

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	約4年1カ月間（2016年2月1日～2020年2月18日）	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	為替ヘッジあり	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」（以下「インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」といいます。）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
	為替ヘッジなし	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）」（以下「インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）」といいます。）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	為替ヘッジあり	①主として、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替ヘッジを行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。 ②当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）では、「投資対象とする資産の通貨売り／米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り／日本円買い」の為替取引を行ない、為替変動リスクの低減をめざします。
	為替ヘッジなし	①主として、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。 ②当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
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モディティ・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、信託財産の成長に資することを目的に、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。	

# ダイワ世界インカム・ハンター （年2回決算型） 為替ヘッジあり／為替ヘッジなし

## 運用報告書（全体版）

### 第1期

（決算日 2016年8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、「ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジあり／為替ヘッジなし」は、このたび、第1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/> <5675>

<5676>

★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 中 率
1 期末 (2016年 8 月18日)	円 10,646	円 10	% 6.6	% 0.0	% 98.2	百万円 101

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

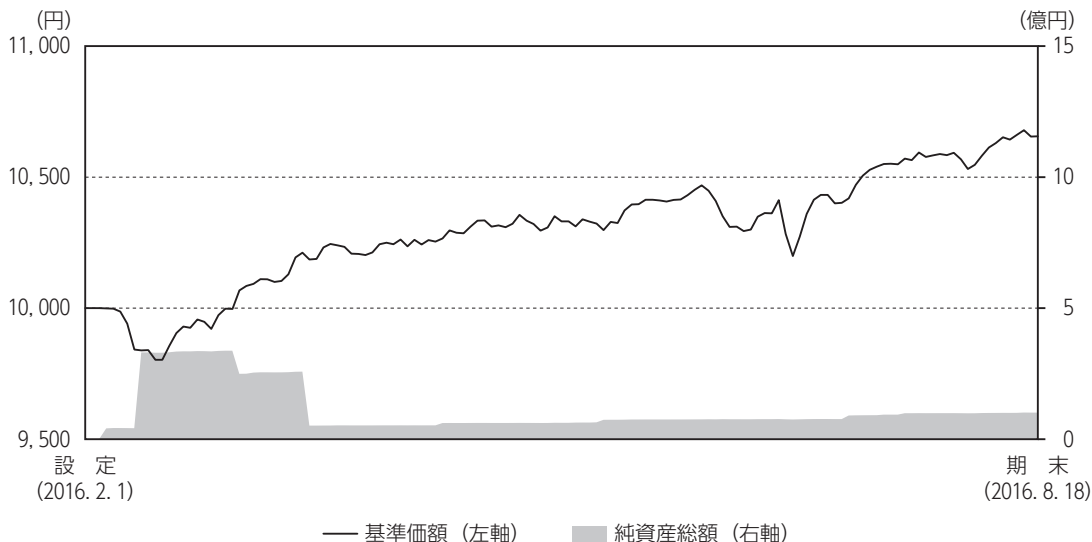
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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

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

## 《運用経過》

### 基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

### ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,646円（分配金10円）

騰落率：6.6%（分配金込み）

### ■ 基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）（以下、「インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」といいます。）で保有している株式やハイ・イールド債券の上昇がプラス要因となり、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。

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）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 率 組 入 比
	円	騰 落 率 %		
(設定)2016年2月1日	10,000	—	—	—
2月末	9,998	△ 0.0	0.0	99.4
3月末	10,244	2.4	0.2	99.6
4月末	10,356	3.6	0.0	99.4
5月末	10,414	4.1	0.0	98.6
6月末	10,360	3.6	0.0	98.9
7月末	10,584	5.8	0.0	99.5
(期末)2016年8月18日	10,656	6.6	0.0	98.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

## 投資環境について

### ○海外金融市況

海外金融市場では、多くの資産が上昇しました。

株式市場では、2016年6月に行なわれた英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票で市場予想に反して離脱派が多数となったことを受けて調整する局面がありましたが、原油価格が上昇したことや、堅調な経済指標、企業業績の発表などを背景に上昇しました。

債券市場では、米国の早期利上げ観測が後退したこと、英国のEU離脱をめぐる不透明感、先進諸国の緩和的な金融政策などを背景に債券価格は上昇しました（利回りは低下）。また、原油価格が上昇したことなどを受けてハイ・イールド債も堅調に推移しました。

非伝統的高利回り資産（※）では、米国の住宅市場が改善していることなどが支援材料となり、リート、優先出資証券、CMB S（商業用不動産担保証券）、ノンエージェンシーMB S（政府関連機関の保証がつかないMB S（住宅ローン担保証券））を中心に上昇しました。

※リート、優先出資証券、ノンエージェンシーMB Sなど。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

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

### ○インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）

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

株式については、これまで堅調に推移してきた生活必需品や公益事業セクターの利益確定の売却などを行なうなど、株式のリスクを引き下げました。

債券では、債券価格の上昇余地が限定的であると考えていることから、比較的デュレーションを短めに維持しました。ハイ・イールド債については、スプレッド（米国国債との利回り格差）が縮小する中、一部利益確定の売りを行ないました。

