

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	追加型投信／海外／株式	
信託期間	約5年間（2011年12月28日～2016年12月20日）	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。	
主要投資対象	①ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド（※1）」（以下「香港ハンセン指数ファンド（※1）」といいます。）の受益証券（円建）②ダイワ・マネープール・マザーファンドの受益証券（※1）は、以下の各コースにおいて、次のように読み替えるものとします。 「ブラジルリアルコース」の場合……ブラジルリアルクラス、「豪ドルコース」の場合……豪ドルクラス、「南アフリカランドコース」の場合……南アフリカランドクラス、「資源国通貨コース」の場合……資源国通貨クラス、「香港ドルコース」の場合……香港ドルクラス、「日本円コース」の場合……日本円クラス	
運用方法	香港ドルコース以外	①主として、香港ハンセン指数ファンド（※1）の受益証券を通じて、香港証券取引所上場の株式（上場予定を含みます。）に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えるとともに、香港ドル建資産について為替取引を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行いません。②当ファンドは、香港ハンセン指数ファンド（※1）とダイワ・マネープール・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、香港ハンセン指数ファンド（※1）への投資割合を高位に維持することを基本とします。③香港ハンセン指数ファンド（※1）では、為替取引を活用して、（※2）で実質的な運用を行いません。また、効率的な運用を行なうため、株価指数先物取引等を活用する場合があります。（※1）は前述。（※2）は、以下の各コースにおいて、次のように読み替えるものとします。 「ブラジルリアルコース」の場合……ブラジル・リアル 「豪ドルコース」の場合……豪ドル 「南アフリカランドコース」の場合……南アフリカ・ランド 「資源国通貨コース」の場合……資源国通貨（ブラジル・リアル、豪ドル、南アフリカ・ランドにおおむね均等） 「日本円コース」の場合……日本円
	香港ドルコース	①主として、香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）の受益証券を通じて、香港証券取引所上場の株式（上場予定を含みます。）に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることにより、信託財産の成長をめざして運用を行いません。②当ファンドは、香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）とダイワ・マネープール・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。③香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）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いません。なお、効率的な運用を行なうため、株価指数先物取引等を活用する場合があります。
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、継続的な分配を行なうことを目標に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。また、第1および第2計算期末には、収益の分配は行いません。	

# 香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型)

ブラジルリアルコース  
豪ドルコース  
南アフリカランドコース  
資源国通貨コース  
香港ドルコース  
日本円コース

## 運用報告書(全体版)

第55期	(決算日)	2016年7月20日)
第56期	(決算日)	2016年8月22日)
第57期	(決算日)	2016年9月20日)
第58期	(決算日)	2016年10月20日)
第59期	(決算日)	2016年11月21日)
満期償還	(償還日)	2016年12月20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、「香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）」は、このたび、満期償還となりました。

ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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 (3133)  
お問い合わせ先（コールセンター） (3134)  
TEL 0120-106212 (3135)  
(営業日の9:00～17:00) (3136)  
<http://www.daiwa-am.co.jp/> (3137)  
(3138)

★ブラジルリアルコース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		ブラジル・リアル 為替レート		公社債 組入率	投資信託 受益証券 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	(参考指数)	期中 騰落率			
31期末 (2014年7月22日)	円 11,075	円 110	% 1.3	12,554	% 0.9	円 45.68	% △ 0.4	% 0.3	% 98.6	百万円 235
32期末 (2014年8月20日)	11,836	110	7.9	13,486	7.4	45.83	0.3	0.3	99.1	233
33期末 (2014年9月22日)	11,527	110	△ 1.7	13,047	△ 3.3	46.02	0.4	0.2	99.0	371
34期末 (2014年10月20日)	10,307	110	△ 9.6	12,359	△ 5.3	43.98	△ 4.4	0.2	99.0	367
35期末 (2014年11月20日)	10,847	110	6.3	12,547	1.5	45.96	4.5	0.1	99.4	569
36期末 (2014年12月22日)	10,518	110	△ 2.0	12,409	△ 1.1	44.90	△ 2.3	0.1	99.0	619
37期末 (2015年1月20日)	10,810	110	3.8	12,743	2.7	44.47	△ 1.0	0.1	98.7	647
38期末 (2015年2月20日)	10,307	110	△ 3.6	13,330	4.6	41.53	△ 6.6	0.1	97.9	520
39期末 (2015年3月20日)	8,828	110	△ 13.3	13,135	△ 1.5	36.67	△ 11.7	0.1	99.1	443
40期末 (2015年4月20日)	10,483	110	20.0	14,844	13.0	39.10	6.6	0.1	99.0	472
41期末 (2015年5月20日)	10,670	110	2.8	14,866	0.1	39.80	1.8	0.2	99.1	432
42期末 (2015年6月22日)	10,395	110	△ 1.5	14,365	△ 3.4	39.62	△ 0.5	0.1	99.3	450
43期末 (2015年7月21日)	9,603	110	△ 6.6	13,637	△ 5.1	38.91	△ 1.8	0.2	99.3	362
44期末 (2015年8月20日)	7,961	110	△ 16.0	12,436	△ 8.8	35.45	△ 8.9	0.2	99.0	289
45期末 (2015年9月24日)	6,501	110	△ 17.0	11,435	△ 8.0	28.76	△ 18.9	0.3	99.0	228
46期末 (2015年10月20日)	6,704	110	4.8	12,387	8.3	30.75	6.9	0.3	98.7	232
47期末 (2015年11月20日)	6,956	110	5.4	12,078	△ 2.5	33.05	7.5	0.2	99.1	190
48期末 (2015年12月21日)	6,247	110	△ 8.6	11,678	△ 3.3	30.43	△ 7.9	0.2	98.3	153
49期末 (2016年1月20日)	5,155	110	△ 15.7	10,540	△ 9.7	28.92	△ 5.0	0.3	99.0	115
50期末 (2016年2月22日)	4,741	110	△ 5.9	10,352	△ 1.8	28.05	△ 3.0	0.4	98.9	104
51期末 (2016年3月22日)	5,528	110	18.9	11,103	7.3	30.93	10.3	—	97.6	109
52期末 (2016年4月20日)	5,588	110	3.1	11,507	3.6	30.91	△ 0.1	—	99.4	108
53期末 (2016年5月20日)	4,988	110	△ 8.8	10,572	△ 8.1	30.88	△ 0.1	—	99.4	93
54期末 (2016年6月20日)	4,991	110	2.3	10,827	2.4	30.65	△ 0.7	—	99.2	87
55期末 (2016年7月20日)	5,634	110	15.1	11,634	7.5	32.62	6.4	—	99.1	69
56期末 (2016年8月22日)	5,370	110	△ 2.7	12,313	5.8	31.40	△ 3.7	—	99.4	63
57期末 (2016年9月20日)	5,310	110	0.9	12,642	2.7	31.14	△ 0.8	—	99.4	54
58期末 (2016年10月20日)	5,496	110	5.6	12,510	△ 1.0	32.70	5.0	—	99.4	56
59期末 (2016年11月21日)	5,123	110	△ 4.8	11,994	△ 4.1	32.76	0.2	—	99.2	52
償還 (2016年12月20日)	5,128.35	—	0.1	11,720	△ 2.3	34.78	6.2	—	—	52

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 香港ハンセン指数（香港ドルベース）は、同指数の原データをもとに、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。

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

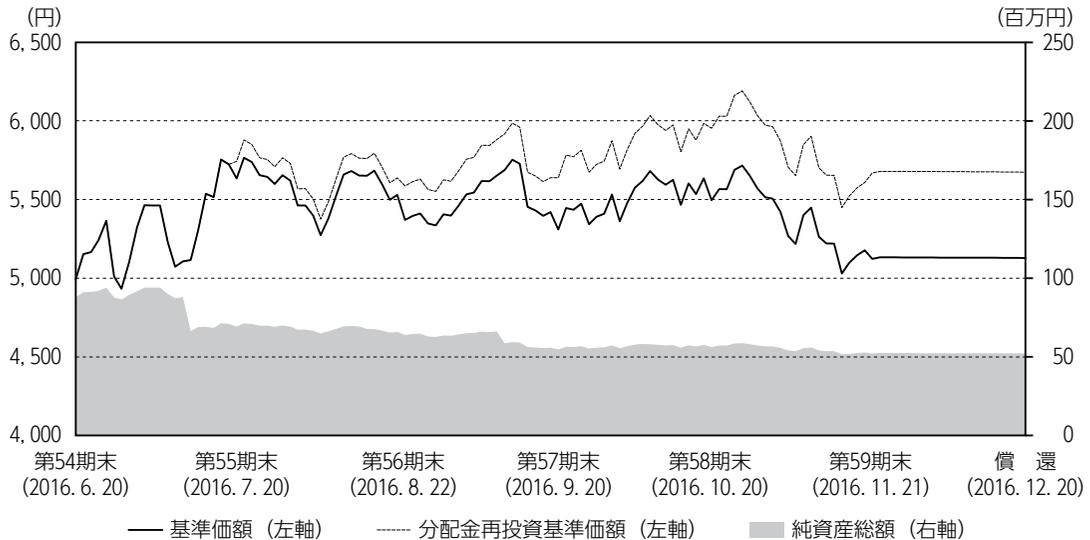
(注4) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。

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

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

## ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：5,128円35銭（既払分配金6,270円）

騰落率：6.5%（分配金再投資ベース）

## ■基準価額の主な変動要因

外国籍投資信託を通じて香港ハンセン指数にほぼ100%投資した結果、香港株式市況の上昇および配当金収入、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）が、プラスに寄与して基準価額は上昇しました。一方、為替相場の下落および運用管理費用等がマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）ブラジルリアルコース

	年 月 日	基 準 価 額		香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		ブラジル・リアル 為 替 レ ー ト		公 社 債 組 入 率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)		
第55期	(期首) 2016年 6月20日	円	%	10,827	%	円	%	%	%
	6月末	4,991	—	10,970	—	30.65	—	—	99.2
	(期末) 2016年 7月20日	5,323	6.7	11,634	1.3	31.94	4.2	—	99.4
第56期	(期首) 2016年 7月20日	5,744	15.1	11,634	7.5	32.62	6.4	—	99.1
	7月末	5,634	—	11,903	—	32.62	—	—	99.1
	(期末) 2016年 8月22日	5,620	△ 0.2	12,313	2.3	31.68	△ 2.9	—	99.0
第57期	(期首) 2016年 8月22日	5,480	△ 2.7	12,313	5.8	31.40	△ 3.7	—	99.4
	8月末	5,370	—	12,355	—	31.40	—	—	99.4
	(期末) 2016年 9月20日	5,463	1.7	12,642	0.3	31.84	1.4	—	99.4
第58期	(期首) 2016年 9月20日	5,420	0.9	12,642	2.7	31.14	△ 0.8	—	99.4
	9月末	5,310	—	12,743	—	31.14	—	—	99.4
	(期末) 2016年 10月20日	5,532	4.2	12,510	0.8	31.01	△ 0.4	—	99.0
第59期	(期首) 2016年 10月20日	5,606	5.6	12,510	△ 1.0	32.70	5.0	—	99.4
	10月末	5,496	—	12,322	—	32.70	—	—	99.4
	(期末) 2016年 11月21日	5,515	0.3	11,994	△ 1.5	32.73	0.1	—	99.0
償還期	(期首) 2016年 11月21日	5,233	△ 4.8	11,994	△ 4.1	32.76	0.2	—	99.2
	11月末	5,123	—	12,205	—	32.76	—	—	99.2
	(償還) 2016年 12月20日	5,132	0.2	11,720	1.8	33.12	1.1	—	—
		5,128.35	0.1		2.3	34.78	6.2	—	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

### ○香港株式市況

香港株式市況は、設定時より、中国の景気刺激策および追加財政支出への期待や、米国経済および先進国の株式市況の堅調な推移などを好感しておおむね上昇基調で推移しました。しかし2015年後半からは、米国の利上げ懸念や新興国経済の不調などから下落基調となりました。2016年3月以降は、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利するなど不安定な局面はありましたが、深セン－香港株式コネクト（相互株式投資制度）の開始期待などによりおおむね上昇基調になりました。10月からは、中国の不動産投資規制や資源価格の先行き不透明感などから、軟調な推移で償還を迎えました。

### ○為替相場

ブラジル・リアル為替相場は、設定時よりボックス圏の動きで推移しましたが、2015年に入ると、国内の政治および景気の先行き不透明感や米国の早期追加利上げ観測の高まりなどが嫌気されて、下落しました。償還にかけては、日米長期金利差の拡大を受けて円売り／米ドル買いが進み、ブラジル・リアルは対円で相対的に下げ幅を縮めました。

### ○短期金利市況

ブラジルの短期金利は、設定時より、国内景気への配慮からブラジル中央銀行が継続して利下げを実施しましたが、2013年前半よりインフレ抑制のために継続的な利上げに転じました。

一方、香港では、設定時より、政策金利を米国の金融政策に合わせるため0.50%に維持してきましたが、米国の利上げに合わせて、2015年12月に0.75%に、2016年12月に1.00%に引き上げました。

## 信託期間中の運用方針

### ○当ファンド

「ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド（ブラジルリアルクラス）」（以下「香港ハンセン指数ファンド（ブラジルリアルクラス）」といいます。）と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（ブラジルリアルクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないます。

### ○香港ハンセン指数ファンド（ブラジルリアルクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を行ないます。

### ○ダイワ・マネープール・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・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないます。

## 信託期間中のポートフォリオについて

### ○当ファンド

外国籍投資信託「香港ハンセン指数ファンド（ブラジルリアルクラス）」と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（ブラジルリアルクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないました。

なお、満期償還に備えるため、2016年11月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式および為替等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

### ○香港ハンセン指数ファンド（ブラジルリアルクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を行ないました。

株式（株式先物取引を含む。）の組入比率は、通常の状態、高位を維持しました。

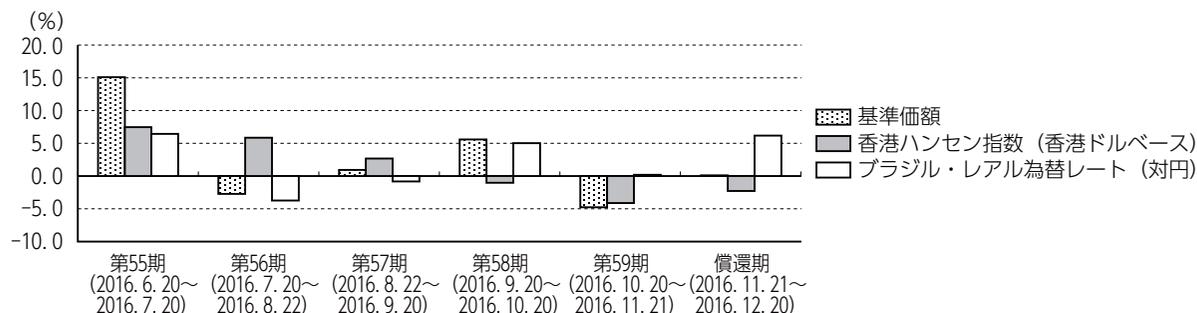
### ○ダイワ・マネープール・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期間における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。参考指数には、香港ハンセン指数（香港ドルベース）とブラジル・リアル為替レート（対円）を掲載しています。



## 分配金について

1万口当り、第3期～第59期各110円の収益分配を行ないました。なお、第1期～第2期は分配方針通り、収益分配を行ないませんでした。

また、第55期～第59期の分配原資の内訳および決定根拠「収益分配金の計算過程（1万口当り）」は下記の通りです。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年6月21日 ～2016年7月20日	2016年7月21日 ～2016年8月22日	2016年8月23日 ～2016年9月20日	2016年9月21日 ～2016年10月20日	2016年10月21日 ～2016年11月21日
当期分配金（税込み）（円）	110	110	110	110	110
対基準価額比率（%）	1.92	2.01	2.03	1.96	2.10
当期の収益（円）	58	55	58	62	55
当期の収益以外（円）	51	54	51	47	54
翌期繰越分配対象額（円）	2,801	2,746	2,694	2,647	2,592

（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	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	58.43円	55.04円	58.64円	62.88円	55.31円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	2,852.57	2,801.00	2,746.06	2,694.71	2,647.59
(d) 分配準備積立金	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,911.01	2,856.04	2,804.71	2,757.59	2,702.90
(f) 分配金	110.00	110.00	110.00	110.00	110.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,801.01	2,746.04	2,694.71	2,647.59	2,592.90

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～償還期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 21～2016. 12. 20)		
	金 額	比 率	
信託報酬	33円	0.611%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は5,400円です。</b>
(投信会社)	(13)	(0.243)	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)	(19)	(0.352)	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)	(0.016)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	33	0.611	

(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まず。

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国（邦貨建）	58.632	3,793	1,513.841	97,064

(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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネープール・マザーファンド	—	—	13	13

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

第55期～償還期							
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
				HONG KONG HANG SENG INDEX FUND BRL CLASS (ケイマン諸島)	1,513.841	97,064	64

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～償還期）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

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年12月20日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	52,236	100.0
投資信託財産総額	52,236	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

種類	第54期末
	□数
	千口
ダイワ・マネープール・マザーファンド	13

(注) 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7月20日)、(2016年8月22日)、(2016年9月20日)、(2016年10月20日)、(2016年11月21日)、(2016年12月20日)現在

項 目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	償還時
<b>(A) 資産</b>	<b>73,266,220円</b>	<b>66,608,435円</b>	<b>56,960,152円</b>	<b>58,516,294円</b>	<b>53,298,567円</b>	<b>52,236,058円</b>
コール・ローン等	536,636	439,504	457,719	339,734	1,576,678	52,236,058
投資信託受益証券（評価額）	68,716,409	63,555,757	54,389,259	55,863,385	51,708,714	—
ダイワ・マネープール・マザーファンド（評価額）	13,175	13,175	13,175	13,175	13,175	—
未収入金	4,000,000	2,599,999	2,099,999	2,300,000	—	—
<b>(B) 負債</b>	<b>3,938,527</b>	<b>2,684,682</b>	<b>2,243,135</b>	<b>2,331,558</b>	<b>1,178,087</b>	<b>52,483</b>
未払金	2,000,000	1,300,000	1,050,000	1,150,000	—	—
未払収益分配金	1,353,639	1,309,349	1,133,603	1,124,601	1,119,050	—
未払解約金	499,999	—	—	—	—	—
未払信託報酬	84,889	75,333	59,532	56,957	59,037	52,422
未払利息	—	—	—	—	—	61
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>69,327,693</b>	<b>63,923,753</b>	<b>54,717,017</b>	<b>56,184,736</b>	<b>52,120,480</b>	<b>52,183,575</b>
元本	123,058,097	119,031,810	103,054,859	102,236,490	101,731,909	101,755,107
次期繰越損益金	△ 53,730,404	△ 55,108,057	△ 48,337,842	△ 46,051,754	△ 49,611,429	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 49,571,532
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>123,058,097口</b>	<b>119,031,810口</b>	<b>103,054,859口</b>	<b>102,236,490口</b>	<b>101,731,909口</b>	<b>101,755,107口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	5,634円	5,370円	5,310円	5,496円	5,123円	—
1万口当り償還価額（C/D）	—	—	—	—	—	5,128円35銭

\* 第54期末における元本額は175,941,939円、当作成期間（第55期～償還期）中における追加設定元本額は3,059,056円、同解約元本額は77,245,888円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は5,128円35銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は49,571,532円です。

■損益の状況

第55期 自2016年6月21日 至2016年7月20日 第57期 自2016年8月23日 至2016年9月20日 第59期 自2016年10月21日 至2016年11月21日  
 第56期 自2016年7月21日 至2016年8月22日 第58期 自2016年9月21日 至2016年10月20日 償還期 自2016年11月22日 至2016年12月20日

