

★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37期	（決算日	2015年11月17日）
第38期	（決算日	2015年12月17日）
第39期	（決算日	2016年1月18日）
第40期	（決算日	2016年2月17日）
第41期	（決算日	2016年3月17日）
第42期	（決算日	2016年4月18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42期の決算を行ないました。

ここに、第37期～第42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 比率	投資信託 資産証 証券比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込配 み金	期騰 落 中率				
13期末 (2013年11月18日)	円 10,624	円 100	% 0.3	% 0.4	% 96.4	百万円 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	
37期末 (2015年11月17日)	9,123	30	0.7	0.2	95.9	15,499	
38期末 (2015年12月17日)	9,104	30	0.1	0.2	95.9	15,112	
39期末 (2016年1月18日)	8,355	30	△ 7.9	0.2	95.7	13,697	
40期末 (2016年2月17日)	8,227	30	△ 1.2	0.2	95.5	13,212	
41期末 (2016年3月17日)	8,648	30	5.5	0.1	95.9	13,544	
42期末 (2016年4月18日)	8,585	30	△ 0.4	0.0	98.4	13,169	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

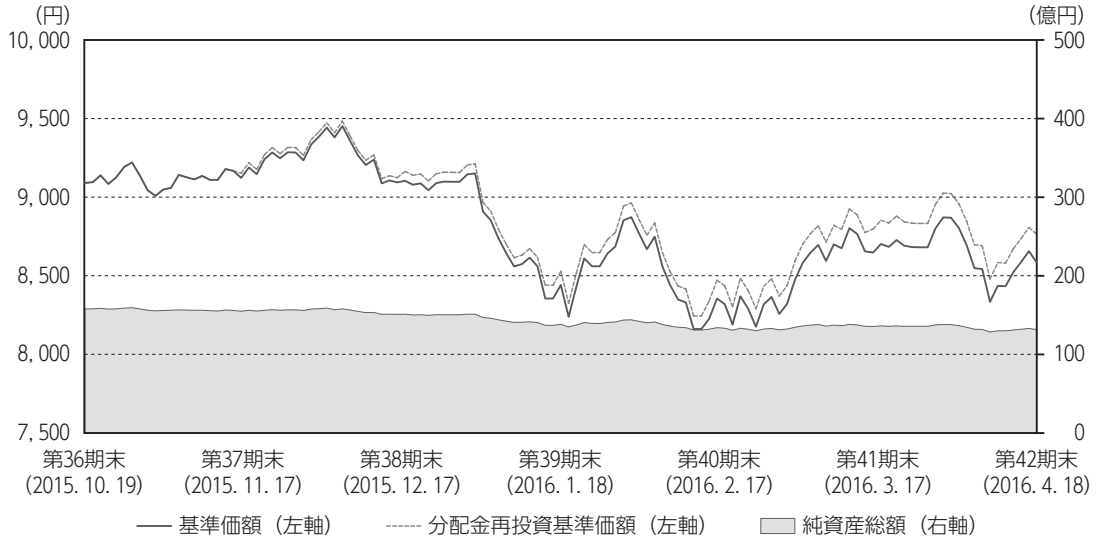
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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37期首：9,091円

第42期末：8,585円（既払分配金180円）

騰落率：△3.6%（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、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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37期	(期首) 2015年10月19日	9,091	—	0.2	95.8
	10月末	9,008	△ 0.9	0.3	99.2
	(期末) 2015年11月17日	9,153	0.7	0.2	95.9
第38期	(期首) 2015年11月17日	9,123	—	0.2	95.9
	11月末	9,235	1.2	0.2	99.2
	(期末) 2015年12月17日	9,134	0.1	0.2	95.9
第39期	(期首) 2015年12月17日	9,104	—	0.2	95.9
	12月末	9,145	0.5	0.2	99.1
	(期末) 2016年1月18日	8,385	△ 7.9	0.2	95.7
第40期	(期首) 2016年1月18日	8,355	—	0.2	95.7
	1月末	8,686	4.0	0.2	99.1
	(期末) 2016年2月17日	8,257	△ 1.2	0.2	95.5
第41期	(期首) 2016年2月17日	8,227	—	0.2	95.5
	2月末	8,365	1.7	0.2	99.1
	(期末) 2016年3月17日	8,678	5.5	0.1	95.9
第42期	(期首) 2016年3月17日	8,648	—	0.1	95.9
	3月末	8,872	2.6	0.0	99.2
	(期末) 2016年4月18日	8,615	△ 0.4	0.0	98.4

