

US短期高利回り社債ファンド (為替ヘッジあり／年1回決算型)

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2019年7月5日)

(作成対象期間 2018年7月6日～2019年7月5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／債券	
信託期間	約14年7カ月間(2013年12月9日～2028年7月5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・トラストーダイワ／プリンシパル・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円ヘッジ／N1クラス)」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	円建ての債券
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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、配当等収益が少額の場合には、分配を行な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、米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、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)

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

最近5期の運用実績

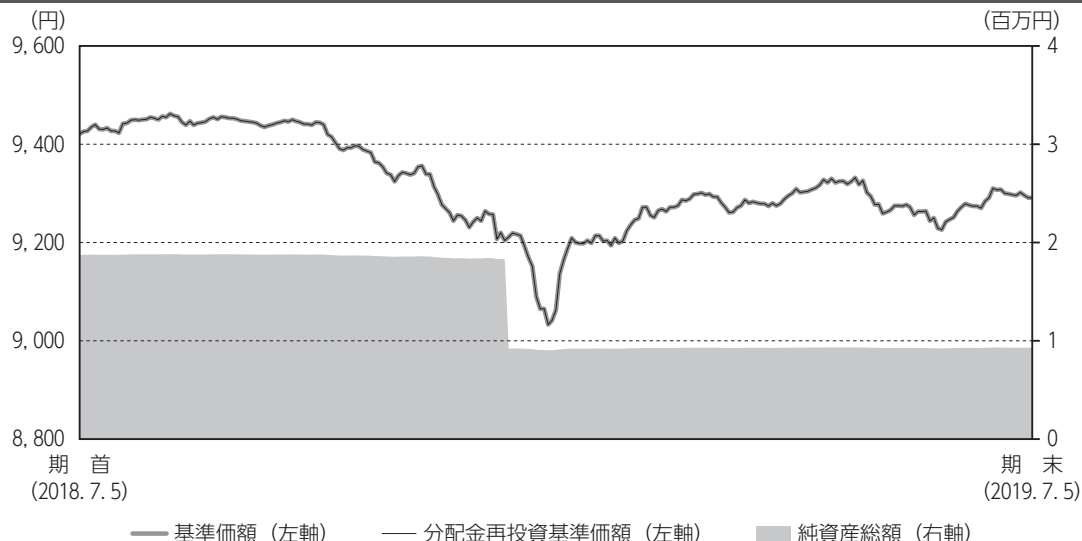
決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
2 期末(2015年 7 月 6 日)	9,861	0	△ 2.5	0.1	99.3	4
3 期末(2016年 7 月 5 日)	9,432	0	△ 4.4	0.0	99.3	4
4 期末(2017年 7 月 5 日)	9,708	0	2.9	0.0	99.8	4
5 期末(2018年 7 月 5 日)	9,421	0	△ 3.0	—	98.4	1
6 期末(2019年 7 月 5 日)	9,291	0	△ 1.4	—	99.5	0

(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



* 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

期 首：9,421円

期 末：9,291円（分配金 0 円）

騰落率：△1.4%（分配金込み）

基準価額の変動要因

U S ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N 1 クラス）を通じて、米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、米ドル建ての資産に対して米ドル売り／日本円買いの為替ヘッジを行った結果、投資している短期ハイ・イールド社債の上昇などはプラスに寄与しましたが、ファンド運用に関連する費用の影響などから、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。

※U S ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N 1 クラス）：ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ／プリンシパル・U S ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N 1 クラス）

US 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

年 月 日	基 準	価 額	公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率		
	円	%	%	%
(期首)2018年7月5日	9,421	—	—	98.4
7月末	9,451	0.3	—	98.5
8月末	9,451	0.3	—	98.6
9月末	9,441	0.2	—	98.6
10月末	9,324	△ 1.0	—	98.7
11月末	9,250	△ 1.8	—	98.8
12月末	9,041	△ 4.0	—	98.8
2019年1月末	9,224	△ 2.1	—	99.0
2月末	9,301	△ 1.3	—	99.1
3月末	9,279	△ 1.5	—	99.2
4月末	9,318	△ 1.1	—	99.2
5月末	9,250	△ 1.8	—	99.4
6月末	9,297	△ 1.3	—	99.5
(期末)2019年7月5日	9,291	△ 1.4	—	99.5

