

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

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、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、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)
繰上償還
(償還日 2016年2月4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、約款の規定により、繰上償還となりました。

ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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
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
償還(2016年2月4日)	7,502.79	—	△ 0.2	11,962	3.8	—	—	91

(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。

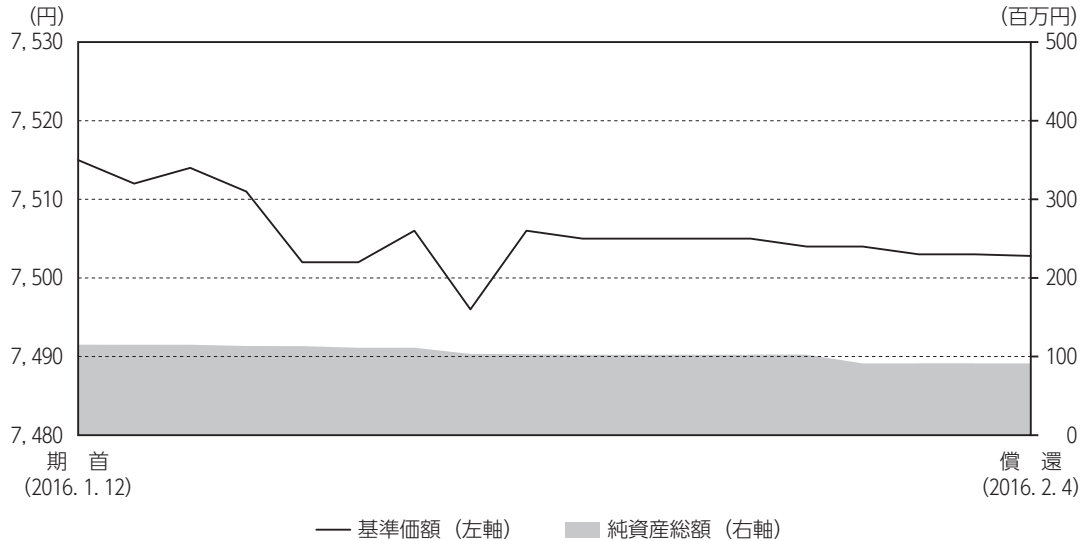
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(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



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：7,502円79銭（既払出金3,600円）

騰落率：7.9%（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、金利が低下（債券価格は上昇）したことや債券の利息収入を得たことがプラスの寄与となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」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 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %		
(期首)2016年 1月12日	7,515	—	11,529	—	—	4.9
1月末	7,504	△ 0.1	12,024	4.3	—	—
(償還)2016年 2月4日	7,502.79	△ 0.2	11,962	3.8	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について**○オーストラリア債券市況**

設定時から2013年3月中旬にかけては、ギリシャに端を発した欧州債務問題への懸念が後退したことや、主要貿易相手国である中国の景気に底打ちの兆しが見られたことで、オーストラリア債券市場の金利は上昇しました。オーストラリアでは鉱業セクターの成長減速による景気悪化懸念から、2012年12月にRBA（オーストラリア準備銀行）は政策金利を0.25%ポイント引き下げ、3.00%としました。2013年3月中旬以降は、オーストラリア景気に悪化が見られたことに加え、中国や米国などでも景気悪化懸念が高まったことで利下げ観測が急速に浮上し、金利は低下しました。5月には豪ドル高に対する警戒感もあって、RBAは0.25%ポイントの利下げに踏み切り、政策金利を2.75%に引き下げました。6月に入ると、米国で量的金融緩和策が段階的に縮小されるとの見方が高まったことで、米国債を中心に金利が急上昇し、オーストラリア債券の金利も米国債に連れる形で上昇しました。しかし7月以降は、オーストラリア景気に対する不透明感がくすぶる中で、8月にRBAが0.25%ポイントの利下げを行ない、政策金利を2.50%に引き下げたことで、金利は低下しました。8月から12月にかけては、米国の量的金融緩和策の縮小観測も再び高まる中、米国債を中心に世界的に債券金利が上昇し、オーストラリア債券の金利も上昇しました。2014年1月から8月にかけては、アルゼンチン・ペソ急落をきっかけとした新興国市場の不安定化に加え、ウクライナの政情不安などを背景に、金利は低下しました。9月に入ると、米国で早期利上げ観測が高まり、米国債に連れてオーストラリアの金利も一時上昇しました。しかしその後は、IMF（国際通貨基金）の世界経済見通しの下方修正やエボラ出血熱の感染拡大、株式などのリスク資産の価格下落などを受けて、金利は再び低下しました。11月から2015年3月にかけては、原油価格の下落が物価を下押しすると観測から、世界的に債券金利の低下が進んだことに加え、2月にはRBAが予想外に0.25%ポイントの利下げを行ない、政策金利を2.25%としたことで、金利は低下基調となりました。4月以降は、原油価格が反発し、世界的にディスインフレへの懸念が後退する中、これまで低水準に抑えられていたユーロ圏の金利が急騰し、オーストラリアの金利もこの動きに連れて急上昇しました。5月初旬にはRBAは0.25%ポイントの利下げを行ない、政策金利を2.00%としました。その後は、ギリシャの債務問題や米国の利上げ時期への思惑など海外動向に左右されつつ、金利は大きく上下に振れる展開が続きました。7月から8月にかけては、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、金利は低下しました。9月から11月にかけては、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。12月以降は、原油や鉄鉱石など商品の価格下落に加え、中国株が再び下落したことを背景に、オーストラリア債券金利は低下が続きました。

