

## 運用報告書 (全体版)

### D I A M世界好配当株式ファンド(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/株式	
信託期間	2010年2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	D I A M世界好配当株式ファンド(毎月決算型)	D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	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。
運用方法	マザーファンドにおける組入銘柄の選定に当たっては、配当利回りの高い銘柄および増配の期待できる銘柄を選定し、安定的な配当収入およびキャピタルゲインを享受することをめざします。 実質外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。 株式の実質組入比率は、原則として高位を維持します。	
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には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
分配方針	決算日(原則として毎月21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等を中心に安定分配を行うことを基本とします。 ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

愛称：ハッピーインカム

第167期	<決算日	2024年1月22日>
第168期	<決算日	2024年2月21日>
第169期	<決算日	2024年3月21日>
第170期	<決算日	2024年4月22日>
第171期	<決算日	2024年5月21日>
第172期	<決算日	2024年6月21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世界好配当株式ファンド(毎月決算型)」は、2024年6月21日に第172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  
 お客様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世界好配当株式ファンド（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	株式先物率	純資産額
		(分配落)	税分 込配	み金 期騰 落中率			
第25作成期	143期(2022年1月21日)	円 7,751	円 45	% 3.6	% 97.5	% -	百万円 20,690
	144期(2022年2月21日)	7,672	45	△0.4	97.5	-	20,393
	145期(2022年3月22日)	7,714	45	1.1	97.9	-	20,468
	146期(2022年4月21日)	8,251	45	7.5	97.9	-	21,756
	147期(2022年5月23日)	7,708	45	△6.0	98.0	-	20,246
	148期(2022年6月21日)	7,642	45	△0.3	98.1	-	20,045
第26作成期	149期(2022年7月21日)	7,908	45	4.1	97.6	-	20,736
	150期(2022年8月22日)	8,052	45	2.4	97.1	-	21,076
	151期(2022年9月21日)	7,789	45	△2.7	97.8	-	20,356
	152期(2022年10月21日)	7,815	45	0.9	97.4	-	20,446
	153期(2022年11月21日)	8,152	45	4.9	98.2	-	21,328
	154期(2022年12月21日)	7,618	45	△6.0	97.9	-	19,877
第27作成期	155期(2023年1月23日)	7,714	45	1.9	98.0	-	20,196
	156期(2023年2月21日)	7,986	45	4.1	97.8	-	20,938
	157期(2023年3月22日)	7,614	45	△4.1	97.3	-	19,931
	158期(2023年4月21日)	8,089	45	6.8	97.2	-	21,175
	159期(2023年5月22日)	8,182	45	1.7	97.6	-	21,499
	160期(2023年6月21日)	8,434	45	3.6	98.2	-	22,114
第28作成期	161期(2023年7月21日)	8,497	45	1.3	97.2	-	22,264
	162期(2023年8月21日)	8,386	45	△0.8	97.4	-	22,017
	163期(2023年9月21日)	8,571	45	2.7	97.3	-	22,528
	164期(2023年10月23日)	8,211	45	△3.7	97.6	-	21,693
	165期(2023年11月21日)	8,568	45	4.9	97.5	-	22,559
	166期(2023年12月21日)	8,563	45	0.5	97.4	-	22,245
第29作成期	167期(2024年1月22日)	8,872	45	4.1	97.4	-	22,890
	168期(2024年2月21日)	9,013	45	2.1	98.1	-	23,120
	169期(2024年3月21日)	9,286	45	3.5	97.9	-	23,785
	170期(2024年4月22日)	9,192	45	△0.5	97.8	-	23,512
	171期(2024年5月21日)	9,874	45	7.9	96.9	-	25,219
	172期(2024年6月21日)	9,977	45	1.5	97.2	-	25,485

