

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信／海外／債券	
信託期間	約5年3カ月間(2016年6月20日～2021年9月10日)	
運用方針	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います。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06の受益証券
	ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06	米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等
ベビーファンドの運用方法	<p>①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、日系企業が発行する外債建ての社債等(劣後債を除きます。以下同じ。)に投資することにより、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。</p> <p>※日系企業とは、日本企業もしくはその子会社をいいます。</p> <p>※社債等には、日本の政府機関、地方公共団体等が発行する債券を含みます。</p> <p>②マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>③保有実質外貨建資産については、(為替ヘッジあり)においては為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。(為替ヘッジなし)において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。(部分為替ヘッジあり)においては為替ヘッジを行なうことにより、当ファンドの実質的な円貨比率を70%に近づけることをめざします。</p> <p>※保有実質外貨建資産とは、当ファンドが保有する外貨建資産およびマザーファンドが保有する外貨建資産のうち当ファンドに属するとみなした外貨建資産をいいます。</p>	
	マザーファンドの運用方法	<p>①運用にあたっては、以下の点に留意します。</p> <p>イ. 投資対象は、主として日系企業が発行する米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等とします。</p> <p>※必ずしも、上記通貨のすべてが組み入れられるわけではありません。</p> <p>ロ. 流動性の確保およびポートフォリオの修正デュレーションの調整のため、米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての海外の国債やコマーシャル・ペーパー等に投資することがあります。</p> <p>ハ. 債券の格付けは、取得時においてA格相当以上(R&amp;I、JCR、S&amp;P、フィッチのいずれかでA-以上またはムーディーズでA3以上)とします。</p> <p>ニ. ポートフォリオの修正デュレーションは、当ファンドの残存年数+0.3(年)以内とすることをめざします。</p> <p>②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。</p>
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10%以下
分配方針	<p>分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のうちいずれか多い額とし、原則として、経費控除後の配当等収益の中から分配することをめざします。ただし、基準価額の水準等を勘案し、元本超過額も含めて分配を行なうことがあります。なお、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。</p>	

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。

# ダイワ高格付日本企業外債ファンド (為替ヘッジあり／為替ヘッジなし／ 部分為替ヘッジあり) 2016-06

## 運用報告書(全体版) 第1期

(決算日 2016年9月12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、「ダイワ高格付日本企業外債ファンド(為替ヘッジあり／為替ヘッジなし／部分為替ヘッジあり)2016-06」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/>

<3611>

<3612>

<3613>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			受 益 者 利 回 り	公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	元 本 残 存 率
		税 込 み 分 配 金	期 中 騰 落 額	期 中 騰 落 率				
	円	円	円	%	%	%	%	%
設 定 (2016年 6月20日)	10,000	—	—	—	—	—	—	100.0
1 期 末 (2016年 9月12日)	9,989	30	19	0.2	0.8	91.7	—	98.8

(注 1) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

(注 2) 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。

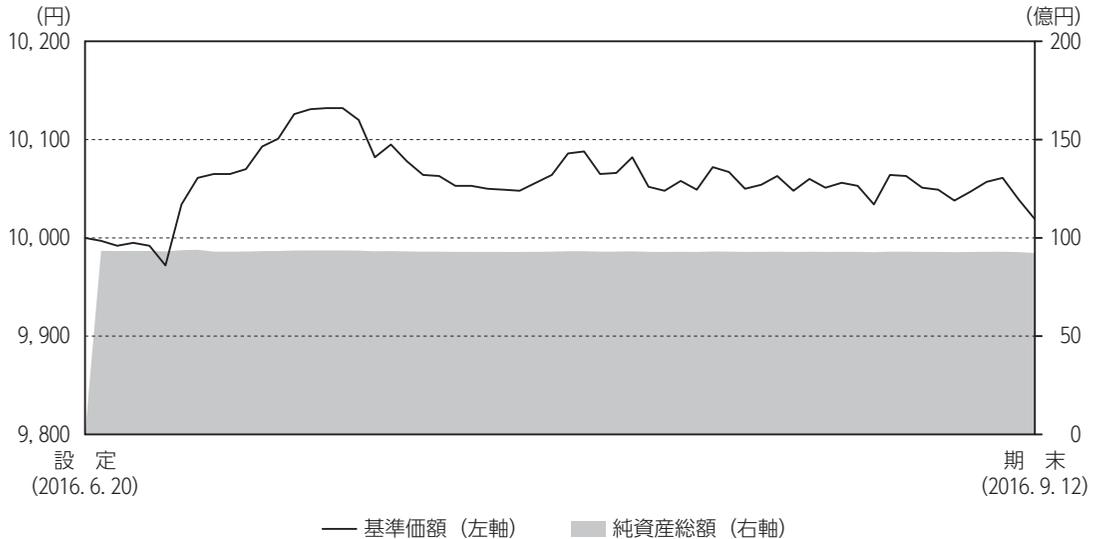
(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注 5) 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

