

運用報告書 (全体版)

D I A M世界インカム・オープン(毎月決算コース)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／資産複合	
信託期間	2005年9月29日から無期限です。	
運用方針	安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。	
主要投資対象	D I A M世界インカム・オープン(毎月決算コース)	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド	高格付資源国の公社債を主要投資対象とします。
	D I A M世界対応株オープン・マザーファンド	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
	D I A M U S ・リート・オープン・マザーファンド	米国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
	D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	米国および日本を除く世界各国の証券取引所に上場もしくは上場に準ずる不動産投信等の投資信託証券を主要投資対象とします。
運用方法	各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に外国債券、外国不動産投資信託証券および外国株式に投資を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。中長期的なリスク水準等を勘案し、各マザーファンド受益証券への基本配分を決定し、投資を行います。各マザーファンド受益証券の時価の変動等により、時価構成比が変化した場合には、定期的に基本配分に修正します。実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
配分方針	決算日（原則として毎月26日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等のうち、原則として利子・配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年6月および12月の決算時には、原則として利子・配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。	

愛称：世界三重奏

第206期	<決算日	2023年1月26日>
第207期	<決算日	2023年2月27日>
第208期	<決算日	2023年3月27日>
第209期	<決算日	2023年4月26日>
第210期	<決算日	2023年5月26日>
第211期	<決算日	2023年6月26日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「D I A M世界インカム・オープン（毎月決算コース）」は、2023年6月26日に第211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

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

DIAM世界インカム・オープン（毎月決算コース）

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	投資信託・債券・証券投資組入率	純資産額
		(分配落)	税金込み	期中騰落率						
第32作成期	182期(2021年1月26日)	円 8,466	円 20	% 1.5	% 24.3	% -	% 48.2	% -	% 24.0	百万円 3,735
	183期(2021年2月26日)	8,608	20	1.9	24.5	-	47.5	-	24.3	3,745
	184期(2021年3月26日)	8,856	20	3.1	25.1	-	47.8	-	23.6	3,818
	185期(2021年4月26日)	9,034	20	2.2	25.0	-	47.5	-	23.6	3,854
	186期(2021年5月26日)	9,277	20	2.9	25.1	-	47.3	-	24.1	3,947
第33作成期	187期(2021年6月28日)	9,401	20	1.6	25.0	-	47.0	-	24.3	3,958
	188期(2021年7月26日)	9,303	20	△0.8	24.7	-	47.2	-	24.7	3,900
	189期(2021年8月26日)	9,290	20	0.1	24.6	-	47.1	-	24.1	3,872
	190期(2021年9月27日)	9,223	20	△0.5	24.5	-	48.0	-	24.6	3,805
	191期(2021年10月26日)	9,606	20	4.4	24.7	-	48.4	-	24.0	3,902
第34作成期	192期(2021年11月26日)	9,504	20	△0.9	24.8	-	47.6	-	24.3	3,838
	193期(2021年12月27日)	9,551	20	0.7	24.4	-	48.3	-	24.1	3,831
	194期(2022年1月26日)	9,239	20	△3.1	24.4	-	49.2	-	23.1	3,686
	195期(2022年2月28日)	9,257	20	0.4	24.5	-	49.2	-	23.1	3,683
	196期(2022年3月28日)	9,845	20	6.6	24.5	-	48.6	-	23.6	3,893
第35作成期	197期(2022年4月26日)	9,890	20	0.7	24.8	-	48.2	-	23.3	3,858
	198期(2022年5月26日)	9,523	20	△3.5	25.6	-	48.4	-	21.8	3,701
	199期(2022年6月27日)	9,499	20	△0.0	25.4	-	49.6	-	21.9	3,663
	200期(2022年7月26日)	9,752	20	2.9	24.7	-	50.1	-	22.0	3,766
	201期(2022年8月26日)	9,716	20	△0.2	25.3	-	48.4	-	22.2	3,734
第36作成期	202期(2022年9月26日)	9,237	20	△4.7	24.4	-	50.1	-	21.2	3,520
	203期(2022年10月26日)	9,488	20	2.9	25.8	-	48.8	-	21.1	3,607
	204期(2022年11月28日)	9,616	20	1.6	25.8	-	48.3	-	21.4	3,638
	205期(2022年12月26日)	8,978	20	△6.4	25.4	-	49.0	-	21.4	3,379
	206期(2023年1月26日)	9,245	20	3.2	25.0	-	49.3	-	21.8	3,479
第36作成期	207期(2023年2月27日)	9,308	20	0.9	24.5	-	49.1	-	22.1	3,485
	208期(2023年3月27日)	8,857	20	△4.6	24.0	-	51.1	-	20.6	3,306
	209期(2023年4月26日)	9,236	20	4.5	25.2	-	49.2	-	21.7	3,439
	210期(2023年5月26日)	9,285	20	0.7	24.7	-	49.5	-	21.6	3,443
	211期(2023年6月26日)	9,638	20	4.0	25.2	-	49.6	-	21.4	3,556

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドは、外国債券、外国不動産投資信託証券（リート）、外国株式に投資を行い、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目標として運用を行います。

上記資産を組み合わせた適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注6) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率 比
		円	騰 落 率					
第206期	(期 首) 2022年12月26日	8,978	—	25.4	—	49.0	—	21.4
	12月 末	9,033	0.6	25.4	—	48.9	—	21.4
	(期 末) 2023年1月26日	9,265	3.2	25.0	—	49.3	—	21.8
第207期	(期 首) 2023年1月26日	9,245	—	25.0	—	49.3	—	21.8
	1月 末	9,299	0.6	24.5	—	49.2	—	21.8
	(期 末) 2023年2月27日	9,328	0.9	24.5	—	49.1	—	22.1
第208期	(期 首) 2023年2月27日	9,308	—	24.5	—	49.1	—	22.1
	2月 末	9,341	0.4	24.6	—	48.9	—	22.0
	(期 末) 2023年3月27日	8,877	△4.6	24.0	—	51.1	—	20.6
第209期	(期 首) 2023年3月27日	8,857	—	24.0	—	51.1	—	20.6
	3月 末	9,205	3.9	24.4	—	50.3	—	21.0
	(期 末) 2023年4月26日	9,256	4.5	25.2	—	49.2	—	21.7
第210期	(期 首) 2023年4月26日	9,236	—	25.2	—	49.2	—	21.7
	4月 末	9,270	0.4	25.2	—	48.9	—	21.7
	(期 末) 2023年5月26日	9,305	0.7	24.7	—	49.5	—	21.6
第211期	(期 首) 2023年5月26日	9,285	—	24.7	—	49.5	—	21.6
	5月 末	9,333	0.5	24.7	—	49.6	—	21.7
	(期 末) 2023年6月26日	9,658	4.0	25.2	—	49.6	—	21.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

