

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	追加型投信／海外／株式
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	追加型投信／国内／債券
信託期間	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	約10年間（2011年4月19日～2021年4月16日）
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	約9年11か月間（2011年5月16日～2021年4月16日）
運用方針	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	世界（※）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。また、DR（預託証券）を含みます。）（※）日本を除きます。以下同じ。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	イ、ダイワ・マネーストック・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券 ロ、円建ての債券
運用方法	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	①主として、世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）の中から、割安と判断される株式を厳選して投資することにより信託財産の成長をめざします。 ②以下の方針を基本として運用を行いません。 イ、世界の株式の中から流動性等を勘案し、投資対象銘柄を選定します。 ロ、投資対象銘柄から、PERやPBR等の株価バリュエーション等を考慮し、調査対象銘柄を決定します。 ハ、調査対象銘柄に対して企業訪問による調査や綿密な財務分析等を行ない、株式の本源的価値（※）と比較し割安と判断される銘柄を組入候補銘柄とします。 ※株式の本源的価値とは、ハリス・アンソニエツ・エル・ビーが独自に評価した企業本来の価値をいいます。 ニ、組入候補銘柄から銘柄を厳選し、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、ハリス・アンソニエツ・エル・ビーに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④株式の組入比率は、通常の状態では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いません。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド マネー・ポートフォリオ	①マザーファンドの受益証券および円建ての債券を中心に投資することにより、安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
組入制限	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	・株式組入上限比率は無制限
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の10%以下
分配方針	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	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、分配を行わないことがあります。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	分配対象額は、経費控除後の配当等収益とし、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、分配を行わないことがあります。

※ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。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ペビーファンド（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／ハリス世界厳選株ファンド ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ

運用報告書（全体版） 第7期 （決算日 2018年4月18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／ハリス世界厳選株ファンド」および「ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ」は、このたび、第7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/>

<4797>

<4799>

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数(円換算)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
3期末(2014年4月18日)	円 14,592	円 1,000	% 33.7	15,920	% 25.4	% 95.7	% -	百万円 17,374
4期末(2015年4月20日)	16,609	700	18.6	19,386	21.8	97.4	-	16,852
5期末(2016年4月18日)	13,070	0	△21.3	16,666	△14.0	96.2	-	11,813
6期末(2017年4月18日)	14,962	600	19.1	18,674	12.0	96.5	-	10,443
7期末(2018年4月18日)	16,929	450	16.2	20,961	12.2	96.5	-	9,060

(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。

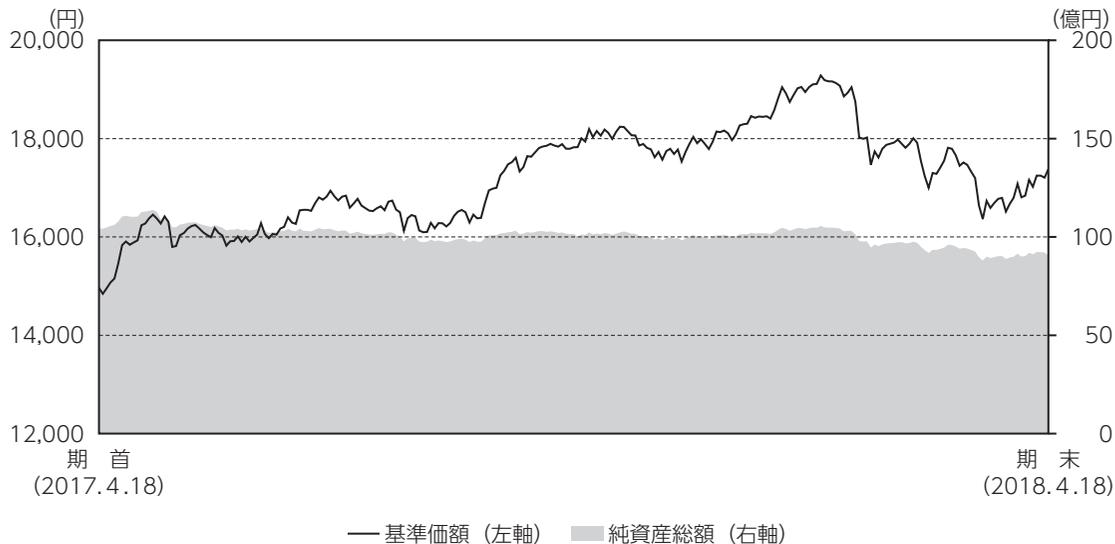
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■ 基準価額・騰落率

