

US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)

運用報告書(全体版)

第84期 (決算日 2020年2月5日)
第85期 (決算日 2020年3月5日)
第86期 (決算日 2020年4月6日)
第87期 (決算日 2020年5月7日)
第88期 (決算日 2020年6月5日)
第89期 (決算日 2020年7月6日)

(作成対象期間 2020年1月7日~2020年7月6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9年11カ月間 (2013年2月4日~2023年1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(円ヘッジクラス)」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーストック・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、当初設定から1年以内に分配を開始し、分配開始後は、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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30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	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期騰 落率			
60期末(2018年2月5日)	8,439	30	△ 0.3	—	99.0	699
61期末(2018年3月5日)	8,346	15	△ 0.9	—	99.2	691
62期末(2018年4月5日)	8,311	15	△ 0.2	—	99.5	688
63期末(2018年5月7日)	8,303	15	0.1	—	99.8	688
64期末(2018年6月5日)	8,275	15	△ 0.2	—	98.6	685
65期末(2018年7月5日)	8,192	15	△ 0.8	—	98.9	678
66期末(2018年8月6日)	8,209	15	0.4	—	99.2	680
67期末(2018年9月5日)	8,189	10	△ 0.1	—	99.4	678
68期末(2018年10月5日)	8,160	10	△ 0.2	—	99.6	676
69期末(2018年11月5日)	8,077	10	△ 0.9	—	99.8	669
70期末(2018年12月5日)	7,995	10	△ 0.9	—	99.6	660
71期末(2019年1月7日)	7,873	10	△ 1.4	—	99.2	649
72期末(2019年2月5日)	7,960	10	1.2	—	99.5	656
73期末(2019年3月5日)	7,989	10	0.5	—	99.7	658
74期末(2019年4月5日)	7,985	10	0.1	—	99.5	656
75期末(2019年5月7日)	7,996	10	0.3	—	99.7	657
76期末(2019年6月5日)	7,914	10	△ 0.9	—	99.2	650
77期末(2019年7月5日)	7,945	10	0.5	—	99.4	652
78期末(2019年8月5日)	7,913	10	△ 0.3	—	99.6	650
79期末(2019年9月5日)	7,904	10	0.0	—	99.1	649
80期末(2019年10月7日)	7,860	10	△ 0.4	—	99.3	645
81期末(2019年11月5日)	7,844	10	△ 0.1	—	99.5	644
82期末(2019年12月5日)	7,838	5	△ 0.0	—	99.1	640
83期末(2020年1月6日)	7,856	5	0.3	—	99.7	639
84期末(2020年2月5日)	7,806	5	△ 0.6	—	99.8	635
85期末(2020年3月5日)	7,721	5	△ 1.0	—	99.2	628
86期末(2020年4月6日)	6,855	5	△ 11.2	—	99.7	555
87期末(2020年5月7日)	7,141	5	4.2	—	99.0	579
88期末(2020年6月5日)	7,429	5	4.1	—	99.2	602
89期末(2020年7月6日)	7,374	5	△ 0.7	—	99.5	597

(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。

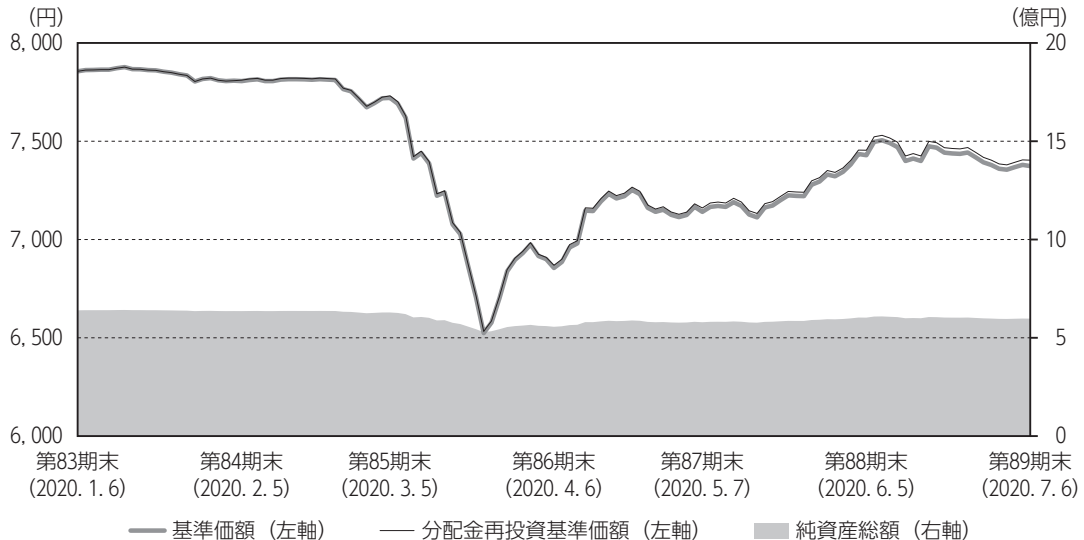
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)および債券先物を除きます。