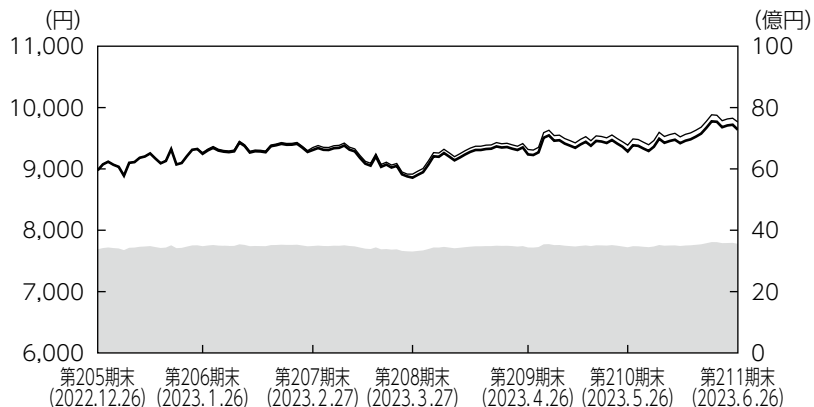
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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206期～第211期の運用経過（2022年12月27日から2023年6月26日まで）

基準価額等の推移



第206期首： 8,978円
 第211期末： 9,638円
 （既払分配金120円）
 騰落率： 8.8%
 （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

主要国の金融引き締めから主要国の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、金利上昇を嫌気したことや景気後退懸念等から欧州等のリート市場が下落したことがマイナスに寄与しました。一方、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から主要通貨に対して円安となったこと、概ね堅調となった企業決算等を背景に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	8.7%
DIAM世界好配当株オープン・マザーファンド	14.2%
DIAM US・リート・オープン・マザーファンド	5.2%
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	7.9%

投資環境

外国債券市場では、全ての投資国の10年国債利回りが上昇しました。多くの投資国では累積的な利上げによる影響を見極めるため政策金利が据え置かれたことで利回りが低下（債券価格は上昇）する場面があったものの、その後に投資国でのインフレ再加速が見られたことや堅調な経済指標の発表等を背景に、中央銀行が再利上げに踏み切り、市場が織り込む政策金利到達水準も切り上がったこと等から利回りが上昇に転じました。

外国株式市場は上昇しました。2023年3月には米地銀の破綻等を受けて下落する局面も見られましたが、堅調な企業決算や中国のゼロコロナ政策解除を受けた景気回復期待、米欧におけるインフレ鈍化を背景とした利上げ停止期待の高まり等を受け、概ね上昇基調で推移しました。

米国リート市場はほぼ横ばいとなりました。作成期初はF R B（米連邦準備理事会）による利上げの減速期待等から上昇しましたが、堅調な経済指標やF R Bのタカ派姿勢等から上げ幅を縮小し、米国地銀の破綻等を受けて下落に転じました。その後は金融システムへの懸念が後退したことから反発する局面もありましたが、F R Bが利上げ姿勢を維持したこと等から下落して作成期末を迎えました。セクター別では、オフィスが下落した一方で住居施設等は堅調に推移しました。

米国以外のリート市場については、多くの市場が下落しました。欧州リート市場は、ユーロ圏の景気後退懸念や欧州不動産会社の債務問題懸念等から下落しました。アジアリート市場では、中国景気への懸念等から香港の下落が目立ちました。オーストラリアリート市場は、R B A（オーストラリア準備銀行）が一時金利引き上げを見送る等したこともあり小幅な下落に留まりました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。ドル／円相場は、内外金利差が拡大したことや、2023年4月末に日銀が金融政策の現状維持を決定したことで金融正常化観測が後退し、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ドル高となりました。その他主要通貨においても、内外金利差の拡大や金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に概ね円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

当ファンドでは、外国債券（D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド）50%、外国株式（D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド）25%、外国リート（D I A M US・リート・オープン・マザーファンド、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド）25%を基本資産配分比率とし、各資産の組入比率が概ね基本資産配分比率に維持されるように資産配分を行いました。

●D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド

基本国別投資比率（カナダ40%、オーストラリア40%、ニュージーランド10%、ノルウェー10%）を概ね維持しました。デュレーション*については、投資国および世界経済見通し、主要国および投資国のインフレ動向や金融政策を勘案して、調整を行いました。当作成期末のデュレーションは、投資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、前作成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。

●D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド

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

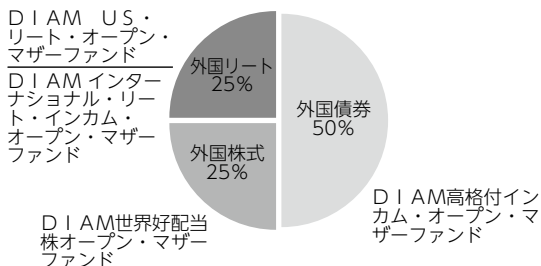
●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

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

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

保守的な財務体質かつ配当成長の見込めるキャッシュフローの安定した銘柄を選別して投資を行いました。また、適正価格に到達した銘柄は適宜入れ替えを行いました。国・地域別では、カナダやシンガポールなどの組入比率を引き上げた一方、オーストラリアや香港などの組入比率を引き下げました。また、セクター別では、その他や住居施設などの組入比率を引き上げた一方、混合型などの組入比率を引き下げました。

当ファンドの基本資産配分比率



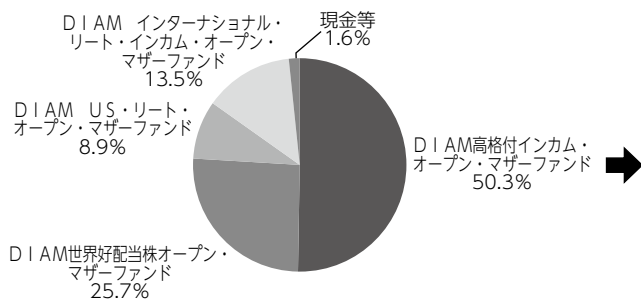
※基本資産配分比率は、市場動向等により変更する場合があります。

※上記外国債券、外国株式、外国リートは、各マザーファンドの主要投資対象を示します。

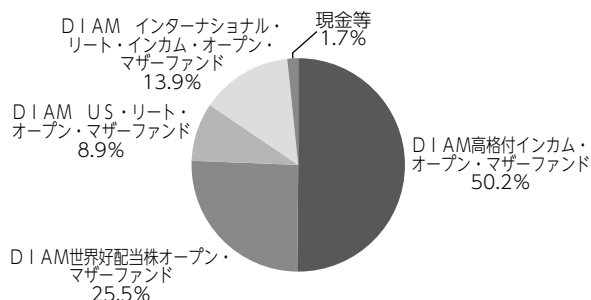
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

前作成期末



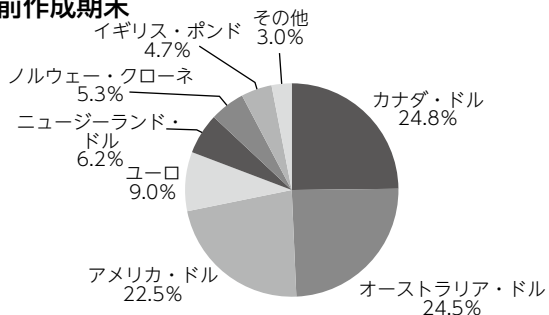
当作成期末



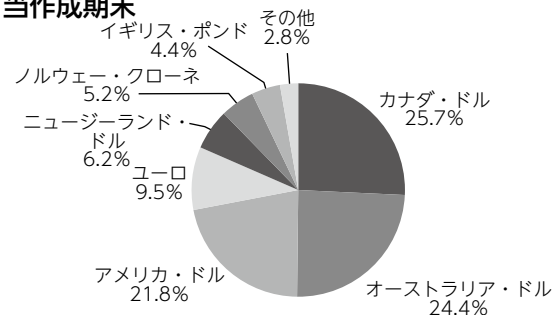
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



