

★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4期

（決算日 2018年2月19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/> <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 中 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末 (2016年 8 月18日)	10,646	10	6.6	0.0	98.2	101
2 期末 (2017年 2 月20日)	10,711	0	0.6	0.0	98.4	161
3 期末 (2017年 8 月18日)	10,885	10	1.7	—	98.2	236
4 期末 (2018年 2 月19日)	10,862	10	△ 0.1	—	99.3	198

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

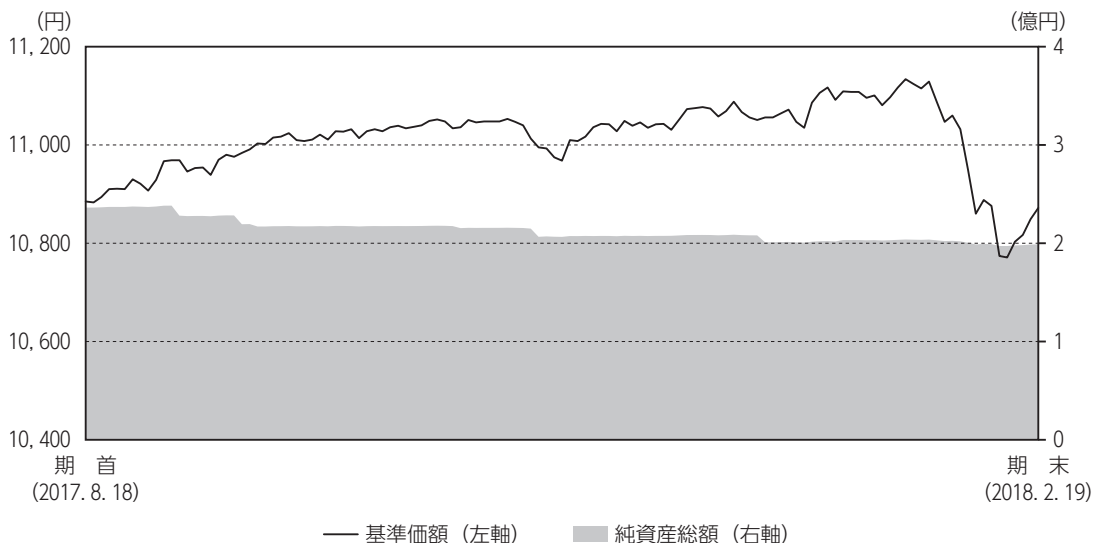
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,885円

期末：10,862円（分配金10円）

騰落率：△0.1%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

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証券化商品の上昇はプラス要因となりましたが、債券の下落などがマイナス要因となり、基準価額はほぼ横ばいとなりました。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 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %		
(期首)2017年 8月18日	10,885	—	—	98.2
8月末	10,929	0.4	—	98.2
9月末	11,011	1.2	—	99.0
10月末	11,046	1.5	—	98.3
11月末	11,039	1.4	—	98.4
12月末	11,047	1.5	—	97.7
2018年 1月末	11,047	1.5	—	99.2
(期末)2018年 2月19日	10,872	△ 0.1	—	99.3

(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. 8. 19 ~ 2018. 2. 19)

■海外金融市況

海外金融市場では、株式市場は堅調に推移しましたが、債券市場は総じて軟調に推移しました。

株式市場では、北朝鮮情勢を巡る地政学リスクが後退したこと、米国の税制改革進展への期待が高まったこと、原油価格の上昇などを背景に、上昇する展開となりました。2018年に入っても良好な地合いが継続しましたが、2月には、米国の長期金利が大幅に上昇したことやインフレ上昇懸念が膨らんだことなどを背景に、世界的に株式市場が急落しました。

債券市場では、株式市場が上昇したこと、インフレ率上昇観測が高まったこと、米国の利上げペースが加速するとの観測が高まったことなどを背景に、利回りが上昇しました。

非伝統的高利回り資産（※）では、好調な米国の住宅市場などが支援材料となり、不動産担保証券が相対的に良好なパフォーマンスでした。

※リート、優先出資証券、不動産担保証券など。

前期における「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）

当ファンドでは、ハイ・イールド債券、証券化商品などの高利回り資産を引き続き選好する方針です。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。なお、バリュエーションが一般的に高止まりしていることから、銘柄選別が重要になると考えています。

また、原資産通貨売り／円買いの為替取引を行ないません。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、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。

ポートフォリオについて

(2017. 8. 19 ~ 2018. 2. 19)

■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、バリュエーションに割高感があると判断して、比率を抑えた運用を行ないました。

債券については、ハイ・イールド債の спреッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の縮小余地は限定的と予想されることや、金利が上昇傾向にある状況下、選別投資を行ないました。クレジット市場については、格付けの高い銘柄と低い銘柄の利回り格差が縮小してきていることから、格付けの高い銘柄を選好しました。

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、不動産担保証券中心に投資しました。

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

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・ローンによる運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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	
	2017年8月19日 ～2018年2月19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）	1,149

- (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	135.95円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	663.94
(d) 分配準備積立金	359.45
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,159.35
(f) 分配金	10.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,149.35

(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）

当ファンドでは、証券化商品などの高利回り資産を引き続き選好する方針です。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います。なお、市場のボラティリティ上昇の可能性などにも留意しながら、リスク管理と銘柄選択に注力していく方針です。

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 (2017. 8. 19～2018. 2. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	68円	0.616%	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11,014円です。
(投 信 会 社)	(21)	(0.192)	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)	(45)	(0.410)	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)	(2)	(0.014)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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	68	0.620	

