

★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ないます。 |
| 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、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等には、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31期 | （決算日 | 2015年5月18日） |
| 第32期 | （決算日 | 2015年6月17日） |
| 第33期 | （決算日 | 2015年7月17日） |
| 第34期 | （決算日 | 2015年8月17日） |
| 第35期 | （決算日 | 2015年9月17日） |
| 第36期 | （決算日 | 2015年10月19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36期の決算を行ないました。

ここに、第31期～第36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/>

最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 公社債 組入比率 | 債券 利率 | 投資信託 資産証 書比率 | 純資産 総額 |
|--------------------|-------------|----------------|---------------|-------------|-----------|--------------------|-----------|
| | (分配落) | 税金 込配 み金 | 期騰 落 中率 | | | | |
| 7期末 (2013年5月17日) | 円 11,500 | 円 200 | % 0.3 | % 0.3 | % 97.3 | 百万円 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 | |
| 31期末 (2015年5月18日) | 10,310 | 30 | 3.7 | 0.2 | 96.2 | 20,396 | |
| 32期末 (2015年6月17日) | 10,204 | 30 | △ 0.7 | 0.2 | 96.1 | 19,927 | |
| 33期末 (2015年7月17日) | 9,807 | 30 | △ 3.6 | 0.3 | 95.7 | 18,751 | |
| 34期末 (2015年8月17日) | 9,714 | 30 | △ 0.6 | 0.2 | 95.9 | 17,782 | |
| 35期末 (2015年9月17日) | 9,102 | 30 | △ 6.0 | 0.2 | 96.0 | 16,333 | |
| 36期末 (2015年10月19日) | 9,091 | 30 | 0.2 | 0.2 | 95.8 | 15,793 | |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

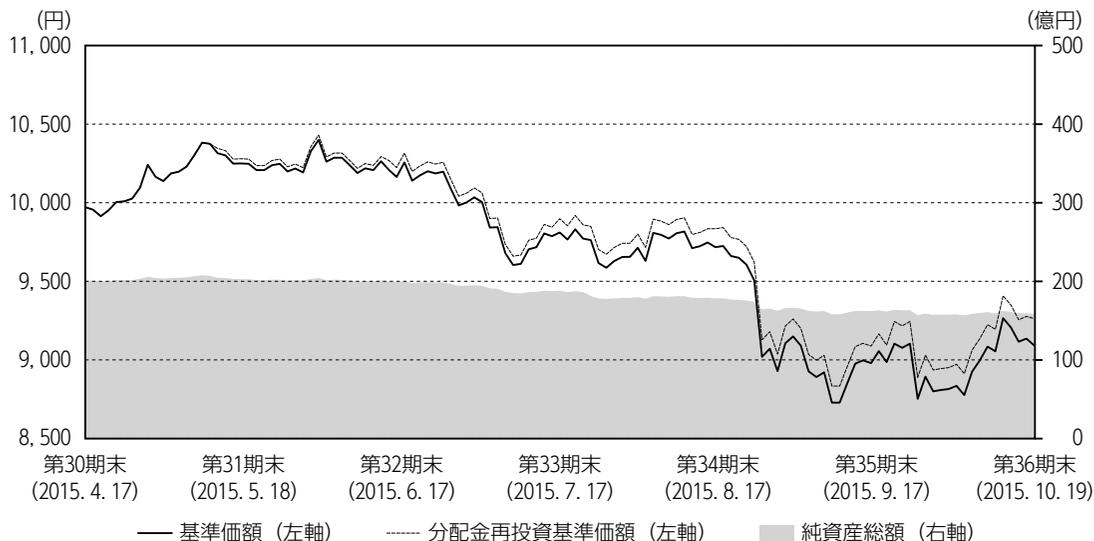
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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。

《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。

* 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。

■基準価額・騰落率

第31期首：9,968円

第36期末：9,091円（既払分配金180円）

騰落率：△7.1%（分配金再投資ベース）

■基準価額の変動要因

豪ドル建てハイブリッド証券および普通社債が軟調な値動きとなったほか、豪ドルが対円で下落したため、当ファンドの基準価額は値下がりしました。

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-

| | 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 公 社 債 率 組 入 比 | 投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率 |
|------|------------------|---------|------------|------------------|-------------------------------|
| | | 円 | 騰 落 率 % | | |
| 第31期 | (期首) 2015年 4月17日 | 9,968 | — | 0.2 | 96.2 |
| | 4月末 | 10,236 | 2.7 | 0.2 | 99.2 |
| | (期末) 2015年 5月18日 | 10,340 | 3.7 | 0.2 | 96.2 |
| 第32期 | (期首) 2015年 5月18日 | 10,310 | — | 0.2 | 96.2 |
| | 5月末 | 10,194 | △ 1.1 | 0.2 | 99.3 |
| | (期末) 2015年 6月17日 | 10,234 | △ 0.7 | 0.2 | 96.1 |
| 第33期 | (期首) 2015年 6月17日 | 10,204 | — | 0.2 | 96.1 |
| | 6月末 | 9,979 | △ 2.2 | 0.2 | 99.2 |
| | (期末) 2015年 7月17日 | 9,837 | △ 3.6 | 0.3 | 95.7 |
| 第34期 | (期首) 2015年 7月17日 | 9,807 | — | 0.3 | 95.7 |
| | 7月末 | 9,653 | △ 1.6 | 0.3 | 99.2 |
| | (期末) 2015年 8月17日 | 9,744 | △ 0.6 | 0.2 | 95.9 |
| 第35期 | (期首) 2015年 8月17日 | 9,714 | — | 0.2 | 95.9 |
| | 8月末 | 9,148 | △ 5.8 | 0.2 | 99.2 |
| | (期末) 2015年 9月17日 | 9,132 | △ 6.0 | 0.2 | 96.0 |
| 第36期 | (期首) 2015年 9月17日 | 9,102 | — | 0.2 | 96.0 |
| | 9月末 | 8,808 | △ 3.2 | 0.2 | 99.2 |
| | (期末) 2015年10月19日 | 9,121 | 0.2 | 0.2 | 95.8 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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、金利上昇（債券価格は下落）しました。

