

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	ドル高円安 ポートフォリオ	追加型投信／海外／その他資産／特殊型 (ブル・ベア型)
	円高ドル安 ポートフォリオ	
	マネー・ ポートフォリオ	追加型投信／国内／債券
信託期間	3年間 (2015年2月9日～2018年2月8日)	
運用方針	ドル高円安 ポートフォリオ	日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度となることをめざして運用を行ないます。
	円高ドル安 ポートフォリオ	日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行ないます。
	マネー・ ポートフォリオ	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	ドル高円安 ポートフォリオ	通貨オプション取引 (選択権付為替予約取引)、わが国の債券およびダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	円高ドル安 ポートフォリオ	
	マネー・ ポートフォリオ	イ、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券 ロ、円建ての債券
運用方法	ドル高円安 ポートフォリオ	①主として、通貨オプションを利用するとともに、残存期間の短いわが国の債券およびマザーファンドの受益証券に投資し、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度となる投資成果をめざします。 ②通貨のプットオプションとコールオプションを組み合わせ、実質的な米ドル買い円売りの建玉を、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度にすることをめざします。
	円高ドル安 ポートフォリオ	①主として、通貨オプションを利用するとともに、残存期間の短いわが国の債券およびマザーファンドの受益証券に投資し、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度逆となる投資成果をめざします。 ②通貨のプットオプションとコールオプションを組み合わせ、実質的な米ドル売り円買いの建玉を、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度にすることをめざします。
	マネー・ ポートフォリオ	①マザーファンドの受益証券および円建ての債券を中心に投資することにより、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。
	ドル高円安 ポートフォリオ 円高ドル安 ポートフォリオ マネー・ ポートフォリオ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の10%以下
配分方針	配分対象額は、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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないました。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド (当ファンド) とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ・ブルベア・セレクト
ドル高円安ポートフォリオ
円高ドル安ポートフォリオ
マネー・ポートフォリオ

運用報告書 (全体版)
満期償還

(償還日 2018年2月8日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「ダイワ・ブルベア・セレクト」は、このたび、満期償還となりました。
ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先 (コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00～17:00)

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

<4608>

<4609>

<4607>

ドル高円安ポートフォリオ

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			米ドル為替レート		公 社 債 組入比率	純資産 総 額
		税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率		
	円	円	%	円	%	%	百万円
1 期末 (2016年 2 月 8 日)	9,674	0	△ 3.3	117.02	△ 1.6	60.3	230
2 期末 (2017年 2 月 8 日)	8,836	0	△ 8.7	112.45	△ 3.9	22.9	246
償 還 (2018年 2 月 8 日)	8,957.36	—	1.4	109.38	△ 2.7	—	68

(注 1) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。

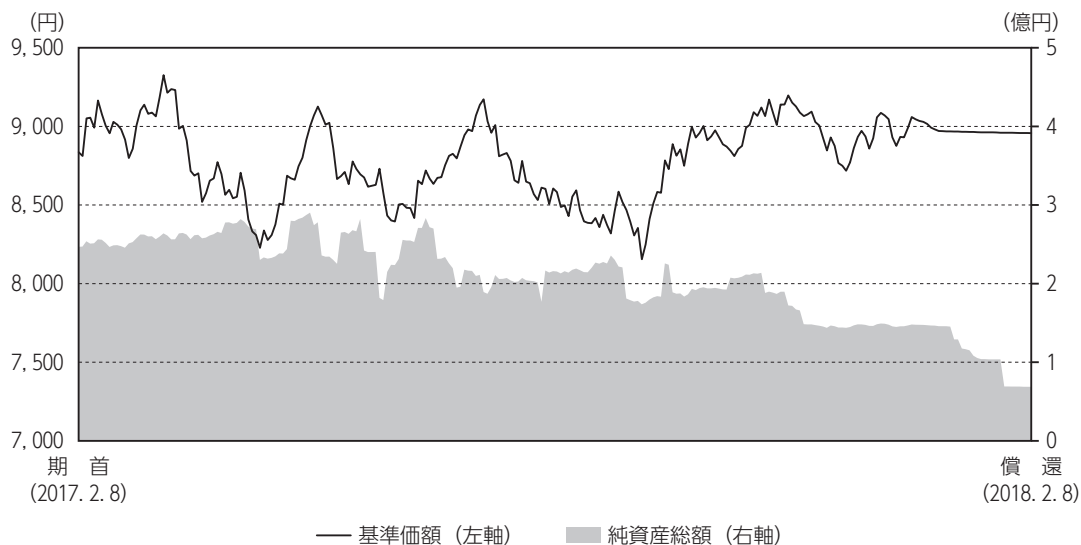
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：8,957円36銭

