

# ダイワ・グローバル IoT関連株ファンド - A | 新時代 - (為替ヘッジあり / 為替ヘッジなし)

## 運用報告書 (全体版) 第9期

(決算日 2021年10月13日)  
(作成対象期間 2021年4月14日～2021年10月13日)

■信託期間を5年間延長し、信託期間終了日を  
2022年4月13日から2027年4月13日に変更しました。

### 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し上げます。

当ファンドは、世界のIoT関連企業の株式に投資し、信託財産の成長をめざしております。当完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/>

<2716>  
<2717>

### ★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 / 内外 / 株式	
信託期間	約10年間 (2017年4月21日～2027年4月13日)	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	為替ヘッジあり	イ. グローバルIoT関連株ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用) の受益証券 ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジなし	イ. グローバルIoT関連株ファンド (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用) の受益証券 ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
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。	
分配方針	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、分配を行わないことがあります。	

為替ヘッジあり

最近５期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース)		公社債 組入比率	投資信託 組入比率	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			
5期末(2019年10月15日)	円 11,479	円 0	% △ 3.6	12,408	% 1.3	% －	% 99.5	百万円 21,412
6期末(2020年 4月13日)	11,490	0	0.1	11,319	△ 8.8	－	99.5	17,852
7期末(2020年10月13日)	15,448	750	41.0	14,423	27.4	－	98.9	20,323
8期末(2021年 4月13日)	16,298	1,700	16.5	17,048	18.2	－	99.1	19,359
9期末(2021年10月13日)	16,091	650	2.7	17,718	3.9	－	98.4	17,542

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World指数（配当込み、米ドルベース）は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCI AC World指数（配当込み、米ドルベース）の原データをもとに、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 AC World指数（配当込み、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。

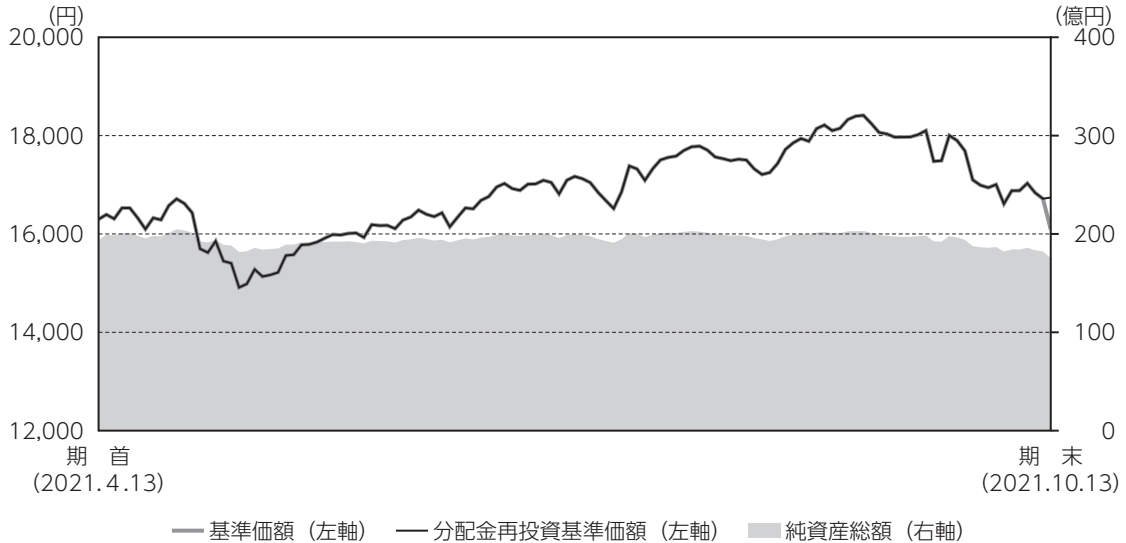
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。



## 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はありません。

\* 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：16,298円

期末：16,091円 (分配金650円)

騰落率：2.7% (分配金込み)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は、保有銘柄の株価が上昇したことがプラス要因となり、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・グローバルIOT関連株ファンドーA I新時代ー (為替ヘッジあり)

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース)		公 社 債 組 入 比	投 資 信 託 受 組 証 券	入 益 証 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首) 2021年 4月13日	16,298	% -	17,048	% -	% -	% -	99.1
4 月末	16,429	0.8	17,421	2.2	-	-	98.1
5 月末	15,988	△ 1.9	17,540	2.9	-	-	99.0
6 月末	17,026	4.5	17,825	4.6	-	-	99.2
7 月末	17,506	7.4	18,047	5.9	-	-	99.4
8 月末	18,215	11.8	18,353	7.7	-	-	99.3
9 月末	16,990	4.2	17,726	4.0	-	-	99.2
(期末) 2021年10月13日	16,741	2.7	17,718	3.9	-	-	98.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

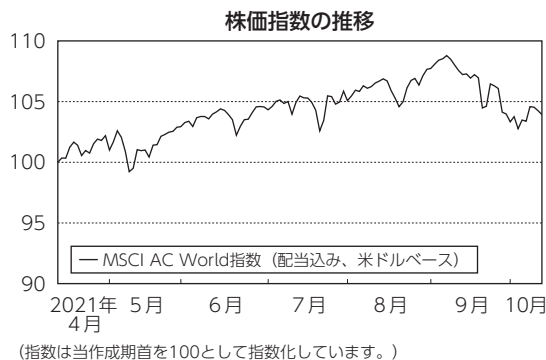
## 投資環境について

(2021.4.14~2021.10.13)

### ■グローバル株式市況

グローバル株式市況は上昇しました。

グローバル株式市場は、当作成期首から2021年6月末にかけて、新型コロナウイルスの変異株の世界的な感染拡大やインフレ圧力に対する警戒感などを受け、軟調に推移する場面もみられました。しかし主要国における経済活動の正常化観測や好調な経済指標の発表が支援材料となり、おおむね堅調に推移しました。9月上旬にかけては、中国当局による各種産業に対する規制強化方針が株価の重しとなりましたが、FRB（米国連邦準備制度理事会）のインフレは一時的との見方や良好な企業決算が好感され、株価は上昇しました。当作成期末にかけては、中国の大手不動産会社の経営不安や米国長期金利の上昇、債務上限を巡る米国議会の混乱などが嫌気され、株価は上昇幅を縮小しました。



## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）：グローバルIOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）  
（適格機関投資家専用）

### ■IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）

当ファンドは、幅広いIOT（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

多くの地政学的、経済的不確実性は依然として存在するものの、IOTの中長期的な見通しはますます強固なものになっています。具体的には、AI（人工知能）や5G（第5世代移動通信システム）な

どの技術は、DX（デジタルトランスフォーメーション）を推進する新たなアプリケーションやソリューションを生み出しています。ＩｏＴ技術の発展や発展の進んだ分野は、私たちを取り巻く世界を自動化するだけでなく、その他の多くの分野においても大きな成長をもたらすと考えます。引き続き、高い成長が期待されるＩｏＴ関連銘柄に投資を行うことで、ファンドの成長をめざしてまいります。

また、保有する実質外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

#### ■ダイワ・マネー・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

(2021.4.14～2021.10.13)

#### ■当ファンド

当ファンドは、ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）とダイワ・マネー・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。当作成期は、ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）を高位に組み入れました。

#### ■ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）

当ファンドは、幅広いＩｏＴ（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の３つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行いました。

ポートフォリオにおいては、ＩｏＴ関連産業からの投資拡大の恩恵を受ける半導体、ＩｏＴの浸透により一段の成長が期待できるヘルスケア機器、オートメーション化などの恩恵を受ける電気部品・設備関連企業などの組入比率を高位としました。当作成期末の組入上位銘柄は、RFID（無線通信による自動認識システム）およびバーコードスキャナ技術を保持するゼブラ・テクノロジーズ（情報技術）、データセンターやゲーム市場向けに強みをもつ半導体メーカーのエヌビディア（情報技術）、ビル・電力・データセンターなどに使用されるインダストリアルＩｏＴテクノロジーを保持するシュナイダー・エレクトリック（資本財・サービス）などでした。

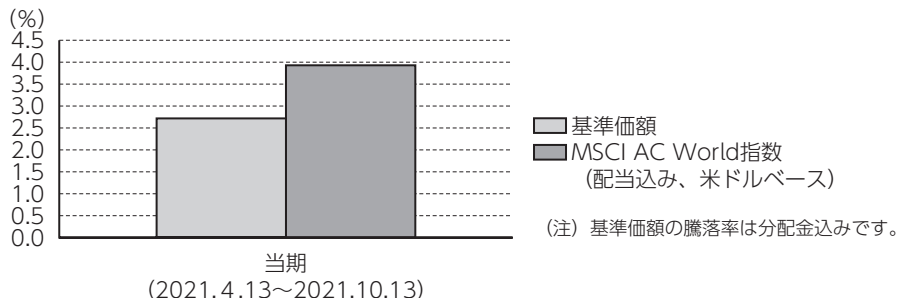
また、保有する実質外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

#### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、現先取引やコール・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。



## 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	
	2021年4月14日 ~2021年10月13日	
<b>当期分配金(税込み) (円)</b>		<b>650</b>
対基準価額比率 (%)		3.88
当期の収益 (円)		424
当期の収益以外 (円)		225
翌期繰越分配対象額 (円)		6,091

(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	0.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓ 424.73
(c) 収益調整金	1,746.76
(d) 分配準備積立金	✓ 4,569.65
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,741.14
(f) 分配金	650.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,091.14

(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

### ■当ファンド

ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

### ■ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）

当ファンドは、幅広いＩｏＴ（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の３つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

多くの地政学的、経済的不確実性は依然として存在するものの、ＩｏＴの中長期的な見通しはますます強固なものになっており、今後も、コネクティビティ（連結性）、セキュリティ、デバイスなどに対する需要増加から恩恵を受けると考えます。ＡＩ（人工知能）や５Ｇ（第５世代移動通信システム）などの技術は、ＤＸ（デジタルトランスフォーメーション）を推進する新たなアプリケーションやソリューションを生み出しています。発展するＩｏＴ技術・分野は、私たちを取り巻く世界を自動化するだけでなく、その他の多くの分野においても大きな成長をもたらすと考えます。引き続き、短期的なリスクに注意を払いつつ、中長期の視点で投資を続けていきます。

また、保有する実質外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

### ■ダイワ・マネー・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。



## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.4.14~2021.10.13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	104円	0.618%	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16,860円です。
(投 信 会 社)	(33)	(0.193)	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)	(70)	(0.414)	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)	(2)	(0.011)	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	—	—	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	1	0.004	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)	(1)	(0.004)	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
合 計	105	0.622	

(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。

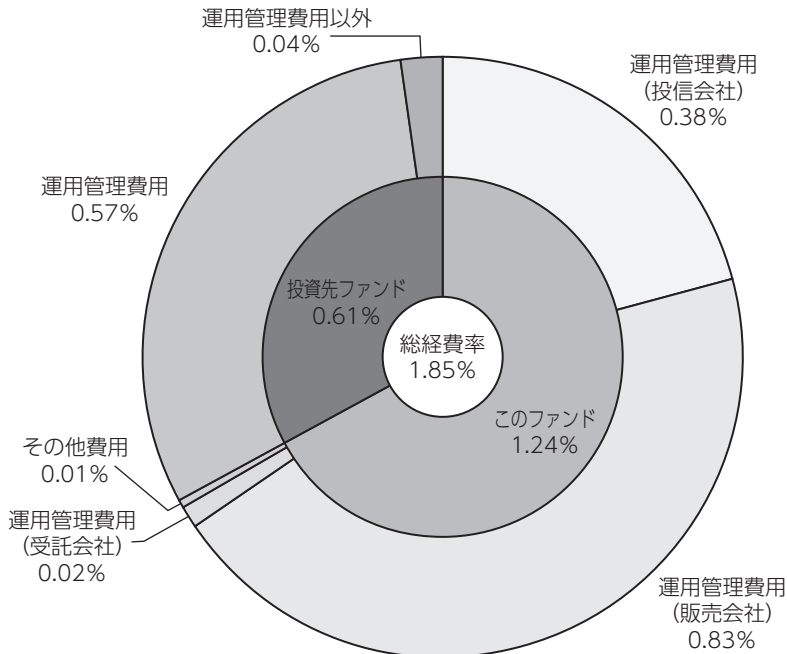
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.85%です。



総経費率 (①+②+③)	1.85%
①このファンドの費用の比率	1.24%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.57%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04%

(注1) ①の費用は、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。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 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。

■売買および取引の状況  
投資信託受益証券

(2021年4月14日から2021年10月13日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
国 内	グローバルIOT 関連株ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	328,251.511	687,000	1,490,805.549	3,279,000

(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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
国内投資信託受益証券 グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	7,897,210.163	17,258,563	98.4

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。  
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	977	977	994

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年10月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	17,258,563	93.9
ダイワ・マネー・マザーファンド	994	0.0
コール・ローン等、その他	1,128,954	6.1
投資信託財産総額	18,388,511	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10月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	18,388,511,668円
コール・ローン等	1,128,954,557
投資信託受益証券(評価額)	17,258,563,090
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	994,021
(B) 負債	846,366,740
未払収益分配金	708,614,227
未払解約金	16,272,435
未払信託報酬	120,672,105
その他未払費用	807,973
(C) 純資産総額(A - B)	17,542,144,928
元本	10,901,757,346
次期繰越損益金	6,640,387,582
(D) 受益権総口数	10,901,757,346口
1万口当り基準価額(C/D)	16,091円

\* 期首における元本額は11,878,342,316円、当作成期間中における追加設定元本額は967,965,533円、同解約元本額は1,944,550,503円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は16,091円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月14日 至2021年10月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 35,722円
受取利息	2,758
支払利息	△ 38,480
(B) 有価証券売買損益	584,539,965
売買益	721,470,655
売買損	△ 136,930,690
(C) 信託報酬等	△ 121,480,078
(D) 当期損益金(A + B + C)	463,024,165
(E) 前期繰越損益金	4,981,695,991
(F) 追加信託差損益金	1,904,281,653
(配当等相当額)	( 1,347,359,437)
(売買損益相当額)	( 556,922,216)
(G) 合計(D + E + F)	7,349,001,809
(H) 収益分配金	△ 708,614,227
次期繰越損益金(G + H)	6,640,387,582
追加信託差損益金	1,904,281,653
(配当等相当額)	( 1,347,359,437)
(売買損益相当額)	( 556,922,216)
分配準備積立金	4,736,141,778
繰越損益金	△ 35,849

(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	463,033,540
(c) 収益調整金	1,904,281,653
(d) 分配準備積立金	4,981,722,465
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	7,349,037,658
(f) 分配金	708,614,227
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,640,423,431
(h) 受益権総口数	10,901,757,346口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

650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5年間延長し、信託期間終了日を2022年4月13日から2027年4月13日に変更しました。

為替ヘッジなし

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		公社債 組入比率	投資信託 組入比率	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			
5期末(2019年10月15日)	円 11,657	円 0	% △ 5.8	12,307	% △ 1.9	% -	% 99.6	百万円 83,798
6期末(2020年4月13日)	11,547	0	△ 0.9	11,207	△ 8.9	-	99.5	66,176
7期末(2020年10月13日)	15,184	750	38.0	13,902	24.0	-	99.1	75,700
8期末(2021年4月13日)	16,780	1,700	21.7	17,090	22.9	-	99.3	71,828
9期末(2021年10月13日)	16,663	1,200	6.5	18,395	7.6	-	99.0	64,256

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCI AC World指数 (配当込み、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 AC World指数 (配当込み、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。

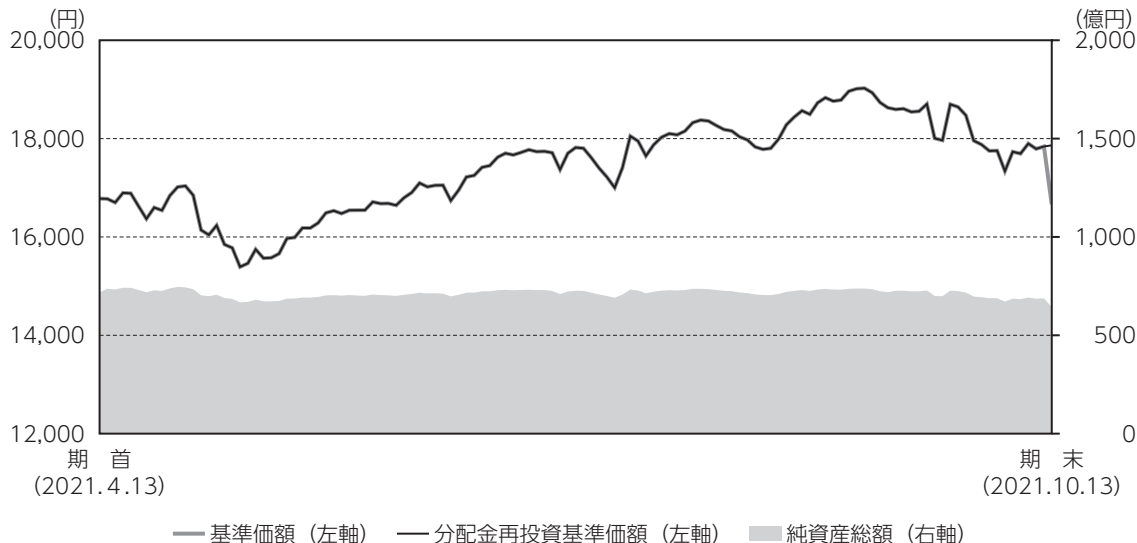
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。



## 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：16,780円

期末：16,663円 (分配金1,200円)

