

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|--|---|
| 商品分類 | ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド | 追加型投信／海外／株式 |
| 信託期間 | 5年間（2012年3月22日～2017年3月21日） | |
| 運用方針 | ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド 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 | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 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 | ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド 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 | ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンドの受益証券 イ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券 ロ. 円建ての債券 |
| 運用方法 | ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド | ①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、オーストラリアの金融商品取引所上場株式等（不動産投資信託証券を含みます。）の中から、相対的に予想配当利回りの高い銘柄に投資し、信託財産の成長をめざします。 ②マザーファンドにおけるポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。 イ. 時価総額や流動性等を勘案して投資対象銘柄を選定します。 ロ. 投資対象銘柄の中から、企業の利益成長性、財務内容、配当余力および配当政策等を分析し、予想配当利回りの水準が高いと判断される銘柄を中心に、組入候補銘柄を選別します。 ハ. 株価バリュエーションや銘柄分散等を勘案してポートフォリオを構築します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ④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ないません。 |
| | 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 | ①マザーファンドの受益証券および円建ての債券を中心に投資することにより、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマースナル・ペーパーに投資することを基本とします。 |
| 組入制限 | ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド 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 | ・マザーファンド組入上限比率および株式組入上限比率は無制限 ・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の10%以下 |
| 配分方針 | ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド 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 | 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、配当等収益等を全額分配し、売買益等は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、分配を行なわないことがあります。 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、分配を行なわないことがあります。 |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者から資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド 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

運用報告書（全体版） 第7期 （決算日 2015年9月24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・オーストラリア高配当株ファンド」および「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」は、このたび、第7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/>

<3817>
<3818>

★ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | S & P / A S X 200指数 (円換算) | | | 株式 組入 率 | 株式 先物 比率 | 投資信託 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 | 騰落率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | | | % | % | % | % | 百万円 |
| 3期末(2013年9月24日) | 12,970 | 200 | 2.8 | 13,134 | △ | 1.3 | 93.2 | 3.1 | 2.6 | 14,307 |
| 4期末(2014年3月24日) | 13,321 | 530 | 6.8 | 13,361 | | 1.7 | 92.9 | 1.6 | 4.8 | 9,434 |
| 5期末(2014年9月22日) | 13,854 | 830 | 10.2 | 14,250 | | 6.7 | 90.1 | 3.2 | 4.8 | 8,722 |
| 6期末(2015年3月23日) | 14,482 | 340 | 7.0 | 15,021 | | 5.4 | 91.8 | 1.6 | 5.0 | 8,662 |
| 7期末(2015年9月24日) | 11,119 | 200 | △ 21.8 | 11,334 | △ | 24.5 | 91.3 | 2.2 | 3.7 | 6,160 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P / A S X 200指数 (円換算) は、S & P / A S X 200指数 (オーストラリア・ドルベース) を円換算し、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。S & P / A S X 200指数 (オーストラリア・ドルベース) の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLC が有しています。S&P Dow Jones Indices LLC は、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

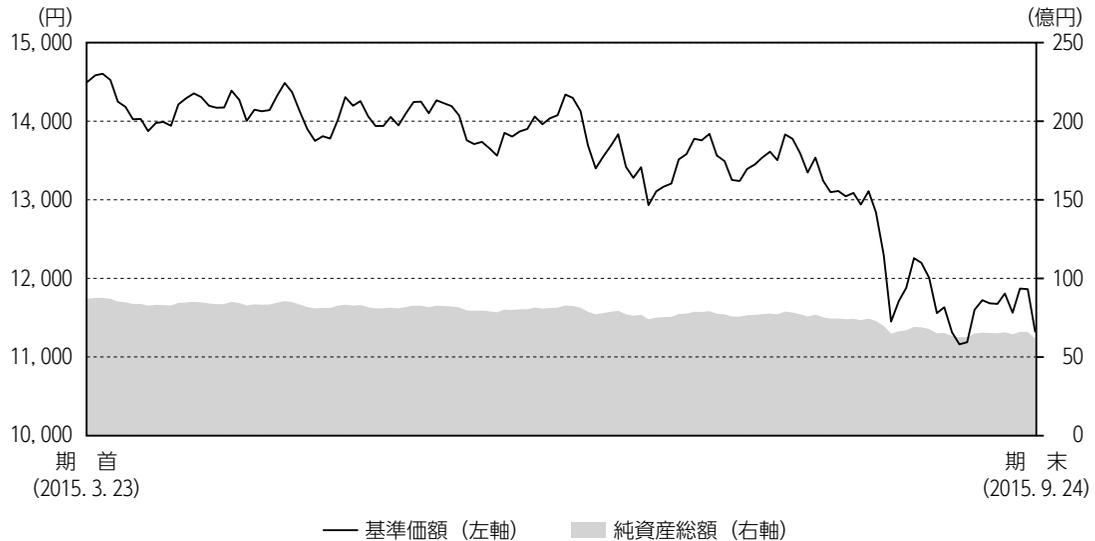
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 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) 株式先物比率は買建比率 - 売建比率です。

《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

期首：14,482円

期末：11,119円 (分配金200円)

騰落率：△21.8% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

オーストラリア株式市況が下落したこと、およびオーストラリア・ドルが対円で下落したことがマイナスの要因となり、基準価額は値下がりしました。

ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P / A S X 200指数 (円換算) | | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------------------|-------------|--------|------------------------------|--------|----------------|--------------------|---------------------------|
| | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | (参考指数) | | | |
| (期首) 2015年 3月23日 | 円 14,482 | % — | 15,021 | % — | % 91.8 | % 1.6 | % 5.0 |
| 3月末 | 14,008 | △ 3.3 | 14,489 | △ 3.5 | 87.5 | 2.1 | 5.0 |
| 4月末 | 14,350 | △ 0.9 | 15,000 | △ 0.1 | 89.1 | 2.1 | 5.1 |
| 5月末 | 14,085 | △ 2.7 | 14,586 | △ 2.9 | 90.4 | 2.2 | 4.2 |
| 6月末 | 13,384 | △ 7.6 | 13,712 | △ 8.7 | 91.4 | 2.1 | 3.9 |
| 7月末 | 13,522 | △ 6.6 | 13,830 | △ 7.9 | 90.9 | 2.1 | 3.9 |
| 8月末 | 12,188 | △ 15.8 | 12,265 | △ 18.3 | 89.6 | 2.1 | 3.7 |
| (期末) 2015年 9月24日 | 11,319 | △ 21.8 | 11,334 | △ 24.5 | 91.3 | 2.2 | 3.7 |

