

ダイワ／ミレーアセット・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／為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版) 満期償還

(償還日 2022年9月16日)
(作成対象期間 2022年3月23日～2022年9月16日)

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	2012年9月20日～2022年9月16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、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Aクラス」の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジ な し	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Bクラス」の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネースtock・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し上げます。

当ファンドは、新興国消費市場の拡大から恩恵を受ける企業の株式の値上がり益を追求することにより、信託財産の成長をめざしており、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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/>

為替ヘッジあり

最近 5 期の運用実績

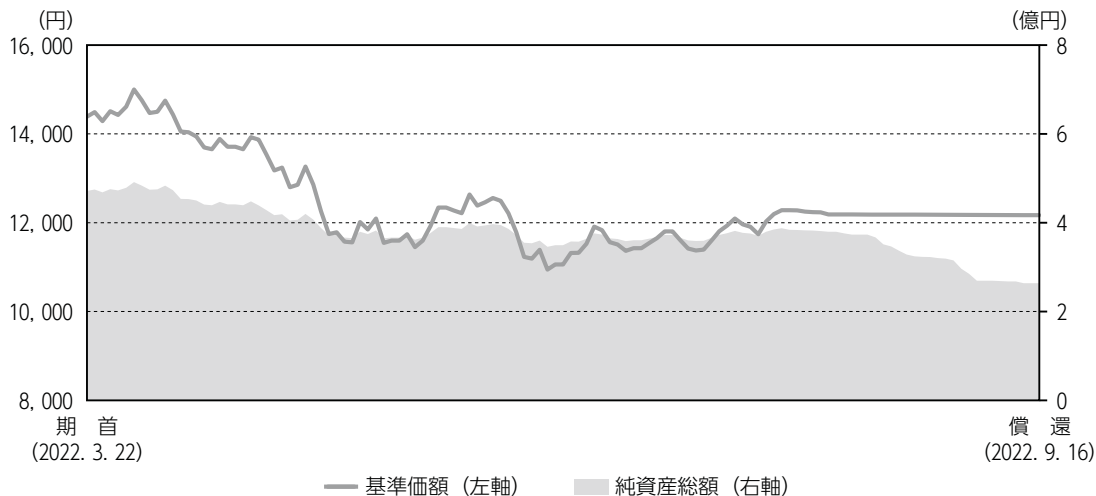
決 算 期	基 準 価 額			MSCI AC World 指数 (配当込み、米ドルベース)		公 社 債 入 率	投 資 信 託 受 益 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配額)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
16期末（2020年 9 月23日）	16,699	900	52.0	20,250	40.9	—	98.4	674
17期末（2021年 3 月19日）	17,535	1,900	16.4	24,545	21.2	—	98.1	660
18期末（2021年 9 月21日）	17,904	1,100	8.4	26,458	7.8	—	97.6	641
19期末（2022年 3 月22日）	14,389	0	△ 19.6	26,040	△ 1.6	—	98.2	471
償 還（2022年 9 月16日）	12,170.43	—	△ 15.4	22,716	△ 12.8	—	—	263

- （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.（「MSCI」）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 が開発した指数です。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 に帰属します。またMSCI 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。本ファンドは、MSCI によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCI は本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。
〔<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>〕
- （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



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：12,170円43銭（既払分配金5,630円）

騰落率：72.5%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

保有株式が上昇したことが主なプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジあり）

年 月 日	基 準 価 額		M S C I A C World 指数 (配当込み、米ドルベース)		公 社 債 組 入 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(参 考 指 数)	騰 落 率		
(期 首) 2022年 3 月22日	円	%		%	%	%
	14,389	—	26,040	—	—	98.2
3 月末	14,758	2.6	26,825	3.0	—	98.3
4 月末	12,854	△ 10.7	24,365	△ 6.4	—	98.3
5 月末	12,341	△ 14.2	24,557	△ 5.7	—	98.5
6 月末	11,510	△ 20.0	22,610	△ 13.2	—	98.6
7 月末	12,193	△ 15.3	23,653	△ 9.2	—	98.8
8 月末	12,178	△ 15.4	23,192	△ 10.9	—	—
(償 還) 2022年 9 月16日	12,170.43	△ 15.4	22,716	△ 12.8	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

（2012. 9. 20 ～ 2022. 9. 16）

■世界株式市況

世界株式市況は上昇しました。

当ファンド設定時から2018年 1 月にかけての世界株式市況は、世界経済の回復や良好な金利環境が支援材料となり、上昇基調で推移しました。2019年末にかけては、英国のEU（欧州連合）離脱や米中間の貿易摩擦など、世界景気に対する不確実性が高まったことで下落する場面も見られましたが、FRB（米国連邦準備制度理事会）の金融緩和姿勢への転換観測などから底堅く推移しました。2021年末にかけて、新型コロナウイルス感染拡大を受けて一時急落しましたが、各国で積極的な金融緩和政策や景気刺激策が打ち出されたこと、また新型コロナウイルスのワクチンの開発・接種が進展したことにより経済活動が正常化に向かうに連れて上昇しました。その後は、米国の金融政策への懸念や、ロシアのウクライナ侵攻を受けて原油価格が上昇し、世界的なインフレ懸念が高まったことなどから、不安定な値動きとなりました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

エクイティファンドAとダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資します。また、エクイティファンドAへの投資割合を高位に維持することを基本とします。

※エクイティファンドA：ダイワ・プレミアム・トラストミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Aクラス

■エクイティファンドA

新興国において売上成長が期待される銘柄の中から、同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに投資してまいります。地域別では、強固なブランド力などを有する米国や欧州などの先進国企業中心のポートフォリオを維持する予定です。新興国の銘柄に関しては、人口の増加、消費の拡大などがプラスに寄与する銘柄などを限定的に組み入れてまいります。