騰落率：6.5% (分配金込み)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は、保有銘柄の株価が上昇したことや、米ドルが対円で上昇 (円安) したことなどがプラス要因となり、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・グローバルIoT関連株ファンドーA | 新時代ー (為替ヘッジなし)

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 受 組 証 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2021年 4月13日	円 16,780	% -	17,090	% -	% -	% 99.3
4 月末	16,847	0.4	17,360	1.6	-	99.0
5 月末	16,533	△ 1.5	17,612	3.1	-	99.1
6 月末	17,702	5.5	18,032	5.5	-	99.4
7 月末	18,028	7.4	18,076	5.8	-	99.0
8 月末	18,832	12.2	18,452	8.0	-	99.4
9 月末	17,879	6.5	18,149	6.2	-	99.2
(期末) 2021年10月13日	17,863	6.5	18,395	7.6	-	99.0

(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

(2021.4.14~2021.10.13)

### ■グローバル株式市況

グローバル株式市況は上昇しました。

グローバル株式市場は、当作成期首から2021年6月末にかけて、新型コロナウイルスの変異株の世界的な感染拡大やインフレ圧力に対する警戒感を受け、軟調に推移する場面もみられました。しかし主要国における経済活動の正常化観測や好調な経済指標の発表が支援材料となり、おおむね堅調に推移しました。9月上旬にかけては、中国当局による各種産業に対する規制強化方針が株価の重しとなりましたが、F R B (米国連邦準備制度理事会) のインフレは一時的との見方や良好な企業決算が好感され、株価は上昇しました。当作成期末にかけては、中国の大手不動産会社の経営不安や米国長期金利の上昇、債務上限を巡る米国議会の混乱などが嫌気され、株価は上昇幅を縮小しました。

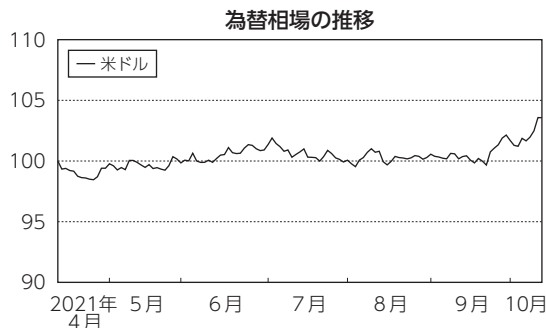


(指数は当作成期首を100として指数化しています。)

### ■為替相場

米ドル円相場は上昇しました。

米ドル円相場は、米国の利上げ開始時期の前倒し観測を受けて米国長期金利が上昇したことで、米ドルは対円で上昇しました。



(為替レートは対円で、当作成期首を100として指数化しています。)

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

I o T 関連株ファンド (為替ヘッジなし) の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。



※IOT関連株ファンド (為替ヘッジなし) : グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジなし)  
(適格機関投資家専用)

### ■IOT関連株ファンド (為替ヘッジなし)

当ファンドは、幅広いIOT (モノのインターネット) 関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

多くの地政学的、経済的不確実性は依然として存在するものの、IOTの中長期的な見通しはますます強固なものになっています。具体的には、AI (人工知能) や5G (第5世代移動通信システム) などの技術は、DX (デジタルトランスフォーメーション) を推進する新たなアプリケーションやソリューションを生み出しています。IOT技術の発展や発展の進んだ分野は、私たちを取り巻く世界を自動化するだけでなく、その他の多くの分野においても大きな成長をもたらすと考えます。引き続き、高い成長が期待されるIOT関連銘柄に投資を行うことで、ファンドの成長をめざしてまいります。

### ■ダイワ・マネー・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

(2021.4.14~2021.10.13)

### ■当ファンド

当ファンドは、IOT関連株ファンド (為替ヘッジなし) とダイワ・マネー・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。当作成期は、IOT関連株ファンド (為替ヘッジなし) を高位に組み入れました。

### ■IOT関連株ファンド (為替ヘッジなし)

当ファンドは、幅広いIOT (モノのインターネット) 関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行いました。

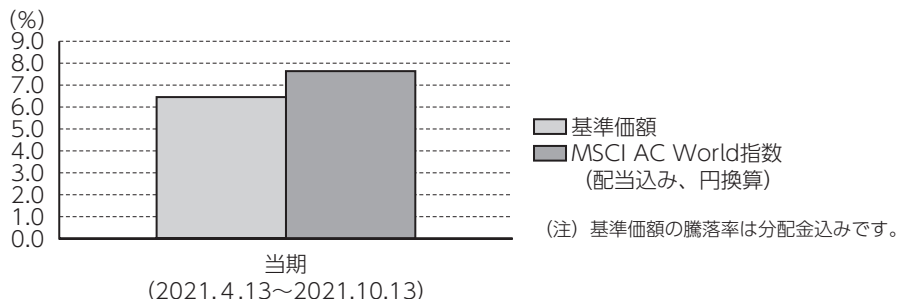
ポートフォリオにおいては、IOT関連産業からの投資拡大の恩恵を受ける半導体、IOTの浸透により一段の成長が期待できるヘルスケア機器、オートメーション化などの恩恵を受ける電気部品・設備関連企業などの組入比率を高位としました。当作成期末の組入上位銘柄は、RFID (無線通信による自動認識システム) およびバーコードスキャナ技術を保持するゼブラ・テクノロジーズ (情報技術)、データセンターやゲーム市場向けに強みをもつ半導体メーカーのエヌビディア (情報技術)、ビル・電力・データセンターなどに使用されるインダストリアルIOTテクノロジーを保持するシュナイダー・エレクトリック (資本財・サービス) などでした。

### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、現先取引やコール・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。



## 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	
	2021年4月14日 ～2021年10月13日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>(円)</b>	<b>1,200</b>
対基準価額比率	(%)	6.72
当期の収益	(円)	1,042
当期の収益以外	(円)	157
翌期繰越分配対象額	(円)	6,663

(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	0.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓ 1,042.63
(c) 収益調整金	2,209.41
(d) 分配準備積立金	✓ 4,611.14
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	7,863.19
(f) 分配金	1,200.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,663.19

(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

### ■当ファンド

IOT関連株ファンド（為替ヘッジなし）の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

### ■IOT関連株ファンド（為替ヘッジなし）

当ファンドは、幅広いIOT（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

多くの地政学的、経済的不確実性は依然として存在するものの、IOTの中長期的な見通しはますます強固なものになっており、今後も、コネクティビティ（連結性）、セキュリティ、デバイスなどに対する需要増加から恩恵を受けると考えます。AI（人工知能）や5G（第5世代移動通信システム）などの技術は、DX（デジタルトランスフォーメーション）を推進する新たなアプリケーションやソリューションを生み出しています。発展するIOT技術・分野は、私たちを取り巻く世界を自動化するだけでなく、その他の多くの分野においても大きな成長をもたらすと考えます。引き続き、短期的なリスクに注意を払いつつ、中長期の視点で投資を続けていきます。

### ■ダイワ・マネー・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。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.4.14~2021.10.13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	108円	0.618%	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17,436円です。
(投 信 会 社)	(34)	(0.193)	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)	(72)	(0.414)	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)	(2)	(0.011)	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	—	—	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	0.001	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)	(0.001)	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
合 計	108	0.619	

(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。

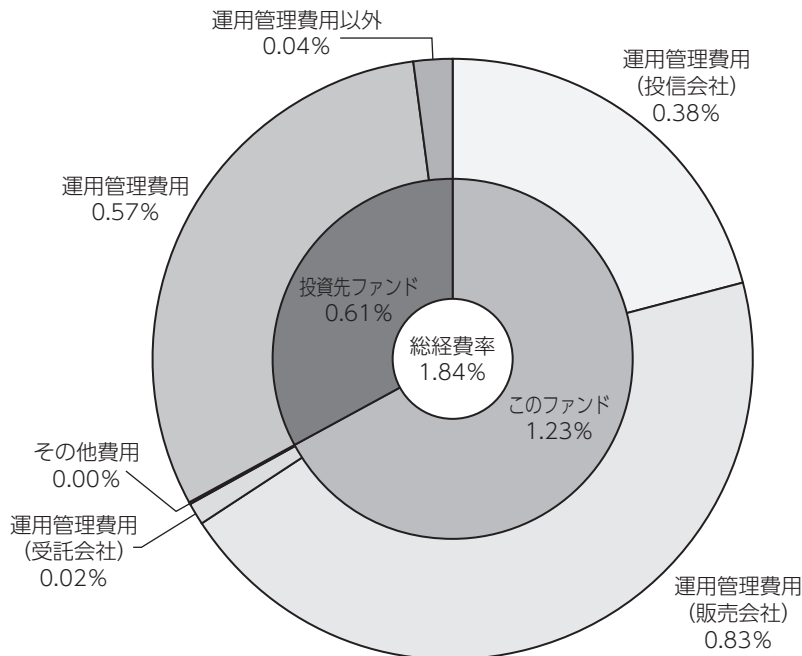
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.84%です。



