

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	追加型投信/海外/株式
	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	追加型投信/国内/債券
信託期間	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	約15年間（2011年4月19日 ～2026年4月17日）
	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	約14年11カ月間（2011年5 月16日～2026年4月17日）
運用方針	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	信託財産の成長をめざして運用 を行ないます。
	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	安定した収益の確保をめざして 安定運用を行ないます。
主要投資対象	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	世界（※）の金融商品取引所上 場株式および店頭登録株式（上 場予定および店頭登録予定を含 みます。また、D R（預託証 券）を含みます。）（※）日本 を除きます。
	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	イ、ダイワ・マネーストック・ マザーファンド（以下「マ ザーファンド」といいま す。）の受益証券 □、円建ての債券
組入制限	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	・株式組入上限比率は無制限
	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	・マザーファンド組入上限比率 は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総 額の10%以下
分配方針	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	分配対象額は、経費控除後の配 当等収益と売買益（評価益を含 みます。）等とし、原則として、 基準価額の水準等を勘案して 分配金額を決定します。ただ し、分配対象額が少額の場合に は、分配を行なわないことがあ ります。
	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	分配対象額は、経費控除後の配 当等収益とし、原則として、基 準価額の水準等を勘案して分配 金額を決定します。ただし、分 配対象額が少額の場合には、分 配を行なわないことがあります。

# ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ

## 運用報告書（全体版） 第10期

（決算日 2021年4月19日）

（作成対象期間 2020年4月21日～2021年4月19日）

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申  
上げます。

当ファンドは、（世界厳選株）世界の株式  
に投資し、信託財産の成長をめざすこと、  
（世界厳選株マネー）円建ての債券に投資  
し、安定した収益の確保をめざすことを目的  
としております。当作成期につきましてもそ  
れに沿った運用を行ないました。ここに、運  
用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、  
お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
（営業日の9：00～17：00）

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

<4797>  
<4799>

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数(円換算)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率			
6期末(2017年4月18日)	円 14,962	円 600	% 19.1	18,674	% 12.0	% 96.5	% -	百万円 10,443
7期末(2018年4月18日)	16,929	450	16.2	20,961	12.2	96.5	-	9,060
8期末(2019年4月18日)	17,138	0	1.2	22,596	7.8	94.7	-	7,805
9期末(2020年4月20日)	12,282	0	△28.3	20,317	△10.1	96.4	-	5,016
10期末(2021年4月19日)	20,047	2,200	81.1	30,152	48.4	96.0	-	6,828

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIコクサイ指数(円換算)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

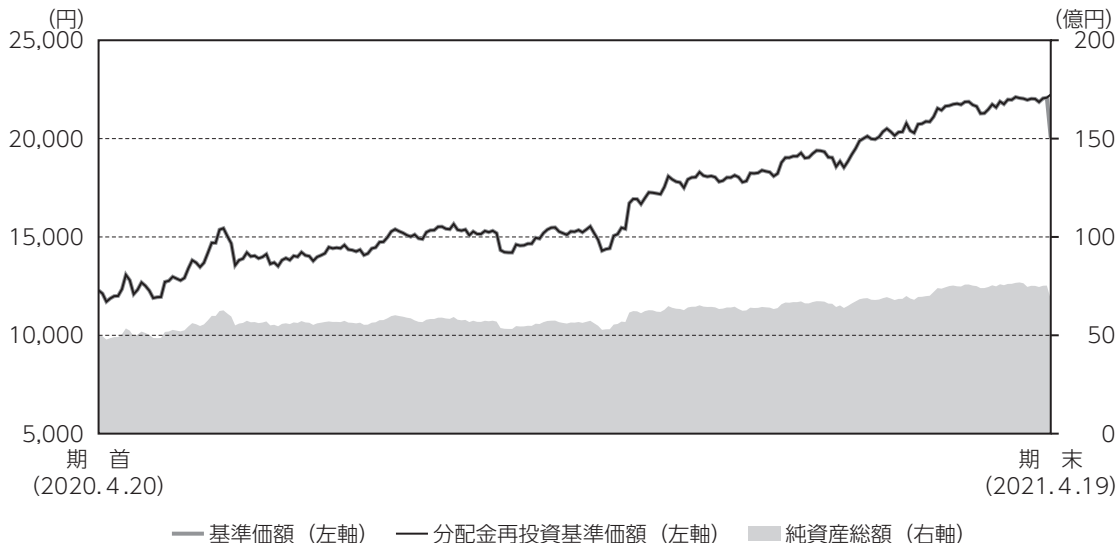
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に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。

\* 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（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：12,282円

