

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	約5年間（2015年9月8日～2020年9月4日）	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	為替あり	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）」（以下「コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）」）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	為替なし	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」（以下「コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」）といひます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
当ファンドの運用方法	為替あり	①主として、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。 ②当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・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、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・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コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）では、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。
	為替なし	①主として、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。 ②当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・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、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・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コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・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。	
組入制限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。	
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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、基準価額の水準等によっては、売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。なお、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。	

ダイワ債券コア戦略ファンド （為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版） 第1期

（決算日 2016年3月7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、「ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）」は、このたび、第1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/> <2700>

<2701>

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

★ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額	
	(分配落)	税 込 分 配 金				期 中 騰 落 率
1 期末(2016年 3 月 7 日)	円 9,781	円 130	% △ 0.9	% 0.0	% 99.2	百万円 3,500

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

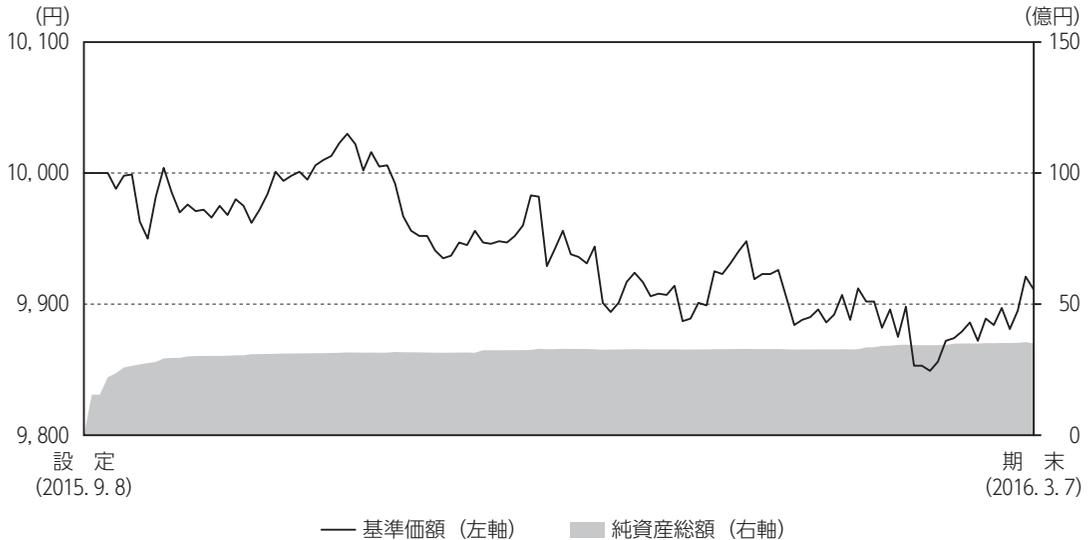
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 3) 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 4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《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

設定時：10,000円

期 末：9,781円（分配金130円）

騰落率：△0.9%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）（以下「コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）」といいます。）の受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ての複数種別の債券等に投資した結果、保有証券からの利息収入はプラスに寄与しましたが、主に債券価格の下落により基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(設定)2015年9月8日	円 10,000	% —	% —	% —	
9月末	9,971	△ 0.3	0.0	99.1	
10月末	10,002	0.0	0.0	99.6	
11月末	9,952	△ 0.5	0.0	99.7	
12月末	9,887	△ 1.1	0.0	99.8	
2016年1月末	9,892	△ 1.1	0.0	99.7	
2月末	9,884	△ 1.2	0.0	100.1	
(期末)2016年3月7日	9,911	△ 0.9	0.0	99.2	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

投資環境について

○債券市況

設定時より、米国債券市場では、2015年12月に開催されたFOMC（米国連邦公開市場委員会）で政策金利の引き上げが決定されたことなどを受け、短期年限を中心に国債金利が上昇（価格は下落）しました。一方、原油など商品市況の下落や中国をはじめとする主要新興国の景気減速を背景に、世界的な景気後退やインフレ率の低下が懸念される中、中長期年限では国債金利が低下（価格は上昇）しました。こうした環境下、市場ではリスク回避傾向が強まり、発行体の信用力悪化が懸念されたハイ・イールド債券やバンクローンなどは、スプレッド（米国国債との利回り格差）の拡大を伴って弱含みました。しかし2016年2月中旬以降は、原油など商品市況の下落が一服したことなどから市場のリスク回避姿勢が和らぎ、期末にかけて国債金利が上昇傾向となる一方で、ハイ・イールド債券やバンクローンなどのリスク資産は下落幅を縮める展開となりました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券とダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資するファンド・オブ・ファンズであり、期を通じてコア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に維持しました。

○コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資し、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせにより、トータルリターンを最大化をめざすポートフォリオを構築しました。債券ポートフォリオでは、長期年限に比して短期年限の金利上昇幅が大きくなる利回り曲線のベアフラット化（短期年限中心の金利上昇）に備え、短期および長期年限に比重を置きつつ、短期年限を中心に変動金利債を活用して金利変動リスクを表すデュレーションを低めに抑えました。債券種別の配分については、ABS（資産担保証券）や非政府系RMBS（住宅ローン担保証券）を中心とする構成としました。また、為替変動リスクを低減するため、対円での為替ヘッジを行ないました。

※国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、資産担保証券、バンクローン、MBS、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF等

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資による安定的な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

当期の1万口当り分配金（税込み）は130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	
	2015年9月8日 ～2016年3月7日	
当期分配金（税込み）	（円）	130
対基準価額比率	（％）	1.31
当期の収益	（円）	130
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	9

（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	135.67円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	3.90
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	139.58
(f) 分配金	130.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	9.58

（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、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

○コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。利上げ開始後の米国債券市場については、利回り曲線のベアフラット化が進むと考えており、債券ポートフォリオにおいては、こうした見通しの下でトータルリターンの向上に寄与する銘柄の選別を重視する方針です。また、為替変動リスクを低減するため、対円での為替ヘッジを行いません。

○ダイワ・マネーアセット・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ってまいります。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 9. 8～2016. 3. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	60円	0. 604%	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9, 938円です。
（投信会社）	(19)	(0. 188)	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）	(40)	(0. 403)	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	—	—	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
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. 004	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. 004)	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	60	0. 608	

(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まず。

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年9月8日から2016年3月7日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	36,390.048	3,630,812	857.388	84,300

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年9月8日から2016年3月7日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・ マネーアセット・ マザーファンド	0	1	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2015年9月8日から2016年3月7日まで)

当 期				期 付			
買 付	口 数	金 額	平均単価	売 付	口 数	金 額	平均単価
銘 柄	千口	千円	円	銘 柄	千口	千円	円
DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	35,692.622	3,563,000	99	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	857.388	84,300	98

(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

(1) 当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) ダイワ・マネーアセット・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

(2015年9月8日から2016年3月7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
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	13,338	1,000	7.5	—	—	—
コール・ローン	489,844	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%
 ※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
 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。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

■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	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT	35,532.659	3,470,617	99.2

(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。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	0	1

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年3月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	3,470,617	97.3
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	95,298	2.7
投資信託財産総額	3,565,916	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

2016年3月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,565,916,394円
コール・ローン等	95,298,393
投資信託受益証券 (評価額)	3,470,617,000
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド (評価額)	1,001
(B) 負債	65,748,887
未払収益分配金	46,521,182
未払信託報酬	19,100,463
その他未払費用	127,242
(C) 純資産総額 (A - B)	3,500,167,507
元本	3,578,552,480
次期繰越損益金	△ 78,384,973
(D) 受益権総口数	3,578,552,480口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,781円

* 設定時における元本額は1,544,706,029円、当期中における追加設定元本額は2,095,155,807円、同解約元本額は61,309,356円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,781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78,384,973円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月8日 至2016年3月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	67,780,668円
受取配当金	67,769,554
受取利息	11,114
(B) 有価証券売買損益	△ 75,535,257
売買益	230,376
売買損	△ 75,765,633
(C) 信託報酬等	△ 19,227,705
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 26,982,294
(E) 追加信託差損益金	△ 4,881,497
(配当等相当額)	(1,396,490)
(売買損益相当額)	(△ 6,277,987)
(F) 合計 (D + E)	△ 31,863,791
(G) 収益分配金	△ 46,521,182
次期繰越損益金 (F + G)	△ 78,384,973
追加信託差損益金	△ 4,881,497
(配当等相当額)	(1,396,490)
(売買損益相当額)	(△ 6,277,987)
分配準備積立金	2,031,781
繰越損益金	△ 75,535,257

