★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／債券	
信託期間	約14年７カ月間（2013年11月27日～2028年７月５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	当ファンド	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／プリンシパル・ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）」（以下「ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ．ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーストック・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、ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）の受益証券への投資を通じて、米国の短期ハイ・イールド社債に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。なお、米国のバンクローンにも投資します。 ②当ファンドはＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）への投資割合を通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）では、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。	
マザーファンドの運用方法	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。	
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、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ＵＳ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）

運用報告書（全体版）

第５期

（決算日　2018年７月５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ＵＳ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）」は、このたび、第５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/

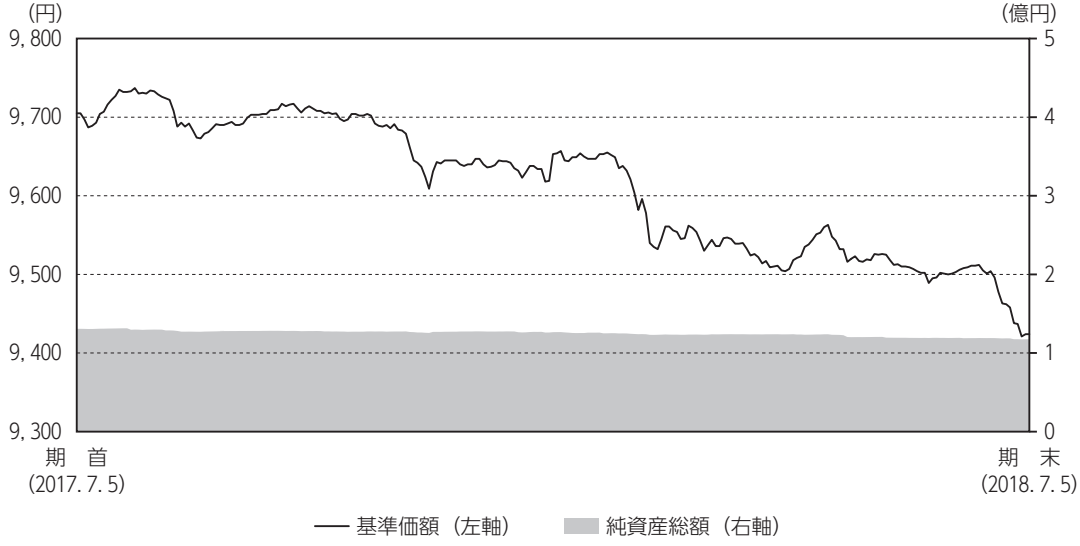
設定以来の運用実績

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
	税込み分配金	期中騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
1期末(2014年7月7日)	10,110	0	1.1	0.2	98.5	82
2期末(2015年7月6日)	9,855	0	△ 2.5	0.1	99.0	112
3期末(2016年7月5日)	9,430	0	△ 4.3	0.0	99.2	118
4期末(2017年7月5日)	9,705	0	2.9	0.0	98.6	130
5期末(2018年7月5日)	9,424	0	△ 2.9	—	98.6	117

（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、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



■基準価額・騰落率

期　首：9,705円

期　末：9,424円

騰落率：△2.9%

■基準価額の主な変動要因

「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ／プリンシパル・ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）」（以下「ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）」といいます。）を通じて、米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、米ドル建ての資産に対して米ドル売り／日本円買いの為替ヘッジを行なった結果、投資している短期ハイ・イールド社債のクレジット・スプレッド（発行体の信用力の差による利回りの差）の縮小などがプラスに寄与しましたが、ファンド運用に関連する費用の影響などから、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ＵＳ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）