(注1) 比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券の時価総額に対する割合です。

(注2) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第206期	第207期	第208期	第209期	第210期	第211期
	2022年12月27日 ~2023年1月26日	2023年1月27日 ~2023年2月27日	2023年2月28日 ~2023年3月27日	2023年3月28日 ~2023年4月26日	2023年4月27日 ~2023年5月26日	2023年5月27日 ~2023年6月26日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.22%	0.21%	0.23%	0.22%	0.21%	0.21%
当期の収益	20円	19円	20円	20円	20円	20円
当期の収益以外	-円	0円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	529円	529円	530円	532円	538円	541円

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

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

各マザーファンドを基本資産配分比率に従い配分します。また、時価の変動などにより時価構成比が変化した場合には、定期的に基本資産配分比率に修正します。マザーファンドの組入比率についても高位組入れを維持します。

●D I A M 高格付インカム・オープン・マザーファンド

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

●D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド

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

●D I A M US・リート・オープン・マザーファンド

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

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

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、リート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	第206期～第211期		項目の概要
	(2022年12月27日 ～2023年6月26日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	61円	0.655%	(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9,301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)	(33)	(0.349)	
(販売会社)	(25)	(0.273)	
(受託会社)	(3)	(0.032)	
(b) 売買委託手数料	0	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.010	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.007)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.002)	
合計	62	0.669	

(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。

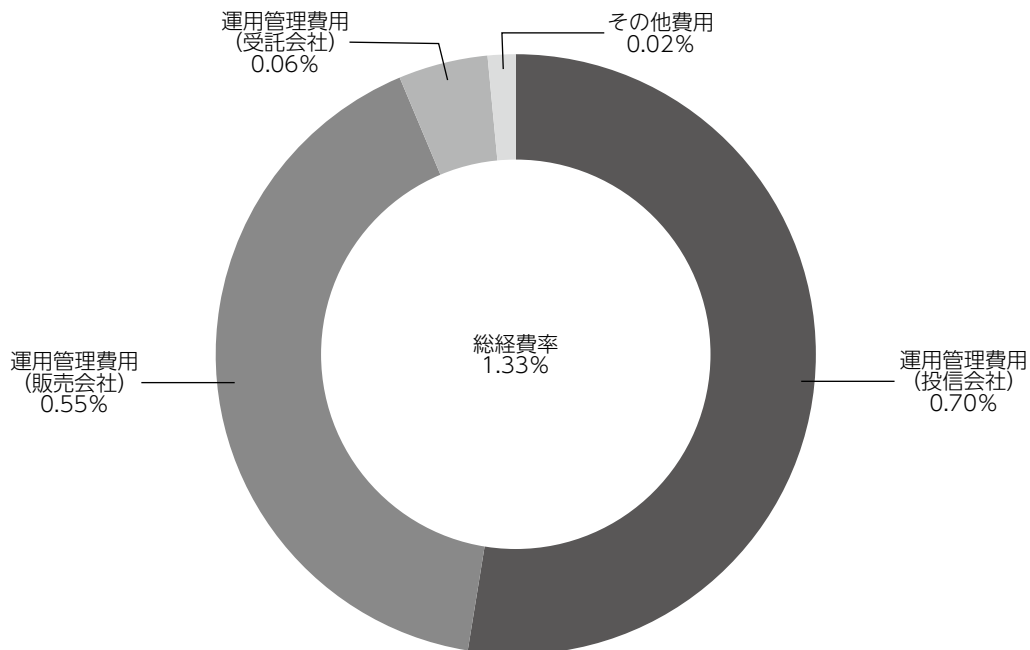
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2022年12月27日から2023年6月26日まで）

	第 206 期 ~ 第 211 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	—	—	23,823	60,000
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	—	—	20,604	80,000
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 206 期 ~ 第 211 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	10,690,243千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	34,430,598千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.31

(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12月27日から2023年6月26日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	第 35 作 成 期 末	第 36 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	710,473	686,649	1,783,778
D I A M 世 界 好 配 当 株 オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	237,151	216,547	905,624
D I A M U S ・ リ ー ト ・ オ ー プ ン ・ マ ザ ー フ ァ ン ド	67,712	67,712	315,099
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	148,947	148,947	493,552

<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 (38,440,497,392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 6 月 26 日 現 在							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 402,200	千カナダ・ドル 365,497	千円 39,820,952	% 39.9	% -	% 30.7	% 9.2	% -
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 464,000	千オーストラリア・ドル 406,879	千円 38,966,823	39.0	-	35.7	3.4	-
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 134,500	千ニュージーランド・ドル 112,879	千円 9,969,508	10.0	-	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 748,376	千円 9,938,436	10.0	-	5.0	3.5	1.4
合 計	-	-	千円 98,695,721	98.8	-	78.0	18.8	2.1

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月26日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、2023年6月26日現在のマザーファンド純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

外国 (外貨建) 公社債銘柄別

銘 柄	2023 年 6 月 26 日 現 在					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	25,000	22,486	2,449,938	2026/03/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	20,900	25,034	2,727,533	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	7,300	8,628	940,022	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	5,000	5,435	592,202	2041/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	32,000	27,676	3,015,369	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	22,000	19,079	2,078,665	2031/06/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	15,000	13,758	1,499,015	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	45,000	43,123	4,698,286	2027/09/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	12,000	12,383	1,349,141	2045/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	37,000	28,608	3,116,858	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	14,000	10,067	1,096,818	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	5,000	4,451	485,034	2064/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	35,000	30,142	3,284,079	2031/12/01
BRITISH COLUMBIA PROVINCE 3.2 06/18/32	地方債証券	3.2000	10,000	9,344	1,018,087	2032/06/18
PROVINCE OF QUEBEC 2.75 09/01/28	地方債証券	2.7500	50,000	46,867	5,106,196	2028/09/01
PROVINCE OF QUEBEC 1.9 09/01/30	地方債証券	1.9000	30,000	26,014	2,834,269	2030/09/01