総経費率 (①+②+③)	1.84%
①このファンドの費用の比率	1.23%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.57%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04%

(注1) ①の費用は、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。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 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。

■売買および取引の状況

投資信託受益証券

(2021年4月14日から2021年10月13日まで)

国	内	買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
	グローバルIOT 関連株ファンド (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)	967,976.546	2,200,000	6,365,899.389	14,800,000

(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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
国内投資信託受益証券 グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	千口 26,909,288.259	千円 63,632,393	% 99.0

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	977	977	994

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年10月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	63,632,393	91.6
ダイワ・マネー・マザーファンド	994	0.0
コール・ローン等、その他	5,870,757	8.4
投資信託財産総額	69,504,145	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10月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	69,504,145,425円
コール・ローン等	5,870,757,458
投資信託受益証券(評価額)	63,632,393,946
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	994,021
(B) 負債	5,247,988,374
未払収益分配金	4,627,416,835
未払解約金	178,148,230
未払信託報酬	441,320,665
その他未払費用	1,102,644
(C) 純資産総額(A - B)	64,256,157,051
元本	38,561,806,959
次期繰越損益金	25,694,350,092
(D) 受益権総口数	38,561,806,959口
1万口当り基準価額(C/D)	16,663円

\* 期首における元本額は42,806,370,683円、当作成期間中における追加設定元本額は3,535,949,059円、同解約元本額は7,780,512,783円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は16,663円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月14日 至2021年10月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 124,678円
受取利息	10,501
支払利息	△ 135,179
(B) 有価証券売買損益	4,463,087,232
売買益	5,127,778,994
売買損	△ 664,691,762
(C) 信託報酬等	△ 442,423,309
(D) 当期損益金(A + B + C)	4,020,539,245
(E) 前期繰越損益金	17,781,317,389
(F) 追加信託差損益金	8,519,910,293
(配当等相当額)	( 5,416,663,354)
(売買損益相当額)	( 3,103,246,939)
(G) 合計(D + E + F)	30,321,766,927
(H) 収益分配金	△ 4,627,416,835
次期繰越損益金(G + H)	25,694,350,092
追加信託差損益金	8,519,910,293
(配当等相当額)	( 5,416,663,354)
(売買損益相当額)	( 3,103,246,939)
分配準備積立金	17,174,564,603
繰越損益金	△ 124,804

- (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	4,020,573,992
(c) 収益調整金	8,519,910,293
(d) 分配準備積立金	17,781,407,446
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	30,321,891,731
(f) 分配金	4,627,416,835
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	25,694,474,896
(h) 受益権総口数	38,561,806,959口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

1,200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5年間延長し、信託期間終了日を2022年4月13日から2027年4月13日に変更しました。

**<補足情報>**

当ファンド（ダイワ・グローバルIoT関連株ファンドーA | 新時代ー（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・マネー・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10月13日）現在におけるダイワ・マネー・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・マザーファンドの主要な売買銘柄**

2021年4月14日～2021年10月13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10月13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・マザーファンド

## 運用報告書 第16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・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。

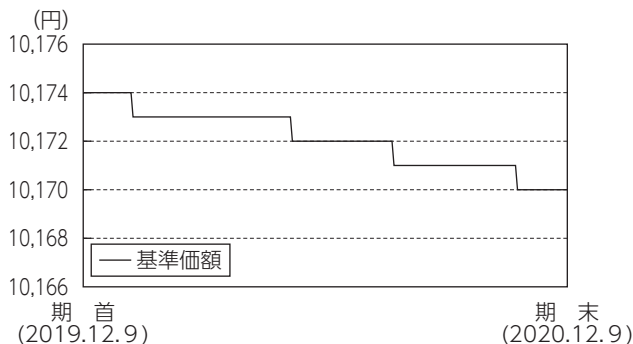
運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行いません。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

## 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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2019年12月9日	円	%	%
12月末	10,174	—	—
2020年 1 月末	10,173	△0.0	—
2 月末	10,173	△0.0	—
3 月末	10,173	△0.0	—
4 月末	10,173	△0.0	—
5 月末	10,172	△0.0	—
6 月末	10,172	△0.0	—
7 月末	10,172	△0.0	—
8 月末	10,171	△0.0	—
9 月末	10,171	△0.0	—
10 月末	10,171	△0.0	—
11 月末	10,170	△0.0	—
(期末)2020年12月9日	10,170	△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、利息収入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：10,174円 期末：10,170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

○ 国内短期金融市場

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、現先取引およびコール・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

その他有価証券

(2019年12月10日から2020年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
内	国内短期社債等	242,997,393	242,997,453 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (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。  
 (注3) 単位未満は切捨て。

■ 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

国内その他有価証券

	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内短期社債等	千円 999,970	% <1.5>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。  
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■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
	千円	%
コール・ローン等、その他	68,466,438	100.0
投資信託財産総額	68,466,438	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	68,466,438,583円
コール・ローン等	67,466,468,172
現先取引(その他有価証券)	999,970,411
(B) 負債	1,000,488,000
未払解約金	1,000,488,000
(C) 純資産総額(A - B)	67,465,950,583
元本	66,337,383,629
次期繰越損益金	1,128,566,954
(D) 受益権総口数	66,337,383,629口
1万口当り基準価額(C/D)	10,170円

\* 期首における元本額は82,259,129,638円、当作成期間中における追加設定元本額は106,172,802,530円、同解約元本額は122,094,548,539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、ダイワ日経225-シフト11- 2019-03 (適格機関投資家専用) 531,632,690円、ゴールド・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 4,718,749,101円、ダイワ・グローバル10T関連株ファンド -A I 新時代- (為替ヘッジあり) 977,694円、ダイワ・グローバル10T関連株ファンド -A I 新時代- (為替ヘッジなし) 977,694円、ダイワF Eグローバル・パリュエ (為替ヘッジあり) 9,608円、ダイワF Eグローバル・パリュエ (為替ヘッジなし) 9,608円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり) 49,107円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし) 49,107円、ダイワ/RICI<sup>®</sup> コモディティ・ファンド5,024,392円、US債券NB戦略ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型) 1,676円、US債券NB戦略ファンド (為替ヘッジなし/年1回決算型) 1,330円、スマート・アロケーション・Dガード99,008,902円、堅実バランスファンド -ハジメの歩- 569,302,583円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/隔月分配型) 180,729円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/隔月分配型) 737,649円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/資産成長型) 95,276円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型) 337,885円、世界セレクトティブ株式オープン983円、世界セレクトティブ株式オープン (年2回決算型) 983円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/毎月分配型) 983円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型) 983円、D Cダイワ・マネー・ポートフォリオ4,455,466,034円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 日本円・コース (毎月分配型) 132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型) 643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- ミドル・コース (毎月分配型) 12,784円、ダイワ/フィデリティ北米株式ファンド -パラダイムシフト- 1,988,495円、ブルベア・マネー・ポートフォリオV 37,213,381,442円、ブル3倍日本株ポートフォリオV 12,502,578,661円、ペア2倍日本株ポートフォリオV 5,944,161,915円、ダイワF Eグローバル・パリュエ株ファンド (ダイワSM A専用) 3,666円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 155,317円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型) 38,024円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) ミドル・コース (毎月分配型) 4,380円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型) 22,592円、ダイワ

ノムディ食糧増産関連ファンド164,735円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ47,833,280円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース) 33,689円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース) 96,254円、ダイワ・ダブルバランス・ファンド (Dガード付/部分為替ヘッジあり) 224,685,913円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジあり) 5,385円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジなし) 11,530円、ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) ミドルコース9,817円、ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 日本円コース6,964円、ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 通貨αコース9,479円、ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型) 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ979,761円、D Cスマート・アロケーション・Dガード11,929,087円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 両アフリカ・ランド・コース (毎月分配型) 1,097円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース (毎月分配型) 2,690円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 1,350円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース98,202円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 98,174円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,170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	△ 26,744,855円
受取利息	309,257
支払利息	△ 27,054,112
(B) その他費用	△ 610,483
(C) 当期損益金(A + B)	△ 27,355,338
(D) 前期繰越損益金	1,431,737,066
(E) 解約差損益金	△2,104,683,137
(F) 追加信託差損益金	1,828,868,363
(G) 合計(C + D + E + F)	1,128,566,954
次期繰越損益金(G)	1,128,566,954

