 194 期 | 第 195 期 | 第 196 期 | 第 197 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。

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20期（決算日 2023年6月5日）

（計算期間 2022年6月7日～2023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 | 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 | | | |
| 16期（2019年6月5日） | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 17期（2020年6月5日） | 21,536 | 0.2 | 96.5 | — | 156,810 |
| 18期（2021年6月7日） | 22,639 | 5.1 | 98.5 | — | 137,252 |
| 19期（2022年6月6日） | 25,062 | 10.7 | 98.0 | — | 125,601 |
| 20期（2023年6月5日） | 25,405 | 1.4 | 98.0 | — | 112,677 |
| | 25,346 | △0.2 | 98.7 | — | 98,072 |

（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）。

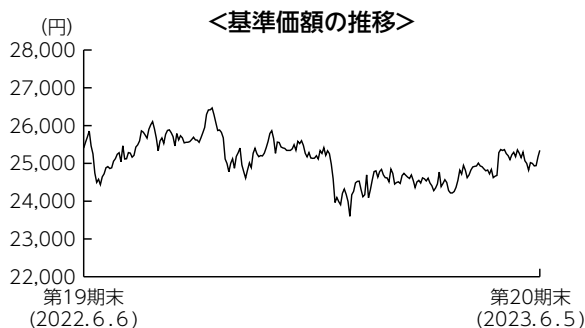
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 債 券 組 入 率 | 債 券 先 物 率 |
|------------------------|---------|-------|-------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年 6 月 6 日 | 円 | | % | % | % |
| | 25,405 | - | | 98.0 | - |
| 6 月 末 | 25,242 | △0.6 | | 98.8 | - |
| 7 月 末 | 25,915 | 2.0 | | 97.8 | - |
| 8 月 末 | 25,621 | 0.9 | | 98.1 | - |
| 9 月 末 | 25,121 | △1.1 | | 97.6 | - |
| 10 月 末 | 25,791 | 1.5 | | 97.8 | - |
| 11 月 末 | 25,171 | △0.9 | | 97.2 | - |
| 12 月 末 | 23,991 | △5.6 | | 97.7 | - |
| 2023年 1 月 末 | 24,695 | △2.8 | | 98.1 | - |
| 2 月 末 | 24,550 | △3.4 | | 98.0 | - |
| 3 月 末 | 24,818 | △2.3 | | 98.4 | - |
| 4 月 末 | 24,681 | △2.8 | | 98.3 | - |
| 5 月 末 | 24,932 | △1.9 | | 98.8 | - |
| (期 末) 2023年 6 月 5 日 | 25,346 | △0.2 | | 98.7 | - |

(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（2022年6月7日から2023年6月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は25,346円となり、前期末比で0.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

主要国や投資国の政策金利の引き上げにより国債利回りが上昇（価格は下落）したものの、投資債券の金利収入が上回り、債券保有は基準価額にプラス寄与となりました。しかしながら、世界経済の下押しや、主要な資源消費国であり当ファンドの投資国の主要な輸出相手先である中国経済のコロナ禍からの回復期待が剥落したことなどを背景に、投資対象国の通貨の多くが対円で下落しました。この結果、投資対象国の通貨の下落を主因に基準価額は下落しました。

投資環境

外国債券市場では、いずれの投資対象国でも10年国債利回りが上昇しました。主要国および投資対象国でインフレが中央銀行の目標を大きく上回っていることで、各国が政策金利の引き上げを進めたことなどが、利回りの上昇要因となりました。期後半には多くの国でインフレの鈍化が見られたことや、高金利による景気下押しが意識されることで利回りが低下（価格は上昇）する場面もありましたが、堅調な景気指標などが利回り上昇の要因となり、揉み合いの動きとなりました。

為替市場では、カナダドルを除く投資対象国の通貨が対円で下落しました。期初は日銀が緩和的な金融政策を堅持する中で、米国がインフレ高進から積極的な利上げを進めたことなどを背景に米ドル高円安が進み、投資対象国の通貨の対円での動きも堅調でした。しかしながら、期中に米国のインフレが鈍化したことや日銀による金融緩和策の見直し、高金利による世界経済の減速懸念や中国経済の回復期待剥落などが、投資対象国の通貨の下押し要因となったことで、多くの投資通貨が対円で下落しました。

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、投資対象国および世界経済見通し、主要国および投資対象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、投資対象国の中央銀行が積極的な利上げを進めたため、インフレがピークアウトに向かうとの判断から、前期末と比較して長期化しました。

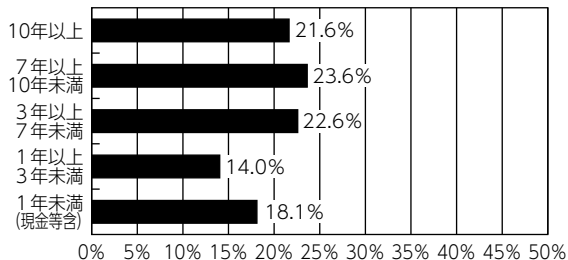
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

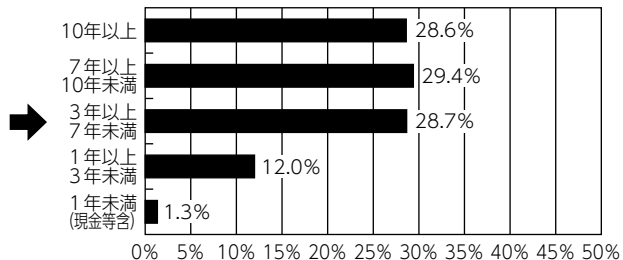
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

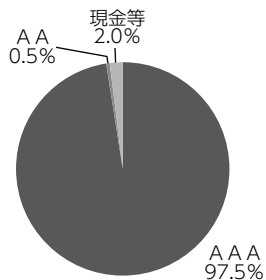


期末

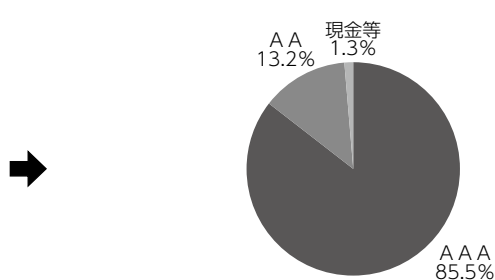


○格付別構成比

期首 (前期末)

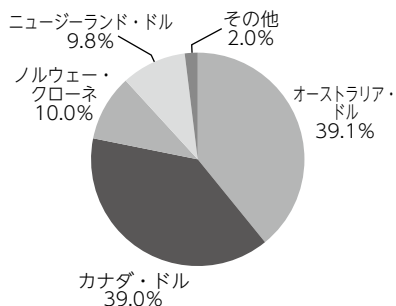


期末

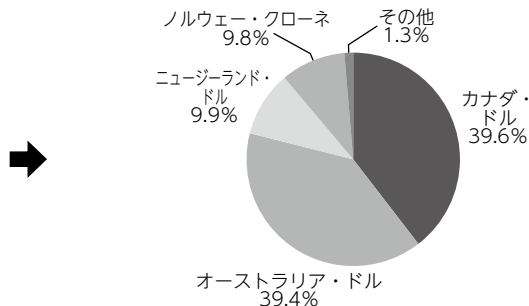


○通貨別構成比

期首 (前期末)



期末

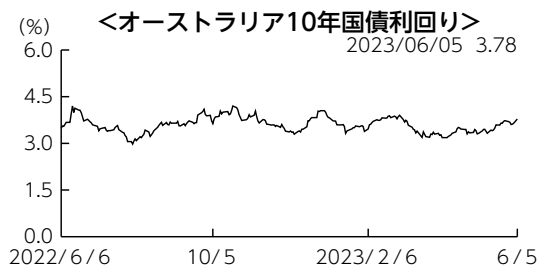
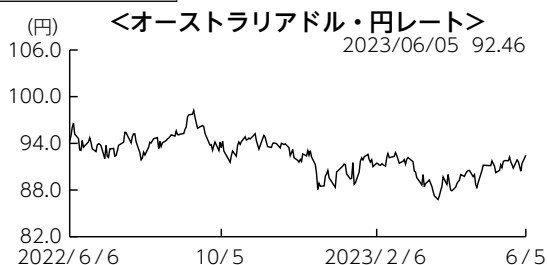


