

★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／海外／資産複合
信託期間	5年間（2012年10月18日～2017年10月17日）
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行いません。
主要投資対象	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」(以下「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」といいます。)の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
当ファンドの運用方法	①主として、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの受益証券への投資を通じて、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、高利回りの獲得をめざします。 ②当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドとダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドでは、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
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、分配対象額の範囲内で、下記イ. およびロ. に基づき分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。 イ. 計算期末の前営業日の基準価額（1万口当たり。既払分配金を加算しません。以下同じ。）が10,500円未満の場合、原則として、主要投資対象とする外国投資信託のポートフォリオにおける利子・配当収入相当分から経費（外国投資信託の経費を含みます。）を控除した額を分配することをめざします。 ロ. 計算期末の前営業日の基準価額が10,500円以上の場合、原則として、当該基準価額に応じ、下記の金額（1万口当たり）を分配することをめざします。 a. 10,500円以上11,000円未満の場合…100円 b. 11,000円以上11,500円未満の場合…150円 c. 11,500円以上12,000円未満の場合…200円 d. 12,000円以上12,500円未満の場合…250円 e. 12,500円以上の場合…300円 なお、計算期末の前営業日から当該計算期末までに基準価額が急激に変動した場合には、上記の分配を行わないことがあります。

# ダイワ豪ドル建て 高利回り証券ファンド －予想分配金提示型－

## 運用報告書（全体版）

第25期（決算日	2014年11月17日）
第26期（決算日	2014年12月17日）
第27期（決算日	2015年1月19日）
第28期（決算日	2015年2月17日）
第29期（決算日	2015年3月17日）
第30期（決算日	2015年4月17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、「ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド－予想分配金提示型－」は、このたび、第30期の決算を行ないました。

ここに、第25期～第30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/>

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額				公社債 組入比率	投資 受益組	信託 証券比	純資 産額
	(分配落)	税金 込配 分金	期騰 落	中率				
1 期末(2012年11月19日)	円 10,205	円 —		% 2.1	% 0.3	% 98.9	百万円 37,284	
2 期末(2012年12月17日)	10,638	100		5.2	0.3	97.3	41,447	
3 期末(2013年1月17日)	11,265	150		7.3	0.3	97.0	46,559	
4 期末(2013年2月18日)	11,433	200		3.3	0.3	97.8	46,592	
5 期末(2013年3月18日)	11,502	200		2.4	0.3	97.3	46,644	
6 期末(2013年4月17日)	11,664	200		3.1	0.3	97.0	46,687	
7 期末(2013年5月17日)	11,500	200		0.3	0.3	97.3	45,908	
8 期末(2013年6月17日)	10,325	30	△	10.0	0.3	95.7	38,979	
9 期末(2013年7月17日)	10,359	30		0.6	0.3	95.9	37,836	
10 期末(2013年8月19日)	10,202	30	△	1.2	0.3	96.1	36,302	
11 期末(2013年9月17日)	10,458	30		2.8	0.3	95.8	36,286	
12 期末(2013年10月17日)	10,693	100		3.2	0.5	96.8	34,381	
13 期末(2013年11月18日)	10,624	100		0.3	0.4	96.4	31,604	
14 期末(2013年12月17日)	10,426	30	△	1.6	0.4	95.9	29,803	
15 期末(2014年1月17日)	10,393	100		0.6	0.5	96.5	28,752	
16 期末(2014年2月17日)	10,401	30		0.4	0.4	95.6	27,360	
17 期末(2014年3月17日)	10,349	100		0.5	0.5	96.5	26,047	
18 期末(2014年4月17日)	10,746	100		4.8	0.5	96.5	25,578	
19 期末(2014年5月19日)	10,663	100		0.2	0.5	96.4	24,801	
20 期末(2014年6月17日)	10,698	100		1.3	0.5	96.6	24,538	
21 期末(2014年7月17日)	10,638	100		0.4	0.5	96.7	23,679	
22 期末(2014年8月18日)	10,556	100		0.2	0.1	96.8	23,339	
23 期末(2014年9月17日)	10,624	100		1.6	0.1	97.1	23,260	
24 期末(2014年10月17日)	10,177	30	△	3.9	0.2	96.1	22,143	
25 期末(2014年11月17日)	11,011	150		9.7	0.2	97.6	23,434	
26 期末(2014年12月17日)	10,318	100	△	5.4	0.2	96.9	21,687	
27 期末(2015年1月19日)	10,371	30		0.8	0.2	96.1	21,711	
28 期末(2015年2月17日)	9,927	30	△	4.0	0.2	96.2	20,374	
29 期末(2015年3月17日)	9,979	30		0.8	0.2	96.2	20,191	
30 期末(2015年4月17日)	9,968	30		0.2	0.2	96.2	20,040	

