

★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／海外／株式	
信託期間	約５年間（2015年10月20日～2020年10月16日）	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	当ファンド	イ．ケイマン籍の外国投資信託「UBS（CAY）USTータル・イールド・ファンド（USTータル・イールド・クラス）」（以下「USTータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」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
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券
当ファンドの運用方法	①主として、USTータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）の受益証券への投資を通じて、継続的に株主還元を行なう米国企業の株式に投資することで、信託財産の成長をめざします。 ※当ファンドにおいて、株主還元とは、配当支払いおよび自社株買いをいいます。 ②当ファンドは、USTータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・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、USTータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・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。 ③USTータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・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	当ファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、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。	

ダイワ米国株主還元株ファンド

運用報告書(全体版)
第４期

(決算日 2017年10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、「ダイワ米国株主還元株ファンド」は、このたび第４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/>

設定以来の運用実績

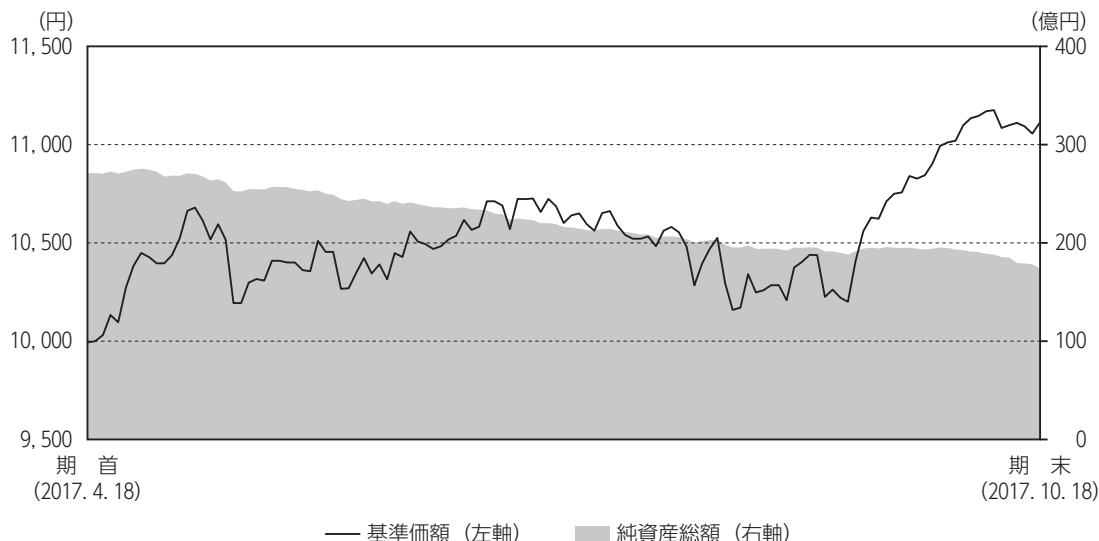
決 算 期	基 準 価 額			M S C I 米国指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2016年 4 月18日)	9,056	0	△ 9.4	9,304	△ 7.0	0.0	98.5	42,712
2 期末 (2016年10月18日)	8,640	0	△ 4.6	9,254	△ 0.5	0.0	98.6	39,287
3 期末 (2017年 4 月18日)	9,994	0	15.7	10,866	17.4	0.1	97.5	27,090
4 期末 (2017年10月18日)	10,814	300	11.2	12,279	13.0	—	98.8	17,406

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。
- (注 2) M S C I 米国指数（配当込み、円換算）は、M S C I Inc. の承諾を得て、M S C I 米国指数（配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。M S C I 米国指数（配当込み、米ドルベース）は、M S C I Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I Inc. に帰属します。またM S C I Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 4) 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 5) 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



(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：9,994円

期 末：10,814円（分配金300円）

騰落率：11.2%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「UBS (CAY) USトータル・イールド・ファンド (USトータル・イールド・クラス)」(以下「USトータル・イールド・ファンド (トータル・イールド・クラス)」といいます。)とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資した結果、USトータル・イールド・ファンド (トータル・イールド・クラス) の上昇が寄与し、基準価額は上昇しました。USトータル・イールド・ファンド (トータル・イールド・クラス) については、米国企業の株式へ投資した結果、株価が上昇したことや米ドルが対円で上昇したことが寄与し、値上がりしました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ米国株主還元株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		M S C I 米国指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2017年 4 月18日	円	%		%	%	%
	9,994	—	10,866	—	0.1	97.5
4 月末	10,428	4.3	11,272	3.7	0.0	98.9
5 月末	10,361	3.7	11,372	4.7	0.0	98.5
6 月末	10,566	5.7	11,530	6.1	0.0	99.2
7 月末	10,540	5.5	11,618	6.9	0.0	98.5
8 月末	10,375	3.8	11,586	6.6	—	99.2
9 月末	11,012	10.2	12,097	11.3	—	99.3
(期末) 2017年10月18日	11,114	11.2	12,279	13.0	—	98.8