設定時：10,000円

期末：9,989円（分配金30円）

騰落率：0.2%（分配金込み）

### ■基準価額の変動要因

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を通じて、主として日系企業が発行する外貨建ての社債に投資し、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行なった結果、債券の利息収入などがプラスに寄与し、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。

ダイワ高格付日本企業外債ファンド（為替ヘッジあり）2016-06

年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率 組 入 比	債 先 物 比 券 率
		騰 落 率			
(設定) 2016年 6 月20日	円	10,000	%	%	%
6 月末		10,065	0.7	91.8	—
7 月末		10,064	0.6	93.1	—
8 月末		10,063	0.6	91.9	—
(期末) 2016年 9 月12日		10,019	0.2	91.7	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

## 投資環境について

### ○海外債券市況

当ファンド設定後、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利し、世界経済への悪影響などへの不安が広がったことから、市場のリスク回避姿勢が強まりました。米ドルなどの外貨建て社債については、一時的にスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が拡大しましたが、英国での新政権の早期発足により政治的な不透明感が後退したほか、世界的な金融緩和の継続期待にも支援され、金利は2016年7月上旬にかけて低下しました。しかし8月後半以降は、米国の利上げ観測が高まったほか、欧州や日本の追加緩和期待が後退し、期末にかけては金利の上昇圧力が強まりました。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないました。

### ○ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、流動性や利回り面で投資妙味のある金融セクターを中心としたポートフォリオを構築しました。

## 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30円といたしました。

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。

### ■収益分配金の計算過程

計算期間末における経費控除後の配当等収益38,857,067円が、純資産額の元本超過額17,925,801円を超過しているため、経費控除後の配当等収益38,857,067円（1万口当り42.05円）を分配対象額として、うち27,715,569円（1万口当り30円）を分配金額としております。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。

### ○ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、金融セクターを中心としたポートフォリオを維持することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 20~2016. 9. 12)		
	金 額	比 率	
信託報酬	13円	0.126%	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10,059円です。</b>
(投信会社)	(8)	(0.075)	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)	(4)	(0.044)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(1)	(0.006)	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
(保管費用)	(0)	(0.001)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(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
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	13	0.129	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は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6月20日から2016年9月12日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ高格付 日本企業外債 マザーファンド2016-06	9,391,094	9,382,400	84,518	85,000

(注) 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

親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06	9,306,576	9,179,076

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06	9,179,076	97.6
コール・ローン等、その他	226,976	2.4
投資信託財産総額	9,406,053	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝102.64円です。

(注3) ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06において、当期末における外貨建純資産(9,504,461千円)の投資信託財産総額(9,816,467千円)に対する比率は、96.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	18,175,803,629円
コール・ローン等	226,976,675
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06 (評価額)	9,179,076,542
未収入金	8,769,750,412
(B) 負債	8,947,070,135
未払金	8,907,493,000
未払収益分配金	27,715,569
未払信託報酬	11,688,152
その他未払費用	173,414
(C) 純資産総額 (A - B)	9,228,733,494
元本	9,238,523,262
次期繰越損益金	△ 9,789,768
(D) 受益権総口数	9,238,523,262口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,989円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,989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9,789,768円です。

■損益の状況

当期 自2016年6月20日 至2016年9月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 27,394円
支払利息	△ 27,394
(B) 有価証券売買損益	149,302,065
売買益	287,044,653
売買損	△ 137,742,588
(C) 有価証券評価差損益	△ 118,842,401
(D) 信託報酬等	△ 11,896,469
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	18,535,801
(F) 解約差損益金	△ 610,000
(G) 合計 (E + F)	17,925,801
(H) 収益分配金	△ 27,715,569
次期繰越損益金 (G + H)	△ 9,789,768