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	償還期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>725,639円</b>	<b>730,492円</b>	<b>663,873円</b>	<b>654,987円</b>	<b>621,730円</b>	△ <b>1,752円</b>
受取配当金	725,754	730,508	663,918	654,987	621,743	—
支払利息	△ 115	△ 16	△ 45	—	△ 13	△ 1,752
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>8,624,048</b>	<b>2,481,497</b>	<b>96,995</b>	<b>2,428,732</b>	<b>3,230,582</b>	<b>105,415</b>
売買益	9,076,515	33,850	297,233	2,460,787	49,781	105,415
売買損	△ 452,467	△ 2,515,347	△ 394,228	△ 32,055	△ 3,280,363	—
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>84,889</b>	<b>75,333</b>	<b>59,532</b>	<b>56,957</b>	<b>59,037</b>	<b>52,422</b>
<b>(D) 当期損益金（A+B+C）</b>	<b>9,264,798</b>	<b>1,826,338</b>	<b>507,346</b>	<b>3,026,762</b>	<b>2,667,889</b>	<b>51,241</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 69,512,025</b>	<b>△ 58,757,842</b>	<b>△ 52,811,128</b>	<b>△ 52,241,712</b>	<b>△ 49,380,469</b>	<b>△ 52,353,336</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>7,870,462</b>	<b>6,785,472</b>	<b>5,099,543</b>	<b>4,287,797</b>	<b>3,555,979</b>	<b>2,730,563</b>
（配当等相当額）	( 35,103,288)	( 33,340,913)	( 28,299,576)	( 27,549,771)	( 26,934,499)	( 26,384,155)
（売買損益相当額）	(△ 27,232,826)	(△ 26,555,441)	(△ 23,200,033)	(△ 23,261,974)	(△ 23,378,520)	(△ 23,653,592)
<b>(G) 合計（D+E+F）</b>	<b>△ 52,376,765</b>	<b>△ 53,798,708</b>	<b>△ 47,204,239</b>	<b>△ 44,927,153</b>	<b>△ 48,492,379</b>	<b>△ 49,571,532</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 1,353,639</b>	<b>△ 1,309,349</b>	<b>△ 1,133,603</b>	<b>△ 1,124,601</b>	<b>△ 1,119,050</b>	<b>—</b>
次期繰越損益金（G+H）	△ 53,730,404	△ 55,108,057	△ 48,337,842	△ 46,051,754	△ 49,611,429	—
追加信託差損益金	7,235,875	6,131,282	4,570,281	3,806,085	2,999,622	—
（配当等相当額）	( 34,468,701)	( 32,686,723)	( 27,770,314)	( 27,068,059)	( 26,378,142)	( —)
（売買損益相当額）	(△ 27,232,826)	(△ 26,555,441)	(△ 23,200,033)	(△ 23,261,974)	(△ 23,378,520)	( —)
繰越損益金	△ 60,966,279	△ 61,239,339	△ 52,908,123	△ 49,857,839	△ 52,611,051	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 49,571,532

(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11ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	719,052円	655,159円	604,341円	642,889円	562,693円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	35,103,288	33,340,913	28,299,576	27,549,771	26,934,499
(d) 分配準備積立金	0	0	0	0	0
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	35,822,340	33,996,072	28,903,917	28,192,660	27,497,192
(f) 分配金	1,353,639	1,309,349	1,133,603	1,124,601	1,119,050
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	34,468,701	32,686,723	27,770,314	27,068,059	26,378,142
(h) 受益権総口数	123,058,097口	119,031,810口	103,054,859口	102,236,490口	101,731,909口

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年12月28日		投資信託契約終了時の状況		
	投資信託契約終了日	2016年12月20日		資産総額	52,236,058円	
区 分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	52,483円	
				純資産総額	52,183,575円	
受益権口数	600,409,370口	101,755,107口	△498,654,263口	受益権口数	101,755,107口	
元 本 額	600,409,370円	101,755,107円	△498,654,263円	1 単 位 当 り 償 還 金	5,128円35銭	
毎 計 算 期 末 の 状 況						
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金		
				金 額	分 配 率	
		円	円	円	円	%
第1期	205,199,059	232,108,059	11,311	—	—	—
第2期	361,277,254	454,498,880	12,580	—	—	—
第3期	512,704,036	632,298,380	12,333	110	110	1.10
第4期	491,669,102	563,055,918	11,452	110	110	1.10
第5期	480,910,303	449,933,352	9,356	110	110	1.10
第6期	469,845,950	441,466,849	9,396	110	110	1.10
第7期	489,606,629	458,236,133	9,359	110	110	1.10
第8期	501,028,224	483,742,365	9,655	110	110	1.10
第9期	205,028,871	199,162,543	9,714	110	110	1.10
第10期	150,163,205	150,581,761	10,028	110	110	1.10
第11期	149,297,836	145,966,167	9,777	110	110	1.10
第12期	119,825,071	127,271,705	10,621	110	110	1.10
第13期	327,388,594	384,991,286	11,759	110	110	1.10
第14期	348,055,823	431,359,788	12,393	110	110	1.10
第15期	311,072,989	363,591,549	11,688	110	110	1.10
第16期	1,597,421,546	1,910,196,935	11,958	110	110	1.10
第17期	900,588,380	1,141,346,410	12,673	110	110	1.10
第18期	717,932,657	724,932,452	10,097	110	110	1.10
第19期	720,698,250	753,919,525	10,461	110	110	1.10
第20期	702,651,536	700,383,592	9,968	110	110	1.10

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）ブラジルリアルコース

毎 計 算 期 末 の 状 況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第21期	685,047,004	783,417,942	11,436	110	1.10
第22期	628,662,544	710,826,092	11,307	110	1.10
第23期	568,159,540	634,960,245	11,176	110	1.10
第24期	642,645,268	689,845,230	10,734	110	1.10
第25期	672,414,906	722,995,327	10,752	110	1.10
第26期	638,013,406	647,448,193	10,148	110	1.10
第27期	585,474,572	573,340,896	9,793	110	1.10
第28期	346,394,765	371,238,118	10,717	110	1.10
第29期	302,819,726	325,781,931	10,758	110	1.10
第30期	228,564,081	252,270,080	11,037	110	1.10
第31期	212,271,939	235,080,768	11,075	110	1.10
第32期	197,238,997	233,449,624	11,836	110	1.10
第33期	322,684,572	371,956,438	11,527	110	1.10
第34期	356,345,624	367,277,225	10,307	110	1.10
第35期	525,235,807	569,709,117	10,847	110	1.10
第36期	588,691,891	619,214,243	10,518	110	1.10
第37期	599,129,039	647,664,316	10,810	110	1.10
第38期	504,917,861	520,395,654	10,307	110	1.10
第39期	502,851,802	443,918,108	8,828	110	1.10
第40期	450,358,206	472,129,874	10,483	110	1.10
第41期	405,124,877	432,284,488	10,670	110	1.10
第42期	433,235,369	450,335,554	10,395	110	1.10
第43期	377,357,284	362,374,099	9,603	110	1.10
第44期	364,244,096	289,960,291	7,961	110	1.10
第45期	351,047,811	228,206,053	6,501	110	1.10
第46期	346,290,485	232,139,453	6,704	110	1.10
第47期	273,766,327	190,434,641	6,956	110	1.10
第48期	245,902,420	153,609,161	6,247	110	1.10
第49期	224,300,809	115,631,377	5,155	110	1.10
第50期	219,442,752	104,037,318	4,741	110	1.10
第51期	197,612,286	109,233,284	5,528	110	1.10
第52期	193,937,325	108,367,000	5,588	110	1.10
第53期	188,257,477	93,893,492	4,988	110	1.10
第54期	175,941,939	87,808,363	4,991	110	1.10
第55期	123,058,097	69,327,693	5,634	110	1.10
第56期	119,031,810	63,923,753	5,370	110	1.10
第57期	103,054,859	54,717,017	5,310	110	1.10
第58期	102,236,490	56,184,736	5,496	110	1.10
第59期	101,731,909	52,120,480	5,123	110	1.10

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	110円	110円	110円	110円	110円
(単 価)	(5,634円)	(5,370円)	(5,310円)	(5,496円)	(5,123円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	5,128円35銭

#### 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。

#### 償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

## ★豪ドルコース

## 最近30期の運用実績

決算期	基準価額			香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		豪ドル 為替レート		公社債 組入率	投資信託 受益証券 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	(参考指数)	期中 騰落率			
31期末 (2014年7月22日)	円 13,048	円 60	% 0.8	12,554	% 0.9	円 95.07	% △ 0.8	% 0.3	% 98.7	百万円 28
32期末 (2014年8月20日)	13,973	60	7.5	13,486	7.4	95.79	0.8	0.2	98.9	19
33期末 (2014年9月22日)	13,716	60	△ 1.4	13,047	△ 3.3	97.42	1.7	0.1	98.8	22
34期末 (2014年10月20日)	12,358	60	△ 9.5	12,359	△ 5.3	94.00	△ 3.5	0.1	99.2	16
35期末 (2014年11月20日)	13,416	60	9.0	12,547	1.5	101.78	8.3	0.1	92.9	31
36期末 (2014年12月22日)	12,580	60	△ 5.8	12,409	△ 1.1	97.28	△ 4.4	0.0	99.7	49
37期末 (2015年1月20日)	12,907	60	3.1	12,743	2.7	96.56	△ 0.7	0.0	99.3	50
38期末 (2015年2月20日)	12,693	60	△ 1.2	13,330	4.6	92.81	△ 3.9	0.1	98.8	51
39期末 (2015年3月20日)	12,373	60	△ 2.0	13,135	△ 1.5	92.55	△ 0.3	0.1	99.1	52
40期末 (2015年4月20日)	13,907	60	12.9	14,844	13.0	93.01	0.5	0.1	98.6	42
41期末 (2015年5月20日)	14,266	60	3.0	14,866	0.1	95.63	2.8	0.1	98.1	46
42期末 (2015年6月22日)	13,718	60	△ 3.4	14,365	△ 3.4	95.31	△ 0.3	0.1	99.6	60
43期末 (2015年7月21日)	12,515	60	△ 8.3	13,637	△ 5.1	91.69	△ 3.8	0.1	99.2	55
44期末 (2015年8月20日)	11,271	60	△ 9.5	12,436	△ 8.8	91.13	△ 0.6	0.1	99.2	49
45期末 (2015年9月24日)	10,134	60	△ 9.6	11,435	△ 8.0	84.23	△ 7.6	0.1	99.0	45
46期末 (2015年10月20日)	10,526	60	4.5	12,387	8.3	86.87	3.1	0.1	99.0	42
47期末 (2015年11月20日)	10,389	60	△ 0.7	12,078	△ 2.5	88.42	1.8	0.1	99.1	41
48期末 (2015年12月21日)	9,781	60	△ 5.3	11,678	△ 3.3	86.81	△ 1.8	0.1	99.3	32
49期末 (2016年1月20日)	8,117	60	△ 16.4	10,540	△ 9.7	81.17	△ 6.5	0.1	99.1	26
50期末 (2016年2月22日)	7,739	60	△ 3.9	10,352	△ 1.8	80.77	△ 0.5	0.1	99.2	25
51期末 (2016年3月22日)	8,695	60	13.1	11,103	7.3	84.78	5.0	—	99.2	28
52期末 (2016年4月20日)	8,921	60	3.3	11,507	3.6	85.12	0.4	—	99.5	15
53期末 (2016年5月20日)	7,504	60	△ 15.2	10,572	△ 8.1	79.63	△ 6.4	—	99.5	12
54期末 (2016年6月20日)	7,391	60	△ 0.7	10,827	2.4	77.89	△ 2.2	—	99.5	11
55期末 (2016年7月20日)	8,140	60	10.9	11,634	7.5	79.51	2.1	—	99.1	10
56期末 (2016年8月22日)	7,800	60	△ 3.4	12,313	5.8	76.43	△ 3.9	—	99.2	9
57期末 (2016年9月20日)	7,867	60	1.6	12,642	2.7	76.79	0.5	—	99.5	9
58期末 (2016年10月20日)	7,993	60	2.4	12,510	△ 1.0	79.91	4.1	—	99.1	9
59期末 (2016年11月21日)	7,824	60	△ 1.4	11,994	△ 4.1	81.34	1.8	—	99.1	3
償還 (2016年12月20日)	7,832.21	—	0.1	11,720	△ 2.3	85.03	4.5	—	—	3

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 香港ハンセン指数 (香港ドルベース) は、同指数の原データをもとに、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。

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

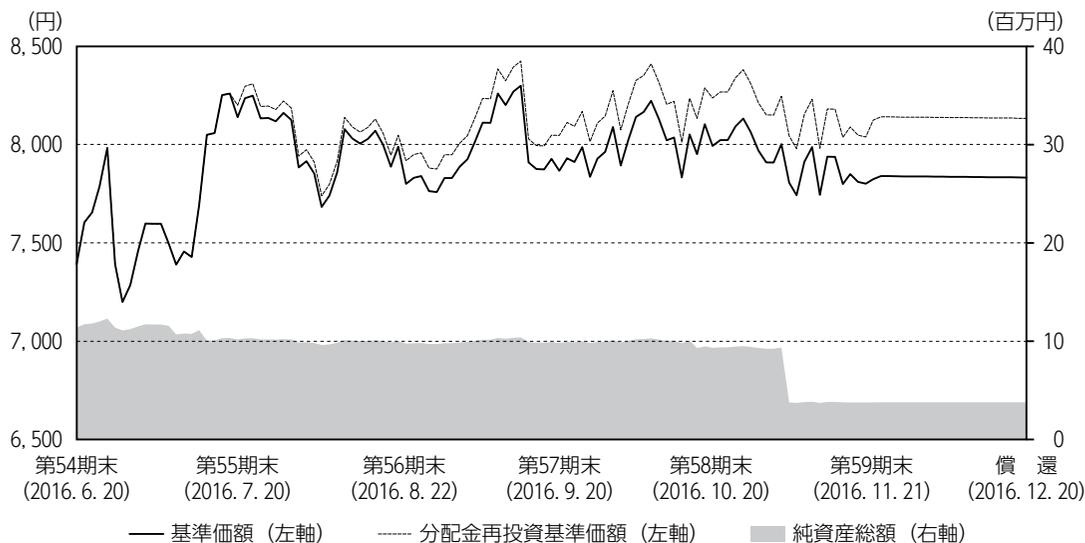
(注4) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。

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

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

### 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：7,832円21銭（既払分配金3,420円）

騰落率：6.6%（分配金再投資ベース）

### ■基準価額の主な変動要因

外国籍投資信託を通じて香港ハンセン指数にほぼ100%投資した結果、香港株式市況の上昇および配当金収入、為替相場の上昇および為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）が、プラスに寄与して基準価額は上昇しました。一方、運用管理費用等がマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）豪ドルコース

	年 月 日	基 準 価 額		香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		豪 為 替 レ ー ト		公 社 債 組 入 率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)		
第55期	(期首) 2016年 6月20日	円 7,391	% —	10,827	% —	円 77.89	% —	% —	% 99.5
	6月末	7,458	0.9	10,970	1.3	76.74	△ 1.5	—	99.5
	(期末) 2016年 7月20日	8,200	10.9	11,634	7.5	79.51	2.1	—	99.1
第56期	(期首) 2016年 7月20日	8,140	—	11,634	—	79.51	—	—	99.1
	7月末	8,126	△ 0.2	11,903	2.3	78.56	△ 1.2	—	99.1
	(期末) 2016年 8月22日	7,860	△ 3.4	12,313	5.8	76.43	△ 3.9	—	99.2
第57期	(期首) 2016年 8月22日	7,800	—	12,313	—	76.43	—	—	99.2
	8月末	7,888	1.1	12,355	0.3	77.51	1.4	—	99.2
	(期末) 2016年 9月20日	7,927	1.6	12,642	2.7	76.79	0.5	—	99.5
第58期	(期首) 2016年 9月20日	7,867	—	12,642	—	76.79	—	—	99.5
	9月末	8,090	2.8	12,743	0.8	77.04	0.3	—	99.6
	(期末) 2016年 10月20日	8,053	2.4	12,510	△ 1.0	79.91	4.1	—	99.1
第59期	(期首) 2016年 10月20日	7,993	—	12,510	—	79.91	—	—	99.1
	10月末	7,910	△ 1.0	12,322	△ 1.5	79.59	△ 0.4	—	99.1
	(期末) 2016年 11月21日	7,884	△ 1.4	11,994	△ 4.1	81.34	1.8	—	99.1
償還期	(期首) 2016年 11月21日	7,824	—	11,994	—	81.34	—	—	99.1
	11月末	7,838	0.2	12,205	1.8	84.14	3.4	—	—
	(償還) 2016年 12月20日	7,832.21	0.1	11,720	△ 2.3	85.03	4.5	—	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

### ○香港株式市況

香港株式市況は、設定時より、中国の景気刺激策および追加財政支出への期待や、米国経済および先進国の株式市況の堅調な推移などを好感しておおむね上昇基調で推移しました。しかし2015年後半からは、米国の利上げ懸念や新興国経済の不調などから下落基調となりました。2016年3月以降は、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利するなど不安定な局面はありましたが、深セン－香港株式コネクト（相互株式投資制度）の開始期待などによりおおむね上昇基調になりました。10月からは、中国の不動産投資規制や資源価格の先行き不透明感などから、軟調な推移で償還を迎えました。

### ○為替相場

豪ドル為替相場は、設定時より、日銀によるデフレ脱却をめざした金融緩和政策による円安の進行から対円で上昇したものの、2015年に入ると、オーストラリアの短期金利の利下げや中国の景気減速などを受けて上値の重い展開となり、下落基調となりました。償還にかけては、日米長期金利差の拡大を受けて円売り／米ドル買いが進み、豪ドルは対円で相対的にやや上昇しました。

### ○短期金利市況

オーストラリアの短期金利は、設定時より、中国経済の減速懸念や資源価格の低迷などの懸念材料を抱える国内景気の動向に配慮して、RBA（オーストラリア準備銀行）が継続的に利下げを実施したため、下落しました。

一方、香港では、設定時より、政策金利を米国の金融政策に合わせるため0.50%に維持しましたが、米国の利上げに合わせて、2015年12月に0.75%に、2016年12月に1.00%に引き上げました。

## 信託期間中の運用方針

### ○当ファンド

「ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド（豪ドルクラス）」（以下「香港ハンセン指数ファンド（豪ドルクラス）」といいます。）と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（豪ドルクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないます。

### ○香港ハンセン指数ファンド（豪ドルクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／豪ドル買いの為替取引を行ないます。

### ○ダイワ・マネープール・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・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないます。

## 信託期間中のポートフォリオについて

### ○当ファンド

外国籍投資信託「香港ハンセン指数ファンド（豪ドルクラス）」と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（豪ドルクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないました。

なお、満期償還に備えるため、2016年11月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式および為替等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

### ○香港ハンセン指数ファンド（豪ドルクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／豪ドル買いの為替取引を行ないました。

株式（株式先物取引を含む。）の組入比率は、通常の状態、高位を維持しました。

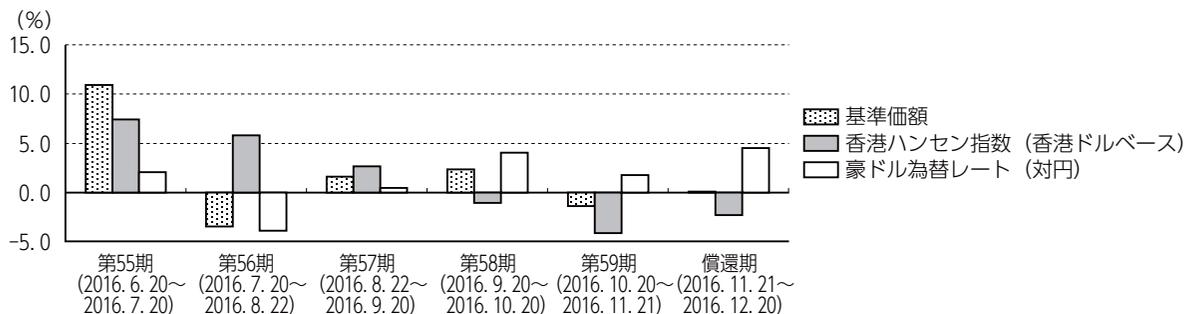
### ○ダイワ・マネープール・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期間における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。参考指数には、香港ハンセン指数（香港ドルベース）と豪ドル為替レート（対円）を掲載しています。



## 分配金について

1万口当り、第3期～第59期各60円の収益分配を行ないました。なお、第1期～第2期は分配方針通り、収益分配を行ないませんでした。

また、第55期～第59期の分配原資の内訳および決定根拠「収益分配金の計算過程（1万口当り）」は下記の通りです。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

## ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年6月21日 ～2016年7月20日	2016年7月21日 ～2016年8月22日	2016年8月23日 ～2016年9月20日	2016年9月21日 ～2016年10月20日	2016年10月21日 ～2016年11月21日
当期分配金（税込み）（円）	60	60	60	60	60
対基準価額比率（%）	0.73	0.76	0.76	0.75	0.76
当期の収益（円）	32	21	27	28	10
当期の収益以外（円）	27	38	32	31	49
翌期繰越分配対象額（円）	3,968	3,930	3,897	3,865	3,816

