

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	追加型投信／海外／株式
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	追加型投信／国内／債券
信託期間	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	約10年間（2011年4月19日～2021年4月16日）
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	約9年11か月間（2011年5月16日～2021年4月16日）
運用方針	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	世界（※）の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。また、DR（預託証券）を含みます。）（※）日本を除きます。以下同じ。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	イ、ダイワ・マネーストック・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券 ロ、円建ての債券
運用方法	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	①主として、世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）の中から、割安と判断される株式を厳選して投資することにより信託財産の成長をめざします。 ②以下の方針を基本として運用を行いません。 イ、世界の株式の中から流動性等を勘案し、投資対象銘柄を選定します。 ロ、投資対象銘柄から、PERやPBR等の株価バリュエーション等を考慮し、調査対象銘柄を決定します。 ハ、調査対象銘柄に対して企業訪問による調査や綿密な財務分析等を行ない、株式の本源的価値（※）と比較し割安と判断される銘柄を組入候補銘柄とします。 ※株式の本源的価値とは、ハリス・アンソニエツ・エル・ビーが独自に評価した企業本来の価値をいいます。 ニ、組入候補銘柄から銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 ③外貨建資産の運用にあたっては、ハリス・アンソニエツ・エル・ビーに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④株式の組入比率は、通常の状態では高位に維持することを基本とします。 ⑤為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド マネー・ポートフォリオ	①マザーファンドの受益証券および円建ての債券を中心に投資することにより、安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
組入制限	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	・株式組入上限比率は無制限
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の10%以下
分配方針	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
	ダイワ／ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	分配対象額は、経費控除後の配当等収益とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてペビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ

運用報告書（全体版） 第6期 （決算日 2017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6期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9：00～17：00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

<4797>
<4799>

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数(円換算)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
6期末(2017年4月18日)	14,962	600	19.1	18,674	12.0	96.5	—	10,443

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

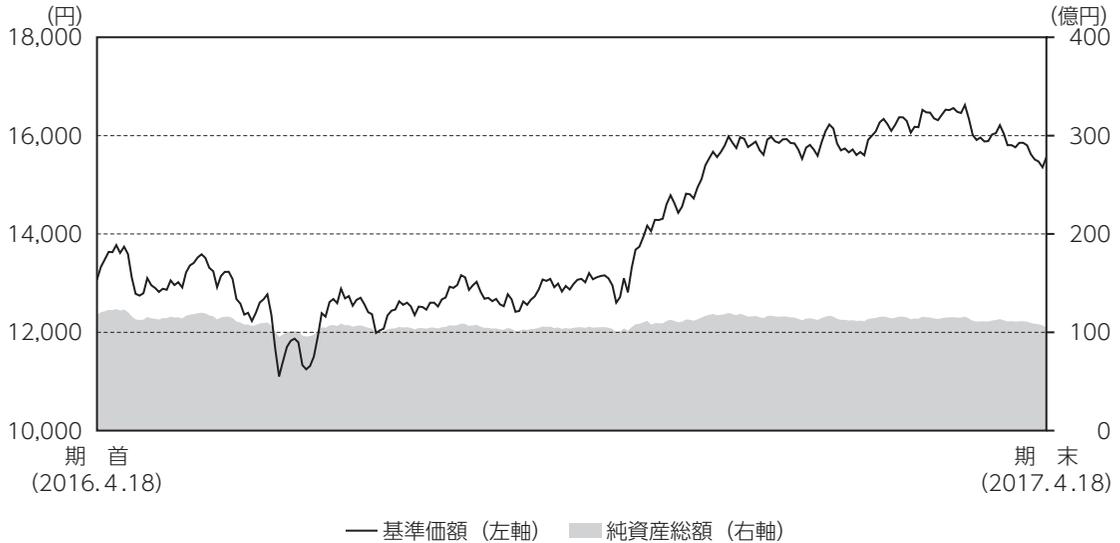
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■ 基準価額・騰落率

期首：13,070円

期末：14,962円 (分配金600円)

