

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15期

(決算日 2022年11月21日)

(作成対象期間 2022年5月24日～2022年11月21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	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) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %	(参考指数) 期中 騰落率 %	期中 騰落率 %			
11期末 (2020年11月24日)	10,932	130	13.0	13,668	20.5	93.4	—	百万円 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
14期末 (2022年5月23日)	11,826	200	0.3	17,493	△ 6.7	93.1	—	2,084
15期末 (2022年11月21日)	12,826	650	14.0	19,251	10.0	95.0	—	1,954

(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。

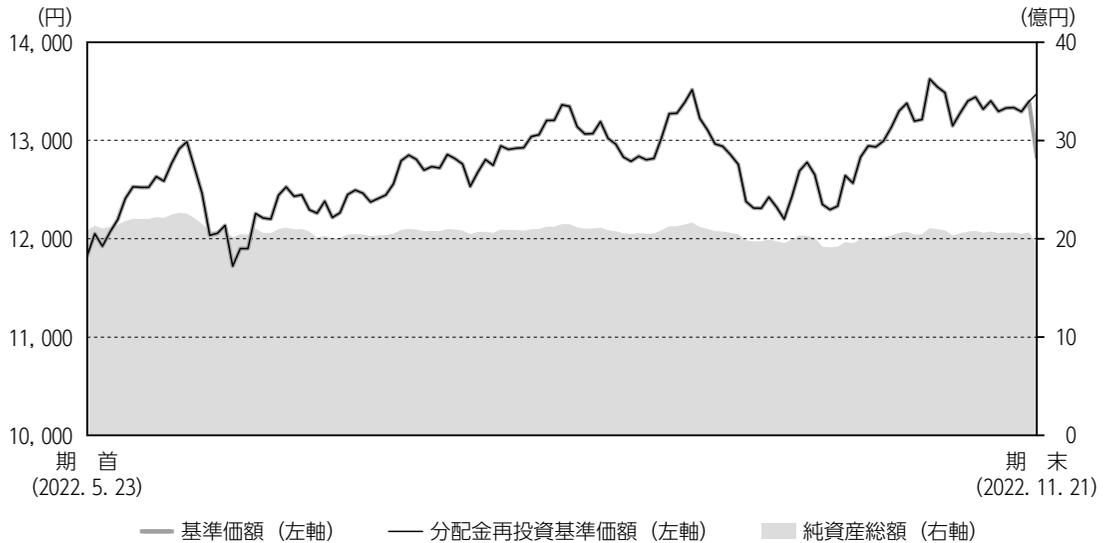
(注5) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* 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：11,826円

期末：12,826円（分配金650円）

騰落率：14.0%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

保有銘柄が上昇したことや、為替相場で円安米ドル高が進行したことなどから、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) 2022年5月23日	11,826	—	17,493	—	93.1	—
5月末	12,530	6.0	18,554	6.1	91.6	—
6月末	12,447	5.3	18,211	4.1	92.9	—
7月末	12,816	8.4	18,763	7.3	94.1	—
8月末	12,831	8.5	18,946	8.3	95.8	—
9月末	12,322	4.2	17,947	2.6	94.2	—
10月末	13,625	15.2	19,414	11.0	95.3	—
(期末) 2022年11月21日	13,476	14.0	19,251	10.0	95.0	—

(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

(2022. 5. 24 ~ 2022. 11. 21)

世界株式市況

世界株式市況は横ばいとなりました。

世界株式市況は、当作成期首から2022年6月半ばにかけて、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから下落しました。6月半ばにF R Bが利上げ幅拡大を決定した後は、悪材料出尽くし観測などから上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトするとの期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇基調となりました。その後は、F R B議長が景気を犠牲にしてもインフレを抑制する姿勢を強調したことや予想以上のインフレ率の上昇で欧米の金利が上昇したこと、英国の財政悪化懸念から英国債が急落したことなどを受け、10月半ばにかけて下落しました。その後は、英国発の混乱が収束し欧米の金利上昇が一服したことや、米国で10月に発表されたC P I（消費者物価指数）が市場予想を下回ったことで利上げペース鈍化への期待が高まったことなどから株価は反発し、当作成期末にかけて下落幅を取り戻す展開となりました。