(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**○オーストラリア株式市況**

オーストラリア株式市況は、2015年5月から6月にかけて、RBA（オーストラリア準備銀行）による金融緩和姿勢の後退やギリシャ債務問題、中国株の下落などを受けて軟調に推移しました。8月には、オーストラリア国内大手銀行による増資の発表や中国人民幣元切下げなどを受けて、大きく下落しました。

○為替相場

2015年6月から7月にかけて、ギリシャ情勢の混乱による投資資金のリスク回避や、オーストラリアの主要輸出先である中国の株式市況下落に伴い、オーストラリア・ドルは相対的な安全資産である円に対して下落しました。8月下旬から9月上旬にかけては、中国経済の減速懸念からアジア株が大きく下落し、また世界的な需要の後退観測から原油など商品相場も値下がりしたことによる市場参加者のリスク回避姿勢から、オーストラリア・ドルは対円で大きく下落しました。

前期における「今後の運用方針」**○当ファンド**

「ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド」の受益証券へ投資を行いません。

○ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド

当ファンドでは引続き、厳しい経済環境下においても安定的なキャッシュフローを生み出すことができる、強固な収益基盤を持つ企業に注目しています。また、その中でも配当という形での株主還元を重視する企業を中心に投資していく所存です。

ポートフォリオについて

○当ファンド

「ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

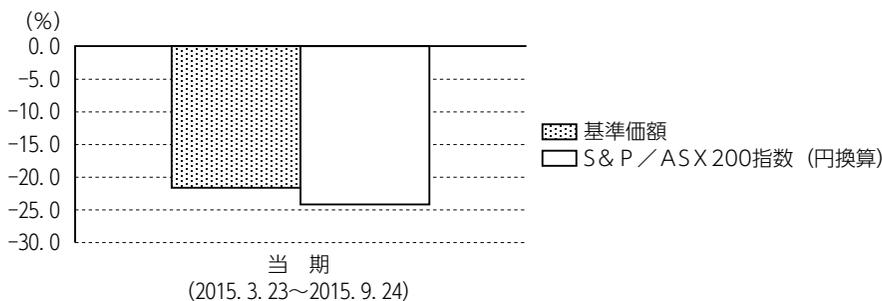
○ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド

高いブランド力と強固な顧客基盤を持ち高い収益性を誇る大手銀行 COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA（金融）、オーストラリア国内で個人向け住宅ローンを主な事業とし優れた財務基盤とともに安定した業績が予想された大手銀行 WESTPAC BANKING CORP（金融）、安定した成長性を維持し、かつ、海外売上高比率の高い大手梱包用品会社 AMCOR LIMITED（素材）、優れたネットワークを持ち、安定した配当が期待された TELSTRA CORP LTD（電気通信サービス）などを高位に組み入れました。

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。参考指数はオーストラリア株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は200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 | |
|------------|---------------------------|-------|
| | 2015年3月24日 ～2015年9月24日 | |
| 当期分配金（税込み） | (円) | 200 |
| 対基準価額比率 | (%) | 1.77 |
| 当期の収益 | (円) | 167 |
| 当期の収益以外 | (円) | 32 |
| 翌期繰越分配対象額 | (円) | 4,395 |

(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 | 167.88円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 |
| (c) 収益調整金 | 461.38 |
| (d) 分配準備積立金 | 3,965.85 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 4,595.12 |
| (f) 分配金 | 200.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 4,395.12 |

(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

「ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

○ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド

当ファンドでは引続き、厳しい経済環境下においても安定的なキャッシュフローを生み出すことができる、強固な収益基盤を持つ企業に注目しています。また、その中でも配当という形での株主還元を重視する企業を中心に投資していく所存です。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------|---------------------------|----------|--|
| | (2015. 3. 24~2015. 9. 24) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 110円 | 0. 817% | 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13, 462円です。 |
| (投信会社) | (51) | (0. 382) | 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) | (55) | (0. 409) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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) | (4) | (0. 027) | 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 | 17 | 0. 127 | 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 |
| (株式) | (17) | (0. 123) | |
| (先物) | (0) | (0. 000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0. 003) | |
| 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 | 5 | 0. 041 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (5) | (0. 035) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (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 |
| (その他) | (0) | (0. 003) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 133 | 0. 985 | |

(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) 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 3) 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
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------------|-----|-----|---------|---------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド | — | — | 408,897 | 730,000 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|------------------------|
| | ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 3,918,614千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 7,074,514千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.55 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■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。

■組入資産明細表
親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | 当 期 末 | |
|------------------------|-----------|-----------|-----------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千□ | 千□ | 千円 |
| ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド | 4,340,149 | 3,931,251 | 6,122,138 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年9月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド | 6,122,138 | 96.6 |
| コール・ローン等、その他 | 218,436 | 3.4 |
| 投資信託財産総額 | 6,340,575 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を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で邦貨換算したものです。なお、9月24日における邦貨換算レートは、1オーストラリア・ドル＝84.23円です。

(注3) ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(6,148,908千円)の投資信託財産総額(6,222,467千円)に対する比率は、98.8%です。

ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年9月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------------|-----------------------|
| (A) 資産 | 6,340,575,359円 |
| コール・ローン等 | 138,436,760 |
| ダイワ・オーストラリア 高配当株マザーファンド (評価額) | 6,122,138,599 |
| 未収入金 | 80,000,000 |
| (B) 負債 | 180,464,227 |
| 未払収益分配金 | 110,801,680 |
| 未払解約金 | 5,821,729 |
| 未払信託報酬 | 63,628,811 |
| その他未払費用 | 212,007 |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 6,160,111,132 |
| 元本 | 5,540,084,038 |
| 次期繰越損益金 | 620,027,094 |
| (D) 受益権総口数 | 5,540,084,038口 |
| 1万口当り基準価額 (C / D) | 11,119円 |

* 期首における元本額は5,981,833,481円、当期中における追加設定元本額は154,736,160円、同解約元本額は596,485,603円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,119円です。

■収益分配金の計算過程 (総額)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 93,010,689円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 255,611,227 |
| (d) 分配準備積立金 | 2,197,114,798 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 2,545,736,714 |
| (f) 分配金 | 110,801,680 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 2,434,935,034 |
| (h) 受益権総口数 | 5,540,084,038口 |