利回りの獲得や分散投資の観点から魅力的な資産と考えている非伝統的高利回り資産では、価格の変動度合いが低く相対的に高い利回りが見込める信用格付けの高いノンエージェンシーMB Sや

## 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

CMB Sなどを選好しました。また、株式の価格上昇がある程度限られると思われることやボラティリティの高止まりなどを踏まえ、株式のカバード・コール戦略によりインカム収益の積み上げを図りました。

また、原資産通貨売り／円買いの為替取引を行ないました。

### ○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないました。

## ベンチマークとの差異について

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

## 分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は10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2月1日 ～2016年8月18日	
当期分配金（税込み）	(円)	10
対基準価額比率	(%)	0.09
当期の収益	(円)	10
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	654

(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	188.81円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	361.75
(c) 収益調整金	114.03
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	664.61
(f) 分配金	10.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	654.61

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

### ○インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。

好調な米国の住宅市場が、引き続きCMB SおよびノンエージェンシーMBSに好ましいファンダメンタル要因となっています。これらの商品は、魅力的な分散特性を備えており、引き続き当ファンドの選好分野となっています。また、株式市場の上昇余地はある程度限られる上、ボラティリティが高止まりしている状況を踏まえ、カバード・コール戦略は魅力的な手段だと考えます。引き続きリスクを抑えつつ、クーポン、配当、カバード・コールによるインカム収入の積み上げを図るとともに、キャピタルゲインを求めた運用を行なう方針です。

また、原資産通貨売り／円買いの為替取引を行ないます。

### ○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 2. 1～2016. 8. 18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	68円	0.664%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は10,299円です。</b>
（投信会社）	(21)	(0.207)	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)	(0.443)	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）	(2)	(0.015)	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	69	0.668	

(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

(1) 投資信託受益証券

(2016年2月1日から2016年8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)	4,322.689	383,534	3,257.375	295,000

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。

(注2) 金額は受渡し代金。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年2月1日から2016年8月18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 アセット・ マザーファンド	340	341	299	300

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2016年2月1日から2016年8月18日まで)

当 期				期			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	4,288.188	380,395	88	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	3,257.375	295,000	90

(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2月1日から2016年8月18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	%
公社債	25,301	2,790	11.0	—	—	—
コール・ローン	673,454	—	—	—	—	—

(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。

■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

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	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) 単位未満切捨て。

■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) MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS	1,065.313	99,570	98.2

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期		末
	□ 数	評価額	額
	千口	千円	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	40		40

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年8月18日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	率
	千円	%	%
投資信託受益証券	99,570	97.4	
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	40	0.0	
コール・ローン等、その他	2,646	2.6	
投資信託財産総額	102,257	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8月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	102,257,940円
コール・ローン等	2,646,358
投資信託受益証券 (評価額)	99,570,624
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	40,958
(B) 負債	842,419
未払収益分配金	95,262
未払信託報酬	742,315
その他未払費用	4,842
(C) 純資産総額 (A - B)	101,415,521
元本	95,262,382
次期繰越損益金	6,153,139
(D) 受益権総口数	95,262,382口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,646円

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は385,770,662円、同解約元本額は291,508,280円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,646円です。

■損益の状況

当期 自2016年2月1日 至2016年8月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,054,927円
受取配当金	2,055,097
受取利息	155
支払利息	△ 325
(B) 有価証券売買損益	3,937,153
売買益	5,338,577
売買損	△ 1,401,424
(C) 信託報酬等	△ 747,161
(D) 当期損益金 (A + B + C)	5,244,919
(E) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	( 1,086,321)
(売買損益相当額)	(△ 82,839)
(F) 合計 (D + E)	6,248,401
(G) 収益分配金	△ 95,262
次期繰越損益金 (F + G)	6,153,139
追加信託差損益金	1,003,482
(配当等相当額)	( 1,086,321)
(売買損益相当額)	(△ 82,839)
分配準備積立金	5,149,657

(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	1,798,726円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	3,446,193
(c) 収益調整金	1,086,321
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	6,331,240
(f) 分配金	95,262
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,235,978
(h) 受益権総口数	95,262,382口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	10円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は8月18日現在の基準価額（1万口当り10,646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。

★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	
	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率				
1 期末(2016年 8 月18日)	円 9,154	円 0	% △ 8.5	% 0.0	% 99.1	百万円 176