(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

第84期首：7,856円

第89期末：7,374円（既払分配金30円）

騰落率：△5.8%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・債券・ファンド（円ヘッジクラス）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・イールド社債の下落や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。

※US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・債券・ファンド（円ヘッジクラス）：
 ダイワ・プレミアム・トラスト・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・債券・ファンド（円ヘッジクラス）

US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)

	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	%	%	%
第84期	(期首)2020年1月6日	7,856	—	—	—	99.7
	1月末	7,810	△ 0.6	—	—	99.7
	(期末)2020年2月5日	7,811	△ 0.6	—	—	99.8
第85期	(期首)2020年2月5日	7,806	—	—	—	99.8
	2月末	7,715	△ 1.2	—	—	99.9
	(期末)2020年3月5日	7,726	△ 1.0	—	—	99.2
第86期	(期首)2020年3月5日	7,721	—	—	—	99.2
	3月末	6,931	△ 10.2	—	—	99.6
	(期末)2020年4月6日	6,860	△ 11.2	—	—	99.7
第87期	(期首)2020年4月6日	6,855	—	—	—	99.7
	4月末	7,125	3.9	—	—	98.9
	(期末)2020年5月7日	7,146	4.2	—	—	99.0
第88期	(期首)2020年5月7日	7,141	—	—	—	99.0
	5月末	7,331	2.7	—	—	99.1
	(期末)2020年6月5日	7,434	4.1	—	—	99.2
第89期	(期首)2020年6月5日	7,429	—	—	—	99.2
	6月末	7,360	△ 0.9	—	—	99.4
	(期末)2020年7月6日	7,379	△ 0.7	—	—	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

（2020. 1. 7 ～ 2020. 7. 6）

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下落しました。

当作成期首から2020年2月前半にかけての米国ハイ・イールド社債市況は、米中通商協議での第1段階合意への署名などが好感され、底堅い動きが続きました。しかし、新型コロナウイルスの感染拡大が加速するに連れて、世界経済の先行きに対する不透明感が急速に強まり、2月後半以降は大幅に下落しました。当作成期末にかけては、主要中央銀行による足並みを揃えた金融緩和策の実施や、米国政府による大規模な景気刺激策などが好感され、値を戻す展開となりました。

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。

※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

（2020. 1. 7 ～ 2020. 7. 6）

■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（貸付債権）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

流動性や資産の安全性に配慮し、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84期	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期
	2020年1月7日 ～2020年2月5日	2020年2月6日 ～2020年3月5日	2020年3月6日 ～2020年4月6日	2020年4月7日 ～2020年5月7日	2020年5月8日 ～2020年6月5日	2020年6月6日 ～2020年7月6日
当期分配金(税込み) (円)	5	5	5	5	5	5
対基準価額比率 (%)	0.06	0.06	0.07	0.07	0.07	0.07
当期の収益 (円)	0	3	3	5	5	5
当期の収益以外 (円)	4	1	1	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	94	92	91	137	166	187

(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84期	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 0.15円	✓ 3.42円	✓ 3.33円	✓ 51.71円	✓ 33.52円	✓ 25.99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	66.25	66.25	66.25	66.25	66.25	66.25
(d) 分配準備積立金	✓ 32.85	✓ 28.01	✓ 26.44	24.78	71.49	100.02
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	99.26	97.69	96.03	142.75	171.27	192.26
(f) 分配金	5.00	5.00	5.00	5.00	5.00	5.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	94.26	92.69	91.03	137.75	166.27	187.26

(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

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84期～第89期 (2020.1.7～2020.7.6)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0.590%	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7,411円です。
(投 信 会 社)	(16)	(0.219)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(26)	(0.355)	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 会 社)	(1)	(0.016)	受託会社分は、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	0.004	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)	(0.004)	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	44	0.594	

