

★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／資産複合	
信託期間	5年間（2012年12月21日～2017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ないます。	
主要投資対象	当ファンド	イ．ケイマン籍の外国投資信託「ＵＢＳエマージング・マーケッツ・ハイインカム・ファンド エクイティ・プラス（円ヘッジ）」（以下「エマージング・ハイインカム・プラス」といいます。）の受益証券（円建） ロ．ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券
当ファンドの運用方法	①主として、エマージング・ハイインカム・プラスの受益証券を通じて、新興国のハイインカム債券に投資し、その利息収益相当額で毎月新興国株式に投資することにより株式の値上がり益の獲得もはかり、信託財産の成長をめざします。 ②新興国のハイインカム債券の運用にあたっては、高水準の利息収益の獲得をめざしてポートフォリオの構築を行ないます。 ③新興国株式への投資は、原則として毎月新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）を通じて行ない、その投資額を積み立てることにより値上がり益の獲得をめざします。 ④外貨建資産への投資にあたっては、主として米ドル売り日本円買いの為替予約取引等により、為替変動リスクの低減をめざします。 ※ＥＴＦを通じて投資する新興国株式部分については、新興国通貨の米ドルに対する為替変動リスクがあります。 ⑤当ファンドは、エマージング・ハイインカム・プラスとダイワ・マネーアセット・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、エマージング・ハイインカム・プ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。	
マザーファンドの運用方法	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。	
投資信託証券組入制限	無制限	
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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

ダイワ新興国
ハイインカム・プラス
ーインカムチェンジ（積立型）ー

運用報告書（全体版）
満期償還

（償還日 2017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、「ダイワ新興国ハイインカム・プラス ーインカムチェンジ（積立型）ー」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
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/>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配 金	期 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末 (2013年12月20日)	9,409	0	△ 5.9	0.1	97.5	24,261
2 期末 (2014年12月22日)	8,921	0	△ 5.2	0.0	98.3	11,370
3 期末 (2015年12月21日)	8,849	0	△ 0.8	0.0	98.1	7,818
4 期末 (2016年12月20日)	9,781	0	10.5	0.0	97.7	5,024
償 還 (2017年12月20日)	10,873.22	—	11.2	—	—	3,143

(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) 当ファンドは主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。外国籍ファンドでは新興国のハイインカム債券に投資し、その利息収益相当額で新興国株式に積立投資を行ないます。当ファンドの値動きを表す適切な指数がないため、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

設定時：10,000円

償還時：10,873円22銭

騰落率：8.7%

基準価額の主な変動要因

米ドル建て新興国債・社債（主にハイ・イールド債）および米ドル建てETF（上場投資信託証券）を通じて新興国の株式へ投資した結果、2016年以降の米ドル建て新興国債・社債や新興国の株式の上昇を反映し、基準価額は上昇しました。外貨建資産への投資にあたっては、米ドル売り／日本円買いの為替予約取引により、為替変動リスクの低減をめざしたため米ドル円為替相場の変動の基準価額への影響は軽微でした。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。

ダイワ新興国ハイインカム・プラス　－インカムチェンジ（積立型）－

年　　月　　日	基　　準	価　　額	公　　社　　債 組　入　比　率	投　資　信　託 受　益　証　券 組　入　比　率
		騰　落　率		
(期首)2016年12月20日	円	%	%	%
	9,781	—	0.0	97.7
12月末	9,866	0.9	—	97.9
2017年 1 月末	10,115	3.4	0.0	98.8
2 月末	10,304	5.3	0.0	99.5
3 月末	10,394	6.3	—	98.1
4 月末	10,506	7.4	0.0	99.1
5 月末	10,628	8.7	0.0	97.6
6 月末	10,546	7.8	0.0	98.0
7 月末	10,769	10.1	0.0	99.3
8 月末	10,929	11.7	—	98.9
9 月末	10,910	11.5	—	99.0
10月末	11,076	13.2	—	98.9
11月末	10,881	11.2	—	—
(償還)2017年12月20日	10,873.22	11.2	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2012. 12. 21 ~ 2017. 12. 20)

■米ドル建て新興国国債市況

設定以来の米ドル建て新興国国債市況は、2014年後半までは一進一退の動きとなったものの、その後は堅調な推移となりました。

2013年はF R B（米国連邦準備制度理事会）のバーナンキ議長が量的金融緩和の早期縮小に言及したことをきっかけに米国で金利が急上昇したことや、投資家のリスク回避姿勢の強まりからスプレッド（米国国債との利回りの差）が拡大したことにより、下落しました。2014年は米国長期金利の低下は上昇要因となったものの、原油価格の下落が止まらず世界経済に対する不安が広がったことや、ロシアが通貨防衛のため大幅な緊急利上げを実施したにもかかわらずロシア・ルーブルが急落したことなどから、リスク回避の動きが強まりスプレッドが拡大し、下落しました。2015年はウクライナ停戦合意などのロシアをめぐる地政学リスクの後退や中国の金融緩和の実施などを受けて投資家心理が改善し、スプレッドが縮小したことから、上昇しました。2016年は米国の大統領に選出されたトランプ氏の政策への期待や利上げなどを背景とした米国金利の上昇が一時的な下落要因となりましたが、原油相場の上昇などを背景としてスプレッドの縮小が年を通じて継続したため、上昇しました。2017年は、5月にかけて投資家の利回りを求める需要から緩やかなスプレッドの縮小が続き、上昇を続けました。

