

運用報告書 (全体版)

D I A M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	D I A M世界3資産オープン(毎月決算型)	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	高格付資産国の公社債を主要投資対象とします。
	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
	D I A M 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。
	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
運用方法	各マザーファンド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、D I A M US・リート・オープン・マザーファンド受益証券およびD I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド受益証券の純資産総額を合算して資産配分を算出します。なお、時価変動等により各マザーファンド受益証券の時価構成比率が基本資産配分比率から乖離した場合は、原則として定期的に基本資産配分比率に近づけるものとします。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。	
配分方針	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。	

愛称：ハッピーハーモニー

第204期	<決算日	2024年6月10日>
第205期	<決算日	2024年7月8日>
第206期	<決算日	2024年8月8日>
第207期	<決算日	2024年9月9日>
第208期	<決算日	2024年10月8日>
第209期	<決算日	2024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、「D I A M世界3資産オープン(毎月決算型)」は、2024年11月8日に第209期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<https://www.am-one.co.jp/>

DIAM世界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・証券・債券組入比率	純資産総額
		(分配落)	税込み分配金	期中騰落率						
第31作成期	180期 (2022年6月8日)	円 10,298	円 15	% 3.7	% 33.4	% -	% 32.8	% -	% 29.4	百万円 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
第34作成期	198期 (2023年12月8日)	10,177	15	1.4	32.2	-	32.4	-	31.7	1,698
	199期 (2024年1月9日)	10,601	15	4.3	32.8	-	32.6	-	31.8	1,742
	200期 (2024年2月8日)	10,701	15	1.1	32.8	-	32.2	-	31.8	1,731
	201期 (2024年3月8日)	10,910	15	2.1	32.2	-	32.3	-	31.5	1,754
	202期 (2024年4月8日)	11,043	15	1.4	32.3	-	32.6	-	31.5	1,753
	203期 (2024年5月8日)	11,217	15	1.7	32.8	-	32.1	-	31.2	1,773
第35作成期	204期 (2024年6月10日)	11,498	15	2.6	32.4	-	32.5	-	31.4	1,800
	205期 (2024年7月8日)	11,908	15	3.7	32.4	-	32.6	-	31.3	1,848
	206期 (2024年8月8日)	10,868	15	△8.6	31.6	-	32.5	-	31.6	1,679
	207期 (2024年9月9日)	11,118	15	2.4	32.0	-	32.4	-	31.3	1,708
	208期 (2024年10月8日)	11,554	15	4.1	32.8	-	31.7	-	31.7	1,769
	209期 (2024年11月8日)	11,704	15	1.4	32.9	-	32.3	-	30.9	1,764

(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204期	(期 首) 2024年5月8日	11,217	—	32.8	—	32.1	—	31.2
	5 月 末	11,395	1.6	32.3	—	32.7	—	31.3
	(期 末) 2024年6月10日	11,513	2.6	32.4	—	32.5	—	31.4
第205期	(期 首) 2024年6月10日	11,498	—	32.4	—	32.5	—	31.4
	6 月 末	11,759	2.3	32.3	—	32.5	—	31.1
	(期 末) 2024年7月8日	11,923	3.7	32.4	—	32.6	—	31.3
第206期	(期 首) 2024年7月8日	11,908	—	32.4	—	32.6	—	31.3
	7 月 末	11,422	△4.1	32.2	—	31.8	—	31.8
	(期 末) 2024年8月8日	10,883	△8.6	31.6	—	32.5	—	31.6
第207期	(期 首) 2024年8月8日	10,868	—	31.6	—	32.5	—	31.6
	8 月 末	11,332	4.3	32.4	—	32.3	—	31.8
	(期 末) 2024年9月9日	11,133	2.4	32.0	—	32.4	—	31.3
第208期	(期 首) 2024年9月9日	11,118	—	32.0	—	32.4	—	31.3
	9 月 末	11,467	3.1	32.4	—	31.7	—	31.6
	(期 末) 2024年10月8日	11,569	4.1	32.8	—	31.7	—	31.7
第209期	(期 首) 2024年10月8日	11,554	—	32.8	—	31.7	—	31.7
	10 月 末	11,787	2.0	32.6	—	31.7	—	31.3
	(期 末) 2024年11月8日	11,719	1.4	32.9	—	32.3	—	30.9

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

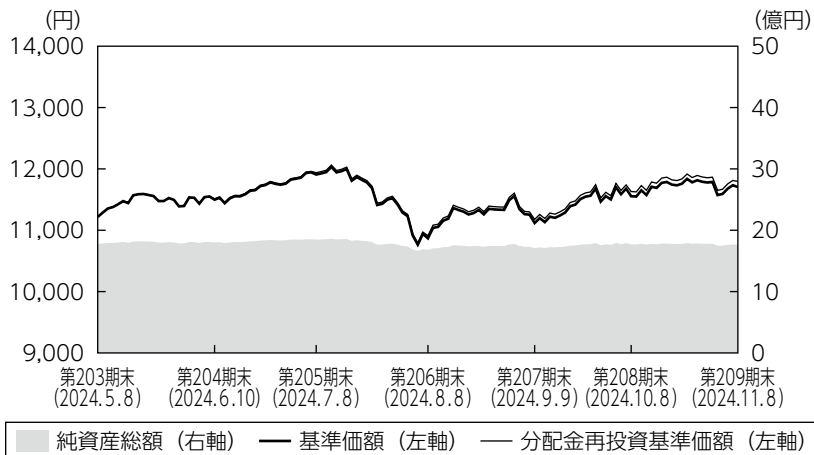
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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204期～第209期の運用経過（2024年5月9日から2024年11月8日まで）

基準価額等の推移



第204期首： 11,217円
 第209期末： 11,704円
 (既払分配金90円)
 騰落率： 5.2%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

オーストラリアやノルウェーで10年国債利回りが上昇（価格は下落）したことや複数の通貨が対円で下落したことなどがマイナスに寄与したものの、米国の底堅い景況感や、F R B（米連邦準備理事会）が利下げを開始したことなどを好感し外国株式や外国リートが上昇したこと、景気減速などから利下げに踏み切ったカナダやニュージーランドで10年国債利回りが低下（価格は上昇）したことなどがプラスに寄与し、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
D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	1.4%
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	9.3%
D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド	14.7%
D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	2.0%

投資環境

外国債券市場では、米国や欧州の中央銀行が利下げに踏み切ったことなどを背景に、10年国債利回りが低下しました。その一方で投資国の10年国債利回りの動きはまちまちとなりました。インフレの落ち着きや景気減速などから利下げに踏み切ったカナダやニュージーランドで10年国債利回りが低下した一方、政策金利を据え置いたオーストラリアやノルウェーでは10年国債利回りが上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。作成期初から2024年6月までは、企業の堅調な1－3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。7月から9月前半にかけては、軟調な米経済指標などを受けて景気後退懸念が高まったことなどから株価は伸び悩みました。作成期末にかけては、概ね堅調な企業決算や米国大統領選挙の結果などを受けて、株価は上昇しました。

米国リート市場（現地通貨建て）は上昇しました。作成期初から2024年9月にかけては、FRBによる利下げ期待が高まり、上昇基調で推移しました。利下げが決定されると、その後は大統領選挙を巡って米長期金利が上昇したことなどから米国リート市場はやや弱含んで作成期末を迎えました。セクター別では、ヘルスケアやオフィスなどが大きく上昇しました。

米国以外のリート市場（現地通貨建て）は、まちまちの展開となりました。欧州市場はECB（欧州中央銀行）の利下げを受けて上昇する局面もありましたが、作成期末にかけて英国新政権に対する懸念や米長期金利の上昇などを受けて下落しました。アジア・オセアニア市場では中国の景気刺激策期待から香港が大きく上昇しました。シンガポールやオーストラリアも同様の理由などから上昇しました。

為替市場では円は主要通貨に対して値動きの大きい展開となりました。米ドル／円相場は、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となった後、日銀の想定以上の金融引き締め姿勢や米景気後退懸念等から急速に円高米ドル安が進みました。その後、米景気後退懸念が和らいだこと等から再び円安米ドル高に振れました。その他主要通貨においても、円安で推移したのち急速に円高が進みましたが、再び円安方向に振れました。

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および金利水準を勘案して、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、作成期初と概ね同水準としました。

※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

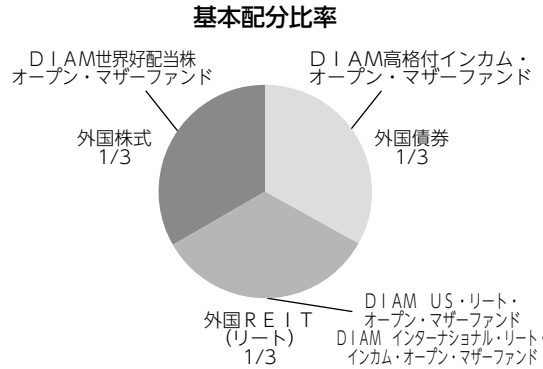
銘柄選択においては、「地域の分散」、「業種の分散」に着目し、世界の好配当株への投資を通じて、安定した配当収益の確保と中長期的な値上がり益の確保をめざした運用を行いました。地域別では、概ね前作成期末と同様の資産配分を維持しました。業種別では、幅広い業種に分散投資を行う中、情報技術セクターや金融セクターに対する投資比率を高位に維持しました。

●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。ヘルスケアなどの組入比率を引き上げた一方、オフィスなどの組入比率を引き下げました。

●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。国別では、スペインなどの組入比率を引き上げた一方、オーストラリアなどの組入比率を引き下げました。また、セクター別では、混合型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。