2015年5月初旬にRBA（オーストラリア準備銀行）による利下げが行なわれたものの、その後の追加緩和観測が後退したことや好調な経済指標が材料となり、金利は上昇しました。6月中旬にかけては、米国の利上げ観測に連れて金利上昇が続きました。しかし7月から8月後半にかけては、ギリシャ情勢の混乱や中国株の下落などを背景とした不安定な金融市場への懸念が強まったことで、金利低下に転じました。9月中旬には株高を受けていったん金利上昇しましたが、9月後半から第36期末にかけては、米国の利上げ見送りもあり再び金利低下しました。

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、中国経済に対する懸念や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、対円で下落しました。

第31期首より、RBAによる追加的な利下げの可能性が後退したことや商品市況が堅調に推移したことにより、豪ドルは対円で上昇しました。2015年6月後半以降は、ギリシャ情勢の混乱による市場のリスク回避姿勢の強まりや、オーストラリアの主要輸出先である中国の株式市況下落、鉄鉱石をはじめとする商品市況の悪化、オーストラリアの4－6月期の実質GDP（国内総生産）成長率が市場予想を下回ったことなどがマイナス材料となり、豪ドルは対円で下落しました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

○当ファンド

当ファンドは、「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。

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および参考指数を設けておりません。

分配金について

第31期から第36期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ30円といたしました。
 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。

■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目 | 第31期 | 第32期 | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 |
|---------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|
| | 2015年4月18日 ～2015年5月18日 | 2015年5月19日 ～2015年6月17日 | 2015年6月18日 ～2015年7月17日 | 2015年7月18日 ～2015年8月17日 | 2015年8月18日 ～2015年9月17日 | 2015年9月18日 ～2015年10月19日 |
| 当期分配金（税込み）（円） | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 対基準価額比率（％） | 0.29 | 0.29 | 0.30 | 0.31 | 0.33 | 0.33 |
| 当期の収益（円） | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 当期の収益以外（円） | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 1,017 | 1,020 | 1,024 | 1,028 | 1,031 | 1,032 |

（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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

| 項 目 | 第31期 | 第32期 | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 41.62円 | 33.69円 | 33.95円 | 33.67円 | 32.70円 | 30.67円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| (c) 収益調整金 | 414.03 | 415.31 | 415.56 | 418.22 | 418.70 | 420.65 |
| (d) 分配準備積立金 | 591.47 | 601.81 | 605.26 | 606.70 | 609.90 | 610.71 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 1,047.13 | 1,050.82 | 1,054.78 | 1,058.60 | 1,061.31 | 1,062.05 |
| (f) 分配金 | 30.00 | 30.00 | 30.00 | 30.00 | 30.00 | 30.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e-f) | 1,017.13 | 1,020.82 | 1,024.78 | 1,028.60 | 1,031.31 | 1,032.05 |

（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31期～第36期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------|----------------------------|---------|--|
| | (2015. 4. 18～2015. 10. 19) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 57円 | 0.588% | 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は9,691円です。 |
| (投信会社) | (16) | (0.163) | 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) | (40) | (0.409) | 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 | 0 | 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) | (0) | (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 | 57 | 0.592 | |

(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4月18日から2015年10月19日まで)

| 決算期 | 第 31 期 ~ 第 36 期 | | | |
|----------|-----------------|-----------|------------|-----------|
| | 買 付 | | 売 付 | |
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国 (邦貨建) | 35,830.932 | 3,921,274 | 59,734.922 | 6,425,268 |

(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

(2015年4月18日から2015年10月19日まで)

| 第 31 期 ~ 第 36 期 | | | | | | | |
|---|------------|-----------|------|---|------------|-----------|------|
| 買 付 | | | | 売 付 | | | |
| 銘 柄 | □ 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 柄 | □ 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) | 31,331.299 | 3,438,959 | 109 | DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島) | 59,734.922 | 6,425,268 | 107 |

(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31期～第36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

(2015年4月18日から2015年10月19日まで)

| 区 分 | 第 31 期 ~ 第 36 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 | 4,329 | 330 | 7.6 | 399 | — | — |
| コール・ローン | 73,138 | — | — | — | — | — |

(注) 平均保有割合4.1%

※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ベビーフ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31期～第36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 36 期 末 | | |
|---|-------------------|------------------|-----------|
| | □ 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 149,489.961 | 千円 15,135,260 | % 95.8 |