期末：20,047円（分配金2,200円）

騰落率：81.1%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

海外の株式市況が大幅に上昇したことや、米ドルおよびユーロが対円で上昇（円安）したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数(円換算)		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2020年 4月20日	円 12,282	% -	20,317	% -	% 96.4	% -
4 月末	13,076	6.5	20,687	1.8	96.3	-
5 月末	13,692	11.5	21,522	5.9	97.2	-
6 月末	13,819	12.5	21,904	7.8	97.3	-
7 月末	14,075	14.6	22,576	11.1	96.8	-
8 月末	15,524	26.4	24,301	19.6	97.5	-
9 月末	14,558	18.5	23,317	14.8	97.8	-
10月末	14,380	17.1	22,646	11.5	96.6	-
11月末	17,772	44.7	25,232	24.2	96.8	-
12月末	18,335	49.3	25,929	27.6	96.9	-
2021年 1 月末	18,843	53.4	26,463	30.3	96.6	-
2 月末	20,400	66.1	27,373	34.7	97.2	-
3 月末	21,886	78.2	29,075	43.1	96.4	-
(期末) 2021年 4月19日	22,247	81.1	30,152	48.4	96.0	-

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

## 投資環境について

(2020.4.21～2021.4.19)

### ■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より2020年8月末にかけて、各国の大胆な景気刺激策や経済活動再開期待、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などを好感し、上昇しました。特に米国やインド、ドイツといった国々の株式市況は大幅上昇となりました。その後9月に入ると、高値警戒感や欧州での感染再拡大による行動制限を嫌気したことなどから、米国ハイテク株や欧州を中心に各国の株式市況は下落基調へと転換しました。11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、米国での大規模経済対策などの政策期待から、各国の株式市況は大幅に上昇しました。2021年1月末から3月上旬にかけては、経済活動の正常化期待から全体的に堅調な展開になりました。しかしながら、これまで相場のけん引役だったハイテクグロース株については、金利上昇に伴い、相対的に軟調な展開となりました。当作成期末にかけては、欧州や米国株式市況は堅調に推移した一方で、新興国の株式市況はやや軟調な展開となりました。

### ■為替相場

米ドルとユーロの対円為替相場は上昇しました。

米ドルとユーロの対円相場は、各国の大胆な景気刺激策や新型コロナウイルスのワクチン実用化などから経済活動の正常化期待が高まり、リスク選好的な相場展開となったことから、対円で上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資してまいります。地政学リスクや中央銀行の政策変更などによる一時的な株価調整局面は、企業の本源的価値に対して割安な水準で投資する機会と捉え、短期的な損益ではなく、長期投資のリターンを追求していきます。

地域別では、米国に加えて本源的価値と比較して割安な銘柄が多い英国、ドイツ、スイスなど欧米中心のポートフォリオを維持します。

## ポートフォリオについて

(2020.4.21～2021.4.19)

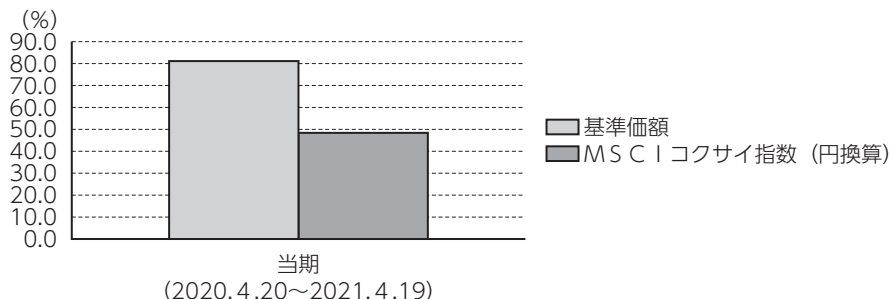
当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、ハリス・アソシエイツ・エル・ピーに運用の指図にかかる権限を委託しております。

株式組入比率は、高位に維持しました。銘柄選定にあたって、ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資しました。個別銘柄では、ALPHABET（米国、コミュニケーション・サービス）、MASTERCARD（米国、情報技術）、TE CONNECTIVITY（米国、情報技術）などを高位で組み入れました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数は海外株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年4月21日 ～2021年4月19日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>2,200</b>
対基準価額比率	（％）	9.89
当期の収益	（円）	2,200
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	10,046

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）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。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	158.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	4,786.62
(c) 収益調整金		2,882.11
(d) 分配準備積立金		4,419.96
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		12,246.70
(f) 分配金		2,200.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		10,046.70

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資してまいります。地政学リスクや中央銀行の政策変更などによる一時的な株価調整局面は、企業の本源的価値に対して割安な水準で投資する機会と捉え、短期的な損益ではなく、長期投資のリターンを追求していきます。