銘 柄	2023 年 6 月 26 日 現 在					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
PROVINCE OF QUEBEC 3.25 09/01/32	地方債証券	3.2500	12,000	11,244	1,225,054	2032/09/01
PROVINCE OF QUEBEC 1.5 09/01/31	地方債証券	1.5000	20,000	16,456	1,792,980	2031/09/01
CANHOU 1.95 12/15/25	特殊債券	1.9500	5,000	4,693	511,397	2025/12/15
小 計	—	—	402,200	365,497	39,820,952	—
(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	10,572	1,012,516	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	13,000	12,533	1,200,366	2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	18,000	17,304	1,657,261	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	5,000	4,639	444,348	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	23,000	20,990	2,010,249	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	24,000	19,541	1,871,492	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	11,000	8,764	839,368	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	39,000	38,116	3,650,384	2034/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	10,000	8,900	852,401	2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	11,000	9,652	924,460	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	17,000	10,177	974,737	2051/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	3,000	2,805	268,706	2029/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	58,000	53,111	5,086,476	2033/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	50,000	39,447	3,777,900	2031/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	17,000	13,759	1,317,753	2030/12/21
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	10,000	9,519	911,645	2034/12/21
NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36	地方債証券	4.2500	14,000	13,131	1,257,600	2036/02/20
NEW S WALES TREASURY CRP 3.0 04/20/29	地方債証券	3.0000	23,000	21,421	2,051,552	2029/04/20
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH 1.75 05/24/32	地方債証券	1.7500	6,500	5,161	494,327	2032/05/24
PROVINCE OF QUEBEC 3.7 05/20/26	地方債証券	3.7000	11,000	10,659	1,020,829	2026/05/20
AUST CAPITAL TERRITORY 1.75 05/17/30	地方債証券	1.7500	4,000	3,367	322,462	2030/05/17
AUST CAPITAL TERRITORY 2.5 10/22/32	地方債証券	2.5000	16,000	13,462	1,289,324	2032/10/22
TREASURY CORP VICTORIA 2.25 11/20/34	地方債証券	2.2500	11,000	8,472	811,389	2034/11/20
NEW S WALES TREASURY CRP 2.5 11/22/32	地方債証券	2.5000	15,000	12,580	1,204,854	2032/11/22
KOMBNK 4.35 01/18/28	特殊債券	4.3500	10,000	9,855	943,841	2028/01/18
KOMBNK 4.4 02/17/26	特殊債券	4.4000	10,000	9,919	949,974	2026/02/17
NATIONAL HOUSING FIN INVT 2.335 06/30/36	特殊債券	2.3350	4,500	3,497	334,957	2036/06/30
EXPORT FIN & INS CORP 1.465 08/18/31	特殊債券	1.4650	7,000	5,550	531,577	2031/08/18
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.5 09/06/28	特殊債券	4.5000	10,000	9,962	954,062	2028/09/06
小 計	—	—	464,000	406,879	38,966,823	—
(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	7,965	703,552	2027/04/15
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	10,000	9,179	810,728	2033/04/14
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	11,000	8,889	785,142	2037/04/15
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	8,500	7,845	692,932	2029/04/20
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	11,000	7,799	688,833	2051/05/15
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	21,000	13,520	1,194,088	2041/05/15
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	10,000	7,982	704,970	2031/05/15
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	10,000	8,162	720,881	2032/05/15

銘 柄	2023 年 6 月 26 日 現 在					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,629	143,888	2028/05/15
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国 債 証 券	0.5000	1,000	887	78,359	2026/05/15
NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	国 債 証 券	4.5000	6,000	5,992	529,228	2030/05/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.75 04/15/25	地 方 債 証 券	2.7500	8,000	7,617	672,780	2025/04/15
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 2.25 05/15/28	地 方 債 証 券	2.2500	10,000	8,768	774,427	2028/05/15
HOUSING NEW ZEALAND LTD 2.183 04/24/30	特 殊 債 券	2.1830	6,000	5,013	442,768	2030/04/24
KOMBANK 4.0 08/20/25	特 殊 債 券	4.0000	12,000	11,627	1,026,925	2025/08/20
小 計	—	—	134,500	112,879	9,969,508	—
(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	113,022	1,500,932	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国 債 証 券	1.7500	72,000	67,289	893,603	2027/02/17
NORWAY 1.75 03/13/25	国 債 証 券	1.7500	110,000	105,927	1,406,713	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国 債 証 券	2.0000	90,000	83,686	1,111,356	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国 債 証 券	2.1250	70,000	62,664	832,180	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国 債 証 券	1.3750	95,000	82,232	1,092,041	2030/08/19
NORWAY 3.0 08/15/33	国 債 証 券	3.0000	80,000	76,592	1,017,141	2033/08/15
NORWAY 1.75 09/06/29	国 債 証 券	1.7500	95,000	85,580	1,136,508	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国 債 証 券	1.2500	85,000	71,382	947,958	2031/09/17
小 計	—	—	817,000	748,376	9,938,436	—
合 計	—	—	—	—	98,695,721	—

■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（8,851,149,561口）の内容です。

外国株式

銘柄	2022年12月26日現在		2023年6月26日現在		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
APPLE INC	—	289.22	5,399	774,725	コンピュータ・周辺機器	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	346.85	346.85	2,255	323,700	医薬品	
JPMORGAN CHASE & CO	339.51	339.51	4,714	676,425	銀行	
CISCO SYSTEMS INC	892.49	1,465.97	7,378	1,058,701	通信機器	
CUMMINS INC	42.81	42.81	993	142,525	機械	
BANK OF AMERICA CORP	962.17	266.41	739	106,080	銀行	
EATON CORP PLC	116.51	116.51	2,265	325,098	電気設備	
NEXTERA ENERGY INC	535.19	272.69	2,022	290,214	電力	
GILEAD SCIENCES INC	340.71	164.97	1,278	183,383	バイオテクノロジー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34.11	—	—	—	航空宇宙・防衛	
JOHNSON & JOHNSON	311.61	264.67	4,379	628,451	医薬品	
KIMBERLY-CLARK CORP	356.58	299.81	4,106	589,241	家庭用品	
LAM RESEARCH CORP	—	40.56	2,469	354,295	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	349.38	10,128	1,453,392	ホテル・レストラン・レジャー	
METLIFE INC	1,218.2	—	—	—	保険	
MERCK & CO.INC.	879.27	556.9	6,382	915,763	医薬品	
MICROSOFT CORP	260.46	302.41	10,131	1,453,745	ソフトウェア	
PACCAR INC	304.73	457.09	3,585	514,471	機械	
PAYCHEX INC	524.48	524.48	5,684	815,642	専門サービス	
PPL CORPORATION	831.02	577.29	1,522	218,519	電力	
PEPSICO INC	155.27	138.01	2,567	368,475	飲料	
PFIZER INC	855.26	586.82	2,247	322,496	医薬品	
PROCTER & GAMBLE CO	139.35	91.51	1,358	194,939	家庭用品	
TRUIST FINANCIAL CORP	440.86	—	—	—	銀行	
AT&T INC	1,593.32	1,593.32	2,461	353,226	各種電気通信サービス	
CHEVRON CORP	371.82	323.7	4,899	702,986	石油・ガス・消耗燃料	
STARBUCKS CORP	—	421.29	4,142	594,474	ホテル・レストラン・レジャー	
TEXAS INSTRUMENTS INC	—	214.53	3,597	516,167	半導体・半導体製造装置	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	346.59	346.59	1,088	156,159	生活必需品流通・小売り	
CME GROUP INC	127.92	204.94	3,723	534,234	資本市場	
MASTERCARD INC	130.31	130.31	4,949	710,175	金融サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	669.41	669.41	6,446	924,996	タバコ	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,604	373,782	化学	
ABBVIE INC	269.58	188.43	2,561	367,498	バイオテクノロジー	
BROADCOM INC	21	109.84	9,030	1,295,785	半導体・半導体製造装置	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,162.24 32銘柄	11,991.14 32銘柄	127,115 —	18,239,777 <49.3%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
NATIONAL BANK OF CANADA	717.64	717.64	6,790	739,804	銀行	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	374.96	374.96	2,071	225,706	銀行	
RUSSEL METALS INC	651.98	1,056.82	3,746	408,173	商社・流通業	

