

★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／海外／株式	
信託期間	約5年間（2014年5月30日～2019年5月17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	当ファンド	イ．ケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲーダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」（以下「ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ．ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネー・マザーファンド	本邦通貨表示の公社債
当ファンドの運用方法	①主として、ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）の受益証券を通じて、相対的に配当利回りの高い英国の株式等（※）への投資と株式等および通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。 （※）不動産投資信託証券を含みます。 ②当ファンドは、ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）では、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。	
マザーファンドの運用方法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（Ａ－２格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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	当ファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下
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、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準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。	

ダイワ英国高配当株ツインα
（毎月分配型）

運用報告書（全体版）

第41期（決算日	2017年12月18日）
第42期（決算日	2018年1月17日）
第43期（決算日	2018年2月19日）
第44期（決算日	2018年3月19日）
第45期（決算日	2018年4月17日）
第46期（決算日	2018年5月17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、「ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型）」は、このたび、第46期の決算を行ないました。

ここに、第41期～第46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/>

最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			M S C I 英国指数 (配当込み、円換算)		英ポンド為替レート		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 分 配	期 騰 落 率	(参考指数)	期 騰 落 率	(参考指数)	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	円	%	%	%	百万円
17期末(2015年12月17日)	8,630	110	△ 1.8	9,950	△ 3.3	183.53	△2.0	0.0	99.2	10,721
18期末(2016年 1 月18日)	7,544	110	△11.3	8,670	△12.9	166.82	△9.1	0.0	99.2	9,206
19期末(2016年 2 月17日)	7,269	110	△ 2.2	8,597	△ 0.8	163.34	△2.1	0.0	98.1	8,552
20期末(2016年 3 月17日)	7,355	110	2.7	8,984	4.5	160.92	△1.5	0.0	98.8	8,417
21期末(2016年 4 月18日)	7,134	110	△ 1.5	8,821	△ 1.8	153.22	△4.8	－	99.1	7,918
22期末(2016年 5 月17日)	6,893	110	△ 1.8	8,819	△ 0.0	157.43	2.7	0.0	99.4	7,380
23期末(2016年 6 月17日)	6,172	110	△ 8.9	8,147	△ 7.6	149.54	△5.0	0.0	99.5	6,257
24期末(2016年 7 月19日)	6,301	110	3.9	8,628	5.9	140.43	△6.1	0.0	99.7	6,023
25期末(2016年 8 月17日)	5,984	110	△ 3.3	8,368	△ 3.0	131.34	△6.5	0.0	99.4	5,570
26期末(2016年 9 月20日)	5,867	110	△ 0.1	8,379	0.1	132.88	1.2	0.0	99.1	5,177
27期末(2016年10月17日)	5,754	110	△ 0.1	8,247	△ 1.6	126.92	△4.5	0.0	99.6	4,868
28期末(2016年11月17日)	5,769	110	2.2	8,489	2.9	135.26	6.6	0.0	99.3	4,770
29期末(2016年12月19日)	6,118	110	8.0	9,602	13.1	146.91	8.6	0.0	99.1	4,893
30期末(2017年 1 月17日)	5,797	110	△ 3.4	9,391	△ 2.2	137.53	△6.4	0.0	99.4	4,556
31期末(2017年 2 月17日)	5,850	110	2.8	9,668	2.9	141.75	3.1	0.0	99.3	4,489
32期末(2017年 3 月17日)	5,814	110	1.3	9,800	1.4	140.22	△1.1	0.0	99.5	4,359
33期末(2017年 4 月17日)	5,639	110	△ 1.1	9,414	△ 3.9	135.81	△3.1	0.0	99.1	4,121
34期末(2017年 5 月17日)	5,894	110	6.5	10,379	10.2	145.47	7.1	0.0	99.4	4,205
35期末(2017年 6 月19日)	5,652	110	△ 2.2	10,086	△ 2.8	141.86	△2.5	0.0	99.6	3,994
36期末(2017年 7 月18日)	5,620	110	1.4	10,366	2.8	146.75	3.4	－	99.1	3,949
37期末(2017年 8 月17日)	5,426	110	△ 1.5	10,120	△ 2.4	141.77	△3.4	－	99.5	3,847
38期末(2017年 9 月19日)	5,322	110	0.1	10,519	3.9	150.67	6.3	－	96.3	4,123
39期末(2017年10月17日)	5,425	110	4.0	10,789	2.6	148.68	△1.3	－	98.8	4,231
40期末(2017年11月17日)	5,188	110	△ 2.3	10,636	△ 1.4	149.19	0.3	－	99.1	4,035
41期末(2017年12月18日)	5,190	110	2.2	10,886	2.4	150.30	0.7	－	98.2	4,018
42期末(2018年 1 月17日)	5,271	110	3.7	11,460	5.3	152.57	1.5	－	98.6	4,056
43期末(2018年 2 月19日)	4,779	110	△ 7.2	10,589	△ 7.6	149.28	△2.2	－	98.5	3,724
44期末(2018年 3 月19日)	4,592	110	△ 1.6	10,322	△ 2.5	147.67	△1.1	－	98.6	3,589
45期末(2018年 4 月17日)	4,605	110	2.7	10,827	4.9	153.60	4.0	－	98.1	3,611
46期末(2018年 5 月17日)	4,560	110	1.4	11,373	5.0	149.42	△2.7	－	98.6	3,550