（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	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	32.01円	21.77円	27.11円	28.63円	10.28円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	3,974.34	3,968.33	3,930.11	3,897.23	3,866.09
(d) 分配準備積立金	21.98	0.00	0.00	0.00	0.00
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	4,028.33	3,990.11	3,957.22	3,925.86	3,876.38
(f) 分配金	60.00	60.00	60.00	60.00	60.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	3,968.34	3,930.11	3,897.22	3,865.86	3,816.38

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～償還期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 21～2016. 12. 20)		
	金 額	比 率	
信託報酬	48円	0.611%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は7,903円です。</b>
(投信会社)	(19)	(0.243)	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)	(28)	(0.352)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(0.016)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	48	0.611	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	7.469	671	143.458	12,960

(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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネープール・マザーファンド	—	—	6	6

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

第55期～償還期							
買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
HONG KONG HANG SENG INDEX FUND AUD CLASS (ケイマン諸島)	5.525	500	90	HONG KONG HANG SENG INDEX FUND AUD CLASS (ケイマン諸島)	143.458	12,960	90

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～償還期）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

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年12月20日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	3,775	100.0
投資信託財産総額	3,775	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

種類	第54期末	
	□数	
		千□
ダイワ・マネープール・マザーファンド		6

(注) 単位未満は切捨て。

# 香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）豪ドルコース

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年7月20日)、(2016年8月22日)、(2016年9月20日)、(2016年10月20日)、(2016年11月21日)、(2016年12月20日)現在

項 目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	償還時
<b>(A) 資産</b>	<b>10,310,375円</b>	<b>9,907,146円</b>	<b>9,971,143円</b>	<b>10,160,431円</b>	<b>3,802,327円</b>	<b>3,775,937円</b>
コール・ローン等	124,000	89,525	75,221	742,304	63,419	3,775,937
投資信託受益証券（評価額）	10,080,278	9,671,524	9,789,824	9,252,030	3,732,810	—
ダイワ・マネーパール・マザーファンド（評価額）	6,098	6,098	6,098	6,098	6,098	—
未収入金	99,999	139,999	100,000	159,999	—	—
<b>(B) 負債</b>	<b>136,203</b>	<b>156,045</b>	<b>134,671</b>	<b>825,472</b>	<b>35,704</b>	<b>3,783</b>
未払金	50,000	70,000	50,000	80,000	—	—
未払収益分配金	74,992	75,005	75,018	70,073	28,883	—
未払解約金	—	—	—	665,410	—	—
未払信託報酬	11,211	11,040	9,653	9,989	6,821	3,779
未払利息	—	—	—	—	—	4
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>10,174,172</b>	<b>9,751,101</b>	<b>9,836,472</b>	<b>9,334,959</b>	<b>3,766,623</b>	<b>3,772,154</b>
元本	12,498,765	12,500,888	12,503,121	11,678,960	4,813,929	4,816,206
次期繰越損益金	△ 2,324,593	△ 2,749,787	△ 2,666,649	△ 2,344,001	△ 1,047,306	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 1,044,052
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>12,498,765口</b>	<b>12,500,888口</b>	<b>12,503,121口</b>	<b>11,678,960口</b>	<b>4,813,929口</b>	<b>4,816,206口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	8,140円	7,800円	7,867円	7,993円	7,824円	—
1万口当り償還価額（C/D）	—	—	—	—	—	7,832円21銭

\*第54期末における元本額は15,410,356円、当作成期間（第55期～償還期）中における追加設定元本額は13,395円、同解約元本額は10,607,545円です。

\*償還時の計算口数当りの純資産額は7,832円21銭です。

\*償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,044,052円です。

## ■損益の状況

第55期 自2016年6月21日 至2016年7月20日 第57期 自2016年8月23日 至2016年9月20日 第59期 自2016年10月21日 至2016年11月21日  
 第56期 自2016年7月21日 至2016年8月22日 第58期 自2016年9月21日 至2016年10月20日 償還期 自2016年11月22日 至2016年12月20日

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	償還期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>40,460円</b>	<b>38,256円</b>	<b>35,959円</b>	<b>34,976円</b>	<b>11,774円</b>	<b>△ 113円</b>
受取配当金	40,474	38,256	35,959	34,976	11,788	—
支払利息	△ 14	—	—	—	△ 14	△ 113
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>982,113</b>	<b>△ 377,010</b>	<b>132,342</b>	<b>191,965</b>	<b>△ 57,147</b>	<b>7,642</b>
売買益	1,034,385	1	132,342	204,476	6,674	7,642
売買損	△ 52,272	△ 377,011	—	△ 12,511	△ 63,821	—
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 11,211</b>	<b>△ 11,040</b>	<b>△ 9,653</b>	<b>△ 9,989</b>	<b>△ 6,821</b>	<b>△ 3,779</b>
<b>(D) 当期損益金（A+B+C）</b>	<b>1,011,362</b>	<b>△ 349,794</b>	<b>158,648</b>	<b>216,952</b>	<b>△ 52,194</b>	<b>3,750</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 7,999,493</b>	<b>△ 7,055,623</b>	<b>△ 7,432,633</b>	<b>△ 6,824,972</b>	<b>△ 2,737,179</b>	<b>△ 2,794,326</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>4,738,530</b>	<b>4,730,635</b>	<b>4,682,354</b>	<b>4,334,092</b>	<b>1,770,950</b>	<b>1,746,524</b>
（配当等相当額）	( 4,967,435)	( 4,960,777)	( 4,913,865)	( 4,551,561)	( 1,861,112)	( 1,838,051)
（売買損益相当額）	(△ 228,905)	(△ 230,142)	(△ 231,511)	(△ 217,469)	(△ 90,162)	(△ 91,527)
<b>(G) 合計（D+E+F）</b>	<b>△ 2,249,601</b>	<b>△ 2,674,782</b>	<b>△ 2,591,631</b>	<b>△ 2,273,928</b>	<b>△ 1,018,423</b>	<b>△ 1,044,052</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 74,992</b>	<b>△ 75,005</b>	<b>△ 75,018</b>	<b>△ 70,073</b>	<b>△ 28,883</b>	<b>—</b>
次期繰越損益金（G+H）	△ 2,324,593	△ 2,749,787	△ 2,666,649	△ 2,344,001	△ 1,047,306	—
追加信託差損益金	4,731,030	4,682,846	4,641,232	4,297,456	1,747,020	—
（配当等相当額）	( 4,959,935)	( 4,912,988)	( 4,872,743)	( 4,514,925)	( 1,837,182)	( —)
（売買損益相当額）	(△ 228,905)	(△ 230,142)	(△ 231,511)	(△ 217,469)	(△ 90,162)	( —)
繰越損益金	△ 7,055,623	△ 7,432,633	△ 7,307,881	△ 6,641,457	△ 2,794,326	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 1,044,052

(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24ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

## ■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	40,016円	27,216円	33,896円	33,437円	4,953円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	4,967,435	4,960,777	4,913,865	4,551,561	1,861,112
(d) 分配準備積立金	27,476	0	0	0	0
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	5,034,927	4,987,993	4,947,761	4,584,998	1,866,065
(f) 分配金	74,992	75,005	75,018	70,073	28,883
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	4,959,935	4,912,988	4,872,743	4,514,925	1,837,182
(h) 受益権総口数	12,498,765□	12,500,888□	12,503,121□	11,678,960□	4,813,929□

## 投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年12月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年12月20日		資産総額	3,775,937円
区 分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	3,783円
				純資産総額	3,772,154円
受益権口数	263,671,773□	4,816,206□	△258,855,567□	受益権口数	4,816,206□
元 本 額	263,671,773円	4,816,206円	△258,855,567円	1 単 位 当 り 償 還 金	7,832円21銭
毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第1期	215,997,959	236,808,333	10,963	—	—
第2期	168,475,866	205,851,297	12,218	—	—
第3期	144,783,070	180,523,326	12,469	60	0.60
第4期	143,400,736	169,289,014	11,805	60	0.60
第5期	129,410,694	127,074,970	9,820	60	0.60
第6期	131,597,116	136,282,287	10,356	60	0.60
第7期	137,222,420	144,627,937	10,540	60	0.60
第8期	120,308,496	130,994,224	10,888	60	0.60
第9期	58,338,259	64,539,394	11,063	60	0.60
第10期	50,108,763	56,939,893	11,363	60	0.60
第11期	26,329,326	30,152,167	11,452	60	0.60
第12期	11,202,141	14,125,156	12,609	60	0.60
第13期	39,561,963	54,474,770	13,769	60	0.60
第14期	69,798,287	96,271,377	13,793	60	0.60
第15期	71,058,692	94,171,786	13,253	60	0.60
第16期	146,058,026	199,867,079	13,684	60	0.60
第17期	107,290,822	150,870,475	14,062	60	0.60
第18期	100,118,571	116,898,731	11,676	60	0.60
第19期	92,690,935	111,557,055	12,035	60	0.60
第20期	73,712,086	90,043,231	12,216	60	0.60

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）豪ドルコース

毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第21期	74,220,141	99,125,869	13,356	60	0.60
第22期	64,053,901	84,688,478	13,221	60	0.60
第23期	50,808,417	67,811,074	13,346	60	0.60
第24期	47,597,906	59,718,717	12,547	60	0.60
第25期	47,649,541	59,706,446	12,530	60	0.60
第26期	44,312,578	54,481,176	12,295	60	0.60
第27期	43,561,499	50,973,920	11,702	60	0.60
第28期	40,576,172	51,399,199	12,667	60	0.60
第29期	37,960,265	47,491,828	12,511	60	0.60
第30期	24,883,770	32,348,113	13,000	60	0.60
第31期	22,114,191	28,855,425	13,048	60	0.60
第32期	14,250,166	19,911,109	13,973	60	0.60
第33期	16,498,159	22,628,386	13,716	60	0.60
第34期	13,396,746	16,556,283	12,358	60	0.60
第35期	23,242,169	31,182,373	13,416	60	0.60
第36期	39,631,788	49,855,466	12,580	60	0.60
第37期	39,120,424	50,494,372	12,907	60	0.60
第38期	40,338,403	51,201,696	12,693	60	0.60
第39期	42,528,004	52,620,229	12,373	60	0.60
第40期	30,674,906	42,659,150	13,907	60	0.60
第41期	32,724,410	46,684,167	14,266	60	0.60
第42期	44,095,897	60,490,103	13,718	60	0.60
第43期	44,096,824	55,185,718	12,515	60	0.60
第44期	44,097,844	49,700,526	11,271	60	0.60
第45期	44,958,659	45,559,981	10,134	60	0.60
第46期	40,370,989	42,493,713	10,526	60	0.60
第47期	40,372,532	41,943,974	10,389	60	0.60
第48期	33,122,982	32,396,977	9,781	60	0.60
第49期	33,124,661	26,887,302	8,117	60	0.60
第50期	33,126,697	25,636,342	7,739	60	0.60
第51期	32,222,361	28,017,248	8,695	60	0.60
第52期	16,831,261	15,015,233	8,921	60	0.60
第53期	16,833,155	12,630,807	7,504	60	0.60
第54期	15,410,356	11,389,718	7,391	60	0.60
第55期	12,498,765	10,174,172	8,140	60	0.60
第56期	12,500,888	9,751,101	7,800	60	0.60
第57期	12,503,121	9,836,472	7,867	60	0.60
第58期	11,678,960	9,334,959	7,993	60	0.60
第59期	4,813,929	3,766,623	7,824	60	0.60

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	60円	60円	60円	60円	60円
(単 価)	(8,140円)	(7,800円)	(7,867円)	(7,993円)	(7,824円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	7,832円21銭

#### 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。

#### 償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

★南アフリカランドコース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		南アフリカ・ランド 為替レート		公社債 組入率	投資信託 受益証券 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	(参考指数)	期中 騰落率			
31期末 (2014年7月22日)	円 10,822	円 70	% 1.4	12,554	% 0.9	円 9.56	% 0.8	% 0.2	% 98.8	百万円 92
32期末 (2014年8月20日)	11,747	70	9.2	13,486	7.4	9.68	1.3	0.1	98.8	100
33期末 (2014年9月22日)	11,495	70	△ 1.5	13,047	△ 3.3	9.84	1.7	0.1	98.8	98
34期末 (2014年10月20日)	10,577	70	△ 7.4	12,359	△ 5.3	9.67	△ 1.7	0.1	98.9	90
35期末 (2014年11月20日)	11,750	70	11.8	12,547	1.5	10.68	10.4	0.3	99.1	23
36期末 (2014年12月22日)	11,193	70	△ 4.1	12,409	△ 1.1	10.33	△ 3.3	0.2	99.1	22
37期末 (2015年1月20日)	11,418	70	2.6	12,743	2.7	10.13	△ 1.9	0.2	99.2	22
38期末 (2015年2月20日)	11,707	70	3.1	13,330	4.6	10.21	0.8	0.2	98.8	23
39期末 (2015年3月20日)	11,055	70	△ 5.0	13,135	△ 1.5	9.83	△ 3.7	0.2	98.9	22
40期末 (2015年4月20日)	12,448	70	13.2	14,844	13.0	9.87	0.4	0.2	99.1	25
41期末 (2015年5月20日)	12,728	70	2.8	14,866	0.1	10.15	2.8	0.2	98.8	26
42期末 (2015年6月22日)	12,352	70	△ 2.4	14,365	△ 3.4	10.10	△ 0.5	0.2	99.1	26
43期末 (2015年7月21日)	11,689	70	△ 4.8	13,637	△ 5.1	10.00	△ 1.0	0.2	99.3	24
44期末 (2015年8月20日)	10,119	70	△ 12.8	12,436	△ 8.8	9.62	△ 3.8	0.2	99.0	21
45期末 (2015年9月24日)	9,022	70	△ 10.1	11,435	△ 8.0	8.67	△ 9.9	0.3	99.3	19
46期末 (2015年10月20日)	9,334	70	4.2	12,387	8.3	9.00	3.8	0.2	99.0	20
47期末 (2015年11月20日)	8,778	70	△ 5.2	12,078	△ 2.5	8.77	△ 2.6	0.2	99.2	18
48期末 (2015年12月21日)	7,727	70	△ 11.2	11,678	△ 3.3	8.04	△ 8.3	0.2	99.1	16
49期末 (2016年1月20日)	5,998	70	△ 21.5	10,540	△ 9.7	7.01	△ 12.8	0.2	98.8	12
50期末 (2016年2月22日)	6,037	70	1.8	10,352	△ 1.8	7.33	4.6	0.2	99.1	12
51期末 (2016年3月22日)	6,382	70	6.9	11,103	7.3	7.34	0.1	—	99.4	13
52期末 (2016年4月20日)	6,828	70	8.1	11,507	3.6	7.63	4.0	—	99.4	14
53期末 (2016年5月20日)	5,597	70	△ 17.0	10,572	△ 8.1	6.97	△ 8.7	—	99.4	12
54期末 (2016年6月20日)	5,616	70	1.6	10,827	2.4	6.97	0.0	—	99.5	12
55期末 (2016年7月20日)	6,424	70	15.6	11,634	7.5	7.39	6.0	—	99.3	12
56期末 (2016年8月22日)	6,460	70	1.7	12,313	5.8	7.44	0.7	—	99.4	12
57期末 (2016年9月20日)	6,285	70	△ 1.6	12,642	2.7	7.28	△ 2.2	—	99.5	12
58期末 (2016年10月20日)	6,377	70	2.6	12,510	△ 1.0	7.50	3.0	—	99.6	12
59期末 (2016年11月21日)	6,266	70	△ 0.6	11,994	△ 4.1	7.69	2.5	—	99.2	12
償還 (2016年12月20日)	6,272.11	—	0.1	11,720	△ 2.3	8.29	7.8	—	—	12

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 香港ハンセン指数（香港ドルベース）は、同指数の原データをもとに、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。

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

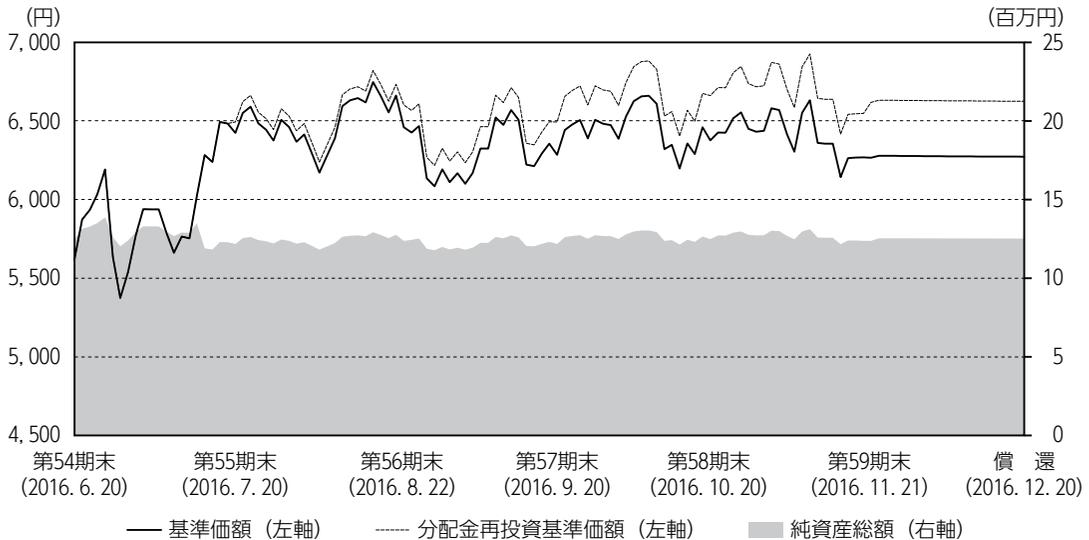
(注4) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。

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

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

## ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：6,272円11銭（既払分配金3,990円）

騰落率：△4.6%（分配金再投資ベース）

## ■ 基準価額の主な変動要因

外国籍投資信託を通じて香港ハンセン指数にほぼ100%投資した結果、香港株式市況の上昇および配当金収入、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）がプラスに寄与しました。一方、為替相場下落および運用管理費用等がマイナス要因となったため、分配金再投資ベースで基準価額は下落しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）南アフリカランドコース

	年 月 日	基 準 価 額		香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		南アフリカ・ランド 為 替 レ ー ト		公 社 債 組 入 率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)		
第55期	(期首) 2016年 6月20日	円	%			円	%	%	%
	6月末	5,616	—	10,827	—	6.97	—	—	99.5
	(期末) 2016年 7月20日	5,774	2.8	10,970	1.3	6.97	0.0	—	98.6
第56期	(期首) 2016年 7月20日	6,494	15.6	11,634	7.5	7.39	6.0	—	99.3
	7月末	6,424	—	11,634	—	7.39	—	—	99.3
	(期末) 2016年 8月22日	6,461	0.6	11,903	2.3	7.39	0.0	—	98.2
第57期	(期首) 2016年 8月22日	6,530	1.7	12,313	5.8	7.44	0.7	—	99.4
	8月末	6,460	—	12,313	—	7.44	—	—	99.4
	(期末) 2016年 9月20日	6,168	△ 4.5	12,355	0.3	7.11	△ 4.4	—	98.3
第58期	(期首) 2016年 9月20日	6,355	△ 1.6	12,642	2.7	7.28	△ 2.2	—	99.5
	9月末	6,285	—	12,642	—	7.28	—	—	99.5
	(期末) 2016年 10月20日	6,474	3.0	12,743	0.8	7.24	△ 0.5	—	98.5
第59期	(期首) 2016年 10月20日	6,447	2.6	12,510	△ 1.0	7.50	3.0	—	99.6
	10月末	6,377	—	12,510	—	7.50	—	—	99.6
	(期末) 2016年 11月21日	6,437	0.9	12,322	△ 1.5	7.60	1.3	—	98.6
償還期	(期首) 2016年 11月21日	6,336	△ 0.6	11,994	△ 4.1	7.69	2.5	—	99.2
	11月末	6,266	—	11,994	—	7.69	—	—	99.2
	(償還) 2016年 12月20日	6,277	0.2	12,205	1.8	8.10	5.3	—	—
		6,272.11	0.1	11,720	△ 2.3	8.29	7.8	—	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

**設定以来の投資環境について****○香港株式市況**

香港株式市況は、設定時より、中国の景気刺激策および追加財政支出への期待や、米国経済および先進国の株式市況の堅調な推移などを好感しておおむね上昇基調で推移しました。しかし2015年後半からは、米国の利上げ懸念や新興国経済の不調などから下落基調となりました。2016年3月以降は、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利するなど不安定な局面はありましたが、深セン－香港株式コネクト（相互株式投資制度）の開始期待などによりおおむね上昇基調になりました。10月からは、中国の不動産投資規制や資源価格の先行き不透明感などから、軟調な推移で償還を迎えました。

