

「ダイワMMF(マネー・マネージメント・ファンド)」 現在の運用状況について

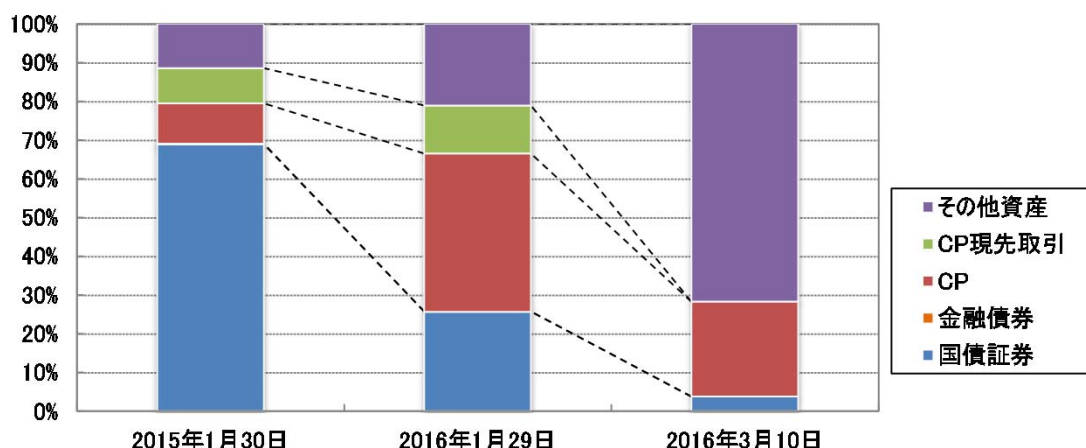
2016年3月15日

平素は、「ダイワMMF(マネー・マネージメント・ファンド)」をご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。
当ファンドの現在の運用状況について、お知らせいたします。

2016年3月10日時点でのポートフォリオ状況は、以下の通りとなっております。

【ポートフォリオ状況】

種類		種類別構成		
		比率		
		2015年1月30日	2016年1月29日	2016年3月10日
公社債	国債証券	68.8%	25.7%	3.8%
	金融債券	0.2%	---	---
短期金融資産	CP	10.4%	40.8%	24.5%
	CP現先取引	9.1%	12.4%	---
	その他資産	11.5%	21.1%	71.7%
合計		100.0%	100.0%	100.0%



※比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

※短期金融資産における「その他資産」は、コール・ローン(翌日物)、日銀割引手形、指定金銭信託、預金、未収金、未払金等を含みます。

当資料のお取り扱いにおけるご注意

■当資料は、ファンドの状況や関連する情報等をお知らせするために大和投資信託により作成されたものです。■当ファンドのお申込みにあたっては、販売会社よりお渡す「投資信託説明書(交付目論見書)」の内容を必ずご確認ください。■投資信託は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではありません。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。■投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。証券会社以外でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。■当資料は、信頼できると考えられる情報源から作成していますが、その正確性・完全性を保証するものではありません。運用実績などの記載内容は過去の実績であり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。また、税金、手数料等を考慮していませんので、投資者のみなさまの実質的な投資成果を示すものではありません。■当資料の中で記載されている内容、数値、図表、意見等は資料作成時点のものであり、今後予告なく変更されることがあります。■分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

販売会社等についてのお問い合わせ⇒ 大和投資信託 フリーダイヤル0120-106212(営業日の9:00~17:00) HP <http://www.daiwa-am.co.jp/>

