

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／海外／資産複合
信 託 期 間	5 年 4 カ月間（2014年 6 月18日～2019年10月17日）
運 用 方 針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」（以下「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
当ファンドの運用方法	①主として、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）の受益証券を通じて、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等への投資により、高利回りの獲得をめざすとともに、通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の構築により、オプションプレミアムの確保をめざします。 ②当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）とダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）の投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）では、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
組 入 制 限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準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、分配を行わないことがあります。

ダイワ豪ドル建て
高利回り証券α
（毎月分配型）

運用報告書（全体版）

第33期（決算日	2017年 5 月17日）
第34期（決算日	2017年 6 月19日）
第35期（決算日	2017年 7 月18日）
第36期（決算日	2017年 8 月17日）
第37期（決算日	2017年 9 月19日）
第38期（決算日	2017年10月17日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）」は、このたび、第38期の決算を行ないました。

ここに、第33期～第38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 0 1 2 0 - 1 0 6 2 1 2
（営業日の 9：00～17：00）
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額				公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 率 受 益 証 比	純 資 産 額
	(分 配 落)	税 込 配 分	み 金 騰 落	中 率			
	円	円	%	%	%	百万円	
9 期末（2015年 5 月18日）	9,241	80	2.6	0.0	98.9	29,491	
10期末（2015年 6 月17日）	9,130	80	△ 0.3	0.0	99.1	28,668	
11期末（2015年 7 月17日）	8,785	80	△ 2.9	0.0	99.0	25,968	
12期末（2015年 8 月17日）	8,657	80	△ 0.5	0.0	99.4	24,543	
13期末（2015年 9 月17日）	8,076	80	△ 5.8	0.0	99.4	22,221	
14期末（2015年10月19日）	8,042	80	0.6	0.0	98.8	21,068	
15期末（2015年11月17日）	8,035	80	0.9	0.0	99.2	20,483	
16期末（2015年12月17日）	7,918	80	△ 0.5	0.0	99.2	19,617	
17期末（2016年 1 月18日）	7,273	80	△ 7.1	0.0	99.3	17,529	
18期末（2016年 2 月17日）	7,141	80	△ 0.7	0.0	98.9	16,516	
19期末（2016年 3 月17日）	7,391	80	4.6	0.0	99.4	16,710	
20期末（2016年 4 月18日）	7,307	80	△ 0.1	0.0	99.3	16,037	
21期末（2016年 5 月17日）	6,995	80	△ 3.2	0.0	99.1	14,927	
22期末（2016年 6 月17日）	6,677	80	△ 3.4	0.0	99.0	13,855	
23期末（2016年 7 月19日）	6,925	80	4.9	0.0	99.1	13,989	
24期末（2016年 8 月17日）	6,752	80	△ 1.3	0.0	98.8	13,415	
25期末（2016年 9 月20日）	6,692	80	0.3	0.0	98.3	12,808	
26期末（2016年10月17日）	6,813	80	3.0	0.0	99.5	12,439	
27期末（2016年11月17日）	6,857	80	1.8	0.0	99.4	12,134	
28期末（2016年12月19日）	7,068	80	4.2	0.0	98.8	12,266	
29期末（2017年 1 月17日）	7,084	80	1.4	0.0	99.0	12,177	
30期末（2017年 2 月17日）	7,128	80	1.8	0.0	99.0	12,064	
31期末（2017年 3 月17日）	7,100	80	0.7	0.0	98.7	11,996	
32期末（2017年 4 月17日）	6,795	80	△ 3.2	0.0	99.4	11,238	
33期末（2017年 5 月17日）	6,835	80	1.8	0.0	99.5	11,069	
34期末（2017年 6 月19日）	6,779	80	0.4	0.0	99.0	10,821	
35期末（2017年 7 月18日）	6,942	80	3.6	—	99.2	10,795	
36期末（2017年 8 月17日）	6,840	80	△ 0.3	—	99.1	10,424	
37期末（2017年 9 月19日）	6,845	80	1.2	—	98.9	10,181	
38期末（2017年10月17日）	6,769	80	0.1	—	98.6	9,866	

