

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	追加型投信／海外／資産複合	
信託期間	約9年9カ月間（2007年8月6日～2017年5月15日）	
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。	
主要投資対象	ベビーファンド	1. ダイワ海外好配当株マザーファンドの受益証券 2. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
	ダイワ海外好配当株マザーファンド	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
ベビーファンドの運用方法	①マザーファンドの受益証券を通じて、主として海外の株式および海外の不動産投資信託証券に投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②信託財産の純資産総額に対するダイワ海外好配当株マザーファンドの受益証券の組入比率は、50％程度とすることを基本とし、ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券の組入比率は、50％程度とすることを基本とします。 ③保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。	
組入制限	ダイワ海外好配当株マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
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、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。 3、6、9、12月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1および第2計算期末には、収益の分配は行ないません。	

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した。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・海外株式&REITファンド
（毎月分配型）
（愛称：グローバルストリート）

運用報告書（全体版）

第112期（決算日	2016年12月15日）
第113期（決算日	2017年1月16日）
第114期（決算日	2017年2月15日）
第115期（決算日	2017年3月15日）
第116期（決算日	2017年4月17日）
満期償還（償還日	2017年5月15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・海外株式&REITファンド（毎月分配型）（愛称：グローバルストリート）」は、このたび、満期償還となりました。

ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

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/>

最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			MSCIコクサイ指数 (円 換 算)		S&P先進国REIT指数 (除く日本、円換算)		株式組入 率	投資信託 証組入比率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 分 配	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%		%	%	%	百万円
88期末(2014年12月15日)	9,196	20	1.7	11,284	△ 0.7	13,936	3.6	47.2	48.7	156
89期末(2015年 1 月15日)	9,310	20	1.5	11,147	△ 1.2	14,750	5.8	44.3	49.7	158
90期末(2015年 2 月16日)	9,561	20	2.9	11,817	6.0	14,922	1.2	45.5	47.8	159
91期末(2015年 3 月16日)	9,430	20	△ 1.2	11,796	△ 0.2	14,703	△ 1.5	46.2	48.9	151
92期末(2015年 4 月15日)	9,511	20	1.1	12,029	2.0	14,760	0.4	47.8	48.5	153
93期末(2015年 5 月15日)	9,487	20	△ 0.0	12,179	1.3	14,529	△ 1.6	46.7	48.6	145
94期末(2015年 6 月15日)	9,497	20	0.3	12,343	1.3	14,462	△ 0.5	47.4	48.7	145
95期末(2015年 7 月15日)	9,409	20	△ 0.7	12,339	△ 0.0	14,644	1.3	45.8	49.6	142
96期末(2015年 8 月17日)	9,392	20	0.0	12,240	△ 0.8	15,014	2.5	45.6	49.5	139
97期末(2015年 9 月15日)	8,512	20	△ 9.2	11,054	△ 9.7	13,519	△10.0	46.8	49.6	126
98期末(2015年10月15日)	8,735	20	2.9	11,131	0.7	14,164	4.8	45.3	50.0	130
99期末(2015年11月16日)	8,723	20	0.1	11,420	2.6	14,199	0.2	44.9	49.9	129
100期末(2015年12月15日)	8,599	20	△ 1.2	11,152	△ 2.3	14,226	0.2	46.2	49.4	124
101期末(2016年 1 月15日)	8,041	20	△ 6.3	10,332	△ 7.4	13,608	△ 4.3	46.8	49.5	115
102期末(2016年 2 月15日)	7,437	20	△ 7.3	9,576	△ 7.3	12,592	△ 7.5	47.6	48.4	103
103期末(2016年 3 月15日)	8,092	20	9.1	10,494	9.6	14,089	11.9	47.9	48.8	112
104期末(2016年 4 月15日)	8,017	20	△ 0.7	10,383	△ 1.1	14,024	△ 0.5	48.2	48.2	106
105期末(2016年 5 月16日)	7,910	20	△ 1.1	10,093	△ 2.8	14,082	0.4	46.4	48.3	105
106期末(2016年 6 月15日)	7,652	20	△ 3.0	9,814	△ 2.8	13,698	△ 2.7	47.2	48.0	95
107期末(2016年 7 月15日)	7,936	20	4.0	10,211	4.1	14,545	6.2	47.4	47.8	97
108期末(2016年 8 月15日)	7,689	20	△ 2.9	9,963	△ 2.4	14,062	△ 3.3	47.4	47.9	93
109期末(2016年 9 月15日)	7,455	20	△ 2.8	9,808	△ 1.6	13,431	△ 4.5	47.4	47.2	89
110期末(2016年10月17日)	7,445	20	0.1	9,982	1.8	13,380	△ 0.4	47.7	47.9	88
111期末(2016年11月15日)	7,390	20	△ 0.5	10,320	3.4	13,259	△ 0.9	47.2	46.9	88
112期末(2016年12月15日)	8,234	20	11.7	11,739	13.8	14,852	12.0	47.2	47.8	96
113期末(2017年 1 月16日)	8,095	20	△ 1.4	11,574	△ 1.4	14,745	△ 0.7	47.2	47.9	95
114期末(2017年 2 月15日)	8,209	20	1.7	11,845	2.3	14,958	1.4	47.0	47.7	96
115期末(2017年 3 月15日)	8,149	20	△ 0.5	11,995	1.3	14,509	△ 3.0	48.1	46.9	95
116期末(2017年 4 月17日)	7,965	20	△ 2.0	11,268	△ 6.1	14,524	0.1	—	—	89
償 還(2017年 5 月15日)	7,954.60	—	△ 0.1	12,186	8.1	14,829	2.1	—	—	86

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIコクサイ指数（円換算）は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数（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として大和投信信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数（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) S&P先進国REIT指数（除く日本、円換算）は、S&P先進国REIT指数（除く日本、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として大和投信信託が計算したものです。S&P先進国REIT指数（除く日本、米ドルベース）の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

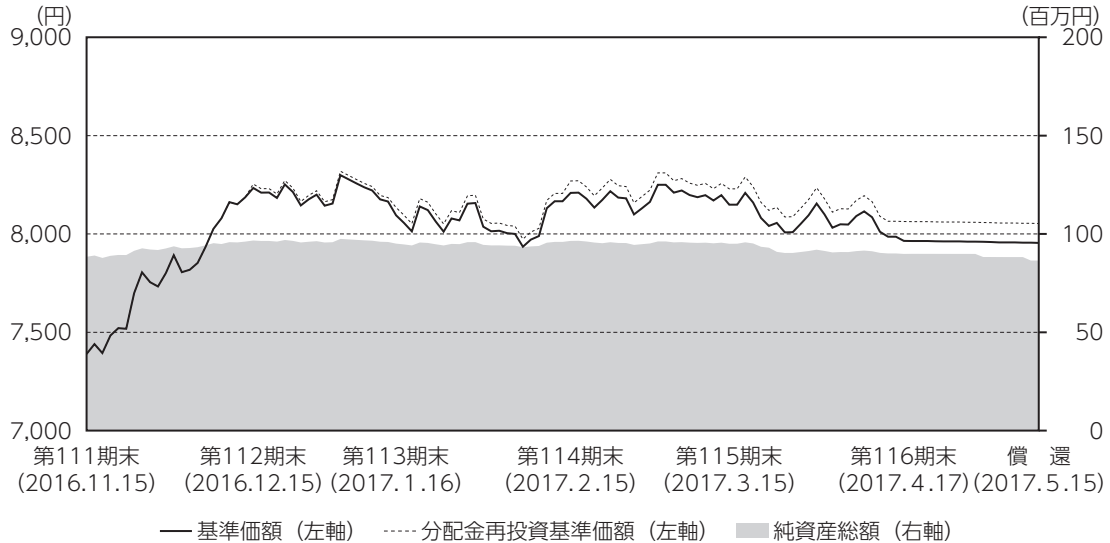
(注4) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注5) 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。



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あり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：7,954円60銭（既払分配金2,280円）

騰落率：13.7%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

海外株式および海外リートに投資した結果、海外株式が上昇したことなどが要因となり基準価額は上昇しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円 換 算)		S&P先進国REIT指数 (除く日本、円換算)		株式組入比率	投資信託証券 組 入 比 率
			騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	騰落率		
第112期	(期首) 2016年11月15日	円 7,390	% －	10,320	% －	13,259	% －	% 47.2	% 46.9
	11月末	7,801	5.6	10,905	5.7	14,000	5.6	47.3	47.5
	(期末) 2016年12月15日	8,254	11.7	11,739	13.8	14,852	12.0	47.2	47.8
第113期	(期首) 2016年12月15日	8,234	－	11,739	－	14,852	－	47.2	47.8
	12月末	8,155	△ 1.0	11,570	△ 1.4	14,825	△ 0.2	46.8	48.2
	(期末) 2017年 1 月16日	8,115	△ 1.4	11,574	△ 1.4	14,745	△ 0.7	47.2	47.9
第114期	(期首) 2017年 1 月16日	8,095	－	11,574	－	14,745	－	47.2	47.9
	1 月末	8,037	△ 0.7	11,537	△ 0.3	14,522	△ 1.5	46.9	47.6
	(期末) 2017年 2 月15日	8,229	1.7	11,845	2.3	14,958	1.4	47.0	47.7
第115期	(期首) 2017年 2 月15日	8,209	－	11,845	－	14,958	－	47.0	47.7
	2 月末	8,131	△ 1.0	11,751	△ 0.8	15,070	0.8	47.3	48.5
	(期末) 2017年 3 月15日	8,169	△ 0.5	11,995	1.3	14,509	△ 3.0	48.1	46.9
第116期	(期首) 2017年 3 月15日	8,149	－	11,995	－	14,509	－	48.1	46.9
	3 月末	8,155	0.1	11,839	△ 1.3	14,634	0.9	47.1	47.8
	(期末) 2017年 4 月17日	7,985	△ 2.0	11,268	△ 6.1	14,524	0.1	－	－
償還期	(期首) 2017年 4 月17日	7,965	－	11,268	－	14,524	－	－	－
	4 月末	7,961	△ 0.1	11,883	5.5	14,855	2.3	－	－
	(償還) 2017年 5 月15日	7,954.60	△ 0.1	12,186	8.1	14,829	2.1	－	－