地域別では、米国に加えて本源的価値と比較して割安な銘柄が多いドイツ、英国、スイスなど欧米中心のポートフォリオを維持します。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.4.21～2021.4.19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	329円	1.974%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,664円です。
(投 信 会 社)	(192)	(1.152)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(128)	(0.768)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(9)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	5	0.030	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(5)	(0.030)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	7	0.040	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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)	(7)	(0.040)	
そ の 他 費 用	23	0.136	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(10)	(0.059)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(12)	(0.072)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	363	2.180	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

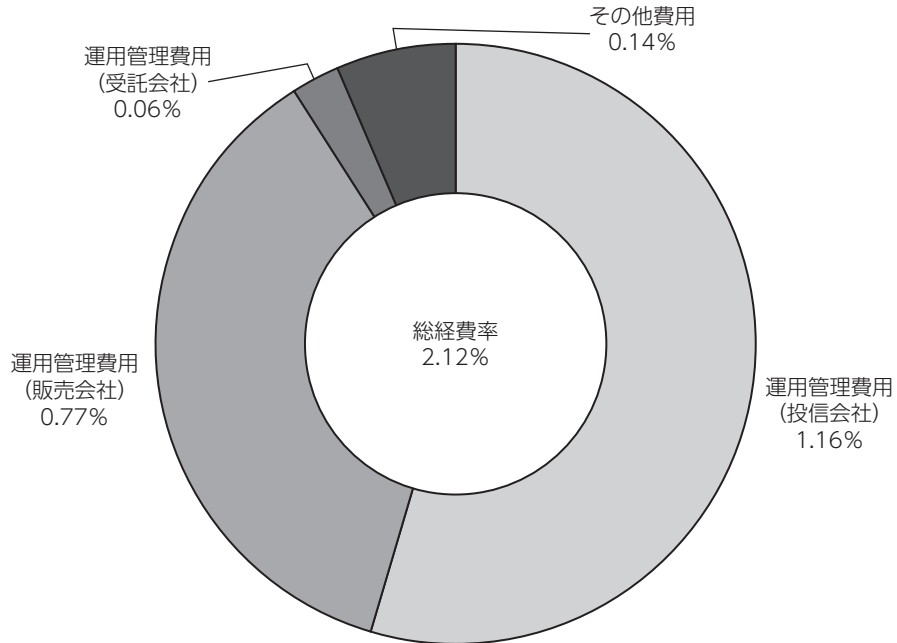
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.12%です。



(注1) 1万口当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。

■売買および取引の状況

(1) 株式

(2020年4月21日から2021年4月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外				
アメリカ	百株 1,261.55 (△ 12.1)	千アメリカ・ドル 5,621 (△ 301)	百株 3,097.55	千アメリカ・ドル 18,730
オーストラリア	百株 1,795.26 ( )	千オーストラリア・ドル 359 ( )	百株 2,906	千オーストラリア・ドル 749
香港	百株 366 (96.8)	千香港ドル 8,516 (1,939)	百株 97	千香港ドル 2,472
イギリス	百株 29,132 (4,210)	千イギリス・ポンド 2,159 (121)	百株 26,376.1	千イギリス・ポンド 3,249
スイス	百株 877.55 ( )	千スイス・フラン 1,766 (△ 110)	百株 1,182.52	千スイス・フラン 3,288
インド	百株 771 ( )	千インド・ルピー 32,052 ( )	百株 741	千インド・ルピー 51,980
韓国	百株 ( )	千韓国ウォン ( )	百株 107	千韓国ウォン 750,835
南アフリカ	百株 43.35 ( )	千南アフリカ・ランド 14,019 ( )	百株 68.45	千南アフリカ・ランド 23,178
ユーロ (アイルランド)	百株 27 ( )	千ユーロ 30 ( )	百株 -	千ユーロ -
ユーロ (オランダ)	百株 318 ( )	千ユーロ 199 ( )	百株 2,023	千ユーロ 2,122
ユーロ (ベルギー)	百株 135.35 ( )	千ユーロ 691 ( )	百株 18.05	千ユーロ 102
国				

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外				
ユーロ (フランス)	百株 42.85 ( )	千ユーロ 602 ( )	百株 5.05	千ユーロ 76
ユーロ (ドイツ)	百株 483.5 ( )	千ユーロ 3,301 ( )	百株 561.05	千ユーロ 3,610
ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 1,006.7 ( )	千ユーロ 4,825 ( )	百株 2,607.15	千ユーロ 5,911