(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

(2017. 4. 19 ~ 2017. 10. 18)

■米国株式市況

米国株式市場は上昇しました。

期首より、フランス大統領選挙で親EU（欧州連合）派のマクロン氏勝利が好感されたことや税制改革案への期待などから、米国株式市場は上昇基調となりました。米国トランプ大統領によるロシアへの機密漏えい疑惑などから株価が急落する局面や、ECB（欧州中央銀行）の金融緩和縮小観測の高まり、北朝鮮情勢の緊迫化などを受けて軟調な推移となる場面もありましたが、良好な米国経済指標や米国企業決算などを背景に、主要株価指数が過去最高値を更新する堅調な展開となりました。期末にかけても、税制改革への期待などから上昇基調を強めました。

■米ドル円為替相場

米ドルの対円為替レートは上昇しました。

期首より、フランス大統領選挙でのマクロン氏の勝利などを背景に米ドル高円安となりました。2017年5月半ばには、トランプ大統領に対するロシア疑惑など政治的混乱が嫌気され円高が進行しましたが、6月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）で公表された資産縮小計画を受けた米国金利の上昇や、良好な米国経済指標などが押し上げ材料となり、再び米ドル高円安となりました。7月半ばから9月上旬にかけては、米国のインフレ鈍化や北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりなどから、米ドルは対円で下落基調となりました。期末にかけては、米国で利上げ観測や税制改革への期待などが高まったことから、米ドルは上昇しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。通常の状態では、USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・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。

■USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

米国株式市場では、米国政権による税制改革に注目が集まっており、企業の財務戦略が引き続き重要になると考えています。今後、税制改革の結果として米国の多国籍企業による海外利益の本国還流が活発化した場合には、還流利益の使途として自社株買いを含めた株主還元がこれまで以上に

米国株式市場における重要な投資テーマになると考えられるため、当ファンドは引き続き株主還元の積極性と持続性に重点を置い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、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

ポートフォリオについて

(2017. 4. 19 ~ 2017. 10. 18)

■当ファンド

US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資しました。US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）への投資割合を高位に維持しました。

■US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

現物株ポートフォリオについては、米国の大型・中型株の中から株主還元の積極性や持続性が優れた企業を選定し、セクター分散等を勘案した上で約100銘柄に等金額投資をして運用を行ないました。期中の株式組入比率はおおむね90%以上の高位を維持しました。業種構成は、引き続き配当利回りの高い金融や自社株買い比率の高い一般消費財・サービス、資本財・サービスの組み入れが高位となりました。一方で、株主還元比率が低いエネルギー、電気通信サービス、公益事業は非保有もしくは低位組み入れとなりました。個別銘柄の組入比率は、等金額投資の結果すべての保有銘柄でおおむね1%前後となりました。

■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、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

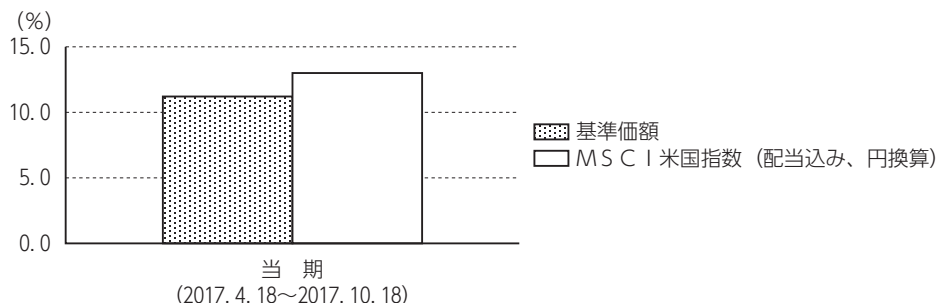
当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。

当期のパフォーマンスは、参考指数（MSCI米国指数（配当込み、円換算））のパフォーマンスを下回る結果となりました。

業種別では、資本財・サービスのオーバーウエート、エネルギーのアンダーウエートなどはプラスに寄与しました。一方、一般消費財・サービスのオーバーウエート、情報技術のアンダーウエートなどはマイナスとなりました。