**○為替相場**

南アフリカ・ランド為替相場は、設定時よりボックス圏の動きで推移しましたが、2015年に入ると、米国の早期追加利上げ観測の高まりなどが嫌気されて、下落しました。償還にかけては、日米長期金利差の拡大を受けて円売り／米ドル買いが進み、南アフリカ・ランドは対円で相対的に下げ幅を縮めました。

**○短期金利市況**

南アフリカの短期金利は、設定時よりほぼ横ばいで推移しましたが、2014年初旬から、南アフリカ準備銀行がインフレ抑制のために政策金利を継続的に引き上げたため、短期金利も上昇しました。

一方、香港では、設定時より、政策金利を米国の金融政策に合わせるため0.50%に維持しましたが、米国の利上げに合わせて、2015年12月に0.75%に、2016年12月に1.00%に引き上げました。

## 信託期間中の運用方針

### ○当ファンド

「ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド（南アフリカランドクラス）」（以下「香港ハンセン指数ファンド（南アフリカランドクラス）」といいます。）と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（南アフリカランドクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないません。

### ○香港ハンセン指数ファンド（南アフリカランドクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／南アフリカ・ランド買いの為替取引を行ないません。

### ○ダイワ・マネープール・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・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないません。

## 信託期間中のポートフォリオについて

### ○当ファンド

外国籍投資信託「香港ハンセン指数ファンド（南アフリカランドクラス）」と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（南アフリカランドクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないました。

なお、満期償還に備えるため、2016年11月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式および為替等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

### ○香港ハンセン指数ファンド（南アフリカランドクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／南アフリカ・ランド買いの為替取引を行ないました。

株式（株式先物取引を含む。）の組入比率は、通常の状態、高位を維持しました。

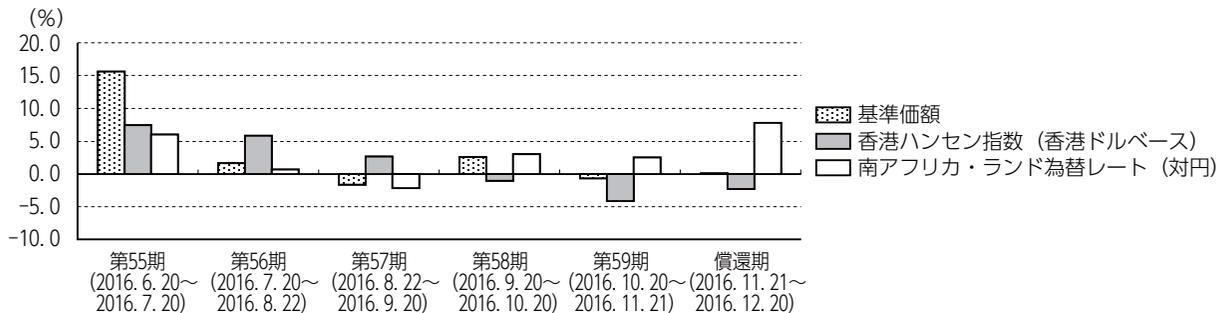
## ○ダイワ・マネープール・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期間における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。参考指数には、香港ハンセン指数（香港ドルベース）と南アフリカ・ランド為替レート（対円）を掲載しています。



## 分配金について

1万口当り、第3期～第59期各70円の収益分配を行ないました。なお、第1期～第2期は分配方針通り、収益分配を行ないませんでした。

また、第55期～第59期の分配原資の内訳および決定根拠「収益分配金の計算過程（1万口当り）」は下記の通りです。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年6月21日 ～2016年7月20日	2016年7月21日 ～2016年8月22日	2016年8月23日 ～2016年9月20日	2016年9月21日 ～2016年10月20日	2016年10月21日 ～2016年11月21日
当期分配金（税込み）（円）	70	70	70	70	70
対基準価額比率（％）	1.08	1.07	1.10	1.09	1.10
当期の収益（円）	46	42	40	46	42
当期の収益以外（円）	23	27	29	23	27
翌期繰越分配対象額（円）	2,049	2,021	1,992	1,969	1,941

（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	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	46.66円	42.49円	40.91円	46.73円	42.48円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	1,658.88	1,663.07	1,666.91	1,670.49	1,673.73
(d) 分配準備積立金	413.63	386.10	354.76	322.09	295.59
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,119.18	2,091.67	2,062.59	2,039.32	2,011.80
(f) 分配金	70.00	70.00	70.00	70.00	70.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	2,049.18	2,021.67	1,992.59	1,969.32	1,941.80

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～償還期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 21～2016. 12. 20)		
	金 額	比 率	
信託報酬	39円	0.611%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は6,315円です。</b>
(投信会社)	(15)	(0.243)	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)	(22)	(0.352)	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)	(0.016)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	39	0.611	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	6.925	475	207.901	14,513

(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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネープール・マザーファンド	—	—	3	3

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

第55期～償還期							
買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
				HONG KONG HANG SENG INDEX FUND ZAR CLASS (ケイマン諸島)	207.901	14,513	69

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～償還期）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

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年12月20日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	12,536	100.0
投資信託財産総額	12,536	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

種類	第54期末
	□数
	千□
ダイワ・マネープール・マザーファンド	3

(注) 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7月20日)、(2016年8月22日)、(2016年9月20日)、(2016年10月20日)、(2016年11月21日)、(2016年12月20日) 現在

項 目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	償還時
<b>(A) 資産</b>	<b>12,418,684円</b>	<b>12,521,036円</b>	<b>12,316,947円</b>	<b>12,633,104円</b>	<b>12,552,779円</b>	<b>12,536,253円</b>
コール・ローン等	132,555	219,341	205,298	193,172	280,206	12,536,253
投資信託受益証券（評価額）	12,082,331	12,297,896	12,107,850	12,436,133	12,268,774	—
ダイワ・マネープール・マザーファンド（評価額）	3,799	3,799	3,799	3,799	3,799	—
未収入金	199,999	—	—	—	—	—
<b>(B) 負債</b>	<b>245,543</b>	<b>147,814</b>	<b>147,347</b>	<b>149,694</b>	<b>179,575</b>	<b>12,562</b>
未払金	100,000	—	—	—	—	—
未払収益分配金	132,638	134,080	135,530	137,036	138,226	—
未払解約金	—	—	—	—	27,806	—
未払信託報酬	12,905	13,734	11,817	12,658	13,543	12,548
未払利息	—	—	—	—	—	14
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>12,173,141</b>	<b>12,373,222</b>	<b>12,169,600</b>	<b>12,483,410</b>	<b>12,373,204</b>	<b>12,523,691</b>
元本	18,948,428	19,154,420	19,361,497	19,576,647	19,746,687	19,967,285
次期繰越損益金	△ 6,775,287	△ 6,781,198	△ 7,191,897	△ 7,093,237	△ 7,373,483	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 7,443,594
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>18,948,428口</b>	<b>19,154,420口</b>	<b>19,361,497口</b>	<b>19,576,647口</b>	<b>19,746,687口</b>	<b>19,967,285口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	6,424円	6,460円	6,285円	6,377円	6,266円	—
1万口当り償還価額（C/D）	—	—	—	—	—	6,272円11銭

\* 第54期末における元本額は22,156,674円、当作成期間（第55期～償還期）中における追加設定元本額は1,295,954円、同解約元本額は3,485,343円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は6,272円11銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は7,443,594円です。

■損益の状況

第55期 自2016年6月21日 至2016年7月20日 第57期 自2016年8月23日 至2016年9月20日 第59期 自2016年10月21日 至2016年11月21日  
 第56期 自2016年7月21日 至2016年8月22日 第58期 自2016年9月21日 至2016年10月20日 償還期 自2016年11月22日 至2016年12月20日

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	償還期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>89,109円</b>	<b>86,937円</b>	<b>91,028円</b>	<b>95,160円</b>	<b>97,437円</b>	<b>△ 410円</b>
受取配当金	89,120	86,937	91,028	95,160	97,437	—
支払利息	△ 11	—	—	—	—	△ 410
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1,588,255</b>	<b>128,629</b>	<b>△ 281,074</b>	<b>233,123</b>	<b>△ 164,310</b>	<b>25,219</b>
売買益	1,695,031	128,630	—	233,123	676	25,219
売買損	△ 106,776	△ 1	△ 281,074	—	△ 164,986	—
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 12,905</b>	<b>△ 13,734</b>	<b>△ 11,817</b>	<b>△ 12,658</b>	<b>△ 13,543</b>	<b>△ 12,548</b>
<b>(D) 当期損益金（A+B+C）</b>	<b>1,664,459</b>	<b>201,832</b>	<b>△ 201,863</b>	<b>315,625</b>	<b>△ 80,416</b>	<b>12,261</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 11,370,868</b>	<b>△ 9,839,047</b>	<b>△ 9,771,295</b>	<b>△ 10,108,688</b>	<b>△ 9,907,836</b>	<b>△ 10,126,478</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>3,063,760</b>	<b>2,990,097</b>	<b>2,916,791</b>	<b>2,836,862</b>	<b>2,752,995</b>	<b>2,670,623</b>
（配当等相当額）	( 3,143,323)	( 3,185,532)	( 3,227,398)	( 3,270,265)	( 3,305,063)	( 3,347,899)
（売買損益相当額）	(△ 79,563)	(△ 195,435)	(△ 310,607)	(△ 433,403)	(△ 552,068)	(△ 677,276)
<b>(G) 合計（D+E+F）</b>	<b>△ 6,642,649</b>	<b>△ 6,647,118</b>	<b>△ 7,056,367</b>	<b>△ 6,956,201</b>	<b>△ 7,235,257</b>	<b>△ 7,443,594</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 132,638</b>	<b>△ 134,080</b>	<b>△ 135,530</b>	<b>△ 137,036</b>	<b>△ 138,226</b>	<b>—</b>
次期繰越損益金（G+H）	△ 6,775,287	△ 6,781,198	△ 7,191,897	△ 7,093,237	△ 7,373,483	—
追加信託差損益金	3,063,760	2,990,097	2,916,791	2,836,862	2,752,995	—
（配当等相当額）	( 3,143,323)	( 3,185,532)	( 3,227,398)	( 3,270,265)	( 3,305,063)	( —)
（売買損益相当額）	(△ 79,563)	(△ 195,435)	(△ 310,607)	(△ 433,403)	(△ 552,068)	( —)
分配準備積立金	739,557	686,875	630,556	585,010	529,366	—
繰越損益金	△ 10,578,604	△ 10,458,170	△ 10,739,244	△ 10,515,109	△ 10,655,844	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 7,443,594

(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37ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）南アフリカランドコース

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	88,424円	81,398円	79,211円	91,490円	83,894円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	3,143,323	3,185,532	3,227,398	3,270,265	3,305,063
(d) 分配準備積立金	783,771	739,557	686,875	630,556	583,698
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	4,015,518	4,006,487	3,993,484	3,992,311	3,972,655
(f) 分配金	132,638	134,080	135,530	137,036	138,226
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	3,882,880	3,872,407	3,857,954	3,855,275	3,834,429
(h) 受益権総口数	18,948,428□	19,154,420□	19,361,497□	19,576,647□	19,746,687□

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年12月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年12月20日		資産総額	12,536,253円
区 分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	12,562円
				純資産総額	12,523,691円
受益権口数	12,049,059□	19,967,285□	7,918,226□	受益権口数	19,967,285□
元 本 額	12,049,059円	19,967,285円	7,918,226円	1 単 位 当 り 償 還 金	6,272円11銭
毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第1期	12,049,059	13,237,436	10,986	—	—
第2期	175,527,511	209,792,931	11,952	—	—
第3期	267,772,550	340,063,568	12,700	70	0.70
第4期	263,773,807	311,964,900	11,827	70	0.70
第5期	262,203,158	254,629,472	9,711	70	0.70
第6期	243,828,271	245,595,443	10,072	70	0.70
第7期	246,691,026	248,257,933	10,064	70	0.70
第8期	254,373,220	259,952,405	10,219	70	0.70
第9期	168,412,810	176,287,501	10,468	70	0.70
第10期	141,667,261	147,575,126	10,417	70	0.70
第11期	121,322,627	124,059,071	10,226	70	0.70
第12期	100,334,690	116,543,475	11,615	70	0.70
第13期	144,564,940	176,229,314	12,190	70	0.70
第14期	148,281,079	183,190,795	12,354	70	0.70
第15期	133,723,486	152,074,760	11,372	70	0.70
第16期	139,164,485	165,160,894	11,868	70	0.70
第17期	95,348,473	120,659,617	12,655	70	0.70
第18期	87,814,815	89,046,868	10,140	70	0.70
第19期	87,841,914	95,760,347	10,901	70	0.70
第20期	87,867,284	94,737,060	10,782	70	0.70

香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型) 南アフリカランドコース

毎 計 算 期 末 の 状 況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第21期	87,893,086	105,580,685	12,012	70	0.70
第22期	87,924,227	101,414,887	11,534	70	0.70
第23期	87,652,907	100,701,072	11,489	70	0.70
第24期	87,676,890	98,683,336	11,255	70	0.70
第25期	85,423,313	92,894,404	10,875	70	0.70
第26期	85,447,511	88,026,983	10,302	70	0.70
第27期	85,473,198	84,341,741	9,868	70	0.70
第28期	85,504,968	91,265,095	10,674	70	0.70
第29期	85,530,081	91,317,418	10,677	70	0.70
第30期	85,555,328	91,898,995	10,741	70	0.70
第31期	85,580,566	92,611,067	10,822	70	0.70
第32期	85,304,910	100,205,474	11,747	70	0.70
第33期	85,327,020	98,082,826	11,495	70	0.70
第34期	85,333,083	90,254,797	10,577	70	0.70
第35期	20,081,716	23,595,967	11,750	70	0.70
第36期	20,079,411	22,475,243	11,193	70	0.70
第37期	20,085,696	22,932,886	11,418	70	0.70
第38期	20,090,871	23,520,868	11,707	70	0.70
第39期	20,096,878	22,216,177	11,055	70	0.70
第40期	20,103,331	25,024,770	12,448	70	0.70
第41期	20,993,653	26,720,253	12,728	70	0.70
第42期	21,075,102	26,031,361	12,352	70	0.70
第43期	21,161,702	24,736,737	11,689	70	0.70
第44期	21,260,398	21,512,660	10,119	70	0.70
第45期	21,326,333	19,241,180	9,022	70	0.70
第46期	21,459,077	20,030,779	9,334	70	0.70
第47期	20,811,245	18,268,943	8,778	70	0.70
第48期	20,926,376	16,170,829	7,727	70	0.70
第49期	21,084,782	12,646,345	5,998	70	0.70
第50期	21,306,780	12,863,427	6,037	70	0.70
第51期	21,513,904	13,729,285	6,382	70	0.70
第52期	21,711,957	14,823,885	6,828	70	0.70
第53期	21,927,240	12,271,749	5,597	70	0.70
第54期	22,156,674	12,443,111	5,616	70	0.70
第55期	18,948,428	12,173,141	6,424	70	0.70
第56期	19,154,420	12,373,222	6,460	70	0.70
第57期	19,361,497	12,169,600	6,285	70	0.70
第58期	19,576,647	12,483,410	6,377	70	0.70
第59期	19,746,687	12,373,204	6,266	70	0.70

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	70円	70円	70円	70円	70円
(単 価)	(6,424円)	(6,460円)	(6,285円)	(6,377円)	(6,266円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	6,272円11銭

#### 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。

#### 償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

## ★資源国通貨コース

## 最近30期の運用実績

決算期	基準価額			香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		公社債 組入率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期騰落 中率	(参考指数)	期騰落 中率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
31期末 (2014年7月22日)	11,788	80	1.2	12,554	0.9	0.3	98.8	22
32期末 (2014年8月20日)	12,688	80	8.3	13,486	7.4	0.2	99.1	30
33期末 (2014年9月22日)	12,402	80	△ 1.6	13,047	△ 3.3	0.1	99.1	19
34期末 (2014年10月20日)	11,204	80	△ 9.0	12,359	△ 5.3	0.1	99.2	17
35期末 (2014年11月20日)	12,181	80	9.4	12,547	1.5	0.1	75.2	30
36期末 (2014年12月22日)	11,659	80	△ 3.6	12,409	△ 1.1	0.0	99.6	80
37期末 (2015年1月20日)	11,949	80	3.2	12,743	2.7	0.0	99.6	82
38期末 (2015年2月20日)	11,801	80	△ 0.6	13,330	4.6	0.0	99.0	81
39期末 (2015年3月20日)	10,926	80	△ 6.7	13,135	△ 1.5	0.1	99.0	75
40期末 (2015年4月20日)	12,513	80	15.3	14,844	13.0	0.1	98.9	90
41期末 (2015年5月20日)	12,792	80	2.9	14,866	0.1	0.2	92.8	58
42期末 (2015年6月22日)	12,443	80	△ 2.1	14,365	△ 3.4	0.1	99.4	27
43期末 (2015年7月21日)	11,543	80	△ 6.6	13,637	△ 5.1	0.2	99.1	19
44期末 (2015年8月20日)	10,012	80	△ 12.6	12,436	△ 8.8	0.2	98.9	17
45期末 (2015年9月24日)	8,702	80	△ 12.3	11,435	△ 8.0	0.2	99.0	15
46期末 (2015年10月20日)	9,010	80	4.5	12,387	8.3	0.2	99.0	16
47期末 (2015年11月20日)	8,907	80	△ 0.3	12,078	△ 2.5	0.1	99.2	15
48期末 (2015年12月21日)	8,088	80	△ 8.3	11,678	△ 3.3	0.2	99.2	13
49期末 (2016年1月20日)	6,558	80	△ 17.9	10,540	△ 9.7	0.2	98.9	9
50期末 (2016年2月22日)	6,300	80	△ 2.7	10,352	△ 1.8	0.2	99.0	9
51期末 (2016年3月22日)	7,036	80	13.0	11,103	7.3	—	99.3	10
52期末 (2016年4月20日)	7,298	80	4.9	11,507	3.6	—	99.3	10
53期末 (2016年5月20日)	6,227	80	△ 13.6	10,572	△ 8.1	—	97.8	6
54期末 (2016年6月20日)	6,215	80	1.1	10,827	2.4	—	99.1	6
55期末 (2016年7月20日)	7,001	80	13.9	11,634	7.5	—	99.1	5
56期末 (2016年8月22日)	6,818	80	△ 1.5	12,313	5.8	—	99.3	4
57期末 (2016年9月20日)	6,753	80	0.2	12,642	2.7	—	99.4	4
58期末 (2016年10月20日)	6,914	80	3.6	12,510	△ 1.0	—	99.1	4
59期末 (2016年11月21日)	6,665	80	△ 2.4	11,994	△ 4.1	—	99.6	4
償還 (2016年12月20日)	6,671.50	—	0.1	11,720	△ 2.3	—	—	4

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 香港ハンセン指数（香港ドルベース）は、同指数の原データをもとに、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。

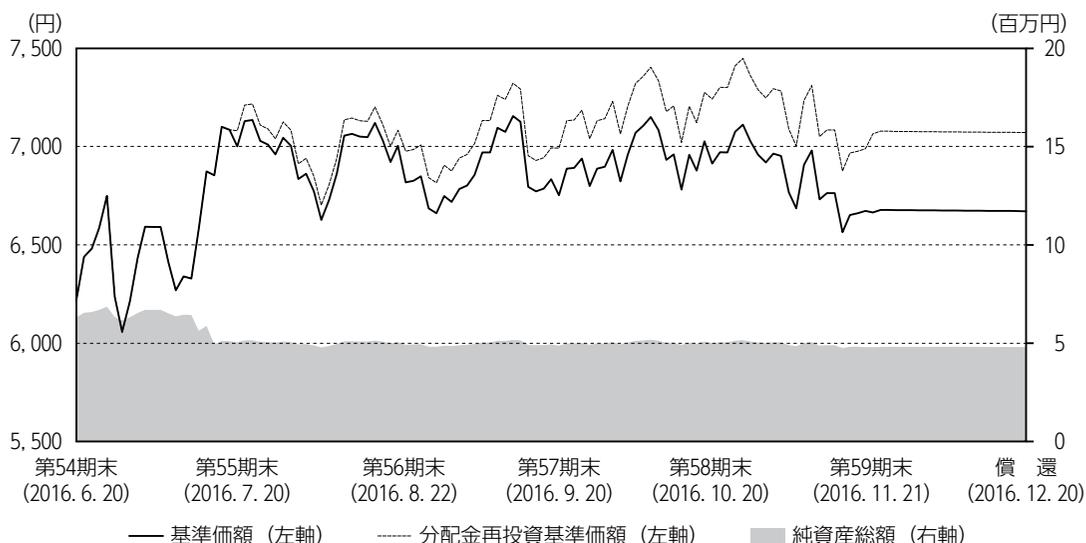
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 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5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

