

★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／債券	
信託期間	約5年間(2015年9月8日～2020年9月4日)	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	為替あり	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・デイスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(円ヘッジ・クラス)」(以下「コア・ボンド・ファンド(円ヘッジ・クラス)」)といひます。)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
	為替なし	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・デイスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(ノンヘッジ・クラス)」(以下「コア・ボンド・ファンド(ノンヘッジ・クラス)」)といひます。)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
当ファンドの運用方法	為替あり	①主として、コア・ボンド・ファンド(円ヘッジ・クラス)の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。 ②当ファンドは、コア・ボンド・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。通常の状態では、コア・ボンド・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コア・ボンド・ファンド(円ヘッジ・クラス)では、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。
	為替なし	①主として、コア・ボンド・ファンド(ノンヘッジ・クラス)の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。 ②当ファンドは、コア・ボンド・ファンド(ノンヘッジ・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。通常の状態では、コア・ボンド・ファンド(ノンヘッジ・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コア・ボンド・ファンド(ノンヘッジ・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。
マザーファンドの運用方法	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スナル・ペーパーに投資することを基本とします。	
組入制限	当ファンドの投資信託証券組入上限比率 無期限 マザーファンドの株式組入上限比率 純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことめざします。ただし、基準価額の水準等によっては、売買益(評価益を含みます。)等を中心に分配する場合があります。なお、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第2期

(決算日 2016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、「ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、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/> <2700>

<2701>

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

★ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

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 分 配 金	期 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末(2016年 3 月 7 日)	9,781	130	△ 0.9	0.0	99.2	3,500
2 期末(2016年 9 月 7 日)	10,178	120	5.3	0.0	99.0	5,866

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

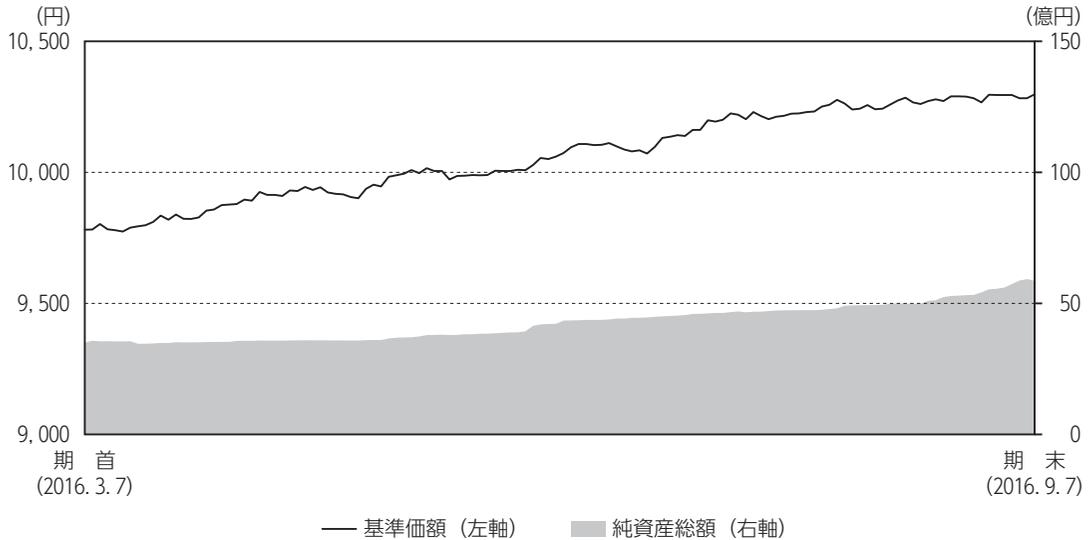
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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

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

《運用経過》

基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■ 基準価額・騰落率

期首：9,781円

期末：10,178円（分配金120円）

騰落率：5.3%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）（以下「コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）」といいます。）の受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ての複数種別の債券等に投資した結果、保有債券からの利息収入および債券価格の上昇により基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

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 %		
(期首)2016年 3月 7日	9,781	—	0.0	99.2
3月末	9,858	0.8	0.0	99.3
4月末	9,937	1.6	0.0	99.2
5月末	10,005	2.3	0.0	98.4
6月末	10,142	3.7	0.0	99.4
7月末	10,258	4.9	0.0	99.0
8月末	10,295	5.3	0.0	98.7
(期末)2016年 9月 7日	10,298	5.3	0.0	99.0

