

★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	5年間（2015年5月22日～2020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。以下同じ。）
マザーファンドの運用方法	<p>①主として、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し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②株式の運用にあたっては、以下の点に留意します。</p> <p>イ．世界の株式の中から、配当成長、配当性向、キャッシュフロー、財務状況、株価バリュエーション等を分析し、投資対象銘柄を選定します。</p> <p>ロ．投資対象銘柄の中から、時価総額、流動性等を勘案し、ポートフォリオを構築します。</p> <p>③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（米国）エルエルシーに運用の指図にかかる権限を委託します。ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ（米国）エルエルシーは、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツに外貨建資産の運用の指図にかかる権限の一部を委託します。</p> <p>④株式の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。</p> <p>⑤為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p>	
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。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド

運用報告書（全体版）

第6期

（決算日 2018年5月21日）

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。

さて、「ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド」は、このたび、第6期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層の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

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）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

<5684>

最近 5 期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		株式 組入比率	株式先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配 金	期 騰落 率	(参考指数)	期 騰落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2016年 5 月23日)	8,073	0	△ 14.4	8,285	△ 12.7	94.0	—	25,275
3 期末 (2016年11月21日)	8,465	50	5.5	8,803	6.3	96.9	—	16,309
4 期末 (2017年 5 月22日)	9,387	90	12.0	10,070	14.4	97.0	—	12,078
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

(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。

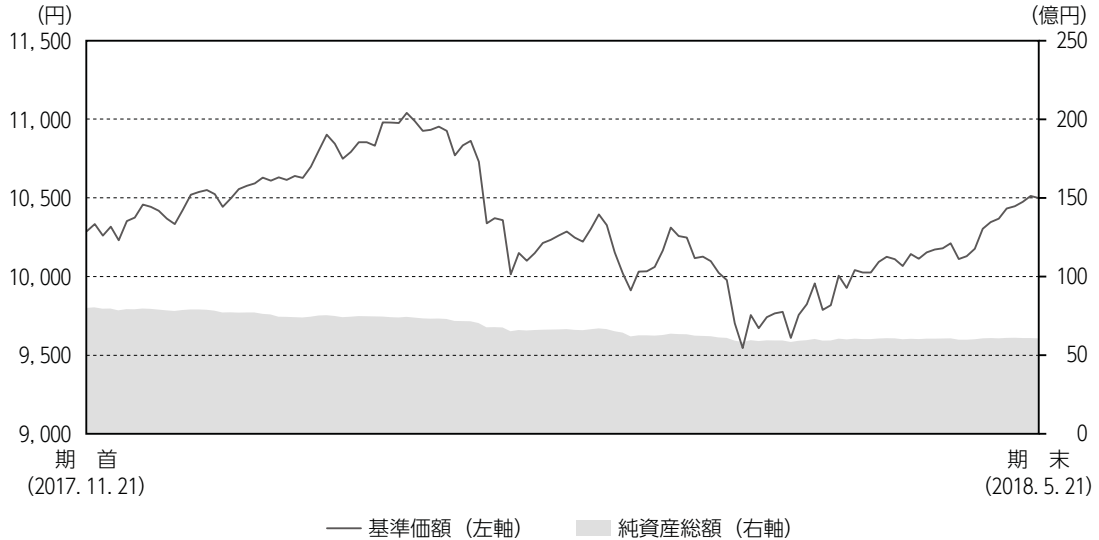
(注 4) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 5) 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



■ 基準価額・騰落率

期首：10,289円

期末：10,499円

騰落率：2.0%

■ 基準価額の変動要因

世界の株式市況が堅調に推移したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2017年11月21日	10,289	—	11,131	—	95.2	—
11月末	10,375	0.8	11,227	0.9	95.3	—
12月末	10,627	3.3	11,551	3.8	95.7	—
2018年1月末	10,771	4.7	11,736	5.4	95.2	—
2月末	10,327	0.4	11,227	0.9	93.7	—
3月末	9,766	△ 5.1	10,751	△ 3.4	94.8	—
4月末	10,172	△ 1.1	11,188	0.5	93.6	—
(期末) 2018年5月21日	10,499	2.0	11,528	3.6	93.1	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 11. 22 ~ 2018. 5. 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、米国の税制改革法案成立への期待や堅調な経済指標の発表などが支援材料となり、期首から2018年1月下旬にかけて上昇しました。その後、米国の雇用統計が市場予想を上回り米国金利が上昇したことで、市場のリスク回避姿勢が強まり、2月中旬にかけて調整しました。期末にかけては、米国の利上げペースや米中の貿易摩擦をめぐる動向などに左右されながら、一進一退の推移となりました。