また、円買い／外貨売りのヘッジポジションを高位に維持してまいります。

■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います。

信託期間中のポートフォリオについて

（2012. 9. 20 ～ 2022. 9. 16）

■当ファンド

当ファンドは、エクイティファンドAとダイワ・マネースtock・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。エクイティファンドAへの投資割合は信託財産の純資産総額の95%程度以上とすることをめざしました。

■エクイティファンドA

新興国において売上成長が期待される銘柄の中から、同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに投資を行いました。地域別では、強固なブランド力などを有する米国や欧州などの先進国企業中心のポートフォリオを構築しました。新興国の銘柄に関しては、人口の増加、消費の拡大などがプラスに寄与する銘柄などを限定的に組み入れました。

また、円買い／外貨売りのヘッジポジションを高位に維持しました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

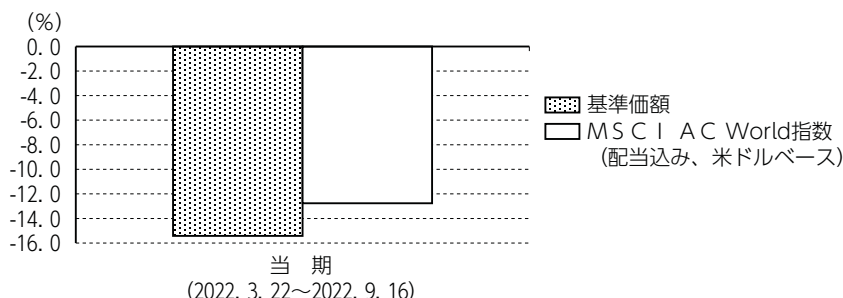
流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行いました。

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、当作成期における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。

参考指数は世界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

1万口当り、第1期200円、第2期300円、第3期200円、第4期30円、第5期200円、第8期100円、第9期～第10期各150円、第11期400円、第16期900円、第17期1,900円、第18期1,100円の収益分配を行いました。なお、第6期～第7期、第12期～第15期、第19期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を行いませんでした。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2022. 3. 23～2022. 9. 16)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	78円	0. 633%	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, 399円です。
(投 信 会 社)	(23)	(0. 188)	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)	(53)	(0. 429)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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. 016)	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	—	—	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
合 計	78	0. 633	

(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。

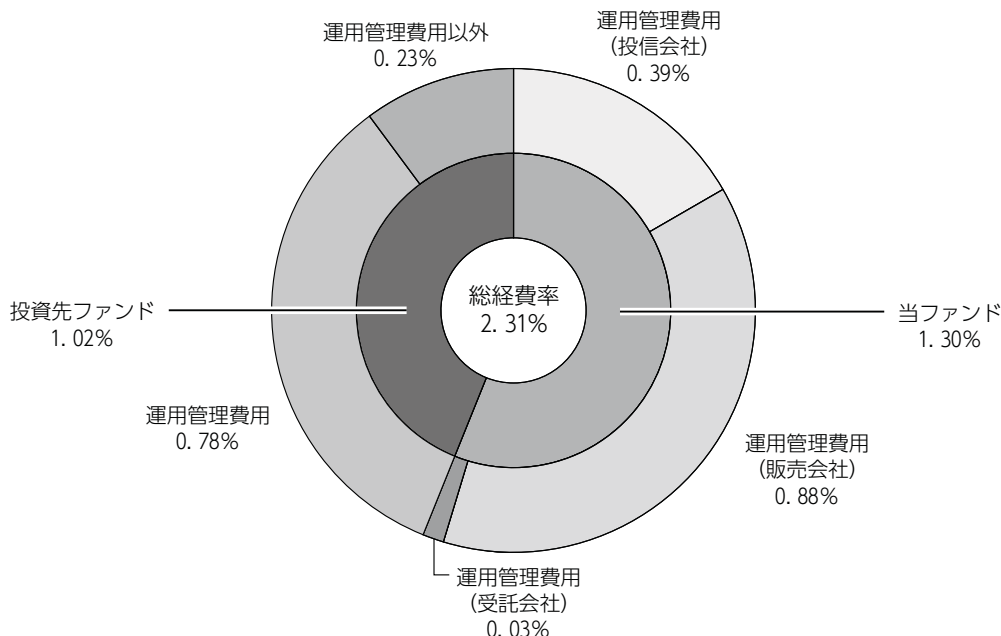
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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2.31%です。



総経費率（①＋②＋③）	2.31%
①当ファンドの費用の比率	1.30%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.78%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.23%

（注1）投資先ファンドとは、当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）投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

（注4）各比率は、年率換算した値です。

（注5）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6）①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

（注7）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8）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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年9月16日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	266,392,684円
コール・ローン等	266,392,684
(B) 負債	2,424,635
未払信託報酬	2,422,895
未払利息	1,740
(C) 純資産総額 (A－B)	263,968,049
元本	216,892,915
償還差損益金	47,075,134
(D) 受益権総口数	216,892,915口
1万口当り償還価額 (C／D)	12,170円43銭

* 期首における元本額は327,728,108円、当作成期間中における追加設定元本額は14,038円、同解約元本額は110,849,231円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は12,170円43銭です。

■損益の状況

当期 自2022年3月23日 至2022年9月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 9,826円
受取利息	1,183
支払利息	△ 11,009
(B) 有価証券売買損益	△ 45,679,282
売買益	1,410,824
売買損	△ 47,090,106
(C) 信託報酬等	△ 2,422,895
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 48,112,003
(E) 前期繰越損益金	90,624,081
(F) 追加信託差損益金	4,563,056
(配当等相当額)	(4,551,531)
(売買損益相当額)	(11,525)
(G) 合計 (D + E + F)	47,075,134
償還差損益金 (G)	47,075,134

