

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	追加型投信／国内／株式／特殊型（ブル・ベア型）	
信託期間	約4年8カ月間（2015年1月16日～2019年9月19日）	
運用方針	日々の基準価額の値動きが日経平均株価の値動きとおおむね逆となることをめざして運用を行ないます。	
主投資対象	ベビーファンド	イ. わが国の株価指数先物取引 ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券 ハ. わが国の債券等
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券
ベビーファンドの運用方法	<p>①主として、わが国の株価指数先物取引を売り建てるとともに、マザーファンドの受益証券および残存期間の短いわが国の債券に投資します。</p> <p>②株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額と同程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きが日経平均株価の値動きとおおむね逆となることをめざします。</p> <p>③追加設定、解約がある場合、設定金額と解約金額の差額分に対して、既存受益者と新規受益者の公平性を維持するために、原則として、当日中に株価指数先物取引を売建てもしくは買戻しするものとし、この結果、株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額と同程度にならないことがあります。</p> <p>④上記①～③にかかわらず、基準価額（1万口当たり。既払分配金を加算しません。）が一度でも11,000円を超えた場合、マザーファンドの受益証券およびわが国の債券等による安定運用に順次切り替えを行ないます。</p>	
マザーファンドの運用方法	円建財産への投資に当たっては、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	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%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、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、分配を行わないことがあります。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないました。ファミリーファンド方式とは、受益者からの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。

ダイワ日本株式ベア・ファンド -ベアシフト11-

運用報告書(全体版) 繰上償還

(償還日 2016年7月7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、「ダイワ日本株式ベア・ファンド-ベアシフト11-」は、このたび、約款の規定により、繰上償還となりました。

ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

<4605>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			日 経 平 均 株 価 (参考指数)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	公 社 債 組入比率	純資産 総 額
	円	円	%	円	%				
1 期末 (2015年 9月24日)	9,089	0	△ 9.1	17,571.83	2.7	—	△ 98.7	29.1	百万円 132
償 還 (2016年 7月 7日)	9,303.57	—	2.4	15,276.24	△ 13.1	—	—	—	0

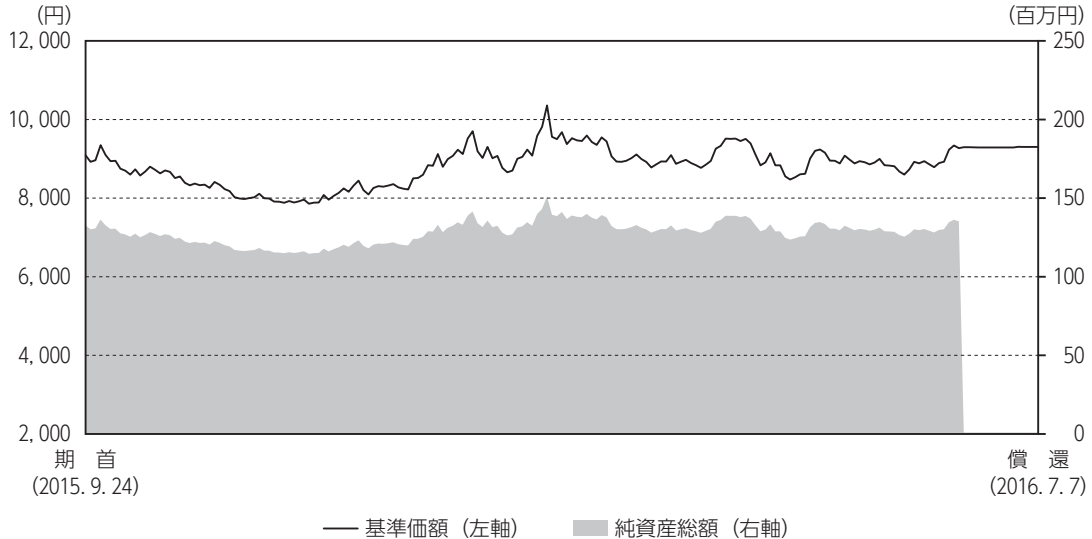
(注 1) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(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。