■米ドル建て新興国社債市況

設定以来の米ドル建て新興国社債市況は上昇しました。

米ドル建て新興国国債市況とおおむね連動した動きとなりましたが、下落局面で新興国国債よりも下落幅が小さかったことから、相対的に上昇幅は大きくなりました。セクター別では、全般的に上昇した中、紙・パルプが堅調でした。一方で、インフラ（社会基盤）は下落しました。

■新興国株式市況

設定以来の新興国株式（現地通貨ベース）は上昇しました。

設定時から2015年末までは軟調な展開が続きましたが、2016年2月に商品市況が底入れしたことをきっかけとして、ブラジルやロシアなどの資源国を中心に上昇しました。新興国株式市況（米ドルベース）は、米ドル高新興国通貨安の影響により、相対的に上昇幅は小さくなりました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

UBS エマージング・マーケット・ハイインカム・ファンド エクイティ・プラス（円ヘッジ）（以下「エマージング・ハイインカム・プラス」といいます。）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。通常の状態、エマージング・ハイインカム・プ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。

■エマージング・ハイインカム・プラス

新興国のハイインカム債券の運用にあたっては、高水準の利息収益の獲得をめざしてポートフォリオの構築を行ないます。新興国株式への投資は、原則として毎月新興国株式の指数を対象指数としたETFを通じて行ない、その投資額を積み立てることにより値上がり益の獲得をめざします。外貨建資産への投資にあたっては、主として米ドル売り／日本円買いの為替予約取引等により、為替変動リスクの低減をめざします（ETFを通じて投資する新興国株式部分については、新興国通貨の米ドルに対する為替変動リスクがあります）。

■ダイワ・マネーアセット・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

（2012. 12. 21 ～ 2017. 12. 20）

■当ファンド

エマージング・ハイインカム・プラスとダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資しました。また、エマージング・ハイインカム・プラスへの投資比率は、高位を維持しました。

■エマージング・ハイインカム・プラス

新興国のハイインカム債券の運用にあたっては、高水準の利息収益の獲得をめざしてポートフォリオの構築を行ないました。新興国株式への投資は、新興国のハイインカム債券から得られる利息収益相当額を毎月新興国株式の指数を対象指数としたETFを通じて行ないました。外貨建資産への投資にあたっては、主として米ドル売り／日本円買いの為替予約取引等により、為替変動リスクの低減をめざしました。

※新興国のハイインカム債券とは、主として米ドル建ての相対的に利回りが高いと判断される、新興国企業が発行する社債、および新興国政府が発行する国債等をいいます。

■ダイワ・マネーアセット・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

信託期間中の収益分配金につきましては、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、見送らせていただきました。

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	当 期 (2016. 12. 21～2017. 12. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	135円	1. 274%	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, 605円です。
(投 信 会 社)	(40)	(0. 378)	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)	(92)	(0. 864)	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. 032)	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	40	0. 382	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
(投資信託受益証券)	(40)	(0. 382)	
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. 005	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. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	176	1. 661	

(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

(2016年12月21日から2017年12月20日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	—	—	47,665.628	5,459,077

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 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12月21日から2017年12月20日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー アセット・ マザーファンド	—	—	1,527	1,529

(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12月21日から2017年12月20日まで)

当 期				期 付			
買 付		売 付		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
				UBS EMERGING MARKETS HIGH INCOME FUND EQUITY PLUS (JPY HEDGED) (ケイマン諸島)	47,665,628	5,459,077	114

(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) ダイワ・マネーアセット・マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2016年12月21日から2017年12月20日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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	33,310	6,560	19.7	—	—	—
コール・ローン	3,023,582	—	—	—	—	—

(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ペーパ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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	□ 数
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	千口 1, 527

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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, 167, 386	100. 0
投資信託財産総額	3, 167, 386	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20日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	3, 167, 386, 258円
コール・ローン等	3, 167, 386, 258
(B) 負債	23, 591, 955
未払信託報酬	23, 586, 969
未払利息	4, 986
(C) 純資産総額 (A－B)	3, 143, 794, 303
元本	2, 891, 319, 090
償還差損益金	252, 475, 213
(D) 受益権総口数	2, 891, 319, 090口
1万口当り償還価額 (C／D)	10, 873円22銭

* 期首における元本額は5, 136, 475, 626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2, 245, 156, 536円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は10, 873円22銭です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月21日 至 2017年12月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 193, 695円
受取利息	14, 755
支払利息	△ 208, 450
(B) 有価証券売買損益	370, 318, 991
売買益	510, 552, 082
売買損	△ 140, 233, 091
(C) 信託報酬等	△ 54, 445, 416
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	315, 679, 880
(E) 前期繰越損益金	△ 63, 188, 992
(F) 追加信託差損益金	△ 15, 675
(配当等相当額)	(32)
(売買損益相当額)	(△ 15, 707)
(G) 合計 (D＋E＋F)	252, 475, 213
償還差損益金 (G)	252, 475, 213