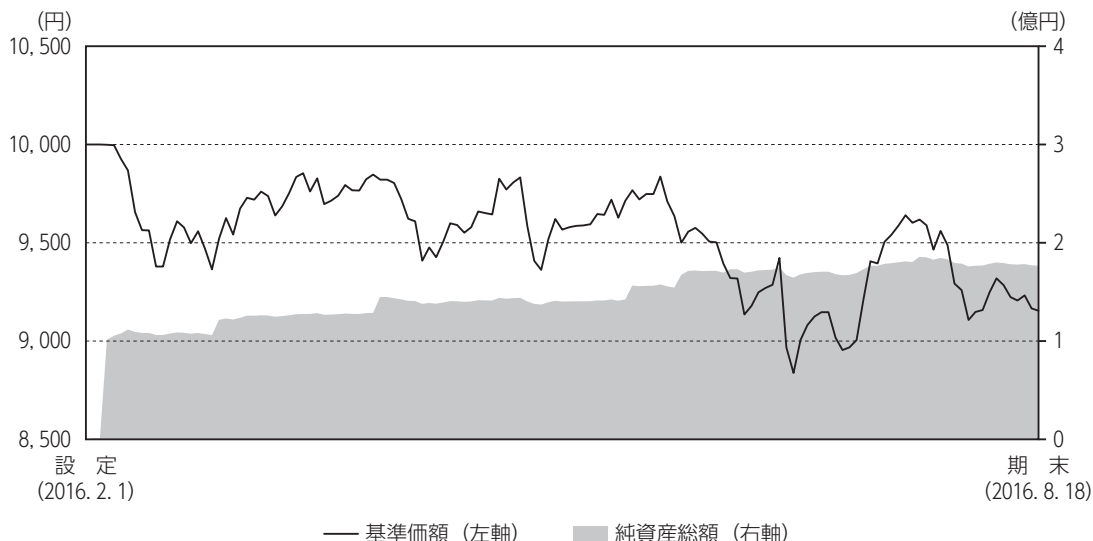
(注1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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、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



#### ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期末：9,154円

騰落率：△8.5%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）（以下、「インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）」といいます。）で保有している株式やハイ・イールド債券の上昇はプラス要因となりましたが、為替相場で米ドルなどの主要通貨が対円で軟調に推移したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 率 組 入 比
	円	騰 落 率 %		
(設定)2016年2月1日	10,000	—	—	—
2月末	9,626	△ 3.7	0.0	99.3
3月末	9,821	△ 1.8	0.0	88.0
4月末	9,833	△ 1.7	0.0	99.5
5月末	9,748	△ 2.5	0.0	99.4
6月末	9,081	△ 9.2	0.0	98.8
7月末	9,488	△ 5.1	0.0	99.1
(期末)2016年8月18日	9,154	△ 8.5	0.0	99.1

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

### ○海外金融市況

海外金融市場では、多くの資産が上昇しました。

株式市場では、2016年6月に行なわれた英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票で市場予想に反して離脱派が多数となったことを受けて調整する局面がありましたが、原油価格が上昇したことや、堅調な経済指標、企業業績の発表などを背景に上昇しました。

債券市場では、米国の早期利上げ観測が後退したこと、英国のEU離脱をめぐる不透明感、先進諸国の緩和的な金融政策などを背景に債券価格は上昇しました（利回りは低下）。また、原油価格が上昇したことなどを受けてハイ・イールド債も堅調に推移しました。

非伝統的高利回り資産（※）では、米国の住宅市場が改善していることなどが支援材料となり、リート、優先出資証券、CMB S（商業用不動産担保証券）、ノンエージェンシーMB S（政府関連機関の保証がつかないMB S（住宅ローン担保証券））を中心に上昇しました。

※リート、優先出資証券、ノンエージェンシーMB Sなど。

### ○為替相場

為替相場では、米国の利上げ観測の後退や、日銀の金融政策決定会合において追加緩和が見送られたこと、欧州金融市場に対する不透明感から市場のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて、低リスク資産と考えられている円が買われ、主要通貨が対円で下落しました。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

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

### ○インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）

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

株式については、これまで堅調に推移してきた生活必需品や公益事業セクターの利益確定の売却などを行なうなど、株式のリスクを引き下げました。

債券では、債券価格の上昇余地が限定的であると考えていることから、比較的デュレーションを短

めに維持しました。ハイ・イールド債については、スプレッド（米国国債との利回り格差）が縮小する中、一部利益確定の売りを行ないました。

利回りの獲得や分散投資の観点から魅力的な資産と考えている非伝統的高利回り資産では、価格の変動度合いが低く相対的に高い利回りが見込める信用格付けの高いノンエージェンシーMBSやCMB Sなどを選好しました。また、株式の価格上昇がある程度限られると思われることやボラティリティの高止まりなどを踏まえ、株式のカバード・コール戦略によりインカム収益の積み上げを図りました。

### ○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

当期は、基準価額の水準を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。

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2月1日 ～2016年8月18日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	278

（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。



## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

今後も、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドへ投資します。インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

### ○インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）

ポートフォリオの資産を保護しつつインカム収入をめざした運用を行なう方針です。

好調な米国の住宅市場が、引き続きCMB SおよびノンエージェンシーMB Sに好ましいファンダメンタル要因となっています。これらの商品は、魅力的な分散特性を備えており、引き続き当ファンドの選好分野となっています。また、株式市場の上昇余地はある程度限られる上、ボラティリティが高止まりしている状況を踏まえ、カバード・コール戦略は魅力的な手段だと考えます。引き続きリスクを抑えつつ、クーポン、配当、カバード・コールによるインカム収入の積み上げを図るとともに、キャピタルゲインを求めた運用を行なう方針です。