(注1) 有価証券評価差損益は、有価証券の期末の評価損益と期首との差額です。

(注2) 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3) 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4) 収益分配金の計算過程は5ページをご参照ください。

<b>収 益 分 配 金 の お 知 ら せ</b>	
<b>1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)</b>	<b>30円</b>

**分配金の課税上の取扱いについて**

- ・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。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			受益者 利益回り	公社債 組入比率	債券 先物比率	元本 残存率
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落額				
	円	円	円	%	%	%	%
設定(2016年6月20日)	10,000	—	—	—	—	—	100.0
1期末(2016年9月12日)	9,822	30	△ 148	△ 6.4	91.6	—	100.0

(注1) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

(注2) 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。

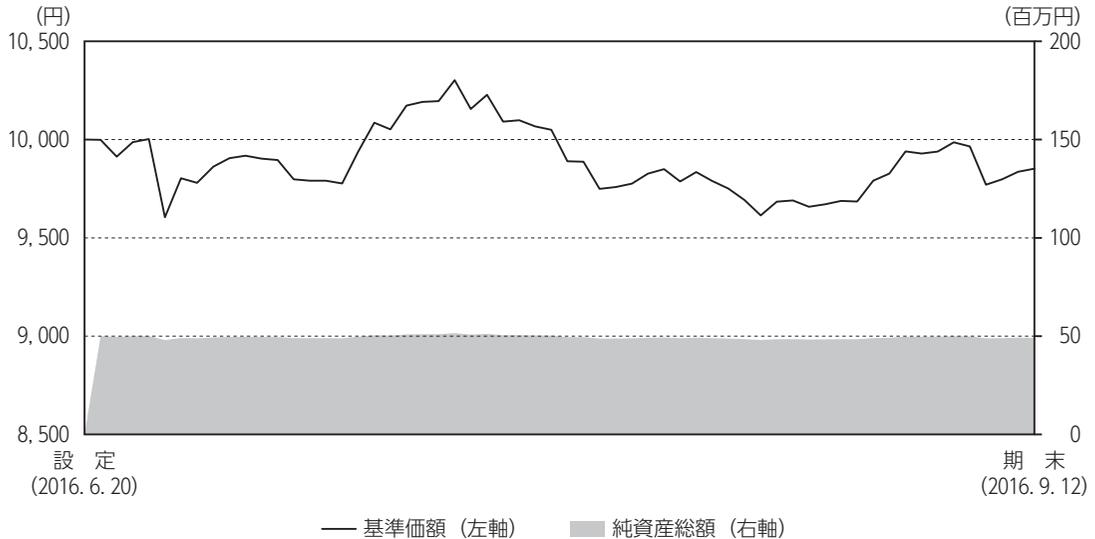
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 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

設定時：10,000円

期末：9,822円 (分配金30円)

騰落率：△1.5% (分配金込み)

### ■ 基準価額の変動要因

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を通じて、主として日系企業が発行する外貨建ての社債に投資した結果、債券の利息収入などはプラスに寄与しましたが、円高米ドル安を反映し、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。

ダイワ高格付日本企業外債ファンド（為替ヘッジなし）2016-06

年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率 組 入 比	債 先 物 比 券 率
		騰 落 率			
(設定) 2016年 6 月20日	円	10,000	% —	% —	% —
6 月末		9,905	△ 1.0	94.1	—
7 月末		10,050	0.5	92.1	—
8 月末		9,940	△ 0.6	91.5	—
(期末) 2016年 9 月12日		9,852	△ 1.5	91.6	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

## 投資環境について

### ○海外債券市況

当ファンド設定後、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利し、世界経済への悪影響などへの不安が広がったことから、市場のリスク回避姿勢が強まりました。米ドルなどの外貨建て社債については、一時的にスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が拡大しましたが、英国での新政権の早期発足により政治的な不透明感が後退したほか、世界的な金融緩和の継続期待にも支援され、金利は2016年7月上旬にかけて低下しました。しかし8月後半以降は、米国の利上げ観測が高まったほか、欧州や日本の追加緩和期待が後退し、期末にかけては金利の上昇圧力が強まりました。