個別銘柄では、金融サービス持株会社のT. ロウ・プライス・グループ、自動車部品メーカーのリアなどの株価が上昇しプラスに寄与した一方で、医療サービスを提供するカーディナルヘルス、薬剤給付サービスを提供するエクスプレス・スクリプツ・ホールディング、マルチメディア会社のCBSなどは株価が下落し、パフォーマンスにマイナスとなりました。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は300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	
	2017年4月19日 ～2017年10月18日	
当期分配金（税込み）	(円)	300
対基準価額比率	(%)	2.70
当期の収益	(円)	300
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	870

(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	309.37円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	43.35
(c) 収益調整金	165.64
(d) 分配準備積立金	651.95
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,170.33
(f) 分配金	300.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	870.33

(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

引き続き、USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）とダイワ・マネアセット・マザーファンドに投資します。通常の状態、USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・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。

■USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

米国は安定した雇用・消費の増加を支えに景気拡大が続いており、主要株価指数は良好な企業業績と緩和的な金融政策を受け、史上最高値を更新しています。当期においては、利益成長率の高い銘柄に注目が集まる展開となりましたが、トランプ政権による税制改革などを考慮すると、自社株買いを含めた株主還元は米国株式市場において引き続き重要な投資テーマであると考えられるため、当ファンドはこれまでと同様に株主還元の積極性と持続性に重点を置いた投資運用をしていく方針です。

■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、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行なう方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 4. 19～2017. 10. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	70円	0. 663%	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, 538円です。
(投 信 会 社)	(23)	(0. 217)	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)	(46)	(0. 433)	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	70	0. 667	

- (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。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。
- (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

(2017年 4月19日から2017年10月18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)	10,928.91	1,036,655	125,584.071	12,130,000

(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

(2017年 4月19日から2017年10月18日まで)

当 期				期 末			
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
UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	3,568.454	330,000	92	UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	125,584.071	12,130,000	96

(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

(2017年 4月19日から2017年10月18日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利 害 関係人との 取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利 害 関係人との 取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	9,000	1,940	21.6	—	—	—
コール・ローン	1,582,656	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.3%
※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・ファンズが組み入れた邦貨建ファン
ドの明細

ファンド名	当 期 末		
	口 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) UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT	172,066.734	17,199,102	98.8

(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	
	口 数	口 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	36,730	36,730	36,766

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ米国株主還元株ファンド

■投資信託財産の構成

項 目	2017年10月18日現在	
	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	17,199,102	95.0
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	36,766	0.2
コール・ローン等、その他	877,463	4.8
投資信託財産総額	18,113,333	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10月18日現在	
項 目	当 期 末
(A) 資産	18,113,333,211円
コール・ローン等	877,463,768
投資信託受益証券 (評価額)	17,199,102,500
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	36,766,943
(B) 負債	706,997,722
未払収益分配金	482,904,252
未払解約金	74,686,953
未払信託報酬	148,506,704
その他未払費用	899,813
(C) 純資産総額 (A－B)	17,406,335,489
元本	16,096,808,429
次期繰越損益金	1,309,527,060
(D) 受益権総口数	16,096,808,429口
1万口当り基準価額 (C／D)	10,814円

* 期首における元本額は27,107,751,884円、当期中における追加設定元本額は1,005,536,654円、同解約元本額は12,016,480,109円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,814円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 4月19日 至 2017年10月18日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	540,798,496円
受取配当金	540,912,185
受取利息	345
支払利息	△ 114,034
(B) 有価証券売買損益	1,347,571,336
売買益	1,784,155,424
売買損	△ 436,584,088
(C) 信託報酬等	△ 149,412,325
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	1,738,957,507
(E) 前期繰越損益金	△ 121,732,042
(F) 追加信託差損益金	175,205,847
(配当等相当額)	(266,634,276)
(売買損益相当額)	(△ 91,428,429)
(G) 合計 (D＋E＋F)	1,792,431,312
(H) 収益分配金	△ 482,904,252
次期繰越損益金 (G＋H)	1,309,527,060
追加信託差損益金	175,205,847
(配当等相当額)	(266,634,276)
(売買損益相当額)	(△ 91,428,429)
分配準備積立金	1,134,321,213

(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「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	497,997,719円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	69,791,752
(c) 収益調整金	266,634,276
(d) 分配準備積立金	1,049,435,994
(e) 当期分配対象額 (a＋b＋c＋d)	1,883,859,741
(f) 分配金	482,904,252
(g) 翌期繰越分配対象額 (e－f)	1,400,955,489
(h) 受益権総口数	16,096,808,429口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	300円

●〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は、10月18日現在の基準価額（1万口当り10,814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。

UBS（CAY）US トータル・イールド・ファンド
(US トータル・イールド・クラス)

