

★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／内外／株式	
信託期間	5年間（2012年9月20日～2017年9月19日）	
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	為替ヘッジ あり	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミウム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Aクラス」(以下「エクイティファンドA」といいます。)の受益証券(円建) ロ、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジ なし	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミウム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Bクラス」(以下「エクイティファンドB」といいます。)の受益証券(円建) ロ、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
運用方法	為替ヘッジ あり	①主として、エクイティファンドAの受益証券を通じて、新興国消費市場の拡大から恩恵を受ける世界の企業の株式を厳選して投資し、値上がり益を追求することにより、信託財産の成長をめざします。 ②当ファンドは、エクイティファンドA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・ファンズです。通常の状態、エクイティファンドAへの投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③エクイティファンドAでは、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないません。ただし、為替ヘッジの手段がない、あるいは、ヘッジコストが過大と判断される際には、一部の通貨について、為替ヘッジを行なわない場合があります。
	為替ヘッジ なし	①主として、エクイティファンドBの受益証券を通じて、新興国消費市場の拡大から恩恵を受ける世界の企業の株式を厳選して投資し、値上がり益を追求することにより、信託財産の成長をめざします。 ②当ファンドは、エクイティファンドB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・ファンズです。通常の状態、エクイティファンドBへの投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③エクイティファンドBでは、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。
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、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。	

# 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/為替ヘッジなし)

## 運用報告書(全体版) 第6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/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/為替ヘッジなし)」は、このたび、第6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/>

<5739>  
<5740>

★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）

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World 指数 (配当込み,米ドルベース)		公社債 組入率	投資信託 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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2013年 9月19日)	11,937	300	17.6	11,736	9.4	0.9	95.3	6,786
3 期末 (2014年 3月19日)	12,587	200	7.1	12,493	6.5	0.4	95.1	3,977
4 期末 (2014年 9月19日)	12,637	30	0.6	13,352	6.9	0.4	96.6	3,440
5 期末 (2015年 3月19日)	13,396	200	7.6	13,424	0.5	0.5	96.6	3,214
6 期末 (2015年 9月24日)	12,617	0	△ 5.8	12,282	△ 8.5	0.4	97.7	2,735

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World 指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI AC World 指数 (配当込み、米ドルベース) の原データをもとに、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。MSCI AC World 指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

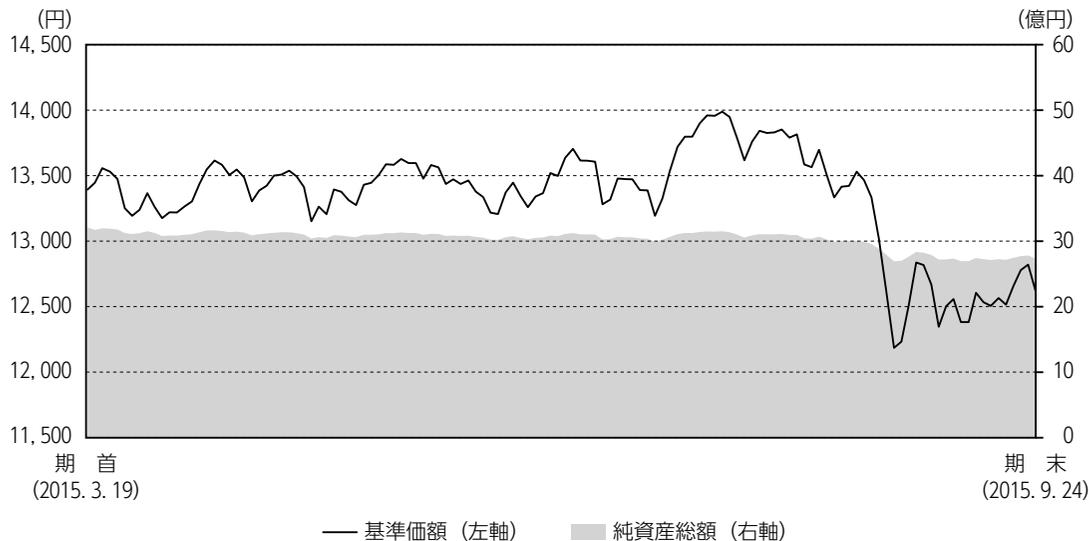
(注3) 海外の指数は、基準価額の反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 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5) 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。

## 《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：13,396円

期末：12,617円

騰落率：△5.8%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

世界の株式市況が軟調に推移したことなどがマイナス要因となり、基準価額は値下がりしました。

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）

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World 指数 (配当込み、米ドルベース)		公 社 組 比	債 入 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首) 2015年3月19日	円 13,396	% —	13,424	% —		% 0.5	% 96.6
3月末	13,368	△ 0.2	13,482	0.4		0.4	98.3
4月末	13,414	0.1	13,906	3.6		0.4	97.4
5月末	13,566	1.3	13,856	3.2		0.4	98.4
6月末	13,283	△ 0.8	13,441	0.1		0.4	96.7
7月末	13,828	3.2	13,517	0.7		0.4	98.5
8月末	12,819	△ 4.3	12,733	△ 5.1		0.4	97.9
(期末) 2015年9月24日	12,617	△ 5.8	12,282	△ 8.5		0.4	97.7