(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。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表					
信 託 期 間	投資信託契約締結日	2012年 9月20日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年 9月16日		資 産 総 額	266,392,684円
区 分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負 債 総 額	2,424,635円
				純資産総額	263,968,049円
受益権口数	17,538,128,439口	216,892,915口	△ 17,321,235,524口	受益権口数	216,892,915口
元 本 額	17,538,128,439円	216,892,915円	△ 17,321,235,524円	1 単位当り償還金	12,170円43銭
毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	円 15,360,413,046	円 15,977,883,674	円 10,402	円 200	% 2.00
第 2 期	5,685,064,647	6,786,025,552	11,937	300	3.00
第 3 期	3,159,707,682	3,977,024,385	12,587	200	2.00
第 4 期	2,722,698,562	3,440,634,290	12,637	30	0.30
第 5 期	2,399,437,685	3,214,213,573	13,396	200	2.00
第 6 期	2,167,880,941	2,735,146,977	12,617	0	0.00
第 7 期	1,836,127,154	2,207,073,040	12,020	0	0.00
第 8 期	1,369,990,544	1,693,947,035	12,365	100	1.00
第 9 期	1,079,709,436	1,400,590,448	12,972	150	1.50
第10期	907,318,924	1,234,173,751	13,602	150	1.50
第11期	737,830,246	1,106,828,246	15,001	400	4.00
第12期	693,995,378	1,029,280,471	14,831	0	0.00
第13期	588,374,199	850,947,028	14,463	0	0.00
第14期	495,736,055	717,492,135	14,473	0	0.00
第15期	434,418,780	502,878,618	11,576	0	0.00
第16期	403,828,181	674,333,207	16,699	900	9.00
第17期	376,928,244	660,926,703	17,535	1,900	19.00
第18期	358,312,529	641,511,754	17,904	1,100	11.00
第19期	327,728,108	471,557,789	14,389	0	0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	12,170円43銭

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 入 率	投 資 信 託 受 益 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配額)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
16期末（2020年 9 月23日）	20,738	1,100	47.1	27,154	35.9	—	98.1	121
17期末（2021年 3 月19日）	22,905	2,500	22.5	34,152	25.8	—	98.2	131
18期末（2021年 9 月21日）	22,962	2,100	9.4	36,973	8.3	—	97.6	114
19期末（2022年 3 月22日）	19,948	0	△ 13.1	39,865	7.8	—	98.4	92
償 還（2022年 9 月16日）	19,325.04	—	△ 3.1	41,461	4.0	—	—	73

（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.（「MSCI」）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が開発した指数です。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に帰属します。またMSCI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。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。

[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>]

（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。

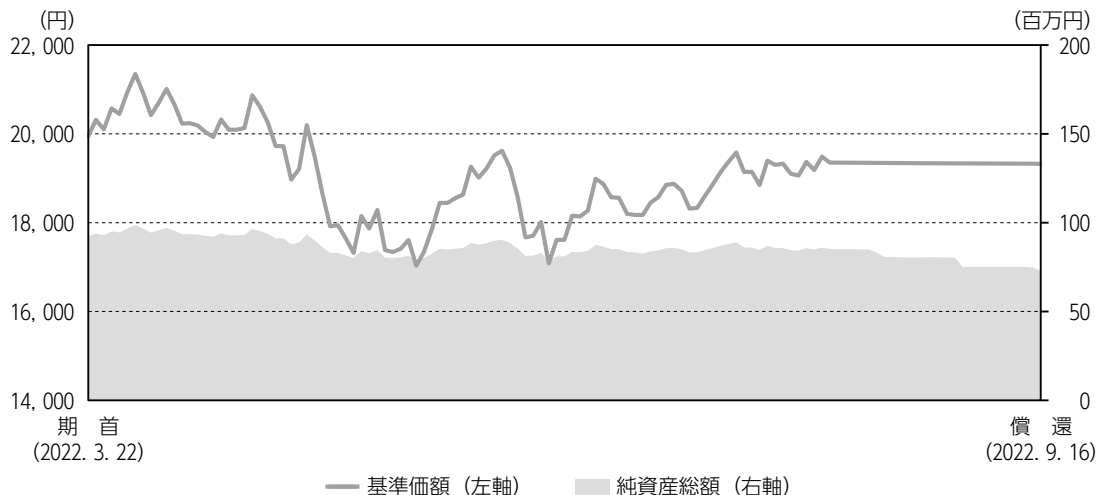
（注 5）公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

（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



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：19,325円04銭（既払分配金9,170円）

騰落率：208.2%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

米ドルが対円で上昇（円安）したことや保有株式が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		M S C I A C World 指数 （配当込み、円換算）		公 社 債 入 率 組 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	（ 参 考 指 数 ）	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
（期 首）2022年 3 月22日	19,948	—	39,865	—	—	98.4
3 月末	20,919	4.9	41,871	5.0	—	98.5
4 月末	19,206	△ 3.7	40,042	0.4	—	98.4
5 月末	18,446	△ 7.5	40,154	0.7	—	98.9
6 月末	18,562	△ 6.9	39,412	△ 1.1	—	98.2
7 月末	19,301	△ 3.2	40,607	1.9	—	98.1
8 月末	19,337	△ 3.1	41,004	2.9	—	—
（償 還）2022年 9 月16日	19,325.04	△ 3.1	41,461	4.0	—	—

（注）騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

（2012. 9. 20 ～ 2022. 9. 16）

■世界株式市況

世界株式市況は上昇しました。

当ファンド設定時から2018年 1 月にかけての世界株式市況は、世界経済の回復や良好な金利環境が支援材料となり、上昇基調で推移しました。2019年末にかけては、英国のEU（欧州連合）離脱や米中間の貿易摩擦など、世界景気に対する不確実性が高まったことで下落する場面も見られましたが、FRB（米国連邦準備制度理事会）の金融緩和姿勢への転換観測などから底堅く推移しました。2021年末にかけて、新型コロナウイルス感染拡大を受けて一時急落しましたが、各国で積極的な金融緩和政策や景気刺激策が打ち出されたこと、また新型コロナウイルスのワクチンの開発・接種が進展したことにより経済活動が正常化に向かうに連れて上昇しました。その後は、米国の金融政策への懸念や、ロシアのウクライナ侵攻を受けて原油価格が上昇し、世界的なインフレ懸念が高まったことなどから、不安定な値動きとなりました。

