

ダイワ／バリュー・パートナーズ・ チャイナ・イノベーション・ファンド

★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（2018年11月16日～2023年11月10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法人「バリュー・パートナーズ・ファンズ・エスピーシー」が発行する「バリュー・パートナーズ・チャイナAシェア・イノベーション・ファンド・エスピー（クラスZ）」（以下「チャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）」といいます。）の投資証券（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	
	ダイワ・マネーアセ ャ ッ ト ・マザーファンド	円建ての債券	
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10%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、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

運用報告書(全体版) 第 1 期

（決算日 2019年 5 月13日）

（作成対象期間 2018年11月16日～2019年 5 月13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。

当ファンドは、中国のイノベーション関連企業の株式に投資することにより、信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

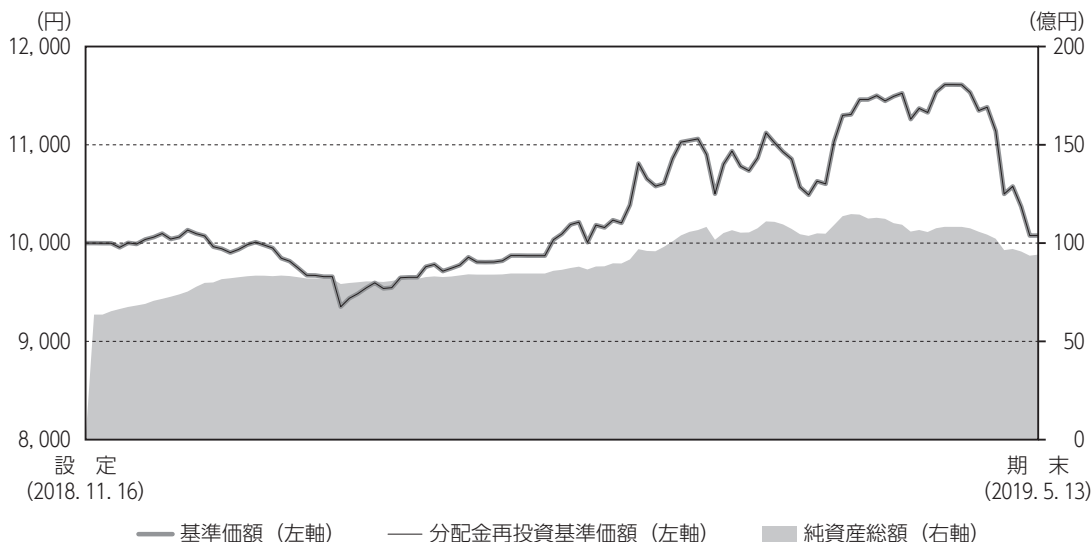
決 算 期	基 準 価 額			MSCI China A Index (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率			
1 期末(2019年 5 月13日)	円 10,076	円 0	% 0.8	11,391	% 13.9	% —	% 94.8	百万円 9,412

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) MSCI China A Index（配当込み、円換算）は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI China A Index（配当込み、人民元ベース）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 China A Index（配当込み、人民元ベース）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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (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す。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,076円（分配金 0 円）

騰落率：0.8%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

チャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）の投資証券を通じて、中国のイノベーション関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資を行い運用した結果、保有株式の価格の上昇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。

※チャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）：バリュー・パートナーズ・チャイナAシェア・イノベーション・ファンド・エスピー（クラスZ）

ダイワ／バリュー・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド

年 月 日	基 準 価 額		MSCI China A Index (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 証 券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2018年11月16日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —
11月末	10,041	0.4	9,634	△ 3.7	—	96.5
12月末	9,659	△ 3.4	9,119	△ 8.8	—	98.1
2019年 1 月末	9,808	△ 1.9	9,691	△ 3.1	—	99.2
2 月末	10,580	5.8	11,511	15.1	—	98.4
3 月末	10,602	6.0	11,721	17.2	—	99.5
4 月末	11,139	11.4	12,436	24.4	—	97.6
(期末) 2019年 5 月13日	10,076	0.8	11,391	13.9	—	94.8

(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

(2018. 11. 16 ~ 2019. 5. 13)