(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」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) 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、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注5) △(白三角) はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株式組入比率	株式先物比率
			騰	落		
第167期	(期首) 2023年12月21日	円 8,563	% -		% 97.4	% -
	12月 末	8,578		0.2	97.7	-
	(期末) 2024年1月22日	8,917		4.1	97.4	-
第168期	(期首) 2024年1月22日	8,872		-	97.4	-
	1月 末	8,940		0.8	98.2	-
	(期末) 2024年2月21日	9,058		2.1	98.1	-
第169期	(期首) 2024年2月21日	9,013		-	98.1	-
	2月 末	9,125		1.2	97.6	-
	(期末) 2024年3月21日	9,331		3.5	97.9	-
第170期	(期首) 2024年3月21日	9,286		-	97.9	-
	3月 末	9,394		1.2	97.6	-
	(期末) 2024年4月22日	9,237		△0.5	97.8	-
第171期	(期首) 2024年4月22日	9,192		-	97.8	-
	4月 末	9,565		4.1	97.5	-
	(期末) 2024年5月21日	9,919		7.9	96.9	-
第172期	(期首) 2024年5月21日	9,874		-	96.9	-
	5月 末	9,666		△2.1	96.9	-
	(期末) 2024年6月21日	10,022		1.5	97.2	-

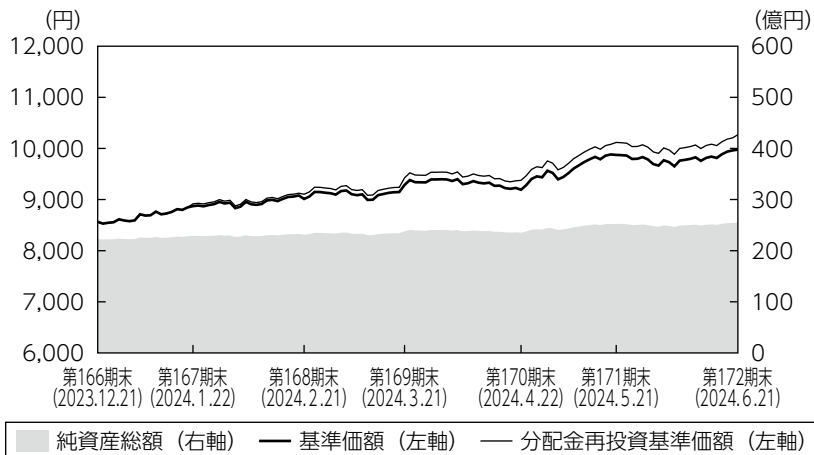
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

## ■第167期～第172期の運用経過（2023年12月22日から2024年6月21日まで）

### 基準価額等の推移



第167期首： 8,563円  
第172期末： 9,977円  
(既払分配金270円)  
騰落率： 19.9%  
(分配金再投資ベース)

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

### 基準価額の主な変動要因

欧米の物価動向やそれに対する金融政策への思惑、中東などの地政学的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強まり株式市場が上昇したことで基準価額も上昇しました。また為替市場で主要通貨に対して前作成期末比で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。

## 投資環境

外国株式市場は上昇しました。主要各国におけるインフレの高止まりや中東の情勢などから一時下落する局面もありましたが、中国当局の経済対策による景気回復期待や、半導体関連など米国主要企業の決算が堅調なことなどを背景に大手ハイテク関連株が好調に推移し、株式市場は概ね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。作成期初から2024年1月中旬頃までは、日銀総裁による金融政策に関する発言を受けて早期にマイナス金利を解除する観測が高まり、円高基調で推移しました。その後は、米経済指標の比較的堅調な状況を受けた米利下げ時期の後退観測により、概ね円安基調で推移しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

### ●D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド

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

## 【運用状況】

(注1) 組入比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

(注2) 国・地域別配分は、発行国・地域を表示しております。

(注3) 業種は各決算日時点でのG I C S（世界産業分類基準）によるものです。

### ○国・地域別配分

#### 前作成期末

国・地域	組入比率
北米	45.0%
米国	4.8%
カナダ	
計	49.8%
中南米	1.0%
ケイマン	1.0%
計	1.0%
欧州	43.8%
フィンランド	0.7%
フランス	7.4%
ドイツ	13.4%
アイルランド	1.8%
オランダ	2.5%
スペイン	2.5%
デンマーク	1.0%
スウェーデン	0.8%
スイス	3.2%
英国	10.5%
計	43.8%
アジア・オセアニア	2.8%
オーストラリア	1.1%
香港	0.7%
シンガポール	1.0%
計	2.8%
小計	97.4%
現金など	2.6%
合計	100%

