

★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ないます。
	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	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	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ないます。 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ないません。
	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	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、分配を行な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、分配を行な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ないます。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5期 （決算日 2016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5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

設定以来の運用実績

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			
1期末(2012年4月18日)	円 9,231	円 0	% △ 7.7	9,592	% △ 4.1	% 98.2	% -	百万円 73,585
2期末(2013年4月18日)	11,666	500	31.8	12,694	32.3	96.4	-	32,447
3期末(2014年4月18日)	14,592	1,000	33.7	15,920	25.4	95.7	-	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

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

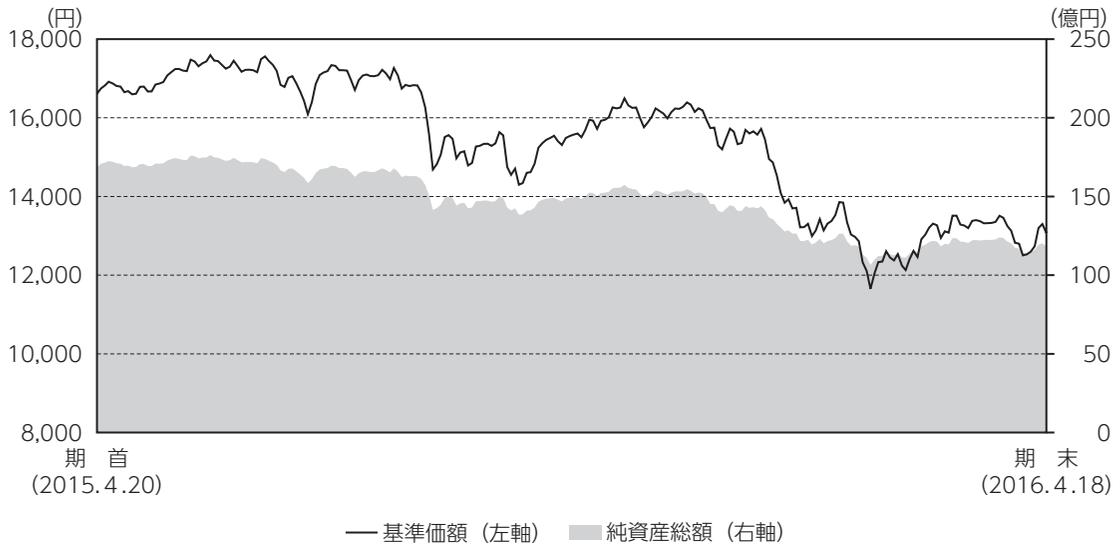
(注2) MSCIコクサイ指数(円換算)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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



■ 基準価額・騰落率

期首：16,609円
 期末：13,070円
 騰落率：△21.3%

■ 基準価額の主な変動要因

海外の株式市況が下落したことや、米ドルやユーロが対円で下落したことなどがマイナス要因となり、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／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	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2015年 4月20日	円 16,609	% -	19,386	% -	% 97.4	% -
4 月末	16,652	0.3	19,667	1.4	97.1	-
5 月末	17,434	5.0	20,427	5.4	96.7	-
6 月末	16,839	1.4	19,593	1.1	97.0	-
7 月末	17,100	3.0	20,129	3.8	97.8	-
8 月末	15,560	△ 6.3	18,487	△ 4.6	96.6	-
9 月末	14,340	△13.7	17,194	△11.3	97.3	-
10月末	15,951	△ 4.0	19,045	△ 1.8	95.6	-
11月末	16,228	△ 2.3	19,241	△ 0.7	96.3	-
12月末	15,716	△ 5.4	18,745	△ 3.3	97.5	-
2016年 1 月末	13,526	△18.6	17,075	△11.9	95.1	-
2 月末	12,615	△24.0	16,327	△15.8	94.6	-
3 月末	13,510	△18.7	17,250	△11.0	95.2	-
(期末) 2016年 4月18日	13,070	△21.3	16,666	△14.0	96.2	-