(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30期末 | 第 36 期 末 | |
|------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド | 千口 53,926 | 千口 53,926 | 千円 54,223 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年10月19日現在

| 項 目 | 第 36 期 末 | |
|------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 15,135,260 | % 95.0 |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド | 54,223 | 0.3 |
| コール・ローン等、その他 | 737,516 | 4.7 |
| 投資信託財産総額 | 15,927,000 | 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5月18日)、(2015年6月17日)、(2015年7月17日)、(2015年8月17日)、(2015年9月17日)、(2015年10月19日)現在

| 項 目 | 第31期末 | 第32期末 | 第33期末 | 第34期末 | 第35期末 | 第36期末 |
|------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| (A) 資産 | 20,898,393,358円 | 20,085,971,928円 | 18,956,999,599円 | 18,027,151,556円 | 16,473,338,748円 | 16,002,800,600円 |
| コール・ローン等 | 814,353,777 | 770,089,138 | 754,135,951 | 762,265,805 | 679,077,614 | 661,716,800 |
| 投資信託受益証券 (評価額) | 19,621,700,447 | 19,158,253,048 | 17,936,185,906 | 17,059,740,616 | 15,686,038,000 | 15,135,260,665 |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額) | 54,223,135 | 54,217,743 | 54,217,743 | 54,223,135 | 54,223,135 | 54,223,135 |
| 未収入金 | 408,115,999 | 103,411,999 | 212,459,999 | 150,922,000 | 53,999,999 | 151,600,000 |
| (B) 負債 | 501,660,479 | 158,873,386 | 205,567,801 | 244,485,545 | 139,510,450 | 209,615,960 |
| 未払金 | 204,058,000 | 51,706,000 | 106,230,000 | 75,461,000 | 27,000,000 | 75,800,000 |
| 未払収益分配金 | 59,349,015 | 58,583,926 | 57,359,424 | 54,921,405 | 53,837,480 | 52,119,173 |
| 未払解約金 | 218,059,495 | 29,070,245 | 23,119,684 | 95,702,459 | 41,648,740 | 64,685,779 |
| 未払信託報酬 | 20,054,714 | 19,240,362 | 18,457,678 | 17,875,550 | 16,385,329 | 16,259,212 |
| その他未払費用 | 139,255 | 272,853 | 401,015 | 525,131 | 638,901 | 751,796 |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 20,396,732,879 | 19,927,098,542 | 18,751,431,798 | 17,782,666,011 | 16,333,828,298 | 15,793,184,640 |
| 元本 | 19,783,005,226 | 19,527,975,633 | 19,119,808,305 | 18,307,135,275 | 17,945,826,798 | 17,373,057,738 |
| 次期繰越損益金 | 613,727,653 | 399,122,909 | △ 368,376,507 | △ 524,469,264 | △ 1,611,998,500 | △ 1,579,873,098 |
| (D) 受益権総口数 | 19,783,005,226口 | 19,527,975,633口 | 19,119,808,305口 | 18,307,135,275口 | 17,945,826,798口 | 17,373,057,738口 |
| 1万口当り基準価額 (C/D) | 10,310円 | 10,204円 | 9,807円 | 9,714円 | 9,102円 | 9,091円 |

* 第30期末における元本額は20,104,564,600円、当作成期間(第31期~第36期)中における追加設定元本額は235,719,030円、同解約元本額は2,967,225,892円です。

* 第36期末の計算口数当りの純資産額は9,091円です。

* 第36期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,579,873,098円です

■損益の状況

第31期 自2015年4月18日 至2015年5月18日 第33期 自2015年6月18日 至2015年7月17日 第35期 自2015年8月18日 至2015年9月17日
 第32期 自2015年5月19日 至2015年6月17日 第34期 自2015年7月18日 至2015年8月17日 第36期 自2015年9月18日 至2015年10月19日