#### 当作成期末

国・地域	組入比率
北米	44.4%
米国	4.7%
カナダ	
計	49.1%
中南米	2.5%
ケイマン	2.5%
計	2.5%
欧州	42.1%
フィンランド	0.5%
フランス	6.7%
ドイツ	11.9%
アイルランド	2.4%
オランダ	2.6%
スペイン	2.1%
デンマーク	1.9%
スウェーデン	0.9%
スイス	3.0%
英国	10.0%
計	42.1%
アジア・オセアニア	3.5%
オーストラリア	0.9%
香港	1.5%
シンガポール	1.1%
計	3.5%
小計	97.2%
現金など	2.8%
合計	100%

### ○組入上位10業種

#### 前作成期末

No.	業種	組入比率
1	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.4%
2	資本財	9.5
3	公益事業	8.9
4	銀行	8.3
5	半導体・半導体製造装置	6.6
6	食品・飲料・タバコ	6.0
7	ソフトウェア・サービス	5.7
8	消費者サービス	5.7
9	金融サービス	5.7
10	エネルギー	5.6

#### 当作成期末

No.	業種	組入比率
1	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	12.3%
2	資本財	12.2
3	銀行	9.3
4	ソフトウェア・サービス	8.8
5	半導体・半導体製造装置	8.4
6	公益事業	7.9
7	エネルギー	6.0
8	金融サービス	5.9
9	食品・飲料・タバコ	5.5
10	電気通信サービス	5.1

## 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167期	第168期	第169期	第170期	第171期	第172期
	2023年12月22日 ~2024年1月22日	2024年1月23日 ~2024年2月21日	2024年2月22日 ~2024年3月21日	2024年3月22日 ~2024年4月22日	2024年4月23日 ~2024年5月21日	2024年5月22日 ~2024年6月21日
当期分配金（税引前）	45円	45円	45円	45円	45円	45円
対基準価額比率	0.50%	0.50%	0.48%	0.49%	0.45%	0.45%
当期の収益	45円	45円	45円	2円	45円	45円
当期の収益以外	-円	-円	-円	42円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	3,050円	3,190円	3,463円	3,421円	4,049円	4,153円

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

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

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

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

引き続き、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドを高位に組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

### ●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。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第167期～第172期 (2023年12月22日 ～2024年6月21日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	56円 (26) (26) ( 3)	
(b) 売買委託手数料 (株式)	2 ( 2)	0.020 (0.020)	(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
(c) 有価証券取引税 (株式)	1 ( 1)	0.007 (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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用)	1 ( 1) ( 0)	0.012 (0.011) (0.001)	(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
合計	59	0.642	

(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。

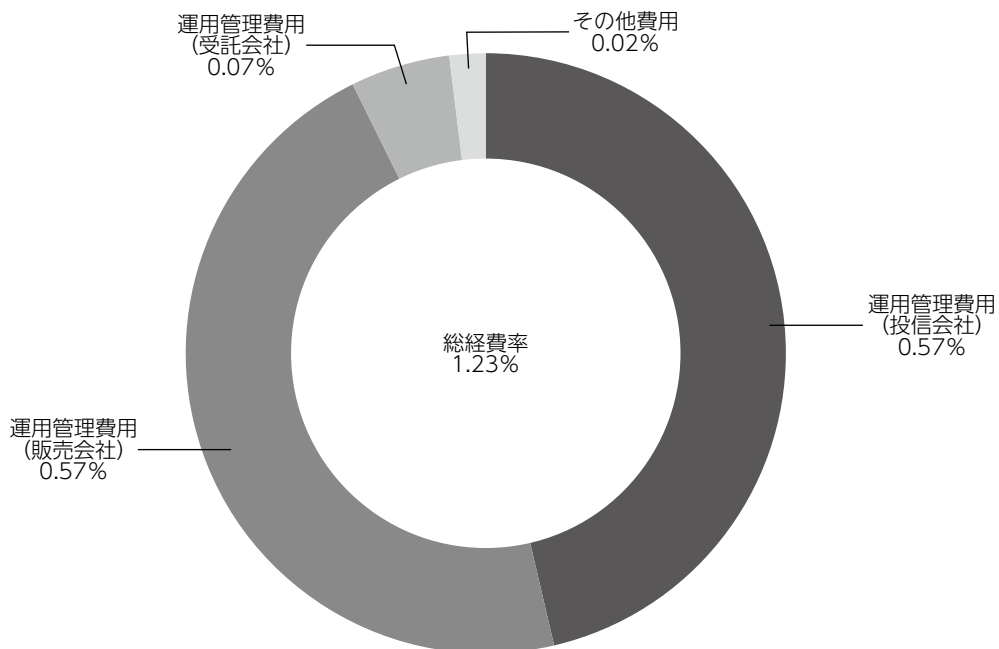
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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1.23%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年12月22日から2024年6月21日まで）

