

ダイワ・グローバル IoT関連株ファンド - AI新時代 - (為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)

★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/株式	
信託期間	約5年間(2017年4月21日~2022年4月13日)	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。	
主要投資対象	為替ヘッジあり	イ. グローバルIoT関連株ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)(以下「IoT関連株ファンド(為替ヘッジあり)」といいます。) の受益証券 ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジなし	イ. グローバルIoT関連株ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)(以下「IoT関連株ファンド(為替ヘッジなし)」といいます。) の受益証券 ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
運用方法	為替ヘッジあり	①主として、IoT関連株ファンド(為替ヘッジあり)の受益証券を通じて、日本を含む世界のIoT関連企業の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、信託財産の成長をめざします。 ※当ファンドにおいて、IoT関連企業とは、IoTを活用した製品・サービスの提供およびビジネスの創出・拡大を行なう企業、IoTを支える通信インフラを管理、提供する企業、IoTに関連した技術を駆使し、AI(人工知能)に携わる企業などをいいます。 ②当ファンドは、IoT関連株ファンド(為替ヘッジあり)とダイワ・マネー・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、IoT関連株ファンド(為替ヘッジあり)への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③IoT関連株ファンド(為替ヘッジあり)では、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。
	為替ヘッジなし	①主として、IoT関連株ファンド(為替ヘッジなし)の受益証券を通じて、日本を含む世界のIoT関連企業の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、信託財産の成長をめざします。 ※当ファンドにおいて、IoT関連企業とは、IoTを活用した製品・サービスの提供およびビジネスの創出・拡大を行なう企業、IoTを支える通信インフラを管理、提供する企業、IoTに関連した技術を駆使し、AI(人工知能)に携わる企業などをいいます。 ②当ファンドは、IoT関連株ファンド(為替ヘッジなし)とダイワ・マネー・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、IoT関連株ファンド(為替ヘッジなし)への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③IoT関連株ファンド(為替ヘッジなし)では、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いません。
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いません。 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	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。	
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、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

運用報告書(全体版) 第1期 (決算日 2017年10月13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・グローバルIoT関連株ファンド-AI新時代- (為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)」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/>

<2716>

<2717>

為替ヘッジあり

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース)		公社債 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	(分配落) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %	(参考指数) 円	期中 騰落率 %			
1期末(2017年10月13日)	10,590	300	8.9	11,189	11.9	—	98.8	百万円 44,851

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World指数（配当込み、米ドルベース）は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCI AC World指数（配当込み、米ドルベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCI AC World指数（配当込み、米ドルベース）は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

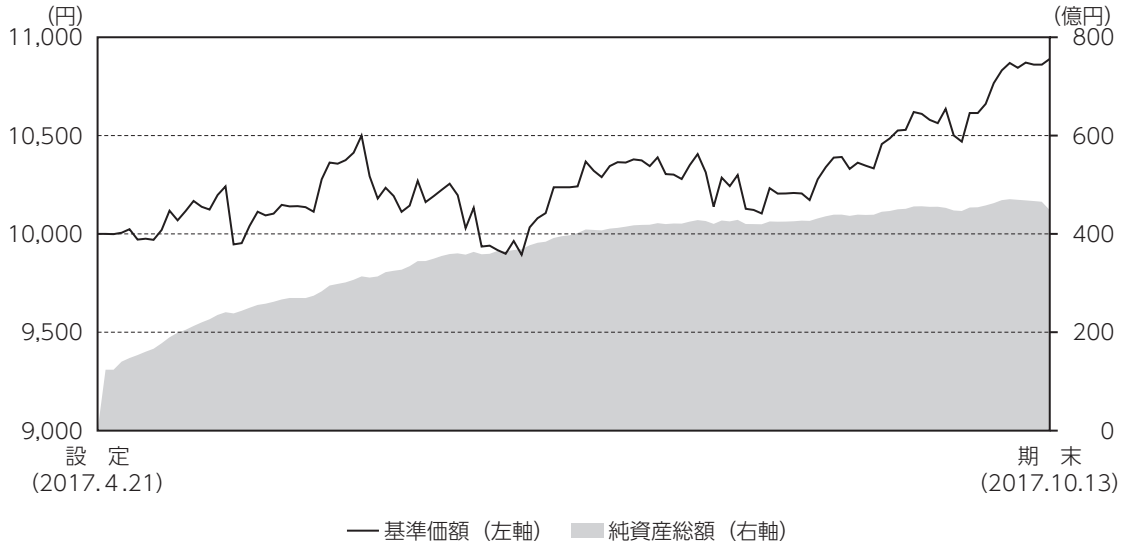
(注4) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 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。



