

★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／その他資産（ハイブリッド証券） | |
| 信託期間 | 約2年11カ月間（2016年8月31日～2019年7月22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 | 当ファンド | 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・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」（以下「コーポレート・ハイブリッド・ファンド」といいます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券 |
| | ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド | 円建ての債券 |
| 当ファンドの運用方法 | ①主として、コーポレート・ハイブリッド・ファンドの受益証券への投資を通じて、世界の企業（金融機関を含みます。）が発行するハイブリッド証券等に投資し、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。 ②当ファンドは、コーポレート・ハイブリッド・ファンドとダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、コーポレート・ハイブリッド・ファンドへの投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③コーポレート・ハイブリッド・ファンドでは、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。 | |
| 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マースナル・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取引（評価益を含みます。）等とし、原則として、経費控除後の配当等収益等を中心に分配することをめざします。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。 | |

コーポレート・ハイブリッド証券 ファンド2016-08 (為替ヘッジあり／限定追加型) (愛称：メジャー・カンパニーズ16-08)

運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2018年7月23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、「コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08（為替ヘッジあり／限定追加型）（愛称：メジャー・カンパニーズ16-08）」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/>

<3306>

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 組入 信託 証券 比率 | 純資 産額 |
|---------------------|------------|--------|-------------|-----------------------|-------------|----------------------------|--------------|
| | (分配 落) | 税 分 | 込 配 金 | 期 騰 落 中 率 | | | |
| 1 期末 (2017年 1 月23日) | 円 9,976 | | 円 60 | % 0.4 | % 0.0 | % 99.3 | 百万円 9,956 |
| 2 期末 (2017年 7 月24日) | 10,114 | | 40 | 1.8 | 0.0 | 99.2 | 9,229 |
| 3 期末 (2018年 1 月22日) | 10,102 | | 25 | 0.1 | — | 99.5 | 8,049 |
| 4 期末 (2018年 7 月23日) | 10,035 | | 0 | △ 0.7 | — | 99.7 | 7,330 |

(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。

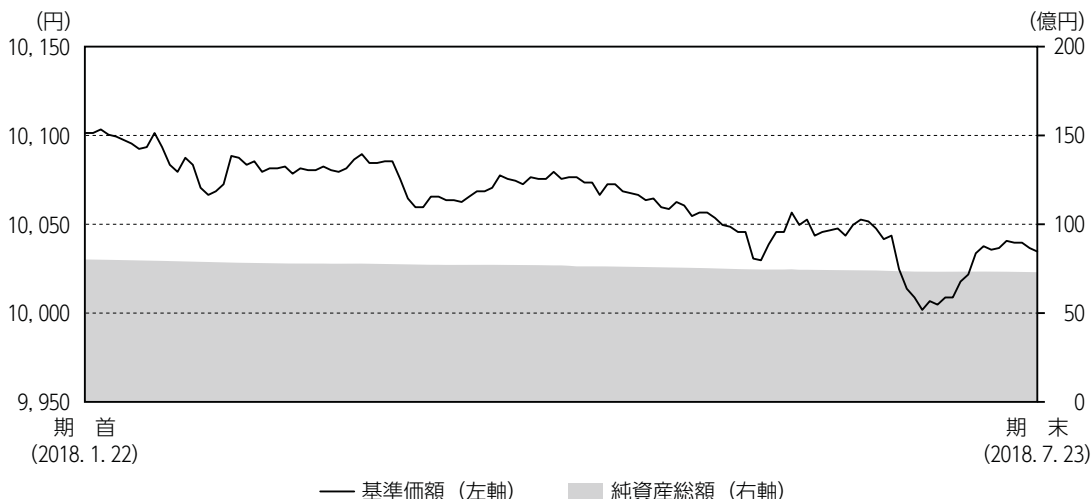
(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



■ 基準価額・騰落率

期首：10,102円

期末：10,035円

騰落率：△0.7%

■ 基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラストグローバル・コーポレート・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド (以下「コーポレート・ハイブリッド・ファンド」といいます。) の受益証券への投資を通じて、金融機関を含む世界の企業が発行するハイブリッド証券等に投資した結果、ハイブリッド証券市況が下落したことにより、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。

コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08 (為替ヘッジあり/限定追加型)

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 公 社 債 率 | 投 資 信 託 証 券 率 |
|-------------------|---------|-------|---------|---------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2018年 1月22日 | 円 | % | % | % |
| | 10,102 | — | — | 99.5 |
| 1月末 | 10,093 | △ 0.1 | — | 99.3 |
| 2月末 | 10,083 | △ 0.2 | 0.0 | 99.3 |
| 3月末 | 10,064 | △ 0.4 | — | 99.3 |
| 4月末 | 10,067 | △ 0.3 | — | 99.4 |
| 5月末 | 10,030 | △ 0.7 | — | 99.4 |
| 6月末 | 10,002 | △ 1.0 | — | 99.6 |
| (期 末) 2018年 7月23日 | 10,035 | △ 0.7 | — | 99.7 |