■為替相場

米ドルは対円で上昇しました。

当ファンド設定時から2015年半ばにかけて、日銀の量的・質的金融緩和政策の拡大などが材料視され、円安米ドル高が進行しました。2015年半ばから2019年末にかけては、日銀によるマイナス金利の導入発表に加えて、英国のEU（欧州連合）離脱や米中貿易摩擦を背景にリスク回避の動きが強まったことから、米ドルは対円で下落（円高）しました。2019年末以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大からリスク回避の動きが強まるなど、一時的に円買いの動きから円高米ドル安基調で推移する場面も見られました。しかし米国では、金融政策正常化が意識されたことから米国金利が上昇した一方で、日銀は断続的に金利上昇を抑制する姿勢を示したことから、日米の金融政策の相違が意識され、円安米ドル高が進行しました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

エクイティファンドBとダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資します。また、エクイティファンドBへの投資割合を高位に維持することを基本とします。

※エクイティファンドB：ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Bクラス

■エクイティファンドB

新興国において売上成長が期待される銘柄の中から、同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに投資してまいります。地域別では、強固なブランド力などを有する米国や欧州などの先進国企業中心のポートフォリオを維持する予定です。新興国の銘柄に関しては、人口の増加、消費の拡大などがプラスに寄与する銘柄などを限定的に組み入れてまいります。

■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います。

信託期間中のポートフォリオについて

（2012. 9. 20 ～ 2022. 9. 16）

■当ファンド

当ファンドは、エクイティファンドBとダイワ・マネースtock・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。エクイティファンドBへの投資割合は信託財産の純資産総額の95%程度以上とすることをめざしました。

■エクイティファンドB

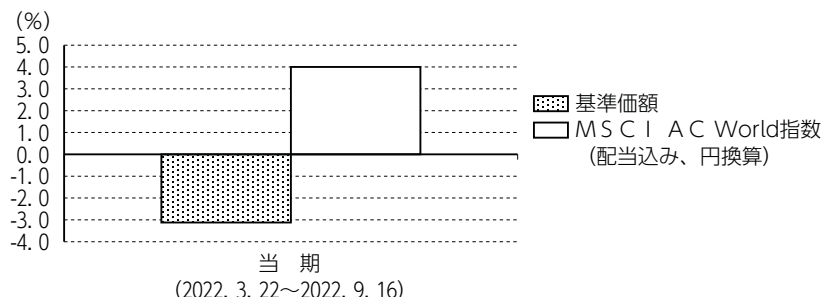
新興国において売上成長が期待される銘柄の中から、同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに投資を行いました。地域別では、強固なブランド力などを有する米国や欧州などの先進国企業中心のポートフォリオを構築しました。新興国の銘柄に関しては、人口の増加、消費の拡大などがプラスに寄与する銘柄などを限定的に組み入れました。

■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、当作成期における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。
参考指数は世界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

1万口当り、第1期700円、第2期500円、第3期350円、第4期120円、第5期600円、第9期600円、第10期100円、第11期350円、第12期150円、第16期1,100円、第17期2,500円、第18期2,100円の収益分配を行いました。なお、第6期～第8期、第13期～第15期、第19期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を行いませんでした。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜り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 (2022. 3. 23～2022. 9. 16)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	121円	0. 633%	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 19, 102円です。
(投 信 会 社)	(36)	(0. 188)	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)	(82)	(0. 429)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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. 016)	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	—	—	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
合 計	121	0. 633	

(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。

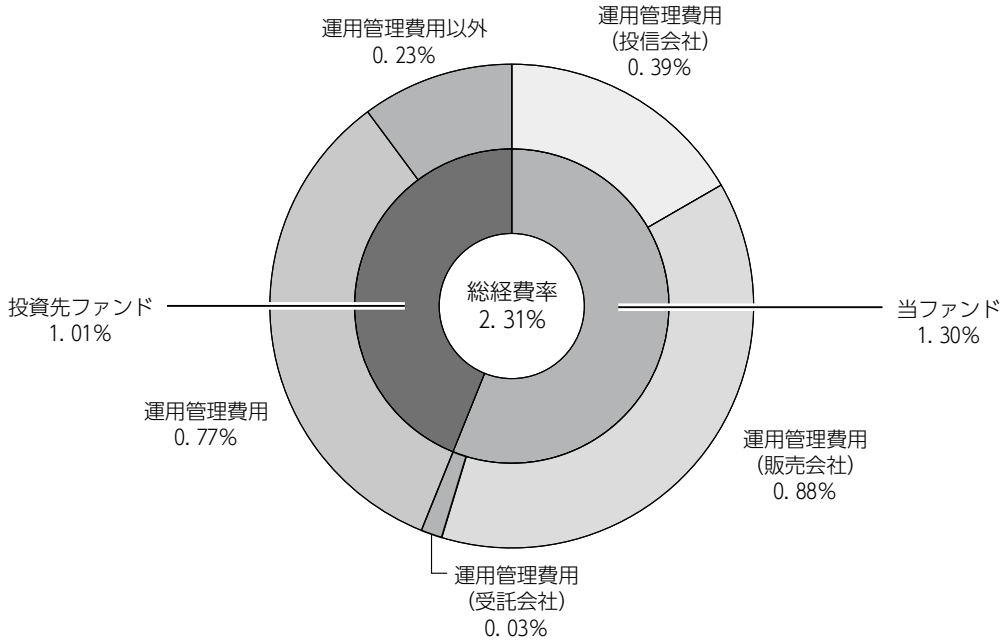
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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2.31%です。



総経費率（①＋②＋③）	2.31%
①当ファンドの費用の比率	1.30%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.77%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.23%

(注1) 投資先ファンドとは、当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) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。
(注4) 各比率は、年率換算した値です。
(注5) 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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。
(注7) 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8) 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