期 首：14,962円

期 末：16,929円 (分配金450円)

騰落率：16.2% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

海外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／ハリス世界厳選株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数(円換算)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2017年 4月18日	円 14,962	% -	18,674	% -	% 96.5	% -
4 月末	15,841	5.9	19,392	3.8	96.1	-
5 月末	16,038	7.2	19,618	5.1	96.0	-
6 月末	16,292	8.9	19,882	6.5	96.7	-
7 月末	16,537	10.5	20,023	7.2	95.6	-
8 月末	16,429	9.8	19,903	6.6	94.3	-
9 月末	17,630	17.8	20,792	11.3	97.2	-
10月末	17,994	20.3	21,249	13.8	95.7	-
11月末	17,897	19.6	21,360	14.4	96.0	-
12月末	18,409	23.0	21,990	17.8	95.4	-
2018年 1 月末	18,859	26.0	22,224	19.0	95.5	-
2 月末	17,917	19.8	21,186	13.5	97.1	-
3 月末	16,776	12.1	20,241	8.4	97.7	-
(期末) 2018年 4月18日	17,379	16.2	20,961	12.2	96.5	-

(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

(2017.4.19～2018.4.18)

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。世界的な景気回復や堅調な企業業績動向、米国の税制改革による企業利益の拡大への期待、原油価格の回復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基調となりました。その後、米国の雇用統計が市場予想を上回り、米国の長期金利が上昇したことなどをを受けて、2月上旬にかけて下落しました。期末にかけては、好調な世界経済や決算発表などを受けていったんは上昇に転じましたが、米国の利上げ加速への警戒感や貿易摩擦への懸念などから反発力は限定的なものにとどまりました。

■為替相場

米ドルは対円で下落しました。堅調な米国経済やインフレ圧力の高まりによる米国の利上げペース加速観測などをを受けて、期首から2017年12月にかけては米ドル高円安傾向で推移しました。その後、米国金利の上昇や貿易摩擦への懸念などを背景に株価が下落する中で市場のリスク回避姿勢が強まり、期末にかけては米ドル安円高傾向で推移しました。

前期における「今後の運用方針」

ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資してまいります。地政学的な状況は依然として不透明ですが、引き続き、一時的な株価調整局面は企業の本源的価値に対して割安な水準で投資する機会と捉え、短期的な損益ではなく、長期投資のリターンを追求していきます。

地域別では、米国に加えて本源的価値と比較して割安な銘柄が多い英国、ドイツ、スイスなど欧州中心のポートフォリオを維持します。

ポートフォリオについて

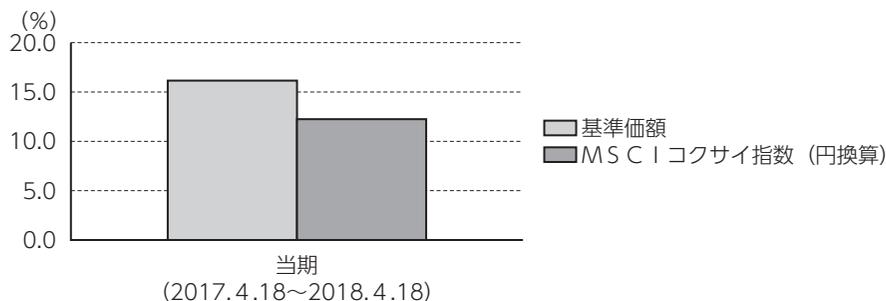
(2017.4.19～2018.4.18)