《運用経過》

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：9,303円57銭

騰落率：△7.0%

■ 基準価額の主な変動要因

日々の基準価額の値動きが日経平均株価の値動きとおおむね逆となるような運用を行なった結果、第1期については、日経平均株価が上昇したことを受け、基準価額は下落しました。当期については、日経平均株価が下落したことを受け、基準価額は上昇しましたが、第1期の下落が大きかったため、信託期間を通じては、基準価額は下落して償還を迎えました。

ダイワ日本株式ベア・ファンドーベアシフト11-

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2015年9月24日	円	%	円	%	%	%	%
	9,089	—	17,571.83	—	—	△ 98.7	29.1
9月末	9,099	0.1	17,388.15	△ 1.0	—	△ 100.9	27.9
10月末	8,259	△ 9.1	19,083.10	8.6	—	△ 101.4	45.4
11月末	7,964	△ 12.4	19,747.47	12.4	—	△ 98.6	35.2
12月末	8,218	△ 9.6	19,033.71	8.3	—	△ 101.6	31.2
2016年1月末	8,771	△ 3.5	17,518.30	△ 0.3	—	△ 100.6	41.9
2月末	9,545	5.0	16,026.76	△ 8.8	—	△ 99.5	30.3
3月末	8,947	△ 1.6	16,758.67	△ 4.6	—	△ 100.2	21.4
4月末	9,008	△ 0.9	16,666.05	△ 5.2	—	△ 99.2	16.2
5月末	8,600	△ 5.4	17,234.98	△ 1.9	—	△ 100.3	7.3
6月末	9,289	2.2	15,575.92	△ 11.4	—	—	—
(償還)2016年7月7日	9,303.57	2.4	15,276.24	△ 13.1	—	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、E C B（欧州中央銀行）による量的金融緩和の導入や国内景気を持ち直し、良好な株式需給関係、円安の進行などを受けて、大きく上昇しました。2015年6月からは、ギリシャ支援協議の難航によりギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念が一時高まったことや、中国株の急落を受け中国経済への不安が高まったこと、さらには世界経済の減速懸念も台頭したことから日本株も一時急落するなど、不安定な推移となりました。10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやE C Bが追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどにより株価は上昇しました。12月以降は、E C Bの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などにより、株価下落が加速しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびE C Bの金融緩和などにより株価も反発しましたが、3月後半からは、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国のEU（欧州連合）離脱観測の高まりと国民投票での離脱決定を受けて、株価は下落しました。

信託期間中の運用方針

○当ファンド

当ファンドの運用の基本方針に従い、日経平均株価先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、原則として信託財産の純資産総額とおおむね同程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きとおおむね逆となることをめざして運用を行ないます。

○ダイワ・マネーアセット・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。

信託期間中のポートフォリオについて

○当ファンド

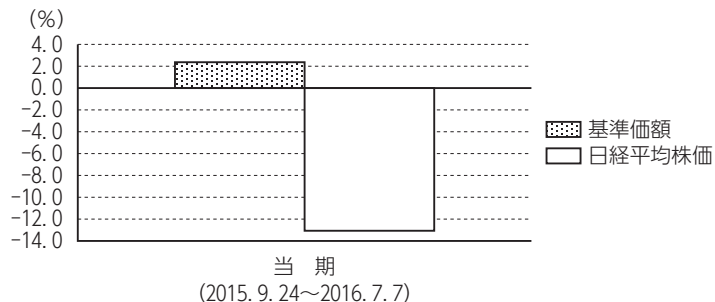
日経平均株価先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、純資産総額とおおむね同程度になるように調整しました。また、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資し、おおむね50～70%程度の組み入れを維持しました。なお、繰上償還が決定した2016年6月下旬以降は、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は先物取引等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

○ダイワ・マネーアセット・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、当期における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。