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) M S C I 英国指数（配当込み、円換算）は、M S C I I n c . の承諾を得て、M S C I 英国指数（配当込み、英ポンドベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。M S C I 英国指数（配当込み、英ポンドベース）は、M S C I I n c . が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I I n c . に帰属します。またM S C I I n c . 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) 為替レートは、計算日における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を採用しています。

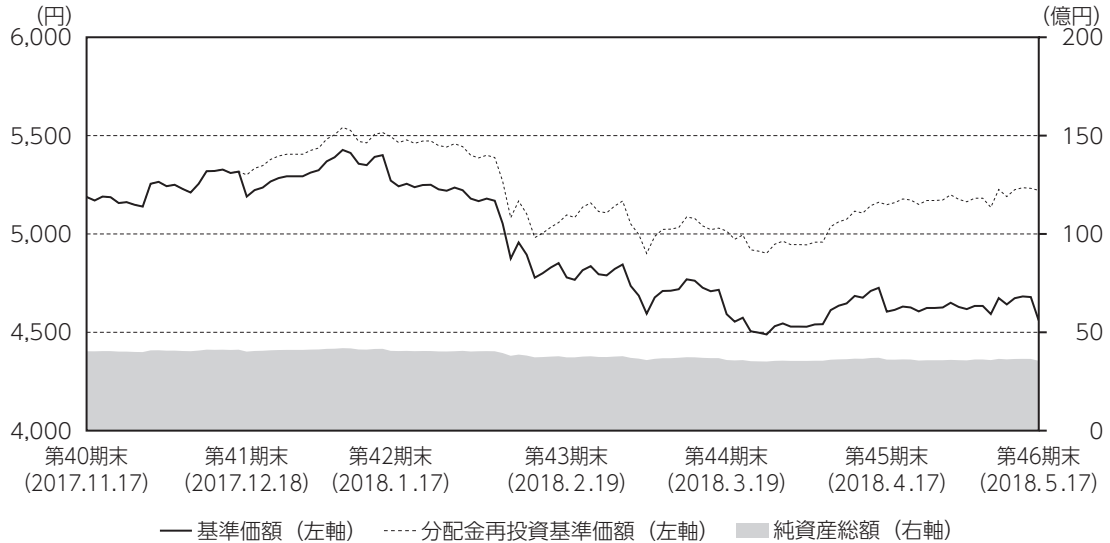
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。