騰落率：19.1% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

海外の株式市況が上昇したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数(円換算)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2016年 4月18日	円 13,070	% -	16,666	% -	% 96.2	% -
4 月末	13,590	4.0	17,113	2.7	97.0	-
5 月末	13,586	3.9	17,224	3.3	97.6	-
6 月末	11,700	△10.5	15,555	△ 6.7	97.0	-
7 月末	12,570	△ 3.8	16,515	△ 0.9	98.2	-
8 月末	12,927	△ 1.1	16,438	△ 1.4	96.7	-
9 月末	12,558	△ 3.9	16,030	△ 3.8	97.5	-
10月末	13,158	0.7	16,321	△ 2.1	97.1	-
11月末	14,555	11.4	17,796	6.8	97.6	-
12月末	15,610	19.4	18,881	13.3	97.6	-
2017年 1 月末	15,837	21.2	18,826	13.0	97.9	-
2 月末	16,179	23.8	19,177	15.1	98.5	-
3 月末	16,214	24.1	19,320	15.9	96.8	-
(期末) 2017年 4月18日	15,562	19.1	18,674	12.0	96.5	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2016.4.19～2017.4.18)

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。2016年6月下旬に行なわれた英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持派が多数だったことを受けて株式市況が下落する場面がありましたが、主要中央銀行が緩和的な金融政策で経済を支えるとの期待や、英国で早々と新首相が任命されて政局の先行き不透明感が一部払しょくされたこと、良好な米国経済指標、原油価格の回復などが支援材料となり、9月上旬にかけて上昇基調となりました。11月上旬にかけては、米国の大統領選挙を前に投資家の手控えムードが強まる中、ボックス圏での推移となりました。その後は、予想外に米国大統領選挙でトランプ氏が勝利したことで、同氏の減税やインフラ（社会基盤）投資などの経済政策への期待から市場のリスク選好が強まったことに加え、11月末のOPEC（石油輸出国機構）総会で減産合意に至ったことで原油価格が上昇に転じたこと、世界的に良好な経済指標が増えてきたことなどを受けて、期末にかけて堅調に推移しました。

■為替相場

米ドルは対円でほぼ横ばいとなりました。日銀がマイナス金利政策を維持する中、英国の国民投票をめぐる混乱から投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、米国の早期追加利上げ観測が後退したことなどを受けて、期首から2016年8月中旬にかけて米ドルは対円で下落しました。その後、米国の大統領選挙を受けてトランプ氏の経済政策への期待などから市場のリスク選好が強まったことや内外金利差の拡大などを受けて、12月中旬にかけて米ドルは対円で上昇しました。期末にかけては、米国のトランプ大統領が日本の為替政策を批判する旨の発言を行なったことやフランス大統領選挙の先行き不透明感の高まりなどを受けて、米ドルは対円で下落しました。

前期における「今後の運用方針」

ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、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。

ポートフォリオについて

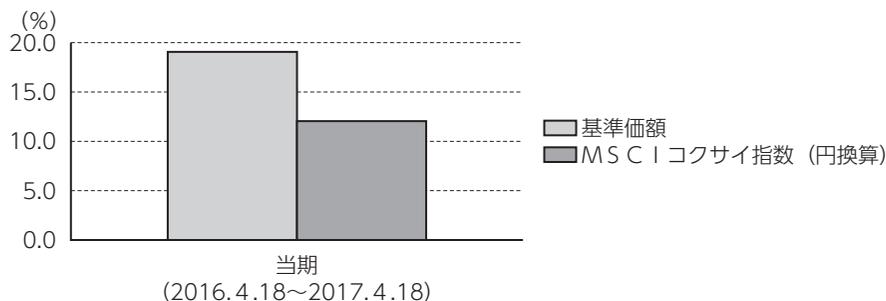
(2016.4.19～2017.4.18)

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数は海外株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は600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	
	2016年4月19日 ～2017年4月18日	
当期分配金（税込み）	（円）	600
対基準価額比率	（％）	3.86
当期の収益	（円）	210
当期の収益以外	（円）	389
翌期繰越分配対象額	（円）	6,070

