

★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／内外／資産複合
信託期間	5年間（2015年2月19日～2020年2月18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。
主要投資家	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・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（※1）」（以下「インカム・アロケーション・ファンド（※1）」）といいます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券（※1）は、以下の各コースにおいて、次のように読み替えるものとします。 「為替ヘッジなしコース」の場合……ヘッジなし・クラス、「日本円コース」の場合……円ヘッジ・クラス、「ブラジル・レアル・コース」の場合……ブラジル・レアル・クラス、「通貨セレクト・コース」の場合……通貨セレクト・クラス
為替ヘッジなしコース	①主として、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、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。 ②当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・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、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・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インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・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。
日本円コース	①主として、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替ヘッジを行ない、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。 ②当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・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、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・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インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）では、「投資対象とする資産の通貨売り／米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り／日本円買い」の為替取引を行ない、為替変動リスクの低減をめざします。
運用方法	①主として、インカム・アロケーション・ファンド（※1）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替取引を行ない、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。（※1）は前述。 ②当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（※1）とダイワ・マネーアセット・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、インカム・アロケーション・ファンド（※1）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③インカム・アロケーション・ファンド（※1）では、「投資対象とする資産の通貨売り／米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り／（※2）買い」の為替取引を行ない、（※2）への投資成果の獲得をめざします。（※2）は、以下のコースにおいて、次のように読み替えるものとします。 「ブラジル・レアル・コース」……ブラジル・レアル、「通貨セレクト・コース」……選定通貨（投資対象とする外国投資信託の投資顧問会社が選定した複数の通貨をいいます。）
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、継続的な分配を行なうことを目標に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。

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
日本円コース
ブラジル・レアル・コース
通貨セレクト・コース

運用報告書（全体版）

第5期（決算日	2015年9月18日）
第6期（決算日	2015年10月19日）
第7期（決算日	2015年11月18日）
第8期（決算日	2015年12月18日）
第9期（決算日	2016年1月18日）
第10期（決算日	2016年2月18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、「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」は、このたび、第10期の決算を行ないました。

ここに、第5期～第10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/>

<5655>

<5656>

<5657>

<5658>

★為替ヘッジなしコース

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
	(分配落)	税 込 み 分 配 金			
	円	円	%	%	百万円
1 期末(2015年 5 月18日)	10,069	25	0.9	99.2	7,250
2 期末(2015年 6 月18日)	10,282	25	2.4	99.5	7,627
3 期末(2015年 7 月21日)	10,272	25	0.1	99.2	7,661
4 期末(2015年 8 月18日)	10,176	25	△ 0.7	99.3	8,573
5 期末(2015年 9 月18日)	9,726	25	△ 4.2	99.5	8,259
6 期末(2015年10月19日)	9,571	25	△ 1.3	99.5	8,253
7 期末(2015年11月18日)	9,873	25	3.4	99.4	8,507
8 期末(2015年12月18日)	9,672	25	△ 1.8	99.4	8,258
9 期末(2016年 1 月18日)	8,906	25	△ 7.7	99.3	7,494
10 期末(2016年 2 月18日)	8,661	25	△ 2.5	99.1	7,176

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

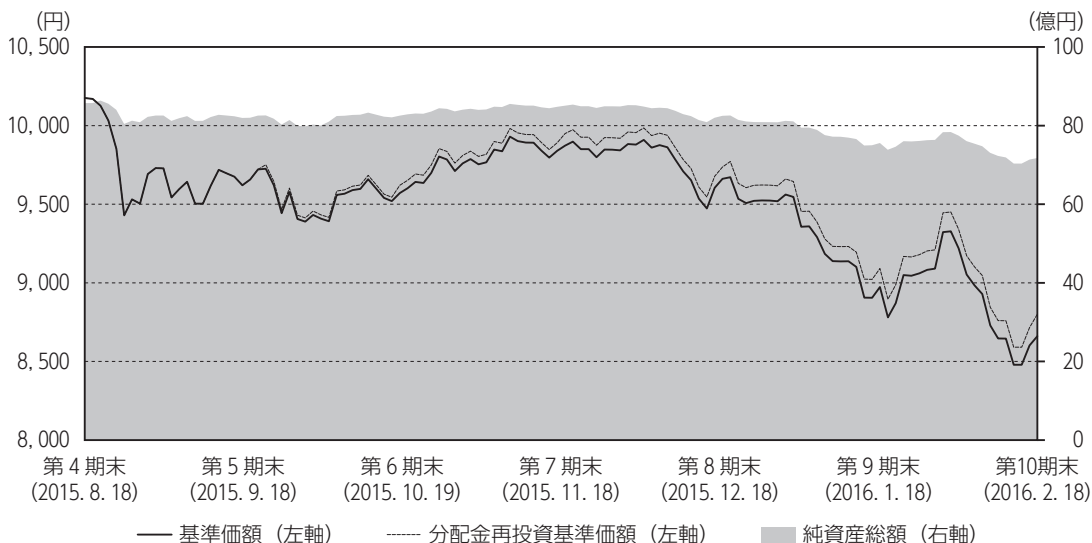
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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5期首：10,176円

第10期末：8,661円（既払分配金150円）

騰落率：△13.5%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）（以下、「インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）」といいます。）で保有している株式やハイ・イールド債券の下落に加えて、為替相場では市場のリスク回避姿勢の強まりを背景に低リスク資産と考えられている円が買われて円高に振れたこともマイナスになり、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。

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

	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
		円	騰 落 率 %		
第 5 期	(期首)2015年 8 月18日	10,176	—	0.1	99.3
	8 月末	9,730	△ 4.4	0.1	99.6
	(期末)2015年 9 月18日	9,751	△ 4.2	0.1	99.5
第 6 期	(期首)2015年 9 月18日	9,726	—	0.1	99.5
	9 月末	9,389	△ 3.5	0.1	99.4
	(期末)2015年10月19日	9,596	△ 1.3	0.1	99.5
第 7 期	(期首)2015年10月19日	9,571	—	0.1	99.5
	10 月末	9,787	2.3	0.1	99.5
	(期末)2015年11月18日	9,898	3.4	0.1	99.4
第 8 期	(期首)2015年11月18日	9,873	—	0.1	99.4
	11 月末	9,843	△ 0.3	0.1	99.4
	(期末)2015年12月18日	9,697	△ 1.8	0.1	99.4
第 9 期	(期首)2015年12月18日	9,672	—	0.1	99.4
	12 月末	9,562	△ 1.1	0.1	99.3
	(期末)2016年 1 月18日	8,931	△ 7.7	0.1	99.3
第10期	(期首)2016年 1 月18日	8,906	—	0.1	99.3
	1 月末	9,090	2.1	0.1	99.4
	(期末)2016年 2 月18日	8,686	△ 2.5	0.1	99.1

(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**○海外金融市況**

海外金融市場では、多くの資産が下落しました。第5期首より、中国経済の減速に歯止めがかからないことや中国本土の株式市況が大幅に下落したことから、世界的な株安で始まりしました。10月には、米国の早期利上げ観測の後退やECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和に対する期待の強まりなどを受けて、米国株式市況はいったんは下落分を取り戻しました。しかし2016年に入り、中国経済の先行きに対する不安が根強いことに加えて、製造業を中心に米国でも景気減速が広がっているとの見方が広まったため、株式市況は第10期末にかけて下げ足を速めました。債券市場では、米国債やドイツ国債などの安全資産は買われたものの（利回りは低下）、原油価格の下落などが嫌気されたエネルギーセクターを中心にハイ・イールド債券市況は下落しました。非伝統的高利回り資産（※）では、株式市場の変動性（ボラティリティ）の増大によりカバードコールのオプション・プレミアムは上昇しました。また、MBS（住宅ローン担保証券）や優先出資証券は、堅調な米国の住宅市場や銀行などの財務面への信頼感を背景に、底堅い推移となりました。

※リート、優先出資証券、ノンエージェンシーMBS（政府関連機関の保証がつかないMBS）など。

○為替相場

為替相場では、世界的な株安や原油価格下落を受けた市場のリスク回避姿勢の強まりを背景に、低リスク資産と考えられている円が2016年に入り大きく買われ、多くの通貨に対して円高になりました。

前作成期間末における「今後の運用方針」**○当ファンド**

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。具体的にはバリュエーション面での魅力度が高い資産への投資を引き上げるとともに、個別銘柄選定に際しては信用度を重視し、保有債券の残存期間を短めにしています。また、足元で株式市場のボラティリティが

高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略にも注目しています。今後も各資産の配分を柔軟に調整することで、魅力的なインカムの獲得を追求します。

○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。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）への投資割合を高位に維持することをめざしました。

○インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）

世界各国のさまざまな資産への投資を行ない、機動的に各資産への配分を調整することで、安定した利回りと信託財産の着実な成長をめざしてポートフォリオを構築しました。

株式市場の変動性が高まったことから株式の組入比率を引き下げ、リスクの抑制に努めました。個別銘柄では、配当利回りの高い銘柄に注目しました。債券では、エネルギーセクター以外のハイ・イールド債券の魅力は高いと考え、組み入れを増やしました。また、ECBの追加金融緩和の可能性が高まったことから、欧州のハイ・イールド債にも注目しました。利回りの獲得や分散投資の観点から魅力的な資産と考えている非伝統的高利回り資産では、価格の変動度合いが低く相対的に高い利回りが見込める信用等级付けの高いノンエージェンシーMBSやCMB S（商業用不動産担保証券）などを選好しました。

○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および参考指数を設けておりません。

分配金について

第5期から第10期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ25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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
	2015年8月19日 ～2015年9月18日	2015年9月19日 ～2015年10月19日	2015年10月20日 ～2015年11月18日	2015年11月19日 ～2015年12月18日	2015年12月19日 ～2016年1月18日	2016年1月19日 ～2016年2月18日
当期分配金（税込み）（円）	25	25	25	25	25	25
対基準価額比率（%）	0.26	0.26	0.25	0.26	0.28	0.29
当期の収益（円）	25	25	25	25	25	25
当期の収益以外（円）	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額（円）	294	307	330	345	359	372

（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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	37.19円	37.79円	47.90円	39.60円	39.71円	37.37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	49.72	54.00	54.73	54.96	55.49	55.86
(d) 分配準備積立金	232.78	240.70	252.84	275.51	289.59	303.95
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	319.70	332.50	355.48	370.08	384.81	397.19
(f) 分配金	25.00	25.00	25.00	25.00	25.00	25.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	294.70	307.50	330.48	345.08	359.81	372.19

（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

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。2016年は金融市場が上下に振れる展開で始まりましたが、新たな投資機会が生まれてきていると考えます。足元は、保守的に柔軟に分散投資を行なうことをめざしていますが、株式市場のボラティリティが高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略に注目しています。また、ノンエージェンシーMBSやCMB Sについても堅調な住宅市場や商業用不動産市場を背景に相対的には安定した推移が見込めるとともに、足元では高い利回りが期待できることから魅力的な資産と考えています。

今後とも、リスクを抑えてファンドの値動きを小幅なものにすることをめざしながら、クーポン、配当、カバードコールによるインカム収入の積み上げを図るとともに、キャピタルゲインを求めた運用を行なう方針です。

○ダイワ・マネーアセット・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	第5期～第10期		項 目 の 概 要
	(2015. 8. 19～2016. 2. 18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	58円	0.610%	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9,506円です。
（投信会社）	(18)	(0.190)	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）	(39)	(0.407)	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	58	0.614	

(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まず。

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	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)	5,463.051	518,507	6,281.122	573,000

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	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	—	—	2,994	3,000

(注) 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8月19日から2016年2月18日まで)

第5期～第10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
MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON- HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	2,811.497	271,000	96	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON- HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	6,281.122	573,000	91

(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当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第5期～第10期）中における利害関係人との取引はありません。

(3) 当作成期間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

当作成期間（第5期～第10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。

(2) ダイワ・マネーアセット・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

区分	第5期～第10期					
	買付額等 A		うち利害関係人との取引状況 B/A	売付額等 C		うち利害関係人との取引状況 D/C
	百万円	%		百万円	%	
公社債	14,338	2,000	13.9	—	—	—
コール・ローン	534,620	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.1%

※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ンドのマザーファンド所有口数の割合。

※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、当作成期間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	第 10 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) MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON- HEDGED CLASS	83,779.118	7,109,160	99.1

(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

2016年 2月18日現在

項 目	第 10 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	7,109,160	98.5
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	8,002	0.1
コール・ローン等、その他	96,896	1.4
投資信託財産総額	7,214,060	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 4 期末	第 10 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	10,980	7,986	8,002

(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

(2015年 9月18日)、(2015年10月19日)、(2015年11月18日)、(2015年12月18日)、(2016年 1月18日)、(2016年 2月18日) 現在

項 目	第 5 期末	第 6 期末	第 7 期末	第 8 期末	第 9 期末	第10期末
(A) 資産	8,314,860,705円	8,284,561,326円	8,537,545,830円	8,288,216,369円	7,588,246,042円	7,244,060,130円
コール・ローン等	88,783,634	63,766,797	66,125,459	71,747,040	64,728,273	66,896,294
投資信託受益証券 (評価額)	8,215,075,973	8,209,793,431	8,460,418,175	8,205,467,133	7,442,515,574	7,109,160,841
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド (評価額)	11,001,098	11,001,098	11,002,196	11,002,196	11,002,196	8,002,995
未収入金	—	—	—	—	69,999,999	60,000,000
(B) 負債	55,025,840	31,085,053	30,098,894	29,943,520	94,140,701	67,799,182
未払金	—	—	—	—	35,000,000	30,000,000
未払収益分配金	21,230,500	21,559,316	21,541,995	21,345,417	21,037,237	20,714,600
未払解約金	25,215,965	999,999	—	—	29,614,196	9,074,192
未払信託報酬	8,522,576	8,412,869	8,388,122	8,373,515	8,209,962	7,679,902
その他未払費用	56,799	112,869	168,777	224,588	279,306	330,488
(C) 純資産総額 (A - B)	8,259,834,865	8,253,476,273	8,507,446,936	8,258,272,849	7,494,105,341	7,176,260,948
元本	8,492,200,201	8,623,726,652	8,616,798,131	8,538,166,953	8,414,894,944	8,285,840,183
次期繰越損益金	△ 232,365,336	△ 370,250,379	△ 109,351,195	△ 279,894,104	△ 920,789,603	△ 1,109,579,235
(D) 受益権総口数	8,492,200,201口	8,623,726,652口	8,616,798,131口	8,538,166,953口	8,414,894,944口	8,285,840,183口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,726円	9,571円	9,873円	9,672円	8,906円	8,661円

*第 4 期末における元本額は8,425,801,391円、当作成期間 (第 5 期～第10期) 中における追加設定元本額は408,779,125円、同解約元本額は548,740,333円です。

*第10期末の計算口数当りの純資産額は8,661円です。

*第10期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,109,579,235円です。

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

■損益の状況

第5期 自 2015年8月19日 至 2015年9月18日 第7期 自 2015年10月20日 至 2015年11月18日 第9期 自 2015年12月19日 至 2016年1月18日
 第6期 自 2015年9月19日 至 2015年10月19日 第8期 自 2015年11月19日 至 2015年12月18日 第10期 自 2016年1月19日 至 2016年2月18日

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(A) 配当等収益	40,164,185円	41,065,785円	42,515,907円	42,243,405円	41,687,912円	38,703,285円
受取配当金	40,164,420	41,062,894	42,513,927	42,240,928	41,685,069	38,701,272
受取利息	2,765	2,891	1,980	2,477	2,843	2,013
(B) 有価証券売買損益	△ 386,123,634	△ 140,768,448	247,671,240	△ 184,008,987	△ 657,152,315	△ 213,207,717
売買益	8,468,000	575,690	248,069,667	391,360	4,784,530	2,680,000
売買損	△ 394,591,634	△ 141,344,138	△ 398,427	△ 184,400,347	△ 661,936,845	△ 215,887,717
(C) 信託報酬等	△ 8,579,375	△ 8,468,939	△ 8,444,030	△ 8,429,326	△ 8,264,680	△ 7,731,084
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 354,538,824	△ 108,171,602	281,743,117	△ 150,194,908	△ 623,729,083	△ 182,235,516
(E) 前期繰越損益金	96,460,177	△ 278,682,770	△ 407,021,301	△ 145,357,439	△ 311,761,682	△ 940,730,751
(F) 追加信託差損益金	46,943,811	38,163,309	37,468,984	37,003,660	35,738,399	34,101,632
(配当等相当額)	(42,230,152)	(46,573,039)	(47,162,622)	(46,931,273)	(46,699,756)	(46,285,413)
(売買損益相当額)	(4,713,659)	(△ 8,409,730)	(△ 9,693,638)	(△ 9,927,613)	(△ 10,961,357)	(△ 12,183,781)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 211,134,836	△ 348,691,063	△ 87,809,200	△ 258,548,687	△ 899,752,366	△ 1,088,864,635
(H) 収益分配金	△ 21,230,500	△ 21,559,316	△ 21,541,995	△ 21,345,417	△ 21,037,237	△ 20,714,600
次期繰越損益金 (G + H)	△ 232,365,336	△ 370,250,379	△ 109,351,195	△ 279,894,104	△ 920,789,603	△ 1,109,579,235
追加信託差損益金	46,943,811	38,163,309	37,468,984	37,003,660	35,738,399	34,101,632
(配当等相当額)	(42,230,152)	(46,573,039)	(47,162,622)	(46,931,273)	(46,699,756)	(46,285,413)
(売買損益相当額)	(4,713,659)	(△ 8,409,730)	(△ 9,693,638)	(△ 9,927,613)	(△ 10,961,357)	(△ 12,183,781)
分配準備積立金	208,042,570	218,613,975	237,606,028	247,707,926	256,079,684	262,108,324
繰越損益金	△ 487,351,717	△ 627,027,663	△ 384,426,207	△ 564,605,690	△ 1,212,607,686	△ 1,405,789,191

(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後掲の「収益分配金の計算過程（総額）」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	31,584,986円	32,597,276円	41,279,359円	33,814,534円	33,423,691円	30,972,446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	42,230,152	46,573,039	47,162,622	46,931,273	46,699,756	46,285,413
(d) 分配準備積立金	197,688,084	207,576,015	217,868,664	235,238,809	243,693,230	251,850,478
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	271,503,222	286,746,330	306,310,645	315,984,616	323,816,677	329,108,337
(f) 分配金	21,230,500	21,559,316	21,541,995	21,345,417	21,037,237	20,714,600
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	250,272,722	265,187,014	284,768,650	294,639,199	302,779,440	308,393,737
(h) 受益権総口数	8,492,200,201口	8,623,726,652口	8,616,798,131口	8,538,166,953口	8,414,894,944口	8,285,840,183口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金	第 5 期	第 6 期	第 7 期	第 8 期	第 9 期	第10期
	25円	25円	25円	25円	25円	25円
(単 価)	(9, 726円)	(9, 571円)	(9, 873円)	(9, 672円)	(8, 906円)	(8, 661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。

★日本円コース

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
	(分配落)	税 込 み 分 配 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末(2015年 5 月18日)	9,993	25	0.2	0.1	99.2	1,387
2 期末(2015年 6 月18日)	9,811	25	△ 1.6	0.1	99.5	1,436
3 期末(2015年 7 月21日)	9,843	25	0.6	0.1	92.9	1,543
4 期末(2015年 8 月18日)	9,726	25	△ 0.9	0.1	98.7	1,503
5 期末(2015年 9 月18日)	9,566	25	△ 1.4	0.1	99.3	1,475
6 期末(2015年10月19日)	9,532	25	△ 0.1	0.1	99.4	1,462
7 期末(2015年11月18日)	9,530	25	0.2	0.1	99.5	1,461
8 期末(2015年12月18日)	9,396	25	△ 1.1	0.1	99.4	1,441
9 期末(2016年 1 月18日)	9,099	25	△ 2.9	0.1	97.8	1,403
10 期末(2016年 2 月18日)	9,037	25	△ 0.4	0.1	99.6	1,370