(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。

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

■売買および取引の状況

投資信託受益証券

(2017年8月19日から2018年2月19日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	85.905	7,973	430.734	40,000

(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8月19日から2018年2月19日まで)

当 期				当 期			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 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)	42.968	4,000	93	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	430.734	40,000	92

(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

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(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	2,170.759	197,463	99.3

(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	□ 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	40	40	40

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年2月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	197,463	98.5
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	2,907	1.5
投資信託財産総額	200,411	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年2月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	200,411,178円
コール・ローン等	2,907,142
投資信託受益証券（評価額）	197,463,119
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	40,917
(B) 負債	1,501,259
未払収益分配金	183,117
未払信託報酬	1,309,489
その他未払費用	8,653
(C) 純資産総額（A－B）	198,909,919
元本	183,117,045
次期繰越損益金	15,792,874
(D) 受益権総口数	183,117,045口
1万口当り基準価額（C/D）	10,862円

*期首における元本額は217,077,164円、当期中における追加設定元本額は6,384,828円、同解約元本額は40,344,947円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,862円です。

■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	2,489,527円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	12,158,016
(d) 分配準備積立金	6,582,294
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	21,229,837
(f) 分配金	183,117
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	21,046,720
(h) 受益権総口数	183,117,045口

■損益の状況

当期 自 2017年8月19日 至 2018年2月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,807,672円
受取配当金	3,808,909
受取利息	8
支払利息	△ 1,245
(B) 有価証券売買損益	△ 2,788,330
売買益	255,693
売買損	△ 3,044,023
(C) 信託報酬等	△ 1,318,142
(D) 当期損益金（A + B + C）	△ 298,800
(E) 前期繰越損益金	5,642,601
(F) 追加信託差損益金	10,632,190
（配当等相当額）	（ 12,158,016）
（売買損益相当額）	（△ 1,525,826）
(G) 合計（D + E + F）	15,975,991
(H) 収益分配金	△ 183,117
次期繰越損益金（G + H）	15,792,874
追加信託差損益金	10,632,190
（配当等相当額）	（ 12,158,016）
（売買損益相当額）	（△ 1,525,826）
分配準備積立金	8,888,704
繰越損益金	△ 3,728,020

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

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

（注3）収益分配金の計算過程は「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 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、2月19日現在の基準価額（1万口当り10,862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
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
1 期末 (2016年 8 月18日)	9,154	0	△ 8.5	0.0	99.1	176
2 期末 (2017年 2 月20日)	10,374	10	13.4	0.0	93.2	202
3 期末 (2017年 8 月18日)	10,380	10	0.2	—	99.0	111
4 期末 (2018年 2 月19日)	10,131	10	△ 2.3	—	98.9	108

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

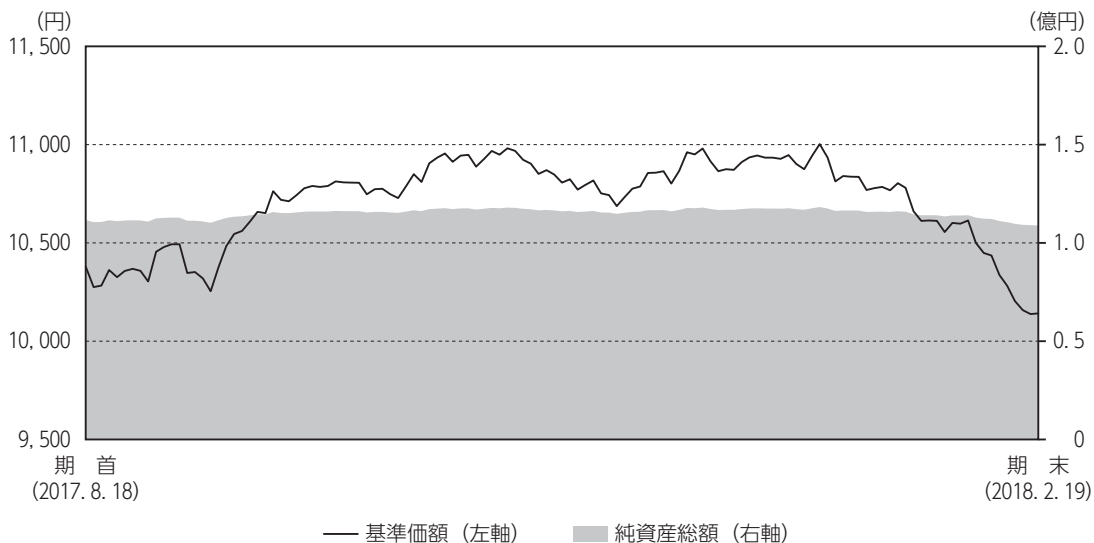
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

期首：10,380円

期末：10,131円（分配金10円）

騰落率：△2.3%（分配金込み）

■基準価額の変動要因

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証券化商品の上昇はプラス要因となりましたが、債券の下落や為替相場が米ドルなどの主要通貨が対円で総じて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。

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 %		
(期首)2017年 8月18日	10,380	—	—	99.0
8月末	10,455	0.7	—	99.1
9月末	10,790	3.9	—	99.3
10月末	10,888	4.9	—	99.5
11月末	10,776	3.8	—	99.5
12月末	10,902	5.0	—	98.7
2018年 1月末	10,555	1.7	—	98.8
(期末)2018年 2月19日	10,141	△ 2.3	—	98.9