	第 167 期 ~ 第 172 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
D I A M 世界好配当株 オープン・マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 263,623	千円 1,262,805

■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 167 期 ~ 第 172 期
	D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	11,455,866千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	38,453,822千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.29

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年12月22日から2024年6月21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28作成期末	第 29 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
D I A M 世界好配当株オープン・マザーファンド	千□ 5,001,551	千□ 4,737,927	千円 25,236,572

<補足情報>

■D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド (7,852,310,230口) の内容です。  
外国株式

銘柄	2023年12月21日現在		2024年6月21日現在		業種等
	株数	株数	評価額	価額	
	株数	株数	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	3,561	566,612	情報技術サービス
AMGEN INC	54.23	41.34	1,281	203,820	バイオテクノロジー
APPLE INC	289.22	149.73	3,139	499,500	コンピュータ・周辺機器
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	146.65	101.29	415	66,136	医薬品
JPMORGAN CHASE & CO	376	299.68	5,953	947,240	銀行
CISCO SYSTEMS INC	781.14	368.59	1,722	273,978	通信機器
BANK OF AMERICA CORP	449.28	449.28	1,796	285,850	銀行
EATON CORP PLC	196.05	196.05	6,337	1,008,235	電気設備
NEXTERA ENERGY INC	771.56	656.69	4,758	757,057	電力
GILEAD SCIENCES INC	164.97	101.52	695	110,623	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	155.46	155.46	2,297	365,514	医薬品
KIMBERLY-CLARK CORP	299.81	260.01	3,643	579,642	家庭用品
LAM RESEARCH CORP	56.75	56.75	6,022	958,248	半導体・半導体製造装置
MCDONALD'S CORPORATION	193.52	38.06	965	153,684	ホテル・レストラン・レジャー
MERCK & CO.INC.	201.18	261.32	3,388	539,116	医薬品
MICROSOFT CORP	284.07	300.79	13,406	2,132,928	ソフトウェア
3M CO	222.9	283.03	2,877	457,775	コンプロマリット
PAYCHEX INC	524.48	-	-	-	専門サービス
PPL CORPORATION	577.29	577.29	1,619	257,630	電力
PEPSICO INC	196.56	143.16	2,386	379,642	飲料
PFIZER INC	475.45	475.45	1,318	209,836	医薬品
PROCTER & GAMBLE CO	91.51	91.51	1,534	244,114	家庭用品
AT&T INC	2,394.41	2,394.41	4,336	689,901	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	323.7	383.91	6,013	956,758	石油・ガス・消耗燃料
STARBUCKS CORP	574.76	102.14	814	129,548	ホテル・レストラン・レジャー
CME GROUP INC	369.05	347.32	6,893	1,096,828	資本市場
TRANSDIGM GROUP INC	-	24.22	3,220	512,375	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	107.45	113.39	5,131	816,343	金融サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	669.41	669.41	6,774	1,077,811	タバコ
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	294.91	294.91	2,803	445,976	化学
ABBVIE INC	188.43	334.65	5,760	916,468	バイオテクノロジー
BROADCOM INC	102.66	93.3	16,183	2,574,786	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,532.86 30銘柄	9,969.43 31銘柄	127,052 -	20,213,991 <48.3%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	376.1	445.77	4,763	553,613	銀行
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	573.6	573.6	3,721	432,514	銀行
RUSSEL METALS INC	1,406.01	1,406.01	5,147	598,231	商社・流通業
CAPITAL POWER CORP	842.72	842.72	3,389	393,918	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,198.43 4銘柄	3,268.1 4銘柄	17,021 -	1,978,277 <4.7%>