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、ハリス・アソシエイツ・エル・ピーに運用の指図にかかる権限を委託しております。株式組入比率は、高位に維持しました。銘柄選定にあたって、ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資しました。個別銘柄では、DAIMLER AG（ドイツ、一般消費財・サービス）、LLOYDS BANKING（英国、金融）、ALLIANZ（ドイツ、金融）などを高位で組み入れました。

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。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。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は450円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「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	
	2017年4月19日 ～2018年4月18日	
当期分配金（税込み）	（円）	450
対基準価額比率	（％）	2.59
当期の収益	（円）	450
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	6,963

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	214.49円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,121.03
(c) 収益調整金	1,635.46
(d) 分配準備積立金	4,442.08
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	7,413.07
(f) 分配金	450.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,963.07

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資してまいります。地政学リスクや中央銀行の政策変更、自然災害、金利上昇などによる一時的な株価調整局面は企業の本源的価値に対して割安な水準で投資する機会と捉え、短期的な損益ではなく、長期投資のリターンを追求していきます

地域別では、米国に加えて本源的価値と比較して割安な銘柄が多い英国、ドイツ、スイスなど欧州中心のポートフォリオを維持します。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.4.19~2018.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	335円	1.944%	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17,213円です。
(投 信 会 社)	(195)	(1.134)	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)	(130)	(0.756)	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)	(9)	(0.054)	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	6	0.034	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)	(6)	(0.034)	
有 価 証 券 取 引 税	3	0.017	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)	(3)	(0.017)	
そ の 他 費 用	9	0.052	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)	(8)	(0.045)	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)	(1)	(0.005)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	352	2.047	

(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。

(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
株式

(2017年4月19日から2018年4月18日まで)

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
外	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
アメリカ	3,696.75 ()	12,818 (△ 77)	4,672.75	22,880
外	百株	千オーストラリア・ドル	百株	千オーストラリア・ドル
オーストラリア	1,513 ()	565 ()	2,667	943
外	百株	千イギリス・ポンド	百株	千イギリス・ポンド
イギリス	8,600 ()	1,289 ()	26,507	4,255
外	百株	千スイス・フラン	百株	千スイス・フラン
スイス	1,283.7 (2,991)	4,336 (△ 422)	5,819.4	7,924
外	百株	千インド・ルピー	百株	千インド・ルピー
インド	1,108 ()	57,172 ()	-	-
外	百株	千韓国ウォン	百株	千韓国ウォン
韓国	()	()	1.95	422,592
外	百株	千南アフリカ・ランド	百株	千南アフリカ・ランド
南アフリカ	74 ()	22,468 ()	-	-
国	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
ユーロ (オランダ)	219 ()	449 ()	2,996	4,232

■主要な売買銘柄
株式

(2017年4月19日から2018年4月18日まで)

当				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
GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	96.9	266,358	2,748	WIRECARD AG (ドイツ)	44.26	412,870	9,328
LAFARGEHOLCIM LTD-REG (スイス)	35.57	224,090	6,299	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG (スイス)	209.8	377,175	1,797
LIBERTY GLOBAL PLC-C (イギリス)	62.2	223,291	3,589	BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	15.225	364,252	23,924
NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	7.4	201,089	27,174	CNH INDUSTRIAL NV (オランダ)	250.3	337,050	1,346
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL (アイルランド)	45.9	193,351	4,212	ALLIANZ SE-REG (ドイツ)	12.325	292,564	23,737
BAYER AG-REG (ドイツ)	14.3	172,885	12,089	DIAGEO PLC (イギリス)	77	275,084	3,572
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A (アメリカ)	3.97	159,078	40,070	LLOYDS BANKING GROUP PLC (イギリス)	2,529.4	251,249	99
BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	6.905	136,602	19,783	MTU AERO ENGINES AG (ドイツ)	13.685	247,626	18,094
LIBERTY GLOBAL PLC-A (イギリス)	30.9	111,725	3,615	UNION PACIFIC CORP (アメリカ)	18.305	217,305	11,871
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG (スイス)	69.2	107,602	1,554	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	72.5	213,037	2,938

(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	
	株数	金額	株数	金額
外	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
ユーロ (ドイツ)	332.85 ()	3,307 ()	926.05	8,792
外	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
ユーロ (ユーロ 通貨計)	551.85 ()	3,757 ()	3,922.05	13,024

