

# ダイワ・スイス 高配当株ツインα (毎月分配型)

## 運用報告書(全体版)

第53期(決算日 2018年7月17日)  
第54期(決算日 2018年8月17日)  
第55期(決算日 2018年9月18日)  
第56期(決算日 2018年10月17日)  
第57期(決算日 2018年11月19日)  
第58期(決算日 2018年12月17日)

(作成対象期間 2018年6月19日～2018年12月17日)

★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／海外／株式	
信託期間	約10年間(2013年12月18日～2023年12月15日)	
運用方針	信託財産の成長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「UBS(CAY)スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券
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益(評価益を含みます。)等とし、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準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。	

## 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。

当ファンドは、配当利回りの高いスイス株式へ投資するとともに、オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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/>

<5638>

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			スイスSMI指数 (円換算)		スイス・フラン 為替レート		公社債 組入率	投資信託 受益証券 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	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	円	%	%	%	百万円
29期末(2016年7月19日)	7,103	110	5.3	9,668	6.2	107.81	△ 0.7	0.0	99.2	38,455
30期末(2016年8月17日)	6,966	110	△ 0.4	9,447	△ 2.3	104.65	△ 2.9	0.0	99.2	36,612
31期末(2016年9月20日)	6,936	110	1.1	9,358	△ 0.9	103.92	△ 0.7	—	98.0	34,857
32期末(2016年10月17日)	6,950	110	1.8	9,353	△ 0.1	105.22	1.3	0.0	98.7	33,435
33期末(2016年11月17日)	6,946	110	1.5	9,446	1.0	108.63	3.2	0.0	99.2	32,040
34期末(2016年12月19日)	7,289	110	6.5	10,360	9.7	114.60	5.5	0.0	99.0	31,733
35期末(2017年1月17日)	7,268	110	1.2	10,372	0.1	112.88	△ 1.5	0.0	98.3	30,996
36期末(2017年2月17日)	7,354	110	2.7	10,578	2.0	113.70	0.7	0.0	98.8	30,279
37期末(2017年3月17日)	7,383	110	1.9	10,846	2.5	113.89	0.2	0.0	98.7	29,422
38期末(2017年4月17日)	7,124	110	△ 2.0	10,225	△ 5.7	107.84	△ 5.3	0.0	98.3	27,916
39期末(2017年5月17日)	7,579	110	7.9	11,476	12.2	114.43	6.1	0.0	98.7	29,212
40期末(2017年6月19日)	7,475	110	0.1	11,229	△ 2.2	114.02	△ 0.4	0.0	98.4	29,065
41期末(2017年7月18日)	7,527	110	2.2	11,602	3.3	116.82	2.5	—	98.6	30,325
42期末(2017年8月17日)	7,238	110	△ 2.4	11,314	△ 2.5	113.93	△ 2.5	—	98.5	30,089
43期末(2017年9月19日)	7,272	110	2.0	11,530	1.9	115.98	1.8	—	98.4	31,561
44期末(2017年10月17日)	7,277	110	1.6	11,714	1.6	114.95	△ 0.9	—	98.5	33,855
45期末(2017年11月17日)	7,117	110	△ 0.7	11,431	△ 2.4	113.74	△ 1.1	—	98.2	34,235
46期末(2017年12月18日)	7,139	110	1.9	11,732	2.6	113.65	△ 0.1	—	98.4	34,727
47期末(2018年1月17日)	7,230	110	2.8	11,982	2.1	115.23	1.4	—	98.4	35,831
48期末(2018年2月19日)	6,789	110	△ 4.6	11,316	△ 5.6	114.60	△ 0.5	—	98.9	33,811
49期末(2018年3月19日)	6,513	110	△ 2.4	10,843	△ 4.2	111.10	△ 3.1	—	98.6	33,029
50期末(2018年4月17日)	6,403	110	0.0	10,694	△ 1.4	111.53	0.4	—	98.6	32,857
51期末(2018年5月17日)	6,417	110	1.9	10,868	1.6	110.22	△ 1.2	—	98.6	33,270
52期末(2018年6月18日)	6,274	75	△ 1.1	10,526	△ 3.1	110.85	0.6	—	98.9	32,695
53期末(2018年7月17日)	6,244	75	0.7	10,964	4.2	112.78	1.7	—	99.0	32,380
54期末(2018年8月17日)	6,205	75	0.6	10,989	0.2	111.15	△ 1.4	—	98.7	32,285
55期末(2018年9月18日)	6,326	75	3.2	11,400	3.7	116.10	4.5	—	98.8	32,637
56期末(2018年10月17日)	5,900	75	△ 5.5	10,966	△ 3.8	113.48	△ 2.3	—	99.7	29,862
57期末(2018年11月19日)	5,818	75	△ 0.1	11,035	0.6	112.75	△ 0.6	—	98.8	29,325
58期末(2018年12月17日)	5,731	75	△ 0.2	10,887	△ 1.3	113.71	0.9	—	98.7	28,716

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) スイスSMI指数(円換算)は、スイスSMI指数(スイス・フランベース)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。

(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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 為替レートは、計算日における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を採用しています。