(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)」の表を参照。

■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	48,552,963円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,396,490
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	49,949,453
(f) 分配金	46,521,182
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	3,428,271
(h) 受益権総口数	3,578,552,480口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	130円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は3月7日現在の基準価額（1万口当り9,781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。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

★ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額	
	(分配落)	税 込 分 配 金				期 騰 落 率
1 期末(2016年 3 月 7 日)	円 9,250	円 130	% △ 6.2	% 0.0	% 99.2	百万円 1,939

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

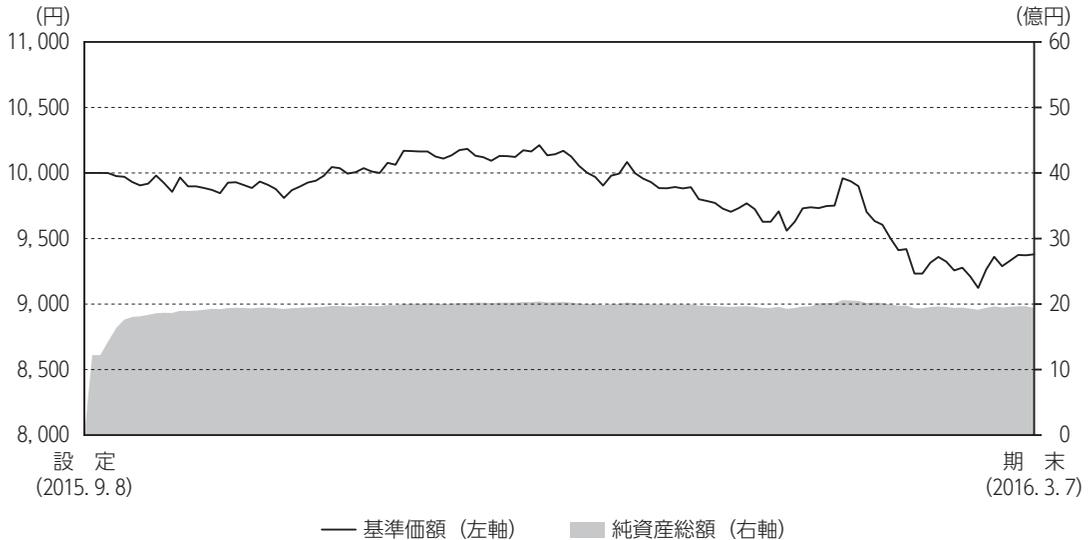
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 3) 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 4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《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

設定時：10,000円

期末：9,250円（分配金130円）

騰落率：△6.2%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）（以下「コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」といいます。）の受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ての複数種別の債券等に投資した結果、保有証券からの利息収入はプラスに寄与しましたが、主に米ドル円為替相場の下落や債券価格の下落により基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(設定)2015年9月8日	円 10,000	% —	% —	% —	
9月末	9,898	△ 1.0	0.0	99.3	
10月末	10,037	0.4	0.0	99.4	
11月末	10,123	1.2	0.0	99.7	
12月末	9,883	△ 1.2	0.0	99.8	
2016年1月末	9,751	△ 2.5	0.0	99.8	
2月末	9,361	△ 6.4	0.0	99.8	
(期末)2016年3月7日	9,380	△ 6.2	0.0	99.2	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

投資環境について

○債券市況

設定時より、米国債券市場では、2015年12月に開催されたFOMC（米国連邦公開市場委員会）で政策金利の引き上げが決定されたことなどを受け、短期年限を中心に国債金利が上昇（価格は下落）しました。一方、原油など商品市況の下落や中国をはじめとする主要新興国の景気減速を背景に、世界的な景気後退やインフレ率の低下が懸念される中、中長期年限では国債金利が低下（価格は上昇）しました。こうした環境下、市場ではリスク回避傾向が強まり、発行体の信用力悪化が懸念されたハイ・イールド債券やバンクローンなどは、スプレッド（米国国債との利回り格差）の拡大を伴って弱含みました。しかし2016年2月中旬以降は、原油など商品市況の下落が一服したことなどから市場のリスク回避姿勢が和らぎ、期末にかけて国債金利が上昇傾向となる一方で、ハイ・イールド債券やバンクローンなどのリスク資産は下落幅を縮める展開となりました。