### 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：6,671円50銭（既払分配金4,560円）

騰落率：5.6%（分配金再投資ベース）

### ■基準価額の主な変動要因

外国籍投資信託を通じて香港ハンセン指数にほぼ100%投資した結果、香港株式市況の上昇および配当金収入、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。一方、為替相場下落および運用管理費用等がマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

	年 月 日	基 準 価 額		香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		公 社 債 入 率 組 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第55期	(期首) 2016年 6月20日	円	%	10,827	%	%	%
	6月末	6,215	—	10,970	—	—	99.1
	(期末) 2016年 7月20日	6,434	3.5	11,634	1.3	—	99.1
第56期	(期首) 2016年 7月20日	7,001	—	11,634	—	—	99.1
	7月末	7,004	0.0	12,313	2.3	—	99.0
	(期末) 2016年 8月22日	6,898	△ 1.5	12,313	5.8	—	99.3
第57期	(期首) 2016年 8月22日	6,818	—	12,313	—	—	99.3
	8月末	6,784	△ 0.5	12,642	0.3	—	99.2
	(期末) 2016年 9月20日	6,833	0.2	12,642	2.7	—	99.4
第58期	(期首) 2016年 9月20日	6,753	—	12,510	—	—	99.4
	9月末	6,983	3.4	12,510	0.8	—	99.3
	(期末) 2016年10月20日	6,994	3.6	12,510	△ 1.0	—	99.1
第59期	(期首) 2016年10月20日	6,914	—	12,322	—	—	99.1
	10月末	6,920	0.1	11,994	△ 1.5	—	99.0
	(期末) 2016年11月21日	6,745	△ 2.4	11,994	△ 4.1	—	99.6
償還期	(期首) 2016年11月21日	6,665	—	11,720	—	—	99.6
	11月末	6,676	0.2	11,720	1.8	—	—
	(償還) 2016年12月20日	6,671.50	0.1	11,720	△ 2.3	—	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

### ○香港株式市況

香港株式市況は、設定時より、中国の景気刺激策および追加財政支出への期待や、米国経済および先進国の株式市況の堅調な推移などを好感しておおむね上昇基調で推移しました。しかし2015年後半からは、米国の利上げ懸念や新興国経済の不調などから下落基調となりました。2016年3月以降は、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利するなど不安定な局面はありましたが、深セン－香港株式コネクト（相互株式投資制度）の開始期待などによりおおむね上昇基調になりました。10月からは、中国の不動産投資規制や資源価格の先行き不透明感などから、軟調な推移で償還を迎えました。

### ○為替相場

ブラジル・レアル為替相場は、設定時よりボックス圏の動きで推移しましたが、2015年に入ると、国内の政治および景気の先行き不透明感や米国の早期追加利上げ観測の高まりなどが嫌気されて、下落しました。

豪ドル為替相場は、設定時より、日銀によるデフレ脱却をめざした金融緩和政策による円安の進行から対円で上昇したものの、2015年に入ると、オーストラリアの短期金利の利下げや中国の景気減速などを受けて上値の重い展開となり、下落基調となりました。

南アフリカ・ランド為替相場は、設定時よりボックス圏の動きで推移しましたが、2015年に入ると、米国の早期追加利上げ観測の高まりなどが嫌気されて、下落しました。

なお、償還日にかけては、日米長期金利差の拡大を受けて円売り／米ドル買いが進み、資源国通貨は対円で、相対的に上昇しました。

### ○短期金利市況

ブラジルの短期金利は、設定時より、国内景気への配慮からブラジル中央銀行が継続して利下げを実施しましたが、2013年前半よりインフレ抑制のために継続的な利上げに転じました。

オーストラリアの短期金利は、設定時より、中国経済の減速懸念や資源価格の低迷などの懸念材料を抱える国内景気の動向に配慮して、RBA（オーストラリア準備銀行）が継続的に利下げを実施したため、下落しました。

南アフリカの短期金利は、設定時よりほぼ横ばいで推移しましたが、2014年初旬から、南アフリカ準備銀行がインフレ抑制のために政策金利を継続的に引き上げたため、短期金利も上昇しました。

一方、香港では、設定時より、政策金利を米国の金融政策に合わせるため0.50%に維持しましたが、米国の利上げに合わせて、2015年12月に0.75%に、2016年12月に1.00%に引き上げました。

## 信託期間中の運用方針

### ○当ファンド

「ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド（資源国通貨クラス）」（以下「香港ハンセン指数ファンド（資源国通貨クラス）」といいます。）と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（資源国通貨クラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないます。

### ○香港ハンセン指数ファンド（資源国通貨クラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／資源国通貨（※）買いの為替取引を行ないます。

※ブラジル・リアル、豪ドル、南アフリカ・ランド

### ○ダイワ・マネープール・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・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないます。

## 信託期間中のポートフォリオについて

### ○当ファンド

外国籍投資信託「香港ハンセン指数ファンド（資源国通貨クラス）」と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（資源国通貨クラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないました。

なお、満期償還に備えるため、2016年11月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式および為替等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

### ○香港ハンセン指数ファンド（資源国通貨クラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／資源国通貨買いの為替取引を行ないました。

株式（株式先物取引を含む。）の組入比率は、通常の状態、高位を維持しました。

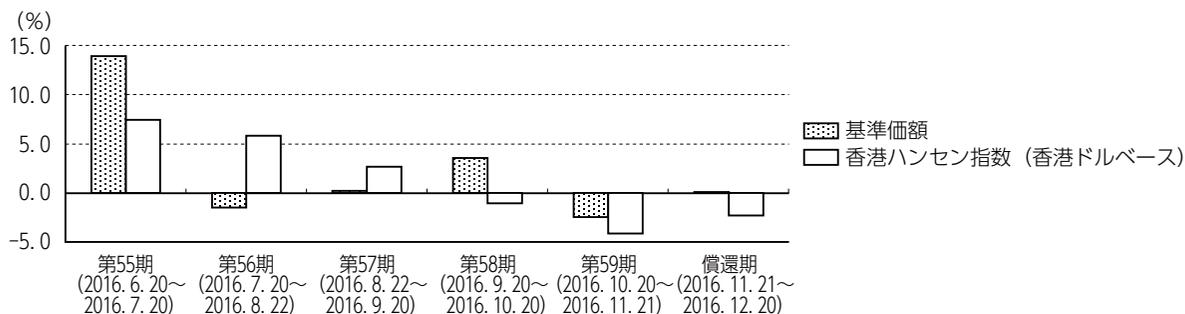
○ダイワ・マネープール・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期間における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。参考指数には、香港ハンセン指数（香港ドルベース）を掲載しています。



## 分配金について

1万口当り、第3期～第59期各80円の収益分配を行ないました。なお、第1期～第2期は分配方針通り、収益分配を行ないませんでした。

また、第55期～第59期の分配原資の内訳および決定根拠「収益分配金の計算過程（1万口当り）」は下記の通りです。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年6月21日 ～2016年7月20日	2016年7月21日 ～2016年8月22日	2016年8月23日 ～2016年9月20日	2016年9月21日 ～2016年10月20日	2016年10月21日 ～2016年11月21日
当期分配金（税込み）（円）	80	80	80	80	80
対基準価額比率（％）	1.13	1.16	1.17	1.14	1.19
当期の収益（円）	51	42	46	51	44
当期の収益以外（円）	28	37	33	28	35
翌期繰越分配対象額（円）	3,492	3,455	3,421	3,393	3,357

（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	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	51.08円	42.58円	46.12円	51.93円	44.85円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	3,353.10	3,353.27	3,353.40	3,353.49	3,353.54
(d) 分配準備積立金	168.21	139.13	101.59	67.63	39.52
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	3,572.41	3,535.00	3,501.12	3,473.06	3,437.91
(f) 分配金	80.00	80.00	80.00	80.00	80.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	3,492.41	3,455.00	3,421.12	3,393.06	3,357.91

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～償還期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 21～2016. 12. 20)		
	金 額	比 率	
信託報酬	42円	0.611%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は6,809円です。</b>
（投信会社）	(17)	(0.243)	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）	(24)	(0.352)	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)	(0.016)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	42	0.611	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	2.733	202	94.471	7,008

(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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネープール・マザーファンド	—	—	1	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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

第55期～償還期							
買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
				HONG KONG HANG SENG INDEX FUND CMC CLASS (ケイマン諸島)	94.471	7,008	74

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～償還期）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

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年12月20日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	4,814	100.0
投資信託財産総額	4,814	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

種類	第54期末
	□数
	千□
ダイワ・マネープール・マザーファンド	1

(注) 単位未満は切捨て。

# 香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）資源国通貨コース

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年7月20日)、(2016年8月22日)、(2016年9月20日)、(2016年10月20日)、(2016年11月21日)、(2016年12月20日)現在

項目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	償還時
<b>(A) 資産</b>	<b>5,157,999円</b>	<b>5,031,117円</b>	<b>4,990,229円</b>	<b>5,132,841円</b>	<b>4,888,729円</b>	<b>4,814,304円</b>
コール・ローン等	55,830	48,079	41,004	34,669	108,110	4,814,304
投資信託受益証券（評価額）	5,000,501	4,881,369	4,847,556	4,956,504	4,778,950	—
ダイワ・マネーパール・マザーファンド（評価額）	1,669	1,669	1,669	1,669	1,669	—
未収入金	99,999	100,000	100,000	139,999	—	—
<b>(B) 負債</b>	<b>113,848</b>	<b>113,241</b>	<b>112,574</b>	<b>132,872</b>	<b>90,438</b>	<b>4,805</b>
未払金	50,000	50,000	50,000	70,000	—	—
未払収益分配金	57,637	57,707	57,779	57,853	57,595	—
未払解約金	—	—	—	—	27,557	—
未払信託報酬	6,211	5,534	4,795	5,019	5,286	4,800
未払利息	—	—	—	—	—	5
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>5,044,151</b>	<b>4,917,876</b>	<b>4,877,655</b>	<b>4,999,969</b>	<b>4,798,291</b>	<b>4,809,499</b>
元本	7,204,686	7,213,395	7,222,440	7,231,679	7,199,439	7,209,018
次期繰越損益金	△ 2,160,535	△ 2,295,519	△ 2,344,785	△ 2,231,710	△ 2,401,148	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 2,399,519
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>7,204,686口</b>	<b>7,213,395口</b>	<b>7,222,440口</b>	<b>7,231,679口</b>	<b>7,199,439口</b>	<b>7,209,018口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	7,001円	6,818円	6,753円	6,914円	6,665円	—
1万口当り償還価額（C/D）	—	—	—	—	—	6,671円50銭

\* 第54期末における元本額は10,152,841円、当作成期間（第55期～償還期）中における追加設定元本額は55,387円、同解約元本額は2,999,210円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は6,671円50銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,399,519円です。

## ■損益の状況

第55期 自2016年6月21日 至2016年7月20日 第57期 自2016年8月23日 至2016年9月20日 第59期 自2016年10月21日 至2016年11月21日  
 第56期 自2016年7月21日 至2016年8月22日 第58期 自2016年9月21日 至2016年10月20日 償還期 自2016年11月22日 至2016年12月20日

項目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	償還期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>37,171円</b>	<b>36,255円</b>	<b>38,107円</b>	<b>38,644円</b>	<b>37,577円</b>	<b>△ 147円</b>
受取配当金	37,178	36,255	38,107	38,644	37,577	—
支払利息	△ 7	—	—	—	—	△ 147
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>593,019</b>	<b>△ 105,386</b>	<b>△ 21,920</b>	<b>140,303</b>	<b>△ 154,083</b>	<b>9,771</b>
売買益	670,702	1	1	140,305	1,221	9,771
売買損	△ 77,683	△ 105,387	△ 21,921	△ 2	△ 155,304	—
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 6,211</b>	<b>△ 5,534</b>	<b>△ 4,795</b>	<b>△ 5,019</b>	<b>△ 5,286</b>	<b>△ 4,800</b>
<b>(D) 当期損益金（A+B+C）</b>	<b>623,979</b>	<b>△ 74,665</b>	<b>11,392</b>	<b>173,928</b>	<b>△ 121,792</b>	<b>4,824</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 4,355,587</b>	<b>△ 3,789,245</b>	<b>△ 3,921,617</b>	<b>△ 3,968,004</b>	<b>△ 3,829,922</b>	<b>△ 4,009,309</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>1,628,710</b>	<b>1,626,098</b>	<b>1,623,219</b>	<b>1,620,219</b>	<b>1,608,161</b>	<b>1,604,966</b>
（配当等相当額）	（ 2,415,810）	（ 2,418,851）	（ 2,421,976）	（ 2,425,137）	（ 2,414,362）	（ 2,417,578）
（売買損益相当額）	（△ 787,100）	（△ 792,753）	（△ 798,757）	（△ 804,918）	（△ 806,201）	（△ 812,612）
<b>(G) 合計（D+E+F）</b>	<b>△ 2,102,898</b>	<b>△ 2,237,812</b>	<b>△ 2,287,006</b>	<b>△ 2,173,857</b>	<b>△ 2,343,553</b>	<b>△ 2,399,519</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 57,637</b>	<b>△ 57,707</b>	<b>△ 57,779</b>	<b>△ 57,853</b>	<b>△ 57,595</b>	<b>—</b>
次期繰越損益金（G+H）	△ 2,160,535	△ 2,295,519	△ 2,344,785	△ 2,231,710	△ 2,401,148	—
追加信託差損益金	1,628,710	1,626,098	1,623,219	1,620,219	1,608,161	—
（配当等相当額）	（ 2,415,810）	（ 2,418,851）	（ 2,421,976）	（ 2,425,137）	（ 2,414,362）	（ —）
（売買損益相当額）	（△ 787,100）	（△ 792,753）	（△ 798,757）	（△ 804,918）	（△ 806,201）	（ —）
分配準備積立金	100,365	73,379	48,912	28,619	3,151	—
繰越損益金	△ 3,889,610	△ 3,994,996	△ 4,016,916	△ 3,880,548	△ 4,012,460	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 2,399,519

(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50ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

## ■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	36,805円	30,721円	33,312円	37,560円	32,291円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	2,415,810	2,418,851	2,421,976	2,425,137	2,414,362
(d) 分配準備積立金	121,197	100,365	73,379	48,912	28,455
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,573,812	2,549,937	2,528,667	2,511,609	2,475,108
(f) 分配金	57,637	57,707	57,779	57,853	57,595
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	2,516,175	2,492,230	2,470,888	2,453,756	2,417,513
(h) 受益権総口数	7,204,686口	7,213,395口	7,222,440口	7,231,679口	7,199,439口

## 投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年12月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年12月20日		資産総額	4,814,304円
区 分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	4,805円
				純資産総額	4,809,499円
受益権口数	86,962,870口	7,209,018口	△79,753,852口	受益権口数	7,209,018口
元 本 額	86,962,870円	7,209,018円	△79,753,852円	1 単 位 当 り 償 還 金	6,671円50銭
毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第1期	70,858,027	78,648,449	11,099	—	—
第2期	104,010,264	128,279,586	12,333	—	—
第3期	115,747,510	145,019,292	12,529	80	0.80
第4期	98,464,729	115,425,396	11,723	80	0.80
第5期	92,016,676	88,751,928	9,645	80	0.80
第6期	92,162,985	91,825,027	9,963	80	0.80
第7期	92,101,582	92,177,877	10,008	80	0.80
第8期	99,437,822	102,274,327	10,285	80	0.80
第9期	46,101,629	48,182,036	10,451	80	0.80
第10期	29,605,217	31,501,910	10,641	80	0.80
第11期	24,367,179	25,534,354	10,479	80	0.80
第12期	18,294,397	21,229,094	11,604	80	0.80
第13期	73,840,966	93,072,389	12,604	80	0.80
第14期	89,167,844	114,903,110	12,886	80	0.80
第15期	55,973,791	67,982,073	12,145	80	0.80
第16期	98,847,980	123,738,705	12,518	80	0.80
第17期	62,956,279	82,785,280	13,150	80	0.80
第18期	70,628,435	75,679,580	10,715	80	0.80
第19期	69,115,745	77,416,046	11,201	80	0.80
第20期	47,383,247	52,315,065	11,041	80	0.80

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）資源国通貨コース

毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第21期	42,752,009	52,798,137	12,350	80	0.80
第22期	36,101,740	43,707,002	12,107	80	0.80
第23期	32,719,892	39,549,269	12,087	80	0.80
第24期	30,382,821	35,249,204	11,602	80	0.80
第25期	29,522,051	33,870,369	11,473	80	0.80
第26期	26,652,495	29,292,075	10,990	80	0.80
第27期	25,724,476	27,081,843	10,528	80	0.80
第28期	25,290,076	29,031,813	11,480	80	0.80
第29期	25,328,396	29,008,749	11,453	80	0.80
第30期	29,087,736	34,115,662	11,729	80	0.80
第31期	19,224,193	22,661,392	11,788	80	0.80
第32期	24,257,724	30,778,614	12,688	80	0.80
第33期	15,908,329	19,729,852	12,402	80	0.80
第34期	15,920,492	17,838,098	11,204	80	0.80
第35期	25,396,369	30,934,614	12,181	80	0.80
第36期	69,179,216	80,653,636	11,659	80	0.80
第37期	69,192,382	82,679,734	11,949	80	0.80
第38期	69,148,731	81,604,559	11,801	80	0.80
第39期	69,161,881	75,564,375	10,926	80	0.80
第40期	72,282,897	90,448,066	12,513	80	0.80
第41期	45,478,759	58,174,818	12,792	80	0.80
第42期	21,972,739	27,341,384	12,443	80	0.80
第43期	16,999,420	19,622,263	11,543	80	0.80
第44期	17,856,095	17,876,932	10,012	80	0.80
第45期	17,880,423	15,560,355	8,702	80	0.80
第46期	17,908,634	16,136,219	9,010	80	0.80
第47期	17,936,133	15,975,443	8,907	80	0.80
第48期	17,211,059	13,919,753	8,088	80	0.80
第49期	14,767,377	9,684,324	6,558	80	0.80
第50期	14,790,898	9,318,513	6,300	80	0.80
第51期	14,800,197	10,412,705	7,036	80	0.80
第52期	14,808,457	10,806,868	7,298	80	0.80
第53期	10,143,296	6,315,756	6,227	80	0.80
第54期	10,152,841	6,310,214	6,215	80	0.80
第55期	7,204,686	5,044,151	7,001	80	0.80
第56期	7,213,395	4,917,876	6,818	80	0.80
第57期	7,222,440	4,877,655	6,753	80	0.80
第58期	7,231,679	4,999,969	6,914	80	0.80
第59期	7,199,439	4,798,291	6,665	80	0.80

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	80円	80円	80円	80円	80円
(単 価)	(7,001円)	(6,818円)	(6,753円)	(6,914円)	(6,665円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	6,671円50銭

