

★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、分配を行な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（1万円当り。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（1万円当り）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、上記の分配を行な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61期	（決算日	2017年11月17日）
第62期	（決算日	2017年12月18日）
第63期	（決算日	2018年1月17日）
第64期	（決算日	2018年2月19日）
第65期	（決算日	2018年3月19日）
第66期	（決算日	2018年4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66期の決算を行ないました。

ここに、第61期～第66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	
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		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		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		0.0	99.1	10,957	
49期末 (2016年11月17日)	8,491	30		0.1	98.9	10,827	
50期末 (2016年12月19日)	8,990	30		0.0	97.2	11,028	
51期末 (2017年1月17日)	9,054	30		0.1	98.6	10,945	
52期末 (2017年2月17日)	9,188	30		0.3	98.0	10,825	
53期末 (2017年3月17日)	9,184	30		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		0.1	98.0	9,587	
56期末 (2017年6月19日)	8,937	30		0.0	97.1	9,297	
57期末 (2017年7月18日)	9,384	30		5.3	—	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	—	8,544	
60期末 (2017年10月17日)	9,344	30	△ 0.6	—	98.0	8,149	
61期末 (2017年11月17日)	9,128	30	△ 2.0	—	98.9	7,811	
62期末 (2017年12月18日)	9,156	30		0.6	—	98.4	7,601
63期末 (2018年1月17日)	9,378	30		2.8	—	99.0	7,675
64期末 (2018年2月19日)	8,900	30	△ 4.8	—	99.4	7,091	
65期末 (2018年3月19日)	8,686	30	△ 2.1	—	98.8	6,787	
66期末 (2018年4月17日)	8,815	30		1.8	—	6,804	

(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。

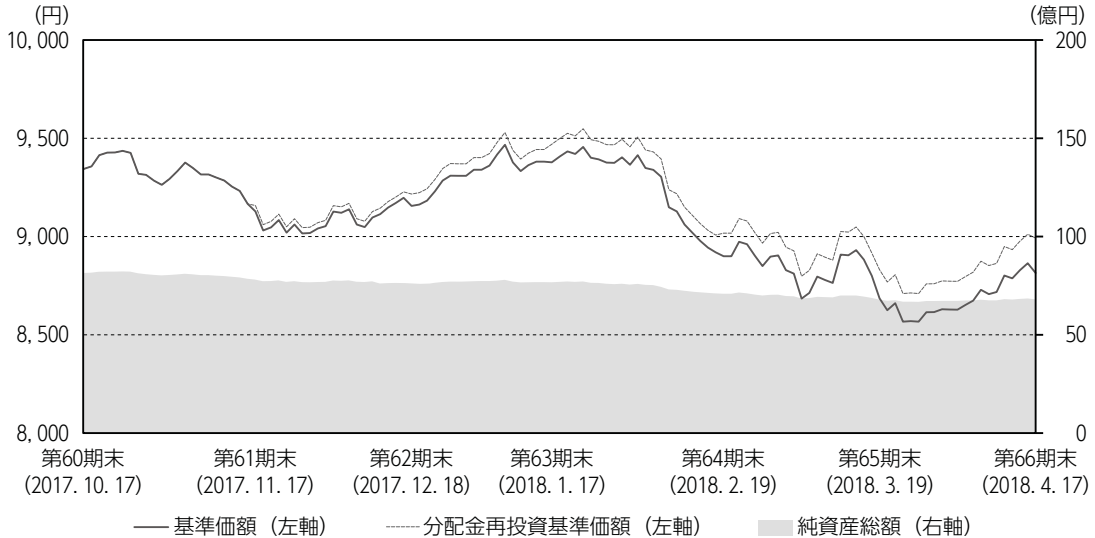
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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61期首：9,344円