当ファンド（ダイワ米国株主還元株ファンド）はケイマン籍の外国投資信託「UBS（CAY）US トータル・イールド・ファンド（US トータル・イールド・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）2017年10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
2016年 9 月30日

資産		
流動資産		
金融資産（損益通算後の評価額）	¥	40,087,846,744
現金および現金同等物		337,998,062
未収：		
配当		21,267,874
資産合計		40,447,112,680
負債		
流動負債		
金融負債（損益通算後の評価額）		12,426,232
保管会社に対する支払		19,507
未払：		
投資運用会社報酬		56,830,913
管理会社報酬		37,920,097
保管会社報酬		8,124,080
受託会社報酬		5,279,703
専門家報酬		4,758,010
名義書換代理人報酬		4,405,231
負債（償却可能受益証券の保有者に帰属する純資産を除く）		129,763,773
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	¥	40,317,348,907

損益計算書

2015年10月20日～2016年 9 月30日

収益

受取利息	¥	336, 568
配当収益		818, 798, 188
損益通算後ならびに外国為替取引後の金融資産および負債の評価額の純実現（損失）		(3, 985, 101, 727)
損益通算後ならびに外国為替換算後の金融資産および負債の評価損の純変動		(3, 084, 257, 089)
収益合計		<u>(6, 250, 224, 060)</u>

費用

投資運用会社報酬		226, 583, 257
取引費用		52, 324, 237
管理会社報酬		37, 920, 097
専門家報酬		9, 349, 743
保管会社報酬		8, 124, 080
受託会社報酬		6, 515, 454
名義書換代理人報酬		4, 405, 231
その他費用		37, 729
費用合計		<u>345, 259, 828</u>

営業（損失）

(6, 595, 483, 888)

金融費用

償却可能受益証券の保有者への分配	(2, 875, 605, 192)
------------------	--------------------

分配後および税引前損失

(9, 471, 089, 080)

源泉徴収税	(215, 567, 205)
-------	-----------------

業務活動の結果生じた償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産の減少額

¥ (9, 686, 656, 285)

投資明細表書
2016年 9 月30日

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
	普通株 (99.4%)		
	バミューダ (1.0%)		
	保険 (1.0%)		
34,350	RenaissanceRe Holdings, Ltd.	1.0	¥ 417,970,873
	バミューダ合計		417,970,873
	アイルランド (2.0%)		
	コンピューター (1.1%)		
34,327	Accenture Plc. Class A	1.1	424,678,018
	保険 (0.9%)		
110,700	XL Group, Ltd.	0.9	376,993,486
	アイルランド合計		801,671,504
	スイス (1.0%)		
	電機 (1.0%)		
64,400	TE Connectivity, Ltd.	1.0	419,851,972
	スイス合計		419,851,972
	英国 (2.0%)		
	アパレル (1.0%)		
80,300	Michael Kors Holdings, Ltd.	1.0	380,476,596
	保険 (1.0%)		
36,100	Aon Plc.	1.0	411,225,916
	英国合計		791,702,512
	米国 (93.4%)		
	航空宇宙・防衛 (5.0%)		
30,564	Boeing Co.	1.0	407,743,651
26,409	General Dynamics Corp.	1.0	414,945,525
18,769	Northrop Grumman Corp.	1.0	406,642,515
28,132	Raytheon Co.	1.0	387,805,363
39,620	United Technologies Corp.	1.0	407,631,312
			2,024,768,366
	農業 (1.0%)		
92,829	Archer-Daniels-Midland Co.	1.0	396,411,852
	航空 (1.0%)		
105,177	Southwest Airlines Co.	1.0	414,207,616
	アパレル (2.8%)		
41,462	Carter's, Inc.	0.9	364,064,884
72,380	NIKE, Inc. Class B	1.0	385,901,362
67,214	VF Corp.	0.9	381,500,153
			1,131,466,399
	自動車部品 (1.1%)		
34,740	Lear Corp.	1.1	426,445,417