| 項 目 | 第31期 | 第32期 | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 |
|------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| (A) 配当等収益 | 84,601,352円 | 85,173,893円 | 83,514,539円 | 79,652,149円 | 75,194,586円 | 69,665,300円 |
| 受取配当金 | 84,594,411 | 85,167,553 | 83,508,143 | 79,641,330 | 75,188,359 | 69,656,256 |
| 受取利息 | 6,941 | 6,340 | 6,396 | 10,819 | 6,227 | 9,044 |
| (B) 有価証券売買損益 | 671,384,927 | △ 213,552,687 | △ 766,709,676 | △ 177,587,700 | △ 1,102,342,649 | △ 19,985,918 |
| 売買益 | 680,134,756 | 2,481,635 | 13,392,902 | 5,767,495 | 20,041,235 | 12,369,043 |
| 売買損 | △ 8,749,829 | △ 216,034,322 | △ 780,102,578 | △ 183,355,195 | △ 1,122,383,884 | △ 32,354,961 |
| (C) 信託報酬等 | △ 20,193,969 | △ 19,373,960 | △ 18,585,840 | △ 17,999,666 | △ 16,499,099 | △ 16,372,107 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 735,792,310 | △ 147,752,754 | △ 701,780,977 | △ 115,935,217 | △ 1,043,647,162 | 33,307,275 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 821,581,125 | △ 142,960,676 | △ 341,859,346 | △ 1,049,834,175 | △ 1,195,664,646 | △ 2,213,109,302 |
| (F) 追加信託差損益金 | 758,865,483 | 748,420,265 | 732,623,240 | 696,221,533 | 681,150,788 | 652,048,102 |
| (配当等相当額) | (819,075,951) | (811,034,567) | (794,548,128) | (765,657,319) | (751,403,678) | (730,809,465) |
| (売買損益相当額) | (△ 60,210,468) | (△ 62,614,302) | (△ 61,924,888) | (△ 69,435,786) | (△ 70,252,890) | (△ 78,761,363) |
| (G) 合計 (D + E + F) | 673,076,668 | 457,706,835 | △ 311,017,083 | △ 469,547,859 | △ 1,558,161,020 | △ 1,527,753,925 |
| (H) 収益分配金 | △ 59,349,015 | △ 58,583,926 | △ 57,359,424 | △ 54,921,405 | △ 53,837,480 | △ 52,119,173 |
| 次期繰越損益金 (G + H) | 613,727,653 | 399,122,909 | △ 368,376,507 | △ 524,469,264 | △ 1,611,998,500 | △ 1,579,873,098 |
| 追加信託差損益金 | 758,865,483 | 748,420,265 | 732,623,240 | 696,221,533 | 681,150,788 | 652,048,102 |
| (配当等相当額) | (819,075,951) | (811,034,567) | (794,548,128) | (765,657,319) | (751,403,678) | (730,809,465) |
| (売買損益相当額) | (△ 60,210,468) | (△ 62,614,302) | (△ 61,924,888) | (△ 69,435,786) | (△ 70,252,890) | (△ 78,761,363) |
| 分配準備積立金 | 1,193,114,794 | 1,182,434,592 | 1,164,825,814 | 1,117,425,767 | 1,099,375,577 | 1,062,178,074 |
| 繰越損益金 | △ 1,338,252,624 | △ 1,531,731,948 | △ 2,265,825,561 | △ 2,338,116,564 | △ 3,392,524,865 | △ 3,294,099,274 |

(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12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31期 | 第32期 | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 |
|-----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 82,342,583円 | 65,801,175円 | 64,929,643円 | 61,653,060円 | 58,696,340円 | 53,294,226円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 819,075,951 | 811,034,567 | 794,548,128 | 765,657,319 | 751,403,678 | 730,809,465 |
| (d) 分配準備積立金 | 1,170,121,226 | 1,175,217,343 | 1,157,255,595 | 1,110,694,112 | 1,094,516,717 | 1,061,003,021 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 2,071,539,760 | 2,052,053,085 | 2,016,733,366 | 1,938,004,491 | 1,904,616,735 | 1,845,106,712 |
| (f) 分配金 | 59,349,015 | 58,583,926 | 57,359,424 | 54,921,405 | 53,837,480 | 52,119,173 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e-f) | 2,012,190,745 | 1,993,469,159 | 1,959,373,942 | 1,883,083,086 | 1,850,779,255 | 1,792,987,539 |
| (h) 受益権総口数 | 19,783,005,226口 | 19,527,975,633口 | 19,119,808,305口 | 18,307,135,275口 | 17,945,826,798口 | 17,373,057,738口 |

| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ | | | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 1 万 口 当 り 分 配 金 | 第31期 | 第32期 | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 |
| | (単 価) | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |
| | (10,310円) | (10,204円) | (9,807円) | (9,714円) | (9,102円) | (9,091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。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年4月17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ください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10,317円です。」

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 – 予想分配金提示型 –）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」の受益証券に投資しております。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。なお、クラス別の記載部分において「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」は「クラスA」と表記しております。

（注）2015年10月19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
2015年3月31日

資産

| | | |
|------------------------------|----|--------------------|
| 投資証券の公正価値（購入費用522,135,348ドル） | ドル | 536,824,505 |
| 現金 | | 1,231,197 |
| 為替先渡契約による評価益 | | 4,818 |
| 未収： | | |
| 売却済みの投資証券 | | 5,455,700 |
| 利息 | | 3,411,470 |
| 配当金 | | 1,471 |
| 金融デリバティブ商品の未収変動証拠金 | | 703,674 |
| その他の資産 | | 60,429 |
| 資産合計 | | 547,693,264 |

負債

| | | |
|----------------------------------|--|------------|
| 売建オプションの公正価値（受取プレミアム1,962,188ドル） | | 641,088 |
| 未払： | | |
| 購入済みの投資証券 | | 12,616,112 |
| 投資運用会社報酬 | | 583,741 |
| 償還済みの受益証券 | | 458,148 |
| 会計および管理報酬 | | 140,780 |
| 保管報酬 | | 132,747 |

| | | |
|------------------------|-----------|----------------------|
| 専門家報酬 | | 53, 143 |
| 為替運用会社報酬 | | 26, 909 |
| 名義書換代理会社報酬 | | 24, 948 |
| 負債合計 | | 14, 677, 616 |
| 純資産 | ドル | 533, 015, 648 |
| 純資産 | | |
| クラス A | ドル | 215, 815, 261 |
| 通貨αクラス | | 317, 200, 387 |
| | ドル | 533, 015, 648 |
| 発行済受益証券数 | | |
| クラス A | | 179, 323, 477 |
| 通貨αクラス | | 324, 709, 004 |
| 受益証券 1 口当たりの純資産 | | |
| クラス A | ドル | 1. 203 |
| 通貨αクラス | ドル | 0. 977 |