(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

○債券市況

債券市況は、期首より、2016年1月および2月のコモディティ市場での下落からの回復が続きました。6月には、英国の国民投票で予想外にEU（欧州連合）離脱派が多数を占めたことにより、市場では混乱と質への逃避が起きました。しかし、各国中央銀行が緊急資金供給を発表した後、市場が反応し、債券・株式ともに大幅に上昇（債券金利は低下）しました。期を通して、すべての米国債券資産クラスは、継続的な米国消費や堅固な経済成長の下支えを受けてプラスとなりました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

主として、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

○コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。利上げ開始後の米国債券市場については、利回り曲線のベアフラット化（短期年限中心の金利上昇）が進むと考えており、債券ポートフォリオにおいては、こうした見通しの下でトータルリターンの向上に寄与する銘柄の選別を重視する方針です。また、為替変動リスクを低減するため、対円での為替ヘッジを行いません。

※国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、資産担保証券、バンクローン、MBS（不動産担保証券）、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF等

○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ってまいります。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券とダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資するファンド・オブ・ファンズであり、期を通じてコア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に維持しました。

○コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

当ファンドでは、ノンコンシューマーABS（資産担保証券）、CLO（ローン担保証券）、非政府系RMB S（住宅ローン担保証券）などの資産分類における価値に着目し、ポートフォリオの配分比率を高めました。実効デュレーションはやや短期化した水準としました。イールドカーブの短期の端の金利上昇および長期の端の金利下落局面でポートフォリオがメリットを享受できるよう、ポートフォリオでは「バーベル型」アプローチによって組成しました。また、為替変動リスクを低減するため、対円での為替ヘッジを行ないました。

○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

当期の1万口当り分配金（税込み）は120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	当 期	
	2016年3月8日 ～2016年9月7日	
当期分配金（税込み）	(円)	120
対基準価額比率	(%)	1.17
当期の収益	(円)	120
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	177

- (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	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	124.35円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	114.79
(c) 収益調整金	55.42
(d) 分配準備積立金	3.27
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	297.84
(f) 分配金	120.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	177.84

(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

主として、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

○コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。主要先進国の中央銀行が経済刺激策として流動性を供給し続ける中、米国は、引き続き魅力的な投資先となっており、長期的な視点において「リスクオン」の取引が続くと考えます。債券ポートフォリオにおいては、こうした見通しの下でトータルリターンの向上に寄与する銘柄の選別を重視する方針です。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないません。

○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せん。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 3. 8～2016. 9. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	62円	0.612%	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10,066円です。
（投信会社）	(19)	(0.191)	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）	(41)	(0.408)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(1)	(0.014)	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	62	0.616	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2016年3月8日から2016年9月7日まで)

	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)	22,996.088	2,327,881	1,514.006	148,000

(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。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2016年3月8日から2016年9月7日まで)

当 期				期 付			
買 付	口 数	金 額	平均単価	売 付	口 数	金 額	平均単価
銘 柄	千口	千円	円	銘 柄	千口	千円	円
DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	22,195.264	2,246,500	101	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	1,514.006	148,000	97

(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期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2016年3月8日から2016年9月7日まで)

決 算 期	当 期			期 付		
	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
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	31,430	3,750	11.9	—	—	—
コール・ローン	713,368	—	—	—	—	—

(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。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT	57,014.742	5,808,661	99.0

(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。

(2) 親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0	0	1			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	5,808,661	96.5
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	209,263	3.5
投資信託財産総額	6,017,926	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,017,926,085円
コール・ローン等	209,263,141
投資信託受益証券 (評価額)	5,808,661,944
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	1,000
(B) 負債	151,182,146
未払収益分配金	69,170,747
未払解約金	55,901,850
未払信託報酬	25,936,721
その他未払費用	172,828
(C) 純資産総額 (A - B)	5,866,743,939
元本	5,764,228,951
次期繰越損益金	102,514,988
(D) 受益権総口数	5,764,228,951口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,178円

* 期首における元本額は3,578,552,480円、当期中における追加設定元本額は2,489,519,247円、同解約元本額は303,842,776円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,178円です。

■損益の状況

当期 自2016年3月8日 至2016年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	80,675,489円
受取配当金	80,689,545
受取利息	129
支払利息	△ 14,185
(B) 有価証券売買損益	153,476,987
売買益	158,162,425
売買損	△ 4,685,438
(C) 信託報酬等	△ 26,109,971
(D) 当期損益金 (A + B + C)	208,042,505
(E) 前期繰越損益金	△ 68,303,247
(F) 追加信託差損益金	31,946,477
(配当等相当額)	(31,312,191)
(売買損益相当額)	(18,634,286)
(G) 合計 (D + E + F)	171,685,735
(H) 収益分配金	△ 69,170,747
次期繰越損益金 (G + H)	102,514,988
追加信託差損益金	31,946,477
(配当等相当額)	(13,312,191)
(売買損益相当額)	(18,634,286)
分配準備積立金	70,568,511

