

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	追加型投信／国内／株式／特殊型（ブル・ベア型） 追加型投信／国内／債券
信託期間	約3年間（2015年9月10日～2018年9月7日）	
運用方針	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ	日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの3程度となることをめざして運用を行ないます。
	ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2程度逆となることをめざして運用を行ないます。
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	主としてわが国の債券への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資 対象	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ	わが国の株価指数先物取引、わが国の債券およびダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	わが国の株価指数先物取引、わが国の債券およびダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	イ、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券口、本邦通貨表示の債券
運用方法	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ	①主として、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するとともに、わが国の株価指数先物取引を買い建てます。 ②株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の3程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの3程度となることをめざします。
	ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	①主として、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するとともに、わが国の株価指数先物取引を売り建てます。 ②株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の2程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2程度逆となることをめざします。
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	①マザーファンドの受益証券およびわが国の債券を中心に投資することにより、安定運用を行ないます。 ②邦貨資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A-2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
組入制限	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	・マザーファンドおよび株式組入上限比率は無制限
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の30%以下
配分方針	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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

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

ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ

ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ

ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ

ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ

運用報告書(全体版)

満期償還

(償還日 2018年9月7日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ」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/>

<4628>

<4629>

<4627>

ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			日 経 平 均 株 価		株 式 先物比率	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 9 月 7 日)	6,614	0	△ 33.9	17,012.44	△ 9.4	303.5	28.3	67,688
2 期末 (2017年 9 月 7 日)	9,591	0	45.0	19,396.52	14.0	297.3	—	57,365
償 還 (2018年 9 月 7 日)	14,125.92	—	47.3	22,307.06	15.0	—	—	1,753

(注1) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

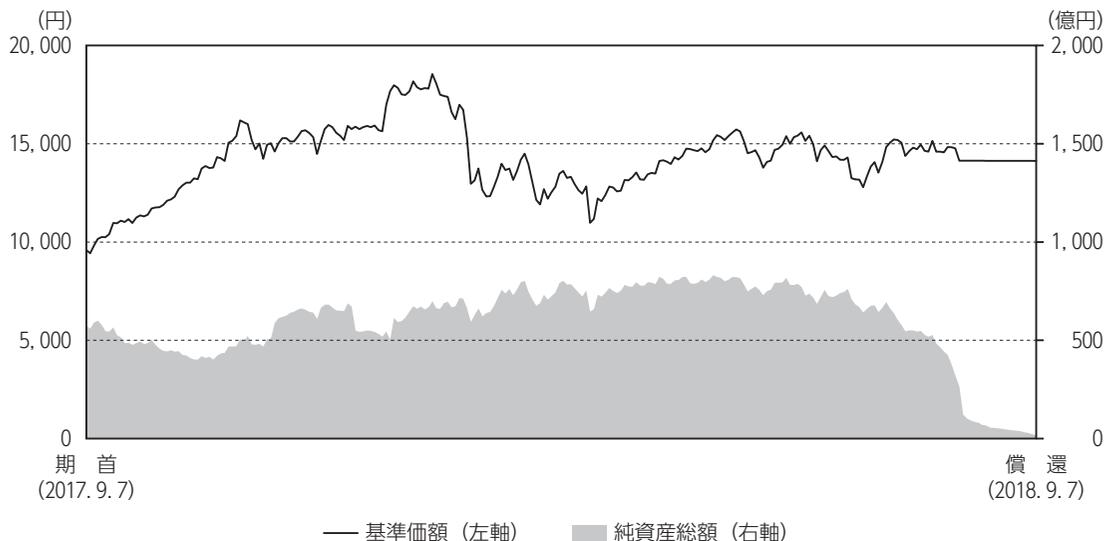
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：14,125円92銭

騰落率：41.3%

■ 基準価額の主な変動要因

設定当初より、日々の基準価額の値動きが日経平均株価の値動きの3倍程度の動きとなることをめざして運用を行なった結果、日経平均株価が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。

ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首)2017年9月7日	円	%	円	%	%	%
	9,591	—	19,396.52	—	297.3	—
9月末	11,308	17.9	20,356.28	4.9	300.1	—
10月末	14,124	47.3	22,011.61	13.5	302.8	—
11月末	15,645	63.1	22,724.96	17.2	296.4	—
12月末	15,633	63.0	22,764.94	17.4	290.3	—
2018年1月末	16,247	69.4	23,098.29	19.1	305.0	—
2月末	13,947	45.4	22,068.24	13.8	304.2	0.1
3月末	12,825	33.7	21,454.30	10.6	294.8	—
4月末	14,751	53.8	22,467.87	15.8	288.2	—
5月末	14,079	46.8	22,201.82	14.5	302.5	—
6月末	14,299	49.1	22,304.51	15.0	300.8	—
7月末	14,600	52.2	22,553.72	16.3	294.5	—
8月末	14,130	47.3	22,865.15	17.9	—	—
(償還)2018年9月7日	14,125.92	47.3	22,307.06	15.0	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2015. 9. 10 ~ 2018. 9. 7)

国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、中国を中心とした世界経済の先行き不透明感が広がったことや日銀のマイナス金利導入の影響から銀行株が大幅に下落したことなどを背景に、軟調な推移となりました。2016年後半以降は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて、同氏の政策に対する期待から上昇基調に転じ、その後もフランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことなどをを受けて、底堅く推移しました。2017年10月には、衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを好感し、一段高となりました。2018年以降は、米国長期金利が上昇したことや米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどを嫌気し、上値の重い展開で償還を迎えました。

信託期間中の運用方針

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券に投資するとともに、わが国の株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の3倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの3倍程度となることをめざして運用を行いません。

ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行いません。

信託期間中のポートフォリオについて

(2015. 9. 10 ~ 2018. 9. 7)

■当ファンド

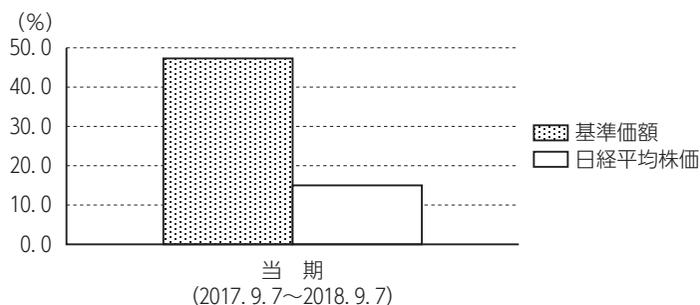
日経平均株価先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、純資産総額の3倍程度となるよう調整しました。また、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券に投資し、純資産総額に対して大きな追加設定および解約があった場合を除き、50~70%程度の組み入れを維持しました。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマーク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 (2017.9.8~2018.9.7)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	143円	1.004%	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14,248円です。
(投 信 会 社)	(46)	(0.324)	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)	(92)	(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)	(0.032)	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	13	0.092	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
(先物・オプション)	(13)	(0.092)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.010	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	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)	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	158	1.106	

(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9月8日から2018年9月7日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	78,135,528	79,600,000	106,073,309	108,046,538

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等

先物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9月8日から2018年9月7日まで)

銘 柄 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
	百万円	百万円	百万円	百万円
国内株 日経平均	1,026,122	1,217,598	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(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

(2017年9月8日から2018年9月7日まで)

決 算 期	当 期			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	%
株式先物取引	1,026,122	932,524	90.9	1,217,598	1,124,223	92.3
コール・ローン	6,250,781	—	—	—	—	—

(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

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

(2017年9月8日から2018年9月7日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	54,829千円
うち利害関係人への支払額 (B)	50,325千円
(B) / (A)	91.8%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

※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・マザーファンド	27,937,780

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9月7日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	3,157,123	100.0
投資信託財産総額	3,157,123	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9月7日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	3,157,123,824円
コール・ローン等	3,157,123,824
(B) 負債	1,403,939,023
未払解約金	1,087,487,803
未払信託報酬	316,366,186
未払利息	18,882
その他未払費用	66,152
(C) 純資産総額 (A - B)	1,753,184,801
元本	1,241,111,875
償還差損益金	512,072,926
(D) 受益権総口数	1,241,111,875口
1万口当り償還価額 (C / D)	14,125円92銭

* 期首における元本額は59,813,440,217円、当期中における追加設定元本額は173,903,193,127円、同解約元本額は232,475,521,469円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は14,125円92銭です。