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2007.8.6～2017.5.15)

■海外株式市況

海外株式市況は、設定当初より、米国のサブプライムローン（信用力の低い個人向け住宅ローン）問題をきっかけとした金融不安の影響を受けて、大きく下落しました。その後も、同問題はグローバルな金融危機へと発展し、株価は大きく下落しました。2009年3月以降は、米国の金融不安の後退や日米欧の主要中央銀行による金融緩和策、良好な米国の景気情勢などを追い風に上昇基調となりました。2015年6月から2016年年初にかけては、ギリシャの債務問題の深刻化や中国・人民元の切下げ、F R B（米国連邦準備制度理事会）による政策金利の引き上げなどが懸念材料となり、株価は下落に転じました。その後は、F R Bの追加利上げに対する慎重な姿勢や好調な企業業績、トランプ米国新大統領による景気刺激策への期待などを背景に、株価は上昇しました。

■海外リート市況

海外リート市況は、設定当初より、サブプライムローン問題の深刻化の影響を受けて大きく下落しました。しかし2009年3月以降は、米国の量的金融緩和策や不良資産買い取りプログラムなどを受けて市場は落ち着きを取り戻し、反発に転じました。その後も、欧州債務問題や米国の債務上限問題、米国の長期金利上昇などをを受けて調整する場面もありましたが、米国をはじめとして世界的に景気が持ち直し不動産市場も回復に転じたことや、米国のトランプ新政権の経済政策が不動産市場には追い風になるとの期待、好調な企業業績などから、海外リート市況は上昇相場が続きました。

■為替相場

為替相場は、設定当初より、サブプライムローン問題の影響を受けて米ドルが対円で下落しましたが、2012年からは、日銀の量的金融緩和拡大等により上昇に転じました。2015年以降、米国の金融緩和策からの脱却等により米ドルは下落に転じる場面もありましたが、その後は、トランプ米国新大統領誕生による金利上昇等により、再び上昇しました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

マザーファンドの受益証券を通じて、主として海外の株式および海外のリートに投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。また、信託財産の純資産総額に対するダイワ海外好配当株マザーファンドの受益証券の組入比率は、50%程度とすることを基本とし、ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券の組入比率は、50%程度とすることを基本とします。

■ダイワ海外好配当株マザーファンド

主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と株式の値上がり益の獲得により信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。投資にあたっては、アメリカ、ヨーロッパ、アジア・オセアニアの3地域に均等に投資することを基本とします。

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートを主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、組み入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

また、外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク（以下、C&S）に運用の指図にかかる権限を委託します。

信託期間中のポートフォリオについて

(2007.8.6～2017.5.15)

■当ファンド

ダイワ海外好配当株マザーファンドの受益証券を50%程度、ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券を50%程度組み入れることをめどに運用しました。

■ダイワ海外好配当株マザーファンド

ポートフォリオにおける地域別組入比率は、北米、欧州、アジア・オセアニアをおおむね3分の1ずつ組み入れました。

個別銘柄の選択に関しては、高い配当利回りが期待される銘柄の中から、特に利益やキャッシュフロー等の業績成長および負債比率等の財務体質の健全性を考慮し、ポートフォリオに組み入れました。具体的には、株価下落局面となった設定当初から2009年2月までの局面では、業績安定性が高い米国のAT&T INC（電気通信サービス）や英国のBRITISH AMERICAN TOBACCO PLC（生活必需品）などを高位組み入れとしました。また2009年3月以降の株価上昇局面では、業績モメンタムやバリュエーションなどを勘案しながらオーストラリアのBHP BILLITON LIMITED（素材）やWESTPAC BANKING CORP（金融）、台湾のTAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC（情報技術）などを高位組み入れとしました。

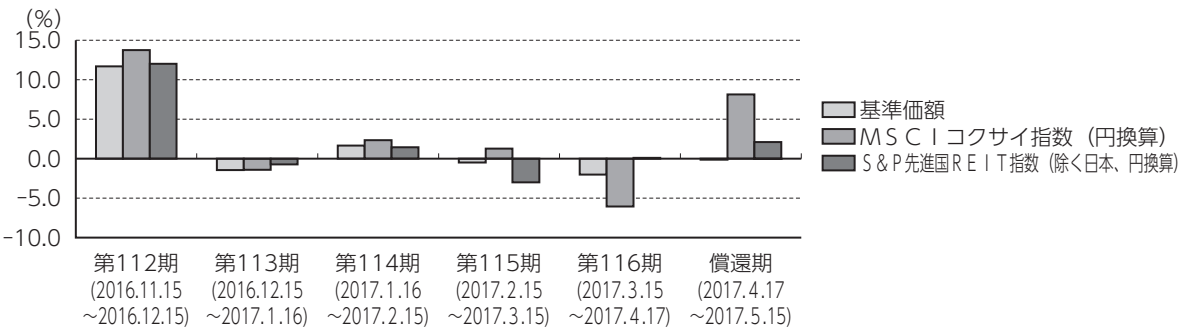
■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の価値などと比べて魅力的であると考えた銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。

国・地域別配分では大きなリスクを取らず各地域にバランス良く投資を行ないました。用途別では、米国では入居者の賃金上昇が支援材料となる住宅セクターなどに注目しました。米国以外では、フランスの商業施設リートや、良好なオフィス需給から恩恵を受け配当利回りが相対的に魅力的なオーストラリアのオフィスリートや商業施設リートなどに注目しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当作成期間における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

1 万口当り、第 3 期～第116期は各20円の収益分配を行ないました。なお、第 1 期および第 2 期は分配方針通り、収益分配を行ないませんでした。

また、第112期～第116期の分配原資の内訳および決定根拠「収益分配金の計算過程（1 万口当り）」は下記の通りです。

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した。

■分配原資の内訳（1 万口当り）

項 目	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
	2016年11月16日 ～2016年12月15日	2016年12月16日 ～2017年1月16日	2017年1月17日 ～2017年2月15日	2017年2月16日 ～2017年3月15日	2017年3月16日 ～2017年4月17日
当期分配金（税込み）（円）	20	20	20	20	20
対基準価額比率（％）	0.24	0.25	0.24	0.24	0.25
当期の収益（円）	12	13	16	20	6
当期の収益以外（円）	7	6	3	—	13
翌期繰越分配対象額（円）	447	440	436	440	426

(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	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
(a) 経費控除後の配当等収益	12.07円	13.00円	16.36円	23.93円	6.36円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	201.07	201.19	201.30	201.41	201.52
(d) 分配準備積立金	254.06	246.02	238.92	235.19	239.01
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	467.20	460.22	456.59	460.53	446.90
(f) 分配金	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	447.21	440.22	436.59	440.53	426.90

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

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

1 万口当りの費用の明細

項 目	第112期～償還期 (2016.11.16～2017.5.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	62円	0.765%	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8,051円です。
(投 信 会 社)	(33)	(0.407)	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)	(26)	(0.321)	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)	(0.037)	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	7	0.086	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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)	(5)	(0.065)	
(投資信託証券)	(2)	(0.022)	
有価証券取引税	3	0.035	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)	(2)	(0.031)	
(投資信託証券)	(0)	(0.004)	
そ の 他 費 用	25	0.312	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)	(27)	(0.330)	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
(そ の 他)	(△2)	(△0.019)	スピンオフに係る税金の戻り、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	96	1.198	

(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

(2016年11月16日から2017年5月15日まで)

決 算 期	第 112 期 ～ 償 還 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	—	—	23,497	47,377
ダイワ海外好配当株 マザーファンド	—	—	37,905	48,735

(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

(2016年11月16日から2017年5月15日まで)

項 目	第 112 期 ～ 償 還 期
	ダイワ海外好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	388,537千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	364,089千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	1.06

(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

当作成期間（第112期～償還期）中における利害関係人との取引はありません。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年12月15日)、(2017年1月16日)、(2017年2月15日)、(2017年3月15日)、(2017年4月17日)、(2017年5月15日)現在

項 目	第 112 期 末	第 113 期 末	第 114 期 末	第 115 期 末	第 116 期 末	償 還 時
(A) 資産	97,023,373円	95,457,290円	96,827,212円	95,356,558円	90,206,085円	88,329,425円
コール・ローン等	1,230,461	1,320,643	1,197,791	1,286,748	1,293,292	88,329,425
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド(評価額)	47,929,256	46,912,045	47,711,311	46,148,059	—	—
ダイワ海外好配当株マザーファンド(評価額)	47,863,656	47,224,602	47,918,110	47,921,751	—	—
未収入金	—	—	—	—	88,912,793	—
(B) 負債	351,829	365,390	355,449	346,511	354,112	1,849,020
未払収益分配金	234,824	234,926	235,032	233,173	225,622	—
未払解約金	—	—	—	—	—	1,739,935
未払信託報酬	117,005	130,464	120,417	113,338	128,490	108,944
未払利息	—	—	—	—	—	102
その他未払費用	—	—	—	—	—	39
(C) 純資産総額(A－B)	96,671,544	95,091,900	96,471,763	95,010,047	89,851,973	86,480,405
元本	117,412,412	117,463,461	117,516,042	116,586,669	112,811,036	108,717,421
次期繰越損益金	△ 20,740,868	△ 22,371,561	△ 21,044,279	△ 21,576,622	△ 22,959,063	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 22,237,016
(D) 受益権総口数	117,412,412口	117,463,461口	117,516,042口	116,586,669口	112,811,036口	108,717,421口
1万口当り基準価額(C/D)	8,234円	8,095円	8,209円	8,149円	7,965円	—
1万口当り償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	7,954円60銭