【各国の為替・金利動向】

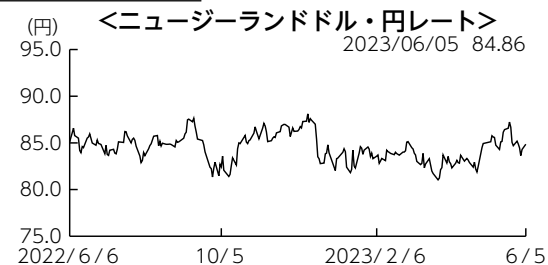
カナダ



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 | 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 |
| （保 管 費 用） | (2) | (0.009) | |
| （そ の 他） | (0) | (0.000) | |
| 合 計 | 2 | 0.009 | |
| 期中の平均基準価額は25,072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6月7日から2023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 414,865 | 千カナダ・ドル 484,596 (63,000) |
| | | 地方債証券 | 112,047 | 15,292 (-) |
| | | 特殊債証券 | - | 9,474 (-) |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル 332,967 | 千オーストラリア・ドル 348,408 (58,000) |
| | | 地方債証券 | 93,319 | 49,469 (-) |
| | | 特殊債証券 | 80,555 | 97,946 (-) |
| 国 | ニュージーランド | 国債証券 | 千ニュージーランド・ドル 20,094 | 千ニュージーランド・ドル 14,424 (-) |
| | | 地方債証券 | - | 18,223 (-) |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ 425,918 | 千ノルウェー・クローネ 464,728 (-) |

(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 (2022年6月7日から2023年6月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 | 当 | | | 期 | | |
|------|--------------|--------------------|------------|--------------|--------------------|------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金銭信託 | 百万円 0.024 | 百万円 0.024 | % 100.0 | 百万円 0.024 | 百万円 0.024 | % 100.0 |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■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 402,200 | 千カナダ・ドル 371,654 | 千円 38,789,621 | % 39.6 | % - | % 29.5 | % 10.0 | % - |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 465,000 | 千オーストラリア・ドル 417,727 | 千円 38,623,044 | 39.4 | - | 34.6 | 4.7 | - |
| ニュージーランド | 千ニューージーランド・ドル 134,500 | 千ニューージーランド・ドル 114,578 | 千円 9,723,122 | 9.9 | - | 6.6 | 2.7 | 0.7 |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 817,000 | 千ノルウェー・クローネ 756,781 | 千円 9,626,262 | 9.8 | - | 5.0 | 3.5 | 1.4 |
| 合 計 | - | - | 千円 96,762,051 | 98.7 | - | 75.7 | 20.9 | 2.0 |

(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 | 25,000 | 22,645 | 2,363,532 | 2026/03/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 20,900 | 25,330 | 2,643,718 | 2033/06/01 |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 7,300 | 8,727 | 910,854 | 2037/06/01 |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 5,000 | 5,514 | 575,525 | 2041/06/01 |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 32,000 | 28,000 | 2,922,408 | 2030/06/01 |
| CANADA 1.5 06/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 22,000 | 19,299 | 2,014,338 | 2031/06/01 |
| CANADA 0.5 09/01/25 | 国債証券 | 0.5000 | 15,000 | 13,851 | 1,445,707 | 2025/09/01 |
| CANADA 2.75 09/01/27 | 国債証券 | 2.7500 | 45,000 | 43,566 | 4,547,018 | 2027/09/01 |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 12,000 | 12,542 | 1,309,027 | 2045/12/01 |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 37,000 | 28,894 | 3,015,716 | 2051/12/01 |
| CANADA 1.75 12/01/53 | 国債証券 | 1.7500 | 4,000 | 2,904 | 303,144 | 2053/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 5,000 | 4,521 | 471,861 | 2064/12/01 |
| CANADA 1.5 12/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 35,000 | 30,483 | 3,181,551 | 2031/12/01 |
| BRITISH COLUMBIA PROVINCE 3.2 06/18/32 | 地方債証券 | 3.2000 | 10,000 | 9,441 | 985,431 | 2032/06/18 |
| PROVINCE OF QUEBEC 2.75 09/01/28 | 地方債証券 | 2.7500 | 50,000 | 47,426 | 4,949,938 | 2028/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.9 09/01/30 | 地方債証券 | 1.9000 | 30,000 | 26,320 | 2,747,057 | 2030/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.25 09/01/32 | 地方債証券 | 3.2500 | 12,000 | 11,359 | 1,185,576 | 2032/09/01 |
| PROVINCE OF QUEBEC 1.5 09/01/31 | 地方債証券 | 1.5000 | 20,000 | 16,639 | 1,736,646 | 2031/09/01 |
| CANHOU 1.95 12/15/25 | 特殊債券 | 1.9500 | 15,000 | 14,185 | 1,480,568 | 2025/12/15 |
| 小 計 | - | - | 402,200 | 371,654 | 38,789,621 | - |

| 銘柄 | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 期 間 | | 償 還 年 月 日 |
|---|-------|--------|-----------------------|-----------------------|-----------------|------------|
| | | | | 評 価 額 | | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (オーストラリア) | | | | | | |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47 | 国債証券 | 3.0000 | 千オーストラリア・ドル 13,000 | 千オーストラリア・ドル 10,828 | 千円 1,001,182 | 2047/03/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 5,000 | 5,239 | 484,471 | 2027/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 13,000 | 12,848 | 1,187,973 | 2029/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 18,000 | 17,794 | 1,645,244 | 2037/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 15,000 | 14,144 | 1,307,777 | 2028/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 23,000 | 21,542 | 1,991,785 | 2030/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 24,000 | 20,059 | 1,854,721 | 2041/05/21 |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 11,000 | 9,010 | 833,100 | 2032/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34 | 国債証券 | 3.7500 | 25,000 | 25,154 | 2,325,747 | 2034/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 10,000 | 9,150 | 846,033 | 2039/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 9,937 | 918,865 | 2035/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 国債証券 | 1.7500 | 17,000 | 10,176 | 940,891 | 2051/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 3,000 | 2,857 | 264,190 | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33 | 国債証券 | 3.0000 | 58,000 | 54,674 | 5,055,237 | 2033/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31 | 国債証券 | 1.0000 | 50,000 | 40,541 | 3,748,494 | 2031/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 国債証券 | 1.0000 | 17,000 | 14,133 | 1,306,751 | 2030/12/21 |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 9,799 | 906,046 | 2034/12/21 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36 | 地方債証券 | 4.2500 | 14,000 | 13,455 | 1,244,067 | 2036/02/20 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29 | 地方債証券 | 3.0000 | 23,000 | 21,880 | 2,023,039 | 2029/04/20 |
| SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32 | 地方債証券 | 1.7500 | 6,500 | 5,287 | 488,877 | 2032/05/24 |
| PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26 | 地方債証券 | 3.7000 | 11,000 | 10,818 | 1,000,292 | 2026/05/20 |
| AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30 | 地方債証券 | 1.7500 | 4,000 | 3,442 | 318,304 | 2030/05/17 |
| AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 16,000 | 13,814 | 1,277,289 | 2032/10/22 |
| TREASURY CORP VICTORIA 2.25 11/20/34 | 地方債証券 | 2.2500 | 11,000 | 8,677 | 802,292 | 2034/11/20 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32 | 地方債証券 | 2.5000 | 15,000 | 12,894 | 1,192,227 | 2032/11/22 |
| KOMBNK 4.35 01/18/28 | 特殊債券 | 4.3500 | 10,000 | 10,049 | 929,178 | 2028/01/18 |
| KOMBNK 4.4 02/17/26 | 特殊債券 | 4.4000 | 10,000 | 10,054 | 929,645 | 2026/02/17 |
| NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36 | 特殊債券 | 2.3350 | 4,500 | 3,601 | 333,009 | 2036/06/30 |
| EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31 | 特殊債券 | 1.4650 | 7,000 | 5,674 | 524,651 | 2031/08/18 |
| EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28 | 特殊債券 | 4.5000 | 10,000 | 10,184 | 941,652 | 2028/09/06 |
| 小 計 | - | - | 465,000 | 417,727 | 38,623,044 | - |
| (ニュージーランド) | | | | | | |
| NEW ZEALAND 4.5 04/15/27 | 国債証券 | 4.5000 | 千ニュージーランド・ドル 8,000 | 千ニュージーランド・ドル 8,047 | 千円 682,914 | 2027/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33 | 国債証券 | 3.5000 | 10,000 | 9,340 | 792,655 | 2033/04/14 |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 9,063 | 769,098 | 2037/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.0 04/20/29 | 国債証券 | 3.0000 | 8,500 | 7,944 | 674,211 | 2029/04/20 |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国債証券 | 2.7500 | 11,000 | 8,048 | 682,995 | 2051/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国債証券 | 1.7500 | 21,000 | 13,841 | 1,174,589 | 2041/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31 | 国債証券 | 1.5000 | 10,000 | 8,082 | 685,838 | 2031/05/15 |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32 | 国債証券 | 2.0000 | 10,000 | 8,307 | 705,001 | 2032/05/15 |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 2,000 | 1,645 | 139,675 | 2028/05/15 |
| NEW ZEALAND 0.5 05/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 1,000 | 892 | 75,737 | 2026/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.5 05/15/30 | 国債証券 | 4.5000 | 6,000 | 6,084 | 516,298 | 2030/05/15 |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25 | 地方債証券 | 2.7500 | 8,000 | 7,644 | 648,744 | 2025/04/15 |