■為替相場

米ドルやユーロは対円で下落しました。

米ドルは、米国の税制改革法案成立への期待などから上昇する局面も見られましたが、米国長期金利の上昇を受けて株価が下落する中で市場のリスク回避姿勢が強まったことや、米中の貿易摩擦への懸念などが米ドル対円相場の下落要因となりました。

ユーロは、米国の長期金利の上昇を受けた市場のリスク回避姿勢の強まりやイタリアの政治動向などが重しとなり、対円で下落しました。

前期における「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ないます。

■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、今後の運用を行なってまいります。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なってまいります。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

(2017. 11. 22 ~ 2018. 5. 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

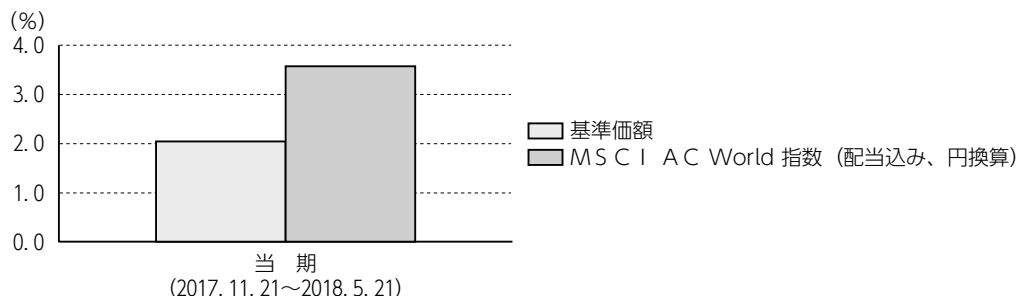
当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ・グループに運用の指図にかかる権限を委託しております。

個別銘柄では、パフォーマンスが相対的に良好であった MASTERCARD（米国、情報技術）や BOEING（米国、資本財・サービス）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 GUANGZHOU AUTOMOBILE（中国、一般消費財・サービス）や BROADCOM（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

当期は、基準価額の水準等を勘案して、収益の分配を行ないませんでした。
 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	
	2017年11月22日 ～2018年5月21日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	541

- (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却等損益」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ないます。

■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、今後の運用を行なってまいります。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なってまいります。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やROE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 (2017. 11. 22～2018. 5. 21)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	100円	0. 964%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10, 332円です。
(投 信 会 社)	(53)	(0. 509)	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、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(44)	(0. 428)	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	3	0. 030	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(3)	(0. 030)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0. 013	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0. 013)	
そ の 他 費 用	5	0. 050	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0. 047)	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	109	1. 057	

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■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

(2017年11月22日から2018年5月21日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
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	—	—	1,896,885	2,139,500

(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

(2017年11月22日から2018年5月21日まで)

項 目	当 期
	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
(a) 期中の株式売買金額	5,841,405千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,497,923千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.89

(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

当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	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千円
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	7,202,705	5,305,820		6,061,899

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年5月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
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	6,061,899	97.7
コール・ローン等、その他	141,766	2.3
投資信託財産総額	6,203,665	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＝111.09円、1カナダ・ドル＝86.21円、1オーストラリア・ドル＝83.47円、1香港ドル＝14.15円、1イギリス・ポンド＝149.49円、1スイス・フラン＝111.12円、1デンマーク・クローネ＝17.52円、1ノルウェー・クローネ＝13.69円、1ユーロ＝130.49円です。

