

# 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9期

(決算日 2019年11月21日)

(作成対象期間 2019年5月22日～2019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   | 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・<br>グローバル好配当株マザー<br>ファンドの受益証券                                   |
|        | ダイワ／ミレーアセッ<br>ト・グローバル好配当<br>株マザーファンド  | 内外の金融商品取引所上場<br>および店頭登録(上場予定<br>および店頭登録予定を含み<br>ます。)の株式(DR(預<br>託証券)を含みます。) |
| 組入制限   | ベビーファンドの<br>マザーファンド組入上限比率   | 無制限   |
|        | ベビーファンドの<br>株式実質組入上限比率  |   |
|        | マザーファンドの<br>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<br>(評価益を含みます。)等とし、原則として、基準<br>価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。た<br>だし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわ<br>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、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。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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<br>(配当込み、円換算) |              | 株式<br>組入比率 | 株式先物<br>比率 | 純資産<br>総額 |
|--------------------|--------|---------------|--------------|-------------------------------|--------------|------------|------------|-----------|
|                    | (分配落)  | 税込<br>分配<br>金 | 期<br>騰落<br>率 | (参考指数)                        | 期<br>騰落<br>率 |            |            |           |
|                    | 円      | 円             | %            |                               | %            | %          | %          | 百万円       |
| 5 期末 (2017年11月21日) | 10,289 | 100           | 10.7         | 11,131                        | 10.5         | 95.2       | —          | 8,002     |
| 6 期末 (2018年 5月21日) | 10,499 | 0             | 2.0          | 11,528                        | 3.6          | 93.1       | —          | 6,067     |
| 7 期末 (2018年11月21日) | 9,933  | 30            | △ 5.1        | 10,941                        | △ 5.1        | 90.9       | —          | 4,761     |
| 8 期末 (2019年 5月21日) | 10,272 | 100           | 4.4          | 11,471                        | 4.8          | 92.5       | —          | 4,101     |
| 9 期末 (2019年11月21日) | 10,740 | 150           | 6.0          | 12,323                        | 7.4          | 92.8       | —          | 3,674     |

(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として大和投資信託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。

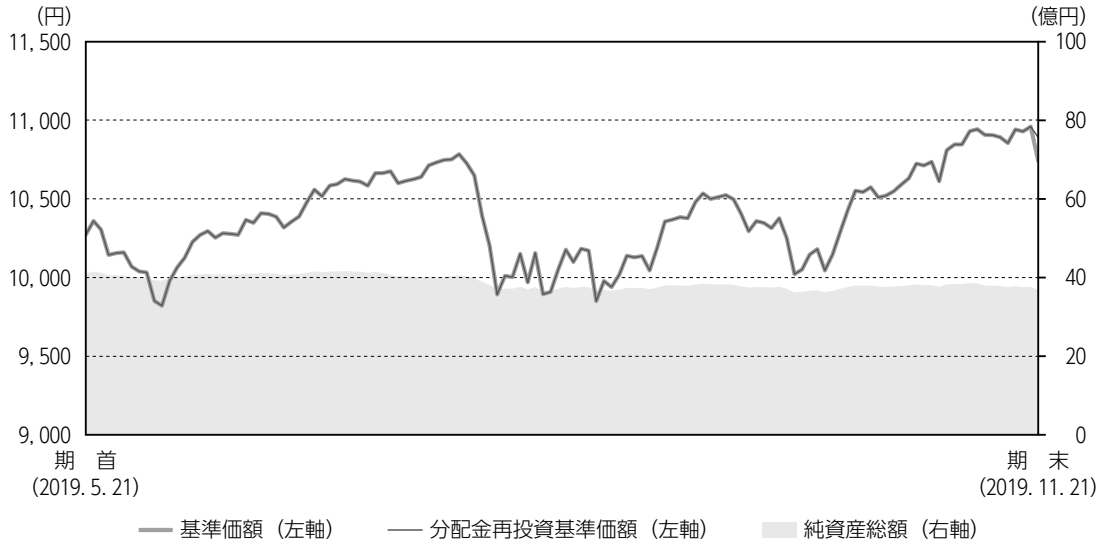
(注 5) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：10,272円

期末：10,740円（分配金150円）

騰落率：6.0%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

円高が進展したことはマイナス要因となりましたが、世界の株式市況が上昇したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ／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<br>(配当込み、円換算) |       | 株 組 入 比 率 | 株 式 先 物 率<br>比 |
|-------------------|---------|-------|-----------------------------------|-------|-----------|----------------|
|                   | 円       | 騰 落 率 | (参考指数)                            | 騰 落 率 |           |                |
| (期 首) 2019年 5月21日 | 10,272  | —     | 11,471                            | —     | 92.5      | —              |
| 5月末               | 10,031  | △ 2.3 | 11,217                            | △ 2.2 | 92.4      | —              |
| 6月末               | 10,387  | 1.1   | 11,633                            | 1.4   | 92.4      | —              |
| 7月末               | 10,725  | 4.4   | 11,904                            | 3.8   | 93.8      | —              |
| 8月末               | 10,138  | △ 1.3 | 11,268                            | △ 1.8 | 91.5      | —              |
| 9月末               | 10,314  | 0.4   | 11,694                            | 1.9   | 93.1      | —              |
| 10月末              | 10,735  | 4.5   | 12,163                            | 6.0   | 95.6      | —              |
| (期 末) 2019年11月21日 | 10,890  | 6.0   | 12,323                            | 7.4   | 92.8      | —              |

(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

(2019. 5. 22 ~ 2019. 11. 21)

### ■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、米中通商協議に対する懸念を受けて下落しました。しかし6月以降は、世界的に緩和された金融政策への期待が高まり、上昇基調に転じました。8月には、米国が中国からの輸入製品に対する追加関税の拡大方針を示したことから米中貿易摩擦激化への懸念が強まり、下落する場面もありました。しかしその後は、米中貿易摩擦への懸念の後退に加えて、英国の合意なきEU（欧州連合）離脱への懸念の後退などから、総じて堅調に推移しました。

### ■為替相場

米ドルは対円で下落（円高）しました。

米ドルの対円為替相場は、当作成期首より、米中通商協議に対する懸念や米国の利下げ観測の高まりなどから、下落しました。8月には、米中貿易摩擦の激化がリスク回避の動きにつながったことから一段と下落しました。9月以降は、米中貿易摩擦への懸念の後退に加えて、英国のEU（欧州連合）離脱への懸念の後退などを受けて、米ドルは反発する展開となりました。

## 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、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

(2019. 5. 22 ~ 2019. 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。

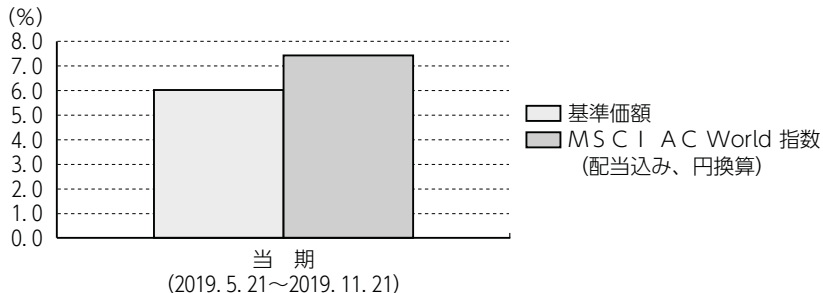
### ■ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