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合(%)	評価額
銀行 (2.0%)			
54,812	Capital One Financial Corp.	1.0	398,695,077
43,675	PNC Financial Services Group, Inc.	1.0	398,445,437
			797,140,514
飲料 (2.0%)			
86,163	Brown-Forman Corp. Class B	1.0	413,928,042
26,617	Monster Beverage Corp.	1.0	395,707,335
			809,635,377
バイオテクノロジー (2.9%)			
13,264	Biogen, Inc.	1.0	420,455,301
50,318	Gilead Sciences, Inc.	1.0	403,152,175
31,101	United Therapeutics Corp.	0.9	371,886,194
			1,195,493,670
化学 (1.0%)			
51,500	LyondellBasell Industries NV Class A	1.0	420,653,788
商業サービス (6.0%)			
45,366	Automatic Data Processing, Inc.	1.0	405,189,732
34,507	Cintas Corp.	1.0	393,463,954
56,794	ManpowerGroup, Inc.	1.0	415,584,912
48,574	Morningstar, Inc.	1.0	389,916,923
100,768	Robert Half International, Inc.	1.0	386,333,711
189,267	Western Union Co.	1.0	399,038,667
			2,389,527,899
コンピューター (4.0%)			
64,753	Amdocs, Ltd.	0.9	379,334,737
38,081	Apple, Inc.	1.1	435,951,593
149,929	Cadence Design Systems, Inc.	1.0	387,610,753
33,073	DST Systems, Inc.	1.0	394,930,267
			1,597,827,350
化粧品・パーソナルケア (1.0%)			
44,402	Estee Lauder Cos, Inc. Class A	1.0	398,198,388
流通・卸売 (1.0%)			
17,101	WW Grainger, Inc.	1.0	389,362,786
総合金融サービス (7.1%)			
60,309	American Express Co.	1.0	391,104,496
58,440	CBOE Holdings, Inc.	1.0	383,777,532
69,466	Discover Financial Services	1.0	397,799,524
114,072	Franklin Resources, Inc.	1.0	410,886,884
41,934	Mastercard, Inc. Class A	1.1	432,160,852
55,431	T Rowe Price Group, Inc.	0.9	373,279,136
50,559	Visa, Inc. Class A	1.1	423,412,176
			2,812,420,600
電機 (2.0%)			
94,290	Avnet, Inc.	1.0	392,052,239
175,483	Corning, Inc.	1.0	420,267,255
			812,319,494

ダイワ米国株主還元株ファンド

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合(%)	評価額
食品 (5.0%)			
31,757	Lancaster Colony Corp.	1.1	424,784,603
93,307	Mondelez International, Inc. Class A	1.0	414,799,385
75,517	Sysco Corp.	0.9	374,790,685
54,350	Tyson Foods, Inc. Class A	1.0	410,965,209
137,318	Whole Foods Market, Inc.	1.0	394,221,122
			2,019,561,004
ヘルスケア製品 (2.1%)			
66,531	DENTSPLY SIRONA, Inc.	1.0	400,395,455
41,945	Varian Medical Systems, Inc.	1.1	422,759,680
			823,155,135
住宅建設 (1.0%)			
2,359	NVR, Inc.	1.0	391,738,918
保険 (9.7%)			
57,788	Allstate Corp.	1.0	404,834,559
63,590	American International Group, Inc.	1.0	382,116,441
44,598	Assurant, Inc.	1.0	416,620,960
72,700	Axis Capital Holdings, Ltd.	1.0	399,975,577
57,158	Endurance Specialty Holdings, Ltd.	0.9	378,831,455
21,222	Everest Re Group, Ltd.	1.0	408,254,227
49,481	Hanover Insurance Group, Inc.	0.9	377,906,493
93,388	Hartford Financial Services Group, Inc.	1.0	404,945,983
32,627	Travelers Cos, Inc.	0.9	378,470,117
4,837	White Mountains Insurance Group, Ltd.	1.0	406,549,599
			3,958,505,411
インターネット (1.0%)			
32,064	F5 Networks, Inc.	1.0	404,701,205
総合機械 (1.1%)			
34,313	Cummins, Inc.	1.1	445,283,557
メディア (3.8%)			
75,656	CBS Corp. Class B	1.0	419,379,818
22,261	FactSet Research Systems, Inc.	0.9	365,415,565
50,997	Time Warner, Inc.	1.0	411,122,845
40,356	Walt Disney Co.	0.9	379,486,342
			1,575,404,570
その他製造 (1.0%)			
21,996	3M Co.	1.0	392,539,089
石油・ガス (1.0%)			
71,509	Valero Energy Corp.	1.0	383,792,012
医薬品 (2.8%)			
46,036	AmerisourceBergen Corp. Class A	0.9	376,583,067
33,218	Johnson & Johnson	1.0	397,368,139
109,409	Pfizer, Inc.	0.9	375,255,964
			1,149,207,170