(注3) 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において、当期末における外貨建純資産(6,070,199千円)の投資信託財産総額(6,141,656千円)に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年5月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,203,665,800円
コール・ローン等	70,766,325
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 (評価額)	6,061,899,475
未収入金	71,000,000
(B) 負債	136,109,452
未払解約金	70,386,799
未払信託報酬	65,538,322
その他未払費用	184,331
(C) 純資産総額 (A - B)	6,067,556,348
元本	5,779,199,659
次期繰越損益金	288,356,689
(D) 受益権総口数	5,779,199,659口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,499円

* 期首における元本額は7,777,317,923円、当期中における追加設定元本額は73,482,874円、同解約元本額は2,071,601,138円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,499円です。

ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株ファンド

■損益の状況

当期 自2017年11月22日 至2018年5月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 9,908円
受取利息	1,056
支払利息	△ 10,964
(B) 有価証券売買損益	187,434,139
売買益	240,908,497
売買損	△ 53,474,358
(C) 信託報酬等	△ 65,724,547
(D) 当期損益金 (A + B + C)	121,699,684
(E) 前期繰越損益金	185,483,372
(F) 追加信託差損益金	△ 18,826,367
(配当等相当額)	(5,862,729)
(売買損益相当額)	(△ 24,689,096)
(G) 合計 (D + E + F)	288,356,689
次期繰越損益金 (G)	288,356,689
追加信託差損益金	△ 18,826,367
(配当等相当額)	(5,862,729)
(売買損益相当額)	(△ 24,689,096)
分配準備積立金	307,183,056

(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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

(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：20,173,674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	46,715,255円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	74,984,429
(c) 収益調整金	5,862,729
(d) 分配準備積立金	185,483,372
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	313,045,785
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	313,045,785
(h) 受益権総口数	5,779,199,659口

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。

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3期（決算日 2018年5月21日）

（計算期間 2017年5月23日～2018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第3期にかかる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。以下同じ。）
運用方法	①主として、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し、信託財産の成長をめざします。 ②株式の運用にあたっては、以下の点に留意します。 イ. 世界の株式の中から、配当成長、配当性向、キャッシュフロー、財務状況、株価バリュエーション等を分析し、投資対象銘柄を選定します。 ロ. 投資対象銘柄の中から、時価総額、流動性等を勘案し、ポートフォリオを構築します。 ③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（米国）エルエルシーに運用の指図にかかる権限を委託します。ミレーアセット・グローバル・インベストメンツ（米国）エルエルシーは、ミレーアセット・グローバル・インベストメンツに外貨建資産の運用の指図にかかる権限の一部を委託します。 ④株式の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ⑤為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
株式組入制限	無制限

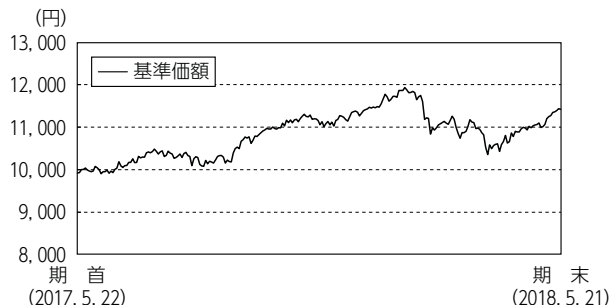
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額と市況の推移



《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：9,919円 期末：11,425円 騰落率：15.2%

【基準価額の主な変動要因】

世界の株式市況が堅調に推移したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○世界株式市況

世界株式市況は上昇しました。

世界株式市況は、良好な経済指標や主要企業を中心に堅調な決算が発表されたこと、米国の税制改革法案成立への期待などが支援材料となり、期首から2018年1月下旬にかけて上昇しました。その後、米国の雇用統計が市場予想を上回り米国金利が上昇したこと、市場のリスク回避姿勢が強まり、2月中旬にかけて調整しました。期末にかけては、米国の利上げペースや米中の貿易摩擦をめぐる動向などに左右されながら、一進一退の推移となりました。

○為替相場

米ドルの対円相場は、おおむね横ばいの水準となりました。

期首から2017年12月にかけては、トランプ政権の政策実行能力への懸念が高まったことなどから下落する局面が見られましたが、北朝鮮情勢への警戒感が和らいだことや米国の税制改革法案成立への期待などから上昇しました。2018年3月下旬にかけては、米国長期金利の上昇を受けて株価が下落したことや米中をめぐる貿易摩擦への懸念などから市場のリスク回避姿勢が強まり、下落しました。期末にかけては、米中の貿易摩擦への懸念が和らいだことなどから反発しました。