第66期末：8,815円（既払分配金180円）

騰落率：△3.8%（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りましたが、豪ドルが対円で下落したため、当ファンドの基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ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61期	(期首) 2017年10月17日	9,344	—	—	98.0
	10月末	9,263	△ 0.9	—	98.1
	(期末) 2017年11月17日	9,158	△ 2.0	—	98.9
第62期	(期首) 2017年11月17日	9,128	—	—	98.9
	11月末	9,041	△ 1.0	—	98.3
	(期末) 2017年12月18日	9,186	0.6	—	98.4
第63期	(期首) 2017年12月18日	9,156	—	—	98.4
	12月末	9,340	2.0	—	98.8
	(期末) 2018年1月17日	9,408	2.8	—	99.0
第64期	(期首) 2018年1月17日	9,378	—	—	99.0
	1月末	9,365	△ 0.1	—	99.1
	(期末) 2018年2月19日	8,930	△ 4.8	—	99.4
第65期	(期首) 2018年2月19日	8,900	—	—	99.4
	2月末	8,904	0.0	0.0	98.7
	(期末) 2018年3月19日	8,716	△ 2.1	—	98.8
第66期	(期首) 2018年3月19日	8,686	—	—	98.8
	3月末	8,630	△ 0.6	—	99.1
	(期末) 2018年4月17日	8,845	1.8	—	99.0

(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. 10. 18 ~ 2018. 4. 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長期年限の金利は横ばいとなりました。

第61期首より、ECB（欧州中央銀行）が量的緩和の延長を決定する中で金利は低下しました。2017年12月以降は、米国の税制改革法が成立したことを背景に市場のリスク選好度が強まったことや、日本およびユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、金利は上昇傾向となりました。2018年2月以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことなどをを受けて市場のリスク回避姿勢が強まり、長期年限の金利は低下しました。

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。オーストラリアの投資適格社債のスプレッドは、需給とファンダメンタルズ両面の好材料に支えられました。活発な取引を伴いながら需給環境は順調で、良好なファンダメンタルズも相まって、スプレッドは縮小しました。

**■ 為替相場**

豪ドルは、当作成期間を通して下落（円高）しました。

第61期首より、オーストラリアのCPI（消費者物価指数）が市場予想を下回ったことなどから豪ドル円は下落しました。2017年12月以降は、オーストラリアの経済指標に堅調なものが見られたことなどから、豪ドル円は上昇しました。しかし2018年2月以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円高豪ドル安が進みました。また、オーストラリアの主要輸出品目である鉄鉱石の価格が下落したことも、豪ドル安の材料となりました。

## 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。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。

## ポートフォリオについて

(2017. 10. 18 ~ 2018. 4. 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61期から第66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61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
	2017年10月18日 ～2017年11月17日	2017年11月18日 ～2017年12月18日	2017年12月19日 ～2018年1月17日	2018年1月18日 ～2018年2月19日	2018年2月20日 ～2018年3月19日	2018年3月20日 ～2018年4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	0.34	0.34	0.34
当期の収益（円）	25	30	30	26	28	30
当期の収益以外（円）	4	—	—	3	1	—
翌期繰越分配対象額（円）	1,085	1,085	1,088	1,085	1,083	1,086

（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61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
(a) 経費控除後の配当等収益	25.87円	30.45円	33.48円	26.24円	28.31円	32.94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	466.35	466.65	466.95	467.20	467.51	467.83
(d) 分配準備積立金	<u>622.79</u>	618.38	618.53	<u>621.77</u>	<u>617.70</u>	615.70
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,115.03	1,115.49	1,118.97	1,115.22	1,113.54	1,116.48
(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)	1,085.03	1,085.49	1,088.97	1,085.22	1,083.54	1,086.48

（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

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、今後もある程度の募集があ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、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	第61期～第66期 (2017. 10. 18～2018. 4. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	53円	0.581%	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9,086円です。
(投信会社)	(15)	(0.161)	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)	(0.404)	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	53	0.585	

(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

(1) 投資信託受益証券

(2017年10月18日から2018年4月17日まで)

決算期	第 61 期 ~ 第 66 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国 (邦貨建)	1,714.54	173,452	9,921.376	1,010,000

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年10月18日から2018年4月17日まで)

決算期	第 61 期 ~ 第 66 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	—	—	53,752	54,000

(注) 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10月18日から2018年4月17日まで)