| 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 | |
| NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28 | 地方債証券 | 2.2500 | 10,000 | 8,875 | 753,133 | 2028/05/15 | |
| HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30 | 特殊債券 | 2.1830 | 6,000 | 5,077 | 430,848 | 2030/04/24 | |
| KOMBANK 4.0 08/20/25 | 特殊債券 | 4.0000 | 12,000 | 11,682 | 991,380 | 2025/08/20 | |
| 小 | 計 | — | 134,500 | 114,578 | 9,723,122 | — | |
| (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 | 120,000 | 114,268 | 1,453,493 | 2026/02/19 | |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 72,000 | 68,137 | 866,705 | 2027/02/17 | |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | 1.7500 | 110,000 | 106,785 | 1,358,308 | 2025/03/13 | |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 90,000 | 84,802 | 1,078,687 | 2028/04/26 | |
| NORWAY 2.125 05/18/32 | 国債証券 | 2.1250 | 70,000 | 63,358 | 805,915 | 2032/05/18 | |
| NORWAY 1.375 08/19/30 | 国債証券 | 1.3750 | 95,000 | 83,226 | 1,058,643 | 2030/08/19 | |
| NORWAY 3.0 08/15/33 | 国債証券 | 3.0000 | 80,000 | 77,288 | 983,103 | 2033/08/15 | |
| NORWAY 1.75 09/06/29 | 国債証券 | 1.7500 | 95,000 | 86,693 | 1,102,737 | 2029/09/06 | |
| NORWAY 1.25 09/17/31 | 国債証券 | 1.2500 | 85,000 | 72,222 | 918,668 | 2031/09/17 | |
| 小 | 計 | — | 817,000 | 756,781 | 9,626,262 | — | |
| 合 | 計 | — | — | — | 96,762,051 | — | |

■投資信託財産の構成

2023年6月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 96,762,051 | 97.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,472,888 | 2.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 99,234,940 | 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、97,802,718千円、98.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2023年6月5日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=104.37円、1オーストラリア・ドル=92.46円、1ニュージーランド・ドル=84.86円、1ノルウェー・クローネ=12.72円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月5日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 99,234,940,856円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 697,991,498 |
| 公 社 債(評価額) | 96,762,051,984 |
| 未 収 入 金 | 1,334,207,540 |
| 未 収 利 息 | 373,534,854 |
| 前 払 費 用 | 67,154,980 |
| (B) 負 債 | 1,162,831,119 |
| 未 払 金 | 948,281,119 |
| 未 払 解 約 金 | 214,550,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 98,072,109,737 |
| 元 本 | 38,692,608,704 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 59,379,501,033 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 38,692,608,704口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,346円 |

(注1) 期首元本額 44,353,039,204円

追加設定元本額 537,281,632円

一部解約元本額 6,197,712,132円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M高格付インカム・オープン (毎月決算コース) 34,913,146,384円

D I A M高格付インカム・オープン<DC年金> 1,007,340,121円

D I A M高格付インカム・オープン (1年決算コース) 462,635,207円

自然環境保護ファンド 346,653,026円

D I A M世界インカム・オープン (毎月決算コース) 696,339,655円

D I A M世界3資産オープン (毎月決算型) 233,775,095円

D I A 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)

865,533,935円

D I A 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)

22,179,475円

D I A 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)

145,005,806円

期末元本合計 38,692,608,704円

■損益の状況

当期 自2022年6月7日 至2023年6月5日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 2,651,486,811円 |
| 受 取 利 息 | 2,651,682,470 |
| そ の 他 収 益 金 | 18,872 |
| 支 払 利 息 | △214,531 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △3,041,851,942 |
| 売 買 損 益 | 1,129,503,241 |
| 売 買 損 益 | △4,171,355,183 |
| (C) そ の 他 費 用 | △9,481,246 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | △399,846,377 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 68,324,651,910 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △9,355,095,868 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 809,791,368 |
| (H) 合 計(D + E + F + G) | 59,379,501,033 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 59,379,501,033 |

(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。

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18期（決算日 2023年5月26日）

（計算期間 2022年5月27日～2023年5月26日）

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2005年6月1日から無期限です。 |
| 運用方針 | 信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準 | 価額 | | 株式組入率 比 | 株式先物率 比 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|-----|------------|------------|---------------|
| | | 期騰 | 中落率 | | | |
| 14期（2019年5月27日） | 円 | | % | % | % | 百万円 36,715 |
| 15期（2020年5月26日） | 25,645 | △0.1 | | 97.7 | — | 30,171 |
| 16期（2021年5月26日） | 23,045 | △10.1 | | 96.6 | — | 36,299 |
| 17期（2022年5月26日） | 31,514 | 36.7 | | 97.5 | — | 35,042 |
| 18期（2023年5月26日） | 35,715 | 13.3 | | 98.6 | — | 35,489 |
| | 39,789 | 11.4 | | 98.6 | — | |

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

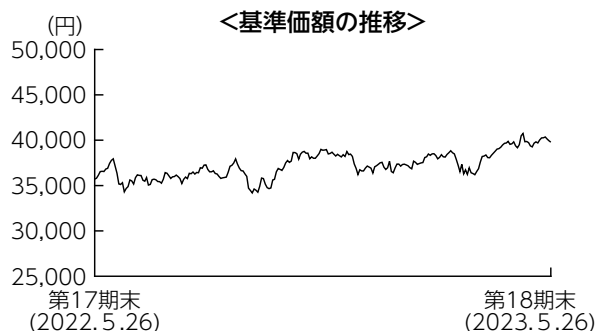
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 株 式 組 入 率 | 株 式 先 物 率 |
|-----------------------|-------------|--------|--------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年 5 月26日 | 円 35,715 | % - | % - | % 98.6 | % - |
| 5 月 末 | 36,536 | 2.3 | | 98.6 | - |
| 6 月 末 | 36,108 | 1.1 | | 98.6 | - |
| 7 月 末 | 35,984 | 0.8 | | 98.2 | - |
| 8 月 末 | 36,006 | 0.8 | | 98.2 | - |
| 9 月 末 | 34,480 | △3.5 | | 98.4 | - |
| 10 月 末 | 38,646 | 8.2 | | 99.0 | - |
| 11 月 末 | 38,539 | 7.9 | | 98.9 | - |
| 12 月 末 | 36,917 | 3.4 | | 98.8 | - |
| 2023年 1 月 末 | 37,275 | 4.4 | | 98.8 | - |
| 2 月 末 | 38,407 | 7.5 | | 98.8 | - |
| 3 月 末 | 38,202 | 7.0 | | 98.2 | - |
| 4 月 末 | 39,503 | 10.6 | | 98.3 | - |
| (期 末) 2023年 5 月26日 | 39,789 | 11.4 | | 98.6 | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年5月27日から2023年5月26日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は39,789円となり、前期末比で11.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

期初から2022年10月中旬にかけては、インフレ高進などから軟調な推移となりましたが、その後は堅調な企業決算や中国のゼロコロナ政策解除を受けた景気回復期待、米欧におけるインフレ鈍化を受けた利上げ停止期待の高まりなどを背景に株式市場全体が上昇したことから、基準価額は上昇しました。また、為替市場において、主要通貨に対して円安が進行したことも基準価額にプラスとなりました。

投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2022年10月中旬にかけては、インフレ高進を背景に米欧の中央銀行がタカ派姿勢を強めたことや中国の行動制限措置が嫌気され下落しました。その後は堅調な企業決算や、中国のゼロコロナ政策解除を受けた景気回復期待、米欧におけるインフレ鈍化を受けた利上げ停止期待の高まりなどを背景に上昇基調で推移しました。