銘柄	2022年12月26日現在		2023年6月26日現在		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ) CAPITAL POWER CORP	百株 842.72	百株 842.72	千カナダ・ドル 3,584	千円 390,486	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> 2,587.3 4銘柄	2,992.14 4銘柄	16,192 -	1,764,170 <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 3,316 453	千円 317,659 43,421	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	3,770 -	361,081 <1.0%>	
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD NEW WORLD DEVELOPMENT	百株 7,280 7,700	百株 7,280 7,700	千香港・ドル 17,472 15,030	千円 320,087 275,356	銀行 不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 14,980 2銘柄	14,980 2銘柄	32,502 -	595,443 <1.6%>	
(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 3,658	千円 388,474	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,658 -	388,474 <1.0%>	
(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 3,024.85 453.25 1,437.68 5,964.93 572.23 2,595.96 367.04	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 438.39 2,153.01 453.25 854.22 5,964.93 829.3 2,235.93 174.37	千イギリス・ポンド 2,850 1,177 2,048 1,793 2,149 2,253 1,559 2,711 1,540 3,186 1,991	千円 520,758 215,083 374,307 327,565 392,704 411,661 284,882 495,392 281,344 582,168 363,855	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> 19,052.28 11銘柄	17,452.65 11銘柄	23,261 -	4,249,725 <11.5%>	
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 99.01 730.45	百株 86.78 607.3	千スイス・フラン 2,399 5,507	千円 384,274 882,042	医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率> 829.46 2銘柄	694.08 2銘柄	7,907 -	1,266,317 <3.4%>	
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 836.54	百株 2,133.28	千スウェーデン・クローナ 18,828	千円 252,299	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	18,828 -	252,299 <0.7%>	
(ユーロ…オランダ) FERROVIAL SE	百株 -	百株 1,029	千ユーロ 2,937	千円 459,706	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率> - 1銘柄	1,029 1銘柄	2,937 -	459,706 <1.2%>	
(ユーロ…フランス) AXA SA	百株 2,624.8	百株 1,240.33	千ユーロ 3,275	千円 512,583	保険

銘柄	2022年12月26日現在		2023年6月26日現在		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DANONE	353.68	422.11	2,367	370,484	食品	
BNP PARIBAS	240.76	240.76	1,320	206,642	銀行	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	94.65	103.16	8,563	1,339,986	繊維・アパレル・贅沢品	
TOTALENERGIES SE	902.13	864.34	4,498	703,986	石油・ガス・消耗燃料	
SANOFI	469.31	412.25	4,064	636,057	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,685.33 6銘柄	3,282.95 6銘柄	24,090 -	3,769,741 <10.2%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	1,576.58	1,576.58	6,809	1,065,511	航空貨物・物流サービス	
SAP SE	117.66	286.32	3,509	549,199	ソフトウェア	
E.ON SE	2,473.24	2,473.24	2,812	440,033	総合公益事業	
SIEMENS AG-REG	328.85	328.85	5,162	807,794	コンプロマリット	
BASF SE	244.71	244.71	1,033	161,727	化学	
ALLIANZ SE	132.27	112.5	2,352	368,187	保険	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,955.37	2,955.37	5,780	904,472	各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	281.18	911.82	3,255	509,444	半導体・半導体製造装置	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,109.86 8銘柄	8,889.39 8銘柄	30,715 -	4,806,370 <13.0%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	2,413.68	1,776.33	2,073	324,518	電力	
FERROVIAL SA	1,029	-	-	-	建設・土木	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,442.68 2銘柄	1,776.33 1銘柄	2,073 -	324,518 <0.9%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	477.99	477.99	1,298	203,145	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	1,298 -	203,145 <0.5%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	71,348.76 72銘柄	67,884.03 72銘柄	- -	36,680,771 <99.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月26日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、2023年6月26日現在のマザーファンド純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

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

■DIAM US・リート・オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、DIAM US・リート・オープン・マザーファンド(4,819,415,430円)の内容です。

外国投資証券

銘柄	2022年12月26日現在		2023年6月26日現在		比率
	□数	金額	□数	金額	
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	49,564	52,324	5,707	818,969	3.7
BOSTON PROPERTIES INC	22.93	55.71	2,869	411,682	1.8
PROLOGIS INC	99,927	92,297	10,789	1,548,188	6.9
AVALONBAY COMMUNITIES INC	35.88	40.5	7,345	1,054,003	4.7
CAMDEN PROPERTY TRUST	23.47	20.93	2,215	317,923	1.4
EQUINIX INC	11.33	7.91	5,901	846,839	3.8
COUSINS PROPERTIES INC	213.225	318,645	6,544	939,137	4.2
CROWN CASTLE INC	37.34	33.32	3,646	523,242	2.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24.431	29.531	6,497	932,313	4.2
EQUITY RESIDENTIAL	60.545	63,915	3,985	571,913	2.6
FEDERAL REALTY INVST TRUST	20.31	21.44	1,931	277,185	1.2
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	69.426	84,946	1,636	234,880	1.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	71.07	75.02	1,592	228,532	1.0
WELLTOWER INC	72.13	89.71	6,843	981,913	4.4
HOST HOTELS & RESORTS INC	187.46	-	-	-	-
REGENCY CENTERS CORP	-	40.44	2,345	336,558	1.5
UDR INC	105.7	111.58	4,488	644,107	2.9
SIMON PROPERTY GROUP INC	53.93	57.59	6,204	890,319	4.0
LIFE STORAGE INC	19.95	19.95	2,526	362,494	1.6
PUBLIC STORAGE	28.04	26.72	7,577	1,087,260	4.8
SUN COMMUNITIES INC	14.96	15.79	1,975	283,507	1.3
VENTAS INC	101.98	107.65	4,787	686,914	3.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	20.86	-	-	-	-
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	352.74	372.36	3,582	513,995	2.3
CUBESMART	40.7	40.7	1,765	253,341	1.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	48.32	46.71	4,864	698,056	3.1
DOUGLAS EMMETT INC	225.53	238.08	2,709	388,764	1.7
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	268.2	283.12	3,663	525,686	2.3
TERRENO REALTY CORP	97.883	89.423	5,063	726,508	3.2
AMERICOLD REALTY TRUST	40.2	-	-	-	-
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	197.813	290.373	1,184	169,995	0.8
AMERICAN TOWER CORP	30.96	28.74	5,346	767,169	3.4
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	100.13	53.09	2,666	382,646	1.7
AMERICAN HOMES 4 RENT	106.05	111.95	3,774	541,668	2.4
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	17.85	-	-	-	-
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	249.75	301.52	6,262	898,616	4.0
NETSTREIT CORP	111.16	68.59	1,183	169,872	0.8
STORE CAPITAL CORP	45.89	-	-	-	-
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	-	45.88	1,452	208,362	0.9
VICI PROPERTIES INC	63.24	63.24	1,937	277,946	1.2
合計	3,340,874	3,399,694	142,870	20,500,517	-
□数・金額 銘柄数<比率>	38銘柄<95.3%>	35銘柄<91.4%>	-	-	91.4

