

DCダイワ・マネー・ ポートフォリオ

★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	無期限	
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	ベビーファンド	イ. ダイワ・マネー・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券 ロ. わが国の公社債
	ダイワ・マネー・マザーファンド	本邦通貨表示の公社債
マザーファンドの運用方法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A－2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	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30%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、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。	

当ファンドは、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。

運用報告書(全体版) 第1期 (決算日 2017年3月31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、「DCダイワ・マネー・ポートフォリオ」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/>

設定以来の運用実績

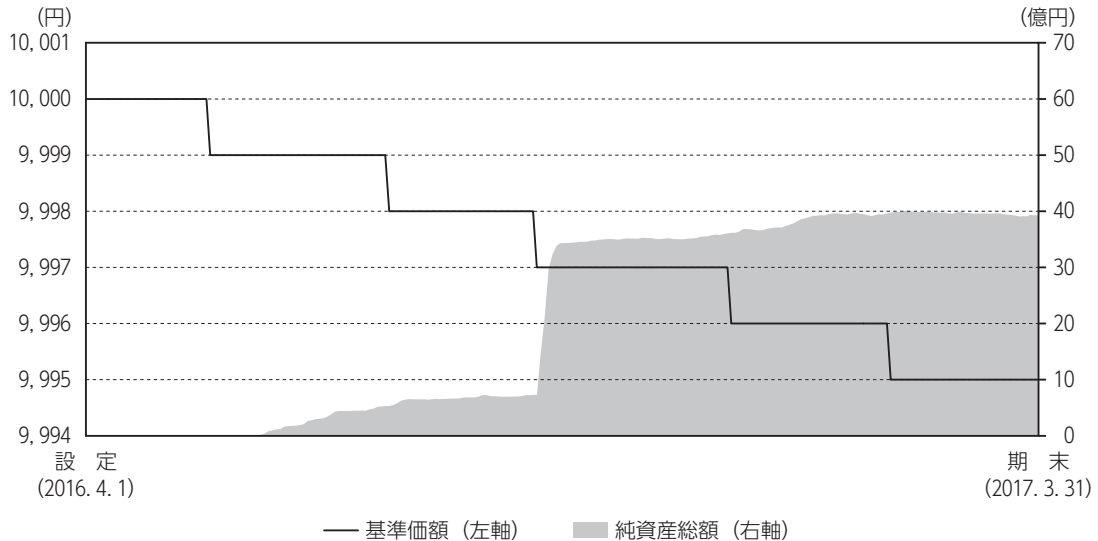
決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率		
1 期末 (2017年 3 月31日)	円 9,995	円 0	% △ 0.1	% —	百万円 3,924

(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、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

設定時：10,000円

期 末：9,995円

騰落率：△0.1%

■基準価額の変動要因

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券を通じて投資した短期の国債やコール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

DCダイワ・マネー・ポートフォリオ

年 月 日	基 準	価 額		公社債組入比率
		騰	落 率	
(設定) 2016年 4 月 1 日	円	%		%
	10, 000	—		—
4 月末	10, 000	0. 0		1. 8
5 月末	9, 999	△ 0. 0		0. 0
6 月末	9, 999	△ 0. 0		1. 1
7 月末	9, 998	△ 0. 0		13. 4
8 月末	9, 998	△ 0. 0		31. 2
9 月末	9, 997	△ 0. 0		17. 9
10月末	9, 997	△ 0. 0		2. 4
11月末	9, 997	△ 0. 0		18. 7
12月末	9, 996	△ 0. 0		—
2017年 1 月末	9, 996	△ 0. 0		21. 5
2 月末	9, 995	△ 0. 1		17. 2
(期末) 2017年 3 月31日	9, 995	△ 0. 1		—

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 4. 1 ~ 2017. 3. 31)

国内短期金融市況

設定時より、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。

ポートフォリオについて

(2016. 4. 1 ~ 2017. 3. 31)

当ファンド

「ダイワ・マネー・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・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、現先取引およびコール・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

当期は、分配対象額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。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2016年4月1日 ～2017年3月31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)	—

- (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・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・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

上記の運用方針により、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資する場合があります。

今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご留意くださいますようお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2016. 4. 1～2017. 3. 31)		項 目 の 概 要
	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 期中の平均基準価額は9,997円です。
(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)	(0)	(0.000)	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4月1日から2017年3月31日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	2, 968, 294	3, 026, 215	271, 323	276, 587

(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)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4月1日から2017年3月31日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	391,460	74,351	19.0	—	—	—
コール・ローン	12,170,887	—	—	—	—	—
現先取引 (その他有価証券)	92,999	—	—	91,999	—	—

(注) 平均保有割合2.7%
※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) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千□	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	2, 696, 970	2, 749, 022