(1) 投資信託受益証券

（2022年3月23日から2022年9月16日まで）

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 （邦貨建）	—	—	247.0118	88,330

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2022年3月23日から2022年9月16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	—	—	315	315

（注）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

（2022年3月23日から2022年9月16日まで）

当 期							
買 付		売 付					
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
				MIRAE ASSET GLOBAL GREAT CONSUMER EQUITY FUND B CLASS（ケイマン諸島）	247.0118	88,330	357

（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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	□ 数
	千口
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	315

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年9月16日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	75,631	100.0
投資信託財産総額	75,631	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

2022年9月16日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	75,631,651円
コール・ローン等	75,631,651
(B) 負債	2,599,665
未払解約金	2,053,684
未払信託報酬	545,489
未払利息	492
(C) 純資産総額 (A－B)	73,031,986
元本	37,791,367
償還差損益金	35,240,619
(D) 受益権総口数	37,791,367口
1万口当り償還価額 (C／D)	19,325円04銭

* 期首における元本額は46,215,769円、当作成期間中における追加設定元本額は63,163円、同解約元本額は8,487,565円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は19,325円04銭です。

■損益の状況

当期 自2022年3月23日 至2022年9月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,596円
受取利息	136
支払利息	△ 2,732
(B) 有価証券売買損益	△ 1,802,813
売買益	178,120
売買損	△ 1,980,933
(C) 信託報酬等	△ 545,489
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	△ 2,350,898
(E) 前期繰越損益金	26,355,293
(F) 追加信託差損益金	11,236,224
(配当等相当額)	(9,123,421)
(売買損益相当額)	(2,112,803)
(G) 合計 (D＋E＋F)	35,240,619
償還差損益金 (G)	35,240,619

(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。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表					
信 託 期 間	投資信託契約締結日	2012年 9月20日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年 9月16日		資 産 総 額	75,631,651円
区 分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負 債 総 額	2,599,665円
				純資産総額	73,031,986円
受益権口数	3,068,060,393口	37,791,367口	△ 3,030,269,026口	受益権口数	37,791,367口
元 本 額	3,068,060,393円	37,791,367円	△ 3,030,269,026円	1 単位当り償還金	19,325円04銭
毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	円 2,183,587,279	円 2,606,909,069	円 11,939	円 700	% 7.00
第 2 期	817,263,080	1,145,609,380	14,018	500	5.00
第 3 期	436,716,253	663,082,466	15,183	350	3.50
第 4 期	378,608,772	604,456,934	15,965	120	1.20
第 5 期	355,269,914	639,738,148	18,007	600	6.00
第 6 期	322,000,799	547,467,181	17,002	0	0.00
第 7 期	266,977,295	401,794,929	15,050	0	0.00
第 8 期	208,355,011	299,719,478	14,385	0	0.00
第 9 期	164,537,723	266,139,294	16,175	600	6.00
第10期	125,280,315	214,223,496	17,100	100	1.00
第11期	113,795,217	208,888,938	18,357	350	3.50
第12期	92,690,219	177,140,930	19,111	150	1.50
第13期	82,415,797	154,164,193	18,706	0	0.00
第14期	74,137,769	135,840,595	18,323	0	0.00
第15期	57,891,280	85,950,470	14,847	0	0.00
第16期	58,402,920	121,117,459	20,738	1,100	11.00
第17期	57,568,606	131,860,004	22,905	2,500	25.00
第18期	49,869,115	114,511,903	22,962	2,100	21.00
第19期	46,215,769	92,192,557	19,948	0	0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	19,325円04銭

エクイティファンド Aクラス／Bクラス

当ファンド（ダイワ／ミレーアセット・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／為替ヘッジなし））はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Aクラス／Bクラス」を主要投資対象としております。以下の内容は、直近で入手可能な Financial Statements 等から抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

(米ドル建て)

貸借対照表
2022年 2月28日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$13,169,421）	\$	14,026,809
現金		7
外国為替先渡取引による評価益		187,886
未収：		
配当		2,971
資産合計		14,217,673

負債

外国為替先渡取引による評価損		103,010
店頭デリバティブ取引に係るカウンターパーティからの預託金		280,000
保管会社に対する支払		47
未払：		
専門家報酬		78,922
会計および管理会社報酬		14,706
運用会社報酬		6,457
保管会社報酬		2,836
為替取引執行会社報酬		997
名義書換代理人報酬		743
為替運用会社報酬		373
負債合計		488,091

純資産

\$	13,729,582
----	-------------------

純資産

Aクラス	\$	4,084,801
豪ドル・クラス		2,697,499
Bクラス		764,136
ブラジル・リアル・クラス		4,887,951
通貨セレクト・クラス		1,295,195
	\$	13,729,582

発行済み受益証券口数

Aクラス	2,013,982
豪ドル・クラス	2,172,398
Bクラス	247,011
ブラジル・リアル・クラス	7,682,822
通貨セレクト・クラス	2,131,058

受益証券1口当り純資産額

Aクラス	\$	2.028
豪ドル・クラス	\$	1.242
Bクラス	\$	3.094
ブラジル・リアル・クラス	\$	0.636
通貨セレクト・クラス	\$	0.608

(米ドル建て)

損益計算書

2022年2月28日に終了した会計年度

投資収益

配当収益（源泉徴収税 \$20,194控除後）	\$	52,748
受取利息		70
投資収益合計		52,818

費用

運用会社報酬		108,841
専門家報酬		47,870
会計および管理会社報酬		45,001
保管会社報酬		18,571
受託会社報酬		9,036
登録料		7,405
為替運用会社報酬		6,360
名義書換代理人報酬		5,137
為替取引執行会社報酬		2,617
費用合計		250,838

投資純損失		(198,020)
--------------	--	------------------

実現益（損失）および評価益（損）：

実現益（損失）：

証券投資		3,043,297
外国為替取引および外国為替先渡取引		(666,440)
純実現益（損）		2,376,857

評価益（損）の純変動：

証券投資		(4,528,353)
外国為替換算および外国為替先渡取引		376,460
評価益（損）の純変動		(4,151,893)