### ○為替相場

米ドルの対円為替レートは下落（円高）しました。当ファンド設定後は、米国の早期利上げ観測が後退したことや英国のEU離脱に対する警戒感を背景に、米ドル円は下落基調となりました。その後、英国新政権の早期発足で政治的な不透明感が後退し市場のリスク回避姿勢が和らぐと、2016年7月中旬に米ドル円はいったん上昇しましたが、7月末に日銀が決定した追加緩和の内容が市場の期待に届かず、米ドル円の上昇は抑制されました。しかし、8月後半に米国の利上げ観測が高まると期末にかけて米ドル円は再び上昇し、設定時からの下落幅を縮めました。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を高位に組み入れました。

### ○ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、流動性や利回り面で投資妙味のある金融セクターを中心としたポートフォリオを維持しました。

## 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30円といたしました。

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。

### ■収益分配金の計算過程

計算期間末における経費控除後の配当等収益が208,249円であり、純資産額の元本超過額がないため、経費控除後の配当等収益208,249円（1万口当り41.64円）を分配対象額として、うち150,000円（1万口当り30円）を分配金額としております。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を高位に組み入れます。

### ○ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、金融セクターを中心としたポートフォリオを維持することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 20~2016. 9. 12)		
	金 額	比 率	
信託報酬	12円	0.126%	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9,886円です。</b>
(投信会社)	(7)	(0.075)	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)	(4)	(0.044)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(1)	(0.006)	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
(保管費用)	(0)	(0.001)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(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
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	13	0.129	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は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6月20日から2016年9月12日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ高格付 日本企業外債 マザーファンド2016-06	49,500	49,500	—	—

(注) 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

親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06	49,500	48,821

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06	48,821	99.0
コール・ローン等、その他	500	1.0
投資信託財産総額	49,321	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝102.64円です。

(注3) ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06において、当期末における外貨建純資産（9,504,461千円）の投資信託財産総額（9,816,467千円）に対する比率は、96.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	49,321,850円
コール・ローン等	500,000
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06（評価額）	48,821,850
(B) 負債	213,001
未払収益分配金	150,000
未払信託報酬	62,128
その他未払費用	873
(C) 純資産総額（A－B）	49,108,849
元本	50,000,000
次期繰越損益金	△ 891,151
(D) 受益権総口数	50,000,000口
1万口当り基準価額（C／D）	9,822円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,822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891,151円です。

■損益の状況

当期 自2016年6月20日 至2016年9月12日

項 目	当 期
(A) 有価証券評価差損益	△ 678,150円
(B) 信託報酬等	△ 63,001
(C) 当期損益金（A＋B）	△ 741,151
(D) 合計（C）	△ 741,151
(E) 収益分配金	△ 150,000
次期繰越損益金（D＋E）	△ 891,151

(注1) 有価証券評価損益は、有価証券の期末の評価損益と期首との差額です。

(注2) 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3) 収益分配金の計算過程は13ページをご参照ください。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	30円

**分配金の課税上の取扱いについて**

- ・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。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	基 準 価 額			受 益 者 利 回 り	公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	元 本 残 存 率
		税 込 み 分 配 金	期 中 騰 落 額	期 中 騰 落 率				
設 定 (2016年 6月20日)	円 10,000	円 —	円 —	% —	% —	% —	% —	% 100.0
1 期 末 (2016年 9月12日)	円 9,939	円 30	円 △ 31	% △ 0.3	% △ 1.3	% 91.0	% —	% 100.0