中国株式市況

中国A株（中国・人民元建株式）市場の代表的な指数であるCSI 300指数および香港株式市場の代表的な指数である香港ハンセン株価指数は、ともに上昇しました。

当作成期首から2018年12月にかけては、中国通信機器大手の華為技術（ファーウェイ）の副会長兼CFO（最高財務責任者）が米国当局の要請によりカナダで逮捕されたことをきっかけに、米中貿易摩擦の深刻化への懸念が強まり下落しました。2019年に入ると、米中両政府に歩み寄る姿勢が見られたことで、米中の全面対決が避けられるという楽観ムードが広がり、年初から4月中旬にかけての中国株式市場の上昇率は顕著となりました。しかし5月には、米国の予想外の対中関税の引き上げ発表を受けて中国株式市場に動揺が広がり、上げ幅を急速に縮小して当作成期末を迎えました。

為替相場

中国・人民元および香港ドルは対円でともに下落しました。

人民元および香港ドルは対円で、米中貿易摩擦の動向に一喜一憂する展開となりました。2019年5月以降は、投資家にリスク回避のための円買いの動きが広がり、当作成期末は当作成期首と比較して、円高人民元安、香港ドル安の水準となりました。

ポートフォリオについて

(2018. 11. 16 ~ 2019. 5. 13)

当ファンド

当ファンドは、チャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）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・ファンズであり、当ファンドの設定後、速やかにチャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）の組み入れを実施し、当作成期を通じてチャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）への投資割合を高位に維持しました。

チャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）

主として、中国のイノベーション関連企業の株式への投資を通し、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行いました。

2018年内は、米中貿易摩擦をめぐる不透明感や中国の景気減速懸念など、当初の想定以上に先行

きが見通しにくい市場環境となったため、慎重にポートフォリオを構築するとともに、株式組入比率を30%前後に抑える投資判断を行いました。その後は、米中通商協議の進展期待や中国当局の相次ぐ景気刺激策の発表などを受けて、2019年1月上旬より段階的に株式組入比率を引き上げ、2月下旬にはポートフォリオの構築がおおむね完了しました。

ポートフォリオ構築にあたっては、米中貿易摩擦において成長性が高いハイテク企業が米国の標的となったことから、内需型で安定的なビジネスモデルと考えられる金融や一般消費財・サービスセクターへの配分に重きを置いた一方、情報技術セクターへの配分を抑制しました。また、中国A株を純資産総額の70%程度組み入れたほか、香港株、米国上場のDRなどにも一部投資を行いました。

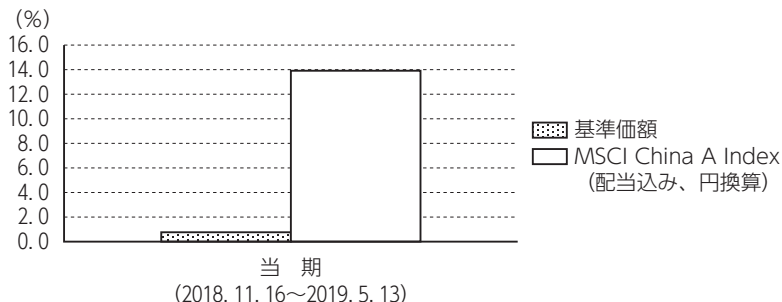
■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行いました。

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

当作成期は、基準価額の水準等を勘案して、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
		2018年11月16日 ～2019年5月13日
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	75

（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。



今後の運用方針

当ファンド

チャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）への投資割合を高位に維持することによって、中国のイノベーション関連企業の株式に投資し、信託財産の成長をめざします。

チャイナAシェア・イノベーション・ファンド（クラスZ）

1. 主として、中国のイノベーション関連企業の株式に投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざします。

※ 1 当ファンドにおける中国のイノベーション関連企業とは、中国に主たる拠点を有している、中国国内の株式市場に上場している、収益の大部分を中国であげているもしくは主たるビジネスを中国で行っている企業のうち、テクノロジー関連ビジネス、消費関連サービス、ヘルスケアビジネス、金融ビジネスなどの分野で革新的な企業をいいます。

※ 2 中国 A 株投資にあたっては、現物株式に加え、個別株式等の価格変動に運用成果が連動する有価証券等にも投資する場合があります。

2. ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針を基本とします。

- ・財務状況、収益性およびバリュエーションなどをもとに定量的なスクリーニングを行い、銘柄の絞込みを行います。
- ・選定された銘柄について、財務分析や企業訪問を含む全方位的なボトムアップ・アプローチを用いたファンダメンタル分析を行います。
- ・各銘柄の本源的価値からの割安度合いや株価が是正されるきっかけとなる事象にもとづく確信度合いなどを勘案し、ポートフォリオを構築します。