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		
	円	%	%	%
(期首)2017年７月５日	9,705	—	0.0	98.6
７月末	9,731	0.3	0.0	98.8
８月末	9,692	△ 0.1	—	98.6
９月末	9,711	0.1	—	98.9
10月末	9,690	△ 0.2	—	99.3
11月末	9,638	△ 0.7	—	98.7
12月末	9,618	△ 0.9	—	99.6
2018年１月末	9,635	△ 0.7	—	99.6
２月末	9,559	△ 1.5	0.0	98.9
３月末	9,510	△ 2.0	—	99.4
４月末	9,520	△ 1.9	—	99.3
５月末	9,495	△ 2.2	—	99.0
６月末	9,438	△ 2.8	—	98.7
(期末)2018年７月５日	9,424	△ 2.9	—	98.6

（注）騰落率は期首比。

投資環境について （2017. 7. 6 ～ 2018. 7. 5）

■米国ハイ・イールド社債市況

米国ハイ・イールド社債市況は、期首から2017年末にかけては、北朝鮮情勢の緊迫化や米国の政治リスクの高まりなどを受けて調整する局面もあったものの、総じて上昇基調で推移しました。2018年の初めから１月下旬にかけては、良好な雇用情勢や好調な企業決算を背景にスプレッドが縮小したことから、底堅く推移しました。その後は２月中旬にかけて、米国長期金利の上昇への警戒感を受けた株式市場の急落とリスク資産全般の調整を背景にスプレッドが急拡大し、大幅に調整する展開となりました。その後、原油価格の上昇や株式市場等のボラティリティの低下などを背景に上昇する局面があった一方で、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の利上げ加速や米中貿易摩擦悪化への警戒感、欧州の政治リスクの高まりなどを材料に軟調な展開となるなど、一進一退で推移しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）への投資割合を高位に保つことによって、米国の短期ハイ・イールド社債等（※）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。

※短期ハイ・イールド社債およびバンクローン（貸付債権）をいいます。

■ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）

米国の短期ハイ・イールド社債に投資し、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。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

■ダイワ・マネーストック・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 （2017.7.6～2018.7.5）

■当ファンド

当ファンドは、ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）とダイワ・マネーストック・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、期を通じてＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）への投資割合を高位に維持しました。

■ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）

米国の短期ハイ・イールド社債に投資し、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した。業種別では、循環消費財セクターや非循環消費財セクター、通信セクターなどに対する組み入れを他のセクターに比べて高めの水準としました。また、米国のバンクローンにも投資を行ないました。

為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないました。

■ダイワ・マネーストック・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、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を行ないませんでした。
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７月６日 ～2018年７月５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)	44

（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

ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）への投資割合を高位に保つことによって、米国の短期ハイ・イールド社債等（※）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。

※短期ハイ・イールド社債およびバンクローンをいいます。

■ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）

米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、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。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

■ダイワ・マネーストック・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	当　期 (2017. 7. 6～2018. 7. 5)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	112円	1. 166%	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, 612円です。**
（投 信 会 社）	(42)	(0. 432)	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）	(67)	(0. 702)	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	—	—	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	1	0. 008	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）	(1)	(0. 008)	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	113	1. 174	

（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７月６日から2018年７月５日まで）

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国（邦貨建）	29.697	3,000	138.761	14,000

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）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７月６日から2018年７月５日まで）

当期							
買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED N1 CLASS（ケイマン諸島）	29.697	3,000	101	US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED N1 CLASS（ケイマン諸島）	138.761	14,000	100

（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等

(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・マネーストック・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７月６日から2018年７月５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	1,230	110	8.9	—	—	—
コール・ローン	7,518,314	—	—	—	—	—

（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

(1)ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当期末		
	口数	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）			
US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED N1 CLASS	1,163.347	115,847	98.6

（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	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	9	9	9

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年７月５日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	115,847	98.0
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	2,334	2.0
投資信託財産総額	118,192	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

2018年７月５日現在

項目	当期末
(A)資産	**118,192,140円**
コール・ローン等	2,334,828
投資信託受益証券（評価額）	115,847,330
ダイワ・マネーストック・マザーファンド（評価額）	9,982
(B)負債	**712,080**
未払信託報酬	707,123
その他未払費用	4,957
(C)純資産総額（A－B）	**117,480,060**
元本	124,663,267
次期繰越損益金	△ 7,183,207
(D)受益権総口数	**124,663,267口**
１万口当り基準価額（C／D）	**9,424円**