(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. 8. 19 ~ 2018. 2. 19)

■海外金融市況

海外金融市場では、株式市場は堅調に推移しましたが、債券市場は総じて軟調に推移しました。

株式市場では、北朝鮮情勢を巡る地政学リスクが後退したこと、米国の税制改革進展への期待が高まったこと、原油価格の上昇などを背景に、上昇する展開となりました。2018年に入っても良好な地合いが継続しましたが、2月には、米国の長期金利が大幅に上昇したことやインフレ上昇懸念が膨らんだことなどを背景に、世界的に株式市場が急落しました。

債券市場では、株式市場が上昇したこと、インフレ率上昇観測が高まったこと、米国の利上げペースが加速するとの観測が高まったことなどを背景に、利回りが上昇しました。

非伝統的高利回り資産（※）では、好調な米国の住宅市場などが支援材料となり、不動産担保証券が相対的に良好なパフォーマンスでした。

※リート、優先出資証券、不動産担保証券など。

■為替相場

為替相場では、米国の利上げ観測の高まりから米ドルが買われる展開が続きましたが、2018年1月以降は、日本の金融正常化観測が高まったことや、米国のムニューシン財務長官が米ドル安を容認する発言を行なったこと、世界的な株価下落を受けた投資家のリスク回避的な動きの強まりを背景として、米ドルは対円で軟調に推移しました。

前期における「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）

当ファンドでは、ハイ・イールド債券、証券化商品などの高利回り資産を引き続き選好する方針です。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。なお、バリュエーションが全般的に高止まりしていることから、銘柄選別が重要になると考えています。

■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、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。

ポートフォリオについて

(2017. 8. 19 ~ 2018. 2. 19)

■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、バリュエーションに割高感があると判断して、比率を抑えた運用を行ないました。

債券については、ハイ・イールド債のスプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の縮小余地は限定的と予想されることや、金利が上昇傾向にある状況下、選別投資を行ないました。クレジット市場については、格付けの高い銘柄と低い銘柄の利回り格差が縮小してきていることから、格付けの高い銘柄を選好しました。

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、不動産担保証券中心に投資しました。

■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・ローンによる運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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	
	2017年8月19日 ～2018年2月19日	
当期分配金（税込み）	（円）	10
対基準価額比率	（％）	0.10
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）	1,197

- (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	205.88円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	265.79
(d) 分配準備積立金	735.74
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,207.42
(f) 分配金	10.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,197.42

(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（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）

当ファンドでは、証券化商品などの高利回り資産を引き続き選好する方針です。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います。なお、市場のボラティリティ上昇の可能性などにも留意しながら、リスク管理と銘柄選択に注力していく方針です。

■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、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 (2017. 8. 19～2018. 2. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	66円	0.616%	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10,711円です。
(投 信 会 社)	(21)	(0.192)	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)	(44)	(0.411)	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)	(0.014)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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	66	0.620	

(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8月19日から2018年2月19日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 (邦貨建)	千口 33,296	千円 2,928	千口 11,241	千円 1,000

(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8月19日から2018年2月19日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
				MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON- HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	11,241	1,000	88

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(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
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON- HEDGED CLASS	千口 1,307,841	千円 107,713	% 98.9

(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	□ 数	評 価 額
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	千口 100	千口 100	千円 100

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年2月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 107,713	% 98.1
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	1,929	1.8
投資信託財産総額	109,744	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジなし

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年2月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	109,744,481円
コール・ローン等	1,929,808
投資信託受益証券（評価額）	107,713,804
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	100,869
(B) 負債	821,255
未払収益分配金	107,519
未払信託報酬	709,102
その他未払費用	4,634
(C) 純資産総額（A－B）	108,923,226
元本	107,519,394
次期繰越損益金	1,403,832
(D) 受益権総口数	107,519,394口
1万口当り基準価額（C／D）	10,131円

* 期首における元本額は107,572,944円、当期中における追加設定元本額は210,107円、同解約元本額は263,657円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,131円です。

■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	2,213,651円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,857,833
(d) 分配準備積立金	7,910,675
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	12,982,159
(f) 分配金	107,519
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	12,874,640
(h) 受益権総口数	107,519,394口

■損益の状況

当期 自 2017年8月19日 至 2018年2月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,927,406円
受取配当金	2,927,688
支払利息	△ 282
(B) 有価証券売買損益	△ 4,796,157
売買益	33,537
売買損	△ 4,829,694
(C) 信託報酬等	△ 713,736
(D) 当期損益金（A + B + C）	△ 2,582,487
(E) 前期繰越損益金	5,578,838
(F) 追加信託差損益金	△ 1,485,000
（配当等相当額）	（ 2,857,833）
（売買損益相当額）	（△ 4,342,833）
(G) 合計（D + E + F）	1,511,351
(H) 収益分配金	△ 107,519
次期繰越損益金（G + H）	1,403,832
追加信託差損益金	△ 1,485,000
（配当等相当額）	（ 2,857,833）
（売買損益相当額）	（△ 4,342,833）
分配準備積立金	10,016,807
繰越損益金	△ 7,127,975

(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 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、2月19日現在の基準価額（1万口当り10,131円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

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

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

ダイワ・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）為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）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）2018年2月19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
2017年7月31日

