

★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／債券
信託期間	無期限
運用方針	毎月の払出水準に基づいて、投資者に対し資金の払出しを行なうことをめざすとともに、豪ドル建ての債券へ投資し、安定した収益の確保をはかります。
主要投資対象	Aコース 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・ボンド・ファンド(Aクラス)」(以下「ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Aクラス)」といいます。)の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	Bコース 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・ボンド・ファンド(Bクラス)」(以下「ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Bクラス)」といいます。)の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
運用方法	Aコース ①主として、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Aクラス)の受益証券を通じて、豪ドル建ての債券に投資します。 ②当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Aクラス)とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Aクラス)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・ボンド・ファンド(Aクラス)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。 ④上記①～③にかかわらず、基準価額(1万口当り。既払出金を加算しません。)が一度でも2,000円を下回った場合、わが国の短期金融商品による安定運用に順次切替えを行ない、ファンド全体が安定運用に入った後、繰上償還します。
	Bコース ①主として、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Bクラス)の受益証券を通じて、豪ドル建ての債券に投資します。 ②当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Bクラス)とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド(Bクラス)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・ボンド・ファンド(Bクラス)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。 ④上記①～③にかかわらず、基準価額(1万口当り。既払出金を加算しません。)が一度でも2,000円を下回った場合、わが国の短期金融商品による安定運用に順次切替えを行ない、ファンド全体が安定運用に入った後、繰上償還します。
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、別に定める毎月の払出水準に基づき、これを上限として払出額を決定します。ただし、当ファンドが償還することとなった場合は、払出しを行ないません。また、分配対象額が少額の場合には払出しを行わないことがあります。なお、第1計算期末には、払出しを行ないません。

りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2

Aコース／Bコース  
(愛称：サザンクロス2)

運用報告書(全体版)

第33期(決算日 2015年8月10日)  
第34期(決算日 2015年9月9日)  
第35期(決算日 2015年10月9日)  
第36期(決算日 2015年11月9日)  
第37期(決算日 2015年12月9日)  
第38期(決算日 2016年1月12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、「りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2」は、このたび、第38期の決算を行ないました。

ここに、第33期～第38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/> <3153>

<3154>

★Aコース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			シティオーストラリア 国債インデックス (円換算)		公社債 組入 比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
9期末(2013年8月9日)	9,998	100	△ 3.9	10,813	△ 2.7	0.2	96.7	353
10期末(2013年9月9日)	10,132	100	2.3	10,980	1.5	0.1	98.8	344
11期末(2013年10月9日)	10,175	100	1.4	11,102	1.1	0.1	98.7	339
12期末(2013年11月11日)	10,235	100	1.6	11,262	1.4	0.2	99.3	324
13期末(2013年12月9日)	10,170	100	0.3	11,289	0.2	0.2	99.2	301
14期末(2014年1月9日)	10,177	100	1.1	11,355	0.6	0.2	99.1	276
15期末(2014年2月10日)	9,885	100	△ 1.9	11,230	△ 1.1	0.2	99.0	258
16期末(2014年3月10日)	10,068	100	2.9	11,470	2.1	0.2	99.1	257
17期末(2014年4月9日)	10,188	100	2.2	11,773	2.6	0.2	99.2	257
18期末(2014年5月9日)	10,160	100	0.7	11,917	1.2	0.2	99.0	245
19期末(2014年6月9日)	10,156	100	0.9	12,067	1.3	0.2	98.9	240
20期末(2014年7月9日)	10,107	100	0.5	12,207	1.2	0.2	99.2	232
21期末(2014年8月11日)	9,990	100	△ 0.2	12,300	0.8	0.2	99.2	229
22期末(2014年9月9日)	10,238	100	3.5	12,692	3.2	0.2	99.1	233
23期末(2014年10月9日)	9,817	100	△ 3.1	12,422	△ 2.1	0.2	99.1	223
24期末(2014年11月10日)	10,164	100	4.6	12,893	3.8	0.2	99.1	228
25期末(2014年12月9日)	10,369	100	3.0	13,277	3.0	0.2	98.7	227
26期末(2015年1月9日)	10,070	100	△ 1.9	13,233	△ 0.3	0.3	98.8	210
27期末(2015年2月9日)	9,625	100	△ 3.4	12,735	△ 3.8	0.2	98.8	199
28期末(2015年3月9日)	9,560	100	0.4	12,783	0.4	0.2	97.1	198
29期末(2015年4月9日)	9,434	100	△ 0.3	12,889	0.8	0.2	99.0	187
30期末(2015年5月11日)	9,381	100	0.5	12,934	0.3	0.2	98.9	183
31期末(2015年6月9日)	9,356	100	0.8	12,973	0.3	0.2	98.9	183
32期末(2015年7月9日)	8,786	100	△ 5.0	12,342	△ 4.9	0.2	98.9	171
33期末(2015年8月10日)	8,867	100	2.1	12,639	2.4	0.2	98.9	164
34期末(2015年9月9日)	8,007	100	△ 8.6	11,779	△ 6.8	0.3	98.4	146
35期末(2015年10月9日)	8,139	100	2.9	12,159	3.2	0.3	98.8	147
36期末(2015年11月9日)	8,054	100	0.2	12,021	△ 1.1	0.3	98.8	141
37期末(2015年12月9日)	8,114	100	2.0	12,293	2.3	0.3	98.7	125
38期末(2016年1月12日)	7,515	0	△ 7.4	11,529	△ 6.2	—	4.9	115

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) シティオーストラリア国債インデックス (円換算) は、シティオーストラリア国債インデックス (オーストラリア・ドルベース) のデータに基づき円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

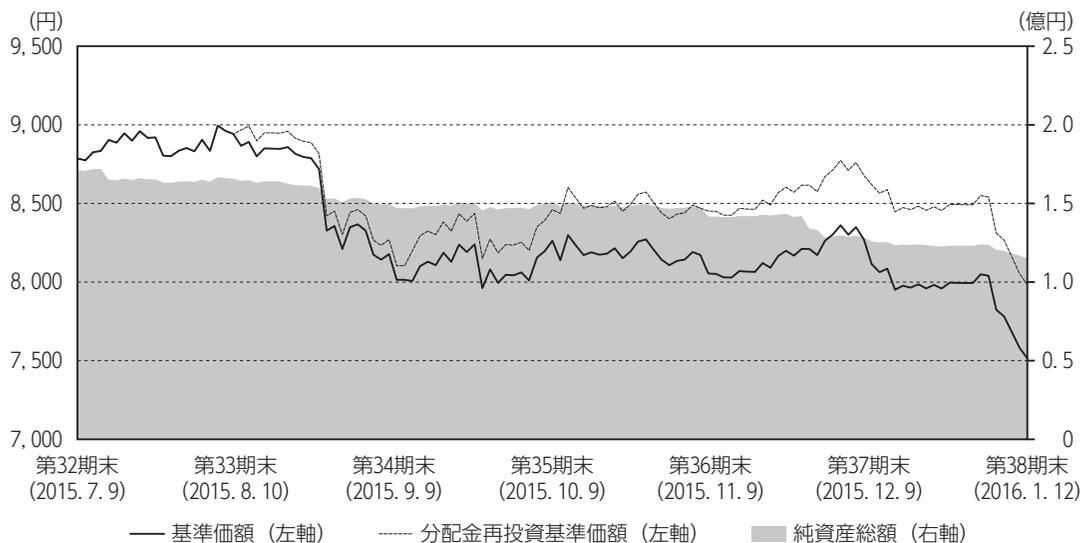
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