損益計算書

2015年3月31日に終了した年度

投資収益

| | | |
|-----------------------|----|------------|
| 利子収益（源泉税38,678ドル控除後） | ドル | 20,169,223 |
| 配当収益（源泉税106,489ドル控除後） | | 1,437,426 |

投資収益合計

21,606,649

費用

| | | |
|------------|--|-----------|
| 投資運用会社報酬 | | 3,107,044 |
| 会計および管理報酬 | | 293,874 |
| 保管報酬 | | 274,224 |
| 為替運用会社報酬 | | 239,652 |
| 専門家報酬 | | 68,292 |
| 名義書換代理会社報酬 | | 52,377 |
| 受託会社報酬 | | 22,513 |
| 登録料 | | 1,834 |

費用合計

4,059,810

純投資収益

17,546,839

実現および評価益（損）：

実現益（損）：

| | | |
|-----------------|--|-------------|
| 有価証券投資 | | 6,049,941 |
| 先物取引 | | (5,051,355) |
| 外国為替取引および為替先渡契約 | | (367,167) |
| 売建オプション | | (7,289,416) |

純実現損

(6,657,997)

評価益（損）の純変動：

| | | |
|-----------------|--|-------------|
| 有価証券投資 | | 6,888,173 |
| 外国為替換算および為替先渡契約 | | (4,886) |
| 先物取引 | | (1,686,338) |
| 売建オプション | | 1,321,100 |

評価益の純変動

6,518,049

純実現損および純評価損

(139,948)

業務活動の結果生じた純資産の純増

ドル 17,406,891

投資明細表

2015年3月31日

| <u>元本</u> | <u>銘柄</u> | <u>純資産に占める 比率 (%)</u> | <u>公正価値</u> |
|----------------|---|---------------------------|---------------|
| | 債券 (92.0%) | | |
| | オーストラリア (62.5%) | | |
| | 社債 (62.5%) | | |
| | Adani Abbot Point Terminal Pty, Ltd. | | |
| AUD 15,000,000 | 5.75% due 11/01/18 | | ドル 15,643,890 |
| | AGL Energy, Ltd. | | |
| AUD 8,000,000 | 5.00% due 11/05/21 | | 8,454,464 |
| | Ale Direct Property Trust | | |
| AUD 5,000,000 | 4.25% due 08/20/17 | | 5,117,445 |
| | Alumina, Ltd. | | |
| AUD 7,000,000 | 5.50% due 11/19/19 | | 7,353,521 |
| | AMP, Ltd. | | |
| AUD 5,000,000 | 6.27% due 09/29/49 (a), (b) | | 4,989,720 |
| | APT Pipelines, Ltd. | | |
| AUD 48,787 | 7.54% due 09/30/72 (b) | | 5,159,225 |
| | AusNet Services Holdings Pty, Ltd. | | |
| AUD 5,000,000 | 5.25% due 02/14/20 | | 5,368,160 |
| | Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. | | |
| AUD 63,509 | 5.03% due 06/20/22 (b) | | 6,547,778 |
| | Australian Gas Networks Vic 3 Pty, Ltd. | | |
| AUD 3,500,000 | 4.50% due 12/17/21 | | 3,611,934 |
| | Australian Unity, Ltd. | | |
| AUD 13,546 | 5.81% due 04/14/16 (b) | | 1,376,274 |
| | Bank of Queensland, Ltd. | | |
| AUD 9,500,000 | 3.47% due 11/06/19 (b) | | 9,529,450 |
| | BHP Billiton Finance, Ltd. | | |
| AUD 3,000,000 | 3.00% due 03/30/20 | | 2,978,022 |
| | Caltex Australia, Ltd. | | |
| AUD 44,012 | 6.82% due 09/15/37 (b) | | 4,638,865 |
| AUD 2,000,000 | 7.25% due 11/23/18 | | 2,264,970 |
| | Colonial Holding Co., Ltd. | | |
| AUD 183,796 | 5.48% due 03/31/37 (b) | | 18,756,382 |
| | Commonwealth Bank of Australia | | |