第 61 期 ~ 第 66 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
				DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	9,921.376	1,010,000	101

(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61期~第66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

(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 66 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千□	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)	68,391.171	6,737,693	99.0

(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。

(2) 親投資信託残高

種 類	第60期末		第 66 期 末	
	□ 数	評 価 額	□ 数	評 価 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネーポートフォリオ・ マザーファンド	53,926	173	174	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年4月17日現在

項 目	第 66 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 6,737,693	% 98.4
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	174	0.0
コール・ローン等、その他	108,550	1.6
投資信託財産総額	6,846,418	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11月17日)、(2017年12月18日)、(2018年1月17日)、(2018年2月19日)、(2018年3月19日)、(2018年4月17日) 現在

項 目	第61期末	第62期末	第63期末	第64期末	第65期末	第66期末
<b>(A) 資産</b>	<b>7,880,526,068円</b>	<b>7,772,666,874円</b>	<b>7,721,754,979円</b>	<b>7,128,344,644円</b>	<b>6,837,269,111円</b>	<b>6,846,418,355円</b>
コール・ローン等	101,530,971	93,179,924	125,866,712	82,400,853	128,963,518	108,550,735
投資信託受益証券 (評価額)	7,724,820,495	7,479,312,367	7,595,713,683	7,045,769,225	6,708,131,027	6,737,693,071
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額)	54,174,602	174,584	174,584	174,566	174,566	174,549
未収入金	—	199,999,999	—	—	—	—
<b>(B) 負債</b>	<b>68,593,700</b>	<b>171,255,218</b>	<b>46,733,379</b>	<b>37,066,678</b>	<b>50,033,601</b>	<b>42,212,304</b>
未払金	—	100,000,000	—	—	—	—
未払収益分配金	25,673,486	24,907,388	24,551,292	23,902,626	23,441,610	23,155,730
未払解約金	34,854,884	38,602,346	14,637,888	5,078,571	20,090,445	12,497,919
未払信託報酬	8,009,724	7,636,859	7,384,308	7,870,946	6,243,289	6,256,952
その他未払費用	55,606	108,625	159,891	214,535	258,257	301,703
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>7,811,932,368</b>	<b>7,601,411,656</b>	<b>7,675,021,600</b>	<b>7,091,277,966</b>	<b>6,787,235,510</b>	<b>6,804,206,051</b>
元本	8,557,828,884	8,302,462,813	8,183,764,265	7,967,542,201	7,813,870,287	7,718,576,710
次期繰越損益金	△ 745,896,516	△ 701,051,157	△ 508,742,665	△ 876,264,235	△ 1,026,634,777	△ 914,370,659
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>8,557,828,884口</b>	<b>8,302,462,813口</b>	<b>8,183,764,265口</b>	<b>7,967,542,201口</b>	<b>7,813,870,287口</b>	<b>7,718,576,710口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	9,128円	9,156円	9,378円	8,900円	8,686円	8,815円

\* 第60期末における元本額は8,721,034,930円、当作成期間 (第61期~第66期) 中における追加設定元本額は34,567,170円、同解約元本額は1,037,025,390円です。