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2018. 1. 23 ~ 2018. 7. 23)

■コーポレート・ハイブリッド証券市況

コーポレート・ハイブリッド証券市況は下落しました。

コーポレート・ハイブリッド証券からのクーポン収入は安定していたものの、世界的にリスク性資産全体が下落する中で、スプレッド（利回り格差）が拡大したことがマイナス要因となり、市況は下落しました。また、当期中にECB（欧州中央銀行）の社債購入プログラムが継続実施されました。コーポレート・ハイブリッド証券の発行体の多くは購入対象となる無担保シニア債を発行していることから、コーポレート・ハイブリッド証券市場にも同プログラムがプラスに影響し、市場を下支えしました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として、コーポレート・ハイブリッド・ファンドへの投資割合を高位に保つことによって、金融機関を含む世界の企業が発行するハイブリッド証券からの収益を享受することをめざします。

■コーポレート・ハイブリッド・ファンド

コーポレート・ハイブリッド証券市場は、相対的に高いインカム水準を提供していることから、投資適格シニア社債のスプレッドが低水準で推移する中、より高いインカム水準を求める投資家ニーズが本資産クラスを下支えすると考えています。ファンダメンタルズ面では、コンセンサスを上回る欧州圏の安定した経済成長もスプレッドタイト（縮小）化の後押しになると考えています。今後の欧州発行体における起債については、資金調達コストが株式に比べていまだ割安な状態にあるため、同市場に多数の新規銘柄が参入するとみています。加えて、2018年には約110億ユーロ程度のコーポレート・ハイブリッド証券が初回コール（繰上償還）日を迎え、対象銘柄のすべてがコールされ、その大半が借り換えされると見込んでいます。また、多くのコーポレート・ハイブリッド証券は、その独自のリスクを勘案してもシニア債とのスプレッドはワイド（拡大した）な状態にあり、今後はスプレッド縮小の余地があるとの見方を維持しています。

当ファンドでは、引き続き世界の企業が発行するハイブリッド証券を対象とし、信用力のベースとなるソブリンリスク（国家の信用リスク）が安定した国における大手企業の発行証券を継続保有することで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざす方針です。

また、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。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・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

(2018. 1. 23 ~ 2018. 7. 23)

■当ファンド

当ファンドは、コーポレート・ハイブリッド・ファンドとダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、期を通じてコーポレート・ハイブリッド・ファンドへの投資割合を高位に維持しました。

■コーポレート・ハイブリッド・ファンド

世界の企業が発行するハイブリッド証券を対象に、信託期間内にコール等が見込まれる銘柄を中心に投資しました。業種別では、景気循環に影響を受けにくい公益企業が発行する質の高いハイブリッド証券を中心としたポートフォリオを継続しました。一方、ギリシャ等の欧州周辺諸国企業が発行する銘柄には投資しませんでした。

なお、為替変動リスクを低減するため、対円での為替ヘッジを行ないました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・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

当期は、組み入れているハイブリッド証券の利回り水準や配当等収益の水準、基準価額の水準等を総合的に勘案し、収益の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 | 当期 | |
|------------|---------------------------|-----|
| | 2018年1月23日 ～2018年7月23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） | 441 |

（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

主として、コーポレート・ハイブリッド・ファンドへの投資割合を高位に保つことによって、金融機関を含む世界の企業が発行するハイブリッド証券からの収益を享受することをめざします。

コーポレート・ハイブリッド・ファンド

コーポレート・ハイブリッド証券市場は、相対的に高いインカム水準を提供していることから、投資適格級の格付けを有するシニア社債のスプレッドが低水準で推移する中、より高いインカム水準を求める投資家ニーズが本資産クラスを下支えすると考えています。ファンダメンタルズ面では、欧州圏の安定した経済成長もスプレッド縮小の後押しになると考えています。今後の欧州発行体における起債については、資金調達コストが株式に比べて依然割安な状態にあるため、同市場では多数の新規発行がみられると考えています。また、2018年に初回コール日を迎えるコーポレー

ト・ハイブリッド証券については、すべての対象銘柄が期限前償還され、その大半が新規で発行されるコーポレート・ハイブリッド証券に借り換えされると見込んでいます。

また、多くのコーポレート・ハイブリッド証券は、ハイブリッド証券特有のリスクを勘案してもシニア債対比でのスプレッドにおいて投資妙味がある水準にあると考えられ、今後はスプレッド縮小余地があるとの見方を維持しています。

