

# ダイワ／ミレーアセット・ グローバル好配当株ファンド

## 運用報告書(全体版) 第13期

(決算日 2021年11月22日)

(作成対象期間 2021年5月22日～2021年11月22日)

### ★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	10年間（2015年5月22日～2025年5月21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	ベビーファンド	ダイワ／ミレーアセット・ グローバル好配当株マザー ファンドの受益証券
	ダイワ／ミレーアセッ ト・グローバル好配当 株マザーファンド	内外の金融商品取引所上場 および店頭登録（上場予定 および店頭登録予定を含み ます。）の株式（DR（預 託証券）を含みます。）
組入制限	ベビーファンドの マザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの 株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの 株式組入上限比率	
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、分配を行なわ ないことがあります。	

### 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、安定的な配当と今後の増配  
が期待できる世界の株式に投資し、信託財産  
の成長をめざしております。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/>

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)		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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
9期末 (2019年11月21日)	10,740	150	6.0	12,323	7.4	92.8	—	3,674
10期末 (2020年5月21日)	9,790	0	△ 8.8	11,345	△ 7.9	91.4	—	2,993
11期末 (2020年11月24日)	10,932	130	13.0	13,668	20.5	93.4	—	2,914
12期末 (2021年5月21日)	11,662	1,200	17.7	16,482	20.6	91.2	—	2,482
13期末 (2021年11月22日)	11,987	900	10.5	18,757	13.8	93.9	—	2,212

(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。

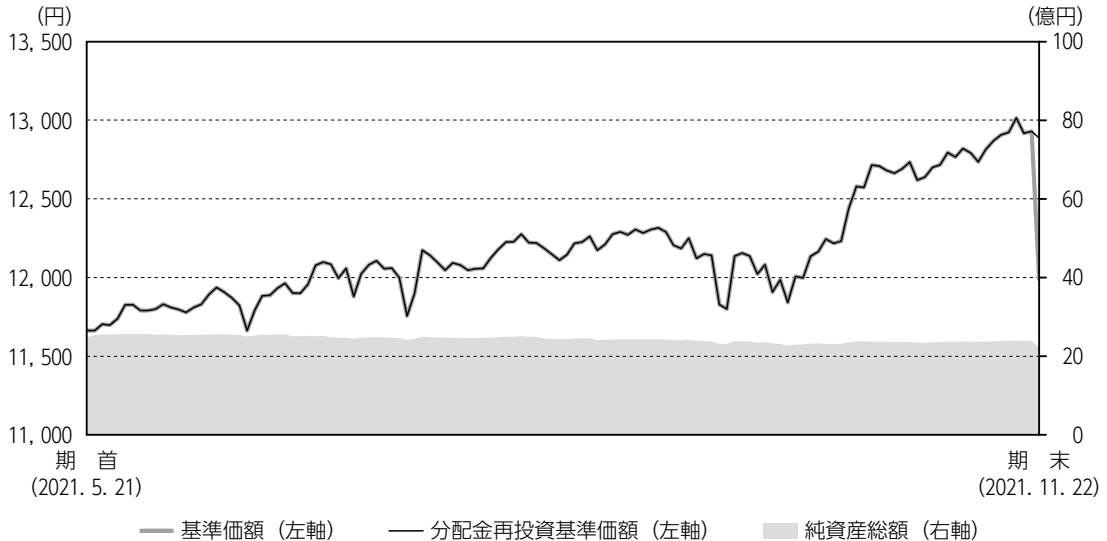
(注5) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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：11,662円

期末：11,987円（分配金900円）

騰落率：10.5%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

世界の株式市況が上昇したことや為替が円安米ドル高に推移したこと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／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		M S C I A C World指数 (配当込み、円換算)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %		
(期首) 2021年5月21日	11,662	—	16,482	—	91.2	—
5月末	11,826	1.4	16,854	2.3	89.5	—
6月末	11,899	2.0	17,255	4.7	89.3	—
7月末	12,092	3.7	17,298	5.0	89.4	—
8月末	12,275	5.3	17,658	7.1	89.8	—
9月末	12,081	3.6	17,367	5.4	90.8	—
10月末	12,638	8.4	18,470	12.1	89.5	—
(期末) 2021年11月22日	12,887	10.5	18,757	13.8	93.9	—

(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. 5. 22 ~ 2021. 11. 22)

### 世界株式市況

世界株式市況は上昇しました。

世界株式市況は、当作成期首から2021年8月末にかけて上昇しました。新型コロナウイルスの変異株への警戒感が相場の重しとなる場面があったものの、世界的な経済活動正常化期待の高まりや堅調な企業業績などを材料として上昇しました。9月から当作成期末にかけては、中国の大手不動産企業の資金繰り問題や、米国金利上昇に対する警戒感から下落する場面があったものの、欧米企業の良好な決算が好感されたことから、堅調な展開になりました。