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 MICROSOFT（米国、情報技術）や KLA CORPORATION（米国、情報技術）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 ALTRIA GROUP（米国、生活必需品）や CISCO SYSTEMS（米国、情報技術）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                         |            |
|-------------------|----------------------------|------------|
|                   | 2019年5月22日<br>～2019年11月21日 |            |
| <b>当期分配金（税込み）</b> | <b>（円）</b>                 | <b>150</b> |
| 対基準価額比率           | （％）                        | 1.38       |
| 当期の収益             | （円）                        | 150        |
| 当期の収益以外           | （円）                        | —          |
| 翌期繰越分配対象額         | （円）                        | 782        |

### ■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             | ✓  | 125.85円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益         | ✓  | 247.76  |
| (c) 収益調整金                   |    | 22.78   |
| (d) 分配準備積立金                 |    | 536.40  |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) |    | 932.80  |
| (f) 分配金                     |    | 150.00  |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)       |    | 782.80  |

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

- (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。



## 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<br>(2019. 5. 22～2019. 11. 21) |         | 項 目 の 概 要   |
|---------------|-----------------------------------|---------|---|
|               | 金 額                               | 比 率     |   |
| 信 託 報 酬       | 102円                              | 0.982%  | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br><b>当作成期中の平均基準価額は 10,394円です。</b>              |
| ( 投 信 会 社 )   | (54)                              | (0.518) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価                       |
| ( 販 売 会 社 )   | (45)                              | (0.437) | 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 銀 行 )   | (3)                               | (0.027) | 受託銀行分は、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                                 | 0.019   | 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<br>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)                               | (0.019) |   |
| 有 価 証 券 取 引 税 | 0                                 | 0.002   | 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<br>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 )       | (0)                               | (0.002) |   |
| そ の 他 費 用     | 6                                 | 0.061   | 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)                               | (0.058) | 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           | 111                               | 1.064   |   |

(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。

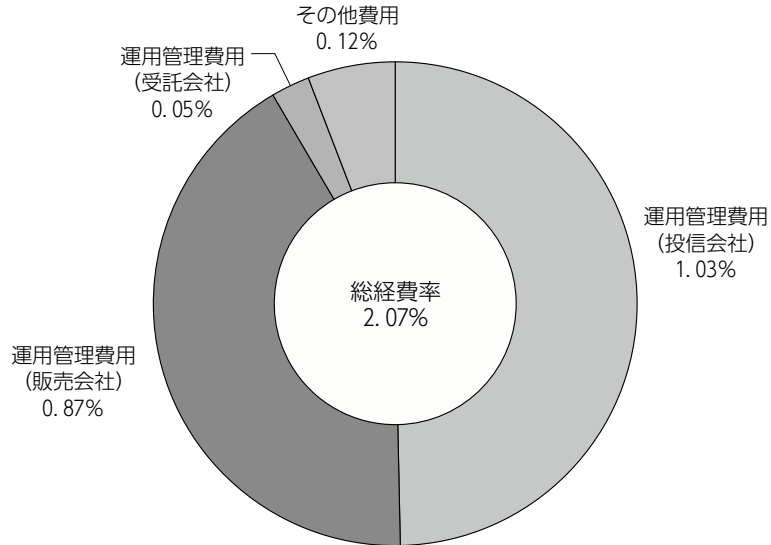
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.07%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

(2019年5月22日から2019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・<br>グローバル好配当株<br>マザーファンド | 20,615 | 25,000 | 598,704 | 717,000 |

(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

(2019年5月22日から2019年11月21日まで)

| 項 目                 | 当 期                              |
|---------------------|----------------------------------|
|                     | ダイワ／ミレーアセット・<br>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       | 2,407,791千円                      |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 3,631,361千円                      |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.66                             |

(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・<br>グローバル好配当株マザーファンド | 3,516,693 | 2,938,604 | 3,632,996 |

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2019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・<br>グローバル好配当株マザーファンド | 3,632,996 | 95.8  |
| コール・ローン等、その他                     | 160,507   | 4.2   |
| 投資信託財産総額                         | 3,793,503 | 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=108.42円、1カナダ・ドル=81.44円、1オーストラリア・ドル=73.64円、1香港・ドル=13.85円、1イギリス・ポンド=140.17円、1スイス・フラン=109.48円、1ノルウェー・クローネ=11.87円、1ユーロ=120.04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(3,586,200千円)の投資信託財産総額(3,660,855千円)に対する比率は、98.0%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年11月21日現在

| 項 目                                   | 当 期 末          |
|---------------------------------------|----------------|
| (A) 資産                                | 3,793,503,679円 |
| コール・ローン等                              | 132,507,038    |
| ダイワ／ミレーアセット・グローバル<br>好配当株マザーファンド(評価額) | 3,632,996,641  |
| 未収入金                                  | 28,000,000     |
| (B) 負債                                | 119,329,268    |
| 未払収益分配金                               | 51,313,868     |
| 未払解約金                                 | 29,780,297     |
| 未払信託報酬                                | 38,127,697     |
| その他未払費用                               | 107,406        |
| (C) 純資産総額(A-B)                        | 3,674,174,411  |
| 元本                                    | 3,420,924,548  |
| 次期繰越損益金                               | 253,249,863    |
| (D) 受益権総口数                            | 3,420,924,548口 |
| 1万口当り基準価額(C/D)                        | 10,740円        |

\* 期首における元本額は3,993,053,776円、当作成期間中における追加設定元本額は35,935,914円、同解約元本額は608,065,142円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,740円です。

■損益の状況

当期 自2019年5月22日 至2019年11月21日

| 項 目                   | 当 期            |
|-----------------------|----------------|
| (A) 配当等収益             | △ 9,050円       |
| 受取利息                  | 1,020          |
| 支払利息                  | △ 10,070       |
| (B) 有価証券売買損益          | 248,417,262    |
| 売買益                   | 268,785,118    |
| 売買損                   | △ 20,367,856   |
| (C) 信託報酬等             | △ 38,235,435   |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 210,172,777    |
| (E) 前期繰越損益金           | 101,139,125    |
| (F) 追加信託差損益金          | △ 6,748,171    |
| (配当等相当額)              | ( 7,794,092)   |
| (売買損益相当額)             | (△ 14,542,263) |
| (G) 合計 (D + E + F)    | 304,563,731    |
| (H) 収益分配金             | △ 51,313,868   |
| 次期繰越損益金 (G + H)       | 253,249,863    |
| 追加信託差損益金              | △ 6,748,171    |
| (配当等相当額)              | ( 7,794,092)   |
| (売買損益相当額)             | (△ 14,542,263) |
| 分配準備積立金               | 259,998,034    |

(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: 11,693,238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             | 43,052,717円    |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益         | 84,760,080     |
| (c) 収益調整金                   | 7,794,092      |
| (d) 分配準備積立金                 | 183,499,105    |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 319,105,994    |
| (f) 分配金                     | 51,313,868     |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)       | 267,792,126    |
| (h) 受益権総口数                  | 3,420,924,548口 |

| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ |      |
|---------------------|------|
| 1 万 口 当 り 分 配 金     | 150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。

#### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・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。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

#### 《お知らせ》

##### ●信託期間の延長について

信託期間を5年間延長し、信託期間終了日を2020年5月21日から2025年5月21日に変更しました。

＜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（2019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（2019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

