

★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、分配を行な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、分配を行な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ペビエファンド（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3期（決算日 2016年11月10日）  
第4期（決算日 2017年2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4期の決算を行ないました。

ここに、第3期、第4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>

★ラダー型ファンド

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 組入 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
3 期末 (2016年11月10日)	10,366	20	△ 1.5	10,221	△ 0.7	99.0	—	5,178
4 期末 (2017年 2月10日)	9,960	20	△ 3.7	10,022	△ 1.9	98.9	—	9,796

(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。

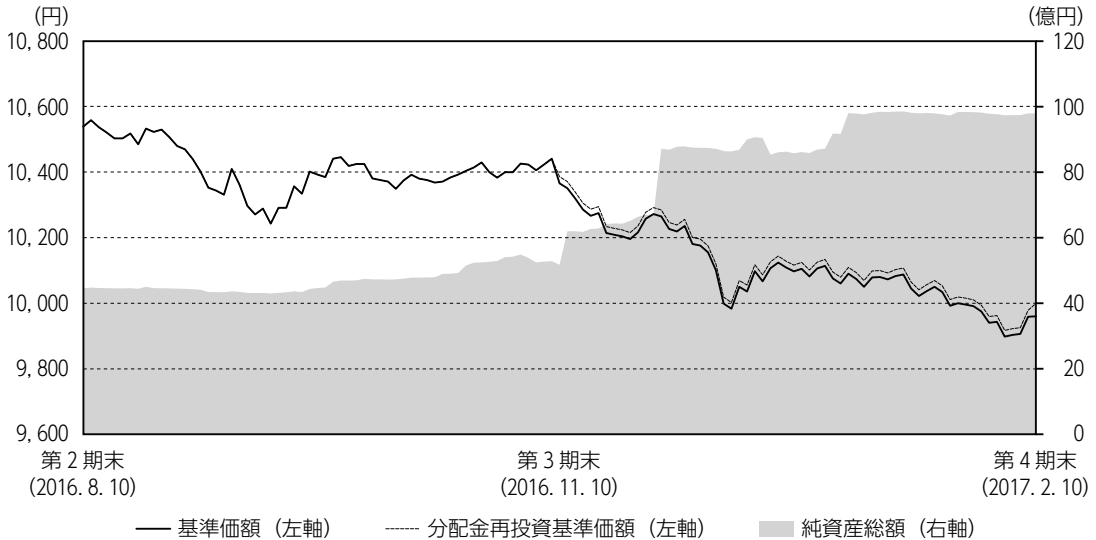
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(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

第3期首：10,539円

第4期末：9,960円（既払分配金40円）

騰落率：△5.1%（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た一方、金利水準の上昇による国債価格の下落により、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 3 期	(期 首) 2016年 8 月10日	円 10,539	% —	10,298	% —	% 99.0	% —
	8 月末	10,440	△ 0.9	10,255	△ 0.4	98.5	—
	9 月末	10,419	△ 1.1	10,262	△ 0.4	99.1	—
	10 月末	10,400	△ 1.3	10,229	△ 0.7	99.1	—
	(期 末) 2016年11月10日	10,386	△ 1.5	10,221	△ 0.7	99.0	—
第 4 期	(期 首) 2016年11月10日	10,366	—	10,221	—	99.0	—
	11 月末	10,265	△ 1.0	10,156	△ 0.6	98.8	—
	12 月末	10,114	△ 2.4	10,092	△ 1.3	98.6	—
	2017年 1 月末	9,991	△ 3.6	10,030	△ 1.9	98.6	—
	(期 末) 2017年 2 月10日	9,980	△ 3.7	10,022	△ 1.9	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

(2016. 8. 11 ~ 2017. 2. 10)

### 国内債券市況

国内長期金利（10年国債利回り）は、第3期首より横ばい圏での推移が続きましたが、2016年11月の米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、今後の財政拡大などが意識されて米国の金利が上昇し、それに連れて国内長期金利も上昇しました。12月には、FOMC（米国連邦公開市場委員会）で政策金利の見通しが上方修正されて米国の金利がさらに上昇し、国内長期金利も上昇しました。しかし12月半ば以降は、米国の金利の上昇が一服したこともあり、国内長期金利は横ばい圏で推移しました。

## 前作成期間末における「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を維持することを基本とします。

## ポートフォリオについて

(2016. 8. 11 ~ 2017. 2. 10)