◆前期における「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、今後の運用を行なってまいります。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なってまいります。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

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BOEING（米国、資本財・サービス）やMASTERCARD（米国、情報技術）、寄与度が低かった銘柄はIMPERIAL BRANDS（英国、生活必需品）やSANOFI（フランス、ヘルスケア）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。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」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	騰落率	(参考指数)	騰落率		
(期 首)2017年5月22日	9,919	—	10,070	—	97.3	—
5月末	9,950	0.3	10,115	0.4	96.8	—
6月末	10,164	2.5	10,281	2.1	95.4	—
7月末	10,266	3.5	10,391	3.2	95.7	—
8月末	10,309	3.9	10,391	3.2	96.1	—
9月末	10,781	8.7	10,828	7.5	96.2	—
10月末	11,130	12.2	11,134	10.6	94.8	—
11月末	11,186	12.8	11,227	11.5	95.4	—
12月末	11,476	15.7	11,551	14.7	95.8	—
2018年1月末	11,652	17.5	11,736	16.5	95.3	—
2月末	11,188	12.8	11,227	11.5	93.7	—
3月末	10,597	6.8	10,751	6.8	94.9	—
4月末	11,055	11.5	11,188	11.1	93.6	—
(期 末)2018年5月21日	11,425	15.2	11,528	14.5	93.1	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCI AC World指数（配当込み、円換算）は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI AC World指数（配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《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、今後の運用を行なってまいります。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なってまいります。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やROE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)	6円 (6)
有価証券取引税 (株式)	4 (4)
その他費用 (保管費用) (その他)	8 (8) (0)
合 計	18

(注1) 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、簡便法により算出した結果です。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) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

株 式

(2017年5月23日から2018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 2,878 (88)	千アメリカ・ドル 18,810 (—)	百株 7,073	千アメリカ・ドル 59,608
	カナダ	百株 150 (—)	千カナダ・ドル 945 (—)	百株 11	千カナダ・ドル 67
	オーストラリア	百株 — (—)	千オーストラリア・ドル — (—)	百株 179.71	千オーストラリア・ドル 1,567
	香港	百株 — (—)	千香港ドル — (—)	百株 74,673	千香港ドル 57,627
	イギリス	百株 2,503 (—)	千イギリス・ポンド 1,250 (—)	百株 4,166	千イギリス・ポンド 3,873
	スイス	百株 278 (—)	千スイス・フラン 1,154 (—)	百株 159	千スイス・フラン 1,645
	デンマーク	百株 125 (—)	千デンマーク・クローネ 2,900 (—)	百株 44	千デンマーク・クローネ 1,076
	ノルウェー	百株 415 (—)	千ノルウェー・クローネ 4,873 (—)	百株 68	千ノルウェー・クローネ 1,236
	ユーロ (オランダ)	百株 329 (—)	千ユーロ 1,381 (—)	百株 1,464	千ユーロ 2,885
	ユーロ (フランス)	百株 713 (—)	千ユーロ 2,176 (—)	百株 1,297	千ユーロ 6,120
	ユーロ (ドイツ)	百株 206 (—)	千ユーロ 1,159 (—)	百株 628	千ユーロ 6,337
	ユーロ (スペイン)	百株 559 (—)	千ユーロ 413 (—)	百株 470	千ユーロ 747
	ユーロ (イタリア)	百株 1,381 (—)	千ユーロ 388 (—)	百株 440	千ユーロ 134
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 3,188 (—)	千ユーロ 5,520 (—)	百株 4,299	千ユーロ 16,225

