

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／資産複合
信託期間	7年間（2012年10月18日～2019年10月17日）
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」（以下「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」といいます。）の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
当ファンドの運用方法	①主として、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの受益証券への投資を通じて、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、高利回りの獲得をめざします。 ②当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドとダイワ・マネーポートフォリオ・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、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドでは、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
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、分配対象額の範囲内で、下記イ. およびロ. に基づき分配します。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計算期末には、収益の分配は行ないません。 イ. 計算期末の前営業日の基準価額（1万口当り。既払分配金を加算しません。以下同じ。）が10,500円未満の場合、原則として、主要投資対象とする外国投資信託のポートフォリオにおける利子・配当収入相当分から経費（外国投資信託の経費を含みます。）を控除した額を分配することをめざします。 ロ. 計算期末の前営業日の基準価額が10,500円以上の場合、原則として、当該基準価額に応じ、下記の金額（1万口当り）を分配することをめざします。 a. 10,500円以上11,000円未満の場合…100円 b. 11,000円以上11,500円未満の場合…150円 c. 11,500円以上12,000円未満の場合…200円 d. 12,000円以上12,500円未満の場合…250円 e. 12,500円以上の場合…300円 なお、計算期末の前営業日から当該計算期末までに基準価額が急激に変動した場合等には、上記の分配を行わないことがあります。

ダイワ豪ドル建て 高利回り証券ファンド —予想分配金提示型—

運用報告書（全体版）

第55期	（決算日	2017年5月17日）
第56期	（決算日	2017年6月19日）
第57期	（決算日	2017年7月18日）
第58期	（決算日	2017年8月17日）
第59期	（決算日	2017年9月19日）
第60期	（決算日	2017年10月17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、「ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド —予想分配金提示型—」は、このたび、第60期の決算を行ないました。

ここに、第55期～第60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/>

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			公社債比率	投資信託証券比率	純資産額
	(分配落)	税金込み	期騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
31期末 (2015年 5月18日)	10,310	30	3.7	0.2	96.2	20,396
32期末 (2015年 6月17日)	10,204	30	△ 0.7	0.2	96.1	19,927
33期末 (2015年 7月17日)	9,807	30	△ 3.6	0.3	95.7	18,751
34期末 (2015年 8月17日)	9,714	30	△ 0.6	0.2	95.9	17,782
35期末 (2015年 9月17日)	9,102	30	△ 6.0	0.2	96.0	16,333
36期末 (2015年10月19日)	9,091	30	0.2	0.2	95.8	15,793
37期末 (2015年11月17日)	9,123	30	0.7	0.2	95.9	15,499
38期末 (2015年12月17日)	9,104	30	0.1	0.2	95.9	15,112
39期末 (2016年 1月18日)	8,355	30	△ 7.9	0.2	95.7	13,697
40期末 (2016年 2月17日)	8,227	30	△ 1.2	0.2	95.5	13,212
41期末 (2016年 3月17日)	8,648	30	5.5	0.1	95.9	13,544
42期末 (2016年 4月18日)	8,585	30	△ 0.4	0.0	98.4	13,169
43期末 (2016年 5月17日)	8,233	30	△ 3.8	0.2	98.0	12,317
44期末 (2016年 6月17日)	7,850	30	△ 4.3	0.2	98.9	11,460
45期末 (2016年 7月19日)	8,317	30	6.3	0.1	99.1	11,786
46期末 (2016年 8月17日)	8,038	30	△ 3.0	0.1	98.8	11,095
47期末 (2016年 9月20日)	7,995	30	△ 0.2	0.0	97.9	10,840
48期末 (2016年10月17日)	8,294	30	4.1	0.0	99.1	10,957
49期末 (2016年11月17日)	8,491	30	2.7	0.1	98.9	10,827
50期末 (2016年12月19日)	8,990	30	6.2	0.0	97.2	11,028
51期末 (2017年 1月17日)	9,054	30	1.0	0.1	98.6	10,945
52期末 (2017年 2月17日)	9,188	30	1.8	0.3	98.0	10,825
53期末 (2017年 3月17日)	9,184	30	0.3	0.1	97.8	10,483
54期末 (2017年 4月17日)	8,810	30	△ 3.7	0.2	97.6	9,737
55期末 (2017年 5月17日)	8,946	30	1.9	0.1	98.0	9,587
56期末 (2017年 6月19日)	8,937	30	0.2	0.0	97.1	9,297
57期末 (2017年 7月18日)	9,384	30	5.3	—	96.7	9,377
58期末 (2017年 8月17日)	9,296	30	△ 0.6	—	97.7	8,822
59期末 (2017年 9月19日)	9,429	30	1.8	—	97.5	8,544
60期末 (2017年10月17日)	9,344	30	△ 0.6	—	98.0	8,149