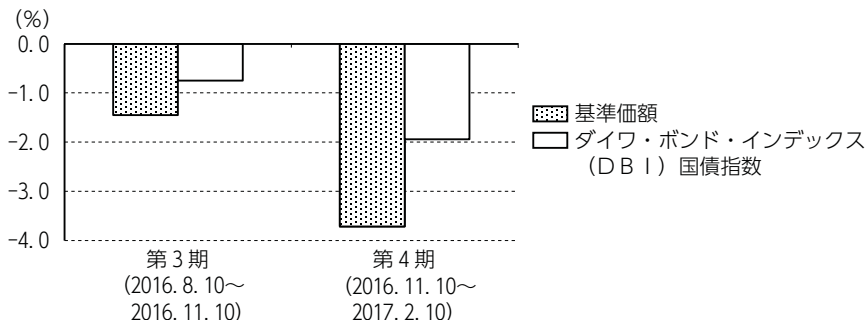
日本国債に投資し利息収入を確保するとともに、信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないました。

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3期から第4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3期		第4期	
	2016年8月11日 ～2016年11月10日		2016年11月11日 ～2017年2月10日	
当期分配金（税込み）	(円)	20	20	
対基準価額比率	(%)	0.19	0.20	
当期の収益	(円)	18	16	
当期の収益以外	(円)	1	3	
翌期繰越分配対象額	(円)	414	203	

(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3期	第4期
(a) 経費控除後の配当等収益	18.26円	16.52円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00
(c) 収益調整金	327.56	167.14
(d) 分配準備積立金	89.01	40.20
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	434.84	223.87
(f) 分配金	20.00	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	414.84	203.87

(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 3 期～第 4 期 (2016. 8. 11～2017. 2. 10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	15円	0. 149%	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, 254円です。</b>
( 投 信 会 社 )	(7)	(0. 068)	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. 068)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 銀 行 )	(1)	(0. 013)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0. 003	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. 003)	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	16	0. 152	

(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8月11日から2017年2月10日まで)

決 算 期		第 3 期 ~ 第 4 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	国債証券	千円 7,345,743	千円 1,660,607 ( )

(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8月11日から2017年2月10日まで)

第 3 期 ~ 第 4 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
158 20年国債 0.5% 2036/9/20	2,173,570	131 20年国債 1.7% 2031/9/20	870,506
154 20年国債 1.2% 2035/9/20	1,309,035	154 20年国債 1.2% 2035/9/20	163,375
150 20年国債 1.4% 2034/9/20	1,294,835	150 20年国債 1.4% 2034/9/20	160,637
146 20年国債 1.7% 2033/9/20	1,287,784	140 20年国債 1.7% 2032/9/20	157,195
140 20年国債 1.7% 2032/9/20	1,280,517	146 20年国債 1.7% 2033/9/20	156,489
		158 20年国債 0.5% 2036/9/20	152,403

(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8月11日から2017年2月10日まで)

決 算 期	第 3 期 ~ 第 4 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B		売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	
百万円		百万円	%		百万円	百万円
公社債	7,345	19	0.3	1,660	24	1.5
コール・ローン	24,546	—	—	—	—	—

(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3期～第4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)

区 分	第 4 期 末						
	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 8,668,700	千円 9,684,928	% 98.9	% —	% 98.9	% —	% —

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 国内 (邦貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	第 4 期 末					
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	140 20年国債	1.7000%	千円 1,619,600	千円 1,937,235	2032/09/20	
	146 20年国債	1.7000%	千円 1,617,600	千円 1,937,350	2033/09/20	
	150 20年国債	1.4000%	千円 1,687,700	千円 1,934,931	2034/09/20	
	154 20年国債	1.2000%	千円 1,749,800	千円 1,936,783	2035/09/20	
	158 20年国債	0.5000%	千円 1,994,000	千円 1,938,626	2036/09/20	
合 計	銘柄数 金 額	5銘柄	8,668,700	9,684,928		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年2月10日現在

項 目	第 4 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 9,684,928	% 98.6
コール・ローン等、その他	137,529	1.4
投資信託財産総額	9,822,457	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11月10日)、(2017年2月10日) 現在