(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。

■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／内外／株式	
信託期間	無期限	
運用方針	グローバルIOT関連株マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を通じて、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	為替ヘッジあり	マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジなし	マザーファンドの受益証券
運用方法	為替ヘッジあり	①マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所等に上場しているIOT関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資することで、信託財産の成長をめざします。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位に維持します。 ③原則として実質組入外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減をめざします。
	為替ヘッジなし	①マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所等に上場しているIOT関連企業の株式に投資することで、信託財産の成長をめざします。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位に維持します。 ③原則として実質組入外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行ないません。
マザーファンドの運用方法	①主として、日本を含む世界の金融商品取引所等に上場しているIOT関連企業の株式に投資することで、信託財産の成長をめざします。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。 イ. 日本を含む世界の金融商品取引所に上場している株式から、IOT関連企業に該当する銘柄を特定します。 ロ. 個別銘柄調査においては、バリュエーション水準、ファンダメンタルズ分析、モメンタムを重視し、組入候補銘柄の選定を行ないます。 ハ. 独自のクオンツモデルを活用し、流動性、ボラティリティなどを考慮してポートフォリオの構築を行ないます。 ③株式の組入比率は、原則として高位に維持します。 ④運用にあたっては、メロン・インベストメンツ・コーポレーションに運用の指図に関する権限を委託します。 ⑤外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行ないません。	
組入制限	マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	毎決算時に原則として、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行なわないこともあります。	



# BNY MELLON

## INVESTMENT MANAGEMENT

### グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジあり) / (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)

追加型投信／内外／株式

## 運用報告書（全体版）

第4期（決算日：2021年3月15日）

### 受益者のみなさまへ

平素は、格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「グローバルIOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」は、2021年3月15日に第4期決算を迎えました。ここに、期中の運用状況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。

BNY Mellon・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

東京都千代田区丸の内1丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

運用商品開発部

電話番号：03-6756-4600（代表）

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページ <https://www.bnymellonam.jp/>

## グローバル I o T 関連株ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

### ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株組比	式入率	株先比	式物率	純 資 産 額
	円	税 込 分 配 金	騰 落 率					
(設定日) 2017年 4月24日	10,000	—	—	—	—	—	—	百万円 12,300
1 期 (2018年 3月13日)	12,348	0	23.5	96.6	—	—	—	42,747
2 期 (2019年 3月13日)	12,425	0	0.6	99.2	—	—	—	26,702
3 期 (2020年 3月13日)	11,003	0	△11.4	92.7	—	—	—	15,748
4 期 (2021年 3月15日)	20,148	0	83.1	102.4	—	—	—	20,029

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

### ○当期中の基準価額と市況等の推移

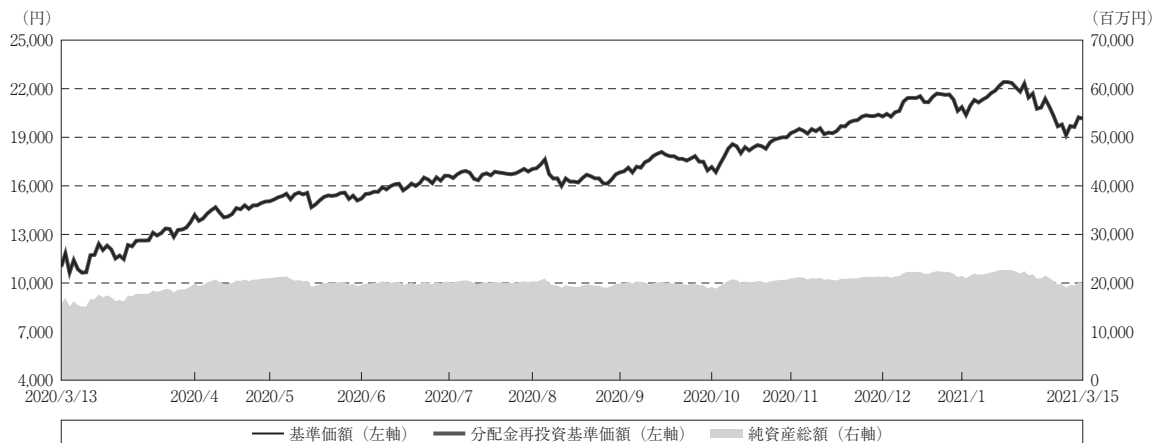
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株組比	式入率	株先比	式物率
		円	%				
(期 首) 2020年 3月13日	11,003	—	—	92.7	—	—	—
3 月末	12,309	11.9	—	100.5	—	—	—
4 月末	14,202	29.1	—	97.4	—	—	—
5 月末	15,050	36.8	—	97.9	—	—	—
6 月末	15,215	38.3	—	99.9	—	—	—
7 月末	16,619	51.0	—	97.3	—	—	—
8 月末	17,041	54.9	—	97.7	—	—	—
9 月末	16,832	53.0	—	98.0	—	—	—
10 月末	17,162	56.0	—	98.0	—	—	—
11 月末	19,260	75.0	—	97.3	—	—	—
12 月末	20,283	84.3	—	98.0	—	—	—
2021年 1 月末	20,863	89.6	—	99.7	—	—	—
2 月末	20,761	88.7	—	99.2	—	—	—
(期 末) 2021年 3月15日	20,148	83.1	—	102.4	—	—	—

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

## ■ 基準価額等の推移について



### 【基準価額・騰落率】

期首：11,003円 期末：20,148円 騰落率：83.1%

### 【基準価額の主な変動要因】

当期は保有銘柄の株価が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。なお、保有する外貨建資産の為替変動リスクを抑制するための為替ヘッジコストが基準価額のマイナス要因となりました。

#### 上昇要因

- ・2020年3月の急落以降、2021年2月中旬にかけて、世界各国での金融・財政両面からの景気刺激策、経済活動の緩やかな再開、米国大統領選挙の消化、ワクチン開発や接種の進展、米国での追加経済支援策への期待などから株式市場が上昇基調で推移したこと。

#### 下落要因

- ・2021年2月下旬から期末にかけて、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国を中心に長期金利が上昇する中、株式市場が軟調となったこと。

## ■投資環境について

### 株式市場

新型コロナウイルスの感染拡大に加え、サウジアラビアとロシアとの原油減産交渉が決裂し原油価格が暴落するなど、経済の先行きに対する不透明感が高まる中で、投資家のリスク回避の動きから、世界の株式市場は2020年3月に急落しました。

その後は、世界各国での金融・財政両面からの景気刺激策や、前例のない都市封鎖などの規制が緩和方向へ進み経済活動が緩やかに再開されたことが好感され、株式市場は反発しました。9月以降、欧州での新型コロナウイルス感染再拡大や、米国において経済支援策の成立が不透明となったことなどが株価の重石となる場面もみられましたが、米国大統領選挙を消化し、ワクチン開発や接種が進んだこと、また米国での追加経済支援策への期待が高まったことで、2021年2月中旬にかけて株価は上昇基調で推移しました。

その後2月下旬から期末にかけては、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国を中心に長期金利が上昇する中、軟調となりました。

### 為替市場

新型コロナウイルスの影響により市場が大きく混乱した2020年3月に米ドル円相場は大きく上下しましたが、FRB（米連邦準備理事会）が3月に危機対応としてゼロ金利政策や無制限の量的緩和を導入し、また9月には新型コロナウイルスからの米国経済回復支援のため2023年まで利上げを行わない見通しが示されるなか、米ドルは2021年1月上旬にかけて下落基調で推移しました。

その後は、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国長期金利が上昇する中、米ドルは一転して上昇しました。

英ポンドやユーロは、新型コロナウイルスの影響が相対的に大きかったものの、欧州復興基金の合意や英国と欧州連合との通商協定合意などを背景に前期末と比較して対円で上昇しました。

## ■ポートフォリオについて

（当ファンド）

グローバルI○T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組み入れました。実質組入外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行いました。

（グローバルI○T関連株マザーファンド）

### 業種別配分

業種別配分は、期を通じて情報技術への配分が多くなりました。期末時点の上位3セクターは、情報技術、資本財・サービス、ヘルスケアとなりました。

### 国別配分

国別配分は、期を通じて米国への配分が多くなりました。期末時点の上位3か国は、米国、日本、フランスとなりました。

## ■ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

## ■分配金について

当期の収益分配については、基準価額水準等を勘案して、見送りとさせて頂きました。分配に充てなかった収益につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用致します。

## ■今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、グローバルI○T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組み入れます。実質組入外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行います。

（グローバルI○T関連株マザーファンド）

幅広いI○T関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

引き続き、高い成長が期待されるI○T関連企業に投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2020年3月14日～2021年3月15日)

項 目	当期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	99 ( 95) ( 1) ( 3)	0.576 (0.553) (0.006) (0.018)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 信託財産の運用指図、法定開示書類の作成、基準価額の算出等の対価 口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 信託財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料  (株 式)	8  ( 8)	0.050  (0.050)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有 価 証 券 取 引 税  (株 式)	1  ( 1)	0.004  (0.004)	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)  (監 査 費 用) (そ の 他)	7 ( 2)  ( 1) ( 4)	0.042 (0.010)  (0.005) (0.026)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 金融商品取引に要する諸費用
合 計	115	0.672	
期中の平均基準価額は、17,133円です。			

(注) 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・解約により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。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。



## ○売買及び取引の状況 (2020年3月14日～2021年3月15日)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
グローバルI o T関連株マザーファンド	1,233,740	1,657,807	4,908,927	8,449,276

(注) 単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率 (2020年3月14日～2021年3月15日)