(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10ページの「収益分配金の計算過程 (総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	71,680,604円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	66,170,621
(c) 収益調整金	31,946,477
(d) 分配準備積立金	1,888,033
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	171,685,735
(f) 分配金	69,170,747
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	102,514,988
(h) 受益権総口数	5,764,228,951口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	120円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は9月7日現在の基準価額（1万口当り10,178円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

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

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

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

★ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

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 分 配 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末(2016年 3 月 7 日)	9,250	130	△ 6.2	0.0	99.2	1,939
2 期末(2016年 9 月 7 日)	8,738	100	△ 4.5	0.0	98.7	1,937

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

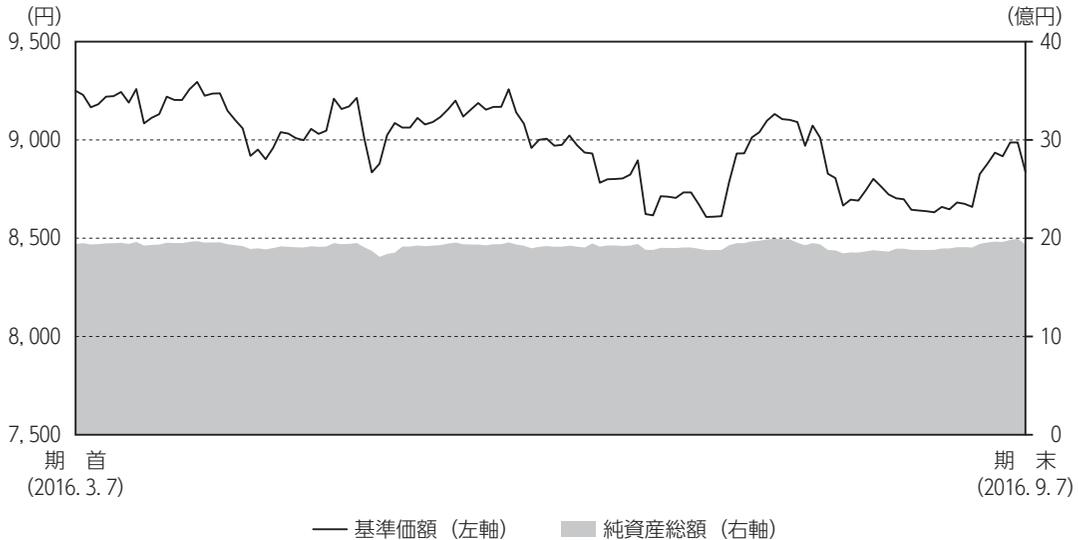
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



（注）期末の基準価額は分配金込みです。

■ 基準価額・騰落率

期首：9,250円

期末：8,738円（分配金100円）

騰落率：△4.5%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）（以下「コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」といいます。）の受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ての複数種別の債券等に投資した結果、保有債券からの利息収入および債券価格の上昇はプラスに寄与しましたが、主に米ドル円為替相場下落により基準価額は下落しました。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期首)2016年 3月 7日	円 9,250	% —	% 0.0	% 99.2	
3月末	9,225	△ 0.3	0.0	99.4	
4月末	9,214	△ 0.4	0.0	99.5	
5月末	9,168	△ 0.9	0.0	99.1	
6月末	8,711	△ 5.8	0.0	99.5	
7月末	9,011	△ 2.6	0.0	98.8	
8月末	8,879	△ 4.0	0.0	99.7	
(期末)2016年 9月 7日	8,838	△ 4.5	0.0	98.7	

(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

○債券市況

債券市況は、期首より、2016年1月および2月のコモディティ市場での下落からの回復が続きました。6月には、英国の国民投票で予想外にEU（欧州連合）離脱派が多数を占めたことにより、市場では混乱と質への逃避が起こりました。しかし、各国中央銀行が緊急資金供給を発表した後、市場が反応し、債券・株式ともに大幅に上昇（債券金利は低下）しました。期を通して、すべての米国債券資産クラスは、継続的な米国消費や堅固な経済成長の下支えを受けてプラスとなりました。

○為替相場

米ドルは対円で下落しました。日銀が2016年4月に追加緩和を見送り、7月もマイナス金利の拡大を見送ったことや、米国の早期利上げ観測の後退、英国のEU離脱懸念などを背景にリスク回避的な円買いが続き、大きく米ドル安円高が進行しました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