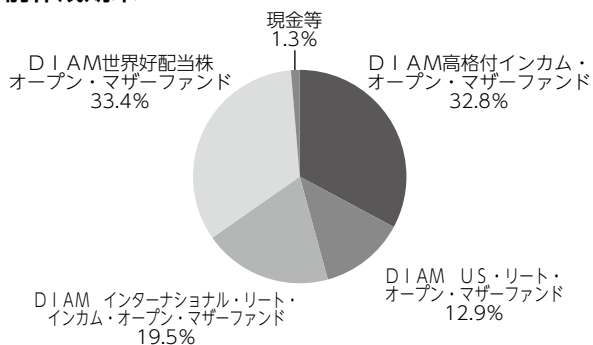


※各マザーファンドの時価の変動などにより、時価構成比率が変化した場合には、定期的に基本配分比率に修正します。

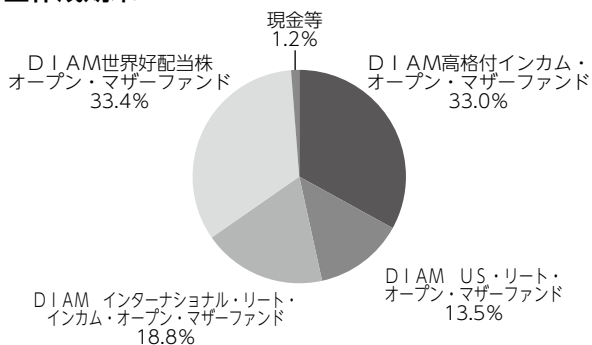
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

前作成期末



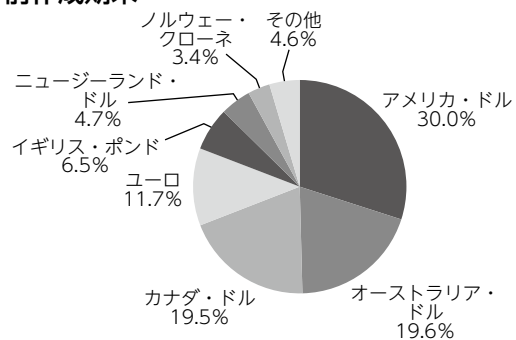
当作成期末



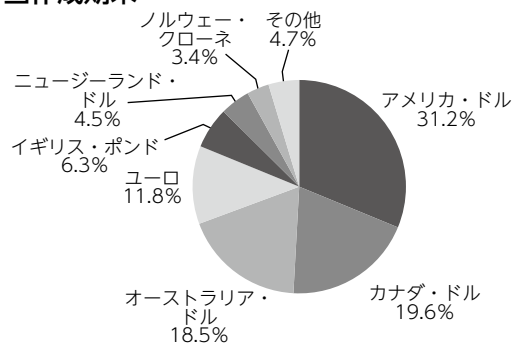
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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204期	第205期	第206期	第207期	第208期	第209期
	2024年5月9日 ~2024年6月10日	2024年6月11日 ~2024年7月8日	2024年7月9日 ~2024年8月8日	2024年8月9日 ~2024年9月9日	2024年9月10日 ~2024年10月8日	2024年10月9日 ~2024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	0.13%	0.13%	0.14%	0.13%	0.13%	0.13%
当期の収益	15円	15円	9円	15円	15円	15円
当期の収益以外	-円	-円	5円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	2,401円	2,812円	2,806円	2,818円	2,839円	2,843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。デュレーションについては、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策および地政学的リスクを注視し、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、各国の利下げや企業業績の改善が期待されています。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

米国ではF R Bによる利下げが開始され、さらなる緩和期待が高まっています。引き続き財務体質が良好で、長期的な成長が期待できる銘柄を選別して投資する方針です。また、割安な水準にある銘柄にも投資することにより、比較的高い配当利回りを維持できるポートフォリオを構築していきます。

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

米国以外においても、欧州では利下げが始まっていますが、オフィスなどでは厳しいファンダメンタルズが予想されます。こうした中、欧州市場は、強力な価格決定力を持つ銘柄などへの投資を行っていく方針です。アジア・オセアニア市場は、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204期～第209期 (2024年5月9日 ～2024年11月8日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	77円	
(投信会社)	(37)	(0.321)	
(販売会社)	(36)	(0.310)	
(受託会社)	(4)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	1	0.013	(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)	(0.010)	
(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	1	0.007	(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)	(0.004)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.003)	
(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)	(0.008)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	80	0.694	

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

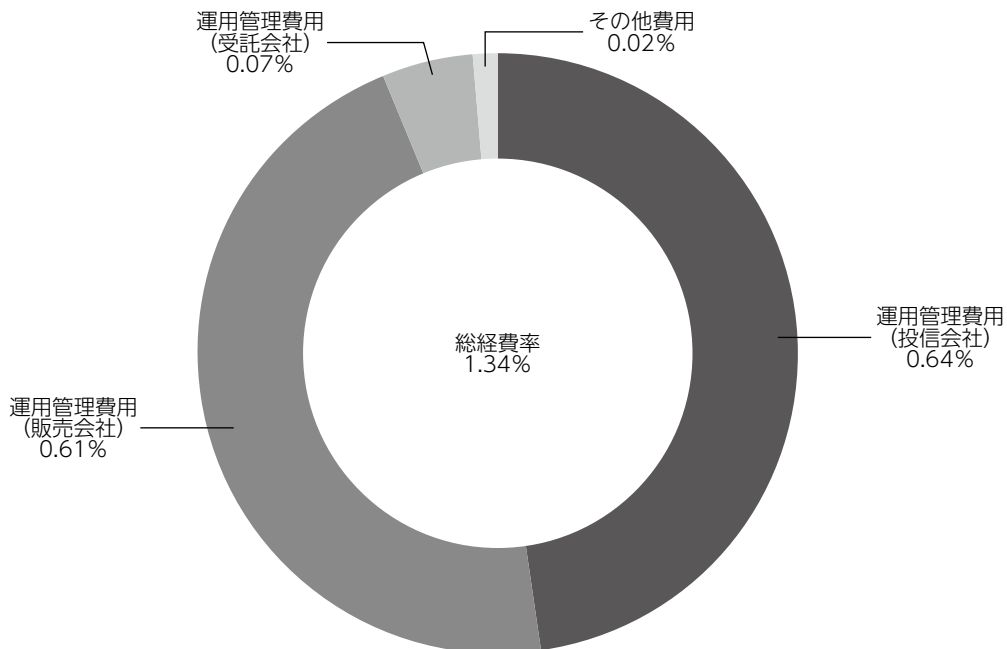
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.34%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2024年5月9日から2024年11月8日まで）

	第 204 期 ~ 第 209 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	—	—	2,783	8,000
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	10,413	55,000
D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	3,814	23,000
D I A M イ ン タ ー ナ シ ョ ナ ル ・ リ ー ト ・ イ ン カ ム ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	5,668	23,000

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 204 期 ~ 第 209 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	16,501,625千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	39,908,234千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.41

(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（2024年5月9日から2024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 34 作 成 期 末	第 35 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	208,090	205,307	582,415
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	117,803	107,390	589,992
D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	41,893	38,079	239,015
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	90,261	84,592	330,934

<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 (32,442,642,425口) の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

外国 (外貨建) 公社債

区 分	2024 年 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 334,700	千カナダ・ドル 325,746	千円 35,949,383	% 39.1	% -	% 25.1	% 2.8	% 11.1
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 393,498	千オーストラリア・ドル 352,191	千円 35,965,811	39.1	-	25.1	2.2	11.8
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 109,000	千ニュージーランド・ドル 98,208	千円 9,055,816	9.8	-	5.0	0.9	3.9
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 699,000	千ノルウェー・クローネ 641,767	千円 9,042,506	9.8	-	5.7	2.7	1.3
合 計	-	-	千円 90,013,518	97.8	-	61.0	8.7	28.2

(注1) 邦貨換算金額は、2024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、2024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	2024 年 11 月 8 日 現 在						償 還 年 月 日
	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	44,000	42,391	4,678,370	2026/03/01	
CANADA 3.75 05/01/25	国債証券	3.7500	25,000	25,045	2,764,072	2025/05/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	10,900	12,944	1,428,533	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,608	949,979	2037/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,486	605,436	2041/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	44,000	39,919	4,405,462	2030/06/01	
CANADA 3.0 06/01/34	国債証券	3.0000	8,000	7,858	867,264	2034/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	14,000	12,652	1,396,337	2031/06/01	
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	20,000	18,439	2,034,928	2032/06/01	
CANADA 3.25 09/01/28	国債証券	3.2500	23,000	23,203	2,560,742	2028/09/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	34,000	35,295	3,895,232	2045/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	12,000	9,292	1,025,470	2051/12/01	

銘柄	2024 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 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	7,500	5,408	596,929	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,542	501,329	2064/12/01
CANADA 3.25 12/01/33	国債証券	3.2500	30,000	30,101	3,322,013	2033/12/01
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	20,000	19,035	2,100,747	2032/12/01
KOMBNK 4.9 10/05/26	特殊債券	4.9000	20,000	20,590	2,272,354	2026/10/05
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	5,000	4,930	544,178	2025/12/15
小 計	—	—	334,700	325,746	35,949,383	—
(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	25,000	18,201	1,858,686	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	61,000	60,704	6,199,106	2025/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	21,000	19,089	1,949,368	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	4,000	3,029	309,374	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	38,000	30,188	3,082,833	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	7,000	6,539	667,810	2034/05/21
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	国債証券	4.7500	2,000	1,905	194,593	2054/06/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	5,000	4,183	427,173	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	11,000	9,251	944,768	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	7,000	3,619	369,658	2051/06/21
AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	国債証券	4.2500	15,000	14,580	1,488,970	2034/06/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	37,000	32,671	3,336,438	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	20,000	15,868	1,620,440	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	3,000	2,996	306,009	2024/11/21
AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	国債証券	4.2500	10,000	9,635	983,926	2035/12/21
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	49,000	44,550	4,549,477	2034/12/21
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	11,000	10,838	1,106,829	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,418	349,123	2030/05/17
KOMBNK 4.35 01/18/28	特殊債券	4.3500	10,000	9,932	1,014,327	2028/01/18
KOMBNK 4.4 02/17/26	特殊債券	4.4000	10,000	9,974	1,018,616	2026/02/17
NATIONL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,431	350,458	2036/06/30
KOMBNK 4.25 07/16/25	特殊債券	4.2500	21,998	21,916	2,238,123	2025/07/16
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,681	580,149	2031/08/18
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28	特殊債券	4.5000	10,000	9,983	1,019,545	2028/09/06
小 計	—	—	393,498	352,191	35,965,811	—