為替相場

米ドルは対円で上昇（円安）しました。

当作成期首から2022年9月末にかけて、米国ではインフレ率の上昇を背景にF R B（米国連邦準備制度理事会）が大幅な利上げの実施を決定したことに対し、日銀は引き続き金融緩和姿勢を維持するなど、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。その後は、米国の金利上昇が一服したことで、当作成期末にかけて米ドルは対円で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**

「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

(2022. 5. 24 ~ 2022. 11. 21)

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

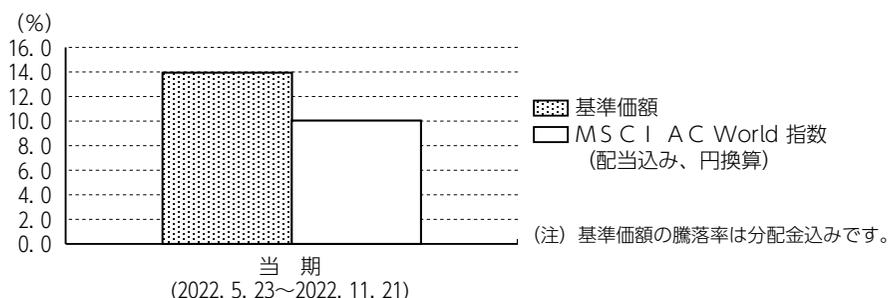
当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループに運用の指図にかかる権限を委託しております。

個別銘柄では、パフォーマンスが相対的に良好であったAMGEN（米国、ヘルスケア）やEXXON MOBIL（米国、エネルギー）の保有などがプラ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	
	2022年5月24日 ～2022年11月21日	
当期分配金（税込み）	（円）	650
対基準価額比率	（％）	4.82
当期の収益	（円）	650
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,856

- (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	✓	206.68円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	1,439.11
(c) 収益調整金		127.63
(d) 分配準備積立金		1,733.00
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）		3,506.44
(f) 分配金		650.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）		2,856.44

(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、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 (2022. 5. 24～2022. 11. 21)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	126円	0. 987%	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, 762円です。
(投 信 会 社)	(67)	(0. 521)	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)	(56)	(0. 439)	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)	(4)	(0. 027)	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	3	0. 027	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)	(3)	(0. 027)	
有 価 証 券 取 引 税	3	0. 026	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)	(3)	(0. 026)	
そ の 他 費 用	5	0. 040	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)	(5)	(0. 037)	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	138	1. 080	

(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。

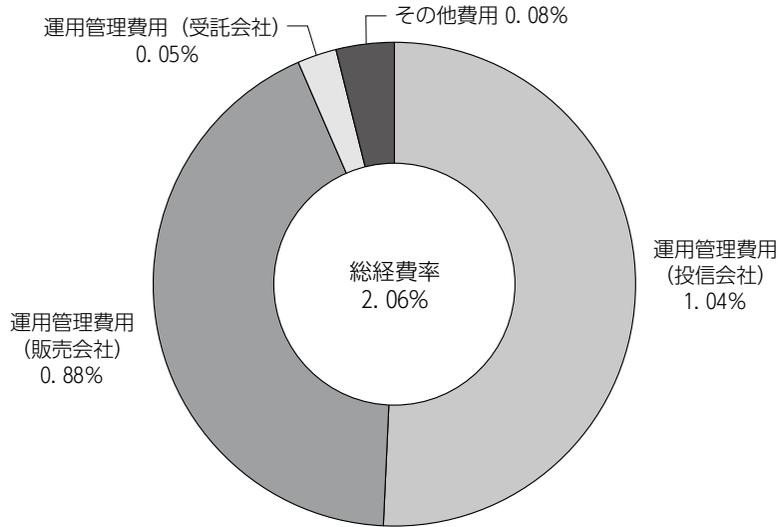
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.06%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

(2022年5月24日から2022年11月21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	23,264	42,000	226,102	429,000

(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

(2022年5月24日から2022年11月21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	1,798,769千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,963,158千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.91

(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	1,172,526	969,689	1,945,681

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月21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	1,945,681	92.4
コール・ローン等、その他	159,201	7.6
投資信託財産総額	2,104,882	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21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=140.36円、1香港・ドル=17.95円、1イギリス・ポンド=166.59円、1スイス・フラン=147.10円、1ユーロ=144.81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(1,964,430千円)の投資信託財産総額(2,095,727千円)に対する比率は、93.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,104,882,795円
コール・ローン等	9,201,307
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)	1,945,681,488
未収入金	150,000,000
(B) 負債	149,994,697
未払収益分配金	99,074,040
未払解約金	30,390,796
未払信託報酬	20,473,073
その他未払費用	56,788
(C) 純資産総額 (A - B)	1,954,888,098
元本	1,524,216,002
次期繰越損益金	430,672,096
(D) 受益権総口数	1,524,216,002口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,826円