(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。

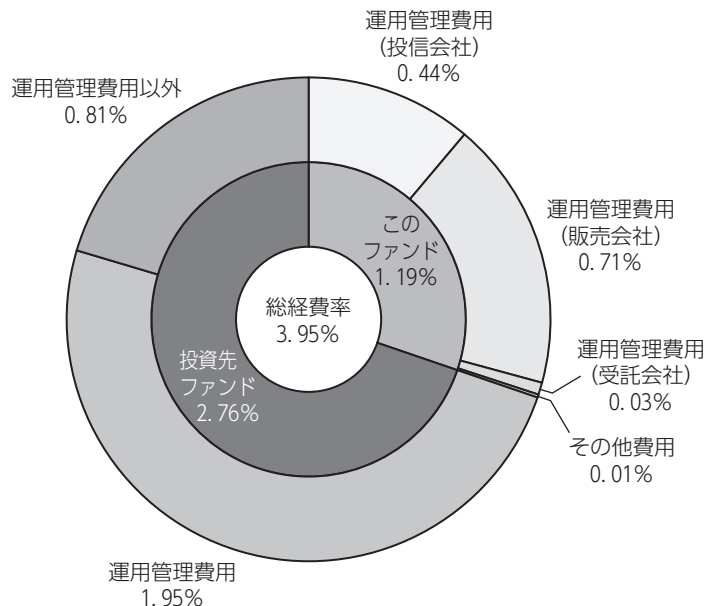
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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3.95%です。



総経費率 (① + ② + ③)	3.95%
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	1.95%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.81%

(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。

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2020年1月7日から2020年7月6日まで)

決算期	第 84 期 ~ 第 89 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	166.57798	12,191	133.55107	10,000

(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

(2020年1月7日から2020年7月6日まで)

第 84 期 ~				第 89 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
				US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	133.55107	10,000	74

(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。

■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	百万円	百万円	百万円	
800	—	—	800	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	第 89 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 CLASS	8,025.67507	594,269	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	第83期末	第 89 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	102	102	102

(注) 単位未満は切捨て。

US 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)

■投資信託財産の構成

2020年7月6日現在

項 目	第 89 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	594,269	99.3
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	102	0.0
コール・ローン等、その他	4,022	0.7
投資信託財産総額	598,394	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

(2020年2月5日)、(2020年3月5日)、(2020年4月6日)、(2020年5月7日)、(2020年6月5日)、(2020年7月6日)現在

項 目	第84期末	第85期末	第86期末	第87期末	第88期末	第89期末
(A) 資産	636,750,602円	629,810,281円	556,974,199円	580,100,448円	603,483,427円	598,394,089円
コール・ローン等	2,130,914	6,101,505	2,683,228	6,678,577	5,688,780	4,022,397
投資信託受益証券 (評価額)	634,517,111	623,606,199	554,188,394	573,319,304	597,692,080	594,269,136
ダイワ・マネーストック・マザーファンド (評価額)	102,577	102,577	102,577	102,567	102,567	102,556
(B) 負債	1,033,714	1,012,568	1,017,179	1,006,218	979,067	1,036,341
未払収益分配金	407,195	407,195	405,489	405,489	405,489	405,018
未払信託報酬	622,211	596,933	599,106	584,097	553,071	606,621
その他未払費用	4,308	8,440	12,584	16,632	20,507	24,702
(C) 純資産総額 (A - B)	635,716,888	628,797,713	555,957,020	579,094,230	602,504,360	597,357,748
元本	814,390,519	814,390,519	810,979,561	810,979,561	810,979,561	810,036,684
次期繰越損益金	△ 178,673,631	△ 185,592,806	△ 255,022,541	△ 231,885,331	△ 208,475,201	△ 212,678,936
(D) 受益権総口数	814,390,519口	814,390,519口	810,979,561口	810,979,561口	810,979,561口	810,036,684口
1万口当り基準価額 (C/D)	7,806円	7,721円	6,855円	7,141円	7,429円	7,374円

* 第83期末における元本額は814,390,519円、当作成期間 (第84期～第89期) 中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は4,353,835円です。

* 第89期末の計算口数当りの純資産額は7,374円です。

* 第89期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は212,678,936円です。

■損益の状況

第84期 自 2020年1月7日 至 2020年2月5日 第86期 自 2020年3月6日 至 2020年4月6日 第88期 自 2020年5月8日 至 2020年6月5日
 第85期 自 2020年2月6日 至 2020年3月5日 第87期 自 2020年4月7日 至 2020年5月7日 第89期 自 2020年6月6日 至 2020年7月6日