### 為替相場

米ドルは対円で上昇（円安）しました。

当作成期首より、世界的に新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で、世界経済への楽観的な見方が強まったことが円安要因となり、米ドルは上昇しました。2021年7月以降は、新規感染者数の増加を受けた景気への懸念や米国金利の低下などから、米ドルは小幅に下落（円高）しました。9月には、利上げ観測の高まりなどから米ドルは上昇しました。10月以降も、日米金融政策の方向性の違いが米ドルの上昇要因となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド」の受益証券を通じて、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式に投資することにより、信託財産の成長をめざして運用を行います。

### ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。今後も、配当成長、フリーキャッシュフロー、株価バリュエーション、企業の財務体質などに着目した運用を行ってまいります。また、株主還元積極的に企業へ注目が集まる中、配当とともに自社株買いを通じてEPS（1株当り利益）やROE（株主資本利益率）の向上が期待できる銘柄にも注目していきます。

## ポートフォリオについて

(2021. 5. 22 ~ 2021. 11. 22)

### 当ファンド

「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド」の受益証券に投資しました。

### ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

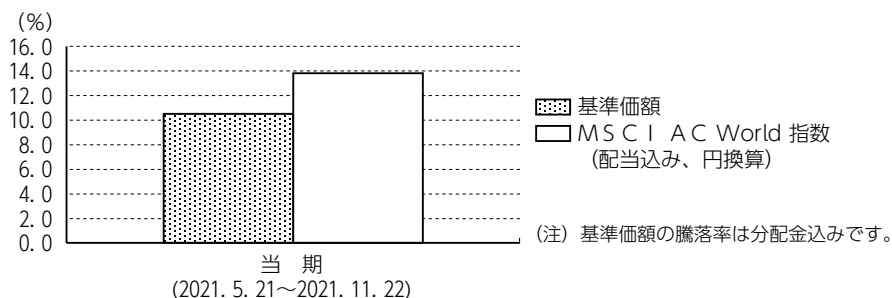
当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループに運用の指図にかかる権限を委託しております。

個別銘柄では、パフォーマンスが相対的に良好であった MICROSOFT（米国、情報技術）や INTUIT（米国、情報技術）の保有などがプラス要因となりました。一方で、パフォーマンスが相対的に軟調であった ZIJIN MINING GROUP（中国、素材）や VISA（米国、情報技術）の保有などがマイナス要因となりました。

## 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5月22日 ～2021年11月22日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>(円)</b>	<b>900</b>
対基準価額比率	(%)	6.98
当期の収益	(円)	900
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,021

(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	✓	127.83円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	1,096.12
(c) 収益調整金		78.32
(d) 分配準備積立金		1,619.31
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		2,921.60
(f) 分配金		900.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		2,021.60

(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

「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド」の受益証券を通じて、安定的な配当と今後の増配が期待できる世界の株式に投資することにより、信託財産の成長をめざして運用を行います。

### ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行ってまいります。今後も、配当成長、フリーキャッシュフロー、株価バリュエーション、企業の財務体質などに着目した運用を行ってまいります。また、株主還元積極的に企業へ注目が集まる中、配当とともに自社株買いを通じてEPS（1株当り利益）やROE（株主資本利益率）の向上が期待できる銘柄にも注目していきます。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 5. 22～2021. 11. 22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	122円	1.003%	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12,176円です。
( 投 信 会 社 )	(64)	(0.530)	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 )	(54)	(0.446)	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 )	(3)	(0.028)	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	2	0.016	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 )	(2)	(0.016)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.005	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 )	(1)	(0.005)	
そ の 他 費 用	6	0.049	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 )	(6)	(0.046)	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 )	(0)	(0.003)	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)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	131	1.073	

(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。

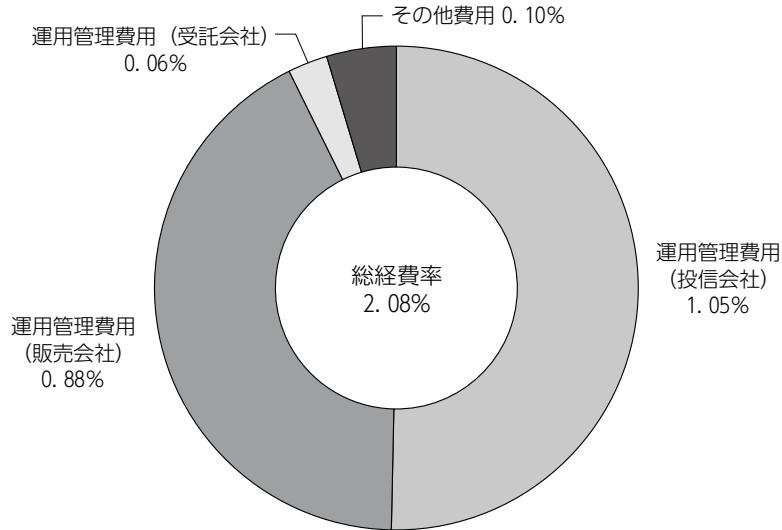
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



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2.08%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。

## ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド

### ■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

(2021年5月22日から2021年11月22日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ／ミレーアセット・ グローバル好配当株 マザーファンド	36,017	56,000	349,488	577,000

(注) 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

(2021年5月22日から2021年11月22日まで)