### 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
	グローバルI o T関連株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	95,697,172千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	94,470,992千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.01

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等 (2020年3月14日～2021年3月15日)

該当事項はございません。

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 (2021年3月15日現在)

### 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
グローバルI o T関連株マザーファンド	13,371,459	9,696,272	20,716,085

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成 (2021年3月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
グローバルI o T関連株マザーファンド	20,716,085	99.2
コール・ローン等、その他	166,674	0.8
投資信託財産総額	20,882,759	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てです。

(注) グローバルI o T関連株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(99,306,387千円)の投資信託財産総額(100,004,505千円)に対する比率は99.3%です。

(注) 外貨建て資産は、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。1米ドル=109.06円、1カナダドル=87.43円、1ユーロ=130.34円、1英ポンド=151.94円、1スイスフラン=117.42円、1スウェーデンクローナ=12.86円、1ノルウェークローネ=12.94円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月15日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	50,678,962,478円
グローバルI o T関連株マザーファンド(評価額)	20,716,085,790
未 収 入 金	29,962,876,688
(B) 負 債	30,649,538,005
未 払 金	30,589,363,244
未 払 信 託 報 酬	59,602,820
そ の 他 未 払 費 用	571,941
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	20,029,424,473
元 本	9,941,325,351
次 期 繰 越 損 益	10,088,099,122
(D) 受 益 権 総 口 数	9,941,325,351口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,148円

(注) 当ファンドの期首元本額は14,312,888,885円、期中追加設定元本額は92,380,172円、期中一部解約元本額は4,463,943,706円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は2,0148円です。

## ○損益の状況 (2020年3月14日～2021年3月15日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,187,512,199円
売 買 益	13,707,769,941
売 買 損	△ 4,520,257,742
(B) 信 託 報 酬 等	△ 116,650,574
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	9,070,861,625
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	781,760,647
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	235,476,850
(配 当 等 相 当 額)	( 74,362,240)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 161,114,610)
(F) 計 (C+D+E)	10,088,099,122
(G) 收 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	10,088,099,122
追 加 信 託 差 損 益 金	235,476,850
(配 当 等 相 当 額)	( 74,549,195)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 160,927,655)
分 配 準 備 積 立 金	9,852,622,272

- (注) 損益の状況の中で(A)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) 損益の状況の中で(B)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) 損益の状況の中で(E)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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(97,637,352円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(7,517,178,730円)、信託約款に規定する収益調整金(235,476,850円)および分配準備積立金(2,237,806,190円)より分配対象収益は10,088,099,122円(10,000口当たり10,147円)ですが、当期に分配した金額はありません。
- (注) 運用の指図にかかる権限を委託するために要する費用：信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に年0.34%を乗じて得た額

## ○分配金のお知らせ

当期の分配金はございません。

## ○お知らせ

### 約款変更のお知らせ

2020年4月1日をもって商号を「BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社」に変更いたしました。これに伴い、当ファンドならびにマザーファンドの約款変更を行いました。(2020年4月1日付)

## グローバル I o T 関連株ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）

### ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	純 資 産 額
	税 込 分 配	み 騰 騰 率					
(設定日) 2017年 4 月 24 日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	% —	百万円 20,000
1 期 (2018年 3 月 13 日)	12,229	0	22.3	98.8	—	—	126,503
2 期 (2019年 3 月 13 日)	13,021	0	6.5	98.3	—	—	92,353
3 期 (2020年 3 月 13 日)	10,984	0	△15.6	97.8	—	—	56,488
4 期 (2021年 3 月 15 日)	20,915	0	90.4	99.0	—	—	78,881

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

### ○当期中の基準価額と市況等の推移

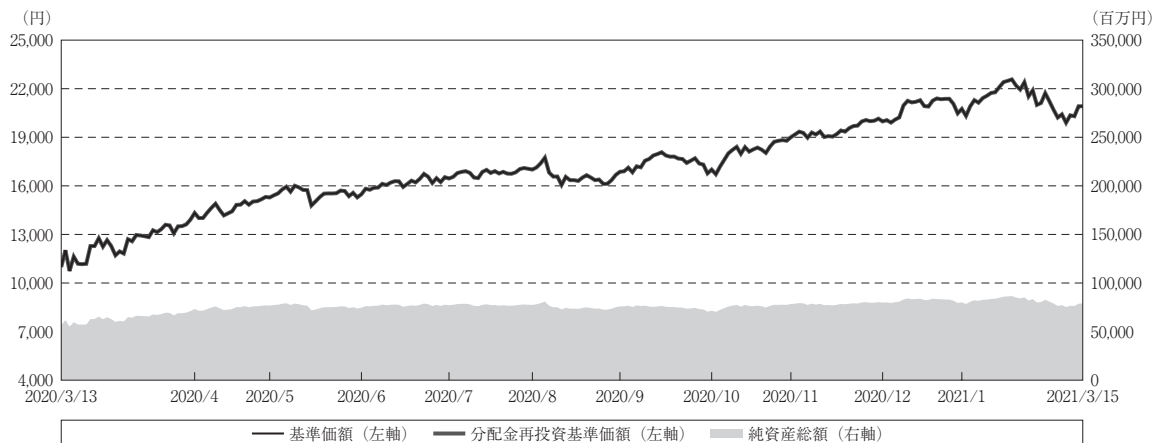
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率
		騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2020年 3 月 13 日	円 10,984	% —	% —	% 97.8	% 97.8	% —	% —
3 月 末	12,644	15.1	—	97.4	97.4	—	—
4 月 末	14,325	30.4	—	98.3	98.3	—	—
5 月 末	15,283	39.1	—	97.5	97.5	—	—
6 月 末	15,482	41.0	—	99.2	99.2	—	—
7 月 末	16,455	49.8	—	99.4	99.4	—	—
8 月 末	17,007	54.8	—	98.4	98.4	—	—
9 月 末	16,870	53.6	—	98.4	98.4	—	—
10 月 末	17,005	54.8	—	98.8	98.8	—	—
11 月 末	19,005	73.0	—	98.2	98.2	—	—
12 月 末	19,979	81.9	—	98.4	98.4	—	—
2021年 1 月 末	20,752	88.9	—	98.9	98.9	—	—
2 月 末	20,998	91.2	—	98.5	98.5	—	—
(期 末) 2021年 3 月 15 日	20,915	90.4	—	99.0	99.0	—	—

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

## ■ 基準価額等の推移について



### 【基準価額・騰落率】

期首：10,984円 期末：20,915円 騰落率：90.4%

### 【基準価額の主な変動要因】

当期は保有銘柄の株価が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。また、米ドルが対円で上昇したことも基準価額の上昇に繋がりました。

#### 上昇要因

- ・2020年3月の急落以降、2021年2月中旬にかけて、世界各国での金融・財政両面からの景気刺激策、経済活動の緩やかな再開、米国大統領選挙の消化、ワクチン開発や接種の進展、米国での追加経済支援策への期待などから株式市場が上昇基調で推移したこと。

#### 下落要因

- ・2021年2月下旬から期末にかけて、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国を中心に長期金利が上昇する中、株式市場が軟調となったこと。

## ■投資環境について

### 株式市場

新型コロナウイルスの感染拡大に加え、サウジアラビアとロシアとの原油減産交渉が決裂し原油価格が暴落するなど、経済の先行きに対する不透明感が高まる中で、投資家のリスク回避の動きから、世界の株式市場は2020年3月に急落しました。

その後は、世界各国での金融・財政両面からの景気刺激策や、前例のない都市封鎖などの規制が緩和方向へ進み経済活動が緩やかに再開されたことが好感され、株式市場は反発しました。9月以降、欧州での新型コロナウイルス感染再拡大や、米国において経済支援策の成立が不透明となったことなどが株価の重石となる場面もみられましたが、米国大統領選挙を消化し、ワクチン開発や接種が進んだこと、また米国での追加経済支援策への期待が高まったことで、2021年2月中旬にかけて株価は上昇基調で推移しました。

その後2月下旬から期末にかけては、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国を中心に長期金利が上昇する中、軟調となりました。

### 為替市場

新型コロナウイルスの影響により市場が大きく混乱した2020年3月に米ドル円相場は大きく上下しましたが、FRB（米連邦準備理事会）が3月に危機対応としてゼロ金利政策や無制限の量的緩和を導入し、また9月には新型コロナウイルスからの米国経済回復支援のため2023年まで利上げを行わない見通しが示されるなか、米ドルは2021年1月上旬にかけて下落基調で推移しました。

その後は、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国長期金利が上昇する中、米ドルは一転して上昇しました。

英ポンドやユーロは、新型コロナウイルスの影響が相対的に大きかったものの、欧州復興基金の合意や英国と欧州連合との通商協定合意などを背景に前期末と比較して対円で上昇しました。

## ■ポートフォリオについて

（当ファンド）

グローバルI○T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組み入れました。実質組入外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行いませんでした。