(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. 7. 6 ～ 2019. 7. 5）

■米国ハイ・イールド社債市況

米国ハイ・イールド社債市況は上昇しました。

米国ハイ・イールド社債市況は、当作成期首から2018年 9 月にかけては、米国経済が好調さを維持し企業決算も総じて好調な内容となる中、緩やかな上昇基調となりました。10月以降は、世界経済の減速懸念や英国のEU（欧州連合）離脱問題、米国の利上げ路線継続への警戒感などを背景に市場のリスク回避姿勢が高まり、年末にかけて下落基調となりました。2019年に入ると、FRB（米国連邦準備制度理事会）のハト派路線への転換を好感して株式市場が上昇相場となり、米国債券市場では利回りが低下基調となる中、4 月にかけて力強い上昇を見せました。5 月に入ると、米中貿易摩擦の激化やそれに伴う世界経済減速への懸念感からスプレッド（米国国債との利回り格差）が拡大し一時的に軟調な展開となったものの、6 月には米国の利下げ観測の高まりや米中貿易協議再開への期待感などから持ち直しの動きとなり、当作成期を通してはプラスのリターンとなりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N1 クラス）への投資割合を高位に保つことによって、米国の短期ハイ・イールド社債等（※）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います。

■US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N1 クラス）

米国の短期ハイ・イールド社債等（※）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います。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネースtock・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。

※短期ハイ・イールド社債およびバンクローン（貸付債権）をいいます。

ポートフォリオについて

（2018.7.6～2019.7.5）

■当ファンド

当ファンドは、US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N1クラス）とダイワ・マネースtock・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、当作成期を通じてUS・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N1クラス）への投資割合を高位に維持しました。

■US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N1クラス）

米国の短期ハイ・イールド社債に投資し、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いました。業種別では、循環消費財セクターや非循環消費財セクター、通信セクターなどに対する組み入れを他のセクターに比べて高めの水準としました。また、米国のバンクローンにも投資を行いました。

為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・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。

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を行ないませんでした。
 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（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2018年7月6日 ～2019年7月5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）	34

- （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

U S ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N1クラス）への投資割合を高位に保つことによって、米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、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います。

■U S ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N1クラス）

米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、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います。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネースtock・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。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2018. 7. 6～2019. 7. 5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	109円	1. 166%	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9, 317円です。
(投 信 会 社)	(40)	(0. 432)	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)	(65)	(0. 702)	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)	(3)	(0. 032)	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	3	0. 028	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)	(3)	(0. 028)	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	111	1. 194	

(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。

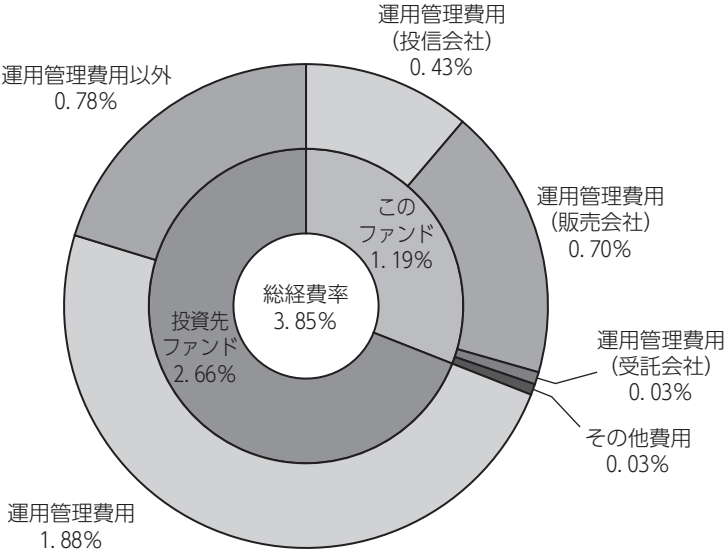
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は3.85%です。



総経費率（①＋②＋③）	3.85%
①このファンドの費用の比率	1.19%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	1.88%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.78%

(注1) ①の費用は、1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
(注3) 各比率は、年率換算した値です。
(注4) 投資先ファンドとは、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。）です。
(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

US 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2018年7月6日から2019年7月5日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	—	—	9.20227	900