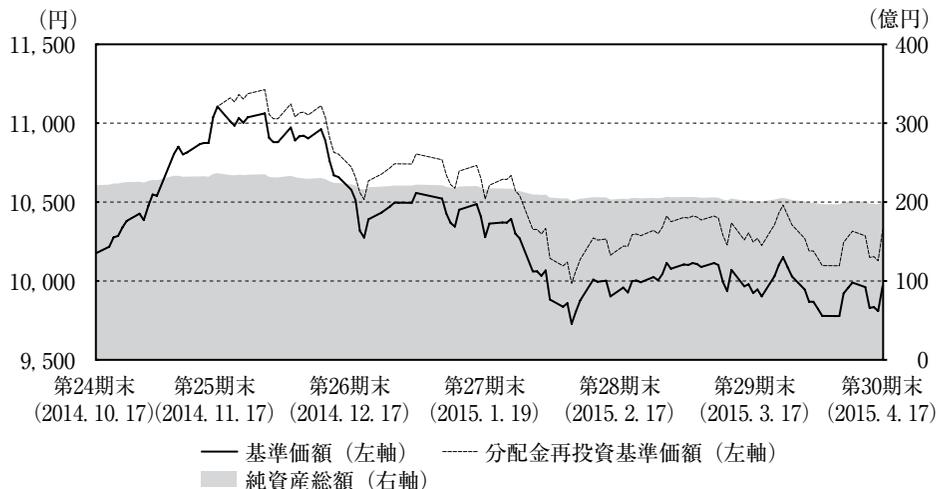
(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 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4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

■当作成期間（第25期～第30期）中の基準価額と市況の推移



\*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。

\*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 入 社 比	債 率	投 資 信 託 受 組 益 入 証 比	託 券 率
		騰 落 率					
第25期	(期首) 2014年10月17日	円	%		%		%
	10月末	10,177	—		0.2		96.1
	(期末) 2014年11月17日	10,540	3.6		0.3		99.3
第26期	(期首) 2014年11月17日	11,161	9.7		0.2		97.6
	11月末	11,011	—		0.2		97.6
	(期末) 2014年12月17日	10,880	△ 1.2		0.1		99.3
第27期	(期首) 2014年12月17日	10,418	△ 5.4		0.2		96.9
	12月末	10,318	—		0.2		96.9
	(期末) 2015年1月19日	10,558	2.3		0.2		99.3
第28期	(期首) 2015年1月19日	10,401	0.8		0.2		96.1
	1月末	10,371	—		0.2		96.1
	(期末) 2015年2月17日	9,882	△ 4.7		0.2		99.2
第29期	(期首) 2015年2月17日	9,957	△ 4.0		0.2		96.2
	2月末	9,927	—		0.2		96.2
	(期末) 2015年3月17日	10,078	1.5		0.2		99.2
第30期	(期首) 2015年3月17日	10,009	0.8		0.2		96.2
	3月末	9,979	—		0.2		96.2
	(期末) 2015年4月17日	9,868	△ 1.1		0.2		99.3
		9,998	0.2		0.2		96.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 《運用経過》

### ◆基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

第25期首：10,177円 第30期末：9,968円（既払分配金370円） 騰落率：1.4%（分配金再投資ベース）

#### 【基準価額の主な変動要因】

豪ドル建てハイブリッド証券および普通社債は利息収入が支えとなり、堅調な値動きとなりました。また豪ドルは対円でやや下落しましたが、当ファンドの基準価額は値上がりしました。

### ◆投資環境について

#### ○オーストラリア債券市況

オーストラリア債券市況は、金利低下しました。第25期首より、世界的な景気減速懸念や各国・地域の中央銀行の金融緩和政策を受けて世界的に金利低下が優勢となりました。オーストラリアに関しても、原油価格の下落や中国の金融緩和、RBA（オーストラリア準備銀行）の利下げ観測などを背景に金利低下が続きました。2015年2月には、RBAが大方の予想に反し政策金利を引下げたことで金利低下が進行しました。

豪ドル建て社債や同ハイブリッド証券の信用スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は、世界景気の先行きへの懸念や原油価格の下落など、商品市況の低迷を受けて拡大傾向となりました。

#### ○為替相場

豪ドル為替相場は、対円でやや下落しました。2014年10月末に日銀が追加金融緩和を決定したことで、11月半ばにかけて大きく上昇（円安）しました。しかしその後は、商品市況の下落やRBAの利下げ観測の台頭、中国経済の減速見通し、2015年2月のRBAによる利下げなどを受けて下落しました。2月中旬以降は、原油価格の下げ止まりや世界的な株価の上昇が豪ドルの下支え要因となり、レンジ推移となりました。