項 目	第3期末	第4期末
<b>(A) 資産</b>	<b>5,259,995,548円</b>	<b>9,822,457,772円</b>
コール・ローン等	63,747,336	94,591,081
公社債(評価額)	5,126,212,595	9,684,928,365
未収入金	62,154,130	—
未収利息	6,954,804	28,873,810
前払費用	926,683	14,064,516
<b>(B) 負債</b>	<b>81,654,625</b>	<b>26,315,105</b>
未払収益分配金	9,991,136	19,671,150
未払解約金	68,099,766	—
未払信託報酬	3,500,136	6,462,903
その他未払費用	63,587	181,052
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>5,178,340,923</b>	<b>9,796,142,667</b>
元本	4,995,568,184	9,835,575,254
次期繰越損益金	182,772,739	△ 39,432,587
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>4,995,568,184口</b>	<b>9,835,575,254口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,366円	9,960円

\* 第2期末における元本額は4,226,535,862円、当作成期間(第3期~第4期)中における追加設定元本額は6,873,913,538円、同解約元本額は1,264,874,146円です。

\* 第4期末の計算口数当りの純資産額は9,960円です。

\* 第4期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は39,432,587円です。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	第3期	第4期
(a) 経費控除後の配当等収益	9,122,346円	16,250,598円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0
(c) 収益調整金	163,639,608	164,399,070
(d) 分配準備積立金	44,467,554	39,546,752
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	217,229,508	220,196,420
(f) 分配金	9,991,136	19,671,150
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	207,238,372	200,525,270
(h) 受益権総口数	4,995,568,184口	9,835,575,254口

■損益の状況

第3期 自2016年8月11日 至2016年11月10日  
 第4期 自2016年11月11日 至2017年2月10日

項 目	第3期	第4期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>12,686,069円</b>	<b>22,830,966円</b>
受取利息	12,697,283	22,875,272
支払利息	△ 11,214	△ 44,306
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 69,215,939</b>	<b>△ 314,850,368</b>
売買益	3,957,347	18,417,582
売買損	△ 73,173,286	△ 333,267,950
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 3,563,723</b>	<b>△ 6,580,368</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 60,093,593</b>	<b>△ 298,599,770</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>20,001,921</b>	<b>△ 45,428,180</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>232,855,547</b>	<b>324,266,513</b>
(配当等相当額)	( 58,536,817)	( 164,399,070)
(売買損益相当額)	( 174,318,730)	( 159,867,443)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>192,763,875</b>	<b>△ 19,761,437</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 9,991,136</b>	<b>△ 19,671,150</b>
<b>次期繰越損益金 (G + H)</b>	<b>182,772,739</b>	<b>△ 39,432,587</b>
追加信託差損益金	232,855,547	324,266,513
(配当等相当額)	( 58,536,817)	( 164,399,070)
(売買損益相当額)	( 174,318,730)	( 159,867,443)
分配準備積立金	43,598,764	36,126,200
繰越損益金	△ 93,681,572	△ 399,825,300

(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 3 期	第 4 期
	20円	20円
(単 価)	(10, 366円)	(9, 960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。

★マネーポートフォリオ

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
	円	円	騰落 率	%			
1 期末 (2016年 5月10日)	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	
3 期末 (2016年11月10日)	9,997	0	△ 0.0	17.5	—	220	
4 期末 (2017年 2月10日)	9,995	0	△ 0.0	38.5	—	136	

(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。

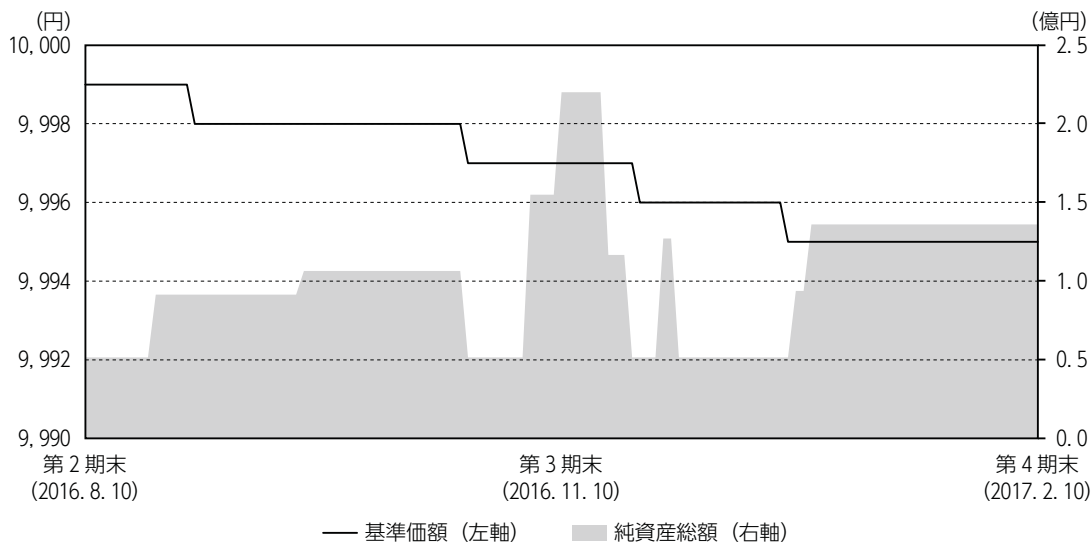
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(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いません。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