＊期首における元本額は134,724,838円、当期中における追加設定元本額は14,509,412円、同解約元本額は24,570,983円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は9,424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7,183,207円です。

■損益の状況

当期　自 2017年７月６日　至 2018年７月５日

項目	当期
(A)配当等収益	△ **592円**
受取利息	69
支払利息	△ 661
(B)有価証券売買損益	△ **1,926,695**
売買益	93,006
売買損	△ 2,019,701
(C)信託報酬等	△ **1,469,478**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	△ **3,396,765**
(E)前期繰越損益金	△ **1,184,567**
(F)追加信託差損益金	△ **2,601,875**
（配当等相当額）	(368,588)
（売買損益相当額）	(△ 2,970,463)
(G)合計（D＋E＋F）	△ **7,183,207**
次期繰越損益金（G）	△ **7,183,207**
追加信託差損益金	△ 2,601,875
（配当等相当額）	(368,588)
（売買損益相当額）	(△ 2,970,463)
分配準備積立金	190,513
繰越損益金	△ 4,771,845

（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10ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項　　目	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	368,588
(d) 分配準備積立金	190,513
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	559,101
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	559,101
(h) 受益権総口数	124,663,267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・プレミアム・トラストーダイワ／プリンシパル・ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）

当ファンド（ダイワＵＳ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））の主要投資対象である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／プリンシパル・ＵＳ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／Ｎ１クラス）」に投資しておりますが、以下の内容はすべてのクラスを合算しております。

（注）2018年７月５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）

貸借対照表

2017年６月30日

資産		
投資資産の評価額（簿価 $7, 709, 558）	$	7, 745, 938
現金		173
外国為替先渡契約による評価益		174
未収：		
売却済みの投資		77, 172
利息		108, 743
その他資産		6, 949
資産合計		7, 939, 149
負債		
外国為替先渡契約による評価損		185, 989
未払：		
購入済み投資資産		23, 503
解約済み受益証券		89, 000
専門家報酬		53, 251
保管会社報酬		12, 583
会計および管理会社報酬		11, 199
運用会社報酬		2, 991
名義書換代理人報酬		919
負債合計		379, 435
純資産	$	7, 559, 714
純資産		
円ヘッジクラス	$	6, 369, 865
円ヘッジ／Ｎ１クラス		1, 189, 849
	$	7, 559, 714
発行済み受益証券口数		
円ヘッジクラス		8, 292, 660
円ヘッジ／Ｎ１クラス		1, 319, 827
受益証券１口当り純資産額		
円ヘッジクラス	$	0. 768
円ヘッジ／Ｎ１クラス	$	0. 902

損益計算書

2017年６月30日に終了する年度

投資収益		
受取利息	$	349, 156
投資収益合計		349, 156
費用		
専門家報酬		51, 960
保管会社報酬		47, 629
会計および管理会社報酬		45, 000
運用会社報酬		36, 408
受託会社報酬		13, 683
名義書換代理人報酬		3, 884
登録料		1, 023
費用合計		199, 587
投資純利益		149, 569
実現益（損）および評価益（損）：		
実現益（損）：		
証券投資		(103, 414)
外国為替取引および外国為替先渡契約		(323, 117)
純実現損		(426, 531)
評価益（損）の純変動：		
証券投資		414, 525
外国為替換算および外国為替先渡契約		(511, 366)
評価損の純変動		(96, 841)
純実現・純評価損		(523, 372)
運用による純資産の純減	$	(373, 803)