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：10,590円 (分配金300円)

騰落率：8.9% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、主に米国を中心に保有銘柄の株価が上昇したことなどがプラス要因となり、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・グローバルIOT関連株ファンドーA I新時代ー (為替ヘッジあり)

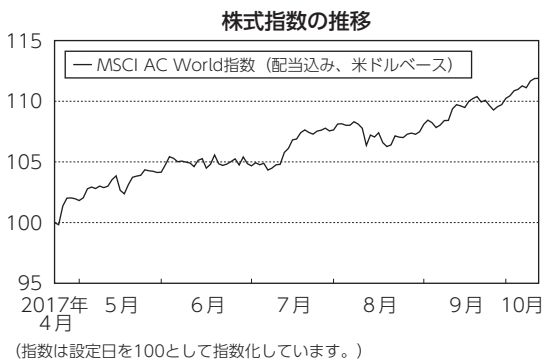
年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース)		公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 受 組 証 券 入 証 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(設定) 2017年 4月21日	10,000	% -	10,000	% -	% -	% -
4 月末	9,976	△0.2	10,197	2.0	0.0	90.8
5 月末	10,136	1.4	10,413	4.1	0.0	97.7
6 月末	9,936	△0.6	10,486	4.9	0.0	97.7
7 月末	10,374	3.7	10,756	7.6	0.0	98.2
8 月末	10,278	2.8	10,750	7.5	-	98.7
9 月末	10,615	6.2	10,972	9.7	-	99.0
(期末) 2017年10月13日	10,890	8.9	11,189	11.9	-	98.8

(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

(2017.4.21~2017.10.13)

■グローバル株式市況



グローバル株式市況は、フランス大統領選挙の結果を受けた政治リスクの後退や米国の利上げペースが緩やかなものになるとの見方が広がったこと、また米国を中心とした堅調な経済指標や企業業績などを受け、設定時から2017年8月上旬にかけて上昇基調となりました。その後、北朝鮮情勢の緊迫化による地政学リスクの高まりや米国トランプ政権の政策実行力への先行き不透明感などから上値の重くなる局面もありましたが、期末にかけては、米国の税制改革の進展期待や地政学リスクの後退、原油価格の回復、緩やかな景気回復や堅調な企業業績動向などが支援材料となり、堅調に推移しました。

ポートフォリオについて

(2017.4.21~2017.10.13)

■当ファンド

当ファンドは、「グローバルIOT関連株ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)」(以下、「IOT関連株ファンド(為替ヘッジあり)」)といえます。)の受益証券とダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券へ投資するファンド・オブ・ファンズです。当期は、IOT関連株ファンド(為替ヘッジあり)の受益証券を高位に組み入れました。

■IOT関連株ファンド(為替ヘッジあり)

当ファンドは、幅広いIOT関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行ないました。

株式組入比率は、高位を維持しました。地域別では、米国を中心に欧州や日本などに投資を行ないました。企業規模の面では、大型株を中心に中小型株にも投資しました。当期末の組入上位銘柄は、米国のピステオン(一般消費財・サービス)、日本のオムロン(情報技術)、米国のゼブラ・テクノロジーズ(情報技術)、ガーミン(一般消費財・サービス)、スイスのABB(資本財・サービス)などでした。

