

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	追加型投信／海外／株式
	ダイワ・アセアン内 需関連株ファンド・マ ネー・ポートフォリオ	追加型投信／国内／債券
信託期間	10年間（2012年2月17日～2022年2月16日）	
運用方針	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
	ダイワ・アセアン内 需関連株ファンド・マ ネー・ポートフォリオ	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないま す。
主 要 投資対象	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	イ. アセアン加盟国の金融商品取引所上場株式およ び店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を 含みます。） ロ. アセアン加盟国の企業のD R（預託証券）
	ダイワ・アセアン内 需関連株ファンド・マ ネー・ポートフォリオ	イ. ダイワ・マネーストック・マザーファンド（以下「マ ザーファンド」といいます。）の受益証券 ロ. 円建ての債券
運用方法	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	①主として、アセアン加盟国の株式（D R（預託証券） を含みます。以下同じ。）の中から、アセアン経済圏 の内需拡大の恩恵を受けると考えられる企業の株式 に投資することにより、信託財産の成長をめざしま す。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で 行なうことを基本とします。 イ. 時価総額や流動性およびアセアン経済圏の内 需との関連性等を勘案して投資対象銘柄を選定 します。 ロ. 投資対象銘柄について、ボトムアップ・アプロ ーチに基づいて個別企業の分析を行ない、次の銘 柄を組入候補銘柄として選定します。 i. 高い利益成長が期待できる銘柄 ii. 収益力等に対して株価が割安と判断される 銘柄 ハ. 株価バリュエーション、銘柄分散等を勘案し、 ポートフォリオを構築します。 ③外貨建資産の運用にあたっては、ダイワ・アセット・ マネジメント（シンガポール）リミテッドに運用の 指図にかかる権限の一部を委託します。 ④株式の組入比率は、通常の状態でも高位に維持す ることを基本とします。 ⑤為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原 則として行ないません。
	ダイワ・アセアン内 需関連株ファンド・マ ネー・ポートフォリオ	①マザーファンドの受益証券および円建ての債券を 中心に投資することにより、安定した収益の確保を めざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年 未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およ びコモディティ・ペーパーに投資することを基本とし ます。
組入制限	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	・株式組入上限比率は無制限
	ダイワ・アセアン内 需関連株ファンド・マ ネー・ポートフォリオ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の10%以下
分配方針		分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。） 等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定し ます。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないこと があります。

※ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオは、ファミリー
ファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資
金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファ
ンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド
ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・
マネー・ポートフォリオ

運用報告書(全体版)
第11期

(決算日 2017年8月16日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申
し上げます。

さて、「ダイワ・アセアン内需関連株ファ
ンド」および「ダイワ・アセアン内需関連株
ファンド・マネー・ポートフォリオ」は、こ
のたび、第11期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げ
ます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、
お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/> <4819>

<4820>

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC 東南アジア指数 (配当込み、円換算) (参考指数)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
7期末(2015年8月17日)	9,422	0	△ 13.4	15,159	△ 11.8	93.3	—	1.4	6,468
8期末(2016年2月16日)	8,285	0	△ 12.1	13,274	△ 12.4	93.1	—	3.1	5,026
9期末(2016年8月16日)	8,665	0	4.6	13,660	2.9	95.2	—	1.6	4,675
10期末(2017年2月16日)	9,482	0	9.4	14,835	8.6	96.8	—	—	4,462
11期末(2017年8月16日)	9,876	0	4.2	16,056	8.2	93.4	—	2.6	4,327

(注1) MSCI AC 東南アジア指数(配当込み、円換算)は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI AC 東南アジア指数(配当込み、米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCI AC 東南アジア指数(配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