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 –

| | <u>元本</u> | <u>銘柄</u> | <u>純資産に占める 比率 (%)</u> | <u>公正価値</u> |
|-----|------------|--|---------------------------|-------------|
| AUD | 171,728 | 3.31% due 12/24/15 (b) | | 17,310,182 |
| AUD | 7,500,000 | 4.35% due 11/05/24 (b) Crown Group Finance, Ltd. | | 7,535,175 |
| AUD | 2,000,000 | 4.50% due 11/18/19 Crown Resorts, Ltd. | | 2,057,652 |
| AUD | 55,000 | 6.24% due 04/23/75 | | 5,651,635 |
| AUD | 83,202 | 7.32% due 09/14/72 (b) DEXUS Finance Pty, Ltd. | | 8,712,331 |
| AUD | 2,160,000 | 5.75% due 09/10/18 Dexus Wholesale Property Fund | | 2,323,966 |
| AUD | 7,500,000 | 4.25% due 07/01/19 ETSA Utilities Finance Pty, Ltd. | | 7,778,325 |
| AUD | 2,750,000 | 4.14% due 10/09/17 (b) General Property Trust | | 2,772,852 |
| AUD | 3,000,000 | 6.75% due 01/24/19 Glencore Australia Holdings Pty, Ltd. | | 3,377,586 |
| AUD | 5,000,000 | 4.50% due 09/19/19 Global Switch Property Australia Pty, Ltd. | | 5,167,825 |
| AUD | 9,550,000 | 6.25% due 12/23/20 Holcim Finance Australia Pty, Ltd. | | 10,668,162 |
| AUD | 7,000,000 | 3.75% due 03/19/20 Incitec Pivot, Ltd. | | 7,045,087 |
| AUD | 8,740,000 | 5.75% due 02/21/19 Insurance Australia, Ltd. | | 9,321,411 |
| AUD | 10,280,000 | 5.07% due 03/19/40 (b) Macquarie Bank, Ltd. | | 10,574,923 |
| AUD | 6,000,000 | 3.38% due 03/03/20 (b) | | 6,005,400 |
| AUD | 12,318 | 5.61% due 12/31/49 Macquarie Finance, Ltd. | | 1,222,364 |
| AUD | 135,478 | 3.96% due 01/29/49 Mirvac Group Finance, Ltd. | | 10,770,501 |
| AUD | 3,500,000 | 5.75% due 09/18/20 National Australia Bank, Ltd. | | 3,859,380 |
| AUD | 235,359 | 3.88% due 06/29/49 | | 18,068,746 |
| AUD | 10,257 | 5.06% due 06/18/22 (b) National Capital Trust III | | 1,061,322 |

| | <u>元本</u> | <u>銘柄</u> | <u>純資産に占める 比率 (%)</u> | <u>公正価値</u> |
|-----|------------|--|---------------------------|--------------------|
| AUD | 18,050,000 | 3.18% due 01/29/49 (a), (b) Origin Energy, Ltd. | | 17,812,426 |
| AUD | 155,558 | 6.27% due 12/22/71 (b) Qantas Airways, Ltd. | | 15,660,024 |
| AUD | 8,000,000 | 7.50% due 06/11/21 Scentre Group Trust 1 | | 8,935,544 |
| AUD | 6,500,000 | 4.50% due 09/08/21 Suncorp Group, Ltd. | | 6,797,310 |
| AUD | 34,985 | 5.17% due 11/22/23 (b) Suncorp-Metway, Ltd. | | 3,599,432 |
| AUD | 33,457 | 3.08% due 05/29/49 Tabcorp Holdings, Ltd. | | 2,556,784 |
| AUD | 39,098 | 6.27% due 03/22/37 (b) Tatts Group, Ltd. | | 4,054,306 |
| AUD | 40,809 | 5.79% due 07/05/19 Westpac Banking Corp. | | 4,251,726 |
| AUD | 98,516 | 4.62% due 08/22/23 (b) | | 10,011,688 |
| AUD | 136,880 | 5.07% due 08/23/22 (b) Woolworths, Ltd. | | 14,187,612 |
| AUD | 20,490 | 5.57% due 11/24/36 (b) | | 2,112,519 |
| | | 社債合計 | | 333,054,296 |
| | | オーストラリア合計 (購入費用 323,266,714ドル) | | 333,054,296 |
| | | カナダ (1.1%) | | |
| | | 社債 (1.1%) | | |
| | | Royal Bank of Canada | | |
| AUD | 6,000,000 | 3.34% due 02/10/20 (b) | | 5,998,092 |
| | | 社債合計 | | 5,998,092 |
| | | カナダ合計 (購入費用 6,000,000ドル) | | 5,998,092 |
| | | チリ (1.0%) | | |
| | | 社債 (1.0%) | | |
| | | Banco Santander Chile | | |
| AUD | 5,000,000 | 4.50% due 03/13/17 | | 5,068,555 |
| | | 社債合計 | | 5,068,555 |
| | | チリ合計 (購入費用 4,992,623ドル) | | 5,068,555 |
| | | フランス (5.9%) | | |
| | | 社債 (5.9%) | | |

| | <u>元本</u> | <u>銘柄</u> | <u>純資産に占める 比率 (%)</u> | <u>公正価値</u> |
|-----|------------|--|---------------------------|-------------------|
| | | AXA S. A. | | |
| AUD | 10,300,000 | 4.06% due 12/29/49 (a), (b) | | 10,195,198 |
| AUD | 15,200,000 | 7.50% due 12/29/49 (a), (c) | | 16,034,176 |
| | | BPCE S. A. | | |
| AUD | 5,000,000 | 4.50% due 04/17/18 | | 5,189,760 |
| | | 社債合計 | | 31,419,134 |
| | | フランス合計 (購入費用 30,225,749ドル) | | 31,419,134 |
| | | 日本 (2.5%) | | |
| | | 譲渡性預金証書 (0.8%) | | |
| | | Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ, Ltd. | | |
| AUD | 4,100,000 | 3.29% due 03/13/19 (b) | | 4,102,046 |
| | | 譲渡性預金証書合計 | | 4,102,046 |
| | | 社債 (1.7%) | | |
| | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | |
| AUD | 2,000,000 | 3.03% due 09/04/17 (b) | | 1,997,270 |
| AUD | 7,000,000 | 3.24% due 04/07/20 (b) | | 7,006,300 |
| | | 社債合計 | | 9,003,570 |
| | | 日本合計 (購入費用 13,100,000ドル) | | 13,105,616 |
| | | オランダ (4.3%) | | |
| | | 社債 (4.3%) | | |
| | | ABN AMRO Bank NV | | |
| AUD | 4,000,000 | 4.75% due 02/05/19 | | 4,222,432 |
| | | Swiss Reinsurance Co. via ELM BV | | |
| AUD | 13,700,000 | 3.99% due 04/29/49 (a), (b) | | 13,504,953 |
| AUD | 4,800,000 | 7.64% due 12/29/49 (a), (c) | | 5,136,864 |
| | | 社債合計 | | 22,864,249 |
| | | オランダ合計 (購入費用 21,499,925ドル) | | 22,864,249 |
| | | ニュージーランド (1.4%) | | |
| | | 社債 (1.4%) | | |
| | | Nufarm Finance NZ, Ltd. | | |
| AUD | 85,556 | 6.16% due 04/29/49 | | 7,627,317 |
| | | 社債合計 | | 7,627,317 |
| | | ニュージーランド合計 (購入費用 7,077,004ドル) | | 7,627,317 |
| | | 韓国 (1.5%) | | |
| | | 社債 (0.7%) | | |