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2020年4月21日から2021年4月19日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外				
国				
スイス	証券 (16,240)	千スイス・フラン ( )	証券 ( )	千スイス・フラン 2 ( )

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年4月21日から2021年4月19日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	5,969,666千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,849,986千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.02

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株式

(2020年4月21日から2021年4月19日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
BAYER AG-REG (ドイツ)	千株 30.975	千円 186,701	円 6,027	MASTERCARD INC - A (アメリカ)	千株 7.62	千円 271,908	円 35,683
HUMANA INC (アメリカ)	3	130,308	43,436	CNH INDUSTRIAL NV (オランダ)	202.3	270,588	1,337
SAP SE (ドイツ)	9.46	127,415	13,468	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES (ドイツ)	32.42	215,901	6,659
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	36.6	117,259	3,203	RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR (アイルランド)	18.325	176,576	9,635
LLOYDS BANKING GROUP PLC (イギリス)	2,797.9	113,472	40	PINTEREST INC-CLASS A (アメリカ)	26.8	167,369	6,245
NOVARTIS AG-REG (スイス)	11.755	110,549	9,404	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	6.845	158,270	23,122
NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	4.335	99,170	22,876	GENERAL MOTORS CO (アメリカ)	28.5	135,629	4,758
PRUDENTIAL PLC (イギリス)	64.1	97,906	1,527	BAYER AG-REG (ドイツ)	17.595	132,254	7,516
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG (スイス)	76	95,287	1,253	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.635	128,860	202,929
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV (ベルギー)	13.535	88,530	6,540	CORELOGIC INC (アメリカ)	17.5	122,803	7,017

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表  
外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	
HOWMET AEROSPACE INC	560	386	1,262	137,152	資本財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	131.45	-	-	-	金融
CITIGROUP INC	258.4	96.55	699	76,008	情報技術
TE CONNECTIVITY LTD	297.15	203.45	2,714	294,905	一般消費財・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	5.2	-	-	-	資本財・サービス
CORELOGIC INC	175	-	-	-	情報技術
FLOWSERVE CORP	-	247	988	107,409	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	472	526	1,392	151,289	コミュニケーション・サービス
FISERV INC	-	54.35	679	73,874	情報技術
GENERAL MOTORS CO	797.78	512.78	3,010	327,124	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	-	36.7	677	73,563	資本財・サービス
ALPHABET INC-CL C	22.57	16.57	3,807	413,710	ヘルスケア
HUMANA INC	-	26.8	1,166	126,757	コミュニケーション・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	209.65	-	-	-	コミュニケーション・サービス
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	229.85	59.15	635	69,086	資本財・サービス
TENET HEALTHCARE CORP	414.33	304.33	1,656	179,958	ヘルスケア
PINTEREST INC- CLASS A	168	-	-	-	コミュニケーション・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.05	2.75	681	74,013	一般消費財・サービス
ENVISTA HOLDINGS CORP	309	243	1,033	112,271	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	35.5	27.3	1,759	191,147	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	182.1	-	-	-	資本財・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	167.5	129.6	809	88,000	資本財・サービス
ORACLE CORP	241.4	187.25	1,478	160,636	情報技術
MASTERCARD INC- A	113.45	37.25	1,438	156,305	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	30.55	-	-	-	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	819	637	2,493	270,982	金融
NOV INC	412.95	553.95	733	79,694	エネルギー
KEURIG DR PEPPER INC	-	208	749	81,387	生活必需品
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	568	430	1,315	142,974	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEvisa SA-SPON ADR	789	676	880	95,710	コミュニケーション・サービス
ARCONIC CORP	169	133	368	40,031	素材
アメリカ・ドル	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	7,582.88	5,734.78	32,431	3,523,996	
	<26銘柄数<比率>	<24銘柄数<比率>	<51.6%>		
(オーストラリア)	百株	百株	千円	千円	
INCITEC PIVOT LTD	6,971.48	5,860.74	1,611	135,141	素材
オーストラリア・ドル	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	6,971.48	5,860.74	1,611	135,141	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<2.0%>		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	-	365.8	8,618	120,483	一般消費財・サービス
香港ドル	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	-	365.8	8,618	120,483	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<1.8%>		
(イギリス)	百株	百株	千円	千円	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,519	-	-	-	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	167.21	332.21	515	77,445	金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	38.1	-	-	-	生活必需品
LLOYD'S BANKING GROUP PLC	42,974	51,404	2,234	335,460	金融
COMPASS GROUP PLC	-	114	181	27,192	一般消費財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	665	479	794	119,362	資本財・サービス
イギリス・ポンド	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	45,363.31	52,329.21	3,725	559,460	
	<5銘柄数<比率>	<4銘柄数<比率>	<8.2%>		