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

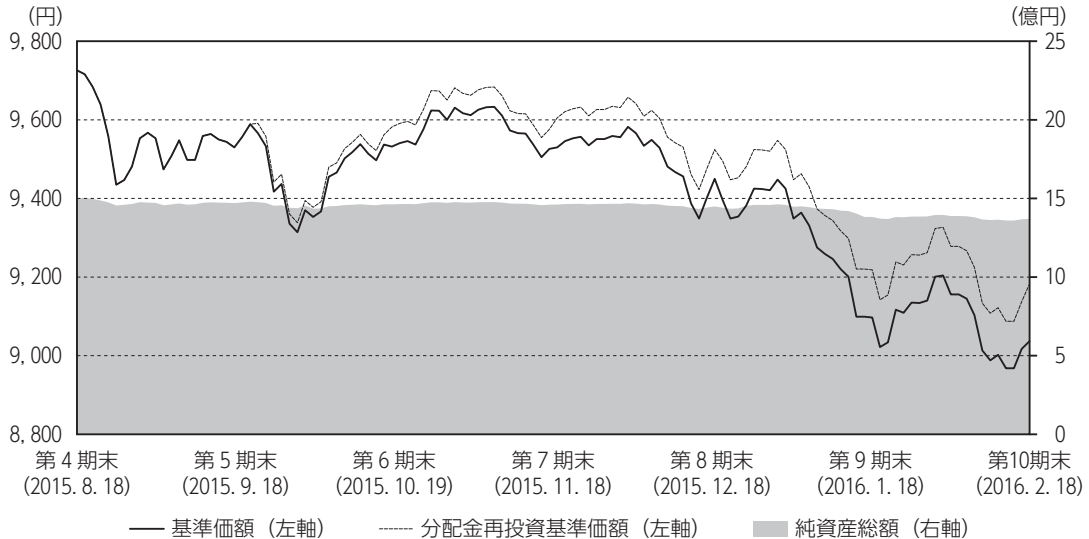
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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5期首：9,726円

第10期末：9,037円（既払分配金150円）

騰落率：△5.6%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）（以下、「インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」といいます。）で保有している株式やハイ・イールド債券が下落したため、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。

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

	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
		円	騰 落 率 %		
第 5 期	(期首)2015年 8 月18日	9,726	—	0.1	98.7
	8 月末	9,567	△ 1.6	0.1	99.4
	(期末)2015年 9 月18日	9,591	△ 1.4	0.1	99.3
第 6 期	(期首)2015年 9 月18日	9,566	—	0.1	99.3
	9 月末	9,314	△ 2.6	0.1	99.3
	(期末)2015年10月19日	9,557	△ 0.1	0.1	99.4
第 7 期	(期首)2015年10月19日	9,532	—	0.1	99.4
	10月末	9,617	0.9	0.1	99.5
	(期末)2015年11月18日	9,555	0.2	0.1	99.5
第 8 期	(期首)2015年11月18日	9,530	—	0.1	99.5
	11月末	9,559	0.3	0.1	99.5
	(期末)2015年12月18日	9,421	△ 1.1	0.1	99.4
第 9 期	(期首)2015年12月18日	9,396	—	0.1	99.4
	12月末	9,448	0.6	0.1	99.4
	(期末)2016年 1 月18日	9,124	△ 2.9	0.1	97.8
第10期	(期首)2016年 1 月18日	9,099	—	0.1	97.8
	1 月末	9,140	0.5	0.1	99.6
	(期末)2016年 2 月18日	9,062	△ 0.4	0.1	99.6

(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

○海外金融市況

海外金融市場では、多くの資産が下落しました。第5期首より、中国経済の減速に歯止めがかからないことや中国本土の株式市況が大幅に下落したことから、世界的な株安で始まりました。10月には、米国の早期利上げ観測の後退やECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和に対する期待の強まりなどを受けて、米国株式市況はいったんは下落分を取り戻しました。しかし2016年に入り、中国経済の先行きに対する不安が根強いことに加えて、製造業を中心に米国でも景気減速が広がっているとの見方が広まったため、株式市況は第10期末にかけて下げ足を速めました。債券市場では、米国債やドイツ国債などの安全資産は買われたものの（利回りは低下）、原油価格の下落などが嫌気されたエネルギーセクターを中心にハイ・イールド債券市況は下落しました。非伝統的高利回り資産（※）では、株式市場の変動性（ボラティリティ）の増大によりカバードコールのオプション・プレミアムは上昇しました。また、MBS（住宅ローン担保証券）や優先出資証券は、堅調な米国の住宅市場や銀行などの財務面への信頼感を背景に、底堅い推移となりました。

※リート、優先出資証券、ノンエージェンシーMBS（政府関連機関の保証がつかないMBS）など。

前作成期間末における「今後の運用方針」

○当ファンド

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。具体的にはバリュエーション面での魅力度が高い資産への投資を引き上げるとともに、個別銘柄選定に際しては信用度を重視し、保有債券の残存期間を短めにしています。また、足元で株式市場のボラティリティが高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略にも注目しています。今後も各資産の配分を柔軟に調整することで、魅力的なインカムの獲得を追求します。

また、原資産通貨売り／円買いの為替取引を行ないます。

○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。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）への投資割合を高位に維持することをめざしました。

○インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）

世界各国のさまざまな資産への投資を行ない、機動的に各資産への配分を調整することで、安定した利回りと信託財産の着実な成長をめざしてポートフォリオを構築しました。

株式市場の変動性が高まったことから株式の組入比率を引き下げ、リスクの抑制に努めました。個別銘柄では、配当利回りの高い銘柄に注目しました。債券では、エネルギーセクター以外のハイ・イールド債券の魅力は高いと考え、組み入れを増やしました。また、ECBの追加金融緩和の可能性が高まったことから、欧州のハイ・イールド債にも注目しました。利回りの獲得や分散投資の観点から魅力的な資産と考えている非伝統的高利回り資産では、価格の変動度合いが低く相対的に高い利回りが見込める信用格付けの高いノンエージェンシーMBSやCMB S（商業用不動産担保証券）などを選好しました。

また、原資産通貨売り／円買いの為替取引を行ないました。

○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および参考指数を設けておりません。

分配金について

第5期から第10期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ25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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
	2015年8月19日 ～2015年9月18日	2015年9月19日 ～2015年10月19日	2015年10月20日 ～2015年11月18日	2015年11月19日 ～2015年12月18日	2015年12月19日 ～2016年1月18日	2016年1月19日 ～2016年2月18日
当期分配金（税込み）（円）	25	25	25	25	25	25
対基準価額比率（%）	0.26	0.26	0.26	0.27	0.27	0.28
当期の収益（円）	25	25	25	25	25	25
当期の収益以外（円）	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額（円）	120	132	145	157	169	178

（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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	34.20円	37.42円	37.81円	36.92円	36.79円	34.19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	17.09	17.72	17.77	17.82	19.13	19.34
(d) 分配準備積立金	94.25	102.82	115.21	127.97	138.59	150.17
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	145.55	157.98	170.79	182.72	194.51	203.71
(f) 分配金	25.00	25.00	25.00	25.00	25.00	25.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	120.55	132.98	145.79	157.72	169.51	178.71

（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

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。2016年は金融市場が上下に振れる展開で始まりましたが、新たな投資機会が生まれてきていると考えます。足元は、保守的に柔軟に分散投資を行なうことをめざしていますが、株式市場のボラティリティが高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略に注目しています。また、ノンエージェンシーMBSやCMB Sについても堅調な住宅市場や商業用不動産市場を背景に相対的には安定した推移が見込めるとともに、足元では高い利回りが期待できることから魅力的な資産と考えています。

今後とも、リスクを抑えてファンドの値動きを小幅なものにすることをめざしながら、クーポン、配当、カバードコールによるインカム収入の積み上げを図るとともに、キャピタルゲインを求めた運用を行なう方針です。

また、原資産通貨売り／円買いの為替取引を行ないます。

○ダイワ・マネーアセット・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	第 5 期～第10期		項 目 の 概 要
	(2015. 8. 19～2016. 2. 18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	57円	0.610%	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9,416円です。
（投信会社）	(18)	(0.190)	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）	(38)	(0.407)	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	58	0.614	

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	721.93	67,257	761.714	69,500

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	設定		解約	
	□数	金額	□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	—	—	299	300

(注) 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8月19日から2016年2月18日まで)

銘柄	第5期～			第10期		
	買付			売付		
	□数	金額	平均単価	□数	金額	平均単価
	千口	千円	円	千口	千円	円
MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	265.495	25,000	94	761.714	69,500	91

(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当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第5期～第10期）中における利害関係人との取引はありません。

(3) 当作成期間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

当作成期間（第5期～第10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。

(2) ダイワ・マネーアセット・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

区分	第5期～第10期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B		売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	
		B/A	D/C			
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	14,338	2,000	13.9	—	—	—
コール・ローン	534,620	—	—	—	—	—

(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。

※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、当作成期間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	第 10 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) MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS	15,393.541	1,364,391	99.6

(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

2016年 2月18日現在

項 目	第 10 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,364,391	99.2
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,400	0.1
コール・ローン等、その他	9,533	0.7
投資信託財産総額	1,375,324	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 4 期末	第 10 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,696	1,397	1,400

(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

(2015年 9月18日)、(2015年10月19日)、(2015年11月18日)、(2015年12月18日)、(2016年 1月18日)、(2016年 2月18日) 現在

項 目	第 5 期末	第 6 期末	第 7 期末	第 8 期末	第 9 期末	第10期末
(A) 資産	1,481,294,078円	1,467,618,828円	1,466,508,242円	1,446,498,887円	1,439,762,262円	1,375,324,995円
コール・ローン等	13,706,043	12,516,993	11,337,199	12,100,169	13,392,919	9,533,345
投資信託受益証券 (評価額)	1,465,887,865	1,453,401,665	1,453,470,704	1,432,698,379	1,373,669,004	1,364,391,172
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	1,700,170	1,700,170	1,700,339	1,700,339	1,700,339	1,400,478
未収入金	—	—	—	—	51,000,000	—
(B) 負債	5,384,635	5,355,335	5,326,604	5,327,217	35,869,052	5,267,124
未払金	—	—	—	—	25,500,000	—
未払収益分配金	3,857,266	3,835,181	3,832,982	3,834,449	3,857,286	3,790,303
未払解約金	—	—	—	—	4,975,672	—
未払信託報酬	1,517,268	1,500,069	1,463,793	1,453,264	1,486,701	1,417,994
その他未払費用	10,101	20,085	29,829	39,504	49,393	58,827
(C) 純資産総額 (A—B)	1,475,909,443	1,462,263,493	1,461,181,638	1,441,171,670	1,403,893,210	1,370,057,871
元本	1,542,906,679	1,534,072,744	1,533,192,934	1,533,779,937	1,542,914,773	1,516,121,251
次期繰越損益金	△ 66,997,236	△ 71,809,251	△ 72,011,296	△ 92,608,267	△ 139,021,563	△ 146,063,380
(D) 受益権総口数	1,542,906,679□	1,534,072,744□	1,533,192,934□	1,533,779,937□	1,542,914,773□	1,516,121,251□
1万口当り基準価額 (C/D)	9,566円	9,532円	9,530円	9,396円	9,099円	9,037円

*第 4 期末における元本額は1,545,845,455円、当作成期間 (第 5 期～第10期) 中における追加設定元本額は35,493,559円、同解約元本額は65,217,763円です。

*第10期末の計算口数当りの純資産額は9,037円です。

*第10期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は146,063,380円です。

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

■損益の状況

第5期 自 2015年8月19日 至 2015年9月18日 第7期 自 2015年10月20日 至 2015年11月18日 第9期 自 2015年12月19日 至 2016年1月18日
 第6期 自 2015年9月19日 至 2015年10月19日 第8期 自 2015年11月19日 至 2015年12月18日 第10期 自 2016年1月19日 至 2016年2月18日

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(A) 配当等収益	6,804,356円	7,251,858円	7,270,649円	7,126,681円	7,173,371円	6,612,210円
受取配当金	6,803,871	7,251,269	7,270,333	7,126,375	7,172,871	6,611,940
受取利息	485	589	316	306	500	270
(B) 有価証券売買損益	△ 25,957,832	△ 6,882,284	△ 2,207,530	△ 22,398,700	△ 47,621,602	△ 10,852,445
売買益	143,537	345,104	170	1	100,662	36,939
売買損	△ 26,101,369	△ 7,227,388	△ 2,207,700	△ 22,398,701	△ 47,722,264	△ 10,889,384
(C) 信託報酬等	△ 1,527,369	△ 1,510,053	△ 1,473,537	△ 1,462,939	△ 1,496,590	△ 1,427,428
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 20,680,845	△ 1,140,479	△ 3,589,582	△ 16,734,958	△ 41,944,821	△ 5,667,663
(E) 前期繰越損益金	△ 40,166,998	△ 63,943,350	△ 68,853,624	△ 69,097,024	△ 89,354,791	△ 132,625,404
(F) 追加信託差損益金	△ 2,292,127	△ 2,890,241	△ 2,914,272	△ 2,941,836	△ 3,864,665	△ 3,980,010
(配当等相当額)	(2,637,925)	(2,719,487)	(2,724,686)	(2,733,366)	(2,952,198)	(2,932,591)
(売買損益相当額)	(△ 4,930,052)	(△ 5,609,728)	(△ 5,638,958)	(△ 5,675,202)	(△ 6,816,863)	(△ 6,912,601)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 63,139,970	△ 67,974,070	△ 68,178,314	△ 88,773,818	△ 135,164,277	△ 142,273,077
(H) 収益分配金	△ 3,857,266	△ 3,835,181	△ 3,832,982	△ 3,834,449	△ 3,857,286	△ 3,790,303
次期繰越損益金 (G + H)	△ 66,997,236	△ 71,809,251	△ 72,011,296	△ 92,608,267	△ 139,021,563	△ 146,063,380
追加信託差損益金	△ 2,292,127	△ 2,890,241	△ 2,914,272	△ 2,941,836	△ 3,864,665	△ 3,980,010
(配当等相当額)	(2,637,925)	(2,719,487)	(2,724,686)	(2,733,366)	(2,952,198)	(2,932,591)
(売買損益相当額)	(△ 4,930,052)	(△ 5,609,728)	(△ 5,638,958)	(△ 5,675,202)	(△ 6,816,863)	(△ 6,912,601)
分配準備積立金	15,962,695	17,681,458	19,628,888	21,458,250	23,203,235	24,163,158
繰越損益金	△ 80,667,804	△ 86,600,468	△ 88,725,912	△ 111,124,681	△ 158,360,133	△ 166,246,528

(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後掲の「収益分配金の計算過程（総額）」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	5,277,012円	5,741,869円	5,797,187円	5,663,811円	5,676,850円	5,184,823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	2,637,925	2,719,487	2,724,686	2,733,366	2,952,198	2,932,591
(d) 分配準備積立金	14,542,949	15,774,770	17,664,683	19,628,888	21,383,671	22,768,638
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	22,457,886	24,236,126	26,186,556	28,026,065	30,012,719	30,886,052
(f) 分配金	3,857,266	3,835,181	3,832,982	3,834,449	3,857,286	3,790,303
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	18,600,620	20,400,945	22,353,574	24,191,616	26,155,433	27,095,749
(h) 受益権総口数	1,542,906,679口	1,534,072,744口	1,533,192,934口	1,533,779,937口	1,542,914,773口	1,516,121,251口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金	第 5 期	第 6 期	第 7 期	第 8 期	第 9 期	第10期
	25円	25円	25円	25円	25円	25円
(単 価)	(9, 566円)	(9, 532円)	(9, 530円)	(9, 396円)	(9, 099円)	(9, 037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。

★ブラジル・リアル・コース

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
	(分配落)	税 込 み 分 配 金	期 中 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末(2015年 5 月18日)	9,850	100	△ 0.5	0.1	99.3	6,580
2 期末(2015年 6 月18日)	9,709	100	△ 0.4	0.2	99.3	6,486
3 期末(2015年 7 月21日)	9,464	100	△ 1.5	0.1	99.2	6,295
4 期末(2015年 8 月18日)	8,655	100	△ 7.5	0.2	99.2	5,793
5 期末(2015年 9 月18日)	7,403	100	△ 13.3	0.1	99.4	4,866
6 期末(2015年10月19日)	7,346	100	0.6	0.1	99.5	4,824
7 期末(2015年11月18日)	7,665	100	5.7	0.1	99.5	5,001
8 期末(2015年12月18日)	7,321	100	△ 3.2	0.1	99.1	4,740
9 期末(2016年 1 月18日)	6,479	100	△ 10.1	0.1	99.3	4,200
10 期末(2016年 2 月18日)	6,376	100	△ 0.0	0.1	99.2	4,098

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

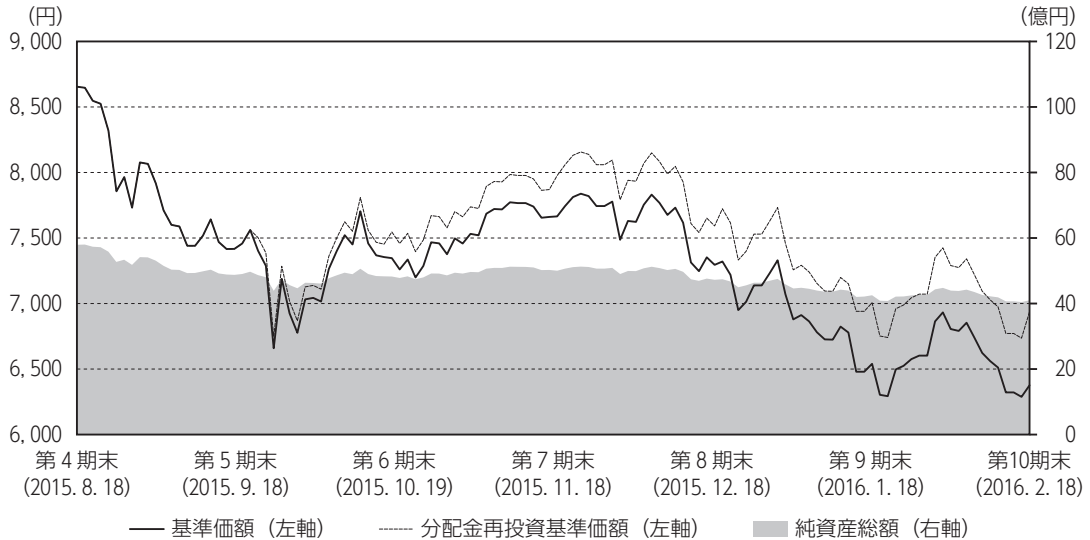
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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いません。

《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5期首：8,655円

第10期末：6,376円（既払分配金600円）

騰落率：△19.8%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）（以下、「インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」といいます。）で保有している株式やハイ・イールド債券の下落に加えて、為替市場で円高ブラジル・リアル安に振れたこと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。

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

	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
		円	騰 落 率 %		
第 5 期	(期首) 2015年 8 月 18 日	8,655	—	0.2	99.2
	8 月 末	8,066	△ 6.8	0.1	99.4
	(期末) 2015年 9 月 18 日	7,503	△ 13.3	0.1	99.4
第 6 期	(期首) 2015年 9 月 18 日	7,403	—	0.1	99.4
	9 月 末	6,776	△ 8.5	0.1	99.3
	(期末) 2015年 10 月 19 日	7,446	0.6	0.1	99.5
第 7 期	(期首) 2015年 10 月 19 日	7,346	—	0.1	99.5
	10 月 末	7,458	1.5	0.1	99.4
	(期末) 2015年 11 月 18 日	7,765	5.7	0.1	99.5
第 8 期	(期首) 2015年 11 月 18 日	7,665	—	0.1	99.5
	11 月 末	7,778	1.5	0.1	99.5
	(期末) 2015年 12 月 18 日	7,421	△ 3.2	0.1	99.1
第 9 期	(期首) 2015年 12 月 18 日	7,321	—	0.1	99.1
	12 月 末	7,330	0.1	0.1	99.4
	(期末) 2016年 1 月 18 日	6,579	△ 10.1	0.1	99.3
第 10 期	(期首) 2016年 1 月 18 日	6,479	—	0.1	99.3
	1 月 末	6,602	1.9	0.1	99.4
	(期末) 2016年 2 月 18 日	6,476	△ 0.0	0.1	99.2