(2019年5月22日から2019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      |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL (アメリカ) | 10   | 82,569 | 8,256  | ALTRIA GROUP INC (アメリカ)            | 16.8 | 73,856 | 4,396  |
| CITIGROUP INC (アメリカ)               | 11   | 80,927 | 7,357  | MICROSOFT CORP (アメリカ)              | 4.5  | 68,605 | 15,245 |
| JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)         | 5.4  | 67,330 | 12,468 | NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)          | 2.9  | 66,971 | 23,093 |
| BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)        | 20.7 | 64,919 | 3,136  | EXELON CORP (アメリカ)                 | 12.4 | 65,762 | 5,303  |
| ALTRIA GROUP INC (アメリカ)            | 10.2 | 54,286 | 5,322  | CITIGROUP INC (アメリカ)               | 7.7  | 56,163 | 7,293  |
| PEPSICO INC (アメリカ)                 | 3.1  | 43,487 | 14,028 | AFLAC INC (アメリカ)                   | 10   | 55,803 | 5,580  |
| CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)           | 5.8  | 32,451 | 5,595  | CENTERPOINT ENERGY INC (アメリカ)      | 16.8 | 53,975 | 3,212  |
| BROADCOM INC (アメリカ)                | 1.1  | 31,992 | 29,083 | CHEVRON CORP (アメリカ)                | 3.9  | 50,247 | 12,883 |
| EXELON CORP (アメリカ)                 | 6.4  | 30,436 | 4,755  | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL (アメリカ) | 6    | 49,040 | 8,173  |
| NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)          | 1.1  | 24,867 | 22,607 | BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)        | 15.3 | 48,851 | 3,192  |

(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、2019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（2,938,604千円）の内容です。

外国株式

| 銘 柄                         | 2019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)                      |               |          |        |                |
| ABBOTT LABORATORIES         | 40            | 335      | 36,381 | ヘルスケア          |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 30            | 412      | 44,713 | 情報技術           |
| AFLAC INC                   | 44            | 238      | 25,822 | 金融             |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 17            | 301      | 32,664 | 資本財・サービス       |
| CITIGROUP INC               | 85            | 628      | 68,113 | 金融             |
| APPLE INC                   | 4             | 105      | 11,414 | 情報技術           |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 32            | 265      | 28,747 | 金融             |
| BOEING CO/THE               | 11            | 408      | 44,235 | 資本財・サービス       |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC  | 63            | 374      | 40,627 | コミュニケーション・サービス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO     | 30            | 169      | 18,347 | ヘルスケア          |

| 銘 柄                          | 2019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     |            |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 61            | 790      | 85,732 | 金融         |
| DELTA AIR LINES INC          | 16            | 89       | 9,657  | 資本財・サービス   |
| CISCO SYSTEMS INC            | 134           | 604      | 65,493 | 情報技術       |
| MORGAN STANLEY               | 70            | 343      | 37,263 | 金融         |
| BROADCOM INC                 | 15            | 467      | 50,686 | 情報技術       |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 7             | 64       | 6,999  | 素材         |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 12            | 360      | 39,105 | 生活必需品      |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 11            | 109      | 11,837 | 一般消費財・サービス |
| EXPEDIA GROUP INC            | 16            | 150      | 16,360 | 一般消費財・サービス |
| NEXTERA ENERGY INC           | 1             | 23       | 2,550  | 公益事業       |
| GENERAL MOTORS CO            | 10            | 35       | 3,825  | 一般消費財・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                          | 2019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      |                |
| HOME DEPOT INC              | 12            | 265      | 28,739  | 一般消費財・サービス     |
| HUMANA INC                  | 10            | 337      | 36,621  | ヘルスケア          |
| INGERSOLL-RAND PLC          | 16            | 207      | 22,523  | 資本財・サービス       |
| JOHNSON & JOHNSON           | 22            | 299      | 32,424  | ヘルスケア          |
| KLA CORP                    | 13            | 225      | 24,478  | 情報技術           |
| LOCKHEED MARTIN CORP        | 6             | 235      | 25,545  | 資本財・サービス       |
| MCDONALD'S CORP             | 19            | 368      | 39,990  | 一般消費財・サービス     |
| PHILLIPS 66                 | 15            | 174      | 18,874  | エネルギー          |
| MERCK & CO. INC.            | 63            | 537      | 58,243  | ヘルスケア          |
| DUPONT DE NEMOURS INC       | 9             | 58       | 6,347   | 素材             |
| NIKE INC -CL B              | 21            | 195      | 21,185  | 一般消費財・サービス     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 93            | 776      | 84,173  | 生活必需品          |
| ALTRIA GROUP INC            | 13            | 62       | 6,828   | 生活必需品          |
| PFIZER INC                  | 79            | 292      | 31,733  | ヘルスケア          |
| DOW INC                     | 8             | 42       | 4,568   | 素材             |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE     | 38            | 464      | 50,382  | 生活必需品          |
| EXELON CORP                 | 5             | 22       | 2,458   | 公益事業           |
| CONOCOPHILLIPS              | 36            | 213      | 23,168  | エネルギー          |
| PEPSICO INC                 | 22            | 294      | 31,900  | 生活必需品          |
| CORTEVA INC                 | 14.33         | 35       | 3,881   | 素材             |
| ACCENTURE PLC-CL A          | 25            | 494      | 53,589  | 情報技術           |
| QUALCOMM INC                | 11            | 94       | 10,211  | 情報技術           |
| ROSS STORES INC             | 16            | 176      | 19,158  | 一般消費財・サービス     |
| CHEVRON CORP                | 17            | 199      | 21,627  | エネルギー          |
| AT&T INC                    | 66            | 245      | 26,604  | コミュニケーション・サービス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC      | 18            | 496      | 53,777  | ヘルスケア          |
| VALERO ENERGY CORP          | 18            | 174      | 18,967  | エネルギー          |
| ANTHEM INC                  | 11            | 321      | 34,907  | ヘルスケア          |
| WALT DISNEY CO/THE          | 73            | 1,072    | 116,290 | コミュニケーション・サービス |
| WALMART INC                 | 30            | 357      | 38,748  | 生活必需品          |
| TJX COMPANIES INC           | 48            | 284      | 30,871  | 一般消費財・サービス     |
| VISA INC-CLASS A SHARES     | 59            | 1,071    | 116,203 | 情報技術           |
| TYSON FOODS INC-CL A        | 4             | 36       | 3,930   | 生活必需品          |
| MASTERCARD INC - A          | 30            | 856      | 92,822  | 情報技術           |
| BANK OF AMERICA CORP        | 206           | 673      | 73,011  | 金融             |
| AMERICAN EXPRESS CO         | 27            | 322      | 34,923  | 金融             |
| AMGEN INC                   | 13            | 293      | 31,784  | ヘルスケア          |
| EATON CORP PLC              | 23            | 206      | 22,398  | 資本財・サービス       |
| GILEAD SCIENCES INC         | 28            | 181      | 19,696  | ヘルスケア          |
| BAXTER INTERNATIONAL INC    | 35            | 287      | 31,116  | ヘルスケア          |
| INTEL CORP                  | 8             | 46       | 5,022   | 情報技術           |
| MICROSOFT CORP              | 169           | 2,528    | 274,148 | 情報技術           |