投資明細表
2017年６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（98.6%）		
		カナダ（6.6%）		
		バンクローン（1.0%）		
		Lions Gate Entertainment Corp.		
ＵＳＤ	70,500	4.23% due 12/08/23		$ 71,029
		バンクローン合計		**71,029**
		社債（5.6%）		
		Bombardier, Inc.		
ＵＳＤ	85,000	8.75% due 12/01/21（a）		94,350
		First Quantum Minerals Ltd.		
ＵＳＤ	35,000	7.00% due 02/15/21（a）, （b）		35,875
		Mattamy Group Corp.		
ＵＳＤ	75,000	6.50% due 11/15/20（a）, （b）		76,500
		Taseko Mines Ltd.		
ＵＳＤ	15,000	7.75% due 04/15/19（b）		15,025
		Teck Resources Ltd.		
ＵＳＤ	25,000	3.75% due 02/01/23（b）		24,344
		Tembec Industries, Inc.		
ＵＳＤ	70,000	9.00% due 12/15/19（a）, （b）		72,719
		Valeant Pharmaceuticals International, Inc.		
ＵＳＤ	110,000	5.38% due 03/15/20（a）, （b）		106,288
		社債合計		**425,101**
		カナダ合計（簿価 $495,157）		**496,130**
		ルクセンブルグ（4.7%）		
		バンクローン（1.5%）		
		JBS USA Lux S. A.		
ＵＳＤ	119,700	5.75% due 10/30/22		117,067
		バンクローン合計		**117,067**
		社債（3.2%）		
		ArcelorMittal		
ＵＳＤ	70,000	6.00% due 03/01/21		75,337
		Intelsat Jackson Holdings S. A.		
ＵＳＤ	70,000	8.00% due 02/15/24（a）, （b）		75,425
		Mallinckrodt International Finance S. A. / Mallinckrodt CB LLC		
ＵＳＤ	90,000	4.88% due 04/15/20（a）, （b）		87,638
		社債合計		**238,400**
		ルクセンブルグ合計（簿価 $359,351）		**355,467**
		米国（87.3%）		
		バンクローン（20.3%）		
		Acadia Healthcare Company, Inc.		
ＵＳＤ	68,950	3.80% due 02/16/23		69,519
		Asurion LLC		
ＵＳＤ	53,256	4.23% due 11/03/23		53,622
		B&G Foods, Inc.		
ＵＳＤ	119,011	3.48% due 11/02/22		119,764

	元本	有価証券の明細	純資産に占める割合	評価額
		Caraustar Industries, Inc.		
ＵＳＤ	29,925	6.80% due 03/14/22		29,981
		CCM Merger, Inc.		
ＵＳＤ	112,886	3.98% due 08/06/21		113,478
		CenturyLink, Inc.		
ＵＳＤ	25,000	1.38% due 01/31/25		24,752
		Comfort Holding LLC		
ＵＳＤ	5,000	5.88% due 02/05/24		5,025
		DaVita Healthcare Partners, Inc.		
ＵＳＤ	157,165	3.98% due 06/24/21		157,558
		DJO Finance LLC		
ＵＳＤ	39,898	4.39% due 06/08/20		39,554
		First Data Corp.		
ＵＳＤ	122,397	3.47% due 07/08/22		122,330
		GEO Group, Inc.		
ＵＳＤ	14,963	3.33% due 03/22/24		15,005
		GTT Communications, Inc.		
ＵＳＤ	104,413	5.25% due 01/09/24		105,001
		Ineos US Finance LLC		
ＵＳＤ	24,875	3.98% due 04/01/24		24,965
		iStar, Inc.		
ＵＳＤ	150,988	4.90% due 07/01/20		152,309
		Kinetic Concepts, Inc.		
ＵＳＤ	25,000	4.55% due 02/02/24		24,932
		Michaels Stores, Inc.		
ＵＳＤ	73,923	3.94% due 01/30/23		73,835
		Navistar, Inc.		
ＵＳＤ	109,444	5.09% due 08/07/20		110,847
		Post Holdings, Inc.		
ＵＳＤ	30,000	3.47% due 05/24/24		30,070
		Prestige Brands, Inc.		
ＵＳＤ	14,358	3.98% due 01/26/24		14,442
		Prime Security Services Borrower LLC		
ＵＳＤ	9,975	3.97% due 05/02/22		9,989
		Radiate Holdco LLC		
ＵＳＤ	74,813	4.23% due 02/01/24		73,868
		Russell Investments US Institutional Holdco, Inc.		
ＵＳＤ	84,150	6.98% due 06/01/23		85,517
		Telenet Financing USD LLC		
ＵＳＤ	80,000	3.91% due 06/30/25		80,123
		バンクローン合計		**1,536,486**
		社債（67.0%）		
		ADT Corp.		
ＵＳＤ	75,000	6.25% due 10/15/21		81,656
		Air 2 US		
ＵＳＤ	16,709	8.03% due 10/01/19 (a)		17,544
		Aircastle Ltd.		
ＵＳＤ	100,000	5.13% due 03/15/21		107,037
		AK Steel Corp.		
ＵＳＤ	75,000	7.63% due 10/01/21 (b)		78,024