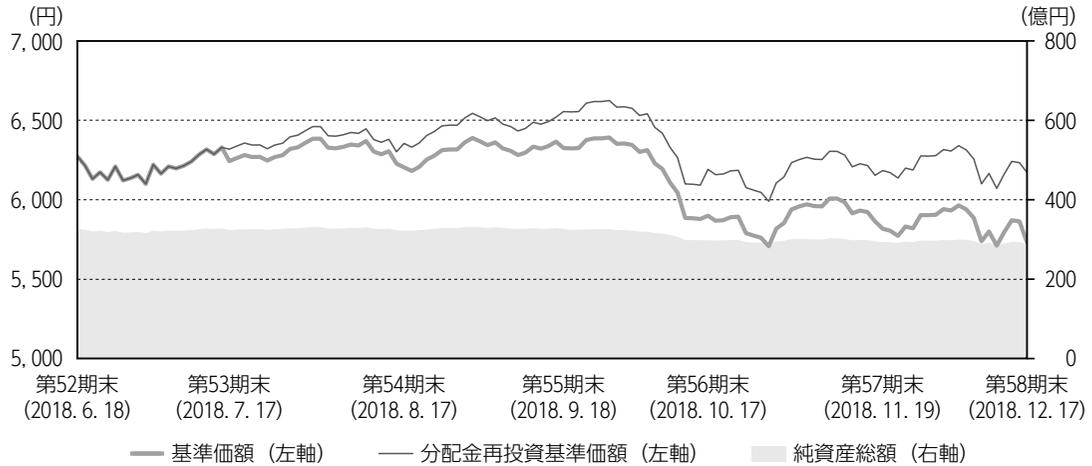
(注6) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注7) 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



\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### 基準価額・騰落率

第53期首：6,274円

第58期末：5,731円（既払分配金450円）

騰落率：△1.6%（分配金再投資ベース）

#### 基準価額の主な変動要因

UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンドの下落が要因となり、基準価額は下落しました。UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンドについては、スイス株式への投資と株価指数および通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築した結果、スイス・フランが対円で上昇したことはプラスに寄与しましたが、株式が下落したことがマイナス要因となり、下落しました。一方、オプション取引については、株価指数オプションがプラスに寄与し、通貨のオプションがマイナス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		スイスSMI指数 (円換算)		スイス・フラン 為 替 レ ー ト		公 社 債 組 入 率 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)		
第53期	(期首) 2018年6月18日	円 6,274	% —	10,526	% —	円 110.85	% —	% —	% 98.9
	6月末	6,100	△ 2.8	10,309	△ 2.1	110.88	0.0	—	99.4
	(期末) 2018年7月17日	6,319	0.7	10,964	4.2	112.78	1.7	—	99.0
第54期	(期首) 2018年7月17日	6,244	—	10,964	—	112.78	—	—	99.0
	7月末	6,359	1.8	11,313	3.2	112.36	△ 0.4	—	99.1
	(期末) 2018年8月17日	6,280	0.6	10,989	0.2	111.15	△ 1.4	—	98.7
第55期	(期首) 2018年8月17日	6,205	—	10,989	—	111.15	—	—	98.7
	8月末	6,369	2.6	11,396	3.7	114.70	3.2	—	98.9
	(期末) 2018年9月18日	6,401	3.2	11,400	3.7	116.10	4.5	—	98.8
第56期	(期首) 2018年9月18日	6,326	—	11,400	—	116.10	—	—	98.8
	9月末	6,353	0.4	11,636	2.1	116.22	0.1	—	98.9
	(期末) 2018年10月17日	5,975	△ 5.5	10,966	△ 3.8	113.48	△ 2.3	—	99.7
第57期	(期首) 2018年10月17日	5,900	—	10,966	—	113.48	—	—	99.7
	10月末	5,854	△ 0.8	10,957	△ 0.1	112.63	△ 0.7	—	98.7
	(期末) 2018年11月19日	5,893	△ 0.1	11,035	0.6	112.75	△ 0.6	—	98.8
第58期	(期首) 2018年11月19日	5,818	—	11,035	—	112.75	—	—	98.8
	11月末	5,942	2.1	11,283	2.2	113.90	1.0	—	99.1
	(期末) 2018年12月17日	5,806	△ 0.2	10,887	△ 1.3	113.71	0.9	—	98.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2018. 6. 19～2018. 12. 17）

### ■ スイス株式市況

スイス株式市場は下落しました。

当作成期の序盤は、スイス中央銀行が緩和的な金融政策を継続するとの見方や、国内インフレ率の低位安定などを背景に、スイス株式市場は上昇基調で推移しました。しかし2018年8月以降は、トルコ・リラの急落を引き金としたリスク回避姿勢の強まりや世界的な貿易摩擦問題に加え、イタリアの財政問題、英国のEU（欧州連合）離脱をめぐる不透明感などを受けて、スイス株式市場は上値の重い展開となりました。さらに10月に入ると、米国長期金利の上昇などを引き金に世界的な株安が進み、スイス株式市場は大きく下落しました。その後も、米国の保護主義的な通商政策や欧州の政治リスクなどの不安材料が意識される中で、スイス株式市場は上下に振れながらも弱含みで推移し、当作成期首を下回る水準で当作成期末を迎えました。