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について**○海外株式市況**

海外株式市況は下落しました。期首から、ギリシャ問題の再燃や米国の利上げ観測などから上値が重い展開が続きました。さらに2015年8月に入ると、中国での人民元の切下げを受けて中国の景気減速懸念が高まったことなどから中国株が急落し、中国経済の悪化が世界的な景気減速につながるとの見方が強まったことから下落基調を強めました。10月以降は、ECB（欧州中央銀行）のドラギ総裁による追加金融緩和の示唆や、中国の金融緩和の実施などを受けて反発しました。しかし2016年1月以降は、原油価格の下落や中国株の急落などを受けたリスク回避姿勢の高まりから海外株式は大きく下落しました。2月中旬以降は、原油価格の持ち直しや米国景気に対する懸念後退、米国の利上げペースが緩やかなものになるとの見通しなどを受けて、海外株式は下げ幅を縮小して期末を迎えました。

○為替相場

対円の米ドル為替相場は下落しました。期首から、米国のマクロ経済指標などを受けて、米国の利上げへの期待が高まったことなどが支援材料となり、底堅い展開が続きました。しかし2015年8月以降は、中国株式市場の急落などから投資家のリスク回避の円買いの動きが活発化したことで、上値が重い展開が続きました。10月以降は、米国の好調な雇用関連指標などを受けて再び上昇基調となりました。しかし2016年1月以降は、原油価格の下落や世界的な株式市場の調整からリスク回避姿勢が強まり、米国の利上げ観測が後退したこともマイナス材料となって、米ドルの対円相場は下落して期末を迎えました。

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、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている長期的に魅力的な銘柄に厳選投資してまいります。マクロ経済状況や政治情勢などから株式市場が調整した際は、優良な企業に割安な水準で投資する好機と考えています。地域別では、米国に加えて、本源的価値と比較して割安な価格で取引されている銘柄が多いスイスなど欧州中心のポートフォリオを維持し、新興国は限定的に投資してまいります。

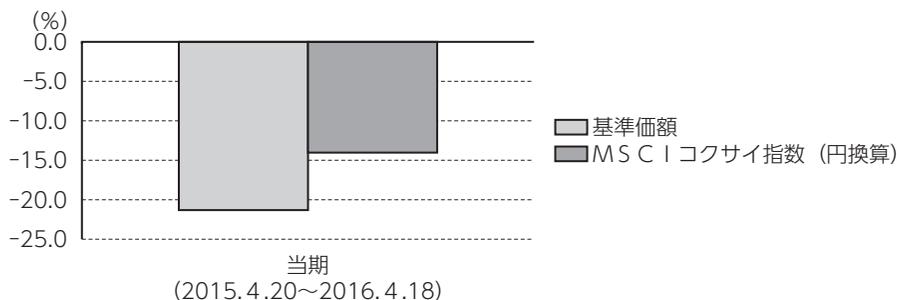
ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、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、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている長期的に魅力的な銘柄に厳選投資しました。個別銘柄では、CREDIT SUISSE GROUP（スイス、金融）、TE CONNECTIVITY（米国、情報技術）、BNP PARIBAS（フランス、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	
	2015年4月21日 ～2016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)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	6,452

(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》

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、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている長期的に魅力的な銘柄に厳選投資してまいります。地域別では、個人消費が好調な米国に加えて、本源的価値と比較して割安な銘柄が多いスイスやドイツなど欧州中心のポートフォリオを維持します。新興国の銘柄については、中国、韓国、メキシコの銘柄に限定的に投資します。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期		項 目 の 概 要
	(2015.4.21~2016.4.18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	297円	1.933%	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15,354円です。
(投信会社)	(173)	(1.128)	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)	(115)	(0.752)	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)	(8)	(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	5	0.030	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(5)	(0.030)	
有価証券取引税	2	0.014	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(2)	(0.014)	
その他費用	10	0.062	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)	(0.049)	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)	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	313	2.039	