\* 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。

\* 当ファンドには<分配金再投資コース>はありません。

## ■基準価額・騰落率

第33期首：8,786円

第38期末：7,515円（既払分配金500円）

騰落率：△9.1%（分配金再投資ベース）

## ■基準価額の主な変動要因

オーストラリアの債券に投資した結果、債券の利息収入を得たことはプラスの寄与となりましたが、豪ドルが対円で値下がりしたことや金利が上昇（債券価格は下落）したことがマイナス要因となり、合計で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。

りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Aコース

	年 月 日	基 準 価 額		シティオーストラリア 国債インデックス (円換算)		公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
第33期	(期首)2015年7月9日	円 8,786	% —	12,342	% —	% 0.2	% 98.9
	7月末	8,832	0.5	12,448	0.9	0.2	99.0
	(期末)2015年8月10日	8,967	2.1	12,639	2.4	0.2	98.9
第34期	(期首)2015年8月10日	8,867	—	12,639	—	0.2	98.9
	8月末	8,367	△ 5.6	11,989	△ 5.1	0.3	98.9
	(期末)2015年9月9日	8,107	△ 8.6	11,779	△ 6.8	0.3	98.4
第35期	(期首)2015年9月9日	8,007	—	11,779	—	0.3	98.4
	9月末	8,046	0.5	11,741	△ 0.3	0.3	98.9
	(期末)2015年10月9日	8,239	2.9	12,159	3.2	0.3	98.8
第36期	(期首)2015年10月9日	8,139	—	12,159	—	0.3	98.8
	10月末	8,107	△ 0.4	12,038	△ 1.0	0.3	98.8
	(期末)2015年11月9日	8,154	0.2	12,021	△ 1.1	0.3	98.8
第37期	(期首)2015年11月9日	8,054	—	12,021	—	0.3	98.8
	11月末	8,171	1.5	12,182	1.3	0.3	93.9
	(期末)2015年12月9日	8,214	2.0	12,293	2.3	0.3	98.7
第38期	(期首)2015年12月9日	8,114	—	12,293	—	0.3	98.7
	12月末	8,049	△ 0.8	12,281	△ 0.1	0.1	99.4
	(期末)2016年1月12日	7,515	△ 7.4	11,529	△ 6.2	—	4.9

(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の金利は上昇しました。第33期首から2015年8月後半にかけては、ギリシャの政情不安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、金利は低下しました。9月から12月半ばにかけては、堅調な国内経済指標から利下げ観測が後退したことや、米国で年内利上げ観測が強まり世界的に金利が上昇したことを受けて、オーストラリアの金利も上昇しました。しかしその後は、原油や鉄鉱石など商品価格の下落に加え、中国株が再び下落したことを背景に、金利は低下しました。

### ○為替相場

豪ドルは対円で下落しました。第33期首から2015年9月前半にかけては、中国経済の減速懸念からアジア株式市場が大きく下落し、市場のリスク回避姿勢が高まったことで、豪ドルは対円で下落しました。9月半ばから12月前半にかけては、堅調な国内経済指標から利下げ観測が後退したことや、世界的に株価が上昇して市場のリスク選好度が強まったことなどで、豪ドルは対円で上昇しました。しかしその後は、商品価格や中国株の下落を受けて、豪ドル円は下落に転じました。

## 前作成期間末における「今後の運用方針」

### ○当ファンド

「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）」（以下「ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）」といいます。）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資し、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）への投資割合を高位に維持することをめざします。ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）を通じて、豪ドル建ての債券に投資することにより、安定した収益の確保をはかります。

### ○ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）

主として、豪ドル建ての債券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

ポートフォリオにつきましては、金利変動リスクを表す修正デュレーションを3～5（年）程度の範囲内でコントロールします。

### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

#### ・第33期首～2016年1月8日

ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資し、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）への投資割合を高位に維持しました。

#### ・1月9日～第38期末

ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が、1月6日（現地）付で10億円を下回り繰上償還されることとなったため、信託約款の規定に基づき、当ファンドも繰上償還することとなりました。このため、基準価額の変動を抑えることを目的とし、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）への投資割合を低位に引き下げました。また、ダイワ・マネーストック・マザーファンドの組入比率をゼロとしました。

### ○ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）

#### ・第33期首～2016年1月6日

主として、豪ドル建ての債券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないました。

金利変動リスクを表す修正デュレーションについては、3（年）程度から5（年）程度の範囲内で運用しました。特に金利低下圧力が強まる場面では、商品性格の中心である4（年）よりも長期化した一方、金利上昇傾向が強まる場面では短期化するなど、経済動向や市場環境等を考慮して対応を行ないました。

債券種別構成に関しては、州債や事業債の組入比率を高めには保ちました。

為替に関しては、実質外貨比率を高位には保ちました。

#### ・1月7日以降

ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が、1月6日（現地）付で10億円を下回り繰上償還されることとなったため、保有債券の全売却を行ない、現金での運用に移行しました。

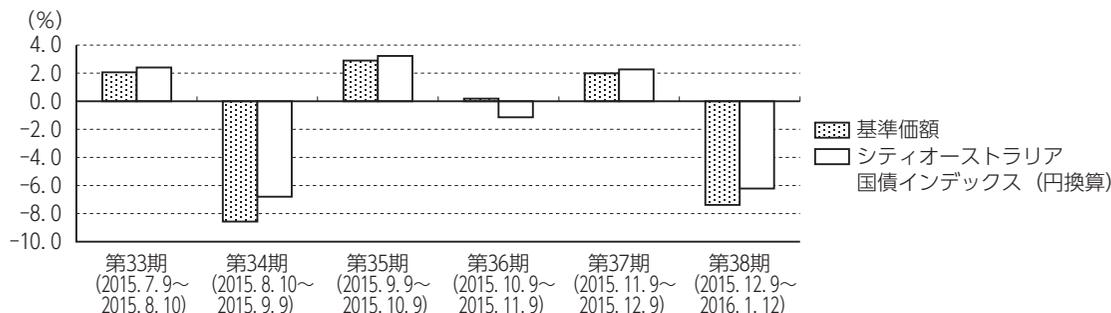
### ○ダイワ・マネーストック・マザーファンド

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

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドは運用方針により、参考指数と比較して国債以外の債券（州債、事業債等）が投資対象に含まれるという特徴があります。参考指数はオーストラリアの債券市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 払出金について

第33期から第37期の1万口当り払出額（税込み）はそれぞれ100円といたしました。第38期は分配方針通り、払出しを行いませんでした。

払出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33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
	2015年7月10日 ～2015年8月10日	2015年8月11日 ～2015年9月9日	2015年9月10日 ～2015年10月9日	2015年10月10日 ～2015年11月9日	2015年11月10日 ～2015年12月9日	2015年12月10日 ～2016年1月12日
当期分配金（税込み）（円）	100	100	100	100	100	—
対基準価額比率（%）	1.12	1.23	1.21	1.23	1.22	—
当期の収益（円）	97	94	99	94	97	—
当期の収益以外（円）	2	5	0	5	2	—
翌期繰越分配対象額（円）	2,154	2,060	2,148	2,064	2,140	2,145

（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33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
(a) 経費控除後の配当等収益	97.77円	94.56円	99.11円	94.38円	97.63円	94.37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	233.59	144.49	233.59	155.10	233.59	144.49
(d) 分配準備積立金	1,923.39	1,921.16	1,915.73	1,914.85	1,909.24	1,906.87
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,254.76	2,160.23	2,248.44	2,164.34	2,240.46	2,145.74
(f) 分配金	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	0.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	2,154.76	2,060.23	2,148.44	2,064.34	2,140.46	2,145.74

(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

繰上償還の決定を受け、今後の運用につきましては、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えてまいります。

○ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）

繰上償還に向けて、現金での運用を行ないます。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第33期～第38期		項 目 の 概 要
	(2015. 7. 10～2016. 1. 12)		
	金 額	比 率	
信託報酬	47円	0.572%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は8,293円です。</b>
(投信会社)	(14)	(0.167)	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)	(32)	(0.389)	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)	(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	48	0.576	

(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。

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年7月10日から2016年1月12日まで)

決算期	第33期～第38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)	136.36	10,863	2,053.737	151,892

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年7月10日から2016年1月12日まで)

決算期	第33期～第38期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	—	—	698	701

(注) 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7月10日から2016年1月12日まで)

第33期～第38期				第38期			
買付		平均単価		売付		平均単価	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
				DAIWA AUSTRALIAN BOND FUND CLASS A (ケイマン諸島)	2,053.737	151,892	73

(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33期～第38期)中における利害関係人との取引はありません。

(2) ダイワ・マネースtock・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2015年7月10日から2016年1月12日まで)

区分	第33期～第38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
公社債	百万円 56,565	百万円 8,560	% 15.1	百万円 —	百万円 —	% —
コール・ローン	1,788,975	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該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33期～第38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 38 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 BOND FUND CLASS A	78.618	5,644	4.9

(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1月12日現在

項 目	第 38 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	5,644	4.9
コール・ローン等、その他	110,273	95.1
投資信託財産総額	115,917	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32期末	第 38 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	698	—	—

(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8月10日)、(2015年9月9日)、(2015年10月9日)、(2015年11月9日)、(2015年12月9日)、(2016年1月12日)現在

項 目	第33期末	第34期末	第35期末	第36期末	第37期末	第38期末
<b>(A) 資産</b>	<b>166,389,074円</b>	<b>149,366,184円</b>	<b>151,513,577円</b>	<b>151,611,329円</b>	<b>127,601,279円</b>	<b>223,691,274円</b>
コール・ローン等	3,092,430	3,072,037	3,045,541	2,985,432	2,676,982	2,298,697
投資信託受益証券(評価額)	162,595,596	144,593,099	146,166,919	139,948,781	124,223,180	5,644,858
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	701,048	701,048	701,117	701,117	701,117	—
未収入金	—	1,000,000	1,600,000	7,975,999	—	215,747,719
<b>(B) 負債</b>	<b>2,016,551</b>	<b>2,479,762</b>	<b>3,562,271</b>	<b>9,893,164</b>	<b>1,682,337</b>	<b>108,655,975</b>
未払金	—	500,000	800,000	3,988,000	—	107,773,301
未払収益分配金	1,853,791	1,834,518	1,817,908	1,759,503	1,551,917	—
未払解約金	—	—	806,000	4,001,959	—	749,999
未払信託報酬	161,600	143,058	135,206	139,549	125,369	126,717
その他未払費用	1,160	2,186	3,157	4,153	5,051	5,958
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>164,372,523</b>	<b>146,886,422</b>	<b>147,951,306</b>	<b>141,718,165</b>	<b>125,918,942</b>	<b>115,035,299</b>
元本	185,379,130	183,451,873	181,790,837	175,950,374	155,191,739	153,070,459
次期繰越損益金	△ 21,006,607	△ 36,565,451	△ 33,839,531	△ 34,232,209	△ 29,272,797	△ 38,035,160
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>185,379,130口</b>	<b>183,451,873口</b>	<b>181,790,837口</b>	<b>175,950,374口</b>	<b>155,191,739口</b>	<b>153,070,459口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	8,867円	8,007円	8,139円	8,054円	8,114円	7,515円

\*第32期末における元本額は194,676,064円、当作成期間(第33期~第38期)中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は41,605,605円です。

\*第38期末の計算口数当りの純資産額は7,515円です。

\*第38期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は38,035,160円です。

## ■損益の状況

項 目	第33期 自 2015年7月10日 至 2015年8月10日 第34期 自 2015年8月11日 至 2015年9月9日	第34期 自 2015年9月10日 至 2015年10月9日 第35期 自 2015年10月10日 至 2015年11月9日	第35期 自 2015年9月10日 至 2015年10月9日 第36期 自 2015年10月10日 至 2015年11月9日	第36期 自 2015年11月10日 至 2015年12月9日 第37期 自 2015年12月10日 至 2016年1月12日	第37期 自 2015年11月10日 至 2015年12月9日 第38期 自 2015年12月10日 至 2016年1月12日	第38期 自 2015年12月10日 至 2016年1月12日
(A) 配当等収益	1,900,410円	1,878,965円	1,859,983円	1,801,249円	1,592,516円	1,572,170円
受取配当金	1,900,308	1,878,923	1,859,941	1,801,189	1,592,461	1,572,125
受取利息	102	42	42	60	55	45
(B) 有価証券売買損益	1,617,030	△ 15,677,588	2,488,941	△ 1,381,014	1,006,439	△ 10,607,011
売買益	1,671,704	3,341	2,528,051	32,225	1,085,118	78,656
売買損	△ 54,674	△ 15,680,929	△ 39,110	△ 1,413,239	△ 78,679	△ 10,685,667
(C) 信託報酬等	△ 162,760	△ 144,084	△ 136,177	△ 140,545	△ 126,267	△ 127,624
(D) 当期損益金 (A + B + C)	3,354,680	△ 13,942,707	4,212,747	279,690	2,472,688	△ 9,162,465
(E) 前期繰越損益金	△ 26,837,869	△ 25,073,582	△ 40,480,925	△ 36,862,526	△ 33,818,794	△ 32,448,373
(F) 追加信託差損益金	4,330,373	4,285,356	4,246,555	4,110,130	3,625,226	3,575,678
(配当等相当額)	( 2,678,619)	( 2,650,773)	( 2,626,772)	( 2,542,384)	( 2,242,439)	( 2,211,790)
(売買損益相当額)	( 1,651,754)	( 1,634,583)	( 1,619,783)	( 1,567,746)	( 1,382,787)	( 1,363,888)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 19,152,816	△ 34,730,933	△ 32,021,623	△ 32,472,706	△ 27,720,880	△ 38,035,160
(H) 収益分配金	△ 1,853,791	△ 1,834,518	△ 1,817,908	△ 1,759,503	△ 1,551,917	—
次期繰越損益金 (G + H)	△ 21,006,607	△ 36,565,451	△ 33,839,531	△ 34,232,209	△ 29,272,797	△ 38,035,160
追加信託差損益金	4,330,373	4,285,356	4,246,555	4,110,130	3,625,226	3,575,678
(配当等相当額)	( 2,678,619)	( 2,650,773)	( 2,626,772)	( 2,542,384)	( 2,242,439)	( 2,211,790)
(売買損益相当額)	( 1,651,754)	( 1,634,583)	( 1,619,783)	( 1,567,746)	( 1,382,787)	( 1,363,888)
分配準備積立金	35,614,434	35,144,565	34,810,197	33,593,094	29,593,096	30,633,167
繰越損益金	△ 60,951,414	△ 75,995,372	△ 72,896,283	△ 71,935,433	△ 62,491,119	△ 72,244,005

(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「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33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,812,480円	1,734,890円	1,801,752円	1,660,719円	1,515,156円	1,444,550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	4,330,373	2,650,773	4,246,555	2,729,101	3,625,226	2,211,790
(d) 分配準備積立金	35,655,745	35,244,193	34,826,353	33,691,878	29,629,857	29,188,617
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	41,798,598	39,629,856	40,874,660	38,081,698	34,770,239	32,844,957
(f) 分配金	1,853,791	1,834,518	1,817,908	1,759,503	1,551,917	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	39,944,807	37,795,338	39,056,752	36,322,195	33,218,322	32,844,957
(h) 受益権総口数	185,379,130口	183,451,873口	181,790,837口	175,950,374口	155,191,739口	153,070,459口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期
	100円	100円	100円	100円	100円