(注 1) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

(注 2) 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。

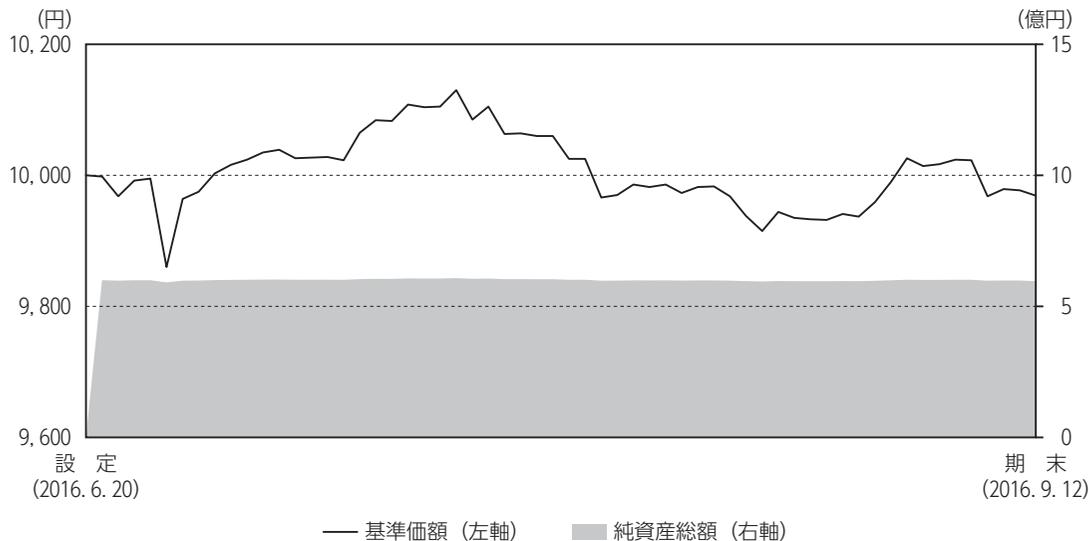
(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注 5) 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

設定時：10,000円

期末：9,939円（分配金30円）

騰落率：△0.3%（分配金込み）

### ■基準価額の変動要因

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を通じて、主として日系企業が発行する外貨建ての社債に投資し、為替変動リスクを低減するため、部分為替ヘッジを行なった結果、債券の利息収入などはプラスに寄与しましたが、円高米ドル安を反映し、基準価額は小幅ながら下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ高格付日本企業外債ファンド（部分為替ヘッジあり）2016-06

年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率 組 入 比 率	債 先 物 比 率 券 率
		騰 落 率			
(設定) 2016年 6 月20日	円		%	%	%
	10,000	—		—	—
6 月末	10,016	0.2		92.2	—
7 月末	10,060	0.6		92.5	—
8 月末	10,026	0.3		91.1	—
(期末) 2016年 9 月12日	9,969	△ 0.3		91.0	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

## 投資環境について

### ○海外債券市況

当ファンド設定後、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利し、世界経済への悪影響などへの不安が広がったことから、市場のリスク回避姿勢が強まりました。米ドルなどの外貨建て社債については、一時的にスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が拡大しましたが、英国での新政権の早期発足により政治的な不透明感が後退したほか、世界的な金融緩和の継続期待にも支援され、金利は2016年7月上旬にかけて低下しました。しかし8月後半以降は、米国の利上げ観測が高まったほか、欧州や日本の追加緩和期待が後退し、期末にかけては金利の上昇圧力が強まりました。

### ○為替相場

米ドルの対円為替レートは下落（円高）しました。当ファンド設定後は、米国の早期利上げ観測が後退したことや英国のEU離脱に対する警戒感を背景に、米ドル円は下落基調となりました。その後、英国新政権の早期発足で政治的な不透明感が後退し市場のリスク回避姿勢が和らぐと、2016年7月中旬に米ドル円はいったん上昇しましたが、7月末に日銀が決定した追加緩和の内容が市場の期待に届かず、米ドル円の上昇は抑制されました。しかし、8月後半に米国の利上げ観測が高まると期末にかけて米ドル円は再び上昇し、設定時からの下落幅を縮めました。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、部分為替ヘッジを行ないました。

### ○ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、流動性や利回り面で投資妙味のある金融セクターを中心としたポートフォリオを維持しました。

## 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30円といたしました。

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。

### ■収益分配金の計算過程

計算期間末における経費控除後の配当等収益が2,476,695円であり、純資産額の元本超過額がないため、経費控除後の配当等収益2,476,695円（1万口当り41.27円）を分配対象額として、うち1,800,000円（1万口当り30円）を分配金額としております。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

「ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、部分為替ヘッジを行ないます。

### ○ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、金融セクターを中心としたポートフォリオを維持することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 6. 20~2016. 9. 12)		
	金 額	比 率	
信託報酬	13円	0.126%	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10,006円です。</b>
(投信会社)	(8)	(0.075)	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)	(4)	(0.044)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(1)	(0.006)	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	1	0.007	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(0)	(0.001)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(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
(その他)	(0)	(0.004)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	13	0.132	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は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6月20日から2016年9月12日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ高格付 日本企業外債 マザーファンド2016-06	596,680	596,500	—	—

(注) 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

親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06	596,680	588,506

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06	588,506	97.3
コール・ローン等、その他	16,392	2.7
投資信託財産総額	604,898	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝102.64円です。

(注3) ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06において、当期末における外貨建純資産(9,504,461千円)の投資信託財産総額(9,816,467千円)に対する比率は、96.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	987,363,220円
コール・ローン等	16,392,561
ダイワ高格付日本企業外債 マザーファンド2016-06 (評価額)	588,506,032
未収入金	382,464,627
(B) 負債	391,045,976
未払金	388,479,910
未払収益分配金	1,800,000
未払信託報酬	754,921
その他未払費用	11,145
(C) 純資産総額 (A - B)	596,317,244
元本	600,000,000
次期繰越損益金	△ 3,682,756
(D) 受益権総口数	600,000,000口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,939円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,939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3,682,756円です。

■損益の状況

当期 自2016年6月20日 至2016年9月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,540円
支払利息	△ 1,540
(B) 有価証券売買損益	6,900,418
売買益	12,915,701
売買損	△ 6,015,283
(C) 有価証券評価差損益	△ 7,993,968
(D) 信託報酬等	△ 787,666
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 1,882,756
(F) 合計 (E)	△ 1,882,756
(G) 収益分配金	△ 1,800,000
次期繰越損益金 (F + G)	△ 3,682,756

(注1) 有価証券評価損益は、有価証券の期末の評価損益と期首との差額です。

(注2) 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あります。

(注3) 収益分配金の計算過程は21ページをご参照ください。

<b>収 益 分 配 金 の お 知 ら せ</b>	
<b>1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)</b>	<b>30円</b>

**分配金の課税上の取扱いについて**

- ・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。

# ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

## 運用報告書 第1期 (決算日 2016年9月12日)

(計算期間 2016年6月20日～2016年9月12日)

ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06の第1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と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等
運用方法	<p>①主として、日系企業が発行する外貨建ての社債等（劣後債を除きます。以下同じ。）に投資することにより、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。 ※日系企業とは、日本企業もしくはその子会社をいいます。 ※社債等には、日本の政府機関、地方公共団体等が発行する債券を含みます。</p> <p>②運用にあたっては、以下の点に留意します。</p> <p>イ. 投資対象は、主として日系企業が発行する米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等とします。 ※必ずしも、上記通貨のすべてが組み入れられるわけではありません。</p> <p>ロ. 流動性の確保およびポートフォリオの修正デュレーションの調整のため、米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての海外の国債やコマーシャル・ペーパー等に投資することがあります。</p> <p>ハ. 債券の格付けは、取得時においてA格相当以上（R&amp;I、JCR、S&amp;P、フィッチのいずれかでA-以上またはムーディーズでA3以上）とします。</p> <p>ニ. ポートフォリオの修正デュレーションは、当ファンドの残存年数+0.3（年）以内とすることをめざします。</p> <p>③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。</p>
株式組入制限	純資産総額の10%以下

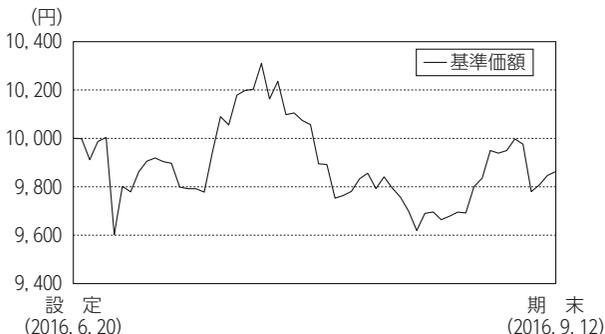
## 大和投資信託

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	債 券 先 物 比 率
	円	%		
(設定) 2016年 6月20日	10,000	—	—	—
6月末	9,906	△ 0.9	95.1	—
7月末	10,057	0.6	93.0	—
8月末	9,950	△ 0.5	92.3	—
(期末) 2016年 9月12日	9,863	△ 1.4	92.2	—