分配金について

第1期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を行いませんでした。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 9. 25~2016. 7. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	41円	0. 470%	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, 830円です。
(投信会社)	(20)	(0. 224)	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)	(19)	(0. 212)	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. 034)	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	31	0. 353	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
(先物)	(31)	(0. 353)	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. 003)	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	73	0. 827	

(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

(2015年9月25日から2016年7月7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・マネーアセット・マザーファンド	15,069	15,100	86,940	87,105

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等

償還時における残高はありません。

先物取引の銘柄別取引状況

(2015年9月25日から2016年7月7日まで)

銘 柄 別			買 建		売 建	
			新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式	ミニ日経平均	百万円	百万円	百万円	百万円
			—	—	642	770

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

(2015年9月25日から2016年7月7日まで)

決 算 期	当 期					
	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	25,749	3,640	14.1	—	—	—
コール・ローン	858,039	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.7%

※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	償還時保有額	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) 単位未満切捨て。

■組入資産明細表

最終期末における該当事項はありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	口 数
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	千口 71,870

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年7月7日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	1,110	100.0
投資信託財産総額	1,110	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7日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	1,110,986円
コール・ローン等	1,110,986
(B) 負債	180,629
未払信託報酬	180,628
未払利息	1
(C) 純資産総額 (A - B)	930,357
元本	1,000,000
償還差損益金	△ 69,643
(D) 受益権総口数	1,000,000口
1万口当り償還価額 (C / D)	9,303円57銭

* 期首における元本額は145,875,935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144,875,935円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,303円57銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は69,643円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月25日 至2016年7月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	538円
受取利息	4,885
支払利息	△ 4,347
(B) 有価証券売買損益	10
売買益	1,487
売買損	△ 1,497
(C) 先物取引等損益	583,876
取引益	24,084,247
取引損	△ 23,500,371
(D) 信託報酬等	562,454
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	21,950
(F) 前期繰越損益金	△ 11,275
(G) 追加信託差損益金	△ 80,318
(配当等相当額)	(3)
(売買損益相当額)	(△) 80,321
(H) 合計 (E + F + G)	△ 69,643
償還差損益金 (H)	△ 69,643

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

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

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2015年1月16日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年7月7日		資 産 総 額	1,110,986円
区 分	投 資 信 託 契 約 締 結 当 初	投資信託契約終了時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	180,629円
				純 資 産 総 額	930,357円
受益権口数	50,000,000口	1,000,000口	△49,000,000口	受 益 権 口 数	1,000,000口
元 本 額	50,000,000円	1,000,000円	△49,000,000円	1 単 位 当 り 償 還 金	9,303円57銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	円 145,875,935	円 132,580,989	円 9,089	円 0	% 0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	9,303円57銭

償還金の課税上の取扱いについて

- ・ 償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・ 法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・ 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・ 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第4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・マネーアセット・マザーファンドの第4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

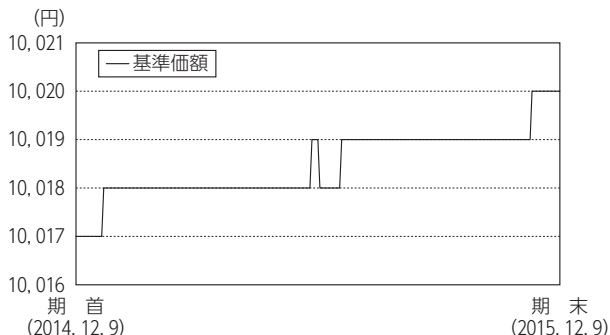
大和投資信託

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



《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：10,017円 期末：10,020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ぎ、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。

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	10,017	—	53.3
12月末	10,018	0.0	72.3
2015年1月末	10,018	0.0	80.5
2月末	10,018	0.0	70.3
3月末	10,018	0.0	59.6
4月末	10,018	0.0	70.6
5月末	10,018	0.0	73.2
6月末	10,019	0.0	69.3
7月末	10,019	0.0	59.4
8月末	10,019	0.0	65.5
9月末	10,019	0.0	51.5
10月末	10,019	0.0	76.0
11月末	10,020	0.0	56.8
(期末) 2015年12月9日	10,020	0.0	52.7