### ◆前作成期間末における「今後の運用方針」

当ファンドでは、「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」（以下、「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」といいます。）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

受益証券の運用につきましては、豪ドル建て社債や同ハイブリッド証券の流通市場で割安に取引されている銘柄や、新規発行の優先証券の組入れに注力しています。2014年後半も普通社債とハイブリッド証券の起債が共に活発になると見込んでおり、今後も新規発行および流通市場の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力する方針です。

### ◆ポートフォリオについて

#### ○当ファンド

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドとダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、当期間を通じてダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドへの投資割合を高位に維持することを基本としました。

#### ○ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債に投資し、高利回りの獲得をめざして運用を行ないました。

○ダイワ・マネーポートフォリオ・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や参考指数を設けておりません。

◆分配金について

【収益分配金】

1万口当り分配金（税込み）は、第25期は150円、第26期は100円、第27期から第30期はそれぞれ30円といたしました。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第 25 期	第 26 期	第 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期
	2014年10月18日 ～2014年11月17日	2014年11月18日 ～2014年12月17日	2014年12月18日 ～2015年1月19日	2015年1月20日 ～2015年2月17日	2015年2月18日 ～2015年3月17日	2015年3月18日 ～2015年4月17日
当期分配金（税込み）（円）	150	100	30	30	30	30
対基準価額比率（％）	1.34	0.96	0.29	0.30	0.30	0.30
当期の収益（円）	84	37	30	30	30	30
当期の収益以外（円）	65	62	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額（円）	1,029	966	979	989	1,000	1,005

(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) 円未満は切捨てしており、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。

【決定根拠、留保益の今後の運用方針】

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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第 25 期	第 26 期	第 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期
(a) 経費控除後の配当等収益	46.39円	37.60円	43.02円	39.44円	40.67円	35.42円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	37.93	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	405.19	406.33	408.02	408.52	410.71	412.83
(d) 分配準備積立金	689.71	622.91	558.83	571.37	578.65	587.24
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,179.24	1,066.85	1,009.88	1,019.33	1,030.04	1,035.50
(f) 分配金	150.00	100.00	30.00	30.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,029.24	966.85	979.88	989.33	1,000.04	1,005.50

(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

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの受益証券への投資割合を高位に保つことによって、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

### ○ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

豪ドル建て社債や同ハイブリッド証券の流通市場で割安に取引されている銘柄や、新規発行銘柄の組入れに注力しています。普通社債とハイブリッド証券は今後も活発な状況が続くと見込んでおり、引続き新規発行および流通市場の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。

### ○ダイワ・マネーポートフォリオ・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	第25期～第30期		項 目 の 概 要
	(2014. 10. 18～2015. 4. 17)		
	金 額	比 率	
信託報酬	60円	0. 581%	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（月末値の平均値）は10, 317円です。
（投信会社）	(17)	(0. 161)	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）	(42)	(0. 404)	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. 016)	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 （監査費用）	0 (0)	0. 004 (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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	60	0. 584	

(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

投資信託受益証券

(2014年10月18日から2015年4月17日まで)

決 算 期	第 25 期 ～ 第 30 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外 国（邦貨建）	35, 592. 684	4, 075, 083	52, 433. 624	5, 998, 336

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。

(注2) 金額は受渡し代金。

(注3) 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

(2014年10月18日から2015年4月17日まで)

銘 柄	第 25 期 ～ 第 30 期				銘 柄	買 付		
	買 付		売 付			買 付		
	口 数	金 額	平均単価	口 数		金 額	平均単価	
	千口	千円	円	千口	千円	円		
DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	30, 436. 949	3, 485, 082	114	DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	52, 433. 624	5, 998, 336	114	

(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当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第25期～第30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・マネーポートフォリオ・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2014年10月18日から2015年4月17日まで)

決算期	第 25 期			第 30 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	399	209	52.5	—	—	—
コール・ローン	8,788	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合26.7%

※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)当作成期間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

当作成期間（第25期～第30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、当作成期間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	第 30 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A)	千口 173,393,951	千円 19,289,036	% 96.2

(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	第24期末	第 30 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	53,926	53,926	54,217

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年4月17日現在

項 目	第 30 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	19,289,036	95.7
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	54,217	0.3
コール・ローン等、その他	811,862	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	20,155,116	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11月17日)、(2014年12月17日)、(2015年1月19日)、(2015年2月17日)、(2015年3月17日)、(2015年4月17日)現在