* 期首における元本額は1,762,559,761円、当作成期間中における追加設定元本額は13,197,417円、同解約元本額は251,541,176円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,826円です。

■損益の状況

当期 自2022年5月24日 至2022年11月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,590円
受取利息	93
支払利息	△ 1,683
(B) 有価証券売買損益	271,386,812
売買益	290,559,856
売買損	△ 19,173,044
(C) 信託報酬等	△ 20,529,861
(D) 当期損益金 (A + B + C)	250,855,361
(E) 前期繰越損益金	264,146,897
(F) 追加信託差損益金	14,743,878
(配当等相当額)	(19,455,011)
(売買損益相当額)	(△ 4,711,133)
(G) 合計 (D + E + F)	529,746,136
(H) 収益分配金	△ 99,074,040
次期繰越損益金 (G + H)	430,672,096
追加信託差損益金	14,743,878
(配当等相当額)	(19,455,011)
(売買損益相当額)	(△ 4,711,133)
分配準備積立金	415,928,218

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。
- (注4) 投資信託財産(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：6,197,794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	31,503,193円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	219,352,168
(c) 収益調整金	19,455,011
(d) 分配準備積立金	264,146,897
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	534,457,269
(f) 分配金	99,074,040
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	435,383,229
(h) 受益権総口数	1,524,216,002口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

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。

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（2022年5月23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（2022年11月21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

（2022年5月24日から2022年11月21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
AMGEN INC (アメリカ)	1.255	41,395	32,984	APPLE INC (アメリカ)	3.65	71,851	19,685
AT&T INC (アメリカ)	15.324	40,921	2,670	MICROSOFT CORP (アメリカ)	1.512	51,301	33,929
GLENCORE PLC (ジャージー)	41.352	31,547	762	ACCENTURE PLC-CL A (アイルランド)	1.226	50,343	41,063
PEPSICO INC (アメリカ)	1.287	31,491	24,468	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	1.863	44,536	23,905
CIGNA CORP (アメリカ)	0.75	31,297	41,729	COCA-COLA CO/THE (アメリカ)	4.49	38,934	8,671
ELEVANCE HEALTH INC (アメリカ)	0.452	31,130	68,873	ELI LILLY & CO (アメリカ)	0.847	37,875	44,716
AMERIPRISE FINANCIAL INC (アメリカ)	0.683	31,014	45,408	HONEYWELL INTERNATIONAL INC (アメリカ)	1.501	36,565	24,360
NOVARTIS AG-REG (スイス)	2.249	26,139	11,622	CHEVRON CORP (アメリカ)	1.556	35,202	22,623
L'OREAL (フランス)	0.532	25,202	47,372	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	2.189	34,462	15,743
SHELL PLC (イギリス)	6.896	25,009	3,626	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	2.154	34,252	15,901

(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、2022年11月21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（969,689千円）の内容です。

外国株式

銘 柄	2022年11月21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)				
AFLAC INC	26.94	191	26,824	金融
CITIGROUP INC	20.18	98	13,782	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4.12	105	14,805	情報技術
APPLE INC	54.45	823	115,624	情報技術
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	67.02	298	41,917	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	30.35	235	32,993	ヘルスケア
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6.83	224	31,511	金融
CISCO SYSTEMS INC	22.39	107	15,018	情報技術
BROADCOM INC	3.57	183	25,813	情報技術
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11.25	136	19,187	金融
COSTCO WHOLESALE CORP	5.34	279	39,250	生活必需品

銘 柄	2022年11月21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		
EXXON MOBIL CORP	12.31	137	19,365	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	39.23	326	45,812	公益事業
HOME DEPOT INC	5.81	181	25,539	一般消費財・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	6.14	105	14,817	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	7.96	140	19,686	ヘルスケア
KLA CORP	3.7	139	19,544	情報技術
MCDONALD'S CORP	10.18	278	39,060	一般消費財・サービス
MERCK & CO. INC.	25.47	265	37,261	ヘルスケア
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	6.09	98	13,822	一般消費財・サービス
MCKESSON CORP	7.1	262	36,845	ヘルスケア
PFIZER INC	57.56	277	38,965	ヘルスケア
CIGNA CORP	7.5	239	33,603	ヘルスケア