■損益の状況

当期 自 2017年9月8日 至 2018年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 337,331円
受取利息	16,178,293
支払利息	△ 16,515,624
(B) 有価証券売買損益	△ 11,711,227
売買益	6,793,501
売買損	△ 18,504,728
(C) 先物取引等損益	582,626,764
取引益	30,548,357,181
取引損	△ 29,965,730,417
(D) 信託報酬等	△ 606,689,722
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 36,111,516
(F) 前期繰越損益金	△ 294,957
(G) 追加信託差損益金	548,479,399
(配当等相当額)	(△ 375,482)
(売買損益相当額)	(548,854,881)
(H) 合計 (E + F + G)	512,072,926
償還差損益金 (H)	512,072,926

(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9月10日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年9月7日		資 産 総 額	3,157,123,824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	1,403,939,023円
				純 資 産 総 額	1,753,184,801円
受益権口数	400,000,000口	1,241,111,875口	841,111,875口	受 益 権 口 数	1,241,111,875口
元 本 額	400,000,000円	1,241,111,875円	841,111,875円	1 単 位 当 り 償 還 金	14,125円92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
	円	円	円	円	%
第1期	102,335,123,725	67,688,799,916	6,614	0	0.00
第2期	59,813,440,217	57,365,536,474	9,591	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	14,125円92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（税込み）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。

ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価 (参考指数)		株式 先物比率	公社債 組入比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
1 期末 (2016年 9月 7日)	円 8,471	円 0	% △ 15.3	円 17,012.44	% △ 9.4	% △ 192.5	% 28.9	百万円 7,690
2 期末 (2017年 9月 7日)	5,737	0	△ 32.3	19,396.52	14.0	△ 201.1	—	9,744
償 還 (2018年 9月 7日)	3,825.32	—	△ 33.3	22,307.06	15.0	—	—	295

(注1) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

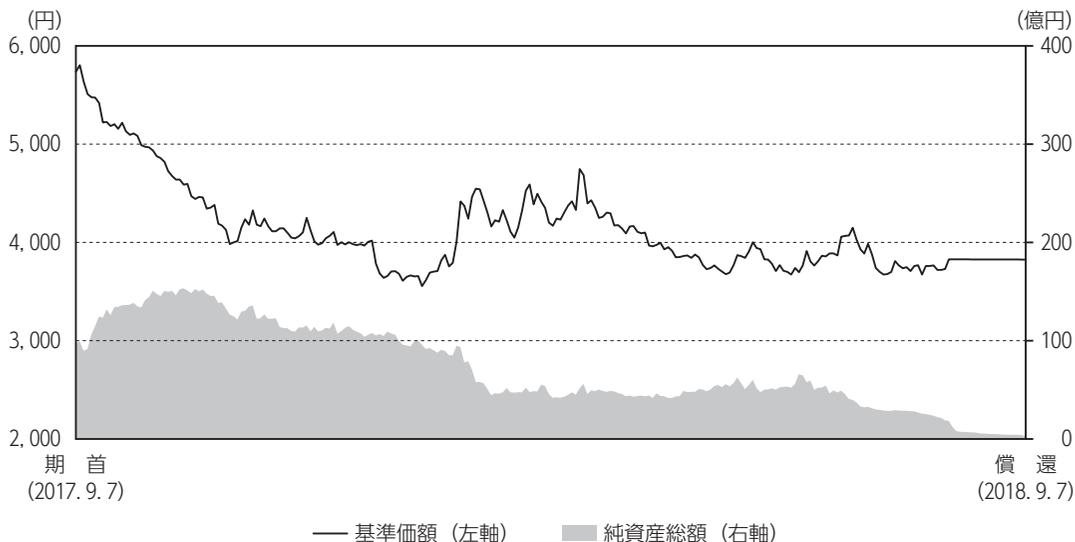
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：3,825円32銭

騰落率：△61.7%

■ 基準価額の変動要因

設定当初より、日々の基準価額の値動きが日経平均株価の値動きの2倍程度逆の動きとなることをめざして運用を行なった結果、日経平均株価が上昇したことを受け、基準価額は下落しました。

ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
	円	騰 落 率 %	(参考指数) 円	騰 落 率 %		
(期首)2017年9月7日	5,737	—	19,396.52	—	△ 201.1	—
9月末	5,109	△ 10.9	20,356.28	4.9	△ 197.1	—
10月末	4,382	△ 23.6	22,011.61	13.5	△ 198.1	—
11月末	4,048	△ 29.4	22,724.96	17.2	△ 199.7	—
12月末	4,017	△ 30.0	22,764.94	17.4	△ 207.4	—
2018年1月末	3,873	△ 32.5	23,098.29	19.1	△ 196.4	—
2月末	4,150	△ 27.7	22,068.24	13.8	△ 191.7	0.3
3月末	4,249	△ 25.9	21,454.30	10.6	△ 194.8	—
4月末	3,849	△ 32.9	22,467.87	15.8	△ 200.6	—
5月末	3,942	△ 31.3	22,201.82	14.5	△ 184.1	—
6月末	3,867	△ 32.6	22,304.51	15.0	△ 198.9	—
7月末	3,767	△ 34.3	22,553.72	16.3	△ 196.4	—
8月末	3,826	△ 33.3	22,865.15	17.9	—	—
(償還)2018年9月7日	3,825.32	△ 33.3	22,307.06	15.0	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2015. 9. 10 ~ 2018. 9. 7)

国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、中国を中心とした世界経済の先行き不透明感が広がったことや日銀のマイナス金利導入の影響から銀行株が大幅に下落したことなどを背景に、軟調な推移となりました。2016年後半以降は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて、同氏の政策に対する期待から上昇基調に転じ、その後もフランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことなどをを受けて、底堅く推移しました。2017年10月には、衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを好感し、一段高となりました。2018年以降は、米国長期金利が上昇したことや米中貿易摩擦への懸念が高まったことなどを嫌気し、上値の重い展開で償還を迎えました。

信託期間中の運用方針

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券に投資するとともに、わが国の株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行ないます。

ダイワ・マネー・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。

信託期間中のポートフォリオについて

(2015. 9. 10 ~ 2018. 9. 7)

■当ファンド

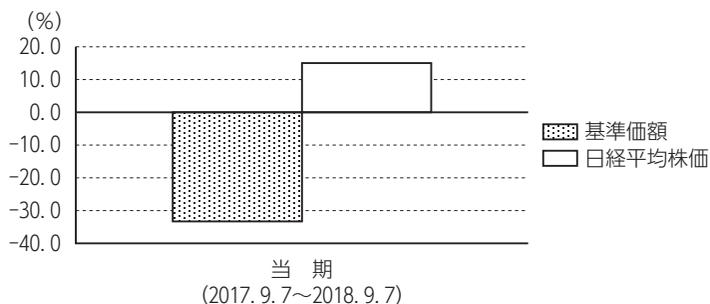
日経平均株価先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、純資産総額の2倍程度となるよう調整しました。また、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券に投資し、純資産総額に対して大きな追加設定および解約があった場合を除き、50~70%程度の組み入れを維持しました。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマーク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 (2017.9.8~2018.9.7)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	41円	1.004%	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4,118円です。
(投 信 会 社)	(13)	(0.324)	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)	(27)	(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)	(1)	(0.032)	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	3	0.077	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
(先物・オプション)	(3)	(0.077)	
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	0.009	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
(そ の 他)	(0)	(0.005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	45	1.090	

(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9月8日から2018年9月7日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	8,382,991	8,540,000	14,405,099	14,673,601

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等

先物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9月8日から2018年9月7日まで)

銘 柄 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
	百万円	百万円	百万円	百万円
国内株式 日経平均	—	—	99,332	123,489

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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・マザーファンド	6,022,107

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9月7日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	437,265	100.0
投資信託財産総額	437,265	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9月7日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	437,265,440円
コール・ローン等	437,265,440
(B) 負債	141,886,969
未払解約金	122,068,742
未払信託報酬	19,812,265
未払利息	2,613
その他未払費用	3,349
(C) 純資産総額 (A - B)	295,378,471
元本	772,167,289
償還差損益金	△ 476,788,818
(D) 受益権総口数	772,167,289口
1万口当り償還価額 (C / D)	3,825円32銭

* 期首における元本額は16,987,006,946円、当期中における追加設定元本額は160,203,033,817円、同解約元本額は176,417,873,474円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は3,825円32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476,788,818円です。