○為替相場

設定時82円台で始まった豪ドル円為替相場は、2012年12月にかけて、日本の衆議院選挙において自民党が単独過半数を獲得したことで、日銀への金融緩和期待が高まる中、円安が進行し豪ドル円は89円台まで上昇しました。2013年に入っても、日銀への金融緩和期待が継続し、日本の経常収支および貿易収支の赤字も円安材料となり、豪ドル円は上昇基調が続きました。4月には日銀が大規模な金融緩和策の導入を決定したことから、これまでの円売りがさらに加速し、豪ドル円は一時105円台まで上昇しました。5月以降は、中国の景気後退懸念が高まったことに加え、金融当局者から豪ドル高をけん制する発言が見られたこと、さらにはRBAによる利下げが行なわれたことで豪ドル円は下落に転じ、8月には一時86円台まで下落しました。9月から2014年1月にかけては、米国の景気回復期待が高まる中で市場のリスクセンチメントが好転し主要通貨に対し円安が進行しましたが、金融当局者による豪ドル高けん制姿勢が重しとなり、豪ドル円は一進一退の推移が続きました。2月から4月上旬にかけては、オーストラリア景気に回復の兆しが見られる中、利下げ観測が後退したことなどで、豪ドル円は上昇しました。その後は、ウクライナ情勢への懸念などから円高豪ドル安となる局面もありましたが、高金利通貨への選好が強まったこともあって、一进一退の推移が続きました。10月中旬以降は、日銀が追加金融緩和を実施したことで円売りが急速に進み、豪ドル円は一時102円台まで上昇しました。しかし12月に入ると、原油価格の下落を受けた資源国通貨売りや、オーストラリア景気の低迷による利下げ観測の浮上を受けて豪ドル円は下落に転じ、2015年1月には91円台まで下落しました。2月から6月中旬にかけては、堅調な経済指標から追加利下げ観測が後退したことなどから豪ドル円が反発し、一時96円台まで上昇しました。6月下旬以降は、ギリシャ情勢の混迷や中国株の急落を背景に、市場のリスク回避姿勢が強まったことで豪ドル円は下落し、9月上旬には82円台まで下落しました。9月中旬から12月上旬にかけては、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市場のリスク選好度が強まったことなどで、豪ドル円は90円台まで回復しました。しかしその後は、原油や鉄鉱石など商品の価格下落に加えて中国株が再び下落したことを受けて、豪ドル円は80円台前後まで下落する動きとなりました。

信託期間中の運用方針

○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。）の受益証券を通じて、豪ドル建ての債券に投資し、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、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。

信託期間中のポートフォリオについて

○当ファンド

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。

2016年1月上旬以降は、投資対象とするダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が10億円を下回り、当ファンドの繰上償還が決まったことから、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Aクラス）への投資割合を段階的に引き下げ、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。

○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。

2016年1月上旬以降は、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が10億円を下回り繰上償還が決定したため、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。

