★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ英国高配当株ファンド	追加型投信／海外／株式
	ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	追加型投信／国内／債券
信託期間	約5年間（2014年5月30日～2019年5月17日）	
運用方針	ダイワ英国高配当株ファンド	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
	ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	ダイワ英国高配当株ファンド	イ．ケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ－ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）」（以下「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ．ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	イ．ダイワ・マネー・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券 ロ．わが国の公社債
運用方法	ダイワ英国高配当株ファンド	①主として、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）の受益証券を通じて、相対的に配当利回りの高い英国の株式等（不動産投資信託証券を含みます。）へ投資し、信託財産の成長をめざします。 ②当ファンドは、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）とダイワ・マネー・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、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
	ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	①マザーファンドの受益証券およびわが国の公社債を中心に投資することにより、安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A－2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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	ダイワ英国高配当株ファンド	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
	ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の30％以下
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、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、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。	

ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者から資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ英国高配当株ファンド
ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ

運用報告書（全体版）
第６期
（決算日　2017年５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、「ダイワ英国高配当株ファンド」および「ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ」は、このたび、第６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/

<5651>
<5652>

ダイワ英国高配当株ファンド

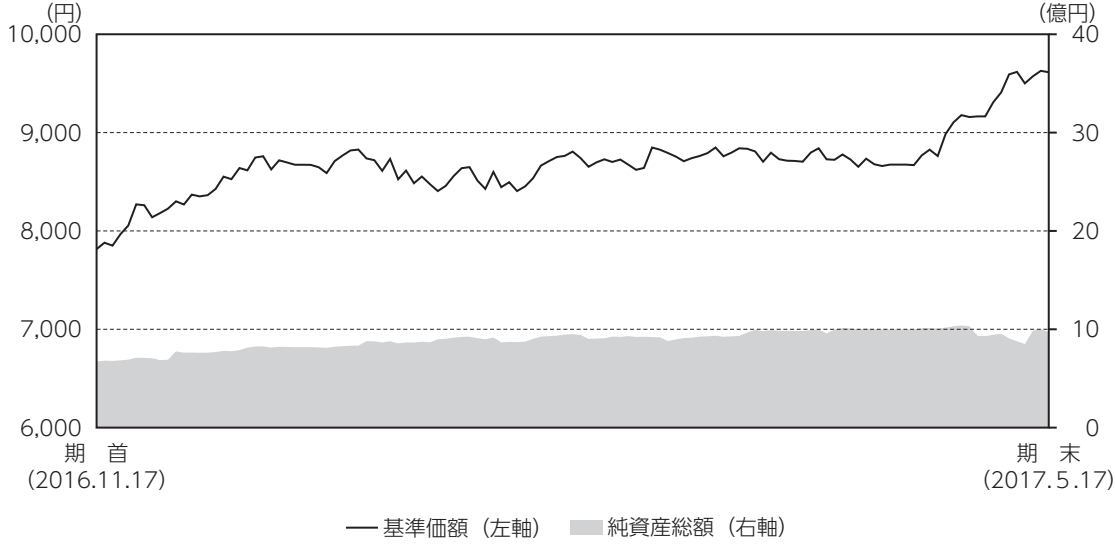
最近５期の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩ英国指数(配当込み、円換算)		公社債組入比率	投資信託証券受益組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期末(2015年５月18日)	11,122	400	11.8	11,552	9.4	0.0	98.8	2,089
3期末(2015年11月17日)	10,352	140	△ 5.7	10,293	△10.9	0.0	98.5	1,842
4期末(2016年５月17日)	8,418	0	△18.7	8,819	△14.3	0.0	98.2	1,117
5期末(2016年11月17日)	7,815	110	△ 5.9	8,489	△ 3.7	0.0	99.3	672
6期末(2017年５月17日)	9,424	190	23.0	10,379	22.3	0.0	98.4	967

（注１）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注２）ＭＳＣＩ英国指数（配当込み、円換算）は、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．の承諾を得て、ＭＳＣＩ英国指数（配当込み、英ポンドベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ＭＳＣＩ英国指数（配当込み、英ポンドベース）は、ＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．に帰属します。またＭＳＣＩ　Ｉｎｃ．は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
（注３）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注４）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５）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。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

期　首：7,815円
期　末：9,424円（分配金190円）
騰落率：23.0%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