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

■主要な売買銘柄 株 式

(2017年5月23日から2018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
AFLAC INC (アメリカ)	24.5	227,772	9,296	MASTERCARD INC - A (アメリカ)	24	401,098	16,712
BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	51.6	175,694	3,404	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	33.7	376,149	11,161
UNILEVER NV-CVA (オランダ)	22.4	148,816	6,643	APPLE INC (アメリカ)	18.4	336,880	18,308
CITIGROUP INC (アメリカ)	15.7	121,302	7,726	BOEING CO/THE (アメリカ)	10.4	289,481	27,834
WESTERN DIGITAL CORP (アメリカ)	10.8	107,435	9,947	HOME DEPOT INC (アメリカ)	15.1	282,615	18,716
HOME DEPOT INC (アメリカ)	5.7	102,641	18,007	MICROSOFT CORP (アメリカ)	29.9	259,924	8,693
TYSON FOODS INC-CL A (アメリカ)	11.8	93,335	7,909	PRUDENTIAL FINANCIAL INC (アメリカ)	20.1	234,029	11,643
BROADCOM INC (アメリカ)	3.2	90,233	28,198	APPLIED MATERIALS INC (アメリカ)	36	212,354	5,898
RIO TINTO PLC (イギリス)	14.4	82,125	5,703	ING GROEP NV (オランダ)	103.2	205,656	1,992
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A (アメリカ)	9	79,438	8,826	BNP PARIBAS (フランス)	22.8	195,354	8,568

(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)					
LAS VEGAS SANDS CORP	—	26	202	22,503	一般消費・サービス
AFLAC INC	—	164	744	82,694	金融
CITIGROUP INC	222	219	1,532	170,203	金融
APPLE INC	230	67	1,248	138,671	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	159	72	556	61,772	金融
BOEING CO/THE	135	36	1,264	140,465	資本財・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	337	—	—	—	金融
DELTA AIR LINES INC	251	101	534	59,410	資本財・サービス
CISCO SYSTEMS INC	468	139	600	66,722	情報技術
MORGAN STANLEY	196	133	717	79,666	金融
DOW CHEMICAL CO/THE	257	—	—	—	その他
BROADCOM INC	48	26	613	68,161	情報技術
TIME WARNER INC	108	45	425	47,216	一般消費・サービス
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	—	18	196	21,861	一般消費・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	75	37	430	47,770	素材
EXXON MOBIL CORP	174	14	113	12,644	エネルギー
GENERAL MOTORS CO	177	75	283	31,485	一般消費・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14	3	71	7,898	金融
HOME DEPOT INC	120	26	487	54,133	一般消費・サービス
HP INC	—	215	476	52,879	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	121	56	695	77,290	ヘルスケア
ABBVIE INC	121	32	339	37,674	ヘルスケア
MCDONALD'S CORP	88	12	193	21,459	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	
MANPOWERGROUP INC	59	17	161	17,933	資本財・サービス
DOWDUPONT INC	—	64	432	48,040	素材
NETAPP INC	—	71	490	54,501	情報技術
ALTRIA GROUP INC	165	81	449	49,976	生活必需品
PFIZER INC	482	201	716	79,580	ヘルスケア
PROCTER & GAMBLE CO/THE	103	43	315	35,086	生活必需品
PEPSICO INC	103	—	—	—	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	194	—	—	—	金融
QUALCOMM INC	62	—	—	—	情報技術
CHEVRON CORP	135	67	856	95,166	エネルギー
AT&T INC	278	130	416	46,285	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	97	25	611	67,942	ヘルスケア
VALERO ENERGY CORP	171	62	747	83,036	エネルギー
ANTHEM INC	93	23	533	59,244	ヘルスケア
WHIRLPOOL CORP	44	—	—	—	一般消費・サービス
WALMART INC	122	29	242	26,945	生活必需品
VISA INC-CLASS A SHARES	—	53	688	76,499	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	—	118	801	89,020	生活必需品
OMNICOM GROUP	132	—	—	—	一般消費・サービス
ORACLE CORP	350	251	1,162	129,156	情報技術
MASTERCARD INC - A	274	36	685	76,145	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	—	500	1,513	168,079	金融
AMERICAN EXPRESS CO	122	25	252	28,047	金融
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	—	83	631	70,112	情報技術

ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株マザーファンド

銘柄	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	
AMGEN INC	49	20	352	39,170	ヘルスケア
EATON CORP PLC	314	137	1,076	119,608	資本財・サービス
APPLIED MATERIALS INC	379	130	643	71,500	情報技術
GAP INC/THE	—	154	486	54,009	一般消費・サービス
GILEAD SCIENCES INC	119	49	333	37,026	ヘルスケア
BANK OF NOVA SCOTIA	220	—	—	—	金融
MICROSOFT CORP	426	160	1,541	171,274	情報技術
CVS HEALTH CORP	43	37	240	26,684	ヘルスケア
CENTERPOINT ENERGY INC	495	133	336	37,424	公益事業
KOHL'S CORP	—	76	483	53,755	一般消費・サービス
LEAR CORP	—	18	363	40,344	一般消費・サービス
BEST BUY CO INC	—	63	492	54,764	一般消費・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	275	128	418	46,526	一般消費・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,607 46銘柄	4,500 52銘柄	30,205 <55.4%>	3,355,479
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円
NATIONAL BANK OF CANADA	—	139	879	75,781	金融
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	139 1銘柄	879 <1.3%>	75,781
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	169.65	84.34	594	49,631	金融
MACQUARIE GROUP LTD	187.72	93.32	1,068	89,227	金融
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	357.37 2銘柄	177.66 2銘柄	1,663 <2.3%>	138,858
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	4,540	—	—	—	その他
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	470.68	205.68	1,825	25,829	資本財・サービス
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	4,560	1,920	1,380	19,533	生活必需品
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,680	1,180	1,333	18,867	資本財・サービス
CNOOC LTD	7,150	3,020	4,366	61,791	エネルギー
HUANENG POWER INTL INC-H	8,360	3,540	1,947	27,550	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,720	6,620	5,408	76,530	金融
CHINA MOBILE LTD	515	215	1,578	22,330	電気通信サービス
CK ASSET HOLDINGS LTD	495.68	210.68	1,405	19,884	不動産
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	3,255	1,375	3,025	42,803	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-H	19,050	8,000	5,400	76,410	金融
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	5,240	2,220	3,108	43,978	一般消費・サービス
PICCC PROPERTY & CASUALTY-H	5,440	2,320	3,280	46,418	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,794	751	1,749	24,760	ヘルスケア
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	23,420	9,880	3,527	49,909	素材
BANK OF CHINA LTD-H	23,170	9,730	4,096	57,963	金融
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	125,860.36 16銘柄	51,187.36 15銘柄	43,431 <10.1%>	614,561

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	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)					
GLAXOSMITHKLINE PLC	383	157	233	34,927	ヘルスケア
RIO TINTO PLC	155	102	442	66,176	素材
TAYLOR WIMPEY PLC	—	728	148	22,146	一般消費・サービス
VODAFONE GROUP PLC	—	470	90	13,572	電気通信サービス
WPP PLC	244	—	—	—	一般消費・サービス
SSE PLC	155	—	—	—	公益事業
3I GROUP PLC	450	188	185	27,794	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	200	84	232	34,808	生活必需品
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	—	53	201	30,107	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	1,247	489	358	53,575	金融
MONDI PLC	92	—	—	—	素材
BT GROUP PLC	804	—	—	—	電気通信サービス
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	332	128	347	51,969	エネルギー
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,062 10銘柄	2,399 9銘柄	2,241 <5.5%>	335,079
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	48	23	516	57,389	ヘルスケア
ABB LTD-REG	—	190	462	51,388	資本財・サービス
NESTLE SA-REG	115	22	169	18,848	生活必需品
NOVARTIS AG-REG	—	47	361	40,214	ヘルスケア
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	163 2銘柄	282 4銘柄	1,510 <2.8%>	167,840
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円
DANSKE BANK A/S	—	81	1,752	30,695	金融
デンマーク・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	81 1銘柄	1,752 <0.5%>	30,695
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円
ORKLA ASA	—	281	2,086	28,559	生活必需品
TELENOR ASA	—	66	1,125	15,405	電気通信サービス
ノルウェー・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	— 2銘柄	347 2銘柄	3,211 <0.7%>	43,964
(ユーロ(オランダ))		百株	百株	千ユーロ	千円
UNILEVER NV-CVA	—	92	440	57,420	生活必需品
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	228	—	—	—	生活必需品
ING GROEP NV	1,032	—	—	—	金融
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	97	232	30,314	金融
RANDSTAD NV	93	29	157	20,548	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,353 3銘柄	218 3銘柄	829 <1.8%>	108,283

