

# フリーファイナンシャルファンド

## 運用報告書(全体版)

(2015年5月29日～2015年11月29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、「フリーファイナンシャルファンド」の上記期間中に行なわれました決算について、運用状況と分配金などをまとめてご報告いたします。

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。

### ★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／国内／債券                                                                               |
| 信託期間   | 無期限                                                                                       |
| 運用方針   | 主として公社債およびコマーシャル・ペーパーへの投資により、安定した収益の確保を目的として、安定運用を行ないます。                                  |
| 主要投資対象 | わが国および外国の公社債、コマーシャル・ペーパー                                                                  |
| 投資制限   | 外貨建資産への投資割合は、純資産総額の30%以下                                                                  |
| 分配方針   | 毎日決算を行ない、運用収益（純資産総額の元本超過額）の全額を収益分配金に充当いたします。<br>分配金は、税金を差引いたうえで、毎月最終営業日にまとめて全額自動的に再投資します。 |

## 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

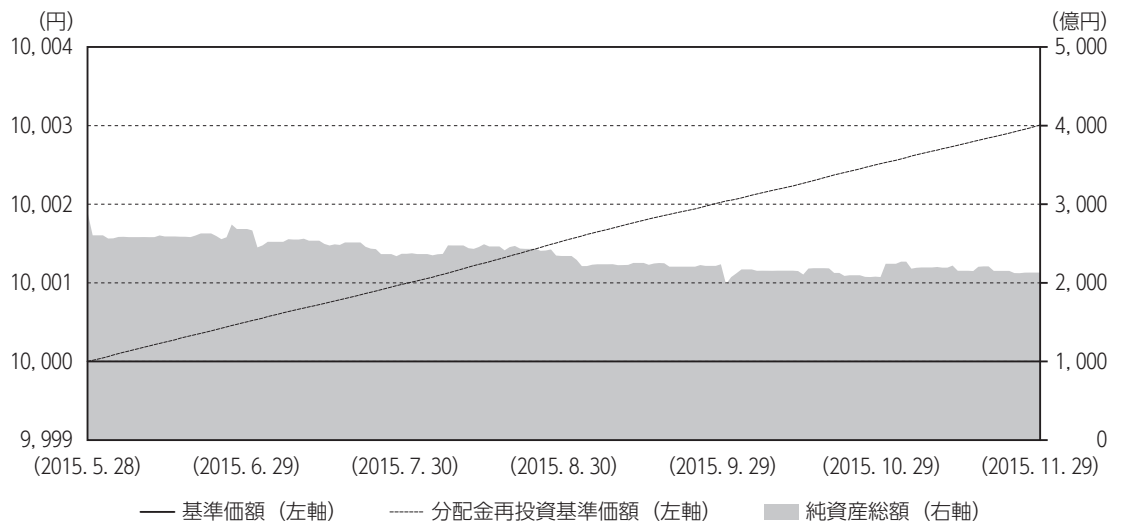
（営業日の9:00～17:00）

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

<0932>

《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あり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 実際には、分配金は税金を差引いたうえで再投資されます。

■ 基準価額・騰落率

2015年 5月28日：10,000円

2015年11月29日：10,000円（既払分配金 3 円00銭 7 厘）

騰 落 率：0.03%（分配金再投資ベース）

■ 基準価額の主な変動要因

基準価額は10,000円で安定して推移しました。

## 投資環境について

### ○国内短期金融市況

当期間を通じて、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金利が続き、無担保コール翌日物金利は0.07%台を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.11～0.00%程度で推移しました。

## 前期末における「今後の運用方針」

翌日物の現先取引を主体に運用しつつ、信用力の高いコマーシャル・ペーパー（C P）も随時購入することで、収益の確保に努めてまいります。

## ポートフォリオについて

翌日物の現先取引を主体に運用しつつ、信用力の高いC Pも随時購入することで、収益の確保に努めました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは、決算時の元本の安全性に配慮した運用を行なっているためベンチマークおよび参考指数はありません。

分配金について

当期間中の収益分配金の合計は 1 万口当り 3 円00銭 7 厘（税込み）となりました。

■各期間における分配率の状況

| 期 間       | 年利回り（税込み） |
|-----------|-----------|
| 2015年 6 月 | 0.059%    |
| 7 月       | 0.057%    |
| 8 月       | 0.064%    |
| 9 月       | 0.058%    |
| 10月       | 0.057%    |
| 11月       | 0.057%    |

（注 1）年利回りは前月最終営業日～当月最終営業日の前日までの分配金合計額に基づいて算出。  
（注 2）表中の数値は過去の実績であり、将来を保証するものではありません。

《今後の運用方針》

翌日物の現先取引を主体に運用しつつ、信用力の高い C P も随時購入することで、収益の確保に努めてまいります。

■収益分配金のお知らせ

(2015年 5月29日～2015年11月29日)

