

ダイワMMF (マネー・マネージメント・ファンド)

運用報告書 (全体版) 繰上償還

(2016年5月31日～2016年10月31日償還)

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MMF (マネー・マネージメント・ファンド)」は、このたび、約款の規定により、繰上償還となりました。

ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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した。

商品分類	追加型投信／国内／債券／MMF
信託期間	無期限
運用方針	内外の公社債およびコマーシャル・ペーパーを中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債およびコマーシャル・ペーパー
分配方針	原則として、信託財産から生ずる利益の全額を毎日分配します。 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)

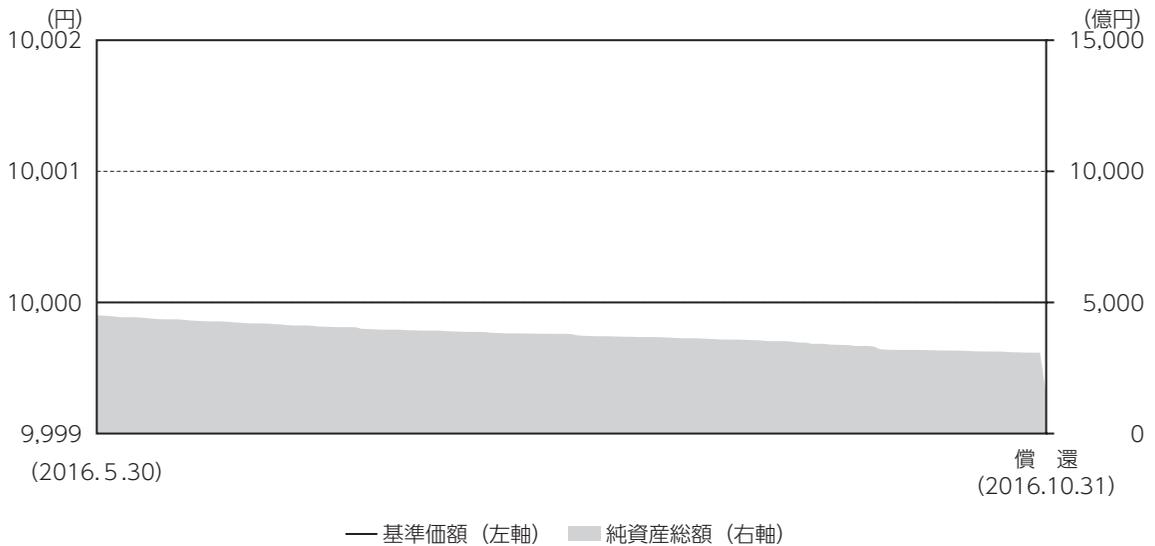
TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

《運用経過》

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：10,000円00銭（既払分配金1,512円64銭）

騰落率：16.3%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

利息収入が基準価額の主な上昇要因となりました。

設定以来の投資環境について

○国内短期金融市況

設定時から1995年にかけて、バブル経済の崩壊により景気は厳しい調整局面を迎えたことから、日銀は公定歩合を引き下げました。1999年には、長期にわたる景気の停滞と金融システム不安に対処するため、日銀はゼロ金利政策を開始しました。2000年にゼロ金利政策は解除され、無担保コール翌日物金利は上昇したものの、2001年に量的緩和政策が導入され、無担保コール翌日物金利はゼロ%近辺まで低下しました。2006年以降、景気の緩やかな拡大を受けて日銀が金融引き締めを行なったことにより無担保コール翌日物金利は上昇しましたが、リーマン・ショック後の金融緩和により低下しました。2016年には、日銀がマイナス金利政策を導入したことを背景に、無担保コール翌日物金利は小幅なマイナスまで低下しました。

信託期間中の運用方針

内外の公社債およびコマーシャルペーパーを中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。

信託期間中のポートフォリオについて

内外の公社債およびコマーシャル・ペーパーを中心に投資し、安定した収益の確保をめざして運用を行ないました。

2016年1月の日銀によるマイナス金利政策の導入以降は、元本の安全性を最優先に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、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

信託期間中の分配金の累計額は、1万口当たり1,512円64銭となりました。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

■収益分配金のお知らせ

当期間（2016年5月31日～2016年10月31日）につきましては運用収益を計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

■資産・負債・元本および基準価額の状況

(2016年10月31日現在)