なお、当ファンドではギリシャやポルトガルなど、引き続きソブリンリスクが高い国の保有を避け、ソブリン・クレジットが比較的安定しているフランスやドイツといった欧州主要国における大手発行体のクレジットを中心にポートフォリオに組み入れ、運用を行なう方針です。

また、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。

コーポレート・ハイブリッド証券にとって良好な環境が継続してきたことでスプレッドが縮小しているほか、当ファンドで再投資することが可能となっている普通社債および先進国の国債等においても、利回りは低水準で推移しています。また、米ドルを中心に総じて対円での為替ヘッジコストが上昇しています。

コーポレート・ハイブリッド証券は当初予想通りにコールが進んでいますが、コール後の再投資において諸コスト（為替ヘッジコスト含む。）控除後の収益を確保できる投資対象が限られています。コーポレート・ハイブリッド証券は引き続き相対的には魅力的な投資対象であると考えていますが、当ファンドの最終利回りは設定以降大きく低下（債券価格は上昇）しているほか、コールが進むに連れて最終利回りがさらに低下する可能性もあり、収益の源泉の一つであるインカム収入の低下が予想されます。そのため、ファンドの満期償還が近づくに連れて、利息収入および保有証券の値上がりから得られる収益は低下していくことが見込まれ、今後の相場環境によっては、諸コスト控除後にプラスの利回りを確保することさえ困難な状況となることも想定されます。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・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 (2018. 1. 23~2018. 7. 23) | | 項 目 の 概 要 |
|------------|----------------------------------|----------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 53円 | 0. 525% | 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, 063円です。 |
| （投信会社） | (19) | (0. 188) | 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） | (33) | (0. 323) | 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 | 2 | 0. 018 | 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 |
| （投資信託受益証券） | (2) | (0. 018) | |
| 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 |
| （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 | 55 | 0. 547 | |

(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

(2018年1月23日から2018年7月23日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|-------------|-----------------|---------------|-----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外国 (邦貨建) | 千口 1,444.614 | 千円 135,015 | 千口 7,249.679 | 千円 688,620 |

(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

(2018年1月23日から2018年7月23日まで)

| 当 期 | | | | 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 |
| | | | | GLOBAL CORPORATE HYBRID SECURITIES FUND (ケイマン諸島) | 7,249.679 | 688,620 | 94 |

(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等

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) GLOBAL CORPORATE HYBRID SECURITIES FUND | 千口 78,124.289 | 千円 7,305,714 | % 99.7 |

(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 | 期 首 | 当 期 末 | |
|----------------------------|---------|---------|---------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド | 千口 0 | 千口 0 | 千円 0 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年7月23日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 7,305,714 | % 98.9 |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド | 0 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 84,519 | 1.1 |
| 投資信託財産総額 | 7,390,235 | 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7月23日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|-----------------------|
| (A) 資産 | 7,410,195,678円 |
| コール・ローン等 | 64,559,893 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 7,305,714,787 |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド(評価額) | 999 |
| 未収入金 | 39,919,999 |
| (B) 負債 | 79,640,701 |
| 未払金 | 19,960,000 |
| 未払解約金 | 19,133,289 |
| 未払信託報酬 | 40,234,236 |
| その他未払費用 | 313,176 |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 7,330,554,977 |
| 元本 | 7,304,677,147 |
| 次期繰越損益金 | 25,877,830 |
| (D) 受益権総口数 | 7,304,677,147口 |
| 1万口当り基準価額 (C / D) | 10,035円 |

*期首における元本額は7,967,570,177円、当期中における追加設定元本額は2,096,708円、同解約元本額は664,989,738円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,035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 | 93,945,070円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 148,397 |
| (d) 分配準備積立金 | 228,496,147 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 322,589,614 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 322,589,614 |
| (h) 受益権総口数 | 7,304,677,147口 |

■損益の状況

当期 自2018年1月23日 至2018年7月23日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------|
| (A) 配当等収益 | 134,504,918円 |
| 受取配当金 | 134,516,119 |
| 受取利息 | 670 |
| 支払利息 | △ 11,871 |
| (B) 有価証券売買損益 | 142,837,989 |
| 売買益 | 1,422,302 |
| 売買損 | △ 144,260,291 |
| (C) 信託報酬等 | 40,559,848 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 48,892,919 |
| (E) 前期繰越損益金 | 91,285,468 |
| (F) 追加信託差損益金 | 16,514,719 |
| (配当等相当額) | (148,397) |
| (売買損益相当額) | (△ 16,663,116) |
| (G) 合計 (D + E + F) | 25,877,830 |
| 次期繰越損益金 (G) | 25,877,830 |
| 追加信託差損益金 | △ 16,514,719 |
| (配当等相当額) | (148,397) |
| (売買損益相当額) | (△ 16,663,116) |
| 分配準備積立金 | 322,441,217 |
| 繰越損益金 | △ 280,048,668 |