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2022年10月末にかけては、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て内外金利差が拡大し、概ね円安基調で推移しました。その後、米欧における利上げ幅縮小への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が見られましたが、2023年1月下旬以降は利上げ観測の継続などから再び円安基調となりました。

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利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、金融セクターやヘルスケア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) | 8円 (8) | 0.022% (0.022) | (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) | 4 (4) | 0.010 (0.010) | (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 (8) (1) | 0.024 (0.021) (0.003) | (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 | 0.056 | |
| 期中の平均基準価額は37,276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5月27日から2023年5月26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 3,961.76 (152.36) | 千アメリカ・ドル 46,142 (-) | 百株 5,537.52 | 千アメリカ・ドル 44,713 |
| | カ ナ ダ | 百株 983.83 (-) | 千カナダ・ドル 3,122 (-) | 百株 3,807.47 | 千カナダ・ドル 8,892 |
| | オ ー ス ト ラ リ ア | 百株 - (-) | 千オーストラリア・ドル - (-) | 百株 2,265.01 | 千オーストラリア・ドル 1,864 |
| | 香 港 | 百株 8,395 (-) | 千香港・ドル 18,793 (-) | 百株 7,214 | 千香港・ドル 23,032 |
| | イ ギ リ ス | 百株 1,995.46 (2,136.16) | 千イギリス・ポンド 1,109 (-) | 百株 21,601.33 | 千イギリス・ポンド 6,484 |
| | ス イ ス | 百株 - (-) | 千スイス・フラン - (-) | 百株 135.38 | 千スイス・フラン 1,321 |
| | ス ウ ェ ー デ ン | 百株 1,296.74 (-) | 千スウェーデン・クローナ 12,733 (-) | 百株 - | 千スウェーデン・クローナ - |
| | ユ ー ロ | 百株 - (-) | 千ユーロ - (-) | 百株 480.86 | 千ユーロ 1,709 |
| | フ ラ ン ス | 412.71 (-) | 3,359 (-) | 1,807.33 | 6,054 |

| | | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|---------|---------|---------------------|-------------------------|--------------|-------------|
| | | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | ユ ー ロ | ド イ ツ | 百株 913.53 (-) | 千ユーロ 4,742 (△206) | 百株 282.74 | 千ユーロ 886 |
| | | ス ペ イ ン | (5,856.36) | (-) | 7,830.25 | 1,042 |
| | ロ ッ デ ン | (-) | (-) | 1,774.25 | 2,207 | |

(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 | 19,141,752千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 34,479,608千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 0.55 |

(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 (2022年5月27日から2023年5月26日まで)

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|--------------|--------------|--------------------|------------|--------------|--------------------|------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.020 | 百万円 0.020 | % 100.0 | 百万円 0.020 | 百万円 0.020 | % 100.0 |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細
外国株式

| 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| APPLE INC | — | 258.78 | 4,476 | 626,236 | コンピュータ・周辺機器 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 346.85 | 346.85 | 2,239 | 313,250 | 医薬品 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 322.44 | 339.51 | 4,606 | 644,351 | 銀行 |
| CISCO SYSTEMS INC | 779.8 | 1,268 | 6,217 | 869,696 | 通信機器 |
| CUMMINS INC | 89.92 | 42.81 | 903 | 126,337 | 機械 |
| BANK OF AMERICA CORP | 815.83 | 516.73 | 1,455 | 203,627 | 銀行 |
| EATON CORP PLC | 116.51 | 116.51 | 2,061 | 288,403 | 電気設備 |
| NEXTERA ENERGY INC | 326.8 | 344.18 | 2,525 | 353,353 | 電力 |
| GILEAD SCIENCES INC | 250.74 | 340.71 | 2,645 | 370,094 | バイオテクノロジー |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 52.43 | 34.11 | 601 | 84,167 | 航空宇宙・防衛 |
| JOHNSON & JOHNSON | 354.66 | 264.67 | 4,086 | 571,698 | 医薬品 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 308.36 | 299.81 | 4,108 | 574,751 | 家庭用品 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 18.28 | 25.69 | 1,137 | 159,143 | 航空宇宙・防衛 |
| MCDONALD'S CORPORATION | 404.64 | 424.25 | 12,113 | 1,694,513 | ホテル・レストラン・レジャー |
| METLIFE INC | 1,218.2 | — | — | — | 保険 |
| MERCK & CO.INC. | 822.24 | 754.49 | 8,472 | 1,185,277 | 医薬品 |
| MICROSOFT CORP | 330.31 | 260.46 | 8,488 | 1,187,513 | ソフトウェア |
| PACCAR INC | 304.73 | 457.09 | 3,246 | 454,118 | 機械 |
| PAYCHEX INC | 347.06 | 524.48 | 5,658 | 791,510 | 専門サービス |
| PPL CORPORATION | 636.97 | 831.02 | 2,160 | 302,253 | 電力 |
| PEPSICO INC | — | 155.27 | 2,853 | 399,226 | 飲料 |
| PFIZER INC | 855.26 | 586.82 | 2,219 | 310,547 | 医薬品 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 184.41 | 91.51 | 1,330 | 186,118 | 家庭用品 |
| QUALCOMM INC | 100.07 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| SOUTH JERSEY INDUSTRIES | 441.41 | — | — | — | ガス |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 774.53 | — | — | — | 銀行 |
| AT&T INC | 1,593.32 | 1,593.32 | 2,413 | 337,677 | 各種電気通信サービス |
| CHEVRON CORP | 371.82 | 338.7 | 5,234 | 732,316 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| STARBUCKS CORP | — | 421.29 | 4,147 | 580,148 | ホテル・レストラン・レジャー |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 46.97 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 346.59 | 346.59 | 1,038 | 145,307 | 生活必需品流通・小売り |
| CME GROUP INC | — | 204.94 | 3,627 | 507,499 | 資本市場 |
| MASTERCARD INC | 217.61 | 130.31 | 4,821 | 674,548 | 金融サービス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 428.18 | 669.41 | 6,075 | 849,910 | タバコ |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 294.91 | 294.91 | 2,617 | 366,220 | 化学 |
| ABBVIE INC | 269.58 | 269.58 | 3,736 | 522,757 | バイオテクノロジー |
| BROADCOM INC | 41.71 | 99.57 | 7,256 | 1,015,134 | 半導体・半導体製造装置 |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC | 262.63 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 14,075.77 34銘柄 | 12,652.37 32銘柄 | 124,581 — | 17,427,714 <49.1%> |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 757.71 | 717.64 | 7,121 | 729,563 | 銀行 |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO | 2,036.59 | — | — | — | 総合公益事業 |

| 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 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 962.28 | 374.96 | 2,129 | 218,097 | 銀行 |
| RUSSEL METALS INC | 1,216.48 | 1,056.82 | 3,675 | 376,530 | 商社・流通業 |
| CAPITAL POWER CORP | 842.72 | 842.72 | 3,766 | 385,887 | 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 > | 5,815.78 4銘柄 | 2,992.14 4銘柄 | 16,693 - | 1,710,078 <4.8%> |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| BHP GROUP LTD | 743.7 | 743.7 | 3,134 | 284,693 | 金属・鉱業 |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 134.38 | 134.38 | 469 | 42,605 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AGL ENERGY LTD | 2,265.01 | - | - | - | 総合公益事業 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 3,143.09 3銘柄 | 878.08 2銘柄 | 3,603 - | 327,298 <0.9%> |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 7,495 | 7,280 | 17,253 | 307,976 | 銀行 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 1,540 | 7,700 | 14,614 | 260,870 | 不動産管理・開発 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD | 804 | - | - | - | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | 3,960 | - | - | - | 専門小売り |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 13,799 4銘柄 | 14,980 2銘柄 | 31,868 - | 568,847 <1.6%> |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポール・ドル | 千円 | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 1,307 | 1,307 | 3,680 | 380,160 | 銀行 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 1,307 1銘柄 | 1,307 1銘柄 | 3,680 - | 380,160 <1.1%> |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| NATIONAL GRID PLC | 2,744.83 | 2,744.83 | 2,974 | 512,543 | 総合公益事業 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 448.5 | 448.5 | 1,194 | 205,835 | タバコ |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 1,155.92 | 1,155.92 | 1,990 | 343,041 | タバコ |
| UNILEVER PLC | 287.09 | 287.09 | 1,196 | 206,195 | パーソナルケア用品 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 2,757.89 | 2,153.01 | 2,156 | 371,606 | 水道 |
| RIO TINTO PLC | 618.76 | 453.25 | 2,156 | 371,662 | 金属・鉱業 |
| VODAFONE GROUP PLC | 14,990.87 | - | - | - | 無線通信サービス |
| SSE PLC | 1,437.68 | 1,437.68 | 2,670 | 460,232 | 電力 |
| BP PLC | 5,964.93 | 5,964.93 | 2,832 | 488,195 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 3I GROUP PLC | 1,790.74 | 572.23 | 1,089 | 187,719 | 資本市場 |
| GSK PLC | 2,670.2 | 2,235.93 | 3,095 | 533,542 | 医薬品 |
| ASTRAZENECA PLC | 367.04 | 311.37 | 3,624 | 624,727 | 医薬品 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 35,234.45 12銘柄 | 17,764.74 11銘柄 | 24,981 - | 4,305,300 <12.1%> |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 99.01 | 86.78 | 2,494 | 385,391 | 医薬品 |
| NOVARTIS AG-REG SHS | 730.45 | 607.3 | 5,377 | 830,684 | 医薬品 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 829.46 2銘柄 | 694.08 2銘柄 | 7,872 - | 1,216,075 <3.4%> |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| TELE2 AB-B SHS | 836.54 | 2,133.28 | 21,285 | 274,800 | 無線通信サービス |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 836.54 1銘柄 | 2,133.28 1銘柄 | 21,285 - | 274,800 <0.8%> |