* 第111期末における元本額は119,611,345円、当作成期間（第112期～償還期）中における追加設定元本額は331,519円、同解約元本額は11,225,443円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は7,954円60銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は22,237,016円です。

■組入資産明細表

最終期末における該当事項はありません。

親投資信託残高

種 類	第 111 期 末
	口 数
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	千口 23,497
ダイワ海外好配当株マザーファンド	37,905

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年5月15日現在

項 目	償 還 時
	評 価 額 比 率
コール・ローン等、その他	千円 88,329 % 100.0
投資信託財産総額	88,329 100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■損益の状況

第112期
第113期
第114期

自2016年11月16日
自2016年12月16日
自2017年1月17日

至2016年12月15日
至2017年1月16日
至2017年2月15日

第115期
第116期
償還期

自2017年2月16日
自2017年3月16日
自2017年4月18日

至2017年3月15日
至2017年4月17日
至2017年5月15日

項 目	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期	償 還 期
(A) 配当等収益	△ 30円	△ 22円	△ 26円	△ 27円	△ 37円	△ 4,509円
受取利息	—	—	—	—	—	111
支払利息	△ 30	△ 22	△ 26	△ 27	△ 37	△ 4,620
(B) 有価証券売買損益	10,254,580	△ 1,256,265	1,692,774	△ 352,226	△ 1,727,068	2,586
売買益	10,344,804	2,629	1,692,774	816,677	464,556	—
売買損	△ 90,224	△ 1,258,894	—	△ 1,168,903	△ 2,191,624	2,586
(C) 信託報酬等	△ 117,005	△ 130,464	△ 120,417	△ 113,338	△ 128,490	△ 109,138
(D) 当期繰越益金(A+B+C)	10,137,545	△ 1,386,751	1,572,331	△ 465,591	△ 1,855,595	△ 111,061
(E) 前期繰越損益金	△23,676,421	△13,773,700	△15,395,377	△13,940,803	△14,159,147	△15,643,439
(F) 追加信託差損益金	△ 6,967,168	△ 6,976,184	△ 6,986,201	△ 6,937,055	△ 6,718,699	△ 6,482,516
(配当等相当額)	(2,360,893)	(2,363,276)	(2,365,629)	(2,348,178)	(2,273,416)	(2,192,114)
(売買損益相当額)	(△ 9,328,061)	(△ 9,339,460)	(△ 9,351,830)	(△ 9,285,233)	(△ 8,992,115)	(△ 8,674,630)
(G) 合計(D+E+F)	△20,506,044	△22,136,635	△20,809,247	△21,343,449	△22,733,441	△22,237,016
(H) 収益分配金	△ 234,824	△ 234,926	△ 235,032	△ 233,173	△ 225,622	—
次期繰越損益金(G+H)	△20,740,868	△22,371,561	△21,044,279	△21,576,622	△22,959,063	—
追加信託差損益金	△ 6,967,168	△ 6,976,184	△ 6,986,201	△ 6,937,055	△ 6,718,699	—
(配当等相当額)	(2,360,893)	(2,363,276)	(2,365,629)	(2,348,178)	(2,273,416)	(—)
(売買損益相当額)	(△ 9,328,061)	(△ 9,339,460)	(△ 9,351,830)	(△ 9,285,233)	(△ 8,992,115)	(—)
分配準備積立金	2,889,908	2,807,787	2,765,086	2,787,897	2,542,577	—
繰越損益金	△16,663,608	△18,203,164	△16,823,164	△17,427,464	△18,782,941	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△22,237,016

(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) 第112期～第116期の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：90,488円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期
(a) 経費控除後の配当等収益	141,727円	152,805円	192,331円	279,051円	71,791円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	2,360,893	2,363,276	2,365,629	2,348,178	2,273,416
(d) 分配準備積立金	2,983,005	2,889,908	2,807,787	2,742,019	2,696,408
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	5,485,625	5,405,989	5,365,747	5,369,248	5,041,615
(f) 分配金	234,824	234,926	235,032	233,173	225,622
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	5,250,801	5,171,063	5,130,715	5,136,075	4,815,993
(h) 受益権総口数	117,412,412口	117,463,461口	117,516,042口	116,586,669口	112,811,036口

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2007年8月6日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2017年5月15日		資産総額	88,329,425円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減 又は追加信託	負債総額	1,849,020円
				純資産総額	86,480,405円
受益権口数	1,000,000口	108,717,421口	107,717,421口	受益権口数	108,717,421口
元本額	1,000,000円	108,717,421円	107,717,421円	1単位当り償還金	7,954円60銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第1期	706,514,642	692,991,605	9,809	0	0.00
第2期	765,468,822	832,305,881	10,873	0	0.00
第3期	794,485,971	770,465,195	9,698	20	0.20
第4期	805,540,899	763,970,409	9,484	20	0.20
第5期	807,797,127	703,560,495	8,710	20	0.20
第6期	799,752,515	681,642,510	8,523	20	0.20
第7期	792,542,034	596,879,781	7,531	20	0.20
第8期	789,223,985	634,551,929	8,040	20	0.20
第9期	784,384,329	683,980,958	8,720	20	0.20
第10期	783,089,620	660,407,843	8,433	20	0.20
第11期	775,802,643	581,224,910	7,492	20	0.20
第12期	762,901,901	599,262,756	7,855	20	0.20
第13期	760,929,330	531,343,349	6,983	20	0.20
第14期	744,851,340	419,984,924	5,639	20	0.20
第15期	742,834,801	325,349,025	4,380	20	0.20
第16期	742,968,932	309,312,920	4,163	20	0.20
第17期	742,112,818	291,626,599	3,930	20	0.20
第18期	738,273,986	278,060,652	3,766	20	0.20
第19期	735,750,463	270,941,061	3,683	20	0.20
第20期	731,975,579	309,301,544	4,226	20	0.20
第21期	732,118,147	317,130,259	4,332	20	0.20
第22期	736,202,234	355,569,469	4,830	20	0.20
第23期	758,734,643	332,231,865	4,379	20	0.20
第24期	764,273,666	392,822,723	5,140	20	0.20
第25期	762,469,873	401,682,955	5,268	20	0.20

ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1 単位当たり分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第26期	742,883,344	404,208,521	5,441	20	0.20
第27期	742,526,181	404,229,448	5,444	20	0.20
第28期	735,332,392	394,106,717	5,360	20	0.20
第29期	713,933,838	405,794,007	5,684	20	0.20
第30期	690,540,989	355,961,703	5,155	20	0.20
第31期	663,649,022	370,314,845	5,580	20	0.20
第32期	652,797,514	392,291,363	6,009	20	0.20
第33期	649,662,288	353,137,421	5,436	20	0.20
第34期	642,028,278	342,166,709	5,329	20	0.20
第35期	626,749,545	326,273,311	5,206	20	0.20
第36期	617,422,441	315,514,481	5,110	20	0.20
第37期	611,587,443	327,607,990	5,357	20	0.20
第38期	607,862,830	329,485,764	5,420	20	0.20
第39期	605,069,042	329,503,888	5,446	20	0.20
第40期	573,815,232	319,478,940	5,568	20	0.20
第41期	544,306,277	305,084,458	5,605	20	0.20
第42期	532,779,484	306,145,218	5,746	20	0.20
第43期	521,196,958	289,518,414	5,555	20	0.20
第44期	502,017,188	295,665,915	5,890	20	0.20
第45期	498,443,776	285,557,699	5,729	20	0.20
第46期	488,135,848	276,523,189	5,665	20	0.20
第47期	467,034,612	258,966,417	5,545	20	0.20
第48期	456,875,148	222,631,626	4,873	20	0.20
第49期	441,259,688	207,091,701	4,693	20	0.20
第50期	436,832,981	209,774,306	4,802	20	0.20
第51期	392,100,571	190,028,116	4,846	20	0.20
第52期	384,388,754	179,224,381	4,663	20	0.20
第53期	381,551,862	183,456,427	4,808	20	0.20
第54期	358,081,544	185,089,177	5,169	20	0.20
第55期	355,723,056	200,326,289	5,632	20	0.20
第56期	352,932,861	187,582,473	5,315	20	0.20
第57期	348,995,681	182,040,321	5,216	20	0.20
第58期	337,715,952	170,617,624	5,052	20	0.20
第59期	334,716,027	174,721,796	5,220	20	0.20