(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

○海外金融市況

海外金融市場では、多くの資産が下落しました。第5期首より、中国経済の減速に歯止めがかからないことや中国本土の株式市況が大幅に下落したことから、世界的な株安で始まりしました。10月には、米国の早期利上げ観測の後退やECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和に対する期待の強まりなどを受けて、米国株式市況はいったんは下落分を取り戻しました。しかし2016年に入り、中国経済の先行きに対する不安が根強いことに加えて、製造業を中心に米国でも景気減速が広がっているとの見方が広まったため、株式市況は第10期末にかけて下げ足を速めました。債券市場では、米国債やドイツ国債などの安全資産は買われたものの（利回りは低下）、原油価格の下落などが嫌気されたエネルギーセクターを中心にハイ・イールド債券市況は下落しました。非伝統的高利回り資産（※）では、株式市場の変動性（ボラティリティ）の増大によりカバードコールのオプション・プレミアムは上昇しました。また、MBS（住宅ローン担保証券）や優先出資証券は、堅調な米国の住宅市場や銀行などの財務面への信頼感を背景に、底堅い推移となりました。

※リート、優先出資証券、ノンエージェンシーMBS（政府関連機関の保証がつかないMBS）など。

○為替相場

ブラジル・リアルの為替相場は、ブラジルの主要貿易相手国である中国の景気減速に対する不安が強まったことに加えて、原油価格の下落や汚職問題をめぐる混迷の長期化により同国の政治的不透明感が高まっていることが嫌気されて大きく売られ、大幅な円高ブラジル・リアル安になりました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

○当ファンド

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。具体的にはバリュエーション面での魅力度が高い資産への投資を引き上げるとともに、個別銘柄選定に際しては信

用度を重視し、保有債券の残存期間を短めにしています。また、足元で株式市場のボラティリティが高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略にも注目しています。今後も各資産の配分を柔軟に調整することで、魅力的なインカムの獲得を追求します。

また、原資産通貨売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を行ないます。

○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。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）への投資割合を高位に維持することをめざしました。

○インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）

世界各国のさまざまな資産への投資を行ない、機動的に各資産への配分を調整することで、安定した利回りと信託財産の着実な成長をめざしてポートフォリオを構築しました。

株式市場の変動性が高まったことから株式の組入比率を引き下げ、リスクの抑制に努めました。個別銘柄では、配当利回りの高い銘柄に注目しました。債券では、エネルギーセクター以外のハイ・イールド債券の魅力は高いと考え、組み入れを増やしました。また、ECBの追加金融緩和の可能性が高まったことから、欧州のハイ・イールド債にも注目しました。利回りの獲得や分散投資の観点から魅力的な資産と考えている非伝統的高利回り資産では、価格の変動度合いが低く相対的に高い利回りが見込める信用格付けの高いノンエージェンシーMBSやCMB S（商業用不動産担保証券）などを選好しました。

また、原資産通貨売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を行ないました。

○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および参考指数を設けておりません。

分配金について

第5期から第10期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ100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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
	2015年8月19日 ～2015年9月18日	2015年9月19日 ～2015年10月19日	2015年10月20日 ～2015年11月18日	2015年11月19日 ～2015年12月18日	2015年12月19日 ～2016年1月18日	2016年1月19日 ～2016年2月18日
当期分配金（税込み）（円）	100	100	100	100	100	100
対基準価額比率（%）	1.33	1.34	1.29	1.35	1.52	1.54
当期の収益（円）	100	100	100	100	100	96
当期の収益以外（円）	—	—	—	—	—	3
翌期繰越分配対象額（円）	367	381	401	408	421	417

（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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	128.80円	114.03円	119.59円	107.01円	112.60円	96.73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	12.31	13.17	14.65	15.81	18.51	19.69
(d) 分配準備積立金	326.60	354.55	367.17	385.60	389.92	401.34
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	467.72	481.75	501.41	508.43	521.04	517.78
(f) 分配金	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	367.72	381.75	401.41	408.43	421.04	417.78

（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

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。2016年は金融市場が上下に振れる展開で始まりましたが、新たな投資機会が生まれてきていると考えます。足元は、保守的に柔軟に分散投資を行なうことをめざしていますが、株式市場のボラティリティが高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略に注目しています。また、ノンエージェンシーMBSやCMB Sについても堅調な住宅市場や商業用不動産市場を背景に相対的には安定した推移が見込めるとともに、足元では高い利回りが期待できることから魅力的な資産と考えています。

今後とも、リスクを抑えてファンドの値動きを小幅なものにすることをめざしながら、クーポン、配当、カバードコールによるインカム収入の積み上げを図るとともに、キャピタルゲインを求めた運用を行なう方針です。

また、原資産通貨売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を行ないます。

○ダイワ・マネーアセット・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	第 5 期～第10期		項 目 の 概 要
	(2015. 8. 19～2016. 2. 18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	44円	0. 609%	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7, 284円です。
（投信会社）	(14)	(0. 190)	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）	(30)	(0. 407)	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	45	0. 613	

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	7,723.349	534,532	9,751.367	667,000

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	設定		解約	
	□数	金額	□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	—	—	7,984	8,000

(注) 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8月19日から2016年2月18日まで)

銘柄	第5期～第10期			銘柄	第5期～第10期		
	買付				売付		
	□数	金額	平均単価		□数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND BRL CLASS (ケイマン諸島)	885.202	64,000	72	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND BRL CLASS (ケイマン諸島)	9,751.367	667,000	68

(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当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第5期～第10期）中における利害関係人との取引はありません。

(3) 当作成期間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

当作成期間（第5期～第10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。

(2) ダイワ・マネーアセット・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

区分	第5期～第10期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B/A		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D/C	
		百万円	百万円		%	百万円
公社債	14,338	2,000	13.9	—	—	—
コール・ローン	534,620	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.1%

※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ンドのマザーファンド所有口数の割合。

※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、当作成期間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	第 10 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) MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND BRL CLASS	66,989.087	4,066,907	99.2

(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

2016年2月18日現在

項 目	第 10 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	4,066,907	97.5
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	4,502	0.1
コール・ローン等、その他	98,501	2.4
投資信託財産総額	4,169,911	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 4 期末	第 10 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	12,477	4,493	4,502

(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

(2015年9月18日)、(2015年10月19日)、(2015年11月18日)、(2015年12月18日)、(2016年1月18日)、(2016年2月18日)現在

項 目	第 5 期末	第 6 期末	第 7 期末	第 8 期末	第 9 期末	第10期末
(A) 資産	4,938,166,082円	4,895,728,889円	5,146,775,149円	4,825,657,591円	4,339,920,881円	4,180,911,786円
コール・ローン等	92,833,204	86,450,834	113,594,304	91,918,423	23,394,781	87,501,854
投資信託受益証券 (評価額)	4,837,831,631	4,801,776,808	4,975,678,849	4,696,237,173	4,169,024,104	4,066,907,488
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	7,501,247	7,501,247	7,501,996	7,501,996	7,501,996	4,502,445
未収入金	—	—	50,000,000	29,999,999	140,000,000	21,999,999
(B) 負債	71,166,248	71,387,089	145,421,622	84,882,074	139,683,220	82,304,172
未払金	—	—	25,000,000	15,000,000	70,000,000	11,000,000
未払収益分配金	65,740,939	65,676,302	65,248,423	64,757,603	64,826,187	64,285,507
未払解約金	—	745,900	50,127,360	—	—	2,459,483
未払信託報酬	5,389,394	4,896,345	4,944,353	4,989,739	4,691,044	4,364,119
その他未払費用	35,915	68,542	101,486	134,732	165,989	195,063
(C) 純資産総額 (A-B)	4,866,999,834	4,824,341,800	5,001,353,527	4,740,775,517	4,200,237,661	4,098,607,614
元本	6,574,093,947	6,567,630,265	6,524,842,387	6,475,760,315	6,482,618,725	6,428,550,721
次期繰越損益金	△ 1,707,094,113	△ 1,743,288,465	△ 1,523,488,860	△ 1,734,984,798	△ 2,282,381,064	△ 2,329,943,107
(D) 受益権総口数	6,574,093,947□	6,567,630,265□	6,524,842,387□	6,475,760,315□	6,482,618,725□	6,428,550,721□
1万口当り基準価額 (C/D)	7,403円	7,346円	7,665円	7,321円	6,479円	6,376円

*第4期末における元本額は6,693,639,349円、当作成期間(第5期~第10期)中における追加設定元本額は158,569,290円、同解約元本額は423,657,918円です。

*第10期末の計算口数当りの純資産額は6,376円です。

*第10期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,329,943,107円です。

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

■損益の状況

第5期 自 2015年8月19日 至 2015年9月18日 第7期 自 2015年10月20日 至 2015年11月18日 第9期 自 2015年12月19日 至 2016年1月18日
 第6期 自 2015年9月19日 至 2015年10月19日 第8期 自 2015年11月19日 至 2015年12月18日 第10期 自 2016年1月19日 至 2016年2月18日

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(A) 配当等収益	90,104,585円	79,823,108円	79,454,764円	74,324,570円	77,717,333円	66,582,412円
受取配当金	90,102,335	79,821,301	79,453,488	74,323,044	77,715,498	66,581,173
受取利息	2,250	1,807	1,276	1,526	1,835	1,239
(B) 有価証券売買損益	△ 839,891,961	△ 47,087,102	199,025,286	△ 227,543,258	△ 552,705,582	△ 64,505,206
売買益	15,596,614	792,271	200,645,583	959,033	219,963	579,064
売買損	△ 855,488,575	△ 47,879,373	△ 1,620,297	△ 228,502,291	△ 552,925,545	△ 65,084,270
(C) 信託報酬等	△ 5,425,309	△ 4,928,972	△ 4,977,297	△ 5,022,985	△ 4,722,301	△ 4,393,193
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 755,212,685	△ 27,807,034	△ 273,502,753	△ 158,241,673	△ 479,710,550	△ 2,315,987
(E) 前期繰越損益金	△ 859,918,198	△ 1,675,157,185	△ 1,695,329,630	△ 1,471,436,306	△ 1,684,598,903	△ 2,204,071,663
(F) 追加信託差損益金	△ 26,222,291	△ 30,262,012	△ 36,413,560	△ 40,549,216	△ 53,245,424	△ 59,269,950
(配当等相当額)	(8,093,500)	(8,652,022)	(9,559,903)	(10,243,839)	(12,003,513)	(12,661,086)
(売買損益相当額)	(△ 34,315,791)	(△ 38,914,034)	(△ 45,973,463)	(△ 50,793,055)	(△ 65,248,937)	(△ 71,931,036)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,641,353,174	△ 1,677,612,163	△ 1,458,240,437	△ 1,670,227,195	△ 2,217,554,877	△ 2,265,657,600
(H) 収益分配金	△ 65,740,939	△ 65,676,302	△ 65,248,423	△ 64,757,603	△ 64,826,187	△ 64,285,507
次期繰越損益金 (G + H)	△ 1,707,094,113	△ 1,743,288,465	△ 1,523,488,860	△ 1,734,984,798	△ 2,282,381,064	△ 2,329,943,107
追加信託差損益金	△ 26,222,291	△ 30,262,012	△ 36,413,560	△ 40,549,216	△ 53,245,424	△ 59,269,950
(配当等相当額)	(8,093,500)	(8,652,022)	(9,559,903)	(10,243,839)	(12,003,513)	(12,661,086)
(売買損益相当額)	(△ 34,315,791)	(△ 38,914,034)	(△ 45,973,463)	(△ 50,793,055)	(△ 65,248,937)	(△ 71,931,036)
分配準備積立金	233,649,773	242,073,535	252,359,395	254,249,721	260,942,889	255,912,747
繰越損益金	△ 1,914,521,595	△ 1,955,099,988	△ 1,739,434,695	△ 1,948,685,303	△ 2,490,078,529	△ 2,526,585,904

(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後掲の「収益分配金の計算過程（総額）」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	84,679,414円	74,894,428円	78,035,080円	69,301,894円	72,995,347円	62,189,356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	8,093,500	8,652,022	9,559,903	10,243,839	12,003,513	12,661,086
(d) 分配準備積立金	214,711,298	232,855,409	239,572,738	249,705,430	252,773,729	258,008,898
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	307,484,212	316,401,859	327,167,721	329,251,163	337,772,589	332,859,340
(f) 分配金	65,740,939	65,676,302	65,248,423	64,757,603	64,826,187	64,285,507
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	241,743,273	250,725,557	261,919,298	264,493,560	272,946,402	268,573,833
(h) 受益権総口数	6,574,093,947口	6,567,630,265口	6,524,842,387口	6,475,760,315口	6,482,618,725口	6,428,550,721口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金	第 5 期	第 6 期	第 7 期	第 8 期	第 9 期	第 10 期
	100円	100円	100円	100円	100円	100円
(単 価)	(7, 403円)	(7, 346円)	(7, 665円)	(7, 321円)	(6, 479円)	(6, 376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。

★通貨セレクト・コース

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
	(分配落)	税 込 み 分 配 金	期 中 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末(2015年 5 月18日)	9,916	80	△ 0.0	0.1	99.3	2,730
2 期末(2015年 6 月18日)	9,737	80	△ 1.0	0.1	99.2	2,734
3 期末(2015年 7 月21日)	9,731	80	0.8	0.1	99.3	2,746
4 期末(2015年 8 月18日)	9,054	80	△ 6.1	0.1	98.9	2,573
5 期末(2015年 9 月18日)	8,282	80	△ 7.6	0.1	99.4	2,361
6 期末(2015年10月19日)	8,438	80	2.8	0.1	99.4	2,401
7 期末(2015年11月18日)	8,549	80	2.3	0.1	99.4	2,431
8 期末(2015年12月18日)	8,106	80	△ 4.2	0.1	99.3	2,290
9 期末(2016年 1 月18日)	7,156	80	△ 10.7	0.1	99.2	1,982
10 期末(2016年 2 月18日)	7,043	80	△ 0.5	0.1	99.6	1,882

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

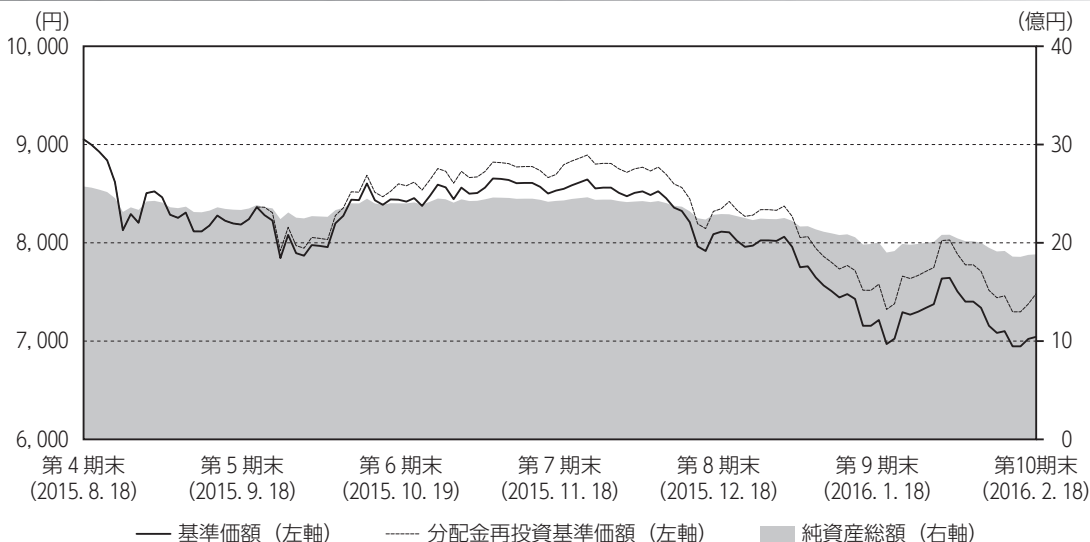
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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5期首：9,054円

第10期末：7,043円（既払分配金480円）

騰落率：△17.4%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）（以下、「インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）」といいます。）で保有している株式やハイ・イールド債券が下落したことに加えて、為替相場で選定通貨（※）が下落（円高）したこと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。

※選定通貨とは、通貨の選定方針により、為替ヘッジ取引の対象通貨として選定された通貨をいいます。当期間においては、インド・ルピー、ロシア・ルーブル、南アフリカ・ランド、ブラジル・リアル、トルコ・リラ、インドネシア・ルピア、チリ・ペソ、中国・人民元を選定通貨としました。

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

	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
		円	騰 落 率 %		
第5期	(期首)2015年8月18日	9,054	—	0.1	98.9
	8月末	8,524	△ 5.9	0.1	99.3
	(期末)2015年9月18日	8,362	△ 7.6	0.1	99.4
第6期	(期首)2015年9月18日	8,282	—	0.1	99.4
	9月末	7,869	△ 5.0	0.1	99.0
	(期末)2015年10月19日	8,518	2.8	0.1	99.4
第7期	(期首)2015年10月19日	8,438	—	0.1	99.4
	10月末	8,500	0.7	0.1	99.4
	(期末)2015年11月18日	8,629	2.3	0.1	99.4
第8期	(期首)2015年11月18日	8,549	—	0.1	99.4
	11月末	8,508	△ 0.5	0.1	99.4
	(期末)2015年12月18日	8,186	△ 4.2	0.1	99.3
第9期	(期首)2015年12月18日	8,106	—	0.1	99.3
	12月末	8,061	△ 0.6	0.1	99.3
	(期末)2016年1月18日	7,236	△ 10.7	0.1	99.2
第10期	(期首)2016年1月18日	7,156	—	0.1	99.2
	1月末	7,376	3.1	0.1	99.5
	(期末)2016年2月18日	7,123	△ 0.5	0.1	99.6

(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**○海外金融市況**

海外金融市場では、多くの資産が下落しました。第5期首より、中国経済の減速に歯止めがかからないことや中国本土の株式市況が大幅に下落したことから、世界的な株安で始まりまして。10月には、米国の早期利上げ観測の後退やE C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和に対する期待の強まりなどを受けて、米国株式市況はいったんは下落分を取り戻しました。しかし2016年に入り、中国経済の先行きに対する不安が根強いことに加えて、製造業を中心に米国でも景気減速が広がっているとの見方が広まったため、株式市況は第10期末にかけて下げ足を速めました。債券市場では、米国債やドイツ国債などの安全資産は買われたものの（利回りは低下）、原油価格の下落などが嫌気されたエネルギーセクターを中心にハイ・イールド債券市況は下落しました。非伝統的高利回り資産（※）では、株式市場の変動性（ボラティリティ）の増大によりカバードコールのオプション・プレミアムは上昇しました。また、MBS（住宅ローン担保証券）や優先出資証券は、堅調な米国の住宅市場や銀行などの財務面への信頼感を背景に、底堅い推移となりました。

※リート、優先出資証券、ノンエージェンシーMBS（政府関連機関の保証がつかないMBS）など。

○為替相場

選定通貨は対円で下落（円高）しました。第5期首から2015年9月末にかけては、中国株式市況の下落や商品価格の低迷に加え、中国の人民元安誘導をきっかけに中国をはじめとする新興国経済全体の先行きに対する不安が強まったため、選定通貨は軟調な推移となりました。10月に入ると、米国の利上げ観測が後退し、金融緩和環境が維持されるとの期待から、資源国通貨や新興国通貨が買い戻され、選定通貨もいったんは持ち直しました。しかし12月以降は、世界的な株安や原油価格が下げ足を速めたことなどをを受けて市場のリスク回避姿勢が強まり、選定通貨は対円で下落しました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

○当ファンド

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。具体的にはバリュエーション面での魅力度が高い資産への投資を引き上げるとともに、個別銘柄選定に際しては信用度を重視し、保有債券の残存期間を短めにしています。また、足元で株式市場のボラティリティが高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略にも注目しています。今後も各資産の配分を柔軟に調整することで、魅力的なインカムの獲得を追求します。

また、原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を行ないます。

○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。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）への投資割合を高位に維持することをめざしました。

○インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）

世界各国のさまざまな資産への投資を行ない、機動的に各資産への配分を調整することで、安定した利回りと信託財産の着実な成長をめざしてポートフォリオを構築しました。

株式市場の変動性が高まったことから株式の組入比率を引き下げ、リスクの抑制に努めました。個別銘柄では、配当利回りの高い銘柄に注目しました。債券では、エネルギーセクター以外のハイ・イールド債券の魅力は高いと考え、組み入れを増やしました。また、ECBの追加金融緩和の可能性が高まったことから、欧州のハイ・イールド債にも注目しました。利回りの獲得や分散投資の観点から魅力的な資産と考えている非伝統的高利回り資産では、価格の変動度合いが低く相対的に高い利回