英国株式市況は、堅調な世界経済への期待感や好調な企業業績の発表などを受けて上昇しました。また英ポンドは、米国の大統領選挙でのトランプ氏の勝利や、総じて堅調な国内経済などを背景に対円で上昇しました。当期において英国株式市況が上昇し、英ポンドが対円で上昇したため、基準価額は上昇しました。英国株式市況の動向につきましては、「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ英国高配当株ファンド

年　月　日	基準価額		MSCI英国指数(配当込み、円換算)		公社債組入比率	投資信託受益証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2016年11月17日	7,815	−	8,489	−	0.0	99.3
11月末	8,182	4.7	8,863	4.4	0.0	98.8
12月末	8,589	9.9	9,491	11.8	−	98.8
2017年 1 月末	8,513	8.9	9,455	11.4	0.0	99.2
2 月末	8,622	10.3	9,534	12.3	0.0	99.2
3 月末	8,797	12.6	9,746	14.8	−	99.3
4 月末	9,158	17.2	9,836	15.9	0.0	89.8
(期末) 2017年 5 月17日	9,614	23.0	10,379	22.3	0.0	98.4

(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 (2016.11.18～2017.5.17)

■英国株式市況

英国株式市況は、2016年12月から2017年１月半ばにかけて、産油国による原油の減産合意で原油価格が上昇したことや、イタリア国民投票およびＥＣＢ（欧州中央銀行）の政策決定会合などのイベントが大きな混乱なく通過したこと、また国内マクロ経済指標がおおむね堅調であったことなどから上昇しました。１月後半は、英ポンドが買い戻されたことや米国の新政権に対する警戒感が高まったことなどから下落しました。２月から３月にかけては、堅調な世界経済への期待感などから緩やかな上昇基調となりました。４月半ばには、メイ首相の解散総選挙表明を受けて下落する局面もありましたが、その後は５月半ばにかけて、好調な企業業績の発表などを背景に上昇しました。

■為替相場

英ポンドは、期首から2016年12月半ばにかけて、米国の大統領選挙でのトランプ氏の勝利を受け、同氏の経済政策への期待感などから市場のリスク選好度が強まり、対円で上昇しました。12月後半から2017年１月半ばにかけては、英国のＥＵ（欧州連合）離脱が強硬なものになるとの懸念が高まったことなどから英ポンドは対円で下落しました。その後はおおむね横ばいの推移となりましたが、４月半ばにメイ首相が議会下院の解散総選挙を発表すると、首相の求心力向上への期待感などから英ポンドは対円で上昇しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として、「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ－ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）」（以下「ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）」といいます。）の組入比率を高位に維持し、信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等へ投資し、信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・マネー・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。

ポートフォリオについて (2016.11.18～2017.5.17)

■当ファンド

当ファンドは、ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。主として、ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）を通じて、相対的に配当利回りの高い英国の株式等へ投資し、信託財産の成長をめざしました。

■ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等へ投資し、信託財産の成長をめざしました。

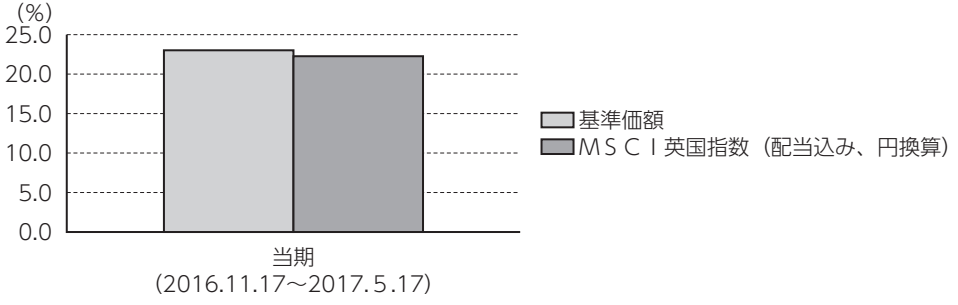
■ダイワ・マネー・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・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を設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数は英国株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



分配金について

当期の１万口当り分配金（税込み）は190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			当期 2016年11月18日 ～2017年５月17日
当期分配金（税込み）		(円)	190
	対基準価額比率	(%)	1.98
	当期の収益	(円)	190
	当期の収益以外	(円)	―
翌期繰越分配対象額		(円)	1,099