(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。

投資信託財産運用総括表					
信託期間	投資信託契約締結日	2012年12月21日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2017年12月20日		資産総額	3,167,386,258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	23,591,955円
				純資産総額	3,143,794,303円
受益権口数	31,417,965,144口	2,891,319,090口	△28,526,646,054口	受益権口数	2,891,319,090口
元本額	31,417,965,144円	2,891,319,090円	△28,526,646,054円	1単位当り償還金	10,873円22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	25,785,840,192	24,261,187,520	9,409	0	0.00
第2期	12,746,395,332	11,370,619,592	8,921	0	0.00
第3期	8,835,312,683	7,818,582,678	8,849	0	0.00
第4期	5,136,475,626	5,024,191,494	9,781	0	0.00

(注) 1単位は受益権1万口。

償還金のお知らせ	
1万口当り償還金	10,873円22銭

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。

UBSエマージング・マーケット・ハイインカム・ファンド エクイティ・プラス（円ヘッジ）

当ファンド（ダイワ新興国ハイインカム・プラス –インカムチェンジ（積立型）–）はケイマン籍の外国投資信託「UBSエマージング・マーケット・ハイインカム・ファンド エクイティ・プラス（円ヘッジ）」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）2017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。

（米ドル建て）

財政状態計算書
2016年11月30日

資産	
流動資産	
金融資産（損益通算後の評価額）	\$ 82,691,158
現金および現金同等物	1,969,884
未収：	
利息	1,002,050
先物取引にかかる証拠金勘定	111,630
資産合計	85,774,722
負債	
流動負債	
金融負債（損益通算後の評価額）	5,990,288
未払：	
償還済受益証券	524,990
運用会社報酬	95,288
専門家報酬	73,103
管理会社報酬	30,430
保管会社報酬	28,832
名義書換代理人報酬	13,534
受託会社報酬	4,139
負債（償還可能受益証券の所有者に帰属する純資産を除く）	6,760,604
償還可能受益証券の所有者に帰属する純資産	\$ 79,014,118

包括利益計算書

2016年11月30日に終了した年度

収益

受取利息	\$	7,434,943
配当収益		202,766
損益通算後ならびに外国為替取引後の 金融資産および負債の評価額の純利益		13,263,944
損益通算後ならびに外国為替換算後の 金融資産および負債の評価額の評価益の純変動		3,218,918
収益合計		24,120,571

費用

運用会社報酬		692,478
管理会社報酬		106,382
保管会社報酬		84,479
専門家報酬		78,233
名義書換代理人報酬		27,136
受託会社報酬		12,901
取引手数料		4,648
その他費用		557
費用合計		1,006,814

営業利益

23,113,757

財務費用

税		(8,591)
償還可能な受益証券の所有者に帰属する 純資産の運用による増加額	\$	23,105,166

投資明細表
2016年11月30日

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
		債券（88.2％）		
		アルゼンチン（5.6％）		
		社債（1.7％）		
		Cablevision SA		
U S D	200,000	6.50% due 06/15/21	0.3	\$ 203,000
		Pan American Energy LLC		
U S D	500,000	7.88% due 05/07/21	0.7	521,750
		YPF SA		
U S D	300,000	8.50% due 03/23/21	0.4	315,375
U S D	250,000	8.75% due 04/04/24	0.3	257,550
		社債合計		1,297,675
		国債（3.9％）		
		Argentine Republic Government International Bond		
U S D	300,000	6.88% due 04/22/21	0.4	312,750
U S D	625,000	7.13% due 07/06/36	0.7	573,438
U S D	1,000,000	7.50% due 04/22/26	1.3	1,008,500
U S D	1,191,732	8.28% due 12/31/33	1.5	1,218,546
		国債合計		3,113,234
		アルゼンチン合計		4,410,909
		オーストリア（1.0％）		
		社債（1.0％）		
		ESAL GmbH		
U S D	750,000	6.25% due 02/05/23	0.9	713,812
		JBS Investments GmbH		
U S D	100,000	7.25% due 04/03/24	0.1	100,375
		社債合計		814,187
		オーストリア合計		814,187
		アゼルバイジャン（0.6％）		
		社債（0.4％）		
		International Bank of Azerbaijan OJSC		
U S D	300,000	5.63% due 06/11/19	0.4	295,500
		社債合計		295,500
		国債（0.2％）		
		State Oil Co. of the Azerbaijan Republic		
U S D	200,000	6.95% due 03/18/30	0.2	200,500
		国債合計		200,500
		アゼルバイジャン合計		496,000
		ブラジル（13.2％）		
		社債（8.7％）		
		Banco Bradesco SA		
U S D	600,000	5.90% due 01/16/21	0.8	618,000
		Banco BTG Pactual SA		
U S D	300,000	4.00% due 01/16/20	0.3	276,000
		Banco do Brasil SA		
U S D	800,000	5.88% due 01/26/22	1.0	795,600