資				産				負 債	純 資 産 総 額		元 本	1 万 口 当 基 準 価 額
公 社 債		そ の 他 有 価 証 券		コ ー ル ・ ロ ー ン 等 そ の 他 資 産		合 計	外 純 資 産 比		建 設 資 産 率			
金 額	比 率	金 額	比 率	金 額	比 率			金 額		百 万 円	%	百 万 円
百万円	%	百万円	%	百万円	%	百万円	百万円	百万円	%	百万円	円	
-	-	-	-	150,343	100.0	150,343	0	150,343	-	150,343	10,000.00	

(注1) 比率は投資信託財産総額（150,343百万円）に対する割合。

(注2) 単位未満は切捨て。

※2016年5月30日現在の元本額は450,978百万円、当作成期間中における追加設定元本額は2,544百万円、同解約元本額は303,179百万円です。

※2016年10月31日現在の1口当り純資産額は1.0000円00銭です。

■売買および損益の状況

(2016年5月31日～2016年10月31日)

組 入 有 価 証 券 の 売 買 状 況				先 物 取 引 状 況				損 益 の 状 況		
買		売		買		売		運 用 損 益	信 託 報 酬 等	収 益 分 配 金
公 社 債	そ の 他 有 価 証 券	公 社 債	そ の 他 有 価 証 券	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額			
百万円	百万円	百万円	百万円	億 円	億 円	億 円	億 円	千 円	千 円	千 円
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
[-]	[-]	(-)	(-)	[-]	[-]	[-]	[-]			

(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) 組入る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) 組入る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。当作成期間中における利害関係人との取引はありません。

(注4) 単位未満は切捨て。

(注5) 償還時における先物取引の取引残高（評価額）はありません。

■組入資産明細表

償還時における該当事項はありません。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	1992年 5 月 8 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年10月31日		資産総額	150,343,784,391円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減 又は追加信託	負債総額	22,426円
				純資産総額	150,343,761,965円
受益権口数	500,000,000口	150,343,761,965口	149,843,761,965口	受益権口数	150,343,761,965口
元本額	500,000,000円	150,343,761,965円	149,843,761,965円	1 単位当り償還金	10,000円00銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1 単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
2006年 5 月31日～2006年11月29日	1,191,234,103,860	1,191,234,169,150	10,000	11.409	0.11
2006年11月30日～2007年 5 月30日	1,296,892,933,369	1,296,893,005,783	10,000	19.980	0.20
2007年 5 月31日～2007年11月29日	1,319,969,788,065	1,319,969,874,741	10,000	25.533	0.26
2007年11月30日～2008年 5 月29日	1,297,702,294,044	1,297,702,408,053	10,000	27.064	0.27
2008年 5 月30日～2008年11月27日	1,232,755,523,224	1,232,755,635,374	10,000	26.784	0.27
2008年11月28日～2009年 5 月28日	1,238,829,965,803	1,238,830,035,000	10,000	19.566	0.20
2009年 5 月29日～2009年11月29日	1,185,067,209,464	1,185,067,227,753	10,000	9.263	0.09
2009年11月30日～2010年 5 月30日	1,102,482,827,027	1,102,482,856,827	10,000	6.359	0.06
2010年 5 月31日～2010年11月29日	1,047,248,632,585	1,047,248,718,726	10,000	5.447	0.05
2010年11月30日～2011年 5 月30日	988,379,901,490	988,379,919,848	10,000	5.452	0.05
2011年 5 月31日～2011年11月29日	904,593,295,355	904,593,332,075	10,000	5.486	0.05
2011年11月30日～2012年 5 月30日	846,766,846,483	846,766,890,911	10,000	5.166	0.05
2012年 5 月31日～2012年11月29日	801,967,381,025	801,967,412,864	10,000	4.708	0.05
2012年11月30日～2013年 5 月30日	796,203,311,765	796,203,352,436	10,000	3.964	0.04
2013年 5 月31日～2013年11月28日	860,744,427,138	860,744,501,235	10,000	3.404	0.03
2013年11月29日～2014年 5 月29日	993,861,464,055	993,861,512,141	10,000	3.486	0.03
2014年 5 月30日～2014年11月27日	946,602,659,472	946,602,659,825	10,000	2.794	0.03
2014年11月28日～2015年 5 月28日	934,174,765,053	934,174,831,208	10,000	1.773	0.02
2015年 5 月29日～2015年11月29日	788,076,643,939	788,076,696,654	10,000	1.477	0.01
2015年11月30日～2016年 5 月30日	450,978,644,736	450,978,667,108	10,000	1.096	0.01

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	10,000円00銭