項 目	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期
(A) 配当等収益	639,356円	880,071円	874,041円	4,298,879円	2,782,625円	2,716,157円
受取配当金	639,412	880,074	874,255	4,298,935	2,782,833	2,716,346
受取利息	—	—	6	—	8	10
支払利息	△ 56	△ 3	△ 220	△ 56	△ 216	△ 199
(B) 有価証券売買損益	△ 3,655,891	△ 6,790,986	△ 70,072,326	19,831,965	21,589,943	△ 6,146,422
売買益	—	1	218,559	19,831,976	21,589,943	—
売買損	△ 3,655,891	△ 6,790,987	△ 70,290,885	△ 11	—	△ 6,146,422
(C) 信託報酬等	△ 626,519	△ 601,065	△ 603,250	△ 588,145	△ 556,949	△ 610,821
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 3,643,054	△ 6,511,980	△ 69,801,535	23,542,699	23,815,619	△ 4,041,086
(E) 前期繰越損益金	△ 177,991,591	△ 182,041,840	△ 188,169,619	△ 258,376,643	△ 235,239,433	△ 211,583,034
(F) 追加信託差損益金	3,368,209	3,368,209	3,354,102	3,354,102	3,354,102	3,350,202
(配当等相当額)	(5,395,601)	(5,395,601)	(5,373,003)	(5,373,003)	(5,373,003)	(5,366,756)
(売買損益相当額)	(△ 2,027,392)	(△ 2,027,392)	(△ 2,018,901)	(△ 2,018,901)	(△ 2,018,901)	(△ 2,016,554)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 178,266,436	△ 185,185,611	△ 254,617,052	△ 231,479,842	△ 208,069,712	△ 212,273,918
(H) 収益分配金	△ 407,195	△ 407,195	△ 405,489	△ 405,489	△ 405,489	△ 405,018
次期繰越損益金 (G + H)	△ 178,673,631	△ 185,592,806	△ 255,022,541	△ 231,885,331	△ 208,475,201	△ 212,678,936
追加信託差損益金	3,368,209	3,368,209	3,354,102	3,354,102	3,354,102	3,350,202
(配当等相当額)	(5,395,601)	(5,395,601)	(5,373,003)	(5,373,003)	(5,373,003)	(5,366,756)
(売買損益相当額)	(△ 2,027,392)	(△ 2,027,392)	(△ 2,018,901)	(△ 2,018,901)	(△ 2,018,901)	(△ 2,016,554)
分配準備積立金	2,281,514	2,153,325	2,009,609	5,798,249	8,111,780	9,802,668
繰越損益金	△ 184,323,354	△ 191,114,340	△ 260,386,252	△ 241,037,682	△ 219,941,083	△ 225,831,806

(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。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期
(a) 経費控除後の配当等収益	12,837円	279,006円	270,791円	4,194,129円	2,719,020円	2,105,336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	5,395,601	5,395,601	5,373,003	5,373,003	5,373,003	5,366,756
(d) 分配準備積立金	2,675,872	2,281,514	2,144,307	2,009,609	5,798,249	8,102,350
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	8,084,310	7,956,121	7,788,101	11,576,741	13,890,272	15,574,442
(f) 分配金	407,195	407,195	405,489	405,489	405,489	405,018
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	7,677,115	7,548,926	7,382,612	11,171,252	13,484,783	15,169,424
(h) 受益権総口数	814,390,519口	814,390,519口	810,979,561口	810,979,561口	810,979,561口	810,036,684口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期
	5円	5円	5円	5円	5円	5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。

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

ダイワ・プレミアム・トラスト・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（円ヘッジクラス）

当ファンド（US 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））は、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・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（円ヘッジクラス）」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。（注）2020年7月6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
2019年6月28日

資産		
投資資産の評価額（簿価 \$6,970,919）	\$	6,969,242
現金		271
外国為替先渡契約による評価益		35,823
未収：		
売却済みの投資資産		88
利息		85,600
資産合計		<u>7,091,024</u>
負債		
未払：		
購入済みの投資資産		43,800
専門家報酬		54,850
会計および管理会社報酬		11,219
保管会社報酬		9,834
運用会社報酬		2,631
名義書換代理人報酬		839
登録料		809
負債合計		<u>123,982</u>
純資産	\$	<u>6,967,042</u>
純資産		
円ヘッジクラス	\$	6,026,102
円ヘッジ／N1クラス		940,940
	\$	<u>6,967,042</u>
発行済み受益証券		
円ヘッジクラス		8,078,612
円ヘッジ／N1クラス		1,020,203
受益証券1口当り純資産額		
円ヘッジクラス	\$	0.746
円ヘッジ／N1クラス	\$	0.922