項 目	第 25 期 末	第 26 期 末	第 27 期 末	第 28 期 末	第 29 期 末	第 30 期 末
(A)資 産	23,960,165,426円	21,954,026,204円	22,708,468,333円	20,612,077,907円	20,468,696,779円	20,163,787,786円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	841,627,484	840,534,498	110,622,210	809,868,522	826,051,920	803,191,307
投資信託受益証券(評価額)	22,863,876,200	21,018,351,963	20,870,962,381	19,594,811,643	19,419,471,116	19,289,036,736
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	54,217,743	54,217,743	54,217,743	54,217,743	54,217,743	54,217,743
未 収 入 金	200,443,999	40,922,000	1,672,665,999	153,179,999	168,956,000	17,342,000
(B)負 債	525,305,660	266,447,311	996,642,707	237,922,949	277,505,310	122,964,210
未 払 金	100,222,000	20,461,000	836,333,000	76,590,000	84,478,000	8,671,000
未 払 収 益 分 配 金	319,258,817	210,184,903	62,807,602	61,570,012	60,703,203	60,313,693
未 払 解 約 金	83,011,572	13,413,096	73,865,823	79,895,498	113,238,871	33,310,736
未 払 信 託 報 酬	22,655,955	22,077,693	23,164,815	19,262,218	18,352,579	19,798,649
そ の 他 未 払 費 用	157,316	310,619	471,467	605,221	732,657	870,132
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	23,434,859,766	21,687,578,893	21,711,825,626	20,374,154,958	20,191,191,469	20,040,823,576
元 本	21,283,921,156	21,018,490,321	20,935,867,486	20,523,337,534	20,234,401,118	20,104,564,600
次 期 繰 越 損 益 金	2,150,938,610	669,088,572	775,958,140	△ 149,182,576	△ 43,209,649	△ 63,741,024
(D)受 益 権 総 口 数	21,283,921,156口	21,018,490,321口	20,935,867,486口	20,523,337,534口	20,234,401,118口	20,104,564,600口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	11,011円	10,318円	10,371円	9,927円	9,979円	9,968円

\*第24期末における元本額は21,759,169,728円、当作成期間(第25期~第30期)中における追加設定元本額は323,922,667円、同解約元本額は1,978,527,795円です。  
 \*第30期末の計算口数当りの純資産額は9,968円です。  
 \*第30期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は63,741,024円です。

■損益の状況

項 目	第25期		第26期		第27期		第28期		第29期		第30期	
	自2014年10月18日	至2014年11月17日	自2014年11月18日	至2014年12月17日	自2014年12月18日	至2015年1月19日	自2015年1月20日	至2015年2月17日	自2015年2月18日	至2015年3月17日	自2015年3月18日	至2015年4月17日
(A)配 当 等 収 益	99,831,528円	101,266,995円	102,257,875円	100,344,575円	91,607,119円	91,152,193円						
受 取 配 当 金	99,824,723	101,260,525	102,251,652	100,338,815	91,600,271	91,146,178						
受 取 利 息	6,805	6,470	6,223	5,760	6,848	6,015						
(B)有価証券売買損益	2,013,717,720	△ 1,323,786,391	93,503,525	△ 928,884,702	90,424,721	△ 31,492,842						
売 買 益	2,041,046,529	3,140,804	94,296,524	15,209,797	96,476,666	1,964,678						
売 買 損	△ 27,328,809	△ 1,326,927,195	△ 792,999	△ 944,094,499	△ 6,051,945	△ 33,457,520						
(C)信 託 報 酬 等	△ 22,813,271	△ 22,230,996	△ 23,325,663	△ 19,395,972	△ 18,480,015	△ 19,936,124						
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	2,090,735,977	△ 1,244,750,392	172,435,737	△ 847,936,099	163,551,825	39,723,227						
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△ 443,260,897	1,309,278,235	△ 144,649,113	△ 34,301,433	△ 927,062,417	△ 816,025,085						
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	822,722,347	814,745,632	810,979,118	794,624,968	781,004,146	772,874,527						
(配 当 等 相 当 額)	( 862,421,616)	( 854,052,634)	( 854,230,619)	( 838,422,516)	( 831,049,599)	( 829,996,045)						
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 39,699,269)	(△ 39,307,002)	(△ 43,251,501)	(△ 43,797,548)	(△ 50,045,453)	(△ 57,121,518)						
(G)合 計 (D+E+F)	2,470,197,427	879,273,475	838,765,742	△ 87,612,564	17,493,554	△ 3,427,331						
(H)収 益 分 配 金	△ 319,258,817	△ 210,184,903	△ 62,807,602	△ 61,570,012	△ 60,703,203	△ 60,313,693						
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	2,150,938,610	669,088,572	775,958,140	△ 149,182,576	△ 43,209,649	△ 63,741,024						
追 加 信 託 差 損 益 金	822,722,347	814,745,632	810,979,118	794,624,968	781,004,146	772,874,527						
(配 当 等 相 当 額)	( 862,421,616)	( 854,052,634)	( 854,230,619)	( 838,422,516)	( 831,049,599)	( 829,996,045)						
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 39,699,269)	(△ 39,307,002)	(△ 43,251,501)	(△ 43,797,548)	(△ 50,045,453)	(△ 57,121,518)						
分 配 準 備 積 立 金	1,328,216,263	1,178,130,109	1,197,243,113	1,192,023,550	1,192,478,067	1,191,533,719						
繰 越 損 益 金	—	△ 1,323,787,169	△ 1,232,264,091	△ 2,135,831,094	△ 2,016,691,862	△ 2,028,149,270						

