

★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／国内／債券	
信託期間	約10年間（2016年2月23日～2026年2月10日）	
運用方針	ラダー型ファンド	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
	マネーポートフォリオ	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	ラダー型ファンド	わが国の国債
	マネーポートフォリオ	イ、ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券 ロ、円建ての債券
運用方法	ラダー型ファンド	①主として、わが国の国債に投資し利息収入を確保するとともに、信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。 ②運用にあたっては、残存期間が15年程度から20年程度までの国債に投資し、残存期間ごとの国債への投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることをめざします。 ③運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、国債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④国債の組入比率は、通常の状態では高位に維持することを基本とします。
	マネーポートフォリオ	①マザーファンドの受益証券および円建ての債券を中心に投資することにより、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
組入制限	ラダー型ファンド	・株式組入上限比率は純資産総額の10%以下
	マネーポートフォリオ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の10%以下
分配方針	ラダー型ファンド	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、継続的な分配を行なうことを目標に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、分配を行わないことがあります。
	マネーポートフォリオ	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

# ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド -SLトレーダー- ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・ マネーポートフォリオ -SLトレーダー-

## 運用報告書(全体版)

第1期（決算日 2016年5月10日）  
第2期（決算日 2016年8月10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、「ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド -SLトレーダー-」および「ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ -SLトレーダー-」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、第1期、第2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/>

<4622>  
<4623>

★ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド – S L トレードー

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 国債指数		公社債比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2016年 5月10日)	10,542	20	5.6	10,310	3.1	99.5	—	3,410
2 期末 (2016年 8月10日)	10,539	20	0.2	10,298	△ 0.1	99.0	—	4,454

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

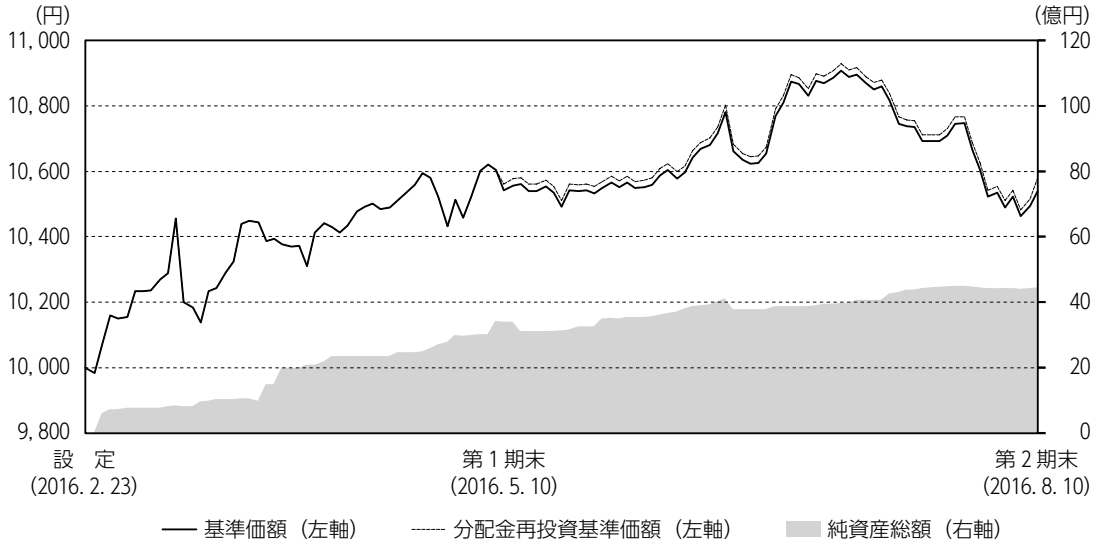
(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 国債指数 (参考指数) は、ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 国債指数の原データに基づき、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 国債指数は、株式会社大和総研が公表している日本国債のパフォーマンス・インデックスです。

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

## 《運用経過》

### 基準価額等の推移について



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

第2期末：10,539円（既払分配金40円）

騰落率：5.8%（分配金再投資ベース）

### ■基準価額の主な変動要因

日本国債に投資した結果、国債からの利息収入を得るとともに金利水準の低下による国債の値上がり益が発生したことが寄与し、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。

ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド - S L トレード -

	年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 国債指数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
第 1 期	(設定) 2016年 2月23日	円	%	(2/22)	%	%	%
		10,000	—	10,000	—	—	—
	2月末	10,156	1.6	10,087	0.9	98.0	—
	3月末	10,311	3.1	10,186	1.9	99.3	—
	4月末	10,520	5.2	10,287	2.9	99.5	—
(期末) 2016年 5月10日	10,562	5.6	10,310	3.1	99.5	—	
第 2 期	(期首) 2016年 5月10日	10,542	—	10,310	—	99.5	—
	5月末	10,565	0.2	10,326	0.2	99.4	—
	6月末	10,831	2.7	10,469	1.5	99.2	—
	7月末	10,667	1.2	10,375	0.6	98.5	—
	(期末) 2016年 8月10日	10,559	0.2	10,298	△ 0.1	99.0	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比 (第1期は設定比。)

## 投資環境について

### ○国内債券市況

国内長期金利は、設定時よりマイナス圏で推移し、2016年4月下旬にかけて緩やかに低下した後、6月上旬にかけては横ばい圏で推移しました。6月中旬には、日銀の追加金融緩和への期待から国内長期金利は再び低下しましたが、日銀による金融政策の現状維持を受け、その後はいったん上昇しました。しかし、市場の追加金融緩和観測は根強く、6月下旬以降の国内長期金利は低下基調を強め再び過去最低を更新し、7月上旬にかけても低下傾向を保った後、7月中旬に入るとやや上昇しました。その後、国内長期金利は再度低下しましたが、日銀がETF（上場投資信託）買い入れの増額などの追加金融緩和を決定したものの、市場で期待されていた国債買い入れの増額やマイナス金利の深掘りが見送られたことから国内長期金利は上昇に転じ、第2期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

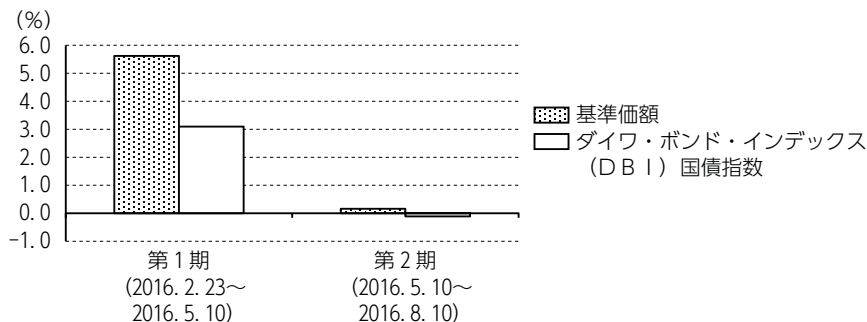
日本国債に投資し利息収入を確保するとともに、信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないました。

運用にあたっては、残存期間が15年程度から20年程度までの日本国債に投資し、残存期間ごと（1年単位）の日本国債の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れました。

日本国債の組入比率は高位を維持しました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。  
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



## 分配金について

第1期から第2期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ20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		第1期	第2期
		2016年2月23日 ～2016年5月10日	2016年5月11日 ～2016年8月10日
当期分配金（税込み）	(円)	20	20
対基準価額比率	(%)	0.19	0.19
当期の収益	(円)	20	19
当期の収益以外	(円)	—	0
翌期繰越分配対象額	(円)	541	539

(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	第1期	第2期
(a) 経費控除後の配当等収益	13.78円	19.59円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	196.14	0.00
(c) 収益調整金	351.99	423.97
(d) 分配準備積立金	0.00	115.64
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	561.92	559.20
(f) 分配金	20.00	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	541.92	539.20

(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》

日本国債に投資し利息収入を確保するとともに、信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないません。

運用にあたっては、残存期間が15年程度から20年程度までの日本国債に投資し、残存期間ごと（1年単位）の日本国債の投資金額がほぼ同程度となるように組み入れることをめざします。

日本国債の組入比率は通常の状態でも高位を維持することを基本とします。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第 1 期～第 2 期		項 目 の 概 要
	(2016. 2. 23～2016. 8. 10)		
	金 額	比 率	
信託報酬	15円	0. 138%	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, 523円です。</b>
(投信会社)	(7)	(0. 063)	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)	(7)	(0. 063)	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. 012)	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. 002	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0. 002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	15	0. 140	

(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。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



■売買および取引の状況

公 社 債

(2016年2月23日から2016年8月10日まで)