(注1) 騰落率は設定比。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）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、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 期末：9,863円 騰落率：△1.4%

【基準価額の主な変動要因】

主として日系企業が発行する外債建ての社債に投資した結果、債券の利息収入などはプラスに寄りましたが、円高米ドル安を反映し、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○海外債券市場

当ファンド設定後、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利し、世界経済への悪影響などへの不安が広がったことから、市場のリスク回避姿勢が強まりました。米ドルなどの外債建て社債については、一時的にスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が拡大しましたが、英国での新政権の早期発足により政治的な不透明感が後退したほか、世界的な金融緩和の継続期待にも支援され、金利は2016年7月上旬にかけて低下しました。しかし8月後半以降は、米国の利上げ観測が高まったほか、欧州や日本の追加緩和期待が後退し、期末にかけては金利の上昇圧力が強まりました。

○為替相場

米ドルの対円為替レートは下落（円高）しました。当ファンド設定後は、米国の早期利上げ観測が後退したことや英国のEU離脱に対する警戒感を背景に、米ドル円は下落基調となりました。その後、英国新政権の早期発足で政治的な不透明感が後退し市場のリスク回避姿勢が和らぐと、2016年7月中旬に米ドル円はいったん上昇しましたが、7月末に日銀が決定した追加緩和の内容が市場の期待に届かず、米ドル円の上昇は抑制されました。しかし、8月後半に米国の利上げ観測が高まると期末にかけて米ドル円は再び上昇し、設定時からの下落幅を縮めました。

◆ポートフォリオについて

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、流動性や利回り面で投資妙味のある金融セクターを中心としたポートフォリオを構築しました。

◆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および参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、金融セクターを中心としたポートフォリオを維持することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

■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 (保管費用)	0 ( 0)
(その他)	( 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方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。

# ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

## ■売買および取引の状況

### 公 社 債

(2016年6月20日から2016年9月12日まで)

外 国	アメリカ	買付額 千アメリカ・ドル	売付額 千アメリカ・ドル
		2,033	( — )
		20,395	( — )
		65,652	( — )

(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) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄

### 公 社 債

(2016年6月20日から2016年9月12日まで)

当 期		期 末	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	銘 柄	銘 柄	金 額
	千円		千円
ORIX Corp (日本) 2.65% 2021/4/13	706,638		
JAPAN FIN. CORP. MUNI. ENT. (日本) 2.125% 2021/4/13	678,565		
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd (日本) 2.95% 2018/9/14	581,387		
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc (日本) 3.85% 2026/3/1	550,887		
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc (日本) 3.784% 2026/3/9	548,217		
Mizuho Financial Group Inc (日本) 3.477% 2026/4/12	534,965		
Toyota Motor Credit Corp (アメリカ) 2.625% 2023/1/10	534,771		
Japan Tobacco Inc (日本) 2.8% 2026/4/13	531,056		
Development Bank of Japan (日本) 1.625% 2019/9/25	496,289		
JAPAN BANK FOR INTL. COOP. (日本) 3% 2024/5/29	445,287		

(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)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	額 面 金 額	当 期		組入比率	うちBB格 以下組入 比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		評 価 額	評 価 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
区 分	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	85,300	88,156	9,048,351	92.2	—	38.1	53.1	1.0