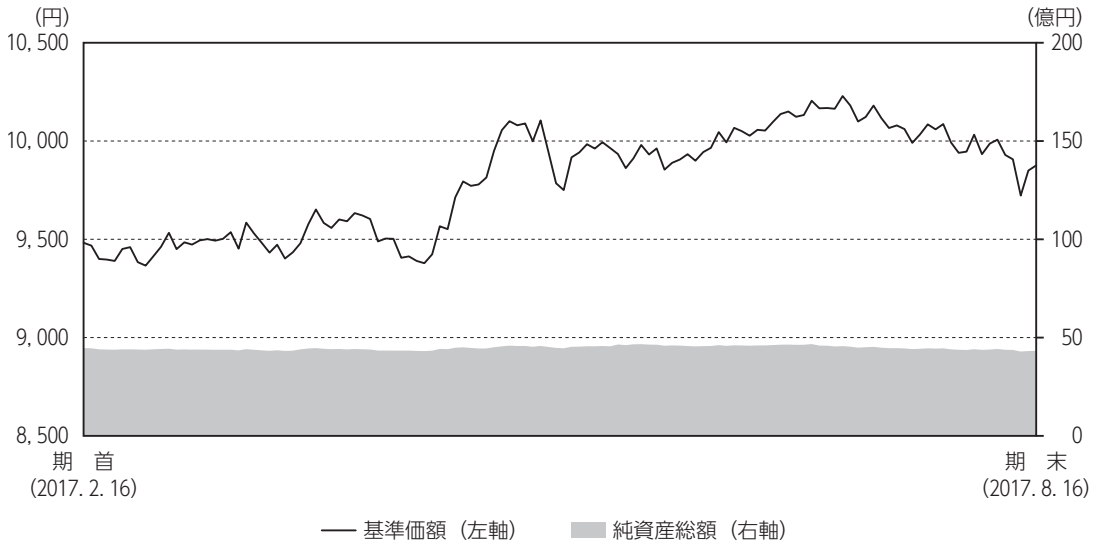
(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

期首：9,482円

期末：9,876円

騰落率：4.2%

■ 基準価額の主な変動要因

アセアンの内需関連企業の株式に投資した結果、為替相場においては通貨ごとに対円でまちまちの動きとなりましたが、アセアン地域のファンダメンタルズへの評価や欧州での政局不透明感の後退などからアセアン株式市況が上昇したことが主なプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC 東南アジア指数 (配当込み、円換算)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2017年2月16日	9,482	—	14,835	—	96.8	—	—
2月末	9,366	△ 1.2	14,754	△ 0.5	95.5	—	—
3月末	9,652	1.8	15,233	2.7	96.0	—	—
4月末	9,772	3.1	15,353	3.5	93.1	—	2.3
5月末	9,862	4.0	15,658	5.5	90.0	—	2.3
6月末	10,123	6.8	16,012	7.9	92.2	—	2.3
7月末	9,992	5.4	16,134	8.8	93.6	—	2.6
(期末)2017年8月16日	9,876	4.2	16,056	8.2	93.4	—	2.6

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 2. 17 ~ 2017. 8. 16)

■アセアン株式市況

アセアン株式市況は上昇しました。

期首から2017年5月上旬までのアセアン株式市況は、マクロ経済データの改善や、フランス大統領選挙でのマクロン氏勝利による欧州政局不透明感の後退などを背景に、フィリピンやインドネシアを中心に上昇基調となりました。その後は、中国の堅調なマクロ経済データやイエレンFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の利上げへの慎重なスタンス表明といったプラス材料と、英国でのテロ事件や北朝鮮によるミサイル発射などを受けた地政学リスクの高まりといった懸念材料が綱引きする格好となり、おおむね横ばい圏での推移となりました。

■為替相場

アセアン通貨は円に対してまちまちの動きとなりました。

対円でのアセアン通貨相場は、おおむね±2%程度の小幅な動きとなりましたが、2016年10月の前国王死去の後、混乱なく王位継承を完了し不透明感が後退したタイ・バーツが対円で上昇した一方で、経常赤字が懸念材料となったインドネシア・ルピアやフィリピン・ペソは対円で下落しました。

前期における「今後の運用方針」

アセアン加盟国の株式の中から、アセアン経済圏の内需拡大の恩恵を受けると考えられる企業で、財務内容や株価水準などを勘案し、中長期的に高い利益成長が期待できる企業を中心に組み入れてまいります。業種では、原油価格の上昇から受注の拡大が期待できるシンガポールの石油開発装置製造企業やインドネシアのインフラ（社会基盤）関連企業などの資本財・サービスセクター、株価バリュエーションが魅力的で、銀行貸出が増加することからの恩恵が期待できるシンガポール、タイ、インドネシアなどの不動産セクターに注目しています。

ポートフォリオについて

(2017. 2. 17 ~ 2017. 8. 16)