(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、金利はほぼ横ばいでした。

米国の利上げに対する思惑などを背景に、第37期首から2015年11月にかけて金利は上昇しましたが、12月以降は、米国の利上げペースが緩やかになるとの見方が広がったことや、原油価格が一段安となったことなどを受けて金利低下が進行しました。2016年3月からは、原油相場の底入れ感などから金利は上昇に転じました。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、商品市況の低迷を受けて2月ごろにかけては拡大傾向となりましたが、3月以降は、米国の景気後退懸念が後退したことに加えて、原油相場に底入れ感が見られ投資家のリスク回避姿勢が弱まった結果、スプレッドは縮小しました。

●為替相場

豪ドル為替相場は、対円で下落しました。

第37期首より、オーストラリアの雇用統計が良好な結果となったことや、RBA（オーストラリア準備銀行）による利下げ観測の後退もあり、豪ドルは対円で上昇しましたが、2016年1月以降は中国経済の減速懸念や原油をはじめとする商品市況の低迷から下落しました。3月以降は、リスクセンチメントの改善から上昇に転じました。

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、新規発行銘柄の組み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発行状況が続くと見込んで

おり、引き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、当作成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37期から第42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37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
	2015年10月20日 ～2015年11月17日	2015年11月18日 ～2015年12月17日	2015年12月18日 ～2016年1月18日	2016年1月19日 ～2016年2月17日	2016年2月18日 ～2016年3月17日	2016年3月18日 ～2016年4月18日
当期分配金（税込み）（円）	30	30	30	30	30	30
対基準価額比率（％）	0.33	0.33	0.36	0.36	0.35	0.35
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）	1,037	1,039	1,041	1,046	1,056	1,057

（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37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
(a) 経費控除後の配当等収益	35.26円	31.96円	32.64円	34.53円	40.37円	31.14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	421.52	421.90	422.15	422.45	422.93	423.21
(d) 分配準備積立金	610.52	615.41	617.11	619.47	623.54	633.63
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,067.31	1,069.27	1,071.92	1,076.46	1,086.84	1,087.99
(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)	1,037.31	1,039.27	1,041.92	1,046.46	1,056.84	1,057.99

（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、新規発行銘柄の組み入れに注力します。引き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する方針です。

●ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、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37期～第42期		項 目 の 概 要
	(2015. 10. 20～2016. 4. 18)		
	金 額	比 率	
信託報酬	51円	0.579%	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8,814円です。
(投信会社)	(14)	(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)	(35)	(0.403)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(1)	(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	51	0.583	

(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、このファンドが組み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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)が支払った費用を含みません。

(注3) 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4) 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10月20日から2016年4月18日まで)

決算期	第 37 期 ~ 第 42 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	31,227.55	3,062,966	44,870.99	4,381,600

(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10月20日から2016年4月18日まで)

第 37 期 ~ 第 42 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)	27,143.434	2,660,300	98	DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	44,870.99	4,381,600	97

(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37期～第42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10月20日から2016年4月18日まで)

決算期	第 37 期 ~ 第 42 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B			売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D
B/A				D/C		
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	10,820	1,200	11.1	—	—	—
コール・ローン	227,303	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.3%

※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37期～第42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 42 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) DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A)	135,846.521	12,963,833	98.4

(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。

■投資信託財産の構成

2016年 4月18日現在

項 目	第 42 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	12,963,833	97.7
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	54,228	0.4
コール・ローン等、その他	249,038	1.9
投資信託財産総額	13,267,100	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第 42 期 末		
	□ 数	□ 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	54,228

(注) 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11月17日)、(2015年12月17日)、(2016年 1月18日)、(2016年 2月17日)、(2016年 3月17日)、(2016年 4月18日) 現在