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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。

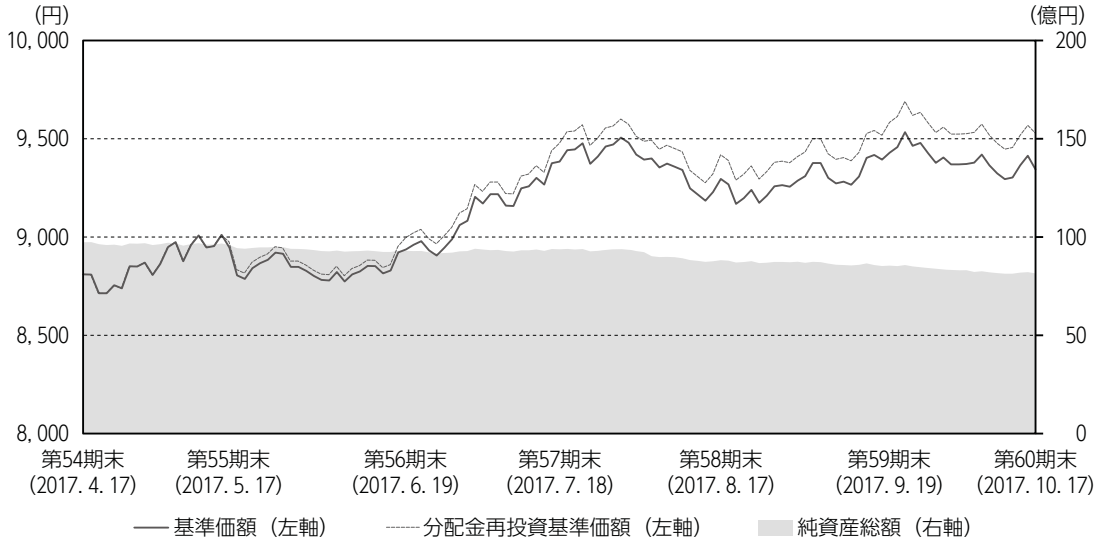
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



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

第55期首：8,810円

第60期末：9,344円（既払分配金180円）

騰落率：8.1%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券が堅調な値動きとなったほか、豪ドルが対円で上昇したことがプラス要因となり、当ファンドの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。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %		
第55期	(期首) 2017年4月17日	8,810	—	0.2	97.6
	4月末	8,807	△ 0.0	0.2	99.1
	(期末) 2017年5月17日	8,976	1.9	0.1	98.0
第56期	(期首) 2017年5月17日	8,946	—	0.1	98.0
	5月末	8,828	△ 1.3	0.0	98.9
	(期末) 2017年6月19日	8,967	0.2	0.0	97.1
第57期	(期首) 2017年6月19日	8,937	—	0.0	97.1
	6月末	9,205	3.0	0.0	98.9
	(期末) 2017年7月18日	9,414	5.3	—	96.7
第58期	(期首) 2017年7月18日	9,384	—	—	96.7
	7月末	9,480	1.0	0.0	98.1
	(期末) 2017年8月17日	9,326	△ 0.6	—	97.7
第59期	(期首) 2017年8月17日	9,296	—	—	97.7
	8月末	9,287	△ 0.1	—	97.4
	(期末) 2017年9月19日	9,459	1.8	—	97.5
第60期	(期首) 2017年9月19日	9,429	—	—	97.5
	9月末	9,370	△ 0.6	—	98.3
	(期末) 2017年10月17日	9,374	△ 0.6	—	98.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 4. 18 ~ 2017. 10. 17)

■ オーストラリア債券市況

オーストラリア債券市況は、当作成期間を通して金利は上昇しました。

第55期首より、フランス大統領選挙の結果などが金利上昇の材料となった一方で、米国トランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことなどが、金利低下の材料となりました。2017年6月下旬からは、先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で金利が上昇しましたが、その後は、トランプ政権の政策実行能力への懸念が高まったことや北朝鮮に関する地政学リスクが意識されたことなどが、金利低下の材料となりました。9月中旬にかけては、市場のリスク回避姿勢が後退したことや、FOMC（米国連邦公開市場委員会）において年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから、金利は上昇しました。

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券の信用スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は、縮小しました。企業のファンダメンタルズが良好なことや、過去に比べて低金利が続く中で投資家の利回りに対する需要が強いことが、スプレッドの縮小要因となりました。

■ 為替相場

豪ドル円為替相場は、当作成期間を通して上昇（円安）しました。

第55期首より、豪ドルは方向感なく推移しました。2017年6月以降は、オーストラリアで堅調な経済指標が確認されたことやオーストラリアの主要輸出品目である鉄鉱石の価格が上昇したことなどから、豪ドルは上昇しました。8月以降は、北朝鮮に関する地政学リスクが意識されて市場のリスク回避姿勢が強まったことや、鉄鉱石価格の下落などが豪ドルの下落材料となりました。一方、北朝鮮の情勢への警戒感が和らぎ市場のリスク回避姿勢が後退したことなどが豪ドルの上昇材料となるなど、豪ドルは方向感のない推移となりました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