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

### ○世界株式市況

世界株式市況は、米国の好調な企業業績や、ECB（欧州中央銀行）や中国人民銀行による金融緩和政策を受けて、上昇して始まりました。しかし2015年6月以降は、ギリシャ問題の再燃や米国の利上げ観測などから上値が重い展開が続きました。さらに8月に入ると、中国での人民元の事実上の切下げを受けて中国の景気減速懸念が高まったことなどから中国株が大幅に下落し、中国経済の悪化が世界的な景気減速につながるとの見方が強まったことから、期末にかけて株式市況は大幅に下落しました。

## 前期における「今後の運用方針」

### ○当ファンド

今後も、ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Aクラス（以下「エクイティファンドA」といいます。）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資します。また、エクイティファンドAへの投資割合を高位に維持することを基本とします。

### ○エクイティファンドA

今後も、新興国消費市場の拡大から恩恵を受ける世界の株式に投資します。同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに厳選投資してまいります。

また、円買い／外貨売りのヘッジポジションを高位に維持してまいります。

### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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います。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

当ファンドはエクイティファンドAとダイワ・マネーストック・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。エクイティファンドAへの投資割合は信託財産の純資産総額の95%程度以上とすることをめざしました。

### ○エクイティファンドA

株式の個別銘柄で寄与度が高かった銘柄は、TESLA MOTORS INC（米国、一般消費財・サービス）、STARBUCKS CORPORATION（米国、一般消費財・サービス）、寄与度が低かった銘柄は、MALLINCKRODT PLC（米国、ヘルスケア）、MICHAEL KORS HOLDINGS LTD（米国、一般消費財・サービス）などでした。

また、円買い／外貨売りのヘッジポジションを高位に維持しました。

### ○ダイワ・マネーストック・マザーファンド

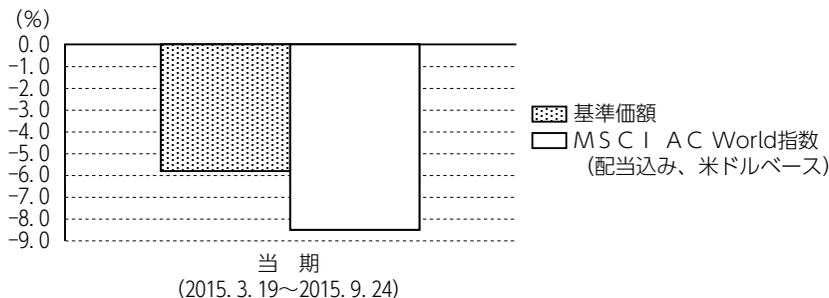
資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないました。

## 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。

参考指数は世界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

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益の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20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)	3,393

(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。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

今後も、エクイティファンドAとダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資します。また、エクイティファンドAへの投資割合を高位に維持することを基本とします。

### ○エクイティファンドA

今後も、新興国消費市場の拡大から恩恵を受ける世界の株式に投資します。同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに厳選投資してまいります。

また、円買い／外貨売りのヘッジポジションを高位に維持してまいります。

### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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います。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 3. 20～2015. 9. 24)		
	金 額	比 率	
信託報酬	88円	0. 658%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は13, 337円です。</b>
(投信会社)	(26)	(0. 195)	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)	(60)	(0. 446)	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)	(2)	(0. 017)	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	1	0. 004	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)	(1)	(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
合 計	88	0. 662	

(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まず。

(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

投資信託受益証券

（2015年3月20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 （邦貨建）	千口	千円	千口	千円
	—	—	1,888.229	280,000

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）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

（2015年3月20日から2015年9月24日まで）

当 期				当 期			
買 付		売 付		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
				MIRAE ASSET GLOBAL GREAT CONSUMER EQUITY FUND A CLASS（ケイマン諸島）	1,888.229	280,000	148

（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

(1) 当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) ダイワ・マネースtock・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20日から2015年9月24日まで）

決算期	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	29,679	4,099	13.8	—	—	—
コール・ローン	1,044,124	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合0.1%

※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ペーパ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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 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) MIRAE ASSET GLOBAL GREAT CONSUMER EQUITY FUND A CLASS	18,721.355	2,673,521	97.7

(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	期 首	当 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	20,016	20,016	20,096

(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	%
投資信託受益証券	2,673,521	96.9
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	20,096	0.7
コール・ローン等、その他	66,123	2.4
投資信託財産総額	2,759,742	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	2,759,742,118円
コール・ローン等	66,123,487
投資信託受益証券（評価額）	2,673,521,840
ダイワ・マネースtock・マザーファンド（評価額）	20,096,791
(B) 負債	24,595,141
未払解約金	4,487,700
未払信託報酬	19,980,548
その他未払費用	126,893
(C) 純資産総額（A－B）	2,735,146,977
元本	2,167,880,941
次期繰越損益金	567,266,036
(D) 受益権総口数	2,167,880,941口
1万口当り基準価額（C/D）	12,617円

\* 期首における元本額は2,399,437,685円、当期中における追加設定元本額は2,874,140円、同解約元本額は234,430,884円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,617円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月20日 至2015年9月24日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	16,524円
受取利息	16,524
(B) 有価証券売買損益	△ 148,789,451
売買益	5,215,622
売買損	△ 154,005,073
(C) 信託報酬等	△ 20,107,441
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 168,880,368
(E) 前期繰越損益金	727,599,837
(F) 追加信託差損益金	8,546,567
(配当等相当額)	( 8,060,410)
(売買損益相当額)	( 486,157)
(G) 合計（D＋E＋F）	567,266,036
次期繰越損益金（G）	567,266,036
追加信託差損益金	8,546,567
(配当等相当額)	( 8,060,410)
(売買損益相当額)	( 486,157)
分配準備積立金	727,599,837
繰越損益金	△ 168,880,368

