

★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12月9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）」）といひます。）の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネースtock・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tock・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も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スヤル・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。	

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）

運用報告書（全体版） 第3期

（決算日 2016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、「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）」は、このたび、第3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 騰 落 率				
	円	円	%	%	百万円	
1 期末(2014年 7 月 7 日)	10,119	0	1.2	0.1	99.5	5
2 期末(2015年 7 月 6 日)	9,861	0	△ 2.5	0.1	99.3	4
3 期末(2016年 7 月 5 日)	9,432	0	△ 4.4	0.0	99.3	4

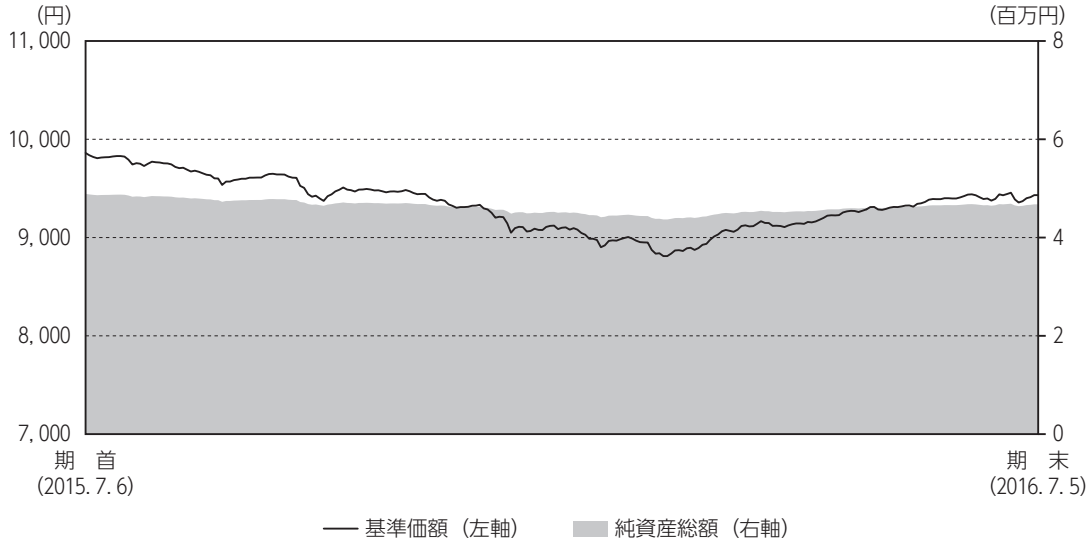
(注1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：9,861円

期末：9,432円

騰落率：△4.4%

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・プレミアム・トラスト・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取引を行なった結果、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）拡大等がマイナス要因となり、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。

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）

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
		騰 落 率			
		円		%	%
(期首)2015年7月6日	9,861		—	0.1	99.3
7月末	9,766	△	1.0	0.1	99.4
8月末	9,590	△	2.7	0.1	99.4
9月末	9,415	△	4.5	0.1	99.5
10月末	9,470	△	4.0	0.1	99.6
11月末	9,313	△	5.6	0.1	99.7
12月末	9,119	△	7.5	0.1	99.8
2016年1月末	8,996	△	8.8	0.1	99.3
2月末	8,926	△	9.5	0.1	99.4
3月末	9,123	△	7.5	0.0	99.5
4月末	9,287	△	5.8	0.0	99.6
5月末	9,391	△	4.8	0.0	99.7
6月末	9,400	△	4.7	0.0	99.3
(期末)2016年7月5日	9,432	△	4.4	0.0	99.3

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

○米国ハイ・イールド社債市況

短期ハイ・イールド社債は、市場インデックスで見ると、金利の低下や債券の利息収入等によりプラスのリターンとなりました。米国債金利は、期首から2015年12月にかけて利上げ期待から短期ゾーンを中心に上昇しました。12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）で利上げが決定され、その後も緩やかに利上げを継続する意向が示唆されました。しかし2016年に入ると、海外経済の減速懸念等から米国の利上げ期待が後退したほか、日欧で金融緩和策が強化されたことなどから、米国債金利は低下基調に転じました。

ハイ・イールド社債については、期首から2016年2月半ばにかけて原油価格の下落等を背景にクレジット・スプレッドが拡大しました。その後は、原油価格の回復等を受けてクレジット・スプレッドはそれまでの拡大幅を縮小しました。