### ■ スイス株価指数オプション市況

期間1カ月アット・ザ・マネーのインプライド・ボラティリティ（予想変動率）は上昇しました。

当作成期首10%台でスタートしたインプライド・ボラティリティは、2018年6月末にかけてやや上昇したものの、スイス株式市場の堅調な動向を背景に低下基調に転じました。しかし8月に入ると、トルコ・リラの急落を引き金としたリスク回避姿勢の強まりを受けて、インプライド・ボラティリティは上昇しました。その後、インプライド・ボラティリティはいったん落ち着きを取り戻しましたが、10月に入り、世界的な株安を受けたリスク回避姿勢の強まりなどから再び大きく上昇しました。その後も、貿易摩擦問題や世界経済の減速懸念、欧州の政治リスクなどを背景に株式市場の値動きが不安定化する中、インプライド・ボラティリティも変動の大きい展開が続き、16%台の水準で当作成期末を迎えました。

### ■ 為替相場

スイス・フランの対円為替レートは上昇しました。

当作成期首から2018年8月中旬にかけて、貿易摩擦をめぐる懸念やイタリアの財政問題、トルコ・リラ急落などを背景にリスク回避の円買いが進む中でも、スイス・フランは円に対しておおむね底堅く推移しました。8月下旬に入ると、投資家心理の改善に連れスイス・フランが対円で上昇しました。9月下旬から10月下旬にかけて、米国長期金利の上昇や欧州の政治リスクへの警戒感などから欧州通貨が全般に弱含む中で、スイス・フランも下落基調となりました。スイス中央銀行総裁が、金融緩和政策の継続に加え、スイス・フラン高の抑制に向け必要に応じて為替介入を実施する方針を示したことも、スイス・フランへの売り圧力を強める要因となりました。11月以降はスイ

ス・フランが緩やかに回復し、当作成期首よりスイス・フラン高円安の水準で当作成期末を迎えました。

#### ■ スイス・フラン／円為替オプション市況

期間1カ月アット・ザ・マネーのインプライド・ボラティリティ（予想変動率）は小幅に低下しました。

当作成期首6%台でスタートしたインプライド・ボラティリティは、不安定な市場環境が続く中でもスイス・フランが対円で底堅く推移したことなどから、当作成期の前半はおおむね安定した動きとなりました。当作成期の後半に入り、米国長期金利の上昇やイタリアの財政問題、英国のEU（欧州連合）離脱をめぐる不透明感などから市場の警戒感が強まり、スイス・フランが対円で軟調に推移したため、インプライド・ボラティリティはやや水準を切上げました。その後、スイス・フランの回復に伴いインプライド・ボラティリティは低下し、5%台で当作成期末を迎えました。

### 前作成期末における「今後の運用方針」

#### ■ 当ファンド

引き続き、UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンドとダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。通常の状態では、UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・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。

#### ■ UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド

米国トランプ政権による政策運営にはいまだ不透明感があるものの、米国経済は旺盛な内需を支えに堅調です。FRB（米国連邦準備制度理事会）は緩やかながらも着実なペースで利上げを進めると予想され、米国金利の上昇が幅広い資産の価格形成に影響を与えると予想されます。欧州では、ユーロ圏の製造業PMI（購買担当者景気指数）が高水準で推移するなど、景気回復の兆しが顕在化しています。失業率はようやく低下に転じ、今後、消費者の信頼感を支えると見込まれます。ECB（欧州中央銀行）は景気下支えのため、金融緩和を継続する方針を示しています。一方で、英国のEU（欧州連合）離脱をめぐる動きが企業景況感に与える影響には、引き続き注意が必要と考えます。

スイス経済は、輸出産業が世界的な景気回復の恩恵を受けているほか、国内消費も引き続き堅調です。また、為替市場ではスイス・フランの下落トレンドが継続するとみています。これは、スイ

ス企業の業績に追い風となると期待され、2018年の業績は好調だった2017年を上回ると期待されます。また、食品・飲料やヘルスケアなどのセクターでM&A（企業の合併・買収）が活発化していますが、景況感の改善に加え、企業が潤沢な資金を保有していることを考慮すると、こうした動きは今後も継続すると見込まれます。今後も、企業価値が株価に十分に反映されていない銘柄などに注目しながら、投資妙味の高い銘柄の組み入れに焦点を当てていく方針です。

スイス株式への投資に加えて、株式カバードコール戦略および通貨カバードコール戦略の活用により、オプションプレミアム（※）の確保をめざします。株式カバードコール戦略ではスイス株価指数のコール・オプション（買う権利）の売りを、通貨カバードコール戦略では円に対するスイス・フランのコール・オプションの売りを行います。いずれのオプションも、カバー率をファンドが保有するスイス・フラン建て資産の評価額に対して50%程度とすることにより、株式の値上がり益、スイス・フランの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざします。

※オプションの買い手が売り手に支払う対価

#### ■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行います。

## ポートフォリオについて

(2018. 6. 19 ~ 2018. 12. 17)