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千円	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2,237	2,288	2,265	267,374	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	422.4	221.05	1,328	156,869	金融
NOVARTIS AG-REG	-	103.5	837	98,800	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	137.85	15.3	147	17,373	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	135.57	-	-	-	素材
スイス・フラン	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	2,932.82	2,627.85	4,578	540,418	
	<4銘柄数<比率>	<4銘柄数<比率>	<7.9%>		
(インド)	百株	百株	千円	千円	
AXIS BANK LTD	499	529	35,400	52,038	金融
インド・ルピー	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	499	529	35,400	52,038	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<0.8%>		
(韓国)	百株	百株	千円	千円	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	107	-	-	-	情報技術
韓国ウォン	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	107	-	-	-	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<->		
(南アフリカ)	百株	百株	千円	千円	
NASPERS LTD-N SHS	98.35	73.25	26,003	197,368	一般消費財・サービス
南アフリカ・ランド	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
通貨計	98.35	73.25	26,003	197,368	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<2.9%>		
ユーロ(アイルランド)	百株	百株	千円	千円	
RYANAIR HOLDINGS PLC	-	27	43	5,615	資本財・サービス
ユーロ	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
国小計	-	27	43	5,615	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<0.1%>		
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千円	千円	
CNH INDUSTRIAL NV	2,667	962	1,282	166,754	資本財・サービス
ユーロ	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
国小計	2,667	962	1,282	166,754	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<2.4%>		
ユーロ(ベルギー)	百株	百株	千円	千円	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	-	117.3	665	86,561	生活必需品
ユーロ	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
国小計	-	117.3	665	86,561	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<1.3%>		
ユーロ(フランス)	百株	百株	千円	千円	
CAPGEMINI SE	-	37.8	572	74,441	情報技術
ユーロ	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
国小計	-	37.8	572	74,441	
	<1銘柄数<比率>	<1銘柄数<比率>	<1.1%>		
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千円	千円	
BAYER AG-REG	276.35	410.15	2,214	287,903	ヘルスケア
CONTINENTAL AG	145.8	125.25	1,472	191,434	一般消費財・サービス
ALLIANZ SE-REG	75.8	82.8	1,811	235,444	金融
SAP SE	-	83.6	971	126,298	情報技術
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	533.1	251.7	1,947	253,208	一般消費財・サービス
ユーロ	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額	
国小計	1,031.05	953.5	8,418	1,094,288	
	<4銘柄数<比率>	<5銘柄数<比率>	<16.0%>		
ユーロ通貨計	3,698.05	2,097.6	10,982	1,427,662	
	<5銘柄数<比率>	<9銘柄数<比率>	<20.9%>		
ファンダ合計	67,252.89	69,618.23	-	6,556,569	
	<44銘柄数<比率>	<45銘柄数<比率>	<96.0%>		

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年4月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	6,556,569	85.7
コール・ローン等、その他	1,096,301	14.3
投資信託財産総額	7,652,871	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、4月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1オーストラリア・ドル=83.85円、1香港ドル=13.98円、1イギリス・ポンド=150.16円、1スイス・フラン=118.04円、1スウェーデン・クローネ=12.85円、1インド・ルピー=1.47円、100韓国ウォン=9.73円、1南アフリカ・ランド=7.59円、1ユーロ=129.99円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(6,730,181千円)の投資信託財産総額(7,652,871千円)に対する比率は、87.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年4月19日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>7,816,494,254円</b>
コール・ローン等	199,458,262
株式(評価額)	6,556,569,889
未収入金	1,051,338,323
未収配当金	9,127,780
<b>(B) 負債</b>	<b>987,648,616</b>
未払金	163,623,180
未払収益分配金	749,422,974
未払解約金	9,009,960
未払信託報酬	65,410,459
その他未払費用	182,043
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>6,828,845,638</b>
元本	3,406,468,066
次期繰越損益金	3,422,377,572
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,406,468,066口</b>
<b>1万口当り基準価額(C / D)</b>	<b>20,047円</b>

\* 期首における元本額は4,084,721,368円、当作成期間中における追加設定元本額は295,079,798円、同解約元本額は973,333,100円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,047円です。

■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2021年4月19日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>56,006,069円</b>
受取配当金	56,041,740
受取利息	12,052
支払利息	△ 47,723
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>3,249,114,797</b>
売買益	3,650,702,493
売買損	△ 401,587,696
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 129,062,927</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>3,176,057,939</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>13,960,742</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>981,781,865</b>
(配当等相当額)	( 943,123,393)
(売買損益相当額)	( 38,658,472)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>4,171,800,546</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 749,422,974</b>
<b>次期繰越損益金(G + H)</b>	<b>3,422,377,572</b>
追加信託差損益金	981,781,865
(配当等相当額)	( 943,123,393)
(売買損益相当額)	( 38,658,472)
分配準備積立金	2,440,595,707