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
U S D	500,000	8.50% due 10/29/49	0.6	516,250
U S D	500,000	9.00% due 06/29/49	0.6	459,375
U S D	600,000	Caixa Economica Federal 3.50% due 11/07/22	0.7	535,500
U S D	450,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA 5.75% due 10/27/21	0.6	441,990
U S D	400,000	Cia Brasileira de Aluminio 6.75% due 04/05/21	0.5	418,000
U S D	300,000	Cosan Overseas, Ltd. 8.25% due 11/29/49	0.4	295,500
U S D	400,000	GTL Trade Finance, Inc. 5.89% due 04/29/24	0.5	392,200
U S D	1,100,000	Itau Unibanco Holding SA 6.20% due 04/15/20	1.5	1,165,958
U S D	300,000	Marfrig Overseas, Ltd. 9.50% due 05/04/20	0.4	307,140
U S D	600,000	Odebrecht Finance, Ltd. 7.13% due 06/26/42	0.4	330,750
U S D	300,000	Samarco Mineracao SA 4.13% due 11/01/22	0.1	125,250
U S D	200,000	Vale Overseas, Ltd. 6.25% due 08/10/26	0.3	208,080
社債合計				6,885,593
国債（4.5%）				
U S D	900,000	Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 5.50% due 07/12/20	1.2	930,375
U S D	800,000	Brazilian Government International Bond 4.25% due 01/07/25	0.9	752,000
U S D	1,200,000	5.00% due 01/27/45	1.2	954,000
U S D	900,000	6.00% due 04/07/26	1.2	940,500
国債合計				3,576,875
ブラジル合計				10,462,468
中国（2.5%）				
社債（2.5%）				
U S D	500,000	Central China Real Estate, Ltd. 6.50% due 06/04/18	0.6	506,168
U S D	500,000	Country Garden Holdings Co., Ltd. 7.25% due 04/04/21	0.7	526,875
U S D	200,000	Franshion Development, Ltd. 6.75% due 04/15/21	0.3	227,000
U S D	200,000	Tencent Holdings, Ltd. 3.38% due 05/02/19	0.2	205,267
U S D	500,000	Trillion Chance, Ltd. 8.50% due 01/10/19	0.7	522,500
社債合計				1,987,810
中国合計				1,987,810

ダイワ新興国ハイインカム・プラス インカムチェンジ（積立型）－

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
		コロンビア（1.6%）		
		社債（1.6%）		
U S D	600,000	Banco de Bogota SA 6.25% due 05/12/26	0.8	592,998
U S D	400,000	Bancolombia SA 5.13% due 09/11/22	0.5	399,400
U S D	300,000	Ecopetrol SA 4.13% due 01/16/25	0.3	271,215
		社債合計		1,263,613
		コロンビア合計		1,263,613
		コスタリカ（0.8%）		
		社債（0.5%）		
U S D	400,000	Instituto Costarricense de Electricidad 6.95% due 11/10/21	0.5	411,500
		社債合計		411,500
		国債（0.3%）		
U S D	300,000	Costa Rica Government International Bond 5.63% due 04/30/43	0.3	241,500
		国債合計		241,500
		コスタリカ合計		653,000
		クロアチア（1.6%）		
		国債（1.6%）		
U S D	600,000	Croatia Government International Bond 6.38% due 03/24/21	0.8	651,000
U S D	550,000	6.75% due 11/05/19	0.8	595,925
		国債合計		1,246,925
		クロアチア合計		1,246,925
		ドミニカ共和国（1.5%）		
		国債（1.5%）		
U S D	700,000	Dominican Republic International Bond 5.50% due 01/27/25	0.8	672,000
U S D	500,000	6.88% due 01/29/26	0.7	518,750
		国債合計		1,190,750
		ドミニカ共和国合計		1,190,750
		エクアドル（0.8%）		
		国債（0.8%）		
U S D	650,000	Ecuador Government International Bond 7.95% due 06/20/24	0.8	593,125
		国債合計		593,125
		エクアドル合計		593,125
		エジプト（0.6%）		
		国債（0.6%）		
U S D	500,000	Egypt Government International Bond 5.88% due 06/11/25	0.6	455,625
		国債合計		455,625
		エジプト合計		455,625