(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10ページの「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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	8,060,410
(d) 分配準備積立金	727,599,837
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	735,660,247
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	735,660,247
(h) 受益権総口数	2,167,880,941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19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12,807円です。」

★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）

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World 指数 (配当込み、円換算)		公社債 組入率	投資信託 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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期末 (2013年9月19日)	14,018	500	21.6	14,696	12.4	0.9	95.4	1,145
3期末 (2014年3月19日)	15,183	350	10.8	16,160	10.0	0.4	96.1	663
4期末 (2014年9月19日)	15,965	120	5.9	18,537	14.7	0.5	96.8	604
5期末 (2015年3月19日)	18,007	600	16.5	20,508	10.6	0.5	96.6	639
6期末 (2015年9月24日)	17,002	0	△ 5.6	18,829	△ 8.2	0.4	97.3	547

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World 指数（配当込み、円換算）は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI AC World 指数（配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、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。MSCI AC World 指数（配当込み、米ドルベース）は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

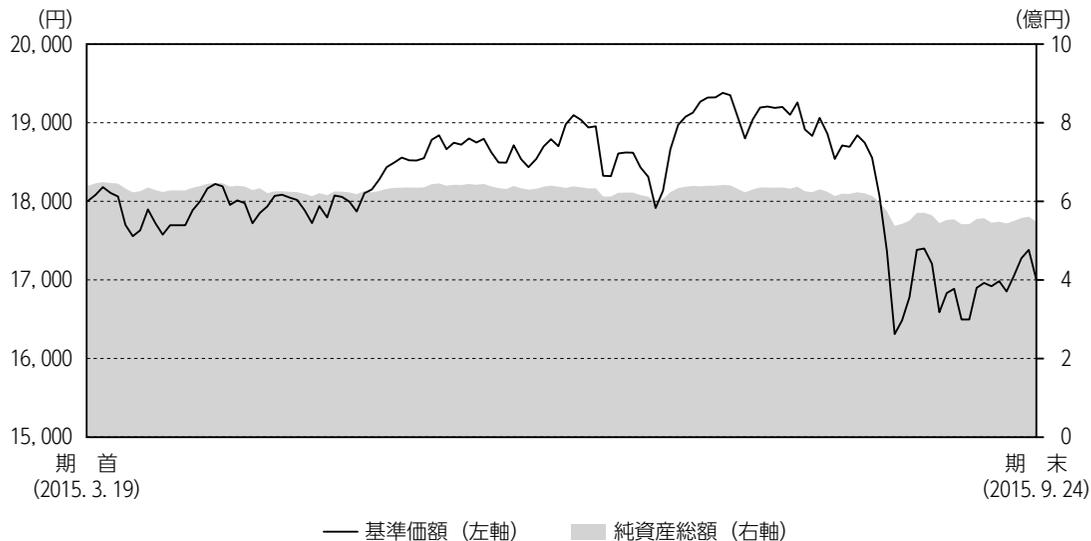
(注3) 海外の指数は、基準価額の反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 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5) 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。

## 《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：18,007円

期末：17,002円

騰落率：△5.6%

#### ■基準価額の主な変動要因

世界の株式市況が軟調に推移したことなどがマイナス要因となり、基準価額は値下がりしました。

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）

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World 指数 (配当込み、円換算)		公 社 組 比	債 入 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首) 2015年3月19日	円 18,007	% —	20,508	% —		% 0.5	% 96.6
3月末	17,897	△ 0.6	20,663	0.8		0.4	96.8
4月末	17,887	△ 0.7	21,105	2.9		0.4	96.6
5月末	18,840	4.6	21,864	6.6		0.4	97.7
6月末	18,325	1.8	20,991	2.4		0.4	97.1
7月末	19,205	6.7	21,383	4.3		0.4	98.3
8月末	17,400	△ 3.4	19,679	△ 4.0		0.4	99.0
(期末) 2015年9月24日	17,002	△ 5.6	18,829	△ 8.2		0.4	97.3

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

### ○世界株式市況

世界株式市況は、米国の好調な企業業績や、ECB（欧州中央銀行）や中国人民銀行による金融緩和政策を受けて、上昇して始まりました。しかし2015年6月以降は、ギリシャ問題の再燃や米国の利上げ観測などから上値が重い展開が続きました。さらに8月に入ると、中国での人民元の事実上の切下げを受けて中国の景気減速懸念が高まったことなどから中国株が大幅に下落し、中国経済の悪化が世界的な景気減速につながるとの見方が強まったことから、期末にかけて株式市況は大幅に下落しました。

### ○為替相場

米ドルは、対円でおおむね横ばいとなりました。

米ドルの対円相場は、米国のマクロ経済指標などを受けて、米国の利上げへの期待が高まったことなどが支援材料となり、底堅い展開が続きました。2015年8月以降は、中国株式市場の急落などから投資家のリスク回避の円買いの動きが活発化したことで調整して期末を迎えました。

## 前期における「今後の運用方針」

### ○当ファンド

今後も、ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Bクラス（以下「エクイティファンドB」といいます。）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資します。また、エクイティファンドBへの投資割合を高位に維持することを基本とします。

### ○エクイティファンドB

今後も、新興国消費市場の拡大から恩恵を受ける世界の株式に投資します。同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに厳選投資してまいります。

### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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います。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

当ファンドはエクイティファンドBとダイワ・マネースtock・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。エクイティファンドBへの投資割合は信託財産の純資産総額の95%程度以上とすることをめざしました。