純実現益（損）および評価益（損）の純変動		(1,775,036)
-----------------------------	--	--------------------

運用による純資産の純減	\$	(1,973,056)
--------------------	----	--------------------

(米ドル建て)

投資明細表
2022年 2 月28日

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	普通株 (89.9%)		
	中国 (3.5%)		
16,000	自動車メーカー (3.5%)		
	BYD Co. Ltd. Class H	\$	486,121
	中国合計 (簿価 \$550,464)		486,121
	フランス (3.6%)		
	アパレル (3.6%)		
665	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE		492,898
	フランス合計 (簿価 \$538,737)		492,898
	ドイツ (2.4%)		
	その他製造 (2.4%)		
2,302	Siemens AG		327,493
	ドイツ合計 (簿価 \$388,078)		327,493
	オランダ (3.0%)		
	半導体 (3.0%)		
612	ASML Holding NV Class REG		407,904
	オランダ合計 (簿価 \$164,602)		407,904
	米国 (77.4%)		
	アパレル (4.3%)		
4,309	NIKE, Inc. Class B		588,394
	自動車メーカー (4.1%)		
11,939	General Motors Co.		557,790
	銀行 (3.2%)		
7,522	Citigroup, Inc.		445,528
	コンピューター (2.9%)		
2,456	Apple, Inc.		405,535
	化粧品 / パーソナルケア (2.8%)		
1,276	Estee Lauder Cos., Inc. Class A		378,117
	ヘルスケア製品 (4.3%)		
3,051	Abbott Laboratories		368,012
816	Danaher Corp.		223,918
			591,930
	ヘルスケアサービス (2.6%)		
1,527	IQVIA Holdings, Inc.		351,393
	インターネット (16.0%)		
154	Alphabet, Inc. Class A		415,976
235	Amazon.com, Inc.		721,746

ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド

株数		有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	234	Booking Holdings, Inc.		508, 306
	15, 172	Uber Technologies, Inc.		546, 647
				2, 192, 675
		医薬品 (5. 5%)		
	600	Dexcom, Inc.		248, 346
	2, 021	Eli Lilly & Co.		505, 149
				753, 495
		小売 (7. 2%)		
	1, 929	Lowe's Cos, Inc.		426, 425
	1, 517	Ulta Beauty, Inc.		568, 116
				994, 541
		半導体 (2. 8%)		
	5, 552	Marvell Technology, Inc.		379, 368
		ソフトウェア (21. 7%)		
	872	Adobe, Inc.		407, 817
	1, 994	Bill. com Holdings, Inc.		474, 333
	2, 610	Datadog, Inc. Class A		420, 497
	2, 416	Microsoft Corp.		721, 877
	1, 898	salesforce. com, Inc.		399, 586
	3, 455	Take-Two Interactive Software, Inc.		559, 710
				2, 983, 820
		米国合計 (簿価 \$9, 837, 733)		10, 622, 586
		普通株合計 (簿価 \$11, 479, 614)		\$ 12, 337, 002
		元本		
		短期投資 (12. 3%)		
		グランド・ケイマン (0. 0%)		
		定期預金 (0. 0%)		
		Brown Brothers Harriman & Co.		
CAD	0**	0. 01% due 03/01/22		0*
HKD	6	0. 01% due 03/01/22		1
ZAR	1	3. 70% due 03/01/22		0*
				1
		グランド・ケイマン合計 (簿価 \$ 1)		1
		日本 (12. 3%)		
		定期預金 (12. 3%)		
		Sumitomo Mitsui Bank		
GBP	5	0. 09% due 03/01/22		7
USD	1, 689, 799	0. 01% due 03/01/22		1, 689, 799
				1, 689, 806

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	日本合計（簿価 \$1,689,806）		1,689,806
	短期投資合計（簿価 \$1,689,807）		1,689,807
	投資総額（簿価 \$13,169,421）	102.2%	\$ 14,026,809
	現金およびその他の資産を超過する負債	(2.2)	(297,227)
	純資産	100.0%	\$ 13,729,582

*：\$0.50未満

**：CAD 0.50未満

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最良の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

2022年2月28日時点のAクラス外国為替先渡取引の残高（純資産の0.1%）

買い	取引相手	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
JPY	Citibank N. A.	432,879,376	03/10/2022	USD	3,750,518	\$ 8,431	\$ —	\$ 8,431
JPY	Citibank N. A.	16,194,119	03/10/2022	HKD	1,093,319	700	—	700
JPY	Citibank N. A.	27,994,141	03/10/2022	EUR	211,997	4,909	—	4,909
						\$ 14,040	\$ —	\$ 14,040

2022年2月28日時点の豪ドル・クラス外国為替先渡取引の残高（純資産の0.2%）

買い	取引相手	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
AUD	Citibank N. A.	3,563,906	03/10/2022	USD	2,559,506	\$ 26,814	\$ —	\$ 26,814
AUD	Citibank N. A.	133,484	03/10/2022	HKD	747,004	1,728	(461)	1,267
AUD	Citibank N. A.	229,084	03/10/2022	EUR	143,801	4,683	—	4,683
EUR	Citibank N. A.	7,058	03/10/2022	AUD	11,076	—	(108)	(108)
HKD	Citibank N. A.	37,409	03/10/2022	AUD	6,638	—	(30)	(30)
USD	Citibank N. A.	130,898	03/10/2022	AUD	181,208	—	(604)	(604)
						\$ 33,225	\$ (1,203)	\$ 32,022