項 目	第37期末	第38期末	第39期末	第40期末	第41期末	第42期末
(A) 資産	15,648,547,783円	15,200,492,754円	14,357,865,526円	13,297,645,778円	13,658,448,615円	13,294,100,708円
コール・ローン等	665,173,967	650,456,996	73,430,913	624,209,680	619,200,624	222,038,654
投資信託受益証券 (評価額)	14,865,145,288	14,495,807,230	13,104,206,086	12,619,207,570	12,985,019,463	12,963,833,527
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額)	54,228,528	54,228,528	54,228,528	54,228,528	54,228,528	54,228,528
未収入金	64,000,000	—	1,125,999,999	—	—	53,999,999
(B) 負債	149,087,413	87,663,443	660,464,493	85,268,636	113,538,390	124,200,115
未払金	32,000,000	—	563,000,000	—	—	27,000,000
未払収益分配金	50,968,806	49,798,246	49,179,946	48,180,366	46,985,685	46,019,635
未払解約金	51,524,378	22,778,615	32,952,754	23,476,596	53,640,328	36,857,984
未払信託報酬	14,493,594	14,882,612	15,023,513	13,211,664	12,426,088	13,740,802
その他未払費用	100,635	203,970	308,280	400,010	486,289	581,694
(C) 純資産総額 (A - B)	15,499,460,370	15,112,829,311	13,697,401,033	13,212,377,142	13,544,910,225	13,169,900,593
元本	16,989,602,036	16,599,415,446	16,393,315,352	16,060,122,228	15,661,895,050	15,339,878,505
次期繰越損益金	△ 1,490,141,666	△ 1,486,586,135	△ 2,695,914,319	△ 2,847,745,086	△ 2,116,984,825	△ 2,169,977,912
(D) 受益権総口数	16,989,602,036□	16,599,415,446□	16,393,315,352□	16,060,122,228□	15,661,895,050□	15,339,878,505□
1万口当り基準価額 (C/D)	9,123円	9,104円	8,355円	8,227円	8,648円	8,585円

* 第36期末における元本額は17,373,057,738円、当作成期間 (第37期～第42期) 中における追加設定元本額は68,319,844円、同解約元本額は2,101,499,077円です。

* 第42期末の計算口数当りの純資産額は8,585円です。

* 第42期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,169,977,912円です。

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 -

■損益の状況

第37期 第38期	自2015年10月20日 自2015年11月18日	至2015年11月17日 至2015年12月17日	第39期 第40期	自2015年12月18日 自2016年1月19日	至2016年1月18日 至2016年2月17日	第41期 第42期	自2016年2月18日 自2016年3月18日	至2016年3月17日 至2016年4月18日
項 目	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第41期	第42期
(A) 配当等収益	68,166,376円	68,037,185円	68,650,259円	68,764,207円	64,348,636円	61,614,997円		
受取配当金	68,160,760	68,030,918	68,644,184	68,760,582	64,348,522	61,614,997		
受取利息	5,616	6,267	6,075	3,625	114	—		
(B) 有価証券売買損益	52,263,685	△ 33,938,511	△ 1,232,119,701	△ 213,910,195	655,036,181	△ 98,275,956		
売買益	54,152,082	6,378,254	5,648,067	8,127,567	664,894,400	4,355,670		
売買損	△ 1,888,397	△ 40,316,765	△ 1,237,767,768	△ 222,037,762	△ 9,858,219	△ 102,631,626		
(C) 信託報酬等	△ 14,594,229	△ 14,985,947	△ 15,127,823	△ 13,303,394	△ 12,512,367	△ 13,836,207		
(D) 当期損益金 (A + B + C)	105,835,832	19,112,727	△ 1,178,597,265	△ 158,449,382	706,872,450	△ 50,497,166		
(E) 前期繰越損益金	△ 2,179,558,983	△ 2,074,641,773	△ 2,078,327,651	△ 3,237,391,302	△ 3,356,091,948	△ 2,639,590,952		
(F) 追加信託差損益金	634,550,291	618,741,157	610,190,543	596,275,964	579,220,358	566,129,841		
(配当等相当額)	(716,156,627)	(700,335,256)	(692,058,955)	(678,460,130)	(662,389,917)	(649,205,771)		
(売買損益相当額)	(△ 81,606,336)	(△ 81,594,099)	(△ 81,868,412)	(△ 82,184,166)	(△ 83,169,559)	(△ 83,075,930)		
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,439,172,860	△ 1,436,787,889	△ 2,646,734,373	△ 2,799,564,720	△ 2,069,999,140	△ 2,123,958,277		
(H) 収益分配金	△ 50,968,806	△ 49,798,246	△ 49,179,946	△ 48,180,366	△ 46,985,685	△ 46,019,635		
次期繰越損益金 (G + H)	△ 1,490,141,666	△ 1,486,586,135	△ 2,695,914,319	△ 2,847,745,086	△ 2,116,984,825	△ 2,169,977,912		
追加信託差損益金	634,550,291	618,741,157	610,190,543	596,275,964	579,220,358	566,129,841		
(配当等相当額)	(716,156,627)	(700,335,256)	(692,058,955)	(678,460,130)	(662,389,917)	(649,205,771)		
(売買損益相当額)	(△ 81,606,336)	(△ 81,594,099)	(△ 81,868,412)	(△ 82,184,166)	(△ 83,169,559)	(△ 83,075,930)		
分配準備積立金	1,046,196,901	1,024,806,202	1,016,006,809	1,002,171,113	992,828,029	973,739,842		
繰越損益金	△ 3,170,888,858	△ 3,130,133,494	△ 4,322,111,671	△ 4,446,192,163	△ 3,689,033,212	△ 3,709,847,595		