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	千ユーロ	千円	
ユーロ(フランス)					
TOTAL SA	181	87	473	61,849	エネルギー
BNP PARIBAS	257	41	252	32,945	金融
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUIT	40	13	401	52,417	一般消費・サービス
CAPGEMINI SE	—	24	276	36,109	情報技術
AXA SA	—	137	315	41,108	金融
RENAULT SA	79	22	200	26,106	一般消費・サービス
ATOS SE	—	26	298	38,999	情報技術
ORANGE	548	79	113	14,834	電気通信サービス
SANOFI	110	35	232	30,344	ヘルスケア
VINCI SA	186	64	556	72,606	資本財・サービス
CREDIT AGRICOLE SA	—	193	259	33,835	金融
ENGIE	—	96	140	18,308	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,401 7銘柄	817 12銘柄	3,521 459,465	<7.6%>
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(ドイツ)					
BAYER AG-REG	59	—	—	—	ヘルスケア
SIEMENS AG-REG	112	—	—	—	資本財・サービス
BASF SE	184	38	338	44,116	素材
ALLIANZ SE-REG	47	16	306	39,982	金融
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	—	77	189	24,767	資本財・サービス
SAP SE	140	15	143	18,761	情報技術
COVESTRO AG	—	49	389	50,794	素材
HENKEL AG & CO KGAA	71	29	287	37,501	生活必需品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	—	30	202	26,385	一般消費・サービス
HANNOVER RUECK SE	63	—	—	—	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	676 7銘柄	254 7銘柄	1,856 242,308	<4.0%>
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(スペイン)					
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	—	431	283	37,006	金融
GAS NATURAL SDG SA	342	—	—	—	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	342 1銘柄	431 1銘柄	283 37,006	<0.6%>

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	千ユーロ	千円	
ユーロ(イタリア)					
INTESA SANPAOLO	—	941	282	36,837	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	941 282	36,837 <0.6%>	
ユーロ	株数、金額	3,772	2,661	6,773	883,901
通貨計	銘柄数<比率>	18銘柄	24銘柄		<14.6%>
ファンド	株数、金額	142,821.73	61,774.02	—	5,646,162
合計	銘柄数<比率>	94銘柄	110銘柄		<93.1%>

(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

2018年5月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 5,646,162	% 91.9
コール・ローン等、その他	495,493	8.1
投資信託財産総額	6,141,656	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=111.09円、1カナダ・ドル=86.21円、1オーストラリア・ドル=83.47円、1香港ドル=14.15円、1イギリス・ポンド=149.49円、1スイス・フラン=111.12円、1デンマーク・クローネ=17.52円、1ノルウェー・クローネ=13.69円、1ユーロ=130.49円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(6,070,199千円)の投資信託財産総額(6,141,656千円)に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年5月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,275,523,888円
コール・ローン等	445,419,579
株式（評価額）	5,646,162,887
未収入金	170,547,462
未取配当金	13,393,960
(B) 負債	213,661,159
未払金	142,659,007
未払解約金	71,000,000
その他未払費用	2,152
(C) 純資産総額（A－B）	6,061,862,729
元本	5,305,820,110
次期繰越損益金	756,042,619
(D) 受益権総口数	5,305,820,110口
1万口当り基準価額（C／D）	11,425円

* 期首における元本額は12,134,356,836円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は6,828,536,726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5,305,820,110円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,425円です。

■損益の状況

当期 自2017年5月23日 至2018年5月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	249,977,805円
受取配当金	247,892,923
受取利息	2,156,407
支払利息	△ 71,525
(B) 有価証券売買損益	1,154,446,948
売買益	1,647,615,564
売買損	△ 493,168,616
(C) その他費用	△ 6,529,097
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	1,397,895,656
(E) 前期繰越損益金	△ 98,389,763
(F) 解約差損益金	△ 543,463,274
(G) 合計（D＋E＋F）	756,042,619
次期繰越損益金（G）	756,042,619

(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。