決 算 期		第 1 期 ~ 第 2 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 4,929,920	千円 572,789 ( )

(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2月23日から2016年8月10日まで)

第 1 期 ~ 第 2 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
131 20年国債 1.7% 2031/9/20	997,866	131 20年国債 1.7% 2031/9/20	121,747
140 20年国債 1.7% 2032/9/20	993,020	146 20年国債 1.7% 2033/9/20	118,297
146 20年国債 1.7% 2033/9/20	988,902	140 20年国債 1.7% 2032/9/20	117,589
150 20年国債 1.4% 2034/9/20	979,639	150 20年国債 1.4% 2034/9/20	110,286
154 20年国債 1.2% 2035/9/20	970,490	154 20年国債 1.2% 2035/9/20	104,869

(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。

■利害関係人との取引状況

(1) 当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2016年2月23日から2016年8月10日まで)

決 算 期	第 1 期 ~ 第 2 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	
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%						
公社債	4,929	40	0.8	572	—	—						
コール・ローン	7,581	—	—	—	—	—						

■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	当作成期間中 設 定 額	当作成期間中 解 約 額	第2期末保有額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	10	—	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) 単位未満は切捨て。

(2) 当作成期間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

当作成期間（第1期～第2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、当作成期間における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド - S L トレーダー

■組入資産明細表

(1) 国内 (邦貨建) 公社債 (種類別)

作成期	第 2 期 末							
	区 分	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 3,578,300	千円 4,408,036	% 99.0	% —	% 99.0	% —	% —	

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 国内 (邦貨建) 公社債 (銘柄別)

第 2 期 末						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日	
国債証券	131 20年国債	1.7000	千円 706,600	千円 880,649	2031/09/20	
	140 20年国債	1.7000	702,600	882,100	2032/09/20	
	146 20年国債	1.7000	696,600	879,534	2033/09/20	
	150 20年国債	1.4000	725,700	883,198	2034/09/20	
	154 20年国債	1.2000	746,800	882,553	2035/09/20	
合 計	銘柄数 金 額	5銘柄	3,578,300	4,408,036		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年8月10日現在

項 目	第 2 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 4,408,036	% 98.7
コール・ローン等、その他	57,835	1.3
投資信託財産総額	4,465,871	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5月10日)、(2016年8月10日) 現在

項 目	第1期末	第2期末
<b>(A) 資産</b>	<b>3,813,087,394円</b>	<b>4,465,871,253円</b>
コール・ローン等	414,684,679	36,323,741
公社債(評価額)	3,393,196,013	4,408,036,061
未収利息	3,903,396	14,509,467
前払費用	1,303,306	7,001,984
<b>(B) 負債</b>	<b>402,750,269</b>	<b>11,438,270</b>
未払金	395,098,740	—
未払収益分配金	6,470,048	8,453,071
未払信託報酬	1,159,895	2,911,267
その他未払費用	21,586	73,932
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>3,410,337,125</b>	<b>4,454,432,983</b>
元本	3,235,024,323	4,226,535,862
次期繰越損益金	175,312,802	227,897,121
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,235,024,323口</b>	<b>4,226,535,862口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,542円	10,539円

\* 設定時における元本額は10,000,000円、当作成期間(第1期~第2期)中における追加設定元本額は5,051,081,938円、同解約元本額は834,546,076円です。

\* 第2期末の計算口数当りの純資産額は10,539円です。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	第1期	第2期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,459,384円	8,280,099円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	63,452,650	0
(c) 収益調整金	113,870,816	179,192,633
(d) 分配準備積立金	0	48,877,460
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	181,782,850	236,350,192
(f) 分配金	6,470,048	8,453,071
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	175,312,802	227,897,121
(h) 受益権総口数	3,235,024,323口	4,226,535,862口