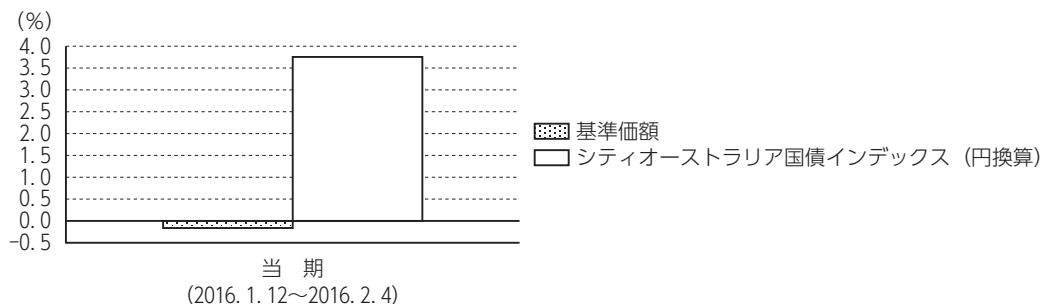
○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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。

以下のグラフは当期における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数は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

1万口当り、第2期～第37期は各100円の払出しを行ないました。なお、第1期および第38期は配分方針通り、払出しを行ないませんでした。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 1. 13~2016. 2. 4)		
	金 額	比 率	
信託報酬	6円	0.074%	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7,505円です。
(投信会社)	(2)	(0.022)	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)	(4)	(0.051)	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)	(0)	(0.002)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	6	0.074	

(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
投資信託受益証券

(2016年1月13日から2016年2月4日まで)

決算期	当期			
	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)	—	—	78.618	5,534

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2016年1月13日から2016年2月4日まで)

銘柄	当 期			銘柄	当 期		
	買付	口数	金額		売付	口数	金額
		千口	千円		千口	千円	平均単価
			円				円
				DAIWA AUSTRALIAN BOND FUND CLASS A (ケイマン諸島)	78.618	5,534	70

(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

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年2月4日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	91,315	100.0
投資信託財産総額	91,315	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

2016年2月4日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	91,315,232円
コール・ローン等	91,315,082
未収利息	150
(B) 負債	76,420
未払信託報酬	76,420
(C) 純資産総額 (A - B)	91,238,812
元本	121,606,550
償還差損益金	△ 30,367,738
(D) 受益権総口数	121,606,550口
1万口当り償還価額 (C / D)	7,502円79銭

* 期首における元本額は153,070,459円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は31,463,909円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は7,502円79銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は30,367,738円です。

■損益の状況

当期 自2016年1月13日 至2016年2月4日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,903円
受取利息	3,903
(B) 有価証券売買損益	△ 78,036
売買益	11,702
売買損	△ 89,738
(C) 信託報酬等	△ 76,420
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 150,553
(E) 前期繰越損益金	△ 33,057,898
(F) 追加信託差損益金	2,840,713
(配当等相当額)	(1,757,166)
(売買損益相当額)	(1,083,547)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 30,367,738
償還差損益金 (G)	△ 30,367,738

(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せん。

(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。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2012年10月19日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年2月4日		資 産 総 額	91,315,232円
区 分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	76,420円
受益権口数	139,525,674口	121,606,550口	△17,919,124口	純 資 産 総 額	91,238,812円
元 本 額	139,525,674円	121,606,550円	△17,919,124円	受 益 権 口 数	121,606,550口
				1 単 位 当 り 償 還 金	7,502円79銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第1期	824,975,949	869,099,221	10,535	0	0.00
第2期	797,719,735	874,701,660	10,965	100	1.00
第3期	640,784,873	731,180,691	11,411	100	1.00
第4期	569,775,887	659,968,178	11,583	100	1.00
第5期	547,121,565	661,198,752	12,085	100	1.00
第6期	531,917,528	633,202,348	11,904	100	1.00
第7期	382,413,287	413,949,006	10,825	100	1.00
第8期	360,028,865	378,121,795	10,503	100	1.00
第9期	353,344,518	353,267,722	9,998	100	1.00
第10期	340,226,088	344,706,272	10,132	100	1.00
第11期	333,498,611	339,324,490	10,175	100	1.00
第12期	317,305,917	324,769,545	10,235	100	1.00
第13期	296,695,844	301,734,959	10,170	100	1.00
第14期	271,329,665	276,135,001	10,177	100	1.00

りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Aコース

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第15期	261,372,008	258,375,355	9,885	100	1.00
第16期	255,376,950	257,105,538	10,068	100	1.00
第17期	253,114,335	257,873,890	10,188	100	1.00
第18期	241,637,743	245,497,151	10,160	100	1.00
第19期	236,658,159	240,355,070	10,156	100	1.00
第20期	230,414,066	232,886,012	10,107	100	1.00
第21期	229,924,350	229,700,610	9,990	100	1.00
第22期	228,455,055	233,881,634	10,238	100	1.00
第23期	227,491,332	223,326,591	9,817	100	1.00
第24期	224,513,030	228,195,934	10,164	100	1.00
第25期	219,880,449	227,986,739	10,369	100	1.00
第26期	209,350,513	210,820,963	10,070	100	1.00
第27期	207,619,491	199,835,048	9,625	100	1.00
第28期	207,619,491	198,489,191	9,560	100	1.00
第29期	198,538,802	187,291,621	9,434	100	1.00
第30期	195,639,693	183,520,223	9,381	100	1.00
第31期	195,639,693	183,049,916	9,356	100	1.00
第32期	194,676,064	171,039,803	8,786	100	1.00
第33期	185,379,130	164,372,523	8,867	100	1.00
第34期	183,451,873	146,886,422	8,007	100	1.00
第35期	181,790,837	147,951,306	8,139	100	1.00
第36期	175,950,374	141,718,165	8,054	100	1.00
第37期	155,191,739	125,918,942	8,114	100	1.00
第38期	153,070,459	115,035,299	7,515	0	0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	7,502円79銭

償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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 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
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
償還(2016年2月4日)	9,133.41	—	△ 0.2	11,962	3.8	—	—	33

(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。

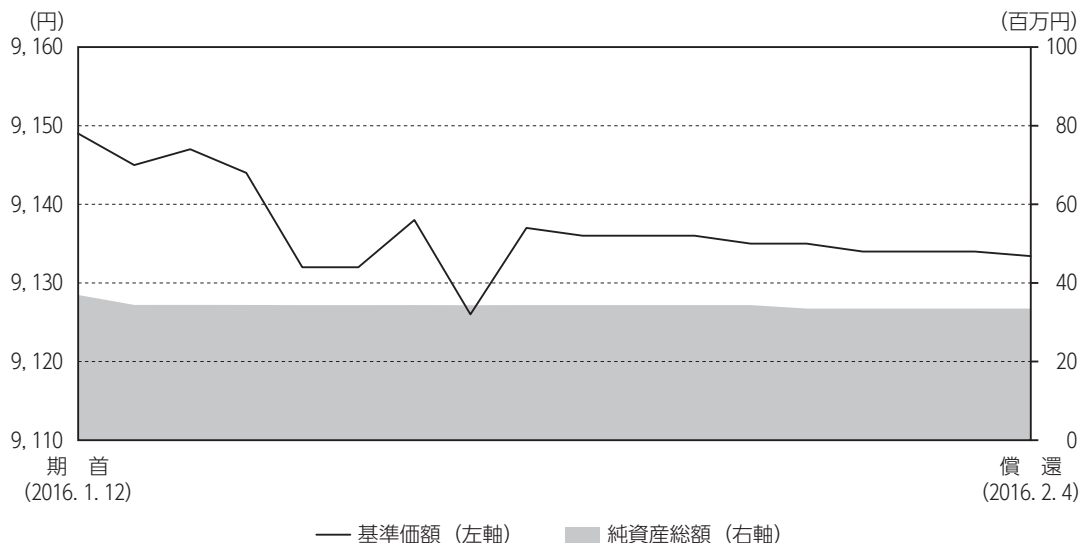
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(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



■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：9,133円41銭（既払出金1,800円）

騰落率：7.8%（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、金利が低下（債券価格は上昇）したことや債券の利息収入を得たことがプラスの寄与となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

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 %		
(期首)2016年 1月12日	9,149	—	11,529	—	—	5.0
1月末	9,135	△ 0.2	12,024	4.3	—	—
(償還)2016年 2月4日	9,133.41	△ 0.2	11,962	3.8	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について**○オーストラリア債券市況**