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

(注4) 投資信託財産の運用に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：39,557,496円(未監査)

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	53,824,906円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,630,548,253
(c) 収益調整金	981,781,865
(d) 分配準備積立金	1,505,645,522
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	4,171,800,546
(f) 分配金	749,422,974
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,422,377,572
(h) 受益権総口数	3,406,468,066口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	2,200円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・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）、残りの額が普通分配金です。
- ・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個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間を約5年間延長し、信託期間終了日を2021年4月16日から2026年4月17日に変更しました。

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	純資産総額
	(分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 中 率		
6 期末(2017年 4月18日)	円 10,006	円 0	% △0.1	% 26.7	百万円 616
7 期末(2018年 4月18日)	9,999	0	△0.1	—	185
8 期末(2019年 4月18日)	9,990	0	△0.1	—	166
9 期末(2020年 4月20日)	9,984	0	△0.1	—	88
10 期末(2021年 4月19日)	9,980	0	△0.0	—	300

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

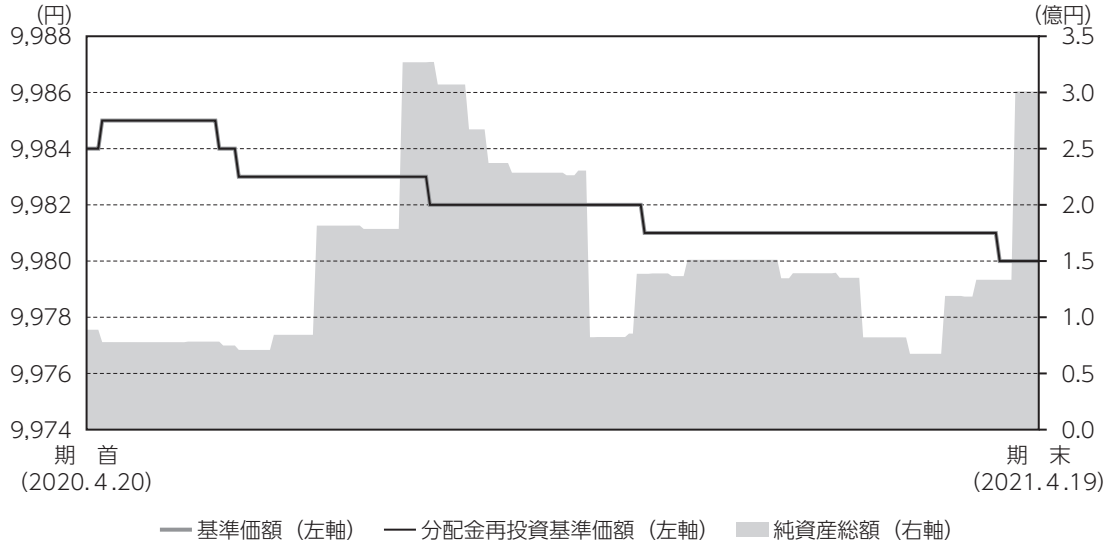
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注4) 当ファンドは、ダイワ／ハリス世界厳選株ファンドの資金をスイッチングにより一時滞留させる受け皿としての役割をもったファンドであり、円建ての債券を中心に、安定運用を行ないます。そのため、ベンチマークおよび参考指数はありません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に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。

\* 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（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：9,984円

期末：9,980円（分配金0円）

騰落率：△0.0%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の受益証券を通じて投資したコール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公 組 入 社 比	債 率
		騰	落		
(期首) 2020年 4月20日	円 9,984	% -			% -
4月末	9,985	0.0			-
5月末	9,985	0.0			-
6月末	9,983	△0.0			-
7月末	9,983	△0.0			-
8月末	9,982	△0.0			-
9月末	9,982	△0.0			-
10月末	9,982	△0.0			-
11月末	9,981	△0.0			-
12月末	9,981	△0.0			-
2021年 1月末	9,981	△0.0			-
2月末	9,981	△0.0			-
3月末	9,981	△0.0			-
(期末) 2021年 4月19日	9,980	△0.0			-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。



## 投資環境について

(2020.4.21～2021.4.19)

### ■国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

### ■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

## ポートフォリオについて

(2020.4.21～2021.4.19)

### ■当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いません。

### ■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年4月21日 ～2021年4月19日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	9

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益です。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