\* 第66期末の計算口数当りの純資産額は8,815円です。

\* 第66期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は914,370,659円です。

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 -

■損益の状況

項 目	第61期 自2017年10月18日 至2017年11月18日	第62期 自2017年12月18日 至2018年1月18日	第63期 自2017年12月19日 至2018年2月19日	第64期 自2018年1月17日 至2018年2月19日	第65期 自2018年2月20日 至2018年3月20日	第66期 自2018年3月19日 至2018年4月17日
(A) 配当等収益	30,213,952円	29,379,883円	28,386,932円	28,835,361円	28,415,717円	26,735,900円
受取配当金	30,218,702	29,384,103	28,391,770	28,839,491	28,420,151	26,740,116
受取利息	20	6	16	34	6	71
支払利息	△ 4,770	△ 4,226	△ 4,854	△ 4,164	△ 4,440	△ 4,287
(B) 有価証券売買損益	△ 181,371,240	△ 25,805,611	△ 185,879,424	△ 377,968,001	△ 165,958,058	△ 102,465,366
売買益	1,078,304	27,699,708	187,860,303	2,090,960	1,498,012	102,798,085
売買損	△ 182,449,544	△ 1,894,097	△ 1,980,879	△ 380,058,961	△ 167,456,070	△ 332,719
(C) 信託報酬等	△ 8,065,330	△ 7,689,878	△ 7,435,574	△ 7,925,590	△ 6,287,011	△ 6,301,181
(D) 当期繰越益金 (A + B + C)	△ 159,222,618	△ 47,495,616	△ 206,830,782	△ 357,058,230	△ 143,829,352	△ 122,900,085
(E) 前期繰越益金	△ 770,337,654	△ 926,288,022	△ 890,342,868	△ 689,084,864	△ 1,048,883,884	△ 1,200,698,833
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	209,337,242 ( 399,102,479)	202,648,637 ( 387,437,619)	199,320,713 ( 382,147,167)	193,781,485 ( 372,245,756)	189,520,069 ( 365,307,318)	186,583,819 ( 361,099,565)
(売買損益相当額)	(△ 189,765,237)	(△ 184,788,982)	(△ 182,826,454)	(△ 178,464,271)	(△ 175,787,249)	(△ 174,515,746)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 720,223,030	△ 676,143,769	△ 484,191,373	△ 852,361,609	△ 1,003,193,167	△ 891,214,929
(H) 収益分配金 次期繰越益金 (G + H)	△ 25,673,486 △ 745,896,516	△ 24,907,388 △ 701,051,157	△ 24,551,292 △ 508,742,665	△ 23,902,626 △ 876,264,235	△ 23,441,610 △ 1,026,634,777	△ 23,155,730 △ 914,370,659
追加信託差損益金 (配当等相当額)	209,337,242 ( 399,102,479)	202,648,637 ( 387,437,619)	199,320,713 ( 382,147,167)	193,781,485 ( 372,245,756)	189,520,069 ( 365,307,318)	186,583,819 ( 361,099,565)
(売買損益相当額)	(△ 189,765,237)	(△ 184,788,982)	(△ 182,826,454)	(△ 178,464,271)	(△ 175,787,249)	(△ 174,515,746)
分配準備積立金	529,453,943	513,788,462	509,044,953	492,407,953	481,356,897	477,515,824
繰越損益金	△ 1,484,687,701	△ 1,417,488,256	△ 1,217,108,331	△ 1,562,453,673	△ 1,697,511,743	△ 1,578,470,302

(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61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
(a) 経費控除後の配当等収益	22,146,207円	25,285,558円	27,401,713円	20,909,766円	22,128,699円	25,432,181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	399,102,479	387,437,619	382,147,167	372,245,756	365,307,318	361,099,565
(d) 分配準備積立金	532,981,222	513,410,292	506,194,532	495,400,813	482,669,808	475,239,373
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	954,229,908	926,133,469	915,743,412	888,556,335	870,105,825	861,771,119
(f) 分配金	25,673,486	24,907,388	24,551,292	23,902,626	23,441,610	23,155,730
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	928,556,422	901,226,081	891,192,120	864,653,709	846,664,215	838,615,389
(h) 受益権総口数	8,557,828,884口	8,302,462,813口	8,183,764,265口	7,967,542,201口	7,813,870,287口	7,718,576,710口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万 口 当 り 分 配 金	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期
	30円	30円	30円	30円	30円	30円
(単 価)	(9, 128円)	(9, 156円)	(9, 378円)	(8, 900円)	(8, 686円)	(8, 815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

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」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」は「クラスA」と表記しております。

（注）2018年4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
<b>資産合計</b>		<b>261,758,765</b>

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
<b>負債合計</b>		<b>8,109,607</b>
<b>純資産</b>	\$	<b>253,649,158</b>
<b>純資産</b>		
クラス A	\$	117,145,856
通貨αクラス		136,503,302
	\$	<b>253,649,158</b>
<b>発行済み受益証券口数</b>		
クラス A		98,919,563
通貨αクラス		166,388,227
<b>受益証券1口当り純資産額</b>		
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
<b>投資収益合計</b>		<b>10,086,976</b>