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1 単位当たり分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第60期	331,898,123	177,679,759	5,353	20	0.20
第61期	320,347,506	176,974,949	5,524	20	0.20
第62期	311,679,075	167,735,276	5,382	20	0.20
第63期	303,710,309	163,699,101	5,390	20	0.20
第64期	297,093,727	175,417,988	5,904	20	0.20
第65期	294,437,045	189,708,652	6,443	20	0.20
第66期	291,580,305	195,900,652	6,719	20	0.20
第67期	286,835,844	200,595,449	6,993	20	0.20
第68期	284,981,945	207,873,398	7,294	20	0.20
第69期	277,410,645	214,898,577	7,747	20	0.20
第70期	275,107,136	185,255,286	6,734	20	0.20
第71期	271,832,378	194,491,267	7,155	20	0.20
第72期	259,138,438	180,795,611	6,977	20	0.20
第73期	258,701,666	183,907,769	7,109	20	0.20
第74期	255,482,997	184,542,621	7,223	20	0.20
第75期	254,094,086	187,318,702	7,372	20	0.20
第76期	237,037,518	173,726,453	7,329	20	0.20
第77期	236,495,005	180,750,219	7,643	20	0.20
第78期	225,390,987	171,025,341	7,588	20	0.20
第79期	223,630,217	168,753,574	7,546	20	0.20
第80期	219,257,609	167,725,992	7,650	20	0.20
第81期	218,686,826	172,264,311	7,877	20	0.20
第82期	217,749,149	173,464,282	7,966	20	0.20
第83期	207,460,177	166,919,645	8,046	20	0.20
第84期	198,976,453	160,275,766	8,055	20	0.20
第85期	197,345,882	163,369,840	8,278	20	0.20
第86期	184,884,627	146,074,837	7,901	20	0.20
第87期	174,993,697	158,625,887	9,065	20	0.20
第88期	170,593,611	156,874,672	9,196	20	0.20
第89期	170,285,515	158,537,675	9,310	20	0.20
第90期	166,438,731	159,136,820	9,561	20	0.20
第91期	160,280,501	151,147,858	9,430	20	0.20
第92期	161,545,142	153,651,659	9,511	20	0.20
第93期	153,870,231	145,980,916	9,487	20	0.20

ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1 単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第94期	152,969,383	145,275,615	9,497	20	0.20
第95期	150,924,134	142,009,380	9,409	20	0.20
第96期	148,814,121	139,769,060	9,392	20	0.20
第97期	148,844,995	126,698,564	8,512	20	0.20
第98期	148,895,132	130,059,927	8,735	20	0.20
第99期	148,944,091	129,930,064	8,723	20	0.20
第100期	145,347,276	124,989,824	8,599	20	0.20
第101期	143,804,806	115,632,066	8,041	20	0.20
第102期	139,035,592	103,406,958	7,437	20	0.20
第103期	139,092,837	112,552,471	8,092	20	0.20
第104期	133,212,364	106,791,811	8,017	20	0.20
第105期	132,975,489	105,177,711	7,910	20	0.20
第106期	125,302,185	95,883,582	7,652	20	0.20
第107期	123,162,812	97,738,550	7,936	20	0.20
第108期	121,159,948	93,163,742	7,689	20	0.20
第109期	120,713,164	89,986,732	7,455	20	0.20
第110期	119,543,219	88,998,123	7,445	20	0.20
第111期	119,611,345	88,393,857	7,390	20	0.20
第112期	117,412,412	96,671,544	8,234	20	0.20
第113期	117,463,461	95,091,900	8,095	20	0.20
第114期	117,516,042	96,471,763	8,209	20	0.20
第115期	116,586,669	95,010,047	8,149	20	0.20
第116期	112,811,036	89,851,973	7,965	20	0.20

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期
1 万 口 当 り 分 配 金	20円	20円	20円	20円	20円
(単 価)	(8,234円)	(8,095円)	(8,209円)	(8,149円)	(7,965円)

●＜分配金再投資コース＞をご利用の方の税引き分配金は、上記()内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	7,954円60銭

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（配当控除の適用はありません。）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。

償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

ダイワ海外好配当株マザーファンド

運用報告書 第21期（決算日 2017年3月9日）

（計算期間 2016年9月10日～2017年3月9日）

ダイワ海外好配当株マザーファンドの第21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	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）
運 用 方 法	①主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と株式の値上がり益の獲得により信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 ②投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。 イ. アメリカ、ヨーロッパ、アジア・オセアニアの3地域に均等に投資することを基本とします。 ロ. 定量分析データ（S & P社クオリティランキング等）を参考に、配当の質の高い企業を選定します。 ハ. 配当利回りの水準、時価総額規模、流動性を勘案します。 ニ. 定性分析に基づき利益や配当の継続性を考慮します。 ③株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。 ④保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
株 式 組 入 制 限	無制限

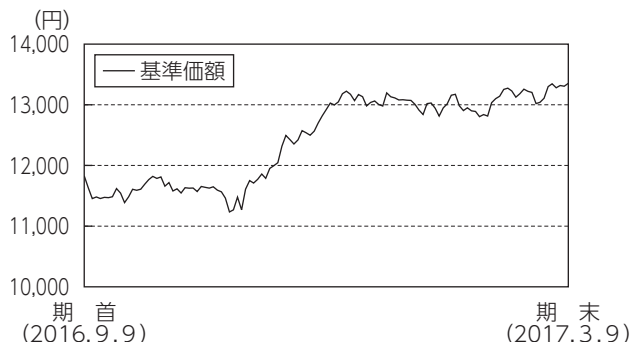
大和投資信託

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



年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数(円換算)		株 式 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	
(期首)2016年 9月9日	11,829	—	11,015	—	95.6
9月末	11,591	△ 2.0	10,730	△ 2.6	95.2
10月末	11,593	△ 2.0	10,925	△ 0.8	94.1
11月末	12,421	5.0	11,912	8.1	94.3
12月末	12,980	9.7	12,638	14.7	95.1
2017年 1月末	12,984	9.8	12,602	14.4	94.0
2月末	13,041	10.2	12,836	16.5	96.3
(期末)2017年 3月9日	13,353	12.9	13,032	18.3	95.9

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数(円換算)は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(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コクサイ指数(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、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

《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：11,829円 期末：13,353円 騰落率：12.9%

【基準価額の主な変動要因】

海外株式市況が、米国大統領選挙で勝利したトランプ氏の減税やインフラ(社会基盤)投資政策等への期待などを背景に上昇したこと、また為替相場で、トランプ氏の政策への期待感や内外金利差の拡大などを受けて円安が進んだ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

○海外株式市況

海外株式市況は、米国の政策金利引き上げに対する警戒や中国の景気減速懸念、米国大統領選挙を前にしたリスク回避姿勢の強まりなどを背景に、期首から2016年11月上旬にかけて下落基調となりました。しかし、11月の大統領選挙で予想外にトランプ氏が勝利すると、同氏の減税やインフラ投資政策により米国景気が再加速するとの期待感から米国株を中心に上昇しました。OPEC(石油輸出機構)の減産合意を受けて原油高が進展したことも支援材料となりました。2017年1月以降も、トランプ大統領が石油パイプラ

インの建設を前進させる大統領令や金融規制を抜本的に見直す大統領令に署名したこと、同氏の議会演説を受けて減税やインフラ投資などへの期待が再び高まったこと、2016年10-12月期の企業業績が総じて良好だったこと、イエレンFRB(米連邦準備制度理事会)議長が議会証言において米国経済に楽観的な見方を示したことなどを受けて、期末にかけて上昇基調となりました。

○為替相場

為替相場は、期首から2016年11月上旬にかけてはおおむね横ばい圏での推移となりましたが、その後は米国の大統領選挙で勝利したトランプ氏の政策への期待感や原油価格の上昇などから市場のリスク選好度が強まり、円安が進みました。内外金利差の拡大も円安の材料となりました。2017年1月以降は、トランプ大統領が米ドル高に対して警戒感を示したことや欧州政治動向の不透明感が強まったことなどを受けて、やや円高基調となり期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

配当利回りに注目するとともに、業績見通しの改善が期待される企業に投資を行なう方針です。北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に対して均等に投資を行ないます。米国をけん引役とした世界的な景気拡大が続いていることや、世界的な金融緩和が続いていることから、景気感応度の高い情報技術セクターや一般消費財・サービスセクターに投資の機会があると考えます。また、安定した増益が期待される生活必需品セクターや公益事業セクターへの投資も行なう方針です。欧州における政治情勢の不透明感が高まっていることから、同地域においては機動的にポートフォリオを変更していく方針です。

◆ポートフォリオについて

ポートフォリオにおける個別銘柄の選択に関しては、高い配当利回りが期待される銘柄の中から、特に利益やキャッシュフロー等の業績成長や負債比率等の財務体質の健全性を考慮し、ポートフォリオに組み入れました。また株価の水準にも注意を払い、相対的に割安感がある企業を中心に組み入れを行ないました。具体的な企業としては、半導体事業を中心とした利益成長に加え株主還元の強化が期待された韓国のSAMSUNG ELECTRONICS(情報技術)、世界的な金利上昇の恩恵が期待された台湾のFUBON FINANCIAL(金融)やフランスのAXA(金融)等の企業の組み入れを上位としました。

◆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。

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。

当ファンドは運用スキーム上、参考指数と比較してアジア・オセアニア地域のウエートが高く、米国地域のウエートが低いという違いがあります。参考指数は海外株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

配当利回りに注目するとともに、業績見通しの改善が期待される企業に投資を行なう方針です。北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域に対して均等に投資を行なう方針です。北米においては金融や情報技術、設備投資関連銘柄に魅力があると考えます。欧州においては、業績の底打ちが見込まれる銀行や保険を中心に金融銘柄の投資魅力が高いと考えています。アジア・オセアニアでは、金利上昇の恩恵が期待される金融に加え、株主還元の強化が期待される企業にも投資機会があると考えています。