また、保有する実質外貨建資産について、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。

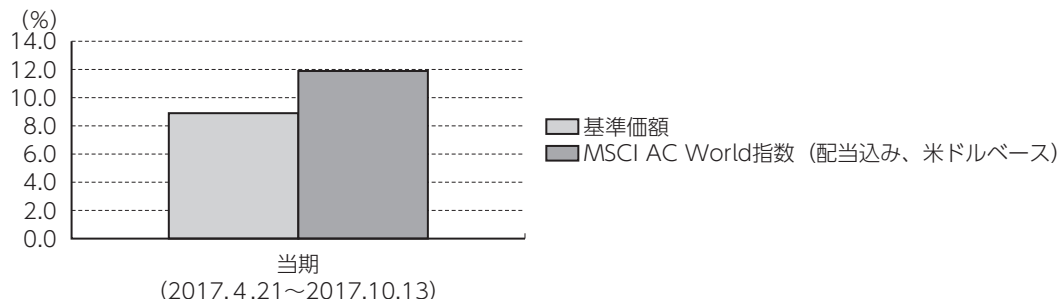
■ダイワ・マネー・マザーファンド

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

当期の1万口当たり分配金 (税込み) は300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	当期	
	2017年4月21日 ~2017年10月13日	
当期分配金 (税込み) (円)		300
対基準価額比率 (%)		2.75
当期の収益 (円)		300
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		590

(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	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	750.17
(c) 収益調整金	140.21
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	890.39
(f) 分配金	300.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	590.39

(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

■当ファンド

IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）の受益証券の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

■IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）

当ファンドは、幅広いIOT関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行ないます。

長期的には、低価格で革新的なセンサーや新たな通信ネットワーク、クラウド技術やAI（人工知能）の発展がIOT社会の成長のけん引役になるとみています。IOT分野の成長は、企業の設備投資動向に幾分影響されますが、現在のマクロ経済環境は追い風です。将来の成長期待の高まりを反映し、株価バリュエーションはやや高水準になってきていますので、銘柄選択を慎重に行なっていく方針です。

引き続き、高い成長が期待されるIOT関連企業に投資を行なうことで、信託財産の成長をめざして運用を行なってまいります。

また、保有する実質外貨建資産について、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・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う方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017.4.21~2017.10.13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	60円	0.583%	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10,276円です。
（投 信 会 社）	(19)	(0.182)	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）	(40)	(0.391)	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)	(0.010)	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	60	0.586	

(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

(1) 投資信託受益証券

(2017年4月21日から2017年10月13日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
国内	グローバルIOT 関連株ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	42,424,246.348	43,045,000	2,104,104.988	2,300,000

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年4月21日から2017年10月13日まで)

	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・マザーファンド	9,811	10,000	-	-

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) 当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) ダイワ・マネー・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

(2017年4月21日から2017年10月13日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 46,081	百万円 6,860	% 14.9	百万円 -	百万円 -	% -
コール・ローン	7,517,457	-	-	-	-	-
現先取引 (その他有価証券)	118,999	-	-	118,999	-	-

(注) 平均保有割合0.0%
※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、当期中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

(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		
	口 数	評 価 額	比 率
国内投資信託受益証券 グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	千口 40,320,141.36	千円 44,331,995	% 98.8

(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	当 期 末	
	口 数	評 価 額
ダイワ・マネー・マザーファンド	千口 9,811	千円 9,997

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年10月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 44,331,995	% 93.2
ダイワ・マネー・マザーファンド	9,997	0.0
コール・ローン等、その他	3,216,904	6.8
投資信託財産総額	47,558,897	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10月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	47,558,897,262円
コール・ローン等	2,616,904,781
投資信託受益証券(評価額)	44,331,995,425
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	9,997,056
未収入金	600,000,000
(B) 負債	2,707,808,660
未払収益分配金	1,270,543,917
未払解約金	1,229,208,032
未払信託報酬	207,014,222
その他未払費用	1,042,489
(C) 純資産総額(A - B)	44,851,088,602
元本	42,351,463,918
次期繰越損益金	2,499,624,684
(D) 受益権総口数	42,351,463,918口
1万口当り基準価額(C/D)	10,590円

* 設定時における元本額は12,383,226,988円、当期中における追加設定元本額は34,638,868,810円、同解約元本額は4,670,631,880円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,590円です。