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 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7月6日から2019年7月5日まで)

当 期				期 付			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
				US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED N1 CLASS (ケイマン諸島)	9.20227	900	97

(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

(1)当ファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成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・マネースtock・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2018年7月6日から2019年7月5日まで)

区 分	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
公社債	百万円 600	百万円 250	% 41.7	百万円 —	百万円 —	% —
コール・ローン	10,485,229	—	—	—	—	—

(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
ンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3)当作成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

当作成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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券
です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み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
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED N1 CLASS	9. 30493	924	99. 5

(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
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	1	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	924	98. 9
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	1	0. 2
コール・ローン等、その他	8	0. 9
投資信託財産総額	934	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

2019年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	934, 427円
コール・ローン等	8, 274
投資信託受益証券 (評価額)	924, 156
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド (評価額)	1, 997
(B) 負債	5, 372
未払信託報酬	5, 191
その他未払費用	181
(C) 純資産総額 (A－B)	929, 055
元本	1, 000, 000
次期繰越損益金	△ 70, 945
(D) 受益権総口数	1, 000, 000口
1 万口当り基準価額 (C／D)	9, 291円

* 期首における元本額は1, 988, 533円、当作成期間中における追加設定元本額は0
円、同解約元本額は988, 533円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は9, 291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70, 945円です。

■損益の状況

当期 自 2018年7月6日 至 2019年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3円
支払利息	△ 3
(B) 有価証券売買損益	2, 683
売買益	16, 782
売買損	△ 14, 099
(C) 信託報酬等	△ 15, 775
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	△ 13, 095
(E) 前期繰越損益金	△ 66, 331
(F) 追加信託差損益金 (売買損益相当額)	8, 481 (8, 481)
(G) 合計 (D＋E＋F)	△ 70, 945
次期繰越損益金 (G)	△ 70, 945
追加信託差損益金 (売買損益相当額)	8, 481 (8, 481)
分配準備積立金	3, 463
繰越損益金	△ 82, 889

(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。

US 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	3,463
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	3,463
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	3,463
(h) 受益権総口数	1,000,000口

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。

ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ／プリンシパル・
U S ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N 1 クラス）

当ファンド（U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1 回決算型））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・トラストーダイワ／プリンシパル・U S ・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジ／N 1 クラス）」に投資しておりますが、以下の内容はすべてのクラスを合算しております。

（注）2019年7月5日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（米ドル建て）

貸借対照表
2018年6月29日

資産		
投資資産の評価額（簿価 \$7, 341, 350）	\$	7, 269, 220
現金		183
外国為替先渡契約による評価益		49
未収：		
売却済みの投資資産		195
利息		76, 438
資産合計		7, 346, 085
負債		
外国為替先渡契約による評価損		68, 350
未払：		
購入済みの投資資産		55, 067
解約済み受益証券		13, 542
専門家報酬		54, 849
会計および管理会社報酬		7, 450
保管会社報酬		7, 214
運用会社報酬		5, 841
登録料		810
名義書換代理人報酬		410
負債合計		213, 533
純資産	\$	7, 132, 552
純資産		
円ヘッジクラス	\$	6, 068, 564
円ヘッジ／N 1 クラス		1, 063, 988
	\$	7, 132, 552
発行済み受益証券		
円ヘッジクラス		8, 120, 592
円ヘッジ／N 1 クラス		1, 181, 855
受益証券1 口当り純資産額		
円ヘッジクラス	\$	0. 747
円ヘッジ／N 1 クラス	\$	0. 900

U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

損益計算書

2018年6月29日に終了する年度

投資収益		
受取利息	\$	344,762
投資収益合計		344,762
費用		
専門家報酬		55,109
会計および管理会社報酬		45,000
保管会社報酬		39,386
運用会社報酬		34,494
受託会社報酬		22,949
名義書換代理人報酬		3,241
登録料		2,662
費用合計		202,841
投資純利益		141,921
実現益（損）および評価益（損）：		
実現益（損）：		
証券投資		7,352
外国為替取引および外国為替先渡契約		(163,375)
純実現損		(156,023)
評価益（損）の純変動：		
証券投資		(108,510)
外国為替換算および外国為替先渡契約		117,717
評価益（損）の純変動		9,207
実現益（損）および評価益（損）の純変動		(146,816)
運用による純資産の純減	\$	(4,895)