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）の受益証券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）

ハイ・イールド社債発行体企業のファンダメンタルズは、おおむね堅調な状況が継続しており、ハイ・イールド社債市場の支援材料と想定しております。一方で、今後もエネルギー関連セクターのボラティリティは高い状況が見込まれ、ハイ・イールド社債市場へ影響を及ぼすものと想定されます。

当ファンドでは、今後も米国の短期ハイ・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tock・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。

ポートフォリオについて

○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tock・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）の受益証券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。業種別では通信セクターや循環消費財セクターに対する組み入れを他のセクターに比べて高い水準としました。また、米国のバンクローンに対しても投資しました。

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tock・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・ローン等の短期金融資産による安定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	
	2015年7月7日 ～2016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)	34

- (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）の受益証券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。

○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、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		項 目 の 概 要
	(2015. 7. 7～2016. 7. 5)		
	金 額	比 率	
信託報酬	109円	1.163%	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9,333円です。
（投信会社）	(40)	(0.431)	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）	(65)	(0.700)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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	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
合 計	109	1.171	

(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。

(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

(2015年7月7日から2016年7月5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)	—	—	0.525	50

(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

(2015年7月7日から2016年7月5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
				US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED N1 CLASS (ケイマン諸島)	0.525	50	95

(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・マネースtock・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

(2015年7月7日から2016年7月5日まで)

区 分	当 期			期 付		
	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	114,797	8,920	7.8	2,822	—	—
コール・ローン	3,915,930	—	—	—	—	—

(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、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

期首保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

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）

■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	当 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) US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED N1 CLASS	47.714	4,642	99.3

(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		
	□ 数	□ 数	□ 数	□ 数	□ 数	□ 数
	千口	千口	千口	千口	千口	千口
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	4	4	4	4	4	5

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016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	4,642	98.7
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	5	0.1
コール・ローン等、その他	54	1.2
投資信託財産総額	4,702	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7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,702,648円
コール・ローン等	54,660
投資信託受益証券（評価額）	4,642,985
ダイワ・マネースtock・マザーファンド（評価額）	5,003
(B) 負債	26,323
未払信託報酬	26,142
その他未払費用	181
(C) 純資産総額（A－B）	4,676,325
元本	4,957,948
次期繰越損益金	△ 281,623
(D) 受益権総口数	4,957,948口
1万口当り基準価額（C/D）	9,432円

* 期首における元本額は4,957,948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0円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,432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281,623円です。

■損益の状況

当期 自2015年7月7日 至2016年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,076円
その他収益金	2,076
(B) 有価証券売買損益	△ 160,575
売買損	△ 160,575
(C) 信託報酬等	△ 54,016
(D) 当期損益金（A+B+C）	△ 212,515
(E) 前期繰越損益金	△ 111,158
(F) 追加信託差損益金	42,050
(売買損益相当額)	(42,050)
(G) 合計（D+E+F）	△ 281,623
次期繰越損益金（G）	△ 281,623
追加信託差損益金	42,050
(売買損益相当額)	(42,050)
分配準備積立金	17,167
繰越損益金	△ 340,840

(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	0
(d) 分配準備積立金	17,167
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	17,167
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	17,167
(h) 受益権総口数	4,957,948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。

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）

ダイワ・プレミアム・トラスト・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（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））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・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）2016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
2015年6月30日

資産		
投資、時価（費用8,120,340ドル）	\$	7,982,552
現金		8
為替先渡契約による評価益		18,997
未取：		
売却済みの投資		85,573
利息		107,851
その他資産		27,149
資産合計		<u>8,222,130</u>
負債		
為替先渡契約による評価損		2,296
未払い：		
専門家報酬		51,706
保管報酬		20,426
会計および管理報酬		18,699
投資運用会社報酬		3,169
償還済みの受益証券		1,610
名義書換代理会社報酬		1,469
購入済みの投資		228
負債合計		<u>99,603</u>
純資産	\$	<u>8,122,527</u>
純資産		
円ヘッジクラス	\$	7,169,869
円ヘッジ／N1クラス		952,658
	\$	<u>8,122,527</u>
発行済み受益証券数		
円ヘッジクラス		9,355,010
円ヘッジ／N1クラス		1,157,777
1口当たり純資産価額		
円ヘッジクラス	\$	0.766
円ヘッジ／N1クラス	\$	0.823