| 銘柄                           | 2019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                |                |
| MEDTRONIC PLC                | 29                | 324               | 35,148            | ヘルスケア          |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 8                 | 19                | 2,120             | 公益事業           |
| INTUIT INC                   | 12                | 328               | 35,580            | 情報技術           |
| BEST BUY CO INC              | 2                 | 14                | 1,607             | 一般消費財・サービス     |
| COMCAST CORP-CLASS A         | 144               | 636               | 69,030            | コミュニケーション・サービス |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 株数、金額<br>銘柄数 <比率> | 2,353.33<br>68銘柄  | 23,131<br><69.0%> |                |
|                              | 百株                | カナダ・ドル            | 千円                |                |
| <b>(カナダ)</b>                 |                   |                   |                   |                |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 43                | 302               | 24,618            | 金融             |
| カナダ・ドル<br>通貨計                | 株数、金額<br>銘柄数 <比率> | 43<br>1銘柄         | 302<br><0.7%>     |                |
|                              | 百株                | オーストラリア・ドル        | 千円                |                |
| <b>(オーストラリア)</b>             |                   |                   |                   |                |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 56.69             | 451               | 33,230            | 金融             |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 62.73             | 847               | 62,376            | 金融             |
| オーストラリア・ドル<br>通貨計            | 株数、金額<br>銘柄数 <比率> | 119.42<br>2銘柄     | 1,298<br><2.6%>   |                |
|                              | 百株                | 千香港・ドル            | 千円                |                |
| <b>(香港)</b>                  |                   |                   |                   |                |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 180.68            | 1,317             | 18,242            | 資本財・サービス       |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 1,590             | 1,028             | 14,247            | 生活必需品          |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H     | 1,020             | 1,068             | 14,805            | 資本財・サービス       |
| CNOOC LTD                    | 2,510             | 2,971             | 41,159            | エネルギー          |
| HUANENG POWER INTL INC-H     | 2,940             | 1,111             | 15,391            | 公益事業           |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 5,460             | 3,494             | 48,397            | 金融             |
| CHINA MOBILE LTD             | 190               | 1,179             | 16,341            | コミュニケーション・サービス |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        | 185.68            | 999               | 13,848            | 不動産            |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 1,135             | 1,720             | 23,831            | エネルギー          |
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 6,600             | 3,814             | 52,834            | 金融             |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 2,588             | 2,181             | 30,216            | 一般消費財・サービス     |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 2,900             | 2,740             | 37,955            | 金融             |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H   | 618               | 893               | 12,376            | ヘルスケア          |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 8,180             | 2,355             | 32,628            | 素材             |
| BANK OF CHINA LTD-H          | 8,020             | 2,590             | 35,877            | 金融             |
| 香港・ドル<br>通貨計                 | 株数、金額<br>銘柄数 <比率> | 44,117.36<br>15銘柄 | 29,469<br><11.2%> |                |
|                              | 百株                | 千イギリス・ポンド         | 千円                |                |
| <b>(イギリス)</b>                |                   |                   |                   |                |
| BP PLC                       | 156               | 77                | 10,869            | エネルギー          |

| 銘柄                           | 2019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            | 千イギリス・ポンド   | 千円     |                |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 56            | 95          | 13,317 | ヘルスケア          |
| RIO TINTO PLC                | 34            | 140         | 19,758 | 素材             |
| VODAFONE GROUP PLC           | 213           | 32          | 4,550  | コミュニケーション・サービス |
| 3I GROUP PLC                 | 43            | 44          | 6,238  | 金融             |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 1,416         | 83          | 11,732 | 金融             |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 48            | 84          | 11,848 | 生活必需品          |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 33            | 74          | 10,500 | エネルギー          |
| イギリス・ポンド                     | 株数、金額         | 1,999       | 633    | 88,815         |
| 通貨計                          | 銘柄数 <比率>      | 8銘柄         |        | <2.4%>         |
|                              | 百株            | 千スイス・フラン    | 千円     |                |
| (スイス)                        |               |             |        |                |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2             | 60          | 6,629  | ヘルスケア          |
| NESTLE SA-REG                | 15            | 156         | 17,128 | 生活必需品          |
| ALCON INC                    | 2.4           | 13          | 1,499  | ヘルスケア          |
| NOVARTIS AG-REG              | 8             | 71          | 7,870  | ヘルスケア          |
| スイス・フラン                      | 株数、金額         | 27.4        | 302    | 33,127         |
| 通貨計                          | 銘柄数 <比率>      | 4銘柄         |        | <0.9%>         |
|                              | 百株            | 千ノルウェー・クローネ | 千円     |                |
| (ノルウェー)                      |               |             |        |                |
| TELENOR ASA                  | 21            | 351         | 4,175  | 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         | 21          | 351    | 4,175          |
| 通貨計                          | 銘柄数 <比率>      | 1銘柄         |        | <0.1%>         |
|                              | 百株            | 千ユーロ        | 千円     |                |
| (ユーロ(オランダ))                  |               |             |        |                |
| ASML HOLDING NV              | 7             | 171         | 20,557 | 情報技術           |
| UNILEVER NV                  | 9             | 47          | 5,750  | 生活必需品          |
| AIRBUS SE                    | 16            | 216         | 25,947 | 資本財・サービス       |
| 国小計                          | 株数、金額         | 32          | 435    | 52,256         |
|                              | 銘柄数 <比率>      | 3銘柄         |        | <1.4%>         |
|                              | 百株            | 千ユーロ        | 千円     |                |
| (ユーロ(フランス))                  |               |             |        |                |
| TOTAL SA                     | 21            | 102         | 12,291 | エネルギー          |
| KERING                       | 2             | 109         | 13,189 | 一般消費財・サービス     |
| L'OREAL                      | 3             | 77          | 9,312  | 生活必需品          |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 2             | 79          | 9,559  | 一般消費財・サービス     |
| CAPGEMINI SE                 | 17            | 183         | 22,008 | 情報技術           |
| AXA SA                       | 50            | 125         | 15,008 | 金融             |
| SANOFI                       | 9             | 74          | 8,954  | ヘルスケア          |
| VINCI SA                     | 21            | 211         | 25,334 | 資本財・サービス       |
| 国小計                          | 株数、金額         | 125         | 963    | 115,659        |
|                              | 銘柄数 <比率>      | 8銘柄         |        | <3.2%>         |

| 銘柄                     | 2019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            | 千ユーロ      | 千円     |            |
| (ユーロ(ドイツ))             |               |           |        |            |
| VOLKSWAGEN AG-PREF     | 7             | 122       | 14,746 | 一般消費財・サービス |
| BASF SE                | 24            | 166       | 20,045 | 素材         |
| ALLIANZ SE-REG         | 5             | 108       | 13,075 | 金融         |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 31            | 53        | 6,422  | 資本財・サービス   |
| 国小計                    | 株数、金額         | 67        | 452    | 54,290     |
|                        | 銘柄数 <比率>      | 4銘柄       |        | <1.5%>     |
|                        | 百株            | 千ユーロ      | 千円     |            |
| (ユーロ(スペイン))            |               |           |        |            |
| IBERDROLA SA           | 111           | 98        | 11,856 | 公益事業       |
| BANCO SANTANDER SA     | 332           | 117       | 14,098 | 金融         |
| 国小計                    | 株数、金額         | 443       | 216    | 25,954     |
|                        | 銘柄数 <比率>      | 2銘柄       |        | <0.7%>     |
| ユーロ                    | 株数、金額         | 667       | 2,067  | 248,160    |
| 通貨計                    | 銘柄数 <比率>      | 17銘柄      |        | <6.8%>     |
| ファンド合計                 | 株数、金額         | 49,347.51 | —      | 3,410,611  |
|                        | 銘柄数 <比率>      | 116銘柄     |        | <93.9%>    |