項 目	当 期
	ダイワ／ミレーアセット・ グローバル好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,202,003千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,190,408千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.54

(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。

### ■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	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ／ミレーアセット・ グローバル好配当株マザーファンド	1,597,426	1,283,955	2,210,843

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2021年11月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ／ミレーアセット・ グローバル好配当株マザーファンド	2,210,843	92.0
コール・ローン等、その他	192,761	8.0
投資信託財産総額	2,403,604	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、11月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=114.10円、1香港・ドル=14.65円、1イギリス・ポンド=153.36円、1スイス・フラン=122.82円、1ノルウェー・クローネ=12.77円、1ユーロ=128.67円です。

(注3) ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(2,170,400千円)の投資信託財産総額(2,400,836千円)に対する比率は、90.4%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,403,604,931円
コール・ローン等	2,761,624
ダイワ／ミレーアセット・グローバル 好配当株マザーファンド(評価額)	2,210,843,307
未収入金	190,000,000
(B) 負債	190,706,886
未払収益分配金	166,154,104
未払解約金	52,852
未払信託報酬	24,432,150
その他未払費用	67,780
(C) 純資産総額 (A - B)	2,212,898,045
元本	1,846,156,722
次期繰越損益金	366,741,323
(D) 受益権総口数	1,846,156,722口
1万口当り基準価額 (C / D)	11,987円

\* 期首における元本額は2,128,904,504円、当作成期間中における追加設定元本額は50,117,269円、同解約元本額は332,865,051円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,987円です。

■損益の状況

当期 自2021年5月22日 至2021年11月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,823円
受取利息	352
支払利息	△ 3,175
(B) 有価証券売買損益	250,465,439
売買益	265,575,931
売買損	△ 15,110,492
(C) 信託報酬等	△ 24,499,930
(D) 当期損益金 (A + B + C)	225,962,686
(E) 前期繰越損益金	298,951,435
(F) 追加信託差損益金	7,981,306
(配当等相当額)	( 14,459,256)
(売買損益相当額)	(△ 6,477,950)
(G) 合計 (D + E + F)	532,895,427
(H) 収益分配金	△ 166,154,104
次期繰越損益金 (G + H)	366,741,323
追加信託差損益金	7,981,306
(配当等相当額)	( 14,459,256)
(売買損益相当額)	(△ 6,477,950)
分配準備積立金	358,760,017

(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せん。

(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(親投資信託)の運用の指図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：7,380,998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	23,601,262円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	202,361,424
(c) 収益調整金	14,459,256
(d) 分配準備積立金	298,951,435
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	539,373,377
(f) 分配金	166,154,104
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	373,219,273
(h) 受益権総口数	1,846,156,722口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

900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。

## ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド）が投資対象としている「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド」の決算日（2021年5月21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11月22日）現在におけるダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株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／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄 株 式

(2021年5月22日から2021年11月22日まで)

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)	3.259	56,201	17,245	MICROSOFT CORP (アメリカ)	2.046	69,658	34,046
ACTIVISION BLIZZARD INC (アメリカ)	5.017	38,776	7,729	VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ)	1.832	45,991	25,104
MAGNA INTERNATIONAL INC (カナダ)	3.021	28,696	9,499	MASTERCARD INC - A (アメリカ)	1.02	40,664	39,866
ELI LILLY & CO (アメリカ)	0.92	27,822	30,242	BOEING CO/THE (アメリカ)	1.155	29,380	25,437
SIEMENS AG-REG (ドイツ)	1.347	25,239	18,737	LOCKHEED MARTIN CORP (アメリカ)	0.728	28,390	38,998
BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	3.871	20,769	5,365	NATIONAL BANK OF CANADA (カナダ)	2.844	26,443	9,297
NIKE INC -CL B (アメリカ)	0.922	18,679	20,259	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H (中国)	166	25,755	155
ABBVIE INC (アメリカ)	1.366	18,262	13,369	APPLE INC (アメリカ)	1.518	24,484	16,129
MCKESSON CORP (アメリカ)	0.71	17,950	25,281	ROSS STORES INC (アメリカ)	1.653	22,478	13,598
LAM RESEARCH CORP (アメリカ)	0.241	16,800	69,709	INTEL CORP (アメリカ)	3.697	21,629	5,850

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2021年11月22日現在におけるダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド（1,283,955千円）の内容です。

#### 外国株式

銘 柄	2021年11月22日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
ABBOTT LABORATORIES	16.11	204	23,315	ヘルスケア
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	11.54	126	14,475	情報技術
AFLAC INC	25.95	143	16,415	金融
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	14.25	311	35,524	資本財・サービス
APPLE INC	85.15	1,367	155,984	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9.39	107	12,254	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	27.85	141	16,161	コミュニケーション・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	30.35	175	20,026	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	17.58	282	32,278	金融
CISCO SYSTEMS INC	35.09	186	21,320	情報技術
MORGAN STANLEY	12.19	118	13,479	金融