(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9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	第 25 期	第 26 期	第 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期
(a) 経費控除後の配当等収益	98,755,919円	79,036,777円	90,073,273円	80,949,183円	82,306,714円	71,216,831円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	80,742,179	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	862,421,616	854,052,634	854,230,619	838,422,516	831,049,599	829,996,045
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,467,976,982	1,309,278,235	1,169,977,442	1,172,644,379	1,170,874,556	1,180,630,581
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	2,509,896,696	2,242,367,646	2,114,281,334	2,092,016,078	2,084,230,869	2,081,843,457
(f) 分 配 金	319,258,817	210,184,903	62,807,602	61,570,012	60,703,203	60,313,693
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	2,190,637,879	2,032,182,743	2,051,473,732	2,030,446,066	2,023,527,666	2,021,529,764
(h) 受 益 権 総 口 数	21,283,921,156口	21,018,490,321口	20,935,867,486口	20,523,337,534口	20,234,401,118口	20,104,564,600口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万 口 当 り 分 配 金	第 25 期	第 26 期	第 27 期	第 28 期	第 29 期	第 30 期
	(単 価)	150円	100円	30円	30円	30円
	(11, 011円)	(10, 318円)	(10, 371円)	(9, 927円)	(9, 979円)	(9, 968円)

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、上記( )内の基準価額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。

#### 〈お知らせ〉

##### ●運用報告書（全体版）の電子交付について

2014年12月1日施行の法改正により、運用報告書は「交付運用報告書」と「運用報告書（全体版）」（本書）の2種類になりましたが、「運用報告書（全体版）」については、交付に代えて電子交付する旨を信託約款に定めました。

##### ●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。

【本資料は、受益者のみなさまにファンドの運用状況をお知らせするためのものであり、投資の勧誘を目的としたものではありません。】

ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・  
ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド ー予想分配金提示型ー）の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」の受益証券の状況は次の通りです。

（注）2015年4月17日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（豪ドル建て）

貸借対照表

2014年3月31日

<b>資産</b>	
投資証券、時価（購入費用267,636,311ドル）	ドル 275,437,295
現金	127,979
未収：	
売却済みの投資証券	4,618,145
配当金	155,191
利息	1,418,919
その他の資産	14,080
<b>資産合計</b>	<b>281,771,609</b>
<b>負債</b>	
為替先渡契約による評価損	8,503
未払：	
購入済みの投資証券	4,063,221
償還済みの受益証券	782,490
投資運用会社報酬	146,311
保管報酬	66,647
会計および管理報酬	52,031
専門家報酬	46,752
名義書換代理会社報酬	9,325
<b>負債合計</b>	<b>5,175,280</b>
<b>純資産</b>	<b>ドル 276,596,329</b>
<b>純資産：</b>	
クラスA	ドル 276,596,329
<b>発行済受益証券数</b>	
クラスA	230,386,655
<b>受益証券1口当りの純資産</b>	
クラスA	ドル 1.201

損益計算書

2014年3月31日に終了した年度

投資収益

利子収益（源泉税1,307ドル控除後）	ドル	16,351,898
配当収益（源泉税72,332ドル控除後）		1,702,977
<b>投資収益合計</b>		<b>18,054,875</b>

費用

投資運用会社報酬		2,398,911
保管報酬		282,441
会計および管理報酬		239,506
専門家報酬		52,617
名義書換代理会社報酬		46,753
受託会社報酬		17,970
登録料		624
<b>費用合計</b>		<b>3,038,822</b>