U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

投資明細表 2018年6月29日

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
		債券 (98.3%)		
		カナダ (4.8%)		
		バンクローン (1.7%)		
U S D	79,600	MacDonald, Dettwiler and Associates Ltd. 4.85% due 2024/10/4	\$	79,401
U S D	40,000	Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 4.98% due 2025/6/2		39,917
		バンクローン合計		119,318
		社債 (3.1%)		
U S D	85,000	Bombardier, Inc. 8.75% due 2021/12/1 (a)		93,500
U S D	35,000	First Quantum Minerals Ltd. 7.00% due 2021/2/15 (a), (b)		35,350
U S D	70,000	NOVA Chemicals Corp. 5.25% due 2023/8/1 (a), (b)		69,825
U S D	25,000	Teck Resources Ltd. 3.75% due 2023/2/1 (b)		23,719
		社債合計		222,394
		カナダ合計 (簿価 \$341,522)		341,712
		ルクセンブルク (6.0%)		
		バンクローン (1.7%)		
U S D	118,500	JBS USA Lux S. A. 4.83% due 2022/10/30		117,759
		バンクローン合計		117,759
		社債 (4.3%)		
U S D	140,000	ArcelorMittal 5.50% due 2021/3/1		145,880
U S D	70,000	Intelsat Jackson Holdings S. A. 8.00% due 2024/2/15 (a), (b)		73,500
U S D	90,000	Mallinckrodt International Finance S. A. / Mallinckrodt CB LLC 4.88% due 2020/4/15 (a), (b)		88,425
		社債合計		307,805
		ルクセンブルク合計 (簿価 \$429,232)		425,564
		オランダ (0.0%)		
		社債 (0.0%)		
U S D	5,000	OI European Group BV 4.00% due 2023/3/15 (a), (b)		4,663
		社債合計		4,663
		オランダ合計 (簿価 \$5,000)		4,663
		米国 (87.5%)		
		バンクローン (18.2%)		
U S D	66,621	Acadia Healthcare Company, Inc. 4.59% due 2023/2/16		66,906
U S D	5,000	Apergy Corp. 4.56% due 2025/5/9		5,013

U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年 1 回決算型）

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D	51, 183	Asurion LLC 4. 84% due 2023/11/3		51, 174
U S D	91, 552	B&G Foods, Inc. 4. 09% due 2022/11/2		91, 709
U S D	35, 000	California Resources Corp. 6. 84% due 2022/12/31		35, 711
U S D	29, 625	Caraustar Industries, Inc. 7. 83% due 2022/3/14		29, 839
U S D	95, 115	CCM Merger, Inc. 4. 84% due 2021/8/6		95, 333
U S D	40, 000	CSC Holdings LLC 4. 57% due 2026/1/25		39, 933
U S D	155, 544	DaVita, Inc. 4. 84% due 2021/6/24		156, 142
U S D	39, 391	DJO Finance LLC 5. 45% due 2020/6/8		39, 293
U S D	30, 000	Energizer Holdings, Inc. 0. 00% due 2025/6/20 (c)		30, 038
U S D	4, 988	Filtration Group Corp. 5. 09% due 2025/3/29		4, 994
U S D	117, 512	First Data Corp. 4. 09% due 2022/7/8		117, 144
U S D	24, 938	Genworth Holdings, Inc. 6. 55% due 2023/3/7		25, 436
U S D	4, 950	Golden Nugget, Inc. 4. 82% due 2023/10/4		4, 952
U S D	20, 000	Hub International Ltd. 5. 36% due 2025/4/25		19, 902
U S D	4, 988	IRB Holding Corp. 5. 27% due 2025/2/5		5, 002
U S D	90, 573	iStar, Inc. 5. 01% due 2023/6/28		90, 573
U S D	24, 750	Kinetic Concepts, Inc. 5. 58% due 2024/2/2		24, 816
U S D	69, 825	Lions Gate Capital Holdings LLC 4. 34% due 2025/3/24		69, 709
U S D	73, 105	Michaels Stores, Inc. 4. 58% due 2023/1/30		72, 648
U S D	74, 362	Post Holdings, Inc. 4. 10% due 2024/5/24		74, 026
U S D	10, 614	Prestige Brands, Inc. 4. 09% due 2024/1/26		10, 598
U S D	9, 875	Prime Security Services Borrower LLC 4. 84% due 2022/5/2		9, 840
U S D	93, 275	Russell Investments US Institutional Holdco, Inc. 5. 34% due 2023/6/1		93, 881
U S D	9, 962	Transdigm, Inc. 4. 59% due 2024/8/22 (c)		9, 904