騰落率：△10.4%

■基準価額の主な変動要因

主として、通貨オプション（選択権付為替予約）を利用するとともに、ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券に投資し、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度となる投資成果をめざした結果、米ドルの対円での動きを反映して、基準価額は下落しました。

ダイワ・ブルベア・セレクト ドル高円安ポートフォリオ

年 月 日	基 準 価 額		米 ド ル 為 替 レ ー ト		公 社 債 組 入 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	
	円	%	円	%	%
(期首)2017年 2 月 8 日	8, 836	—	112. 45	—	22. 9
2 月末	8, 858	0. 2	112. 56	0. 1	17. 5
3 月末	8, 773	△ 0. 7	112. 19	△ 0. 2	—
4 月末	8, 661	△ 2. 0	111. 29	△ 1. 0	24. 4
5 月末	8, 622	△ 2. 4	110. 96	△ 1. 3	4. 5
6 月末	8, 797	△ 0. 4	112. 00	△ 0. 4	0. 4
7 月末	8, 569	△ 3. 0	110. 35	△ 1. 9	0. 1
8 月末	8, 585	△ 2. 8	110. 42	△ 1. 8	—
9 月末	8, 929	1. 1	112. 73	0. 2	—
10月末	9, 009	2. 0	113. 16	0. 6	—
11月末	8, 862	0. 3	112. 05	△ 0. 4	—
12月末	8, 981	1. 6	113. 00	0. 5	—
2018年 1 月末	8, 960	1. 4	108. 79	△ 3. 3	—
(償還)2018年 2 月 8 日	8, 957. 36	1. 4	109. 38	△ 2. 7	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2015. 2. 9 ~ 2018. 2. 8)

為替相場

設定当初から2015年末までの為替レートは、おおむね安定した推移となりました。2016年に入ると、原油価格の下落や日銀の追加緩和見送り、米国の早期利上げ観測の後退、英国の国民投票でのEU（欧州連合）離脱派の勝利を受けた市場のリスク回避姿勢の強まりなどを背景に、円高米ドル安が進行しました。10月以降は、原油価格の上昇や米国の大統領選挙で勝利したトランプ氏の政策への期待感などから市場のリスク選好度が強まり、円安傾向に転じる場面も見られました。しかし2017年に入ると、同氏への期待が剥落するとともに、やや円高米ドル安が進行しました。

信託期間中の運用方針**当ファンド**

主として、通貨オプションを利用するとともに、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券に投資します。また、通貨オプションの利用にあたっては、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度となる投資成果をめざして、米ドルコール円プットオプションの買いおよび米ドルプット円コールオプションの売りを組み合わせます。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

信託期間中のポートフォリオについて

(2015. 2. 9 ~ 2018. 2. 8)

当ファンド

主として、通貨オプションを利用するとともに、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券に投資しました。また、通貨オプションの利用にあたっては、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度となる投資成果をめざして、米ドルコール円プットオプションの買いおよび米ドルプット円コールオプションの売りを組み合わせました。

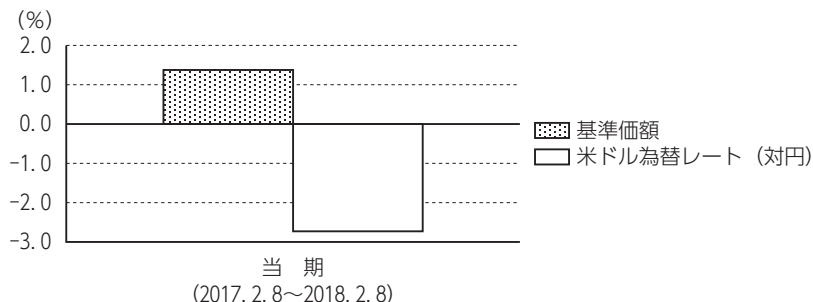
なお、満期償還に備えるため、2018年1月にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当期における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

信託期間中の収益分配金につきましては、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、見送らせていただきました。

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 2. 9～2018. 2. 8)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	100円	1. 134%	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, 806円です。
(投 信 会 社)	(38)	(0. 432)	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)	(57)	(0. 648)	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)	(5)	(0. 054)	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	11	0. 122	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(10)	(0. 118)	特定資産の価格等に関する調査費用、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	111	1. 255	

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	247,077	247,900	422,063	423,427