<b>純投資収益</b>		<b>15,016,053</b>
--------------	--	-------------------

実現および評価益(損)：

実現益(損)

有価証券投資		5,113,239
外国為替取引および為替先渡契約		(376,659)
<b>純実現益</b>		<b>4,736,580</b>

評価益(損)の純変動：

有価証券投資		4,232,129
外国為替換算および為替先渡契約		2,583
<b>評価益の純変動</b>		<b>4,234,712</b>

<b>純実現益および純評価益</b>		<b>8,971,292</b>
--------------------	--	------------------

<b>業務活動の結果生じた純資産の純増</b>	ドル	<b>23,987,345</b>
-------------------------	----	-------------------

投資明細表

2014年3月31日

額面	銘柄	純資産に占める比率(%)	公正価値	額面	銘柄	純資産に占める比率(%)	公正価値
	債券 (86.9%)			31,469	9.36% due 12/20/17 (a)		3,112,220
	オーストラリア (60.5%)				National Australia Bank, Ltd.		
	社債 (60.5%)			112,590	3.88% due 06/29/49 (a)		8,680,689
	Adani Abbot Point Terminal Pty, Ltd.			48,475	5.40% due 06/18/22 (a)		4,997,560
8,500,000	5.75% due 11/01/18	ドル	8,441,087		National Capital Trust III		
	AMP Bank, Ltd.			8,750,000	3.65% due 01/29/49 (a)		8,387,837
5,000,000	3.73% due 05/29/17 (a)		5,048,589		National Wealth Management Holdings, Ltd.		
	AMP, Ltd.			7,000,000	5.25% due 12/07/17		7,202,804
28,550	5.30% due 12/18/23 (a)		2,909,280		Origin Energy, Ltd.		
	ANZ Wealth Australia, Ltd.			57,098	6.66% due 12/22/71 (a)		5,901,078
5,000,000	4.01% due 03/22/16 (a)		5,052,675		Stockland Trust		
	APT Pipelines, Ltd.			5,000,000	5.50% due 09/06/19		5,067,900
36,951	7.15% due 09/30/72 (a)		3,913,111		Suncorp Group, Ltd.		
	Aurizon Network Pty, Ltd.			19,492	5.48% due 11/22/23 (a)		1,959,882
5,000,000	5.75% due 10/28/20		5,016,555		Suncorp-Metway, Ltd.		
	Australia & New Zealand Banking Group, Ltd.			30,457	3.38% due 05/29/49 (a)		2,200,518
34,851	5.41% due 06/20/22 (a)		3,593,138		Tabcorp Holdings, Ltd.		
	Caltex Australia, Ltd.			31,263	6.66% due 03/22/37 (a)		3,232,773
3,454	7.15% due 09/15/37 (a)		369,923	18,188	6.88% due 05/01/14		1,837,525
	Colonial Holding Co., Ltd.			36,409	5.79% due 07/05/19		3,786,258
98,546	5.95% due 03/31/37 (a)		10,100,211		Telstra Corp, Ltd.		
	Commonwealth Bank of Australia			5,000,000	4.00% due 11/15/17		5,010,765
67,228	3.70% due 12/24/15 (a)		6,783,305		Westpac Banking Corp.		
	Crown Resorts, Ltd.			5,000,000	4.50% due 02/25/19		5,001,880
63,884	7.67% due 09/14/72 (a)		6,851,585	37,436	4.93% due 08/22/23 (a)		3,780,982
	GE Capital Australia Funding Pty, Ltd.			66,662	5.38% due 08/23/22 (a)		6,909,516
5,000,000	5.25% due 09/04/20		5,113,695	5,000	5.88% due 11/24/36 (a)		523,250
	Global Switch Property Australia Pty, Ltd.				社債合計		<u>167,344,988</u>
4,500,000	6.25% due 12/23/20		4,506,449		オーストラリア合計		<u>167,344,988</u>
	Healthscope Notes, Ltd.				(購入費用 162,104,359ドル)		
2,167	10.25% due 03/25/18		228,445		チリ (1.8%)		
42,941	11.25% due 06/17/16		4,551,775		社債 (1.8%)		
	Incitec Pivot, Ltd.			5,000,000	Banco Santander Chile		
5,000,000	5.75% due 02/21/19		5,006,355		4.50% due 03/13/17		4,977,200
	Insurance Australia, Ltd.				社債合計		<u>4,977,200</u>
2,500,000	5.47% due 03/19/40 (a)		2,503,660		チリ合計		<u>4,977,200</u>
	Macquarie Finance, Ltd.				(購入費用 4,989,080ドル)		
117,611	4.41% due 01/29/49 (a)		9,761,713		中国 (1.8%)		
	MYOB Finance Australia, Ltd.				譲渡性預金証書 (1.8%)		
				5,000,000	Bank of China, Ltd.		
					3.65% due 03/14/16 (a)		4,992,310