### ○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 2. 1～2016. 8. 18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	63円	0.664%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は9,528円です。</b>
（投信会社）	(20)	(0.207)	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）	(42)	(0.443)	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)	(0.015)	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	64	0.668	

(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

(1) 投資信託受益証券

(2016年2月1日から2016年8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)	2,219.48	192,680	—	—

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。

(注2) 金額は受渡し代金。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年2月1日から2016年8月18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 アセット・ マザーファンド	100	101	—	—

(注) 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2月1日から2016年8月18日まで)

買 柄	当 期			平均単価	銘 柄	期 中			平均単価
	口 数	金 額	付			口 数	金 額	付	
	千口	千円	円			千口	千円	円	
MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON- HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	2,155.271	187,395	86						

(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2月1日から2016年8月18日まで)

区 分	当 期			期 中		
	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	25,301	2,790	11.0	—	—	—
コール・ローン	673,454	—	—	—	—	—

(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。

■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

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	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とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満切捨て。

■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) MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON- HEDGED CLASS	2,219.48	175,221	99.1

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	100	100

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年8月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	175,221	98.6
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	100	0.1
コール・ローン等、その他	2,443	1.3
投資信託財産総額	177,765	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8月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	177,765,716円
コール・ローン等	2,443,413
投資信託受益証券 (評価額)	175,221,333
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド (評価額)	100,970
(B) 負債	973,550
未払信託報酬	967,196
その他未払費用	6,354
(C) 純資産総額 (A - B)	176,792,166
元本	193,130,106
次期繰越損益金	△ 16,337,940
(D) 受益権総口数	193,130,106口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,154円

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は193,140,284円、同解約元本額は1,010,178円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,154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16,337,940円です。

■損益の状況

当期 自2016年2月1日 至2016年8月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	5,278,459円
受取配当金	5,278,713
受取利息	120
支払利息	△ 374
(B) 有価証券売買損益	△ 17,442,927
売買益	16,143
売買損	△ 17,459,070
(C) 信託報酬等	△ 973,562
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 13,138,030
(E) 追加信託差損益金	△ 3,199,910
(配当等相当額)	( 1,075,437)
(売買損益相当額)	(△ 4,275,347)
(F) 合計 (D + E)	△ 16,337,940
次期繰越損益金 (F)	△ 16,337,940
追加信託差損益金	△ 3,199,910
(配当等相当額)	( 1,075,437)
(売買損益相当額)	(△ 4,275,347)
分配準備積立金	4,304,896
繰越損益金	△ 17,442,926

(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。

(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	4,304,896円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,075,437
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	5,380,333
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	5,380,333
(h) 受益権総口数	193,130,106口

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・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド  
（円ヘッジ・クラス／ヘッジなし・クラス）

当ファンド（ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型））はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス／ヘッジなし・クラス）」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。

（注）2016年8月18日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（米ドル建て）

貸借対照表  
2015年7月31日

資産

有価証券への投資、時価（費用128,972,368ドル）	ドル	127,966,780
利害関係人への投資（費用 21,956,350ドル）		21,342,296
カウンターパーティへの預託金		60,000
現金		1,083
外国為替先渡契約による評価益		6,102
デリバティブ金融商品に係る未収変動証拠金		1,012,500
未収：		
売却した有価証券に係る未収金		588,906
配当金		68,694
利子		691,195
<b>資産合計</b>		<b>151,737,556</b>

負債

当座借越		9,185
外国為替先渡契約に係る評価損		4,060,124
未払い：		
購入した有価証券に係る未払金		4,540,778
投資運用報酬		247,350
保管報酬		108,146
会計および管理報酬		64,974
専門家報酬		42,599
決済が完了した為替先渡契約		14,057
名義書換代理報酬		7,824
受託会社報酬		5,881
為替運用報酬		4,334
その他の未払金		15,000
<b>負債合計</b>		<b>9,120,252</b>

純資産

ドル 142,617,304

純資産の内訳：

払込元本	ドル	157,732,018
次期繰越欠損金		(15,114,714)
<b>純資産</b>	ドル	<b>142,617,304</b>

ブラジル・リアル・クラス	ドル	47,489,086
通貨セレクト・クラス		21,298,383
円ヘッジ・クラス		12,346,097
ヘッジなし・クラス		61,483,738
	ドル	142,617,304

発行済み受益証券数

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

1口当りの純資産

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

損益計算書

2015年2月23日（運用開始日）～2015年7月31日

投資収益

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

費用

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

純投資収益

2,604,512

実現益および評価益（実現損および評価損）：

実現益（損）：

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

評価益（損）の純変動：

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

実現損および評価損

(11,445,663)

業務活動の結果生じた純資産の純減

ドル (8,841,151)

ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型)