(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

(2015年4月21日から2016年4月18日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 2,649.85 (△ 140.96)	千アメリカ・ドル 12,374 (△ 994)	百株 5,722.35	千アメリカ・ドル 20,060
	オーストラリア	百株 284 (523.53)	千オーストラリア・ドル 99 (201)	百株 -	千オーストラリア・ドル -
	イギリス	百株 - (-)	千イギリス・ポンド - (-)	百株 1,306	千イギリス・ポンド 2,415
	スイス	百株 2,276.5 (2,797.67)	千スイス・フラン 7,909 (△ 336)	百株 4,275	千スイス・フラン 8,925
	韓国	百株 42.05 (-)	千韓国ウォン 5,269,126 (-)	百株 42.85	千韓国ウォン 5,387,079
	ユーロ (オランダ)	百株 763 (35.38)	千ユーロ 1,008 (86)	百株 2,042.92	千ユーロ 3,109
	ユーロ (フランス)	百株 278.3 (-)	千ユーロ 1,393 (-)	百株 745	千ユーロ 4,314
	ユーロ (ドイツ)	百株 696 (-)	千ユーロ 6,421 (-)	百株 193.1	千ユーロ 2,698
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 1,737.3 (35.38)	千ユーロ 8,823 (86)	百株 2,981.02	千ユーロ 10,121

(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

(2015年4月21日から2016年4月18日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	10,064,664千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,302,182千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.70

(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。

■主要な売買銘柄
株 式

(2015年4月21日から2016年4月18日まで)

当				期			
銘 柄	買 付			銘 柄	売 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)	千株 4.205	千円 564,364	円 134,212	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)	千株 4.285	千円 560,152	円 130,724
LAFARGEHOLCIM LTD-REG (スイス)	82.45	537,393	6,517	JULIUS BAER GROUP LTD (スイス)	64.4	438,113	6,803
BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	26.985	529,787	19,632	BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	15.55	372,818	23,975
USG CORP (アメリカ)	92	304,139	3,305	FRANKLIN RESOURCES INC (アメリカ)	72.4	341,976	4,723
MTU AERO ENGINES AG (ドイツ)	27.65	300,144	10,855	DANONE (フランス)	42.8	338,775	7,915
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES (ドイツ)	28.2	283,983	10,070	APPLIED MATERIALS INC (アメリカ)	153.9	321,395	2,088
ALLIANZ SE-REG (ドイツ)	13.75	268,912	19,557	ALLIANZ SE-REG (ドイツ)	15.11	312,445	20,678
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG (スイス)	114.5	218,976	1,912	HEALTH NET INC (アメリカ)	36.95	280,466	7,590
GRUPO TELEVISIA SA-SPON ADR (メキシコ)	63.1	197,916	3,136	DIAGEO PLC (イギリス)	74.5	248,580	3,336
BNP PARIBAS (フランス)	27.83	184,451	6,627	BNP PARIBAS (フランス)	31.7	245,923	7,757