U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1 回決算型）

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D	26, 325	West Corp. 6. 09% due 2024/10/10		26, 269
		バンクローン合計		1, 300, 785
		社債 (69. 3%)		
U S D	75, 000	ADT Corp. 6. 25% due 2021/10/15		77, 625
U S D	7, 704	Air 2 US 8. 03% due 2019/10/1 (a)		8, 089
U S D	100, 000	Aircastle Ltd. 5. 13% due 2021/3/15		102, 125
U S D	75, 000	AK Steel Corp. 7. 63% due 2021/10/1 (b)		76, 477
U S D	80, 000	Ally Financial, Inc. 4. 25% due 2021/4/15		80, 000
U S D	35, 000	AMC Networks, Inc. 4. 75% due 2022/12/15 (b)		35, 044
U S D	151, 651	American Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5. 63% due 2021/1/15 (a)		154, 305
U S D	75, 000	Anixter, Inc. 5. 13% due 2021/10/1		76, 312
U S D	25, 000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp. 10. 00% due 2022/4/1 (a), (b)		27, 500
U S D	150, 000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp. 5. 25% due 2022/9/30 (b)		150, 469
U S D	110, 000	Centene Corp. 5. 63% due 2021/2/15 (b)		112, 324
U S D	105, 000	CF Industries, Inc. 7. 13% due 2020/5/1		110, 906
U S D	47, 000	Chesapeake Energy Corp. 8. 00% due 2022/12/15 (a), (b)		49, 336
U S D	70, 000	CIT Group, Inc. 4. 13% due 2021/3/9 (b)		69, 562
U S D	35, 000	Clean Harbors, Inc. 5. 13% due 2021/6/1 (b)		35, 131
U S D	10, 000	Cleveland-Cliffs, Inc. 4. 88% due 2024/1/15 (a), (b)		9, 650
U S D	30, 000	Cloud Crane LLC 10. 13% due 2024/8/1 (a), (b)		32, 250
U S D	90, 000	CNO Financial Group, Inc. 4. 50% due 2020/5/30		89, 887
U S D	55, 000	Credit Acceptance Corp. 7. 38% due 2023/3/15 (b)		56, 787
U S D	55, 000	DAE Funding LLC 4. 50% due 2022/8/1 (a), (b)		53, 350
U S D	100, 000	DCP Midstream Operating LP 9. 75% due 2019/3/15 (a)		104, 125
U S D	110, 000	Dell International LLC / EMC Corp. 5. 88% due 2021/6/15 (a), (b)		111, 498

US 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
USD	190,000	DISH DBS Corp. 5.13% due 2020/5/1		188,100
USD	50,000	EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance, Inc.		51,125
USD	110,000	7.75% due 2026/5/15 (a), (b)		90,200
		9.38% due 2024/5/1 (a), (b)		
USD	35,000	Frontier Communications Corp. 7.13% due 2019/3/15		35,262
USD	115,000	GLP Capital LP / GLP Financing II, Inc. 4.38% due 2021/4/15		115,000
USD	90,000	HCA Healthcare, Inc. 6.25% due 2021/2/15		93,375
USD	205,000	HCA, Inc. 3.75% due 2019/3/15		205,769
USD	65,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp. 5.88% due 2022/2/1 (b)		65,081
USD	10,000	6.25% due 2022/2/1 (b)		10,200
USD	100,000	ILFC E-Capital Trust II 4.82% due 2065/12/21 (a), (b), (d)		92,500
USD	50,828	Indiantown Cogeneration LP 9.77% due 2020/12/15		55,052
USD	100,000	Iron Mountain, Inc. 4.38% due 2021/6/1 (a), (b)		99,844
USD	55,000	Jack Ohio Finance LLC / Jack Ohio Finance 1 Corp. 6.75% due 2021/11/15 (a), (b)		56,650
USD	130,000	KB Home 7.00% due 2021/12/15 (b)		136,500
USD	75,000	L Brands, Inc. 5.63% due 2022/2/15		76,125
USD	90,000	Lennar Corp. 4.13% due 2018/12/1 (b)		90,045
USD	35,000	MasTec, Inc. 4.88% due 2023/3/15 (b)		33,885
USD	105,000	MGM Resorts International 6.63% due 2021/12/15		110,644
USD	11,000	NCL Corp. Ltd. 4.75% due 2021/12/15 (a), (b)		10,972
USD	110,000	Netflix, Inc. 5.38% due 2021/2/1		113,058
USD	75,000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp. 6.88% due 2021/10/15 (b)		75,937
USD	35,000	PHI, Inc. 5.25% due 2019/3/15 (b)		34,213
		Reynolds Group Issuer, Inc. / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu		
USD	29,073	5.75% due 2020/10/15 (b)		29,182
USD	100,000	5.85% due 2021/7/15 (a), (b), (d)		100,930
USD	35,000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp. 5.00% due 2021/4/15 (b)		35,088