「S & P社クオリティランキング」について

「Standard & Poor's」、 「S & P」、 「S&P Capital IQ Quality Rankings」、 「S&P Capital IQ International Quality Rankings」はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーの登録商標であり、本商品の提供者である大和証券投資信託委託株式会社に対しては、その利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関し、いかなる意思表示等を行なうものでもありません。スタンダード&プアーズは、大和証券投資信託委託株式会社や本商品の投資家およびその他いかなる者に対しても、S&P Capital IQ Quality RankingsおよびS&P Capital IQ International Quality Rankingsその付随データの利用による効果に対して、明示的にも暗示的にも何ら保証等を行なうものではありません。スタンダード&プアーズは、S&P Capital IQ Quality RankingsおよびS&P Capital IQ International Quality Rankingsの利用や投資目的への適合性やその販売性等に関し、一切の保証等を行なうものではないことを明示的に表明しています。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	31円 (31)
有価証券取引税 (株式)	16 (16)
その他費用 (保管費用)	97 (97)
合 計	144

(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

(2016年9月10日から2017年3月9日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 36 (1.27)	千アメリカ・ドル 202 (△ 15)	百株 85.62	千アメリカ・ドル 540
	カナダ	百株 5 (-)	千カナダ・ドル 30 (-)	百株 -	千カナダ・ドル -
	オーストラリア	百株 317 (-)	千オーストラリア・ドル 238 (-)	百株 286.52	千オーストラリア・ドル 391
	香港	百株 1,579 (-)	千香港ドル 2,091 (-)	百株 752	千香港ドル 1,521
	シンガポール	百株 150 (-)	千シンガポール・ドル 24 (-)	百株 150	千シンガポール・ドル 21

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	台湾	百株 1,520 (△106.79)	千台湾ドル 6,686 (-)	百株 1,643.21	千台湾ドル 10,716
	イギリス	百株 606.3 (3.75)	千イギリス・ポンド 326 (-)	百株 702.95	千イギリス・ポンド 534
	スイス	百株 5 (-)	千スイス・フラン 58 (-)	百株 4.06	千スイス・フラン 86
	デンマーク	百株 1.1 (-)	千デンマーク・クローネ 94 (-)	百株 1.6	千デンマーク・クローネ 138
	ノルウェー	百株 14 (-)	千ノルウェー・クローネ 201 (-)	百株 4	千ノルウェー・クローネ 58
	スウェーデン	百株 30 (-)	千スウェーデン・クローネ 257 (-)	百株 2.5	千スウェーデン・クローネ 61
	韓国	百株 36.92 (-)	千韓国ウォン 137,159 (-)	百株 36.73	千韓国ウォン 313,883
	ユーロ (アイルランド)	百株 5.7 (-)	千ユーロ 17 (-)	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (オランダ)	百株 14 (-)	千ユーロ 6 (-)	百株 39.41	千ユーロ 54
	ユーロ (ベルギー)	百株 4.7 (-)	千ユーロ 26 (-)	百株 3	千ユーロ 17
国	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 38 (-)	千ユーロ 46 (-)	百株 16.5	千ユーロ 13
	ユーロ (フランス)	百株 37.8 (-)	千ユーロ 155 (-)	百株 40.3	千ユーロ 142
	ユーロ (ドイツ)	百株 8.5 (-)	千ユーロ 64 (-)	百株 14.25	千ユーロ 45
	ユーロ (スペイン)	百株 143 (0.93)	千ユーロ 54 (0)	百株 127	千ユーロ 49
	ユーロ (イタリア)	百株 280 (7.6)	千ユーロ 33 (-)	百株 165.6	千ユーロ 23
	ユーロ (フィンランド)	百株 10 (-)	千ユーロ 42 (-)	百株 4.5	千ユーロ 17
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 541.7 (8.53)	千ユーロ 446 (0)	百株 410.56	千ユーロ 363

(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

(2016年9月10日から2017年3月9日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
SK HYNIX INC (韓国)		1.8	9,166	5,092	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES (韓国)		1.7	10,712	6,301
FUBON FINANCIAL HOLDING CO (台湾)		58	8,781	151	CHEVRON CORP (アメリカ)		0.9	10,579	11,754
HSBC HOLDINGS PLC (イギリス)		8.4	7,457	887	CHUNGHWA TELECOM CO LTD (台湾)		27	9,861	365
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO (台湾)		38	6,080	160	BHP BILLITON LIMITED (オーストラリア)		4.45	9,435	2,120
PRIMAX ELECTRONICS LTD (台湾)		35	5,803	165	FUBON FINANCIAL HOLDING CO (台湾)		56	9,193	164
BENDIGO AND ADELAIDE BANK (オーストラリア)		6	5,715	952	WIN SEMICONDUCTORS CORP (台湾)		24.321	7,852	322
SAMPO OYJA SHS (フィンランド)		1	5,024	5,024	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE (韓国)		0.1	7,846	78,464
BHP BILLITON PLC (イギリス)		3	4,859	1,619	IMPERIAL BRANDS PLC (イギリス)		1.4	6,803	4,859
MICROCHIP TECHNOLOGY INC (アメリカ)		0.6	4,641	7,736	NATIONAL GRID PLC (イギリス)		5	6,717	1,343
RIO TINTO PLC (イギリス)		0.94	4,355	4,633	VODAFONE GROUP PLC (イギリス)		23.8	6,695	281

(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		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
LAS VEGAS SANDS CORP	—	3	16	1,855	一般消費財・サービス		
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2	1	10	1,188	情報技術		
BOEING CO/THE	—	1	18	2,082	資本財・サービス		
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7	—	—	—	金融		
JPMORGAN CHASE & CO	—	2	18	2,090	金融		
CISCO SYSTEMS INC	13	8	27	3,118	情報技術		
MORGAN STANLEY	—	3	13	1,594	金融		
DOW CHEMICAL CO/THE	9	6	37	4,351	素材		
COCA-COLA CO/THE	9	9	37	4,330	生活必需品		
EXXON MOBIL CORP	8	7	56	6,500	エネルギー		
ITC HOLDINGS CORP	10	—	—	—	その他		
NEXTERA ENERGY INC	1	1	12	1,483	公益事業		
GENERAL MOTORS CO	—	3	11	1,281	一般消費財・サービス		
GENERAL MILLS INC	—	1	6	688	生活必需品		
HP INC	10	5	8	992	情報技術		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2	2	35	4,112	情報技術		
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	8	—	—	—	資本財・サービス		
JOHNSON & JOHNSON	7	5	62	7,110	ヘルスケア		
ABBVIE INC	3	3	19	2,205	ヘルスケア		
LOCKHEED MARTIN CORP	1	0.6	16	1,840	資本財・サービス		
ELI LILLY & CO	2	2	16	1,911	ヘルスケア		
MCDONALD'S CORP	2	1.2	15	1,761	一般消費財・サービス		
MERCK & CO. INC.	7	5	32	3,770	ヘルスケア		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	—	6	44	5,055	情報技術		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3	3	32	3,772	生活必需品		
NUCOR CORP	2	1	6	698	素材		
ALTRIA GROUP INC	6	6	45	5,214	生活必需品		
PFIZER INC	13	11	37	4,274	ヘルスケア		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	6	5	45	5,165	生活必需品		
PEPSICO INC	3	3	32	3,757	生活必需品		
QUALCOMM INC	4	4	23	2,648	情報技術		
RAYTHEON COMPANY	1	1	15	1,766	資本財・サービス		
CHEVRON CORP	9	—	—	—	エネルギー		
SOUTHERN CO/THE	8	4	19	2,281	公益事業		
TRAVELERS COS INC/THE	1	1	12	1,389	金融		
AT&T INC	15	13	54	6,222	電気通信サービス		
TEXAS INSTRUMENTS INC	2	—	—	—	情報技術		

銘柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
株 数		株 数	千アメリカ・ドル	千円	
WAL-MART STORES INC	5	3	20	2,399	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	—	6	15	1,736	金融
INTEL CORP	11	8	28	3,265	情報技術
DUKE ENERGY CORP	1	1	8	920	公益事業
MICROSOFT CORP	13	8	51	5,958	情報技術
BLACKROCK INC	0.3	0.15	5	661	金融
COMCAST CORP-CLASS A	3	6	22	2,551	一般消費財・サービス
アメリカ・ドル 通 貨 計	株数・金額 銘柄数<比率>	207.3株 36銘柄	158.95株 39銘柄	994 114,013 <29.6%>	
株 数		株 数	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)	株 数	株 数	株 数	株 数	
ROYAL BANK OF CANADA	8	8	78	6,680	金融
TRANSCANADA CORP	—	5	30	2,618	エネルギー
カナダ・ドル 通 貨 計	株数・金額 銘柄数<比率>	8株 1銘柄	13株 2銘柄	109 9,299 <2.4%>	
株 数		株 数	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)	株 数	株 数	株 数	株 数	
BHP BILLITON LIMITED	59	14.5	36	3,156	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	—	60	70	6,113	金融
RIO TINTO LTD	17	5.5	33	2,913	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	—	32	41	3,553	金融
WOOLWORTHS LTD	29	—	—	—	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	—	45	19	1,688	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	—	20	23	2,005	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	50	50	23	2,014	電気通信サービス
BORAL LTD	—	75	45	3,889	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	—	50	24	2,109	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	126	110	67	5,817	金融
TRANSURBAN GROUP	74	—	—	—	資本財・サービス
SYDNEY AIRPORT	61	—	—	—	資本財・サービス
ARDENT LEISURE GROUP	15.52	—	—	—	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通 貨 計	株数・金額 銘柄数<比率>	431.52株 8銘柄	462株 10銘柄	385 33,261 <8.6%>	
株 数		株 数	千香港ドル	千円	
(香港)	株 数	株 数	株 数	株 数	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	—	70	270	3,998	一般消費財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	10	—	—	—	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	—	270	272	4,017	不動産
TENCENT HOLDINGS LTD	27	7	148	2,192	情報技術