(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。

**ダイワ・プレミアム・トラストー
グローバル・コーポレート・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド**

当ファンド(コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08(為替ヘッジあり/限定追加型))の主要投資対象である、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーグローバル・コーポレート・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」の状況は以下の通りです。

(注) 2018年7月23日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

(日本円建て)

**貸借対照表
2017年12月29日**

| | |
|------------------------------|-------------------------|
| 資産 | |
| 投資資産の評価額(簿価 ¥20,955,002,475) | ¥ 23,383,454,635 |
| 外国通貨の評価額(簿価 ¥138,472) | 136,418 |
| 外国為替先渡契約による評価益 | 110,246,714 |
| 未取利息 | 466,745,105 |
| 前払受託会社報酬 | 1,690,703 |
| 資産合計 | 23,962,273,575 |
| 負債 | |
| 外国為替先渡契約による評価損 | 522,274,756 |
| 保管会社に対する支払 | 9,386 |
| 未払: | |
| 償還済み受益証券 | 94,810,000 |
| 運用会社報酬 | 18,039,597 |
| 専門家報酬 | 5,807,056 |
| 会計および管理会社報酬 | 4,703,658 |
| 保管会社報酬 | 2,341,452 |
| 登録料 | 1,702,425 |
| 名義書換代理人報酬 | 1,098,640 |
| 負債合計 | 650,786,970 |
| 純資産 | ¥ 23,311,486,605 |
| 純資産の内訳: | |
| 払込資本金 | ¥ 23,402,416,148 |
| 繰越損失 | (90,929,543) |
| 純資産 | ¥ 23,311,486,605 |
| 円ヘッジクラス | ¥ 23,311,486,605 |
| | ¥ 23,311,486,605 |
| 発行済み受益証券(口数) | |
| 円ヘッジクラス | 240,082,239 |
| 受益証券1口当り純資産額 | |
| 円ヘッジクラス | ¥ 97.098 |

損益計算書

2017年12月29日に終了した年度

投資収益

| | | |
|---------------------------|---|--------------------|
| 受取利息 (源泉税 ¥86,003,316控除後) | ¥ | 720,573,266 |
| その他収益 | | 15,545 |
| 投資収益合計 | | 720,588,811 |

費用

| | | |
|-------------|--|--------------------|
| 運用会社報酬 | | 92,062,836 |
| 会計および管理会社報酬 | | 15,638,069 |
| 保管会社報酬 | | 8,204,140 |
| 専門家報酬 | | 5,733,628 |
| 名義書換代理人報酬 | | 3,404,661 |
| 登録料 | | 1,914,085 |
| 受託会社報酬 | | 1,299,724 |
| その他費用 | | 3,471,504 |
| 費用合計 | | 131,728,647 |

投資純利益

588,860,164

実現利益 (損失) および評価益 (損) の純変動:

実現 (損):

| | |
|-------------------|------------------------|
| 証券投資 | (235,172,135) |
| 外国為替取引および外国為替先渡契約 | (3,344,560,877) |
| 純実現損失 | (3,579,733,012) |

評価益の純変動の内訳:

| | |
|-------------------|----------------------|
| 証券投資 | 2,083,927,366 |
| 外国為替換算および外国為替先渡契約 | 1,824,806,211 |
| 評価益の純変動 | 3,908,733,577 |