| 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…オランダ) STMICROELECTRONICS NV | 百株 480.86 | 百株 - | 千ユーロ - | 千円 - | 半導体・半導体製造装置 |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数<比 率> | 株 数 - | 外 貨 建 金 額 - | 邦 貨 換 算 金 額 - | |
| (ユーロ…フランス) AXA SA DANONE BNP PARIBAS LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE TOTALENERGIES SE SANOFI EUROAPI SASU | 百株 2,249.23 353.68 548.37 66.02 902.13 469.31 20.4 | 百株 1,240.33 353.68 240.76 103.16 864.34 412.25 - | 千ユーロ 3,344 2,021 1,352 8,494 4,753 4,060 - | 千円 501,615 303,204 202,861 1,273,959 712,985 609,018 - | 保険 食品 銀行 繊維・アパレル・贅沢品 石油・ガス・消耗燃料 医薬品 医薬品 |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数<比 率> | 株 数 7銘柄 | 外 貨 建 金 額 24,027 | 邦 貨 換 算 金 額 3,603,644 | <10.2%> |
| (ユーロ…ドイツ) DEUTSCHE POST AG-REG SAP SE E.ON SE SIEMENS AG-REG BASF SE ALLIANZ SE DEUTSCHE TELEKOM AG-REG INFINEON TECHNOLOGIES AG | 百株 1,155.42 - 2,473.24 328.85 256.47 132.27 2,955.37 480.72 | 百株 1,576.58 170.25 2,473.24 328.85 244.71 132.27 2,955.37 531.86 | 千ユーロ 6,509 2,056 2,757 5,052 1,123 2,719 6,247 1,760 | 千円 976,324 308,451 413,594 757,766 168,515 407,866 937,022 263,993 | 航空貨物・物流サービス ソフトウェア 総合公益事業 コングロマリット 化学 保険 各種電気通信サービス 半導体・半導体製造装置 |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数<比 率> | 株 数 8銘柄 | 外 貨 建 金 額 28,227 | 邦 貨 換 算 金 額 4,233,535 | <11.9%> |
| (ユーロ…スペイン) IBERDROLA SA FERROVIAL SA FERROVIAL SA-RTS | 百株 2,413.68 1,182.77 1,182.77 | 百株 1,776.33 1,029 - | 千ユーロ 2,022 2,983 - | 千円 303,312 447,400 - | 電力 建設・土木 建設・土木 |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数<比 率> | 株 数 3銘柄 | 外 貨 建 金 額 5,005 | 邦 貨 換 算 金 額 750,713 | <2.1%> |
| (ユーロ…フィンランド) UPM-KYMMENE OYJ FORTUM OYJ | 百株 477.99 1,774.25 | 百株 477.99 - | 千ユーロ 1,391 - | 千円 208,758 - | 紙製品・林産品 電力 |
| 小 計 | 株 数 銘 柄 数<比 率> | 株 数 2銘柄 | 外 貨 建 金 額 1,391 | 邦 貨 換 算 金 額 208,758 | <0.6%> |
| 合 計 | 株 数 銘 柄 数<比 率> | 株 数 82銘柄 | 外 貨 建 金 額 - | 邦 貨 換 算 金 額 35,006,926 | <98.6%> |

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

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

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

■投資信託財産の構成

2023年5月26日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 35,006,926 | 98.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 527,622 | 1.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 35,534,549 | 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、35,170,231千円、99.0%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、2023年5月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=139.89円、1カナダ・ドル=102.44円、1オーストラリア・ドル=90.82円、1香港・ドル=17.85円、1シンガポール・ドル=103.29円、1台湾・ドル=4.538円、1イギリス・ポンド=172.34円、1スイス・フラン=154.47円、1ノルウェー・クローネ=12.63円、1スウェーデン・クローナ=12.91円、1ユーロ=149.98円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年5月26日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 35,534,549,105円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 480,491,746 |
| 株 式(評価額) | 35,006,926,763 |
| 未 収 配 当 金 | 47,130,596 |
| (B) 負 債 | 45,000,000 |
| 未 払 解 約 金 | 45,000,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 35,489,549,105 |
| 元 本 | 8,919,453,450 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 26,570,095,655 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 8,919,453,450口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 39,789円 |

(注1) 期首元本額 9,811,624,078円
追加設定元本額 53,979,505円
一部解約元本額 946,150,133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) 3,233,166,462円
D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 5,287,004,088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) 35,519,774円
D I AM世界インカム・オープン (毎月決算コース) 216,547,787円
D I AM世界3資産オープン (毎月決算型) 147,215,339円
期末元本合計 8,919,453,450円

■損益の状況

当期 自2022年5月27日 至2023年5月26日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,198,836,072円 |
| 受 取 配 当 金 | 1,195,554,461 |
| 受 取 利 息 | 3,375,835 |
| そ の 他 収 益 金 | 13,198 |
| 支 払 利 息 | △107,422 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 2,618,249,676 |
| 売 買 益 | 5,920,084,918 |
| 売 買 損 | △3,301,835,242 |
| (C) そ の 他 費 用 | △8,294,184 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 3,808,791,564 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 25,230,930,258 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △2,613,646,662 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 144,020,495 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 26,570,095,655 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 26,570,095,655 |

(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 US・リート・オープン・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2022年12月9日）

（計算期間 2021年12月10日～2022年12月9日）

DIAM US・リート・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 | 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 | | | |
| 15期（2018年12月10日） | 円 | | % | | % | 百万円 |
| | 33,842 | | 4.2 | | 94.3 | 31,066 |
| 16期（2019年12月9日） | 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 |

（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。

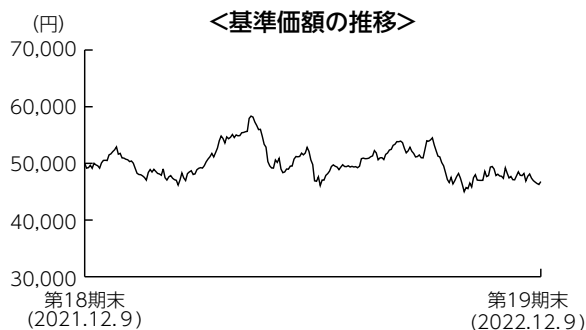
（注2）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

| 年 | 月 | 日 | 基 準 | 価 額 | | 投 資 証 比 | 券 率 |
|--------|------|-----|--------|-----|------|---------|------|
| | | | | 騰 落 | 率 | | |
| (期 首) | | | 円 | | % | | % |
| 2021 年 | 12 月 | 9 日 | 49,994 | | - | | 97.3 |
| | 12 月 | 末 | 52,068 | | 4.1 | | 96.6 |
| 2022 年 | 1 月 | 末 | 48,392 | | △3.2 | | 97.3 |
| | 2 月 | 末 | 48,311 | | △3.4 | | 97.1 |
| | 3 月 | 末 | 54,387 | | 8.8 | | 97.2 |
| | 4 月 | 末 | 56,013 | | 12.0 | | 94.7 |
| | 5 月 | 末 | 51,209 | | 2.4 | | 96.4 |
| | 6 月 | 末 | 49,352 | | △1.3 | | 96.1 |
| | 7 月 | 末 | 52,250 | | 4.5 | | 95.3 |
| | 8 月 | 末 | 51,132 | | 2.3 | | 93.9 |
| | 9 月 | 末 | 46,380 | | △7.2 | | 95.1 |
| | 10 月 | 末 | 49,352 | | △1.3 | | 95.2 |
| | 11 月 | 末 | 47,730 | | △4.5 | | 94.6 |
| (期 末) | | | | | | | |
| 2022 年 | 12 月 | 9 日 | 46,794 | | △6.4 | | 94.5 |