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド ー予想分配金提示型ー

額面	銘柄	純資産に占める比率(%)	公正価値	額面	銘柄	純資産に占める比率(%)	公正価値
	譲渡性預金証書合計		4,992,310		Citigroup, Inc.		
	中国合計		4,992,310	5,000,000	4.75% due 02/05/18		5,051,435
	(購入費用 5,000,000ドル)				Metropolitan Life Global Funding I		
	フランス (5.0%)			5,000,000	4.50% due 10/10/18		5,001,770
	社債 (5.0%)				社債合計		15,127,320
8,100,000	AXA S. A.				米国合計		15,127,320
	4.03% due 12/29/49 (a)		7,783,914		(購入費用 14,955,207ドル)		
	BNP Paribas				債券合計		240,379,673
6,000,000	4.50% due 10/04/17		6,046,620		(購入費用 233,844,795ドル)		
	社債合計		13,830,534				
	フランス合計				株数		
	(購入費用 13,243,880ドル)		13,830,534		優先株式 (8.8%)		
	オランダ (6.8%)				オーストラリア (8.8%)		
	社債 (6.8%)				銀行 (1.6%)		
4,000,000	ABN AMRO Bank NV			45,710	Bendigo and Adelaide Bank, Ltd.		4,507,006
	4.75% due 02/05/19		3,993,096		総合金融サービス (3.9%)		
	ING Bank NV			93,264	Goodman PLUS Trust		9,340,390
5,500,000	3.99% due 11/27/18 (a)		5,550,385		Macquarie Group, Ltd.		
	Swiss Reinsurance Co. via ELM BV			13,680	6.62% (a)		1,427,918
9,800,000	3.78% due 04/29/49 (a)		9,360,294				10,768,308
	社債合計		18,903,775		多角的企業 (0.6%)		
	オランダ合計		18,903,775	18,710	Seven Group Holdings, Ltd.		1,683,900
	(購入費用 18,018,074ドル)				投資会社 (1.4%)		
	ニュージーランド (2.2%)			39,492	Australand Assets Trust		3,877,719
	社債 (2.2%)				リート (1.3%)		
	Nufarm Finance NZ, Ltd.			41,532	Multiplex SITES Trust		3,462,523
79,547	6.63% due 04/29/49		6,077,391		オーストラリア合計		24,299,456
	社債合計		6,077,391		(購入費用 23,033,350ドル)		
	ニュージーランド合計		6,077,391		優先株式合計		24,299,456
	(購入費用 6,622,999ドル)				(購入費用 23,033,350ドル)		
	韓国 (1.9%)				元本		
	社債 (1.9%)				MMF (3.9%)		
	Korea South-East Power Co. Ltd.			10,758,166	オーストラリア (3.9%)		
5,000,000	5.75% due 09/25/20		5,168,155		Goldman Sachs A\$ Cash Reserves Fund Class A	ドル	10,758,166
	社債合計		5,168,155		オーストラリア合計		10,758,166
	韓国合計		5,168,155		MMF		10,758,166
	(購入費用 4,952,156ドル)				(購入費用 10,758,166ドル)		
	英国 (1.4%)				投資証券合計	99.6	ドル 275,437,295
	社債 (1.4%)				(購入費用 267,636,311ドル)		
	Barclays Bank PLC				負債を上回る現金およびその他の資産	0.4	1,159,034
4,000,000	4.50% due 04/04/19		3,958,000		純資産	100.0%	ドル 276,596,329
	社債合計		3,958,000				
	英国合計		3,958,000				
	(購入費用 3,959,040ドル)						
	米国 (5.5%)						
	社債 (5.5%)						
	Bank of America Corp.						
5,000,000	4.05% due 08/23/18 (a)		5,074,115				

(a) 2014年3月31日時点の変動利付き証券。

2014年3月31日現在のファンドレベル為替先渡契約

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/ (損)
JPY	Brown Brothers Harriman & Co.	35,130,000	2014年4月1日	AUD	372,491	ドル	— ドル (4,423)	ドル (4,423)
JPY	Brown Brothers Harriman & Co.	39,560,000	2014年4月2日	AUD	418,593		— (4,080)	(4,080)
						ドル	— ドル (8,503)	ドル (8,503)