設定時から2013年3月中旬にかけては、ギリシャに端を発した欧州債務問題への懸念が後退したことや、主要貿易相手国である中国の景気に底打ちの兆しが見られたことで、オーストラリア債券市場の金利は上昇しました。オーストラリアでは鉱業セクターの成長減速による景気悪化懸念から、2012年12月にRBA（オーストラリア準備銀行）は政策金利を0.25%ポイント引き下げ、3.00%としました。2013年3月中旬以降は、オーストラリア景気に悪化が見られたことに加え、中国や米国などでも景気悪化懸念が高まったことで利下げ観測が急速に浮上し、金利は低下しました。5月には豪ドル高に対する警戒感もあって、RBAは0.25%ポイントの利下げに踏み切り、政策金利を2.75%に引き下げました。6月に入ると、米国で量的金融緩和策が段階的に縮小されるとの見方が高まったことで、米国債を中心に金利が急上昇し、オーストラリア債券の金利も米国債に連れる形で上昇しました。しかし7月以降は、オーストラリア景気に対する不透明感がくすぶる中で、8月にRBAが0.25%ポイントの利下げを行ない、政策金利を2.50%に引き下げたことで、金利は低下しました。8月から12月にかけては、米国の量的金融緩和策の縮小観測も再び高まる中、米国債を中心に世界的に債券金利が上昇し、オーストラリア債券の金利も上昇しました。2014年1月から8月にかけては、アルゼンチン・ペソ急落をきっかけとした新興国市場の不安定化に加え、ウクライナの政情不安などを背景に、金利は低下しました。9月に入ると、米国で早期利上げ観測が高まり、米国債に連れてオーストラリアの金利も一時上昇しました。しかしその後は、IMF（国際通貨基金）の世界経済見通しの下方修正やエボラ出血熱の感染拡大、株式などのリスク資産の価格下落などを受けて、金利は再び低下しました。11月から2015年3月にかけては、原油価格の下落が物価を下押しすると観測から、世界的に債券金利の低下が進んだことに加え、2月にはRBAが予想外に0.25%ポイントの利下げを行ない、政策金利を2.25%としたことで、金利は低下基調となりました。4月以降は、原油価格が反発し、世界的にディスインフレへの懸念が後退する中、これまで低水準に抑えられていたユーロ圏の金利が急騰し、オーストラリアの金利もこの動きに連れて急上昇しました。5月初旬にはRBAは0.25%ポイントの利下げを行ない、政策金利を2.00%としました。その後は、ギリシャの債務問題や米国の利上げ時期への思惑など海外動向に左右されつつ、金利は大きく上下に振れる展開が続きました。7月から8月にかけては、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、金利は低下しました。9月から11月にかけては、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。12月以降は、原油や鉄鉱石など商品の価格下落に加え、中国株が再び下落したことを背景に、オーストラリア債券金利は低下が続きました。

○為替相場

設定時82円台で始まった豪ドル円為替相場は、2012年12月にかけて、日本の衆議院選挙において自民党が単独過半数を獲得したことで日銀への金融緩和期待が高まる中、円安が進行し豪ドル円は89円台まで上昇しました。2013年に入っても、日銀への金融緩和期待が継続し、日本の経常収支および貿易収支の赤字も円安材料となり、豪ドル円は上昇基調が続きました。4月には日銀が大規模な金融緩和策の導入を決定したことから、これまでの円売りがさらに加速し、豪ドル円は一時105円台まで上昇しました。5月以降は、中国の景気後退懸念が高まったことに加え、金融当局者から豪ドル高をけん制する発言が見られたこと、さらにはRBAによる利下げが行なわれたことで豪ドル円は下落に転じ、8月には一時86円台まで下落しました。9月から2014年1月にかけては、米国の景気回復期待が高まる中で市場のリスクセンチメントが好転し主要通貨に対し円安が進行しましたが、金融当局者による豪ドル高けん制姿勢が重しとなり、豪ドル円は一進一退の推移が続きました。2月から4月上旬にかけては、オーストラリア景気に回復の兆しが見られる中、利下げ観測が後退したことなどで、豪ドル円は上昇しました。その後は、ウクライナ情勢への懸念などから円高豪ドル安となる局面もありましたが、高金利通貨への選好が強まったこともあって、一進一退の推移が続きました。10月中旬以降は、日銀が追加金融緩和を実施したことで円売りが急速に進み、豪ドル円は一時102円台まで上昇しました。しかし12月に入ると、原油価格の下落を受けた資源国通貨売りや、オーストラリア景気の低迷による利下げ観測の浮上を受けて豪ドル円は下落に転じ、2015年1月には91円台まで下落しました。2月から6月中旬にかけては、堅調な経済指標から追加利下げ観測が後退したことなどから豪ドル円が反発し、一時96円台まで上昇しました。6月下旬以降は、ギリシャ情勢の混迷や中国株の急落を背景に、市場のリスク回避姿勢が強まったことで豪ドル円は下落し、9月上旬には82円台まで下落しました。9月中旬から12月上旬にかけては、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市場のリスク選好度が強まったことなどで、豪ドル円は90円台まで回復しました。しかしその後は、原油や鉄鉱石など商品の価格下落に加えて中国株が再び下落したことを受けて、豪ドル円は80円台前後まで下落する動きとなりました。