#### 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。

#### 償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

★香港ドルコース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			香港ハンセン指数 (円換算)		公社債 組比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
31期末 (2014年7月22日)	円 14,899	円 20	% 0.9	16,417	% 0.5	% 0.4	% 97.9	百万円 18
32期末 (2014年8月20日)	16,085	20	8.1	17,905	9.1	0.3	98.1	4
33期末 (2014年9月22日)	16,529	20	2.9	18,326	2.4	0.1	98.7	13
34期末 (2014年10月20日)	15,231	20	△ 7.7	17,050	△ 7.0	0.1	99.2	12
35期末 (2014年11月20日)	16,834	20	10.7	19,102	12.0	0.0	95.7	100
36期末 (2014年12月22日)	16,858	20	0.3	19,103	0.0	0.1	99.2	131
37期末 (2015年1月20日)	17,215	20	2.2	19,362	1.4	0.1	99.3	135
38期末 (2015年2月20日)	17,800	20	3.5	20,441	5.6	0.1	98.0	120
39期末 (2015年3月20日)	17,794	20	0.1	20,417	△ 0.1	0.1	99.0	93
40期末 (2015年4月20日)	19,616	20	10.4	22,763	11.5	0.1	90.6	127
41期末 (2015年5月20日)	19,845	20	1.3	23,167	1.8	0.1	98.9	165
42期末 (2015年6月22日)	19,598	20	△ 1.1	22,717	△ 1.9	0.1	99.1	277
43期末 (2015年7月21日)	18,841	20	△ 3.8	21,866	△ 3.7	0.1	99.4	266
44期末 (2015年8月20日)	17,133	20	△ 9.0	19,841	△ 9.3	0.1	99.3	235
45期末 (2015年9月24日)	15,680	20	△ 8.4	17,718	△ 10.7	0.1	99.0	210
46期末 (2015年10月20日)	16,295	20	4.0	19,081	7.7	0.1	98.6	210
47期末 (2015年11月20日)	16,241	20	△ 0.2	19,149	0.4	0.1	99.0	203
48期末 (2015年12月21日)	15,386	20	△ 5.1	18,258	△ 4.6	0.1	99.3	131
49期末 (2016年1月20日)	13,209	20	△ 14.0	15,826	△ 13.3	0.1	96.1	104
50期末 (2016年2月22日)	12,418	20	△ 5.8	15,017	△ 5.1	0.2	99.0	84
51期末 (2016年3月22日)	13,105	20	5.7	16,017	6.7	—	99.4	84
52期末 (2016年4月20日)	13,197	20	0.9	16,185	1.1	—	99.4	80
53期末 (2016年5月20日)	12,122	20	△ 8.0	14,965	△ 7.5	—	98.0	56
54期末 (2016年6月20日)	11,709	20	△ 3.2	14,591	△ 2.5	—	99.3	47
55期末 (2016年7月20日)	12,784	20	9.4	15,888	8.9	—	99.3	48
56期末 (2016年8月22日)	12,093	20	△ 5.2	15,966	0.5	—	98.7	38
57期末 (2016年9月20日)	12,444	20	3.1	16,595	3.9	—	97.7	30
58期末 (2016年10月20日)	12,391	20	△ 0.3	16,697	0.6	—	98.5	22
59期末 (2016年11月21日)	12,540	20	1.4	17,135	2.6	—	98.7	22
償還 (2016年12月20日)	12,552.77	—	0.1	17,667	3.1	—	—	22

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 香港ハンセン指数(円換算)は、香港ハンセン指数(香港ドルベース)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。

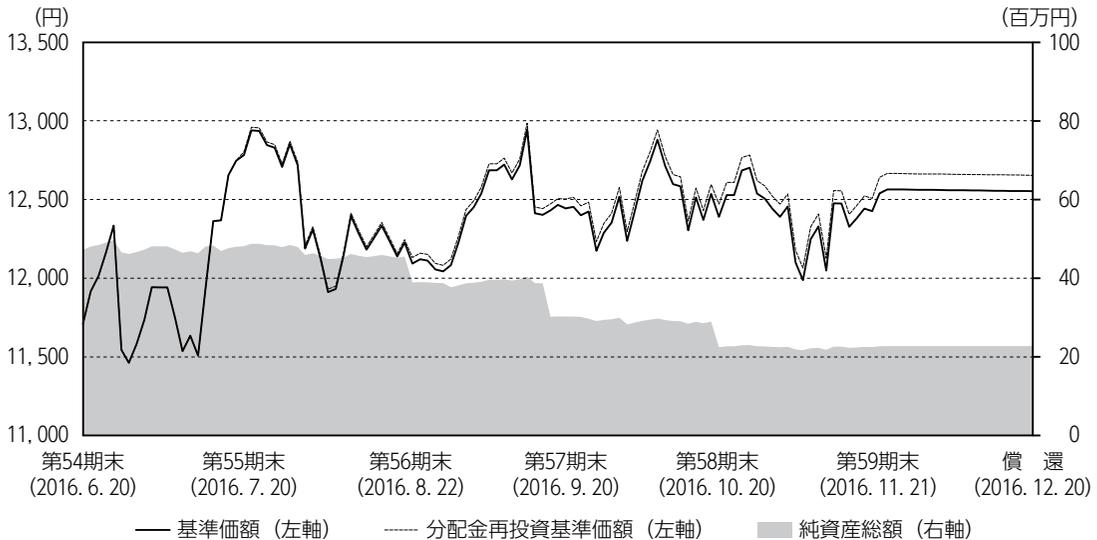
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 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5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

## ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：12,552円77銭（既払分配金1,140円）

騰落率：36.3%（分配金再投資ベース）

## ■ 基準価額の主な変動要因

外国籍投資信託を通じて香港ハンセン指数にほぼ100%投資した結果、香港株式市況の上昇および配当金収入、為替相場の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。一方、運用管理費用等がマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）香港ドルコース

	年 月 日	基 準 価 額		香港ハンセン指数 (円換算)		公 社 債 入 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第55期	(期首) 2016年 6月20日	円	%	14,591	%	%	%
	6月末	11,709	—	14,532	—	—	99.3
	(期末) 2016年 7月20日	11,736	0.2	15,888	△ 0.4	—	99.4
第56期	(期首) 2016年 7月20日	12,804	9.4	15,888	—	—	99.3
	7月末	12,784	—	16,005	0.7	—	99.3
	(期末) 2016年 8月22日	12,719	△ 0.5	15,966	0.5	—	98.7
第57期	(期首) 2016年 8月22日	12,093	—	15,966	—	—	98.7
	8月末	12,397	2.5	16,416	2.8	—	99.2
	(期末) 2016年 9月20日	12,464	3.1	16,595	3.9	—	97.7
第58期	(期首) 2016年 9月20日	12,444	—	16,595	—	—	97.7
	9月末	12,517	0.6	16,600	0.0	—	95.3
	(期末) 2016年10月20日	12,411	△ 0.3	16,697	0.6	—	98.5
第59期	(期首) 2016年10月20日	12,391	—	16,697	—	—	98.5
	10月末	12,440	0.4	16,643	△ 0.3	—	98.5
	(期末) 2016年11月21日	12,560	1.4	17,135	2.6	—	98.7
償還期	(期首) 2016年11月21日	12,540	—	17,135	—	—	98.7
	11月末	12,562	0.2	17,680	3.2	—	—
	(償還) 2016年12月20日	12,552.77	0.1	17,667	3.1	—	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

### ○香港株式市況

香港株式市況は、設定時より、中国の景気刺激策および追加財政支出への期待や、米国経済および先進国の株式市況の堅調な推移などを好感しておおむね上昇基調で推移しました。しかし2015年後半からは、米国の利上げ懸念や新興国経済の不調などから下落基調となりました。2016年3月以降は、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利するなど不安定な局面はありましたが、深セン－香港株式コネクト（相互株式投資制度）の開始期待などによりおおむね上昇基調となりました。10月からは、中国の不動産投資規制や資源価格の先行き不透明感などから、軟調な推移で償還を迎えました。

### ○為替相場

香港ドル為替相場は、設定時より、日銀によるデフレ脱却をめざした金融緩和政策による円安の進行から対円で上昇したものの、2015年に入ると、日米の金融政策への思惑などから上値の重い展開となり、2016年には下落基調に転じました。償還にかけては、日米長期金利差の拡大を受けて円売り／米ドル買いが進み、香港ドルは対円で相対的に上昇しました。

## 信託期間中の運用方針

### ○当ファンド

「ダイワ・グローバル・トラスト－香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）」（以下「香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）」といいます。）と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないます。

### ○香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行ないます。

### ○ダイワ・マネープール・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・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないます。

## 信託期間中のポートフォリオについて

### ○当ファンド

外国籍投資信託「香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）」と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないました。

なお、満期償還に備えるため、2016年11月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式および為替等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

### ○香港ハンセン指数ファンド（香港ドルクラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行ないました。

株式（株式先物取引を含む。）の組入比率は、通常の状態でも高位を維持しました。

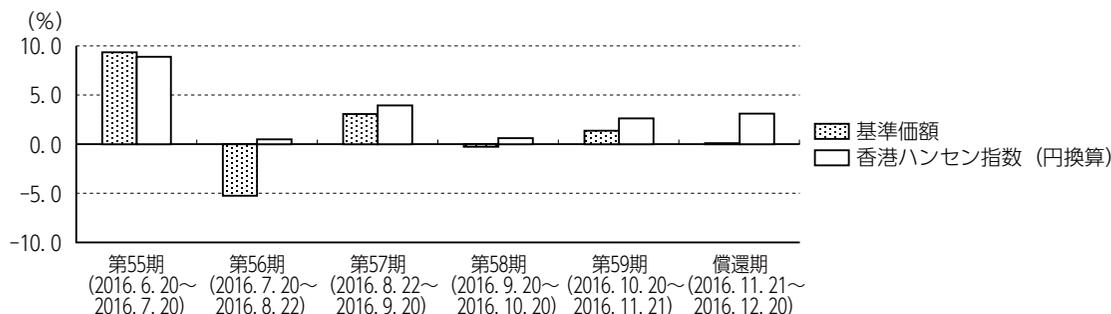
### ○ダイワ・マネープール・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期間における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。参考指数には、香港ハンセン指数（円換算）を掲載しています。



## 分配金について

1万口当り、第3期～第59期各20円の収益分配を行ないました。なお、第1期～第2期は分配方針通り、収益分配を行ないませんでした。

また、第55期～第59期の分配原資の内訳および決定根拠「収益分配金の計算過程（1万口当り）」は下記の通りです。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年6月21日 ～2016年7月20日	2016年7月21日 ～2016年8月22日	2016年8月23日 ～2016年9月20日	2016年9月21日 ～2016年10月20日	2016年10月21日 ～2016年11月21日
当期分配金（税込み）（円）	20	20	20	20	20
対基準価額比率（％）	0.16	0.17	0.16	0.16	0.16
当期の収益（円）	20	20	20	17	20
当期の収益以外（円）	—	—	—	2	—
翌期繰越分配対象額（円）	10,146	9,453	10,155	10,102	10,161

（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	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	36.15円	20.19円	32.63円	17.72円	29.49円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	9,578.92	8,885.70	9,575.64	9,524.65	9,573.77
(d) 分配準備積立金	551.49	567.46	567.57	580.14	577.79
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	10,166.57	9,473.36	10,175.85	10,122.52	10,181.06
(f) 分配金	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	10,146.57	9,453.36	10,155.85	10,102.52	10,161.06

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～償還期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 21～2016. 12. 20)		
	金 額	比 率	
信託報酬	76円	0.611%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は12,376円です。</b>
(投信会社)	(30)	(0.243)	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)	(44)	(0.352)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(2)	(0.016)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	76	0.611	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	4.254	508	408.662	50,288

(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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネープール・マザーファンド	—	—	9	9

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

第55期～償還期							
買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
				HONG KONG HANG SENG INDEX FUND HKD CLASS (ケイマン諸島)	408.662	50,288	123

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～償還期）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

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年12月20日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	22,739	100.0
投資信託財産総額	22,739	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

種類	第54期末
	□数
	千□
ダイワ・マネープール・マザーファンド	9

(注) 単位未満は切捨て。

# 香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）香港ドルコース

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年7月20日)、(2016年8月22日)、(2016年9月20日)、(2016年10月20日)、(2016年11月21日)、(2016年12月20日) 現在

項目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	償還時
<b>(A) 資産</b>	<b>48,740,226円</b>	<b>51,512,032円</b>	<b>38,887,153円</b>	<b>35,056,681円</b>	<b>22,751,481円</b>	<b>22,739,630円</b>
コール・ローン等	658,086	497,414	9,325,981	374,143	339,310	22,739,630
投資信託受益証券（評価額）	47,832,870	38,405,347	29,551,901	22,073,268	22,402,900	—
ダイワ・マネーパル・マザーファンド（評価額）	9,271	9,271	9,271	9,271	9,271	—
未収入金	239,999	12,600,000	—	12,599,999	—	—
<b>(B) 負債</b>	<b>579,609</b>	<b>12,609,906</b>	<b>8,650,224</b>	<b>12,637,900</b>	<b>60,187</b>	<b>22,808</b>
未払金	120,000	6,300,000	—	6,300,000	—	—
未払収益分配金	75,345	64,337	48,597	36,184	36,189	—
未払解約金	336,393	6,194,236	8,565,225	6,272,228	—	—
未払信託報酬	47,871	51,333	36,402	29,488	23,998	22,782
未払利息	—	—	—	—	—	26
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>48,160,617</b>	<b>38,902,126</b>	<b>30,236,929</b>	<b>22,418,781</b>	<b>22,691,294</b>	<b>22,716,822</b>
元本	37,672,970	32,168,946	24,298,689	18,092,103	18,094,601	18,097,061
次期繰越損益金	10,487,647	6,733,180	5,938,240	4,326,678	4,596,693	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	4,619,761
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>37,672,970口</b>	<b>32,168,946口</b>	<b>24,298,689口</b>	<b>18,092,103口</b>	<b>18,094,601口</b>	<b>18,097,061口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	12,784円	12,093円	12,444円	12,391円	12,540円	—
1万口当り償還価額（C/D）	—	—	—	—	—	12,552円77銭

\* 第54期末における元本額は40,324,970円、当作成期間（第55期～償還期）中における追加設定元本額は38,820円、同解約元本額は22,266,729円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は12,552円77銭です。

## ■損益の状況

第55期 自2016年6月21日 至2016年7月20日 第57期 自2016年8月23日 至2016年9月20日 第59期 自2016年10月21日 至2016年11月21日  
 第56期 自2016年7月21日 至2016年8月22日 第58期 自2016年9月21日 至2016年10月20日 償還期 自2016年11月22日 至2016年12月20日

項目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	償還期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>137,784円</b>	<b>116,298円</b>	<b>82,508円</b>	<b>61,562円</b>	<b>57,559円</b>	<b>△ 749円</b>
受取配当金	137,804	116,301	82,526	61,582	57,587	—
受取利息	—	—	—	1	—	—
支払利息	△ 20	△ 3	△ 18	△ 21	△ 28	△ 749
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>4,033,307</b>	<b>△ 2,222,871</b>	<b>854,825</b>	<b>△ 90,670</b>	<b>272,046</b>	<b>45,975</b>
売買益	4,139,666	284,662	1,011,093	38,277	272,047	45,975
売買損	△ 106,359	△ 2,507,533	△ 156,268	△ 128,947	△ 1	—
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 47,871</b>	<b>△ 51,333</b>	<b>△ 36,402</b>	<b>△ 29,488</b>	<b>△ 23,998</b>	<b>△ 22,782</b>
<b>(D) 当期繰越損益金（A+B+C）</b>	<b>4,123,220</b>	<b>△ 2,157,906</b>	<b>900,931</b>	<b>△ 58,596</b>	<b>305,607</b>	<b>22,444</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 29,646,884</b>	<b>△ 21,851,837</b>	<b>△ 18,181,649</b>	<b>△ 12,901,307</b>	<b>△ 12,996,087</b>	<b>△ 12,726,669</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>36,086,656</b>	<b>30,807,260</b>	<b>23,267,555</b>	<b>17,322,765</b>	<b>17,323,362</b>	<b>17,323,986</b>
（配当等相当額）	（ 24,253,464）	（ 20,710,682）	（ 15,644,017）	（ 11,648,259）	（ 11,650,011）	（ 11,651,739）
（売買損益相当額）	（ 11,833,192）	（ 10,096,578）	（ 7,623,538）	（ 5,674,506）	（ 5,673,351）	（ 5,672,247）
<b>(G) 合計（D+E+F）</b>	<b>10,562,992</b>	<b>6,797,517</b>	<b>5,986,837</b>	<b>4,362,862</b>	<b>4,632,882</b>	<b>4,619,761</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 75,345</b>	<b>△ 64,337</b>	<b>△ 48,597</b>	<b>△ 36,184</b>	<b>△ 36,189</b>	<b>—</b>
次期繰越損益金（G+H）	10,487,647	6,733,180	5,938,240	4,326,678	4,596,693	—
追加信託差損益金	36,086,656	30,807,260	23,267,555	17,322,765	17,323,362	—
（配当等相当額）	（ 24,253,464）	（ 20,710,682）	（ 15,644,017）	（ 11,648,259）	（ 11,650,011）	（ —）
（売買損益相当額）	（ 11,833,192）	（ 10,096,578）	（ 7,623,538）	（ 5,674,506）	（ 5,673,351）	（ —）
分配準備積立金	2,138,502	1,826,098	1,409,846	1,045,491	1,062,671	—
繰越損益金	△ 27,737,511	△ 25,900,178	△ 18,739,161	△ 14,041,578	△ 13,789,340	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	4,619,761

(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ひ、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62ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	136,204円	64,965円	79,305円	32,074円	53,369円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	36,086,656	28,584,389	23,267,555	17,232,095	17,323,362
(d) 分配準備積立金	2,077,643	1,825,470	1,379,138	1,049,601	1,045,491
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	38,300,503	30,474,824	24,725,998	18,313,770	18,422,222
(f) 分配金	75,345	64,337	48,597	36,184	36,189
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	38,225,158	30,410,487	24,677,401	18,277,586	18,386,033
(h) 受益権総口数	37,672,970口	32,168,946口	24,298,689口	18,092,103口	18,094,601口

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年12月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年12月20日		資産総額	22,739,630円
区分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	22,808円
				純資産総額	22,716,822円
受益権口数	19,531,897口	18,097,061口	△1,434,836口	受益権口数	18,097,061口
元本額	19,531,897円	18,097,061円	△1,434,836円	1単位当り償還金	12,552円77銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第1期	19,531,897	20,787,573	10,643	—	—
第2期	10,697,863	12,312,183	11,509	—	—
第3期	9,175,644	10,840,563	11,814	20	0.20
第4期	9,540,051	10,938,110	11,465	20	0.20
第5期	9,554,571	9,544,768	9,990	20	0.20
第6期	9,572,803	9,816,422	10,254	20	0.20
第7期	10,359,490	10,580,925	10,214	20	0.20
第8期	10,377,247	10,962,506	10,564	20	0.20
第9期	6,525,744	6,986,504	10,706	20	0.20
第10期	4,511,244	5,028,096	11,146	20	0.20
第11期	5,041,210	5,639,956	11,188	20	0.20
第12期	3,508,343	4,285,225	12,214	20	0.20
第13期	10,569,160	14,051,703	13,295	20	0.20
第14期	8,193,196	11,037,709	13,472	20	0.20
第15期	8,462,572	11,059,194	13,068	20	0.20
第16期	18,769,279	25,518,924	13,596	20	0.20
第17期	7,597,370	11,096,365	14,606	20	0.20
第18期	6,207,512	7,885,980	12,704	20	0.20
第19期	6,210,950	8,431,126	13,575	20	0.20
第20期	6,213,990	8,614,032	13,862	20	0.20

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）香港ドルコース

毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第21期	3,865,881	5,690,148	14,719	20	0.20
第22期	3,867,197	5,525,417	14,288	20	0.20
第23期	3,868,554	5,733,830	14,822	20	0.20
第24期	112,151,185	168,284,705	15,005	20	0.20
第25期	134,041,157	202,200,907	15,085	20	0.20
第26期	142,894,317	206,564,768	14,456	20	0.20
第27期	141,821,682	193,582,725	13,650	20	0.20
第28期	139,637,625	201,977,257	14,464	20	0.20
第29期	139,726,099	199,786,457	14,298	20	0.20
第30期	39,856,464	58,924,127	14,784	20	0.20
第31期	12,381,646	18,447,552	14,899	20	0.20
第32期	2,625,340	4,222,893	16,085	20	0.20
第33期	8,145,413	13,463,340	16,529	20	0.20
第34期	8,210,498	12,505,706	15,231	20	0.20
第35期	59,670,652	100,451,259	16,834	20	0.20
第36期	77,978,608	131,454,372	16,858	20	0.20
第37期	78,564,203	135,249,996	17,215	20	0.20
第38期	67,800,172	120,681,605	17,800	20	0.20
第39期	52,607,434	93,607,331	17,794	20	0.20
第40期	65,035,041	127,575,823	19,616	20	0.20
第41期	83,455,750	165,615,498	19,845	20	0.20
第42期	141,848,913	277,997,247	19,598	20	0.20
第43期	141,326,960	266,269,893	18,841	20	0.20
第44期	137,739,485	235,990,550	17,133	20	0.20
第45期	134,334,798	210,631,017	15,680	20	0.20
第46期	129,343,973	210,769,936	16,295	20	0.20
第47期	125,404,883	203,674,978	16,241	20	0.20
第48期	85,589,167	131,687,037	15,386	20	0.20
第49期	79,246,445	104,673,189	13,209	20	0.20
第50期	67,796,031	84,192,488	12,418	20	0.20
第51期	64,352,360	84,333,139	13,105	20	0.20
第52期	61,287,161	80,877,620	13,197	20	0.20
第53期	46,198,505	56,002,264	12,122	20	0.20
第54期	40,324,970	47,218,084	11,709	20	0.20
第55期	37,672,970	48,160,617	12,784	20	0.20
第56期	32,168,946	38,902,126	12,093	20	0.20
第57期	24,298,689	30,236,929	12,444	20	0.20
第58期	18,092,103	22,418,781	12,391	20	0.20
第59期	18,094,601	22,691,294	12,540	20	0.20