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2021年12月10日から2022年12月9日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は46,794円となり、前期末比で6.4%下落しました。

基準価額の主な変動要因

インフレに伴うF R B（米連邦準備理事会）のタカ派姿勢を嫌気して長期金利が上昇したことなどを背景に米国リート市場が下落したことが、基準価額にマイナスに影響しました。一方、米ドルに対して円安が進行したことは、基準価額にプラスに寄与しました。保有銘柄では、ダグラス・エメット（オフィス）やエセックス・プロパティー・トラスト（住居施設）などが主にマイナスに影響しました。

投資環境

米国リート市場は大きく下落しました。期初こそ新型コロナウイルスに対する警戒感の後退などから堅調な動きとなりましたが、2022年に入ると徐々に利上げ見通しが強まる中で長期金利が上昇し、米国リート市場は下落しました。その後もウクライナ情勢や、F R Bのタカ派姿勢を嫌気して長期金利が上昇したことなどを受けて下落しました。セクター別では、特にオフィスや住居施設が大きく下落しました。

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。その他や小売りなどの組入比率を引き上げた一方、住居施設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

米国では、経済活動の正常化が進む一方で、インフレの進行や金利の上昇により米国経済の成長鈍化懸念が強まっており、米国リート市場は目先神経質な展開が予想されます。引き続き財務体質が良好で、長期的な成長が期待できる銘柄を選別して投資する方針です。また、割安な水準にある銘柄にも投資することにより、比較的高い配当利回りを維持できるポートフォリオを構築していきます。

■ 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) | 17円 (17) | 0.034% (0.034) | (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) | 7 (6) | 0.015 (0.012) | (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 |
| (その他) | (1) | (0.003) | |
| 合 計 | 25 | 0.049 | |
| 期中の平均基準価額は50,088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 (2021年12月10日から2022年12月9日まで)

投資証券

| | 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|------------------------------|---|----------|---|----------|---|--------|---|----------|
| | □ | 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 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 14.01 | | 2,931 | | 2.63 | | 466 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 12.44 | | 1,046 | | 20.48 | | 1,521 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| SL GREEN | | - | | - | | 26.896 | | 1,260 |
| | | (△0.03) | | (63) | | (-) | | (-) |
| PROLOGIS INC | | 4.92 | | 772 | | 28.56 | | 4,467 |
| | | (9.447) | | (-) | | (-) | | (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 4.23 | | 814 | | 2 | | 432 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 1.28 | | 201 | | 1.4 | | 209 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| EQUINIX INC | | 0.62 | | 452 | | 0.67 | | 462 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | | 76.97 | | 1,908 | | 92.43 | | 2,649 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | | 19.89 | | 1,014 | | - | | - |
| | | (△19.89) | | (-) | | (-) | | (-) |
| CROWN CASTLE INC | | 5.29 | | 1,002 | | 2.23 | | 401 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 4.78 | | 1,159 | | 1.25 | | 387 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 4.72 | | 398 | | 31.41 | | 2,010 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | | 2.05 | | 244 | | 11.89 | | 1,190 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | | 7.86 | | 258 | | 83.81 | | 1,915 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | | 4.63 | | 194 | | 19.22 | | 599 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| WELLTOWER INC | | 14.83 | | 1,223 | | 40.2 | | 2,609 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | | 4.94 | | 103 | | 183.63 | | 3,264 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 12.93 | | 262 | | 64.77 | | 1,061 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |

| | 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 |
| UDR INC | 34.01 | 1,760 | 4.49 | 227 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 1.32 | 160 | 3.25 | 412 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LIFE STORAGE INC | 8.5 | 883 | 9.21 | 1,340 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PUBLIC STORAGE | 4.17 | 1,333 | 1.51 | 498 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 0.82 | 144 | 0.89 | 149 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VENTAS INC | 34.79 | 1,647 | 1.51 | 78 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | - | - | 47.116 | 1,650 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | - | - | 179.085 | 11,458 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 1.13 | 227 | 1.25 | 223 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 24 | 289 | 115.15 | 1,282 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CUBESMART | 40.7 | 1,632 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 7.27 | 1,250 | 0.79 | 116 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 96.78 | 1,851 | 8.14 | 237 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 14.58 | 276 | 47.85 | 917 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TERRENO REALTY CORP | - | - | 24.4 | 2,002 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORESITE REALTY CORP | - | - | 18.475 | 3,141 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 106.88 | 1,432 | 56.237 | 1,453 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN TOWER CORP | 1.89 | 472 | 5.93 | 1,283 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 75.8 | 2,248 | 203.9 | 5,482 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | - | - | 25.6 | 2,002 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 5.76 | 227 | 6.34 | 232 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 18.47 | 3,132 | 0.62 | 81 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 16.6 | 420 | 55.05 | 1,264 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CATCHMARK TIMBER TRUST INC | 14.69 | 122 | 282.06 | 3,076 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NETSTREIT CORP | 116.01 | 2,656 | 4.85 | 99 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STORE CAPITAL CORP | 39.34 | 1,313 | 29.81 | 921 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VICI PROPERTIES INC | 3.98 | 118 | 14.36 | 422 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

(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（2021年12月10日から2022年12月9日まで）

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 区 分 | 当 期 | | | 期 末 | | |
|--------------|--------------|--------------------|------------|--------------|--------------------|------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.057 | 百万円 0.057 | % 100.0 | 百万円 0.057 | 百万円 0.057 | % 100.0 |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■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 |
| 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 | 32.684 | 44.064 | 6,550 | 897,098 | 4.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 30.97 | 22.93 | 1,519 | 208,105 | 0.9 |
| SL GREEN | 26.926 | — | — | — | — |
| PROLOGIS INC | 114.12 | 99.927 | 11,751 | 1,609,356 | 7.1 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 33.65 | 35.88 | 6,085 | 833,374 | 3.7 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 23.59 | 23.47 | 2,727 | 373,524 | 1.7 |
| EQUINIX INC | 11.38 | 11.33 | 7,742 | 1,060,300 | 4.7 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 162.975 | 147.515 | 3,634 | 497,781 | 2.2 |
| CROWN CASTLE INC | 34.28 | 37.34 | 5,198 | 711,879 | 3.2 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 20.901 | 24.431 | 5,225 | 715,638 | 3.2 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 87.235 | 60.545 | 3,796 | 519,968 | 2.3 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 37.9 | 28.06 | 3,022 | 413,909 | 1.8 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 145.376 | 69.426 | 1,771 | 242,641 | 1.1 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 85.66 | 71.07 | 1,977 | 270,773 | 1.2 |
| WELLTOWER INC | 97.5 | 72.13 | 4,738 | 648,997 | 2.9 |
| ACADIA REALTY TRUST | 178.69 | — | — | — | — |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 239.3 | 187.46 | 3,316 | 454,149 | 2.0 |
| UDR INC | 55.82 | 85.34 | 3,426 | 469,245 | 2.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 55.86 | 53.93 | 6,316 | 865,014 | 3.8 |
| LIFE STORAGE INC | 20.66 | 19.95 | 2,138 | 292,859 | 1.3 |
| PUBLIC STORAGE | 25.38 | 28.04 | 8,487 | 1,162,314 | 5.1 |
| SUN COMMUNITIES INC | 15.03 | 14.96 | 2,139 | 293,056 | 1.3 |
| VENTAS INC | 68.7 | 101.98 | 4,603 | 630,432 | 2.8 |
| VORNADO REALTY TRUST | 47.116 | — | — | — | — |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 179.085 | — | — | — | — |