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

第41期首：5,188円

第46期末：4,560円（既払分配金660円）

騰 落 率：0.6%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

英国株式市況は、英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展や、米国税制改革の進展期待、原油価格の値上がりなどから上昇しました。一方英ポンドは、EU離脱交渉の進展は好感されたものの、軟調な経済指標の発表などから対円でおおむね横ばいとなりました。これらの結果、基準価額は上昇しました。英国株式市況の動向につきましては、「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		M S C I 英国指数 (配当込み、円換算)		英ポンド為替レート		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
			騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第41期	(期首) 2017年11月17日	円 5,188	% －	10,636	% －	円 149.19	% －	% －	% 99.1
	11月末	5,255	1.3	10,746	1.0	150.33	0.8	－	99.3
	(期末) 2017年12月18日	5,300	2.2	10,886	2.4	150.30	0.7	－	98.2
第42期	(期首) 2017年12月18日	5,190	－	10,886	－	150.30	－	－	98.2
	12月末	5,324	2.6	11,213	3.0	151.95	1.1	－	98.2
	(期末) 2018年 1 月17日	5,381	3.7	11,460	5.3	152.57	1.5	－	98.6
第43期	(期首) 2018年 1 月17日	5,271	－	11,460	－	152.57	－	－	98.6
	1 月末	5,180	△1.7	11,317	△1.2	153.97	0.9	－	97.7
	(期末) 2018年 2 月19日	4,889	△7.2	10,589	△7.6	149.28	△2.2	－	98.5
第44期	(期首) 2018年 2 月19日	4,779	－	10,589	－	149.28	－	－	98.5
	2 月末	4,845	1.4	10,598	0.1	149.26	△0.0	0.0	98.4
	(期末) 2018年 3 月19日	4,702	△1.6	10,322	△2.5	147.67	△1.1	－	98.6
第45期	(期首) 2018年 3 月19日	4,592	－	10,322	－	147.67	－	－	98.6
	3 月末	4,529	△1.4	10,269	△0.5	148.84	0.8	－	98.5
	(期末) 2018年 4 月17日	4,715	2.7	10,827	4.9	153.60	4.0	－	98.1
第46期	(期首) 2018年 4 月17日	4,605	－	10,827	－	153.60	－	－	98.1
	4 月末	4,650	1.0	11,081	2.3	152.17	△0.9	－	99.5
	(期末) 2018年 5 月17日	4,670	1.4	11,373	5.0	149.42	△2.7	－	98.6

(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

(2017.11.18～2018.5.17)

■英国株式市況

英国株式市況は、第41期首より、英国のEU離脱条件をめぐる交渉が合意に近づいたことを好感した買いや、米国税制改革の進展期待などから、上昇する展開となりました。2018年1月中旬以降は、世界的な株価の下落や英ポンド高米ドル安を嫌気して下落しました。3月には、世界的な貿易摩擦への懸念が高まり下落幅を拡大させる展開となりました。しかし4月から第46期末にかけては、米中両国が歩み寄りの姿勢を示す中で株価は持ち直し、原油価格の値上がりや英ポンド安の進展などを背景に上昇基調となりました。

■為替相場

英ポンドは、第41期首から2018年1月下旬にかけて、EU離脱交渉の進展や投資家のリスク選好的な姿勢の強まりにより上昇基調となりました。2月には、株価急落局面での投資家のリスク回避的な姿勢の強まりで、英ポンドは下落に転じました。3月から4月中旬にかけては、英国とEUとの間で、EU離脱の移行期間が合意されたことなどから上昇しました。しかし、軟調な経済指標が多く発表されたことや市場の利上げ予想が後退したことが英ポンドの重しとなり、第41期首からおおむね横ばいの水準で第46期末を迎えました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として、「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲーダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」（以下「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」といいます。）の組入比率を高位に維持し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・マネー・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う方針です。

ポートフォリオについて

(2017.11.18～2018.5.17)

■当ファンド

当ファンドは、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。主として、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）を通じて、相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

■ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

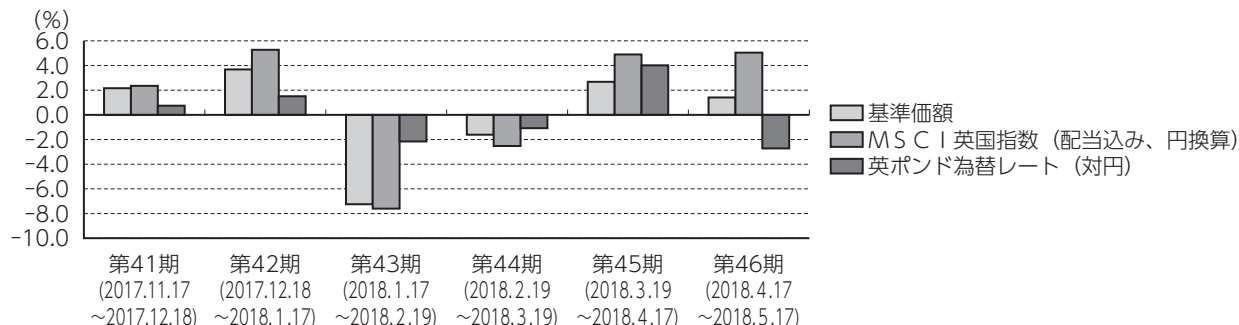
■ダイワ・マネー・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・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

第41期から第46期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ110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	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期
	2017年11月18日 ～2017年12月18日	2017年12月19日 ～2018年1月17日	2018年1月18日 ～2018年2月19日	2018年2月20日 ～2018年3月19日	2018年3月20日 ～2018年4月17日	2018年4月18日 ～2018年5月17日
当期分配金（税込み）（円）	110	110	110	110	110	110
対基準価額比率（％）	2.08	2.04	2.25	2.34	2.33	2.36
当期の収益（円）	80	75	63	59	68	58
当期の収益以外（円）	29	34	46	50	41	51
翌期繰越分配対象額（円）	1,264	1,230	1,183	1,133	1,092	1,041