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合(%)	評価額
小売 (12.7%)			
215,668	American Eagle Outfitters, Inc.	1.0	390,055,605
106,518	Best Buy Co., Inc.	1.0	411,830,289
81,327	Big Lots, Inc.	1.0	393,248,872
41,167	CVS Health Corp.	0.9	370,979,391
60,803	Foot Locker, Inc.	1.0	416,966,644
54,721	Lowe's Cos, Inc.	1.0	400,138,858
32,597	McDonald's Corp.	0.9	380,795,877
18,399	Panera Bread Co. Class A	0.9	362,797,376
67,931	Ross Stores, Inc.	1.1	442,321,794
55,433	Target Corp.	1.0	385,529,866
50,062	TJX Cos, Inc.	0.9	379,099,328
55,865	Wal-Mart Stores, Inc.	1.0	407,995,036
43,794	Yum! Brands, Inc.	1.0	402,724,126
			5,144,483,062
半導体 (5.2%)			
65,046	Analog Devices, Inc.	1.1	424,524,612
136,081	Applied Materials, Inc.	1.0	415,474,301
64,892	QUALCOMM, Inc.	1.1	450,133,244
190,953	Teradyne, Inc.	1.0	417,289,333
56,905	Texas Instruments, Inc.	1.0	404,411,176
			2,111,832,666
ソフトウェア (5.0%)			
121,573	CA, Inc.	1.0	407,250,843
35,948	Intuit, Inc.	1.0	400,466,558
69,869	Microsoft Corp.	1.0	407,536,366
46,183	MSCI, Inc. Class A	1.0	392,563,994
98,399	Oracle Corp.	1.0	391,400,631
			1,999,218,392
運輸 (2.1%)			
78,045	Expeditors International of Washington, Inc.	1.0	407,174,242
24,304	FedEx Corp.	1.1	429,912,722
			837,086,964
米国合計			37,652,388,671
普通株合計 (簿価 ¥43,173,047,083)			¥ 40,083,585,532