| 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 | |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 20.98 | 20.86 | 3,284 | 449,828 | 2.0 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 443.89 | 352.74 | 3,640 | 498,535 | 2.2 | |
| CUBESMART | - | 40.7 | 1,739 | 238,171 | 1.1 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 41.84 | 48.32 | 5,185 | 710,181 | 3.1 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 136.89 | 225.53 | 3,473 | 475,649 | 2.1 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | 301.47 | 268.2 | 4,141 | 567,111 | 2.5 | |
| TERRENO REALTY CORP | 122.283 | 97.883 | 5,638 | 772,132 | 3.4 | |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 40.2 | 40.2 | 1,171 | 160,372 | 0.7 | |
| CORESITE REALTY CORP | 18.475 | - | - | - | - | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 147.17 | 197.813 | 1,954 | 267,654 | 1.2 | |
| AMERICAN TOWER CORP | 35 | 30.96 | 6,571 | 899,934 | 4.0 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 128.1 | - | - | - | - | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 125.73 | 100.13 | 5,487 | 751,461 | 3.3 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 106.63 | 106.05 | 3,496 | 478,841 | 2.1 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | - | 17.85 | 2,084 | 285,499 | 1.3 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 306.96 | 268.51 | 6,068 | 831,057 | 3.7 | |
| CATCHMARK TIMBER TRUST INC | 267.37 | - | - | - | - | |
| NETSTREIT CORP | - | 111.16 | 2,152 | 294,724 | 1.3 | |
| STORE CAPITAL CORP | 36.36 | 45.89 | 1,467 | 200,919 | 0.9 | |
| VICI PROPERTIES INC | 73.62 | 63.24 | 2,129 | 291,692 | 1.3 | |
| 合 計 | □ 数 ・ 金 額 | 4,183.756 | 3,275.814 | 155,853 | 21,344,190 | - |
| | 銘 柄 数<比 率> | 42銘柄<97.3%> | 38銘柄<94.5%> | - | - | 94.5 |

(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

2022年12月9日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 証 券 | 21,344,190 | 94.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,242,832 | 5.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 22,587,022 | 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、21,984,868千円、97.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年12月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.95円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月9日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 22,587,022,311円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,218,547,412 |
| 投 資 証 券(評価額) | 21,344,190,090 |
| 未 収 配 当 金 | 24,284,809 |
| (B) 負 債 | - |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 22,587,022,311 |
| 元 本 | 4,826,944,885 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 17,760,077,426 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 4,826,944,885口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 46,794円 |

(注1) 期首元本額 5,596,677,309円
追加設定元本額 26,555,242円
一部解約元本額 796,287,666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) 4,475,417,143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) 116,854,069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> 123,628,846円
期末元本合計 4,826,944,885円

■損益の状況

当期 自2021年12月10日 至2022年12月9日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 858,702,389円 |
| 受 取 配 当 金 | 855,552,639 |
| 受 取 利 息 | 3,364,559 |
| 支 払 利 息 | △214,809 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △2,341,771,374 |
| 売 買 益 | 5,773,757,104 |
| 売 買 損 | △8,115,528,478 |
| (C) そ の 他 費 用 | △3,996,645 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △1,487,065,630 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 22,383,402,488 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △3,240,204,190 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 103,944,758 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 17,760,077,426 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 17,760,077,426 |

(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19期 (決算日 2022年12月9日)

(計算期間 2021年12月10日～2022年12月9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 | 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 | | | |
| 15期 (2018年12月10日) | 円 | | % | % | 百万円 |
| | 25,036 | △2.6 | | 95.4 | 45,994 |
| 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 |

(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。

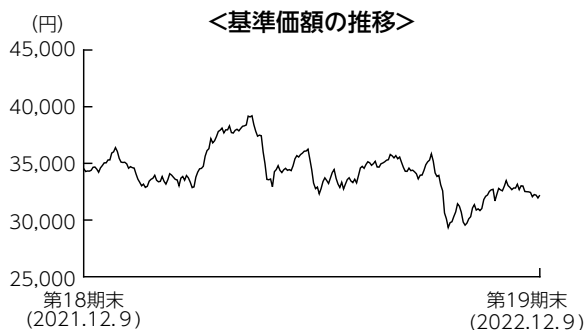
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■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) 2021年12月9日 | 円 34,547 | % - | | % 96.3 |
| 12月末 | 35,916 | 4.0 | | 96.4 |
| 2022年1月末 | 32,978 | △4.5 | | 95.8 |
| 2月末 | 33,694 | △2.5 | | 93.6 |
| 3月末 | 38,116 | 10.3 | | 93.8 |
| 4月末 | 37,489 | 8.5 | | 94.7 |
| 5月末 | 35,405 | 2.5 | | 94.7 |
| 6月末 | 33,675 | △2.5 | | 94.9 |
| 7月末 | 34,978 | 1.2 | | 95.6 |
| 8月末 | 34,256 | △0.8 | | 95.7 |
| 9月末 | 29,850 | △13.6 | | 94.7 |
| 10月末 | 32,529 | △5.8 | | 95.6 |
| 11月末 | 32,501 | △5.9 | | 95.0 |
| (期末) 2022年12月9日 | 32,197 | △6.8 | | 95.8 |

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2021年12月10日から2022年12月9日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は32,197円となり、前期末比で6.8%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国をはじめとして各国中央銀行による利上げへの警戒感や長期金利の上昇などを受けて各国リート市場が下落したことは、基準価額にマイナスに影響しました。一方、各国で利上げ姿勢が強まる中、日銀が緩和姿勢を継続したことを背景に円安が進行したことは、基準価額にプラスに寄与しました。保有銘柄では、セグロ（英・工業）や、ウェアハウス・ド・ポウ（ベルギー・工業）などが主にマイナスに影響しました。

投資環境

米国以外の市場についてもリートは下落しました。欧州リート市場は、ECB（欧州中央銀行）やBOE（イングランド銀行）による利上げが進められたことから大きく下落しました。アジアリート市場では、中国のゼロコロナ政策維持への懸念などから香港の下げが目立ちました。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）による利上げを受けて下落しました。

為替市場では、主要通貨に対して円安が進みました。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、日銀が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、フランスやオーストラリアなどの組入比率を引き上げた一方、ドイツや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、小売りや住居施設などの組入比率を引き上げた一方、混合型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

新型コロナウイルス対策の制限緩和が進む一方で、主要国における金融引き締め懸念によって、市場は不安定な展開になることが予想されます。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、住居施設や工業、小売り等のうち財務体質や成長性、配当利回り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 | 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) | 0.014% (0.011) (0.002) | (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 (0) (5) | 0.014 (0.001) (0.014) | (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) | 8 (6) (2) | 0.024 (0.019) (0.005) | (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 | 18 | 0.052 | |
| 期中の平均基準価額は34,197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 (2021年12月10日から2022年12月9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 | 3,516.7 (-) | 2,057 (-) | - (-) | - (-) |
| カナダ | 千口 | 千カナダ・ドル | 千口 | 千カナダ・ドル |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 59.6 (-) | 3,326 (-) | - (-) | - (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 42.2 (-) | 862 (-) | - (-) | - (-) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | - (-) | - (-) | 32.5 (-) | 846 (-) |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | - (-) | - (-) | 229.6 (-) | 3,532 (-) |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | - (-) | - (-) | 318.8 (-) | 7,157 (-) |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 52.2 (-) | 859 (-) | - (-) | - (-) |
| 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 |
| MIRVAC GROUP | - (-) | - (-) | 5,174.747 (-) | 12,057 (-) |
| GPT GROUP | 1,455.336 (-) | 6,243 (-) | - (-) | - (-) |
| STOCKLAND | - (-) | - (-) | 2,131.047 (-) | 7,809 (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------------|------------|-------------|-----------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| VICINITY CENTRES | 3,796.187 | 6,215 | 402.886 | 808 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHARTER HALL GROUP | - | - | 440.999 | 7,474 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | - | - | 3,201.064 | 10,341 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REGION RE LTD | 5,600.335 | 14,908 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 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 | - | - | - | - |
| | (-) | (△57) | (-) | (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | - | - | 437.3 | 708 |
| | (-) | (△127) | (-) | (-) |
| PARKWAY LIFE REIT | - | - | - | - |
| | (-) | (△51) | (-) | (-) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | - | - | - | - |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | - | - | 2,918.9 | 4,770 |
| | (-) | (△18) | (-) | (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| UNITE GROUP PLC | 354.38 | 3,301 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| ICADE | - | - | - | - |
| | (-) | (△82) | (-) | (-) |
| KLEPIERRE | 285.887 | 6,429 | - | - |
| | (-) | (△486) | (-) | (-) |
| ユーロ (ドイツ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | - | - | - | - |
| | (△569.772) | (△11,116) | (-) | (-) |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | - | - | 569.772 | 11,110 |
| | (569.772) | (11,116) | (-) | (-) |
| ユーロ (スペイン) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | - | - | - | - |
| | (-) | (△30) | (-) | (-) |