（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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期
(a) 経費控除後の配当等収益	80.09円	75.96円	63.62円	59.47円	68.81円	58.98円
(b) 経費控除後の有価証券売却等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	511.90	516.16	537.29	543.98	549.02	556.45
(d) 分配準備積立金	782.20	748.09	692.97	640.29	585.04	536.44
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,374.20	1,340.21	1,293.89	1,243.75	1,202.88	1,151.88
(f) 分配金	110.00	110.00	110.00	110.00	110.00	110.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,264.20	1,230.21	1,183.89	1,133.75	1,092.88	1,041.88

（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

■当ファンド

主として、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）の組入比率を高位に維持し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

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	第41期～第46期 (2017.11.18～2018.5.17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	32円	0.655%	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4,932円です。
（投 信 会 社）	(11)	(0.214)	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）	(21)	(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）	(1)	(0.013)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.030	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
（投資信託受益証券）	(2)	(0.030)	
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	0.003	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)	(0.003)	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
合 計	34	0.689	

（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） 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

（注 3） 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 4） 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
投資信託受益証券

(2017年11月18日から2018年5月17日まで)

決 算 期	第 41 期 ～ 第 46 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国（邦貨建）	千□ 8,944.359	千円 384,564	千□ 13,857.687	千円 592,812

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。
(注2) 金額は受渡し代金。
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2017年11月18日から2018年5月17日まで)

第 41 期 ～				第 46 期			
買		付		売		付	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
UK HIGH DIVIDEND EQUITY FUND TWIN ALPHA CLASS (ケイマン諸島)	千□ 1,038.146	千円 47,000	円 45	UK HIGH DIVIDEND EQUITY FUND TWIN ALPHA CLASS (ケイマン諸島)	千□ 13,857.687	千円 592,812	円 42

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当作成期間（第41期～第46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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第 46 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) UK HIGH DIVIDEND EQUITY FUND TWIN ALPHA CLASS	千□ 84,471.641	千円 3,500,758	% 98.6

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 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17日現在

項 目	第 46 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 3,500,758	% 96.0
ダイワ・マネー・マザーファンド	99	0.0
コール・ローン等、その他	144,444	4.0
投資信託財産総額	3,645,302	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第40期末	第 46 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
ダイワ・マネー・マザーファンド	千□ 98	千□ 98	千円 99

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型）

■資産、負債、元本および基準価額の状況

（2017年12月18日）、（2018年1月17日）、（2018年2月19日）、（2018年3月19日）、（2018年4月17日）、（2018年5月17日）現在

項 目	第 41 期 末	第 42 期 末	第 43 期 末	第 44 期 末	第 45 期 末	第 46 期 末
(A) 資産	4,132,282,574円	4,149,888,024円	3,816,982,206円	3,685,024,359円	3,702,790,691円	3,645,302,682円
コール・ローン等	184,623,427	151,325,750	146,530,769	144,961,023	159,679,715	144,444,522
投資信託受益証券(評価額)	3,947,559,196	3,998,462,323	3,670,351,496	3,539,963,395	3,543,011,045	3,500,758,239
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	99,951	99,951	99,941	99,941	99,931	99,921
(B) 負債	114,203,923	93,384,420	91,994,912	95,974,922	91,781,195	95,013,408
未払収益分配金	85,157,480	84,647,877	85,736,040	85,976,147	86,257,727	85,645,668
未払解約金	24,454,949	4,197,803	1,452,600	6,128,085	1,621,530	5,295,197
未払信託報酬	4,563,571	4,483,384	4,722,019	3,763,334	3,771,490	3,918,086
その他未払費用	27,923	55,356	84,253	107,356	130,448	154,457
(C) 純資産総額(A－B)	4,018,078,651	4,056,503,604	3,724,987,294	3,589,049,437	3,611,009,496	3,550,289,274
元本	7,741,589,156	7,695,261,620	7,794,185,468	7,816,013,429	7,841,611,602	7,785,969,908
次期繰越損益金	△3,723,510,505	△3,638,758,016	△4,069,198,174	△4,226,963,992	△4,230,602,106	△4,235,680,634
(D) 受益権総口数	7,741,589,156口	7,695,261,620口	7,794,185,468口	7,816,013,429口	7,841,611,602口	7,785,969,908口
1万口当り基準価額(C/D)	5,190円	5,271円	4,779円	4,592円	4,605円	4,560円