銘柄	2024 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 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,265	854,328	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	8,857	816,705	2037/04/15
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	27,000	26,824	2,473,468	2025/04/15
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	11,000	7,193	663,274	2051/05/15
NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	国債証券	5.0000	5,000	4,865	448,616	2054/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	3,000	1,899	175,197	2041/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	10,000	8,431	777,434	2032/05/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28	地方債証券	2.2500	10,000	9,323	859,687	2028/05/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 4.5 05/15/30	地方債証券	4.5000	7,000	6,919	638,046	2030/05/15
HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30	特殊債券	2.1830	3,000	2,649	244,314	2030/04/24
KOMBNK 4.0 08/20/25	特殊債券	4.0000	12,000	11,980	1,104,743	2025/08/20
小 計	—	—	109,000	98,208	9,055,816	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	90,000	87,119	1,227,514	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	72,000	68,608	966,687	2027/02/17
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	50,000	46,980	661,948	2028/04/26
NORWAY 3.625 04/13/34	国債証券	3.6250	45,000	43,861	618,005	2034/04/13
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	70,000	62,024	873,925	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	85,000	74,132	1,044,530	2030/08/19
NORWAY 3.0 08/15/33	国債証券	3.0000	102,000	95,127	1,340,352	2033/08/15
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	70,000	63,534	895,204	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	85,000	71,700	1,010,265	2031/09/17
NORWAY 3.5 10/06/42	国債証券	3.5000	30,000	28,677	404,072	2042/10/06
小 計	—	—	699,000	641,767	9,042,506	—
合 計	—	—	—	—	90,013,518	—

■D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド（7,583,114,638口）の内容です。

外国株式

銘柄	2024年5月8日現在		2024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		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	204.77	120.03	2,564	392,766	情報技術サービス	
AMGEN INC	54.23	41.34	1,330	203,781	バイオテクノロジー	
APPLE INC	149.73	433.96	9,871	1,511,656	コンピュータ・周辺機器	
BEST BUY CO INC	—	299.88	2,702	413,790	専門小売り	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	101.29	101.29	554	84,858	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	299.68	249.9	5,907	904,559	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	368.59	1,020.64	5,927	907,735	通信機器	
MORGAN STANLEY	—	470.12	6,038	924,632	資本市場	
BANK OF AMERICA CORP	449.28	—	—	—	銀行	
EATON CORP PLC	196.05	196.05	7,068	1,082,442	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	656.69	656.69	4,900	750,370	電力	
GILEAD SCIENCES INC	101.52	101.52	993	152,192	バイオテクノロジー	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	—	54.98	3,200	490,134	資本市場	
JOHNSON & JOHNSON	155.46	74.97	1,175	179,928	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	260.01	260.01	3,438	526,557	家庭用品	
LAM RESEARCH CORP	56.75	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MCDONALD'S CORPORATION	89.93	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
MERCK & CO.INC.	261.32	129.95	1,314	201,320	医薬品	
MICROSOFT CORP	300.79	240.15	10,216	1,564,483	ソフトウェア	
3M CO	222.9	—	—	—	コングロメリット	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	—	70.04	3,291	504,031	通信機器	
PAYCHEX INC	61.45	—	—	—	専門サービス	
PPL CORPORATION	577.29	577.29	1,866	285,886	電力	
PEPSICO INC	162.44	143.16	2,347	359,522	飲料	
PFIZER INC	475.45	475.45	1,305	199,924	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	91.51	91.51	1,495	228,985	家庭用品	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	—	150.04	3,308	506,658	ホテル・レストラン・レジャー	
AT&T INC	2,394.41	2,394.41	5,277	808,109	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	383.91	200.13	3,137	480,435	石油・ガス・消耗燃料	
STARBUCKS CORP	253.44	40	384	58,875	ホテル・レストラン・レジャー	
CME GROUP INC	347.32	347.32	7,711	1,180,922	資本市場	
TRANSDIGM GROUP INC	—	45.01	5,983	916,266	航空宇宙・防衛	
MASTERCARD INC	126.33	113.39	5,872	899,216	金融サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	669.41	669.41	8,285	1,268,828	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	200.13	1,747	267,630	化学	
ABBVIE INC	232.92	334.65	6,710	1,027,512	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	102.66	499.8	9,186	1,406,778	半導体・半導体製造装置	
ARAMARK	—	799.68	3,116	477,207	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,102.44 31銘柄	11,602.9 33銘柄	138,235 —	21,168,004 <50.8%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	445.77	445.77	5,933	654,837	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	573.6	573.6	5,142	567,570	銀行	
RUSSEL METALS INC	1,406.01	500.05	2,188	241,491	商社・流通業	

銘柄	2024年5月8日現在		2024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 4,770	千円 526,487	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 3,268.1 4銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 2,362.14 4銘柄	18,035 -	1,990,386 <4.8%>	
(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 3,197 325	千円 326,494 33,277	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	株数・金額 銘柄数<比率> 878.08 2銘柄	3,523 -	359,772 <0.9%>	
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	百株 12,690 28,140 2,656	百株 12,690 32,020 -	千香港・ドル 33,184 37,975 -	千円 653,731 748,121 -	銀行 建設・土木 繊維・アパレル・贅沢品
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 43,486 3銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 44,710 2銘柄	71,160 -	1,401,853 <3.4%>	
(シンガポール) UNITED OVERSEAS BANK LTD	百株 1,307	百株 1,307	千シンガポール・ドル 4,352	千円 504,519	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 1,307 1銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 1,307 1銘柄	4,352 -	504,519 <1.2%>	
(イギリス) NATIONAL GRID PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC IMPERIAL BRANDS PLC UNILEVER PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC RIO TINTO PLC BP PLC 3I GROUP PLC GSK PLC	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 264.5 2,153.01 453.25 5,964.93 939.85 2,235.93	百株 2,744.83 800.52 1,155.92 500.33 2,153.01 453.25 5,000.42 939.85 2,235.93	千イギリス・ポンド 2,695 2,186 2,751 2,276 2,240 2,357 1,907 3,241 3,085	千円 535,742 434,533 546,806 452,377 445,263 468,547 379,166 644,289 613,290	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 石油・ガス・消耗燃料 資本市場 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 16,360.72 9銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 15,984.06 9銘柄	22,741 -	4,520,017 <10.8%>	
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 86.78 486.13	百株 51.98 624.38	千スイス・フラン 1,381 5,806	千円 242,240 1,018,094	医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 572.91 2銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 676.36 2銘柄	7,188 -	1,260,335 <3.0%>	
(デンマーク) NOVO NORDISK A/S-B	百株 348.52	百株 250.16	千デンマーク・クローネ 18,261	千円 404,678	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 348.52 1銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 250.16 1銘柄	18,261 -	404,678 <1.0%>	
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 2,475.68	百株 2,475.68	千スウェーデン・クローナ 27,294	千円 391,128	無線通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 2,475.68 1銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 2,475.68 1銘柄	27,294 -	391,128 <0.9%>	
(ユーロ…オランダ) FERROVIAL SE	百株 1,029	百株 1,029	千ユーロ 3,694	千円 610,488	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 1,029 1銘柄	株数・金額 銘柄数<比率> 1,029 1銘柄	3,694 -	610,488 <1.5%>	
(ユーロ…フランス) AXA SA	百株 1,692.38	百株 1,692.38	千ユーロ 5,776	千円 954,557	保険

銘柄	2024年5月8日現在		2024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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DANONE	268.36	50	327	54,155	食品	
BNP PARIBAS	541.55	599.13	3,537	584,667	銀行	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	28.46	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
TOTALENERGIES SE	923.86	840.03	4,850	801,566	石油・ガス・消耗燃料	
SANOFI	—	250.15	2,394	395,745	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,454.61 5銘柄	3,431.69 5銘柄	16,886 —	2,790,691 <6.7%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	721.65	—	—	—	航空貨物・物流サービス	
SAP SE	337.31	358.22	7,902	1,305,939	ソフトウェア	
E.ON SE	2,473.24	2,473.24	2,966	490,268	総合公益事業	
SIEMENS AG-REG	449.4	349.99	6,579	1,087,264	コングロマリット	
BASF SE	244.71	244.71	1,119	185,056	化学	
ALLIANZ SE	120.72	120.72	3,496	577,757	保険	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,955.37	2,706.4	7,653	1,264,850	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,302.4 7銘柄	6,253.28 6銘柄	29,717 —	4,911,137 <11.8%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	2,169.47	2,169.47	2,844	470,028	電力	
AMADEUS IT GROUP SA	411.73	50	338	55,957	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,581.2 2銘柄	2,219.47 2銘柄	3,182 —	525,985 <1.3%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	399.54	399.54	1,060	175,238	紙製品・林産品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	399.54 1銘柄	399.54 1銘柄	1,060 —	175,238 <0.4%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	93,566.2 70銘柄	93,579.36 70銘柄	— —	41,014,238 <98.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2024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、2024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 (3,775,998,354口) の内容です。

外国投資証券

銘柄	2024年5月8日現在		2024年11月8日現在		比率	
	口数	金額	口数	金額		
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千円	千口	千アメリカ・ドル	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	64.644	63.394	7,209	1,103,939	4.7	
BXP INC	70.4	67.32	5,561	851,705	3.6	
PROLOGIS INC	80.367	91.417	10,440	1,598,789	6.7	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	30.16	24.84	5,664	867,406	3.7	
CAMDEN PROPERTY TRUST	28.64	27.59	3,271	501,025	2.1	
EQUINIX INC	7.51	8.07	7,325	1,121,747	4.7	
COUSINS PROPERTIES INC	316.515	276.095	8,719	1,335,152	5.6	
CROWN CASTLE INC	19	18.31	1,908	292,185	1.2	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19.971	13.601	4,033	617,610	2.6	
EQUITY RESIDENTIAL	60.655	41.015	2,944	450,886	1.9	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	30.15	28.38	3,225	493,860	2.1	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	121.226	114.116	2,574	394,226	1.7	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	78.31	73.72	2,493	381,785	1.6	
WELLTOWER INC	54.29	11.95	1,636	250,550	1.1	
EAST GROUP	-	19.08	3,313	507,415	2.1	
MID AMERICA	-	15.64	2,419	370,475	1.6	
REGENCY CENTERS CORP	55.74	52.47	3,875	593,525	2.5	
UDR INC	95.11	89.53	3,898	596,921	2.5	
SIMON PROPERTY GROUP INC	45.8	33.61	5,906	904,532	3.8	
PUBLIC STORAGE	23.97	23.73	7,905	1,210,519	5.1	
SUN COMMUNITIES INC	22.9	-	-	-	-	
VENTAS INC	123.12	115.9	7,469	1,143,843	4.8	
EXTRA SPACE STORAGE INC	16.945	26.095	4,283	655,891	2.8	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	353.37	332.64	3,562	545,537	2.3	
DIGITAL REALTY TRUST INC	46.4	39.34	7,021	1,075,127	4.5	
DOUGLAS EMMETT INC	114.53	54.24	1,042	159,636	0.7	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	266.32	-	-	-	-	
TERRENO REALTY CORP	75.173	47.903	2,894	443,204	1.9	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	303.123	527.753	2,427	371,748	1.6	
AMERICAN TOWER CORP	34.99	42.28	8,365	1,281,076	5.4	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	93.1	110.57	4,709	721,116	3.0	
AMERICAN HOMES 4 RENT	106.24	89.98	3,304	506,089	2.1	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	266.73	203.9	5,790	886,739	3.7	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	99.4	95.04	1,802	276,079	1.2	
VICI PROPERTIES INC	60.02	56.5	1,747	267,601	1.1	
合計	口数・金額	3,184.819	2,836.019	148,749	22,777,952	-
	銘柄数 < 比率 >	33銘柄 < 96.7% >	33銘柄 < 96.1% >	-	-	96.1