■損益の状況

当期 自2015年3月24日 至2015年9月24日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|------------------------|
| (A) 配当等収益 | 25,693円 |
| 受取利息 | 25,693 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 1,680,666,972 |
| 売買益 | 53,316,455 |
| 売買損 | △ 1,733,983,427 |
| (C) 信託報酬等 | △ 63,840,818 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | △ 1,744,482,097 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,197,114,798 |
| (F) 追加信託差損益金 | 278,196,073 |
| (配当等相当額) | (255,611,227) |
| (売買損益相当額) | (22,584,846) |
| (G) 合計 (D + E + F) | 730,828,774 |
| (H) 収益分配金 | △ 110,801,680 |
| 次期繰越損益金 (G + H) | 620,027,094 |
| 追加信託差損益金 | 278,196,073 |
| (配当等相当額) | (255,611,227) |
| (売買損益相当額) | (22,584,846) |
| 分配準備積立金 | 2,179,323,807 |
| 繰越損益金 | △ 1,837,492,786 |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しておりません。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程 (総額)」の表を参照。

| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ | |
|---------------------|------|
| 1 万 口 当 り 分 配 金 | 200円 |

- <分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、9月24日現在の基準価額（1万口当り11,119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）」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。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年3月23日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）は13,908円です。」

ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド

運用報告書 第7期 (決算日 2015年9月24日)

(計算期間 2015年3月24日～2015年9月24日)

ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンドの第7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 | 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 | オーストラリアの金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の株式および不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券） |
| 運用方法 | <p>①主として、オーストラリアの金融商品取引所上場株式等（不動産投資信託証券を含みません。）の中から、相対的に予想配当利回りの高い銘柄に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②ポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。</p> <p>イ. 時価総額や流動性等を勘案して投資対象銘柄を選定します。</p> <p>ロ. 投資対象銘柄の中から、企業の利益成長性、財務内容、配当余力および配当政策等を分析し、予想配当利回りの水準が高いと判断される銘柄を中心に、組入候補銘柄を選別します。</p> <p>ハ. 株価バリュエーションや銘柄分散等を勘案してポートフォリオを構築します。</p> <p>③株式等の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>④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ないません。</p> |
| 株式組入制限 | 無制限 |

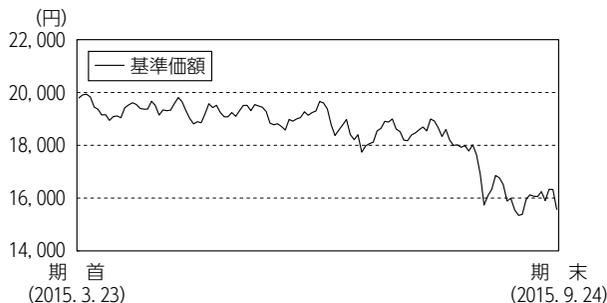
大和投資信託

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/>

■当期中の基準価額と市況の推移



《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：19,793円 期末：15,573円 騰落率：△21.3%

【基準価額の主な変動要因】

オーストラリア株式市況が下落したこと、およびオーストラリア・ドルが対円で下落したことがマイナスの要因となり、基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○オーストラリア株式市況

オーストラリア株式市況は、2015年5月から6月にかけて、RBA（オーストラリア準備銀行）による金融緩和姿勢の後退やギリシャ債務問題、中国株の下落などを受けて軟調に推移しました。8月には、オーストラリア国内大手銀行による増資の発表や中国人民元切下げなどを受けて、大きく下落しました。

○為替相場

2015年6月から7月にかけて、ギリシャ情勢の混乱による投資資金のリスク回避や、オーストラリアの主要輸出先である中国の株式市況下落に伴い、オーストラリア・ドルは相対的な安全資産である円に対して下落しました。8月下旬から9月上旬にかけては、中国経済の減速懸念からアジア株が大きく下落し、また世界的な需要の後退観測から原油など商品相場も値下がりしたことによる市場参加者のリスク回避姿勢から、オーストラリア・ドルは対円で大きく下落しました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドでは引き続き、厳しい経済環境下においても安定的なキャッシュフローを生み出すことができる、強固な収益基盤を持つ企業に注目しています。また、その中でも配当という形での株主還元を重視する企業を中心に投資していく所存です。

| 年 月 日 | 基準価額 | | S&P/ASX200指数 (円換算) | | 株 式 組入比率 | 株式先物 比 率 | 投資信託 証 券 組入比率 |
|----------------|--------|--------|-----------------------|--------|-------------|-------------|---------------------|
| | 円 | % | (参考指数) | 騰落率 | | | |
| (期首)2015年3月23日 | 19,793 | — | 15,021 | — | 92.6 | 1.6 | 5.1 |
| 3月末 | 19,149 | △ 3.3 | 14,489 | △ 3.5 | 87.8 | 2.1 | 5.0 |
| 4月末 | 19,649 | △ 0.7 | 15,000 | △ 0.1 | 89.5 | 2.1 | 5.1 |
| 5月末 | 19,312 | △ 2.4 | 14,586 | △ 2.9 | 90.8 | 2.2 | 4.2 |
| 6月末 | 18,371 | △ 7.2 | 13,712 | △ 8.7 | 92.0 | 2.1 | 3.9 |
| 7月末 | 18,587 | △ 6.1 | 13,830 | △ 7.9 | 91.2 | 2.2 | 3.9 |
| 8月末 | 16,772 | △ 15.3 | 12,265 | △ 18.3 | 90.9 | 2.2 | 3.7 |
| (期末)2015年9月24日 | 15,573 | △ 21.3 | 11,334 | △ 24.5 | 91.9 | 2.2 | 3.7 |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) S & P / A S X 200指数 (円換算) は、S & P / A S X 200指数 (オーストラリア・ドルベース) を円換算し、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。S & P / A S X 200指数 (オーストラリア・ドルベース) の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLC が有しています。S&P Dow Jones Indices LLC は、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

(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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◆ポートフォリオについて

高いブランド力と強固な顧客基盤を持ち高い収益性を誇る大手銀行 COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA (金融)、オーストラリア国内で個人向け住宅ローンを中心とした優れた財務基盤とともに安定した業績が予想された大手銀行 WESTPAC BANKING CORP (金融)、安定した成長性を維持し、かつ、海外売上高比率の高い大手梱包用品会社 AMCOR LIMITED (素材)、優れたネットワークを持ち、安定した配当が期待された TELSTRA CORP LTD (電気通信サービス) などを高位に組み入れました。

◆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。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。参考指数はオーストラリア株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