（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	210.05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	1,281.32
(d) 分配準備積立金	5,178.96
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,670.34
(f) 分配金	600.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,070.34

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

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

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2016.4.19~2017.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	273円	1.944%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,028円です。
(投 信 会 社)	(159)	(1.134)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(106)	(0.756)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(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	0.034	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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)	(0.034)	
有 価 証 券 取 引 税	8	0.060	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)	(8)	(0.060)	
そ の 他 費 用	7	0.051	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)	(6)	(0.041)	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)	(0.005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	293	2.089	

(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

(2016年4月19日から2017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 1,469.85 ()	千アメリカ・ドル 6,736 (△ 104)	百株 4,474.32	千アメリカ・ドル 20,661	
	オーストラリア	百株 377 (405.24)	千オーストラリア・ドル 138 (133)	百株 7,582	千オーストラリア・ドル 2,457	
	イギリス	百株 80,741 ()	千イギリス・ポンド 8,074 ()	百株 19,359	千イギリス・ポンド 4,202	
	スイス	百株 1,249 ()	千スイス・フラン 2,153 (△ 407)	百株 3,281.05	千スイス・フラン 10,837	
	韓国	百株 - ()	千韓国ウォン - ()	百株 25.1	千韓国ウォン 4,212,060	
	ユーロ (オランダ)	百株 104 (24.29)	千ユーロ 93 (56)	百株 2,187	千ユーロ 2,335	
	ユーロ (フランス)	百株 - ()	千ユーロ - ()	百株 991.3	千ユーロ 3,887	
	ユーロ (ドイツ)	百株 766.2 ()	千ユーロ 4,921 ()	百株 439.15	千ユーロ 4,475	
	国	ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 870.2 (24.29)	千ユーロ 5,015 (56)	百株 3,617.45	千ユーロ 10,698

(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

(2016年4月19日から2017年4月18日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	8,547,827千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,784,662千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.79

(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

(2016年4月19日から2017年4月18日まで)

当				期			
銘 柄	株 数	買 付		銘 柄	株 数	売 付	
		金 額	平均単価			金 額	平均単価
LLOYDS BANKING GROUP PLC (イギリス)	千株 7,833.7	千円 590,186	円 75	BNP PARIBAS (フランス)	千株 99.13	千円 446,481	円 4,504
TRAVIS PERKINS PLC (イギリス)	186.1	347,900	1,869	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)	2.51	403,631	160,809
WIRECARD AG (ドイツ)	43.4	247,817	5,710	LAFARGEHOLCIM LTD-REG (スイス)	69.895	397,946	5,693
GRUPO TELEvisa SA-SPON ADR (メキシコ)	85.9	217,994	2,537	LINKEDIN CORP - A (アメリカ)	15.63	307,780	19,691
BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	10.315	191,129	18,529	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG (スイス)	170.6	273,425	1,602
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES (ドイツ)	21.1	163,475	7,747	JULIUS BAER GROUP LTD (スイス)	55.47	271,395	4,892
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG (スイス)	112.3	162,413	1,446	SMITHS GROUP PLC (イギリス)	138	253,823	1,839
LINKEDIN CORP - A (アメリカ)	12.13	162,126	13,365	CIE FINANCIERE RICHMONT-REG (スイス)	32.14	239,288	7,445
DIAGEO PLC (イギリス)	54.3	154,641	2,847	MTU AERO ENGINES AG (ドイツ)	17.84	235,332	13,191
ALLIANZ SE-REG (ドイツ)	8.92	137,269	15,389	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	105.5	214,546	2,033