第3期首：9,999円

第4期末：9,995円

騰落率：△0.0%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。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 3 期	(期 首) 2016年 8 月10日	9,999	—	25.9	—
	8 月末	9,998	△ 0.0	32.5	—
	9 月末	9,998	△ 0.0	18.2	—
	10 月末	9,997	△ 0.0	2.4	—
	(期 末) 2016年11月10日	9,997	△ 0.0	17.5	—
第 4 期	(期 首) 2016年11月10日	9,997	—	17.5	—
	11 月末	9,996	△ 0.0	18.6	—
	12 月末	9,995	△ 0.0	—	—
	2017年 1 月末	9,995	△ 0.0	21.8	—
	(期 末) 2017年 2 月10日	9,995	△ 0.0	38.5	—

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2016. 8. 11 ~ 2017. 2. 10)

### 国内短期金融市況

第3期首より、日銀はマイナス金利付き量的・質的金融緩和を継続し、2016年9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

## 前作成期間末における「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。

## ポートフォリオについて

(2016. 8. 11 ~ 2017. 2. 10)

### 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

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。



## 分配金について

第3期および第4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（1万口当たり）

項 目	第3期	第4期
	2016年8月11日 ～2016年11月10日	2016年11月11日 ～2017年2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 3 期～第 4 期 (2016. 8. 11～2017. 2. 10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—円	—%	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9,997円です。</b>
( 投 信 会 社 )	(—)	(—)	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 )	(—)	(—)	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 )	(—)	(—)	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	0.000	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
合 計	0	0.000	

(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) 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8月11日から2017年2月10日まで)

決算期	第3期～第4期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	255,395	256,342	196,255	196,985

(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3期～第4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8月11日から2017年2月10日まで)

決算期	第3期～第4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
百万円		百万円	%			百万円
公社債	146,663	42,251	28.8	—	—	—
コール・ローン	4,588,425	—	—	—	—	—

(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3期～第4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。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	第2期末	第4期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	35,765	94,905	95,247

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年2月10日現在

項目	第4期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	95,247	70.0
コール・ローン等、その他	40,817	30.0
投資信託財産総額	136,064	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11月10日)、(2017年2月10日) 現在

項 目	第3期末	第4期末
<b>(A) 資産</b>	<b>220,180,248円</b>	<b>136,064,483円</b>
コール・ローン等	66,054,094	40,817,480
ダイワ・マネーストック・マザーファンド(評価額)	154,126,154	95,247,003
<b>(B) 負債</b>	<b>98</b>	<b>250</b>
その他未払費用	98	250
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>220,180,150</b>	<b>136,064,233</b>
元本	220,247,173	136,133,638
次期繰越損益金	△ 67,023	△ 69,405
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>220,247,173口</b>	<b>136,133,638口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	<b>9,997円</b>	<b>9,995円</b>

\* 第2期末における元本額は51,477,833円、当作成期間(第3期~第4期)中における追加設定元本額は384,116,641円、同解約元本額は299,460,836円です。

\* 第4期末の計算口数当りの純資産額は9,995円です。

\* 第4期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は69,405円です。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	第3期	第4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	0	7,170
(c) 収益調整金	0	0
(d) 分配準備積立金	147	14
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	147	7,184
(f) 分配金	0	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	147	7,184
(h) 受益権総口数	220,247,173口	136,133,638口