### ○エクイティファンドB

株式の個別銘柄で寄与度が高かった銘柄は、TESLA MOTORS INC（米国、一般消費財・サービス）、STARBUCKS CORPORATION（米国、一般消費財・サービス）、寄与度が低かった銘柄は、MALLINCKRODT PLC（米国、ヘルスケア）、MICHAEL KORS HOLDINGS LTD（米国、一般消費財・サービス）などでした。

### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

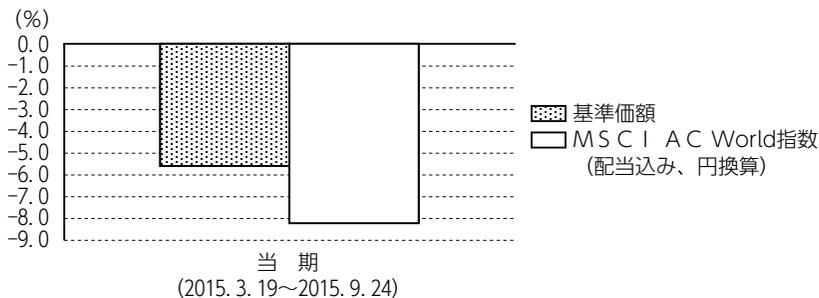
資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないました。

## 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。

参考指数は世界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

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益の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20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）		7,624

（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。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

今後も、エクイティファンドBとダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資します。また、エクイティファンドBへの投資割合を高位に維持することを基本とします。

### ○エクイティファンドB

今後も、新興国消費市場の拡大から恩恵を受ける世界の株式に投資します。同業他社比で競争力があり、利益成長性が相対的に高い銘柄や、安定したキャッシュフロー成長が見込める銘柄などに厳選投資してまいります。

### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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います。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 3. 20～2015. 9. 24)		
	金 額	比 率	
信託報酬	120円	0. 658%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は18, 213円です。</b>
(投信会社)	(36)	(0. 195)	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)	(81)	(0. 446)	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)	(3)	(0. 017)	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	1	0. 004	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)	(1)	(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
合 計	121	0. 662	

(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まず。

(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

投資信託受益証券

（2015年3月20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 （邦貨建）	千口	千円	千口	千円
	—	—	259.591	57,000

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）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

（2015年3月20日から2015年9月24日まで）

当				期			
銘 柄	買 付			売 付			平均単価 円
	口数	金額	平均単価	銘 柄	口数	金額	
	千口	千円	円		千口	千円	円
				MIRAE ASSET GLOBAL GREAT CONSUMER EQUITY FUND B CLASS（ケイマン諸島）	259.591	57,000	219

（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

(1) 当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) ダイワ・マネースtock・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20日から2015年9月24日まで）

決 算 期	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	29,679	4,099	13.8	—	—	—
コール・ローン	1,044,124	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合0.0%

※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ペーパ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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 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) MIRAE ASSET GLOBAL GREAT CONSUMER EQUITY FUND B CLASS	2,532.393	532,610	97.3

(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	当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーストック・ マザーファンド	4,000	4,000	4,016

(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	%
投資信託受益証券	532,610	96.4
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	4,016	0.7
コール・ローン等、その他	16,109	2.9
投資信託財産総額	552,737	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	552,737,240円
コール・ローン等	16,109,724
投資信託受益証券 (評価額)	532,610,554
ダイワ・マネーストック・ マザーファンド (評価額)	4,016,962
(B) 負債	5,270,059
未払解約金	1,179,653
未払信託報酬	4,064,667
その他未払費用	25,739
(C) 純資産総額 (A - B)	547,467,181
元本	322,000,799
次期繰越損益金	225,466,382
(D) 受益権総口数	322,000,799口
1万口当り基準価額 (C / D)	17,002円

\* 期首における元本額は355,269,914円、当期中における追加設定元本額は3,346,620円、同解約元本額は36,615,735円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,002円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月20日 至2015年9月24日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,794円
受取利息	3,794
(B) 有価証券売買損益	△ 28,252,904
売買益	1,886,338
売買損	△ 30,139,242
(C) 信託報酬等	△ 4,090,406
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 32,339,516
(E) 前期繰越損益金	222,512,312
(F) 追加信託差損益金	35,293,586
(配当等相当額)	( 22,998,422)
(売買損益相当額)	( 12,295,164)
(G) 合計 (D + E + F)	225,466,382
次期繰越損益金 (G)	225,466,382
追加信託差損益金	35,293,586
(配当等相当額)	( 22,998,422)
(売買損益相当額)	( 12,295,164)
分配準備積立金	222,512,312
繰越損益金	△ 32,339,516

(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20ページの「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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	22,998,422
(d) 分配準備積立金	222,512,312
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	245,510,734
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	245,510,734
(h) 受益権総口数	322,000,799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19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17,091円です。」

ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・  
エクイティファンド Aクラス／Bクラス

当ファンド（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／為替ヘッジなし））はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー・エクイティファンド Aクラス／B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）2015年9月24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

2015年2月28日

資産

投資、時価（費用 206,940,954ドル）	ドル	223,884,159
現金		143
外国通貨、時価（費用 3ドル）		3
為替先渡契約による評価益		502,935
未収：		
配当		187,645
精算済み為替先渡契約		18,843
その他資産		10,691
<b>資産合計</b>		<b>224,604,419</b>