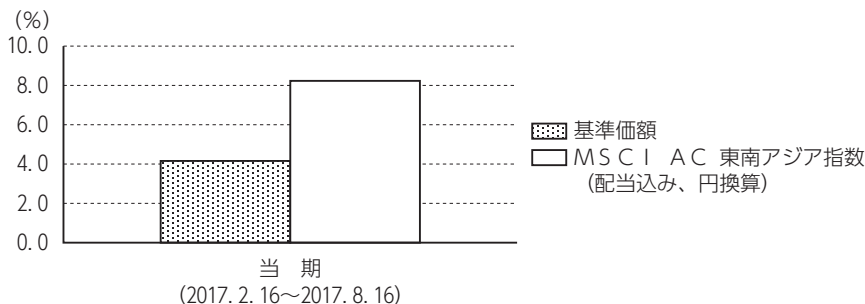
アセアンの内需関連企業の中から、財務内容や株価水準などを勘案し、中長期的に高い利益成長が期待された銘柄に分散投資を行ないました。業種では、世界的な景気拡大環境の中で収益拡大が期待された金融セクター、在庫調整一巡で今後は物件価格の上昇が期待された不動産セクター、インドネシアやタイの農村部の所得増加から恩恵を受けるとみられた一般消費財・サービスセクターなどを組入上位としました。

個別銘柄では、強固な財務体質を有し着実な利益成長が期待されたインドネシアの BANK CENTRAL ASIA (金融)、高い市場占有率を有し高い利益成長が期待されたベトナムの VIETNAM DAIRY PRODUCTS (生活必需品)、住宅開発やホテル運営、オフィス賃貸など幅広く不動産事業を展開し市場回復の恩恵が期待されたシンガポールの CITY DEVELOPMENTS LTD (不動産)などを組入上位としました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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



分配金について

当期は、基準価額の水準等を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目		当 期	
		2017年 2月17日 ～2017年 8月16日	
当期分配金（税込み）	(円)	—	
対基準価額比率	(%)	—	
当期の収益	(円)	—	
当期の収益以外	(円)	—	
翌期繰越分配対象額	(円)	962	

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

アセアン加盟国の株式の中から、アセアン経済圏の内需拡大の恩恵を受けると考えられる企業で、財務内容や株価水準などを勘案し、着実な利益成長が期待できる企業を中心に組み入れてまいります。業種では、アセアン地域の広範な景気回復の恩恵が期待できる銀行を中心とした金融セクター、在庫調整一巡で業績回復が期待できる不動産セクターに加え、インフラ投資増加の恩恵が期待できるインドネシアやタイのセメント関連銘柄を中心に素材セクターに注目しています。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 2. 17~2017. 8. 16)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	87円	0.884%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,801円です。
(投 信 会 社)	(42)	(0.428)	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)	(42)	(0.428)	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)	(3)	(0.027)	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	48	0.491	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(48)	(0.486)	
(投 資 信 託 証 券)	(1)	(0.006)	
有 価 証 券 取 引 税	10	0.101	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(10)	(0.100)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
そ の 他 費 用	7	0.069	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(7)	(0.066)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	151	1.545	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

(1) 株式

(2017年2月17日から2017年8月16日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	シンガポール	百株 48,769 (52.08)	千シンガポール・ドル 7,395 (33)	百株 48,730	千シンガポール・ドル 8,780
	フィリピン	百株 177,450.45 ()	千フィリピン・ペソ 183,820 ()	百株 43,473	千フィリピン・ペソ 55,485
国	インドネシア	百株 183,836 ()	千インドネシア・ルピア 84,108,403 ()	百株 401,758	千インドネシア・ルピア 165,046,729
	マレーシア	百株 47,411 (530.29)	千マレーシア・リンギット 24,839 (160)	百株 71,212.45	千マレーシア・リンギット 15,471
	タイ	百株 62,916 (180)	千タイ・バーツ 177,146 (18)	百株 242,634	千タイ・バーツ 274,314
	ベトナム	百株 4,709.3 (775)	千ベトナム・ドン 43,038,768 ()	百株 700	千ベトナム・ドン 12,423,365

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
 (注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年2月17日から2017年8月16日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国	千口 800 ()	千シンガポール・ドル 1,289 ()	千口 — ()	千シンガポール・ドル — ()

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
 (注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
 (注4) 金額の単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年2月17日から2017年8月16日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	6,701,686千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,196,632千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.59

- (注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株式

(2017年2月17日から2017年8月16日まで)