（グローバルI○T関連株マザーファンド）

### 業種別配分

業種別配分は、期を通じて情報技術への配分が多くなりました。期末時点の上位3セクターは、情報技術、資本財・サービス、ヘルスケアとなりました。

### 国別配分

国別配分は、期を通じて米国への配分が多くなりました。期末時点の上位3か国は、米国、日本、フランスとなりました。

## ■ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

## ■分配金について

当期の収益分配については、基準価額水準等を勘案して、見送りとさせて頂きました。分配に充てなかった収益につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用致します。

## ■今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、グローバルI○T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組み入れます。実質組入外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行いません。

（グローバルI○T関連株マザーファンド）

幅広いI○T関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

引き続き、高い成長が期待されるI○T関連企業に投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2020年3月14日～2021年3月15日)

項 目	当期		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)	99 ( 95) ( 1) ( 3)	0.576 (0.553) (0.006) (0.018)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 信託財産の運用指図、法定開示書類の作成、基準価額の算出等の対価 口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 信託財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料  (株 式)	9  ( 9)	0.050  (0.050)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有 価 証 券 取 引 税  (株 式)	1  ( 1)	0.004  (0.004)	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)  (監 査 費 用) (そ の 他)	7 ( 2)  ( 0) ( 4)	0.039 (0.010)  (0.002) (0.027)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 金融商品取引に要する諸費用
合 計	116	0.669	
期中の平均基準価額は、17,150円です。			

(注) 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・解約により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。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況 (2020年3月14日～2021年3月15日)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
グローバルI o T関連株マザーファンド	1,197,663	2,239,906	14,892,975	26,561,335

(注) 単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率 (2020年3月14日～2021年3月15日)

### 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
	グローバルI o T関連株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	95,697,172千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	94,470,992千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.01

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等 (2020年3月14日～2021年3月15日)

該当事項はございません。

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 (2021年3月15日現在)

### 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千円
グローバルI o T関連株マザーファンド	50,604,837	36,909,525	78,857,200	

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成 (2021年3月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
グローバルI o T関連株マザーファンド	78,857,200	99.7
コール・ローン等、その他	250,073	0.3
投資信託財産総額	79,107,273	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てです。

(注) グローバルI o T関連株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(99,306,387千円)の投資信託財産総額(100,004,505千円)に対する比率は99.3%です。

(注) 外貨建て資産は、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。1米ドル=109.06円、1カナダドル=87.43円、1ユーロ=130.34円、1英ポンド=151.94円、1スイスフラン=117.42円、1スウェーデンクローナ=12.86円、1ノルウェークローネ=12.94円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月15日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	79,107,273,591円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,245,348
グローバルI o T関連株マザーファンド(評価額)	78,857,200,801
未 収 入 金	243,827,442
(B) 負 債	225,674,863
未 払 信 託 報 酬	225,014,756
そ の 他 未 払 費 用	660,107
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	78,881,598,728
元 本	37,714,755,838
次 期 繰 越 損 益	41,166,842,890
(D) 受 益 権 総 口 数	37,714,755,838口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,915円

(注) 当ファンドの期首元本額は51,427,212,609円、期中追加設定元本額は1,392,128,617円、期中一部解約元本額は15,104,585,388円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は2,0915円です。

## ○損益の状況 (2020年3月14日～2021年3月15日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	36,981,661,444円
売 買 益	45,504,810,128
売 買 損	△ 8,523,148,684
(B) 信 託 報 酬 等	△ 436,876,909
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	36,544,784,535
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	1,288,933,018
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,333,125,337
(配 当 等 相 当 額)	( 951,533,754)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 2,381,591,583)
(F) 計 (C+D+E)	41,166,842,890
(G) 收 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	41,166,842,890
追 加 信 託 差 損 益 金	3,333,125,337
(配 当 等 相 当 額)	( 952,824,669)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 2,380,300,668)
分 配 準 備 積 立 金	37,833,717,553

- (注) 損益の状況の中で(A)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) 損益の状況の中で(B)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) 損益の状況の中で(E)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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(371,132,993円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(28,659,489,979円)、信託約款に規定する収益調整金(3,333,125,337円)および分配準備積立金(8,803,094,581円)より分配対象収益は41,166,842,890円(10,000口当たり10,915円)ですが、当期に分配した金額はありません。
- (注) 運用の指図にかかる権限を委託するために要する費用：信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に年0.34%を乗じて得た額

## ○分配金のお知らせ

当期の分配金はございません。

## ○お知らせ

### 約款変更のお知らせ

2020年4月1日をもって商号を「BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社」に変更いたしました。これに伴い、当ファンドならびにマザーファンドの約款変更を行いました。(2020年4月1日付)



## グローバル I o T 関連株マザーファンド

第4期（2021年3月15日決算）〔計算期間：2020年3月14日～2021年3月15日〕

法令・諸規則に基づき、当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。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	世界の金融商品取引所等に上場している株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産の投資割合には、制限を設けません。

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額	株式比率		純資産
		期中騰落率	先比率	
(設定日) 2017年4月24日	円 10,000	% —	% —	百万円 32,300
1期(2018年3月13日)	12,288	22.9	98.9	168,216
2期(2019年3月13日)	13,147	7.0	98.3	119,286
3期(2020年3月13日)	11,158	△15.1	97.8	71,387
4期(2021年3月15日)	21,365	91.5	99.0	99,573

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

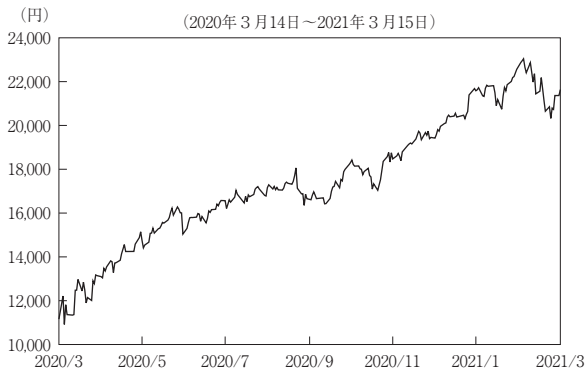
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	株式比率	
		騰落率	先比率
(期首) 2020年3月13日	円 11,158	% —	% 97.8
3月末	12,847	15.1	97.4
4月末	14,561	30.5	98.2
5月末	15,541	39.3	97.4
6月末	15,751	41.2	99.1
7月末	16,747	50.1	99.2
8月末	17,316	55.2	98.1
9月末	17,188	54.0	98.3
10月末	17,335	55.4	98.7
11月末	19,381	73.7	98.1
12月末	20,383	82.7	98.3
2021年1月末	21,180	89.8	98.7
2月末	21,441	92.2	98.2
(期末) 2021年3月15日	21,365	91.5	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

## ■基準価額等の推移について



## 【基準価額・騰落率】

期首：11,158円 期末：21,365円 騰落率：91.5%

## 【基準価額の主な変動要因】

当期は保有銘柄の株価が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。また、米ドルが対円で上昇したことも基準価額の上昇に繋がりました。

上昇要因

- 2020年3月の急落以降、2021年2月中旬にかけて、世界各国での金融・財政両面からの景気刺激策、経済活動の緩やかな再開、米国大統領選挙の消化、ワクチン開発や接種の進展、米国での追加経済支援策への期待などから株式市場が上昇基調で推移したこと。

下落要因

- 2021年2月下旬から期末にかけて、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国を中心に長期金利が上昇する中、株式市場が軟調となったこと。

## ■投資環境について

### 株式市場

新型コロナウイルスの感染拡大に加え、サウジアラビアとロシアとの原油減産交渉が決裂し原油価格が暴落するなど、経済の先行きに対する不透明感が高まる中で、投資家のリスク回避の動きから、世界の株式市場は2020年3月に急落しました。

その後は、世界各国での金融・財政両面からの景気刺激策や、前例のない都市封鎖などの規制が緩和方向へ進み経済活動が緩やかに再開されたことが好感され、株式市場は反発しました。9月以降、欧州での新型コロナウイルス感染再拡大や、米国において経済支援策の成立が不透明となったことなどが株価の重石となる場面もみられましたが、米国大統領選挙を消化し、ワクチン開発や接種が進んだこと、また米国での追加経済支援策への期待が高まったことで、2021年2月中旬にかけて株価は上昇基調で推移しました。

その後2月下旬から期末にかけては、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国を中心に長期金利が上昇する中、軟調となりました。

## 為替市場

新型コロナウイルスの影響により市場が大きく混乱した2020年3月に米ドル円相場は大きく上下しましたが、FRB（米連邦準備理事会）が3月に危機対応としてゼロ金利政策や無制限の量的緩和を導入し、また9月には新型コロナウイルスからの米国経済回復支援のため2023年まで利上げを行わない見通しが示されるなか、米ドルは2021年1月上旬にかけて下落基調で推移しました。

その後は、米国の財政拡大や景気回復期待の高まりなどを背景に米国長期金利が上昇する中、米ドルは一転して上昇しました。

英ポンドやユーロは、新型コロナウイルスの影響が相対的に大きかったものの、欧州復興基金の合意や英国と欧州連合との通商協定合意などを背景に前期末と比較して対円で上昇しました。