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金 (単 価)	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
		20円	20円	20円	20円
	(12,784円)	(12,093円)	(12,444円)	(12,391円)	(12,540円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	12,552円77銭

#### 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。

#### 償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

★日本円コース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		公社債 組入率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	騰落 中率	(参考指数)	騰落 中率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
31期末 (2014年7月22日)	11,439	20	1.4	12,554	0.9	0.6	98.4	5
32期末 (2014年8月20日)	12,182	20	6.7	13,486	7.4	0.3	98.6	6
33期末 (2014年9月22日)	11,738	20	△ 3.5	13,047	△ 3.3	0.1	98.7	6
34期末 (2014年10月20日)	11,040	20	△ 5.8	12,359	△ 5.3	0.1	98.8	5
35期末 (2014年11月20日)	11,244	20	2.0	12,547	1.5	0.1	99.4	13
36期末 (2014年12月22日)	11,025	20	△ 1.8	12,409	△ 1.1	0.0	99.4	17
37期末 (2015年1月20日)	11,415	20	3.7	12,743	2.7	0.0	99.4	18
38期末 (2015年2月20日)	11,636	20	2.1	13,330	4.6	0.0	98.8	18
39期末 (2015年3月20日)	11,446	20	△ 1.5	13,135	△ 1.5	0.1	99.3	18
40期末 (2015年4月20日)	12,709	20	11.2	14,844	13.0	0.1	89.6	34
41期末 (2015年5月20日)	12,692	20	0.0	14,866	0.1	0.0	99.2	37
42期末 (2015年6月22日)	12,339	20	△ 2.6	14,365	△ 3.4	0.1	99.1	34
43期末 (2015年7月21日)	11,762	20	△ 4.5	13,637	△ 5.1	0.1	99.3	32
44期末 (2015年8月20日)	10,664	20	△ 9.2	12,436	△ 8.8	0.2	99.2	27
45期末 (2015年9月24日)	10,137	20	△ 4.8	11,435	△ 8.0	0.2	99.1	26
46期末 (2015年10月20日)	10,562	20	4.4	12,387	8.3	0.3	98.7	15
47期末 (2015年11月20日)	10,238	20	△ 2.9	12,078	△ 2.5	0.1	99.1	6
48期末 (2015年12月21日)	9,792	20	△ 4.2	11,678	△ 3.3	0.1	99.4	5
49期末 (2016年1月20日)	8,737	20	△ 10.6	10,540	△ 9.7	0.1	99.2	5
50期末 (2016年2月22日)	8,538	20	△ 2.0	10,352	△ 1.8	0.1	99.3	5
51期末 (2016年3月22日)	9,083	20	6.6	11,103	7.3	—	99.3	5
52期末 (2016年4月20日)	9,311	20	2.7	11,507	3.6	—	99.5	5
53期末 (2016年5月20日)	8,498	20	△ 8.5	10,572	△ 8.1	—	99.3	5
54期末 (2016年6月20日)	8,631	20	1.8	10,827	2.4	—	99.1	5
55期末 (2016年7月20日)	9,238	20	7.3	11,634	7.5	—	99.1	5
56期末 (2016年8月22日)	9,271	20	0.6	12,313	5.8	—	99.4	5
57期末 (2016年9月20日)	9,322	20	0.8	12,642	2.7	—	99.4	5
58期末 (2016年10月20日)	9,186	20	△ 1.2	12,510	△ 1.0	—	98.2	4
59期末 (2016年11月21日)	8,755	20	△ 4.5	11,994	△ 4.1	—	98.4	4
償還 (2016年12月20日)	8,763.58	—	0.1	11,720	△ 2.3	—	—	4

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 香港ハンセン指数（香港ドルベース）は、同指数の原データをもとに、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。

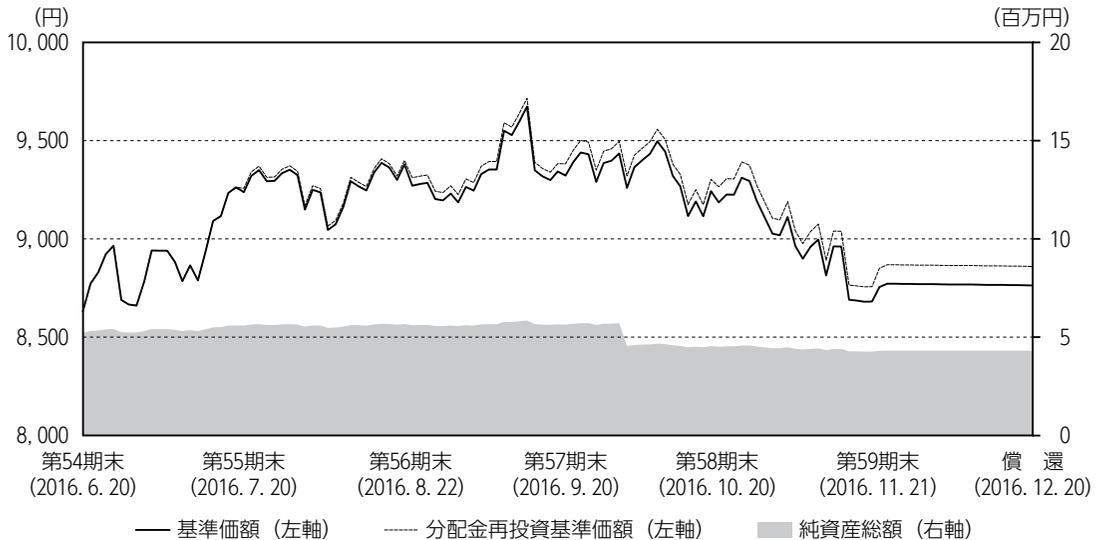
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 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5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

## ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：8,763円58銭（既払分配金1,140円）

騰落率：△2.4%（分配金再投資ベース）

## ■基準価額の主な変動要因

外国籍投資信託を通じて香港ハンセン指数にほぼ100%投資した結果、香港株式市況の上昇および配当金収入がプラスに寄与しましたが、一方、為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）および運用管理費用等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「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）日本円コース

	年 月 日	基 準 価 額		香港ハンセン指数 (香港ドルベース)		公 社 債 入 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第55期	(期首) 2016年 6月20日	円	%	10,827	%	%	%
	6月末	8,631	—	10,970	—	—	99.1
	(期末) 2016年 7月20日	8,784	1.8	11,634	1.3	—	99.1
第56期	(期首) 2016年 7月20日	9,258	7.3	11,634	7.5	—	99.1
	7月末	9,238	—	11,903	—	—	99.1
	(期末) 2016年 8月22日	9,324	0.9	12,313	2.3	—	99.1
第57期	(期首) 2016年 8月22日	9,291	0.6	12,313	5.8	—	99.4
	8月末	9,271	—	12,355	—	—	99.4
	(期末) 2016年 9月20日	9,265	△ 0.1	12,642	0.3	—	99.4
第58期	(期首) 2016年 9月20日	9,342	0.8	12,642	2.7	—	99.4
	9月末	9,322	—	12,743	—	—	99.4
	(期末) 2016年10月20日	9,435	1.2	12,510	0.8	—	79.6
第59期	(期首) 2016年10月20日	9,206	△ 1.2	12,510	△ 1.0	—	98.2
	10月末	9,186	—	12,322	—	—	98.2
	(期末) 2016年11月21日	9,027	△ 1.7	11,994	△ 1.5	—	98.2
償還期	(期首) 2016年11月21日	8,775	△ 4.5	11,994	△ 4.1	—	98.4
	11月末	8,755	—	12,205	—	—	98.4
	(償還) 2016年12月20日	8,770	0.2	11,720	1.8	—	—
	(償還) 2016年12月20日	8,763.58	0.1		△ 2.3	—	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

### ○香港株式市況

香港株式市況は、設定時より、中国の景気刺激策および追加財政支出への期待や、米国経済および先進国の株式市況の堅調な推移などを好感しておおむね上昇基調で推移しました。しかし2015年後半からは、米国の利上げ懸念や新興国経済の不調などから下落基調となりました。2016年3月以降は、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利するなど不安定な局面はありましたが、深セン－香港株式コネクト（相互株式投資制度）の開始期待などによりおおむね上昇基調になりました。10月からは、中国の不動産投資規制や資源価格の先行き不透明感などから、軟調な推移で償還を迎えました。

### ○短期金利市況

日銀は、設定時より、基金による資産買い入れの増額等の追加金融緩和策を決定するなど、金融緩和政策の強化により約0.1%の政策金利を維持しましたが、2013年4月初旬に決定された「量的・質的金融緩和政策」によりマイナス金利を導入すると、2014年10月にマイナス金利幅を拡大しました。

一方、香港では、設定時より、政策金利を米国の金融政策に合わせるため0.50%に維持しましたが、米国の利上げに合わせて、2015年12月に0.75%に、2016年12月に1.00%に引き上げました。

## 信託期間中の運用方針

### ○当ファンド

「ダイワ・グローバル・トラスト－香港ハンセン指数ファンド（日本円クラス）」（以下「香港ハンセン指数ファンド（日本円クラス）」といいます。）と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（日本円クラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないます。

### ○香港ハンセン指数ファンド（日本円クラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／日本円買いの為替ヘッジを行ないます。

### ○ダイワ・マネープール・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・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないます。

## 信託期間中のポートフォリオについて

### ○当ファンド

外国籍投資信託「香港ハンセン指数ファンド（日本円クラス）」と「ダイワ・マネープール・マザーファンド」に投資を行ない、通常の状態、香港ハンセン指数ファンド（日本円クラス）への投資割合を高位に維持することで、信託財産の成長をめざした運用を行ないました。

なお、満期償還に備えるため、2016年11月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株式および為替等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

### ○香港ハンセン指数ファンド（日本円クラス）

主として、香港証券取引所上場の株式に投資し、香港ハンセン指数の値動きをおおむね捉えることを目標に運用を行なうとともに、香港ドル建資産について、香港ドル売り／日本円買いの為替ヘッジを行ないました。

株式（株式先物取引を含む。）の組入比率は、通常の状態でも高位を維持しました。

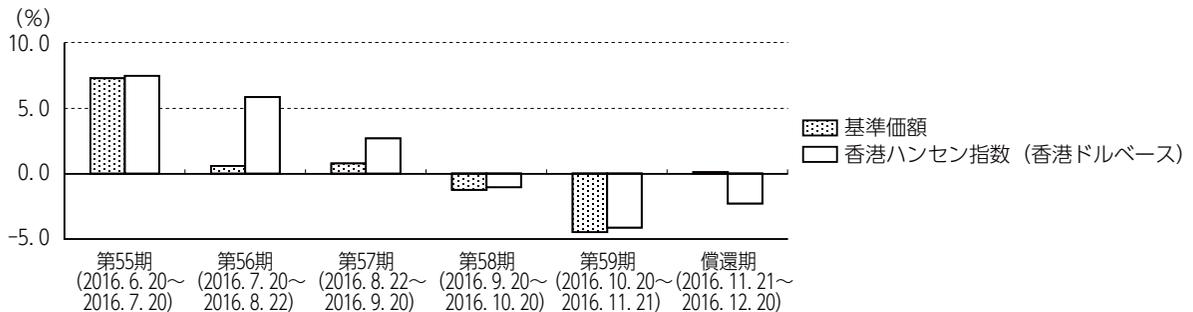
### ○ダイワ・マネープール・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期間における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。参考指数には、香港ハンセン指数（香港ドルベース）を掲載しています。



## 分配金について

1万口当り、第3期～第59期各20円の収益分配を行ないました。なお、第1期～第2期は分配方針通り、収益分配を行ないませんでした。

また、第55期～第59期の分配原資の内訳および決定根拠「収益分配金の計算過程（1万口当り）」は下記の通りです。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2016年6月21日 ～2016年7月20日	2016年7月21日 ～2016年8月22日	2016年8月23日 ～2016年9月20日	2016年9月21日 ～2016年10月20日	2016年10月21日 ～2016年11月21日
当期分配金（税込み）（円）	20	20	20	20	20
対基準価額比率（％）	0.22	0.22	0.21	0.22	0.23
当期の収益（円）	20	19	20	11	12
当期の収益以外（円）	—	0	—	8	7
翌期繰越分配対象額（円）	3,125	3,125	3,126	3,118	3,110

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売却等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	23.12円	19.63円	20.81円	11.84円	12.61円
(b) 経費控除後の有価証券売却等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	2,590.53	2,590.62	2,590.70	2,590.77	2,590.87
(d) 分配準備積立金	532.10	535.14	534.69	535.42	527.17
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	3,145.76	3,145.39	3,146.21	3,138.05	3,130.66
(f) 分配金	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	3,125.76	3,125.39	3,126.21	3,118.05	3,110.66

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～償還期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 21～2016. 12. 20)		
	金 額	比 率	
信託報酬	56円	0.611%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は9,103円です。</b>
（投信会社）	(22)	(0.243)	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）	(32)	(0.352)	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)	(0.016)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	56	0.611	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
外国（邦貨建）	千□ 0.695	千円 64	千□ 59.817	千円 5,417

(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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

決算期	第55期～償還期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
ダイワ・マネープール・マザーファンド	千□ —	千円 —	千□ 1	千円 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

(2016年6月21日から2016年12月20日まで)

第55期～償還期							
買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
				HONG KONG HANG SENG INDEX FUND JPY CLASS (ケイマン諸島)	59.817	5,417	90

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～償還期）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

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年12月20日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
コール・ローン等、その他	千円 4,317	% 100.0
投資信託財産総額	4,317	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

種類	第54期末
	□数
ダイワ・マネープール・マザーファンド	千□ 1

(注) 単位未満は切捨て。

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）日本円コース

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2016年7月20日)、(2016年8月22日)、(2016年9月20日)、(2016年10月20日)、(2016年11月21日)、(2016年12月20日)現在

項目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	償還時
<b>(A)資産</b>	<b>5,627,082円</b>	<b>5,628,580円</b>	<b>5,679,322円</b>	<b>4,533,575円</b>	<b>4,322,192円</b>	<b>4,317,076円</b>
コール・ローン等	46,673	50,030	32,612	95,932	81,893	4,317,076
投資信託受益証券（評価額）	5,538,977	5,577,117	5,605,278	4,436,210	4,238,866	—
ダイワ・マネーパル・マザーファンド（評価額）	1,433	1,433	1,433	1,433	1,433	—
未収入金	39,999	—	39,999	—	—	—
<b>(B)負債</b>	<b>37,503</b>	<b>18,279</b>	<b>37,579</b>	<b>14,904</b>	<b>14,559</b>	<b>4,325</b>
未払金	20,000	—	20,000	—	—	—
未払収益分配金	12,101	12,102	12,104	9,838	9,840	—
未払信託報酬	5,402	6,177	5,475	5,066	4,719	4,320
未払利息	—	—	—	—	—	5
<b>(C)純資産総額（A－B）</b>	<b>5,589,579</b>	<b>5,610,301</b>	<b>5,641,743</b>	<b>4,518,671</b>	<b>4,307,633</b>	<b>4,312,751</b>
元本	6,050,537	6,051,468	6,052,397	4,919,287	4,920,229	4,921,219
次期繰越損益金	△ 460,958	△ 441,167	△ 410,654	△ 400,616	△ 612,596	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 608,468
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>6,050,537口</b>	<b>6,051,468口</b>	<b>6,052,397口</b>	<b>4,919,287口</b>	<b>4,920,229口</b>	<b>4,921,219口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	9,238円	9,271円	9,322円	9,186円	8,755円	—
1万口当り償還価額（C/D）	—	—	—	—	—	8,763円58銭

\* 第54期末における元本額は6,049,543円、当作成期間（第55期～償還期）中における追加設定元本額は5,712円、同解約元本額は1,134,036円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は8,763円58銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は608,468円です。

■損益の状況

第55期 自2016年6月21日 至2016年7月20日    第57期 自2016年8月23日 至2016年9月20日    第59期 自2016年10月21日 至2016年11月21日  
 第56期 自2016年7月21日 至2016年8月22日    第58期 自2016年9月21日 至2016年10月20日    償還期 自2016年11月22日 至2016年12月20日

項目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	償還期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>14,189円</b>	<b>14,176円</b>	<b>14,213円</b>	<b>10,895円</b>	<b>10,924円</b>	<b>△ 136円</b>
受取配当金	14,189	14,176	14,213	10,897	10,924	—
支払利息	—	—	—	△ 2	—	△ 136
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>370,434</b>	<b>23,965</b>	<b>33,947</b>	<b>62,835</b>	<b>△ 208,268</b>	<b>8,708</b>
売買益	370,436	23,965	33,947	11,750	—	8,708
売買損	△ 2	—	—	△ 74,585	△ 208,268	—
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 5,402</b>	<b>△ 6,177</b>	<b>△ 5,475</b>	<b>△ 5,066</b>	<b>△ 4,719</b>	<b>△ 4,320</b>
<b>(D)当期損益金（A+B+C）</b>	<b>379,221</b>	<b>31,964</b>	<b>42,685</b>	<b>△ 57,006</b>	<b>△ 202,063</b>	<b>4,252</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>△ 2,115,904</b>	<b>△ 1,748,784</b>	<b>△ 1,728,922</b>	<b>△ 1,380,167</b>	<b>△ 1,447,011</b>	<b>△ 1,658,914</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>1,287,826</b>	<b>1,287,755</b>	<b>1,287,687</b>	<b>1,046,395</b>	<b>1,046,318</b>	<b>1,046,194</b>
(配当等相当額)	( 1,567,415)	( 1,567,706)	( 1,567,997)	( 1,274,478)	( 1,274,771)	( 1,275,078)
(売買損益相当額)	(△ 279,589)	(△ 279,951)	(△ 280,310)	(△ 228,083)	(△ 228,453)	(△ 228,884)
<b>(G)合計（D+E+F）</b>	<b>△ 448,857</b>	<b>△ 429,065</b>	<b>△ 398,550</b>	<b>△ 390,778</b>	<b>△ 602,756</b>	<b>△ 608,468</b>
<b>(H)収益分配金</b>	<b>△ 12,101</b>	<b>△ 12,102</b>	<b>△ 12,104</b>	<b>△ 9,838</b>	<b>△ 9,840</b>	<b>—</b>
<b>次期繰越損益金（G+H）</b>	<b>△ 460,958</b>	<b>△ 441,167</b>	<b>△ 410,654</b>	<b>△ 400,616</b>	<b>△ 612,596</b>	<b>—</b>
追加信託差損益金	1,287,826	1,287,755	1,287,687	1,046,395	1,046,318	—
(配当等相当額)	( 1,567,415)	( 1,567,706)	( 1,567,997)	( 1,274,478)	( 1,274,771)	( — )
(売買損益相当額)	(△ 279,589)	(△ 279,951)	(△ 280,310)	(△ 228,083)	(△ 228,453)	( — )
分配準備積立金	323,841	323,619	324,112	259,383	255,748	—
繰越損益金	△ 2,072,625	△ 2,052,541	△ 2,022,453	△ 1,706,394	△ 1,914,662	—
<b>償還差損益金</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>△ 608,468</b>

(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74ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

## ■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
(a) 経費控除後の配当等収益	13,990円	11,880円	12,597円	5,829円	6,205円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	1,567,415	1,567,706	1,567,997	1,274,478	1,274,771
(d) 分配準備積立金	321,952	323,841	323,619	263,392	259,383
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,903,357	1,903,427	1,904,213	1,543,699	1,540,359
(f) 分配金	12,101	12,102	12,104	9,838	9,840
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,891,256	1,891,325	1,892,109	1,533,861	1,530,519
(h) 受益権総口数	6,050,537口	6,051,468口	6,052,397口	4,919,287口	4,920,229口