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



ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
U S D	80,000	6.00% due 01/22/14 ヘルスケア用品 (0.1%) 3AB Optique Developpement SAS	89,483	U S D	210,000	XLIT, Ltd. <sup>(b), (c)</sup> 6.50% due 10/29/49 包装・容器 (0.1%) Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA, Inc.	177,975
E U R	100,000	5.63% due 04/15/19 保険 (0.1%) AXA S. A. <sup>(a), (b), (c)</sup>	107,170	E U R	100,000	4.25% due 01/15/22 医薬品 (0.1%) Grifols Worldwide Operations, Ltd.	111,362
U S D	200,000	6.38% due 12/29/49 メディア (0.3%) Numericable-SFR SAS <sup>(a)</sup>	212,500	U S D	200,000	5.25% due 04/01/22 アイルランド計 (費用624,858 ドル) イタリア (0.3%) 自動車部品・設備 (0.1%) Rhino Bondco S. P. A	202,000 604,715
U S D	200,000	4.88% due 05/15/19	203,000	E U R	100,000	7.25% due 11/15/20 銀行 (0.1%) UniCredit SpA	119,096
E U R	100,000	5.38% due 05/15/22	114,905	E U R	100,000	6.95% due 10/31/22 エンジニアリング・建設 (0.1%) Astaldi SpA	131,606
E U R	100,000	5.63% due 05/15/24 包装・容器 (0.1%) SGD Group SAS	113,302	E U R	100,000	7.13% due 12/01/20 イタリア計 (費用371,953ドル) ジャマイカ (0.2%) 通信 (0.2%) Digicel, Ltd. <sup>(a)</sup>	116,838 367,540
E U R	100,000	5.63% due 05/15/19 小売 (0.1%) THOM Europe SAS	113,799	U S D	240,000	6.00% due 04/15/21 ジャマイカ計 (費用237,537ドル) ルクセンブルグ (1.4%) バンクローン (0.1%) Intelsat Jackson Holdings S. A.	226,200 226,200
E U R	100,000	7.38% due 07/15/19 通信 (0.1%) Orange S. A. <sup>(b), (c)</sup>	116,424	U S D	25,000	3.75% due 06/30/19 SS&C European Holdings S. a. r. L	24,758
E U R	100,000	5.00% due 10/29/49 フランス計 (費用2,123,966ドル) ドイツ (1.0%) 銀行 (0.7%) Commerzbank AG <sup>(a)</sup>	117,943 2,066,697	U S D	4,709	4.00% due 07/08/22 Travelport Finance (Luxembourg) S. à r. l.	4,751
U S D	275,000	8.13% due 09/19/23 Deutsche Bank AG <sup>(b), (c)</sup>	320,804	U S D	89,774	5.75% due 09/02/21 エンターテイメント (0.1%) Intralot Capital Luxembourg S. A.	90,204
U S D	600,000	7.50% due 12/29/49 HSH Nordbank AG <sup>(b)</sup>	603,000	E U R	100,000	6.00% due 05/15/21 環境制御 (0.1%) Bilbao Luxembourg S. A. <sup>(d)</sup>	96,675
E U R	100,000	0.79% due 02/14/17 建築材料 (0.1%) Pfleiderer GmbH	81,869	E U R	101,406	10.50% due 12/01/18 ヘルスケア用品 (0.0%)	117,974
E U R	100,000	7.88% due 08/01/19 エレクトロニクス (0.1%) Trionista TopCo GmbH	115,181				
E U R	100,000	6.88% due 04/30/21 メディア (0.1%) Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG / Unitymedia NRW GmbH	117,035				
E U R	100,000	4.00% due 01/15/25	112,695				
E U R	90,000	5.75% due 01/15/23 ドイツ計 (費用1,492,708ドル) アイルランド (0.4%) 銀行 (0.1%) Bank of Ireland <sup>(b)</sup>	107,391 1,457,975				
E U R	100,000	4.25% due 06/11/24 保険 (0.1%)	113,378				

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

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

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

ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型)

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

ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型)

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

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

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

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

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

ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型)