| 期 間       | 1 万 口 (元 本 1 万 円) 当 り 分 配 金 |            |            |            |            |
|-----------|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|
|           | 税 込 み                       | 所 得 税      | 地 方 税      | 源 泉 税 合 計  | お 手 取 り 額  |
| 2015年 6 月 | 0 円52銭 1 厘                  | 0 円07銭 9 厘 | 0 円02銭 6 厘 | 0 円10銭 5 厘 | 0 円41銭 6 厘 |
| 7 月       | 0 円48銭 9 厘                  | 0 円07銭 4 厘 | 0 円02銭 4 厘 | 0 円09銭 8 厘 | 0 円39銭 1 厘 |
| 8 月       | 0 円55銭 2 厘                  | 0 円08銭 4 厘 | 0 円02銭 7 厘 | 0 円11銭 1 厘 | 0 円44銭 1 厘 |
| 9 月       | 0 円47銭 9 厘                  | 0 円07銭 3 厘 | 0 円02銭 3 厘 | 0 円09銭 6 厘 | 0 円38銭 3 厘 |
| 10月       | 0 円47銭 5 厘                  | 0 円07銭 2 厘 | 0 円02銭 3 厘 | 0 円09銭 5 厘 | 0 円38銭     |
| 11月       | 0 円49銭 1 厘                  | 0 円07銭 5 厘 | 0 円02銭 4 厘 | 0 円09銭 9 厘 | 0 円39銭 2 厘 |

(注 1) 分配金は各月における前月最終営業日～当月最終営業日の前日までの累計です。  
(注 2) 所得税には復興特別所得税が含まれます。  
(注 3) 上記期間中のお手取り分配金は、各月の最終営業日にみなさまの口座に繰入れて再投資いたしました。  
(注 4) 上記期間内に取得の場合には、取得日から各期間の末日までの分配金合計から、源泉税額を差引いた額が再投資額となります。

■資産・負債・元本および基準価額の状況

(2015年11月29日現在)

| 資 産、 負 債、 元 本 お よ び 基 準 価 額 の 状 況 |        |                |           |                       |           |                |              |                     |        |                |             | 1万口当り<br>基 準 価 額 |
|-----------------------------------|--------|----------------|-----------|-----------------------|-----------|----------------|--------------|---------------------|--------|----------------|-------------|------------------|
| 資 産                               |        |                |           |                       |           |                | 負 債          | 純 資 産 総 額           |        | 元 本            |             |                  |
| 公 社 債                             |        | その他有価証券        |           | コール・ローン等<br>そ の 他 資 産 |           | 合 計            |              | 外 貨 建<br>純 資 産<br>比 | 率      |                |             |                  |
| 金 額                               | 比 率    | 金 額            | 比 率       | 金 額                   | 比 率       |                |              |                     |        |                |             |                  |
| 百万円<br>—                          | %<br>— | 百万円<br>169,977 | %<br>77.6 | 百万円<br>49,087         | %<br>22.4 | 百万円<br>219,065 | 百万円<br>6,012 | 百万円<br>213,052      | %<br>— | 百万円<br>213,052 | 円<br>10,000 |                  |

(注 1) 比率は投資信託財産総額 (219, 065百万円) に対する割合。  
(注 2) その他有価証券には現先取引により取得したものを含みます。  
(注 3) 2015年11月29日現在における次期繰越金は 0 千円です。  
(注 4) 単位未満は切捨て。  
※2015年 5月28日現在の元本額は290, 100百万円、当作成期間中における追加設定元本額は275, 937百万円、同解約元本額は352, 984百万円です。  
※2015年11月29日現在の 1 口当り純資産額は1. 0000円です。

■売買および損益の状況

(2015年 5月29日～2015年11月29日)

| 組 入 有 価 証 券 の 売 買 状 況 |                     |                    |                               | 先 物 取 引 状 況 |         |            |         | 損 益 の 状 況     |               |               |
|-----------------------|---------------------|--------------------|-------------------------------|-------------|---------|------------|---------|---------------|---------------|---------------|
| 買 付                   |                     | 売 付                |                               | 買 建         |         | 売 建        |         | 運用損益          | 信託報酬等         | 収益分配金         |
| 公 社 債                 | そ の 他<br>有 価 証 券    | 公 社 債              | そ の 他<br>有 価 証 券              | 新<br>買 付 額  | 決 済 額   | 新<br>売 付 額 | 決 済 額   |               |               |               |
| 百万円<br>19, 759        | 百万円<br>21, 670, 103 | 百万円<br>—           | 百万円<br>21, 639, 172           | 億円<br>—     | 億円<br>— | 億円<br>—    | 億円<br>— | 千円<br>88, 573 | 千円<br>18, 051 | 千円<br>70, 521 |
| [ 139]                | [ 5, 970, 279]      | [ 19, 760]<br>[ —] | [ 119, 000]<br>[ 6, 005, 294] | [ —]        | [ —]    | [ —]       | [ —]    |               |               |               |

(注 1) 公社債の買付、売付は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)( )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 2) 組入有価証券の売買状況には、現先取引に係る金額を含めて表示しております。  
(注 3) 組入有価証券の売買状況および先物取引状況の[ ]内は、当作成期間中における利害関係人との取引金額。  
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 項に規定される法人等をいいます。なお、当ファンドに係る当作成期間中の利害関係人は、大和証券、東京短資です。  
(注 4) 単位未満は切捨て。  
(注 5) 2015年11月29日現在における先物取引の取引残高 (評価額) はありません。

フリーファイナンシャルファンド

■ 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

| 2015. 5. 28現在保有額 | 当作成期間中設定額 | 当作成期間中解約額 | 2015. 11. 29現在保有額 | 取 引 の 理 由                |
|------------------|-----------|-----------|-------------------|--------------------------|
| 百万円              | 百万円       | 百万円       | 百万円               |                          |
| 4, 601           | 11, 355   | 15, 657   | 300               | 自社財産の運用を目的<br>とした取得とその処分 |

(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

2015年11月29日現在における該当事項はありません。