#### 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。

## ★Bコース

## 最近30期の運用実績

決算期	基準価額			シティオーストラリア 国債インデックス (円換算)		公社債 組入 率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
9期末(2013年8月9日)	10,362	50	△ 3.8	10,813	△ 2.7	0.4	96.4	102
10期末(2013年9月9日)	10,555	50	2.3	10,980	1.5	0.3	98.4	102
11期末(2013年10月9日)	10,653	50	1.4	11,102	1.1	0.4	98.8	88
12期末(2013年11月11日)	10,770	50	1.6	11,262	1.4	0.4	98.8	89
13期末(2013年12月9日)	10,756	50	0.3	11,289	0.2	0.4	98.8	89
14期末(2014年1月9日)	10,819	50	1.1	11,355	0.6	0.3	98.8	89
15期末(2014年2月10日)	10,567	50	△ 1.9	11,230	△ 1.1	0.4	98.7	85
16期末(2014年3月10日)	10,820	50	2.9	11,470	2.1	0.3	98.7	87
17期末(2014年4月9日)	11,005	50	2.2	11,773	2.6	0.4	98.7	85
18期末(2014年5月9日)	11,033	50	0.7	11,917	1.2	0.4	98.6	85
19期末(2014年6月9日)	11,088	50	1.0	12,067	1.3	0.4	98.6	85
20期末(2014年7月9日)	11,093	50	0.5	12,207	1.2	0.4	98.5	85
21期末(2014年8月11日)	11,024	50	△ 0.2	12,300	0.8	0.4	98.5	85
22期末(2014年9月9日)	11,355	50	3.5	12,692	3.2	0.4	98.4	76
23期末(2014年10月9日)	10,952	50	△ 3.1	12,422	△ 2.1	0.6	97.8	56
24期末(2014年11月10日)	11,394	50	4.5	12,893	3.8	0.5	98.5	55
25期末(2014年12月9日)	11,684	50	3.0	13,277	3.0	0.5	98.6	55
26期末(2015年1月9日)	11,411	50	△ 1.9	13,233	△ 0.3	0.6	98.5	53
27期末(2015年2月9日)	10,972	50	△ 3.4	12,735	△ 3.8	0.6	98.4	51
28期末(2015年3月9日)	10,960	50	0.3	12,783	0.4	0.6	98.3	46
29期末(2015年4月9日)	10,880	50	△ 0.3	12,889	0.8	0.7	98.3	46
30期末(2015年5月11日)	10,883	50	0.5	12,934	0.3	0.6	98.2	46
31期末(2015年6月9日)	10,920	50	0.8	12,973	0.3	0.6	98.4	46
32期末(2015年7月9日)	10,322	50	△ 5.0	12,342	△ 4.9	0.6	98.4	43
33期末(2015年8月10日)	10,484	50	2.1	12,639	2.4	0.6	98.4	44
34期末(2015年9月9日)	9,540	50	△ 8.5	11,779	△ 6.8	0.8	98.1	39
35期末(2015年10月9日)	9,766	50	2.9	12,159	3.2	0.7	98.1	40
36期末(2015年11月9日)	9,735	50	0.2	12,021	△ 1.1	0.7	98.1	40
37期末(2015年12月9日)	9,875	50	2.0	12,293	2.3	0.6	98.1	39
38期末(2016年1月12日)	9,149	0	△ 7.4	11,529	△ 6.2	—	5.0	36

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) シティオーストラリア国債インデックス(円換算)は、シティオーストラリア国債インデックス(オーストラリア・ドルベース)のデータに基づき円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

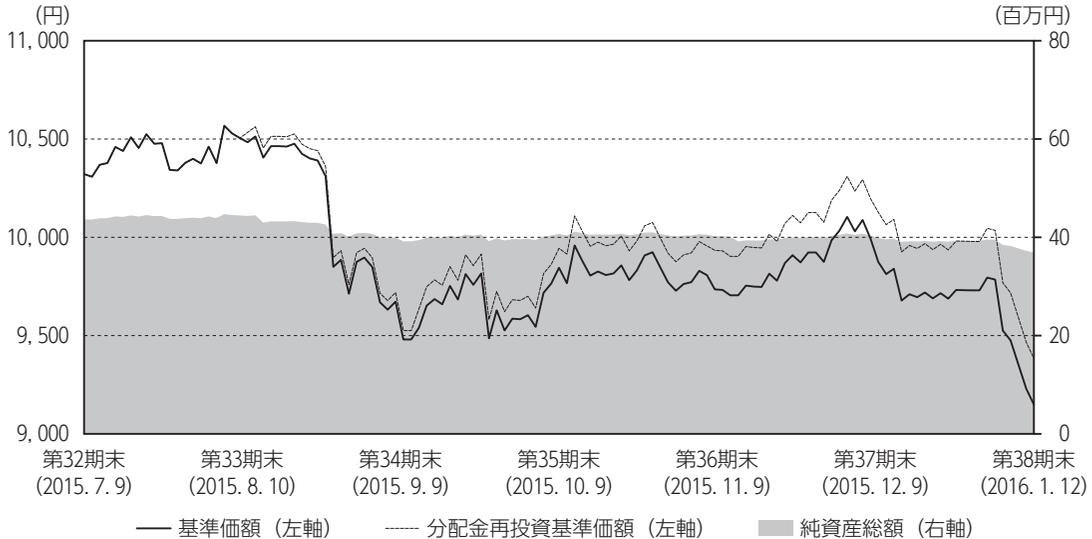
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



\* 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。

\* 当ファンドには＜分配金再投資コース＞はありません。

## ■基準価額・騰落率

第33期首：10,322円

第38期末：9,149円（既払分配金250円）

騰落率：△9.1%（分配金再投資ベース）

## ■基準価額の主な変動要因

オーストラリアの債券に投資した結果、債券の利息収入を得たことはプラスの寄与となりましたが、豪ドルが対円で値下がりしたことや金利が上昇（債券価格は下落）したことがマイナス要因となり、合計で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。

りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Bコース

	年 月 日	基 準 価 額		シティオーストラリア 国債インデックス (円換算)		公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %		
第33期	(期首)2015年7月9日	10,322	—	12,342	—	0.6	98.4
	7月末	10,376	0.5	12,448	0.9	0.6	98.4
	(期末)2015年8月10日	10,534	2.1	12,639	2.4	0.6	98.4
第34期	(期首)2015年8月10日	10,484	—	12,639	—	0.6	98.4
	8月末	9,897	△ 5.6	11,989	△ 5.1	0.6	98.3
	(期末)2015年9月9日	9,590	△ 8.5	11,779	△ 6.8	0.8	98.1
第35期	(期首)2015年9月9日	9,540	—	11,779	—	0.8	98.1
	9月末	9,586	0.5	11,741	△ 0.3	0.7	98.1
	(期末)2015年10月9日	9,816	2.9	12,159	3.2	0.7	98.1
第36期	(期首)2015年10月9日	9,766	—	12,159	—	0.7	98.1
	10月末	9,728	△ 0.4	12,038	△ 1.0	0.8	98.2
	(期末)2015年11月9日	9,785	0.2	12,021	△ 1.1	0.7	98.1
第37期	(期首)2015年11月9日	9,735	—	12,021	—	0.7	98.1
	11月末	9,875	1.4	12,182	1.3	0.6	98.1
	(期末)2015年12月9日	9,925	2.0	12,293	2.3	0.6	98.1
第38期	(期首)2015年12月9日	9,875	—	12,293	—	0.6	98.1
	12月末	9,795	△ 0.8	12,281	△ 0.1	0.6	98.2
	(期末)2016年1月12日	9,149	△ 7.4	11,529	△ 6.2	—	5.0