銘 柄	2023年12月21日現在		2024 年 6 月 21 日 現 在		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア) BHP GROUP LTD WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	百株 743.7 134.38	百株 743.7 134.38	千オーストラリア・ドル 3,179 366	千円 336,689 38,779	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	3,545 -	375,468 <0.9%>
(香港) BOC HONG KONG HOLDINGS LTD CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	百株 7,280 24,480 -	百株 12,690 28,140 2,656	千香港・ドル 31,027 30,222 21,526	千円 632,641 616,233 438,933	銀行 建設・土木 繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	31,760 2銘柄	43,486 3銘柄	82,776 -	1,687,808 <4.0%>
(シンガポール) UNITED OVERSEAS BANK LTD	百株 1,307	百株 1,307	千シンガポール・ドル 3,987	千円 468,469	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,307 1銘柄	1,307 1銘柄	3,987 -	468,469 <1.1%>
(イギリス) NATIONAL GRID PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC IMPERIAL BRANDS PLC UNILEVER PLC UNITED UTILITIES GROUP PLC RIO TINTO PLC SSE PLC BP PLC 3I GROUP PLC GSK PLC	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 264.5 2,153.01 453.25 854.22 5,964.93 829.3 2,235.93	百株 2,744.83 448.5 1,155.92 264.5 2,153.01 453.25 -	千イギリス・ポンド 2,484 1,103 2,361 1,172 2,138 2,389 -	千円 500,217 222,173 475,544 236,112 430,690 481,089 -	総合公益事業 タバコ タバコ パーソナルケア用品 水道 金属・鉱業 電力 石油・ガス・消耗燃料 資本市場 医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	17,104.39 10銘柄	16,360.72 9銘柄	21,043 -	4,237,528 <10.1%>
(スイス) ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 86.78 607.3	百株 51.98 624.38	千スイス・フラン 1,299 5,889	千円 231,778 1,050,500	医薬品 医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	694.08 2銘柄	676.36 2銘柄	7,189 -	1,282,279 <3.1%>
(デンマーク) NOVO NORDISK A/S-B	百株 243.84	百株 348.52	千デンマーク・クローネ 34,635	千円 790,737	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	243.84 1銘柄	348.52 1銘柄	34,635 -	790,737 <1.9%>
(スウェーデン) TELE2 AB-B SHS	百株 2,475.68	百株 2,475.68	千スウェーデン・クローナ 26,304	千円 398,507	無線通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,475.68 1銘柄	2,475.68 1銘柄	26,304 -	398,507 <1.0%>
(ユーロ圏・オランダ) FERROVIAL SE	百株 1,029	百株 1,029	千ユーロ 3,753	千円 639,383	建設・土木
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,029 1銘柄	1,029 1銘柄	3,753 -	639,383 <1.5%>
(ユーロ圏・フランス) AXA SA	百株 1,500.56	百株 1,692.38	千ユーロ 5,236	千円 891,885	保険

銘柄	2023年12月21日現在		2024年6月21日現在		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DANONE	336.69	160.31	920	156,734	食品
BNP PARIBAS	541.55	599.13	3,601	613,421	銀行
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33.32	15.03	1,072	182,685	繊維・アパレル・贅沢品
TOTALENERGIES SE	864.34	923.86	5,756	980,516	石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,276.46 5銘柄	3,390.71 5銘柄	16,586 -	2,825,244 <6.8%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,576.58	602.52	2,298	391,522	航空貨物・物流サービス
SAP SE	286.32	337.31	6,061	1,032,448	ソフトウェア
E.ON SE	2,473.24	2,473.24	3,107	529,321	総合公益事業
SIEMENS AG-REG	364.06	449.4	7,655	1,303,889	コングロマリット
BASF SE	244.71	244.71	1,114	189,817	化学
ALLIANZ SE	112.5	120.72	3,138	534,618	保険
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,955.37	2,706.4	6,194	1,055,185	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	381.74	-	-	-	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,394.52 8銘柄	6,934.3 7銘柄	29,570 -	5,036,804 <12.0%>
(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	2,636	449,158	電力
AMADEUS IT GROUP SA	538.26	411.73	2,643	450,234	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,707.73 2銘柄	2,581.2 2銘柄	5,280 -	899,393 <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	1,356	231,042	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	1,356 -	231,042 <0.6%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	85,080.06 70銘柄	93,104.64 70銘柄	- -	41,064,936 <98.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6月21日現在の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、2024年6月21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。