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	2022年11月21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	
PROCTER & GAMBLE CO/THE EXELON CORP	9.88	140	19,770	生活必需品
PEPSICO INC	95.92	370	51,941	公益事業
QUALCOMM INC	12.87	233	32,756	生活必需品
AT&T INC	11.33	140	19,695	情報技術
UNION PACIFIC CORP	153.24	290	40,802	コミュニケーション・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	4.98	104	14,719	資本財・サービス
ELEVANCE HEALTH INC	5.4	286	40,171	ヘルスケア
VISA INC-CLASS A SHARES	4.52	223	31,424	ヘルスケア
OMNICOM GROUP	19.78	416	58,524	情報技術
MASTERCARD INC - A	27.37	211	29,657	コミュニケーション・サービス
AMGEN INC	12.23	420	58,997	情報技術
MICROSOFT CORP	4.87	139	19,637	ヘルスケア
EBAY INC	33.96	819	114,980	情報技術
COMCAST CORP-CLASS A	18.36	83	11,771	一般消費財・サービス
	111.25	383	53,871	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>	967.45 38銘柄	1,319,779 <67.8%>	
	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)				
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	45.68	198	3,570	資本財・サービス
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	390	198	3,570	生活必需品
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	300	187	3,360	資本財・サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	700	234	4,209	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,330	599	10,766	金融
CK ASSET HOLDINGS LTD	45.68	214	3,845	不動産
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	280	618	11,107	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,610	590	10,606	金融
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	648	337	6,060	一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	700	511	9,172	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	149	194	3,492	ヘルスケア
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,980	1,942	34,865	素材
BANK OF CHINA LTD-H	1,930	505	9,076	金融
香港・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	10,108.36 13銘柄	113,704 <5.8%>	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)				
SHELL PLC	100.44	235	39,228	エネルギー
BP PLC	478.1	227	37,915	エネルギー
RIO TINTO PLC	14.86	80	13,330	素材
GLENCORE PLC	413.52	209	34,843	素材
ASTRAZENECA PLC	21.94	239	39,912	ヘルスケア
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	1,028.86 5銘柄	165,231 <8.5%>	

銘柄	2022年11月21日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)				
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.2	67	9,967	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	11.47	127	18,708	生活必需品
NOVARTIS AG-REG	30.34	247	36,378	ヘルスケア
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	44.01 3銘柄	442 <3.3%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(オランダ)				
ASML HOLDING NV	5.68	324	46,998	情報技術
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	5.68 1銘柄	324 <2.4%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(フランス)				
L'OREAL	7.35	255	37,050	生活必需品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	1.68	117	16,985	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	6.64	118	17,120	情報技術
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	15.67 3銘柄	491 <3.7%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(ドイツ)				
VOLKSWAGEN AG-PREF	2.14	30	4,396	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	23.62	312	45,320	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	25.76 2銘柄	49,716 <2.6%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(スペイン)				
IBERDROLA SA	122.08	129	18,721	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	122.08 1銘柄	129 <1.0%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(その他)				
UNILEVER PLC	10.08	46	6,783	生活必需品
国小計	株数、金額 銘柄数 <比率>	10.08 1銘柄	46 <0.3%>	
ユーロ 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	179.27 8銘柄	1,335 <9.9%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 <比率>	12,327.95 67銘柄	1,857,144 <95.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年11月21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7期（決算日 2022年5月23日）

（作成対象期間 2021年5月22日～2022年5月23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ないます。
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

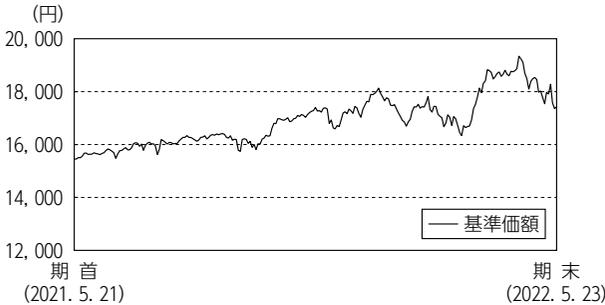
大和アセットマネジメント

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》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：15,439円 期末：17,415円 騰落率：12.8%