U S 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1 回決算型）

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D	65, 000	Sanmina Corp. 4. 38% due 2019/6/1 (a)		65, 000
U S D	65, 000	Service Corp. International 8. 00% due 2021/11/15		72, 313
U S D	110, 000	Sprint Capital Corp. 6. 90% due 2019/5/1		112, 222
U S D	175, 000	Sprint Communications, Inc. 7. 00% due 2020/8/15		181, 125
U S D	75, 000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp. 4. 88% due 2023/1/15 (a), (b)		72, 000
U S D	55, 000	Tenet Healthcare Corp. 6. 00% due 2020/10/1		56, 513
U S D	10, 000	7. 50% due 2022/1/1 (a), (b)		10, 400
U S D	110, 000	T-Mobile USA, Inc. 4. 00% due 2022/4/15 (b)		108, 878
U S D	55, 000	TRI Pointe Group, Inc. 4. 88% due 2021/7/1 (b)		55, 344
U S D	80, 000	Triumph Group, Inc. 5. 25% due 2022/6/1 (b)		77, 000
U S D	75, 000	Universal Hospital Services, Inc. 7. 63% due 2020/8/15 (b)		74, 813
U S D	135, 000	Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 6. 75% due 2021/8/15 (a), (b)		136, 519
U S D	30, 000	Weatherford International Ltd. 4. 50% due 2022/4/15 (b)		27, 536
U S D	15, 000	Whiting Petroleum Corp. 5. 75% due 2021/3/15 (b)		15, 330
U S D	25, 000	Williams Scotsman International, Inc. 7. 88% due 2022/12/15 (a), (b)		25, 875
U S D	225, 000	Yum! Brands, Inc. 3. 88% due 2020/11/1 (b)		222, 188
		社債合計		4, 940, 545
		米国合計（簿価 \$6, 309, 645）		6, 241, 330
		債券合計（簿価 \$7, 085, 399）		\$ 7, 013, 269
		短期投資（3. 6%）		
		ケイマン諸島（0. 0%）		
		定期預金（0. 0%）		
J P Y	330, 049	Brown Brothers Harriman & Co. —0. 22%* due 2018/7/2		2, 980
		定期預金合計		2, 980
		ケイマン諸島合計（簿価 \$2, 980）		2, 980
		米国（3. 6%）		
		定期預金（3. 6%）		
U S D	252, 971	JPMorgan Chase & Co. 1. 17% due 2018/7/2		252, 971
		定期預金合計		252, 971
		米国合計（簿価 \$252, 971）		252, 971
		短期投資合計（簿価 \$255, 951）		255, 951

US 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	投資総額（簿価 \$7,341,350）	101.9%	\$ 7,269,220
	現金および他の資産を超過する負債	(1.9)	(136,668)
	純資産	100.0%	\$ 7,132,552

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最良の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