損益計算書

2019年6月28日に終了する年度

投資収益		
受取利息	\$	336,641
投資収益合計		<u>336,641</u>
費用		
専門家報酬		53,511
会計および管理会社報酬		45,020
保管会社報酬		41,410
運用会社報酬		31,517
受託会社報酬		15,807
名義書換代理人報酬		3,558
登録料		691
費用合計		<u>191,514</u>
投資純利益		<u>145,127</u>
実現益（損）および評価益（損）：		
実現益（損）：		
証券投資		(47,629)
外国為替取引および外国為替先渡契約		(116,286)
純実現損		<u>(163,915)</u>
評価益（損）の純変動：		
証券投資		70,453
外国為替換算および外国為替先渡契約		104,110
評価益の純変動		<u>174,563</u>
実現益（損）および評価益（損）の純変動		<u>10,648</u>
運用による純資産の純増	\$	<u><u>155,775</u></u>

US 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)

投資明細表
2019年6月28日

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
		債券 (97.9%)		
		オーストラリア (1.6%)		
		社債 (1.6%)		
		FMG Resources August 2006 Pty Ltd.		
USD	110,000	4.75% due 2022/5/15 (a), (b)	\$	113,646
		社債合計		113,646
		オーストラリア合計 (簿価 \$110,525)		113,646
		カナダ (6.0%)		
		バンクローン (2.3%)		
		Bausch Health Cos., Inc.		
USD	84,375	5.16% due 2025/11/27		83,980
USD	36,288	5.41% due 2025/6/2		36,315
		Maxar Technologies, Inc.		
USD	38,964	5.16% due 2024/10/4		35,295
		バンクローン合計		155,590
		社債 (3.7%)		
		Bombardier, Inc.		
USD	90,000	6.13% due 2023/1/15 (b)		91,237
		First Quantum Minerals Ltd.		
USD	11,000	7.00% due 2021/2/15 (a), (b)		11,220
		Garda World Security Corp.		
USD	50,000	7.25% due 2021/11/15 (a), (b)		49,875
		NOVA Chemicals Corp.		
USD	105,000	5.25% due 2023/8/1 (a), (b)		106,444
		社債合計		258,776
		カナダ合計 (簿価 \$416,161)		414,366
		アイルランド (2.1%)		
		社債 (2.1%)		
		Avolon Holdings Funding Ltd.		
USD	105,000	5.13% due 2023/10/1 (a), (b)		111,143
USD	35,000	5.50% due 2023/1/15 (a), (b)		37,313
		社債合計		148,456
		アイルランド合計 (簿価 \$140,883)		148,456
		ルクセンブルク (1.0%)		
		社債 (1.0%)		
		Intelsat Jackson Holdings S. A.		
USD	70,000	8.00% due 2024/2/15 (a), (b)		72,975
		社債合計		72,975
		ルクセンブルク合計 (簿価 \$71,057)		72,975
		米国 (87.2%)		
		バンクローン (14.7%)		
		Acadia Healthcare Co., Inc.		
USD	65,946	4.90% due 2023/2/16		65,740
		Agility Health, Inc.		
USD	5,000	5.50% due 2026/1/4		4,994

US 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)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
USD	50,653	Asurion LLC 5.40% due 2023/11/3		50,612
USD	35,000	California Resources Corp. 7.15% due 2022/12/31		33,556
USD	80,379	CCM Merger, Inc. 4.65% due 2021/8/6		80,379
USD	39,600	CSC Holdings LLC 4.89% due 2026/1/25		39,161
USD	105,000	Eldorado Resorts, Inc. 4.69% due 2024/4/17		104,819
USD	34,913	Energizer Holdings, Inc. 4.75% due 2025/12/17		34,847
USD	4,938	Filtration Group Corp. 5.40% due 2025/3/29		4,935
USD	65,726	First Data Corp. 4.40% due 2022/7/8		65,724
USD	34,725	Genworth Holdings, Inc. 6.99% due 2023/3/7		35,094
USD	2,075	Golden Nugget, Inc. 5.14% due 2023/10/4		2,061
USD	2,587	5.15% due 2023/10/4		2,570
USD	14,862	IRB Holding Corp. 5.64% due 2025/2/5		14,698
USD	45,287	iStar, Inc. 5.13% due 2023/6/28		45,258
USD	44,381	5.17% due 2023/6/28		44,354
USD	24,500	Kinetic Concepts, Inc. 5.58% due 2024/2/2		24,549
USD	5,000	Level 3 Financing, Inc. 4.65% due 2024/2/22		4,967
USD	61,845	Lions Gate Capital Holdings LLC 4.65% due 2025/3/24		61,561
USD	8,750	McAfee LLC 10.90% due 2025/9/29		8,883
USD	72,288	Michaels Stores, Inc. 4.90% due 2023/1/30		70,210
USD	44,709	Post Holdings, Inc. 4.40% due 2024/5/24		44,557
USD	8,351	Prestige Brands, Inc. 4.40% due 2024/1/26		8,321
USD	19,900	Refinitiv US Holdings, Inc. 6.15% due 2025/10/1		19,331
USD	34,825	Regionalcare Hospital Partners Holdings, Inc. 6.90% due 2025/11/16		34,679
USD	117,068	Russell Investments US Institutional Holdco, Inc. 5.65% due 2023/6/1		116,146
		バンクローン合計		1,022,006