信託期間中の運用方針

○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。）の受益証券を通じて、豪ドル建ての債券に投資し、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、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。

○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。

信託期間中のポートフォリオについて

○当ファンド

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。

2016年1月上旬以降は、投資対象とするダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が10億円を下回り、当ファンドの繰上償還が決まったことから、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンド（Bクラス）への投資割合を段階的に引き下げ、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。

○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。

2016年1月上旬以降は、ダイワ・オーストラリア・ボンド・ファンドの純資産総額が10億円を下回り繰上償還が決定したため、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。

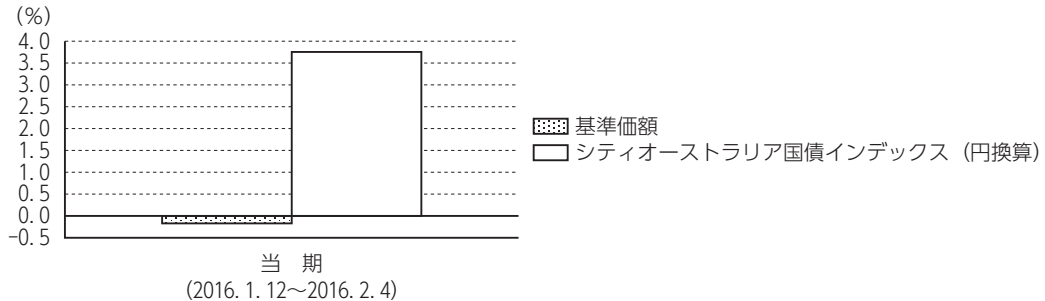
○ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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。

以下のグラフは当期における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数は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

1万口当り、第2期～第37期は各50円の払出しを行ないました。なお、第1期および第38期は分配方針通り、払出しを行ないませんでした。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2016. 1. 13~2016. 2. 4)		
	金 額	比 率	
信託報酬	7円	0.074%	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9,136円です。
(投信会社)	(2)	(0.022)	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)	(5)	(0.050)	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)	(0)	(0.002)	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	—	—	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合 計	7	0.074	

(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 投資信託受益証券

(2016年1月13日から2016年2月4日まで)

決算期	当期			
	買付		売却	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	—	—	20.137	1,801

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄 投資信託受益証券

(2016年1月13日から2016年2月4日まで)

銘柄	当期買付			当期売却		
	□数	金額	平均単価	□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)	20.137	1,801	89			

(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

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

最終期末における該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

2016年2月4日現在

項目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	33,495	100.0
投資信託財産総額	33,495	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

2016年2月4日現在

項目	償還時
(A) 資産	33,495,862円
コール・ローン等	33,495,807
未収利息	55
(B) 負債	24,949
未払信託報酬	24,949
(C) 純資産総額 (A - B)	33,470,913
元本	36,646,681
償還差損益金	△ 3,175,768
(D) 受益権総口数	36,646,681口
1万口当り償還価額 (C / D)	9,133円41銭

* 期首における元本額は40,367,569円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は3,720,888円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,133円41銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,175,768円です。

りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Bコース

■損益の状況

当期 自2016年1月13日 至2016年2月4日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,248円
受取利息	1,248
(B) 有価証券売買損益	△ 34,224
売買益	1
売買損	△ 34,225
(C) 信託報酬等	△ 24,949
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 57,925
(E) 前期繰越損益金	△ 3,735,830
(F) 追加信託差損益金	617,987
(配当等相当額)	(221,158)
(売買損益相当額)	(396,829)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 3,175,768
償還差損益金 (G)	△ 3,175,768

(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せん。

(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。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2012年10月19日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年2月4日		資 産 総 額	33,495,862円
区 分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	24,949円
受益権口数	91,170,879口	36,646,681口	△54,524,198口	受 益 権 口 数	36,646,681口
元 本 額	91,170,879円	36,646,681円	△54,524,198円	1 単 位 当 り 償 還 金	9,133円41銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第1期	227,727,854	239,626,964	10,523	0	0.00
第2期	195,430,693	215,034,379	11,003	50	0.50
第3期	176,893,396	203,400,935	11,499	50	0.50
第4期	165,219,349	193,697,891	11,724	50	0.50
第5期	134,784,703	165,563,329	12,284	50	0.50
第6期	133,361,073	162,055,877	12,152	50	0.50
第7期	111,050,203	123,302,807	11,103	50	0.50
第8期	101,866,732	110,301,950	10,828	50	0.50
第9期	98,978,007	102,562,190	10,362	50	0.50
第10期	97,019,143	102,404,793	10,555	50	0.50
第11期	82,932,440	88,350,068	10,653	50	0.50
第12期	82,932,440	89,319,336	10,770	50	0.50
第13期	82,932,440	89,202,952	10,756	50	0.50
第14期	82,932,440	89,728,752	10,819	50	0.50

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第15期	80,927,529	85,519,711	10,567	50	0.50
第16期	80,927,529	87,560,884	10,820	50	0.50
第17期	77,499,517	85,289,441	11,005	50	0.50
第18期	77,499,517	85,503,001	11,033	50	0.50
第19期	77,499,517	85,929,152	11,088	50	0.50
第20期	77,499,517	85,967,621	11,093	50	0.50
第21期	77,499,517	85,434,161	11,024	50	0.50
第22期	67,610,276	76,768,164	11,355	50	0.50
第23期	51,645,763	56,560,556	10,952	50	0.50
第24期	48,270,739	55,000,224	11,394	50	0.50
第25期	47,203,636	55,152,353	11,684	50	0.50
第26期	47,203,636	53,864,153	11,411	50	0.50
第27期	47,203,636	51,791,319	10,972	50	0.50
第28期	42,306,476	46,368,900	10,960	50	0.50
第29期	42,306,476	46,029,759	10,880	50	0.50
第30期	42,306,476	46,041,294	10,883	50	0.50
第31期	42,306,476	46,200,033	10,920	50	0.50
第32期	42,306,476	43,668,272	10,322	50	0.50
第33期	42,306,476	44,355,413	10,484	50	0.50
第34期	41,327,044	39,426,333	9,540	50	0.50
第35期	41,327,044	40,360,345	9,766	50	0.50
第36期	41,327,044	40,232,757	9,735	50	0.50
第37期	40,367,569	39,862,668	9,875	50	0.50
第38期	40,367,569	36,933,170	9,149	0	0.00

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	9,133円41銭

償還金の課税上の取扱いについて

- ・ 償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・ 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2月4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

資産		
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
資産合計		<u>19,131,032</u>
負債		
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
負債合計		<u>593,738</u>
純資産	ドル	<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
	ドル	<u>18,537,294</u>
発行済み受益証券数		
クラス A		14,148,260
クラス B		3,015,149
クラス C		762,665
1口当たりの純資産		
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