■損益の状況

第3期 自2016年8月11日 至2016年11月10日  
第4期 自2016年11月11日 至2017年2月10日

項 目	第3期	第4期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 2,053円</b>	<b>△ 3,953円</b>
受取利息	1,288	1,699
支払利息	△ 3,341	△ 5,652
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 7,501</b>	<b>△ 4,373</b>
売買益	2,511	△ 801
売買損	△ 10,012	△ 3,572
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 98</b>	<b>△ 152</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 9,652</b>	<b>△ 8,478</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 3,354</b>	<b>△ 1,230</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 54,017</b>	<b>△ 59,697</b>
(配当等相当額)	(△ 23,443)	(△ 18,798)
(売買損益相当額)	(△ 30,574)	(△ 40,899)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 67,023</b>	<b>△ 69,405</b>
次期繰越損益金 (G)	△ 67,023	△ 69,405
追加信託差損益金	△ 54,017	△ 59,697
(配当等相当額)	(△ 23,443)	(△ 18,798)
(売買損益相当額)	(△ 30,574)	(△ 40,899)
分配準備積立金	147	7,184
繰越損益金	△ 13,153	△ 16,892

(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（2016年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの第4期の決算日（2017年2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8月11日から2017年2月10日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
613 国庫短期証券 2016/9/12	18,220,258		
645 国庫短期証券 2017/2/20	13,910,363		
611 国庫短期証券 2016/9/5	12,530,219		
642 国庫短期証券 2017/2/6	9,700,144		
629 国庫短期証券 2016/11/28	8,570,294		
610 国庫短期証券 2016/8/29	7,860,148		
619 国庫短期証券 2016/10/11	7,720,160		
632 国庫短期証券 2016/12/12	7,380,262		
620 国庫短期証券 2016/10/17	7,150,250		
623 国庫短期証券 2016/10/31	6,010,184		

(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、2017年2月10日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（41,735,087千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2017年2月10日現在						
	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
国債証券	千円 23,040,000	千円 23,040,702	% 55.0	% —	% —	% —	% 55.0

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2017年2月10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	643 国庫短期証券	— %	千円 3,090,000	千円 3,090,025	2017/02/13	
	645 国庫短期証券	—	13,910,000	13,910,303	2017/02/20	
	647 国庫短期証券	—	10,000	10,000	2017/02/27	
	648 国庫短期証券	—	2,820,000	2,820,152	2017/03/06	
	631 国庫短期証券	—	1,580,000	1,580,102	2017/03/10	
	649 国庫短期証券	—	1,630,000	1,630,118	2017/03/13	
合 計	銘 柄 数 金 額	6銘柄	23,040,000	23,040,702		

(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7期 (決算日 2016年12月9日)

(計算期間 2015年12月10日～2016年12月9日)

ダイワ・マネースtock・マザーファンドの第7期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

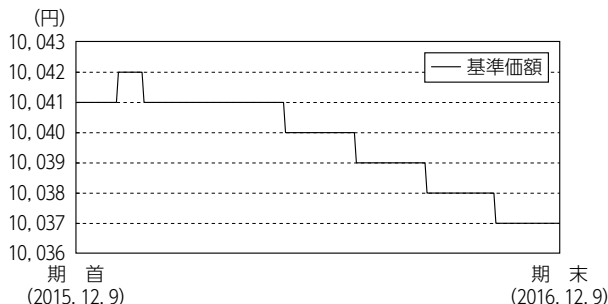
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額の推移



年月日	基準価額		公社債組入比率
	円	騰落率 %	
(期首) 2015年12月9日	10,041	—	51.6
12月末	10,041	0.0	51.7
2016年1月末	10,042	0.0	90.7
2月末	10,041	0.0	51.1
3月末	10,041	0.0	2.0
4月末	10,041	0.0	7.5
5月末	10,040	△ 0.0	0.1
6月末	10,040	△ 0.0	2.0
7月末	10,039	△ 0.0	19.3
8月末	10,038	△ 0.0	46.5
9月末	10,038	△ 0.0	26.0
10月末	10,037	△ 0.0	3.4
11月末	10,037	△ 0.0	26.6
(期末) 2016年12月9日	10,037	△ 0.0	29.1

(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：10,041円 期末：10,037円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

期首より、日銀は量的・質的金融緩和を継続し、2016年1月にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券(3カ月物)の利回りおよび無担保コール翌日物金利は低下しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用(その他)	0 (0)
合計	0

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公社債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

国	買付額 千円	売付額 千円
国内	215,986,756	2,822,446 ( 233,210,000)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子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。

# 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

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

当 期		期 末	
買 付	売 付	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	575 国庫短期証券 2016/6/10	1,500,603
601 国庫短期証券 2016/7/19	18,510,383	342 2年国債 0.1% 2016/7/15	720,475
613 国庫短期証券 2016/9/12	18,220,258	100 5年国債 0.3% 2016/9/20	601,368
611 国庫短期証券 2016/9/5	15,210,394		
596 国庫短期証券 2016/6/20	11,560,241		
588 国庫短期証券 2016/5/16	9,500,428		
609 国庫短期証券 2016/8/22	8,580,187		
629 国庫短期証券 2016/11/28	8,570,294		
610 国庫短期証券 2016/8/29	7,920,152		
619 国庫短期証券 2016/10/11	7,720,160		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 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)