## 投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年12月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年12月20日		資産総額	4,317,076円
区 分	投資信託 契約締結当初	投資信託 契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	4,325円
				純資産総額	4,312,751円
受益権口数	81,429,150口	4,921,219口	△76,507,931口	受益権口数	4,921,219口
元 本 額	81,429,150円	4,921,219円	△76,507,931円	1 単 位 当 り 償 還 金	8,763円58銭
毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第1期	80,178,640	86,129,690	10,742	—	—
第2期	45,351,771	51,903,398	11,445	—	—
第3期	58,489,061	65,702,569	11,233	20	0.20
第4期	52,116,569	58,001,601	11,129	20	0.20
第5期	51,704,618	51,576,111	9,975	20	0.20
第6期	51,807,421	53,131,094	10,255	20	0.20
第7期	48,394,561	49,684,542	10,267	20	0.20
第8期	39,662,762	41,654,059	10,502	20	0.20
第9期	15,965,330	17,255,827	10,808	20	0.20
第10期	14,263,950	15,819,870	11,091	20	0.20
第11期	14,286,400	15,569,226	10,898	20	0.20
第12期	23,240,362	26,781,580	11,524	20	0.20
第13期	13,983,496	16,620,517	11,886	20	0.20
第14期	14,004,641	16,221,618	11,583	20	0.20
第15期	14,026,374	15,433,627	11,003	20	0.20
第16期	29,652,019	32,338,992	10,906	20	0.20
第17期	29,687,411	33,870,212	11,409	20	0.20
第18期	29,718,678	31,309,901	10,535	20	0.20
第19期	29,755,439	31,703,565	10,655	20	0.20
第20期	29,791,855	33,185,641	11,139	20	0.20

香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）日本円コース

毎 計 算 期 末 の 状 況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第21期	20,733,093	24,158,872	11,652	20	0.20
第22期	10,778,880	12,402,725	11,507	20	0.20
第23期	6,401,744	7,456,449	11,648	20	0.20
第24期	10,967,463	12,300,694	11,216	20	0.20
第25期	24,042,882	27,226,672	11,324	20	0.20
第26期	24,068,500	26,594,451	11,049	20	0.20
第27期	23,227,470	24,425,309	10,516	20	0.20
第28期	23,260,207	25,653,975	11,029	20	0.20
第29期	23,291,477	25,638,261	11,008	20	0.20
第30期	18,330,776	20,716,325	11,301	20	0.20
第31期	5,156,078	5,898,265	11,439	20	0.20
第32期	5,120,265	6,237,307	12,182	20	0.20
第33期	5,126,967	6,017,990	11,738	20	0.20
第34期	5,133,931	5,667,626	11,040	20	0.20
第35期	11,621,544	13,066,873	11,244	20	0.20
第36期	15,892,685	17,521,039	11,025	20	0.20
第37期	16,076,666	18,351,256	11,415	20	0.20
第38期	16,087,279	18,719,936	11,636	20	0.20
第39期	16,297,455	18,653,530	11,446	20	0.20
第40期	27,133,731	34,482,977	12,709	20	0.20
第41期	29,822,901	37,852,039	12,692	20	0.20
第42期	27,837,430	34,347,468	12,339	20	0.20
第43期	27,844,742	32,750,023	11,762	20	0.20
第44期	25,868,178	27,585,809	10,664	20	0.20
第45期	25,876,677	26,230,037	10,137	20	0.20
第46期	15,072,095	15,919,893	10,562	20	0.20
第47期	6,043,026	6,186,617	10,238	20	0.20
第48期	6,043,850	5,918,072	9,792	20	0.20
第49期	6,044,714	5,281,097	8,737	20	0.20
第50期	6,045,684	5,161,905	8,538	20	0.20
第51期	6,046,680	5,492,498	9,083	20	0.20
第52期	6,047,619	5,630,896	9,311	20	0.20
第53期	6,048,536	5,139,839	8,498	20	0.20
第54期	6,049,543	5,221,602	8,631	20	0.20
第55期	6,050,537	5,589,579	9,238	20	0.20
第56期	6,051,468	5,610,301	9,271	20	0.20
第57期	6,052,397	5,641,743	9,322	20	0.20
第58期	4,919,287	4,518,671	9,186	20	0.20
第59期	4,920,229	4,307,633	8,755	20	0.20

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	20円	20円	20円	20円	20円
(単 価)	(9,238円)	(9,271円)	(9,322円)	(9,186円)	(8,755円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	8,763円58銭

#### 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。

#### 償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

## 香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）

### ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド ブラジルリアルクラス／豪ドルクラス／南アフリカランドクラス／ 資源国通貨クラス／香港ドルクラス／日本円クラス

当ファンド（香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型））は、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド ブラジルリアルクラス／豪ドルクラス／南アフリカランドクラス／資源国通貨クラス／香港ドルクラス／日本円クラス」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。

（注）2016年12月20日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（香港ドル建て）

#### 貸借対照表 2016年5月31日

##### 資産

投資資産の公正価値（簿価15,651,830ドル）	ドル	13,506,641
現金		6
外国為替先渡契約による評価益		2,830
未収配当金		57,090
金融デリバティブ商品の未収追加証拠金		1,044,905
その他資産		45
<b>資産合計</b>		<b>14,611,517</b>

##### 負債

外国為替先渡契約による評価損		90,991
未払：		
専門家報酬		364,034
保管会社報酬		226,562
会計および管理会社報酬		144,009
受託会社報酬		32,119
名義書換代理人報酬		10,591
投資運用会社報酬		3,598
為替ヘッジ提供報酬		443
<b>負債合計</b>		<b>872,347</b>

##### 純資産

ドル	13,739,170
----	------------

クラス A - ブラジルリアルクラス	ドル	6,964,010
クラス B - 豪ドルクラス		940,105
クラス C - 南アフリカランドクラス		917,970
クラス D - 資源国通貨クラス		462,614
クラス E - 香港ドルクラス		4,078,239
クラス F - 日本円クラス		376,232
	ドル	<b>13,739,170</b>

**発行済み受益証券**

クラス A - ブラジルリアルクラス		1,579,020
クラス B - 豪ドルクラス		149,350
クラス C - 南アフリカランドクラス		199,875
クラス D - 資源国通貨クラス		91,008
クラス E - 香港ドルクラス		457,198
クラス F - 日本円クラス		59,304

**受益証券 1 口当り純資産**

クラス A - ブラジルリアルクラス	ドル	4.410
クラス B - 豪ドルクラス	ドル	6.295
クラス C - 南アフリカランドクラス	ドル	4.593
クラス D - 資源国通貨クラス	ドル	5.083
クラス E - 香港ドルクラス	ドル	8.920
クラス F - 日本円クラス	ドル	6.344

損益計算書

2016年5月31日に終了した年度

投資収益

受取利息	ドル	375
配当収益（源泉税42,679ドル控除後）		830,788
<b>投資収益合計</b>		<b>831,163</b>

費用

保管会社報酬		464,632
専門家報酬		395,297
会計および管理会社報酬		383,272
投資運用会社報酬		88,362
受託会社報酬		82,295
名義書換代理人報酬		47,832
登録料		4,185
為替ヘッジ提供報酬		1,246
<b>費用合計</b>		<b>1,467,121</b>

**投資純損失 (635,958)**

実現利益（損失）および評価益（損）：

実現利益（損失）：

証券投資		(1,357,771)
先物取引		(4,330,985)
外国為替取引および外国為替先渡契約		(3,505,867)
<b>純実現損失</b>		<b>(9,194,623)</b>

評価益（損）の純変動：

証券投資		(6,041,727)
先物取引		285,500
外国為替換算および外国為替先渡契約		1,622,817
<b>評価損の純変動</b>		<b>(4,133,410)</b>

**純実現・純評価損 (13,328,033)**

運用による純資産の純減 **ドル (13,963,991)**

(香港ドル建て)

**投資明細表**  
2016年5月31日

株数	証券の明細	公正価値	株数	証券の明細	公正価値
	<b>普通株 (90.8%)</b>			<b>インターネット (10.3%)</b>	
	<b>中国 (36.9%)</b>		8,200	Tencent Holdings, Ltd.	1,415,320
	<b>銀行 (13.6%)</b>			<b>石油・ガス (5.5%)</b>	
146,000	Bank of China, Ltd. Class H	ドル 461,360	46,000	China Petroleum & Chemical Corp. Class H	242,880
16,000	Bank of Communications Co., Ltd. Class H	76,800	33,000	CNOOC, Ltd.	305,910
155,000	China Construction Bank Corp. Class H	773,450	38,000	PetroChina Co., Ltd. Class H	202,540
135,000	Industrial & Commercial Bank of China, Ltd. Class H	556,200			751,330
		1,867,810		<b>小売 (0.4%)</b>	
	<b>石炭 (0.5%)</b>		12,000	Belle International Holdings, Ltd.	55,080
6,000	China Shenhua Energy Co., Ltd. Class H	73,920		<b>中国合計 (簿価6,030,948ドル)</b>	<b>5,073,165</b>
	<b>コンピューター (0.5%)</b>			<b>香港 (43.9%)</b>	
14,000	Lenovo Group, Ltd.	66,640		<b>航空 (0.2%)</b>	
	<b>食品 (1.2%)</b>		2,000	Cathay Pacific Airways, Ltd.	24,240
5,000	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	64,800		<b>銀行 (4.1%)</b>	
4,000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	28,600	2,600	Bank of East Asia, Ltd.	75,270
13,000	Want Want China Holdings, Ltd.	71,370	6,500	BOC Hong Kong Holdings, Ltd.	155,350
		164,770	13,000	CITIC, Ltd.	146,380
	<b>ヘルスケア製品 (0.7%)</b>		1,400	Hang Seng Bank, Ltd.	192,640
1,500	Hengan International Group Co., Ltd.	104,850			569,640
	<b>保険 (4.2%)</b>			<b>流通 / 卸売 (0.3%)</b>	
14,000	China Life Insurance Co., Ltd. Class H	243,320	10,000	Li & Fung, Ltd.	39,500
9,500	Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. Class H	330,125	2,100	<b>総合金融サービス (2.8%)</b>	
		573,445		Hong Kong Exchanges and Clearing, Ltd.	389,970

## 香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型)

株数	証券の明細	公正価値	株数	証券の明細	公正価値
	<b>電力 (3.6%)</b>				
4,000	China Resources Power Holdings Co., Ltd.	48,960	4,000	Hang Lung Properties, Ltd.	59,200
3,500	CLP Holdings, Ltd.	256,200	2,000	Henderson Land Development Co., Ltd.	94,200
2,500	Power Assets Holdings, Ltd.	188,250	10,000	New World Development Co., Ltd.	73,200
		493,410	6,000	Sino Land Co., Ltd.	71,280
	<b>エンジニアリング・建設 (0.5%)</b>		3,000	Sun Hung Kai Properties, Ltd.	273,600
1,000	Cheung Kong Infrastructure Holdings, Ltd.	72,650		<b>不動産投資信託 (REIT) (1.4%)</b>	1,111,250
	<b>ガス (1.4%)</b>		4,000	Link REIT	190,600
13,000	Hong Kong & China Gas Co., Ltd.	193,700		<b>通信 (7.7%)</b>	
	<b>総合持株会社 (4.8%)</b>		11,000	China Mobile, Ltd.	975,700
2,000	China Merchants Holdings International Co., Ltd.	44,500	10,000	China Unicom Hong Kong, Ltd.	83,700
5,000	CK Hutchison Holdings Ltd.	450,250			1,059,400
1,000	Swire Pacific, Ltd. Class A	83,750		<b>運輸 (0.7%)</b>	
2,000	Wharf Holdings, Ltd.	83,900	2,500	MTR Corp., Ltd.	92,000
		662,400		<b>香港合計 (簿価6,591,306ドル)</b>	<b>6,030,720</b>
	<b>保険 (7.2%)</b>			<b>マカオ (0.9%)</b>	
21,800	AIA Group, Ltd.	989,720		<b>宿泊施設 (0.9%)</b>	
	<b>宿泊施設 (0.8%)</b>		4,400	Sands China, Ltd.	130,680
4,000	Galaxy Entertainment Group, Ltd.	104,200		<b>マカオ合計 (簿価203,686ドル)</b>	<b>130,680</b>
	<b>石油・ガス (0.3%)</b>			<b>英国 (9.1%)</b>	
6,000	Kunlun Energy Co., Ltd.	38,040		<b>銀行 (9.1%)</b>	
	<b>不動産 (8.1%)</b>		24,400	HSBC Holdings PLC	1,248,060
5,000	Cheung Kong Property Holdings, Ltd.	242,250		<b>英国合計 (簿価1,801,874ドル)</b>	<b>1,248,060</b>
8,000	China Overseas Land & Investment, Ltd.	186,400		<b>普通株合計 (簿価14,627,814ドル)</b>	<b>ドル 12,482,625</b>
6,000	China Resources Land, Ltd.	111,120			

元本	証券の明細	純資産に 占める割合	公正価値
	短期投資 (7.5%)		
	グランド・ケイマン (0.0%)		
	定期預金 (0.0%)		
	Brown Brothers Harriman & Co.		
JPY	4 -0.41% due 06/01/16		—
			—
	グランド・ケイマン合計 (簿価0ドル)		— (1)
	香港 (7.5%)		
	定期預金 (7.5%)		
	HSBC Bank		
HKD	1,024,016 0.01% due 06/01/16		1,024,016
			1,024,016
	香港合計 (簿価1,024,016ドル)		1,024,016
	短期投資合計 (簿価1,024,016ドル)		1,024,016
	投資総額 (簿価15,651,830ドル)	98.3%	ドル 13,506,641
	負債を超過する現金および その他の資産	1.7	232,529
	純資産	100.0%	ドル 13,739,170

(1) 1ドル未満

## 香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）

先物取引残高（2016年5月31日現在）

ポジション	明細	満期月	建玉	評価益
Long	Hang Seng Index Future	2016年6月	1	ドル 25,600

クラス A - ブラジルリアルクラスの為替先渡契約（2016年5月31日現在）

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益（損）	
BRL	Citibank N. A.	3,075,778	2016年6月29日	HKD	6,662,395	ドル	—	ドル (87,314)	ドル (87,314)

クラス B - 豪ドルクラスの為替先渡契約（2016年5月31日現在）

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益（損）	
AUD	Citibank N. A.	158,891	2016年6月29日	HKD	891,681	ドル 1,170	ドル	—	ドル 1,170

クラス C - 南アフリカランドクラスの為替先渡契約（2016年5月31日現在）

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益（損）	
ZAR	Citibank N. A.	1,764,125	2016年6月29日	HKD	864,555	ドル 1,251	ドル	—	ドル 1,251

クラス D - 資源国通貨クラスの為替先渡契約（2016年5月31日現在）

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益（損）	
AUD	Citibank N. A.	26,173	2016年6月29日	HKD	146,869	ドル 202	ドル	—	ドル 202
BRL	Citibank N. A.	67,135	2016年6月29日	HKD	145,401	—	(1,888)	(1,888)	
ZAR	Citibank N. A.	297,774	2016年6月29日	HKD	145,936	207	—	207	
						ドル 409	ドル (1,888)	ドル (1,479)	

クラス F - 日本円クラスの為替先渡契約（2016年5月31日現在）

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益（損）	
JPY	Citibank N. A.	5,259,852	2016年6月29日	HKD	370,441	ドル	—	ドル (1,789)	ドル (1,789)

通貨の略称：

- AUD - 豪ドル
- BRL - ブラジル・リアル
- HKD - 香港ドル
- JPY - 日本円
- ZAR - 南アフリカ・ランド

## 【注記】

ハンセン指数は、ハンセン・データ・サービス・リミテッドからライセンスを得たハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドにより算出および公表されています。ハンセン指数という商標および名称は、ハンセン・データ・サービス・リミテッドが独占的に所有しています。ハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドおよびハンセン・データ・サービス・リミテッドは、大和証券投資信託委託株式会社が「香港ハンセン指数ファンド（通貨選択型）」およびその投資対象ファンドである「ケイマン籍の外国投資信託ダイワ・グローバル・トラストー香港ハンセン指数ファンド」（以下、「本商品」）に関連してハンセン指数を使用することおよび参照することに同意していますが、ハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドおよびハンセン・データ・サービス・リミテッドは、本商品のブローカーもしくは保有者またはその他の者に対し、（i）ハンセン指数およびその算定またはそれに関連する情報の正確性または完全性、または（ii）ハンセン指数、ハンセン指数構成銘柄またはハンセン指数に含まれるデータの目的適合性もしくは適当性、または（iii）ハンセン指数、ハンセン指数構成銘柄またはハンセン指数に含まれるデータをいかなる目的のためであれ、ある者が使用したことにより結果を得ることにつき、保証、表明または確約するものではなく、ハンセン指数に関していかなる種類の保証、表明または確約を明示的にも黙示的にも行なうものではありません。

ハンセン指数の算定および編集の手順および基準ならびに関係する一または複数の計算式、構成銘柄および構成要素は、いつでもハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドにより通知なしに変更または修正されることがあります。適用法令により許容される範囲で、（i）本商品に関連して大和証券投資信託委託株式会社がハンセン指数を使用したことおよび／もしくは参照したことに関して、または（ii）ハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドによるハンセン指数の算定における不正確性、欠落、過誤もしくは誤謬に対し、または（iii）第三者から提供されるハンセン指数の算定に関連して使用される情報の不正確性、欠落、過誤、誤謬もしくは不完全性に対し、または（iv）上記のいずれかの結果、本商品のブローカーもしくは保有者または本商品を取扱うその他の者が直接または間接的に被る可能性のある経済的またはその他の損失に対し、ハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドまたはハンセン・データ・サービス・リミテッドは何らの責任または債務を負うものではなく、また、ブローカー、保有者または本商品を取扱うその他の者は、いかなる方法でも本商品に関連してハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドおよび／またはハンセン・データ・サービス・リミテッドに対して請求、訴訟または法的手続きを行なうことはできません。したがって、ブローカー、保有者または本商品を取扱うその他の者は、かかる免責条項を十分に認識した上で本商品を取扱うものとし、ハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドおよびハンセン・データ・サービス・リミテッドに依拠することはできません。誤解がないように付言すると、かかる免責条項により、ブローカー、保有者またはその他の者とハンセン・インデックシズ・カンパニー・リミテッドおよび／またはハンセン・データ・サービス・リミテッドとの間に契約上のまたは準契約上の関係が生じるものではなく、また、かかる関係が生じたと解してはなりません。

# ダイワ・マネープール・マザーファンド

## 運用報告書 繰上償還 (償還日 2016年12月19日)

(計算期間 2016年12月10日～2016年12月19日)

ダイワ・マネープール・マザーファンドの償還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した。

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

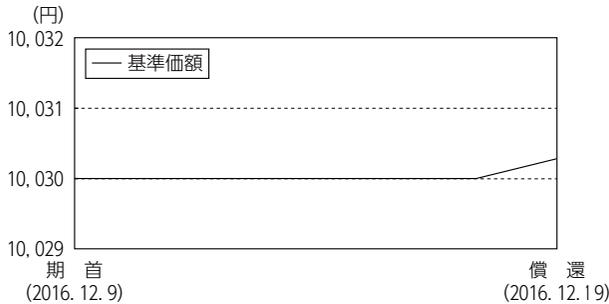
## 大和投資信託

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
	円	騰落率 %	
(期首) 2016年12月9日	10,030	—	—
(償還) 2016年12月19日	10,030.28	0.0	—

(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。

《設定以来の運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 償還時：10,030円28銭 騰落率：0.3%

【基準価額の主な変動要因】

利息収入などにより基準価額は上昇しました。

◆設定以来の投資環境について

○国内短期金融市場

国内短期金融市場においては、設定時に比べて短期金融資産の利回りは低下しました。日銀は、2013年に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・質的金融緩和を導入し、2016年1月にマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このように日銀が金融緩和姿勢を強める中、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、マイナス圏で推移する中で償還を迎えました。

◆信託期間中の運用方針

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います。

◆信託期間中の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。

■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

当期中における該当事項はありません。

■組入資産明細表

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年12月19日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
コール・ローン等、その他	千円 35	% 100.0
投資信託財産総額	35	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ダイワ・マネープール・マザーファンド

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年12月19日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	35,449円
コール・ローン等	35,449
(B) 負債	—
(C) 純資産総額 (A - B)	35,449
元本	35,342
償還差損益金	107
(D) 受益権総口数	35,342口
1万口当り償還価額 (C / D)	10,030円28銭

\* 期首における元本額は35,342円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

\* 償還時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、香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型) ブラジルリアルコース13,136円、香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型) 豪ドルコース6,080円、香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型) 南アフリカランドコース3,788円、香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型) 資源国通貨コース1,665円、香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型) 香港ドルコース9,244円、香港ハンセン指数ファンド (通貨選択型) 日本円コース1,429円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は10,030円28銭です。

### ■損益の状況

当期 自2016年12月10日 至2016年12月19日

項 目	当 期
(A) 前期繰越損益金	107円
(B) 合計 (A)	107
償還差損益金 (B)	107