(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。

■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4月19日から2018年4月18日まで)

項目	当	期
(a) 期中の株式売買金額		8,817,242千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額		9,720,294千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)		0.90

(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
外国株式

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
(アメリカ)	百株	百株	千ドル	千円	
ARCONIC INC	202	531	1,261	135,192	資本財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	491	198	771	82,716	一般消費財・サービス
CITIGROUP INC	653.4	492.5	3,434	368,199	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	-	417	592	63,477	一般消費財・サービス
TE CONNECTIVITY LTD	593.7	385	3,882	416,228	情報技術
CORELOGIC INC	-	203	922	98,884	情報技術
BAIDU INC - SPON ADR	140.3	57.1	1,345	144,256	情報技術
LIBERTY GLOBAL PLC-A	-	309	975	104,541	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	1,199	897	3,518	377,133	一般消費財・サービス
ALPHABET INC-CL C	48.92	36.62	3,933	421,679	情報技術
LIBERTY GLOBAL PLC- C	-	566	1,721	184,513	一般消費財・サービス
ITRON INC	260.25	-	-	-	情報技術
TENET HEALTHCARE CORP	763	656	1,579	169,338	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	-	39.7	1,232	132,135	一般消費財・サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	-	459	1,573	168,723	資本財・サービス
UNION PACIFIC CORP	183.05	-	-	-	資本財・サービス
ORACLE CORP	671	519	2,421	259,601	情報技術
MASTERCARD INC - A	300.95	179.5	3,201	343,168	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	1,985	1,260	3,785	405,756	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	501	412	1,548	166,021	エネルギー
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,063	898	2,186	234,406	一般消費財・サービス
CARMAX INC	306	179.15	1,128	120,933	一般消費財・サービス
USG CORP	662	446	1,841	197,364	資本財・サービス
GRUPO TELEVIS SA-SPON ADR	1,079	986	1,788	191,738	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>	11,102.57 18銘柄	10,126.57 22銘柄	44,645 <52.8%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千ドル	千円	
INCITEC PIVOT LTD.	10,746.27	9,592.27	3,472	289,181	素材
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	10,746.27 1銘柄	9,592.27 1銘柄	289,181 <3.2%>	
(イギリス)	百株	百株	千ポンド	千円	
DIAGEO PLC	855	366	895	137,276	生活必需品
LLOYDS BANKING GROUP PLC	60,969	43,935	2,972	455,735	金融
TRAVIS PERKINS PLC	1,607	1,223	1,568	240,466	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	63,431 3銘柄	45,524 3銘柄	5,436 <9.2%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,265	1,859	2,974	329,563	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	584.3	398.9	2,306	255,553	金融
CIE FINANCIERE RICHENMONT-REG	222.6	154.2	1,446	160,294	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	328.22	443.32	2,375	263,184	素材
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,400.12 4銘柄	2,855.42 4銘柄	9,102 <11.1%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
AXIS BANK LTD	-	1,108	58,989	96,743	金融
インド・ルピー 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	1,108 58,989	96,743 <1.1%>	