■損益の状況

第1期 自2016年2月23日 至2016年5月10日  
第2期 自2016年5月11日 至2016年8月10日

項 目	第1期	第2期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>4,537,007円</b>	<b>11,244,247円</b>
受取利息	4,541,425	11,259,915
支払利息	△ 4,418	△ 15,668
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>64,556,508</b>	<b>△ 26,796,755</b>
売買益	68,607,582	5,300,264
売買損	△ 4,051,074	△ 32,097,019
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 1,181,481</b>	<b>△ 2,964,148</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>67,912,034</b>	<b>△ 18,516,656</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>—</b>	<b>48,877,460</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>113,870,816</b>	<b>205,989,388</b>
(配当等相当額)	( 2,744,853)	( 36,958,065)
(売買損益相当額)	( 111,125,963)	( 169,031,323)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>181,782,850</b>	<b>236,350,192</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 6,470,048</b>	<b>△ 8,453,071</b>
次期繰越損益金 (G + H)	175,312,802	227,897,121
追加信託差損益金	113,870,816	205,989,388
(配当等相当額)	( 2,744,853)	( 36,958,065)
(売買損益相当額)	( 111,125,963)	( 169,031,323)
分配準備積立金	61,441,986	48,704,488
繰越損益金	—	△ 26,796,755

(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	第 1 期	第 2 期
	20円	20円
(単 価)	(10, 542円)	(10, 539円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額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。

★ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - S Lトレード-

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	税 分	込 配	み 金			
1 期末 (2016年 5 月10日)	円	円	%	%	%	百万円
	10,000	0	0.0	20.0	—	52
2 期末 (2016年 8 月10日)	9,999	0	△ 0.0	25.9	—	51

(注 1) 公社債および債券先物の組入比率は、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。

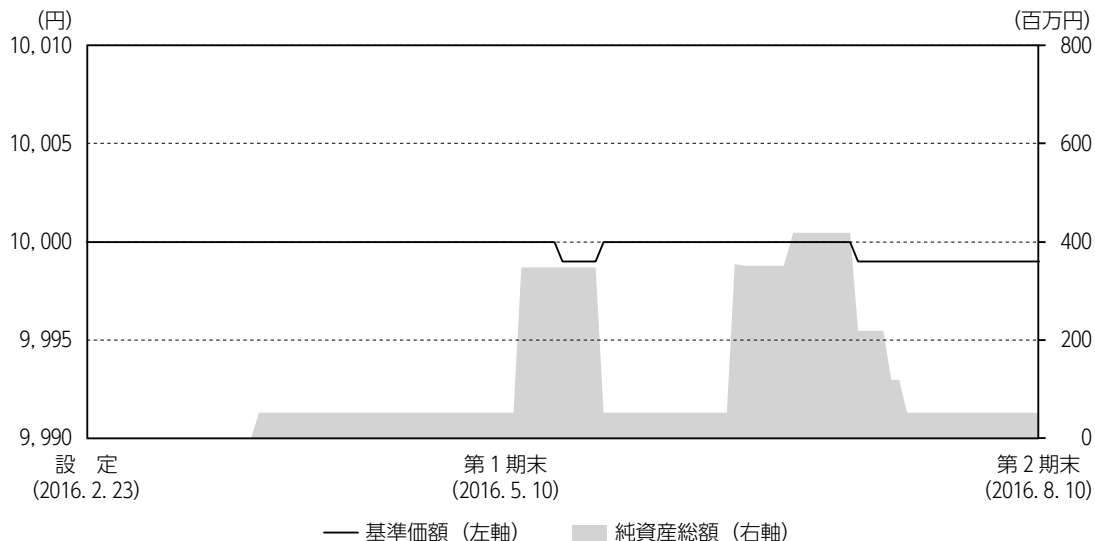
(注 2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注 4) 当ファンドは、ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド - S Lトレード-の資金をスイッチングにより一時滞留させる受皿としての役割を持ったファンドであり、マザーファンドおよび短期金融資産による安定運用を行ないます。そのため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

## 《運用経過》

### 基準価額等の推移について



#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

第2期末：9,999円

騰落率：△0.0%

#### ■基準価額の変動要因

低金利環境であったことなどから、基準価額は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。

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 比
		円	騰 落 率 %		
第 1 期	(設定) 2016年 2月23日	10,000	—	—	—
	2月末	10,000	0.0	28.1	—
	3月末	10,000	0.0	1.1	—
	4月末	10,000	0.0	4.1	—
	(期末) 2016年 5月10日	10,000	0.0	20.0	—
第 2 期	(期首) 2016年 5月10日	10,000	—	20.0	—
	5月末	10,000	0.0	0.1	—
	6月末	10,000	0.0	1.4	—
	7月末	9,999	△	13.5	—
	(期末) 2016年 8月10日	9,999	△	25.9	—

(注) 騰落率は期首比 (第1期は設定比。)