ダイワＵＳ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）

	元本	有価証券の明細	純資産に占める割合	評価額
		Aleris International, Inc.		
ＵＳＤ	35,000	9.50% due 04/01/21 (a), (b)		35,990
		Ally Financial, Inc.		
ＵＳＤ	50,000	3.60% due 05/21/18		50,562
ＵＳＤ	80,000	4.25% due 04/15/21		82,800
		American Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust		
ＵＳＤ	161,394	5.63% due 01/15/21 (a)		168,979
		American Equity Investment Life Holding Co.		
ＵＳＤ	20,000	6.63% due 07/15/21 (b)		20,688
		Anixter, Inc.		
ＵＳＤ	75,000	5.13% due 10/01/21		79,875
		Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp.		
ＵＳＤ	20,000	10.00% due 04/01/22 (a), (b)		20,000
		Cablevision Systems Corp.		
ＵＳＤ	36,000	8.63% due 09/15/17		36,450
		Centene Corp.		
ＵＳＤ	10,000	5.63% due 02/15/21 (b)		10,425
		CF Industries, Inc.		
ＵＳＤ	65,000	7.13% due 05/01/20		71,825
		Chesapeake Energy Corp.		
ＵＳＤ	61,000	8.00% due 12/15/22 (a), (b)		64,507
		CHS/Community Health Systems, Inc.		
ＵＳＤ	120,000	5.13% due 08/01/21 (b)		121,500
		Clean Harbors, Inc.		
ＵＳＤ	35,000	5.13% due 06/01/21 (b)		35,744
		CNH Industrial Capital LLC		
ＵＳＤ	110,000	4.88% due 04/01/21		116,875
		CNO Financial Group, Inc.		
ＵＳＤ	70,000	4.50% due 05/30/20		72,625
		Constellation Brands, Inc.		
ＵＳＤ	35,000	3.88% due 11/15/19		36,357
		Cornerstone Chemical Co.		
ＵＳＤ	40,000	9.38% due 03/15/18 (a), (b)		40,000
		Credit Acceptance Corp.		
ＵＳＤ	135,000	7.38% due 03/15/23 (b)		140,400
		DISH DBS Corp.		
ＵＳＤ	190,000	5.13% due 05/01/20		198,312
		Dollar Tree, Inc.		
ＵＳＤ	85,000	5.25% due 03/01/20 (b)		87,337
		DuPont Fabros Technology LP		
ＵＳＤ	35,000	5.88% due 09/15/21 (b)		36,444
		Dynegy, Inc.		
ＵＳＤ	55,000	6.75% due 11/01/19 (b)		56,719
		EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance, Inc.		
ＵＳＤ	110,000	9.38% due 05/01/20 (b)		86,762
		GLP Capital LP / GLP Financing II, Inc.		
ＵＳＤ	115,000	4.38% due 04/15/21		120,750
		HCA, Inc.		
ＵＳＤ	190,000	3.75% due 03/15/19		193,800