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
U S D	750,000	エルサルバドル (0.8%)		
		国債 (0.8%)		
		El Salvador Government International Bond		
		7.63% due 02/01/41	0.8	643,125
		国債合計		643,125
U S D	200,000	エルサルバドル合計		643,125
		ガボン (0.2%)		
		国債 (0.2%)		
		Gabon Government International Bond		
		6.95% due 06/16/25	0.2	175,500
U S D	500,000	国債合計		175,500
		ガボン合計		175,500
		グアテマラ (0.6%)		
		社債 (0.6%)		
		Comcel Trust via Comunicaciones Celulares SA		
U S D	500,000	6.88% due 02/06/24	0.6	498,750
		社債合計		498,750
		グアテマラ合計		498,750
		香港 (1.8%)		
		社債 (1.8%)		
U S D	500,000	Shimao Property Holdings, Ltd.		
		8.13% due 01/22/21	0.7	540,625
U S D	600,000	Sun Hung Kai Properties Capital Market, Ltd.		
		3.38% due 02/25/24	0.8	610,455
		Yuexiu Property Co., Ltd.		
U S D	300,000	4.50% due 01/24/23	0.3	294,375
		社債合計		1,445,455
		香港合計		1,445,455
U S D	200,000	インドネシア (0.8%)		
		社債 (0.3%)		
		Pertamina Persero PT		
		5.25% due 05/23/21	0.3	210,000
		社債合計		210,000
U S D	400,000	国債 (0.5%)		
		Indonesia Government International Bond		
		4.75% due 01/08/26	0.5	419,500
		国債合計		419,500
		インドネシア合計		629,500
U S D	600,000	アイルランド (3.0%)		
		社債 (3.0%)		
		Gazprombank OJSC Via GPB Eurobond Finance PLC.		
		7.25% due 05/03/19	0.8	635,250
U S D	400,000	Novatek OAO via Novatek Finance DAC		
		4.42% due 12/13/22	0.5	395,080
U S D	200,000	Rosneft Oil Co. via Rosneft International Finance, Ltd.		
		4.20% due 03/06/22	0.2	195,000

ダイワ新興国ハイインカム・プラス インカムチェンジ（積立型）－

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
U S D	500,000	Russian Railways via RZD Capital PLC. 5.70% due 04/05/22	0.7	523,125
U S D	300,000	Vnesheconombank Via VEB Finance PLC. 5.94% due 11/21/23	0.4	303,750
U S D	300,000	6.80% due 11/22/25	0.4	313,125
		社債合計		2,365,330
		アイルランド合計		2,365,330
		コートジボワール (0.8%)		
		国債 (0.8%)		
U S D	693,000	Ivory Coast Government International Bond 5.75% due 12/31/32	0.8	641,025
		国債合計		641,025
		コートジボワール合計		641,025
		ジャマイカ (1.8%)		
		社債 (1.3%)		
U S D	700,000	Digicel Group, Ltd. 8.25% due 09/30/20	0.8	589,050
U S D	500,000	Digicel, Ltd. 6.75% due 03/01/23	0.5	430,000
		社債合計		1,019,050
		国債 (0.5%)		
U S D	200,000	Jamaica Government International Bond 6.75% due 04/28/28	0.3	212,500
U S D	200,000	7.88% due 07/28/45	0.2	211,250
		国債合計		423,750
		ジャマイカ合計		1,442,800
		ケニア (0.5%)		
		国債 (0.5%)		
U S D	400,000	Kenya Government International Bond 5.88% due 06/24/19	0.5	407,500
		国債合計		407,500
		ケニア合計		407,500
		レバノン (2.0%)		
		国債 (2.0%)		
U S D	1,700,000	Lebanon Government International Bond 6.10% due 10/04/22	2.0	1,615,000
		国債合計		1,615,000
		レバノン合計		1,615,000
		ルクセンブルク (7.3%)		
		社債 (7.3%)		
U S D	200,000	ALROSA Finance SA 7.75% due 11/03/20	0.3	224,500
U S D	800,000	Altice Financing SA 6.63% due 02/15/23	1.0	812,000
U S D	800,000	Evraz Group SA 6.50% due 04/22/20	1.1	828,000

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
U S D	500,000	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital SA 6.00% due 11/27/23	0.7	522,500
U S D	200,000	Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 4.95% due 07/19/22	0.3	202,000
U S D	1,400,000	6.51% due 03/07/22	1.9	1,512,000
U S D	200,000	Minerva Luxembourg SA 6.50% due 09/20/26	0.2	187,500
U S D	600,000	Sberbank of Russia Via SB Capital SA 5.25% due 05/23/23	0.7	588,000
U S D	450,000	5.72% due 06/16/21	0.6	474,750
U S D	400,000	VTB Bank OJSC Via VTB Capital SA 6.95% due 10/17/22	0.5	418,500
		社債合計		5,769,750
		ルクセンブルク合計		5,769,750
		メキシコ（2.6%）		
		社債（2.6%）		
U S D	800,000	Cemex SAB de CV 5.70% due 01/11/25	1.0	774,000
U S D	200,000	Comision Federal de Electricidad 4.75% due 02/23/27	0.3	188,750
U S D	500,000	Credito Real SAB de CV SOFOM ER 7.25% due 07/20/23	0.6	496,750
U S D	500,000	Empresas ICA SAB de CV [±] 8.88% due 05/29/24	0.1	92,084
U S D	300,000	Trust F/1401 5.25% due 12/15/24	0.4	291,750
U S D	200,000	6.95% due 01/30/44	0.2	181,000
		社債合計		2,024,334
		メキシコ合計		2,024,334
		オランダ（8.1%）		
		社債（8.1%）		
U S D	450,000	Indo Energy Finance II BV 6.38% due 01/24/23	0.4	338,625
U S D	200,000	Kazakhstan Temir Zholy Finance BV 6.95% due 07/10/42	0.2	187,500
U S D	200,000	Lukoil International Finance BV 4.75% due 11/02/26	0.3	197,250
U S D	200,000	Marfrig Holdings Europe BV 8.00% due 06/08/23	0.3	199,750
U S D	400,000	Petrobras Global Finance BV 4.88% due 03/17/20	0.5	391,280
U S D	2,100,000	6.25% due 03/17/24	2.5	2,022,300
U S D	600,000	6.75% due 01/27/41	0.6	486,330
U S D	1,600,000	8.38% due 05/23/21	2.2	1,716,000
U S D	309,375	Republic of Angola Via Northern Lights III BV 7.00% due 08/16/19	0.4	308,540