* 第40期末における元本額は7,778,933,951円、当作成期間（第41期～第46期）中における追加設定元本額は652,760,109円、同解約元本額は645,724,152円です。

* 第46期末の計算口数当りの純資産額は4,560円です。

* 第46期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は4,235,680,634円です。

■損益の状況

第41期 自2017年11月18日 至2017年12月18日 第44期 自2018年2月20日 至2018年3月19日
第42期 自2017年12月19日 至2018年1月17日 第45期 自2018年3月20日 至2018年4月17日
第43期 自2018年1月18日 至2018年2月19日 第46期 自2018年4月18日 至2018年5月17日

項 目	第 41 期	第 42 期	第 43 期	第 44 期	第 45 期	第 46 期
(A) 配当等収益	65,329,645円	60,250,324円	54,344,609円	50,271,886円	56,092,618円	49,511,759円
受取配当金	65,332,229	60,253,833	54,348,261	50,275,376	56,096,103	49,514,516
受取利息	9	10	22	1	1	7
支払利息	△ 2,593	△ 3,519	△ 3,674	△ 3,491	△ 3,486	△ 2,764
(B) 有価証券売買損益	24,864,925	91,093,637	△ 345,840,010	△ 106,515,873	43,909,280	4,869,938
売買益	25,191,644	92,167,198	1,739,688	527,549	43,880,332	4,939,856
売買損	△ 326,719	△ 1,073,561	△ 347,579,698	△ 107,043,422	28,948	△ 69,918
(C) 信託報酬等	△ 4,591,494	△ 4,510,817	△ 4,750,916	△ 3,786,437	△ 3,794,696	△ 3,942,436
(D) 当期損益金(A+B+C)	85,603,076	146,833,144	△ 296,246,317	△ 60,030,424	96,207,202	50,439,261
(E) 前期繰越損益金	△2,666,208,060	△2,635,009,872	△2,528,945,747	△2,890,609,832	△3,022,150,317	△2,950,038,023
(F) 追加信託差損益金	△1,057,748,041	△1,065,933,411	△1,158,270,070	△1,190,347,589	△1,218,401,264	△1,250,436,204
(配当等相当額)	(396,299,514)	(397,199,099)	(418,775,442)	(425,177,963)	(430,527,131)	(433,256,776)
(売買損益相当額)	(△1,454,047,555)	(△1,463,132,510)	(△1,577,045,512)	(△1,615,525,552)	(△1,648,928,395)	(△1,683,692,980)
(G) 合計(D + E + F)	△3,638,353,025	△3,554,110,139	△3,983,462,134	△4,140,987,845	△4,144,344,379	△4,150,034,966
(H) 収益分配金	△ 85,157,480	△ 84,647,877	△ 85,736,040	△ 85,976,147	△ 86,257,727	△ 85,645,668
次期繰越損益金(G+H)	△3,723,510,505	△3,638,758,016	△4,069,198,174	△4,226,963,992	△4,230,602,106	△4,235,680,634
追加信託差損益金	△1,057,748,041	△1,065,933,411	△1,158,270,070	△1,190,347,589	△1,218,401,264	△1,250,436,204
(配当等相当額)	(396,299,514)	(397,199,099)	(418,775,442)	(425,177,963)	(430,527,131)	(433,256,776)
(売買損益相当額)	(△1,454,047,555)	(△1,463,132,510)	(△1,577,045,512)	(△1,615,525,552)	(△1,648,928,395)	(△1,683,692,980)
分配準備積立金	582,397,489	549,485,564	503,971,881	460,963,460	426,473,929	377,949,679
繰越損益金	△3,248,159,953	△3,122,310,169	△3,414,899,985	△3,497,579,863	△3,438,674,771	△3,363,194,109