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成
2017年3月31日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	2, 749, 022	69.8
コール・ローン等、その他	1, 187, 105	30.2
投資信託財産総額	3, 936, 127	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3月31日現在		
項 目	当 期 末	
(A) 資産	3,936,127,533円	
コール・ローン等	1,187,105,050	
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	2,749,022,483	
(B) 負債	11,942,050	
未払解約金	11,930,130	
未払信託報酬	1,915	
その他未払費用	10,005	
(C) 純資産総額 (A－B)	3,924,185,483	
元本	3,926,189,347	
次期繰越損益金	△	2,003,864
(D) 受益権総口数	3,926,189,347口	
1万口当り基準価額 (C／D)	9,995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4,904,703,903円、同解約元本額は979,514,556円です。
 ＊当期末の計算口数当りの純資産額は9,995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2,003,864円です。

■損益の状況

当期 自2016年4月1日 至2017年3月31日		
項 目	当 期	
(A) 配当等収益	△	270,194円
受取利息		36,935
支払利息	△	307,129
(B) 有価証券売買損益	△	534,823
売買益		71,726
売買損	△	606,549
(C) 信託報酬等	△	13,240
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	△	818,257
(E) 追加信託差損益金	△	1,185,607
(配当等相当額)	(△	193,044)
(売買損益相当額)	(△	992,563)
(F) 合計 (D＋E)	△	2,003,864
次期繰越損益金 (F)	△	2,003,864
追加信託差損益金	△	1,185,607
(配当等相当額)	(△	193,044)
(売買損益相当額)	(△	992,563)
繰越損益金	△	818,257

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
 (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
 (注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a＋b＋c＋d)	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e－f)	0
(h) 受益権総口数	3,926,189,347口

ダイワ・マネー・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・マネー・ポートフォリオ）が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2016年12月 9 日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年 3 月31日）現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を 9 ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年 4 月 1 日から2017年 3 月31日まで)

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	27, 570, 641		
613 国庫短期証券 2016/9/12	27, 280, 379		
591 国庫短期証券 2016/5/30	24, 330, 973		
611 国庫短期証券 2016/9/5	19, 330, 584		
601 国庫短期証券 2016/7/19	19, 020, 392		
642 国庫短期証券 2017/2/6	17, 230, 250		
652 国庫短期証券 2017/3/27	16, 550, 132		
629 国庫短期証券 2016/11/28	14, 720, 456		
596 国庫短期証券 2016/6/20	14, 390, 312		
632 国庫短期証券 2016/12/12	14, 020, 490		

(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 3 月31日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（62, 974, 780千円）の内容です。

国内その他有価証券

	2017年 3 月31日現在	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999, 999	<1.6>

(注 1) < >内は、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。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第12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・マザーファンドの第12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	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
運用方法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A－2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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30%以下

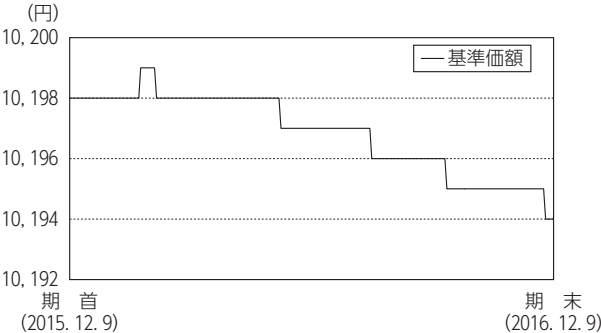
大和投資信託

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, 198	—	55. 2
12月末	10, 198	0. 0	52. 1
2016年 1 月末	10, 198	0. 0	94. 1
2 月末	10, 198	0. 0	50. 0
3 月末	10, 198	0. 0	—
4 月末	10, 198	0. 0	3. 3
5 月末	10, 197	△ 0. 0	0. 1
6 月末	10, 197	△ 0. 0	1. 6
7 月末	10, 196	△ 0. 0	19. 1
8 月末	10, 196	△ 0. 0	44. 5
9 月末	10, 195	△ 0. 0	25. 5
10 月末	10, 195	△ 0. 0	3. 4
11 月末	10, 195	△ 0. 0	26. 7
(期末) 2016年12月 9 日	10, 194	△ 0. 0	30. 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、利息収入の確保をめぐり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：10,198円 期末：10,194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、現先取引およびコール・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

(1) 公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	285,828,471	11,349,138
内		(	297,450,000)

(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。

(2) その他有価証券

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国内短期社債等	17,999,984	16,999,986
内			

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

当		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
613 国庫短期証券 2016/9/12	27,280,379	567 国庫短期証券 2016/2/8	4,999,980
591 国庫短期証券 2016/5/30	24,330,973	566 国庫短期証券 2016/2/1	2,999,991
611 国庫短期証券 2016/9/5	19,330,584	342 2年国債 0.1% 2016/7/15	2,095,779
601 国庫短期証券 2016/7/19	19,020,392	100 5年国債 0.3% 2016/9/20	1,253,387
629 国庫短期証券 2016/11/28	14,720,456		
596 国庫短期証券 2016/6/20	14,390,312		
632 国庫短期証券 2016/12/12	14,020,490		
588 国庫短期証券 2016/5/16	12,500,147		
609 国庫短期証券 2016/8/22	10,870,238		
610 国庫短期証券 2016/8/29	10,390,257		