2022年2月28日時点のブラジル・リアル・クラス外国為替先渡取引の残高（純資産の0.9%）

買い	取引相手	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
BRL	Citibank N. A.	23,823,919	03/10/2022	USD	4,505,343	\$ 109,689	\$ —	\$ 109,689
BRL	Citibank N. A.	891,706	03/10/2022	HKD	1,314,024	4,568	—	4,568
BRL	Citibank N. A.	1,535,895	03/10/2022	EUR	253,872	12,297	—	12,297
EUR	Citibank N. A.	10,143	03/10/2022	BRL	58,119	137	—	137
HKD	Citibank N. A.	68,266	03/10/2022	BRL	44,945	37	(7)	30
USD	Citibank N. A.	245,396	03/10/2022	BRL	1,261,414	1,042	—	1,042
						\$ 127,770	\$ (7)	\$ 127,763

ダイワ／ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド

2022年2月28日時点の通貨セレクト・クラス外国為替先渡取引の残高（純資産の－0.6%）

買い	取引相手	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
BRL	Citibank N. A.	131,426	03/10/2022	USD	25,427	\$ 32	\$ —	\$ 32
BRL	Citibank N. A.	1,365,841	03/10/2022	USD	258,294	6,287	—	6,287
BRL	Citibank N. A.	87,017	03/10/2022	EUR	14,383	697	—	697
BRL	Citibank N. A.	8,052	03/10/2022	EUR	1,388	3	(3)	—
BRL	Citibank N. A.	4,948	03/10/2022	HKD	7,480	3	(2)	1
BRL	Citibank N. A.	51,128	03/10/2022	HKD	75,342	262	—	262
CLP	Citibank N. A.	5,896,778	03/10/2022	HKD	57,986	—	(9)	(9)
CLP	Citibank N. A.	10,059,210	03/10/2022	EUR	11,279	—	(27)	(27)
CLP	Citibank N. A.	157,478,677	03/10/2022	USD	198,175	—	(220)	(220)
COP	Citibank N. A.	28,893,219	03/10/2022	HKD	57,988	—	(19)	(19)
COP	Citibank N. A.	771,618,915	03/10/2022	USD	198,180	—	(500)	(500)
COP	Citibank N. A.	49,288,432	03/10/2022	EUR	11,279	—	(45)	(45)
CZK	Citibank N. A.	4,132,997	03/10/2022	USD	193,967	—	(9,790)	(9,790)
CZK	Citibank N. A.	264,470	03/10/2022	EUR	10,849	257	(660)	(403)
CZK	Citibank N. A.	154,804	03/10/2022	HKD	56,612	40	(387)	(347)
EUR	Citibank N. A.	1,125	03/10/2022	BRL	6,448	15	—	15
EUR	Citibank N. A.	277	03/10/2022	RON	1,376	3	(4)	(1)
EUR	Citibank N. A.	301	03/10/2022	MXN	6,932	4	(5)	(1)
EUR	Citibank N. A.	4,049	03/10/2022	USD	4,542	7	—	7
EUR	Citibank N. A.	271	03/10/2022	CZK	6,766	3	—	3
EUR	Citibank N. A.	10,228	03/10/2022	CZK	257,704	8	—	8
EUR	Citibank N. A.	9,252	03/10/2022	RUB	1,142,866	3	(193)	(190)
EUR	Citibank N. A.	89	03/10/2022	INR	7,544	1	(1)	—
EUR	Citibank N. A.	349	03/10/2022	USD	391	1	—	1
EUR	Citibank N. A.	72	03/10/2022	INR	6,133	—	—	—
EUR	Citibank N. A.	216	03/10/2022	RUB	21,498	44	—	44
HKD	Citibank N. A.	2,559	03/10/2022	CZK	7,331	1	—	1
HKD	Citibank N. A.	2,766	03/10/2022	MXN	7,325	—	(4)	(4)
HKD	Citibank N. A.	2,802	03/10/2022	RUB	31,968	63	—	63
HKD	Citibank N. A.	46,337	03/10/2022	RUB	652,654	—	(114)	(114)
HKD	Citibank N. A.	2,550	03/10/2022	RON	1,454	—	(3)	(3)
HKD	Citibank N. A.	7,567	03/10/2022	BRL	4,982	4	(1)	3
HKD	Citibank N. A.	21,716	03/10/2022	USD	2,780	—	(1)	(1)
HKD	Citibank N. A.	59	03/10/2022	INR	572	—	—	—
HKD	Citibank N. A.	1,980	03/10/2022	INR	19,221	—	(1)	(2)
HKD	Citibank N. A.	51,335	03/10/2022	CZK	147,472	—	(2)	(2)
HKD	Citibank N. A.	2,718	03/10/2022	USD	348	—	—	—
INR	Citibank N. A.	15,713,232	03/10/2022	USD	209,501	—	(1,594)	(1,594)
INR	Citibank N. A.	588,427	03/10/2022	HKD	61,133	48	(86)	(38)
INR	Citibank N. A.	1,000,831	03/10/2022	EUR	11,663	285	(146)	139
MXN	Citibank N. A.	18,120	03/10/2022	EUR	790	—	(2)	(2)