(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10ページの「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	第 41 期	第 42 期	第 43 期	第 44 期	第 45 期	第 46 期
(a) 経費控除後の配当等収益	62,004,026円	58,454,567円	49,593,691円	46,485,448円	53,964,171円	45,922,564円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	396,299,514	397,199,099	418,775,442	425,177,963	430,527,131	433,256,776
(d) 分配準備積立金	605,550,943	575,678,874	540,114,230	500,454,159	458,767,485	417,672,783
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,063,854,483	1,031,332,540	1,008,483,363	972,117,570	943,258,787	896,852,123
(f) 分配金	85,157,480	84,647,877	85,736,040	85,976,147	86,257,727	85,645,668
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	978,697,003	946,684,663	922,747,323	886,141,423	857,001,060	811,206,455
(h) 受益権総口数	7,741,589,156口	7,695,261,620口	7,794,185,468口	7,816,013,429口	7,841,611,602口	7,785,969,908口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	第 41 期	第 42 期	第 43 期	第 44 期	第 45 期	第 46 期
1 万 口 当 り 分 配 金	110円	110円	110円	110円	110円	110円
(単 価)	(5,190円)	(5,271円)	(4,779円)	(4,592円)	(4,605円)	(4,560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。

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。

クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲーダイワ・UK・ハイ・
ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

当ファンド（ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型））はケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲーダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。

（注）2018年5月17日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

財政状態計算書
2017年9月30日現在

資産		
現金および現金同等物	G B P	2,897,645
投資証券の評価額（簿価：G B P 29,303,475）		30,906,375
先物取引の評価額		1,500
その他の未収金		139,100
資産合計		33,944,620
負債		
スワップ取引の評価額		317,873
その他の未払金		45,827
負債合計		363,700
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産		33,580,920
内訳		
資産成長クラス受益証券		
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産	G B P	5,590,275
発行済み償還可能参加型受益証券数		8,921,012
償還可能参加型受益証券一口当り純資産額	G B P	0.6266
ツインαクラス受益証券		
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産	G B P	27,990,645
発行済み償還可能参加型受益証券数		89,825,795
償還可能参加型受益証券一口当り純資産額	G B P	0.3116

包括利益計算書

2017年9月30日に終了した会計年度

投資による純利益	G B P	1,781,068
その他収益		148
外国為替取引による為替純損失		(15,390)
投資純利益		1,765,826
副運用会社報酬		128,957
報酬支払代行会社報酬		67,739
管理会社報酬		18,422
保管会社報酬		16,458
監査報酬		12,522
受託会社報酬		7,960
手数料		462
その他費用		2,436
営業費用合計		254,956
償還可能参加型受益証券の保有者に対する分配金		(7,914,570)
税引前損失		(6,403,700)
税額控除		(9,435)
買戻償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産の変動		(6,413,135)

組入明細
2017年9月30日

（普通株式）

銘 柄 名	株 数	評価額 (GBP)
3I GROUP PLC LONDON LINE	55,000	502,150
ADMIRAL GROUP GBP	31,000	563,270
ASTRAZENECA ORD GBP	61,000	3,022,550
BARCLAYS BANK GBP UK LINE	24,557	47,481
BERKELEY GROUP HLDGS UK LINE	7,000	260,190
BP PLC UK LINE	31,522	150,455
BT GROUP UK LINE	95,000	269,705
CONVATEC GROUP PLC GBP	50,000	136,950
CREST NICHOLSON HLDGS GBP	185,000	1,023,050
CRH ORD GBP UK LINE	6,000	170,220
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC GBP	500,000	1,818,000
GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25 UK LINE	191,000	2,843,035
HSBC HLDGS PLC UK LINE	24,039	177,191
INDIVIOR GBP	19,000	64,543
INMARSAT UK LINE	25,000	160,875
INTERMEDIATE CAPITAL GROUP UK	98,000	917,280
ITV PLC UK LINE	1,000,000	1,747,000
KCOM GROUP GBP	188,054	186,173
LADBROKES CORAL GROUP PLC GBP	270,000	329,670
LANCASHIRE HLDGS COM SHS USD0.50 WI	20,000	133,500
LEGAL AND GENERAL GRP UK LINE	895,000	2,326,105
LONMIN PLC ORD GBP	37	26
MAN GROUP PLC GBP	560,000	940,240
MARKS AND SPENCER GROUP UK LINE	450,000	1,590,300
PEARSON PLC UK LINE	230,000	1,407,600
PERSIMMON PLC UK LINE	80,000	2,065,600
PRUDENTIAL PLC UK LINE	29,000	518,085
ROYAL DUTCH SHELL A SHS UK LINE	17,000	382,245
SHIRE PLC GBP	6,000	227,280
STANDARD CHARTERED UK LINE	6,736	49,954
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC GBP	410,840	1,780,991
TALK TALK TELECOM UK LINE	110,000	230,670
TAYLOR WIMPEY PLC GBP	1,080,000	2,111,400
VODAFONE GROUP POST CON GBP	980,000	2,046,240
WPP 2012 PLC GBP	51,000	706,350