(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		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円			
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	698	649	1,438	155,338	一般消費財・サービス		
CITIGROUP INC	860	845	3,795	409,977	金融		
TE CONNECTIVITY LTD	925	810	5,141	555,374	情報技術		
HEALTH NET INC	743	—	—	—	その他		
CENTENE CORP	—	130.32	763	82,484	ヘルスケア		
BAIDU INC・SPON ADR	—	114.35	2,209	238,644	情報技術		
FRANKLIN RESOURCES INC	724	—	—	—	金融		
GENERAL MOTORS CO	1,530	1,514	4,626	499,738	一般消費財・サービス		
LINKEDIN CORP - A	—	35	408	44,082	情報技術		
ALPHABET INC-CL C	80.5	61.87	4,695	507,207	情報技術		
ITRON INC	378	392	1,570	169,613	情報技術		
TENET HEALTHCARE CORP	640	857	2,708	292,504	ヘルスケア		
UNION PACIFIC CORP	420.5	321.5	2,610	282,003	資本財・サービス		
ORACLE CORP	1,108	912	3,741	404,068	情報技術		
MASTERCARD INC-CLASS A	577.5	412	3,983	430,227	情報技術		
BANK OF AMERICA CORP	3,250	3,040	4,256	459,690	金融		
APPLIED MATERIALS INC	1,539	—	—	—	情報技術		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	522	566	1,566	169,217	エネルギー		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2,391	1,711	4,034	435,770	一般消費財・サービス		
CHESAPEAKE ENERGY CORP	934	—	—	—	エネルギー		
CARMAX INC	—	241	1,293	139,705	一般消費財・サービス		
USG CORP	—	880	2,389	258,057	資本財・サービス		
GRUPO TELEVIS SA-SPON ADR	—	615	1,611	174,036	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>	17,320.5 19銘柄	14,107.04 19銘柄	52,844 <48.3%>	5,707,743 <48.3%>		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円			
INCITEC PIVOT LTD.	16,738.5	17,546.03	5,298	438,060	素材		
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	16,738.5 1銘柄	17,546.03 1銘柄	5,298 <3.7%>	438,060 <3.7%>		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円			
DIAGEO PLC	1,414	669	1,293	198,140	生活必需品		
SMITHS GROUP PLC	1,554	1,380	1,508	231,107	資本財・サービス		
TRAVIS PERKINS PLC	387	—	—	—	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>	3,355 3銘柄	2,049 2銘柄	2,801 <3.6%>	429,248 <3.6%>		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円			
NESTLE SA-REG	137	—	—	—	生活必需品		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,015	3,848	5,548	619,858	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	1,589	1,139	4,574	510,986	金融		
CIE FINANCIERE RICHENMONT-REG	570	499	3,226	360,380	一般消費財・サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	232	946.17	4,661	520,767	素材		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	90	—	—	—	資本財・サービス		
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,633 6銘柄	6,432.17 4銘柄	18,010 <17.0%>	2,011,992 <17.0%>		
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円			
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	27.85	27.05	3,516,500	330,551	情報技術		
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	27.85 1銘柄	27.05 1銘柄	3,516,500 <2.8%>	330,551 <2.8%>		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,080.4	744.78	1,853	226,232	資本財・サービス		
FUGRO NV-CVA	507.92	—	—	—	エネルギー		
CNH INDUSTRIAL NV	7,024	6,623	3,828	467,180	資本財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,612.32 3銘柄	7,367.78 2銘柄	5,681 <5.9%>	693,413 <5.9%>		
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円			
BNP PARIBAS	1,030	991.3	4,476	546,337	金融		
DANONE	428	—	—	—	生活必需品		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,458 2銘柄	991.3 1銘柄	4,476 <4.6%>	546,337 <4.6%>		
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
ALLIANZ SE-REG	267	253.4	3,738	456,297	金融		
DAWLER AG-REGISTERED SHARES	387	627	3,919	478,320	一般消費財・サービス		
MTU AERO ENGINES AG	—	276.5	2,273	277,409	資本財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	654 2銘柄	1,156.9 3銘柄	9,931 <10.3%>	1,212,028 <10.3%>		
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	10,724.32 7銘柄	9,515.98 6銘柄	20,089 <20.8%>	2,451,779 <20.8%>		
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	53,799.17 35銘柄	49,677.27 33銘柄	— <96.2%>	11,369,375 <96.2%>		

(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) < >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