(注1) 邦貨換算金額は、2019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4期（決算日 2019年5月21日）

（作成対象期間 2018年5月22日～2019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   |

## 大和投資信託

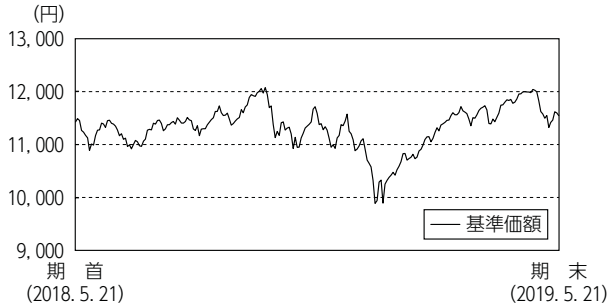
Daiwa Asset Management

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：11,425円 期末：11,544円 騰落率：1.0%

【基準価額の主な変動要因】

一部の保有銘柄が上昇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

世界株式市況はおおむね横ばいの水準となりました。

世界株式市況は、米国株式市場では、当作成期首から2018年9月にかけて、予想を上回る経済指標の発表や総じて好調な四半期決算などを背景に、底堅く推移しました。その後、10月以降は、米国の長期金利が約7年ぶりの水準まで上昇したことを受けて下落しました。2019年に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) が今後の利上げについて慎重な姿勢を示したことや、米中通商協議の進展期待などが支援材料となり、上昇基調で推移しました。

○為替相場

米ドルの対円為替相場は、おおむね横ばいの水準となりました。

米ドルの対円為替相場は、当作成期首から2018年11月にかけて上昇しました。F O M C (米国連邦公開市場委員会) において政策金利見直しを引き上げたことなどが支援材料となりました。しかし12月以降は、米国株式や原油価格の急落などを背景に下落しました。2019年に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり、再び上昇基調で推移しました。

◆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、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、株主還元に関する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MASTERCARD (米国、情報技術)、寄与度が低かった銘柄はAPPLIED MATERIALS (米国、情報技術) やVALERO ENERGY (米国、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。

| 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)2018年5月21日 | 11,425 | —     | 11,528                     | —      | 93.1        | —           |
| 5月末             | 11,006 | △ 3.7 | 11,167                     | △ 3.1  | 93.4        | —           |
| 6月末             | 10,996 | △ 3.8 | 11,200                     | △ 2.8  | 94.5        | —           |
| 7月末             | 11,383 | △ 0.4 | 11,648                     | 1.0    | 94.1        | —           |
| 8月末             | 11,599 | 1.5   | 11,801                     | 2.4    | 92.9        | —           |
| 9月末             | 11,976 | 4.8   | 12,120                     | 5.1    | 94.1        | —           |
| 10月末            | 11,119 | △ 2.7 | 11,012                     | △ 4.5  | 92.3        | —           |
| 11月末            | 11,354 | △ 0.6 | 11,320                     | △ 1.8  | 92.4        | —           |
| 12月末            | 10,322 | △ 9.7 | 10,201                     | △ 11.5 | 92.6        | —           |
| 2019年1月末        | 10,873 | △ 4.8 | 10,836                     | △ 6.0  | 94.0        | —           |
| 2月末             | 11,560 | 1.2   | 11,473                     | △ 0.5  | 94.1        | —           |
| 3月末             | 11,511 | 0.8   | 11,516                     | △ 0.1  | 92.9        | —           |
| 4月末             | 11,995 | 5.0   | 12,013                     | 4.2    | 94.0        | —           |
| (期 末)2019年5月21日 | 11,544 | 1.0   | 11,471                     | △ 0.5  | 93.4        | —           |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) M S C I A C World 指数 (配当込み、円換算) は、M S C I Inc. の承諾を得て、M S C I A C 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として大和投資信託が計算したものです。M S C I A C World 指数 (配当込み、米ドルベース) は、M S C I 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 M S C I Inc. に帰属します。また M S C I 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。

# 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<br>(株式)          | 8円<br>(8)       |
| 有価証券取引税<br>(株式)          | 3<br>(3)        |
| その他費用<br>(保管費用)<br>(その他) | 8<br>(7)<br>(1) |
| 合計                       | 19              |

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の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

(2018年5月22日から2019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<br>4,705.34<br>(96.66) | 千アメリカ・ドル<br>38,140<br>(△225) | 百株<br>6,491 | 千アメリカ・ドル<br>45,056   |
|    | カナダ             | 百株<br>—<br>(—)            | 千カナダ・ドル<br>—<br>(—)          | 百株<br>66    | 千カナダ・ドル<br>421       |
|    | オーストラリア         | 百株<br>—<br>(—)            | 千オーストラリア・ドル<br>—<br>(—)      | 百株<br>55.86 | 千オーストラリア・ドル<br>553   |
|    | 香港              | 百株<br>—<br>(2,048)        | 千香港・ドル<br>—<br>(—)           | 百株<br>8,346 | 千香港・ドル<br>6,032      |
|    | イギリス            | 百株<br>3,270<br>(—)        | 千イギリス・ポンド<br>676<br>(—)      | 百株<br>2,473 | 千イギリス・ポンド<br>1,763   |
|    | スイス             | 百株<br>66<br>(2.4)         | 千スイス・フラン<br>595<br>(—)       | 百株<br>311   | 千スイス・フラン<br>1,858    |
|    | デンマーク           | 百株<br>—<br>(—)            | 千デンマーク・クローネ<br>—<br>(—)      | 百株<br>81    | 千デンマーク・クローネ<br>1,351 |
|    | ノルウェー           | 百株<br>45<br>(—)           | 千ノルウェー・クローネ<br>725<br>(—)    | 百株<br>366   | 千ノルウェー・クローネ<br>3,366 |
|    | ユーロ<br>(オランダ)   | 百株<br>64<br>(—)           | 千ユーロ<br>738<br>(—)           | 百株<br>237   | 千ユーロ<br>1,062        |
|    | ユーロ<br>(フランス)   | 百株<br>339<br>(—)          | 千ユーロ<br>1,444<br>(—)         | 百株<br>915   | 千ユーロ<br>3,427        |
|    | ユーロ<br>(ドイツ)    | 百株<br>67<br>(—)           | 千ユーロ<br>580<br>(—)           | 百株<br>230   | 千ユーロ<br>1,595        |
|    | ユーロ<br>(スペイン)   | 百株<br>885<br>(—)          | 千ユーロ<br>452<br>(—)           | 百株<br>711   | 千ユーロ<br>393          |
|    | ユーロ<br>(イタリア)   | 百株<br>—<br>(—)            | 千ユーロ<br>—<br>(△13)           | 百株<br>941   | 千ユーロ<br>217          |
|    | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 百株<br>1,355<br>(—)        | 千ユーロ<br>3,216<br>(△13)       | 百株<br>3,034 | 千ユーロ<br>6,697        |