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月26日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) <>内は、2023年6月26日現在のマザーファンド純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

■D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド (10,162,209,496円) の内容です。

外国投資信託受益証券、投資証券

銘	柄	2022年12月26日現在		2023 年 6 月 26 日 現 在		
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
不動産ファンド		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール)						
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		6,179.7	12,484.5	5,992	859,872	2.6
小 計	□ 数 ・ 金 額	6,179.7	12,484.5	5,992	859,872	-
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<1.3%>	1銘柄<2.6%>	-	-	2.6
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT		421.539	421.539	20,145	2,194,835	6.5
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		819.87	819.87	15,077	1,642,683	4.9
ALLIED PROPERTIES REIT		271.4	271.4	5,579	607,939	1.8
CROMBIE REAL ESTATE INV		576.2	576.2	7,611	829,284	2.5
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		771.8	771.8	11,183	1,218,429	3.6
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV		1,162.95	1,162.95	19,688	2,145,088	6.4
小 計	□ 数 ・ 金 額	4,023.759	4,023.759	79,286	8,638,260	-
	銘 柄 数<比 率>	6銘柄<23.9%>	6銘柄<25.7%>	-	-	25.7
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL RETAIL REIT		3,230.658	3,230.658	11,533	1,104,558	3.3
GPT GROUP		2,757.12	2,757.12	11,083	1,061,478	3.2
STOCKLAND		944.822	944.822	3,788	362,847	1.1
GOODMAN GROUP		791.805	597.337	11,725	1,122,972	3.3
VICINITY CENTRES		9,247.156	6,302.094	11,280	1,080,357	3.2
CHARTER HALL GROUP		291.519	-	-	-	-
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA		3,578.152	2,991.532	8,316	796,467	2.4
REGION RE LTD		5,600.335	8,722.312	19,450	1,862,798	5.5
NATIONAL STORAGE REIT		7,135.696	7,135.696	16,269	1,558,119	4.6
小 計	□ 数 ・ 金 額	33,577.263	32,681.571	93,448	8,949,599	-
	銘 柄 数<比 率>	9銘柄<28.5%>	8銘柄<26.6%>	-	-	26.6
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT		420.2	-	-	-	-
小 計	□ 数 ・ 金 額	420.2	-	-	-	-
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<1.2%>	-銘柄<-%>	-	-	-
(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	4,193	445,305	1.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		4,282.242	3,294.742	5,370	570,285	1.7
PARKWAY LIFE REIT		2,517	2,517	9,564	1,015,664	3.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		1,674.54	932.24	2,050	217,788	0.6
小 計	□ 数 ・ 金 額	10,044.373	8,314.573	21,179	2,249,044	-
	銘 柄 数<比 率>	4銘柄<6.9%>	4銘柄<6.7%>	-	-	6.7
(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	25,468	2,249,360	6.7
小 計	□ 数 ・ 金 額	11,602.872	11,602.872	25,468	2,249,360	-
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<5.9%>	1銘柄<6.7%>	-	-	6.7

銘	柄	2022年12月26日現在		2023 年 6 月 26 日 現 在		
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
(イギリス)		千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	%
UNITE GROUP PLC		984.214	984.214	8,434	1,540,937	4.6
SEGRO PLC		1,185.138	1,185.138	8,338	1,523,384	4.5
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,169.352	2,169.352	16,773	3,064,322	—
		2銘柄<8.5%>	2銘柄<9.1%>	—	—	9.1
(オランダ)		千□	千□	千ユーロ	千円	%
VASTNED RETAIL		452.507	452.507	8,832	1,382,177	4.1
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	452.507	452.507	8,832	1,382,177	—
		1銘柄<4.0%>	1銘柄<4.1%>	—	—	4.1
(ベルギー)		千□	千□	千ユーロ	千円	%
COFINIMMO SA		34.726	34.726	2,396	374,940	1.1
WAREHOUSES DE PAUW		690.172	690.172	17,185	2,689,153	8.0
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	724.898	724.898	19,581	3,064,093	—
		2銘柄<8.9%>	2銘柄<9.1%>	—	—	9.1
(フランス)		千□	千□	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		43.793	28.669	2,690	421,022	1.3
ICADE		90.256	57.838	2,180	341,203	1.0
KLEPIERRE		285.887	285.887	6,229	974,788	2.9
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	419.936	372.394	11,100	1,737,014	—
		3銘柄<5.9%>	3銘柄<5.2%>	—	—	5.2
(スペイン)		千□	千□	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		174.863	174.863	949	148,578	0.4
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	174.863	174.863	949	148,578	—
		1銘柄<0.4%>	1銘柄<0.4%>	—	—	0.4
合 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	69,789.723	73,001.289	—	32,342,325	—
		31銘柄<95.3%>	29銘柄<96.0%>	—	—	96.0

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月26日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、2023年6月26日現在のマザーファンド純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

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

■投資信託財産の構成

2023年6月26日現在

項 目	第 36 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	1,783,778	50.0
D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド	905,624	25.4
D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンド	315,099	8.8
D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド	493,552	13.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	71,467	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,569,522	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6月26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99,393,684千円、99.5%、D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンドは36,883,648千円、99.6%、D I A M U S ・ リート ・ オープン ・ マザーファンドは21,861,846千円、97.5%、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンドは32,770,387千円、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、2023年6月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=143.49円、1カナダ・ドル=108.95円、1オーストラリア・ドル=95.77円、1香港・ドル=18.32円、1シンガポール・ドル=106.19円、1ニュージーランド・ドル=88.32円、1台湾・ドル=4.634円、1イギリス・ポンド=182.69円、1スイス・フラン=160.15円、1ノルウェー・クローネ=13.28円、1スウェーデン・クローナ=13.40円、1ユーロ=156.48円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年1月26日)、(2023年2月27日)、(2023年3月27日)、(2023年4月26日)、(2023年5月26日)、(2023年6月26日)現在