2016年4月18日現在

項目	当期		比率
	評価額	比率	
株式	千円	%	
	11,369,375	95.2	
コール・ローン等、その他	577,536	4.8	
投資信託財産総額	11,946,911	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＝108.01円、1オーストラリア・ドル＝82.67円、1イギリス・ポンド＝153.22円、1スイス・フラン＝111.71円、1スウェーデン・クローネ＝13.27円、100韓国ウォン＝9.40円、1ユーロ＝122.04円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(11,608,972千円)の投資信託財産総額(11,946,911千円)に対する比率は、97.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	11,955,340,100円
コール・ローン等	466,852,123
株式(評価額)	11,369,375,195
未収入金	109,996,892
未収配当金	9,115,890
(B) 負債	141,545,896
未払金	8,498,545
未払解約金	5,338,028
未払信託報酬	127,355,654
その他未払費用	353,669
(C) 純資産総額(A - B)	11,813,794,204
元本	9,039,046,700
次期繰越損益金	2,774,747,504
(D) 受益権総口数	9,039,046,700口
1万口当り基準価額(C / D)	13,070円

*期首における元本額は10,146,113,328円、当期中における追加設定元本額は922,655,875円、同解約元本額は2,029,722,503円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,070円です。

■損益の状況

当期 自2015年4月21日 至2016年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	206,088,270円
受取配当金	205,758,965
受取利息	329,305
(B) 有価証券売買損益	△2,967,523,431
売買益	900,357,075
売買損	△3,867,880,506
(C) 信託報酬等	△ 293,894,349
(D) 当期損益金(A + B + C)	△3,055,329,510
(E) 前期繰越損益金	5,053,215,335
(F) 追加信託差損益金	776,861,679
(配当等相当額)	(779,243,400)
(売買損益相当額)	(△ 2,381,721)
(G) 合計(D + E + F)	2,774,747,504
次期繰越損益金(G)	2,774,747,504
追加信託差損益金	776,861,679
(配当等相当額)	(779,243,400)
(売買損益相当額)	(△ 2,381,721)
分配準備積立金	5,053,215,335
繰越損益金	△3,055,329,510

(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)」の表を参照。

(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：95,336,115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	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	779,243,400
(d) 分配準備積立金	5,053,215,335
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	5,832,458,735
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	5,832,458,735
(h) 受益権総口数	9,039,046,700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。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年4月20日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えくださいますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）」は15,698円です。」

★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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	純資産総額
	税 分	込 配 金	期 騰 落 中 率		
1 期末(2012年 4月18日)	円 10,005	円 0	% 0.1	% 69.8	百万円 403
2 期末(2013年 4月18日)	10,009	0	0.0	63.9	440
3 期末(2014年 4月18日)	10,012	0	0.0	72.6	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

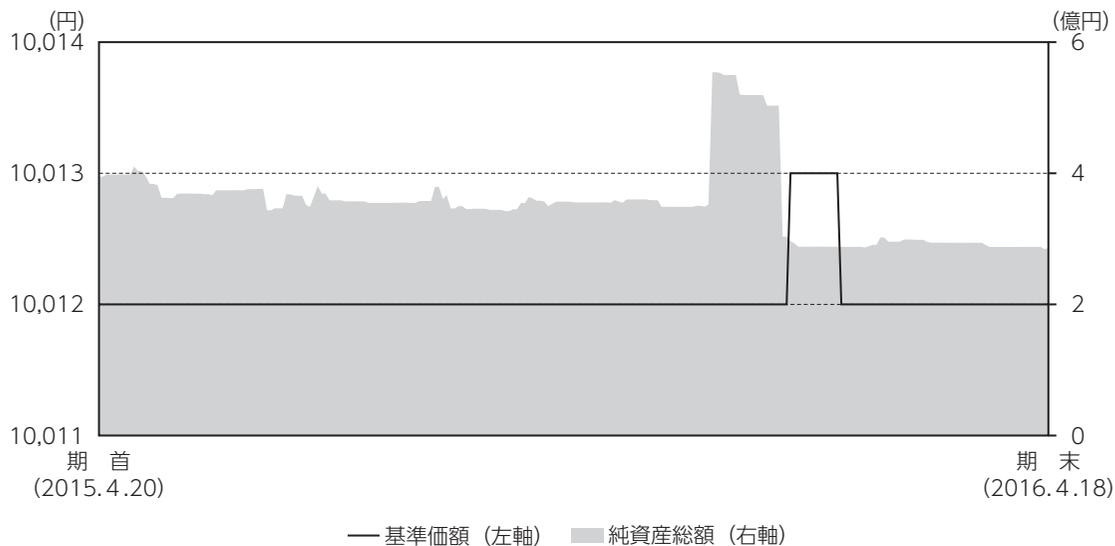
(注1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：10,012円