ダイワ海外好当株マザーファンド

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価金額	損益換算金額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
HSBC HOLDINGS PLC	百株	百株	千香港ドル	千円	金融
SANDS CHINA LTD	160	68	530	7,829	一般消費財・サービス
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	—	15	229	3,382	情報技術
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	—	50	123	1,822	金融
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	—	460	155	2,298	情報技術
香港ドル通貨計	株数、金額 197 3銘柄	株数、金額 1,024 8銘柄	株数、金額 1,870 27銘柄	株数、金額 27,611 7.2%増	
(台湾)	株数	株数	千台湾ドル	千円	
PRIMAX ELECTRONICS LTD	—	350	1,680	6,232	情報技術
TAIWAN CEMENT	150	—	—	—	建材
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	400	130	1,339	4,967	電気通信サービス
MEDIATEK INC	60	40	888	3,294	情報技術
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	—	210	657	2,438	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	480	500	2,575	9,553	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	—	340	1,694	6,288	金融
WIN SEMICONDUCTORS CORP	350	—	—	—	情報技術
SILICONWARE PRECISION INDS	360	—	—	—	情報技術
台湾ドル通貨計	株数、金額 1,800 6銘柄	株数、金額 1,570 6銘柄	株数、金額 8,834 21銘柄	株数、金額 32,774 8.5%増	
(イギリス)	株数	株数	千イリス・ポンド	千円	
TUI AG-DI	12	—	—	—	一般消費財・サービス
BP PLC	32	30	13	1,927	エネルギー
BARCLAYS PLC	—	75	17	2,429	金融
PRUDENTIAL PLC	8	6	9	1,368	金融
INMARSAT PLC	—	15	11	1,554	電気通信サービス
BAE SYSTEMS PLC	27	10	6	905	資本財・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	41	15.7	26	3,659	ヘルスケア
RPC GROUP PLC	10	—	—	—	建材
INFORMA PLC	15	23	15	2,112	一般消費財・サービス
ULTRA ELECTRONICS HLDGS PLC	—	1.5	3	454	資本財・サービス
PAYSAFE GROUP PLC	27	—	—	—	情報技術
DIAGEO PLC	3	—	—	—	生活必需品
RIO TINTO PLC	13	13.5	44	6,139	建材
LADBROKES CORAL GROUP PLC	—	95	11	1,604	一般消費財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	40	15	5	701	金融
VODAFONE GROUP PLC	238	45	9	1,277	電気通信サービス
WPP PLC	7	9	15	2,162	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	12	—	—	—	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1	—	—	—	生活必需品
ASTRAZENECA PLC	14	5.4	25	3,581	ヘルスケア
WOLSELEY PLC	—	2.5	12	1,748	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	—	83	20	2,879	金融
3I GROUP PLC	—	25	18	2,522	金融
ASHTREAD GROUP PLC	—	10	16	2,362	資本財・サービス
NATIONAL GRID PLC	59	19	18	2,584	公益事業
IMPERIAL BRANDS PLC	14	—	—	—	生活必需品
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	9	—	—	—	生活必需品
BHP BILLITON PLC	—	4.5	5	832	建材
SHIRE PLC	1	—	—	—	ヘルスケア
MONDI PLC	4	—	—	—	建材
PERSIMMON PLC	—	5	10	1,477	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	17	—	—	—	電気通信サービス
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2	5	10	1,482	エネルギー
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 606 23銘柄	株数、金額 513.1 22銘柄	株数、金額 328 75銘柄	株数、金額 45,770 11.9%増	
(スイス)	株数	株数	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.6	0.3	7	875	ヘルスケア
SWISS RE AG	3	4.5	40	4,558	金融
FISCHER (GEORG)-REG	0.2	0.05	4	521	資本財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.5	1	28	3,169	金融
SWISSCOM AG-REG	0.5	—	—	—	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	0.06	—	—	—	建材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.6	0.55	24	2,748	ヘルスケア
スイス・フラン通貨計	株数、金額 5.46 7銘柄	株数、金額 6.4 5銘柄	株数、金額 105 105銘柄	株数、金額 11,874 3.1%増	

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価金額	損益換算金額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	株数	株数	千デンマーク・クローネ	千円	
PANDORA A/S	2	1.5	122	1,985	一般消費財・サービス
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 2 1銘柄	株数、金額 1.5 1銘柄	株数、金額 122 1銘柄	株数、金額 1,985 0.5%増	
(ノルウェー)	株数	株数	千ノルウェー・クローネ	千円	
STATOIL ASA	—	10	147	1,973	エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 — 1銘柄	株数、金額 10 1銘柄	株数、金額 147 1銘柄	株数、金額 1,973 0.5%増	
(スウェーデン)	株数	株数	千スウェーデン・クローネ	千円	
NORDEA BANK AB	—	16	171	2,163	金融
TELE2 AB-B SHS	—	14	113	1,433	電気通信サービス
SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	5	2.5	68	867	生活必需品
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 5 1銘柄	株数、金額 32.5 3銘柄	株数、金額 352 3銘柄	株数、金額 4,465 1.2%増	
(韓国)	株数	株数	千韓国ウォン	千円	
SK HYNIX INC	—	18	86,400	8,588	情報技術
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	—	4.3	13,846	1,376	金融
HYUNDAI MOTOR CO	3	2.5	36,125	3,590	一般消費財・サービス
POSCO	1	1	29,000	2,882	建材
KT&G CORP	3	—	—	—	生活必需品
KIWOOM SECURITIES CO LTD	2.46	—	—	—	金融
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	17	—	—	—	資本財・サービス
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1	—	—	—	生活必需品
DONGBU INSURANCE CO LTD	—	2.2	13,706	1,362	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0.95	0.6	120,600	11,987	情報技術
韓国ウォン通貨計	株数、金額 28.41 7銘柄	株数、金額 28.6 6銘柄	株数、金額 299,677 6銘柄	株数、金額 29,787 7.7%増	
ユーロ (アイルランド)	株数	株数	千ユーロ	千円	
CRH PLC	—	5.7	19	2,300	建材
国小計	株数、金額 — 1銘柄	株数、金額 5.7 1銘柄	株数、金額 19 1銘柄	株数、金額 2,300 0.6%増	
ユーロ (オランダ)	株数	株数	千ユーロ	千円	
UNILEVER NV-CVA	2	—	—	—	生活必需品
RELEX NV	14	—	—	—	資本財・サービス
KONINKLUKE AHOLD DELHAIZE NV	9.41	—	—	—	生活必需品
国小計	株数、金額 25.41 3銘柄	株数、金額 — —	株数、金額 — —	株数、金額 — —	
ユーロ (ベルギー)	株数	株数	千ユーロ	千円	
KBC GROEP NV	—	1.7	10	1,248	金融
国小計	株数、金額 — 1銘柄	株数、金額 1.7 1銘柄	株数、金額 10 1銘柄	株数、金額 1,248 0.3%増	
ユーロ (ルクセンブルグ)	株数	株数	千ユーロ	千円	
STABILUS SA	—	2	11	1,418	資本財・サービス
RTL GROUP	—	1.5	10	1,325	一般消費財・サービス
ARCELOORMITTAL	—	18	14	1,768	建材
国小計	株数、金額 — 3銘柄	株数、金額 21.5 3銘柄	株数、金額 37 3銘柄	株数、金額 4,512 1.2%増	
ユーロ (フランス)	株数	株数	千ユーロ	千円	
TOTAL SA	16	15.2	71	8,655	エネルギー
KERING	0.7	0.4	9	1,128	一般消費財・サービス
BNP PARIBAS	—	3.3	19	2,364	金融
SOCIETE GENERALE SA	—	1.5	6	829	金融
ACCOR SA	—	4	14	1,799	一般消費財・サービス
ELIOR GROUP	6	—	—	—	一般消費財・サービス
TARKETT	—	1.3	5	628	資本財・サービス
AXA SA	32	31.5	74	9,023	金融
RENAULT SA	—	2	17	2,068	一般消費財・サービス
VINCI SA	2	—	—	—	資本財・サービス
ENGIE	5	—	—	—	公益事業
国小計	株数、金額 61.7 6銘柄	株数、金額 59.2 8銘柄	株数、金額 219 8銘柄	株数、金額 26,498 6.9%増	
ユーロ (ドイツ)	株数	株数	千ユーロ	千円	
ALLIANZ SE-REG	2	3.65	61	7,419	金融

銘柄	期 首		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
KOENIG & BAUER AG	百株	百株	千ユーロ	千円	資本財・サービス
SILTRONIC AG	—	1	5	647	情報技術
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	—	1.1	6	783	電気通信サービス
VONOVIA SE	9	—	—	—	不動産
	4	3.5	11	1,375	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	15 3銘柄	9.25 4銘柄	84 10,225	< 2.7%>
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	公益事業
IBERDROLA SA	29	42.93	27	3,312	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	8	—	—	—	公益事業
EDP RENOVAVEIS SA	—	11	6	822	公益事業
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	37 2銘柄	53.93 2銘柄	34 4,134	< 1.1%>
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	—	120	7	914	公益事業
ENEL SPA	—	40	16	2,013	エネルギー
SNAM SPA	38	—	—	—	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	38 1銘柄	160 2銘柄	24 2,928	< 0.8%>
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	素材
HUHTAMAKI OYJ	3	—	—	—	金融
SAMPO OYJ-A SHS	—	8.5	36	4,465	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	3 1銘柄	8.5 1銘柄	36 4,465	< 1.2%>
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	180.11 16銘柄	319.78 22銘柄	466 56,314	<14.6%>
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,470.8 109銘柄	4,139.83 125銘柄	— 369,133	<95.9%>