○為替相場

設定時より、米ドルは対円で下落しました。FRB（米国連邦準備制度理事会）による利上げを織り込む局面や、日銀がマイナス金利の導入を決定した際は、米ドル円相場に対する上昇圧力が高まりました。しかし、中国株や中国・人民元の下落、原油価格の続落などを背景に市場のリスク回避姿勢が強まる中、期を通じては円高圧力が優勢となりました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券とダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資するファンド・オブ・ファンズであり、期を通じてコア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に維持しました。

○コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資し、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせにより、トータルリターンを最大化をめざすポートフォリオを構築しました。債券ポートフォリオでは、長期年限に比して短期年限の金利上昇幅が大きくなる利回り曲線のベアフラット化（短期年限中心の金利上昇）に備え、短期および長期年限に比重を置きつつ、短期年限を中心に変動金利債を活用して金利変動リスクを表すデュレーションを低めに抑えました。債券種別の配分については、ABS（資産担保証券）や非政府系RMB S（住宅ローン担保証券）を中心とする構成としました。

※国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、資産担保証券、バンクローン、MBS、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF等

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資による安定的な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

当期の1万口当り分配金（税込み）は130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	
	2015年9月8日 ～2016年3月7日	
当期分配金（税込み）	(円)	130
対基準価額比率	(%)	1.39
当期の収益	(円)	130
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	28

- (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	158.62円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	0.00
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	158.62
(f) 分配金	130.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	28.62

(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、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

○コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。利上げ開始後の米国債券市場については、利回り曲線のベアフラット化が進むと考えており、債券ポートフォリオにおいては、こうした見通しの下でトータルリターンの向上に寄与する銘柄の選別を重視する方針です。

○ダイワ・マネーアセット・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ってまいります。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 9. 8～2016. 3. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	59円	0. 604%	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9, 840円です。
（投信会社）	(18)	(0. 188)	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）	(40)	(0. 403)	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	—	—	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
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. 004	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. 004)	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	60	0. 608	

(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まず。

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年9月8日から2016年3月7日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	21,489.053	2,138,157	582.029	54,500

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年9月8日から2016年3月7日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・ マネーアセット・ マザーファンド	0	1	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2015年9月8日から2016年3月7日まで)

当 期				期 付			
買 付	口 数	金 額	平均単価	売 付	口 数	金 額	平均単価
銘 柄	千口	千円	円	銘 柄	千口	千円	円
DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	20,996.043	2,093,100	99	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	582.029	54,500	93

(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

(1) 当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) ダイワ・マネーアセット・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

(2015年9月8日から2016年3月7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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	13,338	1,000	7.5	—	—	—
コール・ローン	489,844	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

*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。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

■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	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT	20,907.024	1,923,592	99.2

(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。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0	1

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年3月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,923,592	97.2
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	55,447	2.8
投資信託財産総額	1,979,040	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

2016年3月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,979,040,692円
コール・ローン等	55,447,125
投資信託受益証券 (評価額)	1,923,592,566
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	1,001
(B) 負債	39,060,831
未払収益分配金	27,263,327
未払信託報酬	11,719,455
その他未払費用	78,049
(C) 純資産総額 (A - B)	1,939,979,861
元本	2,097,179,018
次期繰越損益金	△ 157,199,157
(D) 受益権総口数	2,097,179,018口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,250円