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
<b>費用合計</b>		<b>2,594,655</b>

<b>投資純利益</b>		<b>7,492,321</b>
--------------	--	------------------

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)
<b>純実現益</b>		<b>2,642,607</b>

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
<b>評価益の純変動</b>		<b>18,499,594</b>

<b>純実現・純評価益</b>		<b>21,142,201</b>
-----------------	--	-------------------

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



投資明細表  
2017年3月31日

	元本	銘柄	評価額
		<b>債券 (82.4%)</b>	
		<b>オーストラリア (67.0%)</b>	
		<b>社債 (67.0%)</b>	
		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 –

	<u>元本</u>	<u>銘柄</u>	<u>評価額</u>
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
		<b>社債合計</b>	<b>169,942,729</b>
		<b>オーストラリア合計 (簿価 \$154,980,495)</b>	<b>169,942,729</b>
		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
		<b>社債合計</b>	<b>5,065,135</b>
		<b>カナダ合計 (簿価 \$5,000,000)</b>	<b>5,065,135</b>
		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
		<b>社債合計</b>	<b>3,553,378</b>
		<b>フランス合計 (簿価 \$3,494,826)</b>	<b>3,553,378</b>
		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
		<b>社債合計</b>	<b>5,121,206</b>
		<b>オランダ合計 (簿価 \$4,947,911)</b>	<b>5,121,206</b>
		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
		<b>社債合計</b>	<b>3,164,968</b>
		<b>ニュージーランド合計 (簿価 \$2,971,877)</b>	<b>3,164,968</b>
		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>
		<b>社債合計</b>	<b>12,118,044</b>
		スウェーデン合計 (簿価 \$12,000,000)	<b>12,118,044</b>
		スイス (2.0%)	
		<b>社債 (2.0%)</b>	
		Credit Suisse AG (b)	
AUD	5,000,000	2.92% due 04/29/20	5,018,940
		<b>社債合計</b>	<b>5,018,940</b>
		スイス合計 (簿価 \$5,000,000)	<b>5,018,940</b>
		米国 (2.0%)	
		<b>社債 (2.0%)</b>	
		Citigroup, Inc. (b)	
AUD	5,000,000	3.02% due 08/07/19	5,015,650
		<b>社債合計</b>	<b>5,015,650</b>
		米国合計 (簿価 \$5,000,000)	<b>5,015,650</b>
		債券合計 (簿価 \$193,395,109)	<b>209,000,050</b>
	<u>株数</u>	<b>優先株式 (12.5%)</b>	
		<b>オーストラリア (12.5%)</b>	
		<b>銀行 (3.9%)</b>	
	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
			<b>10,243,969</b>
		<b>総合金融サービス (0.6%)</b>	
	14,221	Macquarie Group, Ltd. (a), (b), (c)	1,472,300
		<b>総合持株会社 (0.6%)</b>	
	18,710	Seven Group Holdings, Ltd. (a), (b), (c)	1,426,451
		<b>保険 (0.3%)</b>	
	6,110	AMP, Ltd. (a), (b), (c)	644,422
		<b>不動産投資信託 (REIT) (7.1%)</b>	
	125,764	Goodman PLUS Trust (a), (b), (c)	12,689,588
	69,468	Multiplex SITES Trust (a), (b), (c)	5,293,600
			<b>17,983,188</b>

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（2017年12月11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66期の決算日（2018年4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10月18日から2018年4月17日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
707 国庫短期証券 2017/12/11	千円 490,003		
723 国庫短期証券 2018/3/5	400,003		千円

(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

2018年4月17日現在、有価証券等の組み入れはありません。

# 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9期 (決算日 2017年12月11日)

(計算期間 2016年12月10日～2017年12月11日)

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの第9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