■当ファンド

当ファンドは、「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」（以下、「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」といいます。）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券の流通市場で割安に取引されている銘柄や、新規発行銘柄の組み入れに注力します。引き続き、新規発行および流通市場の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017. 4. 18 ~ 2017. 10. 17)

■当ファンド

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドとダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期間を通じてダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドへの投資割合を高位に維持することを基本としました。

■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債に投資し、高利回りの獲得をめざして運用を行ないました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等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

第55期から第60期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ30円といたしました。
 収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	2017年4月18日 ～2017年5月17日	2017年5月18日 ～2017年6月19日	2017年6月20日 ～2017年7月18日	2017年7月19日 ～2017年8月17日	2017年8月18日 ～2017年9月19日	2017年9月20日 ～2017年10月17日
当期分配金（税込み）（円）	30	30	30	30	30	30
対基準価額比率（%）	0.33	0.33	0.32	0.32	0.32	0.32
当期の収益（円）	30	24	30	26	30	27
当期の収益以外（円）	—	5	—	3	—	2
翌期繰越分配対象額（円）	1,091	1,086	1,089	1,086	1,091	1,089

（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	第60期
(a) 経費控除後の配当等収益	34.73円	24.66円	33.53円	26.96円	35.10円	27.32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	0.00
(c) 収益調整金	457.96	459.10	462.21	463.70	465.02	465.27
(d) 分配準備積立金	628.76	632.36	624.01	626.06	621.70	626.56
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,121.46	1,116.13	1,119.76	1,116.72	1,121.83	1,119.15
(f) 分配金	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,091.46	1,086.13	1,089.76	1,086.72	1,091.83	1,089.15

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの受益証券への投資割合を高位に保つことによって、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券の流通市場で割安に取引されている銘柄や、新規発行銘柄の組み入れに注力しています。普通社債とハイブリッド証券の起債については、今後も一定程度の発行が行なわれる状況が継続するとみており、引き続き新規発行および流通市場の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・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う方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～第60期 (2017. 4. 18～2017. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	53円	0. 583%	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, 153円です。
(投 信 会 社)	(15)	(0. 162)	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)	(37)	(0. 406)	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	0	0. 004	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. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	54	0. 587	

(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。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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

投資信託受益証券

(2017年4月18日から2017年10月17日まで)

決算期	第 55 期 ~ 第 60 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	2,076.126	210,711	22,478.579	2,300,000

(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。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2017年4月18日から2017年10月17日まで)

第 55 期 ~ 第 60 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
				DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	22,478.579	2,300,000	102

(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

(1) 当ファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間 (第55期～第60期) 中における利害関係人との取引はありません。

(2) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2017年4月18日から2017年10月17日まで)

決算期	第 55 期 ~ 第 60 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B		売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	
		B/A			D/C	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	99,234	18,670	18.8	—	—	—
コール・ローン	14,499,927	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

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

(3) 当作成期間中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期間 (第55期～第60期) 中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 60 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A)	76,598.007	7,986,797	98.0

(注 1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注 2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年10月17日現在

項 目	第 60 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	7,986,797	97.3
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	54,174	0.7
コール・ローン等、その他	167,287	2.0
投資信託財産総額	8,208,260	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第 60 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	53,926	53,926	54,174

(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

(2017年5月17日)、(2017年6月19日)、(2017年7月18日)、(2017年8月17日)、(2017年9月19日)、(2017年10月17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	第60期末
(A) 資産	9,653,994,469円	9,511,891,388円	9,587,235,798円	8,900,941,186円	8,819,058,636円	8,258,260,006円
コール・ローン等	203,933,481	233,447,131	266,689,930	226,919,018	236,947,032	117,287,764
投資信託受益証券 (評価額)	9,395,870,208	9,024,258,871	9,066,360,481	8,619,842,174	8,327,931,611	7,986,797,641
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額)	54,190,780	54,185,387	54,185,387	54,179,994	54,179,994	54,174,602
未収入金	—	199,999,999	200,000,000	—	199,999,999	99,999,999
(B) 負債	66,462,829	214,322,820	209,524,989	78,443,561	274,275,435	109,012,446
未払金	—	100,000,000	100,000,000	—	100,000,000	50,000,000
未払収益分配金	32,150,822	31,209,624	29,979,002	28,471,730	27,186,343	26,163,104
未払解約金	24,995,670	73,108,652	70,733,288	40,959,231	137,630,342	25,037,730
未払信託報酬	9,252,017	9,871,772	8,620,078	8,759,161	9,141,845	7,443,031
その他未払費用	64,320	132,772	192,621	253,439	316,905	368,581
(C) 純資産総額 (A - B)	9,587,531,640	9,297,568,568	9,377,710,809	8,822,497,625	8,544,783,201	8,149,247,560
元本	10,716,940,859	10,403,208,267	9,993,000,990	9,490,576,701	9,062,114,658	8,721,034,930
次期繰越損益金	△ 1,129,409,219	△ 1,105,639,699	△ 615,290,181	△ 668,079,076	△ 517,331,457	△ 571,787,370
(D) 受益権総口数	10,716,940,859□	10,403,208,267□	9,993,000,990□	9,490,576,701□	9,062,114,658□	8,721,034,930□
1万口当り基準価額 (C/D)	8,946円	8,937円	9,384円	9,296円	9,429円	9,344円