(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

2017年3月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	369,133	94.3
コール・ローン等、その他	22,318	5.7
投資信託財産総額	391,451	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、3月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝114.60円、1カナダ・ドル＝84.91円、1オーストラリア・ドル＝86.28円、1香港ドル＝14.76円、1台湾ドル＝3.71円、1イギリス・ポンド＝139.46円、1スイス・フラン＝112.88円、1デンマーク・クローネ＝16.24円、1ノルウェー・クローネ＝13.41円、1スウェーデン・クローネ＝12.65円、100韓国ウォン＝9.94円、1ユーロ＝120.74円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (388,789千円) の投資信託財産総額 (391,451千円) に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年3月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	397,474,575円
コール・ローン等	13,061,934
株式(評価額)	369,133,042
未収入金	13,236,031
未収配当金	2,043,568
(B) 負債	12,564,765
未払金	6,064,765
未払解約金	6,500,000
(C) 純資産総額(A－B)	384,909,810
元本	288,259,608
次期繰越損益金	96,650,202
(D) 受益権総口数	288,259,608口
1万口当り基準価額(C／D)	13,353円

*期首における元本額は366,042,837円、当期中における追加設定元本額は13,790,233円、同解約元本額は91,573,462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・海外株式&REITファンド (毎月分配型) 35,699,282円、ダイワ外国好配当株ファンド (ダイワSMA専用) 149,843,863円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド (部分為替ヘッジあり) 43,366,125円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド (為替ヘッジなし) 59,350,338円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は13,353円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月10日 至2017年3月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,695,297円
受取配当金	4,678,045
受取利息	7,168
その他収益金	11,168
支払利息	△ 1,084
(B) 有価証券売買損益	48,187,153
売買益	72,145,228
売買損	△23,958,075
(C) その他費用	△ 3,126,625
(D) 当期損益金(A + B + C)	49,755,825
(E) 前期繰越損益金	66,964,148
(F) 解約差損益金	△23,859,538
(G) 追加信託差損益金	3,789,767
(H) 合計(D + E + F + G)	96,650,202
次期繰越損益金(H)	96,650,202

(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。

《お知らせ》

■投資信託証券への投資制限の変更

当ファンドにおいて、投資信託証券への投資比率の上限を純資産総額の5%としていますが、上場投資信託については、この制限の適用除外とし、5%を超えて投資できることとする変更を行ないました。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

運用報告書 第24期（決算日 2017年3月15日）

（計算期間 2016年9月16日～2017年3月15日）

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの第24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	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）
運 用 方 法	①海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。 ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ．個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ．組み入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。 ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン＆ステアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。 ⑤外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
投 資 信 託 証 券 組 入 制 限	無制限

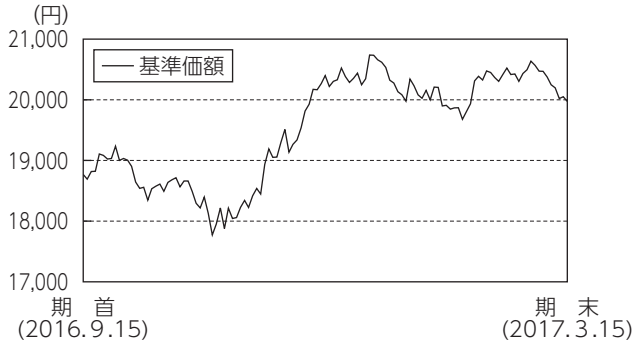
大和投資信託

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



年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国 R E I T 指数 (除く日本、円換算)		投資信託証券 組入比率
	円	騰落率 (参考指数)	騰落率		
(期首)2016年 9月15日	18,769	—	19,338	—	96.4
9 月 末	19,002	1.2	19,693	1.8	97.1
10 月 末	18,217	△2.9	18,771	△ 2.9	96.7
11 月 末	19,294	2.8	20,157	4.2	97.1
12 月 末	20,346	8.4	21,346	10.4	96.5
2017年 1 月 末	19,898	6.0	20,909	8.1	97.0
2 月 末	20,433	8.9	21,698	12.2	97.4
(期末)2017年 3月15日	19,973	6.4	20,890	8.0	96.5

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、円換算) は、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日より10,000として大和投資信託が計算したものです。S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、米ドルベース) の所有権およびその他の権利は、S & P Dow Jones Indices LLC が有しています。S & P Dow Jones Indices LLC は、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

《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：18,769円 期末：19,973円 騰落率：6.4%

【基準価額の主な変動要因】

米国の利上げ懸念などを背景に海外リート市況が下落したことがマイナス要因となったものの、為替相場が円安基調で推移したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は総じて下落しました。

米国では、利上げ懸念が相場の重しとなったほか、2016年11月に実施された米国大統領選挙においてトランプ氏が勝利したことにより、インフラ (社会基盤) 関連などの財政支出を拡大するとの思惑を背景に長期金利が上昇したことから、軟調な展開となりました。その後は一転して、トランプ氏の掲げる減税やインフラ投資などを主軸とした成長政策への期待が強まり、反発基調を強める動きとなりました。しかし期末にかけては好調な経済指標の発表が相次ぎ、

2017年3月の利上げ観測が高まったことから、再び反落する展開となりました。

欧州では、原油高などから E C B (欧州中央銀行) の量的緩和策の終了が前倒しになるとの警戒感を背景に長期金利が上昇圧力を強めたことや域内の政局不安等を背景に、主要市場のフランスやオランダを中心に下落しました。

アジア・オセアニアでは、中国経済の先行き不透明感や米国金利の上昇に伴い域内リートの相対的な魅力が低下するとの見方から、香港が下落しました。

○為替相場

為替相場は、対円で主要通貨が上昇 (円安) しました。

為替相場は、米国トランプ政権の下で物価上昇を伴う経済成長が続くとの思惑や E C B が量的緩和を縮小するとの観測などを背景に、対主要通貨で円安傾向での推移となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン & スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク (以下、C & S) に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行ないます。

◆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、C & S に運用の指図にかかる権限を委託しております。

当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の価値などと比べて魅力的であると考える銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。

国・地域別配分では、大きなリスクを取らず各地域にバランス良く投資を行ないました。米国では、入居者の賃金上昇が支援材料となる住宅セクターなどに注目しました。欧州では、事業環境が良好で投資魅力が高まっている英国の貸倉庫リートやフランスの商業施設リートに、アジア・オセアニアでは、シドニーの良好なオフィス需給から恩恵を受けるオーストラリアのオフィスリートなどに注目しました。

◆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。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行ないます。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (投資信託証券)	10円 (10)
有価証券取引税 (投資信託証券)	3 (3)
その他費用 (保管費用) (その他)	17 (4) (13)
合 計	29

(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
投資信託証券

(2016年9月16日から2017年3月15日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 4,727.044 (273.84)	千アメリカ・ドル 211,903 (211,903)	千口 6,858.14 (6,858.14)	千アメリカ・ドル 268,190 (268,190)
	カナダ	千口 (ー)	千カナダ・ドル (ー)	千口 440.821 (ー)	千カナダ・ドル 13,912 (13,912)
	オーストラリア	千口 (9,281.98 (ー)	千オーストラリア・ドル (39,987 (ー)	千口 (14,906.493 (ー)	千オーストラリア・ドル (57,468 (ー)

■ 主要な売買銘柄
投資信託証券

(2016年9月16日から2017年3月15日まで)

当 期				期 付			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	千口 464.729	千円 3,069,992	円 6,605	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	千口 217.462	千円 4,477,683	円 20,590
GECINA SA (フランス)	181.03	2,793,872	15,433	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	464.729	3,265,773	7,027
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	126.364	2,550,297	20,182	APARTMENT INVT & MGMT CO-A (アメリカ)	617.82	2,887,139	4,673
VENTAS INC (アメリカ)	342.854	2,461,331	7,178	HAMMERSON PLC (イギリス)	3,475.095	2,533,823	729
VORNADO REALTY TRUST (アメリカ)	197.164	2,269,638	11,511	HCP INC (アメリカ)	700.079	2,430,242	3,471
HOST HOTELS & RESORTS INC (アメリカ)	997.801	1,996,426	2,000	KLEPIERRE (フランス)	534.347	2,317,426	4,336
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	2,553.295	1,654,511	647	VICINITY CENTRES (オーストラリア)	8,849.316	2,181,458	246
DOUGLAS EMMETT INC (アメリカ)	411.795	1,547,824	3,758	HOST HOTELS & RESORTS INC (アメリカ)	1,291.75	2,140,851	1,657
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	59.265	1,492,990	25,191	CAMDEN PROPERTY TRUST (アメリカ)	208.246	1,882,414	9,039
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	44.999	1,180,717	26,238	SEGRO PLC (イギリス)	2,536.264	1,574,912	620