(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。

■主要な売買銘柄  
株 式

(2018年5月22日から2019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      |
| MICROSOFT CORP (アメリカ)              | 18.3 | 229,071 | 12,517 | BOEING CO/THE (アメリカ)          | 6.9  | 287,634 | 41,686 |
| CENTERPOINT ENERGY INC (アメリカ)      | 55.4 | 182,781 | 3,299  | CENTERPOINT ENERGY INC (アメリカ) | 58.8 | 193,498 | 3,290  |
| BOEING CO/THE (アメリカ)               | 4.3  | 169,561 | 39,432 | MICROSOFT CORP (アメリカ)         | 13.4 | 172,136 | 12,846 |
| WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)          | 10.5 | 139,376 | 13,273 | CITIGROUP INC (アメリカ)          | 22.8 | 171,267 | 7,511  |
| CHEVRON CORP (アメリカ)                | 9.9  | 132,902 | 13,424 | APPLE INC (アメリカ)              | 7.3  | 158,993 | 21,779 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL (アメリカ) | 12   | 115,122 | 9,593  | ORACLE CORP (アメリカ)            | 28.8 | 156,423 | 5,431  |
| HUMANA INC (アメリカ)                  | 3.4  | 111,275 | 32,728 | BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)   | 46.9 | 153,047 | 3,263  |
| VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ)     | 6.6  | 104,571 | 15,844 | EATON CORP PLC (アイルランド)       | 17.3 | 149,395 | 8,635  |
| ALTRIA GROUP INC (アメリカ)            | 16.3 | 100,516 | 6,166  | CHEVRON CORP (アメリカ)           | 11   | 148,069 | 13,460 |
| BROADCOM INC (アメリカ)                | 3.5  | 98,969  | 28,276 | PFIZER INC (アメリカ)             | 29.8 | 141,043 | 4,732  |

(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          | —   | 45  | 340      | 37,564 | ヘルスケア          |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 26  | —   | —        | —      | 一般商社・サービス      |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | —   | 31  | 366      | 40,409 | 情報技術           |
| AFLAC INC                    | 164 | 132 | 688      | 75,853 | 金融             |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | —   | 19  | 320      | 35,296 | 資本財・サービス       |
| CITIGROUP INC                | 219 | 52  | 337      | 37,214 | 金融             |
| APPLE INC                    | 67  | 6   | 109      | 12,102 | 情報技術           |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 72  | 42  | 326      | 36,008 | 金融             |
| BOEING CO/THE                | 36  | 10  | 352      | 38,866 | 資本財・サービス       |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | —   | 45  | 265      | 29,255 | コミュニケーション・サービス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | —   | 22  | 101      | 11,224 | ヘルスケア          |
| JPMORGAN CHASE & CO          | —   | 35  | 389      | 42,936 | 金融             |
| DELTA AIR LINES INC          | 101 | 24  | 130      | 14,352 | 資本財・サービス       |
| CISCO SYSTEMS INC            | 139 | 78  | 436      | 48,130 | 情報技術           |
| MORGAN STANLEY               | 133 | 61  | 267      | 29,482 | 金融             |
| BROADCOM INC                 | 26  | 16  | 436      | 48,049 | 情報技術           |
| TIME WARNER INC              | 45  | —   | —        | —      | その他            |
| WYNDHAM DESTINATIONS INC     | 18  | —   | —        | —      | 一般商社・サービス      |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 37  | 17  | 135      | 14,956 | 素材             |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | —   | 7   | 174      | 19,194 | 生活必需品          |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | —   | 23  | 210      | 23,177 | 一般商社・サービス      |
| EXPEDIA GROUP INC            | —   | 17  | 198      | 21,815 | 一般商社・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  | —   | —        | —      | エネルギー     |
| NEXTERA ENERGY INC          | —   | 19  | 378      | 41,728 | 公益事業      |
| GENERAL MOTORS CO           | 75  | 17  | 62       | 6,924  | 一般商社・サービス |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC     | 3   | —   | —        | —      | 金融        |
| HOME DEPOT INC              | 26  | 23  | 439      | 48,385 | 一般商社・サービス |
| HUMANA INC                  | —   | 13  | 325      | 35,809 | ヘルスケア     |
| HP INC                      | 215 | —   | —        | —      | 情報技術      |
| INGERSOLL-RAND PLC          | —   | 18  | 218      | 24,062 | 資本財・サービス  |
| JOHNSON & JOHNSON           | 56  | 7   | 96       | 10,674 | ヘルスケア     |
| ABBVIE INC                  | 32  | —   | —        | —      | ヘルスケア     |
| KLA-TENCOR CORP             | —   | 15  | 158      | 17,452 | 情報技術      |
| LOCKHEED MARTIN CORP        | —   | 8   | 273      | 30,143 | 資本財・サービス  |
| MCDONALD'S CORP             | 12  | 19  | 378      | 41,653 | 一般商社・サービス |
| MANPOWERGROUP INC           | 17  | —   | —        | —      | 資本財・サービス  |
| PHILLIPS 66                 | —   | 37  | 312      | 34,452 | エネルギー     |
| MERCK & CO. INC.            | —   | 73  | 575      | 63,438 | ヘルスケア     |
| DOWDUPONT INC               | 64  | 46  | 142      | 15,725 | 素材        |
| NETAPP INC                  | 71  | 24  | 163      | 18,014 | 情報技術      |
| NIKE INC-CL B               | —   | 34  | 281      | 31,033 | 一般商社・サービス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | —   | 53  | 457      | 50,349 | 生活必需品     |
| ALTRIA GROUP INC            | 81  | 79  | 413      | 45,545 | 生活必需品     |
| PFIZER INC                  | 201 | 78  | 324      | 35,739 | ヘルスケア     |
| DOW INC                     | —   | 22  | 110      | 12,138 | 素材        |

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      |           |  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE    | 43      | 42    | 450      | 49,663  | 生活必需品     |  |
| EXELON CORP                | —       | 65    | 318      | 35,039  | 公益事業      |  |
| CONOCOPHILLIPS             | —       | 51    | 318      | 35,088  | エネルギー     |  |
| ACCENTURE PLC-CL A         | —       | 25    | 446      | 49,174  | 情報技術      |  |
| QUALCOMM INC               | —       | 44    | 337      | 37,141  | 情報技術      |  |
| ROSS STORES INC            | —       | 22    | 212      | 23,430  | 一般消費・サービス |  |
| CHEVRON CORP               | 67      | 56    | 676      | 74,552  | エネルギー     |  |
| AT&T INC                   | 130     | 84    | 270      | 29,789  | コミュニケーション |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC     | 25      | 21    | 516      | 56,911  | ヘルスケア     |  |
| VALERO ENERGY CORP         | 62      | 39    | 320      | 35,266  | エネルギー     |  |
| ANTHEM INC                 | 23      | 13    | 346      | 38,141  | ヘルスケア     |  |
| WALT DISNEY CO/THE         | —       | 77    | 1,031    | 113,597 | コミュニケーション |  |
| WALMART INC                | 29      | 18    | 182      | 20,132  | 生活必需品     |  |
| TJX COMPANIES INC          | —       | 62    | 328      | 36,181  | 一般消費・サービス |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES    | 53      | 64    | 1,046    | 115,260 | 情報技術      |  |
| TYSON FOODS INC-CL A       | 118     | 16    | 130      | 14,431  | 生活必需品     |  |
| ORACLE CORP                | 251     | —     | —        | —       | 情報技術      |  |
| MASTERCARD INC - A         | 36      | 39    | 988      | 108,915 | 情報技術      |  |
| BANK OF AMERICA CORP       | 500     | 152   | 431      | 47,558  | 金融        |  |
| AMERICAN EXPRESS CO        | 25      | 40    | 479      | 52,811  | 金融        |  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 83      | —     | —        | —       | 情報技術      |  |
| AMGEN INC                  | 20      | 6     | 101      | 11,130  | ヘルスケア     |  |
| EATON CORP PLC             | 137     | 28    | 219      | 24,190  | 資本財・サービス  |  |
| APPLIED MATERIALS INC      | 130     | —     | —        | —       | 情報技術      |  |
| GAP INC/THE                | 154     | —     | —        | —       | 一般消費・サービス |  |
| GILEAD SCIENCES INC        | 49      | 16    | 105      | 11,609  | ヘルスケア     |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC   | —       | 39    | 293      | 32,362  | ヘルスケア     |  |
| INTEL CORP                 | —       | 7     | 30       | 3,359   | 情報技術      |  |
| MICROSOFT CORP             | 160     | 209   | 2,637    | 290,628 | 情報技術      |  |
| CVS HEALTH CORP            | 37      | —     | —        | —       | ヘルスケア     |  |
| MEDTRONIC PLC              | —       | 37    | 324      | 35,696  | ヘルスケア     |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC     | 133     | 99    | 293      | 32,327  | 公益事業      |  |
| KOHL'S CORP                | 76      | —     | —        | —       | 一般消費・サービス |  |
| LEAR CORP                  | 18      | —     | —        | —       | 一般消費・サービス |  |
| INTUIT INC                 | —       | 16    | 389      | 42,955  | 情報技術      |  |
| BEST BUY CO INC            | 63      | 31    | 213      | 23,510  | 一般消費・サービス |  |
| COMCAST CORP-CLASS A       | 128     | 126   | 539      | 59,384  | コミュニケーション |  |
| アメリカ・ドル                    | 株数、金額   | 4,500 | 2,811    | 24,683  | 2,719,402 |  |
| 通貨計                        | 銘柄数<比率> | 52銘柄  | 67銘柄     |         | <67.0%>   |  |
|                            | 百株      | 百株    | 千カナダ・ドル  | 千円      |           |  |
| <b>(カナダ)</b>               |         |       |          |         |           |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA    | 139     | 73    | 460      | 37,778  | 金融        |  |
| カナダ・ドル                     | 株数、金額   | 139   | 73       | 460     | 37,778    |  |
| 通貨計                        | 銘柄数<比率> | 1銘柄   | 1銘柄      |         | <0.9%>    |  |