りが見込める信用格付けの高いノンエージェンシーMBSやCMB S（商業用不動産担保証券）などを選択しました。

また、原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を行ないました。取引対象通貨においては、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を勘案し、中長期的な視点から安定したキャリア収益が享受できる通貨を毎月6通貨選定し、運用を行ないました。また、取引対象通貨合計の比率は、原資産に対しておおむね100%を維持しました。

○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および参考指数を設けておりません。

分配金について

第5期から第10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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
	2015年8月19日 ～2015年9月18日	2015年9月19日 ～2015年10月19日	2015年10月20日 ～2015年11月18日	2015年11月19日 ～2015年12月18日	2015年12月19日 ～2016年1月18日	2016年1月19日 ～2016年2月18日
当期分配金（税込み）（円）	80	80	80	80	80	80
対基準価額比率（％）	0.96	0.94	0.93	0.98	1.11	1.12
当期の収益（円）	80	80	80	80	80	80
当期の収益以外（円）	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額（円）	286	316	344	365	384	393

（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5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	113.48円	110.09円	107.41円	101.08円	99.32円	88.16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	13.05	13.58	14.73	15.36	16.69	17.55
(d) 分配準備積立金	240.17	273.13	302.17	328.95	348.84	367.32
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	366.71	396.81	424.32	445.40	464.87	473.04
(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)	286.71	316.81	344.32	365.40	384.87	393.04

(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

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・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。

○インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。2016年は金融市場が上下に振れる展開で始まりましたが、新たな投資機会が生まれてきていると考えます。足元は、保守的に柔軟に分散投資を行なうことをめざしていますが、株式市場のボラティリティが高水準になる中、オプションプレミアム収入を得られるカバードコール戦略に注目しています。また、ノンエージェンシーMBSやCMB Sについても堅調な住宅市場や商業用不動産市場を背景に相対的には安定した推移が見込めるとともに、足元では高い利回りが期待できることから魅力的な資産と考えています。

今後とも、リスクを抑えてファンドの値動きを小幅なものにすることをめざしながら、クーポン、配当、カバードコールによるインカム収入の積み上げを図るとともに、キャピタルゲインを求めた運用を行なう方針です。

また、原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を行ないます。

○ダイワ・マネーアセット・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	第 5 期～第10期		項 目 の 概 要
	(2015. 8. 19～2016. 2. 18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	49円	0.609%	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8,081円です。
（投信会社）	(15)	(0.189)	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）	(33)	(0.407)	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	50	0.613	

(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まず。

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	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)	2,840.557	221,634	3,882.305	287,000

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

決算期	第5期～第10期			
	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	—	—	2,495	2,500

(注) 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8月19日から2016年2月18日まで)

第5期～第10期				第5期～第10期			
買付		売付		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
MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND CURRENCY SELECTION CLASS (ケイマン諸島)	421.414	35,000	83	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND CURRENCY SELECTION CLASS (ケイマン諸島)	3,882.305	287,000	73

(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当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第5期～第10期）中における利害関係人との取引はありません。

(3) 当作成期間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

当作成期間（第5期～第10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。

(2) ダイワ・マネーアセット・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

区分	第5期～第10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	14,338	2,000	13.9	—	—	—
コール・ローン	534,620	—	—	—	—	—

(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。

※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、当作成期間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	第 10 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) MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND CURRENCY SELECTION CLASS	27,853,242	1,875,888	99.6

(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

2016年 2月18日現在

項 目	第 10 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,875,888	98.3
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	2,101	0.1
コール・ローン等、その他	30,566	1.6
投資信託財産総額	1,908,555	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 4 期末	第 10 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	4,591	2,096	2,101

(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

(2015年 9月18日)、(2015年10月19日)、(2015年11月18日)、(2015年12月18日)、(2016年 1月18日)、(2016年 2月18日) 現在

項 目	第 5 期末	第 6 期末	第 7 期末	第 8 期末	第 9 期末	第10期末
(A) 資産	2,387,709,161円	2,427,042,782円	2,457,860,913円	2,315,484,004円	2,066,007,352円	1,908,555,222円
コール・ローン等	37,220,056	35,332,778	38,411,720	37,723,356	15,952,617	30,566,170
投資信託受益証券 (評価額)	2,346,888,647	2,388,109,546	2,415,848,375	2,274,159,830	1,966,453,918	1,875,888,025
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	3,600,458	3,600,458	3,600,818	3,600,818	3,600,818	2,101,027
未収入金	—	—	—	—	79,999,999	—
(B) 負債	25,710,108	25,211,507	26,509,242	25,056,641	83,260,668	25,767,703
未払金	—	—	—	—	40,000,000	—
未払収益分配金	22,815,884	22,771,049	22,752,738	22,605,997	22,167,057	21,386,303
未払解約金	409,300	—	1,285,500	—	18,758,742	2,263,340
未払信託報酬	2,468,485	2,407,982	2,422,391	2,386,137	2,255,341	2,025,044
その他未払費用	16,439	32,476	48,613	64,507	79,528	93,016
(C) 純資産総額 (A - B)	2,361,999,053	2,401,831,275	2,431,351,671	2,290,427,363	1,982,746,684	1,882,787,519
元本	2,851,985,505	2,846,381,218	2,844,092,274	2,825,749,670	2,770,882,126	2,673,287,882
次期繰越損益金	△ 489,986,452	△ 444,549,943	△ 412,740,603	△ 535,322,307	△ 788,135,442	△ 790,500,363
(D) 受益権総口数	2,851,985,505□	2,846,381,218□	2,844,092,274□	2,825,749,670□	2,770,882,126□	2,673,287,882□
1万口当り基準価額 (C/D)	8,282円	8,438円	8,549円	8,106円	7,156円	7,043円

*第 4 期末における元本額は2,841,842,327円、当作成期間 (第 5 期～第10期) 中における追加設定元本額は55,126,249円、同解約元本額は223,680,694円です。

*第10期末の計算口数当りの純資産額は7,043円です。

*第10期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は790,500,363円です。

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

■損益の状況

第5期 自 2015年8月19日 至 2015年9月18日 第7期 自 2015年10月20日 至 2015年11月18日 第9期 自 2015年12月19日 至 2016年1月18日
 第6期 自 2015年9月19日 至 2015年10月19日 第8期 自 2015年11月19日 至 2015年12月18日 第10期 自 2016年1月19日 至 2016年2月18日

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(A) 配当等収益	34,851,504円	32,465,525円	31,925,033円	30,964,976円	29,793,309円	25,608,123円
受取配当金	34,850,788	32,464,687	31,924,375	30,964,332	29,792,484	25,607,401
受取利息	716	838	658	644	825	722
(B) 有価証券売買損益	△ 228,765,867	37,204,420	24,667,761	△ 131,196,309	△ 268,311,749	△ 32,307,644
売買益	805,968	37,571,464	24,922,479	643,019	2,412,495	875,641
売買損	△ 229,571,835	△ 367,044	△ 254,718	△ 131,839,328	△ 270,724,244	△ 33,183,285
(C) 信託報酬等	△ 2,484,924	△ 2,424,019	△ 2,438,528	△ 2,402,031	△ 2,270,362	△ 2,038,532
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 196,399,287	67,245,926	54,154,266	△ 102,633,364	△ 240,788,802	△ 8,738,053
(E) 前期繰越損益金	△ 261,701,926	△ 479,046,550	△ 432,712,104	△ 397,961,036	△ 511,293,294	△ 745,241,984
(F) 追加信託差損益金	△ 9,069,355	△ 9,978,270	△ 11,430,027	△ 12,121,910	△ 13,886,289	△ 15,134,023
(配当等相当額)	(3,723,480)	(3,867,789)	(4,190,563)	(4,342,412)	(4,626,697)	(4,693,306)
(売買損益相当額)	(△ 12,792,835)	(△ 13,846,059)	(△ 15,620,590)	(△ 16,464,322)	(△ 18,512,986)	(△ 19,827,329)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 467,170,568	△ 421,778,894	△ 389,987,865	△ 512,716,310	△ 765,968,385	△ 769,114,060
(H) 収益分配金	△ 22,815,884	△ 22,771,049	△ 22,752,738	△ 22,605,997	△ 22,167,057	△ 21,386,303
次期繰越損益金 (G + H)	△ 489,986,452	△ 444,549,943	△ 412,740,603	△ 535,322,307	△ 788,135,442	△ 790,500,363
追加信託差損益金	△ 9,069,355	△ 9,978,270	△ 11,430,027	△ 12,121,910	△ 13,886,289	△ 15,134,023
(配当等相当額)	(3,723,480)	(3,867,789)	(4,190,563)	(4,342,412)	(4,626,697)	(4,693,306)
(売買損益相当額)	(△ 12,792,835)	(△ 13,846,059)	(△ 15,620,590)	(△ 16,464,322)	(△ 18,512,986)	(△ 19,827,329)
分配準備積立金	78,048,640	86,310,088	93,737,642	98,912,356	102,017,326	100,378,608
繰越損益金	△ 558,965,737	△ 520,881,761	△ 495,048,218	△ 622,112,753	△ 876,266,479	△ 875,744,948

(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後掲の「収益分配金の計算過程（総額）」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
(a) 経費控除後の配当等収益	32,366,640円	31,336,070円	30,549,621円	28,563,092円	27,523,095円	23,569,653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	3,723,480	3,867,789	4,190,563	4,342,412	4,626,697	4,693,306
(d) 分配準備積立金	68,497,884	77,745,067	85,940,759	92,955,261	96,661,288	98,195,258
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	104,588,004	112,948,926	120,680,943	125,860,765	128,811,080	126,458,217
(f) 分配金	22,815,884	22,771,049	22,752,738	22,605,997	22,167,057	21,386,303
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	81,772,120	90,177,877	97,928,205	103,254,768	106,644,023	105,071,914
(h) 受益権総口数	2,851,985,505口	2,846,381,218口	2,844,092,274口	2,825,749,670口	2,770,882,126口	2,673,287,882口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1万口当り分配金	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
	80円	80円	80円	80円	80円	80円
(単 価)	(8,282円)	(8,438円)	(8,549円)	(8,106円)	(7,156円)	(7,043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。

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド （ヘッジなし・クラス／円ヘッジ・クラス／ ブラジル・リアル・クラス／通貨セレクト・クラス）

当ファンド（通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（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・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス／円ヘッジ・クラス／ブラジル・リアル・クラス／通貨セレクト・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）2016年2月18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7月31日

資産		
有価証券への投資、時価（費用128,972,368ドル）	ドル	127,966,780
利害関係人への投資（費用 21,956,350ドル）		21,342,296
カウンターパーティへの預託金		60,000
現金		1,083
外国為替先渡契約による評価益		6,102
デリバティブ金融商品に係る未収変動証拠金		1,012,500
未収：		
売却した有価証券に係る未収金		588,906
配当金		68,694
利子		691,195
資産合計		151,737,556
負債		
当座借越		9,185
外国為替先渡契約に係る評価損		4,060,124
未払い：		
購入した有価証券に係る未払金		4,540,778
投資運用報酬		247,350
保管報酬		108,146
会計および管理報酬		64,974
専門家報酬		42,599
決済が完了した為替先渡契約		14,057
名義書換代理報酬		7,824
受託会社報酬		5,881
為替運用報酬		4,334
その他の未払金		15,000
負債合計		9,120,252
純資産	ドル	142,617,304
純資産の内訳：		
払込元本	ドル	157,732,018
次期繰越欠損金		(15,114,714)
純資産	ドル	142,617,304
ブラジル・リアル・クラス	ドル	47,489,086
通貨セレクト・クラス		21,298,383
円ヘッジ・クラス		12,346,097
ヘッジなし・クラス		61,483,738
	ドル	142,617,304

発行済み受益証券数

ブラジル・リアル・クラス	68,503,258
通貨セレクト・クラス	28,803,463
円ヘッジ・クラス	15,750,336
ヘッジなし・クラス	75,184,336

1口当りの純資産

ブラジル・リアル・クラス	ドル	0.693
通貨セレクト・クラス	ドル	0.739
円ヘッジ・クラス	ドル	0.784
ヘッジなし・クラス	ドル	0.818

損益計算書

2015年2月23日（運用開始日）～2015年7月31日

投資収益

利息収入（18,748ドルの源泉徴収税控除後）	ドル	1,746,811
受取配当金（148,054ドルの源泉徴収税控除後）		1,344,199
利害関係人への投資からの受取配当金（58,159ドルの源泉徴収税控除後）		219,557
その他の収益		11
投資収益合計		3,310,578

費用

投資運用報酬	413,237
保管報酬	108,145
会計および管理報酬	64,932
専門家報酬	42,599
ファンド設定費用	39,717
為替運用報酬	22,298
名義書換代理報酬	7,823
受託会社報酬	5,881
支払利息	1,434
費用合計	706,066

純投資収益

2,604,512

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	(1,392,739)
利害関係人への投資	36
先物契約	(595,953)
スワップ契約	11,280
外国為替取引および外国為替先渡契約	(3,619,593)
純実現損	(5,596,969)

評価益（損）の純変動：

有価証券への投資	(1,005,588)
利害関係人への投資	(614,054)
スワップ契約	(6,011)
先物契約	(175,917)
外国為替換算および外国為替先渡契約	(4,047,124)
評価損の純変動	(5,848,694)

実現損および評価損

(11,445,663)

業務活動の結果生じた純資産の純減

ドル (8,841,151)

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		債券 (45.3%)		U S D	144,000	8.25% due 05/15/20	147,600
		アルゼンチン (0.0%)				包装・容器 (0.1%)	
		石油・ガス (0.0%)				Novelis, Inc.	
U S D	60,000	YPF S. A. ^(a)		U S D	30,000	8.38% due 12/15/17	31,050
		8.50% due 07/28/25	ドル 57,804	U S D	110,000	8.75% due 12/15/20	116,050
		アルゼンチン計 (費用60,642ドル)	57,804			医薬品 (0.5%)	
		オーストラリア (0.0%)				Valeant Pharmaceuticals International, Inc. ^(a)	
		鉱業 (0.0%)		E U R	125,000	4.50% due 05/15/23	136,035
		FMG Resources August 2006 Pty, Ltd. ^(a)		U S D	63,000	5.38% due 03/15/20	64,732
U S D	17,000	9.75% due 03/01/22	15,640	U S D	100,000	5.50% due 03/01/23	102,250
		オーストラリア計 (費用16,418ドル)	15,640	U S D	120,000	5.63% due 12/01/21	123,150
		バルバドス (0.1%)		U S D	170,000	5.88% due 05/15/23	176,783
		メディア (0.1%)		U S D	122,000	6.13% due 04/15/25	127,490
		Columbus International, Inc. ^(a)		U S D	13,000	7.50% due 07/15/21	14,105
U S D	200,000	7.38% due 03/30/21	212,500			小売 (0.1%)	
		バルバドス計 (費用211,335ドル)	212,500	U S D	51,000	1011778 BC ULC / New Red Finance, Inc. ^(a)	
		カナダ (1.0%)				6.00% due 04/01/22	52,647
		バンクローン (0.0%)				ソフトウェア (0.0%)	
		Valeant Pharmaceuticals International, Inc.		U S D	35,000	Open Text Corp. ^(a)	
U S D	27,999	4.00% due 04/01/22	28,137			5.63% due 01/15/23	34,913
		バイオテクノロジー (0.0%)				カナダ計 (費用1,495,374ドル)	1,488,442
		Concordia Healthcare Corp. ^(a)				キプロス (0.1%)	
U S D	27,000	7.00% due 04/15/23	27,506			不動産 (0.1%)	
		建築材料 (0.0%)				Aroundtown Property Holdings PLC	
		Masonite International Corp. ^(a)		E U R	100,000	3.00% due 12/09/21	102,762
U S D	22,000	5.63% due 03/15/23	22,660			キプロス計 (費用102,133ドル)	102,762
		鉱業 (0.0%)				フィンランド (0.0%)	
		First Quantum Minerals, Ltd. ^(a)				通信 (0.0%)	
U S D	8,000	7.00% due 02/15/21	6,100	U S D	10,000	Nokia OYJ	
U S D	22,000	7.25% due 05/15/22	16,335			6.63% due 05/15/39	10,850
		雑製造 (0.0%)				フィンランド計 (費用11,612ドル)	10,850
		Bombardier, Inc. ^(a)				フランス (1.4%)	
U S D	15,000	7.50% due 03/15/25	12,413			自動車部品・設備 (0.1%)	
		石油・ガス (0.3%)		E U R	100,000	Autodis S. A.	
		MEG Energy Corp. ^(a)				6.50% due 02/01/19	115,042
U S D	112,000	6.50% due 03/15/21	104,664			銀行 (0.4%)	
U S D	108,000	7.00% due 03/31/24	99,090	U S D	200,000	Credit Agricole S. A. ^{(a), (b), (c)}	
		Paramount Resources, Ltd. ^(a)		U S D	200,000	6.63% due 09/29/49	199,250
U S D	31,000	6.88% due 06/30/23	30,070			7.88% due 01/29/49	207,504
		Seven Generations Energy, Ltd. ^(a)		U S D	250,000	Societe Generale S. A. ^{(a), (b), (c)}	
U S D	15,000	6.75% due 05/01/23	14,662			7.88% due 12/29/49	253,875
						電力 (0.1%)	
						Electricite de France S. A. ^{(a), (b), (c)}	
				U S D	100,000	5.25% due 01/29/49	102,500

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
U S D	80,000	6.00% due 01/22/14 ヘルスケア用品 (0.1%) 3AB Optique Developpement SAS	89,483	U S D	210,000	XLIT, Ltd. ^{(b), (c)} 6.50% due 10/29/49 包装・容器 (0.1%) Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA, Inc.	177,975
E U R	100,000	5.63% due 04/15/19 保険 (0.1%) AXA S. A. ^{(a), (b), (c)}	107,170	E U R	100,000	4.25% due 01/15/22 医薬品 (0.1%) Grifols Worldwide Operations, Ltd.	111,362
U S D	200,000	6.38% due 12/29/49 メディア (0.3%) Numericable-SFR SAS ^(a)	212,500	U S D	200,000	5.25% due 04/01/22 アイルランド計 (費用624,858 ドル) イタリア (0.3%) 自動車部品・設備 (0.1%) Rhino Bondco S. P. A	202,000 604,715
U S D	200,000	4.88% due 05/15/19	203,000	E U R	100,000	7.25% due 11/15/20 銀行 (0.1%) UniCredit SpA	119,096
E U R	100,000	5.38% due 05/15/22	114,905	E U R	100,000	6.95% due 10/31/22 エンジニアリング・建設 (0.1%) Astaldi SpA	131,606
E U R	100,000	5.63% due 05/15/24 包装・容器 (0.1%) SGD Group SAS	113,302	E U R	100,000	7.13% due 12/01/20 イタリア計 (費用371,953ドル) ジャマイカ (0.2%) 通信 (0.2%) Digicel, Ltd. ^(a)	116,838 367,540
E U R	100,000	5.63% due 05/15/19 小売 (0.1%) THOM Europe SAS	113,799	U S D	240,000	6.00% due 04/15/21 ジャマイカ計 (費用237,537ドル) ルクセンブルグ (1.4%) バンクローン (0.1%) Intelsat Jackson Holdings S. A.	226,200 226,200
E U R	100,000	7.38% due 07/15/19 通信 (0.1%) Orange S. A. ^{(b), (c)}	116,424	U S D	25,000	3.75% due 06/30/19 SS&C European Holdings S. a. r. L	24,758
E U R	100,000	5.00% due 10/29/49 フランス計 (費用2,123,966ドル) ドイツ (1.0%) 銀行 (0.7%) Commerzbank AG ^(a)	117,943 2,066,697	U S D	4,709	4.00% due 07/08/22 Travelport Finance (Luxembourg) S. à r. l.	4,751
U S D	275,000	8.13% due 09/19/23 Deutsche Bank AG ^{(b), (c)}	320,804	U S D	89,774	5.75% due 09/02/21 エンターテイメント (0.1%) Intralot Capital Luxembourg S. A.	90,204
U S D	600,000	7.50% due 12/29/49 HSH Nordbank AG ^(b)	603,000	E U R	100,000	6.00% due 05/15/21 環境制御 (0.1%) Bilbao Luxembourg S. A. ^(d)	96,675
E U R	100,000	0.79% due 02/14/17 建築材料 (0.1%) Pfleiderer GmbH	81,869	E U R	100,000	10.50% due 12/01/18 ヘルスケア用品 (0.0%)	117,974
E U R	100,000	7.88% due 08/01/19 エレクトロニクス (0.1%) Trionista TopCo GmbH	115,181				
E U R	100,000	6.88% due 04/30/21 メディア (0.1%) Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG / Unitymedia NRW GmbH	117,035				
E U R	100,000	4.00% due 01/15/25	112,695				
E U R	90,000	5.75% due 01/15/23 ドイツ計 (費用1,492,708ドル) アイルランド (0.4%) 銀行 (0.1%) Bank of Ireland ^(b)	107,391 1,457,975				
E U R	100,000	4.25% due 06/11/24 保険 (0.1%)	113,378				