（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	当期
(ａ) 経費控除後の配当等収益	198.48円
(ｂ) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(ｃ) 収益調整金	868.93
(ｄ) 分配準備積立金	221.72
(ｅ) 当期分配対象額(ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ)	1,289.13
(ｆ) 分配金	190.00
(ｇ) 翌期繰越分配対象額(ｅ－ｆ)	1,099.13

（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

主として、ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）の組入比率を高位に維持し、信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等へ投資し、信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

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

１万口当りの費用の明細

項　　目	当期 (2016.11.18~2017.5.17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	57円	0.656%	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8,698円です。**
（投　信　会　社）	(19)	(0.214)	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)	(0.428)	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)	(0.013)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	―	―	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	―	―	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ　の　他　費　用	0	0.004	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（監　査　費　用）	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合　　計	57	0.660	

（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

（2016年11月18日から2017年５月17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）	6,271.21	537,862	4,684.108	411,000

（注１）買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。
（注２）金額は受渡し代金。
（注３）金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

（2016年11月18日から2017年５月17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
UK HIGH DIVIDEND EQUITY FUND CAPITAL GROWTH CLASS（ケイマン諸島）	5,991.381	513,000	85	UK HIGH DIVIDEND EQUITY FUND CAPITAL GROWTH CLASS（ケイマン諸島）	4,684.108	411,000	87

（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・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11月18日から2017年５月17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	208,316	41,661	20.0	－	－	－
コール・ローン	7,011,350	－	－	－	－	－
現先取引（その他有価証券）	119,999	－	－	119,999	－	－

（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）			
UK HIGH DIVIDEND EQUITY FUND CAPITAL GROWTH CLASS	10,360.862	952,090	98.4

（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・マザーファンド	98	98	99

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年５月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	952,090	93.9
ダイワ・マネー・マザーファンド	99	0.0
コール・ローン等、その他	62,160	6.1
投資信託財産総額	1,014,351	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５月17日現在

項目	当期末
(A) 資産	**1,014,351,072円**
コール・ローン等	62,160,366
投資信託受益証券(評価額)	952,090,716
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	99,990
(B) 負債	**46,592,652**
未払収益分配金	19,511,086
未払解約金	21,210,008
未払信託報酬	5,835,913
その他未払費用	35,645
(C) 純資産総額(A－B)	**967,758,420**
元本	1,026,899,280
次期繰越損益金	△ 59,140,860
(D) 受益権総口数	**1,026,899,280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859,955,475円、当期中における追加設定元本額は754,285,113円、同解約元本額は587,341,308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59,140,860円です。

■損益の状況

当期　自2016年11月18日　至2017年５月17日

項目	当期
(A) 配当等収益	**21,338,840円**
受取配当金	21,342,617
受取利息	864
支払利息	△ 4,641
(B) 有価証券売買損益	**109,694,620**
売買益	150,209,890
売買損	△ 40,515,270
(C) 信託報酬等	**△ 5,871,601**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**125,161,859**
(E) 前期繰越損益金	**△110,258,386**
(F) 追加信託差損益金	**△ 54,533,247**
(配当等相当額)	(89,230,484)
(売買損益相当額)	(△143,763,731)
(G) 合計(D＋E＋F)	**△ 39,629,774**
(H) 収益分配金	**△ 19,511,086**
次期繰越損益金(G+H)	**△ 59,140,860**
追加信託差損益金	△ 54,533,247
(配当等相当額)	(89,230,484)
(売買損益相当額)	(△143,763,731)
分配準備積立金	23,639,850
繰越損益金	△ 28,247,463

（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	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	20,382,344円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	89,230,484
(d) 分配準備積立金	22,768,592
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	132,381,420
(f) 分配金	19,511,086
(g) 翌期繰越分配対象額(e－f)	112,870,334
(h) 受益権総口数	1,026,899,280口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
1　万　口　当　り　分　配　金	190円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、５月17日現在の基準価額（１万口当り9,424円）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。

クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ－ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）

当ファンド（ダイワ英国高配当株ファンド）はケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ－ダイワ・ＵＫ・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（資産成長クラス）」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５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。