純実現損および純評価益の純変動

329,000,565

運用による純資産の純増

¥ **917,860,729**

投資明細表
2017年12月29日

| | 元本 | 証券の明細 | 評価額 |
|-----|------------|--|----------------------|
| | | 債券 (98.5%) | |
| | | オーストリア (0.1%) | |
| | | 通信 (0.1%) | |
| | | Telekom Austria AG ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 100,000 | 5.63% | ¥ 13,594,430 |
| | | オーストリア合計 (簿価 ¥13,444,249) | 13,594,430 |
| | | デンマーク (9.5%) | |
| | | 電力 (9.5%) | |
| | | Orsted A/S ^{(a), (b)} | |
| EUR | 15,962,000 | 4.88% due 2013/7/8 | 2,210,937,122 |
| | | デンマーク合計 (簿価 ¥1,940,062,292) | 2,210,937,122 |
| | | フランス (35.1%) | |
| | | 化学 (9.7%) | |
| | | Solvay Finance SA ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 16,017,000 | 4.20% | 2,264,249,357 |
| | | 電力 (18.9%) | |
| | | Electricite de France SA ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 15,200,000 | 4.25% | 2,179,060,836 |
| | | Engie SA ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 15,900,000 | 3.00% | 2,224,975,706 |
| | | 通信 (4.2%) | |
| | | Orange SA ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 6,795,000 | 4.25% | 987,296,860 |
| | | 水道 (2.3%) | |
| | | Veolia Environnement SA ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 3,900,000 | 4.45% | 534,006,474 |
| | | フランス合計 (簿価 ¥6,990,881,553) | 8,189,589,233 |
| | | 香港 (9.5%) | |
| | | 複合持株会社 (9.5%) | |
| | | Hutchison Whampoa Europe Finance, 13 Ltd. ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 16,140,000 | 3.75% | 2,209,022,084 |
| | | 香港合計 (簿価 ¥1,993,929,806) | 2,209,022,084 |
| | | オランダ (16.4%) | |
| | | 自動車 (6.6%) | |
| | | Volkswagen International Finance N.V. ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 11,130,000 | 3.88% | 1,539,431,373 |
| | | 電力 (0.0%) | |
| | | Alliander N.V. ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 100,000 | 3.25% | 13,874,737 |
| | | 通信 (9.8%) | |
| | | Koninklijke KPN N.V. ^{(a), (b), (c)} | |
| EUR | 16,217,000 | 6.13% | 2,281,558,443 |

コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08 (為替ヘッジあり/限定追加型)

| | 元本 | 証券の明細 | 評価額 |
|-----|------------|--|----------------|
| | | オランダ合計 (簿価 ¥3,454,101,643) | 3,834,864,553 |
| | | スウェーデン (1.4%) | |
| | | 自動車 (1.4%) | |
| | | Volvo Treasury AB ^{(a), (b)} | |
| EUR | 2,280,000 | 4.20% due 2075/6/10 | 331,429,848 |
| | | スウェーデン合計 (簿価 ¥314,641,937) | 331,429,848 |
| | | 英国 (3.1%) | |
| | | 電力 (3.1%) | |
| | | NGG Finance Plc. ^{(a), (b)} | |
| EUR | 4,897,000 | 4.25% due 2076/6/18 | 718,963,045 |
| | | 英国合計 (簿価 ¥664,836,008) | 718,963,045 |
| | | 米国 (23.4%) | |
| | | 銀行 (23.4%) | |
| | | Bank of America Corp ^{(a), (b), (c)} | |
| USD | 18,380,000 | 5.13% | 2,102,599,792 |
| | | Goldman Sachs Group, Inc. ^{(a), (b), (c)} | |
| USD | 7,600,000 | 5.70% | 882,765,926 |
| | | JP Morgan Chase & Co. ^{(a), (b), (c)} | |
| USD | 19,400,000 | 5.00% | 2,223,392,356 |
| | | Morgan Stanley ^{(a), (b), (c)} | |
| USD | 2,200,000 | 5.45% | 254,397,487 |
| | | 米国合計 (簿価 ¥5,170,008,604) | 5,463,155,561 |
| | | 債券 (簿価 ¥20,541,906,092) | 22,971,555,876 |
| | | 短期投資 (1.8%) | |
| | | ドイツ (0.4%) | |
| | | 定期預金 (0.4%) | |
| | | Banco Santander | |
| EUR | 671,623 | -0.57% due 2018/1/2 | 90,850,538 |
| | | 定期預金合計 | 90,850,538 |
| | | ドイツ合計 (簿価 ¥90,118,261) | 90,850,538 |
| | | 米国 (1.2%) | |
| | | 定期預金 (1.2%) | |
| | | JP Morgan Chase & Co. | |
| USD | 2,423,547 | 0.92% due 2018/1/2 | 273,012,509 |
| | | 定期預金合計 | 273,012,509 |
| | | 米国合計 (簿価 ¥274,942,708) | 273,012,509 |
| | | 日本 (0.2%) | |
| | | 定期預金 (0.2%) | |
| | | Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. | |
| JPY | 48,009,325 | -0.25% due 2018/1/4 | 48,009,325 |
| | | 定期預金合計 | 48,009,325 |
| | | 日本合計 (簿価 ¥48,009,325) | 48,009,325 |
| | | グランド・ケイマン (0.0%) | |
| | | 定期預金 (0.0%) | |
| | | Brown Brothers Harriman & Co. | |

コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08 (為替ヘッジあり/限定追加型)

| 元本 | 証券の明細 | 純資産に 占める比率 | 評価額 |
|-----|---------------------------|---------------|------------------|
| GBP | 173 0.16% due 2018/1/2 | | 26,387 |
| | 定期預金合計 | | 26,387 |
| | グランド・ケイマン合計 (簿価 ¥26,089) | | 26,387 |
| | 短期投資合計 (簿価 ¥413,096,383) | | 411,898,759 |
| | 投資総額 (簿価 ¥20,955,002,475) | 100.3 | ¥ 23,383,454,635 |
| | 現金および他の資産を超過する負債 | (0.3) | (71,968,030) |
| | 純資産 | 100.0% | ¥ 23,311,486,605 |

(a) 償還条項付き証券

(b) 2017年12月29日現在の変動利付証券

(c) 永久債

2017年12月29日現在のファンドレベルの外国為替先渡契約 (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 | 純評価益/(損) |
|-----|---------------------------|------------|-----------|-----|-------------|-------------|
| EUR | Goldman Sachs Group, Inc. | 619,753 | 2018/1/24 | JPY | 82,148,396 | ¥ 1,704,004 |
| EUR | Goldman Sachs Group, Inc. | 406,777 | 2018/1/24 | USD | 479,470 | 1,078,834 |
| EUR | Goldman Sachs Group, Inc. | 74,700 | 2018/1/24 | JPY | 9,980,000 | 126,915 |
| EUR | Royal Bank of Canada | 450,863 | 2018/1/24 | JPY | 59,880,000 | 1,121,606 |
| EUR | Royal Bank of Canada | 374,195 | 2018/1/24 | JPY | 49,900,000 | 728,441 |
| EUR | Royal Bank of Canada | 75,021 | 2018/1/24 | JPY | 9,980,000 | 170,259 |
| EUR | State Street Corp. | 630 | 2018/1/24 | GBP | 562 | (340) |
| EUR | State Street Corp. | 50,342,394 | 2018/1/24 | USD | 59,858,113 | 75,083,220 |
| EUR | State Street Corp. | 564,825 | 2018/1/24 | JPY | 75,125,271 | 1,295,364 |
| EUR | State Street Corp. | 405,604 | 2018/1/24 | JPY | 53,806,394 | 1,071,682 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 564,257 | 2018/1/24 | JPY | 74,850,000 | 1,493,768 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 150,725 | 2018/1/24 | JPY | 19,960,000 | 433,086 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 112,714 | 2018/1/24 | JPY | 14,970,000 | 280,119 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 300,763 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 773,166 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 149,199 | 2018/1/24 | JPY | 19,960,000 | 226,616 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 37,399 | 2018/1/24 | JPY | 4,990,000 | 70,134 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 337,716 | 2018/1/24 | JPY | 44,910,000 | 782,821 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 37,380 | 2018/1/24 | JPY | 4,990,000 | 67,566 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 306,116 | 2018/1/24 | USD | 357,655 | 1,168,177 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 1,003,357 | 2018/1/24 | USD | 1,194,534 | 1,325,168 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 416,712 | 2018/1/24 | JPY | 55,888,000 | 493,024 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 379,746 | 2018/1/24 | USD | 452,035 | 509,065 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 666,872 | 2018/1/24 | JPY | 89,820,000 | 407,531 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 337,735 | 2018/1/24 | USD | 402,400 | 410,787 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 853 | 2018/1/24 | USD | 1,013 | 1,411 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 863,151 | 2018/1/24 | JPY | 114,770,000 | 2,014,128 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 378,794 | 2018/1/24 | JPY | 49,900,000 | 1,350,741 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 302,622 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 1,024,626 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 150,578 | 2018/1/24 | JPY | 19,960,000 | 413,158 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 378,449 | 2018/1/24 | JPY | 49,900,000 | 1,304,060 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 264,031 | 2018/1/24 | JPY | 34,930,000 | 793,247 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 396,408 | 2018/1/24 | JPY | 52,894,000 | 739,944 |

コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08 (為替ヘッジあり/限定追加型)