損益計算書

2015年6月30日に終了する年度

投資収益	
利息収入	\$ 445,442
その他収入	20,217
投資収益合計	<u>465,659</u>
費用	
専門家報酬	53,538
保管報酬	49,124
会計および管理報酬	45,123
投資運用会社報酬	41,387
受託会社報酬	22,002
名義書換代理会社報酬	5,534
登録料	1,508
費用合計	<u>218,216</u>
純投資収益	<u>247,443</u>
実現益および評価益（実現損および評価損）：	
実現益（損）：	
有価証券への投資	(54,808)
外国為替取引および為替先渡契約	(1,752,569)
純実現損	<u>(1,807,377)</u>
評価益（損）の純変動：	
有価証券への投資	(290,849)
外国為替換算および為替先渡契約	(34,391)
評価損の純変動	<u>(325,240)</u>
純実現損および純評価損	<u>(2,132,617)</u>
業務活動から生じた純資産の純減	<u>\$ (1,885,174)</u>

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)

投資明細表
2015年6月30日

	元本金額	有価証券の明細	純資産に 占める比率	公正価値
		債券 (94.9%)		
		カナダ (3.5%)		
		社債 (3.5%)		
		Bombardier, Inc.		
USD	125,000	5.50% due 09/15/18 (a)	\$	123,750
		Taseko Mines Ltd.		
USD	15,000	7.75% due 04/15/19 (b)		11,437
		Valeant Pharmaceuticals International, Inc.		
USD	110,000	5.38% due 03/15/20 (a), (b)		113,575
		Whiting Canadian Holdings II, Inc.		
USD	35,000	8.13% due 12/01/19 (b)		36,641
		社債計		285,403
		カナダ計 (費用287,021ドル)		285,403
		アイルランド (2.4%)		
		社債 (2.4%)		
		Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA, Inc.		
USD	200,000	3.29% due 12/15/19 (a), (b), (c)		194,500
		社債計		194,500
		アイルランド計 (費用200,000ドル)		194,500
		ルクセンブルグ (4.5%)		
		社債 (4.5%)		
		Altice Financing S. A.		
USD	200,000	7.88% due 12/15/19 (a), (b)		210,500
		ArcelorMittal		
USD	5,000	5.13% due 06/01/20		5,069
USD	100,000	6.13% due 06/01/18		106,500
		Beverage Packagings Holdings Luxembourg II S. A. / Beverage Packaging Holdings II Is		
USD	40,000	5.63% due 12/15/16 (a), (b)		39,925
		社債計		361,994
		ルクセンブルグ計 (費用363,579ドル)		361,994
		米国 (84.5%)		
		バンクローン (20.2%)		
		Asurion LLC		
USD	43,972	5.00% due 05/24/19		44,133
USD	40,000	8.50% due 03/03/21		40,738
		AZ Chem US, Inc.		
USD	9,027	4.50% due 06/12/21		9,039
USD	95,260	7.50% due 06/12/22		95,200
		CCM Merger, Inc. (MotorCity Casino Hotel)		
USD	142,711	4.50% due 08/08/21		143,291
		Chrysler Group LLC		
USD	127,400	3.50% due 05/24/17		127,393

U S 短期高利回り社債ファンド (為替ヘッジあり／年1回決算型)

	元本金額	有価証券の明細	純資産に 占める比率	公正価値
U S D	158,604	Dell International LLC 3.75% due 10/29/18		158,811
U S D	97,461	Envision Healthcare Corp. 4.00% due 05/25/18		97,609
U S D	171,082	Freescale Semiconductor, Inc. 4.25% due 03/01/20		171,379
U S D	78,545	FTS International, Inc. 5.75% due 04/16/21		63,229
U S D	57,627	Isola USA Corp. 9.25% due 11/28/19		56,186
U S D	75,682	MPH Acquisition Holdings LLC 3.75% due 03/06/21		75,344
U S D	172,380	Neiman Marcus Group Inc. 4.25% due 10/25/20		171,606
U S D	129,422	NewPage Corp. 9.50% due 02/11/21		104,799
U S D	93,331	Ntelos, Inc. 5.75% due 11/09/19		82,598
U S D	194,250	Par Pharmaceutical Cos, Inc. 4.00% due 09/30/19		194,458
U S D	4,950	Seventy Seven Operating LLC 3.75% due 06/25/21		4,558
		バンクローン計		1,640,371
		転換社債 (0.6%)		
U S D	29,000	Jazz Technologies, Inc. 8.00% due 12/31/18		48,086
		転換社債計		48,086
		社債 (63.7%)		
U S D	45,746	Air 2 US 8.03% due 10/01/19 (a)		48,948
U S D	50,000	Ally Financial, Inc. 3.60% due 05/21/18		50,062
U S D	50,000	Alphabet Holding Co., Inc. 7.75% due 11/01/17 (b), (e)		50,000
U S D	150,000	Beazer Homes USA, Inc. 6.63% due 04/15/18 (b)		155,062
U S D	80,000	Cablevision Systems Corp. 8.63% due 09/15/17		87,200
U S D	130,000	Centene Corp. 5.75% due 06/01/17		137,800
U S D	85,000	Chaparral Energy, Inc. 9.88% due 10/01/20 (b)		69,275
U S D	215,000	Chesapeake Energy Corp. 3.53% due 04/15/19 (b), (c)		196,725