項 目	第 206 期 末	第 207 期 末	第 208 期 末	第 209 期 末	第 210 期 末	第 211 期 末
(A) 資 産	3,491,269,369円	3,501,402,992円	3,317,888,683円	3,451,799,234円	3,458,608,196円	3,569,522,765円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	55,357,151	70,088,149	59,370,413	70,574,616	47,776,996	71,467,707
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)	1,750,250,627	1,741,440,760	1,715,592,178	1,714,527,498	1,728,315,023	1,783,778,673
D I A M 世界好配当株オープン・ マザーファンド(評価額)	880,853,123	863,607,604	810,895,810	882,291,919	861,621,989	905,624,500
D I A M U S ・ リート・オープン・ マザーファンド(評価額)	310,779,450	321,721,769	282,089,720	299,268,348	301,482,542	315,099,499
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)	494,029,018	504,544,710	449,940,562	485,136,853	489,411,646	493,552,386
未 収 入 金	-	-	-	-	30,000,000	-
(B) 負 債	11,390,093	16,076,223	10,942,995	12,491,516	14,897,956	12,780,084
未 払 収 益 分 配 金	7,528,219	7,488,514	7,467,240	7,447,644	7,417,948	7,380,410
未 払 解 約 金	58	4,524,986	49	1,305,220	3,684,124	1,456,039
未 払 信 託 報 酬	3,851,559	4,051,937	3,466,475	3,728,724	3,785,802	3,933,162
そ の 他 未 払 費 用	10,257	10,786	9,231	9,928	10,082	10,473
(C) 純資産総額(A-B)	3,479,879,276	3,485,326,769	3,306,945,688	3,439,307,718	3,443,710,240	3,556,742,681
元 本	3,764,109,766	3,744,257,014	3,733,620,318	3,723,822,134	3,708,974,092	3,690,205,447
次 期 繰 越 損 益 金	△284,230,490	△258,930,245	△426,674,630	△284,514,416	△265,263,852	△133,462,766
(D) 受 益 権 総 口 数	3,764,109,766口	3,744,257,014口	3,733,620,318口	3,723,822,134口	3,708,974,092口	3,690,205,447口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,245円	9,308円	8,857円	9,236円	9,285円	9,638円

(注) 第205期末における元本額は3,764,165,878円、当作成期間(第206期～第211期)中における追加設定元本額は19,806,314円、同解約元本額は93,766,745円です。

■損益の状況

〔自 2022年12月27日 至 2023年1月26日〕〔自 2023年1月27日 至 2023年2月27日〕〔自 2023年2月28日 至 2023年3月27日〕〔自 2023年3月28日 至 2023年4月26日〕〔自 2023年4月27日 至 2023年5月26日〕〔自 2023年5月27日 至 2023年6月26日〕

項 目	第 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 期	第 210 期	第 211 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,444円	△865円	△939円	△425円	△2,834円	△3,541円
受 取 利 息	106	53	23	51	5	12
支 払 利 息	△1,550	△918	△962	△476	△2,839	△3,553
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	111,804,165	35,352,496	△157,571,539	152,205,788	29,329,759	141,781,029
売 買 益	111,912,147	44,212,495	298,713	152,706,346	29,607,486	142,223,858
売 買 損	△107,982	△8,859,999	△157,870,252	△500,558	△277,727	△442,829
(C) 信 託 報 酬 等	△3,861,816	△4,062,723	△3,475,706	△3,738,652	△3,795,884	△3,943,635
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	107,940,905	31,288,908	△161,048,184	148,466,711	25,531,041	137,833,853
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△397,206,810	△295,165,974	△270,158,621	△437,356,382	△295,092,038	△275,353,451
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	12,563,634	12,435,335	11,999,415	11,822,899	11,715,093	11,437,242
(配 当 等 相 当 額)	(89,757,064)	(89,313,582)	(89,234,913)	(89,045,116)	(88,714,381)	(88,355,589)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△77,193,430)	(△76,878,247)	(△77,235,498)	(△77,222,217)	(△76,999,288)	(△76,918,347)
(G) 合 計 (D+E+F)	△276,702,271	△251,441,731	△419,207,390	△277,066,772	△257,845,904	△126,082,356
(H) 収 益 分 配 金	△7,528,219	△7,488,514	△7,467,240	△7,447,644	△7,417,948	△7,380,410
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△284,230,490	△258,930,245	△426,674,630	△284,514,416	△265,263,852	△133,462,766
追 加 信 託 差 損 益 金	12,563,634	12,435,335	11,999,415	11,822,899	11,715,093	11,437,242
(配 当 等 相 当 額)	(89,763,798)	(89,313,868)	(89,238,106)	(89,045,981)	(88,714,874)	(88,356,884)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△77,200,164)	(△76,878,533)	(△77,238,691)	(△77,223,082)	(△76,999,781)	(△76,919,642)
分 配 準 備 積 立 金	109,707,540	108,782,456	108,643,529	109,156,154	110,880,524	111,643,060
繰 越 損 益 金	△406,501,664	△380,148,036	△547,317,574	△405,493,469	△387,859,469	△256,543,068

(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206期から第211期まででD I A M U S・リート・オープン・マザーファンド771,085円、D I A M インターナショナル・リート・インカム・オープン・マザーファンド1,220,975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 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 期	第 210 期	第 211 期
(a) 経費控除後の配当等収益	7,814,923円	7,165,260円	7,812,146円	8,286,607円	9,601,018円	8,793,664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	89,763,798	89,313,868	89,238,106	89,045,981	88,714,874	88,356,884
(d) 分 配 準 備 積 立 金	109,420,836	109,105,710	108,298,623	108,317,191	108,697,454	110,229,806
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	206,999,557	205,584,838	205,348,875	205,649,779	207,013,346	207,380,354
(f) 1万口当たり当期分配対象額	549.93	549.07	550.00	552.25	558.14	561.98
(g) 分 配 金	7,528,219	7,488,514	7,467,240	7,447,644	7,417,948	7,380,410
(h) 1万口当たり分配金	20	20	20	20	20	20

■分配金のお知らせ

決算期	第 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 期	第 210 期	第 211 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

D I A M高格付インカム・オープン・マザーファンド

運用報告書

第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）。

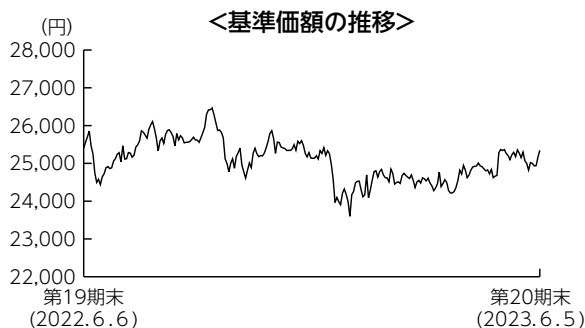
■当期中の基準価額の推移

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。

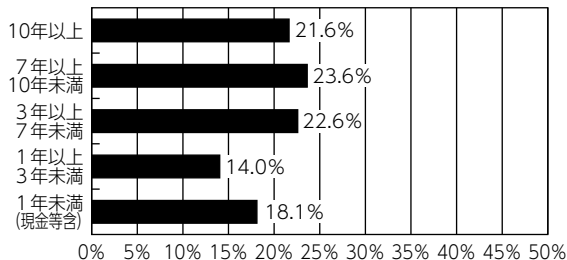
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【運用状況】

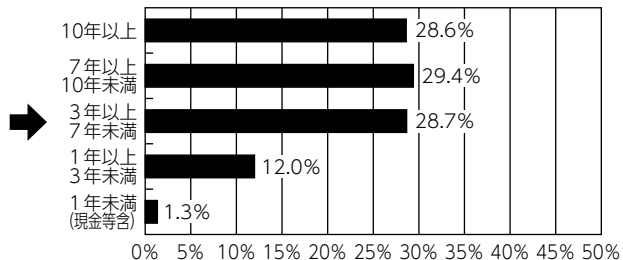
(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存期間別構成比