資産		
投資資産の評価額（簿価 \$22,069,492）	\$	22,524,848
利害関係人への投資（簿価 \$30,094,119）		31,084,673
現金		1,614
外国為替先渡契約による評価益		1,235,979
先物取引に係る未収変動証拠金		214,862
未収：		
売却済みの投資		253,897
利息		22,310
配当		612
前払受託会社報酬		5,321
資産合計		55,344,116
負債		
保管会社に対する支払		211
預り金		870,000
外国為替先渡契約による評価損		18,628
未払：		
購入済み投資		1,943,961
購入済み利害関係人への投資		755,930
解約済み受益証券		362,007
運用会社報酬		86,887
専門家報酬		65,920
保管会社報酬		30,858
会計および管理会社報酬		13,803
名義書換代理人報酬		3,505
為替取引執行会社報酬		1,492
決済済み為替先渡契約		90
負債合計		4,153,292
純資産	\$	51,190,824
純資産		
ブラジル・リアル・クラス	\$	15,556,054
通貨セレクト・クラス		6,781,425
円ヘッジ・クラス		9,619,949
ヘッジなし・クラス		19,233,396
		51,190,824

発行済み受益証券口数

ブラジル・リアル・クラス	21,960,810
通貨セレクト・クラス	10,813,024
円ヘッジ・クラス	11,401,966
ヘッジなし・クラス	24,311,398

受益証券1口当たり純資産額

ブラジル・リアル・クラス	\$	0.708
通貨セレクト・クラス	\$	0.627
円ヘッジ・クラス	\$	0.844
ヘッジなし・クラス	\$	0.791

損益計算書

2017年7月31日に終了した年度

投資収益

受取利息（源泉徴収税 \$876控除後）	\$	607,342
配当収益（源泉徴収税 \$37,352控除後）		1,269,550
利害関係人への投資からの受取配当金（源泉徴収税 \$516,179控除後）		1,305,174
投資収益合計		3,182,066

費用

運用会社報酬		459,655
保管会社報酬		118,301
専門家報酬		77,135
会計および管理会社報酬		59,138
為替取引執行会社報酬		22,023
名義書換代理人報酬		14,025
受託会社報酬		12,652
その他費用		8,190
支払利息		2,249
登録料		769
費用合計		774,137

投資純利益

2,407,929

実現益（損）および評価益（損）：

実現益：

証券投資		751,470
利害関係人への投資		952,212
先物取引		445,014
スワップ契約		29,204
外国為替取引および外国為替先渡契約		1,541,265
純実現益		3,719,165

評価益（損）の純変動：

証券投資		(631,988)
利害関係人への投資		(199,650)
スワップ契約		4,539
先物取引		311
外国為替換算および外国為替先渡契約		549,493
評価損の純変動		(277,295)

純実現・純評価益

3,441,870

運用による純資産の純増

\$ 5,849,799

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

投資明細表
2017年7月31日現在

	元本	有価証券の明細	評価額
		債券 (22.6%)	
		オランダ (0.5%)	
		電力 (0.2%)	
E U R	100,000	Gas Natural Fenosa Finance BV ^{(a), (b), (c)} 4.13% due 11/29/49	\$ 126,928
		メディア (0.3%)	
E U R	100,000	Ziggo Bond BV ^(a) 7.13% due 05/15/24	133,227
		オランダ合計 (簿価 \$241,129)	260,155
		米国 (22.1%)	
		商業用不動産担保証券 (6.1%)	
U S D	1,000,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust Class CME ^{(b), (d)} 3.68% due 05/10/48	973,410
		Core Industrial Trust 2015-CALW Class G ^{(b), (d)}	
U S D	140,000	3.85% due 02/10/34	137,030
		Core Industrial Trust 2015-TEXW Class E ^{(b), (d)}	
U S D	1,000,000	3.85% due 02/10/34	993,579
		GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF Class EFX ^{(b), (d)}	
U S D	1,000,000	3.38% due 12/15/34	1,002,241
		商業サービス (0.0%)	
		ADT Corp.	
U S D	10,000	3.50% due 07/15/22	9,887
		住宅資産 ABS (6.9%)	
		Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-AQ2 Class A2 ^{(a), (b)}	
U S D	655,148	1.40% due 01/25/37	652,705
		Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE1 Class 21A2 ^{(a), (b)}	
U S D	1,157,411	1.39% due 01/25/37	1,082,741
		Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 Class 22A ^{(a), (b)}	
U S D	1,025,449	1.37% due 03/25/37	963,079
		Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 Class 2A ^{(a), (b)}	
U S D	960,123	1.37% due 04/25/37	807,741
		インターネット (0.1%)	
		IAC / InterActiveCorp ^(a)	
U S D	31,000	4.88% due 11/30/18	31,349
		組立住宅 ABS (2.0%)	
		Conseco Finance Securitizations Corp. Class M1 ^{(a), (b)}	
U S D	1,100,000	2.98% due 09/01/33	1,025,132
		その他 ABS (1.1%)	
		Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-FS1 Class 1A3 ^{(a), (b)}	
U S D	588,969	1.40% due 05/25/35	591,435
		パイプライン (0.1%)	
		Tesoro Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp. ^(a)	
U S D	40,000	6.25% due 10/15/22	42,500
		モーゲージ債権担保ホールローン (5.8%)	
		Alternative Loan Trust 2005-IM1 Class A1 ^{(a), (b)}	
U S D	435,197	1.53% due 01/25/36	393,451