期 末：10,012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、基準価額は横ばいとなりました。

年 月 日	基 準	価 額		公 社 比 債 率 組 入 比 率
		騰 落 率	率	
(期首) 2015年 4月20日	円	10,012	% -	% 38.4
4月末	10,012		0.0	33.2
5月末	10,012		0.0	37.0
6月末	10,012		0.0	37.0
7月末	10,012		0.0	36.9
8月末	10,012		0.0	36.6
9月末	10,012		0.0	38.1
10月末	10,012		0.0	45.6
11月末	10,012		0.0	29.6
12月末	10,012		0.0	27.0
2016年 1月末	10,013		0.0	50.7
2月末	10,012		0.0	27.6
3月末	10,012		0.0	1.1
(期末) 2016年 4月18日	10,012		0.0	1.4

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

○国内短期金融市況

日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を導入したことを背景に、無担保コール翌日物金利は△0.07%程度まで低下、国庫短期証券（3カ月物）の利回りは△0.19%程度まで低下しました。

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tock・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tock・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

○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ないました。

○ダイワ・マネースtock・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り、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。

分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が少額であったため、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	
	2015年4月21日 ～2016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）		12

（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ないます。

○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、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
	(2015.4.21~2016.4.18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	3円	0.033%	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10,012円です。
(投信会社)	(1)	(0.008)	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)	(2)	(0.022)	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)	(0)	(0.003)	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 (監査費用)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	3	0.034	

(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

(2015年4月21日から2016年4月18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・マネースtock・マザーファンド	99,591	100,000	166,307	167,000

(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

(2015年4月21日から2016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 72,065	百万円 10,560	% 14.7	百万円 2,822	百万円 -	% -
コール・ローン	2,409,334	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.7%

*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		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	227,137	160,422	161,079			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016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	161,079	55.7
コール・ローン等、その他	128,020	44.3
投資信託財産総額	289,100	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4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	289,100,251円
コール・ローン等	128,020,425
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	161,079,826
(B) 負債	3,444,436
未払解約金	3,390,845
未払信託報酬	52,718
その他未払費用	873
(C) 純資産総額(A - B)	285,655,815
元本	285,307,385
次期繰越損益金	348,430
(D) 受益権総口数	285,307,385口
1万口当り基準価額(C / D)	10,012円

*期首における元本額は394,448,523円、当期中における追加設定元本額は420,311,262円、同解約元本額は529,452,400円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,012円です。

■損益の状況

当期 自2015年4月21日 至2016年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	74,882円
受取利息	74,882
(B) 有価証券売買損益	52,570
売買益	56,464
売買損	△ 3,894
(C) 信託報酬等	△120,678
(D) 当期繰益金(A + B + C)	6,774
(E) 前期繰越損益金	889
(F) 追加信託差損益金	340,767
(配当等相当額)	(254,240)
(売買損益相当額)	(86,527)
(G) 合計(D + E + F)	348,430
次期繰越損益金(G)	348,430
追加信託差損益金	340,767
(配当等相当額)	(254,240)
(売買損益相当額)	(86,527)
分配準備積立金	15,175
繰越損益金	△ 7,512

(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）」の表を参照。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年4月20日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えくださいますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）」は10,012円です。」

■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	5,795円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	340,767
(d) 分配準備積立金	9,380
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	355,942
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	355,942
(h) 受益権総口数	285,307,385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（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