通貨の略称：

AUD - 豪ドル

JPY - 日本円

<補足情報>

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド（予想分配金提示型））が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・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、当ファンドの第30期の決算日（2015年4月17日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの組入資産の内容等を16ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年10月18日から2015年4月17日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
510 国庫短期証券 2015/5/12	99,999		
512 国庫短期証券 2015/5/18	99,999		
502 国庫短期証券 2015/3/30	40,000		
481 国庫短期証券 2014/12/22	39,999		
521 国庫短期証券 2015/6/29	39,998		
496 国庫短期証券 2015/3/9	30,000		
464 国庫短期証券 2015/1/14	19,999		
497 国庫短期証券 2015/3/16	19,999		
493 国庫短期証券 2015/2/23	9,999		

(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4月17日現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（387,802千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

2015年4月17日現在							
区 分	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入 比 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 240,000	千円 239,998	% 61.6	% —	% —	% —	% 61.6

(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4月17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	510 国庫短期証券	—	千円 100,000	千円 99,999	2015/05/12	
	512 国庫短期証券	—	100,000	99,999	2015/05/18	
	521 国庫短期証券	—	40,000	39,998	2015/06/29	
合 計	銘 柄 数 金 額	3 銘柄	240,000	239,998		

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書 第6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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの第6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

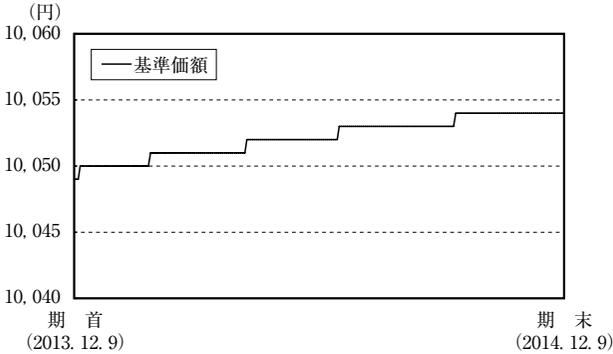
## 大和投資信託

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	%	
(期首) 2013年12月9日	10,049	—	78.1
12月末	10,050	0.0	78.1
2014年1月1日	10,050	0.0	97.6
2月末	10,051	0.0	73.2
3月末	10,051	0.0	73.2
4月末	10,052	0.0	73.2
5月末	10,052	0.0	73.2
6月末	10,053	0.0	73.2
7月末	10,053	0.0	137.0
8月末	10,053	0.0	63.2
9月末	10,054	0.0	63.2
10月末	10,054	0.0	125.2
11月末	10,054	0.0	62.6
(期末) 2014年12月9日	10,054	0.0	62.6

(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：10,049円 期末：10,054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
国 内	国 債 証 券	千円	千円
		409,953	—
		(	520,000)

(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
481 国庫短期証券 2014/12/22	39,999			
469 国庫短期証券 2014/11/4	39,996			
428 国庫短期証券 2014/5/7	39,994			
449 国庫短期証券 2014/8/4	39,994			
427 国庫短期証券 2014/4/28	39,994			
448 国庫短期証券 2014/7/28	39,993			
430 国庫短期証券 2014/5/12	29,996			
450 国庫短期証券 2014/8/11	29,995			
447 国庫短期証券 2014/7/22	19,997			
425 国庫短期証券 2014/4/21	19,996			

(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			期 末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	50,000	49,999	62.6	—	—	—	62.6

(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)

区 分	当 期			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	481 国庫短期証券	—	40,000	39,999	2014/12/22	
	493 国庫短期証券	—	10,000	9,999	2015/02/23	
合計	銘柄数					
	金額	2銘柄	50,000	49,999		

(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	49,999	62.6
コール・ローン等、その他	29,897	37.4
投資信託財産総額	79,897	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	79,897,648円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	29,897,861
公 社 債(評価額)	49,999,787
(B)負 債	—
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	79,897,648
元 本	79,467,922
次 期 繰 越 損 益 金	429,726
(D)受 益 権 総 口 数	79,467,922口
1万口当り基準価額(C/D)	10,054円

\* 期首における元本額は203,797,483円、当期中における追加設定元本額は9,949円、同解約元本額は124,339,510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/ロジャーズ国際コモディティ™・ファンド25,528,439円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)998円、ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド(通貨選択型)アジア通貨・コース(毎月分配型)998円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券α(毎月分配型)9,949円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド-予想分配金提示型-53,926,540円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,054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	81,223円
受 取 利 息	81,223
(B)有価証券売買損益	1,008
売 買 益	1,008
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	82,231
(D)前 期 繰 越 損 益 金	1,007,934
(E)解 約 差 損 益 金	△ 660,490
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	51
(G)合 計 (C+D+E+F)	429,726
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	429,726

(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。