	元本	有価証券の明細	評価額
U S D	902,324	Alternative Loan Trust 2006-OA3 Class 2A1 ^{(a), (b)} 1.44% due 05/25/36	788,909
U S D	1,089,366	Alternative Loan Trust 2007-AL1 Class A1 ^{(a), (b)} 1.48% due 06/25/37	773,105
U S D	363,227	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 Class A1 ^{(b), (d)} 1.46% due 08/25/37	253,169
U S D	861,081	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2005-AR3 Class 1A1 ^{(a), (b)} 1.50% due 08/25/35	766,439
		米國合計 (簿価 \$10,794,066)	11,287,902
		債券合計 (簿価 \$11,035,195)	11,548,057
		証券数 株式リンク証券 (11.9%)	
		カナダ (2.5%)	
		Canadian Imperial Bank of Commerce into Texas Instruments, Inc. due 10/18/17	125,889
		Canadian Imperial Bank of Commerce into Ultra Beauty, Inc. due 08/24/17	73,170
		Royal Bank of Canada into Alphabet, Inc. due 10/20/17	124,894
		Royal Bank of Canada into Baker Hughes due 10/18/17	75,033
		Royal Bank of Canada into Citigroup, Inc. due 08/29/17	128,657
		Royal Bank of Canada into Costco Wholesale Corp. due 10/03/17	124,371
		Royal Bank of Canada into Darden Restaurants, Inc. due 08/22/17	47,337
		Royal Bank of Canada into Delta Air Lines, Inc. due 08/29/17	113,660
		Royal Bank of Canada into Du Pont (E. I.) De Nemours due 10/20/17	48,960
		Royal Bank of Canada into JetBlue Airways due 10/20/17	48,847
		Royal Bank of Canada into JP Morgan Chase & Co. due 08/29/17	126,012
		Royal Bank of Canada into Merck & Co., Inc. due 10/25/17	125,533
		Royal Bank of Canada into Wells Fargo & Co. due 08/29/17	124,104
		カナダ合計 (簿価 \$1,301,786)	1,286,467
		フランス (3.0%)	
		BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Abbott Laboratories due 09/08/17	73,480
		BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Bank of America Corp. due 08/31/17	126,979
		BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into BASF SE due 09/20/17	74,988
		BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Caterpillar, Inc. due 10/20/17	124,847

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

証券数	有価証券の明細	評価額
2,953	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Charles Schwab Corp. due 08/31/17	126,384
1,202	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into E*TRADE Financial Corp. due 09/08/17	49,608
1,705	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Microsoft Corp. due 09/08/17	124,029
837	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Nucor Corp. due 09/07/17	49,031
1,336	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Steel Dynamics, Inc. due 09/07/17	48,143
6,653	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into Telefonica S. A. due 09/20/17	74,988
407	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into United Rentals, Inc. due 09/07/17	48,960
674	BNP Paribas Arbitrage Issuance BV into UnitedHealth Group, Inc. due 09/12/17	127,963
523	Societe Generale S. A. into Boeing Co. due 09/21/17	125,495
717	Societe Generale S. A. into Daimler AG due 09/14/17	50,476
1,387	Societe Generale S. A. into DR Horton, Inc. due 09/21/17	50,012
808	Societe Generale S. A. into Hilton Worldwide Holdings, Inc. due 09/21/17	50,395
2,155	Societe Generale S. A. into PayPal Holdings, Inc. due 09/21/17	128,444
2,307	Societe Generale S. A. into Peugeot S. A. due 09/14/17	49,775
782	Societe Generale S. A. into Xilinx, Inc. due 09/21/17	49,896
	フランス合計 (簿価 \$1,558,435)	1,553,893
	ドイツ (1.2%)	
1,364	Deutsche Bank AG into Alcoa Corp. due 09/07/17	49,929
1,067	Deutsche Bank AG into Electronic Arts, Inc. due 10/18/17	125,017
559	Deutsche Bank AG into Goldman Sachs Group, Inc. due 09/08/17	126,311
145	Deutsche Bank AG into Kering due 09/20/17	50,435
1,169	Deutsche Bank AG into Novo Nordisk A/S due 08/31/17	50,313
1,632	Deutsche Bank AG into T-Mobile U. S., Inc. due 09/07/17	100,658
1,600	Deutsche Bank AG into Walgreens Boots Alliance, Inc. due 10/17/17	127,699
	ドイツ合計 (簿価 \$624,693)	630,362
	日本 (0.1%)	

証券数	有価証券の明細	評価額
2, 208	HSBC Bank PLC into Dai-Ichi Life Holdings, Inc. due 08/04/17	38, 126
946	Nomura International Funding Pte, Ltd. into Dai-Ichi Life Holdings, Inc. due 08/04/17	15, 941
	日本合計 (簿価 \$51, 619)	54, 067
	スイス (0. 4%)	
327	Credit Suisse AG into Humana, Inc. due 08/01/17	76, 215
387	Credit Suisse AG into Parker Hannifin Corp. due 07/31/17	63, 495
387	due 08/01/17	63, 756
	スイス合計 (簿価 \$200, 625)	203, 466
	英国 (1. 0%)	
2, 729	Barclays Bank PLC into KeyCorp. due 09/12/17	49, 449
779	Barclays Bank PLC into WPP PLC due 08/23/17	15, 875
1, 681	due 08/23/17	34, 307
326	HSBC Bank PLC into ASML Holding NV due 10/12/17	49, 497
1, 913	HSBC Bank PLC into Mylan NV due 08/04/17	74, 573
1, 319	HSBC Bank PLC into Philips NV due 09/12/17	50, 431
503	Nomura Bank International PLC into Crown Castle International Corp. due 09/08/17	50, 511
807	Nomura International Funding Pte, Ltd. into Home Depot, Inc. due 08/14/17	121, 483
714	Nomura International Funding Pte, Ltd. into Norwegian Cruise Line Holdings Ltd. due 08/04/17	39, 108
714	due 08/07/17	39, 019
	英国合計 (簿価 \$522, 560)	524, 253
	米国 (3. 6%)	
521	Citigroup, Inc. into Allergan PLC due 08/07/17	129, 307
634	Citigroup, Inc. into Constellation Brands, Inc. due 10/02/17	123, 756
1, 421	Citigroup, Inc. into Newell Brands, Inc. due 08/07/17	75, 471
253	Citigroup, Inc. into O'Reilly Automotive, Inc. due 09/21/17	50, 584
542	Citigroup, Inc. into Tiffany & Co. due 08/22/17	51, 462
542	due 08/23/17	51, 397
962	Goldman Sachs International into Autodesk, Inc. due 08/29/17	105, 129
1, 149	Goldman Sachs International into Carnival Corp. due 09/25/17	76, 588