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等
オプション取引の銘柄別取引状況・残高状況

最終期末における残高はありません。

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

銘 柄 別			コール プット別	買 建				売 建			
				新 規 買付額	決済額	権利行使	権利放棄	新 規 売付額	決済額	権 利 被行使	義務消滅
国 内	通 貨	アメリカ・ドル	コール	百万円 57	百万円 58	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —
			プット	—	—	—	—	67	62	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

決 算 期	当 期			前 期		
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	83,962	11,710	13.9	—	—	—
コール・ローン	7,644,141	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.4%

※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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	□ 数
	千口
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	174,985

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年2月8日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	69,728	100.0
投資信託財産総額	69,728	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■特定資産の価格等の調査

当ファンドにおいて行なった取引のうち、投資信託および投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、あずさ監査法人へその調査を委託しました。対象期間中（2017年2月9日～2018年1月4日）に該当した取引は、オプション取引（選択権付為替予約取引）が120件あり、該当取引については当該監査法人からの調査報告書を受領しました。

なお、オプション取引については、取引の相手方の名称、通貨の種類、プットまたはコールの別、権利行使価格、権利行使期間その他当該オプション取引の内容に関することについて調査を委託しました。

2018年1月5日以降は調査が必要な資産の取引はございませんでした。

■損益の状況

当期 自 2017年2月9日 至 2018年2月8日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,980円
受取利息	29,789
支払利息	△ 36,769
(B) 有価証券売買損益	△ 18,074
売買益	41,882
売買損	△ 59,956
(C) 先物取引等損益	4,500,046
取引益	55,228,081
取引損	△ 50,728,035
(D) 信託報酬等	△ 2,569,634
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	1,905,358
(F) 前期繰越損益金	13,113
(G) 追加信託差損益金	△ 9,920,722
(配当等相当額)	(107,573)
(売買損益相当額)	(△ 10,028,295)
(H) 合計 (E + F + G)	△ 8,002,251
償還差損益金 (H)	△ 8,002,251

(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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年2月8日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	69,728,596円
コール・ローン等	69,728,596
(B) 負債	980,705
未払解約金	27,374
未払信託報酬	953,242
未払利息	89
(C) 純資産総額 (A - B)	68,747,891
元本	76,750,142
償還差損益金	△ 8,002,251
(D) 受益権総口数	76,750,142口
1万口当り償還価額 (C / D)	8,957円36銭

* 期首における元本額は279,376,428円、当期中における追加設定元本額は567,038,307円、同解約元本額は769,664,593円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は8,957円36銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は8,002,251円です。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表					
信 託 期 間	投資信託契約締結日	2015年 2 月 9 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年 2 月 8 日		資 産 総 額	69,728,596円
区 分	投 資 信 託 契 約 締 結 当 初	投資信託契約終了時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	980,705円
				純 資 産 総 額	68,747,891円
受 益 権 口 数	50,000,000口	76,750,142口	26,750,142口	受 益 権 口 数	76,750,142口
元 本 額	50,000,000円	76,750,142円	26,750,142円	1 単位当り償還金	8,957円36銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単位当り分配金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	円 238,147,179	円 230,394,864	円 9,674	円 0	% 0.00
第 2 期	279,376,428	246,851,124	8,836	0	0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	8,957円36銭

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

円高ドル安ポートフォリオ

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			米ドル為替レート		公 社 債 組入比率	純資産 総 額
		税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率		
	円	円	%	円	%	%	百万円
1 期末 (2016年 2 月 8 日)	9,814	0	△ 1.9	117.02	△ 1.6	55.0	82
2 期末 (2017年 2 月 8 日)	9,824	0	0.1	112.45	△ 3.9	21.5	134
償 還 (2018年 2 月 8 日)	9,196.65	—	△ 6.4	109.38	△ 2.7	—	56