【基準価額の主な変動要因】

保有株式が下落したことはマイナス要因でしたが、為替市場で円安米ドル高が進行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。

◆投資環境について

○世界株式市況

世界株式市況は下落しました。

世界株式市況は、当作成期首から2022年1月中旬にかけては、新型コロナウイルスの変異株への警戒感など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。3月中旬にかけては、F R B（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め懸念で金利が上昇したことや、ロシアによるウクライナ侵攻で資源価格が急騰したことなどが懸念され、下落しました。その後は、F R Bの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや、ロシアとウクライナによる停戦協議の進展期待もあり、反発する場面も見られましたが、世界的な景気減速懸念により、当作成期末にかけて下落基調となりました。

○為替相場

米ドルは対円で上昇（円安）しました。

米ドルの対円為替相場は、当作成期首から2022年3月上旬にかけて米国金利の上昇を受けて日米金利差が拡大したことから、円安米ドル高が進行しました。その後も、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、日銀は断続的に指し値オペを行い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、当作成期末にかけて円安米ドル高が進行しました。

◆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。

株式の個別銘柄で寄与度が高かった銘柄はMICROSOFT（米国、情報技術）やEXELON（米国、公益事業）、寄与度が低かった銘柄はSTARBUCKS（米国、一般消費財・サービス）やNIKE（米国、一般消費財・サービス）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。

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) 2021年 5月21日	15,439	—	16,482	—	91.8	—
5 月 末	15,668	1.5	16,854	2.3	89.8	—
6 月 末	15,790	2.3	17,255	4.7	89.7	—
7 月 末	16,074	4.1	17,298	5.0	89.7	—
8 月 末	16,347	5.9	17,658	7.1	89.8	—
9 月 末	16,115	4.4	17,367	5.4	90.6	—
10 月 末	16,881	9.3	18,470	12.1	88.9	—
11 月 末	16,923	9.6	18,293	11.0	94.0	—
12 月 末	17,931	16.1	18,975	15.1	91.9	—
2022年 1 月 末	17,255	11.8	17,769	7.8	91.4	—
2 月 末	17,116	10.9	17,644	7.1	90.3	—
3 月 末	18,722	21.3	19,347	17.4	91.4	—
4 月 末	18,386	19.1	18,502	12.3	91.8	—
(期末) 2022年 5月23日	17,415	12.8	17,493	6.1	95.0	—

(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.（「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。

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

《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。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	5円 (5)
有価証券取引税 (株式)	3 (3)
その他費用 (保管費用) (その他)	14 (14) (0)
合計	22

(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

(2021年5月22日から2022年5月23日まで)

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外 国	アメリカ	百株 592 (33.78)	千アメリカ・ドル 6,450 (—)	百株 927.02	千アメリカ・ドル 9,678
	カナダ	百株 — (—)	千カナダ・ドル — (—)	百株 28.44	千カナダ・ドル 293
	香港	百株 — (—)	千香港・ドル — (—)	百株 12,008	千香港・ドル 8,464
	イギリス	百株 112.66 (—)	千イギリス・ポンド 215 (—)	百株 1,051.22	千イギリス・ポンド 228
	スイス	百株 — (—)	千スイス・フラン — (—)	百株 3.16	千スイス・フラン 40
	ノルウェー	百株 — (—)	千ノルウェー・クローネ — (—)	百株 39.56	千ノルウェー・クローネ 539
	ユーロ (オランダ)	百株 1.84 (—)	千ユーロ 121 (—)	百株 9.69	千ユーロ 116
	ユーロ (フランス)	百株 4.69 (—)	千ユーロ 216 (—)	百株 68.49	千ユーロ 380
	ユーロ (ドイツ)	百株 13.47 (—)	千ユーロ 196 (—)	百株 13.61	千ユーロ 133
	ユーロ (スペイン)	百株 7.89 (4.78)	千ユーロ 7 (4)	百株 181.84	千ユーロ 63
ユーロ (その他)	百株 — (—)	千ユーロ — (—)	百株 1.02	千ユーロ 4	
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 27.89 (4.78)	千ユーロ 542 (4)	百株 274.65	千ユーロ 698	

(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、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。

■主要な売買銘柄
株 式

(2021年5月22日から2022年5月23日まで)