	元本	有価証券の明細	純資産に占める割合	評価額
		HD Supply, Inc.		
ＵＳＤ	80,000	5.25% due 12/15/21 (a), (b)		83,950
		IASIS Healthcare LLC / IASIS Capital Corp.		
ＵＳＤ	80,000	8.38% due 05/15/19 (b)		80,400
		Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp.		
ＵＳＤ	80,000	4.88% due 03/15/19 (b)		80,800
		ILFC E-Capital Trust II		
ＵＳＤ	100,000	4.59% due 12/21/65 (a), (b), (c)		95,500
		Iron Mountain, Inc.		
ＵＳＤ	100,000	4.38% due 06/01/21 (a), (b)		103,750
		iStar, Inc.		
ＵＳＤ	45,000	6.00% due 04/01/22 (b)		46,125
		Jack Ohio Finance LLC / Jack Ohio Finance 1 Corp.		
ＵＳＤ	15,000	6.75% due 11/15/21 (a), (b)		15,675
		JC Penney Corp., Inc.		
ＵＳＤ	45,000	5.65% due 06/01/20		44,269
		KB Home		
ＵＳＤ	75,000	7.00% due 12/15/21 (b)		84,000
		L Brands, Inc.		
ＵＳＤ	75,000	5.63% due 02/15/22		80,250
		Lamar Media Corp.		
ＵＳＤ	35,000	5.88% due 02/01/22 (b)		36,137
		Lennar Corp.		
ＵＳＤ	90,000	4.13% due 12/01/18 (b)		92,025
		Level 3 Financing, Inc.		
ＵＳＤ	90,000	4.94% due 01/15/18 (b), (c)		90,367
		Masco Corp.		
ＵＳＤ	40,000	3.50% due 04/01/21 (b)		41,079
		MGM Resorts International		
ＵＳＤ	105,000	6.63% due 12/15/21		117,863
		Micron Technology, Inc.		
ＵＳＤ	80,000	5.88% due 02/15/22 (b)		83,700
		Navient Corp.		
ＵＳＤ	45,000	5.50% due 01/15/19		46,856
ＵＳＤ	40,000	6.63% due 07/26/21		43,050
		Navios Maritime Holdings, Inc. / Navios Maritime Finance II US, Inc.		
ＵＳＤ	80,000	8.13% due 02/15/19 (b)		72,400
		NCL Corp. Ltd.		
ＵＳＤ	70,000	4.63% due 11/15/20 (a), (b)		71,860
ＵＳＤ	15,000	4.75% due 12/15/21 (a), (b)		15,570
		Netflix, Inc.		
ＵＳＤ	70,000	5.38% due 02/01/21		75,608
		NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp.		
ＵＳＤ	75,000	6.88% due 10/15/21 (b)		74,438
		PHI, Inc.		
ＵＳＤ	70,000	5.25% due 03/15/19 (b)		64,750
		QEP Resources, Inc.		
ＵＳＤ	140,000	6.80% due 04/01/18		143,500