(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		業 種 等
	株 数	株 数	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	
ARCONIC INC	-	202	539	58,868	資本財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	649	491	1,516	165,608	一般消費財・サービス
CITIGROUP INC	845	653.4	3,854	420,862	金融
TE CONNECTIVITY LTD	810	593.7	4,320	471,739	情報技術
CENTENE CORP	130.32	-	-	-	ヘルスケア
BAIDU INC - SPON ADR	114.35	140.3	2,431	265,499	情報技術
GENERAL MOTORS CO	1,514	1,199	4,064	443,814	一般消費財・サービス
LINKEDIN CORP - A	35	-	-	-	その他
ALPHABET INC-CL C	61.87	48.92	4,095	447,180	情報技術
ITRON INC	392	260.25	1,554	169,789	情報技術
TENET HEALTHCARE CORP	857	763	1,226	133,965	ヘルスケア
UNION PACIFIC CORP	321.5	183.05	1,939	211,824	資本財・サービス
ORACLE CORP	912	671	2,971	324,497	情報技術
MASTERCARD INC - A	412	300.95	3,390	370,241	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	3,040	1,985	4,527	494,388	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	566	501	1,881	205,468	エネルギー
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,711	1,063	2,666	291,100	一般消費財・サービス
CARMAX INC	241	306	1,717	187,542	一般消費財・サービス
USG CORP	880	662	2,087	227,910	資本財・サービス
GRUPO TELEVISIA SA-SPON ADR	615	1,079	2,812	307,146	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>	14,107.04 19銘柄	11,102.57 18銘柄	47,600 5,197,451	- <49.8%>
(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	17,546.03	10,746.27	3,922	324,930	素材
オーストラリア・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	17,546.03 1銘柄	10,746.27 1銘柄	3,922 <3.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
DIAGEO PLC	669	855	1,964	269,490	生活必需品
SMITHS GROUP PLC	1,380	-	-	-	資本財・サービス
LLOYDS BANKING GROUP PLC	-	60,969	3,823	524,412	金融
TRAVIS PERKINS PLC	-	1,607	2,481	340,322	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>	2,049 2銘柄	63,431 3銘柄	8,269 1,134,225	- <10.9%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,848	3,265	4,701	511,157	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	1,139	584.3	2,880	313,115	金融
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	499	222.6	1,783	193,850	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	946.17	328.22	1,898	206,432	素材
スイス・フラン 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,432.17 4銘柄	4,400.12 4銘柄	11,263 1,224,556	- <11.7%>
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	27.05	1.95	405,210	39,062	情報技術
韓国ウォン 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	27.05 1銘柄	1.95 1銘柄	405,210 39,062	- <0.4%>

銘柄	期首		当 期		業 種 等
	株 数	株 数	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	744.78	424.07	1,260	146,475	資本財・サービス
CNH INDUSTRIAL NV	6,623	4,885	4,582	532,443	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,367.78 2銘柄	5,309.07 2銘柄	5,842 678,919	- <6.5%>
(ユーロ(フランス))	百株	百株	千ユーロ	千円	
BNP PARIBAS	991.3	-	-	-	金融
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	991.3 1銘柄	- -	- <->	
(ユーロ(ドイツ))	百株	百株	千ユーロ	千円	
ALLIANZ SE-REG	253.4	256.05	4,372	508,032	金融
WIRECARD AG	-	425.6	2,273	264,236	情報技術
DAWLER AG-REGISTERED SHARES	627	672.2	4,464	518,804	一般消費財・サービス
MTU AERO ENGINES AG	276.5	130.1	1,615	187,685	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,156.9 3銘柄	1,483.95 4銘柄	12,725 1,478,758	- <14.2%>
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,515.98 6銘柄	6,793.02 6銘柄	18,568 2,157,677	- <20.7%>
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	49,677.27 33銘柄	96,474.93 33銘柄	- 11,007,904	- <96.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の中値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 10,077,904	% 91.6
コール・ローン等、その他	924,333	8.4
投資信託財産総額	11,002,237	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中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=109.19円、1オーストラリア・ドル=82.84円、1イギリス・ポンド=137.16円、1スイス・フラン=108.72円、1スウェーデン・クローネ=12.12円、100韓国ウォン=9.64円、1ユーロ=116.20円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(10,296,418千円)の投資信託財産総額(11,002,237千円)に対する比率は、93.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	11,022,805,886円
コール・ローン等	769,990,434
株式(評価額)	10,077,904,509
未収入金	149,658,054
未収配当金	25,252,889
(B) 負債	579,599,714
未払金	31,133,170
未払収益分配金	418,781,402
未払解約金	20,335,653
未払信託報酬	109,045,596
その他未払費用	303,893
(C) 純資産総額(A - B)	10,443,206,172
元本	6,979,690,048
次期繰越損益金	3,463,516,124
(D) 受益権総口数	6,979,690,048口
1万口当り基準価額(C / D)	14,962円