（注 1）基準価額の騰落率は分配金込み。

（注 2）公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

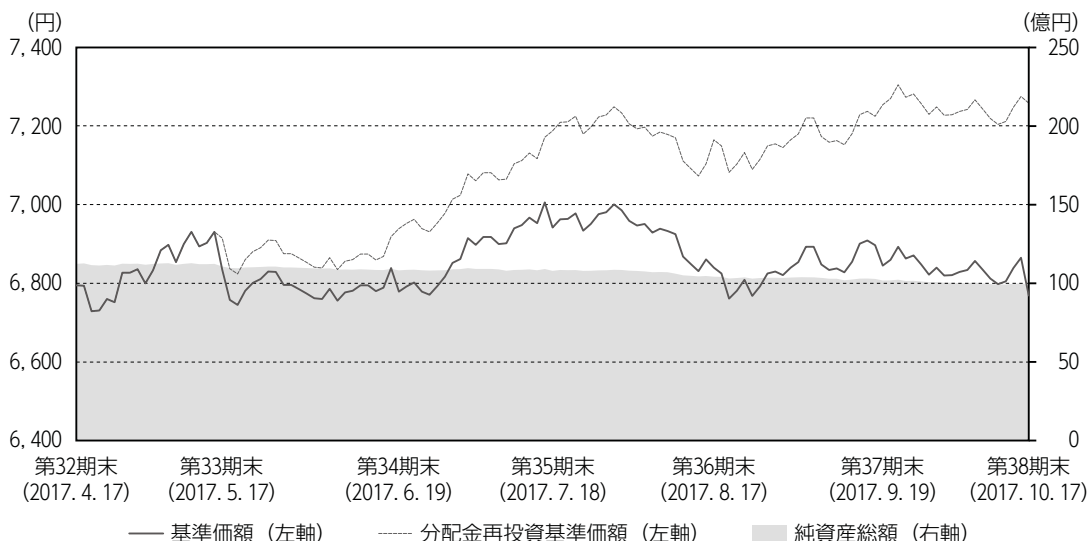
（注 3）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

（注 4）当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

基準価額・騰落率

第33期首：6,795円

第38期末：6,769円（既払分配金480円）

騰落率：6.8%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券が堅調な動きとなったほか、豪ドルが対円で上昇したこと、加えて為替オプションのプレミアム収入がプラスの寄与となったことが要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 率
			騰 落 率		
第33期	(期 首) 2017年 4月17日	円 6,795	% —	% 0.0	% 99.4
	4 月末	6,800	0.1	0.0	99.2
	(期 末) 2017年 5月17日	6,915	1.8	0.0	99.5
第34期	(期 首) 2017年 5月17日	6,835	—	0.0	99.5
	5 月末	6,785	△ 0.7	0.0	99.5
	(期 末) 2017年 6月19日	6,859	0.4	0.0	99.0
第35期	(期 首) 2017年 6月19日	6,779	—	0.0	99.0
	6 月末	6,915	2.0	0.0	98.8
	(期 末) 2017年 7月18日	7,022	3.6	—	99.2
第36期	(期 首) 2017年 7月18日	6,942	—	—	99.2
	7 月末	6,986	0.6	0.0	99.3
	(期 末) 2017年 8月17日	6,920	△ 0.3	—	99.1
第37期	(期 首) 2017年 8月17日	6,840	—	—	99.1
	8 月末	6,840	0.0	—	98.7
	(期 末) 2017年 9月19日	6,925	1.2	—	98.9
第38期	(期 首) 2017年 9月19日	6,845	—	—	98.9
	9 月末	6,820	△ 0.4	—	99.0
	(期 末) 2017年10月17日	6,849	0.1	—	98.6

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 4. 18 ～ 2017. 10. 17）

■オーストラリア債券市況

オーストラリア債券市況は、当作成期間を通して金利は上昇しました。

第33期首より、フランス大統領選挙の結果などが金利上昇の材料となった一方で、米国トランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことなどが、金利低下の材料となりました。2017年6月下旬からは、先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で金利が上昇しましたが、その後はトランプ政権の政策実行能力への懸念が高まったことや北朝鮮に関する地政学リスクが意識されたことなどが、金利低下の材料となりました。9月中旬にかけては、市場のリスク回避姿勢が後退したことや、FOMC（米国連邦公開市場委員会）において年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから、金利は上昇しました。

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券の信用スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は、縮小しました。企業のファンダメンタルズが良好なことや、過去に比べて低金利が続く中で投資家の利回りに対する需要が強いことが、スプレッドの縮小要因となりました。

■為替相場

豪ドル円為替相場は、当作成期間を通して上昇（円安）しました。

第33期首より、豪ドルは方向感なく推移しました。2017年6月以降は、オーストラリアで堅調な経済指標が確認されたことやオーストラリアの主要輸出品目である鉄鉱石の価格が上昇したことなどから、豪ドルは上昇しました。8月以降は、北朝鮮に関する地政学リスクが意識されて市場のリスク回避姿勢が強まったことや、鉄鉱石価格の下落などが豪ドルの下落材料となりました。一方、北朝鮮の情勢への警戒感が和らぎ市場のリスク回避姿勢が後退したことなどが豪ドルの上昇材料となるなど、豪ドルは方向感のない推移となりました。