当 期				期 付			
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)	3.701	64,826	17,516	MICROSOFT CORP (アメリカ)	3.162	111,451	35,247
OMNICOM GROUP (アメリカ)	4.407	43,920	9,966	AMERICAN EXPRESS CO (アメリカ)	2.7	58,230	21,566
ACTIVISION BLIZZARD INC (アメリカ)	5.28	40,442	7,659	ACTIVISION BLIZZARD INC (アメリカ)	5.28	49,330	9,342
STARBUCKS CORP (アメリカ)	2.647	32,561	12,301	VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ)	1.832	45,901	25,055
MAGNA INTERNATIONAL INC (カナダ)	3.309	31,295	9,457	MASTERCARD INC - A (アメリカ)	1.02	40,572	39,777
EBAY INC (アメリカ)	4.46	28,671	6,428	ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H (中国)	236	38,239	162
ELI LILLY & CO (アメリカ)	0.92	27,742	30,154	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	2.016	35,499	17,608
SIEMENS AG-REG (ドイツ)	1.347	25,188	18,699	PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)	1.739	34,395	19,778
BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	4.421	23,538	5,324	EXELON CORP (アメリカ)	5.869	34,273	5,839
COMCAST CORP-CLASS A (アメリカ)	3.692	21,927	5,939	ABBOTT LABORATORIES (アメリカ)	2.183	30,809	14,113

(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	
(アメリカ)					
ABBOTT LABORATORIES	21.83	—	—	—	ヘルスケア
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	15.01	—	—	—	情報技術
AFLAC INC	54.23	26.94	148	18,964	金融
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	13.57	15.01	284	36,393	資本財・サービス
CITIGROUP INC	2.89	—	—	—	金融
APPLE INC	67.74	89.57	1,232	157,475	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10.91	—	—	—	金融
BOEING CO/THE	11.55	—	—	—	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	—	29.16	127	16,308	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	42.53	29.39	145	18,600	コミュニケーション
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	34.92	30.35	231	29,547	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	13.23	21.54	252	32,296	金融
DELTA AIR LINES INC	10.59	—	—	—	資本財・サービス
CISCO SYSTEMS INC	25.66	35.09	150	19,253	情報技術
MORGAN STANLEY	14.16	13.23	105	13,417	金融
BROADCOM INC	3.3	3.57	193	24,778	情報技術
DEERE & CO	—	3.95	123	15,813	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3.98	—	—	—	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	4.28	4.55	189	24,211	生活必需品
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	0.97	—	—	—	一般消費・サービス
COCA-COLA CO/THE	46.97	40.67	248	31,690	生活必需品
EXPEDIA GROUP INC	7.92	—	—	—	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	
EXXON MOBIL CORP	—	14.7	135	17,254	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	59.51	47.1	335	42,863	公益事業
GENERAL MOTORS CO	5.95	—	—	—	一般消費・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	—	3.57	109	13,995	金融
HOME DEPOT INC	7.61	6.99	200	25,651	一般消費・サービス
HUMANA INC	1.63	—	—	—	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	7.28	6.69	120	15,396	情報技術
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8.61	—	—	—	資本財・サービス
JOHNSON & JOHNSON	22.96	18.1	320	40,932	ヘルスケア
MAGNA INTERNATIONAL INC	—	33.09	203	25,990	一般消費・サービス
ABBVIE INC	—	13.66	206	26,358	ヘルスケア
KLA CORP	1.97	4.6	154	19,719	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	7.28	—	—	—	資本財・サービス
ELI LILLY & CO	—	8.47	253	32,344	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	—	2.41	114	14,600	情報技術
MCDONALD'S CORP	9.4	10.78	252	32,220	一般消費・サービス
MERCK & CO. INC.	36.17	21.67	202	25,903	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	5.95	—	—	—	素材
NIKE INC -CL B	4.29	14.44	155	19,927	一般消費・サービス
MCKESSON CORP	—	7.1	229	29,291	ヘルスケア
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	21.64	—	—	—	生活必需品
ALTRIA GROUP INC	34.92	—	—	—	生活必需品
PFIZER INC	71.7	60.14	315	40,321	ヘルスケア