期首 (前期末)

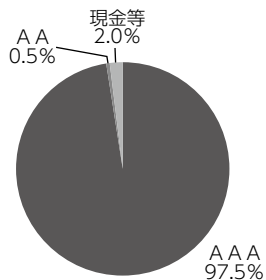


期末

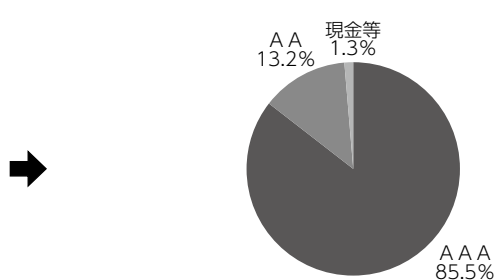


○格付別構成比

期首 (前期末)

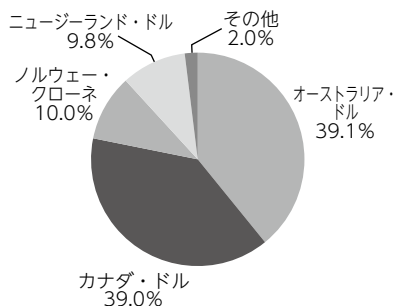


期末

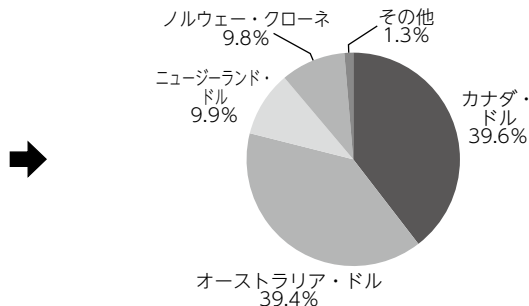


○通貨別構成比

期首 (前期末)

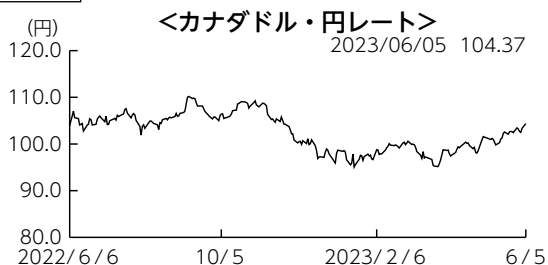


期末

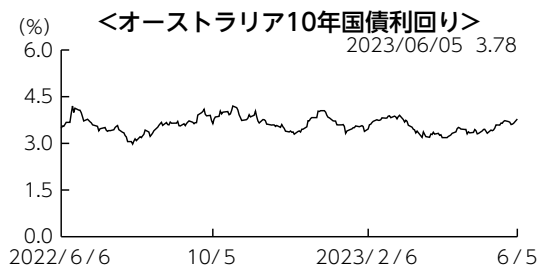


【各国の為替・金利動向】

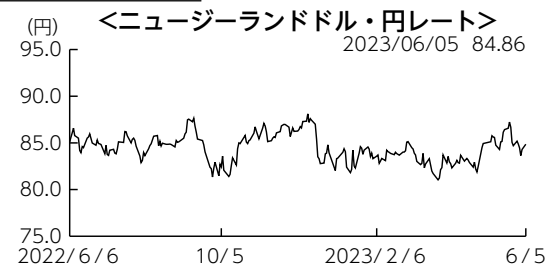
カナダ



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 (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 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 0.024	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	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		13,000	10,828	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)			%	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	8,047	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
(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	期騰落		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
		円	中率 %			
14期（2019年5月27日）	25,645	△0.1	%	97.7	—	百万円 36,715
15期（2020年5月26日）	23,045	△10.1	%	96.6	—	30,171
16期（2021年5月26日）	31,514	36.7	%	97.5	—	36,299
17期（2022年5月26日）	35,715	13.3	%	98.6	—	35,042
18期（2023年5月26日）	39,789	11.4	%	98.6	—	35,489

（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）。

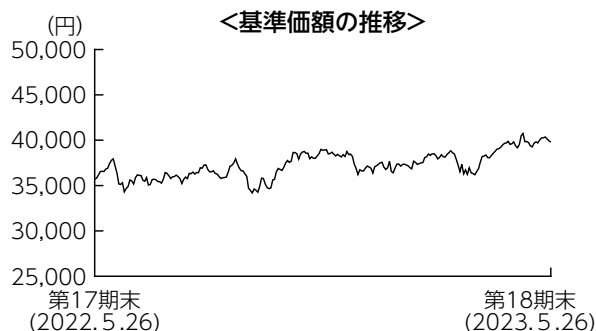
■当期中の基準価額の推移

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
	フ ィ ン ラ ン ド	(-)	(-)	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 5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>	480.86 1銘柄	- -	- <-%>	
(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>	4,609.14 7銘柄	3,214.52 6銘柄	24,027 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>	7,782.34 7銘柄	8,413.13 8銘柄	28,227 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>	4,779.22 3銘柄	2,805.33 2銘柄	5,005 750,713 <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>	2,252.24 2銘柄	477.99 1銘柄	1,391 208,758 <0.6%>	
合 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	94,944.89 82銘柄	68,312.66 72銘柄	- 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	額			
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。

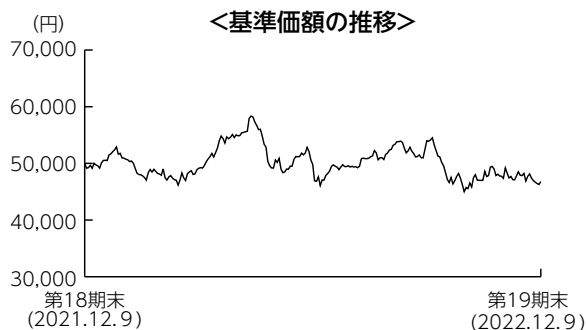
（注2）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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)	千口	千口	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。

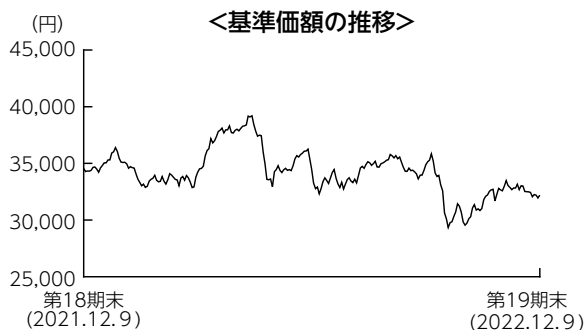
(注2) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■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)	0.014% (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		比 率
(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	777,670	819.87	17,036	1,715,615	4.9	
ALLIED PROPERTIES REIT	303.9	303,900	271.4	7,363	741,462	2.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	326.6	326,600	97	1,460	147,104	0.4	
CROMBIE REAL ESTATE INV	576.2	576,200	576.2	9,219	928,373	2.6	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	318.8	318,800	-	-	-	-	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	771.8	771,800	771.8	11,816	1,189,897	3.4	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	1,110.75	1,110,750	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	420,200	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。