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	1.95	-	-	-	情報技術
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1.95 1銘柄	- -	- ->	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
NASPERS LTD-N SHS	-	74	22,265	199,278	一般消費財・サービス
南アフリカ・ランド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	22,265 1銘柄	199,278 <2.2%>	
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	424.07	45.07	145	19,255	ヘルスケア
CNH INDUSTRIAL NV	4,885	2,487	2,544	337,361	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,309.07 2銘柄	2,532.07 2銘柄	2,689 <3.9%>	
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	-	143	1,439	190,907	ヘルスケア
ALLIANZ SE-REG	256.05	171.95	3,303	438,044	金融
WIRECARD AG	425.6	-	-	-	情報技術
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	672.2	531.85	3,510	465,453	一般消費財・サービス
MTU AERO ENGINES AG	130.1	43.95	604	80,190	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,483.95 4銘柄	890.75 4銘柄	8,858 1,174,595 <13.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,793.02 6銘柄	3,422.82 6銘柄	11,547 1,531,212 <16.9%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	96,474.93 33銘柄	72,703.08 38銘柄	- 8,744,501 <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) < >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4月18日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 8,744,501	% 92.2
コール・ローン等、その他	741,721	7.8
投資信託財産総額	9,486,222	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、4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.20円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1イギリス・ポンド=153.31円、1スイス・フラン=110.80円、1スウェーデン・クローネ=12.75円、1インド・ルピー=1.64円、1南アフリカ・ランド=8.95円、1ユーロ=132.60円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(8,982,712千円)の投資信託財産総額(9,486,222千円)に対する比率は、94.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,604,782,699円
コール・ローン等	711,240,573
株式(評価額)	8,744,501,314
未収入金	141,594,326
未収配当金	7,446,486
(B) 負債	544,476,416
未払金	207,837,821
未払収益分配金	240,841,585
未払信託報酬	95,530,751
その他未払費用	266,259
(C) 純資産総額(A - B)	9,060,306,283
元本	5,352,035,242
次期繰越損益金	3,708,271,041
(D) 受益権総口数	5,352,035,242口
1万口当り基準価額(C/D)	16,929円

*期首における元本額は6,979,690,048円、当期中における追加設定元本額は449,481,144円、同解約元本額は2,077,135,950円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は16,929円です。

■損益の状況

当期 自2017年4月19日 至2018年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	133,982,651円
受取配当金	132,417,162
受取利息	1,669,842
支払利息	△ 104,353
(B) 有価証券売買損益	1,273,087,459
売買益	1,938,872,828
売買損	△ 665,785,369
(C) 信託報酬等	△ 201,521,235
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,205,548,875
(E) 前期繰越損益金	1,886,649,445
(F) 追加信託差損益金	856,914,306
(配当等相当額)	(875,306,218)
(売買損益相当額)	(△ 18,391,912)
(G) 合計(D + E + F)	3,949,112,626
(H) 収益分配金	△ 240,841,585
次期繰越損益金(G + H)	3,708,271,041
追加信託差損益金	856,914,306
(配当等相当額)	(875,306,218)
(売買損益相当額)	(△ 18,391,912)
分配準備積立金	2,851,356,735

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

(注4) 投資信託財産の運用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：65,603,366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	114,797,829円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	599,982,182
(c) 収益調整金	875,306,218
(d) 分配準備積立金	2,377,418,309
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,967,504,538
(f) 分配金	240,841,585
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,726,662,953
(h) 受益権総口数	5,352,035,242口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	450円

- <分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、4月18日現在の基準価額（1万口当り16,929円）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（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。

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／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 率 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	税 分	込 配 金	期 騰 落 中 率		
3 期 末 (2014 年 4 月 18 日)	円 10,012	円 0	% 0.0	% 72.6	百万円 464
4 期 末 (2015 年 4 月 20 日)	10,012	0	0.0	38.4	394
5 期 末 (2016 年 4 月 18 日)	10,012	0	0.0	1.4	285
6 期 末 (2017 年 4 月 18 日)	10,006	0	△0.1	26.7	616
7 期 末 (2018 年 4 月 18 日)	9,999	0	△0.1	—	185