買 柄	当 期			期			
	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
BANK CENTRAL ASIA TBK PT (インドネシア)	1,580	215,036	136	BANK NEGARA INDONESIA PERSER (インドネシア)	3,850	204,268	53
WILMAR INTERNATIONAL LTD (シンガポール)	550	150,596	273	GENTING SINGAPORE PLC (マン島)	2,200	199,265	90
MALAYAN BANKING BHD (マレーシア)	590	144,960	245	UNITED TRACTORS TBK PT (インドネシア)	850	182,582	214
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR (タイ)	561.6	129,870	231	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP (シンガポール)	177	135,865	767
CITY DEVELOPMENTS LTD (シンガポール)	155	129,472	835	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER (インドネシア)	1,000	121,748	121
SIME DARBY BERHAD (マレーシア)	510	123,616	242	MUANGTHAI LEASING PCL-F (タイ)	1,220.2	116,232	95
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER (インドネシア)	1,000	114,423	114	MY EG SERVICES BHD (マレーシア)	2,047.5	113,486	55
AYALA LAND INC (フィリピン)	1,250	113,784	91	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT (インドネシア)	1,575	108,636	68
CIMB GROUP HOLDINGS BHD (マレーシア)	750	112,712	150	SEMBCORP INDUSTRIES LTD (シンガポール)	400	103,635	259
VIETNAM NATIONAL PETROLEUM G (ベトナム)	328.5	111,169	338	PTT PCL/FOREIGN (タイ)	82	103,180	1,258

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,928.34	1,798.34	3,736	302,580	金融	
UOL GROUP LTD	2,250	2,802.08	2,289	185,364	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	—	1,550	1,785	144,580	不動産	
PAN-UNITED CORP LTD	7,260	—	—	—	資本財・サービス	
THAI BEVERAGE PCL	7,000	—	—	—	生活必需品	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	4,005.49	2,235.49	2,505	202,909	金融	
IPS SECUREX HOLDINGS LTD	24,000	24,000	189	15,351	情報技術	
JUMBO GROUP LTD	15,500	15,500	875	70,909	一般消費財・サービス	
HEALTH MANAGEMENT INTL LTD	—	8,948	577	46,731	ヘルスケア	
HRNETGROUP LTD	—	6,001	486	39,357	資本財・サービス	
ASPEN GROUP HOLDINGS LTD	—	20,000	450	36,436	その他	
GENTING SINGAPORE PLC	22,000	—	—	—	一般消費財・サービス	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,500	—	—	—	電気通信サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	2,800	—	—	—	資本財・サービス	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	—	5,500	1,738	140,725	生活必需品	
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	88,243.83 10銘柄	88,334.91 10銘柄	14,634 <27.4%>	1,184,948	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円		
AYALA LAND INC	—	12,500	53,000	113,950	不動産	
CENTURY PACIFIC FOOD INC	5,560.5	8,210.5	13,678	29,409	生活必需品	
MEGAWORLD CORP	—	97,790	47,917	103,021	不動産	
BDO UNIBANK INC	—	750	9,660	20,769	金融	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	40,000	50,527	33,246	71,480	金融	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	5,000	—	—	—	生活必需品	
MEGAWIDE CONSTRUCTION CORP	20,498	19,291	36,074	77,559	一般消費財・サービス	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	243.45	28,459	61,187	金融	
BLOOMBERRY RESORTS CORP	36,766	22,000	21,692	46,637	一般消費財・サービス	
CEMEX HOLDINGS PHILIPPINES I	20,500	—	—	—	素材	
WILCON DEPOT INC	—	47,500	41,895	90,074	一般消費財・サービス	
SHAKEY'S PIZZA ASIA VENTURES	—	3,490	4,369	9,394	一般消費財・サービス	
フィリピン・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	128,324.5 6銘柄	262,301.95 10銘柄	289,992 <14.4%>	623,483	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円		
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	6,300	—	—	—	素材	
UNITED TRACTORS TBK PT	8,500	—	—	—	エネルギー	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	22,000	6,250	4,890,625	40,592	一般消費財・サービス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	10,500	8,000	8,720,000	72,376	素材	
CIPUTRA DEVELOPMENT TBK PT	55,000	45,000	5,310,000	44,073	不動産	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	18,000	12,500	5,912,500	49,073	電気通信サービス	
RAMAYANA LESTARI SENTOSA PT	67,500	—	—	—	一般消費財・サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	38,500	—	—	—	金融	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	—	14,500	27,078,750	224,753	金融	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,500	—	—	—	金融	
SUMMARECON AGUNG TBK PT	40,000	—	—	—	不動産	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	50,000	33,682	9,127,822	75,760	金融	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	8,700	—	—	—	一般消費財・サービス	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	14,854	—	—	—	一般消費財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PEMBANGUNAN PERUMAHAN PERSER NIPRESS PT	百株 12,000 116,046	百株 17,500 116,046	千インドネシア・ルピア 5,232,500 4,409,748	千円 43,429 36,600	資本財・サービス 一般消費財・サービス
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	253,478 8銘柄	70,681,945	586,660 <13.6%>	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD	—	5,900	5,717	147,329	金融
GENTING BHD	2,000	4,111	3,967	102,232	一般消費財・サービス
SIME DARBY BERHAD	—	5,100	4,783	123,278	資本財・サービス
MMC CORP BHD	6,026	—	—	—	資本財・サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	—	7,500	5,085	131,040	金融
MALAYSIAN RESOURCES CORP BHD	16,308	—	—	—	資本財・サービス
MUHHIBAH ENGINEERING (M) BHD	7,019	—	—	—	資本財・サービス
SP SETIA BHD	—	10,484.84	3,418	88,083	不動産
MY EG SERVICES BHD	20,475	—	—	—	情報技術
PRESTARIANG BHD	4,539	—	—	—	一般消費財・サービス
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	33,095.84 5銘柄	22,971	591,964 <13.7%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
SEAFECO PCL-FOREIGN REG	10,154	—	—	—	資本財・サービス
MUANGTHAI LEASING PCL-F	12,202	2,000	6,950	23,143	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	—	200	9,800	32,634	素材
TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	130,000	—	—	—	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	2,400	1,050	20,212	67,307	金融
TISCO FINANCIAL GROUP-NVDR	4,283	3,683	26,701	88,916	金融
SRIVICHAI VEJVIVAT/FOREIGN	20,277	—	—	—	ヘルスケア
BANGKOK CHAIN HOSPITAL-FOREG	—	2,500	3,450	11,488	ヘルスケア
ROBINSON PCL-FOREIGN	3,500	—	—	—	一般消費財・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	5,000	8,800	34,540	115,018	一般消費財・サービス
SINO-THAI ENGR & CONST-FOR	—	8,800	21,736	72,380	資本財・サービス
SRISAWAD CORP PCL - FOREIGN	2,500	4,680	23,283	77,532	金融
SUPALAI PUBLIC CO LTD-FOR	7,500	—	—	—	不動産
PTT PCL/FOREIGN	820	—	—	—	エネルギー
AP THAILAND PCL - NVDR	19,922	—	—	—	不動産
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	—	2,500	12,937	43,081	資本財・サービス
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	—	5,616	37,767	125,766	不動産
MK RESTAURANTS GROUP-FOREIGN	809	—	—	—	一般消費財・サービス
タイ・バーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	39,829 10銘柄	197,378	657,269 <15.2%>	
(ベトナム)	百株	百株	千ベトナム・ドン	千円	
VIETNAM NATIONAL PETROLEUM G	—	3,285	21,779,550	106,719	エネルギー
VIETNAM DAIRY PRODUCTS JSC	1,420	2,844.3	42,237,855	206,965	生活必需品
MOBILE WORLD INVESTMENT CORP	1,475	1,550	16,631,500	81,494	一般消費財・サービス
ベトナム・ドン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,679.3 3銘柄	80,648,905	395,179 <9.1%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	966,597.33 52銘柄	684,719 46銘柄	— <93.4%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資信託証券