■通貨オプション市況

通貨オプションのインプライド・ボラティリティ（予想変動率）は低下しました。

第33期首から2017年4月後半にかけては、フランス大統領選挙第1回投票などのイベントを消化したことに加え、北朝鮮をめぐる地政学リスクへの警戒感も和らいだことで、インプライド・ボラティリティは大きく低下しました。その後も、豪ドル円が堅調に推移したことから市場の警戒感が後退し、ボラティリティの低下が続きました。8月には、北朝鮮に関する地政学リスクが再び高まったことでボラティリティは上昇に転じましたが、10月に入ると、市場の警戒感の後退とともにボラティリティは低下しました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

■当ファンド

当ファンドは、「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」（以下、「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」といいます。）とダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資し、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）への投資割合を高位に維持することをめざします。

■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券の流通市場で割安に取引されている銘柄や、新規発行銘柄の組み入れに注力します。引き続き、新規発行および流通市場の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力する方針です。

通貨カバードコール戦略については、保有する豪ドル建て資産の評価額の50%程度のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの獲得をめざします。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・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. 4. 18 ~ 2017. 10. 17)

■当ファンド

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）とダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期間を通じてダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨α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した。

■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等への投資により、高利回りの獲得をめざすとともに、通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の構築により、オプションプレミアムの確保をめざして運用を行ないました。円に対する豪ドルのコール・オプションのカバー率は、保有する豪ドル建て資産の評価額の50%程度を維持しました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

第33期から第38期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ80円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
	2017年4月18日 ～2017年5月17日	2017年5月18日 ～2017年6月19日	2017年6月20日 ～2017年7月18日	2017年7月19日 ～2017年8月17日	2017年8月18日 ～2017年9月19日	2017年9月20日 ～2017年10月17日
当期分配金（税込み）（円）	80	80	80	80	80	80
対基準価額比率（％）	1.16	1.17	1.14	1.16	1.16	1.17
当期の収益（円）	71	63	66	61	60	56
当期の収益以外（円）	8	16	13	18	19	23
翌期繰越分配対象額（円）	154	138	125	106	87	63

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
(a) 経費控除後の配当等収益	71.42円	63.49円	66.80円	61.09円	60.70円	56.29円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	45.05	45.97	46.30	46.88	47.76	47.88
(d) 分配準備積立金	118.26	108.86	92.05	78.27	58.78	39.37
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	234.74	218.33	205.15	186.25	167.25	143.55
(f) 分配金	80.00	80.00	80.00	80.00	80.00	80.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	154.74	138.33	125.15	106.25	87.25	63.55

（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

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）とダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資し、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）への投資割合を高位に維持することをめざします。

■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

豪ドル建ての社債およびハイブリッド証券の流通市場で割安に取引されている銘柄や、新規発行銘柄の組み入れに注力しています。普通社債とハイブリッド証券の起債については、今後も一定程度の発行が行なわれる状況が継続するとみており、引き続き新規発行および流通市場の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。

通貨カバードコール戦略については、保有する豪ドル建て資産の評価額の50%程度のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの獲得をめざします。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

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

1 万口当りの費用の明細

項 目	第33期～第38期 (2017. 4. 18～2017. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0. 583%	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6, 852円です。
（投 信 会 社）	(11)	(0. 162)	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）	(28)	(0. 406)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 銀 行）	(1)	(0. 016)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 020	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
（投資信託受益証券）	(1)	(0. 020)	
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	42	0. 607	

（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。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 38 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) DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CURRENCY ALPHA CLASS)	142,278.158	9,732,821	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。

■投資信託財産の構成

2017年10月17日現在

項 目	第 38 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	9,732,821	97.3
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	273,073	2.7
投資信託財産総額	10,005,905	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第32期末	第 38 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	9	9	9

(注) 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)、(2017年6月19日)、(2017年7月18日)、(2017年8月17日)、(2017年9月19日)、(2017年10月17日) 現在

項 目	第33期末	第34期末	第35期末	第36期末	第37期末	第38期末
(A) 資産	11,266,048,572円	10,997,740,573円	10,981,388,304円	10,594,048,144円	10,389,438,473円	10,005,905,525円
コール・ローン等	253,071,820	285,604,880	277,241,181	263,987,719	321,002,981	273,073,575
投資信託受益証券（評価額）	11,012,966,755	10,712,125,697	10,704,137,127	10,330,050,430	10,068,425,497	9,732,821,956
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（評価額）	9,997	9,996	9,996	9,995	9,995	9,994
(B) 負債	196,673,835	175,770,726	186,323,822	169,859,787	208,292,441	139,447,907
未払収益分配金	129,563,726	127,705,520	124,406,614	121,926,135	118,985,970	116,609,571
未払解約金	56,278,158	36,356,696	51,617,279	37,359,778	78,037,375	13,410,067
未払信託報酬	10,757,244	11,553,607	10,075,075	10,277,665	10,897,225	8,993,954
その他未払費用	74,707	154,903	224,854	296,209	371,871	434,315
(C) 純資産総額（A－B）	11,069,374,737	10,821,969,847	10,795,064,482	10,424,188,357	10,181,146,032	9,866,457,618
元本	16,195,465,759	15,963,190,069	15,550,826,807	15,240,766,894	14,873,246,345	14,576,196,408
次期繰越損益金	△ 5,126,091,022	△ 5,141,220,222	△ 4,755,762,325	△ 4,816,578,537	△ 4,692,100,313	△ 4,709,738,790
(D) 受益権総口数	16,195,465,759□	15,963,190,069□	15,550,826,807□	15,240,766,894□	14,873,246,345□	14,576,196,408□
1万口当り基準価額（C／D）	6,835円	6,779円	6,942円	6,840円	6,845円	6,769円