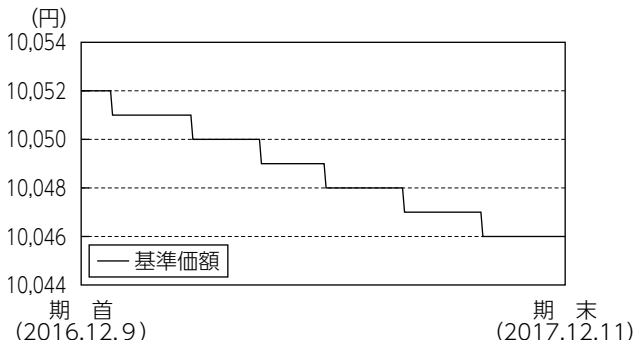
## 大和投資信託

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 円	公 社 債 率	
		騰 落 率 %	組 入 比 率 %
(期首)2016年12月9日	10,052	-	28.1
12月末	10,052	0.0	-
2017年1月末	10,051	△0.0	31.1
2月末	10,051	△0.0	25.0
3月末	10,050	△0.0	-
4月末	10,049	△0.0	35.2
5月末	10,049	△0.0	5.5
6月末	10,048	△0.0	0.5
7月末	10,048	△0.0	0.1
8月末	10,047	△0.0	-
9月末	10,047	△0.0	-
10月末	10,046	△0.1	-
11月末	10,046	△0.1	-
(期末)2017年12月11日	10,046	△0.1	-

- (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：10,052円 期末：10,046円 騰落率：△0.1%

【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「長短金利操作付き量の・質的金融緩和」を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券(3カ月物)の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行いません。

◆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いません。

◆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、安定的な運用を行いません。

■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 (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は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

国 内	買 付 額 千円	売 付 額 千円

- (注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。  
 (注2) ( )内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。  
 (注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額 千円	銘 柄	金 額 千円
645 国庫短期証券 2017/2/20	46,711,084		
657 国庫短期証券 2017/4/17	31,380,607		
659 国庫短期証券 2017/4/24	30,090,880		
669 国庫短期証券 2017/6/12	29,100,894		
652 国庫短期証券 2017/3/27	27,220,217		
642 国庫短期証券 2017/2/6	25,890,391		
644 国庫短期証券 2017/5/12	22,760,976		
651 国庫短期証券 2017/3/21	21,610,540		
660 国庫短期証券 2017/5/1	15,890,292		
638 国庫短期証券 2017/1/16	12,400,099		

- (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

当期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	127,401,750	100.0
投資信託財産総額	127,401,750	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12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	127,401,750,032円
コール・ローン等	127,401,750,032
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	127,401,750,032
元本	126,824,072,530
次期繰越損益金	577,677,502
(D) 受益権総口数	126,824,072,530口
1万口当り基準価額(C / D)	10,046円

\* 期における元本額は103,766,716,434円、当期中における追加設定元本額は73,674,203,533円、同解約元本額は50,616,847,437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) 4,467,705,309円、ダイワ米ドル・ベアファンド(適格機関投資家専用) 16,890,565,266円、ダイワ・マネーポートフォリオ(FOFs用)(適格機関投資家専用) 69,673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) 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) II 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、日本株カムイA1戦略ファンド59,719,320円、ダイワJPX日経400ベア・ファンド(適格機関投資家専用) 3,285,486,762円、ダイワユーロベア・ファンド(2倍、非リバランス型)(適格機関投資家専用) 2,297,118,764円、ダイワ米ドルベア・ファンド(2倍、非リバランス型)(適格機関投資家専用) 35,118,078,983円、ダイワ/ロジャーズ国際コモディティ<sup>TM</sup>・ファンド9,393,201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TOPIXベア・ファンド(適格機関投資家専用) 64,694,720,539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 - 703,716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 - 173,802円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,046円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月10日 至2017年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 75,315,912円
受取利息	△ 9,781,131
支払利息	△ 65,534,781
(B) 有価証券売買損益	△ 15,183
売買損	△ 15,183
(C) その他費用	△ 889,297
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 76,220,392
(E) 前期繰越損益金	539,015,307
(F) 解約差損益金	△ 243,233,880
(G) 追加信託差損益金	358,116,467
(H) 合計(D + E + F + G)	577,677,502
次期繰越損益金(H)	577,677,502

(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。