負債

為替先渡契約による評価損		4,691,293
未払：		
投資運用会社報酬		96,197
専門家報酬		57,053
会計および管理報酬		49,296
保管報酬		28,033
為替仲介会社報酬		23,304
名義書換代理会社報酬		8,728
為替運用会社報酬		7,927
<b>負債合計</b>		<b>4,961,831</b>

純資産

ドル 219,642,588

**純資産**

クラス A	ドル	26, 266, 552
豪ドル・クラス		30, 612, 687
クラス B		5, 475, 132
ブラジル・レアル・クラス		115, 439, 959
通貨セレクト・クラス		41, 848, 258
	ドル	219, 642, 588

**発行済み受益証券数**

クラス A		21, 076, 759
豪ドル・クラス		34, 489, 435
クラス B		2, 996, 737
ブラジル・レアル・クラス		140, 281, 725
通貨セレクト・クラス		50, 103, 369

**1口当たり純資産価値**

クラス A	ドル	1. 246
豪ドル・クラス	ドル	0. 888
クラス B	ドル	1. 827
ブラジル・レアル・クラス	ドル	0. 823
通貨セレクト・クラス	ドル	0. 835

(米ドル建て)

**損益計算書**

2015年2月28日に終了した会計年度

**投資収益**

配当収益（源泉徴収税640,322ドル控除後）	ドル	1,757,460
その他収益		1,286
<b>投資収益合計</b>		<b>1,758,746</b>

**費用**

投資運用会社報酬		1,076,075
会計および管理報酬		127,954
為替運用会社報酬		83,278
保管報酬		73,228
名義書換代理会社報酬		33,156
為替仲介会社報酬		23,304
受託会社報酬		18,433
専門家報酬		10,465
登録料		1,465
<b>費用合計</b>		<b>1,447,358</b>

**純投資収益** **311,388**

**実現益および評価益（実現損および評価損）：**

**実現益（損）：**

有価証券への投資		5,239,087
外国為替取引および為替先渡契約		(34,656,667)
<b>純実現損</b>		<b>(29,417,580)</b>

**評価益（損）の純変動：**

有価証券への投資		7,607,307
外国為替換算および為替先渡契約		(4,255,378)
<b>評価益の純変動</b>		<b>3,351,929</b>

**純実現損および純評価損** **(26,065,651)**

**業務活動から生じた純資産の純減** **ドル (25,754,263)**

(米ドル建て)

投資明細表  
2015年2月28日

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合	公正価値
	普通株 (93.2%)		
	ベルギー (2.1%)		
	飲料 (2.1%)		
35,412	Anheuser-Busch InBev NV	ドル	4,516,149
	ベルギー計 (費用 4,036,616ドル)		4,516,149
	中国 (3.5%)		
	インターネット (3.5%)		
37,665	Alibaba Group Holding, Ltd. - ADR		3,206,045
251,789	Tencent Holdings, Ltd.		4,412,139
			7,618,184
	中国計 (費用 6,404,646ドル)		7,618,184
	ドイツ (7.1%)		
	保険 (2.0%)		
26,004	Allianz SE		4,363,441
	医薬品 (3.0%)		
45,403	Bayer AG		6,724,814
	運輸 (2.1%)		
135,033	Deutsche Post AG		4,608,921
	ドイツ計 (費用15,537,376ドル)		15,697,176
	イスラエル (1.3%)		
	電子部品 (1.3%)		
82,350	Mobileye NV		2,921,778
	イスラエル計 (費用4,286,089ドル)		2,921,778
	シンガポール (1.8%)		
	半導体 (1.8%)		
31,683	Avago Technologies, Ltd. Class A		4,043,384
	シンガポール計 (費用2,775,523ドル)		4,043,384
	スペイン (2.1%)		
	小売り (2.1%)		
145,757	Inditex S. A.		4,591,570
	スペイン計 (費用4,472,729ドル)		4,591,570

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

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合	公正価値
	スイス (6.7%)		
	医薬品 (4.4%)		
52,950	Novarits AG		5,443,014
15,684	Roche Holding AG		4,281,666
			<hr/> 9,724,680
	小売り (2.3%)		
56,763	Cie Financiere Richemont S. A.		5,029,633
	スイス計 (費用15,489,162ドル)		<hr/> 14,754,313
	英国 (4.5%)		
	アパレル (1.4%)		
46,623	Michael Kors Holdings Ltd.		3,142,856
	自動車部品 (1.5%)		
41,953	Delphi Automotive PLC		3,307,575
	宿泊施設 (1.6%)		
43,000	Whitbread PLC		3,492,063
	英国計 (費用10,011,690ドル)		<hr/> 9,942,494
	米国 (64.1%)		
	アパレル (2.7%)		
60,000	NIKE, Inc. Class B		5,827,200
	自動車 (1.4%)		
14,588	Telsa Motors, Inc.		2,966,324
	銀行 (4.9%)		
268,013	Bank of America Corp.		4,237,286
119,505	Wells Fargo & Co.		6,547,679
			<hr/> 10,784,965
	飲料 (1.8%)		
27,939	Monster Beverage Corp.		3,942,752
	バイオテクノロジー (3.5%)		
8,162	Biogen Idec, Inc.		3,343,074
36,564	Celgene Crop.		4,443,623
			<hr/> 7,786,697
	商業サービス (2.6%)		
63,822	MasterCard, Inc. Class A		5,752,277
	化粧品／パーソナルケア (2.0%)		
52,150	Procter & Gamble Co.		4,439,530
			<hr/> 4,439,530