* 設定時における元本額は1,220,426,710円、当期中における追加設定元本額は893,624,546円、同解約元本額は16,872,238円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,250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157,199,157円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月8日 至2016年3月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	45,064,524円
受取配当金	45,057,664
受取利息	6,860
(B) 有価証券売買損益	△ 159,918,172
売買益	120,388
売買損	△ 160,038,560
(C) 信託報酬等	△ 11,797,504
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 126,651,152
(E) 追加信託差損益金	△ 3,284,678
(配当等相当額)	(281)
(売買損益相当額)	(△ 3,284,959)
(F) 合計 (D + E)	△ 129,935,830
(G) 収益分配金	△ 27,263,327
次期繰越損益金 (F + G)	△ 157,199,157
追加信託差損益金	△ 3,284,678
(配当等相当額)	(281)
(売買損益相当額)	(△ 3,284,959)
分配準備積立金	6,003,693
繰越損益金	△ 159,918,172

(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いません。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は20ページの「収益分配金の計算過程 (総額)」の表を参照。

■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	33,267,020円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	281
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	33,267,301
(f) 分配金	27,263,327
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,003,974
(h) 受益権総口数	2,097,179,018口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	130円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は3月7日現在の基準価額（1万口当り9,250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。

ダイワ債券コア戦略ファンド

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ-ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド (円ヘッジ・クラス／ノンヘッジ・クラス)

当ファンド（ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ-ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス／ノンヘッジ・クラス）」は、2016年3月7日現在、第1期決算を迎えておりません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2015年12月9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（2016年3月7日）現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンドの組入資産の内容等を22ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄

公 社 債

（2015年9月8日から2016年3月7日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
555 国庫短期証券 2015/12/7	1,500,000		
557 国庫短期証券 2015/12/14	1,500,000		
563 国庫短期証券 2016/1/18	1,150,000		
100 5年国債 0.3% 2016/9/20	1,103,212		
586 国庫短期証券 2016/5/12	1,000,337		
566 国庫短期証券 2016/2/1	999,999		
567 国庫短期証券 2016/2/8	999,999		
574 国庫短期証券 2016/3/14	700,069		
576 国庫短期証券 2016/3/22	700,067		
573 国庫短期証券 2016/3/7	500,099		

（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、2016年3月7日現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンド（11,317,590千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年3月7日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 5,000,000	千円 5,003,023	% 44.1	% —	% —	% —	% 44.1

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

（注2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2016年3月7日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	574 国庫短期証券	— %	千円 700,000	千円 700,005	2016/03/14	
	576 国庫短期証券	—	700,000	700,010	2016/03/22	
	582 国庫短期証券	—	500,000	500,015	2016/04/18	
	584 国庫短期証券	—	500,000	500,032	2016/04/25	
	585 国庫短期証券	—	500,000	500,027	2016/05/02	
	586 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,236	2016/05/12	
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,102,695	2016/09/20	
合 計	銘 柄 数 金 額	7銘柄	5,000,000	5,003,023		

（注）単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第4期 (決算日 2015年12月9日)

(計算期間 2014年12月10日～2015年12月9日)

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第4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

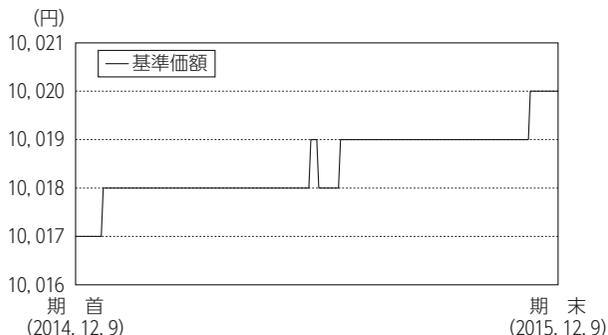
大和投資信託

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



《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：10,017円 期末：10,020円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低金利が続ぎ、無担保コール翌日物金利は0.07%台を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.11～0.02%程度で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

◆ポートフォリオについて

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定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、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組入比率
	円	騰 落 率 %	
(期首) 2014年12月9日	10,017	—	53.3
12月末	10,018	0.0	72.3
2015年1月末	10,018	0.0	80.5
2月末	10,018	0.0	70.3
3月末	10,018	0.0	59.6
4月末	10,018	0.0	70.6
5月末	10,018	0.0	73.2
6月末	10,019	0.0	69.3
7月末	10,019	0.0	59.4
8月末	10,019	0.0	65.5
9月末	10,019	0.0	51.5
10月末	10,019	0.0	76.0
11月末	10,020	0.0	56.8
(期末) 2015年12月9日	10,020	0.0	52.7