#### ■当ファンド

UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンドとダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資しました。UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンドへの投資割合を高位に維持しました。

#### ■UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド

業種構成は、当ファンドの現物株式ポートフォリオのベンチマークであるS P I（スイス・パフォーマンス指数）に対して、資本財・サービスなどをオーバーウエートで推移させた一方で、ヘルスケアや情報技術などをアンダーウエートで推移させました。個別銘柄では、Lonza、Swisscom、GAMなどをオーバーウエートで推移させた一方で、Credit Suisse、Swatch Group、Julius Baerなどをアンダーウエートで推移させました。

スイス株式への投資に加えて、株式カバードコール戦略および通貨カバードコール戦略の活用により、オプションプレミアムの確保をめざしました。株式カバードコール戦略ではスイス株価指数のコール・オプション（買う権利）の売りを、通貨カバードコール戦略では円に対するスイス・フ

## ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

ランのコール・オプションの売りを行いました。いずれのオプションも、カバー率をファンドが保有するスイス・フラン建て資産の評価額に対して50%程度とすることにより、株式の値上がり益、スイス・フランの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざしました。

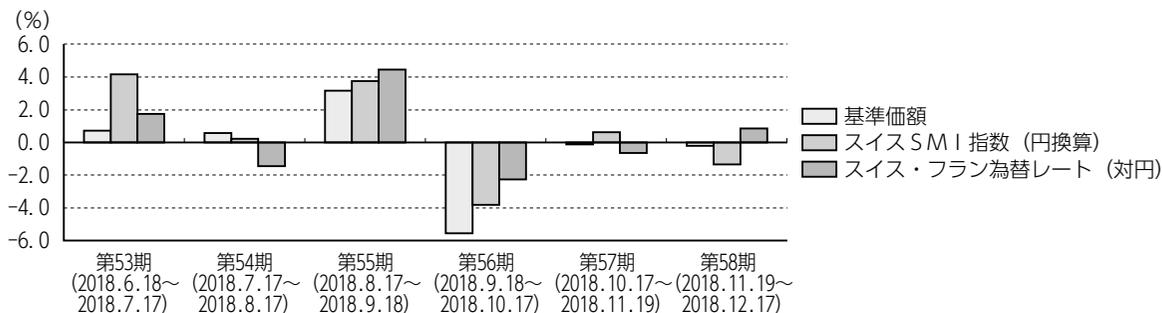
### ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

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。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期
	2018年6月19日 ～2018年7月17日	2018年7月18日 ～2018年8月17日	2018年8月18日 ～2018年9月18日	2018年9月19日 ～2018年10月17日	2018年10月18日 ～2018年11月19日	2018年11月20日 ～2018年12月17日
<b>当期分配金(税込み) (円)</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>75</b>
対基準価額比率 (%)	1.19	1.19	1.17	1.26	1.27	1.29
当期の収益 (円)	75	49	50	48	46	40
当期の収益以外 (円)	—	25	24	26	28	34
翌期繰越分配対象額 (円)	337	312	288	263	234	200

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

### 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 80.96円	✓ 49.27円	✓ 50.55円	✓ 48.65円	✓ 46.12円	✓ 40.52円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	282.13	283.94	284.93	✓ 285.81	✓ 263.47	✓ 235.07
(d) 分配準備積立金	49.73	✓ 54.36	✓ 28.06	✓ 3.53	0.00	0.00
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	412.82	387.58	363.56	338.00	309.60	275.60
(f) 分配金	75.00	75.00	75.00	75.00	75.00	75.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	337.82	312.58	288.56	263.00	234.60	200.60

(注) ✓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

引き続き、UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンドとダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。通常の状態では、UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・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。

### ■UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド

米国経済は、トランプ大統領の政策運営をめぐる不透明感が懸念されるものの、旺盛な内需に支えられており、FRB（米国連邦準備制度理事会）は緩やかながらも着実なペースで利上げを進めています。欧州では、ユーロ圏の製造業PMI（購買担当者景気指数）が高水準で安定推移するなど、景気回復の兆しが顕在化しています。失業率は低下傾向にあり、今後、消費者信頼感を支えると思込まれます。ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を継続していることも、景気を後押しすると予想されます。一方、英国のEU（欧州連合）離脱をめぐる不透明感が企業景況感に与える影響などに留意しています。

スイス経済は、輸出産業が世界的な景気回復の恩恵を受けているほか、国内消費も引き続き堅調です。スイス・フランの動向は、スイス企業の業績にプラスに作用すると予想しています。また、企業景況感の改善傾向や企業の潤沢な手元資金を背景に、M&A（企業の合併・買収）の動きは継続すると予想されます。スイス株式市場は、バリュエーション、企業業績、配当成長の観点から引き続き魅力があると考えます。市場の悪材料に反応した調整局面も想定されますが、そうした調整局面は、長期的な視点から魅力的な銘柄を組み入れる好機になると捉えています。今後も、企業価値が株価に十分に反映されていない銘柄などに注目しながら、投資妙味の高い銘柄の組み入れに焦点を当てていく方針です。