*期首における元本額は9,039,046,700円、当期中における追加設定元本額は577,894,981円、同解約元本額は2,637,251,633円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は14,962円です。

■損益の状況

当期 自2016年4月19日 至2017年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	166,287,464円
受取配当金	166,061,874
受取利息	316,460
支払利息	△ 90,870
(B) 有価証券売買損益	1,696,210,057
売買益	2,465,058,959
売買損	△ 768,848,902
(C) 信託報酬等	△ 220,299,096
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,642,198,425
(E) 前期繰越損益金	1,429,162,704
(F) 追加信託差損益金	810,936,397
(配当等相当額)	(894,325,484)
(売買損益相当額)	(△ 83,389,087)
(G) 合計(D + E + F)	3,882,297,526
(H) 収益分配金	△ 418,781,402
次期繰越損益金(G+H)	3,463,516,124
追加信託差損益金	810,936,397
(配当等相当額)	(894,325,484)
(売買損益相当額)	(△ 83,389,087)
分配準備積立金	3,342,587,898
繰越損益金	△ 690,008,171

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

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

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

(注4) 投資信託財産の運用に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：71,584,353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	146,614,755円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	894,325,484
(d) 分配準備積立金	3,614,754,545
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	4,655,694,784
(f) 分配金	418,781,402
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	4,236,913,382
(h) 受益権総口数	6,979,690,048口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	600円

- <分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、4月18日現在の基準価額（1万口当り14,962円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 率 組 入 比	純 資 産 総 額
	税 分	込 配 金	期 騰 落 中 率		
2 期 末 (2013 年 4 月 18 日)	円 10,009	円 0	% 0.0	% 63.9	百万円 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
6 期 末 (2017 年 4 月 18 日)	10,006	0	△0.1	26.7	616

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

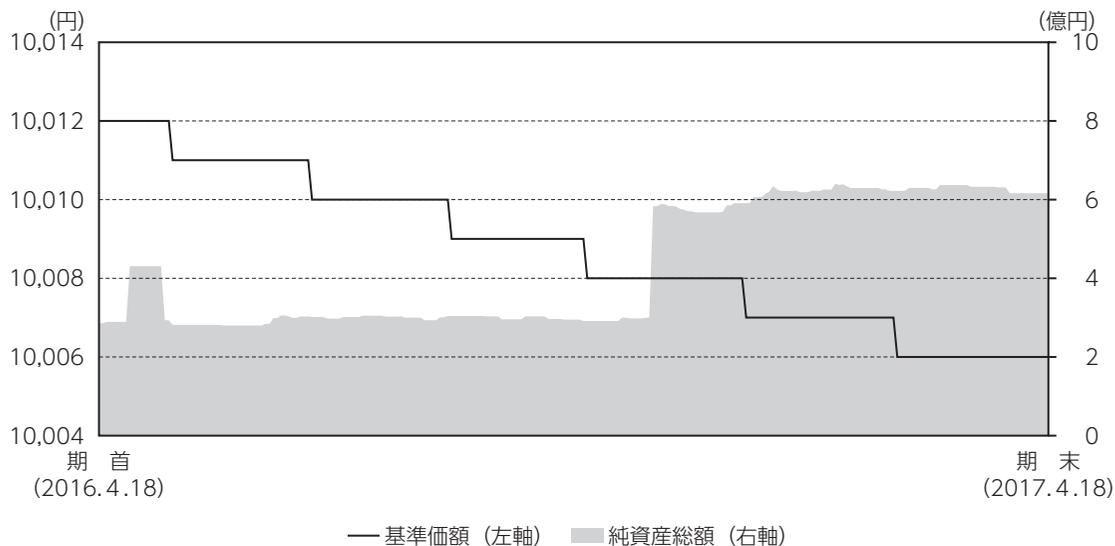
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