■損益の状況

当期 自2017年4月21日 至2017年10月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 374,061円
受取利息	38,320
支払利息	△ 412,381
(B) 有価証券売買損益	3,385,170,497
売買益	3,590,077,528
売買損	△ 204,907,031
(C) 信託報酬等	△ 208,059,595
(D) 当期損益金(A + B + C)	3,176,736,841
(E) 追加信託差損益金	593,431,760
(配当等相当額)	(△ 400,016)
(売買損益相当額)	(593,831,776)
(F) 合計(D + E)	3,770,168,601
(G) 収益分配金	△1,270,543,917
次期繰越損益金(F + G)	2,499,624,684
追加信託差損益金	593,431,760
(配当等相当額)	(△ 400,016)
(売買損益相当額)	(593,831,776)
分配準備積立金	1,906,569,972
繰越損益金	△ 377,048

(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	3,177,113,889
(c) 収益調整金	593,831,776
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,770,945,665
(f) 分配金	1,270,543,917
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	2,500,401,748
(h) 受益権総口数	42,351,463,918口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	300円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、10月13日現在の基準価額（1万口当り10,590円）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。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

グローバルIOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

当ファンド（ダイワ・グローバルIOT関連株ファンドーA | 新時代ー（為替ヘッジあり））の主要投資対象である「グローバルIOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）」は、2017年10月13日現在、第1期決算を迎えておりません。

為替ヘッジなし

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		公社債 組入比率	投資信託 組入比率	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			
1 期末(2017年10月13日)	円 10,733	円 450	% 11.8	11,494	% 14.9	% -	% 98.8	百万円 105,631

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

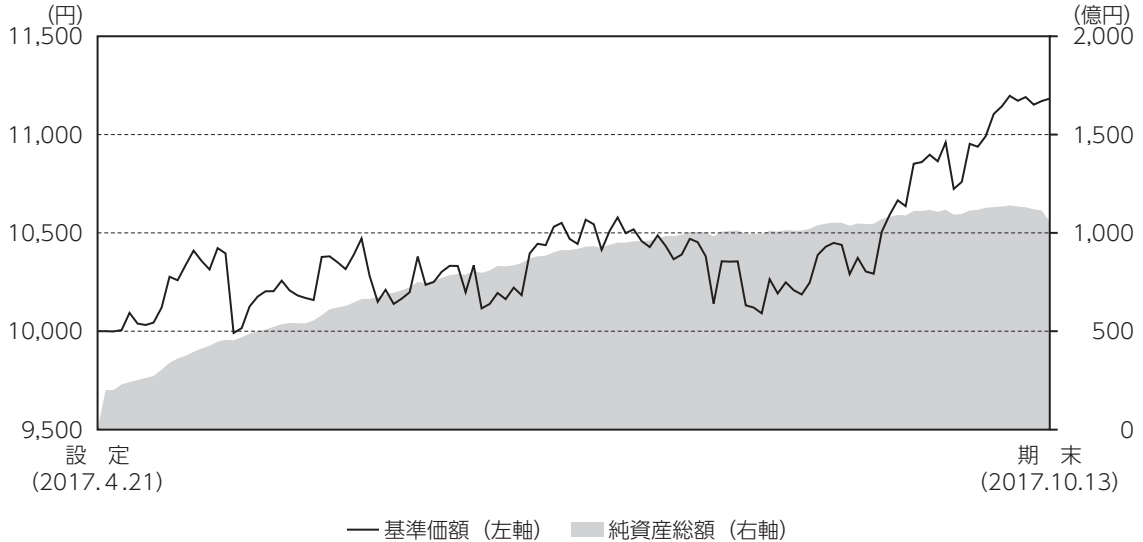
(注4) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 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。



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：10,733円 (分配金450円)

騰落率：11.8% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、主に米国を中心に保有銘柄の株価が上昇したことや、米ドルやユーロが対円で上昇したことなどがプラス要因となり、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・グローバルIOT関連株ファンドーA I新時代ー (為替ヘッジなし)

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 受 組 証 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(設定) 2017年 4月21日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -
4 月末	10,032	0.3	10,381	3.8	0.0	90.7
5 月末	10,169	1.7	10,570	5.7	0.0	97.2
6 月末	10,116	1.2	10,744	7.4	0.0	97.0
7 月末	10,458	4.6	10,858	8.6	0.0	97.8
8 月末	10,388	3.9	10,859	8.6	-	98.4
9 月末	10,938	9.4	11,315	13.2	-	99.0
(期末) 2017年10月13日	11,183	11.8	11,494	14.9	-	98.8

(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

(2017.4.21~2017.10.13)