ダイワ新興国ハイインカム・プラス インカムチェンジ（積立型）－

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
U S D	500,000	VimpelCom Holdings BV 7.50% due 03/01/22 社債合計 オランダ合計 ナイジェリア（0.2%） 国債（0.2%）	0.7	552,500 6,400,075 6,400,075
U S D	200,000	Nigeria Government International Bond 6.38% due 07/12/23 国債合計 ナイジェリア合計 パラグアイ（0.3%） 国債（0.3%）	0.2	186,000 186,000 186,000
U S D	200,000	Paraguay Government International Bond 6.10% due 08/11/44 国債合計 パラグアイ合計 ペルー（1.2%） 社債（1.2%）	0.3	198,500 198,500 198,500
U S D	270,000	Intercorp Peru, Ltd. 5.88% due 02/12/25	0.3	276,750
U S D	200,000	Union Andina de Cementos SAA 5.88% due 10/30/21	0.3	202,000
U S D	500,000	Volcan Cia Minera SAA 5.38% due 02/02/22 社債合計 ペルー合計 ポーランド（0.3%） 国債（0.3%）	0.6	475,625 954,375 954,375
U S D	200,000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% due 04/06/26 国債合計 ポーランド合計 ロシア（6.3%） 社債（0.8%）	0.3	193,500 193,500 193,500
U S D	400,000	Global Ports Finance Plc. 6.87% due 01/25/22	0.5	408,500
U S D	200,000	Polyus Gold International, Ltd. 4.70% due 03/28/22 社債合計 国債（5.5%）	0.3	196,000 604,500
U S D	1,000,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 3.50% due 01/16/19	1.3	1,012,500
U S D	1,400,000	4.50% due 04/04/22	1.8	1,444,800
U S D	1,200,000	4.88% due 09/16/23	1.6	1,261,200
U S D	600,000	5.88% due 09/16/43 国債合計 ロシア合計	0.8	651,900 4,370,400 4,974,900

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
		シンガポール（0.7%）		
		社債（0.7%）		
U S D	400,000	ABJA Investment Co. Pte, Ltd. 5.95% due 07/31/24	0.5	390,318
U S D	200,000	DBS Group Holdings, Ltd. 3.60% due 12/29/49	0.2	193,377
		社債合計		583,695
		シンガポール合計		583,695
		南アフリカ（0.6%）		
		社債（0.2%）		
U S D	200,000	MTN Mauritius Investment, Ltd. 5.37% due 02/13/22	0.2	196,500
		社債合計		196,500
		国債（0.4%）		
U S D	300,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.88% due 04/14/26	0.4	298,050
		国債合計		298,050
		南アフリカ合計		494,550
		韓国（0.5%）		
		社債（0.5%）		
U S D	370,000	Woori Bank 4.50% due 12/29/49	0.5	356,753
		社債合計		356,753
		韓国合計		356,753
		スリランカ（1.7%）		
		社債（0.5%）		
U S D	200,000	Bank of Ceylon 6.88% due 05/03/17	0.2	201,660
U S D	200,000	National Savings Bank 8.88% due 09/18/18	0.3	211,780
		社債合計		413,440
		国債（1.2%）		
U S D	900,000	Sri Lanka Government International Bond 5.88% due 07/25/22	1.2	894,375
		国債合計		894,375
		スリランカ合計		1,307,815
		トルコ（7.8%）		
		社債（2.3%）		
U S D	400,000	Akbank TAS 5.00% due 10/24/22	0.5	376,000
U S D	200,000	Mersin Uslulararasi Liman Isletmeciligi AS 5.88% due 08/12/20	0.3	207,250
U S D	300,000	Turkiye Is Bankasi 6.00% due 10/24/22	0.3	282,000
U S D	500,000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO 6.00% due 11/01/22	0.6	463,750