ダイワＵＳ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）

	元本	有価証券の明細	純資産に占める割合		評価額
		Reynolds Group Issuer, Inc. / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu			
ＵＳＤ	100,000	4.66% due 07/15/21 (a), (b), (c)			101,625
ＵＳＤ	30,000	5.75% due 10/15/20 (b)			30,700
		RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp.			
ＵＳＤ	35,000	5.00% due 04/15/21 (b)			35,875
		Sanmina Corp.			
ＵＳＤ	65,000	4.38% due 06/01/19 (a)			66,788
		Sprint Capital Corp.			
ＵＳＤ	110,000	6.90% due 05/01/19			117,420
		Sprint Communications, Inc.			
ＵＳＤ	105,000	7.00% due 08/15/20			115,500
		Tenet Healthcare Corp.			
ＵＳＤ	55,000	6.00% due 10/01/20			58,919
ＵＳＤ	10,000	7.50% due 01/01/22 (a), (b)			10,848
		T-Mobile USA, Inc.			
ＵＳＤ	120,000	4.00% due 04/15/22 (b)			124,884
		TRI Pointe Group, Inc.			
ＵＳＤ	55,000	4.88% due 07/01/21 (b)			57,888
		VEREIT Operating Partnership LP			
ＵＳＤ	50,000	4.13% due 06/01/21 (b)			52,153
		Whiting Petroleum Corp.			
ＵＳＤ	30,000	5.00% due 03/15/19 (b)			29,813
ＵＳＤ	15,000	5.75% due 03/15/21 (b)			14,100
		WideOpenWest Finance LLC / WideOpenWest Capital Corp.			
ＵＳＤ	70,000	10.25% due 07/15/19 (b)			72,100
		Yum! Brands, Inc.			
ＵＳＤ	115,000	3.88% due 11/01/20 (b)			118,594
		社債合計			**5,061,116**
		米国合計（簿価 $6,558,311）			**6,597,602**
		債券合計（簿価 $7,412,819）		**$**	**7,449,199**
		短期運用（3.9%）			
		ケイマン諸島（3.9%）			
		定期預金（3.9%）			
		Wells Fargo			
ＵＳＤ	296,739	0.58% due 07/03/17			296,739
		定期預金合計			**296,739**
		ケイマン諸島合計（簿価 $296,739）			**296,739**
		短期運用合計（簿価 $296,739）			**296,739**
		投資総額（簿価 $7,709,558）	**102.5%**	**$**	**7,745,938**
		現金および他の資産を超過する負債	**(2.5)**		**(186,224)**
		純資産	**100.0%**	**$**	**7,559,714**

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最良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）144Ａ 証券－1933年証券取引法の規則144Ａの下でＳＥＣへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関投資家への転売が可能です。他に記載がない限り、これらの証券は流動性がないとはみなされません。
（b）期前償還条項付き証券。
（c）2017年６月30日時点の変動金利証券。

2017年６月30日現在の円ヘッジクラスの外国為替先渡契約（純資産の－2.08%）：

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）
ＪＰＹ	Barclays Bank Plc	10,000,000	2017/7/5	ＵＳＤ	88,826	$ 174	$ –	$ 174
ＪＰＹ	Barclays Bank Plc	728,053,796	2017/7/14	ＵＳＤ	6,639,561	–	(157,346)	(157,346)
						$ 174	$ (157,346)	$ (157,172)

2017年６月30日現在の円ヘッジ／Ｎ１クラスの外国為替先渡契約（純資産の－0.38%）：

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）
ＪＰＹ	Barclays Bank Plc	132,532,954	2017/7/14	ＵＳＤ	1,208,648	$ –	$ (28,643)	$ (28,643)
						$ –	$ (28,643)	$ (28,643)

通貨の略称：

ＪＰＹ　-　日本円
ＵＳＤ　-　米ドル

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワＵＳ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））が投資対象としている「ダイワ・マネーストック・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、当ファンドの決算日（2018年７月５日）現在におけるダイワ・マネーストック・マザーファンドの組入資産の内容等を19ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーストック・マザーファンドの主要な売買銘柄

公　社　債

（2017年７月６日から2018年７月５日まで）

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
679 国庫短期証券 2017/7/31	740,008		
723 国庫短期証券 2018/3/5	220,001		
707 国庫短期証券 2017/12/11	130,001		
355 2年国債 0.1% 2017/8/15	70,003		
682 国庫短期証券 2017/8/14	40,000		
680 国庫短期証券 2017/8/7	30,000		

（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）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