■損益の状況

当期 自 2017年9月8日 至 2018年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 37,018円
受取利息	1,700,206
支払利息	△ 1,737,224
(B) 有価証券売買損益	△ 310,045
売買益	1,321,499
売買損	△ 1,631,544
(C) 先物取引等損益	74,260,140
取引益	3,291,042,604
取引損	△ 3,216,782,464
(D) 信託報酬等	△ 75,027,236
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 1,114,159
(F) 前期繰越損益金	1,170
(G) 追加信託差損益金	△ 475,675,829
(配当等相当額)	(11,956,594)
(売買損益相当額)	(△ 487,632,423)
(H) 合計 (E + F + G)	△ 476,788,818
償還差損益金 (H)	△ 476,788,818

(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9月10日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年9月7日		資産総額	437,265,440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	141,886,969円
				純資産総額	295,378,471円
受益権口数	600,000,000口	772,167,289口	172,167,289口	受益権口数	772,167,289口
元本額	600,000,000円	772,167,289円	172,167,289円	1単位当り償還金	3,825円32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
	円	円	円	円	%
第1期	9,078,658,972	7,690,255,309	8,471	0	0.00
第2期	16,987,006,946	9,744,716,367	5,737	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	3,825円32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（税込み）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。

ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ

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 9 月 7 日)	9,998	0	△ 0.0	38.8	27,609
2 期末 (2017年 9 月 7 日)	9,992	0	△ 0.1	—	34,096
償 還 (2018年 9 月 7 日)	9,984.11	—	△ 0.1	—	2,007

(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。

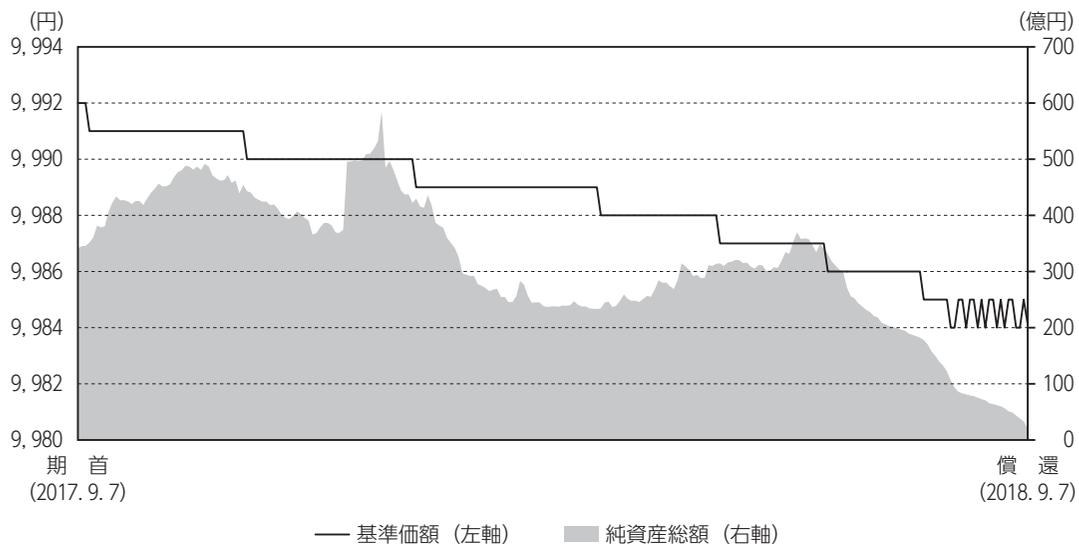
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは「ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ」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持ったファンドであり、わが国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：9,984円11銭

騰落率：△0.2%

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネー・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2月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9月7日	円	9,992	—	%
9月末		9,991	△ 0.0	—
10月末		9,991	△ 0.0	—
11月末		9,990	△ 0.0	—
12月末		9,990	△ 0.0	—
2018年1月末		9,989	△ 0.0	—
2月末		9,989	△ 0.0	0.3
3月末		9,988	△ 0.0	—
4月末		9,988	△ 0.0	—
5月末		9,987	△ 0.1	—
6月末		9,986	△ 0.1	—
7月末		9,986	△ 0.1	—
8月末		9,985	△ 0.1	—
(償還)2018年9月7日		9,984.11	△ 0.1	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2015. 9. 10 ~ 2018. 9. 7)

国内短期金融市況

国内短期金利は、設定時より、日銀の追加緩和観測などから低下しました。日銀は、2016年1月にマイナス金利付き量的・質的金融緩和策を導入し、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和策を導入しました。このような金融政策を背景に、国内短期金利は恒常的にマイナス圏で推移しました。2017年以降は、主要先進国において金融政策の正常化観測が進む中、日本も緩和的な金融政策の運営方針を転換するのではないかとの思惑が浮上しました。国内短期金利はマイナス幅を縮小させつつも引き続きマイナス圏で推移し、おおむね横ばいの展開で償還を迎えました。