ダイワ米国株主還元株ファンド

ＵＳ トータル・イールド・クラスの2016年 9月30日時点の売建オプション残高（純資産の -0.0%）

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - Accenture Plc.	¥ 115	2016年10月13日	930	¥ (87, 449)	¥ (693, 850)
Call - American Eagle Outfitters, Inc.	20	2016年10月13日	5, 820	(64, 898)	(4, 214)
Call - American Express Co.	67	2016年10月13日	1, 630	(54, 283)	(20, 876)
Call - Analog Devices, Inc.	63	2016年10月13日	1, 760	(66, 507)	(329, 145)
Call - Apple, Inc.	113	2016年10月13日	1, 030	(69, 223)	(134, 551)
Call - Applied Materials, Inc.	31	2016年10月13日	3, 690	(97, 244)	(48, 670)
Call - Archer-Daniels-Midland Co.	44	2016年10月13日	2, 520	(72, 205)	(16, 571)
Call - Avnet, Inc.	41	2016年10月13日	2, 560	(121, 327)	(234, 328)
Call - Best Buy Co., Inc.	40	2016年10月13日	2, 890	(71, 200)	(22, 997)
Call - Big Lots., Inc.	51	2016年10月13日	2, 200	(93, 250)	(32, 223)
Call - Biogen, Inc.	312	2016年10月13日	360	(223, 254)	(336, 341)
Call - Boeing Co.	135	2016年10月13日	830	(58, 470)	(45, 527)
Call - CA, Inc.	34	2016年10月13日	3, 300	(48, 491)	(74, 578)
Call - Cadence Design Systems, Inc.	25	2016年10月13日	4, 070	(102, 392)	(229, 259)
Call - Capital One Financial Corp.	73	2016年10月13日	1, 480	(139, 422)	(63, 880)
Call - Carter's, Inc.	102	2016年10月13日	1, 120	(63, 867)	(427)
Call - CBOE Holdings, Inc.	70	2016年10月13日	1, 580	(71, 668)	(635)
Call - CBS Corp.	53	2016年10月13日	2, 050	(121, 896)	(464, 551)
Call - Cintas Corp.	116	2016年10月13日	930	(122, 591)	(18, 045)
Call - Corning, Inc.	23	2016年10月13日	4, 760	(42, 754)	(226, 367)
Call - Cummins, Inc.	123	2016年10月13日	930	(90, 413)	(532, 702)
Call - DST Systems, Inc.	124	2016年10月13日	890	(112, 116)	(46, 942)
Call - F5 Networks, Inc.	125	2016年10月13日	870	(68, 622)	(242, 108)
Call - FactSet Research Systems, Inc.	181	2016年10月13日	600	(136, 975)	(49)
Call - FedEx Corp.	168	2016年10月13日	660	(102, 924)	(455, 479)
Call - Franklin Resources, Inc.	36	2016年10月13日	3, 090	(171, 232)	(136, 011)
Call - Gilead Sciences, Inc.	81	2016年10月13日	1, 360	(84, 619)	(49, 727)
Call - Hartford Financial Services Group, Inc.	44	2016年10月13日	2, 530	(46, 768)	(57, 377)
Call - Lowe's Cos, Inc.	73	2016年10月13日	1, 480	(107, 285)	(69, 662)
Call - LyondellBasell Industries NV	78	2016年10月13日	1, 390	(106, 826)	(453, 190)
Call - ManpowerGroup, Inc.	72	2016年10月13日	1, 540	(146, 538)	(287, 484)
Call - Michael Kors Holdings, Ltd.	51	2016年10月13日	2, 180	(85, 719)	(11, 217)
Call - Mondelez International, Inc.	45	2016年10月13日	2, 530	(103, 903)	(111, 562)
Call - Monster Beverage Corp.	148	2016年10月13日	720	(140, 886)	(130, 040)
Call - Morningstar, Inc.	83	2016年10月13日	1, 310	(71, 322)	(18, 742)
Call - MSCI, Inc.	89	2016年10月13日	1, 250	(43, 876)	(9, 404)
Call - NIKE, Inc.	57	2016年10月13日	1, 960	(188, 526)	(1, 932)
Call - Oracle Corp.	41	2016年10月13日	2, 670	(152, 487)	(374)
Call - Panera Bread Co.	214	2016年10月13日	490	(118, 132)	(2, 103)
Call - PNC Financial Services Group, Inc.	92	2016年10月13日	1, 180	(108, 991)	(42, 960)
Call - QUALCOMM, Inc.	64	2016年10月13日	1, 760	(57, 479)	(762, 440)
Call - Robert Half International, Inc.	39	2016年10月13日	2, 730	(141, 854)	(255, 367)
Call - Southwest Airlines Co.	39	2016年10月13日	2, 850	(117, 190)	(210, 630)
Call - T Rowe Price Group, Inc.	69	2016年10月13日	1, 500	(86, 724)	(41, 308)
Call - TE Connectivity, Ltd.	64	2016年10月13日	1, 740	(48, 362)	(229, 314)
Call - Teradyne, Inc.	21	2016年10月13日	5, 180	(182, 192)	(446, 722)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - Time Warner, Inc.	80	2016年10月13日	1,380	(51,371)	(104,131)
Call - United Therapeutics Corp.	130	2016年10月13日	840	(100,376)	(11,518)
Call - Valero Energy Corp.	59	2016年10月13日	1,940	(58,282)	(2,495)
Call - VF Corp.	60	2016年10月13日	1,820	(128,342)	(7,931)
Call - Whole Foods Market, Inc.	29	2016年10月13日	3,720	(181,093)	(139,038)
Call - WW Grainger, Inc.	229	2016年10月13日	460	(113,846)	(85,588)
Call - Yum! Brands, Inc.	89	2016年10月13日	1,180	(199,762)	(406,625)
				¥ (5,447,424)	¥ (8,359,207)

B R L オーバーレイ&カバードコール・クラスの2016年9月30日時点の売建オプション残高（純資産の-0.0%）

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - OTC Brazilian Real versus Japanese Yen	¥ 31	2016年10月13日	4,770,000	¥ (2,587,007)	¥ (2,161,934)

U S Dカバードコール・クラスの2016年9月30日時点の売建オプション残高（純資産の-0.0%）

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - OTC United States Dollar versus Japanese Yen	¥ 102	2016年10月13日	4,490,000	¥ (6,590,934)	¥ (1,702,776)

B R L オーバーレイ&カバードコール・クラスの2016年9月30日時点の為替先渡契約（純資産の0.0%）

買い	カウンターパーティー	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益 / (損)
B R L	Credit Suisse AG	9,530,000	2016年10月20日	U S D	2,879,154	¥ 4,261,212	¥ (202,315)	¥ 4,058,897
						¥ 4,261,212	¥ (202,315)	¥ 4,058,897

通貨の略称：

B R L	-	ブラジル・レアル
J P Y	-	日本円
U S D	-	米ドル

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（ダイワ米国株主還元株ファンド）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（2016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（2017年10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21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

(2017年4月19日から2017年10月18日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
669 国庫短期証券 2017/6/12	3,020,099		
650 国庫短期証券 2017/6/12	1,240,022		
660 国庫短期証券 2017/5/1	1,210,019		
644 国庫短期証券 2017/5/12	990,010		
665 国庫短期証券 2017/5/22	680,024		
659 国庫短期証券 2017/4/24	520,003		
671 国庫短期証券 2017/6/19	450,004		
679 国庫短期証券 2017/7/31	350,003		
661 国庫短期証券 2017/5/8	140,004		
666 国庫短期証券 2017/5/29	100,005		