### ■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

上記の運用方針により、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資する場合があります。今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご留意くださいますようお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020.4.21～2021.4.19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	一円	—%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,982円です。
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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
そ の 他 費 用	0	0.003	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.003	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

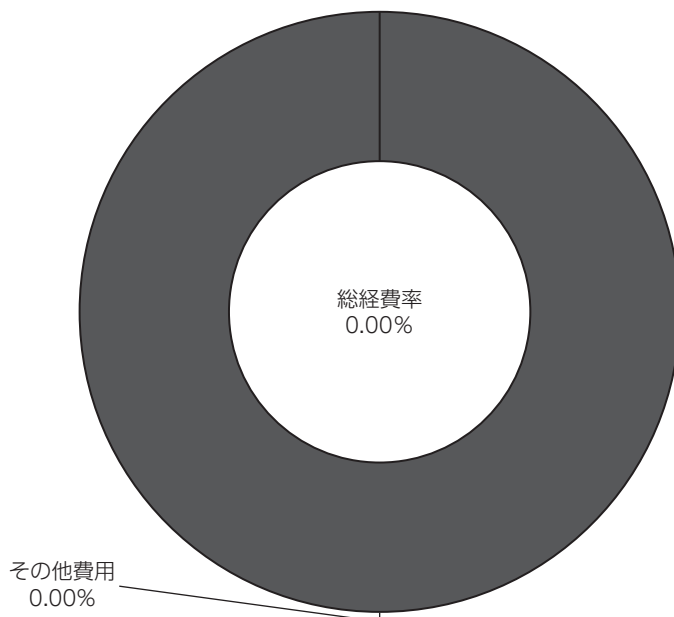
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## 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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.00%です。



(注1) 1万口当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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年4月21日から2021年4月19日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	570,073	570,685	360,768	361,159

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	88,359	297,664	297,932			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年4月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	297,932	99.0
コール・ローン等、その他	3,013	1.0
投資信託財産総額	300,945	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年4月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	300,945,857円
コール・ローン等	3,013,716
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	297,932,141
(B) 負債	4,325
未払解約金	3,992
その他未払費用	333
(C) 純資産総額(A - B)	300,941,532
元本	301,542,638
次期繰越損益金	△ 601,106
(D) 受益権総口数	301,542,638口
1万口当り基準価額(C / D)	9,980円

\* 期首における元本額は89,037,889円、当作成期中における追加設定元本額は577,492,766円、同解約元本額は364,988,017円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,980円です。

\* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は601,106円です。

■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2021年4月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 465円
受取利息	1,078
支払利息	△ 1,543
(B) 有価証券売買損益	△ 20,347
売買益	21,570
売買損	△ 41,917
(C) 信託報酬等	△ 729
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 21,541
(E) 前期繰越損益金	△ 3,677
(F) 追加信託差損益金	△575,888
(配当等相当額)	( 246,931)
(売買損益相当額)	(△822,819)
(G) 合計(D + E + F)	△601,106
次期繰越損益金(G)	△601,106
追加信託差損益金	△575,888
(配当等相当額)	( 246,931)
(売買損益相当額)	(△822,819)
分配準備積立金	30,648
繰越損益金	△ 55,866

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	30,617
(c) 収益調整金	246,931
(d) 分配準備積立金	31
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	277,579
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	277,579
(h) 受益権総口数	301,542,638口

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間を約5年間延長し、信託期間終了日を2021年4月16日から2026年4月17日に変更しました。

**<補足情報>**

当ファンド（ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ）が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2020年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年4月19日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

**■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄**

2020年4月21日～2021年4月19日における主要な売買銘柄はありません。

**■組入資産明細表**

2021年4月19日現在、有価証券等の組み入れはありません。

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド

## 運用報告書 第11期 (決算日 2020年12月9日)

(作成対象期間 2019年12月10日～2020年12月9日)

ダイワ・マネースtock・マザーファンド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。

運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

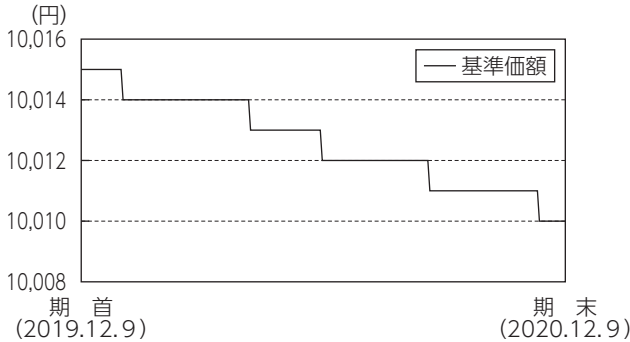
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>