3. 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・マネーアセット・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う方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2018. 11. 16～2019. 5. 13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	62円	0. 596%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10, 365円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0. 185)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(41)	(0. 397)	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＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成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
(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	62	0. 600	

(注 1) 当作成期中の費用（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) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券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。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2018年11月16日から2019年 5月13日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	983. 245509 (—)	9, 940, 000 (—)	100. 798089 (—)	1, 150, 000 (—)

(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。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2018年11月16日から2019年 5月13日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VALUE PARTNERS CHINA A-SHARE INNOVATION FUND SP - CLASS Z (ACC) (JPY) SHARES (ケイマン諸島)	983. 245509	9, 940, 000	10, 109	VALUE PARTNERS CHINA A-SHARE INNOVATION FUND SP - CLASS Z (ACC) (JPY) SHARES (ケイマン諸島)	100. 798089	1, 150, 000	11, 408

(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等

(1) 当ファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成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当作成期中の利害関係人との取引状況

(2018年11月16日から2019年 5月13日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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	40	40	100. 0	—	—	—
コール・ローン	580, 454	—	—	—	—	—

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2018年11月16日から2019年 5月13日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 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	10	10	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

(3) 当作成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

当作成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、当作成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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託証券 (ケイマン諸島) VALUE PARTNERS CHINA A-SHARE INNOVATION FUND SP - CLASS Z (ACC) (JPY) SHARES	882. 44742	8, 923, 308	94. 8

(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
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	千口	千円
	10	9

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年5月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	千円	%
	8, 923, 308	93. 7
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	9	0. 0
コール・ローン等、その他	603, 372	6. 3
投資信託財産総額	9, 526, 691	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

2019年5月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9, 606, 691, 233円
コール・ローン等	523, 372, 926
投資信託証券 (評価額)	8, 923, 308, 311
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	9, 996
未収入金	160, 000, 000
(B) 負債	193, 984, 989
未払金	80, 000, 000
未払解約金	59, 668, 638
未払信託報酬	53, 934, 727
その他未払費用	381, 624
(C) 純資産総額 (A－B)	9, 412, 706, 244
元本	9, 341, 897, 005
次期繰越増益金	70, 809, 239
(D) 受益権総口数	9, 341, 897, 005口
1万口当り基準価額 (C／D)	10, 076円

* 期首における元本額は6, 361, 491, 318円、当作成期間中における追加設定元本額は6, 305, 313, 652円、同解約元本額は3, 324, 907, 965円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10, 076円です。

■損益の状況

当期 自 2018年11月16日 至 2019年5月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 61, 427円
受取利息	15, 313
支払利息	△ 76, 740
(B) 有価証券売買損益	△ 162, 731, 736
売買益	134, 052, 573
売買損	△ 296, 784, 309
(C) 信託報酬等	△ 54, 347, 571
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	△ 217, 140, 734
(E) 追加信託差増益金	287, 949, 973
(配当等相当額)	(△ 17, 790)
(売買損益相当額)	(287, 967, 763)
(F) 合計 (D＋E)	70, 809, 239
次期繰越増益金 (F)	70, 809, 239
追加信託差増益金	287, 949, 973
(配当等相当額)	(△ 17, 790)
(売買損益相当額)	(287, 967, 763)
繰越増益金	△ 217, 140, 734

(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) 追加信託差増益金とは、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下記「収益分配金の計算過程 (総額)」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	70, 888, 456
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a＋b＋c＋d)	70, 888, 456
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e－f)	70, 888, 456
(h) 受益権総口数	9, 341, 897, 005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。

**バリュー・パートナーズ・チャイナ A シェア・イノベーション・ファンド・エスピー
(クラス Z)**

当ファンド（ダイワ／バリュー・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド）の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資法人「バリュー・パートナーズ・ファンズ・エスピーシー」が発行する「バリュー・パートナーズ・チャイナ A シェア・イノベーション・ファンド・エスピー（クラス Z）」は、2019年 3 月31日に第 1 期決算を行っておりますが、2019 年 5 月13日現在、決算情報を入手できておりません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ／バリュー・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド）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（2018年12月10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（2019年 5 月13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12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