(注1) 邦貨換算金額は、2024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、2024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 (8,711,504,974円) の内容です。

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	2024年5月8日現在		2024年11月8日現在		
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
不動産ファンド	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール)					
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE	14,435.4	-	-	-	-
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	14,435.4 1銘柄<3.7%>	- -銘柄<-%>	- -	- -
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT	421.539	357.839	16,385	1,808,298	5.3
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	733.47	733.47	14,038	1,549,301	4.5
CROMBIE REAL ESTATE INV	576.2	576.2	8,568	945,574	2.8
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	771.8	771.8	11,885	1,311,708	3.8
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	1,162.95	1,162.95	21,421	2,364,081	6.9
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	3,665.959 5銘柄<22.5%>	3,602.259 5銘柄<23.4%>	72,299 7,978,963	- 23.4
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL RETAIL REIT	2,724.945	2,059.724	6,879	702,532	2.1
GPT GROUP	1,691.07	485.603	2,156	220,178	0.6
STOCKLAND	944.822	944.822	4,724	482,426	1.4
INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,199.852	2,199.852	10,603	1,082,807	3.2
GOODMAN GROUP	597.337	221.816	7,838	800,516	2.3
VICINITY CENTRES	6,302.094	6,302.094	13,108	1,338,625	3.9
REGION RE LTD	8,722.312	8,722.312	18,665	1,906,146	5.6
NATIONAL STORAGE REIT	7,135.696	7,135.696	17,411	1,778,021	5.2
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	30,318.128 8銘柄<28.9%>	28,071.919 8銘柄<24.4%>	81,387 8,311,253	- 24.4
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	1,092.8	1,856	67,651	1,332,728	3.9
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,092.8 1銘柄<2.2%>	1,856 1銘柄<3.9%>	67,651 -	- 3.9
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
PARKWAY LIFE REIT	2,517	2,517	8,834	1,024,114	3.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	2,517 1銘柄<2.9%>	2,517 1銘柄<3.0%>	8,834 -	- 3.0
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
GOODMAN PROPERTY TRUST	10,701.792	10,701.792	21,831	2,013,096	5.9
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	10,701.792 1銘柄<6.3%>	10,701.792 1銘柄<5.9%>	21,831 -	- 5.9
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
UNITE GROUP PLC	509.982	318.475	2,722	541,215	1.6
SEGRO PLC	649.531	367.15	2,832	563,073	1.7
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	-	1,614.958	3,074	611,163	1.8
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	4,792.979	4,792.979	6,480	1,287,986	3.8

銘柄	2024年5月8日現在		2024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
(イギリス) TRITAX BIG BOX REIT PLC	千口 4,830.553	千円 10,783.045	千口 4,830.553	千イギリス・ポンド 6,646	千円 1,321,126	% 3.9
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	10,783.045 4銘柄<14.1%>	11,924.115 5銘柄<12.7%>	21,757 -	4,324,564 -	- 12.7
(ガーンジー) SHURGARD SELF STORAGE LTD	千口 -	千円 -	千口 110.33	千ユーロ 4,369	千円 722,032	% 2.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	- -銘柄<-%>	110.33 1銘柄<2.1%>	4,369 -	722,032 -	- 2.1
(オランダ) VASTNED RETAIL	千口 452.507	千円 452.507	千口 452.507	千ユーロ 11,086	千円 1,832,142	% 5.4
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	452.507 1銘柄<4.8%>	452.507 1銘柄<5.4%>	11,086 -	1,832,142 -	- 5.4
(ベルギー) COFINIMMO SA WAREHOUSES DE PAUW AEDIFICA	千口 15.778 320.887 -	千円 15.778 320.887 -	千口 - 320.887 45.184	千ユーロ - 6,732 2,616	千円 - 1,112,564 432,345	% - 3.3 1.3
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	336.665 2銘柄<4.5%>	366.071 2銘柄<4.5%>	9,348 -	1,544,910 -	- 4.5
(フランス) GECINA SA KLEPIERRE	千口 32.875 285.887	千円 32.875 285.887	千口 32.875 285.887	千ユーロ 3,154 8,136	千円 521,288 1,344,612	% 1.5 3.9
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	318.762 2銘柄<5.1%>	318.762 2銘柄<5.5%>	11,290 -	1,865,901 -	- 5.5
(スペイン) INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千口 174.863 -	千円 174.863 -	千口 174.863 840.676	千ユーロ 948 8,457	千円 156,770 1,397,636	% 0.5 4.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	174.863 1銘柄<0.5%>	1,015.539 2銘柄<4.6%>	9,405 -	1,554,407 -	- 4.6
合計	口数・金額 銘柄数<比率>	74,796.921 27銘柄<95.6%>	60,936.294 29銘柄<95.4%>	- -	32,504,115 -	- 95.4

(注1) 邦貨換算金額は、2024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、2024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

2024年11月8日現在

項 目	第 35 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	582,415	32.9
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	589,992	33.4
D I A M U S・リート・オープン・マザーファンド	239,015	13.5
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	330,934	18.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	26,656	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	1,769,016	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年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91,613,122千円、96.8%、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドは41,344,286千円、99.2%、D I A M U S・リート・オープン・マザーファンドは23,030,059千円、94.7%、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33,047,420千円、95.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年11月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=153.13円、1カナダ・ドル=110.36円、1オーストラリア・ドル=102.12円、1香港・ドル=19.70円、1シンガポール・ドル=115.92円、1ニュージーランド・ドル=92.21円、1台湾・ドル=4.745円、1イギリス・ポンド=198.76円、1スイス・フラン=175.33円、1デンマーク・クローネ=22.16円、1ノルウェー・クローネ=14.09円、1スウェーデン・クローナ=14.33円、1ユーロ=165.26円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月10日)、(2024年7月8日)、(2024年8月8日)、(2024年9月9日)、(2024年10月8日)、(2024年11月8日)現在

項 目	第204期末	第205期末	第206期末	第207期末	第208期末	第209期末
(A) 資 産	1,805,242,756円	1,852,618,457円	1,683,653,317円	1,713,145,455円	1,774,039,570円	1,769,016,103円
コール・ローン等	21,612,981	28,735,888	32,322,051	33,763,755	23,577,063	26,656,940
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)	596,241,927	610,029,836	556,403,546	560,981,901	576,503,139	582,415,992
D I A M 世界好配当株オープン・ マザーファンド(評価額)	597,794,446	609,985,724	538,891,686	552,897,604	591,161,771	589,992,585
D I A M U S・ リート・オープン・ マザーファンド(評価額)	233,990,837	240,583,204	225,774,143	222,268,447	229,176,019	239,015,692
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)	355,602,565	363,283,805	330,261,891	343,233,748	353,621,578	330,934,894
(B) 負 債	4,505,051	4,250,875	4,338,512	4,319,314	4,723,364	4,941,599
未払収益分配金	2,349,271	2,328,270	2,317,859	2,305,538	2,297,055	2,260,943
未払解約金	-	65,629	-	-	582,100	688,632
未払信託報酬	2,149,421	1,851,498	2,014,690	2,007,840	1,838,771	1,986,148
その他未払費用	6,359	5,478	5,963	5,936	5,438	5,876
(C) 純資産総額(A-B)	1,800,737,705	1,848,367,582	1,679,314,805	1,708,826,141	1,769,316,206	1,764,074,504
元 本	1,566,180,816	1,552,180,384	1,545,239,497	1,537,025,389	1,531,370,293	1,507,295,616
次期繰越損益金	234,556,889	296,187,198	134,075,308	171,800,752	237,945,913	256,778,888
(D) 受 益 権 総 口 数	1,566,180,816口	1,552,180,384口	1,545,239,497口	1,537,025,389口	1,531,370,293口	1,507,295,616口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,498円	11,908円	10,868円	11,118円	11,554円	11,704円

(注) 第203期末における元本額は1,580,976,514円、当作成期間(第204期~第209期)中における追加設定元本額は4,691,059円、同解約元本額は78,371,957円です。

■損益の状況

〔自 2024年5月9日 至 2024年6月10日〕〔自 2024年6月11日 至 2024年7月8日〕〔自 2024年7月9日 至 2024年8月8日〕〔自 2024年8月9日 至 2024年9月9日〕〔自 2024年9月10日 至 2024年10月8日〕〔自 2024年10月9日 至 2024年11月8日〕