| 買い | 取引相手 | 契約金額 | 決済日 | 売り | 契約金額 | 純評価益/(損) |
|-----|---------------------------|----------------|-----------|-----|-------------|-----------------|
| EUR | Westpac Banking Corp. | 261,104 | 2018/1/24 | JPY | 34,930,000 | ¥ 397,328 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 298,784 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 505,359 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 260,062 | 2018/1/24 | JPY | 34,930,000 | 256,275 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 151,098 | 2018/1/24 | JPY | 19,960,000 | 483,461 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 299,840 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 648,202 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 226,385 | 2018/1/24 | JPY | 29,940,000 | 689,805 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 299,783 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 640,488 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 227,164 | 2018/1/24 | JPY | 29,940,000 | 795,201 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 149,477 | 2018/1/24 | JPY | 19,960,000 | 264,232 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 300,900 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 791,645 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 120,815 | 2018/1/24 | JPY | 15,968,000 | 378,232 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 527,416 | 2018/1/24 | JPY | 69,860,000 | 1,499,195 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 150,578 | 2018/1/24 | JPY | 19,960,000 | 413,160 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 377,784 | 2018/1/24 | JPY | 49,900,000 | 1,214,054 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 303,269 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 1,112,158 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 301,994 | 2018/1/24 | JPY | 39,920,000 | 939,640 |
| EUR | Westpac Banking Corp. | 418,608 | 2018/1/24 | JPY | 55,888,000 | 749,474 |
| GBP | State Street Corp. | 10,150 | 2018/1/24 | EUR | 11,383 | 6,137 |
| JPY | State Street Corp. | 24,852,997,295 | 2018/1/24 | EUR | 187,347,095 | (495,006,399) |
| JPY | Westpac Banking Corp. | 62,684,040 | 2018/1/24 | EUR | 474,482 | (1,513,280) |
| JPY | Westpac Banking Corp. | 69,175,970 | 2018/1/24 | EUR | 522,048 | (1,456,957) |
| JPY | Westpac Banking Corp. | 63,979,588 | 2018/1/24 | EUR | 478,664 | (783,471) |
| JPY | Westpac Banking Corp. | 91,565,194 | 2018/1/24 | EUR | 687,292 | (1,425,188) |
| USD | Goldman Sachs Group, Inc. | 1,169,218 | 2018/1/24 | EUR | 1,000,000 | (3,719,900) |
| USD | Goldman Sachs Group, Inc. | 1,184,907 | 2018/1/24 | EUR | 1,000,000 | (1,954,314) |
| USD | Goldman Sachs Group, Inc. | 1,190,289 | 2018/1/24 | EUR | 1,000,000 | (1,348,642) |
| USD | Royal Bank of Canada | 1,162,171 | 2018/1/24 | EUR | 1,000,000 | (4,512,946) |
| USD | State Street Corp. | 306,503 | 2018/1/24 | EUR | 259,443 | (609,777) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 270,317 | 2018/1/24 | EUR | 230,351 | (745,882) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 79,369 | 2018/1/24 | EUR | 68,000 | (268,473) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 324,659 | 2018/1/24 | EUR | 277,561 | (1,017,942) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 246,063 | 2018/1/24 | EUR | 210,149 | (742,051) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 1,006,485 | 2018/1/24 | EUR | 845,404 | (1,116,554) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 1,187,153 | 2018/1/24 | EUR | 1,000,000 | (1,701,557) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 380,676 | 2018/1/24 | EUR | 321,886 | (711,150) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 459 | 2018/1/24 | EUR | 386 | (628) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 1,180,524 | 2018/1/24 | EUR | 1,000,000 | (2,447,562) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 1,194,403 | 2018/1/24 | EUR | 1,000,000 | (885,667) |
| USD | Westpac Banking Corp. | 262,868 | 2018/1/24 | EUR | 220,905 | (306,076) |
| | | | | | | ¥ (412,028,042) |

通貨の略称:

EUR - ユーロ
 GBP - 英ポンド
 JPY - 日本円
 USD - 米ドル

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08（為替ヘッジあり／限定追加型））が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・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7月23日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの組入資産の内容等を17ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2018年1月23日から2018年7月23日まで)

| 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------|---------|-----|-----|
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 |
| 723 国庫短期証券 2018/3/5 | 400,003 | | |
| 731 国庫短期証券 2018/7/10 | 210,000 | | |

(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

2018年7月23日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書 第9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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの第9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 |