銘 柄	2021年11月22日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADCOM INC	3.57	203	23,166	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	4.86	259	29,600	生活必需品
ACTIVISION BLIZZARD INC	46.46	289	33,068	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	40.67	224	25,582	生活必需品
NEXTERA ENERGY INC	46.06	406	46,410	公益事業
HOME DEPOT INC	6.58	268	30,683	一般消費財・サービス
HUMANA INC	1.48	64	7,343	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	6.32	139	15,955	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	18.1	294	33,640	ヘルスケア
MAGNA INTERNATIONAL INC	30.21	259	29,557	一般消費財・サービス
ABBVIE INC	13.66	158	18,117	ヘルスケア
KLA CORP	3.53	149	17,012	情報技術

ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

銘柄	2021年11月22日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ELI LILLY & CO	8.47	220	25,194	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	2.41	155	17,722	情報技術
MCDONALD'S CORP	8.22	207	23,630	一般消費財・サービス
MERCK & CO. INC.	31.47	253	28,977	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	5.14	41	4,692	素材
NIKE INC -CL B	12.95	226	25,840	一般消費財・サービス
MCKESSON CORP	7.1	156	17,895	ヘルスケア
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	14.21	128	14,657	生活必需品
PFIZER INC	56.67	287	32,847	ヘルスケア
PROCTER & GAMBLE CO/THE	22.29	327	37,340	生活必需品
EXELON CORP	72.3	387	44,225	公益事業
CONOCOPHILLIPS	4.92	34	3,907	エネルギー
PEPSICO INC	12.91	211	24,129	生活必需品
CORTEVA INC	9.27	44	5,056	素材
ACCENTURE PLC-CL A	8.98	332	37,889	情報技術
CHEVRON CORP	3.24	36	4,137	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15.17	152	17,443	情報技術
UNITEDHEALTH GROUP INC	5.59	245	28,064	ヘルスケア
ANTHEM INC	2.59	107	12,270	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	17.56	270	30,855	コミュニケーション・サービス
WALMART INC	6.72	95	10,917	生活必需品
TJX COMPANIES INC	28.72	203	23,272	一般消費財・サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	11.88	238	27,226	情報技術
MASTERCARD INC - A	7.39	251	28,645	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	62.5	283	32,375	金融
AMERICAN EXPRESS CO	19.35	335	38,314	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	23.94	131	15,009	金融
AMGEN INC	6.62	136	15,566	ヘルスケア
APPLIED MATERIALS INC	9.34	140	15,988	情報技術
GILEAD SCIENCES INC	17.1	117	13,402	ヘルスケア
BAXTER INTERNATIONAL INC	14.83	117	13,411	ヘルスケア
MICROSOFT CORP	54.27	1,862	212,460	情報技術
MEDTRONIC PLC	20.82	244	27,846	ヘルスケア
BLACKROCK INC	1.51	138	15,763	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	34.14	90	10,342	公益事業
INTUIT INC	5.2	360	41,077	情報技術
BEST BUY CO INC	4.59	62	7,129	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	60.91	316	36,076	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	1,218.24 61銘柄	14,837 <76.6%>	1,692,980
(香港)	百株	千香港・ドル	千円	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	80.68	420	6,158	資本財・サービス
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	680	416	6,106	生活必需品
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	460	353	5,182	資本財・サービス

銘柄	2021年11月22日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
HUANENG POWER INTL INC-H	1,260	419	6,146	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,290	1,193	17,478	金融
CK ASSET HOLDINGS LTD	80.68	369	5,413	不動産
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	480	785	11,504	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,780	1,184	17,349	金融
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,108	895	13,115	一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,220	855	12,528	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	259	364	5,334	ヘルスケア
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	3,440	3,749	54,931	素材
BANK OF CHINA LTD-H	3,360	937	13,733	金融
香港・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	17,498.36 13銘柄	11,944 <7.9%>	174,984
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	73.65	24	3,688	エネルギー
GLAXOSMITHKLINE PLC	33.25	50	7,758	ヘルスケア
RIO TINTO PLC	14.86	66	10,152	素材
3I GROUP PLC	28.11	40	6,220	金融
LLOYDS BANKING GROUP PLC	704.17	34	5,297	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	17.92	28	4,422	エネルギー
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	871.96 6銘柄	244 <1.7%>	37,541
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.2	81	9,996	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	11.47	140	17,293	生活必需品
NOVARTIS AG-REG	7.85	59	7,331	ヘルスケア
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	21.52 3銘柄	281 <1.6%>	34,621
(ノルウェー)	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
TELENOR ASA	35.9	500	6,388	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	35.9 1銘柄	500 <0.3%>	6,388
(ユーロ(オランダ))	百株	千ユーロ	千円	
ASML HOLDING NV	1.32	100	12,906	情報技術
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	1.32 1銘柄	100 <0.6%>	12,906
(ユーロ(フランス))	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	11.59	48	6,247	エネルギー
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2.14	156	20,197	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	5.88	126	16,326	情報技術

ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

銘柄	2021年11月22日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
AXA SA	百株 30.88	千ユーロ 77	千円 9,998	金融
SANOFI	7.33	65	8,384	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	57.82 5銘柄	475 61,155 <2.8%>	
<b>ユーロ(ドイツ)</b>	百株	千ユーロ	千円	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2.14	38	4,973	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	13.47	209	26,899	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	15.61 2銘柄	247 31,873 <1.4%>	
<b>ユーロ(スペイン)</b>	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	108.96	109	14,146	公益事業
BANCO SANTANDER SA	142.77	43	5,618	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	251.73 2銘柄	153 19,764 <0.9%>	
<b>ユーロ(その他)</b>	百株	千ユーロ	千円	
UNILEVER PLC	10.08	46	5,938	生活必需品
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	10.08 1銘柄	46 5,938 <0.3%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	336.56 11銘柄	1,023 131,638 <6.0%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 <比率>	19,982.54 95銘柄	— 2,078,154 <94.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月22日現在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。

# ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド 運用報告書 第6期（決算日 2021年5月21日）

（作成対象期間 2020年5月22日～2021年5月21日）

ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株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	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の金融商品取引所上場および店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

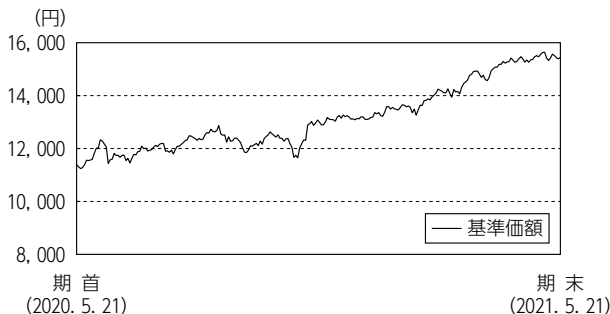
Daiwa Asset Management

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

《運用経過》



年 月 日	基準 価 額		MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	%	(参考指数)	騰落率		
(期首)2020年5月21日	11,389	—	11,345	—	91.8	—
5月末	11,546	1.4	11,587	2.1	92.1	—
6月末	11,638	2.2	11,869	4.6	94.4	—
7月末	11,797	3.6	12,263	8.1	94.9	—
8月末	12,652	11.1	13,148	15.9	94.2	—
9月末	12,089	6.1	12,693	11.9	94.2	—
10月末	11,741	3.1	12,443	9.7	94.1	—
11月末	13,091	14.9	13,848	22.1	94.6	—
12月末	13,313	16.9	14,242	25.5	93.6	—
2021年1月末	13,491	18.5	14,646	29.1	92.0	—
2月末	14,092	23.7	15,201	34.0	91.3	—
3月末	15,077	32.4	16,001	41.0	93.2	—
4月末	15,510	36.2	16,613	46.4	91.3	—
(期末)2021年5月21日	15,439	35.6	16,482	45.3	91.8	—

(注1) 騰落率は期首比。

(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。

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：11,389円 期末：15,439円 騰落率：35.6%

【基準価額の主な変動要因】

保有銘柄が上昇したことや為替が円安に推移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。

◆投資環境について

○世界株式市況

世界株式市況は上昇しました。

世界株式市況は、当作成期首より2020年8月末にかけては、各国の大胆な景気刺激策や経済活動の再開期待、新型コロナウイルスワクチン開発への期待などから上昇しました。その後9月に入ると、高値警戒感や欧州での感染拡大による行動制限を嫌気したことなどから、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り、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上昇しました。2021年1月末から当作成期末にかけては、金利上昇に伴って軟調な展開となる場面も散見されたものの、経済活動の正常化期待から堅調な展開になり、当作成期は大幅な上昇となりました。

○為替相場

米ドルの対円相場は上昇(円安)しました。

米ドルの対円相場は、当作成期首より2020年12月末にかけて、緩和的な金融環境から米国の実質金利が低下したことなどが米ドルの下落要因となり、円高米ドル安基調で推移しました。また、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念や、米中関係の動向および追加経済対策をめぐる不透明感なども、米ドル安要因となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・連邦議会上下両院を制したことやワクチンの実用化などから市場のリスク選好姿勢が強まり、円安米ドル高となりました。また、F R B (米国連邦準備制度理事会) 高官からの量的緩和政策の縮小時期をめぐる発言が、米国の金利上昇とともに米ドル買いにつながったことも米ドルの上昇要因となり、当作成期の米ドル円為替相場は上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、ミレーアセット・グローバル・インベストメント・グループに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行ってまいります。今後も、配当成長、フリーキャッシュフロー、株価バリュエーション、企業の財務体質などに着目した運用を行ってまいります。また、株主還元積極的に積極的な企業へ注目が集まる中、配当とともに自社株買いを通じてEPS (1株当たり利益) やROE (株主資本利益率) の向上が期待できる銘柄にも注目していきます。

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、ミレーアセット・グローバル・インベストメント・グループに運用の指図にかかる権限を委託しております。

株式の個別銘柄で寄与度が高かった銘柄はZIJIN MINING GROUP (中国、素材) やMICROSOFT (米国、情報技術)、寄与度が低かった銘柄はINTEL (米国、情報技術) やCNOOC (中国、エネルギー) などでした。

◆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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。