* 第32期末における元本額は16,540,338,116円、当作成期間（第33期～第38期）中における追加設定元本額は525,857,408円、同解約元本額は2,489,999,116円です。
* 第38期末の計算口数当りの純資産額は6,769円です。
* 第38期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は4,709,738,790円です。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

■損益の状況

	第33期 自2017年4月18日 第34期 自2017年5月18日	第33期 自2017年5月17日 第34期 自2017年6月19日	第35期 自2017年6月20日 第36期 自2017年7月19日	第35期 自2017年7月18日 第36期 自2017年8月17日	第37期 自2017年8月18日 第38期 自2017年9月20日	第37期 自2017年9月19日 第38期 自2017年10月17日
項 目	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
(A) 配当等収益	122,119,312円	112,985,654円	106,681,164円	103,458,394円	98,092,798円	91,109,404円
受取配当金	122,124,960	112,992,891	106,687,101	103,464,788	98,101,295	91,115,382
受取利息	36	19	27	27	35	28
支払利息	△ 5,684	△ 7,256	△ 5,964	△ 6,421	△ 8,532	△ 6,006
(B) 有価証券売買損益	83,424,645	△ 61,983,691	280,449,592	△ 127,135,550	39,717,827	△ 76,797,743
売買益	84,490,097	3,216,539	283,436,771	2,105,150	42,445,367	797,088
売買損	△ 1,065,452	△ 65,200,230	△ 2,987,179	△ 129,240,700	△ 2,727,540	△ 77,594,831
(C) 信託報酬等	△ 10,832,219	△ 11,633,825	△ 10,145,026	△ 10,349,020	△ 10,972,887	△ 9,056,398
(D) 当期損益金 (A + B + C)	194,711,738	39,368,138	376,985,730	△ 34,026,176	126,837,738	5,255,263
(E) 前期繰越損益金	△ 4,667,510,238	△ 4,502,276,337	△ 4,457,156,761	△ 4,090,275,171	△ 4,103,178,371	△ 4,002,390,892
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	△ 523,728,796 (72,970,679)	△ 550,606,503 (73,396,175)	△ 551,184,680 (72,002,609)	△ 570,351,055 (71,459,596)	△ 596,773,710 (71,046,006)	△ 595,993,590 (69,800,957)
(売買損益相当額)	(△ 596,699,475)	(△ 624,002,678)	(△ 623,187,289)	(△ 641,810,651)	(△ 667,819,716)	(△ 665,794,547)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 4,996,527,296	△ 5,013,514,702	△ 4,631,355,711	△ 4,694,652,402	△ 4,573,114,343	△ 4,593,129,219
(H) 収益分配金 次期繰越損益金 (G + H)	△ 129,563,726 △ 5,126,091,022	△ 127,705,520 △ 5,141,220,222	△ 124,406,614 △ 4,755,762,325	△ 121,926,135 △ 4,816,578,537	△ 118,985,970 △ 4,692,100,313	△ 116,609,571 △ 4,709,738,790
追加信託差損益金 (配当等相当額)	△ 523,728,796 (72,970,679)	△ 550,606,503 (73,396,175)	△ 551,184,680 (72,002,609)	△ 570,351,055 (71,459,596)	△ 596,773,710 (71,046,006)	△ 595,993,590 (69,800,957)
(売買損益相当額)	(△ 596,699,475)	(△ 624,002,678)	(△ 623,187,289)	(△ 641,810,651)	(△ 667,819,716)	(△ 665,794,547)
分配準備積立金	177,653,326	147,436,273	122,628,630	90,478,180	58,726,431	22,837,182
繰越損益金	△ 4,780,015,552	△ 4,738,049,992	△ 4,327,206,275	△ 4,336,705,662	△ 4,154,053,034	△ 4,136,582,382