## 投資環境について

### ○国内短期金融市況

日銀のマイナス金利政策の影響により、短期金融市場ではマイナス圏での金利水準が続き、無担保コール翌日物金利は $\Delta 0.05\%$ 程度、国庫短期証券（3カ月物）の利回りは $\Delta 0.23\%$ 程度で第2期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

### ○ダイワ・マネースtock・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

第1期および第2期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、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	第1期	第2期
	2016年2月23日 ～2016年5月10日	2016年5月11日 ～2016年8月10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）	0	0

（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

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

### ○ダイワ・マネースtock・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	第 1 期～第 2 期		項 目 の 概 要
	(2016. 2. 23～2016. 8. 10)		
	金 額	比 率	
信託報酬	0円	0.000%	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10,000円です。</b>
(投信会社)	(0)	(0.000)	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)	(0)	(0.000)	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)	(―)	(―)	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	0.001	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.001	

(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まず。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況  
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年2月23日から2016年8月10日まで)

決算期	第1期～第2期					
	設定			解約		
	□数	金額	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	500,871	502,899	465,105	466,954		

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第1期～第2期）中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2016年2月23日から2016年8月10日まで)

決算期	第1期～第2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	百万円	%				
公社債	105,673	18,000	17.0		—	—					
コール・ローン	2,728,901	—	—		—	—					

(注) 平均保有割合0.2%

※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) 当作成期間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

当作成期間（第1期～第2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、当作成期間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	当作成期間中設定額	当作成期間中解約額	第2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) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種類	第2期末	
	□数	評価額
	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	35,765	35,905

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年8月10日現在

項目	第2期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	35,905	69.8
コール・ローン等、その他	15,565	30.2
投資信託財産総額	51,471	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5月10日)、(2016年8月10日) 現在

項 目	第1期末	第2期末
<b>(A) 資産</b>	<b>52,476,923円</b>	<b>51,471,228円</b>
コール・ローン等	23,926,922	15,565,829
ダイワ・マネーストック・マザーファンド(評価額)	28,550,001	35,905,399
<b>(B) 負債</b>	<b>184</b>	<b>331</b>
未払信託報酬	7	—
その他未払費用	177	331
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>52,476,739</b>	<b>51,470,897</b>
元本	52,477,833	51,477,833
次期繰越損益金	△ 1,094	△ 6,936
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>52,477,833口</b>	<b>51,477,833口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,000円	9,999円

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当作成期間(第1期~第2期)中における追加設定元本額は717,430,787円、同解約元本額は666,952,954円です。

\* 第2期末の計算口数当りの純資産額は9,999円です。

\* 第2期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は6,936円です。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	第1期	第2期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,082	285
(c) 収益調整金	7	3,965
(d) 分配準備積立金	0	20
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,089	4,270
(f) 分配金	0	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,089	4,270
(h) 受益権総口数	52,477,833口	51,477,833口

■損益の状況

第1期 自2016年2月23日 至2016年5月10日  
第2期 自2016年5月11日 至2016年8月10日

項 目	第1期	第2期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 911円</b>	<b>△ 2,617円</b>
受取利息	—	9,742
支払利息	△ 911	△ 12,359
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1</b>	<b>△ 4,045</b>
売買益	1	23,434
売買損	—	△ 27,479
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 184</b>	<b>△ 254</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 1,094</b>	<b>△ 6,916</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>—</b>	<b>△ 20</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>—</b>	<b>—</b>
(配当等相当額)	(△ 7)	(△ 3,965)
(売買損益相当額)	( ) 7)	( ) 3,965)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 1,094</b>	<b>△ 6,936</b>
<b>次期繰越損益金 (G)</b>	<b>△ 1,094</b>	<b>△ 6,936</b>
追加信託差損益金	—	—
(配当等相当額)	(△ 7)	(△ 3,965)
(売買損益相当額)	( ) 7)	( ) 3,965)
分配準備積立金	1,082	305
繰越損益金	△ 2,176	△ 7,241

(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。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - S Lトレーダー）が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・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、当ファンドの第2期の決算日（2016年8月10日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を20ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

(2016年2月23日から2016年8月10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	18,690,605		
601 国庫短期証券 2016/7/19	18,510,383		
596 国庫短期証券 2016/6/20	11,560,241		
588 国庫短期証券 2016/5/16	8,500,095		
607 国庫短期証券 2016/8/15	7,700,132		
605 国庫短期証券 2016/8/8	6,790,235		
587 国庫短期証券 2016/8/10	5,200,027		
609 国庫短期証券 2016/8/22	4,050,128		
586 国庫短期証券 2016/5/12	4,000,096		
98 5年国債 0.3% 2016/6/20	3,990,332		