主として、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

○コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。利上げ開始後の米国債券市場については、利回り曲線のベアフラット化（短期年限中心の金利上昇）が進むと考えており、債券ポートフォリオにおいては、こうした見通しの下でトータルリターンの向上に寄与する銘柄の選別を重視する方針です。

※国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、資産担保証券、バンクローン、MBS（不動産担保証券）、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF等

○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っております。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券とダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資するファンド・オブ・ファンズであり、期を通じてコア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に維持しました。

○コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

当ファンドでは、ノンコンシューマーABS（資産担保証券）、CLO（ローン担保証券）、非政府系RMBS（住宅ローン担保証券）などの資産分類における価値に着目し、ポートフォリオの配分比率を高めました。実効デュレーションはやや短期化した水準としました。イールドカーブの短期の端の金利上昇および長期の端の金利下落局面でポートフォリオがメリットを享受できるよう、ポートフォリオでは「バーベル型」アプローチによって組成しました。

○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

当期の1万口当り分配金（税込み）は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	当 期	
	2016年3月8日 ～2016年9月7日	
当期分配金（税込み）	(円)	100
対基準価額比率	(%)	1.13
当期の収益	(円)	100
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	37

(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	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	106.77円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	6.51
(d) 分配準備積立金	24.62
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	137.91
(f) 分配金	100.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	37.91

(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

主として、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

○コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。主要先進国の中央銀行が経済刺激策として流動性を供給し続ける中、米国は、引き続き魅力的な投資先となっており、長期的な視点において「リスクオン」の取引が続くと考えます。債券ポートフォリオにおいては、こうした見通しの下でトータルリターンの向上に寄与する銘柄の選別を重視する方針です。

○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	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 3. 8～2016. 9. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	55円	0.612%	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8,965円です。
（投信会社）	(17)	(0.191)	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）	(37)	(0.408)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(1)	(0.014)	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	55	0.616	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2016年3月8日から2016年9月7日まで)

	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)	3,048.334	269,117	1,900.728	169,000

(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。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2016年3月8日から2016年9月7日まで)

当 期				期 付			
買 付	口 数	金 額	平均単価	売 付	口 数	金 額	平均単価
銘 柄	千口	千円	円	銘 柄	千口	千円	円
DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	2,627.806	233,500	88	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	1,900.728	169,000	88

(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期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2016年3月8日から2016年9月7日まで)

決 算 期	当 期			期 付		
	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	31,430	3,750	11.9	—	—	—
コール・ローン	713,368	—	—	—	—	—

(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。

(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。

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT	22,054.63	1,912,224	98.7

(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。

(2) 親投資信託残高

種 類	期 首 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	0	0	1

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,912,224	96.8
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	63,301	3.2
投資信託財産総額	1,975,526	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,975,526,899円
コール・ローン等	63,301,224
投資信託受益証券 (評価額)	1,912,224,675
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	1,000
(B) 負債	38,060,490
未払収益分配金	22,172,617
未払解約金	4,044,150
未払信託報酬	11,765,377
その他未払費用	78,346
(C) 純資産総額 (A - B)	1,937,466,409
元本	2,217,261,723
次期繰越損益金	△ 279,795,314
(D) 受益権総口数	2,217,261,723口
1万口当り基準価額 (C/D)	8,738円

* 期首における元本額は2,097,179,018円、当期中における追加設定元本額は321,078,931円、同解約元本額は200,996,226円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,738円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は279,795,314円です。

■損益の状況

当期 自2016年3月8日 至2016年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	35,518,081円
受取配当金	35,522,612
受取利息	149
支払利息	△ 4,680
(B) 有価証券売買損益	△ 105,159,481
売買益	5,480,526
売買損	△ 110,640,007
(C) 信託報酬等	△ 11,843,909
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 81,485,309
(E) 前期繰越損益金	△ 139,973,685
(F) 追加信託差損益金	△ 36,163,703
(配当等相当額)	(1,445,116)
(売買損益相当額)	(△ 37,608,819)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 257,622,697
(H) 収益分配金	△ 22,172,617
次期繰越損益金 (G + H)	△ 279,795,314
追加信託差損益金	△ 36,163,703
(配当等相当額)	(1,445,116)
(売買損益相当額)	(△ 37,608,819)
分配準備積立金	6,961,465
繰越損益金	△ 250,593,076