(注1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

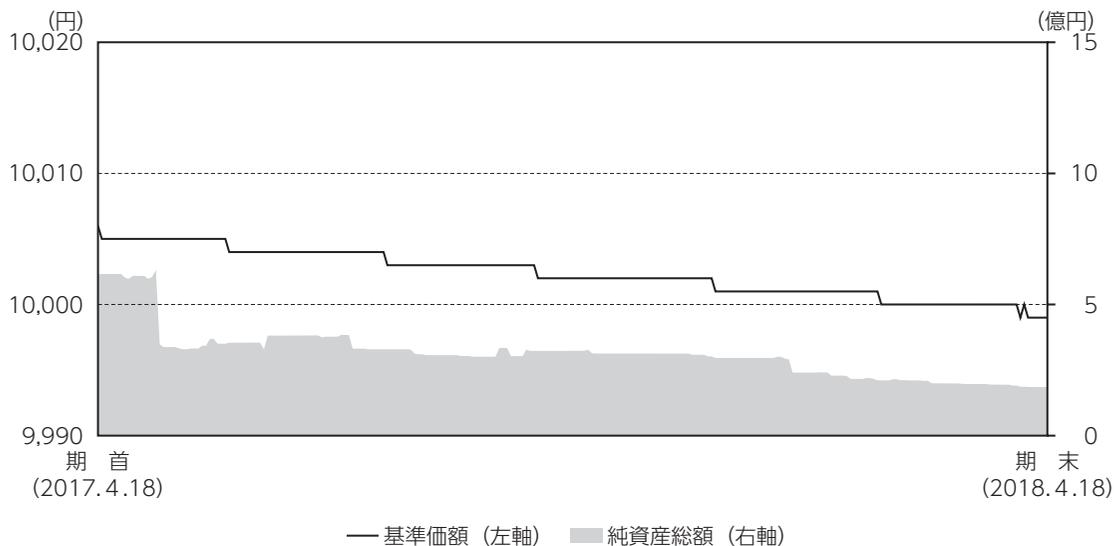
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、ダイワ／ハリス世界厳選株ファンドの資金をスイッチングにより一時滞留させる受け皿としての役割をもったファンドであり、円建ての債券を中心に、安定運用を行ないます。そのため、ベンチマークおよび参考指数はありません。



運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

期首：10,006円

期末：9,999円

騰落率：△0.1%

■基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の受益証券を通じて投資した短期の国債やコール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

年 月 日	基 準	価 額		公 社 比 債 率 組 入 比 率
		騰 落 率	率	
(期首) 2017年 4月18日	円	10,006	% -	% 26.7
4 月末		10,005	△0.0	24.9
5 月末		10,005	△0.0	4.4
6 月末		10,004	△0.0	0.4
7 月末		10,004	△0.0	0.1
8 月末		10,003	△0.0	-
9 月末		10,003	△0.0	-
10月末		10,002	△0.0	-
11月末		10,002	△0.0	-
12月末		10,001	△0.0	-
2018年 1 月末		10,001	△0.0	-
2 月末		10,000	△0.1	0.3
3 月末		10,000	△0.1	-
(期末) 2018年 4月18日		9,999	△0.1	-

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.4.19～2018.4.18)

■国内短期金融市況

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が維持されるなか、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

■ダイワ・マネーストック・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

ポートフォリオについて

(2017.4.19～2018.4.18)

■当ファンド

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

■ダイワ・マネーストック・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。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4月19日 ～2018年4月18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)	—
翌期繰越分配可能額	(円)	8

(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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益です。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いません。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

上記の運用方針により、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資する場合があります。今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご注意くださいようお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2017.4.19~2018.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	一円	—%	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10,002円です。
(投 信 会 社)	(一)	(一)	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)	(一)	(一)	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)	(一)	(一)	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	—	—	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
有 価 証 券 取 引 税	—	—	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
そ の 他 費 用	0	0.002	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.000)	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)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.002	

(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4月19日から2018年4月18日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	159,761	160,286	460,355	461,861

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の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。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年4月19日から2018年4月18日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 23,960	百万円 4,880	% 20.4	百万円 -	百万円 -	% -
コール・ローン	8,320,094	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.6%

*平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	429,899	129,306	129,668

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	129,668	70.0
コール・ローン等、その他	55,574	30.0
投資信託財産総額	185,242	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	185,242,666円
コール・ローン等	55,574,058
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	129,668,608
(B) 負債	2,040
未払解約金	999
その他未払費用	1,041
(C) 純資産総額(A - B)	185,240,626
元本	185,251,275
次期繰越損益金	△ 10,649
(D) 受益権総口数	185,251,275□
1万口当り基準価額(C/D)	9,999円

*期首における元本額は615,919,777円、当期中における追加設定元本額は235,377,931円、同解約元本額は666,046,433円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,999円です。