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Mallinckrodt International Finance S. A. / Mallinckrodt CB LLC ^(a)		EUR	100,000	9.88% due 12/01/19	118,771
USD	49,000	4.88% due 04/15/20	50,428			電力 (0.1%)	
		家具 (0.1%)				Gas Natural Fenosa Finance BV ^{(b), (c)}	
EUR	100,000	Magnolia BC S. A. 9.00% due 08/01/20	118,219	EUR	100,000	4.13% due 11/29/49	112,557
		鉄鋼 (0.0%)				エンターテインメント (0.1%)	
USD	30,000	ArcelorMittal 6.25% due 03/01/21	30,300	EUR	100,000	7.25% due 12/01/20	114,936
		通信 (1.0%)				インターネット (0.2%)	
EUR	100,000	Altice Financing S. A. ^(a) 5.25% due 02/15/23	113,523	EUR	200,000	7.88% due 11/15/20	235,355
USD	200,000	6.63% due 02/15/23	206,000			メディア (0.2%)	
USD	200,000	7.88% due 12/15/19	210,500	EUR	100,000	7.13% due 05/15/24	122,119
		Altice S. A.				Ziggo Bond Finance BV	
EUR	100,000	7.25% due 05/15/22	112,695	EUR	100,000	4.63% due 01/15/25	108,828
		Matterhorn Telecom S. A.				鉱業 (0.3%)	
EUR	175,000	3.88% due 05/01/22	181,525			Constellium NV ^(a)	
EUR	100,000	5.25% due 02/01/19	113,800	USD	250,000	5.75% due 05/15/24	207,500
		Play Finance 2 S. A.		USD	250,000	8.00% due 01/15/23	240,625
EUR	100,000	7.75% due 01/24/33	152,491			石油・ガス (0.2%)	
		Telecom Italia Finance S. A.				Petrobras Global Finance BV	
EUR	100,000	Telenet Finance V Luxembourg SCA 6.25% due 08/15/22	119,324	EUR	100,000	4.75% due 01/14/25	96,946
EUR	100,000	6.75% due 08/15/24	121,257	USD	104,000	5.38% due 01/27/21	96,820
		Wind Acquisition Finance S. A.		USD	45,000	6.85% due 06/05/15	36,368
EUR	100,000	4.00% due 07/15/20	112,833			小売 (0.0%)	
		ルクセンブルグ計 (費用2,036,110ドル)		EUR	100,000	6.25% due 06/15/19	74,588
		オランダ (1.9%)	1,977,257			半導体 (0.0%)	
		自動車部品・設備 (0.2%)		USD	20,000	5.00% due 10/01/25	19,600
		Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV				通信 (0.1%)	
EUR	100,000	4.13% due 07/15/21	112,076	EUR	100,000	4.20% due 12/29/49	114,076
		Schaeffler Holding Finance BV ^{(a), (d)}		EUR	100,000	4.00% due 01/15/27	103,856
USD	200,000	6.75% due 11/15/22	216,500			オランダ計 (費用2,818,838ドル)	2,666,160
		バンクローン (0.1%)				ノルウェー (0.1%)	
USD	150,000	Amaya Holdings BV 8.00% due 08/01/22	151,912	EUR	100,000	7.50% due 02/01/22	115,181
		銀行 (0.3%)				ノルウェー計 (費用116,390ドル)	115,181
USD	350,000	ING Bank NV ^(a) 5.80% due 09/25/23	382,727			ポルトガル (0.1%)	
		商業サービス (0.1%)				銀行 (0.1%)	
		TMF Group Holding BV		EUR	100,000	4.00% due 01/21/19	112,621

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		ポルトガル計（費用116,239ドル）	112,621			Eco-Bat Finance PLC	
		プエルトリコ（0.2%）		EUR	100,000	7.75% due 02/15/17	107,999
		銀行（0.2%）				小売（0.4%）	
USD	365,000	Popular, Inc. 7.00% due 07/01/19	350,400			Punch Taverns Finance B, Ltd.	
		プエルトリコ計（費用365,829ドル）	350,400	GBP	63,871	5.27% due 03/30/24	93,691
		スペイン（0.4%）				Punch Taverns Finance PLC ^{(a), (b)}	
		銀行（0.3%）		GBP	110,000	6.08% due 10/15/27	162,217
		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S. A. ^{(b), (c)}		GBP	100,000	Travis Perkins PLC	
EUR	200,000	7.00% due 12/29/49	225,389			4.38% due 09/15/21	159,959
		Banco Santander S. A. ^{(b), (c)}				Unique Pub Finance Co. PLC	
EUR	100,000	6.25% due 03/12/49	110,762	GBP	100,000	6.46% due 03/30/32	138,885
		Bankia S. A. ^(b)				通信（0.1%）	
EUR	100,000	4.00% due 05/22/24	109,444			Virgin Media Secured Finance PLC	
		エンジニアリング・建設（0.1%）		GBP	90,000	6.00% due 04/15/21	146,589
		Abengoa Finance SAU				英国計（費用3,388,268ドル）	3,396,176
EUR	100,000	6.00% due 03/31/21	82,864			アメリカ（34.0%）	
		スペイン計（費用566,157ドル）	528,459			広告（0.0%）	
		スイス（0.3%）				Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp.	
		銀行（0.3%）		USD	40,000	5.63% due 02/15/24	40,800
		Credit Suisse Group AG ^{(a), (b), (c)}				航空宇宙・防衛（0.1%）	
USD	400,000	6.25% due 12/29/49	389,500			Moog, Inc. ^(a)	
		スイス計（費用393,070ドル）	389,500	USD	40,000	5.25% due 12/01/22	40,400
		英国（2.4%）				Spirit AeroSystems, Inc.	
		銀行（1.4%）		USD	40,000	5.25% due 03/15/22	41,100
		Barclays PLC ^{(b), (c)}				TransDigm, Inc.	
USD	325,000	6.63% due 06/29/49	321,962	USD	60,000	5.50% due 10/15/20	59,916
USD	700,000	8.25% due 12/29/49	749,000	USD	24,000	6.00% due 07/15/22	23,940
		Lloyds Banking Group PLC ^{(b), (c)}				農業（0.1%）	
USD	300,000	7.50% due 04/30/49	312,750			Reynolds American, Inc.	
		Royal Bank of Scotland Group PLC		USD	85,000	5.85% due 08/15/45	91,397
USD	575,000	6.00% due 12/19/23	616,337			自動車部品・設備（0.2%）	
		フードサービス（0.1%）				Affinia Group, Inc.	
		Brakes Capital		USD	40,000	7.75% due 05/01/21	41,700
GBP	100,000	7.13% due 12/15/18	161,356			Goodyear Tire & Rubber Co.	
		ヘルスケアサービス（0.3%）		USD	75,000	6.50% due 03/01/21	79,406
		Care UK Health & Social Care PLC ^(b)				UCI International, Inc.	
GBP	100,000	5.58% due 07/15/19	151,368	USD	120,000	8.63% due 02/15/19	101,400
		Ephios Bondco PLC				ZF North America Capital, Inc.	
EUR	100,000	6.25% due 07/01/22	112,551	EUR	100,000	2.75% due 04/27/23	105,513
		Voyage Care Bondco PLC				バンクローン（0.7%）	
GBP	100,000	6.50% due 08/01/18	161,512			Air Medical Group Holdings, Inc.	
		金属組立・ハードウェア（0.1%）		USD	20,000	4.50% due 04/28/22	19,890

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Alere Inc. (fka IM US Holdings, LLC)		U S D	57,630	Station Casinos LLC	57,835
U S D	12,000	4.25% due 06/20/22	12,067			4.25% due 03/02/20	
		AlixPartners, LLP ^(f)		U S D	10,000	Sterigenics-Nordion Holdings, LLC	10,025
U S D	14,000	0.00% due 07/28/22	14,067			4.25% due 05/16/22	
		Avaya, Inc.				銀行 (4.2%)	
U S D	89,733	6.25% due 05/29/20	85,583			Bank of America Corp. ^{(b), (c)}	
		Blue Coat Holdings, Inc.		U S D	521,000	6.10% due 12/29/49	518,656
U S D	8,000	4.50% due 05/20/22	8,018	U S D	294,000	6.25% due 09/29/49	294,273
		Commscope, Inc.		U S D	45,000	6.50% due 10/29/49	46,462
U S D	19,000	3.75% due 12/29/22	19,071	U S D	220,000	8.13% due 12/29/49	235,125
		DJO Finance LLC				Bank of New York Mellon Corp. ^{(b), (c)}	
U S D	30,000	4.25% due 06/08/20	30,097	U S D	525,000	4.50% due 12/29/49	485,625
		Dole Food Company, Inc.		U S D	325,000	4.95% due 12/29/49	323,375
U S D	48,453	4.50% due 11/01/18	48,665			Capital One Financial Corp. ^{(b), (c)}	
		Dynergy, Inc.		U S D	375,000	5.55% due 12/29/49	375,450
U S D	49,493	4.00% due 04/23/20	49,688			CIT Group, Inc. ^(a)	
		Epicor Software Corporation (fka Eagle Parent Inc.)		U S D	30,000	5.25% due 03/15/18	31,125
U S D	42,000	4.75% due 06/01/22	42,058	U S D	70,000	5.38% due 05/15/20	73,982
		Houghton Mifflin Harcourt Company		U S D	60,000	5.50% due 02/15/19	63,450
U S D	50,000	4.00% due 05/28/21	49,969			Citigroup, Inc. ^{(b), (c)}	
		Informatica Corp. ^(f)		U S D	100,000	5.88% due 12/29/49	100,625
U S D	49,000	0.00% due 08/05/22	49,080	U S D	400,000	5.95% due 12/29/49	390,000
		Interactive Data Corp.		U S D	80,000	6.30% due 12/29/49	78,200
U S D	30,533	4.75% due 05/02/21	30,698			Goldman Sachs Group, Inc. ^{(b), (c)}	
		LightSquared LP ^(f)		U S D	350,000	5.38% due 12/29/49	347,900
U S D	110,000	0.00% due 06/15/20	107,387			JP Morgan Chase & Co. ^{(b), (c)}	
		Par Pharmaceutical Companies, Inc. (Par Pharmaceutical, Inc.)		U S D	100,000	5.00% due 12/29/49	97,760
U S D	49,750	4.25% due 09/30/19	49,800	U S D	325,000	5.30% due 12/29/49	323,830
		Party City Holdings, Inc.		U S D	210,000	6.00% due 12/29/49	207,900
U S D	49,747	4.00% due 07/27/19	49,817	U S D	245,000	7.90% due 04/29/49	258,475
		Pharmaceutical Product Development, Inc. (Jaguar Holdings, LLC)				JP Morgan Chase Capital XXIII ^(b)	
U S D	24,872	4.00% due 12/05/18	24,913	U S D	50,000	1.27% due 05/15/47	39,475
		Rexnord LLC / RBS Global, Inc.		U S D	175,000	Morgan Stanley ^{(b), (c)}	
U S D	113,707	4.00% due 08/21/20	113,944	U S D	135,000	5.45% due 07/29/49	173,950
		Servicemaster Company, LLC, The				5.55% due 12/29/49	134,325
U S D	74,624	4.25% due 07/01/21	74,899	U S D	100,000	PNC Financial Services Group, Inc. ^{(b), (c)}	
		SS&C Technologies, Inc.				4.85% due 05/29/49	95,000
U S D	28,565	4.00% due 07/08/22	28,821	U S D	575,000	State Street Capital Trust IV ^(b)	
		Stardust Finance Holdings, Inc.				1.29% due 06/15/37	500,969
U S D	19,251	6.50% due 03/14/22	19,311	U S D	155,000	State Street Corp. ^{(b), (c)}	
						5.25% due 12/29/49	156,581
				U S D	575,000	Wells Fargo & Co. ^{(b), (c)}	
						5.88% due 12/29/49	588,656

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		建築材料 (0.2%)				Core Industrial Trust	
		Builders FirstSource, Inc. ^(a)				2015-TEXW ^{(a), (b)}	
U S D	16,000	10.75% due 08/15/23	16,480	U S D	1,000,000	3.85% due 02/10/34	936,772
		CPG Merger Sub LLC ^(a)				CSMC Trust 2014-TIKI Class F ^{(a), (b)}	
U S D	43,000	8.00% due 10/01/21	43,860	U S D	1,000,000	4.01% due 09/15/38	991,287
		Ply Gem Industries, Inc.				GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF Class EFX ^{(a), (b)}	
U S D	70,000	6.50% due 02/01/22	69,213	U S D	1,000,000	3.38% due 12/15/19	940,846
		USG Corp. ^(a)				JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC20 Class AJ ^(b)	
U S D	43,000	5.88% due 11/01/21	45,042	U S D	1,000,000	6.08% due 02/12/51	1,044,163
U S D	60,000	9.75% due 01/15/18	68,250			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-COSMO ^{(a), (b)}	
		化学製品 (0.5%)		U S D	1,000,000	4.14% due 01/15/32	1,003,012
		Axalta Coating Systems US Holdings, Inc. / Axalta Coating Systems Dutch Holding B ^(a)				商業サービス (0.5%)	
U S D	150,000	7.38% due 05/01/21	159,750			Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance, Inc. ^(a)	
		Chemours Co. ^(a)		U S D	100,000	5.13% due 06/01/22	99,500
U S D	27,000	6.63% due 05/15/23	23,760	U S D	10,000	5.63% due 06/15/23	10,025
U S D	22,000	7.00% due 05/15/25	19,298	U S D	26,000	5.63% due 04/15/23	26,683
		Chemtura Corp.		U S D	20,000	4.25% due 04/01/18	20,350
U S D	110,000	5.75% due 07/15/21	111,100	U S D	70,000	5.88% due 10/15/20	71,225
		Huntsman International LLC ^(a)		U S D	10,000	6.75% due 04/15/19	10,322
U S D	129,000	4.88% due 11/15/20	126,420	U S D	90,000	5.88% due 04/15/19	91,237
U S D	110,000	5.13% due 11/15/22	106,150	U S D	60,000	7.88% due 05/01/18	60,000
		Platform Specialty Products Corp. ^(a)		U S D	115,000	Safway Group Holding LLC / Safway Finance Corp. ^(a)	
U S D	60,000	6.50% due 02/01/22	62,100	U S D	30,000	7.00% due 05/15/18	117,300
		PSPC Escrow Corp.		U S D	30,000	Service Corp International	
E U R	100,000	6.00% due 02/01/23	112,308			5.38% due 05/15/24	31,800
		WR Grace & Co-Conn ^(a)				United Rentals North America, Inc.	
U S D	40,000	5.63% due 10/01/24	40,800	U S D	18,000	5.50% due 07/15/25	17,213
		石炭 (0.1%)		U S D	75,000	5.75% due 11/15/24	73,313
		CONSOL Energy, Inc.		U S D	10,000	7.38% due 05/15/20	10,637
U S D	188,000	5.88% due 04/15/22	146,053	U S D	50,000	7.63% due 04/15/22	54,312
		SunCoke Energy Partners LP / SunCoke Energy Partners Finance Corp. ^(a)				コンピュータ (0.1%)	
U S D	30,000	7.38% due 02/01/20	29,400	U S D	14,000	NCR Corp.	
		商業用不動産担保証券 (4.9%)				6.38% due 12/15/23	14,752
		COMM 2007-C9 Mortgage Trust Class AJFL ^{(a), (b)}					
U S D	1,000,000	0.88% due 12/10/49	970,869				
		COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust Class CME ^{(a), (b)}					
U S D	1,000,000	3.68% due 05/10/48	915,274				
		Core Industrial Trust 2015-CALW Class G ^{(a), (b)}					
U S D	140,000	3.85% due 02/10/34	130,298				

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Project Homestake Merger Corp. ^(a)		U S D	50,000	6.25% due 05/01/24	49,125
U S D	52,000	8.88% due 03/01/23	48,880	U S D	15,000	Talen Energy Supply LLC ^(a) 6.50% due 06/01/25	14,700
U S D	70,000	SunGard Data Systems, Inc. 6.63% due 11/01/19	72,348	U S D	30,000	電気部品・設備 (0.0%) GrafTech International, Ltd. 6.38% due 11/15/20	26,700
U S D	72,000	流通・卸売 (0.4%) American Tire Distributors, Inc. ^(a) 10.25% due 03/01/22	75,060	U S D	70,000	エレクトロニクス (0.1%) Sanmina Corp. ^(a) 4.38% due 06/01/19	71,050
U S D	190,000	HD Supply, Inc. ^(a) 5.25% due 12/15/21	195,700	U S D	11,000	代替エネルギー源 (0.0%) TerraForm Power Operating LLC ^(a) 6.13% due 06/15/25	11,028
U S D	160,000	7.50% due 07/15/20	170,800	U S D	30,000	エンジニアリング・建設 (0.1%) SBA Communications Corp. 4.88% due 07/15/22	39,400
U S D	135,000	11.00% due 04/15/20	150,525	U S D	40,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp. 6.00% due 02/01/23	28,238
U S D	20,000	多角的金融サービス (0.8%) Aircastle, Ltd. 5.13% due 03/15/21	20,600	U S D	120,000	エンターテインメント (0.2%) NAI Entertainment Holdings / NAI Entertainment Holdings Finance Corp. ^(a) 5.00% due 08/01/18	122,700
U S D	118,000	Ally Financial, Inc. 4.63% due 03/30/25	113,575	U S D	41,000	Pinnacle Entertainment, Inc. 6.38% due 08/01/21	44,229
U S D	210,000	8.00% due 11/01/31	250,950	U S D	70,000	Six Flags Entertainment Corp. ^(a) 5.25% due 01/15/21	72,100
U S D	210,000	American Express Co. ^{(b), (c)} 4.90% due 12/29/49	205,485	U S D	40,000	環境制御 (0.0%) ADS Waste Holdings, Inc. 8.25% due 10/01/20	41,800
U S D	175,000	5.20% due 05/29/49	175,000	U S D	10,000	Covanta Holding Corp. 5.88% due 03/01/24	9,850
U S D	50,000	DFC Finance Corp. ^(a) 10.50% due 06/15/20	35,125	U S D	70,000	食品 (0.1%) Diamond Foods, Inc. ^(a) 7.00% due 03/15/19	71,575
U S D	37,000	E*TRADE Financial Corp. 4.63% due 09/15/23	36,815	U S D	25,000	JBS USA LLC / JBS USA Finance, Inc. ^(a) 5.75% due 06/15/25	24,774
U S D	40,000	5.38% due 11/15/22	41,700	U S D	70,000	Smithfield Foods, Inc. 6.63% due 08/15/22	74,826
U S D	10,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp. 3.50% due 03/15/17	10,105	U S D	55,000	フードサービス (0.0%) Aramark Services, Inc. 5.75% due 03/15/20	20,900
U S D	30,000	4.88% due 03/15/19	30,938	U S D	48,715	ヘルスケア用品 (0.2%) Alcoa, Inc. ^(a)	
U S D	70,000	5.88% due 02/01/22	72,450				
U S D	45,000	6.00% due 08/01/20	47,362				
U S D	12,000	International Lease Finance Corp. 4.63% due 04/15/21	12,255				
U S D	60,000	5.88% due 08/15/22	65,400				
U S D	30,000	電力 (0.2%) AES Corp. 4.88% due 05/15/23	28,519				
U S D	26,000	Calpine Corp. ^(a) 5.38% due 01/15/23	25,415				
U S D	10,000	6.00% due 01/15/22	10,575				
U S D	55,000	Dynegy, Inc. ^(a) 6.75% due 11/01/19	56,787				
U S D	48,715	Miran Mid-Atlantic Series C Pass Through Trust 10.06% due 12/30/28	53,099				
		NRG Energy, Inc.					