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	香港	千口 (ー)	千香港ドル (ー)	千口 9,514.5 (ー)	千香港ドル 118,693 (ー)
	シンガポール	千口 (5,586.742)	千シンガポール・ドル (6,452)	千口 11,074.9 (ー)	千シンガポール・ドル 17,491 (ー)
	イギリス	千口 3,710.623 (1,821.861)	千イギリス・ポンド 9,965 659	千口 11,189.365 (ー)	千イギリス・ポンド 36,909 (ー)
	ユーロ (オランダ)	千口 (ー)	千ユーロ (ー)	千口 1,844.883 (ー)	千ユーロ 6,864 (ー)
	ユーロ (ベルギー)	千口 (56.383 (ー)	千ユーロ 4,765 (ー)	千口 (ー) (ー)	千ユーロ (ー) (ー)
	ユーロ (フランス)	千口 (226.029 (ー)	千ユーロ 34,481 (ー)	千口 538.956 (ー)	千ユーロ 20,185 (ー)
	ユーロ (ドイツ)	千口 (582.055 (ー)	千ユーロ 6,701 (ー)	千口 69.069 (ー)	千ユーロ 770 (ー)
	ユーロ (スペイン)	千口 (1,121.531 (ー)	千ユーロ 12,259 (△ 21)	千口 188.028 (ー)	千ユーロ 1,793 (ー)
国	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口 (1,985.998 (ー)	千ユーロ 58,208 (△ 21)	千口 2,640.936 (ー)	千ユーロ 29,614 (ー)

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 買付()内は分割割当、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) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 4) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファ ン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	336.194	9,332	1,071,679	0.9
AVALONBAY COMMUNITIES INC	126.364	22,573	2,592,133	2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	201.765	33,741	3,874,497	3.4
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	285.388	12,303	1,412,762	1.2
VORNADO REALTY TRUST	197.164	20,199	2,319,503	2.0
QTS REALTY TRUST INC-CL A	99.729	4,767	547,399	0.5
EQUINIX INC	26.825	10,230	1,174,770	1.0
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288.006	6,027	692,191	0.6
HOST HOTELS & RESORTS INC	896.057	15,905	1,826,372	1.6
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	551.703	12,302	1,412,750	1.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	301.722	10,183	1,169,327	1.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	574.136	10,569	1,213,735	1.0
CYRUSONE INC	106.284	5,333	612,426	0.5
STORE CAPITAL CORP	244.331	5,538	636,041	0.6
PARAMOUNT GROUP INC	1.196	19	2,224	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	445.431	8,993	1,032,695	0.9
VENTAS INC	278.405	16,526	1,897,694	1.6
GEO GROUP INC/THE	172.814	7,736	888,426	0.8
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	572.207	12,342	1,417,289	1.2
CROWN CASTLE INTL CORP	112.412	10,077	1,157,226	1.0
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	963.54	9,683	1,111,965	1.0
SUN COMMUNITIES INC	215.149	17,061	1,959,150	1.7
PROLOGIS INC	430.69	21,258	2,441,154	2.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	86.378	9,344	1,073,014	0.9
COUSINS PROPERTIES INC	1,291.472	10,254	1,177,499	1.0
DDR CORP	135.798	1,738	199,599	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	99.271	22,346	2,566,093	2.2
FEDERAL REALTY INVS TRUST	54.172	7,021	806,310	0.7
KILROY REALTY CORP	167.78	11,885	1,364,816	1.2
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	234.842	7,681	882,087	0.8
PUBLIC STORAGE	59.265	12,999	1,492,764	1.3
SL GREEN REALTY CORP	207.123	21,894	2,514,199	2.2
UDR INC	775.697	27,219	3,125,581	2.7
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	644.969	9,313	1,069,452	0.9
DIGITAL REALTY TRUST INC	145.783	14,928	1,714,202	1.5
EXTRA SPACE STORAGE INC	283.857	21,042	2,416,289	2.1
EDUCATION REALTY TRUST INC	390.32	15,210	1,746,652	1.5
DOUGLAS EMMETT INC	332.225	12,564	1,442,810	1.2
アメリカ・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	12,336,464 38銘柄	488,154 56,054,793	<48.5%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	501.527	17,999	1,533,943	1.3
カナダ・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	501,527 1銘柄	17,999 1,533,943	<1.3%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
NATIONAL STORAGE REIT	13,452.587	19,102	1,658,112	1.4
SCENTRE GROUP	9,306.169	38,248	3,319,957	2.9
DEXUS PROPERTY GROUP	5,867.085	54,094	4,695,404	4.1
INVESTA OFFICE FUND	3,158.791	14,435	1,253,016	1.1
MIRVAC GROUP	6,049.079	12,945	1,123,628	1.0
GOODMAN GROUP	2,553.295	18,817	1,633,383	1.4
VICINITY CENTRES	12,629.696	34,479	2,992,783	2.6
INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,003.818	18,630	1,617,097	1.4
オーストラリア・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	60,020.52 8銘柄	210,753 18,293,383	<15.8%>

ファ ン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
FORTUNE REIT	15,114.07	129,376	1,912,183	1.7
LINK REIT	2,908.92	149,082	2,203,434	1.9
CHAMPION REIT	3,889.376	17,735	262,131	0.2
香 港 ド ル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	21,912.366 3銘柄	296,194 4,377,749	<3.8%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	20,827.413	24,368	1,976,738	1.7
CAPITALAND MALL TRUST	6,481.5	12,509	1,014,754	0.9
FRASERS CENTREPOINT TRUST	6,530.1	12,962	1,051,497	0.9
シンガポール・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	33,839.013 3銘柄	49,839 4,042,989	<3.5%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	16,832.655	9,897	1,381,903	1.2
CAPITAL & REGIONAL PLC	9,863.918	5,745	802,219	0.7
SEGRO PLC-NIL PAID RIGHTS	1,193.925	1,137	158,777	0.1
SEGRO PLC	5,969.629	27,078	3,780,663	3.3
UNITE GROUP PLC	150.741	960	134,171	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	691.61	5,359	748,360	0.6
BIG YELLOW GROUP PLC	2,516.475	17,866	2,494,586	2.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,347.957	6,574	917,877	0.8
TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,868.272	4,055	566,261	0.5
イギリス・ポンド 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	44,435.182 9銘柄	78,676 10,984,820	<9.5%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
WAREHOUSES DE PAUW SCA	56.383	4,816	587,195	0.5
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	56.383 1銘柄	4,816 587,195	<0.5%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO SE	40.39	8,615	1,050,363	0.9
GECINA SA	181.03	21,108	2,573,499	2.2
KLEPIERRE	1,470.945	51,894	6,327,031	5.5
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	1,692.365 3銘柄	81,618 9,950,893	<8.6%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,133.438	24,417	2,976,944	2.6
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	2,133.438 1銘柄	24,417 2,976,944	<2.6%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	637.827	7,813	952,607	0.8
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1,364.198	14,494	1,767,182	1.5
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	2,002.025 2銘柄	22,307 2,719,789	<2.4%>
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	5,884.211 7銘柄	133,159 16,234,823	<14.0%>
合 計	口数、金額 銘柄数<比率>	178,929.283 69銘柄	111,522.503 111,522,503	<96.5%>

(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) 比率欄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

2017年3月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	111,522,503	95.2
コール・ローン等、その他	5,619,757	4.8
投資信託財産総額	117,142,261	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、3月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝114.83円、1カナダ・ドル＝85.22円、1オーストラリア・ドル＝86.80円、1香港ドル＝14.78円、1シンガポール・ドル＝81.12円、1イギリス・ポンド＝139.62円、1ユーロ＝121.92円です。
- (注3) 当期末における外貨建純資産（115,141,793千円）の投資信託財産総額（117,142,261千円）に対する比率は、98.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年3月15日現在

項 目	当 期 末	
	当	末
(A) 資産	118,170,049,127円	
コール・ローン等	4,047,143,263	
投資信託証券(評価額)	111,522,503,763	
未収入金	2,465,069,157	
未収配当金	135,332,944	
(B) 負債	2,550,559,824	
未払金	2,313,559,824	
未払解約金	237,000,000	
(C) 純資産総額(A－B)	115,619,489,303	
元本	57,888,284,111	
次期繰越損益金	57,731,205,192	
(D) 受益権総口数	57,888,284,111口	
1万口当り基準価額(C／D)	19,973円	

- * 期首における元本額は65,116,316,222円、当期中における追加設定元本額は144,175,694円、同解約元本額は7,372,207,805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・グローバル R E I T ・オープン（毎月分配型）52,555,655,748円、ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）45,279,652円、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）27,352,959円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）25,003,249円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）128,497,688円、6資産バランスファンド（分配型）219,228,090円、6資産バランスファンド（成長型）447,098,300円、リそな ワールド・リート・ファンド2,321,555,730円、世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）72,319,377円、「しがぎん」 S R I 三資産バランス・オープン（奇数月分配型）6,131,826円、常陽3分法ファンド339,850,026円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）76,917,172円、ダイワ・海外株式& R E I T ファンド（毎月分配型）23,105,222円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）200,494,327円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）274,135,572円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）333,252,719円、ダイワ・グローバル R E I T ファンド（ダイワ S M A 専用）58,981,399円、ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）666,925,979円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）28,059,683円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）38,439,393円です。
- * 当期末の計算口数当りの純資産額は19,973円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月16日 至2017年3月15日

項 目	当 期	
	当	期
(A) 配当等収益	2,000,118,172円	
受取配当金	1,999,695,823	
受取利息	661,625	
支払利息	△ 239,276	
(B) 有価証券売買損益	5,633,196,513	
売買益	14,580,927,421	
売買損	△ 8,947,730,908	
(C) その他費用	△ 102,928,968	
(D) 当期損益金(A + B + C)	7,530,385,717	
(E) 前期繰越損益金	57,098,596,364	
(F) 解約差損益金	△ 7,024,255,195	
(G) 追加信託差損益金	126,478,306	
(H) 合計(D + E + F + G)	57,731,205,192	
次期繰越損益金(H)	57,731,205,192	

- (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。