（株式先物）

銘 柄 名	枚 数	評価額 (GBP)
FTSE 100 IDX (ICF) DEC-17	15	1,099,425

（注）株式先物の評価額は投資枚数と評価単価から算出したもので、財政状態計算書の評価額とは異なります。

（スワップ取引）

取 引	想定元本 (GBP)	評価額 (GBP)
DAIWA UK HD EQ/ CREDIT SUISSE SWP GBP	26,995,617	-317,873

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型））が投資対象としている「ダイワ・マネー・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、当ファンドの第46期の決算日（2018年5月17日）現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を14ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年11月18日から2018年5月17日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
707 国庫短期証券 2017/12/11		千円 230,001			千円
723 国庫短期証券 2018/3/5		210,001			

(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

下記は、2018年5月17日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（87,794,823千口）の内容です。

国内その他有価証券

	2018年5月17日現在	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999,999	<1.1>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第13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・マザーファンドの第13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	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	本邦通貨表示の公社債
運 用 方 法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A-2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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30%以下

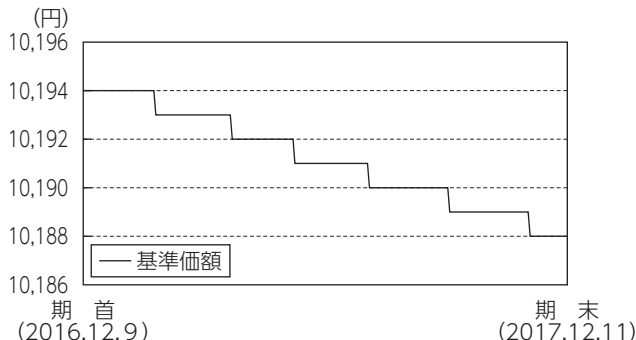
大和投資信託

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	騰 落 率	公 社 債 組 入 比 率
	円	%	%
(期首)2016年12月9日	10,194	—	30.1
12月末	10,194	0.0	—
2017年1月末	10,194	0.0	30.7
2月末	10,193	△0.0	24.6
3月末	10,193	△0.0	—
4月末	10,192	△0.0	32.5
5月末	10,191	△0.0	5.2
6月末	10,191	△0.0	0.5
7月末	10,190	△0.0	0.1
8月末	10,190	△0.0	—
9月末	10,189	△0.0	—
10月末	10,189	△0.0	—
11月末	10,188	△0.1	—
(期末)2017年12月11日	10,188	△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、利息収入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：10,194円 期末：10,188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、現先取引およびコール・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。

《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

(1) 公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

	買 付 額	売 付 額
国 内	千円	千円
国債証券	210,925,408	— (231,500,000)

(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、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

(2) その他有価証券

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

	買 付 額	売 付 額
国 内	千円	千円
国内短期社債等	246,999,814	246,999,819 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■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			期 付		
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
645	国庫短期証券 2017/2/20	27,570,641			
657	国庫短期証券 2017/4/17	17,880,344			
642	国庫短期証券 2017/2/6	17,230,250			
652	国庫短期証券 2017/3/27	16,550,132			
659	国庫短期証券 2017/4/24	16,270,410			
669	国庫短期証券 2017/6/12	15,870,490			
651	国庫短期証券 2017/3/21	13,160,344			
644	国庫短期証券 2017/5/12	11,970,533			
638	国庫短期証券 2017/1/16	9,360,075			
648	国庫短期証券 2017/3/6	7,370,272			

(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
国内その他有価証券

	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999,999	<1.4>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■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	69,737,046	100.0
投資信託財産総額	69,737,046	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	69,737,046,159円
コール・ローン等	68,737,047,077
現先取引(その他有価証券)	999,999,082
(B) 負債	60,400,000
未払解約金	60,400,000
(C) 純資産総額(A－B)	69,676,646,159
元本	68,390,547,168
次期繰越損益金	1,286,098,991
(D) 受益権総口数	68,390,547,168口
1万口当り基準価額(C／D)	10,188円