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
(a) 経費控除後の配当等収益	115,683,891円	101,351,829円	103,885,195円	93,109,374円	90,282,297円	82,053,006円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	72,970,679	73,396,175	72,002,609	71,459,596	71,046,006	69,800,957
(d) 分配準備積立金	191,533,161	173,789,964	143,150,049	119,294,941	87,430,104	57,393,747
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	380,187,731	348,537,968	319,037,853	283,863,911	248,758,407	209,247,710
(f) 分配金	129,563,726	127,705,520	124,406,614	121,926,135	118,985,970	116,609,571
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	250,624,005	220,832,448	194,631,239	161,937,776	129,772,437	92,638,139
(h) 受益権総口数	16,195,465,759口	15,963,190,069口	15,550,826,807口	15,240,766,894口	14,873,246,345口	14,576,196,408口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万 口 当 り 分 配 金	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
	80円	80円	80円	80円	80円	80円
(単 価)	(6, 835円)	(6, 779円)	(6, 942円)	(6, 840円)	(6, 845円)	(6, 769円)

●＜分配金再投資コース＞をご利用の方の税引き分配金は、上記（ ）内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・
ハインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型））はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）」の受益証券に投資しております。以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。

（注）2017年10月17日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（豪ドル建て）

貸借対照表

2017年3月31日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$230, 170, 464）	\$	245, 912, 619
現金		14, 245, 386
外国為替先渡契約による評価益		182
未収：		
売却済みの投資資産		283, 867
配当		68, 079
利息		1, 233, 216
前払受託会社報酬		14, 370
その他資産		1, 046
資産合計		261, 758, 765

負債

売建てオプションの評価額（受取プレミアム \$958, 860）		452, 093
未払：		
購入済みの投資資産		3, 006, 000
解約済み受益証券		3, 939, 503
運用会社報酬		573, 987
専門家報酬		68, 111
保管会社報酬		27, 056
会計および管理会社報酬		26, 179

為替運用会社報酬	11,680
名義書換代理人報酬	4,998
負債合計	8,109,607
純資産	\$ 253,649,158
純資産	
クラス A	\$ 117,145,856
通貨αクラス	136,503,302
	\$ 253,649,158
発行済み受益証券口数	
クラス A	98,919,563
通貨αクラス	166,388,227
受益証券1口当り純資産額	
クラス A	\$ 1.184
通貨αクラス	\$ 0.820

損益計算書

2017年 3月31日に終了した年度

投資収益

受取利息（源泉税 \$56,686控除後）	\$	8,917,848
配当収益（源泉税 \$109,224控除後）		1,169,128
投資収益合計		10,086,976

費用

運用会社報酬		1,944,441
保管会社報酬		189,104
会計および管理会社報酬		179,971
為替運用会社報酬		161,686
専門家報酬		63,580
名義書換代理人報酬		35,113
受託会社報酬		18,814
登録料		1,649
その他費用		297
費用合計		2,594,655

投資純利益		7,492,321
--------------	--	------------------

実現益（損）および評価益（損）：

実現益（損）：

証券投資		1,735,356
先物取引		467,594
売建オプション		509,745
外国為替取引および外国為替先渡契約		(70,088)
純実現益		2,642,607

評価益（損）の純変動：

証券投資		16,874,672
売建オプション		1,362,179
先物取引		257,104
外国為替換算および外国為替先渡契約		5,639
評価益の純変動		18,499,594

純実現・純評価益		21,142,201
-----------------	--	-------------------

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

投資明細表
2017年3月31日

<u>元本</u>		<u>銘柄</u>	<u>評価額</u>
債券 (82.4%)			
オーストラリア (67.0%)			
社債 (67.0%)			
AAI, Ltd. (a), (b)			
AUD	1,250,000	4.99% due 10/06/42	\$ 1,304,569
Adani Abbot Point Terminal Pty, Ltd. (a)			
AUD	4,000,000	6.75% due 11/01/18	4,010,808
AGL Energy, Ltd. (a)			
AUD	5,000,000	5.00% due 11/05/21	5,232,545
Ale Direct Property Trust (a)			
AUD	5,000,000	4.00% due 08/20/22	5,029,125
Alumina, Ltd. (a)			
AUD	7,000,000	7.25% due 11/19/19	7,267,022
AMP Bank, Ltd. (b)			
AUD	4,000,000	3.13% due 05/24/21	4,051,272
AMP, Ltd. (a), (b), (c)			
AUD	5,000,000	5.97% due 12/31/49	4,973,035
APT Pipelines, Ltd. (a), (b)			
AUD	66,420	6.29% due 09/30/72	6,774,176
Aurizon Network Pty, Ltd.			
AUD	1,550,000	5.75% due 10/28/20	1,665,418
AusNet Services Holdings Pty, Ltd.			
AUD	5,000,000	5.25% due 02/14/20	5,278,185
Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a)			
AUD	5,500,000	2.91% due 08/16/21 (b)	5,565,439
AUD	2,500,000	4.48% due 05/17/26	2,584,233
Australian Unity, Ltd. (b)			
AUD	57,748	4.58% due 12/15/20	6,023,116
Bank of Queensland, Ltd. (a), (b), (c)			
AUD	1,500,000	6.36% due 12/31/49	1,514,304
Caltex Australia, Ltd. (a), (b)			
AUD	60,868	6.29% due 09/15/37	6,165,989