財政状態計算書
2016年９月30日現在

資産		
現金および現金同等物	ＧＢＰ	2,400,908
投資証券の評価額（簿価：ＧＢＰ41,034,400）		42,857,080
先物取引の評価額		8,110
約定未収金		810,609
その他の未収金		99,684
資産合計		**46,176,391**
負債		
スワップ取引の評価額		462,076
約定未払金		847
未払償還金		683,336
その他の未払金		56,620
負債合計		**1,202,879**
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産		**44,973,512**
内訳		
資産成長クラス受益証券		
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産	ＧＢＰ	6,071,663
発行済み償還可能参加型受益証券数		10,413,830
償還可能参加型受益証券一口当り純資産額	ＧＢＰ	0.5830
ツインαクラス受益証券		
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産	ＧＢＰ	38,901,849
発行済み償還可能参加型受益証券数		100,313,198
償還可能参加型受益証券一口当り純資産額	ＧＢＰ	0.3878

包括利益計算書
2016年９月30日に終了した会計年度

配当収益	ＧＢＰ	2,590,038
受取利息		3,295
投資による収益		5,763,225
外国為替取引による為替純損失		(19,580)
投資純利益		**8,336,978**
副投資運用会社報酬		208,593
報酬支払代理人報酬		110,529
管理会社報酬		29,799
保管会社報酬		21,416
監査報酬		12,933
受託会社報酬		6,895
手数料		806
その他費用		3,629
営業費用合計		**394,600**
償還可能参加型受益証券保有者に対する分配金		(15,306,586)
税引前損失		**(7,364,208)**
税額控除		(131,134)
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産の変動		**(7,495,342)**

組入明細（普通株式）

2016年9月30日

（普通株式）

銘柄名	株数	評価額（GBP）
3I GROUP PLC LONDON LINE	119,000	774,095
ANGLO AMERICAN PLC UK LINE	80,000	774,080
ASTRAZENECA ORD GBP	66,000	3,302,640
BAE SYSTEMS UK LINE	120,000	628,800
BARCLAYS BANK GBP UK LINE	24,557	41,207
BHP BILLITON PLC GBP	200,000	2,325,000
BP PLC UK LINE	222,761	1,002,425
BRITISH AMERICAN TOBACCO UK LINE	10,000	493,000
BRITISH LAND CO UK LINE	25,451	160,978
BRITVIC ORD GBP	48,000	289,440
BT GROUP UK LINE	225,000	875,363
CENTRICA PLC UK LINE	580,423	1,324,525
CREST NICHOLSON HLDGS GBP	115,000	518,995
CRH ORD GBP UK LINE	20,000	512,400
CRODA INTL ORD PLC GBP	6,000	209,040
DIAGEO PLC UK LINE	42,000	928,410
DIRECT LINE INS GBP	290,000	1,057,920
EXPERIAN PLC ORD USD0.10 UK LINE	13,000	200,720
GLAXOSMITHKLINE ORD GBP0.25 UK LINE	258,000	4,238,940
HSBC HLDGS PLC UK LINE	92,160	533,330
IMPERIAL BRANDS PLC UK LINE	11,500	456,953
INDIVIOR GBP	19,000	58,235
INMARSAT UK LINE	25,000	176,250
ITV PLC UK LINE	470,000	879,840
KCOM GROUP GBP	198,812	230,622
LANCASHIRE HLDGS COM SHS USD0.50 WI	20,000	134,100
LEGAL AND GENERAL GRP UK LINE	890,000	1,946,430
LLOYDS BANKING GROUP GBP0.10 UK LINE	500,000	272,750
LONMIN PLC ORD GBP	37	74
MAN GROUP PLC GBP	220,000	247,720
MEGGITT PLC GBP	50,000	225,500
MONDI PLC UK LINE	54,000	876,420
NATIONAL GRID ORD UK LINE	91,307	997,072
PEARSON PLC UK LINE	40,000	301,200
PERSIMMON PLC UK LINE	22,000	399,300
PRUDENTIAL PLC UK LINE	103,000	1,407,495
RANDGOLD RESOURCES LTD UK LINE	2,000	155,700
RECKITT BENCKISER GROUP PLC GBP	6,000	435,900
RIO TINTO PLC UK LINE	81,000	2,085,345
ROYAL DUTCH SHELL A SHS UK LINE	124,000	2,373,360
ROYAL DUTCH SHELL B UK LINE	89,683	1,790,970
RPC GROUP UK LINE	35,000	336,000
SAINSBURY /J/ UK LINE	60,000	147,480
SHIRE PLC GBP	22,500	1,124,550
SMITH AND NEPHEW ORD USD0.20	43,000	534,920
SMITH DS UK LINE	90,000	345,870
STANDARD CHARTERED UK LINE	6,736	42,322
TALK TALK TELECOM UK LINE	110,000	222,200
TAYLOR WIMPEY PLC GBP	400,000	616,400
TUI AG LN LINE GBP	40,000	438,800
TULLETT PREBON PLC GBP0.25	40,000	133,440
VODAFONE GROUP POST CON GBP	1,170,000	2,594,475
WOLSELEY PLC	5,000	217,750
WPP 2012 PLC GBP	51,000	925,140