期首：10,012円

期末：10,006円

騰落率：△0.1%

■基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券を通じて投資した短期の国債やコール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準	価 額		公 社 比 債 率 組 入 比 率
		騰 落 率	率	
(期首) 2016年 4月18日	円	10,012	% -	% 1.4
4月末		10,012	0.0	4.6
5月末		10,011	△0.0	0.1
6月末		10,011	△0.0	1.4
7月末		10,010	△0.0	13.5
8月末		10,009	△0.0	32.5
9月末		10,009	△0.0	18.2
10月末		10,008	△0.0	2.4
11月末		10,008	△0.0	18.9
12月末		10,007	△0.0	-
2017年 1月末		10,007	△0.0	21.8
2月末		10,006	△0.1	17.6
3月末		10,006	△0.1	-
(期末) 2017年 4月18日		10,006	△0.1	26.7

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2016.4.19～2017.4.18)

■国内短期金融市況

期首より、日銀はマイナス金利付き量的・質的金融緩和を継続し、2016年9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。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

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。

ポートフォリオについて

(2016.4.19～2017.4.18)

■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

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目		当 期
		2016年4月19日 ～2017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)	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（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

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



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いません。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2016.4.19~2017.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	一円	—%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,009円です。
(投 信 会 社)	(一)	(一)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目 論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(一)	(一)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後 の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(一)	(一)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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	0.001	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.001	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年4月19日から2017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	425,032	426,646	155,554	156,153

(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

(2016年4月19日から2017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 300,418	百万円 67,071	% 22.3	百万円 -	百万円 -	% -
コール・ローン	8,798,832	-	-	-	-	-

(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	160,422	429,899	431,404			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	431,404	70.0
コール・ローン等、その他	184,887	30.0
投資信託財産総額	616,291	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4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	616,291,445円
コール・ローン等	184,887,120
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	431,404,325
(B) 負債	2,288
その他未払費用	2,288
(C) 純資産総額(A - B)	616,289,157
元本	615,919,777
次期繰越損益金	369,380
(D) 受益権総口数	615,919,777口
1万口当り基準価額(C/D)	10,006円

*期首における元本額は285,307,385円、当期中における追加設定元本額は634,072,210円、同解約元本額は303,459,818円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,006円です。

■損益の状況

当期 自2016年4月19日 至2017年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 59,975円
受取利息	12,395
支払利息	△ 72,370
(B) 有価証券売買損益	△142,254
売買益	23,418
売買損	△165,672
(C) 信託報酬等	△ 3,629
(D) 当期損益金(A + B + C)	△205,858
(E) 前期繰越損益金	3,547
(F) 追加信託差損益金	571,691
(配当等相当額)	(527,539)
(売買損益相当額)	(44,152)
(G) 合計(D + E + F)	369,380
次期繰越損益金(G)	369,380
追加信託差損益金	571,691
(配当等相当額)	(527,539)
(売買損益相当額)	(44,152)
分配準備積立金	40,492
繰越損益金	△242,803

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	33,468
(c) 収益調整金	571,691
(d) 分配準備積立金	7,024
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	612,183
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	612,183
(h) 受益権総口数	615,919,777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（2016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（2017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

(2016年4月19日から2017年4月18日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
591 国庫短期証券	2016/5/30	18,690,605			
601 国庫短期証券	2016/7/19	18,510,383			
613 国庫短期証券	2016/9/12	18,220,258			
645 国庫短期証券	2017/2/20	17,010,400			
611 国庫短期証券	2016/9/5	15,210,394			
596 国庫短期証券	2016/6/20	11,560,241			
657 国庫短期証券	2017/4/17	10,150,199			
652 国庫短期証券	2017/3/27	9,790,078			
642 国庫短期証券	2017/2/6	9,700,144			
609 国庫短期証券	2016/8/22	8,580,187			

(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、2017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（34,904,526千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

2017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	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	13,340,000	13,340,505	38.1	—	—	—	—	38.1