(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

2017年10月18日現在における該当事項はありません。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第5期（決算日 2016年12月9日）

（計算期間 2015年12月10日～2016年12月9日）

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第5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

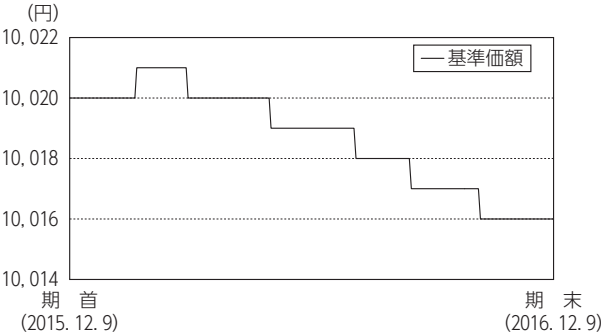
大和投資信託

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 組入比率
	円	騰 落 率 %	
(期首) 2015年12月9日	10,020	—	52.7
12月末	10,020	0.0	52.0
2016年1月末	10,020	0.0	61.6
2月末	10,021	0.0	48.5
3月末	10,020	0.0	32.1
4月末	10,020	0.0	24.5
5月末	10,019	△ 0.0	10.5
6月末	10,019	△ 0.0	10.5
7月末	10,018	△ 0.0	19.3
8月末	10,017	△ 0.0	46.5
9月末	10,017	△ 0.0	26.1
10月末	10,016	△ 0.0	3.4
11月末	10,016	△ 0.0	26.7
(期末) 2016年12月9日	10,016	△ 0.0	28.2

(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。

《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：10,020円 期末：10,016円 騰落率：△0.0%
【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
○国内短期金融市況
期首より、日銀は量的・質的金融緩和を継続し、2016年1月にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を、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低下しました。
- ◆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、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
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を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 48,041,830	千円 — (51,515,000)

(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。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月10日から2016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
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		
629 国庫短期証券 2016/11/28	2,440,076		
586 国庫短期証券 2016/5/12	2,000,342		
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		
632 国庫短期証券 2016/12/12	1,890,066		

(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 区 分	当		期			末		
	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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満	%
国債証券	2,960,000	2,960,056	28.2	—	—	—	—	28.2

(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。
(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

当		期		末	
区 分	銘 柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	632 国庫短期証券	— %	千円 1,890,000	千円 1,890,015	2016/12/12
	634 国庫短期証券	—	320,000	320,006	2016/12/19
	635 国庫短期証券	—	750,000	750,034	2016/12/26
合計	銘柄数	3銘柄			
	金 額		2,960,000	2,960,056	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項 目	当	期	末
	評 価 額	比	率
	千円		%
公社債	2,960,056		27.4
コール・ローン等、その他	7,832,675		72.6
投資信託財産総額	10,792,732		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12月 9 日現在		
項 目	当 期 末	
(A) 資産	10,792,732,361円	
コール・ローン等	7,832,629,033	
公社債（評価額）	2,960,056,480	
その他未収収益	46,848	
(B) 負債	300,005,700	
未払金	300,005,700	
(C) 純資産総額（A－B）	10,492,726,661	
元本	10,476,400,958	
次期繰越損益金	16,325,703	
(D) 受益権総口数	10,476,400,958口	
1万口当り基準価額（C／D）	10,016円	

* 期首における元本額は12,186,116,869円、当期中における追加設定元本額は1,736,323,360円、同解約元本額は3,446,039,271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・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／N B・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／N B・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・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－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39,455,979円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 3－1,078,302,562円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 7－1,257,987,220円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 5－2,095,808,384円、ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース5,990,216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1,397,544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・レアル・コース3,994,008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1,597,623円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジあり40,885円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジなし100,789円、ダイワ／N B・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／N B・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／N B・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／N B・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、ダイワ新興国ハインカム・プラス－インカムチェンジ（積立型）－1,527,685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12－1,088,870,549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10,016円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月10日 至2016年12月 9 日		
項 目	当 期	
(A) 配当等収益	△	1,082,398円
受取利息		1,776,408
その他収益金		46,848
支払利息	△	2,905,654
(B) 有価証券売買損益	△	3,128,171
売買益		40
売買損	△	3,128,211
(C) その他費用	△	111,607
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△	4,322,176
(E) 前期繰越損益金		24,173,441
(F) 解約差損益金	△	6,316,919
(G) 追加信託差損益金		2,791,357
(H) 合計（D＋E＋F＋G）		16,325,703
次期繰越損益金（H）		16,325,703

（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。