区 分	当 期			期 末			
	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	
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	12,370,000	12,370,239	29.1	—	—	—	29.1

(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。

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

### (2) 国内(邦貨建) 公社債(銘柄別)

区 分	当 期		期 末		償還年月日
	銘 柄	年利率	額面金額	評価額	
		%	千円	千円	
国債証券	632 国庫短期証券	—	7,380,000	7,380,059	2016/12/12
	634 国庫短期証券	—	2,070,000	2,070,043	2016/12/19
	635 国庫短期証券	—	2,920,000	2,920,135	2016/12/26
合計	銘柄数		3銘柄		
	金 額		12,370,000	12,370,239	

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	12,370,239	27.2
コール・ローン等、その他	33,049,576	72.8
投資信託財産総額	45,419,816	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	45,419,816,005円
コール・ローン等	33,049,294,532
公社債(評価額)	12,370,239,552
その他未収収益	281,921
(B) 負債	2,970,027,930
未払金	1,470,027,930
未払解約金	1,500,000,000
(C) 純資産総額(A-B)	42,449,788,075
元本	42,294,564,193
次期繰越損益金	155,223,882
(D) 受益権総口数	42,294,564,193口
1万口当り基準価額(C/D)	10,037円

\* 期首における元本額は62,535,131,959円、当期中における追加設定元本額は110,785,944,225円、同解約元本額は131,026,511,991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)3,021,993円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジなし)1,018,149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-ロボテック-49,795,838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、US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、US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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド-ロボテック(為替ヘッジあり)39,849円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド(年1回決算型)-ロボテック(年1回)- (為替ヘッジあり)3,985円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス13,026,074,887円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス7,057,921,466円、ダイワ上場投信-TOPIXレバレッジ(2倍)指数1,434,536,786円、ダイワ上場投信-TOPIXダブルインバース(-2倍)指数757,087,194円、ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス11,055,796,865円、ダイワ上場投信-TOPIXインバース(-1倍)指数2,230,635,146円、ダイワ上場投信-JPX日経400レバレッジ・インデックス901,494,652円、ダイワ上場投信-JPX日経400インバース・インデックス4,402,808,262円、ダイワ上場投信-JPX日経400ダブルインバース・インデックス313,802,045円、ダイワ米国投資法人債ファンド(為替ヘッジあり)2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(部分為替ヘッジあり)2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(為替ヘッジあり)2016-10 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(部分為替ヘッジあり)2016-10 997円、ダイワ・プルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ185,052,355円、ダイワ・プルベア・セレクト ドル高円安ポートフォリオ160,376,323円、ダイワ・プルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ76,963,963円、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トレード - 48,811,188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-成長の福音(つちおと) - 11,000,000円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ395,846,364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91,481,943円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・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US短期ハイ・ワ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、ダイワ/ミレニアセット垂細亜株式ファンド9,958,176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/ミレニアセット・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/ミレニアセット・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/ミレニアセット・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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド(年1回決算型) - ロボット(年1回) - 100,588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/ミレニアセット・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)2,088,438円、ダイワ/ミレニアセット・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)1,012,911円、ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド10,009,811円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ - 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) - ジャパン・トリプルリターンズ - 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) - ジャパン・トリプルリターンズ - 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) - ジャパン・トリプルリターンズ - 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) - ジャパン・トリプルリターンズ - 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 - イーグルアイII - 予想分配金提示型 日本円・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 豪ドル・コース499,994円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 ブラジル・リアル・コース1,496,804円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 米ドル・コース9,976,045円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII - 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース2,001,563円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,037円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月10日 至2016年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 16,210,382円
受取利息	△ 3,627,074
その他収益金	281,921
支払利息	△ 12,865,229
(B) 有価証券売買損益	△ 1,217,528
売買益	236,035
売買損	△ 1,453,563
(C) その他費用	△ 176,405
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 17,604,315
(E) 前期繰越損益金	256,659,974
(F) 解約差損益金	△ 525,706,324
(G) 追加信託差損益金	441,874,547
(H) 合計 (D + E + F + G)	155,223,882
次期繰越損益金 (H)	155,223,882

(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。