US 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)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
		社債 (72.5%)		
		ADT Security Corp.		
USD	75,000	6.25% due 2021/10/15		79,312
		AK Steel Corp.		
USD	75,000	7.63% due 2021/10/1 (a)		73,875
		Ally Financial, Inc.		
USD	80,000	4.25% due 2021/4/15		81,500
		AMC Networks, Inc.		
USD	35,000	4.75% due 2022/12/15 (a)		35,440
		American Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust		
USD	106,350	5.63% due 2021/1/15 (b)		108,976
		Anixter, Inc.		
USD	75,000	5.13% due 2021/10/1		77,719
		Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp.		
USD	97,000	10.00% due 2022/4/1 (a), (b)		102,689
		Boyne USA, Inc.		
USD	40,000	7.25% due 2025/5/1 (a), (b)		43,300
		Builders FirstSource, Inc.		
USD	100,000	5.63% due 2024/9/1 (a), (b)		103,067
		CCM Merger, Inc.		
USD	50,000	6.00% due 2022/3/15 (a), (b)		51,250
		CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp.		
USD	135,000	5.25% due 2022/9/30 (a)		137,038
		Centene Corp.		
USD	110,000	5.63% due 2021/2/15 (a)		112,062
		CF Industries, Inc.		
USD	105,000	7.13% due 2020/5/1		108,412
		Chesapeake Energy Corp.		
USD	35,000	7.00% due 2024/10/1 (a)		31,412
		CIT Group, Inc.		
USD	70,000	4.13% due 2021/3/9 (a)		71,333
		Clean Harbors, Inc.		
USD	35,000	5.13% due 2021/6/1 (a)		35,000
		Cleveland-Cliffs, Inc.		
USD	35,000	4.88% due 2024/1/15 (a), (b)		35,525
		Cloud Crane LLC		
USD	60,000	10.13% due 2024/8/1 (a), (b)		64,500
		Credit Acceptance Corp.		
USD	135,000	7.38% due 2023/3/15 (a)		140,231
		CSC Holdings LLC		
USD	60,000	6.75% due 2021/11/15		64,200
		DAE Funding LLC		
USD	55,000	4.50% due 2022/8/1 (a), (b)		55,825
USD	15,000	5.25% due 2021/11/15 (a), (b)		15,581
		Dell, Inc.		
USD	100,000	4.63% due 2021/4/1		102,810
		Dell International LLC / EMC Corp.		
USD	135,000	5.88% due 2021/6/15 (a), (b)		137,241

US 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)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
USD	140,000	DISH DBS Corp. 5.13% due 2020/5/1		140,699
USD	100,000	EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance, Inc. 7.75% due 2026/5/15 (a), (b)		89,250
USD	40,000	Forestar Group, Inc. 8.00% due 2024/4/15 (a), (b)		41,950
USD	115,000	GLP Capital LP / GLP Financing II, Inc. 4.38% due 2021/4/15		116,998
USD	90,000	HCA Healthcare, Inc. 6.25% due 2021/2/15		94,275
USD	65,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp. 5.88% due 2022/2/1 (a)		65,650
USD	10,000	6.25% due 2022/2/1 (a) ILFC E-Capital Trust II		10,237
USD	100,000	4.34% due 2065/12/21 (a), (b), (c) Indiantown Cogeneration LP		72,500
USD	28,561	9.77% due 2020/12/15 Iron Mountain, Inc.		29,477
USD	100,000	4.38% due 2021/6/1 (a), (b) Jack Ohio Finance LLC / Jack Ohio Finance 1 Corp.		101,000
USD	55,000	6.75% due 2021/11/15 (a), (b) KB Home		56,496
USD	150,000	7.00% due 2021/12/15 (a) L Brands, Inc.		160,988
USD	75,000	5.63% due 2022/2/15 MasTec, Inc.		78,383
USD	35,000	4.88% due 2023/3/15 (a) MGM Resorts International		35,481
USD	90,000	6.00% due 2023/3/15 Navient Corp.		97,538
USD	135,000	6.63% due 2021/7/26 NCL Corp. Ltd.		142,931
USD	11,000	4.75% due 2021/12/15 (a), (b) Netflix, Inc.		11,151
USD	110,000	5.38% due 2021/2/1 NextEra Energy Operating Partners LP		113,713
USD	20,000	4.25% due 2024/7/15 (a), (b) NRG Energy, Inc.		20,125
USD	65,000	7.25% due 2026/5/15 (a) NuStar Logistics LP		71,581
USD	70,000	6.75% due 2021/2/1 Popular, Inc.		73,150
USD	35,000	6.13% due 2023/9/14 (a) Prestige Brands, Inc.		37,144
USD	60,000	5.38% due 2021/12/15 (a), (b) Reynolds Group Issuer, Inc. / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Luxembourg		60,300
USD	29,073	5.75% due 2020/10/15 (a)		29,146