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

証券数	有価証券の明細	評価額
1,639	Goldman Sachs International into Lowe's Co., Inc. due 08/23/17	126,816
554	Goldman Sachs International into Tiffany & Co. due 08/23/17	51,854
503	Goldman Sachs International into Workday, Inc. due 08/31/17	51,131
481	J. P. Morgan Structured Products BV into SAP SE due 09/12/17	50,738
2,898	J. P. Morgan Structured Products BV into Volvo AB due 10/19/17	48,702
2,130	Merrill Lynch International & Co. CV into ABB Ltd. due 10/19/17	49,229
2,661	Merrill Lynch International & Co. CV into Applied Materials, Inc. due 08/10/17	118,770
404	Merrill Lynch International & Co. CV into Domino's Pizza, Inc. due 10/25/17	75,319
590	Merrill Lynch International & Co. CV into FedEx Corp. due 09/14/17	123,726
476	Merrill Lynch International & Co. CV into Kansas City Southern due 10/18/17	49,454
940	Merrill Lynch International & Co. CV into Lennar Corp. due 09/14/17	49,855
940	Merrill Lynch International & Co. CV into Lennar Corp. due 09/15/17	49,865
3,131	Merrill Lynch International & Co. CV into MGM Resorts International due 08/03/17	103,283
2,706	Merrill Lynch International & Co. CV into Morgan Stanley due 10/12/17	127,609
1,319	Merrill Lynch International & Co. CV into Suntrust Banks, Inc. due 10/18/17	75,262
	米国合計（簿価 \$1,809,292）	1,815,307
	株式リンク証券合計（簿価 \$6,069,010）	6,067,815
証券数	上場投資信託（ETF）（57.4%）	
	米国（57.4%）	
60,095	Alerian MLP ETF	721,140
25,187	iShares 10+ Year Credit Bond ETF ^(e)	1,556,305
14,341	iShares 1-3 Year Credit Bond ETF ^(e)	1,513,119
12,800	iShares Core High Dividend ETF ^(e)	1,081,728
101,980	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF ^(e)	9,067,042
31,421	iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF ^(e)	3,805,397
29,787	iShares International Developed Real Estate ETF ^(e)	872,759
107,373	iShares International Select Dividend ETF ^(e)	3,598,069
6,674	iShares U. S. Real Estate ETF ^(e)	538,325
168,737	iShares U. S. Preferred Stock ETF ^(e)	6,622,927
	米国合計	29,376,811
	上場投資信託（ETF）合計（簿価 \$28,526,356）	29,376,811
	投資信託（4.8%）	
	ルクセンブルク（4.8%）	
24,215	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Equity Income Fund Class X6 ^(e)	269,756

証券数	有価証券の明細	評価額
201,422	BlackRock Global Funds - Asian Tiger Bond Fund Class X3 ^(e)	2,159,246
	ルクセンブルク合計	2,429,002
	投資信託合計 (簿価 \$2,334,821)	2,429,002
契約数	購入済みオプション (0.0%)	
	米国 (0.0%)	
	S&P 500 Index	
2	@ 2,350 due Oct 2017	4,220
	S&P 500 Index	
3	@ 2,300 due Oct 2017	4,590
	S&P 500 Index	
4	@ 2,375 due Oct 2017	10,080
	米国合計	18,890
	購入済みオプション合計 (支払済みプレミアム \$29,283)	18,890
元本	短期運用 (8.1%)	
	グランド・ケイマン (0.0%)	
	定期預金 (0.0%)	
	Brown Brothers Harriman & Co.	
EUR	1,126 -0.56% due 08/01/17	1,328
JPY	9,991 -0.22% due 08/01/17	90
GBP	12,705 0.05% due 08/01/17	16,750
NOK	1 0.07% due 08/01/17	0
AUD	1,638 0.58% due 08/01/17	1,308
USD	3,009 0.59% due 08/01/17	3,009
	定期預金合計	22,485
	グランド・ケイマン合計 (簿価 \$22,485)	22,485
	日本 (0.8%)	
	定期預金 (0.8%)	
	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ, Ltd.	
JPY	46,526,203 -0.22% due 08/01/17	421,071
	定期預金合計	421,071
	日本合計 (簿価 \$421,071)	421,071
	オランダ (0.0%)	
	定期預金 (0.0%)	
	ING Bank	
AUD	25,451 0.58% due 08/01/17	20,319
	定期預金合計	20,319
	オランダ合計 (簿価 \$20,319)	20,319
	プエルトリコ (2.5%)	
	定期預金 (2.5%)	
	Citibank N. A.	
USD	1,271,640 0.59% due 08/01/17	1,271,640
	定期預金合計	1,271,640
	プエルトリコ合計 (簿価 \$1,271,640)	1,271,640
	スウェーデン (0.1%)	
	定期預金 (0.1%)	
	Skandinaviska Enskilda Banken AB	
SEK	412,256 -0.95% due 08/01/17	50,965