(注 1) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。

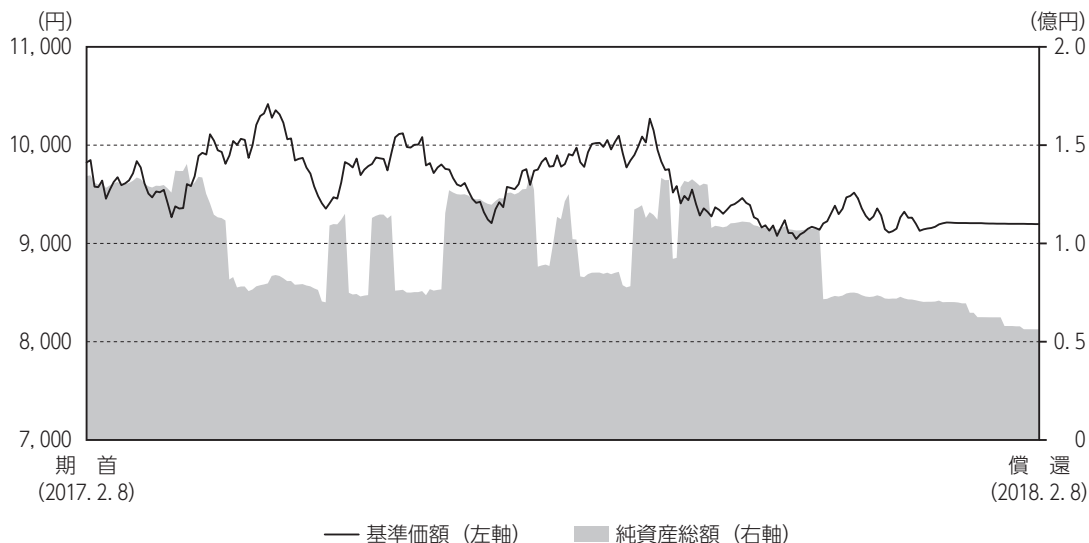
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：9,196円65銭

騰落率：△8.0%

■基準価額の主な変動要因

主として、通貨オプション（選択権付為替予約）を利用するとともに、ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券に投資し、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度逆となる投資成果をめざした結果、日々の上下変動による長期的な下方バイアスと信託報酬等の影響により、基準価額は下落しました。

年 月 日	基 準	価 額		米 ド ル 為 替 レ ー ト		公社債組入比率
		騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率	
	円	%		円	%	%
(期首)2017年 2 月 8 日	9,824	—		112.45	—	21.5
2 月末	9,773	△	0.5	112.56	0.1	17.0
3 月末	9,810	△	0.1	112.19	△ 0.2	—
4 月末	9,871	0.5		111.29	△ 1.0	26.3
5 月末	9,867	0.4		110.96	△ 1.3	4.4
6 月末	9,615	△	2.1	112.00	△ 0.4	0.4
7 月末	9,829	0.1		110.35	△ 1.9	0.1
8 月末	9,773	△	0.5	110.42	△ 1.8	—
9 月末	9,357	△	4.8	112.73	0.2	—
10 月末	9,237	△	6.0	113.16	0.6	—
11 月末	9,357	△	4.8	112.05	△ 0.4	—
12 月末	9,205	△	6.3	113.00	0.5	—
2018年 1 月末	9,199	△	6.4	108.79	△ 3.3	—
(償還)2018年 2 月 8 日	9,196.65	△	6.4	109.38	△ 2.7	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2015. 2. 9 ~ 2018. 2. 8)

■為替相場

設定当初から2015年末までの為替レートは、おおむね安定した推移となりました。2016年に入ると、原油価格の下落や日銀の追加緩和見送り、米国の早期利上げ観測の後退、英国の国民投票でのEU（欧州連合）離脱派の勝利を受けた市場のリスク回避姿勢の強まりなどを背景に、円高米ドル安が進行しました。10月以降は、原油価格の上昇や米国の大統領選挙で勝利したトランプ氏の政策への期待感などから市場のリスク選好度が強まり、円安傾向に転じる場面も見られました。しかし2017年に入ると、同氏への期待が剥落するとともに、やや円高米ドル安が進行しました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

主として、通貨オプションを利用するとともに、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券に投資します。また、通貨オプションの利用にあたっては、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度逆となる投資成果をめざして、米ドルプット円コールオプションの買いおよび米ドルコール円プットオプションの売りを組み合わせます。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

信託期間中のポートフォリオについて

(2015. 2. 9 ~ 2018. 2. 8)

■当ファンド

主として、通貨オプションを利用するとともに、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券に投資しました。また、通貨オプションの利用にあたっては、日々の基準価額の値動きが、米ドルの対円での値動きの2倍程度逆となる投資成果をめざして、米ドルプット円コールオプションの買いおよび米ドルコール円プットオプションの売りを組み合わせました。

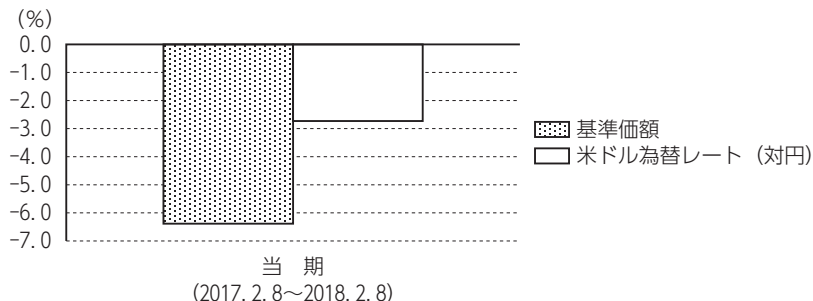
なお、満期償還に備えるため、2018年1月にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当期における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