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



ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

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

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Diamondback Energy, Inc.		U S D	11,000	6.50% due 11/15/20	9,515
U S D	60,000	7.63% due 10/01/21	63,600			Whiting Petroleum Corp.	
		EP Energy LLC / Everest		U S D	38,000	5.00% due 03/15/19	36,480
		Acquisition Finance, Inc. <sup>(a)</sup>		U S D	26,000	6.25% due 04/01/23	25,350
U S D	27,000	6.38% due 06/15/23	25,245			WPX Energy, Inc.	
U S D	80,000	9.38% due 05/01/20	82,600	U S D	20,000	5.25% due 09/15/24	17,150
		Gulfport Energy Corp. <sup>(a)</sup>		U S D	15,000	6.00% due 01/15/22	14,025
U S D	32,000	6.63% due 05/01/23	32,000			<b>その他 ABS (1.6%)</b>	
		Halcon Resources Corp. <sup>(a)</sup>				Bear Stearns Asset Backed	
U S D	28,000	8.63% due 02/01/20	26,740			Securities I Trust 2007-FS1	
		Hilcorp Energy I LP / Hilcorp		U S D	625,224	Class 1A3 <sup>(b)</sup>	502,048
U S D	30,000	Finance Co. <sup>(a)</sup>	27,900			0.36% due 05/25/35	
		Linn Energy LLC / Linn		U S D	900,000	Carrington Mortgage Loan	
		Energy Finance Corp.				Trust Series 2005-FRE1 Class	
U S D	2,000	6.25% due 11/01/19	1,211			M1 <sup>(b)</sup>	759,027
U S D	31,000	7.75% due 02/01/21	18,135			0.66% due 12/25/35	
U S D	2,000	8.63% due 04/15/20	1,230			Countrywide Asset-Backed	
		Matador Resources Co. <sup>(a)</sup>		U S D	1,156,495	Certificates Class 1A <sup>(b)</sup>	967,067
U S D	9,000	6.88% due 04/15/23	9,135			1.03% due 10/25/47	
		Memorial Production				<b>包装・容器 (0.2%)</b>	
		Partners LP / Memorial		U S D	75,000	Ball Corp.	
		Production Finance Corp.				5.25% due 07/01/25	75,416
U S D	73,000	6.88% due 08/01/22	58,400	U S D	41,000	Berry Plastics Corp.	40,283
U S D	31,000	7.63% due 05/01/21	26,040			5.13% due 07/15/23	
		Memorial Resource				Reynolds Group Issuer, Inc.	
		Development Corp.		U S D	80,000	/ Reynolds Group Issuer LLC	
U S D	86,000	5.88% due 07/01/22	81,055			/ Reynolds Group Issuer Lu	82,800
		Newfield Exploration Co.		U S D	80,000	5.75% due 10/15/20	81,200
U S D	19,000	5.38% due 01/01/26	18,240			Sealed Air Corp. <sup>(a)</sup>	
		Oasis Petroleum, Inc.		U S D	30,000	5.25% due 04/01/23	30,900
U S D	7,000	6.50% due 11/01/21	6,370			<b>医薬品 (0.1%)</b>	
U S D	16,000	6.88% due 03/15/22	14,720			Endo Finance LLC <sup>(a)</sup>	
		QEP Resources, Inc.		U S D	30,000	5.75% due 01/15/22	30,900
U S D	6,000	5.25% due 05/01/23	5,550			Endo Finance LLC / Endo	
U S D	40,000	5.38% due 10/01/22	37,400	U S D	30,000	Finco, Inc. <sup>(a)</sup>	30,319
		Sanchez Energy Corp.		U S D	40,000	5.38% due 01/15/23	42,600
U S D	87,000	6.13% due 01/15/23	70,470			5.75% due 01/15/22	
		SM Energy Co.		U S D	30,000	Omnicare, Inc.	31,687
U S D	55,000	5.00% due 01/15/24	50,325			4.75% due 12/01/22	
U S D	75,000	6.13% due 11/15/22	73,875	U S D	32,000	Valeant Pharmaceuticals	
		Sunoco LP / Sunoco Finance				International <sup>(a)</sup>	
		Corp. <sup>(a)</sup>		U S D	10,000	6.38% due 10/15/20	33,720
U S D	36,000	5.50% due 08/01/20	36,630	U S D	22,000	6.75% due 08/15/21	10,413
U S D	13,000	6.38% due 04/01/23	13,358	U S D	22,000	7.00% due 10/01/20	22,852
		Transocean, Inc.				<b>フィリピン (0.9%)</b>	
U S D	25,000	3.00% due 10/15/17	23,450			Energy Transfer Equity LP	
U S D	4,000	4.30% due 10/15/22	2,905	U S D	110,000	5.88% due 01/15/24	111,925
U S D	37,000	6.00% due 03/15/18	35,520	U S D	25,000	7.50% due 10/15/20	28,000
						Energy Transfer Partners LP	
				U S D	175,000	6.13% due 12/15/45	176,171