(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の金利は上昇しました。第33期首から2015年8月後半にかけては、ギリシャの政情不安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、金利は低下しました。9月から12月半ばにかけては、堅調な国内経済指標から利下げ観測が後退したことや、米国で年内利上げ観測が強まり世界的に金利が上昇したことを受けて、オーストラリアの金利も上昇しました。しかしその後は、原油や鉄鉱石など商品価格の下落に加え、中国株が再び下落したことを背景に、金利は低下しました。

### ○為替相場

豪ドルは対円で下落しました。第33期首から2015年9月前半にかけては、中国経済の減速懸念からアジア株式市場が大きく下落し、市場のリスク回避姿勢が高まったことで、豪ドルは対円で下落しました。9月半ばから12月前半にかけては、堅調な国内経済指標から利下げ観測が後退したことや、世界的に株価が上昇して市場のリスク選好度が強まったことなどで、豪ドルは対円で上昇しました。しかしその後は、商品価格や中国株の下落を受けて、豪ドル円は下落に転じました。

## 前作成期間末における「今後の運用方針」

### ○当ファンド

「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）」（以下「ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）」といいます。）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資し、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）への投資割合を高位に維持することをめざします。ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）を通じて、豪ドル建ての債券に投資することにより、安定した収益の確保をはかります。

### ○ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）

主として、豪ドル建ての債券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

ポートフォリオにつきましては、金利変動リスクを表す修正デュレーションを3～5（年）程度の範囲内でコントロールします。

### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

#### ・第33期首～2016年1月8日

ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資し、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）への投資割合を高位に維持しました。

#### ・1月9日～第38期末

ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が、1月6日（現地）付で10億円を下回り繰上償還されることとなったため、信託約款の規定に基づき、当ファンドも繰上償還することとなりました。このため、基準価額の変動を抑えることを目的とし、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）への投資割合を低位に引き下げました。また、ダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入比率をゼロとしました。

### ○ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）

#### ・第33期首～2016年1月6日

主として、豪ドル建ての債券に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないました。

金利変動リスクを表す修正デュレーションについては、3（年）程度から5（年）程度の範囲内で運用しました。特に金利低下圧力が強まる場面では、商品性格の中心である4（年）よりも長期化した一方、金利上昇傾向が強まる場面では短期化するなど、経済動向や市場環境等を考慮して対応を行ないました。

債券種別構成に関しては、州債や事業債の組入比率を高めには保ちました。

為替に関しては、実質外貨比率を高位には保ちました。

#### ・1月7日以降

ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が、1月6日（現地）付で10億円を下回り繰上償還されることとなったため、保有債券の全売却を行ない、現金での運用に移行しました。

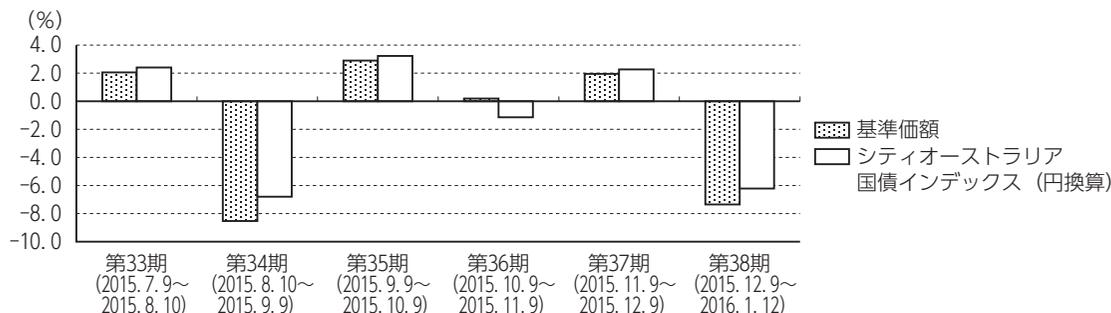
### ○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドは運用方針により、参考指数と比較して国債以外の債券（州債、事業債等）が投資対象に含まれるという特徴があります。参考指数はオーストラリアの債券市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 払出金について

第33期から第37期の1万口当り払出額（税込み）はそれぞれ50円といたしました。第38期は分配方針通り、払出しを行いませんでした。

払出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33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
	2015年7月10日 ～2015年8月10日	2015年8月11日 ～2015年9月9日	2015年9月10日 ～2015年10月9日	2015年10月10日 ～2015年11月9日	2015年11月10日 ～2015年12月9日	2015年12月10日 ～2016年1月12日
当期分配金（税込み）（円）	50	50	50	50	50	—
対基準価額比率（%）	0.47	0.52	0.51	0.51	0.50	—
当期の収益（円）	47	39	47	39	46	—
当期の収益以外（円）	2	10	2	10	3	—
翌期繰越分配対象額（円）	2,286	2,167	2,273	2,242	2,260	2,190

（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33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
(a) 経費控除後の配当等収益	47.02円	39.95円	47.55円	39.72円	46.70円	38.88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	168.63	60.34	168.63	148.03	168.63	60.34
(d) 分配準備積立金	2,120.47	2,117.50	2,107.45	2,105.01	2,094.73	2,091.44
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,336.13	2,217.80	2,323.64	2,292.77	2,310.07	2,190.67
(f) 分配金	50.00	50.00	50.00	50.00	50.00	0.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	2,286.13	2,167.80	2,273.64	2,242.77	2,260.07	2,190.67

(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

繰上償還の決定を受け、今後の運用につきましては、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えてまいります。

○ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）

繰上償還に向けて、現金での運用を行ないます。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第33期～第38期		項 目 の 概 要
	(2015. 7. 10～2016. 1. 12)		
	金 額	比 率	
信託報酬	56円	0.568%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は9,916円です。</b>
(投信会社)	(16)	(0.166)	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)	(38)	(0.386)	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)	(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	0.003	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)	(0.003)	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	0.571	

(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。

(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

(1) 投資信託受益証券

(2015年7月10日から2016年1月12日まで)

決算期	第33期～第38期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国 (邦貨建)	千口 12,219	千円 1,212	千口 409,127	千円 37,609

(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。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年7月10日から2016年1月12日まで)

決算期	第33期～第38期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 458	千円 460

(注) 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7月10日から2016年1月12日まで)

銘柄	第33期～第38期			銘柄	第38期		
	買付				売付		
	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 BOND FUND CLASS B (ケイマン諸島)	409,127	37,609	91				

(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33期～第38期)中における利害関係人との取引はありません。

(2) ダイワ・マネースtock・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2015年7月10日から2016年1月12日まで)

区分	第33期～第38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
公社債	百万円 56,565	百万円 8,560	% 15.1	百万円 —	百万円 —	% —
コール・ローン	1,788,975	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

\*平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該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33期～第38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 38 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 BOND FUND CLASS B	20.137	1,837	5.0

(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1月12日現在

項 目	第 38 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,837	5.0
コール・ローン等、その他	35,137	95.0
投資信託財産総額	36,975	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32期末	第 38 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	458	—	—

(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8月10日)、(2015年9月9日)、(2015年10月9日)、(2015年11月9日)、(2015年12月9日)、(2016年1月12日)現在