(2015年4月21日から2016年4月18日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
568 国庫短期証券	2016/2/15	7,000,594	575 国庫短期証券	2016/6/10	1,500,603
574 国庫短期証券	2016/3/14	5,000,640	342 2年国債 0.1%	2016/7/15	720,475
573 国庫短期証券	2016/3/7	4,500,619	100 5年国債 0.3%	2016/9/20	601,368
567 国庫短期証券	2016/2/8	4,299,996			
540 国庫短期証券	2015/9/24	3,799,996			
576 国庫短期証券	2016/3/22	3,500,336			
557 国庫短期証券	2015/12/14	2,999,999			
555 国庫短期証券	2015/12/7	2,500,000			
553 国庫短期証券	2015/11/24	2,060,000			
578 国庫短期証券	2016/3/28	2,000,106			

(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（39,568,810千口）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

2016年4月18日現在							
区 分	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 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
国債証券	千円 1,000,000	千円 1,000,102	% 2.5	% -	% -	% -	% 2.5

(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4月18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	588 国庫短期証券		% -	千円 1,000,000	千円 1,000,102	2016/05/16

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第6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・マネースtock・マザーファンドの第6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

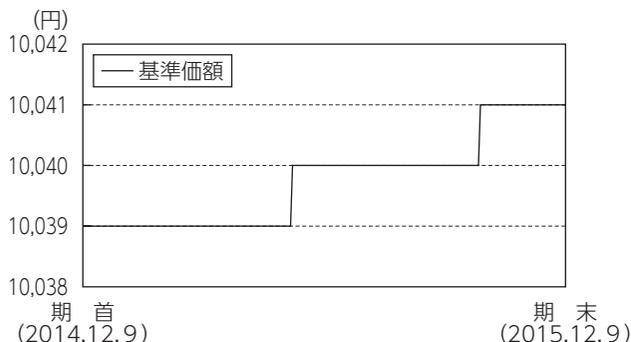
大和投資信託

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 組 入 比 率
	騰 落 率	%	
(期首)2014年12月9日	10,039	—	58.5
12月末	10,039	0.0	97.2
2015年1月末	10,039	0.0	71.6
2月末	10,039	0.0	62.6
3月末	10,039	0.0	56.0
4月末	10,039	0.0	58.0
5月末	10,040	0.0	59.9
6月末	10,040	0.0	56.2
7月末	10,040	0.0	57.4
8月末	10,040	0.0	55.6
9月末	10,040	0.0	59.3
10月末	10,041	0.0	71.0
11月末	10,041	0.0	52.1
(期末)2015年12月9日	10,041	0.0	51.6

- (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：10,039円 期末：10,041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

○国内短期金融市場

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き、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まいります。

◆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まいります。

■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	—
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。

■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)

国 内	買 付 額	売 付 額
国債証券	75,714,577	—
		(43,770,000)

- (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。

■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)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
568 国庫短期証券 2016/2/15	7,000,594		
574 国庫短期証券 2016/3/14	5,000,640		
573 国庫短期証券 2016/3/7	4,500,619		
540 国庫短期証券 2015/9/24	3,799,996		
557 国庫短期証券 2015/12/14	2,999,999		
567 国庫短期証券 2016/2/8	2,999,997		
520 国庫短期証券 2015/6/22	2,999,976		
555 国庫短期証券 2015/12/7	2,500,000		
553 国庫短期証券 2015/11/24	2,060,000		
536 国庫短期証券 2015/9/7	2,000,000		

- (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）

区 分	当 期			末			
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちB B格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	32,420,000	32,424,550	51.6	—	—	—	51.6