| | <u>元本</u> | <u>銘柄</u> | <u>純資産に占める 比率 (%)</u> | <u>公正価値</u> |
|-----|------------|--|---------------------------|-------------------|
| AUD | 3,500,000 | Korea South-East Power Co., Ltd. 5.75% due 09/25/20 | | 3,872,995 |
| | | 社債合計 | | 3,872,995 |
| | | 国債 (0.8%) | | |
| AUD | 4,000,000 | Export- Import Bank of Korea 3.47% due 05/21/20 | | 4,000,440 |
| | | 国債合計 | | 4,000,440 |
| | | 韓国合計 (購入費用 7,691,315ドル) | | 7,873,435 |
| | | スイス (1.9%) | | |
| | | 社債 (1.9%) | | |
| AUD | 5,000,000 | Credit Suisse AG 3.18% due 11/14/17 (b) | | 4,999,120 |
| AUD | 5,000,000 | 3.75% due 07/16/19 (b) | | 5,004,770 |
| | | 社債合計 | | 10,003,890 |
| | | スイス合計 (購入費用 10,000,000ドル) | | 10,003,890 |
| | | 英国 (5.5%) | | |
| | | 社債 (5.5%) | | |
| AUD | 11,085,000 | Lloyds Bank PLC 13.00% due 12/19/21 (c) | | 12,761,950 |
| AUD | 5,100,000 | R&R Ice Cream PLC 8.25% due 05/15/20 | | 5,011,648 |
| AUD | 10,000,000 | Royal Bank of Scotland PLC 13.13% due 03/19/22 (c) | | 11,646,930 |
| | | 社債合計 | | 29,420,528 |
| | | 英国合計 (購入費用 29,227,433ドル) | | 29,420,528 |
| | | 米国 (4.4%) | | |
| | | 社債 (4.4%) | | |
| AUD | 10,000,000 | Bank of America Corp. 3.50% due 03/05/20 (b) | | 10,037,620 |
| AUD | 5,500,000 | JPMorgan Chase & Co. 3.43% due 12/09/19 (b) | | 5,512,606 |
| AUD | 1,990,000 | Metropolitan Life Global Funding I 4.50% due 10/10/18 | | 2,084,519 |
| AUD | 2,100,000 | Morgan Stanley 2.79% due 02/22/17 (b) | | 2,083,977 |
| AUD | 3,591,000 | 7.38% due 02/22/18 | | 3,986,800 |

| <u>元本</u> | <u>銘柄</u> | <u>純資産に占める 比率 (%)</u> | <u>公正価値</u> |
|------------|--|---------------------------|----------------|
| | 社債合計 | | 23,705,522 |
| | 米国合計 (購入費用 23,519,923ドル) | | 23,705,522 |
| | 債券合計 (購入費用 476,600,686ドル) | | 490,140,634 |
| <u>株数</u> | 優先株式 (5.2%) | | |
| | オーストラリア (5.2%) | | |
| | 銀行 (0.4%) | | |
| 22,067 | National Australia Bank, Ltd. | | 2,185,516 |
| | 総合金融サービス (3.4%) | | |
| 125,764 | Goodman PLUS Trust | | 12,840,504 |
| 44,428 | Macquarie Group, Ltd. (a), (b) | | 4,598,298 |
| 1,112 | Preferred Capital, Ltd. | | 219,042 |
| 3,297 | Westpac TPS Trust | | 321,820 |
| | | | 17,979,664 |
| | 多角的企業 (0.3%) | | |
| 18,710 | Seven Group Holdings, Ltd. | | 1,643,674 |
| | リート (1.1%) | | |
| 63,723 | Multiplex SITES Trust | | 5,722,325 |
| | オーストラリア合計 (購入費用26,381,970ドル) | | 27,531,179 |
| | 優先株式合計 (購入費用 26,381,970ドル) | | 27,531,179 |
| | MMF (3.6%) | | |
| | オーストラリア (3.6%) | | |
| 19,152,692 | Goldman Sachs A\$ Cash Reserves Fund Class A | | ドル 19,152,692 |
| | オーストラリア合計 | | 19,152,692 |
| | MMF (購入費用 19,152,692ドル) | | 19,152,692 |
| | 投資証券合計 (購入費用522,135,348ドル) | 100.7 | ドル 536,824,505 |
| | 現金およびその他の資産を上回る負債 | (0.7) | (3,808,857) |
| | 純資産 | 100.0 | ドル 533,015,648 |