（株式先物）

銘柄名	枚数	評価額（GBP）
FTSE 100 IDX (ICF) DEC-16	25	1,714,375

（注）株式先物の評価額は投資枚数と評価単価から算出したもので、財政状態計算書の評価額とは異なります。

ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ

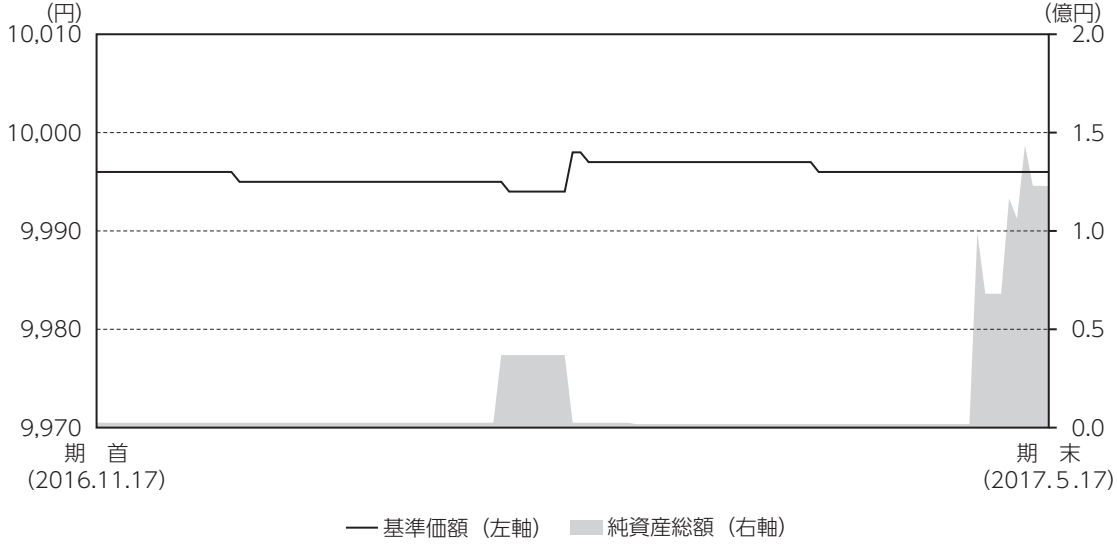
最近５期の運用実績

決算期	基準価額			公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込み分配金	期中騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
2期末(2015年５月18日)	10,004	0	0.0	34.2	－	152
3期末(2015年11月17日)	10,008	0	0.0	30.7	－	13
4期末(2016年５月17日)	10,002	0	△0.1	26.2	－	1
5期末(2016年11月17日)	9,996	0	△0.1	19.8	－	2
6期末(2017年５月17日)	9,996	0	0.0	9.9	－	122

（注１）公社債および債券先物の組入比率は、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）を除きます。
（注３）債券先物比率は買建比率－売建比率です。
（注４）当ファンドは、ダイワ英国高配当株ファンドの資金をスイッチングにより一時滞留させる受け皿としての役割を持ったファンドであり、マザーファンドおよび短期金融資産による安定運用を行ないます。そのため、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