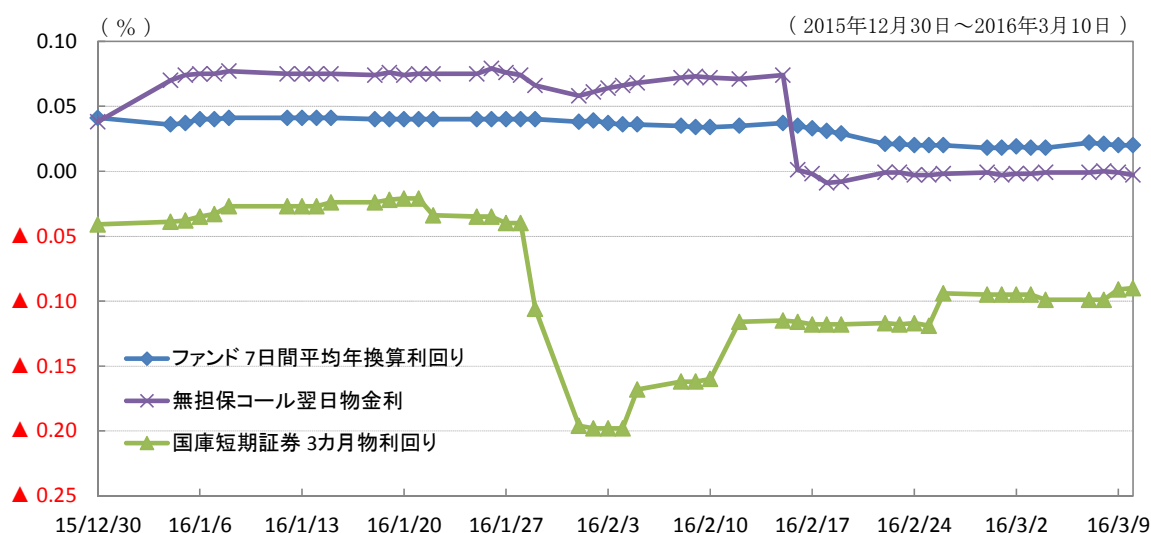
＜国内短期金融市場の動向および1月末以降の運用状況について＞

日銀の国債買い入れの影響などにより、短期国債(3カ月物)の利回りはマイナス圏で推移していましたが、マイナス金利導入が発表された1月29日以降、利回りは一段と低下しました。

無担保コール翌日物金利については、おおむね0.07%台を中心に推移していましたが、日銀のマイナス金利が適用された2月16日以降は0%近辺から小幅なマイナス圏で推移し、コール市場の流動性も低下しました。

CP金利については、銘柄によってまちまちでしたが、マイナス金利導入の発表後は銘柄間格差が縮小し、ほとんどの銘柄で0%近辺まで低下しました。

ファンドの利回りおよび短期金融市場金利の推移



※7日間平均年換算利回りは、課税前の7日間平均利回りを年率換算したものです。

(出所)
ブルームバーグより
大和投資信託作成

このような状況下、元本の安全性を最優先に運用を行った結果、短期金融市場の金利低下などを背景にファンドの平均利回りは低下しました。

種類別では、マイナス金利の国債の購入を見送ったため、国債の組入比率が低下しました。また、流動性と安全性に配慮してCPへの投資を検討した結果、CPの組入比率も低下しました。一方、その他資産の比率は上昇しました。

＜今後の運用方針＞

国内短期金融市場では、上述の通り利回り水準が低下しており、運用環境も厳しさを増しておりますが、引き続き元本の安全性を最優先に運用を行ってまいります。

以上

ダイワMMF(マネー・マネージメント・ファンド)

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

ファンドの目的・特色

ファンドの目的

- 内外の公社債およびコマーシャル・ペーパーに投資し、安定した収益の確保をめざします。

ファンドの特色

1. 安全性の高い公社債、短期金融商品等(コマーシャル・ペーパー、譲渡性預金証書、コール・ローン)を中心に投資します。
 - わが国の国債証券、政府保証債券および日銀が発行する債券(以下「国債等」といいます。)に投資します。
 - 譲渡性預金証書、コール・ローンなどで運用することで流動性の確保をはかります。
 - 国債等を除く有価証券または金融商品は、取得時において、信用格付業者等によりP-2またはA-2相当以上の短期信用格付け、もしくはBBBまたはBaa2相当以上の長期信用格付けを受けているもの(委託会社が同等と判断するものを含みます。)とします。
 - 投資する有価証券または金融商品は、残存期間が1年以内のものとし、平均残存期間は180日以内とします。
2. 毎日決算を行ない、原則として信託財産から生ずる利益の全額を分配します。
 - ◆将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※外貨建資産は、円貨で約定し円貨で決済する資産に限るものとし、投資割合には、制限を設けません。

※くわしくは「投資信託説明書(交付目論見書)」の「ファンドの目的・特色」をご覧ください。

投資リスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。投資信託は預貯金とは異なります。基準価額の変動要因は、以下のとおりです。「公社債等の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)」、「その他(解約申込みに伴うリスク等)」
- ※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。
※くわしくは「投資信託説明書(交付目論見書)」の「投資リスク」をご覧ください。

ダイワMMF(マネー・マネージメント・ファンド)