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
U S D	55,000	3.00% due 05/15/16	65,072	U S D	15,000	5.75% due 11/15/20	15,750
U S D	24,000	6.38% due 07/01/23	24,960			持株会社 - 多角的 (0.0%)	
U S D	35,000	7.25% due 07/01/18	36,715			HRG Group, Inc. ^(a)	
U S D	41,000	Crimson Merger Sub, Inc. ^(a)		U S D	20,000	7.88% due 07/15/19	21,138
		6.63% due 05/15/22	37,822			住宅建設業者 (0.5%)	
		DJO Finco, Inc. / DJO				Allegion US Holding Co., Inc.	
		Finance LLC / DJO Finance		U S D	30,000	5.75% due 10/01/21	30,675
		Corp. ^(a)				Beazer Homes USA, Inc.	
U S D	81,000	8.13% due 06/15/21	83,228	U S D	40,000	5.75% due 06/15/19	39,800
		Hologic, Inc. ^(a)		U S D	50,000	7.50% due 09/15/21	50,125
U S D	34,000	5.25% due 07/15/22	35,105			Dollar Tree, Inc.	
		Sterigenics-Nordion		U S D	30,000	4.00% due 02/15/20	30,600
		Holdings LLC ^(a)				KB Home	
U S D	9,000	6.50% due 05/15/23	9,203	U S D	30,000	4.75% due 05/15/19	29,925
		Teleflex, Inc.		U S D	40,000	7.00% due 12/15/21	41,350
U S D	7,000	3.88% due 08/01/17	15,238			Lennar Corp. ^{(a), (e)}	
		ヘルスケアサービス (0.7%)		U S D	5,000	2.75% due 12/15/20	11,941
		Amsurg Corp.		U S D	30,000	4.50% due 11/15/19	31,012
U S D	80,000	5.63% due 07/15/22	82,284	U S D	30,000	4.75% due 12/15/17	31,200
		Centene Corp.				Meritage Homes Corp. ^(a)	
U S D	30,000	4.75% due 05/15/22	30,150	U S D	21,000	6.00% due 06/01/25	21,210
		CHS / Community Health				PulteGroup, Inc.	
		Systems, Inc.		U S D	30,000	6.38% due 05/15/33	30,450
U S D	10,000	6.88% due 02/01/22	10,700			Shea Homes LP / Shea	
U S D	80,000	7.13% due 07/15/20	85,200			Homes Funding Corp. ^(a)	
		DaVita HealthCare Partners,		U S D	33,000	5.88% due 04/01/23	33,495
		Inc.				Standard Pacific Corp.	
U S D	31,000	5.00% due 05/01/25	30,651	U S D	70,000	8.38% due 05/15/18	79,975
U S D	30,000	5.13% due 07/15/24	30,232	U S D	60,000	8.38% due 01/15/21	70,650
		HCA Holdings, Inc.				TRI Pointe Holdings, Inc.	
U S D	40,000	6.25% due 02/15/21	43,800	U S D	30,000	4.38% due 06/15/19	29,700
		HCA, Inc.				William Lyon Homes, Inc.	
U S D	20,000	3.75% due 03/15/19	20,288	U S D	70,000	8.50% due 11/15/20	75,425
U S D	20,000	5.38% due 02/01/25	20,450			Woodside Homes Co LLC /	
U S D	100,000	5.88% due 05/01/23	107,500			Woodside Homes Finance,	
U S D	75,000	6.50% due 02/15/20	83,859			Inc. ^(a)	
U S D	117,000	7.50% due 02/15/22	136,305	U S D	90,000	6.75% due 12/15/21	85,050
		HealthSouth Corp. ^(e)				住宅資産 ABS (3.5%)	
U S D	15,000	2.00% due 12/01/43	18,937			Bear Stearns Asset Backed	
U S D	30,000	5.75% due 11/01/24	30,300			Securities I Trust 2006-HE9	
		Surgical Care Affiliates, Inc. ^(a)		U S D	1,200,537	0.33% due 11/25/36	1,022,896
U S D	14,000	6.00% due 04/01/23	14,210			Bear Stearns Asset Backed	
		Tenet Healthcare Corp. ^{(a), (b)}				Securities I Trust 2007-AQ2	
U S D	40,000	3.79% due 06/15/20	41,150			Class A2 ^(b)	
U S D	90,000	5.00% due 03/01/19	90,900	U S D	713,583	0.36% due 01/25/37	603,279
U S D	30,000	6.00% due 10/01/20	32,625			Bear Stearns Asset Backed	
U S D	52,000	6.75% due 06/15/23	54,340			Securities I Trust 2007-HE1	
U S D	30,000	8.13% due 04/01/22	33,656			Class 21A2 ^(b)	
		WellCare Health Plans, Inc.		U S D	1,500,565	0.35% due 01/25/37	1,351,220

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 Class 2A ^(b)		U S D	45,000	5.50% due 02/15/22 Twitter, Inc. ^(a)	46,800
U S D	1,262,852	0.33% due 03/25/37	1,004,044	U S D	17,000	1.00% due 09/15/21 Zayo Group LLC / Zayo Capital, Inc. ^(a)	14,716
		Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 Class 2A ^(b)		U S D	147,000	6.00% due 04/01/23	147,476
U S D	1,281,664	0.33% due 04/25/37	998,868	U S D	15,000	6.38% due 05/15/25	14,831
		家庭用品 (0.1%)		U S D	115,000	10.13% due 07/01/20	127,650
		Spectrum Brands, Inc. ^(a)				投資会社 (0.1%)	
U S D	37,000	5.75% due 07/15/25	38,103	U S D	85,000	American Capital, Ltd. ^(a)	
U S D	40,000	6.13% due 12/15/24	41,559			6.50% due 09/15/18	87,763
U S D	70,000	6.38% due 11/15/20	74,550			鉄鋼 (0.1%)	
U S D	40,000	6.63% due 11/15/22	42,800			Ryerson Inc / Joseph T Ryerson & Son, Inc.	
		保険 (1.3%)		U S D	40,000	9.00% due 10/15/17	39,500
		Allstate Corp. ^(b)		U S D	50,000	5.13% due 10/01/21	49,875
U S D	60,000	5.75% due 08/15/53	62,700	U S D	3,000	5.25% due 04/15/23	2,940
U S D	50,000	6.50% due 05/15/57	56,125			United States Steel Corp.	
		CNO Financial Group, Inc.		U S D	30,000	7.38% due 04/01/20	29,100
U S D	56,000	4.50% due 05/30/20	57,820			レジャー (0.0%)	
		Genworth Holdings, Inc.				Jarden Corp.	
U S D	160,000	4.80% due 02/15/24	139,500	U S D	20,000	7.50% due 05/01/17	21,775
U S D	40,000	6.50% due 06/15/34	35,300			宿泊業 (0.5%)	
		Liberty Mutual Group, Inc. ^{(a), (b)}		U S D	62,000	6.88% due 05/15/23	64,480
U S D	80,000	7.00% due 03/15/37	82,000			Caesars Entertainment Resort Properties LLC / Caesars Entertainment Resort Prope	
U S D	280,000	7.80% due 03/15/37	331,800	U S D	190,000	8.00% due 10/01/20	181,450
		MetLife Capital Trust X ^(a)		U S D	41,000	6.00% due 06/01/25	42,230
U S D	100,000	9.25% due 04/08/38	139,980			Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp.	
		Nationwide Financial Services, Inc.		U S D	90,000	5.63% due 10/15/21	93,712
U S D	75,000	6.75% due 05/15/37	78,675	U S D	40,000	5.63% due 04/15/23	40,200
		Principal Financial Group, Inc. ^(b)		U S D	43,000	6.00% due 03/15/23	43,753
U S D	325,000	4.70% due 05/15/55	321,750	U S D	97,000	6.63% due 12/15/21	102,456
		Prudential Financial, Inc. ^(b)		U S D	30,000	6.75% due 10/01/20	32,100
U S D	20,000	5.38% due 05/15/45	19,750			Station Casinos LLC	
U S D	80,000	5.63% due 06/15/43	83,084	U S D	70,000	7.50% due 03/01/21	74,725
		Reinsurance Group of America, Inc. ^(b)				機械 - 建設・鉱業 (0.1%)	
U S D	270,000	6.75% due 12/15/65	249,750	U S D	110,000	BlueLine Rental Finance Corp. ^(a)	
		Voya Financial, Inc. ^(b)				7.00% due 02/01/19	109,450
U S D	250,000	5.65% due 05/15/53	255,400				
		インターネット (0.3%)					
		Blue Coat Holdings, Inc. ^(a)					
U S D	26,000	8.38% due 06/01/23	26,585				
		IAC / InterActiveCorp.					
U S D	40,000	4.88% due 11/30/18	41,330				
		Netflix, Inc. ^(a)					

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		組立住宅 ABS (0.7%)		U S D	30,000	5.75% due 08/01/21	31,200
		Conseco Finance				Townsquare Media, Inc. ^(a)	
		Securizations Corp. Class		U S D	3,000	6.50% due 04/01/23	2,985
		M1 ^(b)				Tribune Media Co. ^(a)	
U S D	1,100,000	1.94% due 09/01/33	995,405	U S D	75,000	5.88% due 07/15/22	77,438
		メディア (1.2%)				Univision Communications, Inc. ^(a)	
		AMC Networks, Inc.		U S D	30,000	5.13% due 05/15/23	30,075
U S D	8,000	4.75% due 12/15/22	8,060	U S D	92,000	5.13% due 02/15/25	92,230
U S D	40,000	7.75% due 07/15/21	43,200	U S D	70,000	8.50% due 05/15/21	73,806
		Cablevision Systems Corp.				金属組立・ハードウェア (0.1%)	
U S D	3,000	5.88% due 09/15/22	2,843			Global Brass & Copper, Inc.	
U S D	50,000	8.63% due 09/15/17	54,937			9.50% due 06/01/19	109,000
		CCO Holdings LLC / CCO		U S D	100,000	Wise Metals Group LLC /	
		Holdings Capital Corp. ^(a)				Wise Alloys Finance Corp. ^(a)	
U S D	10,000	5.13% due 05/01/23	9,900	U S D	90,000	8.75% due 12/15/18	92,052
U S D	3,000	5.25% due 09/30/22	3,038			鉱業 (0.1%)	
U S D	88,000	5.88% due 05/01/27	87,175			Alcoa, Inc.	
U S D	20,000	6.50% due 04/30/21	20,912	U S D	30,000	5.13% due 10/01/24	30,150
		CCO Safari II LLC ^(a)		U S D	100,000	5.87% due 02/23/22	105,875
U S D	195,000	4.91% due 07/23/25	195,432			オフィス・ビジネス設備 (0.2%)	
U S D	100,000	6.38% due 10/23/35	102,228			CDW LLC / CDW Finance	
U S D	45,000	6.83% due 10/23/55	46,277			Corp.	
		Clear Channel Worldwide		U S D	34,000	5.00% due 09/01/23	33,766
		Holdings, Inc.		U S D	200,000	6.00% due 08/15/22	209,000
U S D	300,000	6.50% due 11/15/22	311,250			石油・ガス (1.1%)	
		DISH DBS Corp.				Antero Resources Corp.	
U S D	40,000	4.25% due 04/01/18	40,700	U S D	12,000	5.13% due 12/01/22	11,340
U S D	30,000	5.00% due 03/15/23	28,087	U S D	40,000	5.38% due 11/01/21	38,900
U S D	70,000	5.13% due 05/01/20	70,875	U S D	17,000	6.00% due 12/01/20	17,212
U S D	50,000	5.88% due 11/15/24	48,500			Blue Racer Midstream LLC /	
		Mediacom Broadband LLC /		U S D	51,000	Blue Racer Finance Corp. ^(a)	
		Mediacom Broadband Corp.				6.13% due 11/15/22	51,893
U S D	35,000	5.50% due 04/15/21	33,950	U S D	96,000	Bonanza Creek Energy, Inc.	
		Midcontinent				6.75% due 04/15/21	83,040
		Communications &		U S D	2,000	California Resources Corp.	
		Midcontinent Finance Corp. ^(a)		U S D	97,000	5.00% due 01/15/20	1,715
U S D	120,000	6.25% due 08/01/21	121,800	U S D	208,000	5.50% due 09/15/21	80,025
		Nielsen Finance LLC /				6.00% due 11/15/24	168,480
		Nielsen Finance Co. ^(a)		U S D	66,000	Carrizo Oil & Gas, Inc.	
U S D	23,000	5.00% due 04/15/22	22,799	U S D	5,000	6.25% due 04/15/23	63,347
		Radio One, Inc. ^(a)				7.50% due 09/15/20	5,025
U S D	10,000	7.38% due 04/15/22	9,775	U S D	28,000	Chesapeake Energy Corp.	
		RCN Telecom Services LLC /				6.63% due 08/15/20	25,060
		RCN Capital Corp. ^(a)		U S D	80,000	CrownRock LP / CrownRock	
U S D	30,000	8.50% due 08/15/20	31,350			Finance, Inc. ^(a)	
U S D	20,000	4.25% due 05/15/20	19,925	U S D	30,000	7.13% due 04/15/21	81,700
U S D	10,000	4.63% due 05/15/23	9,625	U S D		7.75% due 02/15/23	31,050
U S D	89,000	5.38% due 04/15/25	88,777				

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Diamondback Energy, Inc.		U S D	11,000	6.50% due 11/15/20	9,515
U S D	60,000	7.63% due 10/01/21	63,600			Whiting Petroleum Corp.	
		EP Energy LLC / Everest		U S D	38,000	5.00% due 03/15/19	36,480
		Acquisition Finance, Inc. ^(a)		U S D	26,000	6.25% due 04/01/23	25,350
U S D	27,000	6.38% due 06/15/23	25,245			WPX Energy, Inc.	
U S D	80,000	9.38% due 05/01/20	82,600	U S D	20,000	5.25% due 09/15/24	17,150
		Gulfport Energy Corp. ^(a)		U S D	15,000	6.00% due 01/15/22	14,025
U S D	32,000	6.63% due 05/01/23	32,000			その他 ABS (1.6%)	
		Halcon Resources Corp. ^(a)				Bear Stearns Asset Backed	
U S D	28,000	8.63% due 02/01/20	26,740			Securities I Trust 2007-FS1	
		Hilcorp Energy I LP / Hilcorp		U S D	625,224	Class 1A3 ^(b)	502,048
U S D	30,000	5.00% due 12/01/24	27,900			0.36% due 05/25/35	
		Finance Co. ^(a)				Carrington Mortgage Loan	
		Linn Energy LLC / Linn		U S D	900,000	Trust Series 2005-FRE1 Class	
U S D	2,000	6.25% due 11/01/19	1,211			M1 ^(b)	759,027
U S D	31,000	7.75% due 02/01/21	18,135			0.66% due 12/25/35	
U S D	2,000	8.63% due 04/15/20	1,230			Countrywide Asset-Backed	
		Matador Resources Co. ^(a)		U S D	1,156,495	Certificates Class 1A ^(b)	967,067
U S D	9,000	6.88% due 04/15/23	9,135			1.03% due 10/25/47	
		Memorial Production				包装・容器 (0.2%)	
		Partners LP / Memorial		U S D	75,000	Ball Corp.	
		Production Finance Corp.		U S D	41,000	5.25% due 07/01/25	75,416
U S D	73,000	6.88% due 08/01/22	58,400			Berry Plastics Corp.	
U S D	31,000	7.63% due 05/01/21	26,040			5.13% due 07/15/23	40,283
		Memorial Resource				Reynolds Group Issuer, Inc.	
		Development Corp.		U S D	80,000	/ Reynolds Group Issuer LLC	
U S D	86,000	5.88% due 07/01/22	81,055			/ Reynolds Group Issuer Lu	
		Newfield Exploration Co.		U S D	80,000	5.75% due 10/15/20	82,800
U S D	19,000	5.38% due 01/01/26	18,240			Sealed Air Corp. ^(a)	
		Oasis Petroleum, Inc.		U S D	80,000	5.25% due 04/01/23	81,200
U S D	7,000	6.50% due 11/01/21	6,370			医薬品 (0.1%)	
U S D	16,000	6.88% due 03/15/22	14,720	U S D	30,000	Endo Finance LLC ^(a)	30,900
		QEP Resources, Inc.				5.75% due 01/15/22	
U S D	6,000	5.25% due 05/01/23	5,550	U S D	30,000	Endo Finance LLC / Endo	
U S D	40,000	5.38% due 10/01/22	37,400			Finco, Inc. ^(a)	
		Sanchez Energy Corp.		U S D	30,000	5.38% due 01/15/23	30,319
U S D	87,000	6.13% due 01/15/23	70,470			5.38% due 01/15/22	42,600
		SM Energy Co.		U S D	30,000	Omnicare, Inc.	
U S D	55,000	5.00% due 01/15/24	50,325			4.75% due 12/01/22	31,687
U S D	75,000	6.13% due 11/15/22	73,875			Valeant Pharmaceuticals	
		Sunoco LP / Sunoco Finance		U S D	32,000	International ^(a)	
		Corp. ^(a)		U S D	10,000	6.38% due 10/15/20	33,720
U S D	36,000	5.50% due 08/01/20	36,630			6.75% due 08/15/21	10,413
U S D	13,000	6.38% due 04/01/23	13,358			7.00% due 10/01/20	22,852
		Transocean, Inc.				フィリピン (0.9%)	
U S D	25,000	3.00% due 10/15/17	23,450			Energy Transfer Equity LP	
U S D	4,000	4.30% due 10/15/22	2,905	U S D	110,000	5.88% due 01/15/24	111,925
U S D	37,000	6.00% due 03/15/18	35,520			7.50% due 10/15/20	28,000
				U S D	25,000	Energy Transfer Partners LP	
						6.13% due 12/15/45	176,171

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp.		U S D	9,000	6.00% due 04/15/23	8,640
U S D	27,000	6.00% due 05/15/23	25,718	U S D	43,000	8.25% due 10/15/23	41,065
U S D	20,000	6.75% due 08/01/22	19,950	U S D	25,000	ESH Hospitality, Inc. ^(a)	24,344
		MarkWest Energy Partners LP / MarkWest Energy Finance Corp.		U S D	30,000	iStar Financial, Inc. ^(a)	29,925
U S D	50,000	4.88% due 12/01/24	48,750			RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp. ^(a)	
U S D	69,000	4.88% due 06/01/25	67,102	U S D	57,000	5.00% due 04/15/23	56,715
U S D	30,000	NGPL PipeCo LLC ^(a)	30,375			小売 (0.4%)	
		PBF Logistics LP / PBF Logistics Finance Corp. ^(a)		U S D	8,000	Dollar Tree, Inc. ^(a)	
U S D	27,000	6.88% due 05/15/23	26,932	U S D	185,000	5.25% due 03/01/20	8,440
		Regency Energy Partners LP / Regency Energy Finance Corp.		U S D	23,000	5.75% due 03/01/23	195,175
U S D	89,000	4.50% due 11/01/23	84,295	U S D	23,000	Family Dollar Stores, Inc.	23,977
U S D	55,000	Rockies Express Pipeline LLC ^(a)	55,550	U S D	30,000	Neiman Marcus Group, Ltd. LLC ^(a)	31,800
U S D	60,000	5.63% due 04/15/20	61,350			Penske Automotive Group, Inc.	
U S D	13,000	6.00% due 01/15/19	13,650	U S D	85,000	5.75% due 10/01/22	88,506
		Rose Rock Midstream LP / Rose Rock Finance Corp. ^(a)		U S D	105,000	Rite Aid Corp. ^(a)	
U S D	25,000	5.63% due 11/15/23	23,750	U S D	94,000	6.13% due 04/01/23	109,069
U S D	70,000	Sabine Pass Liquefaction LLC ^(a)	68,950	U S D	94,000	6.75% due 06/15/21	99,875
U S D	130,000	5.75% due 05/15/24	129,269			半導体 (0.1%)	
U S D	210,000	Sabine Pass LNG LP	218,400	U S D	5,000	Advanced Micro Devices Inc	3,325
		Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp.		U S D	5,000	Advanced Micro Devices, Inc.	3,450
U S D	24,000	4.25% due 11/15/23	22,200	U S D	60,000	Micron Technology, Inc. ^(a)	57,600
U S D	30,000	5.25% due 05/01/23	29,625	U S D	11,000	ON Semiconductor Corp. ^(e)	12,939
		Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp. ^(a)				造船 (0.0%)	
U S D	40,000	6.25% due 10/15/22	41,800	U S D	30,000	Huntington Ingalls Industries, Inc. ^(a)	30,825
		不動産 (0.1%)				5.00% due 12/15/21	
U S D	50,000	Crescent Resources LLC / Crescent Ventures, Inc. ^(a)	52,500	U S D	40,000	ソフトウェア (0.5%)	
U S D	30,000	10.25% due 08/15/17	31,687	U S D	105,000	Audatex North America, Inc. ^(a)	40,850
		Realogy Group LLC ^(a)		U S D	40,000	6.00% due 06/15/21	40,850
U S D	65,000	7.63% due 01/15/20	65,488	U S D	30,000	6.13% due 11/01/23	102,637
U S D	45,000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp. ^(a)	46,125	U S D	40,000	First Data Corp. ^(a)	42,300
		REIT (0.1%)		U S D	30,000	6.75% due 11/01/20	31,762
		Communications Sales & Leasing, Inc. ^(a)		U S D	40,000	8.25% due 01/15/21	42,400
				U S D	50,000	8.75% due 01/15/22	55,750
				U S D	91,000	10.63% due 06/15/21	103,285
				U S D	100,000	11.75% due 08/15/21	103,500
						IMS Health, Inc. ^(a)	
						6.00% due 11/01/20	