## ■投資信託財産の構成

2024年6月21日現在

項 目	第 29 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド	25,236,572 千円	98.5 %
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	390,916	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	25,627,488	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) D I A M世界好配当株オープン・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2024年6月21日現在、41,507,300千円、98.9%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6月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.10円、1カナダ・ドル=116.22円、1オーストラリア・ドル=105.90円、1香港・ドル=20.39円、1シンガポール・ドル=117.48円、1台湾・ドル=4.917円、1イギリス・ポンド=201.37円、1スイス・フラン=178.36円、1デンマーク・クローネ=22.83円、1ノルウェー・クローネ=15.10円、1スウェーデン・クローナ=15.15円、1ユーロ=170.33円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月22日)、(2024年2月21日)、(2024年3月21日)、(2024年4月22日)、(2024年5月21日)、(2024年6月21日)現在

項 目	第 167 期 末	第 168 期 末	第 169 期 末	第 170 期 末	第 171 期 末	第 172 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>23,051,441,447円</b>	<b>23,265,364,653円</b>	<b>23,930,112,406円</b>	<b>23,656,265,110円</b>	<b>25,379,132,865円</b>	<b>25,627,488,951円</b>
コール・ローン等	222,864,103	248,135,733	198,994,699	215,201,850	219,260,900	253,590,727
D I A M世界好配当株オープン・マザーファンド(評価額)	22,673,328,344	22,893,537,920	23,542,116,707	23,278,400,260	24,970,602,965	25,236,572,224
未 収 入 金	155,249,000	123,691,000	189,001,000	162,663,000	189,269,000	137,326,000
<b>(B) 負 債</b>	<b>160,795,264</b>	<b>144,638,386</b>	<b>144,894,778</b>	<b>143,880,966</b>	<b>159,696,098</b>	<b>142,004,234</b>
未 払 収 益 分 配 金	116,103,637	115,433,115	115,257,404	115,105,478	114,940,988	114,953,927
未 払 解 約 金	20,871,837	6,345,920	7,205,012	3,387,857	21,178,379	1,265,989
未 払 信 託 報 酬	23,754,481	22,797,355	22,371,945	25,319,960	23,514,575	25,717,027
そ の 他 未 払 費 用	65,309	61,996	60,417	67,671	62,156	67,291
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>22,890,646,183</b>	<b>23,120,726,267</b>	<b>23,785,217,628</b>	<b>23,512,384,144</b>	<b>25,219,436,767</b>	<b>25,485,484,717</b>
元 本	25,800,808,249	25,651,803,533	25,612,756,616	25,578,995,147	25,542,441,990	25,545,317,269
次 期 繰 越 損 益 金	△2,910,162,066	△2,531,077,266	△1,827,538,988	△2,066,611,003	△323,005,223	△59,832,552
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>25,800,808,249口</b>	<b>25,651,803,533口</b>	<b>25,612,756,616口</b>	<b>25,578,995,147口</b>	<b>25,542,441,990口</b>	<b>25,545,317,269口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	8,872円	9,013円	9,286円	9,192円	9,874円	9,977円

(注) 第166期末における元本額は25,980,344,379円、当作成期間(第167期～第172期)中における追加設定元本額は813,103,616円、同解約元本額は1,248,130,726円です。

## ■損益の状況

〔自 2023年12月22日 至 2024年1月22日〕〔自 2024年1月23日 至 2024年2月21日〕〔自 2024年2月22日 至 2024年3月21日〕〔自 2024年3月22日 至 2024年4月21日〕〔自 2024年4月22日 至 2024年5月21日〕〔自 2024年5月22日 至 2024年6月21日〕