当ファンドでは引き続き、厳しい経済環境下においても安定的なキャッシュフローを生み出すことができる、強固な収益基盤を持つ企業に注目しています。また、その中でも配当という形での株主還元を重視する企業を中心に投資していく所存です。

ドイツ・オーストラリア高配当株マザーファンド

■ 1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------|-------------|
| 売買委託手数料 (株式) | 24円 (23) |
| (先物) | (0) |
| (投資信託証券) | (1) |
| 有価証券取引税 | — |
| その他費用 (保管費用) | 7 (6) |
| (その他) | (1) |
| 合 計 | 31 |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---------------|-----------------------|--------------------|-----------|-------------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外国 オーストラリア | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 百株 | 千オーストラリア・ドル |
| | 14,439 (3,863.94) | 17,795 (1,622) | 39,203.69 | 25,224 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|---------------|------------------|--------------|-------------|---------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国 オーストラリア | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千口 | 千オーストラリア・ドル |
| | — (△ 120.601) | — (△ 245) | 480 (—) | 1,426 (—) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()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4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|--------------|-------|-------|-------|-------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 346 | 307 | — | — |

(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

(1)株 式

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| 当 期 | | | | 期 | | | |
|--------------------------------------|------|---------|-------|-------------------------------------|-----|---------|-------|
| 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
| 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| BHP BILLITON LIMITED (オーストラリア) | 104 | 258,612 | 2,486 | BENDIGO AND ADELAIDE BANK (オーストラリア) | 175 | 197,991 | 1,131 |
| WESFARMERS LTD (オーストラリア) | 64 | 237,209 | 3,706 | LEND LEASE GROUP (オーストラリア) | 135 | 192,350 | 1,424 |
| WESTPAC BANKING CORP (オーストラリア) | 41 | 122,910 | 2,997 | SYDNEY AIRPORT (オーストラリア) | 360 | 179,171 | 497 |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK (オーストラリア) | 90 | 101,244 | 1,124 | SONIC HEALTHCARE LTD (オーストラリア) | 82 | 159,370 | 1,943 |
| SANTOS LTD (オーストラリア) | 115 | 93,055 | 809 | BANK OF QUEENSLAND LTD (オーストラリア) | 95 | 123,458 | 1,299 |
| SYDNEY AIRPORT (オーストラリア) | 180 | 80,819 | 448 | IOOF HOLDINGS LTD (オーストラリア) | 140 | 121,404 | 867 |
| JB HI-FI LTD (オーストラリア) | 31.5 | 62,320 | 1,978 | ALUMINA LTD (オーストラリア) | 570 | 87,784 | 154 |
| CSL LTD (オーストラリア) | 6.9 | 57,887 | 8,389 | AMCOR LIMITED (オーストラリア) | 65 | 85,989 | 1,322 |
| SUNCORP GROUP LTD (オーストラリア) | 50 | 56,507 | 1,130 | SANTOS LTD (オーストラリア) | 115 | 83,072 | 722 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD (オーストラリア) | 335 | 56,182 | 167 | INSURANCE AUSTRALIA GROUP (オーストラリア) | 155 | 77,824 | 502 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2)投資信託証券

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| 当 期 | | | | 期 | | | |
|-----|-----|-----|------|--|-----|--------|------|
| 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 |
| | | | | FEDERATION CENTRES (オーストラリア) | 250 | 69,581 | 278 |
| | | | | DEXUS PROPERTY GROUP (オーストラリア) | 50 | 35,050 | 701 |
| | | | | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR (オーストラリア) | 70 | 20,628 | 294 |
| | | | | GDI PROPERTY GROUP (オーストラリア) | 110 | 9,356 | 85 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

| 銘 柄 | 期 首 | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-----------------------------|----------|----------|-------|---------|----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| (オーストラリア) | | | 千円 | 千円 | |
| BHP BILLITON LIMITED | — | 1,040 | 2,371 | 199,726 | 素材 |
| LEND LEASE GROUP | 1,730 | 490 | 622 | 52,457 | 金融 |
| ASCIANO LTD | — | 600 | 498 | 41,997 | 資本財・サービス |
| ALUMINA LTD | 5,700 | — | — | — | 素材 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 200 | 145 | 417 | 35,174 | エネルギー |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 1,431.67 | 581.67 | 574 | 48,406 | 金融 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 1,831.49 | 1,902.4 | 5,669 | 477,512 | 金融 |
| WESTPAC BANKING CORP | 1,791.72 | 1,961.72 | 5,879 | 495,211 | 金融 |
| AUST AND NZ BANKING GROUP | 1,714.57 | 1,724.57 | 4,654 | 392,058 | 金融 |

| 銘 柄 | 期 首 | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|----------|--------|-------|---------|----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| AMCOR LIMITED | 3,540 | 3,210 | 4,063 | 342,298 | 素材 |
| WESTERN AREAS LTD | 430 | — | — | — | 素材 |
| DULUXGROUP LTD | 1,489.21 | 739.21 | 395 | 33,311 | 素材 |
| INCITEC PIVOT LTD | 400 | 400 | 149 | 12,567 | 素材 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 794.98 | 850.41 | 6,088 | 512,871 | 金融 |
| QBE INSURANCE GROUP LTD | 376.42 | 226.42 | 292 | 24,659 | 金融 |
| WOOLWORTHS LTD | 138.3 | — | — | — | 生活必需品 |
| QANTAS AIRWAYS LTD | 600 | 600 | 221 | 18,648 | 資本財・サービス |
| TELSTRA CORP LTD | 6,650 | 5,950 | 3,343 | 281,656 | 電気通信サービス |
| AMP LTD | 270 | 270 | 150 | 12,712 | 金融 |