信託期間中の収益分配金につきましては、経費控除後の配当等収益が計上できなかった、または少額であったため、見送らせていただきました。

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 2. 9～2018. 2. 8)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	109円	1. 134%	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, 581円です。
(投 信 会 社)	(41)	(0. 432)	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)	(62)	(0. 648)	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)	(5)	(0. 054)	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	23	0. 244	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(23)	(0. 241)	特定資産の価格等に関する調査費用、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	132	1. 378	

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	172,479	173,050	261,734	262,586

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等

オプション取引の銘柄別取引状況・残高状況

最終期末における残高はありません。

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

銘 柄 別			コール プット別	買 建				売 建			
				新 規 買付額	決済額	権利行使	権利放棄	新 規 売付額	決済額	権 利 被行使	義務消滅
				百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
国 内	通 貨	アメリカ・ドル	コール	—	—	—	—	27	26	—	—
			プット	32	29	—	—	—	—	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

決 算 期	当			期		
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	83,962	11,710	13.9	—	—	—
コール・ローン	7,644,141	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.2%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	口 数
	千口
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	89,255

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年2月8日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	56,833	100.0
投資信託財産総額	56,833	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■特定資産の価格等の調査

当ファンドにおいて行なった取引のうち、投資信託および投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、あずさ監査法人へその調査を委託しました。対象期間中（2017年2月9日～2018年1月4日）に該当した取引は、オプション取引（選択権付為替予約取引）が140件あり、該当取引については当該監査法人からの調査報告書を受領しました。

なお、オプション取引については、取引の相手方の名称、通貨の種類、プットまたはコールの別、権利行使価格、権利行使期間その他当該オプション取引の内容に関することについて調査を委託しました。

2018年1月5日以降は、調査が必要な資産の取引はございませんでした。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年2月8日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	56,833,181円
コール・ローン等	56,833,181
(B) 負債	528,872
未払解約金	15,276
未払信託報酬	513,523
未払利息	73
(C) 純資産総額 (A - B)	56,304,309
元本	61,222,635
償還差損益金	△ 4,918,326
(D) 受益権総口数	61,222,635口
1万口当り償還価額 (C / D)	9,196円65銭

* 期首における元本額は136,677,840円、当期中における追加設定元本額は319,961,192円、同解約元本額は395,416,397円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,196円65銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は4,918,326円です。

■損益の状況

当期 自 2017年2月9日 至 2018年2月8日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,082円
受取利息	12,494
支払利息	△ 17,576
(B) 有価証券売買損益	△ 5,876
売買益	17,954
売買損	△ 23,830
(C) 先物取引等損益	△ 1,797,317
取引益	21,490,702
取引損	△ 23,288,019
(D) 信託報酬等	△ 1,345,217
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 3,153,492
(F) 前期繰越損益金	△ 122,293
(G) 追加信託差損益金	△ 1,642,541
(配当等相当額)	(3,072,449)
(売買損益相当額)	(△ 4,714,990)
(H) 合計 (E + F + G)	△ 4,918,326
償還差損益金 (H)	△ 4,918,326

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

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

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表					
信 託 期 間	投資信託契約締結日	2015年 2 月 9 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年 2 月 8 日		資 産 総 額	56,833,181円
区 分	投 資 信 託 契 約 締 結 当 初	投資信託契約終了時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	528,872円
				純 資 産 総 額	56,304,309円
受 益 権 口 数	50,000,000口	61,222,635口	11,222,635口	受 益 権 口 数	61,222,635口
元 本 額	50,000,000円	61,222,635円	11,222,635円	1 単位当り償還金	9,196円65銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単位当り分配金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	円 83,654,023	円 82,096,525	円 9,814	円 0	% 0.00
第 2 期	136,677,840	134,275,947	9,824	0	0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	9,196円65銭