銘 柄	期 首 □ 数	当 期 □ 数	末 額	
			評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(シンガポール) CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	千口 —	千口 800	千シンガポール・ドル 1,380	千円 111,738
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	— —	800 1 銘柄	1,380 <2.6%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年8月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,039,506	90.4
投資信託証券	111,738	2.5
コール・ローン等、その他	317,958	7.1
投資信託財産総額	4,469,203	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、8月16日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.71円、1シンガポール・ドル=80.97円、1フィリピン・ペソ=2.15円、100インドネシア・ルピア=0.83円、1マレーシア・リンギット=25.77円、1タイ・バーツ=3.33円、100ベトナム・ドン=0.49円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(4,288,723千円)の投資信託財産総額(4,469,203千円)に対する比率は、96.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年8月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,592,307,609円
コール・ローン等	223,815,731
株式(評価額)	4,039,506,409
投資信託証券(評価額)	111,738,600
未収入金	199,378,230
未収配当金	17,868,639
(B) 負債	265,179,145
未払金	195,947,172
未払解約金	29,597,190
未払信託報酬	39,515,122
その他未払費用	119,661
(C) 純資産総額(A-B)	4,327,128,464
元本	4,381,483,074
次期繰越損益金	△ 54,354,610
(D) 受益権総口数	4,381,483,074口
1万口当り基準価額(C/D)	9,876円