(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10日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（40,240,269千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年8月10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 14,970,000	千円 14,970,405	% 37.1	% —	% —	% —	% 37.1

(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10日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
国債証券	343 2年国債	0.1000	330,000	330,000	2016/08/15	
	607 国庫短期証券	—	7,700,000	7,700,103	2016/08/15	
	609 国庫短期証券	—	4,050,000	4,050,107	2016/08/22	
	610 国庫短期証券	—	60,000	60,003	2016/08/29	
	611 国庫短期証券	—	2,680,000	2,680,175	2016/09/05	
	558 国庫短期証券	—	10,000	10,001	2016/09/20	
	615 国庫短期証券	—	140,000	140,015	2016/09/20	
合 計	銘 柄 数 金 額	7銘柄	14,970,000	14,970,405		

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド 運用報告書 第6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・マネースtock・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

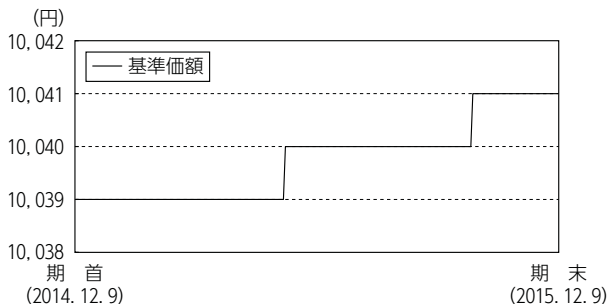
## 大和投資信託

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		公社債組入比率
	円	騰落率	
(期首) 2014年12月9日	10,039	—	58.5
12月末	10,039	0.0	97.2
2015年1月末	10,039	0.0	71.6
2月末	10,039	0.0	62.6
3月末	10,039	0.0	56.0
4月末	10,039	0.0	58.0
5月末	10,040	0.0	59.9
6月末	10,040	0.0	56.2
7月末	10,040	0.0	57.4
8月末	10,040	0.0	55.6
9月末	10,040	0.0	59.3
10月末	10,041	0.0	71.0
11月末	10,041	0.0	52.1
(期末) 2015年12月9日	10,041	0.0	51.6

(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：10,039円 期末：10,041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く、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。

■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)

国	買付額	売付額
内	千円 75,714,577	千円 — ( 43,770,000)

(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、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。

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド

## ■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		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
568 国庫短期証券 2016/2/15	7,000,594		
574 国庫短期証券 2016/3/14	5,000,640		
573 国庫短期証券 2016/3/7	4,500,619		
540 国庫短期証券 2015/9/24	3,799,996		
557 国庫短期証券 2015/12/14	2,999,999		
567 国庫短期証券 2016/2/8	2,999,997		
520 国庫短期証券 2015/6/22	2,999,976		
555 国庫短期証券 2015/12/7	2,500,000		
553 国庫短期証券 2015/11/24	2,060,000		
536 国庫短期証券 2015/9/7	2,000,000		

(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		
区分	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	32,420,000	32,424,550	51.6	—	—	—	51.6

(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
国債証券	557 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,999	2015/12/14
	559 国庫短期証券	—	2,000,000	2,000,000	2015/12/21
	560 国庫短期証券	—	1,600,000	1,599,999	2015/12/28
	563 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/01/18
	566 国庫短期証券	—	1,500,000	1,499,999	2016/02/01
	567 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,998	2016/02/08
	568 国庫短期証券	—	7,000,000	7,000,594	2016/02/15
	573 国庫短期証券	—	4,500,000	4,500,612	2016/03/07
	556 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,123	2016/03/10
	574 国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,640	2016/03/14
	575 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,448	2016/06/10
	342 2年国債	0.1000	720,000	720,576	2016/07/15
	100 5年国債	0.3000	600,000	601,560	2016/09/20
合計	銘柄数	13銘柄			
	金額		32,420,000	32,424,550	

(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	
	評 価 額	比 率
公社債	32,424,550	40.2
コール・ローン等、その他	48,181,367	59.8
投資信託財産総額	80,605,918	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。