■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 率
	騰 落 率	組 入 比 率	
(期首)2019年12月9日	円	%	%
12月9日	10,015	-	-
12月末	10,015	0.0	-
2020年 1 月 末	10,014	△0.0	-
2 月 末	10,014	△0.0	-
3 月 末	10,014	△0.0	-
4 月 末	10,013	△0.0	-
5 月 末	10,013	△0.0	-
6 月 末	10,012	△0.0	-
7 月 末	10,012	△0.0	-
8 月 末	10,011	△0.0	-
9 月 末	10,011	△0.0	-
10 月 末	10,011	△0.0	-
11 月 末	10,010	△0.0	-
(期末)2020年12月9日	10,010	△0.0	-

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。  
 (注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,015円 期末：10,010円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

◆ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。  
 (注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2020年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 88,460,615	% 100.0
投資信託財産総額	88,460,615	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	88,460,615,301円
コール・ローン等	88,460,615,301
(B) 負債	50,000,000
未払解約金	50,000,000
(C) 純資産総額(A - B)	88,410,615,301
元本	88,319,921,795
次期繰越損益金	90,693,506
(D) 受益権総口数	88,319,921,795口
1万口当り基準価額(C/D)	10,010円

\* 期首における元本額は103,532,314,258円、当作成期間中における追加設定元本額は103,255,612,211円、同解約元本額は118,468,004,674円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック-947,268円、ダイワ/ミレリアセット・インド株ファンド - インドの匠-29,910,270円、ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジあり) 998円、ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジなし) 998円、新興国ソブリン・豪ドルファンド (毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ブラジルレアルファンド (毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型) 999円、US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型) 102,434円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (為替ヘッジあり) 39,849円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり) 3,985円、iFreeレパレッジ S & P 500 1,249,412,852円、iFreeレパレッジ N A S D A Q 100 11,006,295,149円、米国4資産リスク分散ファンド (年2回決算型) 689,912円、グリーンテック株式ファンド (資産成長型) 998,802円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (毎月決算/予想分配金提示型) 999円、ダイワ上場投信-日経平均レパレッジ・インデックス2,927,475,552円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス6,683,086,104円、ダイワ上場投信-TOP I Xレパレッジ (2倍) 指数1,085,050,377円、ダイワ上場投信-TOP I Xダブルインバース (-2倍) 指数1,226,094,880円、ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス25,058,858,800円、ダイワ上場投信-TOP I Xインバース (-1倍) 指数11,170,317,850円、ダイワ上場投信-J P X日経400レパレッジ・インデックス387,469,071円、ダイワ上場投信-J P X日経400インバース・インデックス611,537,975円、ダイワ上場投信-J P X日経400ダブルインバース・インデックス141,884,108円、ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016-10 997円、先進国トータルリターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用) 6,988,339,549円、ダイワ日本株ベア・ファンド (適格機関投資家専用) 19,374,063,390円、低リスク型アロケーションファンド (金利トレンド判断付き/適格機関投資家専用) 179,433,743円、ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - S Lトレード-5,091,608円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ149,382,442円、ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ5,609,419円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 豪ドル・コース (毎月分配型) 595,106円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII ブラジル・レアル・コース (毎月分配型) 987,373円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 494,581円、ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型) 9,957円、ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり) 997円、ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジなし) 997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり) 997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジなし) 997円、ダイワ/ミレリアセット・細細株株式ファンド9,958,176円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 米ドル・コース1,989,053円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・レアル・コース2,978,118円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース1,691,241円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回) -100,588円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり (毎月分配型) 399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし (毎月分配型) 99,771円、通貨選択型ダイワ先進

国リートα 円ヘッジコース (毎月分配型) 399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース (毎月分配型) 99,771円、ダイワ/ミレリアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジあり) 1,091,429円、ダイワ/ミレリアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジなし) 315,004円、ダイワ/ミレリアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド10,009,811円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 日本円・コース (毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型) 99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- ブラジル・レアル・コース (毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 日本円・コース300,273円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 豪ドル・コース200,861円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 ブラジル・レアル・コース300,273円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 米ドル・コース1,999,177円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース505,900円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,010円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月10日 至2020年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 34,974,173円
受取利息	1,075,374
支払利息	△ 36,049,547
(B) その他費用	△ 1,522,123
(C) 当期損益金(A + B)	△ 36,496,296
(D) 前期繰越損益金	156,051,230
(E) 解約差損益金	△161,476,434
(F) 追加信託差損益金	132,615,006
(G) 合計(C + D + E + F)	90,693,506
次期繰越損益金(G)	90,693,506

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。