*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は10,649円です。

■損益の状況

当期 自2017年4月19日 至2018年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 28,247円
受取利息	30,178
支払利息	△ 58,425
(B) 有価証券売買損益	△ 66,017
売買益	49,967
売買損	△115,984
(C) 信託報酬等	△ 3,707
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 97,971
(E) 前期繰越損益金	△ 31,504
(F) 追加信託差損益金	118,826
(配当等相当額)	(156,767)
(売買損益相当額)	(△ 37,941)
(G) 合計(D + E + F)	△ 10,649
次期繰越損益金(G)	△ 10,649
追加信託差損益金	118,826
(配当等相当額)	(156,767)
(売買損益相当額)	(△ 37,941)
分配準備積立金	6,316
繰越損益金	△135,791

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	156,767
(d) 分配準備積立金	6,316
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	163,083
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	163,083
(h) 受益権総口数	185,251,275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。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ）が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2017年12月11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（2018年4月18日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を20ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年4月19日から2018年4月18日まで)

買		付		売		付	
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
			千円				千円
669	国庫短期証券 2017/6/12		6,970,248				
660	国庫短期証券 2017/5/1		3,900,062				
644	国庫短期証券 2017/5/12		2,920,029				
650	国庫短期証券 2017/6/12		2,490,050				
665	国庫短期証券 2017/5/22		2,190,078				
659	国庫短期証券 2017/4/24		1,640,009				
661	国庫短期証券 2017/5/8		830,025				
679	国庫短期証券 2017/7/31		740,008				
671	国庫短期証券 2017/6/19		650,005				
672	国庫短期証券 2017/6/26		440,006				

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

2018年4月18日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第8期 (決算日 2017年12月11日)

(計算期間 2016年12月10日～2017年12月11日)

ダイワ・マネースtock・マザーファンドの第8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	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
運用方法	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

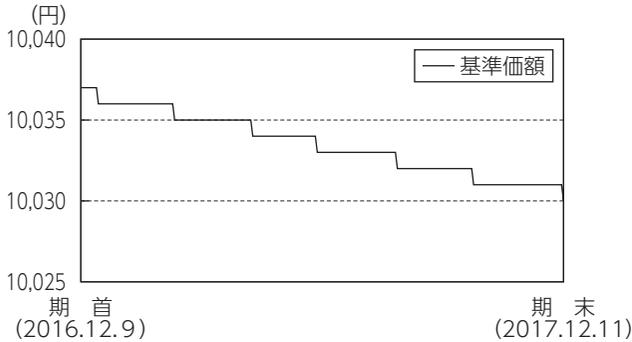
大和投資信託

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/>

■当期中の基準価額の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 率	
	騰 落 率	騰 落 率	組 入 比 率	組 入 比 率
(期首)2016年12月9日	円	%	%	%
	10,037	-	-	29.1
12月末	10,036	△0.0	-	-
2017年1月末	10,036	△0.0	31.1	-
2月末	10,035	△0.0	25.2	-
3月末	10,035	△0.0	-	-
4月末	10,034	△0.0	35.6	-
5月末	10,034	△0.0	6.4	-
6月末	10,033	△0.0	0.6	-
7月末	10,033	△0.0	0.1	-
8月末	10,032	△0.0	-	-
9月末	10,032	△0.0	-	-
10月末	10,031	△0.1	-	-
11月末	10,031	△0.1	-	-
(期末)2017年12月11日	10,030	△0.1	-	-

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
 (注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,037円 期末：10,030円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

期首より、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

◆ポートフォリオについて

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行ないません。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(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
公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

国 内	国債証券	買 付 額	売 付 額
		千円	千円
		116,573,085	(128,940,000)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()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3) 単位未満は四捨五入。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
645 国庫短期証券 2017/2/20	17,010,400		
657 国庫短期証券 2017/4/17	10,150,199		
652 国庫短期証券 2017/3/27	9,790,078		
642 国庫短期証券 2017/2/6	9,700,144		
659 国庫短期証券 2017/4/24	9,120,282		
651 国庫短期証券 2017/3/21	7,630,194		
669 国庫短期証券 2017/6/12	6,970,248		
644 国庫短期証券 2017/5/12	6,690,300		
638 国庫短期証券 2017/1/16	5,120,041		
660 国庫短期証券 2017/5/1	4,590,081		