ダイワ／ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド

買い	取引相手	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / (損)
MXN	Citibank N. A.	280, 176	03/10/2022	EUR	11, 868	360	—	360
MXN	Citibank N. A.	4, 374, 819	03/10/2022	USD	212, 015	1, 809	—	1, 809
MXN	Citibank N. A.	11, 430	03/10/2022	HKD	4, 368	1	(1)	—
MXN	Citibank N. A.	163, 883	03/10/2022	HKD	61, 888	90	—	90
MXN	Citibank N. A.	302, 735	03/10/2022	USD	14, 807	—	(10)	(10)
RON	Citibank N. A.	54, 195	03/10/2022	EUR	10, 926	240	(229)	11
RON	Citibank N. A.	25, 027	03/10/2022	USD	5, 671	3	—	3
RON	Citibank N. A.	956	03/10/2022	HKD	1, 692	—	—	—
RON	Citibank N. A.	846, 238	03/10/2022	USD	195, 197	—	(3, 340)	(3, 340)
RON	Citibank N. A.	1, 355	03/10/2022	EUR	274	—	—	—
RON	Citibank N. A.	31, 701	03/10/2022	HKD	56, 979	29	(134)	(105)
RUB	Citibank N. A.	1, 164, 364	03/10/2022	EUR	13, 517	316	(4, 719)	(4, 403)
RUB	Citibank N. A.	684, 622	03/10/2022	HKD	70, 855	47	(2, 774)	(2, 727)
RUB	Citibank N. A.	18, 272, 444	03/10/2022	USD	242, 690	—	(73, 457)	(73, 457)
USD	Citibank N. A.	9, 132	03/10/2022	CZK	204, 285	29	—	29
USD	Citibank N. A.	9, 845	03/10/2022	MXN	203, 535	—	(103)	(103)
USD	Citibank N. A.	175, 013	03/10/2022	CZK	3, 928, 712	—	(60)	(60)
USD	Citibank N. A.	9, 075	03/10/2022	RON	40, 404	—	(86)	(86)
USD	Citibank N. A.	26, 538	03/10/2022	BRL	136, 414	113	—	113
USD	Citibank N. A.	318	03/10/2022	INR	24, 047	—	—	—
USD	Citibank N. A.	7, 230	03/10/2022	INR	547, 466	—	(14)	(14)
USD	Citibank N. A.	157, 958	03/10/2022	RUB	17, 384, 986	—	(3, 054)	(3, 054)
USD	Citibank N. A.	9, 963	03/10/2022	RUB	887, 458	1, 743	—	1, 743
						\$ 12, 851	\$ (101, 800)	\$ (88, 949)

通貨の略称

AUD — 豪ドル
BRL — ブラジル・リアル
CAD — カナダ・ドル
CLP — チリ・ペソ
COP — コロンビア・ペソ
CZK — チェコ・コルナ
EUR — ユーロ
GBP — 英ポンド
HKD — 香港ドル
INR — インド・ルピー
JPY — 日本円
MXN — メキシコ・ペソ
RON — ルーマニア・レイ
RUB — ロシア・ルーブル
USD — 米ドル
ZAR — 南アフリカ・ランド

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2021年12月9日）

（作成対象期間 2020年12月10日～2021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。

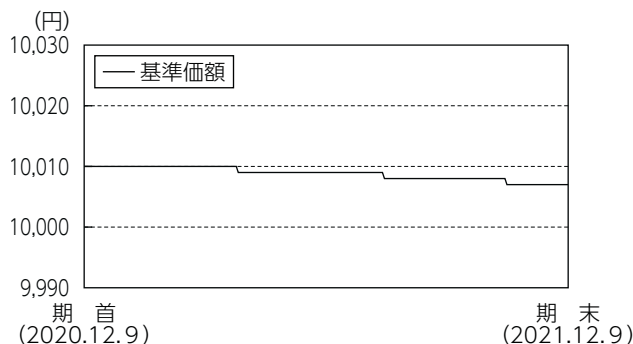
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2020年12月9日	円	%	%
12月末	10,010	0.0	—
2021年1月末	10,010	0.0	—
2月末	10,010	0.0	—
3月末	10,010	0.0	—
4月末	10,009	△0.0	—
5月末	10,009	△0.0	—
6月末	10,009	△0.0	—
7月末	10,008	△0.0	—
8月末	10,008	△0.0	—
9月末	10,008	△0.0	—
10月末	10,007	△0.0	—
11月末	10,007	△0.0	—
(期末)2021年12月9日	10,007	△0.0	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率是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：10,010円 期末：10,007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

2021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	147,987,988	100.0
投資信託財産総額	147,987,988	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12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	147,987,988,484円
コール・ローン等	147,987,988,484
(B) 負債	210,000,000
未払解約金	210,000,000
(C) 純資産総額(A－B)	147,777,988,484
元本	147,676,216,454
次期繰越損益金	101,772,030
(D) 受益権総口数	147,676,216,454口
1万口当り基準価額(C／D)	10,007円

* 期首における元本額は88,319,921,795円、当作成期間中における追加設定元本額は176,557,677,368円、同解約元本額は117,201,382,709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：

日本株ロング・ショート戦略パイロットファンド (適格機関投資家専用)	266,761,115円
ロボット・テックノロジー関連株ファンド	947,268円
ダイワ/ミレアセット・インド株式ファンド	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
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・テックノロジー関連株ファンド	39,489円
ロボット・テックノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	
ロボット (年1回)	3,985円
i Freeレバレッジ S & P 500	8,293,797,395円
i Freeレバレッジ NASDAQ100	70,959,132,903円
クリーンテック株式ファンド (資産成長型)	998,802円
ロボット・テックノロジー関連株ファンド	999円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型)	1,000円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	499,501円
ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	5,345,339,466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	6,483,785,045円
ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,334,794,630円
ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース (－2倍) 指数	936,360,631円
ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	6,676,062,567円
ダイワ上場投信－TOPIXインバース (－1倍) 指数	3,084,973,807円
ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス	574,295,634円
ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス	861,497,868円
ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス	104,920,073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5セクター・ファンド (適格機関投資家専用)	101,154,451円
ダイワ日本株15－20年ラダー型ファンド・マザーポートフォリオ	301,448,680円
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	16,464,882,107円
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	17,685,532,691円
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	1,058,922,067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	89,553,240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	2,938,475円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	595,106円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	987,373円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	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/ミレアセット亜細亜株式ファンド	9,958,176円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 米ドル・コース	10,833円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	10,788円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース	12,751円
ロボット・テックノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	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・リアル・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)	15,402円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド－イーグルアイⅠ－ 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Ⅰ－ 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・リアル・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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,007円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 31,130,963円
受取利息	469,134
支払利息	△ 31,600,097
(B) その他費用	△ 147,839
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 31,278,802
(D) 前期繰越損益金	90,693,506
(E) 解約差損益金	△106,126,697
(F) 追加信託差損益金	148,484,023
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	101,772,030
次期繰越損益金(G)	101,772,030

(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。