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

	<u>元本</u>	<u>銘柄</u>	<u>評価額</u>
AUD	3,000,000	Commonwealth Bank of Australia (a), (b) 4.44% due 06/03/26	3,096,417
AUD	124,958	Crown Resorts, Ltd. (a), (b) 5.80% due 04/23/75	11,883,506
AUD	24,767	6.80% due 09/14/72 ETSA Utilities Finance Pty, Ltd. (b)	2,522,519
AUD	2,750,000	3.18% due 10/09/17 Global Switch Property Australia Pty, Ltd.	2,753,418
AUD	4,550,000	6.25% due 12/23/20 Holcim Finance Australia Pty, Ltd.	4,939,230
AUD	4,000,000	3.75% due 03/19/20 Insurance Australia, Ltd. (a), (b)	4,033,204
AUD	3,280,000	4.60% due 03/19/40 Investa Office Fund (a)	3,334,871
AUD	3,000,000	4.26% due 04/05/24 Macquarie Bank, Ltd. (a), (b), (c)	3,000,000
AUD	12,318	5.30% due 12/31/49 Macquarie Finance, Ltd. (a), (b), (c)	1,231,430
AUD	145,427	3.48% due 12/31/49 Mirvac Group Finance, Ltd.	10,982,647
AUD	3,500,000	5.75% due 09/18/20 National Australia Bank, Ltd. (a), (b)	3,764,723
AUD	246,661	3.03% due 12/31/49 (c)	18,785,702
AUD	11,250	4.00% due 09/20/28	1,135,125
AUD	2,000,000	4.20% due 09/21/26 Qantas Airways, Ltd.	2,048,022
AUD	6,500,000	7.50% due 06/11/21 Scentre Group Trust 1 (a)	7,375,823
AUD	1,500,000	4.50% due 09/08/21 Suncorp Group, Ltd. (a), (b)	1,559,619
AUD	32,985	4.63% due 11/22/23 Suncorp-Metway, Ltd. (a), (b), (c)	3,375,091
AUD	33,991	2.53% due 12/31/49 Tatts Group, Ltd. (b)	2,532,669
AUD	49,929	4.89% due 07/05/19	5,197,609

	<u>元本</u>	<u>銘柄</u>	<u>評価額</u>
AUD	88,369	Westpac Banking Corp. (a), (b) 4.08% due 08/22/23	8,951,868
		社債合計	169,942,729
		オーストラリア合計（簿価 \$154,980,495）	169,942,729
		カナダ（2.0%）	
		社債（2.0%）	
AUD	5,000,000	Royal Bank of Canada (b) 3.05% due 02/03/21	5,065,135
		社債合計	5,065,135
		カナダ合計（簿価 \$5,000,000）	5,065,135
		フランス（1.4%）	
		社債（1.4%）	
AUD	3,500,000	BNP Paribas S. A. (a), (b) 5.00% due 05/31/28	3,553,378
		社債合計	3,553,378
		フランス合計（簿価 \$3,494,826）	3,553,378
		オランダ（2.0%）	
		社債（2.0%）	
AUD	2,000,000	Cooperatieve Rabobank UA (a), (b) 4.29% due 07/02/25	2,032,832
AUD	3,000,000	5.00% due 07/02/25	3,088,374
		社債合計	5,121,206
		オランダ合計（簿価 \$4,947,911）	5,121,206
		ニュージーランド（1.2%）	
		社債（1.2%）	
AUD	36,585	Nufarm Finance NZ, Ltd. (a), (b), (c) 5.89% due 12/31/49	3,164,968
		社債合計	3,164,968
		ニュージーランド合計（簿価 \$2,971,877）	3,164,968
		スウェーデン（4.8%）	
		社債（4.8%）	
AUD	5,000,000	Svenska Handelsbanken AB (b) 3.29% due 03/02/21	5,079,215
AUD	7,000,000	Swedbank AB (b) 2.92% due 11/05/18	7,038,829