項 目	第33期末	第34期末	第35期末	第36期末	第37期末	第38期末
<b>(A) 資産</b>	<b>44,610,147円</b>	<b>39,671,575円</b>	<b>40,604,179円</b>	<b>40,478,620円</b>	<b>40,102,219円</b>	<b>71,372,505円</b>
コール・ローン等	503,550	547,432	552,740	559,699	517,712	439,448
投資信託受益証券(評価額)	43,645,909	38,663,455	39,590,705	39,458,187	39,123,773	1,837,365
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	460,688	460,688	460,734	460,734	460,734	—
未収入金	—	—	—	—	—	69,095,692
<b>(B) 負債</b>	<b>254,734</b>	<b>245,242</b>	<b>243,834</b>	<b>245,863</b>	<b>239,551</b>	<b>34,439,335</b>
未払金	—	—	—	—	—	34,397,480
未払収益分配金	211,532	206,635	206,635	206,635	201,837	—
未払信託報酬	42,914	38,057	36,408	38,183	36,427	40,296
その他未払費用	288	550	791	1,045	1,287	1,559
<b>(C) 純資産総額 (A-B)</b>	<b>44,355,413</b>	<b>39,426,333</b>	<b>40,360,345</b>	<b>40,232,757</b>	<b>39,862,668</b>	<b>36,933,170</b>
元本	42,306,476	41,327,044	41,327,044	41,327,044	40,367,569	40,367,569
次期繰越損益金	2,048,937	△ 1,900,711	△ 966,699	△ 1,094,287	△ 504,901	△ 3,434,399
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>42,306,476□</b>	<b>41,327,044□</b>	<b>41,327,044□</b>	<b>41,327,044□</b>	<b>40,367,569□</b>	<b>40,367,569□</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,484円	9,540円	9,766円	9,735円	9,875円	9,149円

\*第32期末における元本額は42,306,476円、当作成期間(第33期～第38期)中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は1,938,907円です。

\*第38期末の計算口数当りの純資産額は9,149円です。

\*第38期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,434,399円です。

■損益の状況

項 目	第33期 自 2015年7月10日 至 2015年8月10日 第34期 自 2015年8月11日 至 2015年9月9日	第34期	第35期 自 2015年9月10日 至 2015年10月9日 第36期 自 2015年10月10日 至 2015年11月9日	第35期	第36期 自 2015年11月10日 至 2015年12月9日 第37期 自 2015年12月10日 至 2016年1月12日	第36期	第37期	第38期
(A) 配当等収益	208,523円	203,419円	202,839円	202,839円	202,599円	197,539円	197,547円	197,547円
受取配当金	208,522	203,415	202,839	202,839	202,597	197,538	197,547	197,547
受取利息	1	4	—	—	2	1	—	—
(B) 有価証券売買損益	733,352	△ 3,860,680	974,457	△ 85,115	604,948	△ 3,086,477	△ 3,086,477	△ 3,086,477
売買益	733,352	2,913	975,463	1	607,644	—	—	—
売買損	—	△ 3,863,593	△ 1,006	△ 85,116	△ 2,696	△ 3,086,477	△ 3,086,477	△ 3,086,477
(C) 信託報酬等	△ 43,202	△ 38,319	△ 36,649	△ 38,437	△ 36,669	△ 40,568	△ 40,568	△ 40,568
(D) 当期損益金 (A + B + C)	898,673	△ 3,695,580	1,140,647	79,047	765,818	△ 2,929,498	△ 2,929,498	△ 2,929,498
(E) 前期繰越損益金	648,370	1,304,594	△ 2,597,621	△ 1,663,609	△ 1,749,613	△ 1,185,632	△ 1,185,632	△ 1,185,632
(F) 追加信託差損益金	713,426	696,910	696,910	696,910	680,731	680,731	680,731	680,731
(配当等相当額)	( 255,313)	( 249,402)	( 249,402)	( 249,402)	( 243,612)	( 243,612)	( 243,612)	( 243,612)
(売買損益相当額)	( 458,113)	( 447,508)	( 447,508)	( 447,508)	( 437,119)	( 437,119)	( 437,119)	( 437,119)
(G) 合計 (D + E + F)	2,260,469	△ 1,694,076	△ 760,064	△ 887,652	△ 303,064	△ 3,434,399	△ 3,434,399	△ 3,434,399
(H) 収益分配金	△ 211,532	△ 206,635	△ 206,635	△ 206,635	△ 201,837	—	—	—
次期繰越損益金 (G + H)	2,048,937	△ 1,900,711	△ 966,699	△ 1,094,287	△ 504,901	△ 3,434,399	△ 3,434,399	△ 3,434,399
追加信託差損益金	713,426	696,910	696,910	696,910	680,731	680,731	680,731	680,731
(配当等相当額)	( 255,313)	( 249,402)	( 249,402)	( 249,402)	( 243,612)	( 243,612)	( 243,612)	( 243,612)
(売買損益相当額)	( 458,113)	( 447,508)	( 447,508)	( 447,508)	( 437,119)	( 437,119)	( 437,119)	( 437,119)
分配準備積立金	8,958,417	8,709,499	8,699,394	8,656,931	8,442,640	8,599,624	8,599,624	8,599,624
繰越損益金	△ 7,622,906	△ 11,307,120	△ 10,363,003	△ 10,448,128	△ 9,628,272	△ 12,714,754	△ 12,714,754	△ 12,714,754

(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「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33期	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期
(a) 経費控除後の配当等収益	198,966円	165,105円	196,530円	164,172円	188,521円	156,984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	713,426	249,402	696,910	611,785	680,731	243,612
(d) 分配準備積立金	8,970,983	8,751,029	8,709,499	8,699,394	8,455,956	8,442,640
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	9,883,375	9,165,536	9,602,939	9,475,351	9,325,208	8,843,236
(f) 分配金	211,532	206,635	206,635	206,635	201,837	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	9,671,843	8,958,901	9,396,304	9,268,716	9,123,371	8,843,236
(h) 受益権総口数	42,306,476口	41,327,044口	41,327,044口	41,327,044口	40,367,569口	40,367,569口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金	第33期	第34期	第35期	第36期	第37期
	50円	50円	50円	50円	50円

#### 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。

ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド  
Aクラス／Bクラス

当ファンド（りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2）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・ボンド・ファンド Aクラス／Bクラス」に投資しておりますが、以下の内容はすべてのクラスを合算しております。

（注）2016年1月12日時点で入手しうる直近の決算分を掲載しております。

（豪ドル建て）

貸借対照表  
2014年12月30日

<b>資産</b>		
投資、時価（費用18,033,800ドル）	ドル	18,678,779
現金		283
外国為替先渡契約による評価益		1,298
未収：		
売却した投資に係る未収金		221,604
利息		208,529
前払受託会社報酬		20,539
<b>資産合計</b>		<u>19,131,032</u>
<b>負債</b>		
未払い：		
償還済みの受益証券		513,695
専門家報酬		55,366
保管報酬		7,933
会計および管理報酬		7,779
投資運用報酬		4,854
名義書換代理報酬		3,633
その他の未払金		478
<b>負債合計</b>		<u>593,738</u>
<b>純資産</b>	<b>ドル</b>	<u>18,537,294</u>
クラス A	ドル	14,086,006
クラス B		3,511,495
クラス C		939,793
	<b>ドル</b>	<u>18,537,294</u>
<b>発行済み受益証券数</b>		
クラス A		14,148,260
クラス B		3,015,149
クラス C		762,665
<b>1口当たりの純資産</b>		
クラス A	ドル	0.996
クラス B	ドル	1.165
クラス C	ドル	1.232