投資収益		
利息収入	ドル	920,748
投資収益合計		<u>920,748</u>
費用		
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
費用合計		<u>274,052</u>
純投資収益		<u>646,696</u>
実現益および評価益（実現損および評価損）：		
実現益（損）：		
有価証券への投資		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)
純実現益		<u>571,412</u>
評価益（損）の純変動：		
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)
評価益の純変動		<u>654,071</u>
実現益および評価益		<u>1,225,483</u>
業務活動の結果生じた純資産の純増	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2月4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
		債券 (99.5%)		
		オーストラリア (78.8%)		
		社債 (27.1%)		
		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
		社債計		5,015,454
		国債 (51.7%)		
		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 ^(a)		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
		国債計		9,585,236
		オーストラリア計 (費用14,087,571ドル)		14,600,690
		オランダ (1.7%)		
		社債 (1.7%)		
AUD	300,000	ING Bank NV 5.50% due 09/27/19		321,718
		社債計		321,718
		オランダ計 (費用299,841ドル)		321,718
		スイス (2.7%)		
		社債 (2.7%)		
AUD	500,000	Credit Suisse AG 4.00% due 07/16/19		507,171
		社債計		507,171
		スイス計 (費用495,802ドル)		507,171
		英国 (2.8%)		
		社債 (2.8%)		
AUD	500,000	Barclays Bank PLC 4.50% due 04/04/19		518,315
		社債計		518,315
		英国計 (費用495,566ドル)		518,315
		米国 (13.5%)		
		社債 (13.5%)		
AUD	400,000	Goldman Sachs Group, Inc. 5.00% due 08/21/19		419,565
AUD	500,000	7.75% due 11/23/16		539,948
AUD	500,000	JPMorgan Chase & Co. 4.65% due 11/07/17		518,481
AUD	500,000	Morgan Stanley 4.75% due 11/16/18		517,514
AUD	500,000	Wells Fargo & Co. 4.00% due 08/08/19		510,221
		社債計		2,505,729
		米国計 (費用2,429,864ドル)		2,505,729
		債券計 (費用17,808,644ドル)		18,453,623
		短期投資 (1.3%)		
		英国 (1.3%)		
		定期預金 (1.3%)		
AUD	225,156	National Australian Bank, Ltd. 1.65% due 1/02/15		225,156
		定期預金計		225,156
		英国計 (費用225,156ドル)		225,156
		短期投資計 (費用225,156ドル)		225,156
		投資計 (費用18,033,800ドル)	100.8	ドル 18,678,779
		現金とその他の資産を上回る負債	(0.8)	(141,485)
		純資産	100.0%	ドル 18,537,294

^(a) 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

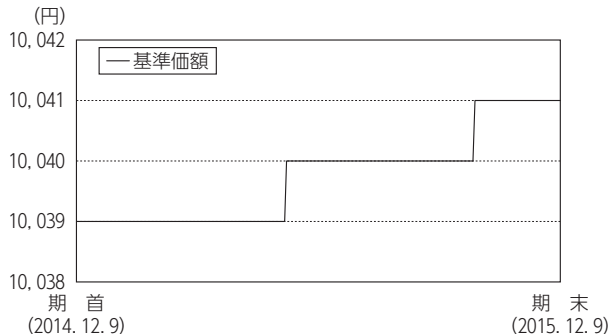
大和投資信託

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	%	
(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	2015年12月9日現在	
	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
(A) 資産	80,605,918,433円
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) 負債	17,814,126,500
未払金	17,502,126,500
未払解約金	312,000,000
(C) 純資産総額 (A - B)	62,791,791,933
元本	62,535,131,959
次期繰越損益金	256,659,974
(D) 受益権総口数	62,535,131,959口
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-TOPIXレバレッジ(2倍)指数2,081,906,471円、ダイワ上場投信-TOPIX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-TOPIXインバース(-1倍)指数2,340,731,717円、ダイワ上場投信-JPX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-JPX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-JPX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CBファンド(限定追加型)為替ヘッジあり7,009,001円、ダイワ/シュローダー・グローバル高利回りCBファンド(限定追加型)為替ヘッジなし904,221円、ダイワ・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-予想配分金提示型日本円・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-予想配分金提示型 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-予想配分金提示型 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-予想配分金提示型 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-予想配分金提示型 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
(A) 配当等収益	4,849,980円
受取利息	4,849,980
(B) 有価証券売買損益	△ 176,333
売買益	15,667
売買損	△ 192,000
(C) 当期損益金 (A + B)	4,673,647
(D) 前期繰越損益金	3,178,379
(E) 解約差損益金	△ 74,181,691
(F) 追加信託差損益金	322,989,639
(G) 合計 (C + D + E + F)	256,659,974
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。