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

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

	元本金額	有価証券の明細	公正価値		元本金額	有価証券の明細	公正価値
		Infor Software Parent LLC /		U S D	20,000	7.00% due 03/01/20	21,300
		Infor Software Parent, Inc. <sup>(a)</sup> , <sup>(c)</sup>		U S D	215,000	9.00% due 11/15/18	240,800
U S D	45,000	7.13% due 05/01/21	44,212			Sprint Corp.	
		Infor US, Inc. <sup>(a)</sup>		U S D	89,000	7.13% due 06/15/24	81,435
U S D	87,000	6.50% due 05/15/22	88,958	U S D	60,000	7.63% due 02/15/25	55,650
		Italics Merger Sub, Inc. <sup>(a)</sup>		U S D	50,000	7.88% due 09/15/23	47,937
U S D	21,000	7.13% due 07/15/23	20,633			T-Mobile USA, Inc.	
		Nuance Communications, Inc. <sup>(a)</sup>		U S D	80,000	6.38% due 03/01/25	83,900
U S D	30,000	5.38% due 08/15/20	30,450	U S D	30,000	6.63% due 04/28/21	31,761
		SS&C Technologies Holdings, Inc. <sup>(a)</sup>				<b>輸送 (0.1%)</b>	
		Mobile Mini, Inc. <sup>(a)</sup>		U S D	19,000	Air Medical Merger Sub Corp. <sup>(a)</sup>	
U S D	20,000	5.88% due 07/15/23	20,700			Florida East Coast Holdings Corp. <sup>(a)</sup>	17,765
		<b>保管・倉庫 (0.1%)</b>		U S D	44,000	6.75% due 05/01/19	44,440
U S D	60,000	7.88% due 12/01/20	62,400			XPO Logistics, Inc. <sup>(a)</sup>	
		<b>通信 (1.2%)</b>		U S D	74,000	6.50% due 06/15/22	72,798
U S D	105,000	Alcatel-Lucent USA, Inc. <sup>(a)</sup>	110,775	U S D	40,000	7.88% due 09/01/19	42,750
U S D	200,000	6.45% due 03/15/29	215,000			<b>トラック・リース (0.0%)</b>	
		Altice US Finance I Corp. <sup>(a)</sup>		U S D	40,000	Jurassic Holdings III, Inc. <sup>(a)</sup>	28,000
U S D	200,000	6.75% due 11/15/20	201,000			<b>モーゲージ債権担保ホールローン (4.3%)</b>	
		Avaya, Inc. <sup>(a)</sup>				Alternative Loan Trust 2005-IM1 Class A1 <sup>(b)</sup>	496,096
U S D	55,000	5.38% due 07/15/23	53,075			Alternative Loan Trust 2006-OA3 Class 1A1 <sup>(b)</sup>	959,404
U S D	70,000	7.00% due 04/01/19	56,875			Alternative Loan Trust 2006-OA3 Class 2A1 <sup>(b)</sup>	923,539
		CommScope Technologies Finance LLC <sup>(a)</sup>		U S D	1,147,172	0.40% due 05/25/36	
U S D	33,000	6.00% due 06/15/25	32,588			Alternative Loan Trust 2007-AL1 Class A1 <sup>(b)</sup>	1,029,893
U S D	34,000	4.38% due 06/15/20	34,212	U S D	1,428,766	0.44% due 06/25/37	
		DigitalGlobe, Inc. <sup>(a)</sup>				Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-OA1 Class A1 <sup>(b)</sup>	1,067,306
U S D	30,000	5.25% due 02/01/21	28,800			MASTR Resecuritization Trust 2008-3 Class A1 <sup>(a)</sup> , <sup>(b)</sup>	
		Frontier Communications Corp.		U S D	1,007,074	0.62% due 08/25/37	719,051
U S D	40,000	6.25% due 09/15/21	36,900			Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2005-AR3 Class 1A1 <sup>(b)</sup>	952,897
U S D	20,000	6.88% due 01/15/25	17,025			0.46% due 08/25/35	952,897
U S D	8,000	7.63% due 04/15/24	7,280			<b>アメリカ計 (費用49,060,676ドル)</b>	48,509,978
		Level 3 Financing, Inc. <sup>(a)</sup>				<b>債券計 (費用65,610,113ドル)</b>	<b>64,656,857</b>
U S D	28,000	5.13% due 05/01/23	27,230				
U S D	110,000	5.38% due 08/15/22	111,100				
U S D	130,000	5.63% due 02/01/23	131,300				
U S D	30,000	7.00% due 06/01/20	31,650				
		Plantronics, Inc. <sup>(a)</sup>					
U S D	17,000	5.50% due 05/31/23	17,255				
		SBA Telecommunications, Inc.					
U S D	40,000	5.75% due 07/15/20	41,800				
		Sprint Capital Corp.					
U S D	40,000	6.88% due 11/15/28	33,900				
		Sprint Communications, Inc. <sup>(a)</sup>					

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

ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型)

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

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

ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型)

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



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

ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型)

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

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

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

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

#### 2015年7月31日現在の先物建玉

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

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

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

## ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

### 2015年7月31日現在のファンドレベルの為替先渡契約残高

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価(損)益
E U R	BNP Paribas S. A.	157,000	2015年10月20日	U S D	171,873	ドル 1,784	ドル	ドル 1,784
MX N	Goldman Sachs Group, Inc.	63,000	2015年10月20日	U S D	3,802	106	—	106
MX N	Goldman Sachs Group, Inc.	34,865	2015年10月20日	U S D	2,192	—	(29)	(29)
MX N	HSBC Bank PLC	748,000	2015年10月20日	U S D	45,665	736	—	736
U S D	Goldman Sachs Group, Inc.	101,770	2015年10月20日	MX N	1,619,100	1,331	—	1,331
U S D	HSBC Bank PLC	1,168,425	2015年10月20日	G B P	751,000	—	(2,886)	(2,886)
U S D	UBS AG	6,318,568	2015年10月20日	E U R	5,725,000	—	(13,794)	(13,794)
						ドル 3,957	ドル (16,709)	ドル (12,752)