* 第54期末における元本額は11,053,224,974円、当作成期間 (第55期～第60期) 中における追加設定元本額は141,040,782円、同解約元本額は2,473,230,826円です。

* 第60期末の計算口数当りの純資産額は9,344円です。

* 第60期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は571,787,370円です。

■損益の状況

項 目	第55期 自2017年4月18日 至2017年6月19日	第56期 自2017年5月17日 至2017年7月19日	第57期 自2017年6月20日 至2017年8月17日	第58期 自2017年7月18日 至2017年8月17日	第59期 自2017年8月18日 至2017年9月20日	第60期 自2017年9月19日 至2017年10月17日
(A) 配当等収益	39,177,013円	35,607,353円	34,127,068円	34,413,269円	33,799,828円	31,323,875円
受取配当金	39,183,530	35,615,679	34,133,628	34,421,699	33,807,005	31,329,354
受取利息	86	34	60	175	67	57
支払利息	△ 6,603	△ 8,360	△ 6,620	△ 8,605	△ 7,244	△ 5,536
(B) 有価証券売買損益	148,440,396	△ 3,542,460	450,147,085	△ 80,947,543	123,222,326	△ 71,592,351
売買益	150,783,554	3,965,556	457,460,209	1,729,969	124,816,680	1,244,435
売買損	△ 2,343,158	△ 7,508,016	△ 7,313,124	△ 82,677,512	△ 1,594,354	△ 72,836,786
(C) 信託報酬等	△ 9,316,922	△ 9,940,308	△ 8,679,927	△ 8,819,979	△ 9,205,311	△ 7,494,707
(D) 当期損益金 (A + B + C)	178,300,487	22,124,585	475,594,226	△ 55,354,253	147,816,843	△ 47,763,183
(E) 前期繰越損益金	△ 1,552,262,069	△ 1,362,495,743	△ 1,311,156,094	△ 820,074,134	△ 861,257,893	△ 712,471,379
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	276,703,185 (490,795,868)	265,941,083 (477,612,939)	250,250,689 (461,887,812)	235,821,041 (440,079,152)	223,295,936 (421,412,041)	214,610,296 (405,766,849)
(売買損益相当額)	(△ 214,092,683)	(△ 211,671,856)	(△ 211,637,123)	(△ 204,258,111)	(△ 198,116,105)	(△ 191,156,553)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,097,258,397	△ 1,074,430,075	△ 585,311,179	△ 639,607,346	△ 490,145,114	△ 545,624,266
(H) 収益分配金 次期繰越損益金 (G + H)	△ 32,150,822 △ 1,129,409,219	△ 31,209,624 △ 1,105,639,699	△ 29,979,002 △ 615,290,181	△ 28,471,730 △ 668,079,076	△ 27,186,343 △ 517,331,457	△ 26,163,104 △ 571,787,370
追加信託差損益金 (配当等相当額)	276,703,185 (490,795,868)	265,941,083 (477,612,939)	250,250,689 (461,887,812)	235,821,041 (440,079,152)	223,295,936 (421,412,041)	214,610,296 (405,766,849)
(売買損益相当額)	(△ 214,092,683)	(△ 211,671,856)	(△ 211,637,123)	(△ 204,258,111)	(△ 198,116,105)	(△ 191,156,553)
分配準備積立金	678,920,986	652,315,559	627,111,430	591,288,285	568,023,165	544,092,822
繰越損益金	△ 2,085,033,390	△ 2,023,896,341	△ 1,492,652,300	△ 1,495,188,402	△ 1,308,650,558	△ 1,330,490,488