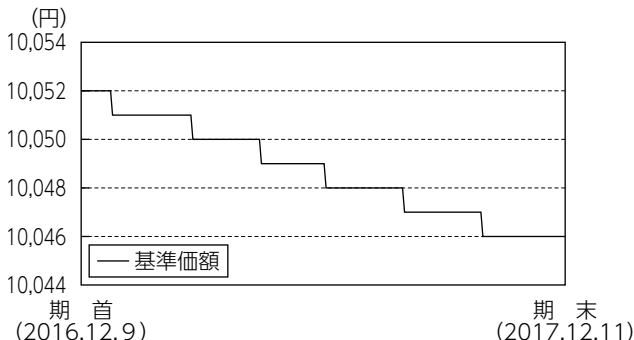
大和投資信託

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 円 | 公 社 債 率 | |
|-----------------|--------------|------------|--------------|
| | | 騰 落 率 % | 組 入 比 率 % |
| (期首)2016年12月9日 | 10,052 | - | 28.1 |
| 12月末 | 10,052 | 0.0 | - |
| 2017年1月末 | 10,051 | △0.0 | 31.1 |
| 2月末 | 10,051 | △0.0 | 25.0 |
| 3月末 | 10,050 | △0.0 | - |
| 4月末 | 10,049 | △0.0 | 35.2 |
| 5月末 | 10,049 | △0.0 | 5.5 |
| 6月末 | 10,048 | △0.0 | 0.5 |
| 7月末 | 10,048 | △0.0 | 0.1 |
| 8月末 | 10,047 | △0.0 | - |
| 9月末 | 10,047 | △0.0 | - |
| 10月末 | 10,046 | △0.1 | - |
| 11月末 | 10,046 | △0.1 | - |
| (期末)2017年12月11日 | 10,046 | △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：10,052円 期末：10,046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の・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、安定的な運用を行いません。

◆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いません。

◆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、安定的な運用を行いません。

■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)

| 国 内 | 買 付 額 千円 | 売 付 額 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) ()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。

■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)

| 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------|------------|-----|-----------|
| 銘 柄 | 金 額 千円 | 銘 柄 | 金 額 千円 |
| 645 国庫短期証券 2017/2/20 | 46,711,084 | | |
| 657 国庫短期証券 2017/4/17 | 31,380,607 | | |
| 659 国庫短期証券 2017/4/24 | 30,090,880 | | |
| 669 国庫短期証券 2017/6/12 | 29,100,894 | | |
| 652 国庫短期証券 2017/3/27 | 27,220,217 | | |
| 642 国庫短期証券 2017/2/6 | 25,890,391 | | |
| 644 国庫短期証券 2017/5/12 | 22,760,976 | | |
| 651 国庫短期証券 2017/3/21 | 21,610,540 | | |
| 660 国庫短期証券 2017/5/1 | 15,890,292 | | |
| 638 国庫短期証券 2017/1/16 | 12,400,099 | | |

(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

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 | 127,401,750 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 127,401,750 | 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 | 127,401,750,032円 |
| コール・ローン等 | 127,401,750,032 |
| (B) 負債 | — |
| (C) 純資産総額(A - B) | 127,401,750,032 |
| 元本 | 126,824,072,530 |
| 次期繰越損益金 | 577,677,502 |
| (D) 受益権総口数 | 126,824,072,530口 |
| 1万口当り基準価額(C / D) | 10,046円 |

* 期末における元本額は103,766,716,434円、当中における追加設定元本額は73,674,203,533円、同解約元本額は50,616,847,437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、ダイワ米ドル・ブルファンド(適格機関投資家専用) 4,467,705,309円、ダイワ米ドル・ペアファンド(適格機関投資家専用) 16,890,565,266円、ダイワ・マネーポートフォリオ(FOFs用)(適格機関投資家専用) 69,673円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-07(為替ヘッジあり) 995円、通貨選択型米国リート・αクワトロ(毎月分配型) 159,141円、通貨選択型アメリカン・エクイティ・αクワトロ(毎月分配型) 159,141円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10(為替ヘッジあり) 995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10(為替ヘッジあり) II 995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-12(為替ヘッジあり) 995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-02(為替ヘッジあり/限定追加型) 995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2016-08(為替ヘッジあり/限定追加型) 995円、日本株カムイA1戦略ファンド59,719,320円、ダイワJPX日経400ペア・ファンド(適格機関投資家専用) 3,285,486,762円、ダイワユーロペア・ファンド(2倍、非リバランス型)(適格機関投資家専用) 2,297,118,764円、ダイワ米ドルペア・ファンド(2倍、非リバランス型)(適格機関投資家専用) 35,118,078,983円、ダイワ/ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド9,393,201円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) 日本円・コース(毎月分配型) 998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) ブラジル・レアル・コース(毎月分配型) 998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型) アジア通貨・コース(毎月分配型) 998円、ダイワTOPIXペア・ファンド(適格機関投資家専用) 64,694,720,539円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券α(毎月分配型) 9,949円、ダイワ米国国債7-10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - USトライアングル - 703,716円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 - 173,802円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,046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 | △ 75,315,912円 |
| 受取利息 | △ 9,781,131 |
| 支払利息 | △ 65,534,781 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 15,183 |
| 売買損 | △ 15,183 |
| (C) その他費用 | △ 889,297 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △ 76,220,392 |
| (E) 前期繰越損益金 | 539,015,307 |
| (F) 解約差損益金 | △ 243,233,880 |
| (G) 追加信託差損益金 | 358,116,467 |
| (H) 合計(D + E + F + G) | 577,677,502 |
| 次期繰越損益金(H) | 577,677,502 |

(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。