(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（2021年12月10日から2022年12月9日まで）

期中の利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 期 | | | 期 | | |
|---------|--------------|--------------------|------------|--------------|--------------------|------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.100 | 百万円 0.100 | % 100.0 | 百万円 0.100 | 百万円 0.100 | % 100.0 |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■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 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (シンガポール) | 千口 | 千円 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE | - | - | 3,516.7 | 2,127 | 291,375 | 0.8 | |
| 小 計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | □ 金 額 銘 柄 数<比 率> | - | 3,516.7 | 2,127 | 291,375 | - |
| | | | - | 1銘柄<0.8%> | - | - | 0.8 |
| (カナダ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | % | |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 361.939 | 361.939 | 421.539 | 18,180 | 1,830,824 | 5.2 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 777.67 | 777.67 | 819.87 | 17,036 | 1,715,615 | 4.9 | |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 303.9 | 303.9 | 271.4 | 7,363 | 741,462 | 2.1 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 326.6 | 326.6 | 97 | 1,460 | 147,104 | 0.4 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 576.2 | 576.2 | 576.2 | 9,219 | 928,373 | 2.6 | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 318.8 | 318.8 | - | - | - | - | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 771.8 | 771.8 | 771.8 | 11,816 | 1,189,897 | 3.4 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV | 1,110.75 | 1,110.75 | 1,162.95 | 19,200 | 1,933,470 | 5.5 | |
| 小 計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | □ 金 額 銘 柄 数<比 率> | 4,547.659 | 4,120.759 | 84,277 | 8,486,748 | - |
| | | | 8銘柄<24.9%> | 7銘柄<24.1%> | - | - | 24.1 |
| (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 | % | |
| MIRVAC GROUP | 5,174.747 | 5,174.747 | - | - | - | - | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 3,230.658 | 3,230.658 | 3,230.658 | 12,858 | 1,191,295 | 3.4 | |
| GPT GROUP | - | - | 1,455.336 | 6,301 | 583,843 | 1.7 | |
| STOCKLAND | 3,075.869 | 3,075.869 | 944.822 | 3,647 | 337,895 | 1.0 | |
| GOODMAN GROUP | 791.805 | 791.805 | 791.805 | 14,434 | 1,337,366 | 3.8 | |
| VICINITY CENTRES | 5,853.855 | 5,853.855 | 9,247.156 | 18,401 | 1,704,930 | 4.8 | |
| CHARTER HALL GROUP | 732.518 | 732.518 | 291.519 | 3,722 | 344,907 | 1.0 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 9,252.813 | 9,252.813 | 6,051.749 | 19,123 | 1,771,794 | 5.0 | |
| REGION RE LTD | - | - | 5,600.335 | 15,120 | 1,400,951 | 4.0 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 7,135.696 | 7,135.696 | 7,135.696 | 16,697 | 1,547,026 | 4.4 | |
| 小 計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | □ 金 額 銘 柄 数<比 率> | 35,247.961 | 34,749.076 | 110,307 | 10,220,012 | - |
| | | | 8銘柄<28.2%> | 9銘柄<29.1%> | - | - | 29.1 |
| (香港) | 千口 | 千円 | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % | |
| LINK REIT | 420.2 | 420.2 | 420.2 | 22,858 | 402,087 | 1.1 | |
| 小 計 | □ 数 銘 柄 数<比 率> | □ 金 額 銘 柄 数<比 率> | 420.2 | 420.2 | 22,858 | 402,087 | - |
| | | | 1銘柄<1.0%> | 1銘柄<1.1%> | - | - | 1.1 |

| 銘柄 | 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 | |
| (シンガポール) | | 千口 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | | % |
| | CAPLAND ASCENDAS REIT | 1,570.591 | 1,570.591 | 4,334 | 438,945 | | 1.2 |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 4,719.542 | 4,282.242 | 6,894 | 698,127 | | 2.0 |
| | PARKWAY LIFE REIT | 2,517 | 2,517 | 9,413 | 953,219 | | 2.7 |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 1,674.54 | 1,674.54 | 3,700 | 374,736 | | 1.1 |
| | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | 2,918.9 | - | - | - | | - |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 13,400.573 5銘柄<7.4%> | 10,044.373 4銘柄<7.0%> | 24,343 - | 2,465,028 - | | - 7.0 |
| (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 | 11,602.872 | 11,602.872 | 23,843 | 2,081,334 | | 5.9 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 11,602.872 1銘柄<5.6%> | 11,602.872 1銘柄<5.9%> | 23,843 - | 2,081,334 - | | - 5.9 |
| (イギリス) | | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | | % |
| | UNITE GROUP PLC | 629.834 | 984.214 | 9,025 | 1,511,728 | | 4.3 |
| | SEGRO PLC | 1,185.138 | 1,185.138 | 9,504 | 1,592,055 | | 4.5 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 1,814.972 2銘柄<8.6%> | 2,169.352 2銘柄<8.8%> | 18,530 - | 3,103,783 - | | - 8.8 |
| (オランダ) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| | VASTNED RETAIL | 452.507 | 452.507 | 9,638 | 1,393,134 | | 4.0 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 452.507 1銘柄<3.2%> | 452.507 1銘柄<4.0%> | 9,638 - | 1,393,134 - | | - 4.0 |
| (ベルギー) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| | COFINIMMO SA | 34.726 | 34.726 | 2,944 | 425,636 | | 1.2 |
| | WAREHOUSES DE PAUW | 690.172 | 690.172 | 18,248 | 2,637,587 | | 7.5 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 724.898 2銘柄<10.2%> | 724.898 2銘柄<8.7%> | 21,192 - | 3,063,223 - | | - 8.7 |
| (フランス) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| | GECINA SA | 43.793 | 43.793 | 4,180 | 604,183 | | 1.7 |
| | ICADE | 90.256 | 90.256 | 3,613 | 522,345 | | 1.5 |
| | KLEPIERRE | - | 285.887 | 6,338 | 916,111 | | 2.6 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 134.049 2銘柄<3.4%> | 419.936 3銘柄<5.8%> | 14,132 - | 2,042,640 - | | - 5.8 |
| (ドイツ) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 569.772 | - | - | - | | - |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 569.772 1銘柄<3.5%> | - -銘柄<-%> | - - | - - | | - - |
| (スペイン) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 174.863 | 174.863 | 1,037 | 150,005 | | 0.4 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 174.863 1銘柄<0.4%> | 174.863 1銘柄<0.4%> | 1,037 - | 150,005 - | | - 0.4 |
| 合計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 69,090.326 32銘柄<96.3%> | 68,395.536 32銘柄<95.9%> | - - | 33,699,372 - | | - 95.9 |

(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

2022年12月9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 | 33,699,372 | 95.9 |
| コール・ローン等、その他 | 1,458,626 | 4.1 |
| 投資信託財産総額 | 35,157,999 | 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、34,143,223千円、97.1%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、2022年12月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.95円、1カナダ・ドル=100.70円、1オーストラリア・ドル=92.65円、1香港・ドル=17.59円、1シンガポール・ドル=101.26円、1ニュージーランド・ドル=87.29円、1イギリス・ポンド=167.50円、1ユーロ=144.54円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月9日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 35,157,999,031円 |
| コール・ローン等 | 1,395,019,714 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 12,976,415,691 |
| 投資証券(評価額) | 20,722,956,809 |
| 未 収 入 金 | 6,462,418 |
| 未 収 配 当 金 | 57,144,399 |
| (B) 負 債 | - |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 35,157,999,031 |
| 元 本 | 10,919,663,091 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 24,238,335,940 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 10,919,663,091口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 32,197円 |

(注1) 期首元本額 12,002,161,901円
追加設定元本額 61,565,463円
一部解約元本額 1,144,064,273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) 10,137,742,028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) 262,801,966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> 271,614,018円
期末元本合計 10,919,663,091円

■損益の状況

当期 自2021年12月10日 至2022年12月9日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,379,524,326円 |
| 受 取 配 当 金 | 1,377,201,280 |
| 受 取 利 息 | 2,603,314 |
| そ の 他 収 益 金 | 46,686 |
| 支 払 利 息 | △326,954 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △3,995,784,308 |
| 売 買 益 損 | 5,694,702,273 |
| 売 買 損 益 | △9,690,486,581 |
| (C) そ の 他 費 用 | △9,626,498 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △2,625,886,480 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 29,462,197,578 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △2,753,909,695 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 155,934,537 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 24,238,335,940 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 24,238,335,940 |

(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。