《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、ミレーアセット・グローバル・インベストメント・グループに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。今後も、配当成長、フリーキャッシュフロー、株価バリュエーション、企業の財務体質などに着目した運用を行ってまいります。また、株主還元積極的に企業へ注目が集まる中、配当とともに自社株買いを通じてEPS（1株当たり利益）やROE（株主資本利益率）の向上が期待できる銘柄にも注目していきます。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	2円 (2)
有価証券取引税 (株式)	1 (1)
その他費用 (保管費用) (その他)	12 (12) (0)
合計	16

(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

株式

(2020年5月22日から2021年5月21日まで)

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外国	アメリカ	百株 — ( 155.73)	千アメリカ・ドル — ( —)	百株 849.24	千アメリカ・ドル 8,545
	カナダ	百株 — ( —)	千カナダ・ドル — ( —)	百株 14.56	千カナダ・ドル 114
	オーストラリア	百株 — ( —)	千オーストラリア・ドル — ( —)	百株 89.45	千オーストラリア・ドル 864
	香港	百株 496 ( —)	千香港・ドル 539 ( —)	百株 15,608	千香港・ドル 11,464
	イギリス	百株 — ( 0.41)	千イギリス・ポンド — ( 1)	百株 779.76	千イギリス・ポンド 206
	スイス	百株 — ( —)	千スイス・フラン — ( —)	百株 14.32	千スイス・フラン 167
	ノルウェー	百株 — ( —)	千ノルウェー・クローネ — ( —)	百株 22.44	千ノルウェー・クローネ 333
	ユーロ (オランダ)	百株 — (△ 15.93)	千ユーロ — ( —)	百株 8.06	千ユーロ 115
	ユーロ (フランス)	百株 — ( —)	千ユーロ — ( —)	百株 47.49	千ユーロ 329
	ユーロ (ドイツ)	百株 — ( —)	千ユーロ — ( —)	百株 9.25	千ユーロ 103
ユーロ (スペイン)	百株 — ( 16.73)	千ユーロ — ( 6)	百株 169.77	千ユーロ 112	
ユーロ (その他)	百株 — ( 15.52)	千ユーロ — (△ 1)	百株 4.42	千ユーロ 21	
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 — ( 16.32)	千ユーロ — ( 4)	百株 238.99	千ユーロ 682	

(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。

# ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

## ■主要な売買銘柄 株 式

(2020年5月22日から2021年5月21日まで)

当 期				期			
買		付		売		付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
CNOOC LTD (香港)	46	4,901	106	MICROSOFT CORP (アメリカ)	4,627	111,905	24,185
CHINA MOBILE LTD (香港)	3.6	2,365	656	APPLE INC (アメリカ)	3,606	53,244	14,765
				MACQUARIE GROUP LTD (オーストラリア)	4,699	42,545	9,054
				MASTERCARD INC - A (アメリカ)	1,041	38,056	36,558
				VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ)	1,58	35,870	22,703
				CNOOC LTD (香港)	280	30,943	110
				ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H (中国)	250	30,378	121
				NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)	3,082	28,850	9,361
				COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL (オーストラリア)	4,246	22,609	5,324
				PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)	1,545	22,384	14,488

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表 外国株式

銘 柄	期 首		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	千アメリカ・ドル	千円	
<b>(アメリカ)</b>					
ABBOTT LABORATORIES	35	21.83	257	28,004	ヘルスケア
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	23	15.01	224	24,489	情報技術
AFLAC INC	82	54.23	301	32,864	金融
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	21	13.57	301	32,825	資本財・サービス
CITIGROUP INC	8	2.89	22	2,398	金融
APPLE INC	27	67.74	862	93,915	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19	10.91	124	13,595	金融
BOEING CO/THE	18	11.55	262	28,633	資本財・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	65	42.53	241	26,302	コミュニケーションサービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	55	34.92	233	25,478	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	22	13.23	212	23,171	金融
DELTA AIR LINES INC	16	10.59	48	5,236	資本財・サービス
CISCO SYSTEMS INC	49	25.66	135	14,768	情報技術
MORGAN STANLEY	25	14.16	122	13,333	金融
BROADCOM INC	5	3.3	150	16,351	情報技術
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6	3.98	43	4,758	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	7	4.28	164	17,878	生活必需品
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2	0.97	11	1,273	一般消費・サービス
COCA-COLA CO/THE	71	46.97	256	27,953	生活必需品
EXPEDIA GROUP INC	12	7.92	133	14,588	一般消費・サービス
NEXTERA ENERGY INC	24	59.51	442	48,144	公益事業
GENERAL MOTORS CO	9	5.95	33	3,596	一般消費・サービス