項 目	第 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 期
(A) 配 当 等 収 益	1,538円	1,522円	2,570円	4,885円	4,753円	4,955円
受 取 利 息	1,538	1,522	2,570	4,885	4,753	4,955
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	48,369,903	67,903,982	△156,445,378	42,740,919	70,899,523	26,815,069
売 買 益	48,647,592	68,257,085	537,558	43,050,434	71,080,807	39,585,486
売 買 損	△277,689	△353,103	△156,982,936	△309,515	△181,284	△12,770,417
(C) 信 託 報 酬 等	△2,155,780	△1,856,976	△2,020,653	△2,013,776	△1,844,209	△1,992,024
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	46,215,661	66,048,528	△158,463,461	40,732,028	69,060,067	24,828,000
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	305,363,620	345,942,703	407,620,160	245,408,278	282,630,625	343,736,065
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△114,673,121	△113,475,763	△112,763,532	△112,034,016	△111,447,724	△109,524,234
(配 当 等 相 当 額)	(26,896,695)	(26,822,952)	(26,915,086)	(26,967,720)	(27,098,187)	(26,865,800)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△141,569,816)	(△140,298,715)	(△139,678,618)	(△139,001,736)	(△138,545,911)	(△136,390,034)
(G) 合 計 (D+E+F)	236,906,160	298,515,468	136,393,167	174,106,290	240,242,968	259,039,831
(H) 収 益 分 配 金	△2,349,271	△2,328,270	△2,317,859	△2,305,538	△2,297,055	△2,260,943
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	234,556,889	296,187,198	134,075,308	171,800,752	237,945,913	256,778,888
追 加 信 託 差 損 益 金	△114,673,121	△113,475,763	△112,763,532	△112,034,016	△111,447,724	△109,524,234
(配 当 等 相 当 額)	(26,897,980)	(26,824,106)	(26,915,765)	(26,968,606)	(27,099,575)	(26,866,463)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△141,571,101)	(△140,299,869)	(△139,679,297)	(△139,002,622)	(△138,547,299)	(△136,390,697)
分 配 準 備 積 立 金	349,230,010	409,662,961	406,705,773	406,281,371	407,756,397	401,667,405
繰 越 損 益 金	-	-	△159,866,933	△122,446,603	△58,362,760	△35,364,283

(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する権限を委託するために要する費用は、第204期から第209期まででD I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド592,612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883,566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 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 期
(a) 経費控除後の配当等収益	5,393,311円	7,036,681円	1,403,472円	4,238,214円	5,495,691円	2,774,562円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	40,822,350	59,011,847	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	26,897,980	26,824,106	26,915,765	26,968,606	27,099,575	26,866,463
(d) 分 配 準 備 積 立 金	305,363,620	345,942,703	407,620,160	404,348,695	404,557,761	401,153,786
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	378,477,261	438,815,337	435,939,397	435,555,515	437,153,027	430,794,811
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,416.56	2,827.09	2,821.18	2,833.76	2,854.65	2,858.06
(g) 分 配 金	2,349,271	2,328,270	2,317,859	2,305,538	2,297,055	2,260,943
(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 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■当ファンドが投資対象とする「D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド」において、有価証券等の運用の指図に関する権限の委託先であるデービス・セレクトド・アドバイザーズの所在地を変更しました。

(2024年10月8日)

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2024年6月5日）

（計算期間 2023年6月6日～2024年6月5日）

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2003年7月15日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主要投資対象	高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使等により取得するもの に限り、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率			
17期（2020年6月5日）	円 22,639	% 5.1	% 98.5	% -	百万円 137,252
18期（2021年6月7日）	25,062	10.7	98.0	-	125,601
19期（2022年6月6日）	25,405	1.4	98.0	-	112,677
20期（2023年6月5日）	25,346	△0.2	98.7	-	98,072
21期（2024年6月5日）	28,558	12.7	98.0	-	97,439

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドは高格付資源国の公社債を投資対象としており、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

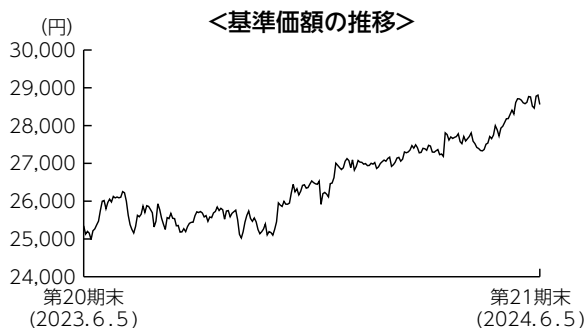
■当期中の基準価額の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年6月6日から2024年6月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は28,558円となり、前期末比で12.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション*については、投資国および世界経済見通し、主要国および投資国のインフレ動向や金融政策を勘案して調整を行いました。当期末のデュレーションは、高金利の長期化が見込まれる中で利回り上昇のリスクが強まったとの判断などから、前期末と比較して短期化しました。

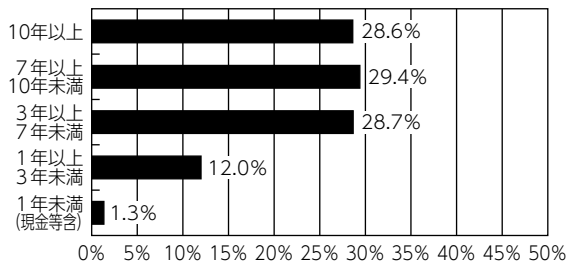
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

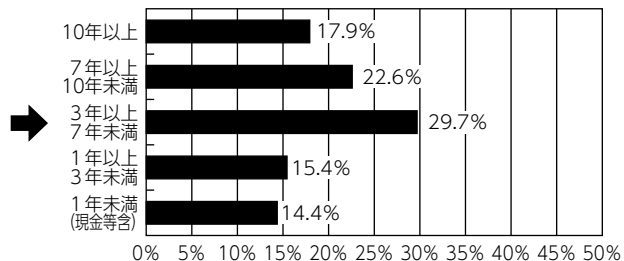
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

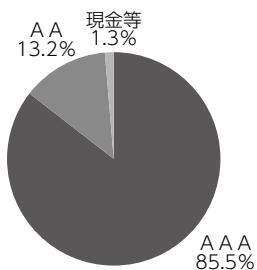


期末

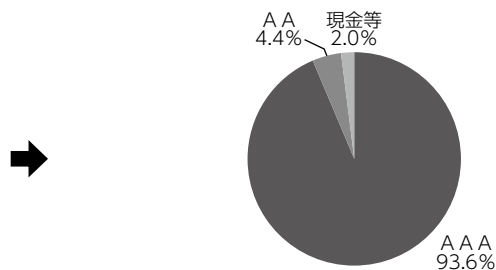


○格付別構成比

期首 (前期末)

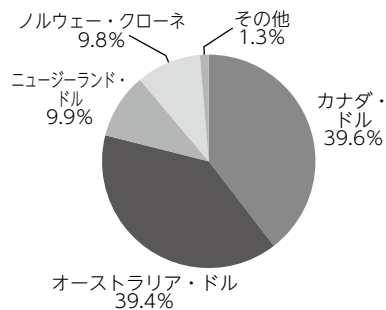


期末

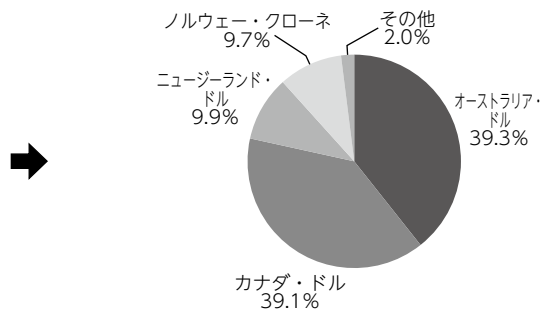


○通貨別構成比

期首 (前期末)



期末

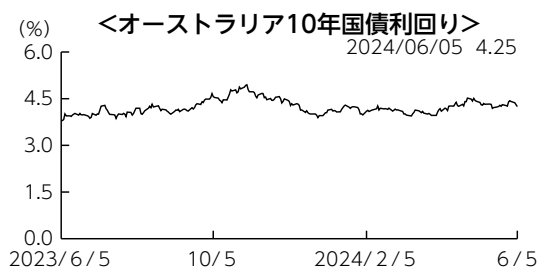
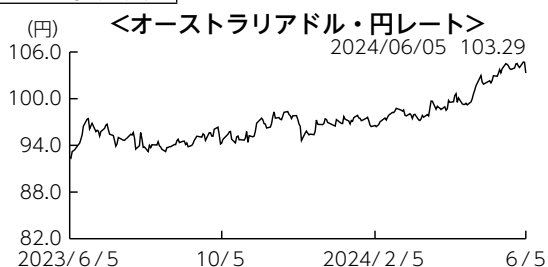


【各国の為替・金利動向】

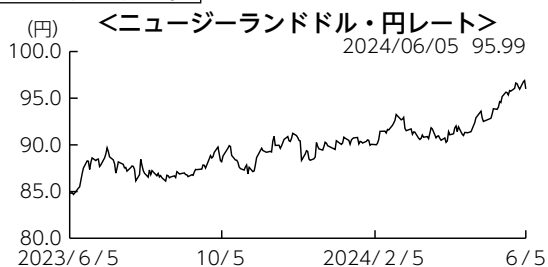
カナダ



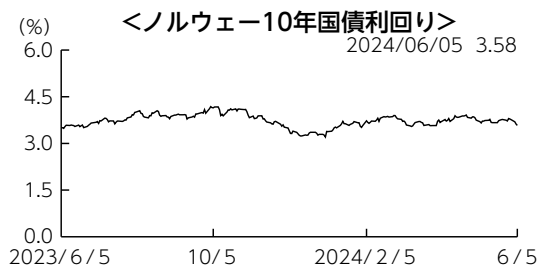
オーストラリア



ニュージーランド



ノルウェー



今後の運用方針

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）に沿った運用を維持する方針です。デフレーションについては、主要国および投資国の中央銀行がインフレの抑制に主眼を置いていることから、主要国および投資国のインフレや景気見通し、金融政策を注視し、利回り水準等を勘案しながら機動的に調整を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	2円	0.009%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.009	
期中の平均基準価額は26,538円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買及び取引の状況 (2023年6月6日から2024年6月5日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 353,162	千カナダ・ドル 286,578 (-)
		地 方 債 証 券	35,380	145,805 (-)
		特 殊 債 券	19,954	9,409 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 320,413	千オーストラリア・ドル 357,638 (-)
		地 方 債 証 券	16,548	15,945 (-)
	国	ニュージーランド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 5,306
地 方 債 証 券			6,599	7,755 (-)
特 殊 債 券			-	2,568 (-)
ノルウェー		国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 107,821	千ノルウェー・クローネ 222,670 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2023年6月6日から2024年6月5日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 349,700	千カナダ・ドル 335,673	千円 38,112,385	% 39.1	% -	% 16.8	% 9.7	% 12.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 413,000	千オーストラリア・ドル 371,052	千円 38,325,970	39.3	-	24.9	6.8	7.6
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 120,500	千ニュージーランド・ドル 100,163	千円 9,614,696	9.9	-	6.4	2.3	1.2
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 692,000	千ノルウェー・クローネ 642,544	千円 9,451,829	9.7	-	6.6	1.7	1.3
合 計	-	-	千円 95,504,882	98.0	-	54.7	20.6	22.7