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合	公正価値
	総合金融サービス (2.5%)		
20,337	Visa, Inc. Class A		5,517,631
	電機 (2.1%)		
35,000	Thermo Fisher Scientific, Inc.		4,550,000
	食品 (1.6%)		
56,148	Hain Celestial Group Inc.		3,510,934
	家具・インテリア (1.5%)		
15,703	Whirlpool Corp.		3,328,251
	保険 (1.9%)		
83,980	MetLife, Inc.		4,268,703
	インターネット (5.6%)		
10,200	Google, Inc. Class A		5,738,826
5,210	Priceline Group, Inc.		6,447,271
			12,186,097
	宿泊施設 (3.9%)		
122,280	Hilton Worldwide Holdings Inc.		3,456,856
89,788	Las Vegas Sands Corp.		5,108,937
			8,565,793
	メディア (4.6%)		
75,651	Comcast Corp. Class A		4,492,156
53,069	Walt Disney Co.		5,523,422
			10,015,578
	医薬品 (9.1%)		
72,758	Abbott Laboratories		3,446,546
85,226	AbbVie, Inc.		5,156,173
50,071	Mallinckrodt PLC		5,844,287
163,249	Pfizer, Inc.		5,602,706
			20,049,712
	小売り (8.4%)		
65,070	CVS Health Corp.		6,758,821
72,938	Starbucks Corp.		6,818,609
59,074	YUM! Brands, Inc.		4,791,492
			18,368,922
	ソフトウェア (2.0%)		
102,324	Microsoft Corp.		4,486,907

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

<u>株数</u>		<u>有価証券の明細</u>	<u>純資産に 占める割合</u>	<u>公正価値</u>
		運輸 (2.0%)		
42,947		United Parcel Service, Inc. Class B		4,368,998
		米国計 (費用126,560,007ドル)		140,717,271
		<b>普通株計 (費用189,573,838ドル)</b>		<b>204,802,319</b>
		上場投資信託 (4.2%)		
		米国 (4.2%)		
78,287		Health Care Select Sector SPDR Fund		5,652,321
10,336		iShares Nasdaq Biotechnology ETF		3,488,090
				9,140,411
		米国計		9,140,411
		<b>上場投資信託計 (費用7,425,687ドル)</b>		<b>9,140,411</b>
<u>元本金額</u>		短期投資 (4.5%)		
		グランド・ケイマン (0.0%)		
		定期預金 (0.0%)		
		Brown Brothers Harriman & Co.		
JPY	67	0.01% due 03/02/15		1
GBP	1	0.09% due 03/02/15		2
				3
		グランド・ケイマン計 (費用3ドル)		3
		スウェーデン (4.5%)		
		定期預金 (4.5%)		
		Skandinaviska Enskilda Banken AB		
USD	9,941,426	0.03% due 03/02/15		9,941,426
				9,941,426
		スウェーデン計 (費用9,941,426ドル)		9,941,426
		<b>短期投資計 (費用9,941,429ドル)</b>		<b>9,941,429</b>
		<b>投資総額 (費用206,940,954ドル)</b>	<b>101.9%</b>	<b>ドル 223,884,159</b>
		<b>現金およびその他の資産を上回る負債</b>	<b>(1.9)</b>	<b>(4,241,571)</b>
		<b>純資産</b>	<b>100.0%</b>	<b>ドル 219,642,588</b>

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

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

2015年2月28日時点のクラスA為替先渡契約の残高（純資産の（0.2）％）

買い	カウンターパーティー	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / (損)	
JPY	Citibank N. A.	213,930,171	2015年3月18日	CHF	1,679,123	ドル 17,540	ドル	—	ドル 17,540
JPY	Citibank N. A.	341,519,372	2015年3月18日	EUR	2,547,314	—	(324)	(324)	
JPY	Citibank N. A.	47,152,378	2015年3月18日	GBP	256,850	—	(2,378)	(2,378)	
JPY	Citibank N. A.	58,890,122	2015年3月18日	HKD	3,899,702	—	(10,105)	(10,105)	
JPY	Citibank N. A.	2,453,466,322	2015年3月18日	USD	20,901,149	—	(373,572)	(373,572)	
						ドル 17,540	ドル (386,379)	ドル (368,839)	

2015年2月28日時点の豪ドル・クラス為替先渡契約の残高（純資産の0.1％）

買い	カウンターパーティー	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / (損)	
AUD	Citibank N. A.	2,662,413	2015年3月18日	CHF	1,913,790	ドル 62,030	ドル	—	ドル 62,030
AUD	Citibank N. A.	4,255,781	2015年3月18日	EUR	2,903,200	71,131	—	71,131	
AUD	Citibank N. A.	580,476	2015年3月18日	GBP	293,200	877	—	877	
AUD	Citibank N. A.	736,008	2015年3月18日	HKD	4,442,343	2,771	—	2,771	
AUD	Citibank N. A.	30,556,927	2015年3月18日	USD	23,820,992	74,756	—	74,756	
						ドル 211,565	ドル	—	ドル 211,565

2015年2月28日時点のブラジル・リアル・クラス為替先渡契約の残高（純資産の（1.7）％）

買い	カウンターパーティー	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / (損)
BRL	Citibank N. A.	22,595,967	2015年3月18日	CHF	7,467,974	ドル	ドル (21,104)	ドル (21,104)
BRL	Citibank N. A.	35,703,465	2015年3月18日	EUR	11,326,760	—	(286,497)	(286,497)
BRL	Citibank N. A.	5,126,838	2015年3月18日	GBP	1,152,016	3,638	—	3,638
BRL	Citibank N. A.	6,125,087	2015年3月18日	HKD	17,295,794	—	(99,576)	(99,576)
BRL	Citibank N. A.	257,543,833	2015年3月18日	USD	92,934,359	—	(3,346,604)	(3,346,604)
						ドル 3,638	ドル (3,753,781)	ドル (3,750,143)