スイス株式への投資に加えて、株式カバードコール戦略および通貨カバードコール戦略の活用により、オプションプレミアムの確保をめざします。株式カバードコール戦略ではスイス株価指数のコール・オプション（買う権利）の売りを、通貨カバードコール戦略では円に対するスイス・フランのコール・オプションの売りをを行います。いずれのオプションも、カバー率をファンドが保有するスイス・フラン建て資産の評価額に対して50%程度とすることにより、株式の値上がり益、スイス・フランの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざします。

■ダイワ・マネーアセット・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う方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第53期～第58期 (2018. 6. 19～2018. 12. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0. 659%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は6, 129円です。
（投信会社）	(13)	(0. 215)	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、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(26)	(0. 430)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(1)	(0. 013)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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＝当作成期中のその他費用／当作成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	41	0. 662	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券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。

## ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■売買および取引の状況

#### 投資信託受益証券

(2018年6月19日から2018年12月17日まで)

決算期	第 53 期 ～ 第 58 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国（邦貨建）	29,699.77134	1,820,243	61,069.51445	3,730,000

(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6月19日から2018年12月17日まで)

第 53 期 ～ 第 58 期							
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
				UBS (CAY) SWISS HIGH DIVIDEND EQUITY TWIN ALPHA FUND (ケイマン諸島)	61,069.51445	3,730,000	61

(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

当作成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	第 58 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) UBS (CAY) SWISS HIGH DIVIDEND EQUITY TWIN ALPHA FUND	485,985.79942	28,336,859	98.7

(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	第52期末	第 58 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	2,996	2,996	2,996

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2018年12月17日現在

項 目	第 58 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	28,336,859	97.2
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	2,996	0.0
コール・ローン等、その他	812,318	2.8
投資信託財産総額	29,152,174	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17日)、(2018年8月17日)、(2018年9月18日)、(2018年10月17日)、(2018年11月19日)、(2018年12月17日) 現在

項 目	第53期末	第54期末	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末
<b>(A) 資産</b>	<b>32,896,644,399円</b>	<b>32,740,033,912円</b>	<b>33,222,535,051円</b>	<b>30,416,519,256円</b>	<b>29,801,629,769円</b>	<b>29,152,174,270円</b>
コール・ローン等	831,333,886	883,805,205	973,431,269	635,187,523	827,726,063	812,318,172
投資信託受益証券(評価額)	32,062,313,209	31,853,231,703	32,246,107,077	29,778,335,028	28,970,907,301	28,336,859,992
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド(評価額)	2,997,304	2,997,004	2,996,705	2,996,705	2,996,405	2,996,106
<b>(B) 負債</b>	<b>516,237,085</b>	<b>454,989,902</b>	<b>585,173,616</b>	<b>553,752,154</b>	<b>476,603,785</b>	<b>435,531,959</b>
未払収益分配金	388,912,016	390,233,745	386,946,989	379,634,870	378,021,409	375,825,474
未払解約金	93,259,789	27,572,431	159,658,488	140,038,156	62,031,684	28,763,677
未払信託報酬	33,879,407	36,820,471	38,018,159	33,369,966	35,637,328	29,873,112
その他未払費用	185,873	363,255	549,980	709,162	913,364	1,069,696
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>32,380,407,314</b>	<b>32,285,044,010</b>	<b>32,637,361,435</b>	<b>29,862,767,102</b>	<b>29,325,025,984</b>	<b>28,716,642,311</b>
元本	51,854,935,490	52,031,166,103	51,592,931,966	50,617,982,758	50,402,854,640	50,110,063,325
次期繰越損益金	△ 19,474,528,176	△ 19,746,122,093	△ 18,955,570,531	△ 20,755,215,656	△ 21,077,828,656	△ 21,393,421,014
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>51,854,935,490口</b>	<b>52,031,166,103口</b>	<b>51,592,931,966口</b>	<b>50,617,982,758口</b>	<b>50,402,854,640口</b>	<b>50,110,063,325口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	6,244円	6,205円	6,326円	5,900円	5,818円	5,731円

\* 第52期末における元本額は52,112,634,580円、当作成期間(第53期～第58期)中における追加設定元本額は6,886,239,583円、同解約元本額は8,888,810,838円です。

\* 第58期末の計算口数当りの純資産額は5,731円です。

\* 第58期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は21,393,421,014円です。

■損益の状況

第53期 自2018年6月19日 至2018年7月17日 第55期 自2018年8月18日 至2018年9月18日 第57期 自2018年10月18日 至2018年11月19日  
 第54期 自2018年7月18日 至2018年8月17日 第56期 自2018年9月19日 至2018年10月17日 第58期 自2018年11月20日 至2018年12月17日