■グローバル株式市況

株式指数の推移

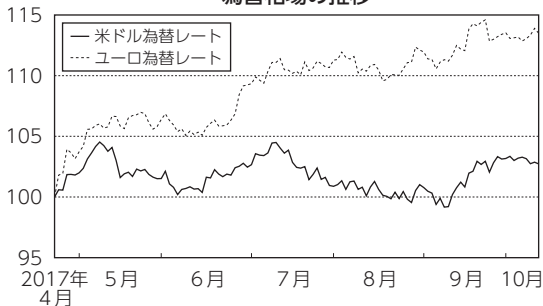


(指数は設定日を100として指数化しています。)

グローバル株式市況は、フランス大統領選挙の結果を受けた政治リスクの後退や米国の利上げペースが緩やかなものになるとの見方が広がったこと、また米国を中心とした堅調な経済指標や企業業績などを受け、設定時から2017年8月上旬にかけて上昇基調となりました。その後、北朝鮮情勢の緊迫化による地政学リスクの高まりや米国トランプ政権の政策実行力への先行き不透明感などから上値の重くなる局面もありましたが、期末にかけては、米国の税制改革の進展期待や地政学リスクの後退、原油価格の回復、緩やかな景気回復や堅調な企業業績動向などが支援材料となり、堅調に推移しました。

■為替相場

為替相場の推移



(為替レートは対円で、設定日を100として指数化しています。)

為替相場は、設定時より、米ドル、ユーロともに対円で上昇しました。北朝鮮情勢の緊迫化による地政学リスクの高まりなどが円高要因となりましたが、米国の年内追加利上げ観測が台頭したことやトランプ政権の税制改革への期待などから、米ドルは対円で上昇しました。また、フランス大統領選挙のマクロン氏勝利で政治リスクが後退したことや欧州経済が回復基調となったことなどから、ユーロも対円で上昇しました。

ポートフォリオについて

(2017.4.21~2017.10.13)

■当ファンド

当ファンドは、「グローバルIOT関連株ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)」(以下、「IOT関連株ファンド(為替ヘッジなし)」)の受益証券とダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券へ投資するファンド・オブ・ファンズです。当期は、IOT関連株ファンド(為替ヘッジなし)の受益証券を高位に組み入れました。

■IOT関連株ファンド(為替ヘッジなし)

当ファンドは、幅広いIOT関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行ないました。

株式組入比率は、高位を維持しました。地域別では、米国を中心に欧州や日本などに投資を行ないました。企業規模の面では、大型株を中心に中小型株にも投資しました。当期末の組入上位銘柄は、米国のビステオン(一般消費財・サービス)、日本のオムロン(情報技術)、米国のゼブラ・テクノロジーズ(情報技術)、ガーミン(一般消費財・サービス)、スイスのABB(資本財・サービス)などでした。

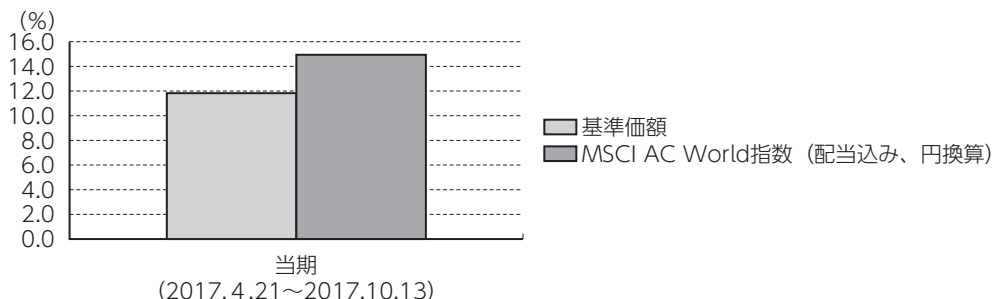
■ダイワ・マネー・マザーファンド

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

当期の1万口当り分配金(税込み)は450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	当 期	
	2017年4月21日 ~2017年10月13日	
当期分配金(税込み) (円)		450
対基準価額比率 (%)		4.02
当期の収益 (円)		450
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		733

(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	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	905.25
(c) 収益調整金	278.37
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,183.63
(f) 分配金	450.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	733.63