| 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        | 千オーストラリア・ドル | 千円     |           |  |
| <b>(オーストラリア)</b>              |         |           |             |        |           |  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL  | 84.34   | 57.82     | 447         | 34,114 | 金融        |  |
| MACQUARIE GROUP LTD           | 93.32   | 63.98     | 780         | 59,492 | 金融        |  |
| オーストラリア・ドル                    | 株数、金額   | 177.66    | 121.8       | 1,227  | 93,606    |  |
| 通貨計                           | 銘柄数<比率> | 2銘柄       | 2銘柄         |        | <2.3%>    |  |
|                               | 百株      | 百株        | 千香港・ドル      | 千円     |           |  |
| <b>(香港)</b>                   |         |           |             |        |           |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD     | 205.68  | 180.68    | 1,416       | 19,888 | 資本財・サービス  |  |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD  | 1,920   | 1,620     | 972         | 13,646 | 生活必需品     |  |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H      | 1,180   | 1,020     | 1,064       | 14,950 | 資本財・サービス  |  |
| CNOOC LTD                     | 3,020   | 2,550     | 3,483       | 48,905 | エネルギー     |  |
| HUANENG POWER INTL INC-H      | 3,540   | 2,980     | 1,352       | 18,994 | 公益事業      |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H     | 6,620   | 5,560     | 3,497       | 49,101 | 金融        |  |
| CHINA MOBILE LTD              | 215     | 190       | 1,388       | 19,500 | コミュニケーション |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD         | 210.68  | 185.68    | 1,137       | 15,967 | 不動産       |  |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H     | 1,375   | 1,155     | 1,903       | 26,724 | エネルギー     |  |
| IND & COMM BK OF CHINA-H      | 8,000   | 6,730     | 3,755       | 52,724 | 金融        |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H  | 2,220   | 2,628     | 1,923       | 27,008 | 一般消費・サービス |  |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H    | 2,320   | 2,940     | 2,299       | 32,279 | 金融        |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H    | 751     | 630       | 967         | 13,586 | ヘルスケア     |  |
| ZHUI MINING GROUP CO LTD-H    | 9,880   | 8,340     | 2,285       | 32,083 | 素材        |  |
| BANK OF CHINA LTD-H           | 9,730   | 8,180     | 2,871       | 40,311 | 金融        |  |
| 香港・ドル                         | 株数、金額   | 51,187.36 | 44,889.36   | 30,318 | 425,673   |  |
| 通貨計                           | 銘柄数<比率> | 15銘柄      | 15銘柄        |        | <10.5%>   |  |
|                               | 百株      | 百株        | 千イギリス・ポンド   | 千円     |           |  |
| <b>(イギリス)</b>                 |         |           |             |        |           |  |
| BP PLC                        | —       | 224       | 124         | 17,501 | エネルギー     |  |
| GLAXOSMITHKLINE PLC           | 157     | 77        | 119         | 16,750 | ヘルスケア     |  |
| RIO TINTO PLC                 | 102     | 46        | 215         | 30,163 | 素材        |  |
| TAYLOR WIMPEY PLC             | 728     | —         | —           | —      | 一般消費・サービス |  |
| VODAFONE GROUP PLC            | 470     | 289       | 36          | 5,122  | コミュニケーション |  |
| 3I GROUP PLC                  | 188     | 59        | 63          | 8,864  | 金融        |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC      | —       | 2,344     | 139         | 19,556 | 金融        |  |
| IMPERIAL BRANDS PLC           | 84      | 48        | 105         | 14,723 | 生活必需品     |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC  | 53      | —         | —           | —      | 生活必需品     |  |
| HSBC HOLDINGS PLC             | 489     | 60        | 39          | 5,469  | 金融        |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS   | 128     | 49        | 124         | 17,444 | エネルギー     |  |
| イギリス・ポンド                      | 株数、金額   | 2,399     | 3,196       | 967    | 135,595   |  |
| 通貨計                           | 銘柄数<比率> | 9銘柄       | 9銘柄         |        | <3.3%>    |  |
|                               | 百株      | 百株        | 千スイス・フラン    | 千円     |           |  |
| <b>(スイス)</b>                  |         |           |             |        |           |  |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 23      | 4         | 106         | 11,611 | ヘルスケア     |  |
| ABB LTD-REG                   | 190     | —         | —           | —      | 資本財・サービス  |  |
| NESTLE SA-REG                 | 22      | 23        | 228         | 24,991 | 生活必需品     |  |