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
		定期預金合計		50,965
		スウェーデン合計（簿価 \$50,965）		50,965
		スイス（0.1%）		
		定期預金（0.1%）		
		Credit Suisse AG		
C H F	48,001	−1.45% due 08/02/17		49,749
		定期預金合計		49,749
		スイス合計（簿価 \$49,749）		49,749
		英国（1.0%）		
		定期預金（1.0%）		
		Citibank N. A.		
E U R	419,245	−0.56% due 08/01/17		494,290
		定期預金合計		494,290
		英国合計（簿価 \$494,290）		494,290
		米国（3.6%）		
		定期預金（3.6%）		
		JP Morgan Chase & Co.		
U S D	1,838,427	0.59% due 08/01/17		1,838,427
		定期預金合計		1,838,427
		米国合計（簿価 \$1,838,427）		1,838,427
		短期運用合計（簿価 \$4,168,946）		4,168,946
		投資総額（簿価 \$52,163,611）	104.7%	\$ 53,609,521
		現金および他の資産を超過する負債	(4.7)	(2,418,697)
		純資産	100.0%	\$ 51,190,824

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ない分類しています。

- (a) コーラブル債
- (b) 2017年7月31日現在の変動利付証券
- (c) 永久債
- (d) 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。取引の買い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。
- (e) 運用会社の利害関係人

2017年7月31日現在、以下の先物取引について現金 \$368,613をブローカーが保有しています。

2017年7月31日現在の先物建玉（純資産の−0.2%）

ポジション	銘柄	限月	契約枚数	純評価益 / (損)
売り	Euro FX Currency Futures	2017年9月	(14)	\$ (90,058)
買い	Euro STOXX 50 Futures	2017年9月	19	(22,607)
売り	Japan Yen Currency Futures	2017年9月	(6)	(3,589)
買い	Nikkei 225 IDX Futures	2017年9月	3	(1,871)
売り	S&P 500 E-Mini Futures	2017年9月	(17)	(22,104)
売り	U. S. Long Bond Futures	2017年9月	(8)	(10,280)
売り	U. S. Treasury 2-Year Note Futures	2017年9月	(6)	(831)
売り	U. S. Treasury 5-Year Note Futures	2017年9月	(26)	108
買い	U. S. Treasury 10-Year Note Futures	2017年9月	10	(538)
売り	U. S. Ultra Bond Futures	2017年9月	(7)	(1,981)
				\$ (153,751)

2017年7月31日現在のファンドレベルの外国為替先渡契約残高 (純資産の-0.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
U S D	Deutsche Bank AG	386,379	2017/8/3	E U R	338,000	\$ -	\$ (12,144)	\$ (12,144)
U S D	Deutsche Bank AG	399,134	2017/9/6	E U R	338,000	-	(170)	(170)
						\$ -	\$ (12,314)	\$ (12,314)

2017年7月31日現在のブラジル・リアル・クラスの外国為替先渡契約残高 (純資産の1.8%)

買い	取引相手	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	Citibank N. A.	47,100,180	2017/8/10	U S D	14,162,663	\$ 887,178	\$ -	\$ 887,178
B R L	Citibank N. A.	662,721	2017/8/10	J P Y	22,054,971	12,087	-	12,087
B R L	Citibank N. A.	816,418	2017/8/10	E U R	209,316	13,979	-	13,979
						\$ 913,244	\$ -	\$ 913,244

2017年7月31日現在の通貨セレクト・クラスの外国為替先渡契約残高 (純資産の0.2%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
C N Y	Citibank N. A.	7,059,676	2017/8/10	U S D	1,034,043	\$ 14,609	\$ -	\$ 14,609
C N Y	Citibank N. A.	96,980	2017/8/10	J P Y	1,611,129	-	(181)	(181)
C N Y	Citibank N. A.	117,805	2017/8/10	E U R	15,283	-	(528)	(528)
I D R	Citibank N. A.	13,914,082,623	2017/8/10	U S D	1,033,612	9,917	-	9,917
I D R	Citibank N. A.	190,824,276	2017/8/10	J P Y	1,611,771	-	(281)	(281)
I D R	Citibank N. A.	232,064,797	2017/8/10	E U R	15,280	-	(618)	(618)
I N R	Citibank N. A.	68,786,119	2017/8/10	U S D	1,059,153	12,029	-	12,029
I N R	Citibank N. A.	944,518	2017/8/10	J P Y	1,651,469	-	(243)	(243)
I N R	Citibank N. A.	1,146,015	2017/8/10	E U R	15,657	-	(621)	(621)
M X N	Citibank N. A.	18,046,981	2017/8/10	U S D	981,382	28,417	-	28,417
M X N	Citibank N. A.	251,268	2017/8/10	J P Y	1,529,290	214	-	214
M X N	Citibank N. A.	310,404	2017/8/10	E U R	14,505	259	-	259
R U B	Citibank N. A.	63,924,443	2017/8/10	U S D	1,058,357	2,407	-	2,407
R U B	Citibank N. A.	879,706	2017/8/10	J P Y	1,650,706	-	(347)	(347)
R U B	Citibank N. A.	1,078,533	2017/8/10	E U R	15,646	-	(558)	(558)
T R Y	Citibank N. A.	4,709,402	2017/8/10	U S D	1,289,705	43,679	-	43,679
T R Y	Citibank N. A.	65,410	2017/8/10	J P Y	2,009,304	328	-	328
T R Y	Citibank N. A.	79,994	2017/8/10	E U R	19,062	164	-	164
						\$ 112,023	\$ (3,377)	\$ 108,646