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）

	元本金額	有価証券の明細	純資産に 占める比率	公正価値
USD	190,000	CIT Group, Inc. 3.88% due 02/19/19		188,575
USD	125,000	CNH Industrial America LLC 7.25% due 01/15/16		127,500
USD	80,000	Comstock Resources, Inc. 7.75% due 04/01/19 (b)		33,600
USD	40,000	Constellation Brands, Inc. 3.88% due 11/15/19		40,600
USD	155,000	Coveris Holding Corp. 10.00% due 06/01/18 (a), (b)		162,750
USD	100,000	Crescent Resources LLC / Crescent Ventures, Inc. 10.25% due 08/15/17 (a), (b)		106,125
USD	70,000	Dana Holding Corp. 6.75% due 02/15/21 (b)		73,325
USD	250,000	DISH DBS Corp. 4.25% due 04/01/18		254,375
USD	9,000	DPL, Inc. 6.50% due 10/15/16 (b)		9,360
USD	65,000	Dynegy, Inc. 6.75% due 11/01/19 (a), (b)		67,632
USD	110,000	EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance, Inc. 9.38% due 05/01/20 (b)		117,557
USD	85,000	Family Tree Escrow LLC 5.25% due 03/01/20 (a), (b)		88,931
USD	25,000	Goodman Networks, Inc. 12.13% due 07/01/18 (b)		20,750
USD	70,000	HCA, Inc. 3.75% due 03/15/19		70,525
USD	215,000	HD Supply, Inc. 11.00% due 04/15/20 (b)		239,273
USD	100,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp. 3.50% due 03/15/17 (b)		100,625
USD	25,000	4.88% due 03/15/19 (b)		25,187
USD	110,000	IGATE Corp. 4.75% due 04/15/19 (b)		113,987
USD	100,000	ILFC E-Capital Trust II 6.25% due 12/21/65 (a), (b), (d)		99,500
USD	45,000	Jarden Corp. 6.13% due 11/15/22 (b)		46,575
USD	15,000	Jurassic Holdings III, Inc. 6.88% due 02/15/21 (a), (b)		11,700
USD	90,000	Kinetic Concepts, Inc. / KCI USA, Inc. 10.50% due 11/01/18 (b)		96,077
USD	85,000	Landry's Holdings II, Inc. 10.25% due 01/01/18 (a), (b)		88,187

U S 短期高利回り社債ファンド (為替ヘッジあり／年1回決算型)