期　首：9,996円
期　末：9,996円
騰落率：0.0%

■基準価額の主な変動要因

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は横ばいとなりました。

年　　月　　日	基準価額		公社債組入比率	債券先物比率
	円	%	%	%
（期首）2016年11月17日	9,996	－	19.8	－
11月末	9,996	0.0	18.7	－
12月末	9,995	△0.0	－	－
2017年 1 月末	9,995	△0.0	21.5	－
2 月末	9,997	0.0	17.2	－
3 月末	9,997	0.0	－	－
4 月末	9,996	0.0	22.7	－
（期末）2017年 5 月17日	9,996	0.0	9.9	－

（注）騰落率は期首比。

投資環境について (2016.11.18～2017.5.17)

■国内短期金融市況

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が維持される中、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」

■当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」へ投資を行ないます。

■ダイワ・マネー・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。

ポートフォリオについて (2016.11.18～2017.5.17)

■当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

■ダイワ・マネー・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、現先取引およびコール・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、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を見送らせていただきました。
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 2016年11月18日 ～2017年5月17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)	0

（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

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。そのため、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資します。

今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご留意くださいますようお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

項　　目	当期 (2016.11.18~2017.5.17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	—	—	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9,996円です。**
（投　信　会　社）	(—)	(—)	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）	(—)	(—)	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）	(—)	(—)	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	0.010	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)	(0.009)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	1	0.010	

（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）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3）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

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年11月18日から2017年５月17日まで)

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	148,671	151,530	66,517	67,797

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビー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) 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11月18日から2017年５月17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	208,316	41,661	20.0	－	－	－
コール・ローン	7,011,350	－	－	－	－	－
現先取引(その他有価証券)	119,999	－	－	119,999	－	－

(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。

■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。

■組入資産明細表

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・マザーファンド	1,729	83,883	85,493

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年５月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	85,493	54.1
コール・ローン等、その他	72,465	45.9
投資信託財産総額	157,959	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５月17日現在

項目	当期末
(A) 資産	**157,959,546円**
コール・ローン等	72,465,900
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	85,493,646
(B) 負債	**35,156,049**
未払解約金	35,155,865
その他未払費用	184
(C) 純資産総額(A－B)	**122,803,497**
元本	122,854,073
次期繰越損益金	△ 50,576
(D) 受益権総口数	**122,854,073口**
１万口当り基準価額(C／D)	**9,996円**

＊期首における元本額は2,519,647円、当期中における追加設定元本額は247,052,179円、同解約元本額は126,717,753円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は9,996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50,576円です。

■損益の状況

当期　自2016年11月18日　至2017年５月17日

項目	当期
(A) 配当等収益	**△ 1,044円**
受取利息	868
支払利息	△ 1,912
(B) 有価証券売買損益	**△ 143**
売買益	2,501
売買損	△ 2,644
(C) 信託報酬等	**△ 184**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△ 1,371**
(E) 前期繰越損益金	**5**
(F) 追加信託差損益金	**△49,210**
(配当等相当額)	(△35,768)
(売買損益相当額)	(△13,442)
(G) 合計(D＋E＋F)	**△50,576**
次期繰越損益金(G)	**△50,576**
追加信託差損益金	△49,210
(配当等相当額)	(△35,768)
(売買損益相当額)	(△13,442)
分配準備積立金	3,039
繰越損益金	△ 4,405

(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	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	3,010
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	29
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	3,039
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e－f)	3,039
(h) 受益権総口数	122,854,073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。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ英国高配当株ファンド／ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ）が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2016年12月９日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年５月17日）現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を22～23ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄

公　社　債

（2016年11月18日から2017年５月17日まで）

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	27,570,641		
657 国庫短期証券　2017/4/17	17,880,344		
642 国庫短期証券　2017/2/6	17,230,250		
652 国庫短期証券　2017/3/27	16,550,132		
659 国庫短期証券　2017/4/24	16,270,410		
632 国庫短期証券　2016/12/12	14,020,490		
651 国庫短期証券　2017/3/21	13,160,344		
644 国庫短期証券　2017/5/12	11,970,533		
638 国庫短期証券　2017/1/16	9,360,075		
648 国庫短期証券　2017/3/6	7,370,272		

（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、2017年５月17日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（71,154,851千口）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

2017年５月17日現在							
区　分	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	10,330,000	10,330,377	14.2	－	－	－	14.2