■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月9日現在

項目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>80,605,918,433円</b>
コール・ローン等	48,180,683,441
公社債(評価額)	32,424,550,578
未収利息	481,238
前払費用	203,176
<b>(B) 負債</b>	<b>17,814,126,500</b>
未払金	17,502,126,500
未払解約金	312,000,000
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>62,791,791,933</b>
元本	62,535,131,959
次期繰越損益金	256,659,974
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>62,535,131,959口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,041円

\*期首における元本額は817,136,908円、当期中における追加設定元本額は80,209,414,361円、同解除元本額は18,491,419,310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、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジあり)112,594,660円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジなし)73,734,556円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-07 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-09 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-11 9,962円、ロボット・テクノロジー関連株ファンドーロポテックー3,983,667円、新興国ソブリン・豪ドルファンド(毎月決算型)999円、新興国ソブリン・ブラジルリアルファンド(毎月決算型)999円、新興国ソブリン・ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)999円、アジア高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)999円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド A コース2,996,693円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド B コース2,494,264円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド C コース999,197円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 A コース698,255円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 B コース458,853円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 A コース1,994,416円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 B コース648,186円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 C コース179,498円、世界優先証券ファンド(為替ヘッジあり/限定追加型)998円、U.S短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)3,988,832円、U.S短期高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)4,984円、ダイワ上場投信ー日経平均レバレッジ・インデックス14,063,387,856円、ダイワ上場投信ー日経平均ダブルインバース・インデックス2,983,307,364円、ダイワ上場投信ーTOPIXレバレッジ(2倍)指数2,081,906,471円、ダイワ上場投信ーTOPIXダブルインバース(ー2倍)指数796,936,766円、ダイワ上場投信ー日経平均インバース・インデックス37,546,378,604円、ダイワ上場投信ーTOPIXインバース(ー1倍)指数2,340,731,717円、ダイワ上場投信ーJ P X日経400レバレッジ・インデックス687,286,710円、ダイワ上場投信ーJ P X日経400インバース・インデックス278,916,205円、ダイワ上場投信ーJ P X日経400ダブルインバース・インデックス727,153,136円、ダイワ/シュロダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型)為替ヘッジあり7,009,001円、ダイワ/シュロダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型)為替ヘッジなし904,221円、ダイワ・プルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ4,980,676円、ダイワ・プルベア・セレクトドル高安ポートフォリオ258,995,899円、ダイワ・プルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ69,726,080円、ダイワ/モルガン・スタンレー新興4カ国不動産関連ファンドー成長の権音(つちおと)ー11,000,000円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンドーマネー・ポートフォリオ197,260,107円、ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ90,940,158円、ダイワ米国高利回り不動産証券ファンド19,942,168円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 豪ドル・コース(毎月分配型)4,184,518円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 通貨セレクト・コース(毎月分配型)4,981,569円、ダイワU.S

短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)199,295円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)997円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジなし)997円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり49,806円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし49,806円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型)米ドル・コース4,980,080円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型)ブラジル・リアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型)通貨セレクト・コース3,685,259円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり(毎月分配型)399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし(毎月分配型)99,771円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース(毎月分配型)399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース(毎月分配型)99,771円、ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジあり)20,016,725円、ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジなし)4,000,959円、ダイワ/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド49,850,449円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 日本円・コース(毎月分配型)398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 豪ドル・コース(毎月分配型)99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 米ドル・コース(毎月分配型)398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー 通貨セレクト・コース(毎月分配型)1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー 予想配分金提示型 日本円・コース3,488,836円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー 予想配分金提示型 豪ドル・コース2,492,026円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー 予想配分金提示型 ブラジル・リアル・コース3,488,836円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー 予想配分金提示型 米ドル・コース19,936,205円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー 予想配分金提示型 通貨セレクト・コース11,961,723円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,041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>4,849,980円</b>
受取利息	4,849,980
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 176,333</b>
売買益	15,667
売買損	△ 192,000
<b>(C) 当期損益金 (A + B)</b>	<b>4,673,647</b>
<b>(D) 前期繰越損益金</b>	<b>3,178,379</b>
<b>(E) 解約差損益金</b>	<b>△ 74,181,691</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>322,989,639</b>
<b>(G) 合計 (C + D + E + F)</b>	<b>256,659,974</b>
次期繰越損益金 (G)	256,659,974

(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。