	<u>元本金額</u>	<u>有価証券の明細</u>	<u>純資産に 占める比率</u>	<u>公正価値</u>
		Lennar Corp.		
U S D	90,000	4.13% due 12/01/18 (b)		90,900
		Level 3 Financing, Inc.		
U S D	90,000	3.91% due 01/15/18 (b), (c)		90,450
		Lions Gate Entertainment Corp.		
U S D	100,000	5.25% due 08/01/18		103,000
		MGM Resorts International		
U S D	50,000	10.00% due 11/01/16		54,500
		Mirant Mid-Atlantic Series B Pass Through Trust		
U S D	58,300	9.13% due 06/30/17		61,507
		Navios Maritime Holdings, Inc. / Navios Maritime Finance II US, Inc.		
U S D	80,000	8.13% due 02/15/19 (b)		62,800
		New Academy Finance Co. LLC / New Academy Finance Corp.		
U S D	125,000	8.00% due 06/15/18 (a), (b), (e)		126,250
		NRG Energy, Inc.		
U S D	50,000	7.63% due 01/15/18		54,813
		Par Pharmaceutical Cos, Inc.		
U S D	56,000	7.38% due 10/15/20 (b)		59,780
		Peninsula Gaming LLC / Peninsula Gaming Corp.		
U S D	75,000	8.38% due 02/15/18 (a), (b)		78,094
		PHI, Inc.		
U S D	70,000	5.25% due 03/15/19 (b)		64,750
		QEP Resources, Inc.		
U S D	140,000	6.80% due 04/01/18		145,250
		Reynolds Group Issuer, Inc. / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu		
U S D	150,000	7.88% due 08/15/19 (b)		156,188
		Sanmina Corp.		
U S D	45,000	4.38% due 06/01/19 (a)		44,888
		Smithfield Foods, Inc.		
U S D	40,000	5.25% due 08/01/18 (a), (b)		40,600
		Sprint Capital Corp.		
U S D	205,000	6.90% due 05/01/19		209,100
		Tenet Healthcare Corp.		
U S D	55,000	6.00% due 10/01/20		58,644
		T-Mobile USA, Inc.		
U S D	130,000	6.46% due 04/28/19 (b)		133,900
		Vander Intermediate Holding II Corp.		
U S D	15,000	9.75% due 02/01/19 (a), (b), (e)		14,775
		WellCare Health Plans, Inc.		
U S D	120,000	5.75% due 11/15/20 (b)		124,800
		WideOpenWest Finance LLC / WideOpenWest Capital Corp.		
U S D	145,000	13.38% due 10/15/19 (b)		157,688

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）

	元本金額	有価証券の明細	純資産に 占める比率	公正価値
		Wise Metals Intermediate Holdings LLC / Wise Holdings Finance Corp.		
USD	45,000	9.75% due 06/15/19 (a), (b) WMG Holdings Corp.		47,925
USD	145,000	13.75% due 10/01/19 (b) Zayo Group LLC / Zayo Capital, Inc.		158,775
USD	50,000	10.13% due 07/01/20 (b) Zions Bancorporation		55,838
USD	7,000	6.00% due 09/15/15		7,054
		社債計		5,180,057
		米国計（費用6,997,599ドル）		6,868,514
		債券計（費用7,848,199ドル）		\$ 7,710,411
		短期投資（3.4%）		
		英国（3.4%）		
		定期預金（3.4%）		
		ANZ National Bank		
USD	272,141	0.03% due 07/01/15		272,141
		定期預金計		272,141
		英国計（費用272,141ドル）		272,141
		短期投資計（費用272,141ドル）		272,141
		投資総額（費用8,120,340ドル）	98.3%	\$ 7,982,552
		負債を上回る現金およびその他の資産	1.7	139,975
		純資産	100.0%	\$ 8,122,527

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購入者に転売が可能です。他に指定がない限り、これらの証券は非流動的だとみなされません。
- (b) 償還条項付き証券。
- (c) 2015年6月30日時点の変動利付き証券。
- (d) 2015年6月30日時点の変動金利証券。
- (e) PIK－現物支給証券。発行者の裁量により、利息が現金または追加で発行される証券で払われます。

U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

2015年6月30日現在の円ヘッジクラスの為替先渡契約（純資産の0.2%）：

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益（損）
J P Y	State Street Bank & Trust Co.	915,408,217	2015年7月15日	U S D	7,465,399	ドル 16,726	ドル —	ドル 16,726
U S D	State Street Bank & Trust Co.	139,857	2015年7月15日	J P Y	17,320,000	—	(1,709)	(1,709)
U S D	State Street Bank & Trust Co.	213,097	2015年7月15日	J P Y	26,130,184	—	(479)	(479)
						ドル 16,726	ドル (2,188)	ドル 14,538