(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。

■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	—
合 計	—

(注) 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。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■売買および取引の状況

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国	国債証券	千円	千円
国内	国債証券	32,338,160	(32,240,000)

(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) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
491 国庫短期証券 2015/5/14	1,999,998		
540 国庫短期証券 2015/9/24	1,699,999		
555 国庫短期証券 2015/12/7	1,500,000		
557 国庫短期証券 2015/12/14	1,500,000		
541 国庫短期証券 2015/9/28	1,499,998		
532 国庫短期証券 2015/8/17	1,499,995		
514 国庫短期証券 2015/5/25	1,499,968		
521 国庫短期証券 2015/6/29	1,499,925		
502 国庫短期証券 2015/3/30	1,199,993		
563 国庫短期証券 2016/1/18	1,150,000		

(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) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率	5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%	
国債証券	6,435,000	6,437,978	52.7	—	—	—	—	52.7	

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

区 分	銘 柄	年利率	当		期		末	
			額面金額	評価額	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円	千円	千円		
国債証券	557 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,000	2015/12/14			
	336 2年国債	0.1000	185,000	185,022	2016/01/15			
	563 国庫短期証券	—	1,150,000	1,150,000	2016/01/18			
	566 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/01			
	567 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/08			
	573 国庫短期証券	—	500,000	500,097	2016/03/07			
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,102,860	2016/09/20			
合計	銘柄数	7銘柄						
	金額		6,435,000	6,437,978				

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月9日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	比 率
	千円	%	%
公社債	6,437,978	52.7	
コール・ローン等、その他	5,772,311	47.3	
投資信託財産総額	12,210,290	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

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	12, 210, 290, 310円
コール・ローン等	5, 771, 514, 330
公社債 (評価額)	6, 437, 978, 324
未収利息	668, 726
前払費用	128, 930
(B) 負債	—
(C) 純資産総額 (A - B)	12, 210, 290, 310
元本	12, 186, 116, 869
次期繰越損益金	24, 173, 441
(D) 受益権総口数	12, 186, 116, 869口
1万口当り基準価額 (C / D)	10, 020円

* 期首における元本額は11,884,993,463円、当期中における追加設定元本額は8,064,725,261円、同解約元本額は7,763,601,855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・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジあり4,998,495円、ダイワ・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジなし2,499,247円、ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンドⅡ (為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし) 999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (毎月分配型) 219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (年2回決算型) 24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (毎月分配型) 848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (年2回決算型) 66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型) 4,995円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型) 4,995円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2015-01 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、ダイワ・ブラジル・リアル債α (毎月分配型) -スーパー・ハイインカム- α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・リアル債α (毎月分配型) -スーパー・ハイインカム- α100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ26,536,157円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 3 -2,395,687,762円、ダイワ日本株式ベア・ファンド-ベアシフト11-71,870,634円、ダイワ日本株式ベア・ファンド-ベアシフト11 Ver 2 -29,945,799円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 5 -2,095,808,384円、ダイワ・スイス高配当株ツインα (毎月分配型) 2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 為替ヘッジなしコース10,980,236円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 日本円コース1,696,946円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース7,487,022円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 通貨セレクト・コース3,593,631円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (毎月分配型) 29,988,005円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (毎月分配型) 1,999,201円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース (毎月分配型) 1,002,195円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース (毎月分配型) 3,011,774円、ダイワ新興国ハイインカム・プラス -インカムチェンジ (積立型) -7,515,709円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド (限定追加型) -シフト11-3,536,610,361円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド (限定追加型) -シフト12-2,626,169,333円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド (限定追加型) -シフト13-1,287,713,056円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,020円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月10日 至2015年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3, 173, 485円
受取利息	3, 173, 485
(B) 有価証券売買損益	△ 382, 400
売買益	1, 050
売買損	△ 383, 450
(C) 当期損益金 (A + B)	2, 791, 085
(D) 前期繰越損益金	20, 640, 762
(E) 解約差損益金	△ 14, 198, 145
(F) 追加信託差損益金	14, 939, 739
(G) 合計 (C + D + E + F)	24, 173, 441
次期繰越損益金 (G)	24, 173, 441

(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。