* 期首における元本額は66,967,614,984円、当期中における追加設定元本額は143,241,011,614円、同解約元本額は141,818,079,430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ＩＯＴ関連株ファンド－ＡＩ新時代－(為替ヘッジあり) 977,694円、ダイワ・グローバルＩＯＴ関連株ファンド－ＡＩ新時代－(為替ヘッジなし) 977,694円、ダイワＦＥグローバル・バリュー(為替ヘッジあり) 98,069円、ダイワＦＥグローバル・バリュー(為替ヘッジなし) 98,069円、ダイワ／「R I C I」[®] コモディティ・ファンド8,952,508円、ＵＳ債券ＮＢ戦略ファンド(為替ヘッジあり／年1回決算型) 1,676円、ＵＳ債券ＮＢ戦略ファンド(為替ヘッジなし／年1回決算型) 1,330円、ＮＢストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>米ドルコース981円、ＮＢストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース981円、ＮＢストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>世界通貨分散コース981円、ＤＣダイワ・マネー・ポートフォリオ 2,898,147,134円、ダイワファンドラップ コモディティセレクト 317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選別型) ートリプルリターンズー 日本円・コース(毎月分配型) 132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選別型) ートリプルリターンズー 豪ドル・コース(毎月分配型) 643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選別型) ートリプルリターンズー ブラジル・リアル・コース(毎月分配型) 4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選別型) ートリプルリターンズー 米ドル・コース(毎月分配型) 12,784円、ダイワ／フィデリティ北米株式ファンドー パラダイムシフター 9,853,995円、ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ 25,987,316,146円、ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ 31,864,786,854円、ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ 7,199,848,570円、ダイワＦＥグローバル・バリュー株ファンド(ダイワＳＭＡ専用) 4,090,590円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) ブラジル・リアル・コース(毎月分配型) 155,317円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 日本円・コース(毎月分配型) 38,024円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 米ドル・コース(毎月分配型) 4,380円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 豪ドル・コース(毎月分配型) 22,592円、ダイワ／アムンディ食糧増産関連ファンド 164,735円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ 68,368,780円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスⅡー 金積立型ー 501,660円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド(償還条項付き) 為替ヘッジあり 1,004,378円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(資産成長コース) 33,689円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(通貨αコース) 96,254円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドー インフラ革命ー (為替ヘッジあり) 988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドー インフラ革命ー (為替ヘッジなし) 4,926,018円、ダイワ米国ＭＬＰファンド(毎月分配型) 米ドルコース 285,029円、ダイワ米国ＭＬＰファンド(毎月分配型) 日本円コース 144,570円、ダイワ米国ＭＬＰファンド(毎月分配型) 通貨αコース 13,437,960円、ダイワ英国高配当株ツインα(毎月分配型) 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ 1,229,944円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド(ダイワＳＭＡ専用) 235,407円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 南アフリカ・ランド・コース(毎月分配型) 1,097円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) トルコ・リラ・コース 2,690円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 通貨セレクト・コース(毎月分配型) 1,350円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 通貨αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース 982,029円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選別型) ートリプルリターンズー 通貨セレクト・コース(毎月分配型) 98,174円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,188円です。

型) 38,024円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 米ドル・コース(毎月分配型) 4,380円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 豪ドル・コース(毎月分配型) 22,592円、ダイワ／アムンディ食糧増産関連ファンド 164,735円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ 68,368,780円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスⅡー 金積立型ー 501,660円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド(償還条項付き) 為替ヘッジあり 1,004,378円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(資産成長コース) 33,689円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(通貨αコース) 96,254円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドー インフラ革命ー (為替ヘッジあり) 988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドー インフラ革命ー (為替ヘッジなし) 4,926,018円、ダイワ米国ＭＬＰファンド(毎月分配型) 米ドルコース 285,029円、ダイワ米国ＭＬＰファンド(毎月分配型) 日本円コース 144,570円、ダイワ米国ＭＬＰファンド(毎月分配型) 通貨αコース 13,437,960円、ダイワ英国高配当株ツインα(毎月分配型) 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ 1,229,944円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド(ダイワＳＭＡ専用) 235,407円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 南アフリカ・ランド・コース(毎月分配型) 1,097円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) トルコ・リラ・コース 2,690円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選別型) 通貨セレクト・コース(毎月分配型) 1,350円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 通貨αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース 982,029円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選別型) ートリプルリターンズー 通貨セレクト・コース(毎月分配型) 98,174円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,188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	△ 41,076,414円
受取利息	△ 5,752,611
支払利息	△ 35,323,803
(B) 有価証券売買損益	△ 9,224
売買損	△ 9,224
(C) その他費用	△ 196,417
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 41,282,055
(E) 前期繰越損益金	1,302,196,055
(F) 解約差損益金	△ 2,715,466,915
(G) 追加信託差損益金	2,740,651,906
(H) 合計(D + E + F + G)	1,286,098,991
次期繰越損益金(H)	1,286,098,991

(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。