ダイワ・オーストラリア高配当株マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|-------|---------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| SUPER RETAIL GROUP LTD | 307.35 | 307.35 | 270 | 22,755 | 一般消費・サービス |
| MACQUARIE GROUP LTD | 371.64 | 411.64 | 3,169 | 266,977 | 金融 |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 1,193.65 | 530.36 | 619 | 52,221 | 金融 |
| CSL LTD | 104 | 173 | 1,543 | 130,038 | ヘルスケア |
| WESFARMERS LTD | 213.63 | 853.63 | 3,259 | 274,518 | 生活必需品 |
| SUNCORP GROUP LTD | 2,510 | 2,680 | 3,280 | 276,301 | 金融 |
| ASX LTD | — | 140 | 531 | 44,786 | 金融 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 400 | 400 | 152 | 12,836 | 一般消費・サービス |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 5,060 | 3,510 | 1,705 | 143,684 | 金融 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 1,927.56 | 1,107.56 | 2,109 | 177,717 | ヘルスケア |
| TRANSURBAN GROUP | 900 | 900 | 875 | 73,760 | 資本財・サービス |
| TOLL HOLDINGS LTD | 460 | — | — | — | その他 |
| AWE LTD | 1,000 | — | — | — | エネルギー |
| CHALLENGER LTD | 1,866.72 | 1,516.72 | 1,070 | 90,193 | 金融 |
| SYDNEY AIRPORT | 3,350 | 1,550 | 930 | 78,333 | 資本財・サービス |
| JB HI-FI LTD | 90 | 215 | 394 | 33,267 | 一般消費・サービス |
| TATTS GROUP LTD | 4,382.08 | 3,583.72 | 1,257 | 105,951 | 一般消費・サービス |
| AGL ENERGY LTD | 550 | 730 | 1,168 | 98,442 | 公益事業 |
| BRAMBLES LTD | — | 250 | 242 | 20,383 | 資本財・サービス |
| APA GROUP | 3,893.85 | 3,993.85 | 3,342 | 281,568 | 公益事業 |
| DUET GROUP | 5,030.54 | 5,700.62 | 1,219 | 102,754 | 公益事業 |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | 45 | 45 | 153 | 12,955 | 一般消費・サービス |
| GRAINCORP LTD-A | 450 | — | — | — | 生活必需品 |
| IOOF HOLDINGS LTD | 2,120 | 720 | 621 | 52,337 | 金融 |
| MINERAL RESOURCES LTD | 99.95 | 99.95 | 41 | 3,476 | 資本財・サービス |
| MONADELPHOUS GROUP LTD | 168.78 | — | — | — | 資本財・サービス |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT | 180 | 180 | 117 | 9,930 | 金融 |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 100 | 50 | 301 | 25,399 | ヘルスケア |
| SPARK INFRASTRUCTURE GROUP | 2,000 | 1,000 | 188 | 15,835 | 公益事業 |
| FLEXIGROUP LTD | 1,307.42 | — | — | — | 金融 |
| CARDNO LTD | 214.35 | 214.35 | 63 | 5,326 | 資本財・サービス |
| AUTOMOTIVE HOLDINGS GROUP LT | 2,453.96 | 2,003.96 | 785 | 66,167 | 一般消費・サービス |
| THORN GROUP LTD | 242.19 | 249.11 | 49 | 4,186 | 一般消費・サービス |
| RETAIL FOOD GROUP LTD | 220 | 523.58 | 210 | 17,728 | 一般消費・サービス |
| G8 EDUCATION LTD | 469.65 | 487.4 | 150 | 12,685 | 一般消費・サービス |
| BEGA CHEESE LTD | 194.48 | — | — | — | 生活必需品 |
| SIRTEX MEDICAL LTD | 150 | 80 | 264 | 22,297 | ヘルスケア |
| NANOSONICS LTD | 40.37 | 40.37 | 5 | 442 | ヘルスケア |
| GREENCROSS LTD | 246.28 | — | — | — | ヘルスケア |
| AFFINITY EDUCATION GROUP LTD | 2,535.06 | — | — | — | 一般消費・サービス |
| ORORA LTD | 1,863.9 | 1,863.9 | 417 | 35,167 | 素材 |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 90 | 90 | 162 | 13,690 | 金融 |
| GBST HOLDINGS LTD | 564.41 | — | — | — | 情報技術 |
| RIDLEY CORP LTD | 125.71 | 125.71 | 16 | 1,381 | 生活必需品 |
| DOMINOS PIZZA ENTERPRISES L | 45 | 45 | 171 | 14,467 | 一般消費・サービス |

| 銘柄 | 期首 | | 当期末 | | 業種等 | |
|-------------------------|---------|-----------|-----------|---------|-----------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | | |
| TECHNOLOGY ONE LTD | 400 | 400 | 148 | 12,466 | 情報技術 | |
| SLATER & GORDON LTD | 610 | — | — | — | 一般消費・サービス | |
| SHINE CORPORATE LTD | 230.63 | 230.63 | 49 | 4,176 | 一般消費・サービス | |
| NEARMAP LTD | 800 | 800 | 37 | 3,133 | 情報技術 | |
| EBET LTD | 371.94 | 371.94 | 126 | 10,683 | 一般消費・サービス | |
| PACT GROUP HOLDINGS LTD | 71.25 | 71.25 | 32 | 2,748 | 素材 | |
| ARDENT LEISURE GROUP | — | 1,271.96 | 328 | 27,641 | 一般消費・サービス | |
| ファンド | 株数、金額 | 81,109.71 | 60,208.96 | 66,984 | 5,642,088 | |
| 合計 | 銘柄数<比率> | 66銘柄 | 58銘柄 | <91.9%> | | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を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で邦貨換算したものです。

(注2) < > は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首 | | 当期末 | | |
|------------------------------|---------|-----------|---------|--------|---------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 千口 | 千口 | 千円 | 千円 | |
| (オーストラリア) | | | | | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 151.983 | 81.983 | 249 | 20,992 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 170.951 | 170.951 | 254 | 21,454 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 110 | — | — | — | |
| SCENTRE GROUP | 59.808 | 59.808 | 224 | 18,941 | |
| BWP TRUST | 50 | 50 | 148 | 12,466 | |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 86.333 | 36.333 | 257 | 21,667 | |
| WESTFIELD CORP | 18 | 18 | 175 | 14,767 | |
| ARDENT LEISURE GROUP | 124.031 | — | — | — | |
| GOODMAN GROUP | 195 | 198.43 | 1,115 | 93,931 | |
| FEDERATION CENTRES | 365 | 115 | 301 | 25,378 | |
| 合計 | 口数、金額 | 1,331.106 | 730.505 | 2,725 | 229,598 |
| | 銘柄数<比率> | 10銘柄 | 8銘柄 | <3.7%> | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を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で邦貨換算したものです。

(注2) < > は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

| 銘柄別 | 当 期 末 | |
|-------------------------------|------------|----------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 SPI 200 INDEX (オーストラリア) | 百万円 136 | 百万円 — |