(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

■当ファンド

I o T 関連株ファンド(為替ヘッジなし)の受益証券の組入比率を、通常の状態では高位に維持することを基本とします。

■I o T 関連株ファンド(為替ヘッジなし)

当ファンドは、幅広いI o T 関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行ないます。

長期的には、低価格で革新的なセンサーや新たな通信ネットワーク、クラウド技術やAI(人工知能)の発展がI o T 社会の成長のけん引役になるとみています。I o T 分野の成長は、企業の設備投資動向に幾分影響されますが、現在のマクロ経済環境は追い風です。将来の成長期待の高まりを反映し、株価バリュエーションはやや高水準になってきていますので、銘柄選択を慎重に行なっていく方針です。

ダイワ・グローバルＩｏＴ関連株ファンド－ＡＩ新時代－（為替ヘッジなし）

引き続き、高い成長が期待されるＩｏＴ関連企業に投資を行なうことで、信託財産の成長をめざして運用を行なってまいります。

■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、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行なう方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017.4.21~2017.10.13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	61円	0.583%	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10,406円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.182)	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)	(41)	(0.391)	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)	(0.010)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0.001	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	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	61	0.584	

(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

(1) 投資信託受益証券

(2017年4月21日から2017年10月13日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
国内	グローバルIoT関連株ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	100,296,639.694	103,270,000	8,226,162.833	9,300,000

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年4月21日から2017年10月13日まで)

	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・マザーファンド	9,811	10,000	-	-

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) 当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) ダイワ・マネー・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

(2017年4月21日から2017年10月13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
区分						
百万円	百万円	%	百万円	百万円	%	
公社債	46,081	6,860	14.9	-	-	-
コール・ローン	7,517,457	-	-	-	-	-
現先取引 (その他有価証券)	118,999	-	-	118,999	-	-

(注) 平均保有割合0.0%
※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、当期中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

(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		
	口 数	評 価 額	比 率
国内投資信託受益証券	千口	千円	%
グローバルIoT関連株ファンド (為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	92,070,476.861	104,361,885	98.8

(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	当 期 末	
	口 数	評 価 額
ダイワ・マネー・マザーファンド	千口 9,811	千円 9,997

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年10月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 104,361,885	% 91.2
ダイワ・マネー・マザーファンド	9,997	0.0
コール・ローン等、その他	10,026,316	8.8
投資信託財産総額	114,398,198	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10月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	114,398,198,722円
コール・ローン等	7,626,316,145
投資信託受益証券(評価額)	104,361,885,521
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	9,997,056
未収入金	2,400,000,000
(B) 負債	8,766,928,505
未払収益分配金	4,428,600,451
未払解約金	3,869,157,382
未払信託報酬	468,132,481
その他未払費用	1,038,191
(C) 純資産総額(A - B)	105,631,270,217
元本	98,413,343,375
次期繰越損益金	7,217,926,842
(D) 受益権総口数	98,413,343,375口
1万口当り基準価額(C / D)	10,733円

* 設定時における元本額は20,103,617,734円、当期中における追加設定元本額は92,232,395,865円、同解約元本額は13,922,670,224円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,733円です。

■損益の状況

当期 自2017年4月21日 至2017年10月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 822,263円
受取利息	112,065
支払利息	△ 934,328
(B) 有価証券売買損益	9,378,127,747
売買益	10,386,545,302
売買損	△ 1,008,417,555
(C) 信託報酬等	△ 469,175,320
(D) 当期損益金(A + B + C)	8,908,130,164
(E) 追加信託差損益金	2,738,397,129
(配当等相当額)	(△ 1,158,792)
(売買損益相当額)	(2,739,555,921)
(F) 合計(D + E)	11,646,527,293
(G) 収益分配金	△ 4,428,600,451
次期繰越損益金(F + G)	7,217,926,842
追加信託差損益金	2,738,397,129
(配当等相当額)	(△ 1,158,792)
(売買損益相当額)	(2,739,555,921)
分配準備積立金	4,480,354,963
繰越損益金	△ 825,250

(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	8,908,955,414
(c) 収益調整金	2,739,555,921
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	11,648,511,335
(f) 分配金	4,428,600,451
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	7,219,910,884
(h) 受益権総口数	98,413,343,375口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	450円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、10月13日現在の基準価額（1万口当り10,733円）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。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

グローバルＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）

当ファンド（ダイワ・グローバルＩｏＴ関連株ファンド－ＡＩ新時代－（為替ヘッジなし））の主要投資対象である「グローバルＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」は、2017年10月13日現在、第1期決算を迎えておりません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド-A | 新時代-（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））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10月13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22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

(2017年4月21日から2017年10月13日まで)

買		付		売		付	
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
			千円				千円
669	国庫短期証券 2017/6/12		15,820,483				
650	国庫短期証券 2017/6/12		6,150,116				
644	国庫短期証券 2017/5/12		5,240,052				
660	国庫短期証券 2017/5/1		5,090,078				
665	国庫短期証券 2017/5/22		4,380,157				
661	国庫短期証券 2017/5/8		3,440,106				
671	国庫短期証券 2017/6/19		2,080,018				
679	国庫短期証券 2017/7/31		1,700,018				
666	国庫短期証券 2017/5/29		650,035				
672	国庫短期証券 2017/6/26		460,006				

(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10月13日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（68,142,061千円）の内容です。

国内その他有価証券

	2017年10月13日現在	
	評 価 額	比 率
国内短期社債等	千円 999,998	% <1.4>

(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

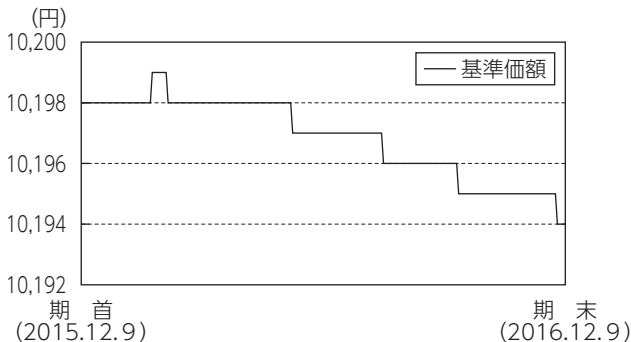
大和投資信託

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 率	
	円	騰 落 率 %	組 入 比 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：10,198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

○国内短期金融市場

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)

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

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

(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)

買 付				売 付			
銘	柄	金 額	千円	銘	柄	金 額	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）

区 分	当 期			末 期			
	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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
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手入しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	年 利 率	当 期			末 期		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円		千円	千円	
国債証券	632 国庫短期証券	—	14,020,000	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 金額	3銘柄	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

区 分	当 期			末 期		
	額 面 金 額	評 価 額	比 率	額 面 金 額	評 価 額	比 率
	千円	千円	%	千円	千円	%
国内短期社債等	999,999	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 期		
	評 価 額	比 率	率	評 価 額	比 率	率
	千円	%	%	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 期
(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	
その他未取収益	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・パリュウ (為替ヘッジあり) 98,069円、ダイワ F E グローバル・パリュウ (為替ヘッジなし) 98,069円、ダイワ・R I C I * コモディ

ティ・ファンド8,952,508円、U S 債券NB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NB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、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>米ドルコース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>円コース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>世界通貨分散コース981円、堅実バランスファンド - ハジメの一歩 - 129,891,397円、D C ダイワ・マネー・ポートフォリオ2,529,711,704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) - トリプルリターンズ - 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) - トリプルリターンズ - 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) - トリプルリターンズ - ブラジル・レアル・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) - トリプルリターンズ - 米ドル・コース (毎月分配型) 12,784円、ダイワノビリティ北米株式ファンド - パラダイムシフト - 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 IV 21,858,178,543円、フル3倍日本株ポートフォリオ IV 34,413,293,504円、2倍日本株ポートフォリオ IV 6,512,563,667円、ダイワ F E グローバル・パリュウ株ファンド (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・レアル・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、ダイワノ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 - 金積立型 - 501,660円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド (償還案項付) 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 - インフラ革命 - (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 - インフラ革命 - (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ソリンα (毎月分配型) 98,107円、ダイワ英国高配当株ソリンα (毎月分配型) 株式αコース98,203円、ダイワ・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&通貨ソリン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) - トリプルリターンズ - 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。