## 損益計算書

2014年12月30日に終了した会計年度

<b>投資収益</b>		
利息収入	ドル	920,748
<b>投資収益合計</b>		<u>920,748</u>
<b>費用</b>		
投資運用報酬		68,518
保管報酬		65,229
会計および管理報酬		51,817
専門家報酬		48,980
受託会社報酬		18,763
名義書換代理報酬		17,308
登録料		2,120
為替運用報酬		408
その他費用		909
<b>費用合計</b>		<u>274,052</u>
<b>純投資収益</b>		<u>646,696</u>
<b>実現益および評価益（実現損および評価損）：</b>		
<b>実現益（損）：</b>		
有価証券への投資		553,990
売建オプション		41,554
外国為替取引および外国為替先渡契約		(24,132)
<b>純実現益</b>		<u>571,412</u>
<b>評価益（損）の純変動：</b>		
有価証券への投資		654,121
売建オプション		301
外国為替換算および外国為替先渡契約		(351)
<b>評価益の純変動</b>		<u>654,071</u>
<b>実現益および評価益</b>		<u>1,225,483</u>
<b>業務活動の結果生じた純資産の純増</b>	ドル	<u><u>1,872,179</u></u>

## りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2

当ファンド（りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2）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・ボンド・ファンド Aクラス／Bクラス」に投資しておりますが、以下の内容はすべてのクラスに共通です。

（注）2016年1月12日時点で入手しうる直近の決算分を掲載しております。

（豪ドル建て）

### 投資明細表 2014年12月30日

	元本金額	有価証券の明細	純資産に占める割合 (%)	公正価値
		<b>債券 (99.5%)</b>		
		<b>オーストラリア (78.8%)</b>		
		<b>社債 (27.1%)</b>		
		Australia & New Zealand Banking Group, Ltd.		
AUD	500,000	4.50% due 11/06/18	ドル	522,693
		Australia Pacific Airports Melbourne Pty, Ltd.		
AUD	500,000	5.00% due 06/04/20		529,212
		General Electric Capital Australia Funding Pty, Ltd.		
AUD	500,000	5.25% due 08/23/17		527,244
		Mercedes-Benz Australia		
AUD	500,000	4.00% due 11/15/16		509,757
		National Australia Bank, Ltd.		
AUD	100,000	6.00% due 02/15/17		106,351
AUD	800,000	7.25% due 03/07/18		901,213
		Telstra Corp., Ltd.		
AUD	300,000	4.50% due 11/13/18		314,988
AUD	500,000	7.00% due 08/02/16		531,773
		Volkswagen Financial Services Australia Pty, Ltd.		
AUD	200,000	5.00% due 06/27/17		208,553
		Westpac Banking Corp.		
AUD	800,000	7.25% due 11/18/16		863,670
		<b>社債計</b>		<b>5,015,454</b>
		<b>国債 (51.7%)</b>		
		Airservices Australia		
AUD	210,000	4.75% due 11/19/20		225,241
		Australia Government Bond		
AUD	700,000	3.25% due 04/21/29		714,497
AUD	800,000	6.25% due 04/15/15		808,760
		New South Wales Treasury Corp.		
AUD	1,100,000	3.50% due 03/20/19		1,144,980
AUD	1,300,000	4.00% due 04/20/23		1,400,052
		Queensland Treasury Corp.		
AUD	300,000	4.25% due 07/21/23 <sup>(a)</sup>		327,096
AUD	1,100,000	5.50% due 06/21/21		1,277,270
AUD	1,000,000	5.75% due 07/22/24		1,212,507
AUD	600,000	6.00% due 04/21/16		627,126
AUD	800,000	6.00% due 02/21/18		886,467
		Treasury Corp. of Victoria		

AUD	400,000	5.50% due 12/17/24 Western Australian Treasury Corp.		482,966
AUD	400,000	7.00% due 10/15/19		478,274
		<b>国債計</b>		<b>9,585,236</b>
		<b>オーストラリア計 (費用14,087,571ドル)</b>		<b>14,600,690</b>
		<b>オランダ (1.7%)</b>		
		<b>社債 (1.7%)</b>		
AUD	300,000	ING Bank NV 5.50% due 09/27/19		321,718
		<b>社債計</b>		<b>321,718</b>
		<b>オランダ計 (費用299,841ドル)</b>		<b>321,718</b>
		<b>スイス (2.7%)</b>		
		<b>社債 (2.7%)</b>		
AUD	500,000	Credit Suisse AG 4.00% due 07/16/19		507,171
		<b>社債計</b>		<b>507,171</b>
		<b>スイス計 (費用495,802ドル)</b>		<b>507,171</b>
		<b>英国 (2.8%)</b>		
		<b>社債 (2.8%)</b>		
AUD	500,000	Barclays Bank PLC 4.50% due 04/04/19		518,315
		<b>社債計</b>		<b>518,315</b>
		<b>英国計 (費用495,566ドル)</b>		<b>518,315</b>
		<b>米国 (13.5%)</b>		
		<b>社債 (13.5%)</b>		
AUD	400,000	Goldman Sachs Group, Inc. 5.00% due 08/21/19		419,565
AUD	500,000	7.75% due 11/23/16 JPMorgan Chase & Co.		539,948
AUD	500,000	4.65% due 11/07/17 Morgan Stanley		518,481
AUD	500,000	4.75% due 11/16/18 Wells Fargo & Co.		517,514
AUD	500,000	4.00% due 08/08/19		510,221
		<b>社債計</b>		<b>2,505,729</b>
		<b>米国計 (費用2,429,864ドル)</b>		<b>2,505,729</b>
		<b>債券計 (費用17,808,644ドル)</b>		<b>18,453,623</b>
		<b>短期投資 (1.3%)</b>		
		<b>英国 (1.3%)</b>		
		<b>定期預金 (1.3%)</b>		
AUD	225,156	National Australian Bank, Ltd. 1.65% due 1/02/15		225,156
		<b>定期預金計</b>		<b>225,156</b>
		<b>英国計 (費用225,156ドル)</b>		<b>225,156</b>
		<b>短期投資計 (費用225,156ドル)</b>		<b>225,156</b>
		<b>投資計 (費用18,033,800ドル)</b>	100.8	<b>ドル 18,678,779</b>
		<b>現金とその他の資産を上回る負債</b>	(0.8)	<b>(141,485)</b>
		<b>純資産</b>	<b>100.0%</b>	<b>ドル 18,537,294</b>

<sup>(a)</sup> 144A 証券・1933年証券法の規則144Aのもと登録が免除されている証券。同証券は、登録が免除されている取引によって転売できる。取引の買手は通常は適格機関投資家。別段の記載がない限り、同証券は非流動資産とみなされない。

## りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2

### ファンドレベルの外国為替先渡契約（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	純評価益
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	490,000	2015年1月7日	A U D	4,990	ドル 21
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	12,200,000	2015年1月7日	A U D	124,245	511
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	14,262,000	2015年1月7日	A U D	145,245	597
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	2,887,000	2015年1月7日	A U D	29,401	121
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	400,000	2015年1月8日	A U D	4,090	1
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	330,000	2015年1月8日	A U D	3,374	1
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	2,700,000	2015年1月8日	A U D	27,606	6
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	1,100,000	2015年1月8日	A U D	11,247	3
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	900,000	2015年1月8日	A U D	9,202	2
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	100,000	2015年1月8日	A U D	1,022	0*
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	8,900,000	2015年1月8日	A U D	90,997	21
J P Y	Brown Brothers Harriman & Co.	6,000,000	2015年1月8日	A U D	61,347	14
						ドル 1,298

\*表示がゼロでも、実際の額を概数にして得られた値が1未満になったものをゼロと表示している場合もあります。

#### 通貨の略称：

A U D	-	豪ドル
J P Y	-	日本円

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド 運用報告書 第6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・マネースtock・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