- ＊日本の中央銀行による預金金利引き下げのため、日本円建ての短期投資の金利はゼロ％未満である可能性があります。
- (a) 144A証券－1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関投資家への転売が可能です。他に記載がない限り、これらの証券は流動性がないとはみなされません。
- (b) 期前償還条項付き証券。
- (c) このポジションの全部または一部は、期末の未決済のローンコミットメントを表しています。この購入に関連する詳細（クーポンレートを含む）については、決済日以前には分かりません。
- (d) 2018年6月29日時点の変動金利証券。

2018年6月29日現在の円ヘッジクラスの外国為替先渡契約（純資産の－0.8％）：

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
J P Y	Barclays Bank Plc	685,053,796	2018/7/19	U S D	6,249,521	\$ -	\$ (58,078)	\$ (58,078)
U S D	Barclays Bank Plc	123,954	2018/7/19	J P Y	13,715,733	-	(7)	(7)
						\$ -	\$ (58,085)	\$ (58,085)

2018年6月29日現在の円ヘッジ／N1クラスの外国為替先渡契約（純資産の－0.1％）：

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
J P Y	Barclays Bank Plc	1,500,000	2018/7/3	U S D	13,591	\$ -	\$ (49)	\$ (49)
J P Y	Barclays Bank Plc	120,508,905	2018/7/19	U S D	1,099,363	-	(10,216)	(10,216)
U S D	Barclays Bank Plc	13,605	2018/7/19	J P Y	1,500,000	49	-	49
						\$ 49	\$ (10,265)	\$ (10,216)

通貨の略称：

- J P Y - 日本円
- U S D - 米ドル

＜補足情報＞

当ファンド（US 短期高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり／年 1 回決算型））が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・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、当ファンドの決算日（2019年 7 月 5 日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を20ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2018年 7 月 6 日から2019年 7 月 5 日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
801 国庫短期証券 2019/3/18	250,003		
757 国庫短期証券 2018/8/13	200,001		
731 国庫短期証券 2018/7/10	150,000		

（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

2019年 7 月 5 日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第9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・マネースtock・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ないます。
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

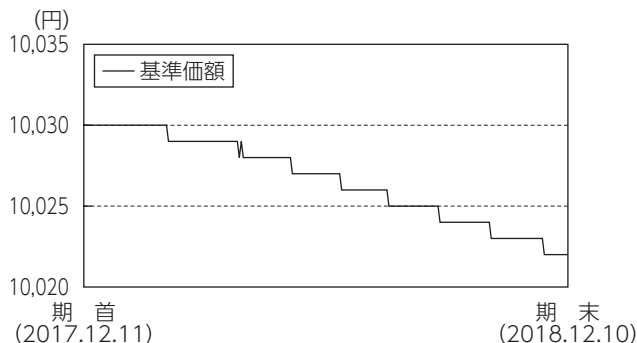
大和投資信託

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 率
	騰 落 率	組 入 比	
(期首)2017年12月11日	円	%	%
	10,030	—	—
12月末	10,030	0.0	—
2018年 1 月末	10,030	0.0	—
2 月末	10,029	△0.0	0.5
3 月末	10,029	△0.0	—
4 月末	10,028	△0.0	—
5 月末	10,027	△0.0	—
6 月末	10,026	△0.0	—
7 月末	10,025	△0.0	—
8 月末	10,025	△0.0	—
9 月末	10,024	△0.1	—
10月末	10,023	△0.1	—
11月末	10,022	△0.1	—
(期末)2018年12月10日	10,022	△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なっており、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：10,030円 期末：10,022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」

流動性及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

流動性及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》

流動性及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	570,003	— (570,000)

(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。

■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		220,001
757	国庫短期証券 2018/8/13		200,001
731	国庫短期証券 2018/7/10		150,000

(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

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	41,081,960	100.0
投資信託財産総額	41,081,960	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	41,081,960,031円
コール・ローン等	41,081,960,031
(B) 負債	22,652,366
未払解約金	20,000,000
その他未払費用	2,652,366
(C) 純資産総額(A－B)	41,059,307,665
元本	40,969,233,796
次期繰越損益金	90,073,869
(D) 受益権総口数	40,969,233,796口
1万口当り基準価額(C／D)	10,022円