ダイワ新興国ハイインカム・プラス インカムチェンジ（積立型）－

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
U S D	500,000	Yapi ve Kredi Bankasi AS 5. 50% due 12/06/22 社債合計 国債（5.5%）	0.6	461,250 1,790,250
U S D	2,350,000	Turkey Government International Bond 3. 25% due 03/23/23	2.6	2,082,687
U S D	1,800,000	5. 13% due 03/25/22	2.3	1,793,250
U S D	400,000	8. 00% due 02/14/34 国債合計 トルコ合計 ウクライナ（2.4%） 国債（2.4%）	0.6	459,500 4,335,437 6,125,687
U S D	350,000	Ukraine Government International Bond 7. 75% due 09/01/19	0.4	339,063
U S D	487,000	7. 75% due 09/01/21	0.6	457,171
U S D	287,000	7. 75% due 09/01/22	0.3	266,192
U S D	250,000	7. 75% due 09/01/23	0.3	228,875
U S D	287,000	7. 75% due 09/01/24	0.3	259,017
U S D	387,000	7. 75% due 09/01/25 国債合計 ウクライナ合計 英国（1.0%） 社債（1.0%）	0.5	346,849 1,897,167 1,897,167
U S D	300,000	Ukreximbank Via Biz Finance PLC. 9. 75% due 01/22/25	0.3	271,875
U S D	500,000	Vedanta Resources PLC. 8. 25% due 06/07/21 社債合計 英国合計 アラブ首長国連邦（0.5%） 社債（0.5%）	0.7	515,133 787,008 787,008
U S D	400,000	MAF Global Securities, Ltd. 7. 13% due 10/29/49 社債合計 アラブ首長国連邦合計 米国（0.4%） 社債（0.4%）	0.5	416,000 416,000 416,000
U S D	300,000	CNOOC Finance 2015 USA LLC 3. 50% due 05/05/25 社債合計 米国合計 ウルグアイ（0.3%） 国債（0.3%）	0.4	293,251 293,251 293,251
U S D	215,000	Uruguay Government International Bond 4. 38% due 10/27/27 国債合計 ウルグアイ合計	0.3	214,462 214,462 214,462

元本		有価証券の明細	純資産に 占める 割合（％）	評価額
		ベネズエラ（3.3%）		
		社債（1.7%）		
		Petroleos de Venezuela SA		
U S D	1,500,000	6.00% due 11/15/26	0.7	542,175
U S D	1,650,000	9.00% due 11/17/21	1.0	792,000
		社債合計		1,334,175
		国債（1.6%）		
		Venezuela Government International Bond		
U S D	500,000	7.75% due 10/13/19	0.3	248,750
U S D	200,000	8.25% due 10/13/24	0.1	85,500
U S D	800,000	9.00% due 05/07/23	0.5	356,000
U S D	600,000	9.25% due 05/07/28	0.3	261,000
U S D	600,000	11.95% due 08/05/31	0.4	318,000
		国債合計		1,269,250
		ベネズエラ合計		2,603,425
		ザンビア（0.6%）		
		国債（0.6%）		
		Zambia Government International Bond		
U S D	500,000	8.50% due 04/14/24	0.6	468,125
		国債合計		468,125
		ザンビア合計		468,125
		債券合計（簿価 \$71,020,235）		\$ 69,687,769

エクイティ・プラス（円ヘッジ）受益証券：

2016年11月30日時点の為替先渡契約（純資産の－0.7%）

買い	取引相手	契約額	精算日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益（損）
J P Y	HSBC Bank Plc	934,200,000	2016/12/20	U S D	8,788,955	\$ -	\$ (581,329)	\$ (581,329)
						\$ -	\$ (581,329)	\$ (581,329)

上場投資信託（純資産の13.8%、簿価 \$11,167,463）

口数	種類	評価額
U S D 307,918	iShares MSCI Emerging Market	\$ 10,931,089

ゴールド・プラス（円ヘッジ）受益証券：

2016年11月30日時点の為替先渡契約（純資産の－4.1%）

買い	取引相手	契約額	精算日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益（損）
J P Y	HSBC Bank Plc	5,456,200,000	2016/12/20	U S D	51,331,938	\$ -	\$ (3,395,257)	\$ (3,395,257)
U S D	Morgan Stanley	2,358,349	2016/12/20	J P Y	257,700,000	94,267	-	94,267
U S D	State Street Corp.	1,211,366	2016/12/20	J P Y	134,400,000	30,565	-	30,565
						\$ 124,832	\$ (3,395,257)	\$ (3,270,425)

ダイワ新興国ハイインカム・プラス –インカムチェンジ（積立型） –

上場投資信託（純資産の2.3%、簿価 \$1,954,823）

口数	種類	評価額
U S D 16,585	SPDR Gold Shares	\$ 1,853,374

円ヘッジ受益証券：

2016年11月30日時点の為替先渡契約（純資産の－2.5%）

買い	取引相手	契約額	精算日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益（損）
J P Y	HSBC Bank Plc	3,217,200,000	2016/12/20	U S D	30,267,422	\$ -	\$ (2,001,983)	\$ (2,001,983)
U S D	Morgan Stanley	1,256,505	2016/12/20	J P Y	137,300,000	50,224	-	50,224
						\$ 50,224	\$ (2,001,983)	\$ (1,951,759)

2016年11月30日時点の先物取引（純資産の0.1%）

ポジション	種類	限月	枚数	純評価益（損）
買い	U.S. Treasury Long Bond March Futures	2017年3月	5	\$ (5,000)
売り	US 10 YEAR NOTE (CBT)	2017年3月	(76)	36,812
買い	US 2 Year Note Future March Futures	2017年3月	37	(578)
売り	US 5 YEAR NOTE (CBT)	2017年3月	(39)	7,058
買い	US ULTRA BOND (CBT)	2017年3月	9	(6,141)
				\$ 32,151