* 期首における元本額は4,706,453,922円、当期中における追加設定元本額は688,728,250円、同解約元本額は1,013,699,098円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,876円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は54,354,610円です。

■損益の状況

当期 自2017年2月17日 至2017年8月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	76,307,661円
受取配当金	76,059,256
受取利息	267,830
支払利息	△ 19,425
(B) 有価証券売買損益	117,254,782
売買益	489,920,145
売買損	△ 372,665,363
(C) 信託報酬等	△ 42,635,473
(D) 当期損益金 (A + B + C)	150,926,970
(E) 前期繰越損益金	△ 414,646,286
(F) 追加信託差損益金	209,364,706
(配当等相当額)	(129,454,021)
(売買損益相当額)	(79,910,685)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 54,354,610
次期繰越損益金 (G)	△ 54,354,610
追加信託差損益金	209,364,706
(配当等相当額)	(129,454,021)
(売買損益相当額)	(79,910,685)
分配準備積立金	212,404,739
繰越損益金	△ 476,124,055

- (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せん。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。
- (注4) 投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：10,642,053円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	59,500,758円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	209,364,706
(d) 分配準備積立金	152,903,981
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	421,769,445
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	421,769,445
(h) 受益権総口数	4,381,483,074口

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

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		公 社 債 組入比率	純 資 産 総 額	
	税 込 配 金	期 中 騰 落 率			
	円	円	%	%	百万円
7 期末 (2015年 8 月17日)	10,008	0	0.0	41.2	177
8 期末 (2016年 2 月16日)	10,008	0	0.0	31.7	154
9 期末 (2016年 8 月16日)	10,006	0	△ 0.0	19.7	148
10 期末 (2017年 2 月16日)	10,003	0	△ 0.0	38.5	129
11 期末 (2017年 8 月16日)	9,999	0	△ 0.0	—	124

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

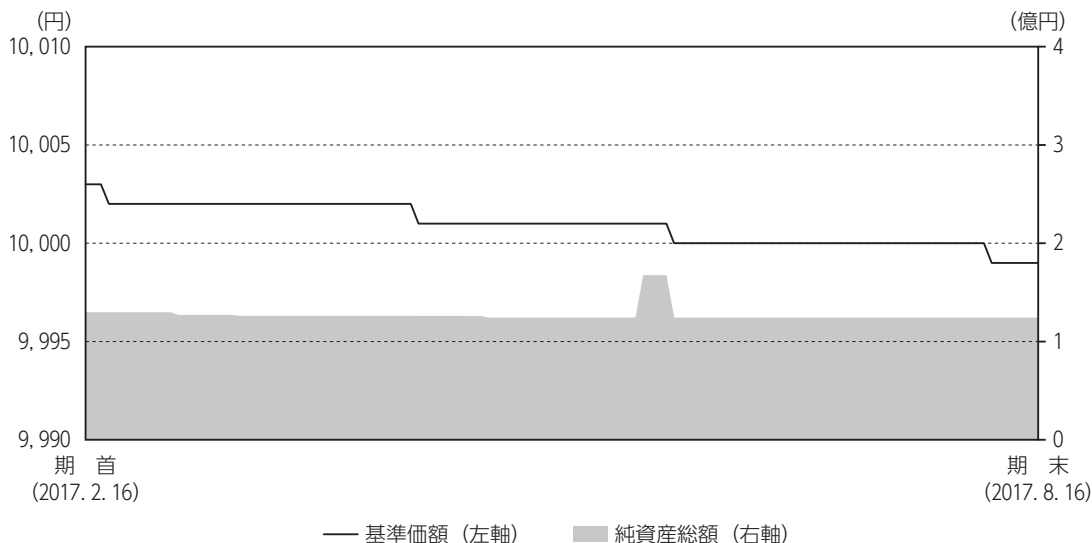
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

期首：10,003円

期末：9,999円

騰落率：△0.0%

■ 基準価額の変動要因

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ

年 月 日	基 準	価 額		公社債組入比率
		騰 落 率		
	円		%	%
(期首)2017年2月16日	10,003	—		38.5
2月末	10,002	△	0.0	17.6
3月末	10,002	△	0.0	—
4月末	10,001	△	0.0	24.9
5月末	10,001	△	0.0	4.4
6月末	10,000	△	0.0	0.4
7月末	10,000	△	0.0	0.1
(期末)2017年8月16日	9,999	△	0.0	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 2. 17 ~ 2017. 8. 16)

国内短期金融市況

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が維持される中、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マイナス圏で推移しました。