## ■ポートフォリオについて

### 業種別配分

業種別配分は、期を通じて情報技術への配分が多くなりました。期末時点の上位3セクターは、情報技術、資本財・サービス、ヘルスケアとなりました。

### 国別配分

国別配分は、期を通じて米国への配分が多くなりました。期末時点の上位3か国は、米国、日本、フランスとなりました。

## ■ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

## ■今後の運用方針

幅広いI o T関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

引き続き、高い成長が期待されるI o T関連企業に投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年3月14日～2021年3月15日)

項 目	当期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	9 ( 9 )	0.050 (0.050)	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	1 ( 1 )	0.004 (0.004)	(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)	6 ( 2 ) ( 4 )	0.037 (0.010) (0.027)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 金融商品取引に要する諸費用
合 計	16	0.091	
期中の平均基準価額は、17,472円です。			

(注) 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・解約により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。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況 (2020年3月14日～2021年3月15日)

株 式					
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		64,100 ( 2,417 )	296,421 ( - )	121,262 ( - )	571,450 ( 574 )
	ヨーロッパ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
		540	6,133	238	2,529
	イギリス	—	千英ポンド	1,867	千英ポンド
スイス	—	千スイスフラン	—	千スイスフラン	
国	ノルウェー	—	—	1,949	8,725
	ノルウェー	2,552	千ノルウェー クローネ	—	千ノルウェー クローネ
		41,322	—	—	—

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) ( )内は株式分割、予約権行使、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。

## ○株式売買比率 (2020年3月14日～2021年3月15日)

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	95,697,172千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	94,470,992千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.01

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等 (2020年3月14日～2021年3月15日)

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(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

(2021年3月15日現在)

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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
(アメリカ)	百株	百株			
ADVANCED MICRO DEVICES	5,095	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ANSYS, INC.	1,077	854	27,089	2,954,408	ソフトウェア・サービス
AMETEK, INC.	—	734	8,929	973,844	資本財
POWER INTEGRATIONS, INC.	2,293	3,921	32,363	3,529,588	半導体・半導体製造装置
COGNEX CORPORATION	6,546	4,964	40,277	4,392,707	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DIODES INC	—	3,785	31,594	3,445,730	半導体・半導体製造装置
ELECTRONIC ARTS INC	793	—	—	—	メディア・娯楽
NVIDIA CORPORATION	807	538	27,683	3,019,172	半導体・半導体製造装置
NUANCE COMMUNICATIONS, INC.	1,925	8,176	36,182	3,946,065	ソフトウェア・サービス
HILL-ROM HOLDINGS INC	2,058	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HITACHI LTD -ADR	2,780	1,679	16,558	1,805,868	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STMICROELECTRONICS NV-NY SHS	7,270	6,328	22,622	2,467,236	半導体・半導体製造装置
ITRON INC	2,792	2,210	20,919	2,281,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SILICON LABORATORIES INC	1,288	1,698	25,197	2,747,986	半導体・半導体製造装置
MITSUBISHI ELECTRIC-UNSP ADR	9,880	—	—	—	資本財
DENSO CORPORATION-UNSPON ADR	5,690	—	—	—	自動車・自動車部品
QUALCOMM INC	3,143	—	—	—	半導体・半導体製造装置
RESMED INC	—	1,030	19,067	2,079,546	ヘルスケア機器・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,616	1,090	28,934	3,155,596	資本財
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	—	1,169	19,083	2,081,230	ヘルスケア機器・サービス
OMNICELL INC	2,000	1,210	16,357	1,783,958	ヘルスケア機器・サービス
SEMTECH CORPORATION	5,452	4,432	30,572	3,334,203	半導体・半導体製造装置
SONY CORP-SPONSORED ADR	3,715	2,794	29,220	3,186,781	耐久消費財・アパレル
INTUITIVE SURGICAL INC	307	479	35,202	3,839,147	ヘルスケア機器・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,197	1,673	28,828	3,144,035	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,143	1,043	49,364	5,383,702	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DEXCOM INC	787	412	14,773	1,611,162	ヘルスケア機器・サービス
ADVANTEST CORP- SPON ADR	—	3,098	25,316	2,761,066	半導体・半導体製造装置
MASIMO CORPORATION	1,508	1,022	23,562	2,569,731	ヘルスケア機器・サービス
THK CO LTD-UNSPON ADR	21,615	—	—	—	資本財
FUJI ELECTRIC HLDS-UNSP ADR	29,510	—	—	—	資本財
GARMIN LTD.	2,320	1,744	22,234	2,424,867	耐久消費財・アパレル
SPLUNK INC	1,961	1,562	21,241	2,316,561	ソフトウェア・サービス
PROOFPOINT, INC.	1,969	500	6,284	685,351	ソフトウェア・サービス
AMERICAN TOWER CORPORATION	832	785	16,908	1,843,991	不動産
YASKAWA ELECTRIC CORP-ADR	3,649	2,337	23,642	2,578,418	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANRITSU CORP - UNSP ADR	2,366	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADT INC	—	17,617	14,658	1,598,603	商業・専門サービス
DaiFuku Co Ltd - UNSP ADR	—	10,288	24,208	2,640,231	資本財
ALCON INC	3,292	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス

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	千米ドル	千円		
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	839	13,742	1,498,782	資本財	
GLOBANT SA	2,275	990	20,892	2,278,496	ソフトウェア・サービス	
TELADOC HEALTH INC	1,159	977	19,353	2,110,743	ヘルスケア機器・サービス	
IRHYTHM TECHNOLOGIES INC	2,018	675	9,536	1,040,093	ヘルスケア機器・サービス	
VIAVI SOLUTIONS INC	3,162	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EVERBRIDGE INC	3,322	1,297	17,824	1,943,987	ソフトウェア・サービス	
ROKU INC	—	761	27,427	2,991,205	メディア・娯楽	
RAPID7 INC	—	1,154	9,146	997,539	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	150,629 38	95,886 37	856,804 —	93,443,122 <93.8%>	
(ユーロ・・・フランス)			千ユーロ			
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,518	2,821	35,688	4,651,580	資本財	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,518 1	2,821 1	35,688 —	4,651,580 <4.7%>	
(イギリス)			千英ポンド			
AVEVA GROUP PLC	1,867	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,867 1	— —	— —	— <—%>	
(スイス)			千スイスフラン			
LOGITECH INTERNATIONAL S.A.	1,949	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,949 1	— —	— —	— <—%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
NORDIC SEMICONDUCTOR ASA	—	2,552	37,624	486,858	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	— —	2,552 1	37,624 —	486,858 <0.5%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	156,965 41	101,259 39	— —	98,581,561 <99.0%>	

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

(注) 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注) 一印は組み入れなし。

## ○投資信託財産の構成 (2021年3月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	98,581,561	98.6
コール・ローン等、その他	1,422,944	1.4
投資信託財産総額	100,004,505	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

(注) 当期末における外貨建て純資産 (99,306,387千円) の投資信託財産総額 (100,004,505千円) に対する比率は99.3%です。

(注) 外貨建て資産は、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。1米ドル=109.06円、1カナダドル=87.43円、1ユーロ=130.34円、1英ポンド=151.94円、1スイスフラン=117.42円、1スウェーデンクローナ=12.86円、1ノルウェークローネ=12.94円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月15日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	100,004,505,910円
コール・ローン等	695,264,474
株 式(評価額)	98,581,561,813
未 収 入 金	713,522,121
未 収 配 当 金	14,157,502
(B) 負 債	430,753,928
未 払 金	120,278,784
未 払 解 約 金	310,427,442
そ の 他 未 払 費 用	47,702
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	99,573,751,982
元 本	46,605,797,609
次 期 繰 越 損 益 金	52,967,954,373
(D) 受 益 権 総 口 数	46,605,797,609口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,365円

(注) 当親ファンドの期首元本額は63,976,296,314円、期中追加設定元本額は2,431,403,878円、期中一部解約元本額は19,801,902,583円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、グローバルIOT関連株ファンド(為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用) 36,909,525,299円  
グローバルIOT関連株ファンド(為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用) 9,696,272,310円

です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は2.1365円です。

## ○お知らせ

### 約款変更のお知らせ

2020年4月1日をもって商号を「BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社」に変更いたしました。これに伴う約款変更を行いました。(2020年4月1日付)

## ○損益の状況 (2020年3月14日~2021年3月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	554,261,348円
受 取 配 当 金	554,261,283
受 取 利 息	65
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	58,781,953,996
売 買 益	59,174,226,463
売 買 損	△ 392,272,467
(C) 保 管 費 用 等	△ 36,684,702
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	59,299,530,642
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,410,822,031
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,466,310,607
(G) 解 約 差 損 益 金	△15,208,708,907
(H) 計 (D+E+F+G)	52,967,954,373
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	52,967,954,373

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(G)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。