（注１）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注２）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
（注３）評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2017年5月17日現在						
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
国債証券		665 国庫短期証券	－	4,420,000	4,420,056	2017/05/22
		666 国庫短期証券	－	2,270,000	2,270,073	2017/05/29
		667 国庫短期証券	－	410,000	410,020	2017/06/05
		650 国庫短期証券	－	380,000	380,025	2017/06/12
		669 国庫短期証券	－	2,850,000	2,850,201	2017/06/12
合計	銘柄数	5銘柄				
	金額			10,330,000	10,330,377	

（注）単位未満は切捨て。

(3) 国内その他有価証券

	2017年5月17日現在	
	評価額	比率
	千円	%
国内短期社債等	999,998	<1.4>

（注1）＜　＞内は、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。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書　第12期（決算日　2016年12月９日）

（計算期間　2015年12月10日～2016年12月９日）

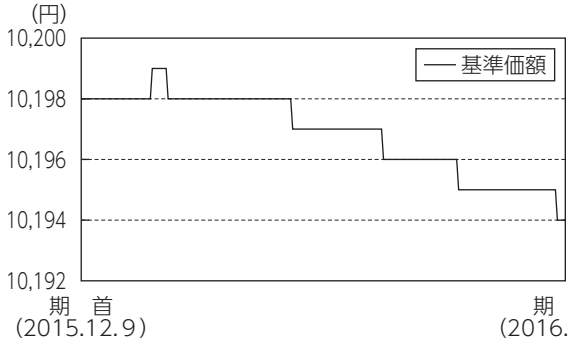
ダイワ・マネー・マザーファンドの第12期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
運用方法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A-2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が１年未満の短期債、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30％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)2015年12月9日	10,198	−	55.2
12月末	10,198	0.0	52.1
2016年1月末	10,198	0.0	94.1
2月末	10,198	0.0	50.0
3月末	10,198	0.0	−
4月末	10,198	0.0	3.3
5月末	10,197	△0.0	0.1
6月末	10,197	△0.0	1.6
7月末	10,196	△0.0	19.1
8月末	10,196	△0.0	44.5
9月末	10,195	△0.0	25.5
10月末	10,195	△0.0	3.4
11月末	10,195	△0.0	26.7
(期末)2016年12月9日	10,194	△0.0	30.1

(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、利息収入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：10,198円　期末：10,194円　騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・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	一円
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を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 公社債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	285,828,471	11,349,138 (297,450,000)

(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。

(2) その他有価証券

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国内短期社債等	17,999,984	16,999,986

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公社債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

当期 買付 銘柄	金額	当期 売付 銘柄	金額
	千円		千円
613 国庫短期証券 2016/9/12	27,280,379	567 国庫短期証券 2016/2/8	4,999,980
591 国庫短期証券 2016/5/30	24,330,973	566 国庫短期証券 2016/2/1	2,999,991
611 国庫短期証券 2016/9/5	19,330,584	342 2年国債 0.1% 2016/7/15	2,095,779
601 国庫短期証券 2016/7/19	19,020,392	100 5年国債 0.3% 2016/9/20	1,253,387
629 国庫短期証券 2016/11/28	14,720,456		
596 国庫短期証券 2016/6/20	14,390,312		
632 国庫短期証券 2016/12/12	14,020,490		
588 国庫短期証券 2016/5/16	12,500,147		
609 国庫短期証券 2016/8/22	10,870,238		
610 国庫短期証券 2016/8/29	10,390,257		

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

作成期	当期末						
区分	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	20,580,000	20,580,364	30.1	－	－	－	30.1

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
（注3）評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

区分	銘柄		当期末			
			年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
国債証券	632	国庫短期証券	－	14,020,000	14,020,113	2016/12/12
	634	国庫短期証券	－	2,010,000	2,010,039	2016/12/19
	635	国庫短期証券	－	4,550,000	4,550,211	2016/12/26
合計	銘柄数	3銘柄				
	金額			20,580,000	20,580,364	

（注）単位未満は切捨て。

(3) 国内その他有価証券

	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内短期社債等	999,999	<1.5>

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

■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	20,580,364	27.2
その他有価証券	999,999	1.3
コール・ローン等、その他	53,984,185	71.4
投資信託財産総額	75,564,549	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年12月9日現在