2015年6月30日現在の円ヘッジ／N1クラスの為替先渡契約（純資産の0.0%）：

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益（損）
J P Y	State Street Bank & Trust Co.	433,000	2015年7月15日	U S D	3,484	ドル 55	ドル —	ドル 55
J P Y	State Street Bank & Trust Co.	219,000	2015年7月15日	U S D	1,771	19	—	19
J P Y	State Street Bank & Trust Co.	119,711,892	2015年7月15日	U S D	976,283	2,187	—	2,187
J P Y	State Street Bank & Trust Co.	164,000	2015年7月15日	U S D	1,331	10	—	10
U S D	State Street Bank & Trust Co.	1,589	2015年7月15日	J P Y	197,000	—	(21)	(21)
U S D	State Street Bank & Trust Co.	3,987	2015年7月15日	J P Y	491,000	—	(26)	(26)
U S D	State Street Bank & Trust Co.	27,142	2015年7月15日	J P Y	3,328,158	—	(61)	(61)
						ドル 2,271	ドル (108)	ドル 2,163

通貨の略称：

J P Y - 日本円
U S D - 米ドル

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2015年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年7月5日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を19ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2015年7月7日から2016年7月5日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
591 国庫短期証券 2016/5/30	18,690,605	575 国庫短期証券 2016/6/10	1,500,603
596 国庫短期証券 2016/6/20	11,560,241	342 2年国債 0.1% 2016/7/15	720,475
588 国庫短期証券 2016/5/16	9,500,428	100 5年国債 0.3% 2016/9/20	601,368
568 国庫短期証券 2016/2/15	7,000,594		
574 国庫短期証券 2016/3/14	5,000,640		
573 国庫短期証券 2016/3/7	4,500,619		
567 国庫短期証券 2016/2/8	4,299,996		
586 国庫短期証券 2016/5/12	4,000,096		
98 5年国債 0.3% 2016/6/20	3,990,332		
576 国庫短期証券 2016/3/22	3,500,336		

(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

下記は、2016年7月5日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（50,500,893千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年7月5日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 以 下 組 入 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国債証券	千円 2,260,000	千円 2,260,036	%	%	%	%	%
			4.5	—	—	—	4.5

(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。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2016年7月5日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	581 国庫短期証券	—	千円 2,210,000	千円 2,210,035	2016/07/11	
	600 国庫短期証券	—	50,000	50,000	2016/07/11	
合 計	銘 柄 数 金 額	2銘柄	2,260,000	2,260,036		

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド 運用報告書 第6期 (決算日 2015年12月9日)

(計算期間 2014年12月10日～2015年12月9日)

ダイワ・マネースtock・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

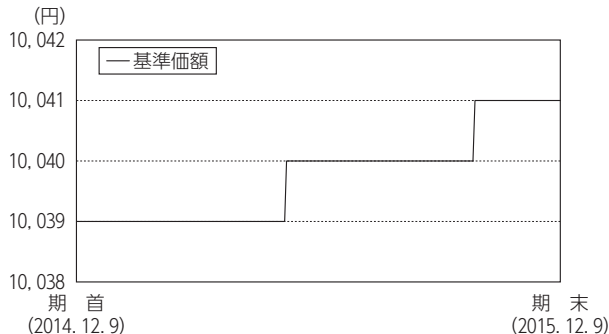
大和投資信託

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		公社債組入比率
	円	騰落率 %	
(期首) 2014年12月9日	10,039	—	58.5
12月末	10,039	0.0	97.2
2015年1月末	10,039	0.0	71.6
2月末	10,039	0.0	62.6
3月末	10,039	0.0	56.0
4月末	10,039	0.0	58.0
5月末	10,040	0.0	59.9
6月末	10,040	0.0	56.2
7月末	10,040	0.0	57.4
8月末	10,040	0.0	55.6
9月末	10,040	0.0	59.3
10月末	10,041	0.0	71.0
11月末	10,041	0.0	52.1
(期末) 2015年12月9日	10,041	0.0	51.6

(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：10,039円 期末：10,041円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低金利が続き、無担保コール翌日物金利は0.07%台を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.11～0.02%程度で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定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、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

■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	—
合計	—

(注) 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。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円	千円
		75,714,577	(43,770,000)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
568 国庫短期証券 2016/2/15	7,000,594		
574 国庫短期証券 2016/3/14	5,000,640		
573 国庫短期証券 2016/3/7	4,500,619		
540 国庫短期証券 2015/9/24	3,799,996		
557 国庫短期証券 2015/12/14	2,999,999		
567 国庫短期証券 2016/2/8	2,999,997		
520 国庫短期証券 2015/6/22	2,999,976		
555 国庫短期証券 2015/12/7	2,500,000		
553 国庫短期証券 2015/11/24	2,060,000		
536 国庫短期証券 2015/9/7	2,000,000		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利分は含まれておりません)。