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

	<u>元本</u>	<u>銘柄</u>	<u>評価額</u>
		社債合計	12,118,044
		スウェーデン合計（簿価 \$12,000,000）	12,118,044
		スイス（2.0%）	
		社債（2.0%）	
		Credit Suisse AG（b）	
AUD	5,000,000	2.92% due 04/29/20	5,018,940
		社債合計	5,018,940
		スイス合計（簿価 \$5,000,000）	5,018,940
		米国（2.0%）	
		社債（2.0%）	
		Citigroup, Inc.（b）	
AUD	5,000,000	3.02% due 08/07/19	5,015,650
		社債合計	5,015,650
		米国合計（簿価 \$5,000,000）	5,015,650
		債券合計（簿価 \$193,395,109）	209,000,050
	<u>株数</u>	優先株式（12.5%）	
		オーストラリア（12.5%）	
		銀行（3.9%）	
	1,900	Bendigo & Adelaide Bank, Ltd.（a）,（b）,（c）	195,320
	45,004	Commonwealth Bank of Australia（a）,（b）,（c）	4,275,830
	45,008	Commonwealth Bank of Australia/New Zealand（a）,（b）,（c）	4,550,800
	5,000	National Australia Bank Series CN, Ltd.（a）,（b）,（c）	500,800
	2,301	National Australia Bank Series CPS2, Ltd.（a）,（b）,（c）	228,719
	5,000	Westpac Banking Corp.（a）,（b）,（c）	492,500
			10,243,969
		総合金融サービス（0.6%）	
	14,221	Macquarie Group, Ltd.（a）,（b）,（c）	1,472,300
		総合持株会社（0.6%）	
	18,710	Seven Group Holdings, Ltd.（a）,（b）,（c）	1,426,451
		保険（0.3%）	
	6,110	AMP, Ltd.（a）,（b）,（c）	644,422
		不動産投資信託（REIT）（7.1%）	
	125,764	Goodman PLUS Trust（a）,（b）,（c）	12,689,588
	69,468	Multiplex SITES Trust（a）,（b）,（c）	5,293,600
			17,983,188

株数	銘柄	投資資産に 占める比率	評価額
	オーストラリア合計（簿価 \$31, 633, 116）		31, 770, 330
	優先株式合計（簿価 \$31, 633, 116）		31, 770, 330
口数	MMF（2.0%）		
	オーストラリア（2.0%）		
5, 142, 239	Goldman Sachs A\$ Cash Reserves Fund Class A		5, 142, 239
	オーストラリア合計		5, 142, 239
	MMF 合計（簿価 \$5, 142, 239）		5, 142, 239
	投資総額（簿価 \$230, 170, 464）	96.9%	\$ 245, 912, 619
	負債を超過する現金およびその他の資産	3.1	7, 736, 539
	純資産	100.0%	\$ 253, 649, 158

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最善の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

- (a) 償還条項付き証券
- (b) 2017年3月31日時点の変動利付証券
- (c) 永久債

2017年3月31日現在の通貨αクラスの外国為替先渡契約残高（純資産の0.0%）：

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
AUD	Royal Bank of Scotland Plc	279, 967	2017年4月3日	JPY	23, 783, 000	\$ 182	\$ —	\$ 182
						\$ 182	\$ —	\$ 182

2017年3月31日現在の通貨αクラスの売建オプション残高（純資産の-0.2%）：

取引内容	行使価格	満期日	想定元本	受取プレミアム	評価額
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	\$ 86.25	2017年4月12日	17, 000, 000	\$ (240, 111)	\$ (24, 937)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	86.30	2017年4月21日	17, 000, 000	(217, 316)	(48, 355)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	85.30	2017年4月26日	17, 000, 000	(215, 792)	(136, 420)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	84.80	2017年5月12日	17, 000, 000	(285, 641)	(242, 381)
				\$ (958, 860)	\$ (452, 093)

通貨の略称：

- AUD - 豪ドル
- JPY - 日本円

<補足情報>

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型））が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の決算日（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、当ファンドの第38期の決算日（2017年10月17日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの組入資産の内容等を21ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年4月18日から2017年10月17日まで)

買 付			売 付		
銘 柄		金 額	銘 柄		金 額
		千円			千円
669 国庫短期証券	2017/6/12	29,100,894			
644 国庫短期証券	2017/5/12	15,890,426			
660 国庫短期証券	2017/5/1	15,270,265			
650 国庫短期証券	2017/6/12	10,480,200			
665 国庫短期証券	2017/5/22	7,490,272			
659 国庫短期証券	2017/4/24	5,820,034			
671 国庫短期証券	2017/6/19	3,780,034			
679 国庫短期証券	2017/7/31	3,110,034			
661 国庫短期証券	2017/5/8	3,070,103			
666 国庫短期証券	2017/5/29	1,540,107			

(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
2017年10月17日現在における該当事項はありません。

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書 第8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・マネーポートフォリオ・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