項目	当期末
(A) 資産	**75,564,549,239円**
コール・ローン等	53,983,440,401
公社債(評価額)	20,580,364,994
現先取引(その他有価証券)	999,999,178
その他未収収益	744,666
(B) 負債	**7,294,738,200**
未払金	1,800,034,200
未払解約金	5,494,704,000
(C) 純資産総額(A－B)	**68,269,811,039**
元本	66,967,614,984
次期繰越損益金	1,302,196,055
(D) 受益権総口数	**66,967,614,984口**
1万口当り基準価額(C／D)	**10,194円**

＊期首における元本額は77,361,886,547円、当期中における追加設定元本額は229,319,669,570円、同解約元本額は239,713,941,133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ＦＥグローバル・バリュー（為替ヘッジあり）98,069円、ダイワＦＥグローバル・バリュー（為替ヘッジなし）98,069円、ダイワ／“ＲＩＣＩ®”コモディティ・ファンド8,952,508円、ＵＳ債券ＮＢ戦略ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）740,564円、ＵＳ債券ＮＢ戦略ファンド（為替ヘッジなし／年1回決算型）1,623,350円、スマート・アロケーション・Ｄガード1,987,559円、ＮＢストラテジック・インカム・ファンド＜ラップ＞米ドルコース981円、ＮＢストラテジック・インカム・ファンド＜ラップ＞円コース981円、ＮＢストラテジック・インカム・ファンド＜ラップ＞世界通貨分散コース981円、堅実バランスファンド　－ハジメの一歩－129,891,397円、ＤＣダイワ・マネー・ポートフォリオ2,529,071,704円、ダイワファンドラップ　コモディティセレクト317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）－トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）　－トリプルリターンズ－　豪ドル・コース（毎月分配型）643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）　－トリプルリターンズ－　ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）－トリプルリターンズ－　米ドル・コース（毎月分配型）12,784円、ダイワ／フィデリティ北米株式ファンド　－パラダイムシフト－29,484,934円、（適格機関投資家専用）スマート・シックス・Ｄガード495,850,899円、ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ21,858,178,543円、ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ34,413,293,504円、ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ6,512,563,667円、ダイワＦＥグローバル・バリュー株ファンド（ダイワＳＭＡ専用）4,090,590円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）98,290,744円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）日本円・コース　（毎月分配型）23,590,527円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）米ドル・コース（毎月分配型）2,163,360円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）豪ドル・コース（毎月分配型）13,761,552円、ダイワ／アムンディ食糧増産関連ファンド4,974,315円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ197,896,688円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスⅡ　－金積立型－501,660円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド（償還条項付き）為替ヘッジあり1,004,378円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド（資産成長コース）49,082,149円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド（通貨αコース）196,290,094円、ダイワ・ダブルバランス・ファンド（Ｄガード付／部分為替ヘッジあり）27,494,856円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド　－インフラ革命－　（為替ヘッジあり）988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド　－インフラ革命－　（為替ヘッジなし）4,926,018円、ダイワ米国ＭＬＰファンド（毎月分配型）米ドルコース13,732,222円、ダイワ米国ＭＬＰファンド（毎月分配型）日本円コース3,874,449円、ダイワ米国ＭＬＰファンド（毎月分配型）通貨αコース13,437,960円、ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型）98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ1,724,477円、ＤＣスマート・アロケーション・Ｄガード95,147円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド（ダイワＳＭＡ専用）274,626円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）南アフリカ・ランド・コース（毎月分配型）98,252円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）トルコ・リラ・コース（毎月分配型）2,554,212円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）通貨セレクト・コース（毎月分配型）1,178,976円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）　通貨αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）　株式＆通貨ツインαコース982,029円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）　－トリプルリターンズ－通貨セレクト・コース（毎月分配型）98,174円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,194円です。

■損益の状況

当期　自2015年12月10日　至2016年12月9日

項目	当期	
(A) 配当等収益	△	**17,198,883円**
受取利息	△	3,050,070
その他収益金		744,666
支払利息	△	14,893,479
(B) 有価証券売買損益	△	**1,077,368**
売買益		242,421
売買損	△	1,319,789
(C) その他費用	△	**139,970**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△	**18,416,221**
(E) 前期繰越損益金		**1,530,291,621**
(F) 解約差損益金		**△4,723,800,173**
(G) 追加信託差損益金		**4,514,120,828**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)		**1,302,196,055**
次期繰越損益金(H)		**1,302,196,055**

（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。