(注2) 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 区 分	当 期			末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちB 格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	32,420,000	32,424,550	51.6	—	—	—	51.6

(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。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

区 分	銘 柄	年利率	当 期		末	
			額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円		
国債証券	557 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,999	2015/12/14	
	559 国庫短期証券	—	2,000,000	2,000,000	2015/12/21	
	560 国庫短期証券	—	1,600,000	1,599,999	2015/12/28	
	563 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/01/18	
	566 国庫短期証券	—	1,500,000	1,499,999	2016/02/01	
	567 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,998	2016/02/08	
	568 国庫短期証券	—	7,000,000	7,000,594	2016/02/15	
	573 国庫短期証券	—	4,500,000	4,500,612	2016/03/07	
	556 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,123	2016/03/10	
	574 国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,640	2016/03/14	
	575 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,448	2016/06/10	
	342 2年国債	0.1000	720,000	720,576	2016/07/15	
100 5年国債	0.3000	600,000	601,560	2016/09/20		
合計	銘柄数	13銘柄				
	金額		32,420,000	32,424,550		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	32,424,550	40.2
コール・ローン等、その他	48,181,367	59.8
投資信託財産総額	80,605,918	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月9日現在

項目	当 期 末
(A) 資産	80,605,918,433円
コール・ローン等	48,180,683,441
公社債(評価額)	32,424,550,578
未収利息	481,238
前払費用	203,176
(B) 負債	17,814,126,500
未払金	17,502,126,500
未払解約金	312,000,000
(C) 純資産総額 (A - B)	62,791,791,933
元本	62,535,131,959
次期繰越損益金	256,659,974
(D) 受益権総口数	62,535,131,959口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,041円

*期首における元本額は817,136,908円、当期中における追加設定元本額は80,209,414,361円、同解約元本額は18,491,419,310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)112,594,660円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジなし)73,734,556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・テクノロジ関連株ファンド-ロボテック-3,983,667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・ブラジルリアルファンド(毎月決算型)999円、新興国ソブリン・ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)999円、アジア高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)999円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Aコース2,996,693円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Bコース2,494,264円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Cコース999,197円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Aコース698,255円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Bコース458,853円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Aコース1,994,416円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Bコース648,186円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Cコース179,498円、世界優先証券ファンド(為替ヘッジあり/限定追加型)998円、U.S短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)3,988,832円、U.S短期高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)4,984円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス14,063,387,856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2,983,307,364円、ダイワ上場投信-TOPIXレバレッジ(2倍)指数2,081,906,471円、ダイワ上場投信-TOPIXダブルインバース(-2倍)指数796,936,766円、ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス37,546,378,604円、ダイワ上場投信-TOPIXインバース(-1倍)指数2,340,731,717円、ダイワ上場投信-JPX日経400レバレッジ・インデックス687,286,710円、ダイワ上場投信-JPX日経400インバース・インデックス278,916,205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727,153,136円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型)為替ヘッジあり7,009,001円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型)為替ヘッジなし904,221円、ダイワ・ブルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ4,980,676円、ダイワ・ブルベア・セレクト ドル高円安ポートフォリオ258,995,899円、ダイワ・ブルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ69,726,080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-成長の楯音(つちおと)-11,000,000円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ197,260,107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90,940,158円、ダイワ米国高利回り不動産証券ファンド19,942,168円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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・リアル・コース(毎月分配型)12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グ

レートコンシューマー株式ファンドII 通貨セレクト・コース(毎月分配型)4,981,569円、ダイワU.S短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)199,295円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)997円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジなし)997円、<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/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型)ブラジル・リアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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、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)20,016,725円、ダイワ/ミレアセット・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)4,000,959円、ダイワ/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド49,850,449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・リアル・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3,488,836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2,492,026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・リアル・コース3,488,836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19,936,205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11,961,723円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,041円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月10日 至2015年12月9日

項目	当 期
(A) 配当等収益	4,849,980円
受取利息	4,849,980
(B) 有価証券売買損益	△ 176,333
売買益	15,667
売買損	△ 192,000
(C) 当期損益金 (A + B)	4,673,647
(D) 前期繰越損益金	3,178,379
(E) 解約差損益金	△ 74,181,691
(F) 追加信託差損益金	322,989,639
(G) 合計 (C + D + E + F)	256,659,974
次期繰越損益金 (G)	256,659,974

(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。