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

マネー・ポートフォリオ

設定以来の運用実績

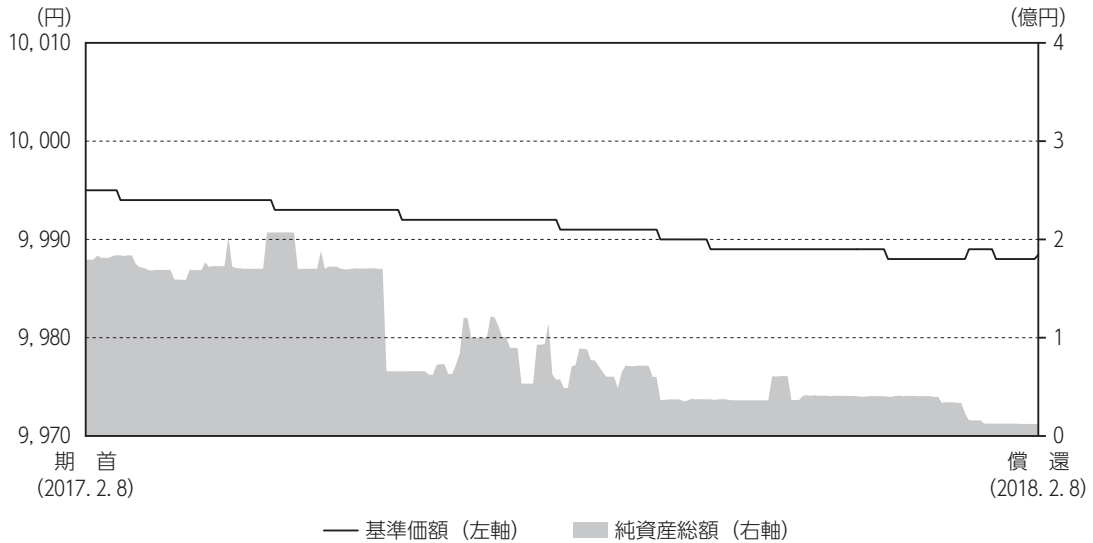
決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組 入 比 率	純資産総額
		税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率		
	円	円	%	%	百万円
1 期末 (2016年 2 月 8 日)	9,994	0	△ 0.1	41.7	2
2 期末 (2017年 2 月 8 日)	9,995	0	0.0	22.6	179
償 還 (2018年 2 月 8 日)	9,988.44	—	△ 0.1	—	12

(注 1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
(注 3) 当ファンドは「ダイワ・ブルベア・セレクト」を構成するファンドのスイッチング資金を一時滞留させる受け皿としての役割をもったファンドであり、円建ての債券を中心に安定運用を行ないます。そのため、ベンチマークおよび参考指数はありません。



運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：9,988円44銭

騰落率：△0.1%

■基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券を通じて投資した短期の国債やコール・ローン等の利回りが2016年半ばごろよりマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

年 月 日	基 準	価 額	公社債組入比率
		騰 落 率	
(期首)2017年 2 月 8 日	円	% —	% 22. 6
2 月末	9, 994	△ 0. 0	18. 0
3 月末	9, 994	△ 0. 0	—
4 月末	9, 993	△ 0. 0	24. 9
5 月末	9, 993	△ 0. 0	4. 5
6 月末	9, 992	△ 0. 0	0. 4
7 月末	9, 992	△ 0. 0	0. 1
8 月末	9, 991	△ 0. 0	—
9 月末	9, 990	△ 0. 1	—
10月末	9, 989	△ 0. 1	—
11月末	9, 989	△ 0. 1	—
12月末	9, 988	△ 0. 1	—
2018年 1 月末	9, 988	△ 0. 1	—
(償還)2018年 2 月 8 日	9, 988. 44	△ 0. 1	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2015. 2. 9 ~ 2018. 2. 8)

国内短期金融市況

設定時より、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。その後、2016年1月末にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。また、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利は2016年半ばごろよりマイナス圏で推移しました。

信託期間中の運用方針

当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

信託期間中のポートフォリオについて

(2015. 2. 9 ~ 2018. 2. 8)

当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

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

信託期間中の収益分配金につきましては、経費控除後の配当等収益が計上できなかった、または少額であったため、見送らせていただきました。

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 2. 9～2018. 2. 8)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—円	—%	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9,991円です。
(投 信 会 社)	(—)	(—)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(—)	(—)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(—)	(—)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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	0.002	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)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.002	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	257,984	258,841	383,166	384,432

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年2月9日から2018年2月8日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	83,962	11,710	13.9	—	—	—
コール・ローン	7,644,141	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.2%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

期 首 有 額	期 設 中 額	期 解 約 中 額	償 還 時 有 額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	□ 数
	千口
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	125,181

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年2月8日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	12,216	100.0
投資信託財産総額	12,216	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年2月8日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	12,216,962円
コール・ローン等	12,216,962
(B) 負債	15
未払利息	15
(C) 純資産総額 (A－B)	12,216,947
元本	12,231,092
償還差損益金	△ 14,145
(D) 受益権総口数	12,231,092口
1万口当り償還価額 (C／D)	9,988円44銭