(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
区 分	額面金額	評価額	組入比率	うちB B格以下組入比率	残存期間別組入比率
					5年以上 2年以上 2年未満
	千円	千円	%	%	%
国債証券	20,580,000	20,580,364	30.1	—	— 30.1

(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）

当		期		末	
区 分	銘 柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	632 国庫短期証券	— %	千円 14,020,000	千円 14,020,113	2016/12/12
	634 国庫短期証券	—	2,010,000	2,010,039	2016/12/19
	635 国庫短期証券	—	4,550,000	4,550,211	2016/12/26
合計	銘柄数	3銘柄			
	金 額		20,580,000	20,580,364	

(注) 単位未満は切捨て。

(3) 国内その他有価証券

	当	期	末
	評 価 額	比	率
	千円		%
国内短期社債等	999,999	< 1.5 >	

(注1) < >内は、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。

■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	20,580,364	27.2	
その他有価証券	999,999	1.3	
コール・ローン等、その他	53,984,185	71.4	
投資信託財産総額	75,564,549	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	75,564,549,239円
コール・ローン等	53,983,440,401
公社債（評価額）	20,580,364,994
現先取引（その他有価証券）	999,999,178
その他未収収益	744,666
(B) 負債	7,294,738,200
未払金	1,800,034,200
未払解約金	5,494,704,000
(C) 純資産総額（A－B）	68,269,811,039
元本	66,967,614,984
次期繰越損益金	1,302,196,055
(D) 受益権総口数	66,967,614,984口
1万口当り基準価額（C／D）	10,194円

* 期首における元本額は77,361,886,547円、当期中における追加設定元本額は229,319,669,570円、同解約元本額は239,713,941,133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 F E グローバル・バリュー（為替ヘッジあり）98,069円、ダイワ F E グローバル・バリュー（為替ヘッジなし）98,069円、ダイワ／“RICI”[®] コモディティ・ファンド8,952,508円、U S 債券 N B 戦略ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）740,564円、U S 債券 N B 戦略ファンド（為替ヘッジなし／年1回決算型）1,623,350円、スマート・アロケーション・Dガード1,987,559円、N B ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>米ドルコース981円、N B ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース981円、N B ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>世界通貨分散コース981円、堅実バランスファンダー・ハジメの歩一129,891,397円、D C ダイワ・マネー・ポートフォリオ 2,529,071,704円、ダイワファンドラップ コモディティセレクト317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズー日本円・コース（毎月分配型）132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズー豪ドル・コース（毎月分配型）643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ー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）4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズー米ドル・コース（毎月分配型）12,784円、ダイワ／フィデリティ北米株式ファンドーパラダイムシフトー29,484,934円、（適格機関投資家専用）スマート・シックス・Dガード495,850,899円、ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ21,858,178,543円、ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ34,413,293,504円、ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ6,512,563,667円、ダイワ F E グローバル・バリュー株ファンド（ダイワ S M A 専用）4,090,590円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）98,290,744円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）23,590,527円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）米ドル・コース（毎月分配型）2,163,360円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）豪ドル・コース（毎月分配型）13,761,552円、ダイワ／アムンディ食糧増産関連ファンド4,974,315円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ197,896,688円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスⅡー金積立型ー501,660円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド（償還条項付き）為替ヘッジあり1,004,378円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド（資産成長コース）49,082,149円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド（通貨αコース）196,290,094円、ダイワ・ダブルバランス・ファンド（Dガード付／部分為替ヘッジあり）27,494,856円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー（為替ヘッジあり）988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー（為替ヘッジなし）4,926,018円、ダイワ米国 M L P ファンド（毎月分配型）米ドルコース13,732,222円、ダイワ米国 M L P ファンド（毎月分配型）日本円コース3,874,449円、ダイワ米国 M L P ファンド（毎月分配型）通貨αコース13,437,960円、ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型）98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ1,724,477円、D C スマート・アロケーション・Dガード95,147

円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド（ダイワ S M A 専用）274,626円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）南アフリカ・ランド・コース（毎月分配型）98,252円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）トルコ・リラ・コース（毎月分配型）2,554,212円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）通貨セレクト・コース（毎月分配型）1,178,976円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）通貨αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）株式&通貨ツインαコース982,029円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズー通貨セレクト・コース（毎月分配型）98,174円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,194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	△ 17,198,883円
受取利息	△ 3,050,070
その他収益金	744,666
支払利息	△ 14,893,479
(B) 有価証券売買損益	△ 1,077,368
売買益	242,421
売買損	△ 1,319,789
(C) その他費用	△ 139,970
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 18,416,221
(E) 前期繰越損益金	1,530,291,621
(F) 解約差損益金	△ 4,723,800,173
(G) 追加信託差損益金	4,514,120,828
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	1,302,196,055
次期繰越損益金（H）	1,302,196,055

（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。