### 2015年7月31日現在のブラジル・レアル・クラスの為替先渡契約残高

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価(損)益
B R L	Citibank N. A.	8,603,371	2015年8月13日	G B P	1,734,339	ドル	ドル (193,052)	ドル (193,052)
B R L	Citibank N. A.	146,010,603	2015年8月13日	U S D	45,662,574	—	(3,009,158)	(3,009,158)
B R L	Citibank N. A.	2,937,611	2015年8月13日	A U D	1,237,348	—	(49,993)	(49,993)
B R L	Citibank N. A.	3,812,208	2015年8月13日	C H F	1,129,240	—	(61,584)	(61,584)
						ドル	ドル (3,313,787)	ドル (3,313,787)

### 2015年7月31日現在の通貨セレクト・クラスの為替先渡契約残高

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

### 2015年7月31日現在の円ヘッジ・クラスの為替先渡契約残高

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価(損)益
J P Y	Citibank N. A.	81,356,747	2015年8月13日	G B P	430,058	ドル	ドル (14,356)	ドル (14,356)
J P Y	Citibank N. A.	1,386,028,090	2015年8月13日	U S D	11,307,755	—	(119,826)	(119,826)
J P Y	Citibank N. A.	27,826,469	2015年8月13日	A U D	306,492	—	(343)	(343)
J P Y	Citibank N. A.	36,128,210	2015年8月13日	C H F	279,746	472	—	472
						ドル 472	ドル (134,525)	ドル (134,053)

通貨の略称：

---

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

## ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2015年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年8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45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2月1日から2016年8月18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		
601 国庫短期証券 2016/7/19	3,150,065		
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		
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		
587 国庫短期証券 2016/8/10	1,200,002		

（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8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（10,386,493千円）の内容です。

#### (1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年8月18日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下組入率	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 4,960,000	千円 4,960,519	% 47.7	% —	% —	% —	% 47.7

（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）

2016年8月18日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	609 国庫短期証券	—	千円 1,940,000	千円 1,940,020	2016/08/22	
	610 国庫短期証券	—	1,920,000	1,920,036	2016/08/29	
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,100,462	2016/09/20	
合 計	銘 柄 数	3銘柄				
	金 額		4,960,000	4,960,519		

（注）単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## 運用報告書 第4期 (決算日 2015年12月9日)

(計算期間 2014年12月10日～2015年12月9日)

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第4期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

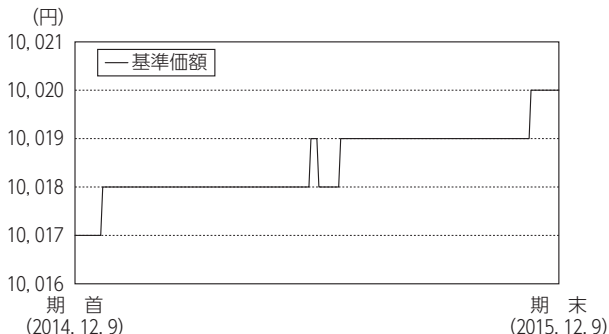
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,017円 期末：10,020円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低金利が続き、無担保コール翌日物金利は0.07%台を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.11～0.02%程度で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

◆ポートフォリオについて

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組入比率
	円	騰 落 率 %	
(期首) 2014年12月9日	10,017	—	53.3
12月末	10,018	0.0	72.3
2015年1月末	10,018	0.0	80.5
2月末	10,018	0.0	70.3
3月末	10,018	0.0	59.6
4月末	10,018	0.0	70.6
5月末	10,018	0.0	73.2
6月末	10,019	0.0	69.3
7月末	10,019	0.0	59.4
8月末	10,019	0.0	65.5
9月末	10,019	0.0	51.5
10月末	10,019	0.0	76.0
11月末	10,020	0.0	56.8
(期末) 2015年12月9日	10,020	0.0	52.7

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■1万口当りの費用の明細

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

(注) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。



■売買および取引の状況

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

		買付額	売付額
国	国債証券	千円 32,338,160	千円 ( 32,240,000)
国内	国債証券		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建) 公社債(種類別)

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

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)国内(邦貨建) 公社債(銘柄別)

区分	銘柄	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	7銘柄								
	金額		6,435,000	6,437,978						

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月9日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>12, 210, 290, 310円</b>
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>(B) 負債</b>	<b>—</b>
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>12, 210, 290, 310</b>
元本	12, 186, 116, 869
次期繰越損益金	24, 173, 441
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>12, 186, 116, 869口</b>
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
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>3, 173, 485円</b>
受取利息	3, 173, 485
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 382, 400</b>
売買益	1, 050
売買損	△ 383, 450
<b>(C) 当期損益金（A＋B）</b>	<b>2, 791, 085</b>
<b>(D) 前期繰越損益金</b>	<b>20, 640, 762</b>
<b>(E) 解約差損益金</b>	<b>△ 14, 198, 145</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>14, 939, 739</b>
<b>(G) 合計（C＋D＋E＋F）</b>	<b>24, 173, 441</b>
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。