(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。

(注3) 収益分配金の計算過程は20ページの「収益分配金の計算過程 (総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	23,674,172円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,445,116
(d) 分配準備積立金	5,459,910
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	30,579,198
(f) 分配金	22,172,617
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	8,406,581
(h) 受益権総口数	2,217,261,723口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	100円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は9月7日現在の基準価額（1万口当り8,738円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

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

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

ダイワ債券コア戦略ファンド

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ-ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド (円ヘッジ・クラス／ノンヘッジ・クラス)

当ファンド（ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ-ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス／ノンヘッジ・クラス）」は、2016年9月7日現在、第1期決算を迎えておりません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））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、当ファンドの決算日（2016年9月7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22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

(2016年3月8日から2016年9月7日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
591 国庫短期証券 2016/5/30	4,500,177		
613 国庫短期証券 2016/9/12	3,790,054		
601 国庫短期証券 2016/7/19	3,150,065		
611 国庫短期証券 2016/9/5	3,010,051		
607 国庫短期証券 2016/8/15	1,980,036		
609 国庫短期証券 2016/8/22	1,940,045		
610 国庫短期証券 2016/8/29	1,920,037		
596 国庫短期証券 2016/6/20	1,780,031		
545 国庫短期証券 2016/7/20	1,470,000		
97 5年国債 0.4% 2016/6/20	1,240,071		

(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9月7日現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンド（10,386,469千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年9月7日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 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
国債証券	千円 5,720,000	千円 5,720,240	%	%	%	%	%
			55.0	—	—	—	55.0

(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9月7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	593 国庫短期証券	—	千円 630,000	千円 630,008	2016/09/12	
	613 国庫短期証券	—	3,790,000	3,790,048	2016/09/12	
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,100,176	2016/09/20	
	615 国庫短期証券	—	200,000	200,007	2016/09/20	
	合 計	銘 柄 数 金 額		5,720,000	5,720,240	
		4銘柄				

(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

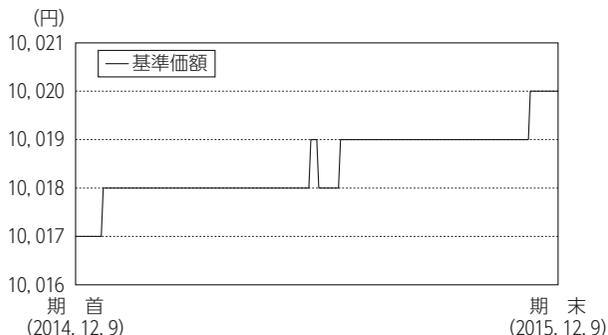
大和投資信託

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。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■売買および取引の状況

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

		買付額	売付額
国	国内	千円	千円
		国債証券	32,338,160

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当		期	
買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
491 国庫短期証券 2015/5/14	1,999,998		
540 国庫短期証券 2015/9/24	1,699,999		
555 国庫短期証券 2015/12/7	1,500,000		
557 国庫短期証券 2015/12/14	1,500,000		
541 国庫短期証券 2015/9/28	1,499,998		
532 国庫短期証券 2015/8/17	1,499,995		
514 国庫短期証券 2015/5/25	1,499,968		
521 国庫短期証券 2015/6/29	1,499,925		
502 国庫短期証券 2015/3/30	1,199,993		
563 国庫短期証券 2016/1/18	1,150,000		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率	5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%	
国債証券	6,435,000	6,437,978	52.7	—	—	—	—	52.7	

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

区分	銘柄	当			期			末		
		年利率	額面金額	評価額	償還年月日					
		%	千円	千円						
国債証券	557 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,000	2015/12/14					
	336 2年国債	0.1000	185,000	185,022	2016/01/15					
	563 国庫短期証券	—	1,150,000	1,150,000	2016/01/18					
	566 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/01					
	567 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/08					
	573 国庫短期証券	—	500,000	500,097	2016/03/07					
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,102,860	2016/09/20					
合計	銘柄数 金額	7銘柄	6,435,000	6,437,978						

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	6,437,978	52.7
コール・ローン等、その他	5,772,311	47.3
投資信託財産総額	12,210,290	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月9日現在

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

* 期首における元本額は11,884,993,463円、当期中における追加設定元本額は8,064,725,261円、同解約元本額は7,763,601,855円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジあり4,998,495円、ダイワ・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジなし2,499,247円、ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンドⅡ (為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし) 999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (毎月分配型) 219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (年2回決算型) 24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (毎月分配型) 848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (年2回決算型) 66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型) 4,995円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型) 4,995円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2015-01 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、ダイワ・ブラジル・リアル債α (毎月分配型) -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。