2018年７月５日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

運用報告書　第８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）

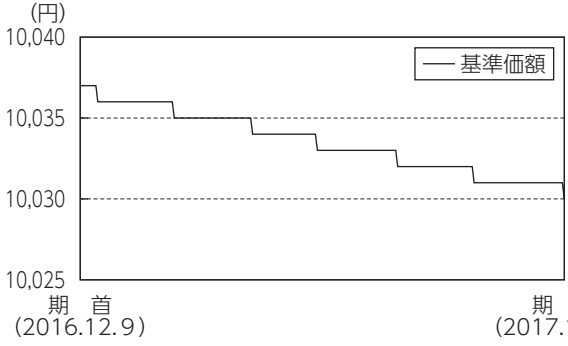
ダイワ・マネーストック・マザーファンドの第８期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★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
		騰落率	
	円	%	%
(期首)2016年12月9日	10,037	−	29.1
12月末	10,036	△0.0	−
2017年1月末	10,036	△0.0	31.1
2月末	10,035	△0.0	25.2
3月末	10,035	△0.0	−
4月末	10,034	△0.0	35.6
5月末	10,034	△0.0	6.4
6月末	10,033	△0.0	0.6
7月末	10,033	△0.0	0.1
8月末	10,032	△0.0	−
9月末	10,032	△0.0	−
10月末	10,031	△0.1	−
11月末	10,031	△0.1	−
(期末)2017年12月11日	10,030	△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：10,037円　期末：10,030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	0
(その他)	(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
		千円	千円
国内	国債証券	116,573,085	− (128,940,000)

(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	17,010,400		
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		
642 国庫短期証券 2017/2/6	9,700,144		
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		
638 国庫短期証券 2017/1/16	5,120,041		
660 国庫短期証券 2017/5/1	4,590,081		

(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	30,906,278	100.0
投資信託財産総額	30,906,278	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	**30,906,278,899円**
コール・ローン等	30,906,278,899
(B) 負債	**799,000,000**
未払解約金	799,000,000
(C) 純資産総額(A－B)	**30,107,278,899**
元本	30,015,878,475
次期繰越損益金	91,400,424
(D) 受益権総口数	**30,015,878,475口**
1万口当り基準価額(C／D)	**10,030円**

＊期首における元本額は42,294,564,193円、当期中における追加設定元本額は17,178,092,718円、同解約元本額は29,456,778,436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－947,268円、ダイワ／ミレーアセット・インド株式ファンド－インドの匠－29,910,270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、ＵＳ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）102,434円、ＵＳ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）1,994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3,969,366,810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5,902,244,309円、ダイワ上場投信－ＴＯＰＩＸレバレッジ（２倍）指数1,105,650,011円、ダイワ上場投信－ＴＯＰＩＸダブルインバース（－２倍）指数821,890,786円、ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス6,073,206,032円、ダイワ上場投信－ＴＯＰＩＸインバース（－１倍）指数5,071,127,230円、ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400レバレッジ・インデックス383,378,807円、ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400インバース・インデックス5,200,107,448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205,174,656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）2017－06　997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2017－06　997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28,215,782円、ダイワ・プルベア・セレクト　ドル高円安ポートフォリオ104,220,911円、ダイワ・プルベア・セレクト　円高ドル安ポートフォリオ49,706,154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－641,089,307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）－5,020,480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206,680,116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126,940,913円、通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・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／ミレーアセット・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／ミレーアセット・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ＵＳ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）9,957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／ミレー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／ミレーアセット・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／ミレーアセット・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／ミレーアセット・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／ミレーアセット・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／ミレーアセット・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／ミレーアセット・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10,030円です。

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

■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	**△ 21,002,641円**
受取利息	△ 3,317,956
支払利息	△ 17,684,685
(B) 有価証券売買損益	**△ 4,086**
売買損	△ 4,086
(C) その他費用	**△ 329,559**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△ 21,336,286**
(E) 前期繰越損益金	**155,223,882**
(F) 解約差損益金	**△ 99,854,368**
(G) 追加信託差損益金	**57,367,196**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**91,400,424**
次期繰越損益金(H)	**91,400,424**

（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。