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を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で邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年9月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 5,642,088 | 90.7 |
| 投資信託証券 | 229,598 | 3.7 |
| コール・ローン等、その他 | 350,779 | 5.6 |
| 投資信託財産総額 | 6,222,467 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を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で邦貨換算したものです。なお、9月24日における邦貨換算レートは、1オーストラリア・ドル=84.23円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(6,148,908千円)の投資信託財産総額(6,222,467千円)に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年9月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------|----------------|
| (A) 資産 | 6,249,417,516円 |
| コール・ローン等 | 237,095,106 |
| 株式（評価額） | 5,642,088,699 |
| 投資信託証券（評価額） | 229,598,988 |
| 未収入金 | 27,542,400 |
| 未取配当金 | 90,289,604 |
| 差入委託証拠金 | 22,802,719 |
| (B) 負債 | 109,797,374 |
| 未払金 | 29,797,374 |
| 未払解約金 | 80,000,000 |
| (C) 純資産総額（A－B） | 6,139,620,142 |
| 元本 | 3,942,540,371 |
| 次期繰越損益金 | 2,197,079,771 |
| (D) 受益権総口数 | 3,942,540,371口 |
| 1万口当り基準価額（C/D） | 15,573円 |

*期首における元本額は4,349,625,892円、当期中における追加設定元本額は1,811,960円、同解約元本額は408,897,481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、オーストラリア好配当株オープン（毎月決算型）11,288,461円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド3,931,251,910円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は15,573円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月24日 至2015年9月24日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 152,808,027円 |
| 受取配当金 | 151,630,746 |
| 受取利息 | 1,093,012 |
| その他収益金 | 84,269 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 1,868,147,934 |
| 売買益 | 85,388,197 |
| 売買損 | △ 1,953,536,131 |
| (C) 先物取引等損益 | △ 24,872,361 |
| 取引損 | △ 24,872,361 |
| (D) その他費用 | △ 2,957,951 |
| (E) 当期損益金（A+B+C+D） | △ 1,743,170,219 |
| (F) 前期繰越損益金 | 4,259,764,469 |
| (G) 解約差損益金 | △ 321,102,519 |
| (H) 追加信託差損益金 | 1,588,040 |
| (I) 合計（E+F+G+H） | 2,197,079,771 |
| 次期繰越損益金（I） | 2,197,079,771 |

(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。

★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

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | | 公社債組入比率 | 純資産総額 |
|--------------------|--------|----------|--------|---------------|-----------|-----------|
| | 円 | 税金 分配 | み 金 | 期騰 落 中率 | | |
| 3 期末 (2013年 9月24日) | 10,006 | | 円 0 | % 0.0 | % 60.0 | 百万円 80 |
| 4 期末 (2014年 3月24日) | 10,007 | | 円 0 | % 0.0 | % 58.8 | 75 |
| 5 期末 (2014年 9月22日) | 10,007 | | 円 0 | % 0.0 | % 59.0 | 65 |
| 6 期末 (2015年 3月23日) | 10,006 | | 円 0 | △ 0.0 | % 39.8 | 70 |
| 7 期末 (2015年 9月24日) | 10,006 | | 円 0 | % 0.0 | % 42.5 | 48 |

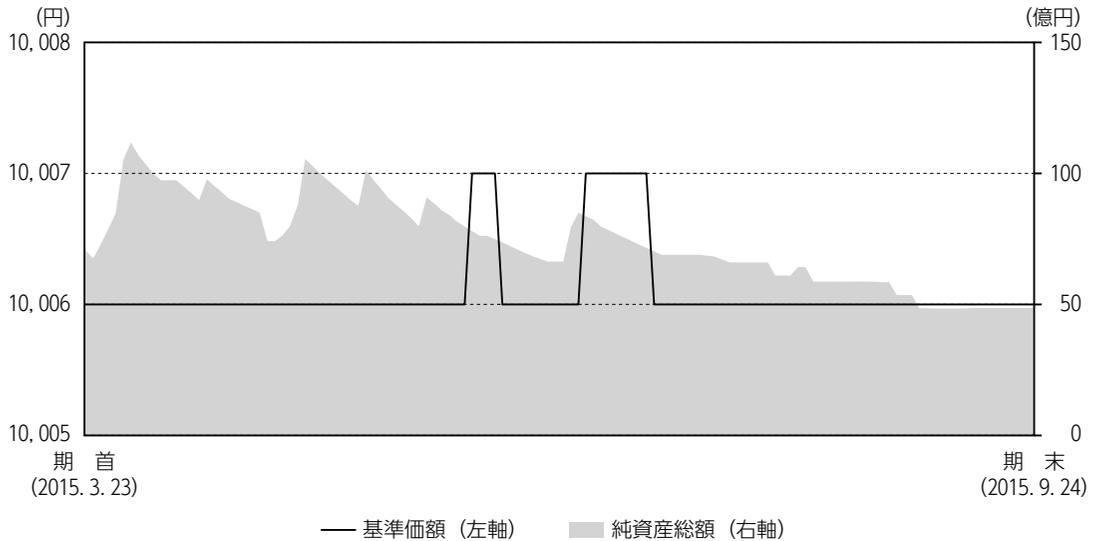
(注1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンドの資金をスイッチングにより一時滞留させる受皿としての役割を持ったファンドであり、マザーファンドおよび短期金融資産による安全運用を行いません。そのため、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：10,006円

期末：10,006円

騰落率：0.0%

■ 基準価額の主な変動要因

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額は横ばいとなりました。

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

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 公 組 入 社 比 | 債 率 |
|------------------|-------------|--------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | | |
| (期首) 2015年 3月23日 | 円 10,006 | % — | | % 39.8 |
| 3月末 | 10,006 | 0.0 | | 33.8 |
| 4月末 | 10,006 | 0.0 | | 42.9 |
| 5月末 | 10,006 | 0.0 | | 51.2 |
| 6月末 | 10,007 | 0.0 | | 40.9 |
| 7月末 | 10,006 | 0.0 | | 43.7 |
| 8月末 | 10,006 | 0.0 | | 52.0 |
| (期末) 2015年 9月24日 | 10,006 | 0.0 | | 42.5 |

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

○国内短期債券市況

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低位での金利水準が続き、無担保コール翌日物金利は0.06~0.08%を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、0.02~△0.08%程度で推移しました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

引続き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まいります。

ポートフォリオについて

○当ファンド

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が少額であったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目 | 当期 | |
|------------|---------------------------|---|
| | 2015年3月24日 ～2015年9月24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) | 9 |