前期における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

ポートフォリオについて

(2017. 2. 17 ~ 2017. 8. 16)

当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当期は、基準価額の水準等を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年 2月17日 ～2017年 8月16日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	7

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

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

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



今後の運用方針

当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。
 そのため、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資します。

今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご留意ください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	当 期 (2016. 2. 17~2017. 8. 16)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—円	—%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,001円です。
(投 信 会 社)	(—)	(—)	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)	(—)	(—)	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)	(—)	(—)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0.001	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.001	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年2月17日から2017年8月16日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー ストック・ マザーファンド	30,197	30,300	33,931	34,047

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年2月17日から2017年8月16日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	68,591	11,700	17.1	—	—	—
コール・ローン	3,583,327	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.3%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	90,501	86,767	87,045

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年8月16日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	87,045	70.0
コール・ローン等、その他	37,307	30.0
投資信託財産総額	124,352	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年8月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	124,352,974円
コール・ローン等	37,307,423
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド (評価額)	87,045,551
(B) 負債	187
その他未払費用	187
(C) 純資産総額 (A - B)	124,352,787
元本	124,365,159
次期繰越損益金	△ 12,372
(D) 受益権総口数	124,365,159口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,999円

* 期首における元本額は129,717,576円、当期中における追加設定元本額は43,182,016円、同解約元本額は48,534,433円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,999円です。

■損益の状況

当期 自2017年2月17日 至2017年8月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 9,366円
受取利息	1,720
支払利息	△ 11,086
(B) 有価証券売買損益	△ 30,811
売買益	4,830
売買損	△ 35,641
(C) 信託報酬等	△ 587
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 40,764
(E) 前期繰越損益金	△ 39,752
(F) 追加信託差損益金	68,144
(配当等相当額)	(78,683)
(売買損益相当額)	(△ 10,539)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 12,372
次期繰越損益金 (G)	△ 12,372
追加信託差損益金	68,144
(配当等相当額)	(78,683)
(売買損益相当額)	(△ 10,539)
分配準備積立金	11,883
繰越損益金	△ 92,399

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	78,683
(d) 分配準備積立金	11,883
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	90,566
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	90,566
(h) 受益権総口数	124,365,159口

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

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ）が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2016年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年8月16日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を21ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年2月17日から2017年8月16日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
657 国庫短期証券 2017/4/17	10,150,199		
652 国庫短期証券 2017/3/27	9,790,078		
659 国庫短期証券 2017/4/24	9,120,282		
651 国庫短期証券 2017/3/21	7,630,194		
669 国庫短期証券 2017/6/12	6,970,248		
644 国庫短期証券 2017/5/12	6,690,300		
660 国庫短期証券 2017/5/1	4,590,081		
649 国庫短期証券 2017/3/13	2,490,082		
650 国庫短期証券 2017/6/12	2,490,050		
665 国庫短期証券 2017/5/22	2,200,079		

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

2017年8月16日現在における該当事項はありません。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド 運用報告書 第7期（決算日 2016年12月9日）

（計算期間 2015年12月10日～2016年12月9日）

ダイワ・マネースtock・マザーファンドの第7期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
運用方法	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

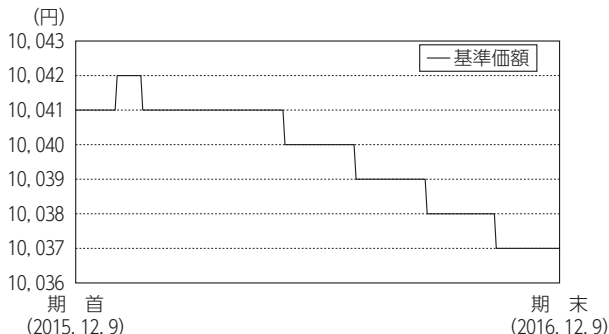
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額の推移



年月日	基準価額		公社債組入比率
	円	%	
(期首) 2015年12月9日	10,041	—	51.6
12月末	10,041	0.0	51.7
2016年1月末	10,042	0.0	90.7
2月末	10,041	0.0	51.1
3月末	10,041	0.0	2.0
4月末	10,041	0.0	7.5
5月末	10,040	△ 0.0	0.1
6月末	10,040	△ 0.0	2.0
7月末	10,039	△ 0.0	19.3
8月末	10,038	△ 0.0	46.5
9月末	10,038	△ 0.0	26.0
10月末	10,037	△ 0.0	3.4
11月末	10,037	△ 0.0	26.6
(期末) 2016年12月9日	10,037	△ 0.0	29.1