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	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DOW INC	3.97	—	—	—	素材
PROCTER & GAMBLE CO/THE	24.55	11.04	156	20,002	生活必需品
EXELON CORP	94.59	54.12	255	32,606	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	7.59	—	—	—	資本財・サービス
CONOCOPHILLIPS	5.62	—	—	—	エネルギー
PEPSICO INC	15.01	—	—	—	生活必需品
CORTEVA INC	10.59	—	—	—	素材
ACCENTURE PLC-CL A	11.3	9.47	261	33,476	情報技術
ROSS STORES INC	16.53	—	—	—	一般消費・サービス
QUEST DIAGNOSTICS INC	—	8.92	125	16,074	ヘルスケア
CHEVRON CORP	3.84	7.32	122	15,697	エネルギー
VIATRIS INC	8.91	—	—	—	ヘルスケア
AT&T INC	61.51	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	15.17	121	15,530	情報技術
UNION PACIFIC CORP	—	5.1	108	13,918	資本財・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	5.62	6.11	296	37,922	ヘルスケア
VALERO ENERGY CORP	1.65	—	—	—	エネルギー
ANTHEM INC	2.97	—	—	—	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	20.16	—	—	—	コミュニケーション・サービス
WALMART INC	7.4	7.42	88	11,301	生活必需品
TJX COMPANIES INC	33.06	—	—	—	一般消費・サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	30.2	12.96	257	32,959	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	6.94	—	—	—	生活必需品
OMNICON GROUP	—	44.07	329	42,150	コミュニケーション・サービス
MASTERCARD INC - A	17.59	8.44	283	36,255	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	27.06	68	230	29,421	金融
AMERICAN EXPRESS CO	25	—	—	—	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	—	25.69	142	18,258	金融
AMGEN INC	7.61	—	—	—	ヘルスケア
EATON CORP PLC	1.98	—	—	—	資本財・サービス
APPLIED MATERIALS INC	9.27	10.18	108	13,848	情報技術
GILEAD SCIENCES INC	19.84	18.89	120	15,409	ヘルスケア
BAXTER INTERNATIONAL INC	17.19	—	—	—	ヘルスケア
INTEL CORP	36.97	—	—	—	情報技術
MICROSOFT CORP	74.73	49.08	1,239	158,391	情報技術
MEDTRONIC PLC	23.8	7.16	73	9,380	ヘルスケア
BLACKROCK INC	—	1.87	112	14,347	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	39.23	—	—	—	公益事業
EBAY INC	—	44.6	197	25,252	一般消費・サービス
PACCAR INC	—	11.95	95	12,186	資本財・サービス
STARBUCKS CORP	—	26.47	194	24,822	一般消費・サービス
INTUIT INC	7.06	5.71	210	26,834	情報技術
BEST BUY CO INC	5.29	—	—	—	一般消費・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	56.22	76.45	321	41,038	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 株数、金額	1,453.96	1,152.72	12,197	1,558,610	
通貨計 銘柄数<比率>	71銘柄	53銘柄		<76.3%>	

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	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
NATIONAL BANK OF CANADA	28.44	—	—	—	金融
カナダ・ドル 株数、金額	28.44	—	—	—	
通貨計 銘柄数<比率>	1銘柄	—		<—>	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	120.68	60.68	343	5,586	資本財・サービス
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,000	540	403	6,567	生活必需品
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	660	380	299	4,868	資本財・サービス
HUANENG POWER INTL INC-H	1,860	980	376	6,126	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,410	1,830	1,026	16,713	金融
CK ASSET HOLDINGS LTD	120.68	60.68	329	5,369	不動産
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	710	380	976	15,899	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,120	2,230	1,036	16,881	金融
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,648	908	628	10,229	一般消費・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,820	960	748	12,190	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	385	207	266	4,340	ヘルスケア
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	5,100	2,740	2,838	46,213	素材
BANK OF CHINA LTD-H	5,000	2,670	817	13,301	金融
香港・ドル 株数、金額	25,954.36	13,946.36	10,091	164,286	
通貨計 銘柄数<比率>	13銘柄	13銘柄		<8.0%>	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
SHELL PLC	—	31.48	73	11,775	エネルギー
BP PLC	86.18	149.07	62	9,956	エネルギー
GSK	37.65	—	—	—	ヘルスケア
RIO TINTO PLC	17.24	14.86	80	12,963	素材
VODAFONE GROUP PLC	131.49	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ASTRAZENECA PLC	—	9.39	98	15,776	ヘルスケア
3i GROUP PLC	31.66	—	—	—	金融
ASHTREAD GROUP PLC	—	14.29	54	8,803	資本財・サービス
LLOYDS BANKING GROUP PLC	803.52	—	—	—	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	29.48	—	—	—	生活必需品
SHELL PLC	20.43	—	—	—	エネルギー
イギリス・ポンド 株数、金額	1,157.65	219.09	370	59,276	
通貨計 銘柄数<比率>	8銘柄	5銘柄		<2.9%>	
	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.55	2.2	70	9,232	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	13.19	11.47	129	17,044	生活必需品
NOVARTIS AG-REG	8.94	7.85	68	8,934	ヘルスケア
スイス・フラン 株数、金額	24.68	21.52	268	35,211	
通貨計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<1.7%>	