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

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	47,000	44,035	4,999,738	2026/03/01
CANADA 3.75 05/01/25	国債証券	3.7500	60,000	59,605	6,767,579	2025/05/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	10,900	12,823	1,455,940	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,483	963,232	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,367	609,401	2041/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	30,000	26,477	3,006,214	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	14,000	12,322	1,399,116	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	20,000	17,989	2,042,502	2032/06/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	25,000	24,319	2,761,260	2027/09/01
CANADA 3.25 09/01/28	国債証券	3.2500	39,000	38,564	4,378,604	2028/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,203	1,385,567	2045/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	12,000	9,103	1,033,584	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	7,500	5,286	600,177	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,426	502,535	2064/12/01
CANADA 3.25 12/01/33	国債証券	3.2500	30,000	29,543	3,354,339	2033/12/01
KOMBANK 4.9 10/05/26	特殊債券	4.9000	20,000	20,292	2,304,043	2026/10/05
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	5,000	4,831	548,548	2025/12/15
小 計	-	-	349,700	335,673	38,112,385	-

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	10,000	7,647	789,934	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	26,000	25,765	2,661,270	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	10,000	10,210	1,054,615	2027/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	13,000	12,565	1,297,905	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	8,000	7,489	773,582	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	43,000	39,427	4,072,448	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	4,000	3,137	324,096	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	11,000	8,804	909,454	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	7,000	6,689	690,925	2034/05/21
AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	国債証券	4.7500	4,000	4,051	418,507	2054/06/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	5,000	4,322	446,482	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	11,000	9,473	978,468	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	12,000	6,616	683,395	2051/06/21
AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	国債証券	4.2500	15,000	15,046	1,554,152	2034/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	3,000	2,811	290,401	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	8,000	7,204	744,130	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	30,000	23,915	2,470,260	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	26,000	25,540	2,638,103	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	17,000	13,980	1,444,048	2030/12/21
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	10,000	9,308	961,482	2034/12/21
NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36	地方債証券	4.2500	14,000	12,720	1,313,891	2036/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29	地方債証券	3.0000	23,000	21,531	2,223,947	2029/04/20
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,167	533,699	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	11,000	10,803	1,115,923	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,402	351,453	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,333	1,377,171	2032/10/22
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	12,519	1,293,159	2032/11/22
TREASURY CORP VICTORIA 4.25 12/20/32	地方債証券	4.2500	9,000	8,532	881,352	2032/12/20
KOMBANK 4.35 01/18/28	特殊債券	4.3500	10,000	9,923	1,025,038	2028/01/18
KOMBANK 4.4 02/17/26	特殊債券	4.4000	10,000	9,962	1,029,027	2026/02/17
NATIONAL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,463	357,772	2036/06/30
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,684	587,134	2031/08/18
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28	特殊債券	4.5000	10,000	9,998	1,032,732	2028/09/06
小計	—	—	413,000	371,052	38,325,970	—
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	6,000	5,965	572,636	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,134	876,811	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	8,771	841,963	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	7,500	6,982	670,210	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	11,000	7,383	708,740	2051/05/15
NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	国債証券	5.0000	4,000	3,997	383,710	2054/05/15

銘	柄	当				期		末										
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日	
																		外
(ニュージーランド)				%	千	ニュージーランド・ドル	千	ニュージーランド・ドル	千	円								
NEW ZEALAND 1.75	05/15/41	国	債	証	券	1.7500	23,000	14,547	1,396,421				2041/05/15					
NEW ZEALAND 1.5	05/15/31	国	債	証	券	1.5000	4,000	3,256	312,620				2031/05/15					
NEW ZEALAND 2.0	05/15/32	国	債	証	券	2.0000	10,000	8,239	790,927				2032/05/15					
NEW ZEALAND 0.25	05/15/28	国	債	証	券	0.2500	2,000	1,686	161,903				2028/05/15					
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	2.25 05/15/28	地	方	債	証	券	2.2500	10,000	9,026	866,456			2028/05/15					
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	4.5 05/15/30	地	方	債	証	券	4.5000	7,000	6,809	653,687			2030/05/15					
HOUSING NEW ZEALAND LTD	2.183 04/24/30	特	殊	債	券	2.1830	3,000	2,568	246,527				2030/04/24					
KOMBANK 4.0	08/20/25	特	殊	債	券	4.0000	12,000	11,793	1,132,081				2025/08/20					
小	計	—	—	—	—	—	120,500	100,163	9,614,696				—					
(ノルウェー)				%	千	ノルウェー・クローネ	千	ノルウェー・クローネ	千	円								
NORWAY 1.5	02/19/26	国	債	証	券	1.5000	90,000	86,563	1,273,351				2026/02/19					
NORWAY 1.75	02/17/27	国	債	証	券	1.7500	72,000	68,547	1,008,332				2027/02/17					
NORWAY 2.0	04/26/28	国	債	証	券	2.0000	50,000	47,150	693,576				2028/04/26					
NORWAY 3.625	04/13/34	国	債	証	券	3.6250	45,000	45,112	663,604				2034/04/13					
NORWAY 2.125	05/18/32	国	債	証	券	2.1250	70,000	63,048	927,440				2032/05/18					
NORWAY 1.375	08/19/30	国	債	証	券	1.3750	85,000	74,812	1,100,494				2030/08/19					
NORWAY 3.0	08/15/33	国	債	証	券	3.0000	95,000	90,744	1,334,845				2033/08/15					
NORWAY 1.75	09/06/29	国	債	証	券	1.7500	70,000	64,054	942,244				2029/09/06					
NORWAY 1.25	09/17/31	国	債	証	券	1.2500	85,000	72,523	1,066,820				2031/09/17					
NORWAY 3.5	10/06/42	国	債	証	券	3.5000	30,000	29,987	441,119				2042/10/06					
小	計	—	—	—	—	—	692,000	642,544	9,451,829				—					
合	計	—	—	—	—	—	—	—	95,504,882				—					

■投資信託財産の構成

2024年6月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	95,504,882	96.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,693,280	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	99,198,162	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、97,018,760千円、97.8%です。

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

なお、2024年6月5日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=113.54円、1オーストラリア・ドル=103.29円、1ニュージーランド・ドル=95.99円、1ノルウェー・クローネ=14.71円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	99,198,162,890円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	914,170,760
公 社 債(評価額)	95,504,882,214
未 収 入 金	2,309,437,446
未 収 利 息	409,831,558
前 払 費 用	59,840,912
(B) 負 債	1,759,045,860
未 払 金	1,543,725,860
未 払 解 約 金	215,320,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	97,439,117,030
元 本	34,120,247,584
次 期 繰 越 損 益 金	63,318,869,446
(D) 受 益 権 総 口 数	34,120,247,584口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	28,558円

(注1) 期首元本額 38,692,608,704円

追加設定元本額 374,679,233円

一部解約元本額 4,947,040,353円

(注2) 期末における元本の内訳

DIA M高格付インカム・オープン (毎月決算コース) 30,578,746,184円

DIA M高格付インカム・オープン<DC年金> 974,608,095円

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

尾瀬紀行 400,994,172円

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

DIA M世界3資産オープン (毎月決算型) 208,090,576円

DIA M高格付インカム私募オープン (3ヵ月決算コース) (適格機関投資家向け)

843,270,700円

DIA M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)

12,442,691円

DIA M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)

114,881,651円

期末元本合計 34,120,247,584円

■損益の状況

当期 自2023年6月6日 至2024年6月5日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

《お知らせ》 約款変更お知らせ

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

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2024年5月27日）

（計算期間 2023年5月27日～2024年5月27日）

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準 価額	期騰落		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
		円	中率			
15期（2020年5月26日）	23,045	△10.1	%	%	%	百万円 30,171
16期（2021年5月26日）	31,514	36.7		96.6	—	36,299
17期（2022年5月26日）	35,715	13.3		97.5	—	35,042
18期（2023年5月26日）	39,789	11.4		98.6	—	35,489
19期（2024年5月27日）	52,023	30.7		97.7	—	41,171

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

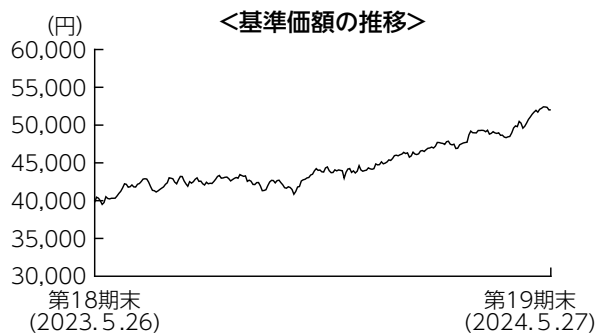
■当期中の基準価額の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年5月27日から2024年5月27日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は52,023円となり、前期末比で30.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式)	19円 (19)	0.042% (0.042)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (株 式)	9 (9)	0.019 (0.019)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	9 (9) (0)	0.019 (0.019) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	36	0.080	
期中の平均基準価額は44,723円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2023年5月27日から2024年5月27日まで)