項 目	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期	第 172 期
(A) 配 当 等 収 益	△3,389円	△1,268円	△961円	12,997円	13,327円	15,190円
受 取 利 息	18	78	-	12,997	13,327	15,190
支 払 利 息	△3,407	△1,346	△961	-	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	937,629,373	499,813,503	836,658,051	△101,533,846	1,876,299,715	404,541,674
売 買 益	940,073,685	500,321,626	837,602,198	60,248	1,881,471,705	404,174,176
売 買 損	△2,444,312	△508,123	△944,147	△101,594,094	△5,171,990	367,498
(C) 信 託 報 酬 等	△23,819,790	△22,859,351	△22,432,362	△25,387,631	△23,576,731	△25,784,318
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	913,806,194	476,952,884	814,224,728	△126,908,480	1,852,736,311	378,772,546
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,600,094,775	3,360,531,848	3,697,384,802	4,362,664,299	4,095,767,390	5,806,153,441
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△6,307,959,398	△6,253,128,883	△6,223,891,114	△6,187,261,344	△6,156,567,936	△6,129,804,612
(配 当 等 相 当 額)	(4,471,437,106)	(4,463,322,033)	(4,475,609,484)	(4,497,686,703)	(4,510,927,951)	(4,539,642,299)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,779,396,504)	(△10,716,450,916)	(△10,699,500,598)	(△10,684,948,047)	(△10,667,495,887)	(△10,669,446,911)
(G) 合 計 (D + E + F)	△2,794,058,429	△2,415,644,151	△1,712,281,584	△1,951,505,525	△208,064,235	55,121,375
(H) 収 益 分 配 金	△116,103,637	△115,433,115	△115,257,404	△115,105,478	△114,940,988	△114,953,927
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△2,910,162,066	△2,531,077,266	△1,827,538,988	△2,066,611,003	△323,005,223	△59,832,552
追 加 信 託 差 損 益 金	△6,307,959,398	△6,253,128,883	△6,223,891,114	△6,187,261,344	△6,156,567,936	△6,129,804,612
(配 当 等 相 当 額)	(4,471,503,965)	(4,463,403,077)	(4,475,694,797)	(4,497,743,190)	(4,511,068,666)	(4,539,755,796)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△10,779,463,363)	(△10,716,531,960)	(△10,699,585,911)	(△10,685,004,534)	(△10,667,636,602)	(△10,669,560,408)
分 配 準 備 積 立 金	3,397,797,332	3,722,051,617	4,396,352,126	4,254,721,030	5,833,562,713	6,069,972,060
繰 越 損 益 金	-	-	-	△134,070,689	-	-

(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) 分配金の計算過程

項 目	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期	第 172 期
(a) 経費控除後の配当等収益	50,910,764円	43,738,804円	80,959,508円	7,162,209円	117,172,209円	89,037,172円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	862,895,430	433,214,080	733,265,220	0	1,602,303,011	289,735,374
(c) 収 益 調 整 金	4,471,503,965	4,463,403,077	4,475,694,797	4,497,743,190	4,511,068,666	4,539,755,796
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,600,094,775	3,360,531,848	3,697,384,802	4,362,664,299	4,229,028,481	5,806,153,441
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	7,985,404,934	8,300,887,809	8,987,304,327	8,867,569,698	10,459,572,367	10,724,681,783
(f) 1万口当たり当期分配対象額	3,095.02	3,235.99	3,508.92	3,466.74	4,094.98	4,198.30
(g) 分 配 金	116,103,637	115,433,115	115,257,404	115,105,478	114,940,988	114,953,927
(h) 1万口当たり分配金	45	45	45	45	45	45

## ■分配金のお知らせ

決算期	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期	第 172 期
1 万口当たり分配金	45円	45円	45円	45円	45円	45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）。

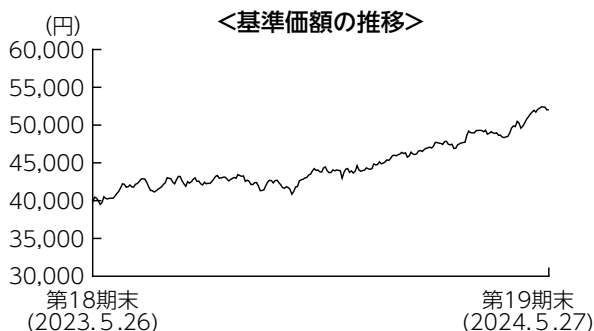
## ■当期中の基準価額の推移

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		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	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。