(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、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「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37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
(a) 経費控除後の配当等収益	59,906,969円	53,052,223円	53,523,116円	55,461,192円	63,228,969円	47,778,599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	716,156,627	700,335,256	692,058,955	678,460,130	662,389,917	649,205,771
(d) 分配準備積立金	1,037,258,738	1,021,552,225	1,011,663,639	994,890,287	976,584,745	971,980,878
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,813,322,334	1,774,939,704	1,757,245,710	1,728,811,609	1,702,203,631	1,668,965,248
(f) 分配金	50,968,806	49,798,246	49,179,946	48,180,366	46,985,685	46,019,635
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,762,353,528	1,725,141,458	1,708,065,764	1,680,631,243	1,655,217,946	1,622,945,613
(h) 受益権総口数	16,989,602,036□	16,599,415,446□	16,393,315,352□	16,060,122,228□	15,661,895,050□	15,339,878,505□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万 口 当 り 分 配 金	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
	30円	30円	30円	30円	30円	30円
(単 価)	(9, 123円)	(9, 104円)	(8, 355円)	(8, 227円)	(8, 648円)	(8, 585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）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」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。

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）2016年4月18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%)		

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>
		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

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

<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（一）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（2015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42期の決算日（2016年4月18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10月20日から2016年4月18日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
572 国庫短期証券 2016/2/29	1,300,031		
578 国庫短期証券 2016/3/28	1,200,054		
576 国庫短期証券 2016/3/22	1,050,089		
586 国庫短期証券 2016/5/12	1,000,337		
582 国庫短期証券 2016/4/18	1,000,064		
573 国庫短期証券 2016/3/7	800,071		
574 国庫短期証券 2016/3/14	650,026		
579 国庫短期証券 2016/4/7	600,033		
567 国庫短期証券 2016/2/8	600,002		
560 国庫短期証券 2015/12/28	600,000		

（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）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年4月18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（64,709,153千口）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年4月18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
国債証券	千円 1,500,000	千円 1,500,137	% 2.3	% —	% —	% —	% 2.3

（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）

2016年4月18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	586 国庫短期証券	—	千円 1,000,000	千円 1,000,086	2016/05/12	
	588 国庫短期証券	—	500,000	500,051	2016/05/16	
合 計	銘 柄 数 金 額	2銘柄	1,500,000	1,500,137		

（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7期 (決算日 2015年12月9日)

(計算期間 2014年12月10日～2015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7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