* 期首における元本額は179,511,316円、当期中における追加設定元本額は390,076,997円、同解約元本額は557,357,221円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,988円44銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は14,145円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 2月 9 日 至 2018年 2月 8 日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 876円
受取利息	16,073
支払利息	△ 16,949
(B) 有価証券売買損益	△ 20
売買益	14,315
売買損	△ 14,335
(C) 信託報酬等	△ 950
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,846
(E) 前期繰越損益金	△ 14
(F) 追加信託差損益金	△ 12,285
(配当等相当額)	(6,934)
(売買損益相当額)	(△ 19,219)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 14,145
償還差損益金 (G)	△ 14,145

- (注 1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
- (注 2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表					
信 託 期 間	投資信託契約締結日	2015年 2月 9 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年 2月 8 日		資 産 総 額	12,216,962円
区 分	投 資 信 託 契 約 締 結 当 初	投資信託契約終了時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	15円
				純 資 産 総 額	12,216,947円
受 益 権 □ 数	1,000,000□	12,231,092□	11,231,092□	受 益 権 □ 数	12,231,092□
元 本 額	1,000,000円	12,231,092円	11,231,092円	1 単位当り償還金	9,988円44銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単位当り分配金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	円 2,500,593	円 2,499,081	円 9,994	円 0	% 0.00
第 2 期	179,511,316	179,418,772	9,995	0	0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ									
1	万	口	当	り	償	還	金	9,988円44銭	

償還金の課税上の取扱いについて

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

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第8期（決算日 2017年12月11日）

（計算期間 2016年12月10日～2017年12月11日）

ダイワ・マネースtock・マザーファンドの第8期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
運用方法	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA－2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

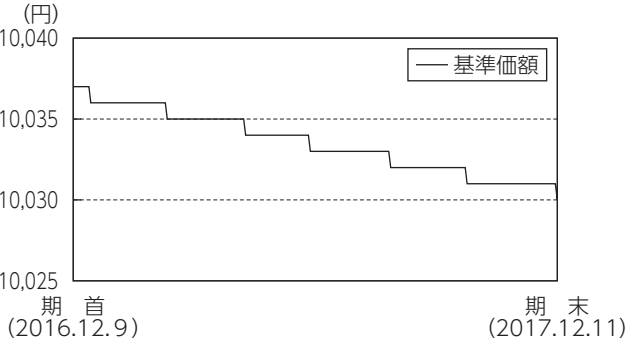
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額の推移



年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率
	騰 落 率	組 入 比 率	
(期首)2016年12月9日	円 10,037	% -	% 29.1
12月末	10,036	△0.0	-
2017年1月末	10,036	△0.0	31.1
2月末	10,035	△0.0	25.2
3月末	10,035	△0.0	-
4月末	10,034	△0.0	35.6
5月末	10,034	△0.0	6.4
6月末	10,033	△0.0	0.6
7月末	10,033	△0.0	0.1
8月末	10,032	△0.0	-
9月末	10,032	△0.0	-
10月末	10,031	△0.1	-
11月末	10,031	△0.1	-
(期末)2017年12月11日	10,030	△0.1	-

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なっており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,037円 期末：10,030円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

期首より、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 116,573,085	千円 (128,940,000)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は四捨五入。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

当 期			期		
買 付		金 額	売 付		金 額
銘 柄	銘 柄		銘 柄	銘 柄	
645 国庫短期証券 2017/2/20		千円 17,010,400			千円
657 国庫短期証券 2017/4/17		10,150,199			
652 国庫短期証券 2017/3/27		9,790,078			
642 国庫短期証券 2017/2/6		9,700,144			
659 国庫短期証券 2017/4/24		9,120,282			
651 国庫短期証券 2017/3/21		7,630,194			
669 国庫短期証券 2017/6/12		6,970,248			
644 国庫短期証券 2017/5/12		6,690,300			
638 国庫短期証券 2017/1/16		5,120,041			
660 国庫短期証券 2017/5/1		4,590,081			

(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) 単位未満は四捨五入。

■組入資産明細表

当期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	30,906,278	100.0
投資信託財産総額	30,906,278	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	30,906,278,899円
コール・ローン等	30,906,278,899
(B) 負債	799,000,000
未払解約金	799,000,000
(C) 純資産総額(A－B)	30,107,278,899
元本	30,015,878,475
次期繰越損益金	91,400,424
(D) 受益権総口数	30,015,878,475口
1万口当り基準価額(C／D)	10,030円