お申し込みの際は、必ず「投資信託説明書(交付目論見書)」をご覧ください。

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
購入時手数料	ありません。	—
換金時手数料	ありません。	—
信託財産留保額	1万口につき10円	購入日から起算して換金申込受付日の翌営業日の前日までの日数が30日未満の場合、左記の額を、換金代金の中から差引き、信託財産に返戻します。
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
	料率等	費用の内容
運用管理費用 (信託報酬)	運用管理費用の総額は、信託元本の額に、次に掲げる率(以下「運用管理費用(年率)」といいます。)を乗じて得た額とし、毎計算期末に計上します。 各週の最初の営業日(委託会社の営業日をいいます。以下同じ。)から翌週以降の最初の営業日の前日までの毎計算期にかかる運用管理費用(年率)は、当該各週の最初の営業日の前日までの7日間の元本1万口当たりの収益分配金合計額の年換算収益分配率(以下「収益分配率」といいます。)に0.0711を乗じて得た率以内の率とします。ただし、当該率が1.0135%以上の場合には運用管理費用(年率)は1.0135%とし、当該率が0.3555%以下の場合には運用管理費用(年率)は0.3555%以内の率とします。なお、収益分配率が0.3555%以下の場合には、運用管理費用(年率)は当該収益分配率以内の率とします。	運用管理費用は、毎月の最終営業日または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
その他の費用・手数料	(注)	監査報酬、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を信託財産でご負担いただきます。

(注)「その他の費用・手数料」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

※くわしくは「投資信託説明書(交付目論見書)」の「手続・手数料等」をご覧ください。

設定・運用:

大和投資信託

Daiwa Asset Management

商号等

大和証券投資信託委託株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第352号

加入協会

一般社団法人投資信託協会

一般社団法人日本投資顧問業協会

ダイワMMF(マネー・マネージメント・ファンド) 取扱い販売会社

販売会社名 (業態別、50音順) (金融商品取引業者名)		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会
株式会社愛知銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第12号	○			
株式会社あおぞら銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第8号	○	○		
株式会社青森銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第1号	○			
株式会社秋田銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第2号	○			
株式会社足利銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第43号	○			
株式会社池田泉州銀行	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第6号	○	○		
株式会社大分銀行	登録金融機関	九州財務局長(登金)第1号	○			
沖縄県労働金庫	登録金融機関	沖縄総合事務局長(登金)第8号				
株式会社香川銀行	登録金融機関	四国財務局長(登金)第7号	○			
株式会社関西アーバン銀行	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第16号	○	○		
株式会社北九州銀行	登録金融機関	福岡財務支局長(登金)第117号	○	○		
岐阜信用金庫	登録金融機関	東海財務局長(登金)第35号	○			
株式会社きらやか銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第15号	○			
株式会社群馬銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第46号	○	○		
株式会社京葉銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第56号	○			
株式会社高知銀行	登録金融機関	四国財務局長(登金)第8号	○			
株式会社四国銀行	登録金融機関	四国財務局長(登金)第3号	○			
四国労働金庫	登録金融機関	四国財務局長(登金)第26号				
株式会社静岡銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第5号	○	○		
静岡県労働金庫	登録金融機関	東海財務局長(登金)第72号				
株式会社荘内銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第6号	○			
湘南信用金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第192号	○			
株式会社常陽銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第45号	○	○		
スルガ銀行株式会社	登録金融機関	東海財務局長(登金)第8号	○			
全国信用協同組合連合会	登録金融機関	関東財務局長(登金)第300号				
株式会社第三銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第16号	○			
株式会社第四銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第47号	○	○		
株式会社大東銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第17号	○			
株式会社千葉銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第39号	○	○		
株式会社千葉興業銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第40号	○	○		
中央労働金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第259号				
株式会社中京銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第17号	○			
株式会社中国銀行	登録金融機関	中国財務局長(登金)第2号	○	○		
株式会社筑波銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第44号	○			
東海労働金庫	登録金融機関	東海財務局長(登金)第70号				
東京海上日動火災保険株式会社	登録金融機関	関東財務局長(登金)第135号	○			
株式会社東京都民銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第37号	○	○		
株式会社東邦銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第7号	○			
東北労働金庫	登録金融機関	東北財務局長(登金)第68号				
株式会社東和銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第60号	○			
株式会社栃木銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第57号	○			
株式会社鳥取銀行	登録金融機関	中国財務局長(登金)第3号	○			
株式会社長野銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第63号	○			
長野県労働金庫	登録金融機関	関東財務局長(登金)第268号				
株式会社名古屋銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第19号	○			
株式会社八十二銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第49号	○	○		
株式会社百五銀行	登録金融機関	東海財務局長(登金)第10号	○	○		
株式会社百十四銀行	登録金融機関	四国財務局長(登金)第5号	○	○		