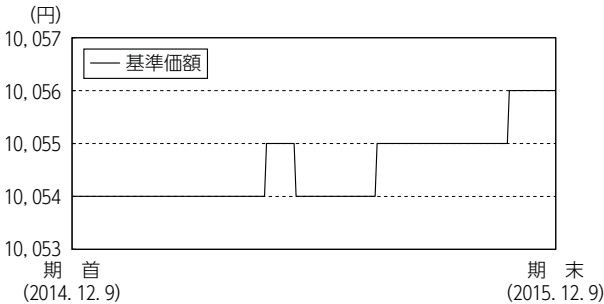
大和投資信託

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		公社債組入比率
	円	騰落率	
(期首) 2014年12月9日	10,054	—	62.6
12月末	10,054	0.0	71.5
2015年1月末	10,054	0.0	71.5
2月末	10,054	0.0	74.4
3月末	10,054	0.0	61.6
4月末	10,054	0.0	60.0
5月末	10,054	0.0	87.5
6月末	10,054	0.0	78.1
7月末	10,055	0.0	90.8
8月末	10,055	0.0	67.2
9月末	10,055	0.0	51.4
10月末	10,055	0.0	76.0
11月末	10,056	0.0	51.3
(期末) 2015年12月9日	10,056	0.0	51.3

(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：10,054円 期末：10,056円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

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。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低金利が続く、無担保コール翌日物金利は0.07%台を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.11～0.02%程度で推移しました。

◆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および参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性と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

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

国	買付額	売付額
内	6,780,031	399,997
		(4,330,000)

(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

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当 期		期 末	
買 付	売 付	買 付	売 付
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
554 国庫短期証券 2015/11/30	699,999	532 国庫短期証券 2015/8/17	99,999
560 国庫短期証券 2015/12/28	600,000	534 国庫短期証券 2015/8/24	99,999
540 国庫短期証券 2015/9/24	470,000	520 国庫短期証券 2015/6/22	99,999
548 国庫短期証券 2015/11/2	449,999	466 国庫短期証券 2015/7/21	99,998
555 国庫短期証券 2015/12/7	400,000		
546 国庫短期証券 2015/10/19	389,999		
536 国庫短期証券 2015/9/7	309,999		
557 国庫短期証券 2015/12/14	300,000		
563 国庫短期証券 2016/1/18	299,999		
567 国庫短期証券 2016/2/8	299,999		

(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。

■投資信託財産の構成

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	2,100,038	51.3
コール・ローン等、その他	1,990,861	48.7
投資信託財産総額	4,090,899	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■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	2,100,000	2,100,038	51.3	—	—	—	51.3

(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	557 国庫短期証券	—	300,000	300,000	2015/12/14
	559 国庫短期証券	—	200,000	200,000	2015/12/21
	560 国庫短期証券	—	600,000	600,000	2015/12/28
	563 国庫短期証券	—	300,000	299,999	2016/01/18
	566 国庫短期証券	—	200,000	199,999	2016/02/01
	567 国庫短期証券	—	300,000	299,999	2016/02/08
	573 国庫短期証券	—	200,000	200,038	2016/03/07
合計	銘柄数	7銘柄			
	金 額		2,100,000	2,100,038	

(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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,090,899,982円
コール・ローン等	1,990,861,486
公社債（評価額）	2,100,038,496
(B) 負債	—
(C) 純資産総額（A－B）	4,090,899,982
元本	4,068,192,218
次期繰越損益金	22,707,764
(D) 受益権総口数	4,068,192,218口
1万口当り基準価額（C/D）	10,056円

*期首における元本額は79,467,922円、当期中における追加設定元本額は4,645,374,497円、同解約元本額は656,650,201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、ダイワ米ドル・プルファンド（適格機関投資家専用）188,972,589円、ダイワ米ドル・ペアファンド（適格機関投資家専用）3,808,997,814円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-07（為替ヘッジあり／限定追加型）995円、通貨選択型 米国内リート・αワトロ（毎月分配型）159,141円、通貨選択型アメリカン・エクイティ・αワトロ（毎月分配型）159,141円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）Ⅱ995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-12（為替ヘッジあり）995円、ダイワ/ロジャーズ国際コモディティ™・ファンド15,363,351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TOP I Xベア・ファンド（適格機関投資家専用）596,719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10,056円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月10日 至2015年12月9日

項 目	当	期
(A) 配当等収益		299,560円
受取利息		299,560
(B) 有価証券売買損益	△	1,226
売買益		597
売買損	△	1,823
(C) 当期損益金（A＋B）		298,334
(D) 前期繰越損益金		429,726
(E) 解約差損益金	△	3,569,799
(F) 追加信託差損益金		25,549,503
(G) 合計（C＋D＋E＋F）		22,707,764
次期繰越損益金（G）		22,707,764

(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。