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 |           |
| ALCON INC                    | 百株      | 百株   | 千スイス・フラン   | 千円     | ヘルスケア     |
| NOVARTIS AG-REG              | —       | 2.4  | 14         | 1,583  | ヘルスケア     |
| スイス・フラン                      | 株数、金額   | 282  | 39.4       | 432    | 47,238    |
| 通貨計                          | 銘柄数<比率> | 4銘柄  | 4銘柄        | <1.2%> |           |
| <b>(デンマーク)</b>               | 百株      | 百株   | デンマーク・クローネ | 千円     |           |
| DANSKE BANK A/S              | 81      | —    | —          | —      | 金融        |
| デンマーク・クローネ                   | 株数、金額   | 81   | —          | —      |           |
| 通貨計                          | 銘柄数<比率> | 1銘柄  | —          | <—>    |           |
| <b>(ノルウェー)</b>               | 百株      | 百株   | ノルウェー・クローネ | 千円     |           |
| ORKLA ASA                    | 281     | —    | —          | —      | 生活必需品     |
| TELENOR ASA                  | 66      | 26   | 470        | 5,893  | コミュニケーション |
| ノルウェー・クローネ                   | 株数、金額   | 347  | 26         | 470    | 5,893     |
| 通貨計                          | 銘柄数<比率> | 2銘柄  | 1銘柄        | <0.1%> |           |
| <b>ユーロ(オランダ)</b>             | 百株      | 百株   | 千ユーロ       | 千円     |           |
| UNILEVER NV-CVA              | 92      | 11   | 59         | 7,313  | 生活必需品     |
| ASML HOLDING NV              | —       | 11   | 188        | 23,177 | 情報技術      |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        | 97      | —    | —          | —      | 金融        |
| RANDSTAD NV                  | 29      | —    | —          | —      | 資本財・サービス  |
| AIRBUS SE                    | —       | 23   | 273        | 33,684 | 資本財・サービス  |
| 国小計                          | 株数、金額   | 218  | 45         | 521    | 64,176    |
|                              | 銘柄数<比率> | 3銘柄  | 3銘柄        | <1.6%> |           |
| <b>ユーロ(フランス)</b>             | 百株      | 百株   | 千ユーロ       | 千円     |           |
| TOTAL SA                     | 87      | 31   | 152        | 18,767 | エネルギー     |
| KERING                       | —       | 2    | 100        | 12,377 | 一般消費・サービス |
| BNP PARIBAS                  | 41      | —    | —          | —      | 金融        |
| L'OREAL                      | —       | 5    | 120        | 14,832 | 生活必需品     |
| LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUI | 13      | 4    | 132        | 16,237 | 一般消費・サービス |
| CAPGEMINI SE                 | 24      | 24   | 249        | 30,639 | 情報技術      |
| AXA SA                       | 137     | 36   | 80         | 9,924  | 金融        |
| RENAULT SA                   | 22      | —    | —          | —      | 一般消費・サービス |
| ATOS SE                      | 26      | —    | —          | —      | 情報技術      |
| ORANGE                       | 79      | —    | —          | —      | コミュニケーション |
| SANOFI                       | 35      | 11   | 81         | 10,057 | ヘルスケア     |
| VINCI SA                     | 64      | 31   | 275        | 33,902 | 資本財・サービス  |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 193     | 97   | 107        | 13,206 | 金融        |
| ENGIE                        | 96      | —    | —          | —      | 公益事業      |
| 国小計                          | 株数、金額   | 817  | 241        | 1,300  | 159,945   |
|                              | 銘柄数<比率> | 12銘柄 | 9銘柄        | <3.9%> |           |

| 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  |           |
| <b>ユーロ(ドイツ)</b>              | 百株      | 百株        | 千ユーロ      | 千円      |           |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | —       | 12        | 173       | 21,373  | 一般消費・サービス |
| BASF SE                      | 38      | 34        | 210       | 25,897  | 素材        |
| ALLIANZ SE-REG               | 16      | 4         | 80        | 9,922   | 金融        |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 77      | 41        | 73        | 9,043   | 資本財・サービス  |
| SAP SE                       | 15      | —         | —         | —       | 情報技術      |
| COVESTRO AG                  | 49      | —         | —         | —       | 素材        |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 29      | —         | —         | —       | 生活必需品     |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 30      | —         | —         | —       | 一般消費・サービス |
| 国小計                          | 株数、金額   | 254       | 91        | 538     | 66,237    |
|                              | 銘柄数<比率> | 7銘柄       | 4銘柄       | <1.6%>  |           |
| <b>ユーロ(スペイン)</b>             | 百株      | 百株        | 千ユーロ      | 千円      |           |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 431     | —         | —         | —       | 金融        |
| IBERDROLA SA                 | —       | 144       | 117       | 14,476  | 公益事業      |
| BANCO SANTANDER SA           | —       | 461       | 188       | 23,206  | 金融        |
| 国小計                          | 株数、金額   | 431       | 605       | 306     | 37,683    |
|                              | 銘柄数<比率> | 1銘柄       | 2銘柄       | <0.9%>  |           |
| <b>ユーロ(イタリア)</b>             | 百株      | 百株        | 千ユーロ      | 千円      |           |
| INTESA SANPAOLO              | 941     | —         | —         | —       | 金融        |
| 国小計                          | 株数、金額   | 941       | —         | —       | —         |
|                              | 銘柄数<比率> | 1銘柄       | —         | <—>     |           |
| ユーロ                          | 株数、金額   | 2,661     | 982       | 2,667   | 328,042   |
| 通貨計                          | 銘柄数<比率> | 24銘柄      | 18銘柄      | <8.1%>  |           |
| ファンド                         | 株数、金額   | 61,774.02 | 52,138.56 | —       | 3,793,231 |
| 合計                           | 銘柄数<比率> | 110銘柄     | 117銘柄     | <93.4%> |           |

(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。

# 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

## ■投資信託財産の構成

2019年5月21日現在

| 項 目          | 当 期 末           |           |
|--------------|-----------------|-----------|
|              | 評 価 額           | 比 率       |
| 株式           | 3,793,231<br>千円 | 93.2<br>% |
| コール・ローン等、その他 | 276,398         | 6.8       |
| 投資信託財産総額     | 4,069,630       | 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=110.17円、1カナダ・ドル=82.04円、1オーストラリア・ドル=76.23円、1香港・ドル=14.04円、1イギリス・ポンド=140.22円、1スイス・フラン=109.15円、1ノルウェー・クローネ=12.53円、1ユーロ=122.99円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(3,993,748千円)の投資信託財産総額(4,069,630千円)に対する比率は、98.1%です。

## ■損益の状況

当期 自2018年5月22日 至2019年5月21日

| 項 目                   | 当 期           |
|-----------------------|---------------|
| (A) 配当等収益             | 137,127,450円  |
| 受取配当金                 | 133,410,957   |
| 受取利息                  | 3,730,667     |
| その他収益金                | 13,098        |
| 支払利息                  | △ 27,272      |
| (B) 有価証券売買損益          | △ 82,976,149  |
| 売買益                   | 478,470,520   |
| 売買損                   | △ 561,446,669 |
| (C) その他費用             | △ 3,386,502   |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 50,764,799    |
| (E) 前期繰越損益金           | 756,042,619   |
| (F) 解約差損益金            | △ 263,873,426 |
| (G) 合計 (D + E + F)    | 542,933,992   |
| 次期繰越損益金 (G)           | 542,933,992   |

(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。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年5月21日現在

| 項 目               | 当 期 末          |
|-------------------|----------------|
| (A) 資産            | 4,076,455,888円 |
| コール・ローン等          | 245,925,950    |
| 株式 (評価額)          | 3,793,231,351  |
| 未収入金              | 29,148,850     |
| 未取配当金             | 8,149,737      |
| (B) 負債            | 16,828,360     |
| 未払金               | 6,827,260      |
| 未払解約金             | 10,000,000     |
| その他未払費用           | 1,100          |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 4,059,627,528  |
| 元本                | 3,516,693,536  |
| 次期繰越損益金           | 542,933,992    |
| (D) 受益権総口数        | 3,516,693,536口 |
| 1万口当り基準価額 (C / D) | 11,544円        |

\* 期首における元本額は5,305,820,110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1,789,126,574円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド3,516,693,536円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,544円です。