銘 柄	期 首		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	千アメリカ・ドル	千円	
HOME DEPOT INC	12	7.61	240	26,179	一般消費・サービス
HUMANA INC	3	1.63	71	7,805	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	12	7.28	145	15,829	情報技術
TRANE TECHNOLOGIES PLC	13	8.61	155	16,919	資本財・サービス
JOHNSON & JOHNSON	35	22.96	392	42,773	ヘルスケア
KLA CORP	3	1.97	61	6,722	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	11	7.28	282	30,785	資本財・サービス
MCDONALD'S CORP	15	9.4	218	23,767	一般消費・サービス
MERCK & CO. INC.	55	36.17	288	31,377	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	9	5.95	50	5,448	素材
NIKE INC -CL B	7	4.29	57	6,226	一般消費・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	33	21.64	210	22,957	生活必需品
ALTRIA GROUP INC	56	34.92	174	19,025	生活必需品
PFIZER INC	113	71.7	287	31,326	ヘルスケア
DOW INC	6	3.97	27	2,951	素材
PROCTER & GAMBLE CO/THE	40	24.55	338	36,894	生活必需品
EXELON CORP	143	94.59	432	47,116	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	11.47	7.59	36	3,989	資本財・サービス
CONOCOPHILLIPS	10	5.62	31	3,389	エネルギー
PEPSICO INC	23	15.01	220	24,066	生活必需品
CORTEVA INC	16	10.59	46	5,089	素材
ACCURENT PLC-CL A	19	11.3	320	34,942	情報技術
ROSS STORES INC	25	16.53	202	22,047	一般消費・サービス

ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

銘柄	期首		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	千アメリカ・ドル	千円		
CHEVRON CORP	6	3.84	39	4,330	エネルギー	
VIATRIS INC	—	8.91	13	1,512	ヘルスケア	
AT&T INC	93	61.51	182	19,854	コミュニケーション/サービス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9	5.62	229	25,009	ヘルスケア	
VALERO ENERGY CORP	4	1.65	12	1,383	エネルギー	
ANTHEM INC	5	2.97	116	12,650	ヘルスケア	
WALT DISNEY CO/THE	31	20.16	345	37,620	コミュニケーション/サービス	
WALMART INC	12	7.4	105	11,477	生活必需品	
TJX COMPANIES INC	50	33.06	222	24,254	一般消費/サービス	
VISA INC-CLASS A SHARES	46	30.2	683	74,471	情報技術	
TYSON FOODS INC-CL A	12	6.94	55	6,089	生活必需品	
MASTERCARD INC - A	28	17.59	646	70,434	情報技術	
BANK OF AMERICA CORP	49	27.06	113	12,338	金融	
AMERICAN EXPRESS CO	38	25	388	42,343	金融	
AMGEN INC	12	7.61	191	20,878	ヘルスケア	
EATON CORP PLC	4	1.98	28	3,096	資本財/サービス	
APPLIED MATERIALS INC	14	9.27	120	13,154	情報技術	
GILEAD SCIENCES INC	30	19.84	137	14,983	ヘルスケア	
BAXTER INTERNATIONAL INC	26	17.19	142	15,530	ヘルスケア	
INTEL CORP	74	36.97	206	22,525	情報技術	
MICROSOFT CORP	121	74.73	1,841	200,587	情報技術	
MEDTRONIC PLC	36	23.8	301	32,838	ヘルスケア	
CENTERPOINT ENERGY INC	72	39.23	96	10,552	公益事業	
INTUIT INC	11	7.06	307	33,465	情報技術	
BEST BUY CO INC	8	5.29	60	6,597	一般消費/サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	85	56.22	309	33,697	コミュニケーション/サービス	
アメリカ・ドル	株数、金額	2,147.47	1,453.96	15,783	1,718,873	
通貨計	銘柄数<比率>	70銘柄	71銘柄		<69.7%>	
<b>(カナダ)</b>		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	株数、金額	43	28.44	264	23,893	金融
カナダ・ドル	株数、金額	43	28.44	264	23,893	
通貨計	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<1.0%>	
<b>(オーストラリア)</b>		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	株数、金額	42.46	—	—	—	金融
MACQUARIE GROUP LTD	株数、金額	46.99	—	—	—	金融
オーストラリア・ドル	株数、金額	89.45	—	—	—	
通貨計	銘柄数<比率>	2銘柄	—		<—>	
<b>(香港)</b>		百株	百株	千香港・ドル	千円	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	株数、金額	175.68	120.68	748	10,505	資本財/サービス
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	株数、金額	1,480	1,000	576	8,081	生活必需品
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	株数、金額	980	660	601	8,444	資本財/サービス
CNOOC LTD	株数、金額	2,340	—	—	—	エネルギー
HUANENG POWER INTL INC-H	株数、金額	2,760	1,860	515	7,228	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株数、金額	5,060	3,410	2,100	29,470	金融