2015年2月28日時点の通貨セレクト・クラス為替先渡契約の残高（純資産の（0.1）％）

買い	カウンターパーティー	契約額	決済日	売り	契約額	評価益	評価（損）	純評価益 / (損)	
AUD	Citibank N. A.	497,639	2015年3月18日	CHF	358,070	ドル 11,216	ドル	—	ドル 11,216
AUD	Citibank N. A.	795,569	2015年3月18日	EUR	543,144	12,821	—	12,821	
AUD	Citibank N. A.	108,603	2015年3月18日	GBP	54,856	164	—	164	
AUD	Citibank N. A.	137,665	2015年3月18日	HKD	831,158	486	—	486	
AUD	Citibank N. A.	5,715,177	2015年3月18日	USD	4,456,838	12,472	—	12,472	
BRL	Citibank N. A.	1,475,701	2015年3月18日	CHF	488,347	—	(2,043)	(2,043)	

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

BRL	Citibank N. A.	2,336,853	2015年3月18日	EUR	740,679	—	(17,988)	(17,988)			
BRL	Citibank N. A.	335,254	2015年3月18日	GBP	75,333	238	—	238			
BRL	Citibank N. A.	400,663	2015年3月18日	HKD	1,131,006	—	(6,465)	(6,465)			
BRL	Citibank N. A.	16,845,887	2015年3月18日	USD	6,077,160	—	(217,236)	(217,236)			
INR	Citibank N. A.	33,082,467	2015年3月18日	CHF	491,831	14,239	—	14,239			
INR	Citibank N. A.	52,972,649	2015年3月18日	EUR	746,036	17,094	—	17,094			
INR	Citibank N. A.	7,260,647	2015年3月18日	GBP	75,370	588	—	588			
INR	Citibank N. A.	9,136,477	2015年3月18日	HKD	1,141,654	86	—	86			
INR	Citibank N. A.	380,122,299	2015年3月18日	USD	6,121,735	6,284	—	6,284			
NZD	Citibank N. A.	572,813	2015年3月18日	CHF	389,624	21,557	—	21,557			
NZD	Citibank N. A.	920,284	2015年3月18日	EUR	590,999	32,340	—	32,340			
NZD	Citibank N. A.	122,635	2015年3月18日	GBP	59,739	345	—	345			
NZD	Citibank N. A.	159,631	2015年3月18日	HKD	904,148	4,033	—	4,033			
NZD	Citibank N. A.	6,594,776	2015年3月18日	USD	4,849,509	133,283	—	133,283			
TRY	Citibank N. A.	1,296,586	2015年3月18日	CHF	486,170	262	—	262			
TRY	Citibank N. A.	2,071,697	2015年3月18日	EUR	737,437	—	(6,975)	(6,975)			
TRY	Citibank N. A.	286,139	2015年3月18日	GBP	74,570	—	(1,929)	(1,929)			
TRY	Citibank N. A.	357,300	2015年3月18日	HKD	1,128,168	—	(3,997)	(3,997)			
TRY	Citibank N. A.	14,883,812	2015年3月18日	USD	6,051,109	—	(158,040)	(158,040)			
ZAR	Citibank N. A.	5,353,600	2015年3月18日	CHF	431,548	2,684	—	2,684			
ZAR	Citibank N. A.	8,501,875	2015年3月18日	EUR	654,555	—	(6,706)	(6,706)			
ZAR	Citibank N. A.	1,195,027	2015年3月18日	GBP	66,390	—	(313)	(313)			
ZAR	Citibank N. A.	1,467,697	2015年3月18日	HKD	1,000,391	—	(3,387)	(3,387)			
ZAR	Citibank N. A.	61,284,798	2015年3月18日	USD	5,370,756	—	(126,054)	(126,054)			
						ドル	270,192	ドル	(551,133)	ドル	(280,941)

通貨の略称：

AUD	—	豪ドル
BRL	—	ブラジル・リアル
CHF	—	スイス・フラン
EUR	—	ユーロ
GBP	—	英ポンド
HKD	—	香港ドル
INR	—	インド・ルピー
JPY	—	日本円
NZD	—	ニュージーランド・ドル
TRY	—	トルコ・リラ
USD	—	米ドル
ZAR	—	南アフリカ・ランド

<補足情報>

当ファンド（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／為替ヘッジなし））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（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・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を30～31ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

(2015年3月20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	3,799,996				
536 国庫短期証券 2015/9/7	2,000,000				
548 国庫短期証券 2015/11/2	2,000,000				
554 国庫短期証券 2015/11/30	2,000,000				
555 国庫短期証券 2015/12/7	2,000,000				
538 国庫短期証券 2015/9/14	1,999,998				
487 国庫短期証券 2015/10/20	1,999,997				
532 国庫短期証券 2015/8/17	1,500,000				
520 国庫短期証券 2015/6/22	1,499,998				
516 国庫短期証券 2015/6/8	1,499,993				

(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・マネースtock・マザーファンド（27,560,063千円）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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	14,380,000	14,379,997	52.0	—	—	—	52.0