2017年7月31日現在の円ヘッジ・クラスの外国為替先渡契約残高 (純資産の0.4%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
J P Y	Citibank N. A.	1,031,042,692	2017/8/10	U S D	9,123,535	\$ 210,712	\$ -	\$ 210,712
J P Y	Citibank N. A.	17,243,872	2017/8/10	E U R	134,847	-	(2,937)	(2,937)
						\$ 210,712	\$ (2,937)	\$ 207,775

ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）

通貨の略称：

AUD	-	豪ドル
BRL	-	ブラジル・リアル
CHF	-	スイス・フラン
CNY	-	中国元
EUR	-	ユーロ
GBP	-	英ポンド
IDR	-	インドネシア・ルピア
INR	-	インド・ルピー
JPY	-	日本円
MXN	-	メキシコ・ペソ
NOK	-	ノルウェー・クローネ
RUB	-	ロシア・ルーブル
SEK	-	スウェーデン・クローネ
TRY	-	トルコ・リラ
USD	-	米ドル

<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）為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）が投資対象として
いる「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2017年12月11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（2018年2月19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34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8月19日から2018年2月19日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
707 国庫短期証券 2017/12/11	千円 70,000		千円

(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

2018年2月19日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第6期 (決算日 2017年12月11日)

(計算期間 2016年12月10日～2017年12月11日)

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第6期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

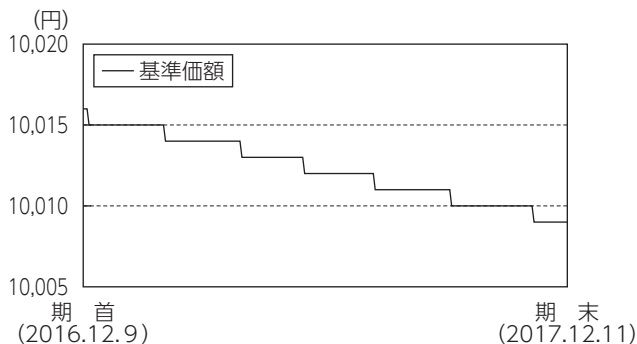
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 率
	騰 落 率	組 入 比 率	
(期首)2016年12月9日	円	%	%
	10,016	-	28.2
12月末	10,015	△0.0	-
2017年1月1日	10,015	△0.0	31.1
2月末	10,014	△0.0	25.3
3月末	10,014	△0.0	-
4月末	10,013	△0.0	35.3
5月末	10,012	△0.0	5.1
6月末	10,012	△0.0	0.6
7月末	10,011	△0.0	0.1
8月末	10,011	△0.0	-
9月末	10,010	△0.1	-
10月末	10,010	△0.1	-
11月末	10,009	△0.1	-
(期末)2017年12月11日	10,009	△0.1	-

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
 (注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、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：10,016円 期末：10,009円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

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

◆前期における「今後の運用方針」

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況
公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国債証券	33,310,870	(36,270,000)

(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

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
645	国庫短期証券 2017/2/20		4,280,100
669	国庫短期証券 2017/6/12		3,020,099
657	国庫短期証券 2017/4/17		2,860,055
659	国庫短期証券 2017/4/24		2,650,077
652	国庫短期証券 2017/3/27		2,530,020
642	国庫短期証券 2017/2/6		2,410,036
644	国庫短期証券 2017/5/12		2,070,088
651	国庫短期証券 2017/3/21		1,970,049
660	国庫短期証券 2017/5/1		1,450,027
638	国庫短期証券 2017/1/16		1,270,010

(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。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■組入資産明細表

当期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	17,415,714	100.0
投資信託財産総額	17,415,714	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	17,415,714,754円
コール・ローン等	17,415,714,754
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	17,415,714,754
元本	17,399,953,390
次期繰越損益金	15,761,364
(D) 受益権総口数	17,399,953,390口
1万口当り基準価額(C / D)	10,009円

* 期首における元本額は10,476,400,958円、当期中における追加設定元本額は9,625,428,641円、同解約元本額は2,701,876,209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DBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジあり) 6,592,748円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジなし) 10,288,683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・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32,460,107円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 3-858,588,190円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 6-3,325,620,751円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 7-828,595,357円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 4-3,326,673,327円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト12 Ver 2-549,443,563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、ダイワ円債セレクト マネーコース808,108,471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/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型) 1,235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) 1,598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) 1,544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) 1,984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12-679,321,043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10,009円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月10日 至2017年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 8,299,426円
受取利息	△ 922,829
支払利息	△ 7,376,597
(B) 有価証券売買損益	△ 2,491
売買損	△ 2,491
(C) その他費用	△ 174,287
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 8,476,204
(E) 前期繰越損益金	16,325,703
(F) 解約差損益金	△ 3,147,995
(G) 追加信託差損益金	11,059,860
(H) 合計(D + E + F + G)	15,761,364
次期繰越損益金(H)	15,761,364

(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。