銘柄	期首		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	千香港・ドル	千円		
CHINA MOBILE LTD	185	—	—	—	コミュニケーション/サービス	
CK ASSET HOLDINGS LTD	180.68	120.68	586	8,228	不動産	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,055	710	1,195	16,774	エネルギー	
IND & COMM BK OF CHINA-H	6,110	4,120	2,039	28,612	金融	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2,428	1,648	1,128	15,838	一般消費/サービス	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,720	1,820	1,365	19,150	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	572	385	633	8,890	ヘルスケア	
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,600	5,100	5,997	84,146	素材	
BANK OF CHINA LTD-H	7,420	5,000	1,560	21,886	金融	
香港・ドル	株数、金額	41,066.36	25,954.36	19,049	267,261	
通貨計	銘柄数<比率>	15銘柄	13銘柄		<10.8%>	
<b>(イギリス)</b>		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	株数、金額	135	86.18	26	4,128	エネルギー
GLAXOSMITHKLINE PLC	株数、金額	59	37.65	51	7,905	ヘルスケア
RIO TINTO PLC	株数、金額	27	17.24	103	16,045	素材
VODAFONE GROUP PLC	株数、金額	206	131.49	16	2,596	コミュニケーション/サービス
3I GROUP PLC	株数、金額	52	31.66	39	6,044	金融
LLOYDS BANKING GROUP PLC	株数、金額	1,370	803.52	38	5,982	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	株数、金額	56	29.48	48	7,467	生活必需品
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株数、金額	32	20.43	28	4,368	エネルギー
イギリス・ポンド	株数、金額	1,937	1,157.65	353	54,539	
通貨計	銘柄数<比率>	8銘柄	8銘柄		<2.2%>	
<b>(スイス)</b>		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株数、金額	4	2.55	78	9,530	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	株数、金額	21	13.19	145	17,677	生活必需品
NOVARTIS AG-REG	株数、金額	14	8.94	70	8,588	ヘルスケア
スイス・フラン	株数、金額	39	24.68	294	35,796	
通貨計	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<1.5%>	
<b>(ノルウェー)</b>		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
TELENOR ASA	株数、金額	62	39.56	593	7,774	コミュニケーション/サービス
ノルウェー・クローネ	株数、金額	62	39.56	593	7,774	
通貨計	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.3%>	
<b>ユーロ(オランダ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
ASML HOLDING NV	株数、金額	3	1.45	76	10,139	情報技術
UNILEVER NV	株数、金額	17	—	—	—	その他
AIRBUS SE	株数、金額	15	9.56	92	12,291	資本財/サービス
国小計	銘柄数<比率>	35銘柄	2銘柄		<0.9%>	
<b>ユーロ(フランス)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTAL SE	株数、金額	20	12.77	49	6,557	エネルギー
L'OREAL	株数、金額	1	0.62	22	2,963	生活必需品

# ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株マザーファンド

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	百株	百株	千ユーロ	千円	一般消費・サービス
CAPGEMINI SE	4	2.36	148	19,772	情報技術
AXA SA	12	6.76	103	13,742	金融
SANOFI	57	35.3	78	10,522	ヘルスケア
VINCI SA	14	8.48	74	9,952	資本財・サービス
	16	10.22	94	12,640	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	124 7銘柄	76.51 7銘柄	571 <3.1%>	76,151
<b>ユーロ(ドイツ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOLKSWAGEN AG-PREF	4	2.36	50	6,776	一般消費・サービス
BASF SE	16	10.22	69	9,209	素材
ALLIANZ SE-REG	5	3.17	68	9,077	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	25 3銘柄	15.75 3銘柄	188 <1.0%>	25,063
<b>ユーロ(スペイン)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	192	121.42	139	18,553	公益事業
BANCO SANTANDER SA	249	166.54	55	7,361	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	441 2銘柄	287.96 2銘柄	194 <1.1%>	25,914
<b>ユーロ(その他)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
UNILEVER PLC	—	11.1	55	7,359	生活必需品
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	11.1 1銘柄	55 <0.3%>	7,359
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	625 15銘柄	402.33 15銘柄	1,177 <6.4%>	156,920
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	46,009.28 115銘柄	29,060.98 112銘柄	— <91.8%>	2,265,059

(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5月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 2,265,059	% 90.4
コール・ローン等、その他	241,142	9.6
投資信託財産総額	2,506,201	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、5月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.90円、1カナダ・ドル=90.27円、1香港・ドル=14.03円、1イギリス・ポンド=154.40円、1スイス・フラン=121.35円、1ノルウェー・クローネ=13.11円、1ユーロ=133.22円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(2,448,331千円)の投資信託財産総額(2,506,201千円)に対する比率は、97.7%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年5月21日現在

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>2,506,201,448円</b>
コール・ローン等	204,928,567
株式(評価額)	2,265,059,370
未収入金	33,028,980
未収配当金	3,184,531
<b>(B)負債</b>	<b>40,000,000</b>
未払解約金	40,000,000
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>2,466,201,448</b>
元本	1,597,426,686
次期繰越損益金	868,774,762
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>1,597,426,686口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	15,439円

\*期首における元本額は2,618,887,542円、当作成期間中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は1,021,460,856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:

ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株ファンド 1,597,426,686円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は15,439円です。

■損益の状況

当期 自2020年5月22日 至2021年5月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	69,527,373円
受取配当金	66,423,292
受取利息	14,172
その他収益金	3,105,548
支払利息	△ 15,639
(B) 有価証券売買損益	799,863,066
売買益	860,012,300
売買損	△ 60,149,234
(C) その他費用	△ 2,748,298
(D) 当期損益金 (A + B + C)	866,642,141
(E) 前期繰越損益金	363,671,765
(F) 解約差損益金	△ 361,539,144
(G) 合計 (D + E + F)	868,774,762
次期繰越損益金 (G)	868,774,762

(注) 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。