信託期間中の運用方針

当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

信託期間中のポートフォリオについて

(2015. 9. 10 ~ 2018. 9. 7)

当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

ダイワ・マネー・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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 (2017.9.8~2018.9.7)		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9,988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	1	0.007	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)	(1)	(0.007)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	1	0.007	

(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9月8日から2018年9月7日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	65,396,866	66,619,685	89,221,733	90,880,960

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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・マザーファンド	23,824,866

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9月7日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	3,806,739	100.0
投資信託財産総額	3,806,739	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9月7日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	3,806,739,931円
コール・ローン等	3,806,739,931
(B) 負債	1,799,250,698
未払解約金	1,799,226,285
未払利息	22,767
その他未払費用	1,646
(C) 純資産総額 (A - B)	2,007,489,233
元本	2,010,683,528
償還差損益金	△ 3,194,295
(D) 受益権総口数	2,010,683,528口
1万口当り償還価額 (C / D)	9,984円11銭

* 期首における元本額は34,124,766,294円、当期中における追加設定元本額は223,184,962,289円、同解約元本額は255,299,045,055円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,984円11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3,194,295円です。

■損益の状況

当期 自 2017年9月8日 至 2018年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 102,648円
受取利息	5,822,345
支払利息	△ 5,924,993
(B) 有価証券売買損益	91,880
売買益	5,713,943
売買損	△ 5,622,063
(C) 信託報酬等	△ 661,292
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 672,060
(E) 前期繰越損益金	△ 405
(F) 追加信託差損益金	△ 2,521,830
(配当等相当額)	(133,678)
(売買損益相当額)	(△ 2,655,508)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 3,194,295
償還差損益金 (G)	△ 3,194,295

(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いません。

(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9月10日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年9月7日		資産総額	3,806,739,931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	1,799,250,698円
				純資産総額	2,007,489,233円
受益権口数	1,000,000口	2,010,683,528口	2,009,683,528口	受益権口数	2,010,683,528口
元本額	1,000,000円	2,010,683,528円	2,009,683,528円	1単位当り償還金	9,984円11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
	円	円	円	円	%
第1期	27,614,789,079	27,609,207,462	9,998	0	0.00
第2期	34,124,766,294	34,096,809,381	9,992	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 9,984円11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（税込み）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・マザーファンド

運用報告書 第13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・マザーファンドの第13期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
運用方法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位 (A-2格相当) 以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和投資信託

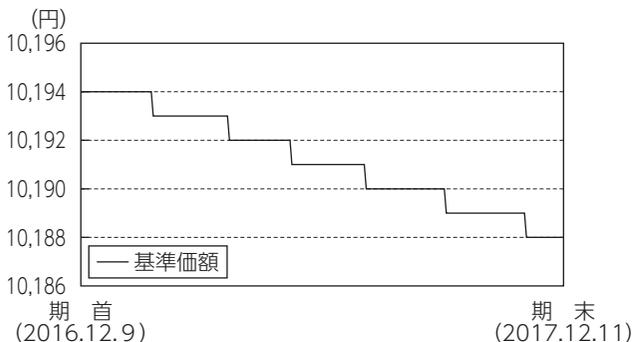
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

ダイワ・マネー・マザーファンド

■当期中の基準価額の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	%	
(期首)2016年12月9日	10,194	—	30.1
12月末	10,194	0.0	—
2017年1月末	10,194	0.0	30.7
2月末	10,193	△0.0	24.6
3月末	10,193	△0.0	—
4月末	10,192	△0.0	32.5
5月末	10,191	△0.0	5.2
6月末	10,191	△0.0	0.5
7月末	10,190	△0.0	0.1
8月末	10,190	△0.0	—
9月末	10,189	△0.0	—
10月末	10,189	△0.0	—
11月末	10,188	△0.1	—
(期末)2017年12月11日	10,188	△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、利息収入の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,194円 期末：10,188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、現先取引およびコール・ローン等による運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—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

(1) 公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

国 内	買 付 額	売 付 額	
		千円	千円
国債証券	210,925,408	—	(231,500,000)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