通貨の略称：

J P Y	-	日本円
U S D	-	米ドル

注：

±	-	デフォルト証券
---	---	---------

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第6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・マネーアセット・マザーファンドの第6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

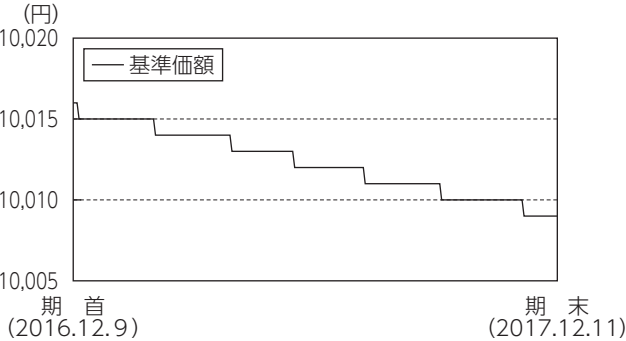
大和投資信託

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 率
	騰 落 率	組 入 比 率	
(期首)2016年12月 9 日	円 10,016	% -	% 28.2
12月末	10,015	△0.0	-
2017年 1 月末	10,015	△0.0	31.1
2 月末	10,014	△0.0	25.3
3 月末	10,014	△0.0	-
4 月末	10,013	△0.0	35.3
5 月末	10,012	△0.0	5.1
6 月末	10,012	△0.0	0.6
7 月末	10,011	△0.0	0.1
8 月末	10,011	△0.0	-
9 月末	10,010	△0.1	-
10月末	10,010	△0.1	-
11月末	10,009	△0.1	-
(期末)2017年12月11日	10,009	△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なっており、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：10,016円 期末：10,009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

○国内短期金融市況

期首より、日銀は「長短金利操作付き量的・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、安定的な運用を行ないます。

◆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)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 33,310,870	千円 - (36,270,000)

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

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
645 国庫短期証券 2017/2/20	4,280,100		
669 国庫短期証券 2017/6/12	3,020,099		
657 国庫短期証券 2017/4/17	2,860,055		
659 国庫短期証券 2017/4/24	2,650,077		
652 国庫短期証券 2017/3/27	2,530,020		
642 国庫短期証券 2017/2/6	2,410,036		
644 国庫短期証券 2017/5/12	2,070,088		
651 国庫短期証券 2017/3/21	1,970,049		
660 国庫短期証券 2017/5/1	1,450,027		
638 国庫短期証券 2017/1/16	1,270,010		

(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	17,415,714	100.0
投資信託財産総額	17,415,714	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	17,415,714,754円
コール・ローン等	17,415,714,754
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	17,415,714,754
元本	17,399,953,390
次期繰越損益金	15,761,364
(D) 受益権総口数	17,399,953,390口
1万口当り基準価額(C／D)	10,009円

* 期首における元本額は10,476,400,958円、当期中における追加設定元本額は9,625,428,641円、同解約元本額は2,701,876,209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、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし) 999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム(毎月分配型) 219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム(年2回決算型) 24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型) 848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型) 66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジあり) 6,592,748円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジなし) 10,288,683円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型) 4,995円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型) 4,995円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04(為替ヘッジあり／限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07(為替ヘッジあり／限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10(為替ヘッジあり／限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2015-01(為替ヘッジあり／限定追加型) 999円、ダイワ・ブラジル・レアル債α(毎月分配型) ースーパー・ハインカムーα50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α(毎月分配型) ースーパー・ハインカムーα100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ32,460,107円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 3－858,588,190円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 6－3,325,620,751円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 7－828,595,357円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 4－3,326,673,327円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト12 Ver 2－549,443,563円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 5－2,095,808,384円、ダイワ円債セレクト マネーコース808,108,471円、ダイワ・スイス高配当株ツインα(毎月分配型) 2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 為替ヘッジなしコース5,990,216円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 日本円コース1,397,544円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) ブラジル・レアル・コース3,994,008円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 通貨セレクトコース1,597,623円、ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型) 為替ヘッジあり40,885円、ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型) 為替ヘッジなし100,789円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型) 1,235円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎

月分配型) 1,598円、通貨選択型 ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース(毎月分配型) 1,544円、通貨選択型 ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース(毎月分配型) 1,984円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) ーシフト11－3,536,610,361円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) ーシフト12－679,321,043円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) ーシフト13－1,287,713,056円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,009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	△ 8,299,426円
受取利息	△ 922,829
支払利息	△ 7,376,597
(B) 有価証券売買損益	△ 2,491
売買損	△ 2,491
(C) その他費用	△ 174,287
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 8,476,204
(E) 前期繰越損益金	16,325,703
(F) 解約差損益金	△ 3,147,995
(G) 追加信託差損益金	11,059,860
(H) 合計(D + E + F + G)	15,761,364
次期繰越損益金(H)	15,761,364

(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。