項 目	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>453,906,392円</b>	<b>293,438,689円</b>	<b>270,805,115円</b>	<b>279,838,567円</b>	<b>268,345,272円</b>	<b>233,132,663円</b>
受取配当金	453,908,365	293,449,247	270,835,311	279,871,626	268,360,582	233,146,171
受取利息	—	—	97	115	147	41
支払利息	△ 1,973	△ 10,558	△ 30,293	△ 33,174	△ 15,457	△ 13,549
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 179,118,520</b>	<b>△ 77,346,220</b>	<b>768,323,282</b>	<b>△ 2,016,154,246</b>	<b>△ 264,981,843</b>	<b>△ 269,291,226</b>
売買益	16,314,707	43,852	777,816,425	26,983,049	3,690,167	3,982,136
売買損	△ 195,433,227	△ 77,390,072	△ 9,493,143	△ 2,043,137,295	△ 268,672,010	△ 273,273,362
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 34,083,524</b>	<b>△ 37,034,429</b>	<b>△ 38,219,723</b>	<b>△ 33,543,924</b>	<b>△ 35,848,713</b>	<b>△ 30,056,409</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>240,704,348</b>	<b>179,058,040</b>	<b>1,000,908,674</b>	<b>△ 1,769,859,603</b>	<b>△ 32,485,284</b>	<b>△ 66,214,972</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 11,184,359,191</b>	<b>△ 11,100,026,618</b>	<b>△ 10,989,247,381</b>	<b>△ 9,929,211,609</b>	<b>△ 11,628,806,823</b>	<b>△ 11,593,502,921</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 8,141,961,317</b>	<b>△ 8,434,919,770</b>	<b>△ 8,580,284,835</b>	<b>△ 8,676,509,574</b>	<b>△ 9,038,515,140</b>	<b>△ 9,357,877,647</b>
(配当等相当額)	( 1,462,987,580)	( 1,477,380,388)	( 1,470,080,030)	( 1,446,750,171)	( 1,328,000,677)	( 1,177,987,205)
(売買損益相当額)	(△ 9,604,948,897)	(△ 9,912,300,158)	(△ 10,050,364,865)	(△ 10,123,259,745)	(△ 10,366,515,817)	(△ 10,535,864,852)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>△ 19,085,616,160</b>	<b>△ 19,355,888,348</b>	<b>△ 18,568,623,542</b>	<b>△ 20,375,580,786</b>	<b>△ 20,699,807,247</b>	<b>△ 21,017,595,540</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 388,912,016</b>	<b>△ 390,233,745</b>	<b>△ 386,946,989</b>	<b>△ 379,634,870</b>	<b>△ 378,021,409</b>	<b>△ 375,825,474</b>
次期繰越損益金(G+H)	△ 19,474,528,176	△ 19,746,122,093	△ 18,955,570,531	△ 20,755,215,656	△ 21,077,828,656	△ 21,393,421,014
追加信託差損益金	△ 8,141,961,317	△ 8,434,919,770	△ 8,580,284,835	△ 8,791,961,484	△ 9,184,040,101	△ 9,530,626,958
(配当等相当額)	( 1,462,987,580)	( 1,477,380,388)	( 1,470,080,030)	( 1,331,298,261)	( 1,182,475,716)	( 1,005,237,894)
(売買損益相当額)	(△ 9,604,948,897)	(△ 9,912,300,158)	(△ 10,050,364,865)	(△ 10,123,259,745)	(△ 10,366,515,817)	(△ 10,535,864,852)
分配準備積立金	288,791,766	149,036,302	18,692,126	—	—	—
繰越損益金	△ 11,621,358,625	△ 11,460,238,625	△ 10,393,977,822	△ 11,963,254,172	△ 11,893,788,555	△ 11,862,794,056

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

## ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期
(a) 経費控除後の配当等収益	419,822,849円	256,404,183円	260,844,888円	246,294,482円	232,496,448円	203,076,163円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	1,462,987,580	1,477,380,388	1,470,080,030	1,446,750,171	1,328,000,677	1,177,987,205
(d) 分配準備積立金	257,880,933	282,865,864	144,794,227	17,888,478	0	0
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,140,691,362	2,016,650,435	1,875,719,145	1,710,933,131	1,560,497,125	1,381,063,368
(f) 分配金	388,912,016	390,233,745	386,946,989	379,634,870	378,021,409	375,825,474
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,751,779,346	1,626,416,690	1,488,772,156	1,331,298,261	1,182,475,716	1,005,237,894
(h) 受益権総口数	51,854,935,490口	52,031,166,103口	51,592,931,966口	50,617,982,758口	50,402,854,640口	50,110,063,325口

### 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期
	75円	75円	75円	75円	75円	75円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

#### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税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。

UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・  
ツイン・アルファ・ファンド

当ファンド（ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型））の主要投資対象である、ケイマン籍の外国投資信託「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」の受益証券（円建）の状況は次の通りです。

（注）2018年12月17日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

財政状態計算書

2017年11月30日

資産

流動資産

金融資産（損益通算後の評価額）	¥	34,032,451,577
現金および現金同等物		621,694,601
担保としてブローカーが保有する現金		395,448,169
未収：		
売却済み証券		13,650,579
資産合計		<u>35,063,244,926</u>

負債

流動負債

金融負債（損益通算後の評価額）		448,588,570
保管会社に対する支払		736,695
未払：		
購入済み証券		14,000,986
運用会社報酬		163,890,936
管理会社報酬		16,821,683
保管会社報酬		5,770,040
専門家報酬		5,347,914
名義書換代理人報酬		2,304,428
受託会社報酬		2,062,112
負債（償却可能受益証券の保有者に帰属する純資産を除く）		<u>659,523,364</u>
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	¥	<u>34,403,721,562</u>