(2) その他有価証券

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

国 内	買 付 額	売 付 額	
		千円	千円
国内短期社債等	246,999,814	246,999,819	(—)

(注1) 金額は受渡し代金。

(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

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

買 付		売 付	
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
645 国庫短期証券	2017/2/20	27,570,641	
657 国庫短期証券	2017/4/17	17,880,344	
642 国庫短期証券	2017/2/6	17,230,250	
652 国庫短期証券	2017/3/27	16,550,132	
659 国庫短期証券	2017/4/24	16,270,410	
669 国庫短期証券	2017/6/12	15,870,490	
651 国庫短期証券	2017/3/21	13,160,344	
644 国庫短期証券	2017/5/12	11,970,533	
638 国庫短期証券	2017/1/16	9,360,075	
648 国庫短期証券	2017/3/6	7,370,272	

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
国内その他有価証券

	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999,999	<1.4>

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

■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	69,737,046	100.0
投資信託財産総額	69,737,046	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	69,737,046,159円
コール・ローン等	68,737,047,077
現先取引(その他有価証券)	999,999,082
(B) 負債	60,400,000
未払解約金	60,400,000
(C) 純資産総額(A - B)	69,676,646,159
元本	68,390,547,168
次期繰越損益金	1,286,098,991
(D) 受益権総口数	68,390,547,168口
1万口当り基準価額(C / D)	10,188円

* 期首における元本額は66,967,614,984円、当期中における追加設定元本額は143,241,011,614円、同解約元本額は141,818,079,430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IoT関連株ファンド - A I 新時代 - (為替ヘッジあり) 977,694円、ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド - A I 新時代 - (為替ヘッジなし) 977,694円、ダイワ F E グローバル・バリュー (為替ヘッジあり) 98,069円、ダイワ F E グローバル・バリュー (為替ヘッジなし) 98,069円、ダイワ / "R I C I" コモディティ・ファンド 8,952,508円、US 債券 NB 戦略ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型) 1,676円、US 債券 NB 戦略ファンド (為替ヘッジなし/年1回決算型) 1,330円、NB ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>米ドルコース981円、NB ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース981円、NB ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>世界通貨分散コース981円、DCダイワ・マネー・ポートフォリオ 2,898,147,134円、ダイワファンドラップ コモディティセレクト 317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 日本円・コース (毎月分配型) 132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 豪ドル・コース (毎月分配型) 643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 米ドル・コース (毎月分配型) 12,784円、ダイワ/フィデリティ北米株式ファンド - パラダイムシフター - 9,853,995円、プルベア・マネー・ポートフォリオ IV 25,987,316,146円、ブル3倍日本株ポートフォリオ IV 31,864,786,854円、ベア2倍日本株ポートフォリオ IV 7,199,848,570円、ダイワ F E グローバル・バリュー株ファンド (ダイワ S M A 専用) 4,090,590円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 155,317円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配

型) 38,024円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 米ドル・コース (毎月分配型) 4,380円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型) 22,592円、ダイワ/アムンディ食糧増産関連ファンド 164,735円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ 68,368,780円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスⅡ - 金積立型 - 501,660円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド (償還条項付き) 為替ヘッジあり 1,004,378円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース) 33,689円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース) 96,254円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジあり) 988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジなし) 4,926,018円、ダイワ米国 M L P ファンド (毎月分配型) 米ドルコース 285,029円、ダイワ米国 M L P ファンド (毎月分配型) 日本円コース 144,570円、ダイワ米国 M L P ファンド (毎月分配型) 通貨αコース 13,437,960円、ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型) 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ 1,229,944円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド (ダイワ S M A 専用) 235,407円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 南アフリカ・ランド・コース (毎月分配型) 1,097円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース 2,690円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 1,350円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 通貨αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース 98,202円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 98,174円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,188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	△ 41,076,414円
受取利息	△ 5,752,611
支払利息	△ 35,323,803
(B) 有価証券売買損益	△ 9,224
売買損	△ 9,224
(C) その他費用	△ 196,417
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 41,282,055
(E) 前期繰越損益金	1,302,196,055
(F) 解約差損益金	△ 2,715,466,915
(G) 追加信託差損益金	2,740,651,906
(H) 合計(D + E + F + G)	1,286,098,991
次期繰越損益金(H)	1,286,098,991

(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。