株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2023年5月27日から2024年5月27日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細
外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	—	204.77	3,499	548,937	情報技術サービス	
AMGEN INC	—	41.34	1,264	198,337	バイオテクノロジー	
APPLE INC	258.78	149.73	2,844	446,227	コンピュータ・周辺機器	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	346.85	101.29	417	65,527	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	339.51	299.68	6,014	943,553	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	1,268	368.59	1,710	268,403	通信機器	
CUMMINS INC	42.81	—	—	—	機械	
BANK OF AMERICA CORP	516.73	449.28	1,783	279,799	銀行	
EATON CORP PLC	116.51	196.05	6,683	1,048,385	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	344.18	656.69	5,030	789,197	電力	
GILEAD SCIENCES INC	340.71	101.52	666	104,598	バイオテクノロジー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34.11	—	—	—	航空宇宙・防衛	
JOHNSON & JOHNSON	264.67	155.46	2,284	358,415	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	299.81	260.01	3,430	538,153	家庭用品	
LAM RESEARCH CORP	—	56.75	5,507	864,037	半導体・半導体製造装置	
LOCKHEED MARTIN CORP	25.69	—	—	—	航空宇宙・防衛	
MCDONALD'S CORPORATION	424.25	38.06	982	154,103	ホテル・レストラン・レジャー	
MERCK & CO.INC.	754.49	261.32	3,383	530,821	医薬品	
MICROSOFT CORP	260.46	300.79	12,938	2,029,706	ソフトウェア	
3M CO	—	283.03	2,820	442,523	コングロメリット	
PACCAR INC	457.09	—	—	—	機械	
PAYCHEX INC	524.48	—	—	—	専門サービス	
PPL CORPORATION	831.02	577.29	1,655	259,724	電力	
PEPSICO INC	155.27	143.16	2,548	399,721	飲料	
PFIZER INC	586.82	475.45	1,373	215,398	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	91.51	91.51	1,512	237,334	家庭用品	
AT&T INC	1,593.32	2,394.41	4,190	657,319	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	338.7	383.91	6,056	950,032	石油・ガス・消耗燃料	
STARBUCKS CORP	421.29	102.14	805	126,371	ホテル・レストラン・レジャー	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	346.59	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
CME GROUP INC	204.94	347.32	7,464	1,170,972	資本市場	
TRANSDIGM GROUP INC	—	24.22	3,270	513,035	航空宇宙・防衛	
MASTERCARD INC	130.31	113.39	5,115	802,535	金融サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	669.41	669.41	6,689	1,049,368	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,906	455,870	化学	
ABBVIE INC	269.58	334.65	5,256	824,510	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	99.57	93.3	13,135	2,060,510	半導体・半導体製造装置	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,652.37 32銘柄	9,969.43 31銘柄	123,244 —	19,333,438 <47.0%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	717.64	445.77	5,113	586,816	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	374.96	573.6	3,808	437,021	銀行	
RUSSEL METALS INC	1,056.82	1,406.01	5,469	627,665	商社・流通業	
CAPITAL POWER CORP	842.72	842.72	3,201	367,403	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,992.14 4銘柄	3,268.1 4銘柄	17,592 —	2,018,907 <4.9%>	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア) BHP GROUP LTD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	百株 743.7 134.38	百株 743.7 134.38	千オーストラリア・ドル 3,319 375	千円 345,067 39,011	金属・鉱業 石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	878.08 2銘柄	878.08 2銘柄	3,695 -	384,079 <0.9%>
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD NEW WORLD DEVELOPMENT CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	百株 7,280 7,700 - -	百株 12,690 - 28,140 2,656	千香港・ドル 31,788 - 27,605 20,331	千円 638,312 - 554,315 408,260	銀行 不動産管理・開発 建設・土木 繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14,980 2銘柄	43,486 3銘柄	79,725 -	1,600,887 <3.9%>
(シンガポール) UNITED OVERSEAS BANK LTD	百株 1,307	百株 1,307	千シンガポール・ドル 3,992	千円 464,132	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,992 -	464,132 <1.1%>
(イギリス) NATIONAL GRID PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC IMPERIAL BRANDS PLC UNILEVER PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC RIO TINTO PLC SSE PLC BP PLC 3I GROUP PLC GSK PLC ASTRAZENECA PLC NATIONAL GRID PLC-RTS	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 287.09 2,153.01 453.25 1,437.68 5,964.93 572.23 2,235.93 311.37 -	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 264.5 2,153.01 453.25 - 5,964.93 939.85 2,235.93 - 800.57	千イギリス・ポンド 2,441 1,071 2,237 1,136 2,169 2,563 - 2,881 2,772 3,967 - 160	千円 487,859 214,211 447,214 227,076 433,484 512,215 - 575,751 554,067 792,896 - 31,997	総合公益事業 タバコ タバコ パーソナルケア用品 水道 金属・鉱業 電力 石油・ガス・消耗燃料 資本市場 医薬品 医薬品 総合公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	17,764.74 11銘柄	17,161.29 10銘柄	21,400 -	4,276,775 <10.4%>
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 86.78 607.3	百株 51.98 624.38	千スイス・フラン 1,197 5,728	千円 205,391 982,362	医薬品 医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	694.08 2銘柄	676.36 2銘柄	6,925 -	1,187,754 <2.9%>
(デンマーク) NOVO NORDISK A/S-B	百株 -	百株 348.52	千デンマーク・クローネ 32,370	千円 738,371	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	- 1銘柄	348.52 1銘柄	32,370 -	738,371 <1.8%>
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 2,133.28	百株 2,475.68	千スウェーデン・クローナ 25,016	千円 367,746	無線通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,133.28 1銘柄	2,475.68 1銘柄	25,016 -	367,746 <0.9%>
(ユーロ…オランダ) FERROVIAL SE	百株 -	百株 1,029	千ユーロ 3,737	千円 635,981	建設・土木
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	- 1銘柄	1,029 1銘柄	3,737 -	635,981 <1.5%>
(ユーロ…フランス) AXA SA	百株 1,240.33	百株 1,692.38	千ユーロ 5,686	千円 967,654	保険

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

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

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

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

■投資信託財産の構成

2024年5月27日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	40,237,946千円	97.7%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	933,446	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	41,171,392	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、40,528,816千円、98.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年5月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=156.87円、1カナダ・ドル=114.76円、1オーストラリア・ドル=103.94円、1香港・ドル=20.08円、1シンガポール・ドル=116.24円、1台湾・ドル=4.861円、1イギリス・ポンド=199.84円、1スイス・フラン=171.50円、1デンマーク・クローネ=22.81円、1ノルウェー・クローネ=14.81円、1スウェーデン・クローナ=14.70円、1ユーロ=170.17円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年5月27日)現在

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

(注1) 期首元本額 8,919,453,450円
追加設定元本額 2,960,307円
一部解約元本額 1,008,391,462円

(注2) 期末における元本の内訳
D I AM世界好配当株オープン (毎月決算コース) 2,838,467,144円
D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) 4,763,927,611円
D I AM世界好配当株式ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) 23,318,644円
D I AM世界インカム・オープン (毎月決算コース) 173,421,335円
D I AM世界3資産オープン (毎月決算型) 114,887,561円
期末元本合計 7,914,022,295円

■損益の状況

当期 自2023年5月27日 至2024年5月27日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含まず。

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

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

DIAM US・リート・オープン・マザーファンド

運用報告書

第20期 (決算日 2023年12月11日)

(計算期間 2022年12月10日～2023年12月11日)

DIAM US・リート・オープン・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2004年4月23日から無期限です。
運用方針	信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主要投資対象	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		投資 組入 証 比	券 率	純 総 資 産 額
		期 中 騰 落 率	額			
16期 (2019年12月9日)	円		%	%		百万円
	38,048		12.4	97.0		29,121
17期 (2020年12月9日)	33,190	△12.8		96.5		23,446
18期 (2021年12月9日)	49,994	50.6		97.3		27,980
19期 (2022年12月9日)	46,794	△6.4		94.5		22,587
20期 (2023年12月11日)	50,574	8.1		97.7		22,409

(注1) 当ファンドの信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得するというコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

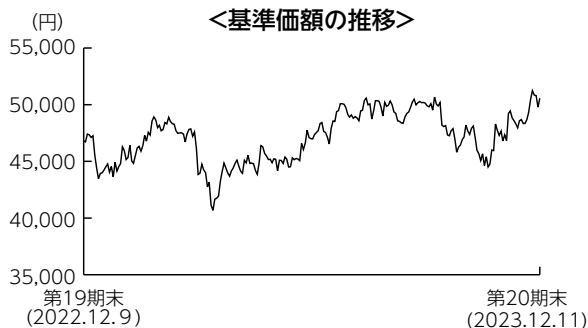
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2022年12月10日から2023年12月11日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は50,574円となり、前期末比で8.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

適正価格に到達したと見られる銘柄については、適宜入れ替えを行いました。また、米国景気の先行きや金利の動向も注視しつつ、保守的な財務体質かつ長期的に見て成長見込みがある銘柄や、割安な水準にある銘柄を選別して投資しました。オフィスやヘルスケアなどの組入比率を引き上げる一方、その他や工業などの組入比率を引き下げました。

今後の運用方針

米国では、インフレの鈍化などを受けて2024年の利下げ期待が高まっています。一方で、オフィスなど厳しいファンダメンタルズが続くと予想されるセクターもあります。引き続き財務体質が良好で、長期的な成長が期待できる銘柄を選別して投資する方針です。また、割安な水準にある銘柄にも投資することにより、比較的高い配当利回りを維持できるポートフォリオを構築していきます。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (投資証券)	15円 (15)	0.031% (0.031)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) その他費用 (保管費用) (その他)	5 (5) (0)	0.011 (0.011) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	20	0.042	
期中の平均基準価額は47,083円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2022年12月10日から2023年12月11日まで)