(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

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

引続き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まいります。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------|---------------------------|---------|--|
| | (2015. 3. 24~2015. 9. 24) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 2円 | 0.016% | 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10,006円です。 |
| (投信会社) | (0) | (0.004) | 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) | (1) | (0.011) | 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) | (0) | (0.001) | 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 | 0.000 | 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) | (0.000) | 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 | 2 | 0.017 | |

(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) 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3) 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

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年3月24日から2015年9月24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・マネーアセット・マザーファンド | 29,946 | 30,000 | 39,925 | 40,000 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビー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) 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

(2015年3月24日から2015年9月24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 |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 14,099 | 2,000 | 14.2 | — | — | — |
| コール・ローン | 492,818 | — | — | — | — | — |

(注) 平均保有割合0.4%

※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

親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | 当 期 末 | |
|---------------------|--------|--------|--------|
| | 口 数 | 口 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 | 48,491 | 38,512 | 38,585 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年9月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------|--------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| ダイワ・マネーアセット・マザーファンド | 38,585 | 79.3 |
| コール・ローン等、その他 | 10,097 | 20.7 |
| 投資信託財産総額 | 48,682 | 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

2015年9月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-------------|
| (A) 資産 | 48,682,530円 |
| コール・ローン等 | 10,097,152 |
| ダイワ・マネーアセット・マザーファンド(評価額) | 38,585,378 |
| (B) 負債 | 13,457 |
| 未払信託報酬 | 13,272 |
| その他未払費用 | 185 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 48,669,073 |
| 元本 | 48,639,088 |
| 次期繰越損益金 | 29,985 |
| (D) 受益権総口数 | 48,639,088口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 10,006円 |

*期首における元本額は70,585,698円、当期中における追加設定元本額は135,478,203円、同解約元本額は157,424,813円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,006円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月24日 至2015年9月24日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|------------|
| (A) 配当等収益 | 6,561円 |
| 受取利息 | 6,561 |
| (B) 有価証券売買損益 | 7,231 |
| 売買益 | 5,884 |
| 売買損 | 1,347 |
| (C) 信託報酬等 | △ 13,457 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 335 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 334 |
| (F) 追加信託差損益金 | 29,984 |
| (配当等相当額) | (46,705) |
| (売買損益相当額) | (△ 16,721) |
| (G) 合計 (D + E + F) | 29,985 |
| 次期繰越損益金 (G + H) | 29,985 |
| 追加信託差損益金 | 29,984 |
| (配当等相当額) | (46,705) |
| (売買損益相当額) | (△ 16,721) |
| 分配準備積立金 | 311 |
| 繰越損益金 | △ 310 |

(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）」の表を参照。

■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 | 250円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 46,705 |
| (d) 分配準備積立金 | 61 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 47,016 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e-f) | 47,016 |
| (h) 受益権総口数 | 48,639,088口 |

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」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。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年3月23日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えくださいますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）は10,007円です。」

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（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）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（2014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（2015年9月24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25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

(2015年3月24日から2015年9月24日まで)

| 買 付 | | | 売 付 | | |
|-----------------------|-----------|--|-----|-----|--|
| 銘 柄 | 金 額 | | 銘 柄 | 金 額 | |
| | 千円 | | | 千円 | |
| 540 国庫短期証券 2015/9/24 | 1,699,999 | | | | |
| 555 国庫短期証券 2015/12/7 | 1,500,000 | | | | |
| 541 国庫短期証券 2015/9/28 | 1,499,998 | | | | |
| 532 国庫短期証券 2015/8/17 | 1,499,995 | | | | |
| 521 国庫短期証券 2015/6/29 | 1,499,925 | | | | |
| 536 国庫短期証券 2015/9/7 | 1,000,000 | | | | |
| 548 国庫短期証券 2015/11/2 | 1,000,000 | | | | |
| 554 国庫短期証券 2015/11/30 | 1,000,000 | | | | |
| 534 国庫短期証券 2015/8/24 | 999,997 | | | | |
| 535 国庫短期証券 2015/8/31 | 999,990 | | | | |

(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、2015年9月24日現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンド（10,064,394千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

| 区 分 | 2015年9月24日現在 | | | | | | |
|------|-----------------|-----------------|-----------|--------------------|-----------|--------|-----------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組入比率 | うちBB格 以下組入 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 千円 5,400,000 | 千円 5,399,999 | % 53.6 | % — | % — | % — | % 53.6 |

(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。

(2)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

| 2015年9月24日現在 | | | | | | |
|--------------|--------------|-------|-----------------|-----------------|------------|--|
| 区 分 | 銘 柄 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 | |
| 国債証券 | 541 国庫短期証券 | — % | 千円 1,500,000 | 千円 1,499,999 | 2015/09/28 | |
| | 548 国庫短期証券 | — | 1,000,000 | 1,000,000 | 2015/11/02 | |
| | 550 国庫短期証券 | — | 400,000 | 400,000 | 2015/11/09 | |
| | 554 国庫短期証券 | — | 1,000,000 | 1,000,000 | 2015/11/30 | |
| | 555 国庫短期証券 | — | 1,500,000 | 1,500,000 | 2015/12/07 | |
| 合 計 | 銘 柄 数 金 額 | 5 銘柄 | 5,400,000 | 5,399,999 | | |

(注) 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 運用報告書 第3期（決算日 2014年12月9日）

（計算期間 2013年12月10日～2014年12月9日）

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第3期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

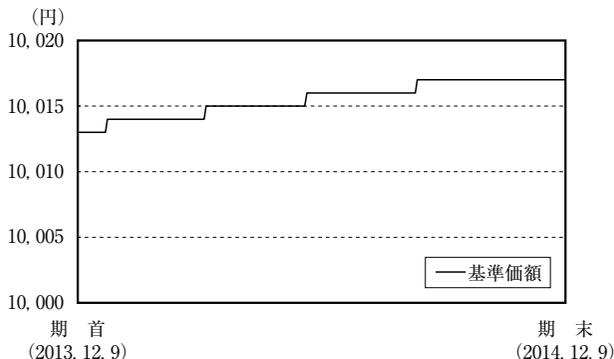
| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 円建ての債券 |
| 運用方法 | ①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下 |