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Infor Software Parent LLC / Infor Software Parent, Inc. ^{(a), (c)}		U S D	20,000	7.00% due 03/01/20	21,300
U S D	45,000	7.13% due 05/01/21	44,212	U S D	215,000	9.00% due 11/15/18	240,800
		Infor US, Inc. ^(a)		U S D	89,000	7.13% due 06/15/24	81,435
U S D	87,000	6.50% due 05/15/22	88,958	U S D	60,000	7.63% due 02/15/25	55,650
		Italics Merger Sub, Inc. ^(a)		U S D	50,000	7.88% due 09/15/23	47,937
U S D	21,000	7.13% due 07/15/23	20,633			T-Mobile USA, Inc.	
		Nuance Communications, Inc. ^(a)		U S D	80,000	6.38% due 03/01/25	83,900
U S D	30,000	5.38% due 08/15/20	30,450	U S D	30,000	6.63% due 04/28/21	31,761
		SS&C Technologies Holdings, Inc. ^(a)				輸送 (0.1%)	
U S D	20,000	5.88% due 07/15/23	20,700	U S D	19,000	Air Medical Merger Sub Corp. ^(a)	17,765
		保管・倉庫 (0.1%)				Florida East Coast Holdings Corp. ^(a)	
U S D	60,000	7.88% due 12/01/20	62,400	U S D	44,000	6.75% due 05/01/19	44,440
		通信 (1.2%)				XPO Logistics, Inc. ^(a)	
U S D	105,000	Alcatel-Lucent USA, Inc. ^(a)	110,775	U S D	74,000	6.50% due 06/15/22	72,798
U S D	200,000	6.45% due 03/15/29	215,000	U S D	40,000	7.88% due 09/01/19	42,750
		Altice US Finance I Corp. ^(a)				トラック・リース (0.0%)	
U S D	200,000	6.75% due 11/15/20	201,000	U S D	40,000	Jurassic Holdings III, Inc. ^(a)	28,000
		Avaya, Inc. ^(a)				モーゲージ債権担保ホールローン (4.3%)	
U S D	55,000	5.38% due 07/15/23	53,075			Alternative Loan Trust	
U S D	70,000	7.00% due 04/01/19	56,875			2005-IM1 Class A1 ^(b)	
		CommScope Technologies Finance LLC ^(a)		U S D	588,403	0.49% due 01/25/36	496,096
U S D	33,000	6.00% due 06/15/25	32,588			Alternative Loan Trust	
		CommScope, Inc. ^(a)		U S D	1,169,930	2006-OA3 Class 1A1 ^(b)	959,404
U S D	34,000	4.38% due 06/15/20	34,212			Alternative Loan Trust	
		DigitalGlobe, Inc. ^(a)		U S D	1,147,172	2006-OA3 Class 2A1 ^(b)	923,539
U S D	30,000	5.25% due 02/01/21	28,800			Alternative Loan Trust	
		Frontier Communications Corp.		U S D	1,428,766	2007-AL1 Class A1 ^(b)	1,029,893
U S D	40,000	6.25% due 09/15/21	36,900			Deutsche Alt-A Securities	
U S D	20,000	6.88% due 01/15/25	17,025			Mortgage Loan Trust Series	
U S D	8,000	7.63% due 04/15/24	7,280			2006-OA1 Class A1 ^(b)	
		Level 3 Financing, Inc. ^(a)		U S D	1,327,282	0.39% due 02/25/47	1,067,306
U S D	28,000	5.13% due 05/01/23	27,230			MASTR Resecuritization	
U S D	110,000	5.38% due 08/15/22	111,100			Trust 2008-3 Class A1 ^{(a), (b)}	
U S D	130,000	5.63% due 02/01/23	131,300	U S D	1,007,074	0.62% due 08/25/37	719,051
U S D	30,000	7.00% due 06/01/20	31,650			Structured Asset Mortgage	
		Plantronics, Inc. ^(a)				Investments II Trust 2005-AR3	
U S D	17,000	5.50% due 05/31/23	17,255			Class 1A1 ^(b)	952,897
		SBA Telecommunications, Inc.		U S D	1,101,724	0.46% due 08/25/35	952,897
U S D	40,000	5.75% due 07/15/20	41,800			アメリカ計 (費用49,060,676ドル)	48,509,978
		Sprint Capital Corp.				債券計 (費用65,610,113ドル)	64,656,857
U S D	40,000	6.88% due 11/15/28	33,900				
		Sprint Communications, Inc. ^(a)					

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型)

株式	有価証券の明細	公正価値	株式	有価証券の明細	公正価値
	株式リンク証券 (14.8%)			オランダ計 (費用831,217ドル)	819,893
	フランス (0.4%)			スペイン (0.3%)	
4,430	Credit Suisse AG into Danone Co. due 09/28/15	ドル 299,952	6,330	Credit Suisse AG into INDITEX due 09/17/15	219,368
	Merrill Lynch International & Co. into Publicis Groupe SA		6,330	due 09/16/15	219,369
1,990	due 09/28/15	149,999		スペイン計 (費用409,741ドル)	438,737
1,990	due 09/29/15	149,977		スウェーデン (0.7%)	
	フランス計 (費用601,285ドル)	599,928	5,030	HSBC Bank PLC into Assa Abloy AB due 10/06/15	101,513
	ドイツ (0.3%)		6,840	HSBC Bank PLC into Electrolux AB due 10/05/15	199,642
410	Credit Suisse AG into Metro AG due 08/05/15	13,308	16,320	HSBC Bank PLC into VOLVO AB/ Class B due 10/05/15	196,766
3,120	Deutsche Bank AG into Deutsche Post AG ^(a) due 08/05/15	99,873	4,980	Merrill Lynch International & Co. into Assa Abloy AB due 10/05/15	101,277
3,120	due 08/06/15	99,983	5,680	Merrill Lynch International & Co. into Nordea Bank AB due 10/27/15	200,833
	ドイツ計 (費用415,919ドル)	413,997	15,700	due 10/05/15	198,635
	英国 (0.8%)		1,830	UBS AG into Autoliv, Inc. due 10/05/15	193,828
3,230	Credit Suisse AG into SABMiller PLC ^(a) due 09/04/15	172,997		スウェーデン計 (費用1,001,501ドル)	991,661
	Deutsche Bank AG into SABMiller PLC ^(a)		27,100	アメリカ (11.7%)	
3,260	due 09/08/15	173,718	850	Barclays Bank PLC into Ford Motor Co. due 10/27/15	405,057
40,310	Deutsche Bank AG into Vodafone Group PLC due 09/28/15	150,578	850	Candadian Imperial Bank of Commerce into Whirlpool Corp. due 10/06/15	151,679
40,310	due 09/29/15	150,944		due 10/07/15	151,626
	Societe Generale S. A. into GlaxoSmithKline PLC		7,410	Credit Suisse AG into Altria Group, Inc. due 09/22/15	401,840
9,320	due 08/21/15	414,605	2,840	Credit Suisse AG into Honeywell International, Inc. due 09/17/15	298,933
	英国計 (費用1,052,418ドル)	1,062,842	830	Credit Suisse AG into Morgan Stanley Co. due 09/10/15	292,491
	オランダ (0.6%)		830	due 08/04/15	
	Credit Suisse AG into Heineken NV ^(a)		7,460	Deutsche Bank AG into Adobe Systems, Inc. due 09/18/15	409,771
8,230	due 07/31/15	66,069	5,020	due 09/18/15	
8,230	due 08/04/15	66,198	7,550	Deutsche Bank AG into General Growth Properties, Inc. due 08/05/15	207,545
8,230	HSBC Bank PLC into AEGON NV due 08/13/15	66,688	7,550	due 08/06/15	206,692
	due 08/14/15	66,256	5,330	Deutsche Bank AG into Kroger Co. due 09/14/15	412,707
	due 08/17/15	66,230		Deutsche Bank AG into LyondellBasell Industries NV	
2,600	Merrill Lynch International & Co. into Akzo Nobel N. V. due 10/05/15	188,064			
3,790	due 10/28/15	300,388			

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

株式	有価証券の明細	公正価値	株式	有価証券の明細	公正価値
4,350	due 10/22/15 Deutsche Bank AG into Monsanto Co.	401,318		Merrill Lynch International & Co. into The Goldman Sachs Group, Inc.	
3,760	due 09/21/15 Deutsche Bank AG into PepsiCo, Inc.	388,971	1,910	due 10/13/15 Merrill Lynch International & Co. into USG Corp.	395,224
4,180	due 09/15/15 Deutsche Bank AG into Walgreens Boots Alliance, Inc.	404,642	5,200	due 10/16/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Abbott Laboratories ^(a)	157,169
4,460	due 10/06/15 Goldman Sachs Group, Inc. into HD Supply Holdings, Inc. ^(a)	419,019	5,900	due 10/19/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Cigna Corp. ^(a)	299,761
5,880	due 08/19/15 Goldman Sachs Group, Inc. into HD Supply Holdings, Inc. ^(a)	206,992	840	due 10/19/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into GoPro, Inc. ^(a)	121,755
5,880	due 08/21/15 Merrill Lynch International & Co. into American Airlines Group, Inc.	206,772	4,930	due 09/11/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Harley Davidson, Inc. ^(a)	306,964
6,986	due 10/19/15 Merrill Lynch International & Co. into Cisco Systems, Inc.	282,107	5,090	due 10/06/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Hilton Worldwide Holdings, Inc.	298,245
3,400	due 08/11/15 Merrill Lynch International & Co. into Citigroup, Inc.	97,187	7,310	due 10/26/15	201,557
6,840	due 10/09/15 Merrill Lynch International & Co. into General Motors Co.	400,301	7,310	due 10/27/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into J. B. Hunt Transport Services, Inc. ^(a)	201,557
9,009	due 10/19/15 Merrill Lynch International & Co. into J. B. Hunt Transport Services, Inc.	282,015	1,190	due 09/18/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Mohawk Industries, Inc. ^(a)	100,209
1,800	due 09/17/15 Merrill Lynch International & Co. into Kansas City Southern Co.	151,570	820	due 10/16/15	163,128
781	due 09/17/15 Merrill Lynch International & Co. into Owens Corning, Inc.	76,962	820	due 10/20/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Philip Morris International, Inc. ^{(a) . (e)}	163,139
6,820	due 09/11/15 Merrill Lynch International & Co. into Quest Diagnostics, Inc.	305,439	4,690	due 10/13/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Prudential Financial, Inc. ^(a)	401,981
910	due 10/16/15	66,455	1,220	due 10/16/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into Raytheon Co. ^(a)	107,629
910	due 10/20/15	66,464	1,930	due 10/16/15	214,118
910	due 10/21/15 Merrill Lynch International & Co. into Raytheon Co.	66,426	558	due 10/20/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into The Blackstone Group LP ^{(a) . (e)}	59,607
1,372	due 10/20/15 Merrill Lynch International & Co. into Southwest Airlines Co.	142,742	4,780	due 10/12/15	192,245
7,987	due 10/15/15 Merrill Lynch International & Co. into The Boeing Co.	284,351	4,780	due 10/13/15 Nomura International Funding Pte, Ltd. into The Charles Schwab Corp. ^{(a) . (e)}	192,263
1,030	due 09/11/15	148,879	11,720	due 10/13/15	408,659
1,030	due 09/15/15	148,919			

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

株式	有価証券の明細	公正価値	株式	有価証券の明細	公正価値
2,090	Nomura International Funding Pte, Ltd. into Time Warner Cable, Inc. due 10/02/15	399,650	4,570	Wells Fargo Bank NA into Medtronic, PLC, ^(a) due 08/12/15	360,878
600	Royal Bank of Canada into Autozone, Inc. ^(a) due 09/03/15	417,009	5,490	Wells Fargo Bank NA into Wal-Mart Stores, Inc. ^(a) due 08/17/15	395,302
4,150	Royal Bank of Canada into Comerica, Inc. ^(a) due 10/14/15	197,996		アメリカ計（費用16,604,456ドル）	16,736,646
5,630	Royal Bank of Canada into Darden Restaurants, Inc. ^(a) due 09/03/15	415,605	66,356	株式リンク証券計（費用20,916,537ドル）	21,063,704
2,480	Royal Bank of Canada into Hasbro, Inc. ^(a) due 09/10/15	197,384	81,646	普通株（23.5%）	
759	Royal Bank of Canada into Kansas City Southern Co. ^(a) due 09/17/15	74,846	107,804	オーストラリア（0.4%）	
1,030	Royal Bank of Canada into Lockhead Martin Corp. ^(a) due 09/18/15	101,561	66,356	REIT（0.4%）	
490	Societe Generale S. A. into Carnival Corp. due 09/10/15	100,906	81,646	Charter Hall Retail REIT	210,020
490	Societe Generale S. A. into Carnival Corp. due 09/11/15	100,895	107,804	Federation Centres	179,870
3,550	Societe Generale S. A. into Domino's Pizza, Inc. due 09/04/15	184,496		National Storage REIT Class Miscella	132,603
3,550	Societe Generale S. A. into Domino's Pizza, Inc. due 09/08/15	184,380		オーストラリア計（費用549,138ドル）	522,493
1,800	Societe Generale S. A. into MGM Resorts International, Inc. due 09/17/15	203,531		ベルギー（0.3%）	
9,070	UBS AG into Home Depot, Inc. due 08/05/15	181,073	3,677	飲料（0.3%）	
9,070	UBS AG into Home Depot, Inc. due 08/06/15	179,769		Anheuser-Busch InBev NV	440,176
890	UBS AG into Lowe's Cos, Inc. ^(a) due 08/13/15	103,673		ベルギー計（費用448,622ドル）	440,176
5,850	Wells Fargo Bank NA into Activision Blizzard, Inc. ^(a) due 08/14/15	407,734	40,300	ブラジル（0.1%）	
3,960	Wells Fargo Bank NA into American International Group, Inc. due 08/05/15	102,888		商業サービス（0.1%）	
6,490	Wells Fargo Bank NA into Celanese Corp. ^(a) due 08/04/15	418,252	40,300	CCR S. A.	179,807
3,040	Wells Fargo Bank NA into Hilton Worldwide Holdings, Inc. due 09/10/15	200,896		ブラジル計（費用189,202ドル）	179,807
12,520	Wells Fargo Bank NA into Hilton Worldwide Holdings, Inc. due 08/03/15	336,840		カナダ（0.8%）	
			5,446	銀行（0.1%）	
			8,660	National Bank of Canada	191,476
			13,978	不動産（0.1%）	
			11,264	First Capital Realty, Inc.	123,215
				通信（0.6%）	
			7,045	Rogers Communications, Inc.	492,741
			1,044	TELUS Corp.	386,592
				カナダ計（費用1,246,334ドル）	1,194,024
				デンマーク（0.4%）	
			7,045	Novo Nordisk A/S Class B	415,593
				医薬品（0.3%）	
			3,237	小売（0.1%）	
				Pandora A/S	118,103
				デンマーク計（費用437,838ドル）	533,696
				フィンランド（0.5%）	
			7,422	保険（0.1%）	
				Sampo OYJ Class A	160,938
			39,173	機械・多角的（0.3%）	
				Kone OYJ Class B	312,919
				不動産（0.1%）	
				Sponda OYJ	156,675
				フィンランド計（費用658,180ドル）	630,532
				フランス（1.1%）	
				エンジニアリング・建設（0.2%）	

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

株式	有価証券の明細	公正価値	株式	有価証券の明細	公正価値
3,437	SPIE S. A.	68,505	6,281	SES S. A.	195,453
3,167	Vinci S. A.	204,345		ルクセンブルグ計（費用219,319ドル）	195,453
	保険（0.1%）			マカオ（0.1%）	
7,572	AXA S. A.	200,782		宿泊業（0.1%）	
	メディア（0.1%）		36,800	Sands China, Ltd.	162,821
2,549	Lagardere SCA	76,644		マカオ計（費用181,079ドル）	162,821
	医薬品（0.4%）			オランダ（0.9%）	
4,854	Sanofi	525,407		石油・ガス（0.4%）	
	REIT（0.2%）		20,010	Royal Dutch Shell PLC	580,952
3,539	Klepierre	162,053		REIT（0.3%）	
658	Unibail-Rodamco SE	176,150	4,637	Eurocommercial Properties NV	201,316
	通信（0.1%）		2,826	Vastned Retail NV	129,342
6,784	Eutelsat Communications S. A.	207,995	2,310	Wereldhave NV	137,436
	フランス計（費用1,604,398ドル）	1,621,881		半導体（0.1%）	
	ドイツ（0.8%）		775	ASML Holding NV	77,611
	不動産（0.2%）			通信（0.1%）	
4,669	LEG Immobilien AG	341,547	52,099	Koninklijke KPN NV	207,222
	小売（0.1%）			オランダ計（費用1,411,934ドル）	1,333,879
1,230	HUGO BOSS AG	149,214		ノルウェー（0.1%）	
	通信（0.2%）		7,969	DNB ASA	130,581
12,641	Deutsche Telekom AG	229,748		ノルウェー計（費用136,619ドル）	130,581
	輸送（0.3%）			ポルトガル（0.1%）	
14,305	Deutsche Post AG	434,950		電力（0.1%）	
	ドイツ計（費用1,223,772ドル）	1,155,459	45,287	EDP - Energias de Portugal S. A.	168,519
	香港（0.1%）			ポルトガル計（費用170,944ドル）	168,519
	REIT（0.1%）			シンガポール（0.4%）	
22,500	Link REIT	132,348		不動産（0.1%）	
	香港計（費用135,856ドル）	132,348	161,500	Croesus Retail Trust	108,587
	イタリア（0.3%）			REIT（0.2%）	
	銀行（0.1%）		72,500	CapitaLand Retail China Trust	84,247
10,686	Intesa Sanpaolo SpA	41,346	44,900	Parkway Life Real Estate Investment Trust	79,739
29,859	Intesa Sanpaolo SpA - Savings Shares	100,355	88,900	SPH REIT	66,271
	商業サービス（0.1%）			通信（0.1%）	
4,277	Atlantia SpA	114,923	52,400	Singapore Telecommunications, Ltd.	156,629
	電力（0.1%）			シンガポール計（費用519,088ドル）	495,473
39,116	Enel SpA	185,229		スウェーデン（0.8%）	
	イタリア計（費用412,601ドル）	441,853		銀行（0.2%）	
	日本（0.5%）		9,087	Nordea Bank AB	113,913
	農業（0.3%）		11,423	Svenska Handelsbanken AB	175,833
12,000	Japan Tobacco, Inc.	466,217		化粧品・パーソナルケア（0.1%）	
	REIT（0.2%）		4,780	Svenska Cellulosa AB SCA Class B	136,900
237	Japan Rental Housing Investments, Inc. Class A	157,050		機械 - 建設・鉱業（0.1%）	
57	Japan Senior Living Investment Corp.	82,812	7,120	Atlas Copco AB	195,780
	日本計（費用624,534ドル）	706,079		機械 - 多角的（0.1%）	
	ルクセンブルグ（0.1%）		3,094	Hexagon AB	100,627
	通信（0.1%）			金属組立・ハードウェア（0.1%）	