* 期首における元本額は42,294,564,193円、当期中における追加設定元本額は17,178,092,718円、同解約元本額は29,456,778,436円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド（為替ヘッジあり）3,021,993円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド（為替ヘッジなし）1,018,149円、ダイワ米国バンクロン・ファンド（為替ヘッジあり）2014－07 9,963円、ダイワ米国バンクロン・ファンド（為替ヘッジあり）2014－09 9,963円、ダイワ米国バンクロン・ファンド（為替ヘッジあり）2014－11 9,962円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド－ロボテック－947,268円、ダイワ／ミレアセット・インド株式ファンド－インドの匠－29,910,270円、新興国ソブリン・豪ドルファンド（毎月決算型）999円、新興国ソブリン・ブラジルリアルファンド（毎月決算型）999円、新興国ソブリン・ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）999円、US短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）102,434円、US短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）1,994円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド－ロボテック－（為替ヘッジあり）39,849円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド（年1回決算型）－ロボテック（年1回）－（為替ヘッジあり）3,985円、ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス3,969,366,810円、ダイワ上場投信－日経平均ダブルインパース・インデックス5,902,244,309円、ダイワ上場投信－TOP I Xレバレッジ（2倍）指数1,105,650,011円、ダイワ上場投信－TOP I Xダブルインパース（－2倍）指数821,890,786円、ダイワ上場投信－日経平均インパース・インデックス6,073,206,032円、ダイワ上場投信－TOP I Xインパース（－1倍）指数5,071,127,230円、ダイワ上場投信－J P X日経400レバレッジ・インデックス383,378,807円、ダイワ上場投信－J P X日経400インパース・インデックス5,200,107,448円、ダイワ上場投信－J P X日経400ダブルインパース・インデックス205,174,656円、ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016－07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016－07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2017－06 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2017－06 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016－10 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016－10 997円、ダイワ・ブルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ28,215,782円、ダイワ・ブルベア・セレクト ドル高円安ポートフォリオ104,220,911円、ダイワ・ブルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ49,706,154円、ダイワ日本国債15－20年ラダー型ファンド・マネー

ポートフォリオ－SLトレード－641,089,307円、ダイワ／モルガン・スタンレー新興4カ国不動産関連ファンド－成長の雄音（つちおと）－5,020,480円、ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ206,680,116円、ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ126,940,913円、通貨選択型ダイワ／ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 豪ドル・コース（毎月分配型）4,184,518円、通貨選択型ダイワ／ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）12,952,078円、通貨選択型ダイワ／ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 通貨セレクト・コース（毎月分配型）4,981,569円、ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）9,957円、ダイワ米国バンクロン・オープン（為替ヘッジあり）997円、ダイワ米国バンクロン・オープン（為替ヘッジなし）997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジなし）997円、ダイワ／ミレアセット垂亜垂株式ファンド9,958,176円、＜奇数月定額払出型＞ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり49,806円、＜奇数月定額払出型＞ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし49,806円、通貨選択型ダイワ／ミレアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース4,980,080円、通貨選択型ダイワ／ミレアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ／ミレアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース3,685,259円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド（年1回決算型）－ロボテック（年1回）－100,588円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり（毎月分配型）399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし（毎月分配型）99,771円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース（毎月分配型）399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース（毎月分配型）99,771円、ダイワ／ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジあり）2,088,438円、ダイワ／ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジなし）1,012,911円、ダイワ／ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド10,009,811円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 日本円・コース（毎月分配型）398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 豪ドル・コース（毎月分配型）99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 米ドル・コース（毎月分配型）398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 通貨セレクト・コース（毎月分配型）1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド－イーグルアイⅡ－ 予想分配金提示型 日本円・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド－イーグルアイⅡ－ 予想分配金提示型 豪ドル・コース499,994円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド－イーグルアイⅡ－ 予想分配金提示型 ブラジル・リアル・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド－イーグルアイⅡ－ 予想分配金提示型 米ドル・コース9,976,045円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド－イーグルアイⅡ－ 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース2,001,563円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,030円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月10日 至2017年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 21,002,641円
受取利息	△ 3,317,956
支払利息	△ 17,684,685
(B) 有価証券売買損益	△ 4,086
売買損	△ 4,086
(C) その他費用	△ 329,559
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 21,336,286
(E) 前期繰越損益金	155,223,882
(F) 解約差損益金	△ 99,854,368
(G) 追加信託差損益金	57,367,196
(H) 合計(D + E + F + G)	91,400,424
次期繰越損益金(H)	91,400,424

(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。