(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	—	1,280,000	1,279,999	2015/09/28
	542 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,000	2015/10/05
	544 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2015/10/13
	487 国庫短期証券	—	2,000,000	1,999,998	2015/10/20
	547 国庫短期証券	—	1,100,000	1,099,999	2015/10/26
	548 国庫短期証券	—	2,000,000	2,000,000	2015/11/02
	551 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,000	2015/11/16
	554 国庫短期証券	—	2,000,000	2,000,000	2015/11/30
	555 国庫短期証券	—	2,000,000	2,000,000	2015/12/07
	557 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2015/12/14
合 計	銘 柄 数 金 額	10銘柄	14,380,000	14,379,997	

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド 運用報告書 第5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・マネースtock・マザーファンドの第5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。

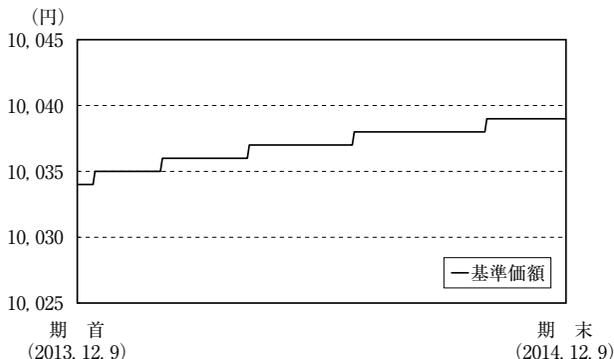
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
運用方法	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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
	騰 落 率	騰 落 率	
(期 首) 2013年12月9日	円	%	%
12月末	10,034	—	69.6
2014年1月末	10,035	0.0	63.0
2月末	10,035	0.0	70.9
3月末	10,036	0.0	65.8
4月末	10,036	0.0	67.1
5月末	10,037	0.0	69.1
6月末	10,037	0.0	69.1
7月末	10,037	0.0	67.6
8月末	10,038	0.0	72.5
9月末	10,038	0.0	73.1
10月末	10,038	0.0	68.8
11月末	10,039	0.0	64.6
(期 末) 2014年12月9日	10,039	0.0	64.6
			58.5

(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：10,034円 期末：10,039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おります。

◆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おります。

■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
国		千円	千円
内	国 債 証 券	2,599,774	—
		(	2,690,000)

(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

(2013年12月10日から2014年12月9日まで)

当 期		期 末	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
464 国庫短期証券 2015/1/14	149,999		
419 国庫短期証券 2014/12/22	99,999		
477 国庫短期証券 2014/12/8	99,996		
475 国庫短期証券 2014/11/25	99,992		
454 国庫短期証券 2014/8/25	99,990		
433 国庫短期証券 2014/5/26	99,988		
493 国庫短期証券 2015/2/23	89,998		
473 国庫短期証券 2014/11/17	79,995		
452 国庫短期証券 2014/8/18	79,991		
431 国庫短期証券 2014/5/19	79,991		

(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)

作 成 期	当 期		期 末				
	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		
区 分	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	480,000	479,995	58.5	—	—	—	58.5

(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		期 末		
	銘 柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	479 国庫短期証券	—	70,000	69,999	2014/12/15
	419 国庫短期証券	—	100,000	99,999	2014/12/22
	464 国庫短期証券	—	150,000	149,999	2015/01/14
	490 国庫短期証券	—	70,000	69,997	2015/02/09
	493 国庫短期証券	—	90,000	89,998	2015/02/23
合計	銘柄数				
	金 額	5 銘柄	480,000	479,995	

(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	479,995	58.5
コール・ローン等、その他	340,319	41.5
投資信託財産総額	820,315	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネーストック・マザーファンド

## ■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	820,315,287円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	340,319,449
公 社 債(評価額)	479,995,838
(B)負 債	—
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	820,315,287
元 本	817,136,908
次 期 繰 越 損 益 金	3,178,379
(D)受 益 権 総 口 数	817,136,908口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,039円

\*期首における元本額は815,881,793円、当期中における追加設定元本額は358,153,378円、同解約元本額は356,898,263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・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)998円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジあり)112,594,660円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジなし)73,734,556円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-07 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-09 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-11 9,962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・ブラジルレアルファンド(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、アジア高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)999円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Aコース4,988,527円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Bコース2,494,264円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Cコース999,197円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Aコース698,255円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Aコース1,994,416円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Bコース648,186円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Cコース179,498円、世界優先証券ファンド(為替ヘッジあり/限定追加型)998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)3,988,832円、US短期高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)4,984円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型)為替ヘッジあり7,009,001円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型)為替ヘッジなし904,221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)-11,000,000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277,939,483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155,681,197円、ダイワ米国高利回り不動産証券ファンド19,942,168円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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)4,184,518円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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)12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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)4,981,569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)199,295円、ダイワ先進国リートa 為替ヘッジあり(毎月分配型)399,083円、ダイワ先進国リートa 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a 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a 通貨セレクトコース(毎月分配型)99,771円、ダイワ/ミレアセット・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)20,016,725円、ダイワ/ミレアセット・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)4,000,959円、ダイワ/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド49,850,449円、ダイワ日本株ストラテジーa(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a(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a(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a(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ-米ドル・コース(毎月分配型)398,764円、ダイワ日本株ストラテジーa(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3,488,836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2,492,026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3,488,836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19,936,205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11,961,723円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,039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	423,234円
受 取 利 息	423,234
(B)有価証券売買損益	2,048
売 買 益	2,048
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	425,282
(D)前 期 繰 越 損 益 金	2,803,343
(E)解 約 差 損 益 金	△ 1,321,868
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,271,622
(G)合 計 (C+D+E+F)	3,178,379
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	3,178,379

(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に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。