(2018年11月16日から2019年 5 月13日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
801 国庫短期証券 2019/3/18	千円 40,000		千円

(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

2019年 5 月13日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第7期（決算日 2018年12月10日）

（作成対象期間 2017年12月12日～2018年12月10日）

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの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
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

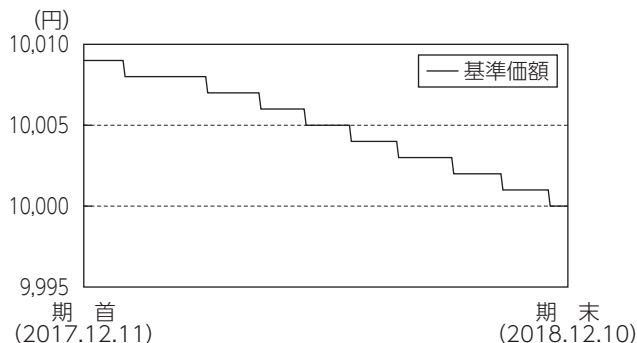
大和投資信託

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/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2017年12月11日	円	%	%
12月末	10,009	—	—
2018年 1 月末	10,008	△0.0	—
2 月末	10,008	△0.0	0.5
3 月末	10,007	△0.0	—
4 月末	10,006	△0.0	—
5 月末	10,005	△0.0	—
6 月末	10,005	△0.0	—
7 月末	10,004	△0.0	—
8 月末	10,003	△0.1	—
9 月末	10,002	△0.1	—
10月末	10,001	△0.1	—
11月末	10,000	△0.1	—
(期末)2018年12月10日	10,000	△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：10,009円 期末：10,000円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

マイナス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

当作成期首より、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持し、2018年7月には金融緩和継続のための枠組み強化を決定しました。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。

◆前作成期末における「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》

流動性及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う方針です。

■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)	4 (4)
合 計	4

(注1) 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) 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

(2017年12月12日から2018年12月10日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円	千円
		180,001	— (180,000)

(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

(2017年12月12日から2018年12月10日まで)

当 期		期	
買 付 額	売 付 額	買 付 額	売 付 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
723 国庫短期証券 2018/3/5	千円 90,000		千円
757 国庫短期証券 2018/8/13	50,000		
731 国庫短期証券 2018/7/10	40,000		

(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

当作成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

2018年12月10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	9,019,491	100.0
投資信託財産総額	9,019,491	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12月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,019,491,424円
コール・ローン等	9,019,491,424
(B) 負債	745,957
その他未払費用	745,957
(C) 純資産総額(A－B)	9,018,745,467
元本	9,018,625,641
次期繰越損益金	119,826
(D) 受益権総口数	9,018,625,641口
1万口当り基準価額(C／D)	10,000円

* 期首における元本額は17,399,953,390円、当作成期間中における追加設定元本額は2,846,717,287円、同解約元本額は11,228,045,036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DBモメンタム戦略ファンド（為替ヘッジあり）6,592,748円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド（為替ヘッジなし）10,288,683円、ダイワノバリュー・パートナーズ・チャイナ・イノベーション・ファンド10,000円、ダイワノ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、ダイワノ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、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－ α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－ 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14,873,813円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 3－ 858,588,190円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 6－ 2,475,152,803円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 7－ 828,595,357円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 4－ 1,078,808,907円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 5－ 2,095,808,384円、ダイワ円債セレクト マネーコース1,605,380,447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1,490,665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497,633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・レアル・コース994,307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397,742円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジあり40,885円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジなし100,789円、ダイワノNB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）1,235円、ダイワノNB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）1,598円、通貨選択型 ダイワノNB・米国債券戦略ファンド 日本円コース（毎月分配型）1,544円、通貨選択型 ダイワノ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）1,984円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,000円です。

■損益の状況

当期 自2017年12月12日 至2018年12月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,977,479円
受取利息	2,652
支払利息	△ 5,980,131
(B) その他費用	△ 4,966,849
(C) 当期損益金(A＋B)	△10,944,328
(D) 前期繰越損益金	15,761,364
(E) 解約差損益金	△ 5,797,371
(F) 追加信託差損益金	1,100,161
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	119,826
次期繰越損益金(G)	119,826

(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。