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額の推移



| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 公 社 債 組 入 率 |
|-----------------|---------|---------|-------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | |
| (期首) 2013年12月9日 | 10,013 | — | 64.6 |
| 12月末 | 10,013 | 0.0 | 66.4 |
| 2014年1月1日 | 10,014 | 0.0 | 76.5 |
| 2月末 | 10,014 | 0.0 | 77.7 |
| 3月末 | 10,015 | 0.0 | 70.6 |
| 4月末 | 10,015 | 0.0 | 72.5 |
| 5月末 | 10,015 | 0.0 | 77.2 |
| 6月末 | 10,016 | 0.0 | 66.1 |
| 7月末 | 10,016 | 0.0 | 76.4 |
| 8月末 | 10,017 | 0.0 | 80.2 |
| 9月末 | 10,017 | 0.0 | 66.3 |
| 10月末 | 10,017 | 0.0 | 66.6 |
| 11月末 | 10,017 | 0.0 | 85.2 |
| (期末) 2014年12月9日 | 10,017 | 0.0 | 53.3 |

(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：10,013円 期末：10,017円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】
 利息収入により、基準価額は値上がりしました。

◆投資環境について

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。また、2014年10月末には追加金融緩和を実施し、長期国債を中心とする資産買い入れを一層拡大しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場ではおおむね低位での金利水準が続き、無担保コール翌日物金利は0.06%台を中心に推移しました。国庫短期証券(3カ月物)の利回りは0.06%程度で始まりましたが、日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.01%程度まで低下して期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

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まいります。

◆ポートフォリオについて

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定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や参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

引続き、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まいります。

■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 | — |
| 合 計 | — |

(注) 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。

■売買および取引の状況
 公 社 債

(2013年12月10日から2014年12月9日まで)

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|---------|------------|---------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 内 | 国 債 証 券 | 21,368,540 | (19,920,000) |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子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

(2013年12月10日から2014年12月9日まで)

| 当 期 | | | | |
|-----------------------|-----------|-----|-----|-----|
| 買 付 | | 売 付 | | |
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 | 金 額 |
| | 千円 | | | 千円 |
| 496 国庫短期証券 2015/3/9 | 2,999,997 | | | |
| 486 国庫短期証券 2014/12/3 | 1,999,974 | | | |
| 476 国庫短期証券 2014/12/1 | 1,799,916 | | | |
| 490 国庫短期証券 2015/2/9 | 999,950 | | | |
| 492 国庫短期証券 2015/2/16 | 999,945 | | | |
| 493 国庫短期証券 2015/2/23 | 799,984 | | | |
| 473 国庫短期証券 2014/11/17 | 799,952 | | | |
| 475 国庫短期証券 2014/11/25 | 799,936 | | | |
| 454 国庫短期証券 2014/8/25 | 799,922 | | | |
| 434 国庫短期証券 2014/6/2 | 799,920 | | | |

(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 | | | | | | | |
|------|-----------|-----------|----------|--------------------|-----------|---|------|------|
| | 額面金額 | | 組入 比率 | うちBB格 以下組入 率 | 残存期間別組入比率 | | | 5年未満 |
| | 千円 | 千円 | | | % | % | % | |
| 国債証券 | 6,340,000 | 6,339,912 | 53.3 | — | — | — | 53.3 | |

(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。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | |
|------|------------|-----|-----------|-----------|------------|--|
| | 銘 柄 | 年利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 | |
| | | % | 千円 | 千円 | | |
| 国債証券 | 479 国庫短期証券 | — | 340,000 | 339,999 | 2014/12/15 | |
| | 481 国庫短期証券 | — | 200,000 | 199,999 | 2014/12/22 | |
| | 490 国庫短期証券 | — | 1,000,000 | 999,965 | 2015/02/09 | |
| | 492 国庫短期証券 | — | 1,000,000 | 999,961 | 2015/02/16 | |
| | 493 国庫短期証券 | — | 800,000 | 799,988 | 2015/02/23 | |
| | 496 国庫短期証券 | — | 3,000,000 | 2,999,997 | 2015/03/09 | |
| 合計 | 銘柄数 | 6銘柄 | | | | |
| | 金額 | | 6,340,000 | 6,339,912 | | |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2014年12月9日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 6,339,912 | 53.3 |
| コール・ローン等、その他 | 5,565,721 | 46.7 |
| 投資信託財産総額 | 11,905,634 | 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

2014年12月9日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A)資 産 | 11,905,634,225円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 5,565,721,829 |
| 公 社 債(評価額) | 6,339,912,396 |
| (B)負 債 | — |
| (C)純 資 産 総 額 (A-B) | 11,905,634,225 |
| 元 本 | 11,884,993,463 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 20,640,762 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 11,884,993,463口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 10,017円 |

* 期首における元本額は7,555,798,942円、当期中における追加設定元本額は7,270,665,044円、同解約元本額は2,941,470,523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・グローバル高利回りCBファンドII 為替ヘッジあり4,998,495円、ダイワ・グローバル高利回りCBファンドII 為替ヘッジなし2,499,247円、ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンドII(為替ヘッジあり)999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、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04(為替ヘッジあり/限定追加型)999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07(為替ヘッジあり/限定追加型)999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10(為替ヘッジあり/限定追加型)999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48,492,145円、ダイワ・スイス高配当株ツインα(毎月分配型)2,996,106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)29,988,005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)1,999,201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)1,002,195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)3,011,774円、ダイワ新興国ハイインカム・プラス-インカムチェンジ(積立型) - 7,515,709円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) - シフト11-4,694,526,114円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型) - シフト12 - 7,087,950,486円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,017円です。

■損益の状況

当期 自2013年12月10日 至2014年12月9日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 2,880,333円 |
| 受 取 利 息 | 2,880,333 |
| (B)有価証券売買損益 | 1,353 |
| 売 買 益 | 1,353 |
| (C)当 期 損 益 金 (A+B) | 2,881,686 |
| (D)前 期 繰 越 損 益 金 | 9,949,597 |
| (E)解 約 差 損 益 金 | △ 4,529,477 |
| (F)追加信託差損益金 | 12,338,956 |
| (G)合 計 (C+D+E+F) | 20,640,762 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 20,640,762 |

(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。

《お知らせ》

●書面決議手続きの改正について

重大な約款変更や繰上償還の際に行なう書面決議について、2014年12月1日施行の法改正により以下の点が変更されたことに伴い、信託約款の該当箇所の変更を行ないました。

- ・書面決議の可決要件が、「受益者の半数以上の賛成かつ受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」から「受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」に変更されました。
- ・投資信託の併合を行なう際、すべての場合で書面決議が必要とされてきましたが、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものであるときは、当該併合に関する書面決議が不要となりました。
- ・書面決議に反対した受益者による受益権買取請求の規定について、一部解約請求に応じる投資信託（当ファンドは該当します。）には適用されなくなりました。