(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	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
(a) 経費控除後の配当等収益	37,228,157円	25,663,863円	33,512,493円	25,590,658円	31,815,729円	23,826,978円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	490,795,868	477,612,939	461,887,812	440,079,152	421,412,041	405,766,849
(d) 分配準備積立金	673,843,651	657,861,320	623,577,939	594,169,357	563,393,779	546,428,948
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,201,867,676	1,161,138,122	1,118,978,244	1,059,839,167	1,016,621,549	976,022,775
(f) 分配金	32,150,822	31,209,624	29,979,002	28,471,730	27,186,343	26,163,104
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,169,716,854	1,129,928,498	1,088,999,242	1,031,367,437	989,435,206	949,859,671
(h) 受益権総口数	10,716,940,859□	10,403,208,267□	9,993,000,990□	9,490,576,701□	9,062,114,658□	8,721,034,930□

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	第60期
	30円	30円	30円	30円	30円	30円
(単 価)	(8, 946円)	(8, 937円)	(9, 384円)	(9, 296円)	(9, 429円)	(9, 344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。

分配金の課税上の取扱いについて

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

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

ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・
ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド – 予想分配金提示型 –）はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」の受益証券に投資しております。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。なお、クラス別の記載部分において「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」は「クラスA」と表記しております。

（注）2017年10月17日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（豪ドル建て）

貸借対照表

2017年3月31日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$230,170,464）	\$	245,912,619
現金		14,245,386
外国為替先渡契約による評価益		182
未収：		
売却済みの投資資産		283,867
配当		68,079
利息		1,233,216
前払受託会社報酬		14,370
その他資産		1,046
資産合計		261,758,765

負債

売建てオプションの評価額（受取プレミアム \$958,860）		452,093
未払：		
購入済みの投資資産		3,006,000
解約済み受益証券		3,939,503
運用会社報酬		573,987
専門家報酬		68,111
保管会社報酬		27,056
会計および管理会社報酬		26,179

為替運用会社報酬		11,680
名義書換代理人報酬		4,998
負債合計		8,109,607
純資産	\$	253,649,158
純資産		
クラス A	\$	117,145,856
通貨αクラス		136,503,302
	\$	253,649,158
発行済み受益証券口数		
クラス A		98,919,563
通貨αクラス		166,388,227
受益証券1口当り純資産額		
クラス A	\$	1.184
通貨αクラス	\$	0.820

損益計算書

2017年3月31日に終了した年度

投資収益

受取利息 (源泉税 \$56,686控除後)	\$	8,917,848
配当収益 (源泉税 \$109,224控除後)		1,169,128
投資収益合計		10,086,976

費用

運用会社報酬		1,944,441
保管会社報酬		189,104
会計および管理会社報酬		179,971
為替運用会社報酬		161,686
専門家報酬		63,580
名義書換代理人報酬		35,113
受託会社報酬		18,814
登録料		1,649
その他費用		297
費用合計		2,594,655

投資純利益		7,492,321
--------------	--	------------------

実現益 (損) および評価益 (損) :

実現益 (損) :

証券投資		1,735,356
先物取引		467,594
売建オプション		509,745
外国為替取引および外国為替先渡契約		(70,088)
純実現益		2,642,607

評価益 (損) の純変動 :

証券投資		16,874,672
売建オプション		1,362,179
先物取引		257,104
外国為替換算および外国為替先渡契約		5,639
評価益の純変動		18,499,594

純実現・純評価益		21,142,201
-----------------	--	-------------------

運用による純資産の純増	\$	28,634,522
--------------------	----	-------------------

投資明細表
2017年3月31日

	元本	銘柄	評価額
		債券 (82.4%)	
		オーストラリア (67.0%)	
		社債 (67.0%)	
		AAI, Ltd. (a), (b)	
AUD	1,250,000	4.99% due 10/06/42	\$ 1,304,569
		Adani Abbot Point Terminal Pty, Ltd. (a)	
AUD	4,000,000	6.75% due 11/01/18	4,010,808
		AGL Energy, Ltd. (a)	
AUD	5,000,000	5.00% due 11/05/21	5,232,545
		Ale Direct Property Trust (a)	
AUD	5,000,000	4.00% due 08/20/22	5,029,125
		Alumina, Ltd. (a)	
AUD	7,000,000	7.25% due 11/19/19	7,267,022
		AMP Bank, Ltd. (b)	
AUD	4,000,000	3.13% due 05/24/21	4,051,272
		AMP, Ltd. (a), (b), (c)	
AUD	5,000,000	5.97% due 12/31/49	4,973,035
		APT Pipelines, Ltd. (a), (b)	
AUD	66,420	6.29% due 09/30/72	6,774,176
		Aurizon Network Pty, Ltd.	
AUD	1,550,000	5.75% due 10/28/20	1,665,418
		AusNet Services Holdings Pty, Ltd.	
AUD	5,000,000	5.25% due 02/14/20	5,278,185
		Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a)	
AUD	5,500,000	2.91% due 08/16/21 (b)	5,565,439
AUD	2,500,000	4.48% due 05/17/26	2,584,233
		Australian Unity, Ltd. (b)	
AUD	57,748	4.58% due 12/15/20	6,023,116
		Bank of Queensland, Ltd. (a), (b), (c)	
AUD	1,500,000	6.36% due 12/31/49	1,514,304
		Caltex Australia, Ltd. (a), (b)	
AUD	60,868	6.29% due 09/15/37	6,165,989