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)および債券先物を除きます。
 (注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,041円 期末：10,037円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

期首より、日銀は量的・質的金融緩和を継続し、2016年1月にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券(3カ月物)の利回りおよび無担保コール翌日物金利は低下しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
 (注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国債証券	215,986,756	2,822,446 (233,210,000)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建) 公社債(種類別)

作成期	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちB格以下組入比率	残存期間別組入比率				
区分					5年以上	2年以上	2年未満		
	千円	千円	%	%	%	%	%		%
国債証券	12,370,000	12,370,239	29.1	—	—	—	—		29.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)国内(邦貨建) 公社債(銘柄別)

		当		期		末	
区 分	銘 柄	年 利率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日		
国債証券	632 国庫短期証券	—	千円 7,380,000	千円 7,380,059	2016/12/12		
	634 国庫短期証券	—	2,070,000	2,070,043	2016/12/19		
	635 国庫短期証券	—	2,920,000	2,920,135	2016/12/26		
合計	銘柄数	3銘柄					
	金額		12,370,000	12,370,239			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 12,370,239	% 27.2
コール・ローン等、その他	33,049,576	72.8
投資信託財産総額	45,419,816	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・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9日現在

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

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

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド（為替ヘッジあり）3,021,993円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド（為替ヘッジなし）1,018,149円、ダイワ米国バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）2014-07 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）2014-09 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）2014-11 9,962円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド-ロボテック-49,795,838円、新興国ソブリン・豪ドルファンド（毎月決算型）999円、新興国ソブリン・ブラジルレアルファンド（毎月決算型）999円、新興国ソブリン・ファンド（為替ヘッジあり/毎月決算型）999円、アジア高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり/毎月決算型）999円、U.S短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり/毎月決算型）3,988,832円、U.S短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり/年1回決算型）4,984円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド-ロボテック-（為替ヘッジあり）39,849円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型）-ロボテック（年1回）-（為替ヘッジあり）3,985円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス13,026,074,887円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス7,057,921,466円、ダイワ上場投信-TOPIXレバレッジ（2倍）指数1,434,536,786円、ダイワ上場投信-TOPIXダブルインバース（-2倍）指数757,087,194円、ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス11,055,796,865円、ダイワ上場投信-TOPIXインバース（-1倍）指数2,230,635,146円、ダイワ上場投信-JPX日経400レバレッジ・インデックス901,494,652円、ダイワ上場投信-JPX日経400インバース・インデックス4,402,808,262円、ダイワ上場投信-JPX日経400ダブルインバース・インデックス313,802,045円、ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-10 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016-10 997円、ダイワ・プルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ185,052,355円、ダイワ・プルベア・セレクト ドル高円安ポートフォリオ160,376,323円、ダイワ・プルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ76,963,963円、ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネー・ポートフォリオ-SLトレード-48,811,188円、ダイワ/モルガン・スタンレー新興4カ国不動産関連ファンド-成長の槌音（つちおと）-11,000,000円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ395,846,364円、ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ91,481,943円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 豪ドル・コース（毎月分配型）4,184,518円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 通貨セレクト・コース（毎月分配型）4,981,569円、ダイワU.S短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり/年1回決算型）199,295円、ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）997円、ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）997円、ダイワ新グロー

バル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジなし）997円、ダイワ/ミレニアセット 亜細亜株式ファンド9,958,176円、＜奇数月定額払出型＞ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり49,806円、＜奇数月定額払出型＞ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし49,806円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース4,980,080円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース3,685,259円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型）-ロボテック（年1回）-100,588円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり（毎月分配型）399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし（毎月分配型）99,771円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース（毎月分配型）399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース（毎月分配型）99,771円、ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジあり）2,088,438円、ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジなし）1,012,911円、ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド10,009,811円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）-ジャパン・トリプルリターンズ-日本円・コース（毎月分配型）398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）-ジャパン・トリプルリターンズ-豪ドル・コース（毎月分配型）99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）-ジャパン・トリプルリターンズ-ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）-ジャパン・トリプルリターンズ-米ドル・コース（毎月分配型）398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）-ジャパン・トリプルリターンズ-通貨セレクト・コース（毎月分配型）1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型 日本円・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型 豪ドル・コース499,994円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型 ブラジル・レアル・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型 米ドル・コース9,976,045円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型 通貨セレクト・コース2,001,563円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,037円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月10日 至2016年12月9日

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

（注1）解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

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