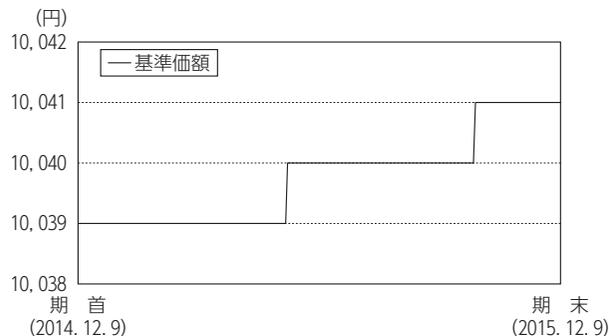
## 大和投資信託

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		公社債組入比率
	円	騰落率 %	
(期首) 2014年12月9日	10,039	—	58.5
12月末	10,039	0.0	97.2
2015年1月末	10,039	0.0	71.6
2月末	10,039	0.0	62.6
3月末	10,039	0.0	56.0
4月末	10,039	0.0	58.0
5月末	10,040	0.0	59.9
6月末	10,040	0.0	56.2
7月末	10,040	0.0	57.4
8月末	10,040	0.0	55.6
9月末	10,040	0.0	59.3
10月末	10,041	0.0	71.0
11月末	10,041	0.0	52.1
(期末) 2015年12月9日	10,041	0.0	51.6

(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：10,039円 期末：10,041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

○国内短期金融市況

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き、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

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国	国債証券	千円 75,714,577	千円 ( 43,770,000)
国内	国債証券		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利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

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
568 国庫短期証券 2016/2/15	7,000,594		
574 国庫短期証券 2016/3/14	5,000,640		
573 国庫短期証券 2016/3/7	4,500,619		
540 国庫短期証券 2015/9/24	3,799,996		
557 国庫短期証券 2015/12/14	2,999,999		
567 国庫短期証券 2016/2/8	2,999,997		
520 国庫短期証券 2015/6/22	2,999,976		
555 国庫短期証券 2015/12/7	2,500,000		
553 国庫短期証券 2015/11/24	2,060,000		
536 国庫短期証券 2015/9/7	2,000,000		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利分は含まれておりません)。  
 (注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちB B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	32,420,000	32,424,550	51.6	—	—	—	—	51.6	

(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	銘 柄	年利率	当		期		末	
			額面金額	評価額	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	—	3,000,000	2,999,999	2015/12/14			
	559 国庫短期証券	—	2,000,000	2,000,000	2015/12/21			
	560 国庫短期証券	—	1,600,000	1,599,999	2015/12/28			
	563 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/01/18			
	566 国庫短期証券	—	1,500,000	1,499,999	2016/02/01			
	567 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,998	2016/02/08			
	568 国庫短期証券	—	7,000,000	7,000,594	2016/02/15			
	573 国庫短期証券	—	4,500,000	4,500,612	2016/03/07			
	556 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,123	2016/03/10			
	574 国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,640	2016/03/14			
	575 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,448	2016/06/10			
	342 2年国債	0.1000	720,000	720,576	2016/07/15			
100 5年国債	0.3000	600,000	601,560	2016/09/20				
合計	銘柄数	13銘柄						
	金額		32,420,000	32,424,550				

(注) 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
	千円	%
公社債	32,424,550	40.2
コール・ローン等、その他	48,181,367	59.8
投資信託財産総額	80,605,918	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネースtock・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
<b>(A) 資産</b>	<b>80,605,918,433円</b>
コール・ローン等	48,180,683,441
公社債(評価額)	32,424,550,578
未収利息	481,238
前払費用	203,176
<b>(B) 負債</b>	<b>17,814,126,500</b>
未払金	17,502,126,500
未払解約金	312,000,000
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>62,791,791,933</b>
元本	62,535,131,959
次期繰越損益金	256,659,974
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>62,535,131,959口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,041円

\*期首における元本額は817,136,908円、当期中における追加設定元本額は80,209,414,361円、同解約元本額は18,491,419,310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、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジあり)112,594,660円、ダイワ米国担保付貸付債権ファンド(為替ヘッジなし)73,734,556円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-07 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-09 9,963円、ダイワ米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり)2014-11 9,962円、ロボット・テクノロジ関連株ファンド-ロボテック-3,983,667円、新興国ソブリン・豪ドルファンド(毎月決算型)999円、新興国ソブリン・ブラジルリアルファンド(毎月決算型)999円、新興国ソブリン・ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)999円、アジア高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)999円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド A コース2,996,693円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド B コース2,494,264円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド C コース999,197円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド 2 A コース698,255円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド 2 B コース458,853円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド 3 A コース1,994,416円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド 3 B コース648,186円、リそな毎月払出し・豪ドル債ファンド 3 C コース179,498円、世界優先証券ファンド(為替ヘッジあり/限定追加型)998円、U S 短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/毎月決算型)3,988,832円、U S 短期高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)4,984円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス14,063,387,856円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス2,983,307,364円、ダイワ上場投信-T O P I Xレバレッジ(2倍)指数2,081,906,471円、ダイワ上場投信-T O P I Xダブルインバース(-2倍)指数796,936,766円、ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス37,546,378,604円、ダイワ上場投信-T O P I Xインバース(-1倍)指数2,340,731,717円、ダイワ上場投信-J P X日経400レバレッジ・インデックス687,286,710円、ダイワ上場投信-J P X日経400インバース・インデックス278,916,205円、ダイワ上場投信-J P X日経400ダブルインバース・インデックス727,153,136円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りC B ファンド(限定追加型)為替ヘッジあり7,009,001円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りC B ファンド(限定追加型)為替ヘッジなし904,221円、ダイワ・ブルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ4,980,676円、ダイワ・ブルベア・セレクト ドル高円安ポートフォリオ258,995,899円、ダイワ・ブルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ69,726,080円、ダイワ/モルガン・スタンレー新興4カ国不動産関連ファンド-成長の楯(つちおと)-11,000,000円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ197,260,107円、ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ90,940,158円、ダイワ米国高利回り不動産証券ファンド19,942,168円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 豪ドル・コース(毎月分配型)4,184,518円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グ

レートコンシューマー株式ファンドII 通貨セレクト・コース(毎月分配型)4,981,569円、ダイワU S 短期ハイ・イールド社債ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)199,295円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)997円、ダイワ米国バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)997円、ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジなし)997円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり49,806円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし49,806円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型)米ドル・コース4,980,080円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型)ブラジル・リアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型)通貨セレクト・コース3,685,259円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり(毎月分配型)399,083円、ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし(毎月分配型)99,771円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース(毎月分配型)399,083円、通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース(毎月分配型)99,771円、ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジあり)20,016,725円、ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド(為替ヘッジなし)4,000,959円、ダイワ/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド49,850,449円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ-日本円・コース(毎月分配型)398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ-豪ドル・コース(毎月分配型)99,691円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ-ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ-米ドル・コース(毎月分配型)398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)-ジャパン・トリプルリターンズ-通貨セレクト・コース(毎月分配型)1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型日本円・コース3,488,836円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型豪ドル・コース2,492,026円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型ブラジル・リアル・コース3,488,836円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型米ドル・コース19,936,205円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイII-予想分配金提示型通貨セレクト・コース11,961,723円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,041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
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>4,849,980円</b>
受取利息	4,849,980
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 176,333</b>
売買益	15,667
売買損	△ 192,000
<b>(C) 当期損益金 (A + B)</b>	<b>4,673,647</b>
<b>(D) 前期繰越損益金</b>	<b>3,178,379</b>
<b>(E) 解約差損益金</b>	<b>△ 74,181,691</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>322,989,639</b>
<b>(G) 合計 (C + D + E + F)</b>	<b>256,659,974</b>
次期繰越損益金 (G)	256,659,974

(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。