(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。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2017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
			%	千円	千円	
国債証券	602 国庫短期証券		—	60,000	60,000	2017/04/20
	659 国庫短期証券		—	7,480,000	7,480,119	2017/04/24
	660 国庫短期証券		—	690,000	690,018	2017/05/01
	661 国庫短期証券		—	140,000	140,006	2017/05/08
	644 国庫短期証券		—	3,770,000	3,770,237	2017/05/12
	663 国庫短期証券		—	260,000	260,017	2017/05/15
	665 国庫短期証券		—	10,000	10,000	2017/05/22
	666 国庫短期証券		—	930,000	930,103	2017/05/29
合 計	銘 柄 数 金 額	8銘柄		13,340,000	13,340,505	

(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7期 (決算日 2016年12月9日)

(計算期間 2015年12月10日～2016年12月9日)

ダイワ・マネースtock・マザーファンドの第7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

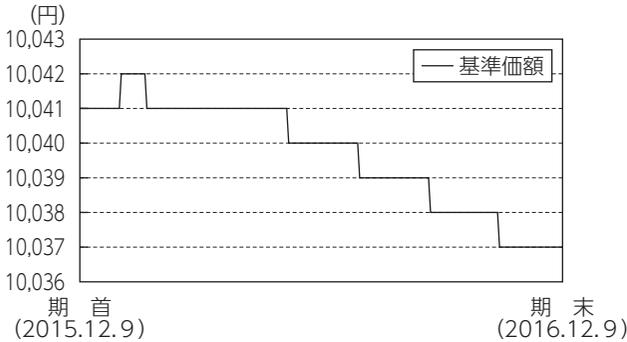
大和投資信託

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)2015年12月9日	円 10,041	% -	51.6
12月末	10,041	0.0	51.7
2016年1月末	10,042	0.0	90.7
2月末	10,041	0.0	51.1
3月末	10,041	0.0	2.0
4月末	10,041	0.0	7.5
5月末	10,040	△0.0	0.1
6月末	10,040	△0.0	2.0
7月末	10,039	△0.0	19.3
8月末	10,038	△0.0	46.5
9月末	10,038	△0.0	26.0
10月末	10,037	△0.0	3.4
11月末	10,037	△0.0	26.6
(期末)2016年12月9日	10,037	△0.0	29.1

(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：10,041円 期末：10,037円 騰落率：△0.0%

【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、日銀は量的・質的金融緩和を継続し、2016年1月にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。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低下しました。

◆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、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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《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を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

国 内	買 付 額	売 付 額
国債証券	215,986,756	2,822,446 (233,210,000)

(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

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

買 付			売 付		
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
591	国庫短期証券 2016/5/30	18,690,605	575	国庫短期証券 2016/6/10	1,500,603
601	国庫短期証券 2016/7/19	18,510,383	342	2年国債 0.1% 2016/7/15	720,475
613	国庫短期証券 2016/9/12	18,220,258	100	5年国債 0.3% 2016/9/20	601,368
611	国庫短期証券 2016/9/5	15,210,394			
596	国庫短期証券 2016/6/20	11,560,241			
588	国庫短期証券 2016/5/16	9,500,428			
609	国庫短期証券 2016/8/22	8,580,187			
629	国庫短期証券 2016/11/28	8,570,294			
610	国庫短期証券 2016/8/29	7,920,152			
619	国庫短期証券 2016/10/11	7,720,160			

(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		組入比率	期 末		
	額面金額	評 価 額		うち8B格以下 組入比率	残存期間別組入比率	
	千円	千円	%	%	%	%
国債証券	12,370,000	12,370,239	29.1	-	-	29.1

(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。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	当 期		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
		千円	千円	
国債証券	632 国庫短期証券	7,380,000	7,380,059	2016/12/12
	634 国庫短期証券	2,070,000	2,070,043	2016/12/19
	635 国庫短期証券	2,920,000	2,920,135	2016/12/26
合計	銘柄数 金額	3銘柄 12,370,000	12,370,239	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項 目	当 期		率
	評 価 額	比	
	千円	%	
公社債	12,370,239	27.2	
コール・ローン等、その他	33,049,576	72.8	
投資信託財産総額	45,419,816	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12月9日現在