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	
(ノルウェー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELENOR ASA	39.56	—	—	—	通信・サービス
ノルウェー・クロネ	株数、金額	39.56	—	—	
通貨計	銘柄数<比率>	1銘柄	—	<—>	
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASML HOLDING NV	1.45	3.16	158	21,397	情報技術
AIRBUS SE	9.56	—	—	—	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	11.01 2銘柄	3.16 1銘柄	158 <1.0%>	21,397
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	12.77	—	—	—	エネルギー
KERING	—	1.9	85	11,572	一般消費・サービス
L'OREAL	0.62	2.03	62	8,450	生活必需品
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUI	2.36	2.14	119	16,108	一般消費・サービス
CAPGEMINI SE	6.76	6.64	120	16,231	情報技術
AXA SA	35.3	—	—	—	金融
SANOFI	8.48	—	—	—	ヘルスケア
VINCI SA	10.22	—	—	—	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	76.51 7銘柄	12.71 4銘柄	387 <2.6%>	52,362
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2.36	2.14	31	4,216	一般消費・サービス
SIEMENS AG-REG	—	13.47	155	20,963	資本財・サービス
BASF SE	10.22	—	—	—	素材
ALLIANZ SE-REG	3.17	—	—	—	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	15.75 3銘柄	15.61 2銘柄	186 <1.2%>	25,180
ユーロ(スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	121.42	118.79	131	17,832	公益事業
BANCO SANTANDER SA	166.54	—	—	—	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	287.96 2銘柄	118.79 1銘柄	131 <0.9%>	17,832

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	
ユーロ(その他)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UNILEVER PLC	11.1	10.08	41	5,660	生活必需品
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	11.1 1銘柄	10.08 1銘柄	41 <0.3%>	5,660
ユーロ	株数、金額	402.33	160.35	905	122,433
通貨計	銘柄数<比率>	15銘柄	9銘柄	<6.0%>	
ファンド	株数、金額	29,060.98	15,500.04	—	1,939,817
合計	銘柄数<比率>	112銘柄	83銘柄	<95.0%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年5月23日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 1,939,817	% 91.7
コール・ローン等、その他	176,083	8.3
投資信託財産総額	2,115,901	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23日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=127.78円、1香港・ドル=16.28円、1イギリス・ポンド=160.10円、1スイス・フラン=131.27円、1ユーロ=135.24円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(2,009,583千円)の投資信託財産総額(2,115,901千円)に対する比率は、95.0%です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年5月23日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,115,901,008円
コール・ローン等	172,872,782
株式（評価額）	1,939,817,558
未取配当金	3,210,668
(B) 負債	74,000,000
未払解約金	74,000,000
(C) 純資産総額（A－B）	2,041,901,008
元本	1,172,526,515
次期繰越損益金	869,374,493
(D) 受益権総口数	1,172,526,515口
1万口当り基準価額（C／D）	17,415円

* 期首における元本額は1,597,426,686円、当作成期間中における追加設定元本額は45,590,309円、同解約元本額は470,490,480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 1,172,526,515円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,415円です。

■損益の状況

当期 自2021年5月22日 至2022年5月23日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	51,773,192円
受取配当金	51,295,764
受取利息	35,532
その他収益金	454,608
支払利息	△ 12,712
(B) 有価証券売買損益	247,814,909
売買益	504,371,079
売買損	△ 256,556,170
(C) その他費用	△ 1,888,541
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	297,699,560
(E) 前期繰越損益金	868,774,762
(F) 解約差損益金	△ 323,509,520
(G) 追加信託差損益金	26,409,691
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	869,374,493
次期繰越損益金（H）	869,374,493

(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。