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)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D	100,000	6.10% due 2021/7/15 (a), (b), (c) RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp.		100,000
U S D	35,000	5.00% due 2021/4/15 (a) Sanchez Energy Corp.		34,956
U S D	55,000	7.25% due 2023/2/15 (a), (b) Scientific Games International, Inc.		41,663
U S D	37,000	10.00% due 2022/12/1 (a) Service Corp. International		38,804
U S D	65,000	8.00% due 2021/11/15 Spectrum Brands, Inc.		71,013
U S D	33,000	6.63% due 2022/11/15 (a) Springleaf Finance Corp.		33,792
U S D	130,000	5.63% due 2023/3/15 Sprint Communications, Inc.		138,125
U S D	175,000	7.00% due 2020/8/15 Sunoco LP / Sunoco Finance Corp.		181,344
U S D	75,000	4.88% due 2023/1/15 (a) Tenet Healthcare Corp.		76,594
U S D	70,000	4.50% due 2021/4/1		71,138
U S D	55,000	6.00% due 2020/10/1		56,619
U S D	120,000	8.13% due 2022/4/1 T-Mobile USA, Inc.		125,850
U S D	220,000	4.00% due 2022/4/15 (a) TRI Pointe Group, Inc.		112,475
U S D	55,000	4.88% due 2021/7/1 (a) Triumph Group, Inc.		56,100
U S D	80,000	5.25% due 2022/6/1 (a) Whiting Petroleum Corp.		78,400
U S D	15,000	5.75% due 2021/3/15 (a) Williams Scotsman International, Inc.		15,113
U S D	25,000	7.88% due 2022/12/15 (a), (b) Xerox Corp.		26,250
U S D	70,000	4.13% due 2023/3/15 (a) Yum! Brands, Inc.		71,254
U S D	105,000	3.88% due 2020/11/1 (a)		105,263
		社債合計		5,053,214
		米国合計 (簿価 \$6,087,714)		6,075,220
		債券合計 (簿価 \$6,826,340)		\$ 6,824,663
		短期投資 (2.1%)		
		ケイマン諸島 (0.1%)		
		定期預金 (0.1%)		
		Brown Brothers Harriman & Co.		
J P Y	328,874	(0.27) %** due 2019/7/1		3,052
		定期預金合計		3,052
		ケイマン諸島合計 (簿価 \$3,052)		3,052
		日本 (2.0%)		
		定期預金 (2.0%)		

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)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D	141,527	Sumitomo Corp. 1.64% due 2019/7/1		141,527
		定期預金合計		141,527
		日本合計 (簿価 \$141,527)		141,527
		短期投資合計 (簿価 \$144,579)		144,579
		投資総額 (簿価 \$6,970,919)	100.0%	\$ 6,969,242
		現金および他の資産を超過する負債	(0.0)	(2,200)
		純資産	100.0%	\$ 6,967,042

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。

* バンクローンは変動金利証券です。クーポンレートは期末時点のものを表示しております。

** 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) 期前償還条項付き証券。

(b) 144A 証券-1933年証券取引法の規則144A の下で S E C 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。

(c) 2019年6月28日時点の変動金利証券。

2019年6月28日現在の円ヘッジクラスの外国為替先渡契約 (純資産の0.4%) :

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	637,065,652	2019/7/19	U S D	5,890,101	\$ 30,983	\$ -	\$ 30,983

2019年6月28日現在の円ヘッジ/N 1 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	99,507,030	2019/7/19	U S D	920,009	\$ 4,840	\$ -	\$ 4,840

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短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型））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（2019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、当ファンドの第89期の決算日（2020年7月6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