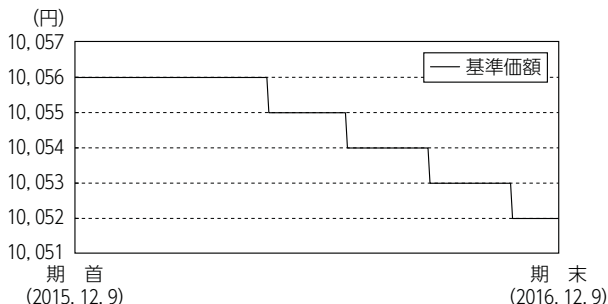
大和投資信託

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		
(期 首) 2015年12月 9 日	円	%	%
12月 末	10,056	—	51.3
2016年 1月 末	10,056	0.0	53.4
2月 末	10,056	0.0	57.6
3月 末	10,056	0.0	42.0
4月 末	10,056	0.0	5.2
5月 末	10,056	0.0	5.4
6月 末	10,055	△ 0.0	0.1
7月 末	10,055	△ 0.0	1.9
8月 末	10,054	△ 0.0	19.3
9月 末	10,054	△ 0.0	45.8
10月 末	10,053	△ 0.0	26.0
11月 末	10,053	△ 0.0	3.4
(期 末) 2016年12月 9 日	10,052	△ 0.0	26.7
	10,052	△ 0.0	28.1

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,056円 期末：10,052円 騰落率：△0.0%

【基準価額の変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

期首より、日銀は量的・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おります。

◆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を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

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
国 内	千円 436,874,861	千円 — (409,652,750)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

当 期		期 末	
買 付	売 付	買 付	売 付
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
613 国庫短期証券 2016/9/12	38,290,545		
601 国庫短期証券 2016/7/19	32,440,634		
611 国庫短期証券 2016/9/5	32,020,679		
591 国庫短期証券 2016/5/30	27,000,600		
629 国庫短期証券 2016/11/28	21,440,750		
609 国庫短期証券 2016/8/22	18,650,416		
632 国庫短期証券 2016/12/12	18,230,651		
610 国庫短期証券 2016/8/29	18,200,396		
596 国庫短期証券 2016/6/20	17,520,381		
533 国庫短期証券 2016/5/20	17,450,349		

(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		期 末	
区 分	額面金額	評価額	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	29,310,000	29,310,563	28.1	— — — 28.1

(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)

		当 期		期 末		
区 分		銘 柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券			%	千円	千円	
		632 国庫短期証券	—	18,230,000	18,230,147	2016/12/12
		634 国庫短期証券	—	3,720,000	3,720,073	2016/12/19
		635 国庫短期証券	—	7,360,000	7,360,342	2016/12/26
合計	銘柄数	3銘柄				
	金 額			29,310,000	29,310,563	

(注) 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	29,310,563	27.2
コール・ローン等、その他	78,355,232	72.8
投資信託財産総額	107,665,795	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	107,665,795,581円
コール・ローン等	78,354,409,362
公社債(評価額)	29,310,563,469
その他未収収益	822,750
(B) 負債	3,360,063,840
未払金	3,360,063,840
(C) 純資産総額(A-B)	104,305,731,741
元本	103,766,716,434
次期繰越損益金	539,015,307
(D) 受益権総口数	103,766,716,434口
1万口当り基準価額(C/D)	10,052円

* 期首における元本額は4,068,192,218円、当期中における追加設定元本額は128,013,693,034円、同解約元本額は28,315,168,818円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ米ドル・プルファンド(適格機関投資家専用)512,014,302円、ダイワ米ドル・ベアファンド(適格機関投資家専用)11,755,926,415円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-07(為替ヘッジあり/限定追加型)995円、通貨選択型米国リート・αクワトロ(毎月分配型)159,141円、通貨選択型アメリカン・エクイティ・αクワトロ(毎月分配型)159,141円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10(為替ヘッジあり)995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-12(為替ヘッジあり)995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-02(為替ヘッジあり/限定追加型)995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08(為替ヘッジあり/限定追加型)995円、ダイワ/ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド15,363,351円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)アジア通貨・コース(毎月分配型)998円、ダイワTOPIXベア・ファンド(適格機関投資家専用)89,575,789,270円、ダイワユーロベア・ファンド(3倍、非リバランス型)(適格機関投資家専用)1,501,723,555円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券α(毎月分配型)9,949円、ダイワ米国国債7-10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオUSトライアングル-351,635,806円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド-予想分配金提示型-53,926,540円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,052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	△ 31,874,427円
受取利息	△ 7,919,727
その他収益金	822,750
支払利息	△ 24,777,450
(B) 有価証券売買損益	△ 1,748,531
売買益	39
売買損	△ 1,748,570
(C) その他費用	△ 248,630
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 33,871,588
(E) 前期繰越損益金	22,707,764
(F) 解約差損益金	△ 153,699,691
(G) 追加信託差損益金	703,878,822
(H) 合計 (D + E + F + G)	539,015,307
次期繰越損益金 (H)	539,015,307

- (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。