包括利益計算書

2017年11月30日に終了した年度

収益

受取利息、配当収益、金融資産および負債の純実現損益・  
評価損益の純変動（損益通算および外国為替取引による評価額） ￥ 6,545,476,154

費用

運用会社報酬	182,749,847
管理会社報酬	25,606,104
取引費用	11,637,553
支払利息	10,207,957
保管会社報酬	9,353,894
専門家報酬	4,860,803
名義書換代理人報酬	3,435,571
受託会社報酬	3,045,831
登録料	10,019
その他費用	29,491
費用合計	<u>250,937,070</u>

営業利益

6,294,539,084

金融費用

償却可能受益証券の保有者への分配 (5,158,563,432)

分配後および税引前利益

1,135,975,652

源泉徴収税 (225,995,268)

運用の結果生じた償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産の増加額 ￥ 909,980,384

投資明細  
2017年11月30日

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合(%)	評価額
	<b>普通株 (98.9%)</b>		
	アイルランド (1.0%)		
	医薬品 (1.0%)		
21,685	COSMO Pharmaceuticals NV	1.0	¥ 342,517,489
	<b>アイルランド合計</b>		<u>342,517,489</u>
	<b>スイス (97.9%)</b>		
	広告 (1.7%)		
59,609	DKSH Holding AG	1.7	572,663,503
	<b>銀行 (10.2%)</b>		
8,394	Banque Cantonale Vaudoise	2.1	720,317,615
1,177,598	UBS Group AG*	6.6	2,280,082,350
40,644	Valiant Holding AG	1.5	495,610,290
			<u>3,496,010,255</u>
	<b>化学 (6.6%)</b>		
7,758	EMS-Chemie Holding AG	1.7	579,980,923
6,645	Givaudan SA	4.9	1,694,787,148
			<u>2,274,768,071</u>
	<b>商業サービス (3.6%)</b>		
4,536	SGS SA	3.6	1,257,177,822
	<b>総合金融サービス (5.2%)</b>		
89,306	Cembra Money Bank AG	2.6	903,252,337
262,206	GAM Holding AG	1.4	466,151,749
63,606	Vontobel Holding AG	1.2	430,933,283
			<u>1,800,337,369</u>
	<b>電子部品 (2.3%)</b>		
18,536	Burkhalter Holding AG	0.7	254,121,695
27,556	Daetwyler Holding AG	1.6	555,211,600
			<u>809,333,295</u>
	<b>食品 (9.4%)</b>		
338,468	Nestle SA	9.4	3,249,732,541
	<b>ヘルスケア製品 (4.5%)</b>		
33,902	Lonza Group AG	2.9	993,316,136
31,466	Sonova Holding AG	1.6	561,915,005
			<u>1,555,231,141</u>
	<b>保険 (9.2%)</b>		
23,130	Swiss Life Holding AG	2.5	870,387,802
67,369	Zurich Insurance Group AG	6.7	2,281,754,945
			<u>3,152,142,747</u>
	<b>建設・採掘機械 (5.5%)</b>		
654,886	ABB, Ltd.	5.5	1,879,983,200

ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合(%)	評価額
	<b>総合機械 (3.2%)</b>		
7,152	Inficon Holding AG	1.4	476,807,926
345,168	OC Oerlikon Corp. AG	1.8	629,376,616
			<u>1,106,184,542</u>
	<b>金属製品 (1.4%)</b>		
37,552	SFS Group AG	1.4	484,439,552
	<b>医薬品 (19.6%)</b>		
27,132	Idorsia, Ltd.	0.2	65,396,164
347,648	Novartis AG	9.7	3,335,891,534
117,815	Roche Holding AG	9.7	3,332,440,924
			<u>6,733,728,622</u>
	<b>不動産 (0.5%)</b>		
24,816	Investis Holding SA	0.5	172,371,549
	<b>小売 (5.8%)</b>		
161,927	Cie Financiere Richemont SA	4.6	1,563,013,664
78,275	Galenica AG	1.2	425,947,964
			<u>1,988,961,628</u>
	<b>通信 (6.6%)</b>		
152,316	Ascom Holding AG	1.2	407,918,576
77,602	Sunrise Communications Group AG	2.3	788,856,236
17,954	Swisscom AG	3.1	1,061,912,354
			<u>2,258,687,166</u>
	<b>運輸 (2.6%)</b>		
45,610	Kuehne + Nagel International AG	2.6	898,181,085
	<b>スイス合計</b>		<u>33,689,934,088</u>
	<b>普通株合計 (簿価 ¥29,728,571,966)</b>		<u>¥ 34,032,451,577</u>

2017年11月30日現在の売建オプション残高（純資産の-1.3%）

明細	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - OTC Swiss Franc versus Japanese Yen	¥ 113	2017/12/15	141,000,000	¥ (108,299,715)	¥ (156,219,349)
Call - SMI Index Option	9,184	2017/12/15	15,400	(167,769,523)	(292,369,221)
				<u>¥ (276,069,238)</u>	<u>¥ (448,588,570)</u>