* 期首における元本額は30,015,878,475円、当作成期間中における追加設定元本額は79,229,641,363円、同解約元本額は68,276,286,042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、ダイワ米国担保貸付債権ファンド(為替ヘッジあり) 3,021,993円、ダイワ米国担保貸付債権ファンド(為替ヘッジなし) 1,018,149円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 2014-07 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 2014-09 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 2014-11 9,962円、ロボット・テクノロジード株ファンド(為替ヘッジあり) 998円、ワールド・フィンテック革命ファンド(為替ヘッジなし) 998円、新興国ソブリン・豪ドルファンド(毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ブラジルレアルファンド(毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型) 999円、U S 短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型) 102,434円、U S 短期高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型) 1,994円、ロボット・テクノロジード株ファンド(為替ヘッジあり) 39,849円、ロボット・テクノロジード株ファンド(年1回決算型) 1,994円、ロボット・テクノロジード株ファンド(為替ヘッジあり) 3,985円、iFreeレバレッジ S & P 500 9,976,058円、ダイワ上場投信ー日経平均レバレッジ・インデックス6,480,317,774円、ダイワ上場投信ー日経平均ダブルインバース・インデックス3,588,745,910円、ダイワ上場投信ーT O P I Xレバレッジ(2倍) 指数1,873,252,277円、ダイワ上場投信ーT O P I Xダブルインバース(ー2倍) 指数602,505,046円、ダイワ上場投信ー日経平均インバース・インデックス3,957,907,355円、ダイワ上場投信ーT O P I Xインバース(ー1倍) 指数3,685,167,742円、ダイワ上場投信ーJ P X日経400レバレッジ・インデックス323,527,433円、ダイワ上場投信ーJ P X日経400インバース・インデックス2,008,932,965円、ダイワ上場投信ーJ P X日経400ダブルインバース・インデックス208,181,200円、ダイワ米国投資法人債ファンド(為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(部分為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(為替ヘッジあり) 2017-06 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(部分為替ヘッジあり) 2017-06 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド(為替ヘッジあり) 2016-10 997円、ダイワ日本株式ベア・ファン

ド(適格機関投資家専用) 3,619,070,901円、低リスク型アロケーションファンド(金利トレンド判断付き/適格機関投資家専用) 199,401,795円、ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオーS Lトレードー56,086,003円、ダイワ/モルガン・スタンレー新興4カ国不動産関連ファンドー成長の権音(つちおと)ー5,020,480円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ168,192,739円、ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ151,817,656円、低リスク型アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 13,958,125,625円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 豪ドル・コース(毎月分配型) 595,106円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ ブラジル・レアル・コース(毎月分配型) 987,373円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 通貨セレクト・コース(毎月分配型) 494,581円、ダイワU S 短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型) 9,957円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジあり) 997円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジなし) 997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり) 997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジなし) 997円、ダイワ/ミレアセット亜細亜株式ファンド9,958,176円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり49,806円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし49,806円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) 米ドル・コース1,989,053円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) ブラジル・レアル・コース2,978,118円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) 通貨セレクト・コース1,691,241円、ロボット・テクノロジード株ファンド(年1回決算型)ーロボテック(年1回)ー100,588円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり(毎月分配型) 399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし(毎月分配型) 99,771円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース(毎月分配型) 399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース(毎月分配型) 99,771円、ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジあり) 1,091,429円、ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジなし) 315,004円、ダイワ/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド10,009,811円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー日本・コース(毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー豪ドル・コース(毎月分配型) 99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズーブラジル・レアル・コース(毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー米ドル・コース(毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)ージャパン・トリプルリターンズー通貨セレクト・コース(毎月分配型) 1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー予想分配金提示型日本・コース300,273円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー予想分配金提示型 豪ドル・コース200,861円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー予想分配金提示型 ブラジル・レアル・コース300,273円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー予想分配金提示型 米ドル・コース1,999,177円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンドーイーグルアイⅡー予想分配金提示型 通貨セレクト・コース505,900円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,022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	△ 21,014,406円
受取利息	30,196
支払利息	△ 21,044,602
(B) 有価証券売買損益	△ 2
売買損	△ 2
(C) その他費用	△ 16,468,861
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 37,483,269
(E) 前期繰越損益金	91,400,424
(F) 解約差損益金	△184,462,233
(G) 追加信託差損益金	220,618,947
(H) 合計(D + E + F + G)	90,073,869
次期繰越損益金(H)	90,073,869

(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。