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

株式	有価証券の明細	公正価値	株式	有価証券の明細	公正価値
3,930	Assa Abloy AB Class B 不動産 (0.1%)	80,246	29,036	Aviva PLC	235,616
10,875	Atrium Ljungberg AB 小売 (0.1%)	151,038	23,789	Legal & General Group PLC	96,779
4,330	Hennes & Mauritz AB スウェーデン計 (費用1,187,666ドル) スイス (2.2%) 化学製品 (0.5%)	173,293 <u>1,127,630</u>	6,160	Prudential PLC インターネット (0.1%)	144,911
240	Givaudan S. A.	449,485	1,544	Rightmove PLC 医薬品 (0.9%)	87,799
597	Syngenta AG 商業サービス (0.2%)	247,223	14,127	AstraZeneca PLC	952,352
113	SGS S. A. 食品 (0.4%)	216,923	14,999	GlaxoSmithKline PLC REIT (0.2%)	326,747
8,422	Nestle S. A. 保険 (0.2%)	641,443	186,694	Assura PLC	158,778
158	Helvetia Holding AG	87,294	42,937	Empiric Student Property PLC	72,364
886	Zurich Insurance Group AG 医薬品 (0.9%)	271,303	53,525	Tritax Big Box REIT PLC 通信 (0.4%)	98,560
8,759	Novartis AG	914,997	31,885	BT Group PLC	231,094
1,060	Roche Holding AG スイス計 (費用3,086,469ドル) 台湾 (0.2%) 通信 (0.2%)	307,820 <u>3,136,488</u>	5,145	Inmarsat PLC	71,296
115,000	Far Eastone Telecommunications Co., Ltd. 台湾計 (費用273,249ドル) 英国 (5.0%) 農業 (1.2%)	269,183 <u>269,183</u>	75,348	Vodafone Group PLC 水道 (0.1%)	284,369
10,640	British American Tobacco PLC	631,107	3,950	Severn Trent PLC 英国計 (費用7,006,147ドル) アメリカ (8.3%) 航空宇宙・防衛 (0.3%)	135,854 <u>7,123,158</u>
20,306	Imperial Tobacco Group PLC 銀行 (0.4%)	1,066,285	537	Northrop Grumman Corp.	92,906
21,200	HSBC Holdings PLC	190,607	2,745	United Technologies Corp. 農業 (1.2%)	275,351
322,886	Lloyds Banking Group PLC 飲料 (0.5%)	419,214	12,923	Altria Group, Inc.	702,753
24,553	Diageo PLC 商業サービス (0.2%)	685,646	6,978	Philip Morris International, Inc.	596,828
16,587	RELX NV	278,008	5,601	Reynolds American, Inc. 銀行 (0.9%)	480,510
9,534	UBM PLC 多角的金融サービス (0.2%)	79,075	10,632	Citizens Financial Group, Inc.	277,176
8,657	IG Group Holdings PLC	101,117	2,439	M&T Bank Corp.	319,875
13,748	Jupiter Fund Management PLC	100,747	7,088	US Bancorp	320,448
2,663	London Stock Exchange Group PLC 食品 (0.3%)	108,503	5,831	Wells Fargo & Co. 飲料 (0.8%)	337,440
7,927	Unilever PLC 林産物・紙 (0.1%)	359,598	17,947	Coca-Cola Co.	737,263
13,840	DS Smith PLC 住宅建設業者 (0.1%)	86,497	3,614	PepsiCo, Inc. 商業サービス (0.3%)	348,209
2,287	Berkeley Group Holdings PLC 保険 (0.3%)	120,235	11,624	H&R Block, Inc. 流通・卸売 (0.3%)	386,963
			5,609	Genuine Parts Co. 林産物・紙 (0.1%)	498,921
			4,149	International Paper Co. 多角的製造 (0.3%)	198,613
			14,879	General Electric Co. 石油・ガス (0.2%)	388,342
			3,522	Chevron Corp. 医薬品 (1.0%)	311,627
			4,746	AbbVie, Inc.	332,267
			6,653	Johnson & Johnson	666,697
			10,231	Pfizer, Inc.	368,930

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

株式	有価証券の明細	公正価値	株式	有価証券の明細	公正価値
	不動産 (0.0%)			アメリカ計 (費用2,226,436ドル)	2,225,782
3,652	Community Healthcare Trust, Inc. REIT (1.1%)	68,913		優先株計 (費用2,226,436ドル) ETF (12.1%)	<u>2,225,782</u>
5,047	EPR Properties	288,285		アメリカ (12.1%)	
2,610	Gramercy Property Trust, Inc.	63,841	38,109	iShares 1-3 Year Credit Bond ETF ^(e)	4,008,686
4,910	Liberty Property Trust	167,087	72,871	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF ^(e)	6,410,462
2,600	National Health Investors, Inc.	169,650	52,239	iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF ^(e)	6,078,007
4,678	Prologis, Inc.	189,974	18,805	SPDR Barclays High Yield Bond ETF	714,026
9,765	Ramco-Gershenson Properties Trust	165,419		アメリカ計	17,211,181
7,658	Retail Properties of America, Inc. Class A	111,500		ETF 計 (費用17,623,413ドル)	<u>17,211,181</u>
8,302	STAG Industrial, Inc.	163,051		投資信託 (3.5%)	
7,348	UDR, Inc.	248,436		ガンジー (0.1%)	
	小売 (0.5%)		81,262	Picton Property Income, Ltd.	93,839
7,032	McDonald's Corp.	702,215		ガンジー計	93,839
	半導体 (0.1%)			ルクセンブルグ (3.4%)	
4,081	Linear Technology Corp.	167,321	252,947	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Equity Income Fund Class X6 ^(e)	2,311,939
11,610	Microsoft Corp.	542,187	243,812	BlackRock Global Funds - Asian Tiger Bond Fund Class X3 ^(e)	2,533,202
	通信 (0.3%)			ルクセンブルグ計	4,845,141
8,096	Verizon Communications, Inc.	378,812		投資信託計 (費用5,160,534ドル)	<u>4,938,980</u>
20,877	Mattel, Inc.	484,555			
	輸送 (0.2%)				
3,245	United Parcel Service, Inc. Class B	332,158		契約 有価証券の明細	公正価値
	アメリカ計 (費用11,917,945ドル)	11,884,523		購入済みオプション (0.0%)	
	普通株計 (費用33,640,934ドル)	<u>33,586,056</u>		アメリカ (0.0%)	
	転換優先株式 (0.0%)		28	Roll up under S&P 500 Index @ 2,190 due Sep 2015	ドル 6,440
	アメリカ (0.0%)		43	S&P 500 Index @ 2,200 due Sep 2015	7,310
	通信 (0.0%)			アメリカ計	13,750
500	T-Mobile US, Inc. 5.50%	35,600		購入済みオプション計 (支払済み料金140,360ドル)	<u>13,750</u>
	アメリカ計 (費用33,225ドル)	35,600			
	転換優先株式計 (費用33,225ドル)	<u>35,600</u>			
	優先株 (1.6%)				
	アメリカ (1.6%)				
	銀行 (0.7%)				
10,000	BB&T Corp. ^(c)	240,900			
15,000	Goldman Sachs Group, Inc. ^{(b) . (c)}	372,600			
10,000	Morgan Stanley ^(c)	262,000			
6,600	Wells Fargo & Co. ^{(b) . (c)}	169,950			
	電力 (0.5%)				
7,000	DTE Energy Co.	169,050			
8,600	Entergy Texas, Inc.	220,332			
10,000	SCE Trust III ^{(b) . (c)}	278,900			
	保険 (0.1%)				
5,000	Allstate Corp. ^(b)	130,000			
	REIT (0.3%)				
15,000	Public Storage ^(c)	382,050			

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

元本価格		有価証券の明細		公正価値	元本価格		有価証券の明細		公正価値
			短期投資 (3.9%)				ブランドケイマン計		
			香港 (0.3%)				(費用60,591ドル)		60,591
			定期預金 (0.3%)				英国 (0.1%)		
			Standard Chartered				定期預金 (0.1%)		
			Bank Hong Kong Ltd.				ANZ National Bank		
U S D	422,136	0.03% due 08/03/15		ドル	422,136	U S D	149,419	0.03% due 08/03/15	149,419
			定期預金計		422,136			定期預金計	149,419
			香港計 (費用422,136					英国計 (費用149,419	
			ドル)		422,136			ドル)	149,419
			ブランドケイマン					ノルウェー (3.5%)	
			(0.0%)					定期預金 (3.5%)	
			定期預金 (0.0%)					DnB NORBank ASA	
			Brown Brothers			U S D	4,513,541	0.03% due 08/03/15	4,513,541
			Harriman & Co.			E U R	390,532	(0.23) % due 08/03/15	431,479
S E K	554	(0.42) % due 08/03/15		65				定期預金計	4,945,020
E U R	694	(0.23) % due 08/03/15		767				ノルウェー計 (費用	
H K D	22,022	0.01% due 08/03/15		2,829				4,945,020ドル)	4,945,020
C A D	1,565	0.05% due 08/03/15		1,203				短期投資計 (費用	
G B P	7,556	0.09% due 08/03/15		11,793				5,577,166ドル)	5,577,166
S G D	859	0.10% due 08/03/15		627				投資計 (費用	
A U D	7	1.03% due 08/03/15		5				150,928,718ドル)	104.7
			Wells Fargo					現金およびその他資	
A U D	58,942	1.03% due 08/03/15		43,302				産を超過する負債	(4.7)
			定期預金計		60,591			純資産	100%
									ドル 142,617,304

投資明細表に記載の有価証券はすべて、その証券の所在地よりもカンントリーリスクがどこにあるかについて経営陣が最善の評価を行い分類しています。

- (a) 144A 証券 - 1933年証券法の規則144Aのもと登録が免除されている証券。同証券は、登録が免除されている取引によって転売できます。取引の買手は通常は適格機関投資家。別段の記載がない限り、同証券は非流動資産とみなされません。
- (b) 2015年7月31日現在の変動利付証券
- (c) 永久債
- (d) PIK (Payment-in kind (現物支払)) 証券。発行体の裁量で、収益が現金で支払われることもあれば証券を追加発行して支払われることもあります。
- (e) コーラブル債
- (f) このポジションの全部または一部は、期末時点でまだ実行していない貸し出し予約です。この購入に関する一部詳細は、表面利率を含め決済日当日まで分かりません。
- (g) 運用会社の利害関係人

2015年7月31日現在の先物建玉

ポジション	銘柄	決済日	契約枚数	純評価 (損) 益
買い	オーストラリア10年物国債先物	2015年9月	20	ドル 40,019
売り	ユーロ通貨先物	2015年9月	(33)	136,872
売り	ユーロ STOXX50種先物	2015年9月	(113)	(173,750)
買い	MSCI EM (エマージング・マーケット) 先物	2015年9月	42	(116,970)
売り	S&P 500種 E ミニ先物	2015年9月	(40)	(59,136)
売り	米国10年物国債先物	2015年9月	(18)	(2,952)
				ドル (175,917)

2015年7月31日現在の中央清算されるクレジット・デフォルト・スワップ残高

通貨	想定元本	信用プロテクション	参照指数	受取 (支払)	終了日	評価 (損) 益
U S D	1,385,504	買い	CDX NA. HY Series 24 Version	(5.000%)	2020年6月20日	ドル (93,212)

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）

2015年7月31日現在のファンドレベルの為替先渡契約残高

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(損)益
E U R	BNP Paribas S. A.	157,000	2015年10月20日	U S D	171,873	ドル 1,784	ドル	— 1,784
M X N	Goldman Sachs Group, Inc.	63,000	2015年10月20日	U S D	3,802	106	—	106
M X N	Goldman Sachs Group, Inc.	34,865	2015年10月20日	U S D	2,192	—	(29)	(29)
M X N	HSBC Bank PLC	748,000	2015年10月20日	U S D	45,665	736	—	736
U S D	Goldman Sachs Group, Inc.	101,770	2015年10月20日	M X N	1,619,100	1,331	—	1,331
U S D	HSBC Bank PLC	1,168,425	2015年10月20日	G B P	751,000	—	(2,886)	(2,886)
U S D	UBS AG	6,318,568	2015年10月20日	E U R	5,725,000	—	(13,794)	(13,794)
						ドル 3,957	ドル (16,709)	ドル (12,752)

2015年7月31日現在のブラジル・レアル・クラスの為替先渡契約残高

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(損)益
B R L	Citibank N. A.	8,603,371	2015年8月13日	G B P	1,734,339	ドル	ドル (193,052)	ドル (193,052)
B R L	Citibank N. A.	146,010,603	2015年8月13日	U S D	45,662,574	—	(3,009,158)	(3,009,158)
B R L	Citibank N. A.	2,937,611	2015年8月13日	A U D	1,237,348	—	(49,993)	(49,993)
B R L	Citibank N. A.	3,812,208	2015年8月13日	C H F	1,129,240	—	(61,584)	(61,584)
						ドル	ドル (3,313,787)	ドル (3,313,787)

2015年7月31日現在の通貨セレクト・クラスの為替先渡契約残高

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(損)益
B R L	Citibank N. A.	667,686	2015年8月13日	G B P	134,588	ドル	ドル (14,967)	ドル (14,967)
B R L	Citibank N. A.	11,331,964	2015年8月13日	U S D	3,543,498	—	(233,142)	(233,142)
B R L	Citibank N. A.	227,964	2015年8月13日	A U D	96,020	—	(3,880)	(3,880)
B R L	Citibank N. A.	295,835	2015年8月13日	C H F	87,631	—	(4,779)	(4,779)
I D R	Citibank N. A.	2,613,767,776	2015年8月13日	G B P	126,151	—	(3,931)	(3,931)
I D R	Citibank N. A.	44,502,100,500	2015年8月13日	U S D	3,317,107	—	(32,456)	(32,456)
I D R	Citibank N. A.	893,925,441	2015年8月13日	A U D	89,908	—	(9)	(9)
I D R	Citibank N. A.	1,160,585,977	2015年8月13日	C H F	82,061	257	—	257
I N R	Citibank N. A.	13,031,772	2015年8月13日	G B P	132,277	—	(3,515)	(3,515)
I N R	Citibank N. A.	221,810,901	2015年8月13日	U S D	3,475,481	—	(22,061)	(22,061)
I N R	Citibank N. A.	4,456,402	2015年8月13日	A U D	94,215	232	—	232
I N R	Citibank N. A.	5,784,719	2015年8月13日	C H F	85,998	561	—	561
R U B	Citibank N. A.	10,228,866	2015年8月13日	G B P	113,880	—	(10,575)	(10,575)
R U B	Citibank N. A.	173,948,046	2015年8月13日	U S D	2,993,481	—	(151,353)	(151,353)
R U B	Citibank N. A.	3,498,708	2015年8月13日	A U D	81,142	—	(2,389)	(2,389)
R U B	Citibank N. A.	4,536,179	2015年8月13日	C H F	74,062	—	(2,963)	(2,963)
T R Y	Citibank N. A.	527,900	2015年8月13日	G B P	125,966	—	(5,995)	(5,995)
T R Y	Citibank N. A.	8,956,954	2015年8月13日	U S D	3,310,600	—	(77,235)	(77,235)
T R Y	Citibank N. A.	180,172	2015年8月13日	A U D	89,741	—	(825)	(825)
T R Y	Citibank N. A.	233,737	2015年8月13日	C H F	81,912	—	(872)	(872)
Z A R	Citibank N. A.	2,269,644	2015年8月13日	G B P	117,193	—	(3,272)	(3,272)
Z A R	Citibank N. A.	38,685,177	2015年8月13日	U S D	3,082,076	—	(20,884)	(20,884)
Z A R	Citibank N. A.	777,234	2015年8月13日	A U D	83,535	192	—	192
Z A R	Citibank N. A.	1,008,224	2015年8月13日	C H F	76,244	431	—	431
						ドル 1,673	ドル (595,103)	ドル (593,430)

2015年7月31日現在の円ヘッジ・クラスの為替先渡契約残高

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(損)益
J P Y	Citibank N. A.	81,356,747	2015年8月13日	G B P	430,058	ドル	ドル (14,356)	ドル (14,356)
J P Y	Citibank N. A.	1,386,028,090	2015年8月13日	U S D	11,307,755	—	(119,826)	(119,826)
J P Y	Citibank N. A.	27,826,469	2015年8月13日	A U D	306,492	—	(343)	(343)
J P Y	Citibank N. A.	36,128,210	2015年8月13日	C H F	279,746	472	—	472
						ドル 472	ドル (134,525)	ドル (134,053)

通貨の略称：

AUD	-	豪ドル
BRL	-	ブラジル・レアル
CHF	-	スイス・フラン
EUR	-	ユーロ
GBP	-	英ポンド
IDR	-	インド・ルピー
JPY	-	日本円
MXN	-	メキシコ・ペソ
TRY	-	トルコ・リラ
RUB	-	ロシア・ルーブル
USD	-	米ドル
ZAR	-	南アフリカ・ランド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・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、当ファンドの第10期の決算日（2016年2月18日）現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンドの組入資産の内容等を73ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2015年8月19日から2016年2月18日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
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		
563 国庫短期証券 2016/1/18	1,150,000		
100 5年国債 0.3% 2016/9/20	1,103,212		
586 国庫短期証券 2016/5/12	1,000,337		
554 国庫短期証券 2015/11/30	1,000,000		
566 国庫短期証券 2016/2/1	999,999		
567 国庫短期証券 2016/2/8	999,999		
574 国庫短期証券 2016/3/14	700,069		
576 国庫短期証券 2016/3/22	700,067		

(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2月18日現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンド（11,320,284千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年2月18日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入 比	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 6,500,000	千円 6,503,520	%	%	%	%	%
			57.3	—	—	—	57.3

(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2月18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	570 国庫短期証券	—	千円 500,000	千円 500,000	2016/02/22	
	572 国庫短期証券	—	500,000	500,007	2016/02/29	
	573 国庫短期証券	—	500,000	500,019	2016/03/07	
	574 国庫短期証券	—	700,000	700,019	2016/03/14	
	576 国庫短期証券	—	700,000	700,022	2016/03/22	
	582 国庫短期証券	—	500,000	500,022	2016/04/18	
	584 国庫短期証券	—	500,000	500,044	2016/04/25	
	585 国庫短期証券	—	500,000	500,036	2016/05/02	
	586 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,301	2016/05/12	
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,103,047	2016/09/20	
	合 計	銘 柄 数 金 額	10銘柄	6,500,000	6,503,520	

(注) 単位未満は切捨て。

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

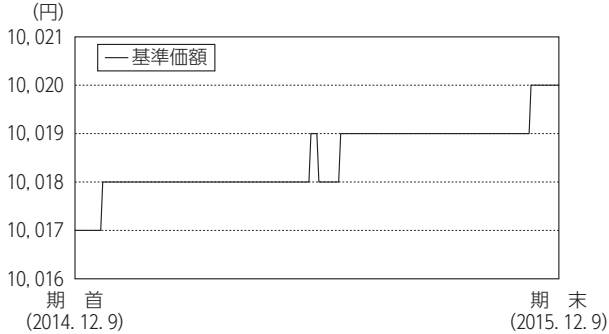
大和投資信託

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。

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。

■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	国債証券	千円 32,338,160	千円 (32,240,000)
国内	国債証券		

(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	年利率	当		期		末	
			額面金額	評価額	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円	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。

ダイワ・マネーアセット・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	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）－スーパー・ハイインカム－α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・リアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハイインカム－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－シフト11 Ver 3－2,395,687,762円、ダイワ日本株式ベア・ファンド－ベアシフト11－71,870,634円、ダイワ日本株式ベア・ファンド－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－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－インカムチェンジ（積立型）－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）－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）－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）－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。