\* 利害関係人

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2018年12月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの第58期の決算日（2018年12月17日）現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンドの組入資産の内容等を18ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄

公 社 債

(2018年6月19日から2018年12月17日まで)

買 付		売 付		
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額	
	千円		千円	
757 国庫短期証券 2018/8/13	50,000			
731 国庫短期証券 2018/7/10	40,000			

(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12月17日現在、有価証券等の組み入れはありません。

# ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## 運用報告書 第7期（決算日 2018年12月10日）

（作成対象期間 2017年12月12日～2018年12月10日）

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの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いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

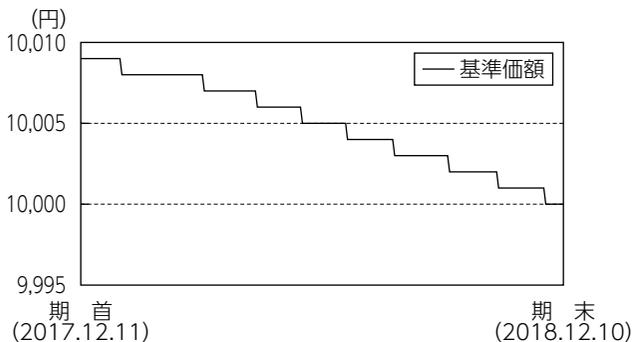
## 大和投資信託

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/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2017年12月11日	円	%	%
	10,009	-	-
12月末	10,009	0.0	-
2018年 1 月末	10,008	△0.0	-
2 月末	10,008	△0.0	0.5
3 月末	10,007	△0.0	-
4 月末	10,006	△0.0	-
5 月末	10,005	△0.0	-
6 月末	10,005	△0.0	-
7 月末	10,004	△0.0	-
8 月末	10,003	△0.1	-
9 月末	10,002	△0.1	-
10 月末	10,001	△0.1	-
11 月末	10,000	△0.1	-
(期末)2018年12月10日	10,000	△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：10,009円 期末：10,000円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

マイナス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

当作成期首より、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持し、2018年7月には金融緩和継続のための枠組み強化を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前作成期末における「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す。

◆ポートフォリオについて

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

◆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う方針です。

■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 (その他)	4 (4)
合 計	4

(注1) 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) 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

(2017年12月12日から2018年12月10日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国債証券	180,001	(180,000)

(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、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

(2017年12月12日から2018年12月10日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄	銘	柄
	金 額		金 額
	千円		千円
723	国庫短期証券 2018/3/5		90,000
757	国庫短期証券 2018/8/13		50,000
731	国庫短期証券 2018/7/10		40,000

(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。

# ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## ■組入資産明細表

当作成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

2018年12月10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	9,019,491	100.0
投資信託財産総額	9,019,491	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12月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,019,491,424円
コール・ローン等	9,019,491,424
(B) 負債	745,957
その他未払費用	745,957
(C) 純資産総額(A - B)	9,018,745,467
元本	9,018,625,641
次期繰越損益金	119,826
(D) 受益権総口数	9,018,625,641口
1万口当り基準価額(C/D)	10,000円

\* 期首における元本額は17,399,953,390円、当作成期間中における追加設定元本額は2,846,717,287円、同解約元本額は11,228,045,036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、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし) 999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αフットプレミアム(毎月分配型) 219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αフットプレミアム(年2回決算型) 24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型) 848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型) 66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジあり) 6,592,748円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジなし) 10,288,683円、ダイワ/バリュー・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド10,000円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型) 4,995円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型) 4,995円、ダイワ・ブラジル・レアル債α(毎月分配型) - スーパー・ハイインカム - α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α(毎月分配型) - スーパー・ハイインカム - α100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ14,873,813円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 3 - 858,588,190円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 6 - 2,475,152,803円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 7 - 828,595,357円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 4 - 1,078,808,907円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 5 - 2,095,808,384円、ダイワ円債セレクト マネーコース1,605,380,447円、ダイワ・スイス高配当株ツインα(毎月分配型) 2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 為替ヘッジなしコース1,490,665円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 日本円コース497,633円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) ブラジル・レアル・コース994,307円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 通貨セレクト・コース397,742円、ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型) 為替ヘッジあり40,885円、ダイワ世界インカム・ハンター(年2回決算型) 為替ヘッジなし100,789円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型) 1,235円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎月分配型) 1,598円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース(毎月分配型) 1,544円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファ

ンド 通貨セレクトコース(毎月分配型) 1,984円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,000円です。

## ■損益の状況

当期 自2017年12月12日 至2018年12月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,977,479円
受取利息	2,652
支払利息	△ 5,980,131
(B) その他費用	△ 4,966,849
(C) 当期損益金(A + B)	△ 10,944,328
(D) 前期繰越損益金	15,761,364
(E) 解約差損益金	△ 5,797,371
(F) 追加信託差損益金	1,100,161
(G) 合計(C + D + E + F)	119,826
次期繰越損益金(G)	119,826

(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。