項 目	当 期	末
(A) 資産	45,419,816,005円	
コール・ローン等	33,049,294,532	
公社債(評価額)	12,370,239,552	
その他未収収益	281,921	
(B) 負債	2,970,027,930	
未払金	1,470,027,930	
未払解約金	1,500,000,000	
(C) 純資産総額(A-B)	42,449,788,075	
元本	42,294,564,193	
次期繰越損益金	155,223,882	
(D) 受益権総口数	42,294,564,193口	
1万口当り基準価額(C/D)	10,037円	

* 期首における元本額は62,535,131,959円、当期中における追加設定元本額は110,785,944,225円、同解約元本額は131,026,511,991円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジあり) 3,021,993円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジなし) 1,018,149円、ダイワ米国バンクロー

ン・ファンド(為替ヘッジあり) 2014-07 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 2014-09 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 2014-11 9,962円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド - ロボテック-49,795,838円、新興国ソブリン・豪ドルファンド(毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ブラジルレアルファンド(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、U S短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型) 3,988,832円、U S短期高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型) 4,984円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド - ロボテック - (為替ヘッジあり) 39,849円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド(年1回決算型) - ロボテック(年1回) - (為替ヘッジあり) 3,985円、ダイワ上場投信 - 日経平均レバレッジ・インデックス13,026,074,887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7,057,921,466円、ダイワ上場投信 - T O P I Xレバレッジ(2倍) 指数1,434,536,786円、ダイワ上場投信 - T O P I Xダブルインバース(-2倍) 指数757,087,194円、ダイワ上場投信 - 日経平均インバース・インデックス11,055,796,865円、ダイワ上場投信 - T O P I Xインバース(-1倍) 指数2,230,635,146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901,494,652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4,402,808,262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31,802,045円、ダイワ米国投資法人債ファンド(為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(部分為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(為替ヘッジあり) 2016-10 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(部分為替ヘッジあり) 2016-10 997円、ダイワ・ブルベア・セレクト・マネー・ポートフォリオ185,052,355円、ダイワ・ブルベア・セレクト・ドル高円安ポートフォリオ160,376,323円、ダイワ・ブルベア・セレクト・円高ドル安ポートフォリオ76,963,963円、ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - S L Tレード-48,811,188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-成長の権音(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395,846,364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91,481,943円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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 ブラジル・レアル・コース(毎月分配型) 12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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U S短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型) 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、ダイワ/ミレアセット亜細亜株ファンド9,958,176円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり49,806円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし49,806円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) ブラジル・レアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) 通貨セレクト・コース3,685,259円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド(年1回決算型) - ロボテック(年1回) - 100,588円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり(毎月分配型) 399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし(毎月分配型) 99,771円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース(毎月分配型) 399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース(毎月分配型) 99,771円、ダイワ/ミレアセット・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) 2,088,438円、ダイワ/ミレアセット・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) 1,012,911円、ダイワ/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド10,009,811円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 日本円・コース(毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 豪ドル・コース(毎月分配型) 99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- ブラジル・レアル・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1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイⅡ - 予想分配金提示型 豪ドル・コース499,994円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイⅡ - 予想分配金提示型 ブラジル・レアル・コース1,496,804円、

通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イーグルアイII- 予想分配金提示型
米ドル・コース9,976,045円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イーグル
アイII- 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース2,001,563円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,037円です。

■ 損益の状況

当期 自2015年12月10日 至2016年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 16,210,382円
受取利息	△ 3,627,074
その他収益金	281,921
支払利息	△ 12,865,229
(B) 有価証券売買損益	△ 1,217,528
売買益	236,035
売買損	△ 1,453,563
(C) その他費用	△ 176,405
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 17,604,315
(E) 前期繰越損益金	256,659,974
(F) 解約差損益金	△525,706,324
(G) 追加信託差損益金	441,874,547
(H) 合計(D + E + F + G)	155,223,882
次期繰越損益金(H)	155,223,882

(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。