(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	当 期		末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	額面金額	評 価 額	
		千円	千円	千円	千円	
国債証券	557 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,999	2015/12/14	
	559 国庫短期証券	—	2,000,000	2,000,000	2015/12/21	
	560 国庫短期証券	—	1,600,000	1,599,999	2015/12/28	
	563 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/01/18	
	566 国庫短期証券	—	1,500,000	1,499,999	2016/02/01	
	567 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,998	2016/02/08	
	568 国庫短期証券	—	7,000,000	7,000,594	2016/02/15	
	573 国庫短期証券	—	4,500,000	4,500,612	2016/03/07	
	556 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,123	2016/03/10	
	574 国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,640	2016/03/14	
	575 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,448	2016/06/10	
	342 2年国債	0.1000	720,000	720,576	2016/07/15	
	100 5年国債	0.3000	600,000	601,560	2016/09/20	
合計	銘柄数 13銘柄		32,420,000	32,424,550		

(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		率
	評 価 額	比	
	千円	%	
公社債	32,424,550	40.2	
コール・ローン等、その他	48,181,367	59.8	
投資信託財産総額	80,605,918	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	80,605,918,433円	
コール・ローン等	48,180,683,441	
公社債(評価額)	32,424,550,578	
未収利息	481,238	
前払費用	203,176	
(B) 負債	17,814,126,500	
未払金	17,502,126,500	
未払解約金	312,000,000	
(C) 純資産総額(A-B)	62,791,791,933	
元本	62,535,131,959	
次期繰越損益金	256,659,974	
(D) 受益権総口数	62,535,131,959口	
1万口当り基準価額(C/D)	10,041円	

* 期首における元本額は817,136,908円、当期中における追加設定元本額は80,209,414,361円、同解約元本額は18,491,419,310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) 112,594,660円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジなし) 73,734,556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・テクノロジー関連株ファンド-ロボテック-3,983,667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、アジア高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型) 999円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Aコース2,996,693円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Bコース2,494,264円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Aコース999,197円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Bコース698,255円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Bコース458,853円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Aコース1,994,416円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Bコース648,186円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Cコース179,498円、世界優先証券ファンド(為替ヘッジあり/限定追加型) 998円、US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) 3,988,832円、US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) 4,984円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス14,063,387,856円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス2,983,307,364円、ダイワ上場投信-TOP I Xレバレッジ(2倍) 指数2,081,906,471円、ダイワ上場投信-TOP I Xダブルインバース(一2倍) 指数796,936,766円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス37,546,378,604円、ダイワ上場投信-TOP I Xインバース(一1倍) 指数2,340,731,717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687,286,710円、ダイワ上場投信-J P X日経400インバース・インデックス278,916,205円、ダイワ上場投信-J P X日経400ダブルインバース・インデックス727,153,136円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型) 為替ヘッジあり7,009,001円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型) 為替ヘッジなし904,221円、ダイワ・プルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ4,980,676円、ダイワ・プルベア・セレクト ドル高安ポートフォリオ258,995,899円、ダイワ・プルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ69,726,080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-成長の権首(つちおと) -11,000,000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197,260,107円、ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ90,940,158円、ダイワ米国高利回り不動産証券ファンド19,942,168円、通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 豪ドル・コース(毎月分配型) 4,184,518円、通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ ブラジリアル・コース(毎月分配型) 12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 通貨セレクト・コース(毎月分配型) 4,981,569円、ダイワUS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) 199,295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、<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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) ブラジリアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・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、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/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジあり) 20,016,725円、ダイワ/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジなし) 4,000,959円、ダイワ/ミレーアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド49,850,449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- 米ドル・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3,488,836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2,492,026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 ブラジリアル・コース

3,488,836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19,936,205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11,961,723円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,041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	4,849,980円
受取利息	4,849,980
(B) 有価証券売買損益	△ 176,333
売買益	15,667
売買損	△ 192,000
(C) 当期損益金(A + B)	4,673,647
(D) 前期繰越損益金	3,178,379
(E) 解約差損益金	△ 74,181,691
(F) 追加信託差損益金	322,989,639
(G) 合計(C + D + E + F)	256,659,974
次期繰越損益金(G)	256,659,974

(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。