2020年1月7日～2020年7月6日における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

2020年7月6日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

運用報告書 第10期（決算日 2019年12月9日）

（作成対象期間 2018年12月11日～2019年12月9日）

ダイワ・マネーストック・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。

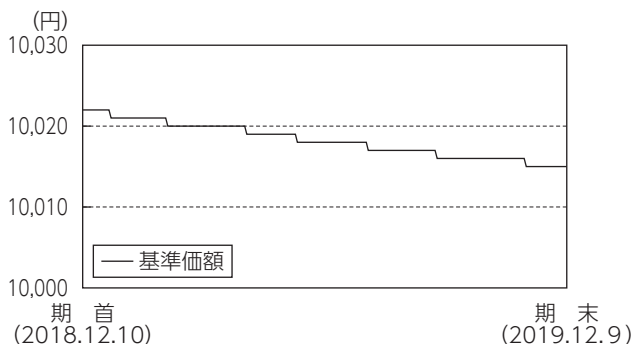
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://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)2018年12月10日	円	%	%
	10,022	-	-
12月末	10,022	0.0	-
2019年1月末	10,021	△0.0	-
2月末	10,020	△0.0	-
3月末	10,020	△0.0	-
4月末	10,019	△0.0	-
5月末	10,018	△0.0	-
6月末	10,018	△0.0	-
7月末	10,017	△0.0	-
8月末	10,017	△0.0	-
9月末	10,016	△0.1	-
10月末	10,016	△0.1	-
11月末	10,015	△0.1	-
(期末)2019年12月9日	10,015	△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：10,022円 期末：10,015円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

短期の国債やコール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。こ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。

◆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。

《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)	1 (1)
合 計	1

(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) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2018年12月11日から2019年12月9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

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

銘	買 付 額		売 付 額	
	柄	金 額 千円	柄	金 額 千円
801 国庫短期証券 2019/3/18		250,003		

(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・マネースtock・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

2019年12月9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	103,888,808	100.0
投資信託財産総額	103,888,808	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12月9日現在

項目	当 期 末
(A) 資産	103,888,808,252円
コール・ローン等	103,888,808,252
(B) 負債	200,442,764
未払解約金	200,000,000
その他未払費用	442,764
(C) 純資産総額(A - B)	103,688,365,488
元本	103,532,314,258
次期繰越損益金	156,051,230
(D) 受益権総口数	103,532,314,258口
1口当り基準価額(C / D)	10,015円

* 期首における元本額は40,969,233,796円、当作成期間中における追加設定元本額は198,584,973,661円、同解約元本額は136,021,893,199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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック-947,268円、ダイワ/ミレーアセット・インド株式ファンド - インドの匠-29,910,270円、ワールド・フィンテック革命ファンド (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・ブラジルリアルファンド (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、US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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (為替ヘッジあり) 39,849円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり) 3,985円、iFreeレバレッジ S & P 500 995,814円、iFreeレバレッジN A S D A Q 100 29,943,109円、米国4資産リスク分散ファンド (年2回決算型) 658,945円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス3,526,781,327円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス6,932,995,956円、ダイワ上場投信-TOP 1 Xレバレッジ (2倍) 指数1,154,855,756円、ダイワ上場投信-TOP 1 Xダブルインバース (-2倍) 指数1,136,478,065円、ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス46,620,451,844円、ダイワ上場投信-TOP 1 Xインバース (-1倍) 指数10,870,537,799円、ダイワ上場投信-J P X日経400レバレッジ・インデックス413,400,603円、ダイワ上場投信-J P X日経400インバース・インデックス811,328,174円、ダイワ上場投信-J P X日経400ダブルインバース・インデックス401,731,588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 (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 (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、ダイワ米国投資法人債ファンド (部分為替ヘッジあり) 2016-10 997円、先進国トータルリターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用) 6,289,387,976円、ダイワ日本株式ベア・ファンド (適格機関投資家専用) 10,596,789,950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) 179,433,743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 - S L T

レード-186,241,301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-成長の植音 (つちおと) -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339,840,055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8,383,335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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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US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/ミレー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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型) -ロボテック (年1回) -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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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) -ジャパン・トリプルリターンズ- 日本円・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) -ジャパン・トリプルリターンズ- 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) -ジャパン・トリプルリターンズ- 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) -ジャパン・トリプルリターンズ- 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 -イーグルアイII- 予想分配金提示型 日本円・コース300,273円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イーグルアイII- 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 -イーグルアイII- 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 -イーグルアイII- 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 -イーグルアイII- 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10,015円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月11日 至2019年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 46,990,800円
受取利息	413,173
支払利息	△ 47,403,973
(B) その他費用	△ 10,190,474
(C) 当期損益金(A + B)	△ 57,181,274
(D) 前期繰越損益金	90,073,869
(E) 解約差損益金	△254,373,622
(F) 追加信託差損益金	377,532,257
(G) 合計(C + D + E + F)	156,051,230
次期繰越損益金(G)	156,051,230

(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。