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	Tokyo Metropolitan Government	地方債証券	2.1250	1,000	1,012	103,908	2019/05/20
	Tokyo Metropolitan Government	地方債証券	2.1250	1,000	1,018	104,572	2020/05/19
	JAPAN BANK FOR INTL. COOP.	特殊債券	2.1250	2,500	2,525	259,217	2025/02/10
	JAPAN BANK FOR INTL. COOP.	特殊債券	3.0000	4,000	4,287	440,034	2024/05/29
	JAPAN FIN. CORP. MUNI. ENT.	特殊債券	2.1250	6,500	6,560	673,404	2021/04/13
	Development Bank of Japan	特殊債券	1.6250	4,800	4,810	493,736	2019/09/25
	Development Bank of Japan	特殊債券	2.7500	2,000	2,139	219,604	2025/09/16
	Sumitomo Mitsui Banking Corp	社 債 券	2.4500	1,700	1,729	177,522	2020/01/16
	Chiba Bank Ltd/The	社 債 券	2.7500	2,000	2,055	210,980	2020/07/29
	Toyota Motor Credit Corp	社 債 券	1.4000	1,500	1,499	153,876	2019/05/20
	UnionBanCal Corp	社 債 券	3.5000	1,000	1,057	108,538	2022/06/18
	Mizuho Financial Group Inc	社 債 券	2.6320	1,800	1,820	186,860	2021/04/12
	Mizuho Financial Group Inc	社 債 券	3.4770	5,000	5,253	539,173	2026/04/12
	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	社 債 券	3.8500	5,000	5,400	554,317	2026/03/01
	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	社 債 券	2.9500	1,700	1,750	179,633	2021/03/01
	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	社 債 券	3.7840	5,000	5,411	555,477	2026/03/09
	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	社 債 券	1.8000	1,000	1,000	102,705	2018/03/28
	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	社 債 券	2.9500	5,500	5,617	576,612	2018/09/14
	Japan Tobacco Inc	社 債 券	2.0000	1,700	1,705	175,093	2021/04/13
	Japan Tobacco Inc	社 債 券	2.8000	5,000	5,187	532,445	2026/04/13
	ORIX Corp	社 債 券	2.6500	6,800	6,933	711,610	2021/04/13
	Central Nippon Expressway Co Ltd	社 債 券	2.1700	800	809	83,102	2019/08/05
	Central Nippon Expressway Co Ltd	社 債 券	2.2930	4,000	4,059	416,623	2021/04/23
	Central Nippon Expressway Co Ltd	社 債 券	2.3620	1,000	1,014	104,149	2021/05/28
	Central Nippon Expressway Co Ltd	社 債 券	2.2410	1,000	1,008	103,469	2021/02/16
	AMERICAN HONDA FINANCE	社 債 券	2.2500	2,000	2,048	210,231	2019/08/15
	AMERICAN HONDA FINANCE	社 債 券	7.6250	2,000	2,248	230,753	2018/10/01
	Toyota Motor Credit Corp	社 債 券	2.6250	5,000	5,148	528,462	2023/01/10
	Mitsubishi UFJ Lease&Finance Co Ltd	社 債 券	2.5000	3,000	3,042	312,233	2020/03/09
合 計	銘柄数	29銘柄					
	金 額			85,300	88,156	9,048,351	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ高格付日本企業外債マザーファンド2016-06

## ■投資信託財産の構成

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	9,048,351 千円	92.2 %
コール・ローン等、その他	768,115	7.8
投資信託財産総額	9,816,467	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝102.64円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(9,504,461千円)の投資信託財産総額(9,816,467千円)に対する比率は、96.8%です。

## ■損益の状況

当期 自2016年6月20日 至2016年9月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	53,851,210円
受取利息	53,909,087
支払利息	△ 57,877
(B) 有価証券売買損益	△ 180,651,147
売買益	32,467,290
売買損	△ 213,118,437
(C) その他費用	△ 132,860
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 126,932,797
(E) 解約差損益金	△ 481,754
(F) 追加信託差損益金	△ 8,875,445
(G) 合計 (D + E + F)	△ 136,289,996
次期繰越損益金 (G)	△ 136,289,996

(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。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,816,467,203円
コール・ローン等	697,209,621
公社債(評価額)	9,048,351,855
未収利息	40,426,457
前払費用	30,479,270
(B) 負債	—
(C) 純資産総額 (A - B)	9,816,467,203
元本	9,952,757,199
次期繰越損益金	△ 136,289,996
(D) 受益権総口数	9,952,757,199口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,863円

\* 設定時における元本額は9,695,900,000円、当期中における追加設定元本額は341,375,445円、同解約元本額は84,518,246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、ダイワ高格付日本企業外債ファンド(為替ヘッジあり)2016-06 9,306,576,643円、ダイワ高格付日本企業外債ファンド(為替ヘッジなし)2016-06 49,500,000円、ダイワ高格付日本企業外債ファンド(部分為替ヘッジあり)2016-06 596,680,556円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,863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136,289,996円です。