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は四捨五入。

■組入資産明細表

当期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	30,906,278	100.0
投資信託財産総額	30,906,278	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	30,906,278,899円
コール・ローン等	30,906,278,899
(B) 負債	799,000,000
未払解約金	799,000,000
(C) 純資産総額(A - B)	30,107,278,899
元本	30,015,878,475
次期繰越損益金	91,400,424
(D) 受益権総口数	30,015,878,475口
1万口当り基準価額(C / D)	10,030円

* 期首における元本額は42,294,564,193円、当期中における追加設定元本額は17,178,092,718円、同解約元本額は29,456,778,436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、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド (為替ヘッジあり) 3,021,993円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド (為替ヘッジなし) 1,018,149円、ダイワ米国バンクローン・ファンド (為替ヘッジあり) 2014-07 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド (為替ヘッジあり) 2014-09 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド (為替ヘッジあり) 2014-11 9,962円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド - ロボテック-947,268円、ダイワ/ミレニアセット・インド株式ファンド-インドの匠-29,910,270円、新興国ソブリン・豪ドルファンド (毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ブラジルリアルファンド (毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型) 999円、U.S 短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型) 102,434円、U.S 短期高利回り社債ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型) 1,994円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド - ロボテック (為替ヘッジあり) 39,849円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり) 3,985円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス3,969,366,810円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインパース・インデックス5,902,244,309円、ダイワ上場投信-TOP I Xレバレッジ (2倍) 指数1,105,650,011円、ダイワ上場投信-TOP I Xダブルインパース (-2倍) 指数821,890,786円、ダイワ上場投信-日経平均インパース・インデックス6,073,206,032円、ダイワ上場投信-TOP I Xインパース (-1倍) 指数5,071,127,230円、ダイワ上場投信-J P X日経400レバレッジ・インデックス383,378,807円、ダイワ上場投信-J P X日経400インパース・インデックス5,200,107,448円、ダイワ上場投信-J P X日経400ダブルインパース・インデックス205,174,656円、ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (部分為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2017-06 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (部分為替ヘッジあり) 2017-06 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016-10 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (部分為替ヘッジあり) 2016-10 997円、ダイワ・ブルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ28,215,782円、ダイワ・ブルベア・セレクト ドル高円安ポートフォリオ104,220,911円、ダイワ・ブルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ49,706,154円、ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネー

ポートフォリオ - S Lトレード-641,089,307円、ダイワ/モルガン・スタンレー新興4カ国不動産関連ファンド-成長の福音 (つちおと) -5,020,480円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ206,680,116円、ダイワ・アセア内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ126,940,913円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株ファンドII 豪ドル・コース (毎月分配型) 4,184,518円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株ファンドII ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株ファンドII 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 4,981,569円、ダイワU.S 短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型) 9,957円、ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり) 997円、ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジなし) 997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり) 997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジなし) 997円、ダイワ/ミレニアセット垂直株式ファンド 9,958,176円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり 49,806円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし 49,806円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 米ドル・コース4,980,080円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース3,685,259円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回) -100,588円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり (毎月分配型) 399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし (毎月分配型) 99,771円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース (毎月分配型) 399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース (毎月分配型) 99,771円、ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株ファンド (為替ヘッジあり) 2,088,438円、ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株ファンド (為替ヘッジなし) 1,012,911円、ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド10,009,811円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 日本円・コース (毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型) 99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 日本円・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 豪ドル・コース499,994円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 ブラジル・リアル・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 米ドル・コース9,976,045円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース2,001,563円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,030円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月10日 至2017年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 21,002,641円
受取利息	△ 3,317,956
支払利息	△ 17,684,685
(B) 有価証券売買損益	△ 4,086
売買損	△ 4,086
(C) その他費用	△ 329,559
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 21,336,286
(E) 前期繰越損益金	155,223,882
(F) 解約差損益金	△ 99,854,368
(G) 追加信託差損益金	57,367,196
(H) 合計(D + E + F + G)	91,400,424
次期繰越損益金(H)	91,400,424

(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。