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド – 予想分配金提示型 –

	元本	銘柄	評価額
AUD	3,000,000	Commonwealth Bank of Australia (a), (b) 4.44% due 06/03/26	3,096,417
AUD	124,958	Crown Resorts, Ltd. (a), (b) 5.80% due 04/23/75	11,883,506
AUD	24,767	6.80% due 09/14/72	2,522,519
AUD	2,750,000	ETSA Utilities Finance Pty, Ltd. (b) 3.18% due 10/09/17	2,753,418
AUD	4,550,000	Global Switch Property Australia Pty, Ltd. 6.25% due 12/23/20	4,939,230
AUD	4,000,000	Holcim Finance Australia Pty, Ltd. 3.75% due 03/19/20	4,033,204
AUD	3,280,000	Insurance Australia, Ltd. (a), (b) 4.60% due 03/19/40	3,334,871
AUD	3,000,000	Investa Office Fund (a) 4.26% due 04/05/24	3,000,000
AUD	12,318	Macquarie Bank, Ltd. (a), (b), (c) 5.30% due 12/31/49	1,231,430
AUD	145,427	Macquarie Finance, Ltd. (a), (b), (c) 3.48% due 12/31/49	10,982,647
AUD	3,500,000	Mirvac Group Finance, Ltd. 5.75% due 09/18/20	3,764,723
AUD	246,661	National Australia Bank, Ltd. (a), (b) 3.03% due 12/31/49 (c)	18,785,702
AUD	11,250	4.00% due 09/20/28	1,135,125
AUD	2,000,000	4.20% due 09/21/26	2,048,022
AUD	6,500,000	Qantas Airways, Ltd. 7.50% due 06/11/21	7,375,823
AUD	1,500,000	Scentre Group Trust 1 (a) 4.50% due 09/08/21	1,559,619
AUD	32,985	Suncorp Group, Ltd. (a), (b) 4.63% due 11/22/23	3,375,091
AUD	33,991	Suncorp-Metway, Ltd. (a), (b), (c) 2.53% due 12/31/49	2,532,669
AUD	49,929	Tatts Group, Ltd. (b) 4.89% due 07/05/19	5,197,609

	元本	銘柄	評価額
AUD	88,369	Westpac Banking Corp. (a), (b) 4.08% due 08/22/23	8,951,868
		社債合計	169,942,729
		オーストラリア合計 (簿価 \$154,980,495)	169,942,729
		カナダ (2.0%)	
		社債 (2.0%)	
AUD	5,000,000	Royal Bank of Canada (b) 3.05% due 02/03/21	5,065,135
		社債合計	5,065,135
		カナダ合計 (簿価 \$5,000,000)	5,065,135
		フランス (1.4%)	
		社債 (1.4%)	
AUD	3,500,000	BNP Paribas S. A. (a), (b) 5.00% due 05/31/28	3,553,378
		社債合計	3,553,378
		フランス合計 (簿価 \$3,494,826)	3,553,378
		オランダ (2.0%)	
		社債 (2.0%)	
AUD	2,000,000	Cooperatieve Rabobank UA (a), (b) 4.29% due 07/02/25	2,032,832
AUD	3,000,000	5.00% due 07/02/25	3,088,374
		社債合計	5,121,206
		オランダ合計 (簿価 \$4,947,911)	5,121,206
		ニュージーランド (1.2%)	
		社債 (1.2%)	
AUD	36,585	Nufarm Finance NZ, Ltd. (a), (b), (c) 5.89% due 12/31/49	3,164,968
		社債合計	3,164,968
		ニュージーランド合計 (簿価 \$2,971,877)	3,164,968
		スウェーデン (4.8%)	
		社債 (4.8%)	
AUD	5,000,000	Svenska Handelsbanken AB (b) 3.29% due 03/02/21	5,079,215
AUD	7,000,000	Swedbank AB (b) 2.92% due 11/05/18	7,038,829