投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21.02 (-)	2,412 (-)	- (-)	- (-)
BOSTON PROPERTIES INC	47.94 (-)	2,734 (-)	- (-)	- (-)
SL GREEN	38.51 (-)	1,570 (-)	- (-)	- (-)
PROLOGIS INC	5.56 (-)	692 (-)	17.75 (-)	2,126 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4.62 (-)	777 (-)	6.47 (-)	1,186 (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	5.28 (-)	491 (-)	11.73 (-)	1,097 (-)
EQUINIX INC	- (-)	- (-)	3.42 (-)	2,364 (-)
COUSINS PROPERTIES INC	171.13 (-)	4,077 (-)	- (-)	- (-)
CROWN CASTLE INC	6.26 (-)	653 (-)	24.47 (-)	2,809 (-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.1 (-)	1,124 (-)	5.08 (-)	1,185 (-)
EQUITY RESIDENTIAL	3.37 (-)	208 (-)	- (-)	- (-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10.04 (-)	959 (-)	7.75 (-)	848 (-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.15 (-)	2,586 (-)	44.56 (-)	691 (-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7.77 (-)	175 (-)	- (-)	- (-)
WELLTOWER INC	17.58 (-)	1,239 (-)	32.5 (-)	2,742 (-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	- (-)	- (-)	187.46 (-)	3,135 (-)
REGENCY CENTERS CORP	56.12 (-)	3,424 (-)	- (-)	- (-)
UDR INC	31.92 (-)	1,297 (-)	21.51 (-)	687 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.66	403	9.33	1,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	-	-	-	-
	(△19.95)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	1.56	452	4.34	1,236
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	8.09	1,076	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	21.97	1,011	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	-	-	20.86	3,285
	(17.855)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	19.62	193	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	-	-	9.67	418
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.46	239	4.07	414
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	24.67	314	134.9	1,752
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	29.34	387	29.42	376
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	9.99	606	13.9	802
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	-	-	40.2	1,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	107.35	884	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	8.32	1,520	12.53	2,420
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	17.89	883	47.04	2,443
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	5.9	195	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	-	-	17.85	1,661
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	67.13	1,435	18.76	435
	(-)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	-	-	111.16	1,740
	(-)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	-	-	45.89	1,469
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	100.07	3,313	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等（2022年12月10日から2023年12月11日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44.064	65.084	7,773	1,130,286		5.0
BOSTON PROPERTIES INC	22.93	70.87	4,541	660,312		2.9
SL GREEN	—	38.51	1,636	237,916		1.1
PROLOGIS INC	99.927	87.737	10,515	1,528,921		6.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC	35.88	34.03	5,980	869,604		3.9
CAMDEN PROPERTY TRUST	23.47	17.02	1,593	231,756		1.0
EQUINIX INC	11.33	7.91	6,342	922,126		4.1
COUSINS PROPERTIES INC	147.515	318.645	7,156	1,040,593		4.6
CROWN CASTLE INC	37.34	19.13	2,220	322,848		1.4
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24.431	24.451	5,528	803,860		3.6
EQUITY RESIDENTIAL	60.545	63.915	3,759	546,628		2.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	28.06	30.35	3,008	437,405		2.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	69.426	145.016	2,719	395,349		1.8
HIGHWOODS PROPERTIES INC	71.07	78.84	1,696	246,690		1.1
WELLTOWER INC	72.13	57.21	5,018	729,684		3.3
HOST HOTELS & RESORTS INC	187.46	—	—	—		—
REGENCY CENTERS CORP	—	56.12	3,589	521,903		2.3
UDR INC	85.34	95.75	3,386	492,422		2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	53.93	48.26	6,412	932,419		4.2
LIFE STORAGE INC	19.95	—	—	—		—
PUBLIC STORAGE	28.04	25.26	6,916	1,005,650		4.5
SUN COMMUNITIES INC	14.96	23.05	2,942	427,781		1.9
VENTAS INC	101.98	123.95	5,790	842,003		3.8
EXTRA SPACE STORAGE INC	20.86	17.855	2,476	360,029		1.6
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	352.74	372.36	3,779	549,532		2.5
CUBESMART	40.7	31.03	1,308	190,306		0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	48.32	46.71	6,296	915,580		4.1
DOUGLAS EMMETT INC	225.53	115.3	1,649	239,901		1.1
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	268.2	268.12	3,598	523,173		2.3
TERRENO REALTY CORP	97.883	93.973	5,535	804,927		3.6
AMERICOLD REALTY TRUST	40.2	—	—	—		—
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	197.813	305.163	2,322	337,661		1.5
AMERICAN TOWER CORP	30.96	26.75	5,522	802,976		3.6
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	100.13	70.98	3,720	541,000		2.4
AMERICAN HOMES 4 RENT	106.05	111.95	3,927	571,015		2.5
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	17.85	—	—	—		—

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

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

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

■投資信託財産の構成

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	21,899,770	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	509,913	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	22,409,684	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、21,979,626千円、98.1%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年12月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=145.40円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月11日)現在

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

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

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

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド 運用報告書

第20期 (決算日 2023年12月11日)

(計算期間 2022年12月10日～2023年12月11日)

DIAM インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2004年4月23日から無期限です。
運用方針	信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得することを目標として運用を行います。
主要投資対象	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		投資信託受益証券、 投資証券組入比率	純資産額
		期中騰落率			
16期 (2019年12月9日)	円		%	%	百万円
16期 (2019年12月9日)	28,681	14.6		96.0	45,328
17期 (2020年12月9日)	26,456	△7.8		96.0	36,364
18期 (2021年12月9日)	34,547	30.6		96.3	41,464
19期 (2022年12月9日)	32,197	△6.8		95.8	35,157
20期 (2023年12月11日)	35,186	9.3		95.8	34,367

(注1) 当ファンドの信託財産の着実な成長と比較的高い配当利回りを安定的に獲得するというコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークを特定しません。

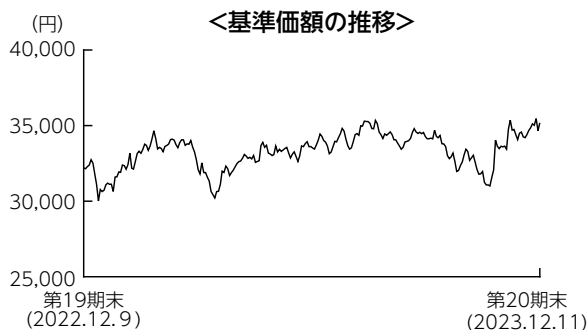
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		投資信託受益証券、 投資証券組入比率
		騰	落	
(期 首) 2022 年 12 月 9 日	円 32,197	% -		% 95.8
12 月 末	31,123	△3.3		95.0
2023 年 1 月 末	33,689	4.6		94.9
2 月 末	34,059	5.8		94.5
3 月 末	31,985	△0.7		95.6
4 月 末	32,676	1.5		95.8
5 月 末	32,950	2.3		95.4
6 月 末	33,923	5.4		95.7
7 月 末	34,789	8.1		95.6
8 月 末	34,800	8.1		93.7
9 月 末	32,930	2.3		93.7
10 月 末	31,004	△3.7		95.1
11 月 末	34,389	6.8		96.0
(期 末) 2023 年 12 月 11 日	35,186	9.3		95.8

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2022年12月10日から2023年12月11日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は35,186円となり、前期末比で9.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

ました。保有銘柄では、カナディアン・アパートメント・プロパティーズ（カナダ・居住施設）や、ウェアハウス・ド・ポウ（ベルギー・工業）などが主にプラスに影響しました。

投資環境

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

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

ポートフォリオについて

保守的な財務体質かつ配当成長の見込めるキャッシュフローの安定した銘柄を選別して投資を行いました。また、適正価格に到達した銘柄は適宜入れ替えを行いました。地域別では、英国やベルギーなどの組入比率を引き上げた一方、香港やカナダなどの組入比率を引き下げました。また、用途別では、住居施設やその他などの組入比率を引き上げた一方、工業やオフィスなどの組入比率を引き下げました。

今後の運用方針

利上げへの警戒感が後退したことなどを受けて足元のリート市場は上昇傾向にありますが、オフィスなどでは厳しいファンダメンタルズが予想されます。欧州リート市場では、安定したキャッシュフローが期待できる銘柄を中心に投資を行う方針です。オーストラリアリート市場は、工業や小売り等のうち財務体質や成長性、配当利回りといった点に優れる銘柄を選別し投資する方針です。アジアリート市場は、優れた収益成長見通しと健全な財務体質を有する銘柄に厳選して投資を行う方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券)	5円 (4) (1)	0.016% (0.012) (0.004)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券)	5 (1) (4)	0.015 (0.002) (0.013)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	10 (7) (4)	0.031 (0.020) (0.011)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	21	0.062	
期中の平均基準価額は33,295円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2022年12月10日から2023年12月11日まで)

投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	8,967.8 (-)	4,770 (△195)	- (-)	- (-)
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
ALLIED PROPERTIES REIT	- (-)	- (-)	271.4 (-)	4,810 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	- (-)	- (-)	97 (-)	1,461 (-)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	1,301.784 (-)	5,689 (-)	- (-)	- (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,199.852 (-)	8,726 (-)	- (-)	- (-)
GOODMAN GROUP	- (-)	- (-)	194.468 (-)	3,858 (-)
VICINITY CENTRES	- (-)	- (-)	2,945.062 (-)	5,892 (-)
CHARTER HALL GROUP	- (-)	- (-)	291.519 (-)	4,142 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	- (-)	- (-)	3,060.217 (-)	9,709 (-)
REGION RE LTD	3,121.977 (-)	8,042 (-)	- (-)	- (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	-	-	420.2	22,925
	(-)	(-)	(-)	(-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPLAND ASCENDAS REIT	-	-	460.6	1,302
	(-)	(△33)	(-)	(-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	-	4,282.242	7,077
	(-)	(△123)	(-)	(-)
PARKWAY LIFE REIT	-	-	-	-
	(-)	(△89)	(-)	(-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	-	-	1,674.54	3,708
	(-)	(△1)	(-)	(-)
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
GOODMAN PROPERTY TRUST	-	-	901.08	1,907
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	-	-	535.607	3,918
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	3,425.318	3,975	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	4.206	425	15.124	1,494
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	-	-	44.96	1,735
	(-)	(△96)	(-)	(-)
KLEPIERRE	-	-	-	-
	(-)	(△241)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	-	-	-	-
	(-)	(△9)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、合併、分割等による増減分で、上段の数値には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等（2022年12月10日から2023年12月11日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

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

■投資信託財産の構成

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券及び投資証券	32,920,349	95.8
コール・ローン等、その他	1,447,621	4.2
投資信託財産総額	34,367,970	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、33,299,038千円、96.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年12月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=145.40円、1カナダ・ドル=107.02円、1オーストラリア・ドル=95.59円、1香港・ドル=18.62円、1シンガポール・ドル=108.39円、1ニュージーランド・ドル=89.03円、1イギリス・ポンド=182.49円、1ユーロ=156.58円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月11日)現在

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

(注1) 期首元本額 10,919,663,091円

追加設定元本額 1,092,440円

一部解約元本額 1,153,283,915円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM ワールド・リート・インカム・オープン (毎月決算コース) 9,056,447,407円

DIAM世界インカム・オープン (毎月決算コース) 148,947,485円

DIAM ワールドREITアクティブファンド (毎月決算型) 226,501,969円

DIAM世界3資産オープン (毎月決算型) 98,557,594円

DIAM ワールドREITアクティブファンド<DC年金> 237,017,161円

期末元本合計 9,767,471,616円

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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