(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。

■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。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■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	国内	千円	千円
		国債証券	32,338,160

(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

(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
491 国庫短期証券 2015/5/14	1,999,998		
540 国庫短期証券 2015/9/24	1,699,999		
555 国庫短期証券 2015/12/7	1,500,000		
557 国庫短期証券 2015/12/14	1,500,000		
541 国庫短期証券 2015/9/28	1,499,998		
532 国庫短期証券 2015/8/17	1,499,995		
514 国庫短期証券 2015/5/25	1,499,968		
521 国庫短期証券 2015/6/29	1,499,925		
502 国庫短期証券 2015/3/30	1,199,993		
563 国庫短期証券 2016/1/18	1,150,000		

(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

(1)国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期	当			期			末		
	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	6,435,000	6,437,978	52.7	—	—	—	—	52.7	

(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	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	557 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,000	2015/12/14		
	336 2年国債	0.1000	185,000	185,022	2016/01/15		
	563 国庫短期証券	—	1,150,000	1,150,000	2016/01/18		
	566 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/01		
	567 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/08		
	573 国庫短期証券	—	500,000	500,097	2016/03/07		
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,102,860	2016/09/20		
合計	銘柄数	7銘柄					
	金額		6,435,000	6,437,978			

(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	6,437,978	52.7
コール・ローン等、その他	5,772,311	47.3
投資信託財産総額	12,210,290	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

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	12,210,290,310円
コール・ローン等	5,771,514,330
公社債(評価額)	6,437,978,324
未収利息	668,726
前払費用	128,930
(B)負債	—
(C)純資産総額(A-B)	12,210,290,310
元本	12,186,116,869
次期繰越損益金	24,173,441
(D)受益権総口数	12,186,116,869口
1万口当り基準価額(C/D)	10,020円

*期首における元本額は11,884,993,463円、当期中における追加設定元本額は8,064,725,261円、同解約元本額は7,763,601,855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・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジあり4,998,495円、ダイワ・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジなし2,499,247円、ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンドⅡ(為替ヘッジあり)999円、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)999円、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム(毎月分配型)219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム(年2回決算型)24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型)848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型)66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型)4,995円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型)4,995円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04(為替ヘッジあり/限定追加型)999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07(為替ヘッジあり/限定追加型)999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10(為替ヘッジあり/限定追加型)999円、世界ハイブリッド証券ファンド2015-01(為替ヘッジあり/限定追加型)999円、ダイワ・ブラジル・リアル債α(毎月分配型)ースーパー・ハイインカムーα50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・リアル債α(毎月分配型)ースーパー・ハイインカムーα100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ26,536,157円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 3-2,395,687,762円、ダイワ日本株式ベア・ファンドーベアシフト11-71,870,634円、ダイワ日本株式ベア・ファンドーベアシフト11 Ver 2-29,945,799円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 5-2,095,808,384円、ダイワ・スイス高配当株ツインα(毎月分配型)2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型)為替ヘッジなしコース10,980,236円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型)日本円コース1,696,946円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型)ブラジル・リアル・コース7,487,022円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型)通貨セレクト・コース3,593,631円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)29,988,005円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎月分配型)1,999,201円、通貨選択型ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース(毎月分配型)1,002,195円、通貨選択型ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース(毎月分配型)3,011,774円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスーインカムチェンジ(積立型)ー7,515,709円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型)ーシフト11-3,536,610,361円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型)ーシフト12-2,626,169,333円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型)ーシフト13-1,287,713,056円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,020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	3,173,485円
受取利息	3,173,485
(B)有価証券売買損益	△ 382,400
売買益	1,050
売買損	△ 383,450
(C)当期損益金(A+B)	2,791,085
(D)前期繰越損益金	20,640,762
(E)解約差損益金	△ 14,198,145
(F)追加信託差損益金	14,939,739
(G)合計(C+D+E+F)	24,173,441
次期繰越損益金(G)	24,173,441

(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。