上記の販売会社については今後変更となる場合があります。また、新規のご購入の取り扱いを行っていない場合がありますので、各販売会社にご確認ください。

ダイワMMF(マネー・マネージメント・ファンド) 取扱い販売会社

販売会社名 (業態別、50音順) (金融商品取引業者名)		登録番号	加入協会			
			日本証券業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会
株式会社広島銀行	登録金融機関	中国財務局長(登金)第5号	○	○		
株式会社福井銀行	登録金融機関	北陸財務局長(登金)第2号	○	○		
株式会社福島銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第18号	○			
株式会社北陸銀行	登録金融機関	北陸財務局長(登金)第3号	○	○		
北陸労働金庫	登録金融機関	北陸財務局長(登金)第36号				
株式会社北海道銀行	登録金融機関	北海道財務局長(登金)第1号	○	○		
北海道労働金庫	登録金融機関	北海道財務局長(登金)第38号				
株式会社北國銀行	登録金融機関	北陸財務局長(登金)第5号	○	○		
三井住友海上火災保険株式会社	登録金融機関	関東財務局長(登金)第141号	○			
株式会社三井住友銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第54号	○	○		○
三井住友信託銀行株式会社	登録金融機関	関東財務局長(登金)第649号	○	○	○	
三井生命保険株式会社	登録金融機関	関東財務局長(登金)第122号	○			
株式会社みなと銀行	登録金融機関	近畿財務局長(登金)第22号	○	○		
株式会社武蔵野銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第38号	○			
株式会社もみじ銀行	登録金融機関	中国財務局長(登金)第12号	○	○		
株式会社山形銀行	登録金融機関	東北財務局長(登金)第12号	○			
株式会社山口銀行	登録金融機関	中国財務局長(登金)第6号	○	○		
株式会社横浜銀行	登録金融機関	関東財務局長(登金)第36号	○	○		
株式会社琉球銀行	登録金融機関	沖縄総合事務局(登金)第2号	○			
あかつき証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第67号	○	○		
安藤証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第1号	○			
池田泉州TT証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第370号	○			
今村証券株式会社	金融商品取引業者	北陸財務局長(金商)第3号	○			
岩井コスモ証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第15号	○	○		
エイチ・エス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第35号	○	○		
エース証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第6号	○			
SMBCフレンド証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第40号	○			○
株式会社SBI証券	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第44号	○	○		○
岡地証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第5号	○			
カブドットコム証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第61号	○	○		
共和証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第64号	○		○	
極東証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第65号	○			○
クレディ・スイス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第66号	○	○	○	○
静岡東海証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第8号	○			
島大証券株式会社	金融商品取引業者	北陸財務局長(金商)第6号	○			
株式会社証券ジャパン	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第170号	○			
大熊本証券株式会社	金融商品取引業者	九州財務局長(金商)第1号	○			
大和証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第108号	○	○	○	○
高木証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第20号	○			
立花証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第110号	○	○		
ちばぎん証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第114号	○			
DBJ証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第149号	○			
東海東京証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第140号	○	○		○
内藤証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第24号	○			
西日本シティTT証券株式会社	金融商品取引業者	福岡財務支局長(金商)第75号	○			
日産証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第131号	○	○		
日本アジア証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第134号	○			
ニュース証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第138号	○			

上記の販売会社については今後変更となる場合があります。また、新規のご購入の取り扱いを行っていない場合がありますので、各販売会社にご確認ください。

ダイワMMF(マネー・マネージメント・ファンド) 取扱い販売会社

販売会社名 (業態別、50音順) (金融商品取引業者名)	登録番号	加入協会				
		日本証券業協会	一般社団法人 金融先物 取引業協会	一般社団法人 日本投資 顧問業協会	一般社団法人 第二種金融商 品取引業協会	
浜銀TT証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第1977号	○			
ばんせい証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第148号	○			
PWM日本証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第50号	○			
日の出証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第31号	○			
ひろぎんウツミ屋証券株式会社	金融商品取引業者	中国財務局長(金商)第20号	○			
廣田証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長(金商)第33号	○			
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	
丸三証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第167号	○			
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第2336号	○	○	○	○
水戸証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第181号	○		○	
むさし証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第105号	○			○
山形證券株式会社	金融商品取引業者	東北財務局長(金商)第3号	○			
山和証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第190号	○			
UBS証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第2633号	○	○	○	○
豊証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長(金商)第21号	○	○		
リテラ・クリア証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長(金商)第199号	○			

上記の販売会社については今後変更となる場合があります。また、新規のご購入の取り扱いを行っていない場合がありますので、各販売会社にご確認ください。