	<u>元本</u>	<u>銘柄</u>	<u>評価額</u>
		社債合計	12,118,044
		スウェーデン合計 (簿価 \$12,000,000)	12,118,044
		スイス (2.0%)	
		社債 (2.0%)	
		Credit Suisse AG (b)	
AUD	5,000,000	2.92% due 04/29/20	5,018,940
		社債合計	5,018,940
		スイス合計 (簿価 \$5,000,000)	5,018,940
		米国 (2.0%)	
		社債 (2.0%)	
		Citigroup, Inc. (b)	
AUD	5,000,000	3.02% due 08/07/19	5,015,650
		社債合計	5,015,650
		米国合計 (簿価 \$5,000,000)	5,015,650
		債券合計 (簿価 \$193,395,109)	209,000,050
	<u>株数</u>	優先株式 (12.5%)	
		オーストラリア (12.5%)	
		銀行 (3.9%)	
	1,900	Bendigo & Adelaide Bank, Ltd. (a), (b), (c)	195,320
	45,004	Commonwealth Bank of Australia (a), (b), (c)	4,275,830
	45,008	Commonwealth Bank of Australia/New Zealand (a), (b), (c)	4,550,800
	5,000	National Australia Bank Series CN, Ltd. (a), (b), (c)	500,800
	2,301	National Australia Bank Series CPS2, Ltd. (a), (b), (c)	228,719
	5,000	Westpac Banking Corp. (a), (b), (c)	492,500
			10,243,969
		総合金融サービス (0.6%)	
	14,221	Macquarie Group, Ltd. (a), (b), (c)	1,472,300
		総合持株会社 (0.6%)	
	18,710	Seven Group Holdings, Ltd. (a), (b), (c)	1,426,451
		保険 (0.3%)	
	6,110	AMP, Ltd. (a), (b), (c)	644,422
		不動産投資信託 (REIT) (7.1%)	
	125,764	Goodman PLUS Trust (a), (b), (c)	12,689,588
	69,468	Multiplex SITES Trust (a), (b), (c)	5,293,600
			17,983,188

株数	銘柄	投資資産に 占める比率	評価額
	オーストラリア合計 (簿価 \$31, 633, 116)		31, 770, 330
	優先株式合計 (簿価 \$31, 633, 116)		31, 770, 330
口数	MMF (2.0%)		
	オーストラリア (2.0%)		
5, 142, 239	Goldman Sachs A\$ Cash Reserves Fund Class A		5, 142, 239
	オーストラリア合計		5, 142, 239
	MMF 合計 (簿価 \$5, 142, 239)		5, 142, 239
	投資総額 (簿価 \$230, 170, 464)	96.9%	\$ 245, 912, 619
	負債を超過する現金およびその他の資産	3.1	7, 736, 539
	純資産	100.0%	\$ 253, 649, 158

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最善の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

- (a) 償還条項付き証券
- (b) 2017年3月31日時点の変動利付証券
- (c) 永久債

2017年3月31日現在の通貨αクラスの外国為替先渡契約残高 (純資産の0.0%) :

買い	取引相手	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	Royal Bank of Scotland Plc	279, 967	2017年4月3日	JPY	23, 783, 000	\$ 182	\$ —	\$ 182
						\$ 182	\$ —	\$ 182

2017年3月31日現在の通貨αクラスの売建オプション残高 (純資産の-0.2%) :

取引内容	行使価格	満期日	想定元本	受取プレミアム	評価額
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	\$ 86.25	2017年4月12日	17, 000, 000	\$ (240, 111)	\$ (24, 937)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	86.30	2017年4月21日	17, 000, 000	(217, 316)	(48, 355)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	85.30	2017年4月26日	17, 000, 000	(215, 792)	(136, 420)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	84.80	2017年5月12日	17, 000, 000	(285, 641)	(242, 381)
				\$ (958, 860)	\$ (452, 093)

通貨の略称:

- AUD - 豪ドル
- JPY - 日本円

<補足情報>

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド（一予想分配金提示型））が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・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、当ファンドの第60期の決算日（2017年10月17日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年4月18日から2017年10月17日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
669 国庫短期証券 2017/6/12	29,100,894		
644 国庫短期証券 2017/5/12	15,890,426		
660 国庫短期証券 2017/5/1	15,270,265		
650 国庫短期証券 2017/6/12	10,480,200		
665 国庫短期証券 2017/5/22	7,490,272		
659 国庫短期証券 2017/4/24	5,820,034		
671 国庫短期証券 2017/6/19	3,780,034		
679 国庫短期証券 2017/7/31	3,110,034		
661 国庫短期証券 2017/5/8	3,070,103		
666 国庫短期証券 2017/5/29	1,540,107		

(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10月17日現在における該当事項はありません。

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書 第8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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの第8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