(a) 永久債

(b) 2015年3月31日時点の変動利付き証券。

(c) 2015年3月31日時点の変動金利証券。

2015年3月31日現在の先物取引（純資産の(0.3)%) :

| ポジション | 銘柄 | 満期日 | 契約数 | 評価 (損) |
|-------|--------------------------------------|---------|-------|----------------|
| 売り | Australian 10 Year Bond June Futures | 2015年6月 | (466) | ドル (1,686,338) |

2015年3月31日現在のファンダレベル為替先渡契約（純資産の0.0%）:

| 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. | 13,201,000 | 2015年4月1日 | AUD | 141,651 | ドル 2,439 | ドル - | ドル 2,439 |
| JPY | Brown Brothers Harriman & Co. | 28,773,000 | 2015年4月2日 | AUD | 311,679 | 2,379 | - | 2,379 |
| | | | | | | ドル 4,818 | ドル - | ドル 4,818 |

2015年3月31日現在の通貨αクラスの売建オプション（純資産の(0.1)%) :

| 銘柄 | 行使価格 | 満期日 | 想定元本 | 受取プレミアム | 公正価値 |
|---|---------|------------|------------|----------------|--------------|
| Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar | 円 92.20 | 2015年4月17日 | 25,000,000 | ドル (312,856) | ドル (179,667) |
| Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar | 93.05 | 2015年4月10日 | 25,000,000 | (308,903) | (67,988) |
| Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar | 93.20 | 2015年4月14日 | 21,000,000 | (271,403) | (65,994) |
| Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar | 93.20 | 2015年4月21日 | 27,000,000 | (307,120) | (115,541) |
| Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar | 93.95 | 2015年5月1日 | 30,000,000 | (394,867) | (113,003) |
| Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar | 94.00 | 2015年4月28日 | 30,000,000 | (367,039) | (98,895) |
| | | | | ドル (1,962,188) | ドル (641,088) |

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36期の決算日（2015年10月19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23～24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

(2015年4月18日から2015年10月19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 | 470,000 | 532 国庫短期証券 2015/8/17 | 99,999 |
| 548 国庫短期証券 2015/11/2 | 449,999 | 534 国庫短期証券 2015/8/24 | 99,999 |
| 554 国庫短期証券 2015/11/30 | 400,000 | 520 国庫短期証券 2015/6/22 | 99,999 |
| 555 国庫短期証券 2015/12/7 | 400,000 | 466 国庫短期証券 2015/7/21 | 99,998 |
| 546 国庫短期証券 2015/10/19 | 389,999 | | |
| 536 国庫短期証券 2015/9/7 | 309,999 | | |
| 563 国庫短期証券 2016/1/18 | 299,999 | | |
| 532 国庫短期証券 2015/8/17 | 299,999 | | |
| 553 国庫短期証券 2015/11/24 | 219,999 | | |
| 538 国庫短期証券 2015/9/14 | 169,999 | | |

(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10月19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（3,272,645千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

| 区 分 | 2015年10月19日現在 | | | | | | |
|------|---------------|-----------|------|----------------------|-----------|------|------|
| | 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 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 1,900,000 | 1,899,999 | 57.7 | — | — | — | 57.7 |

(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10月19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 | 548 国庫短期証券 | — | 450,000 | 449,999 | 2015/11/02 |
| | 550 国庫短期証券 | — | 120,000 | 120,000 | 2015/11/09 |
| | 531 国庫短期証券 | — | 10,000 | 9,999 | 2015/11/10 |
| | 553 国庫短期証券 | — | 220,000 | 219,999 | 2015/11/24 |
| | 554 国庫短期証券 | — | 400,000 | 400,000 | 2015/11/30 |
| | 555 国庫短期証券 | — | 400,000 | 400,000 | 2015/12/07 |
| | 563 国庫短期証券 | — | 300,000 | 299,999 | 2016/01/18 |
| 合 計 | 銘 柄 数 金 額 | 7 銘柄 | 1,900,000 | 1,899,999 | |

(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 |

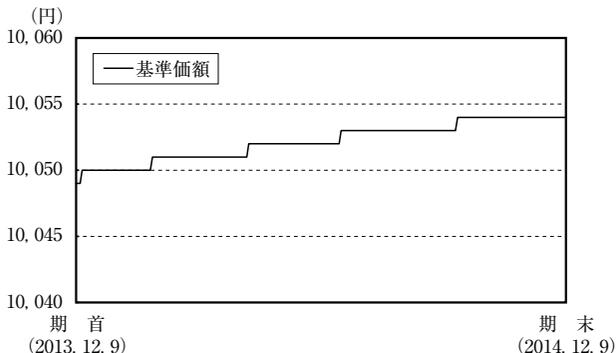
大和投資信託

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 | 騰 落 率 % | |
| (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 |
|---|---------|---------|----------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国 債 証 券 | 409,953 | — |
| 内 | | (| 520,000) |

(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 | | | | |
|-----------------------|--------|-----|-----|-----|
| 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 | | 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が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。