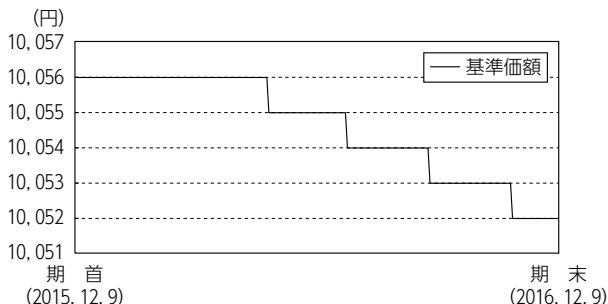
大和投資信託

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	騰落率 %	
(期首) 2015年12月9日	10,056	—	51.3
12月末	10,056	0.0	53.4
2016年1月末	10,056	0.0	57.6
2月末	10,056	0.0	42.0
3月末	10,056	0.0	5.2
4月末	10,056	0.0	5.4
5月末	10,055	△ 0.0	0.1
6月末	10,055	△ 0.0	1.9
7月末	10,054	△ 0.0	19.3
8月末	10,054	△ 0.0	45.8
9月末	10,053	△ 0.0	26.0
10月末	10,053	△ 0.0	3.4
11月末	10,052	△ 0.0	26.7
(期末) 2016年12月9日	10,052	△ 0.0	28.1

(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：10,056円 期末：10,052円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

公社債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

国	買付額	売付額
国内	千円 436,874,861	千円 — (409,652,750)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子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		期 末	
買 付	売 付	買 付	売 付
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
613 国庫短期証券 2016/9/12	38,290,545		
601 国庫短期証券 2016/7/19	32,440,634		
611 国庫短期証券 2016/9/5	32,020,679		
591 国庫短期証券 2016/5/30	27,000,600		
629 国庫短期証券 2016/11/28	21,440,750		
609 国庫短期証券 2016/8/22	18,650,416		
632 国庫短期証券 2016/12/12	18,230,651		
610 国庫短期証券 2016/8/29	18,200,396		
596 国庫短期証券 2016/6/20	17,520,381		
533 国庫短期証券 2016/5/20	17,450,349		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期	当 期		期 末		残存期間別組入比率		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入率	5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	29,310,000	29,310,563	28.1	—	—	—	28.1

(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)

区 分	銘 柄	年利率	当 期		期 末		償還年月日
			額面金額	評価額	額面金額	評価額	
		%	千円	千円	千円	千円	
国債証券	632 国庫短期証券	—	18,230,000	18,230,147	18,230,147	18,230,147	2016/12/12
	634 国庫短期証券	—	3,720,000	3,720,073	3,720,073	3,720,073	2016/12/19
	635 国庫短期証券	—	7,360,000	7,360,342	7,360,342	7,360,342	2016/12/26
合計	銘柄数		3銘柄				
	金額		29,310,000	29,310,563	29,310,563	29,310,563	

(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
	千円	%
公社債	29,310,563	27.2
コール・ローン等、その他	78,355,232	72.8
投資信託財産総額	107,665,795	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	107,665,795,581円
コール・ローン等	78,354,409,362
公社債(評価額)	29,310,563,469
その他未収収益	822,750
(B)負債	3,360,063,840
未払金	3,360,063,840
(C)純資産総額(A-B)	104,305,731,741
元本	103,766,716,434
次期繰越損益金	539,015,307
(D)受益権総口数	103,766,716,434口
1万円当り基準価額(C/D)	10,052円

*期首における元本額は4,068,192,218円、当期中における追加設定元本額は128,013,693,034円、同解約元本額は28,315,168,818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、ダイワ米ドル・プルファンド(適格機関投資家専用)512,014,302円、ダイワ米ドル・ベアファンド(適格機関投資家専用)11,755,926,415円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-07(為替ヘッジあり/限定追加型)995円、通貨選択型米国リート・αクワトロ(毎月分配型)159,141円、通貨選択型アメリカン・エクイティ・αクワトロ(毎月分配型)159,141円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10(為替ヘッジあり)995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10(為替ヘッジあり)995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-12(為替ヘッジあり)995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-02(為替ヘッジあり/限定追加型)995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08(為替ヘッジあり/限定追加型)995円、ダイワ/ロジャーズ国際コモディティ™・ファンド15,363,351円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)ブラジル・レアル・コース(毎月分配型)998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)アジア通貨・コース(毎月分配型)998円、ダイワTOP I Xベア・ファンド(適格機関投資家専用)89,575,789,270円、ダイワユーロベア・ファンド(3倍、非リバランス型)(適格機関投資家専用)1,501,723,555円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券α(毎月分配型)9,949円、ダイワ米国国債7-10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ-U S トライアングル-351,635,806円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド-予想分配金提示型-53,926,540円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,052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	△ 31,874,427円
受取利息	△ 7,919,727
その他収益金	822,750
支払利息	△ 24,777,450
(B) 有価証券売買損益	△ 1,748,531
売買益	39
売買損	△ 1,748,570
(C) その他費用	△ 248,630
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 33,871,588
(E) 前期繰越損益金	22,707,764
(F) 解約差損益金	△ 153,699,691
(G) 追加信託差損益金	703,878,822
(H) 合計 (D + E + F + G)	539,015,307
次期繰越損益金 (H)	539,015,307

(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。