

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	単位型投信/内外/その他資産 (ハイブリッド証券)	
信託期間	約2年10カ月間 (2012年11月21日～2015年9月10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	当ファンド	イ. ケイマン籍の外国投資信託「トライアングルⅡ ファンドーワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンド」(以下「ワールド フィナンシャル ハイブリッド 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・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	円建ての債券
当ファンドの運用方法	①主として、ワールド フィナンシャル ハイブリッド 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、世界の金融機関(関連会社等を含みます。)が発行するハイブリッド証券に投資し、高利回りの獲得をめざします。 ②当ファンドは、ワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンドとダイワ・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、ワールド フィナンシャル ハイブリッド 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ワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンドでは、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。	
マザーファンドの運用方法	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。	
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、元本超過額または経費控除後の配当等収益のうちいずれか多い額とし、原則として、経費控除後の配当等収益の中から分配することをめざします。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。	

ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版) 満期償還 (償還日 2015年9月10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・グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)」は、このたび、満期償還となりました。

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/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受益者 利回り	公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	元本 残存率
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落額	期中 騰落率				
設定(2012年11月21日)	円 10,000	円 —	円 —	% —	% —	% —	% —	% 100.0
1期末(2013年3月11日)	10,086	25	111	1.1	3.7	0.0	99.5	97.8
2期末(2013年9月10日)	10,328	160	402	4.0	6.4	0.0	99.3	77.1
3期末(2014年3月10日)	10,670	200	542	5.2	8.1	0.0	99.3	60.3
4期末(2014年9月10日)	10,635	240	205	1.9	7.0	0.0	99.3	51.7
5期末(2015年3月10日)	10,515	250	130	1.2	6.0	0.0	99.4	47.5
償還(2015年9月10日)	10,486.44	—	△ 28.56	△ 0.3	4.9	—	—	23.3

(注1) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

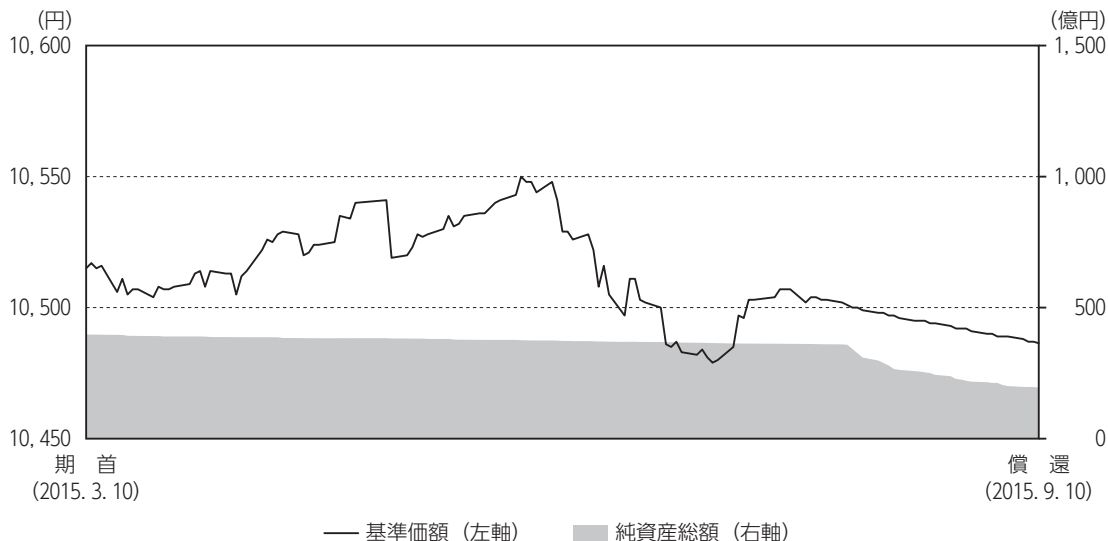
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：10,486円44銭（既払分配金875円）

騰落率：△13.9%（分配金再投資ベース）

■ 基準価額の主な変動要因

「トライアングルⅡ ファンドーワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンド（以下、「ワールド フィナンシャル ハイブリッド 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を通じて、世界の金融機関（関連会社等を含む。）が発行するハイブリッド証券等に投資した結果、ハイブリッド証券からの利息収入や債券価格の上昇が寄与し、基準価額は値上がりしました。

ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
	円	騰 落 率 %		
(期首)2015年 3月10日	10,515	—	0.0	99.4
3月末	10,513	△ 0.0	0.0	99.6
4月末	10,534	0.2	0.0	99.7
5月末	10,541	0.2	0.0	99.8
6月末	10,486	△ 0.3	0.0	99.9
7月末	10,503	△ 0.1	0.0	99.9
8月末	10,490	△ 0.2	—	—
(償還)2015年 9月10日	10,486.44	△ 0.3	—	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について**○ハイブリッド証券市況**

設定後のハイブリッド証券市況は、欧州債務問題に進展が見られる中、2013年5月にかけて堅調に推移しました。6月には米国量的金融緩和の早期縮小が懸念され、世界的に株価が下落するなど市場のリスク回避姿勢が強まったことで調整色を強めましたが、7月に入るとECB（欧州中央銀行）が低金利政策を長期化する意思を明示したほか、米国でも緩和的な金融政策の継続が示されたことで市場に安心感が広がり、ハイブリッド証券市況は再び上昇基調に転じました。12月に米国で量的金融緩和の縮小開始が決定されると、新興国市場などは一時不安定化しましたが、ハイブリッド証券市場に目立った混乱は見られず、むしろ世界的な低金利環境下で相対的に高い利回りを求める投資需要と、金融規制強化を背景としたコール（繰上償還）期待の高まりに支えられ、2014年6月まで堅調な地合いが継続しました。その後、ウクライナや中東における地政学リスクの高まりや、英国スコットランドの独立問題、エボラ出血熱の感染拡大懸念など、悪材料が続いたことから弱含みの展開となりました。また、原油など商品市況の大幅下落やロシア情勢の悪化、ギリシャの国際支援をめぐる混乱も上値を抑える要因となりましたが、10月に実施された欧州の銀行に対する包括的審査が無難な結果であったほか、2015年1月にはECBが国債購入を含む量的金融緩和を決定したことなどから、ハイブリッド証券市況は徐々に持ち直し、再び上昇基調となりました。4月下旬以降は、ギリシャの国際支援をめぐる先行き不透明感や中国株の大幅下落などへの警戒感から上値は抑えられましたが、小康を得るに従い市場のリスク回避姿勢が和らいだことから、ハイブリッド証券市況は底堅い展開となりました。

信託期間中の運用方針

○当ファンド

主として、ワールド フィナンシャル ハイブリッド 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、世界の金融機関（関連会社等を含む。）が発行するハイブリッド証券からの収益を享受することをめざします。

○ワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンド

バーゼルⅢ（金融機関の国際的な自己資本規制）で資本算入されない従来型ハイブリッド証券については、発行体の財務健全化に加え、相対的に高い利回りを求める投資需要とコールの進展による希少性の高まりといった需給要因も引続き支援材料になるとみられます。当ファンドでは、現状の組入銘柄の保有を基本に、相対価値比較の上で一部銘柄の入れ替え等も考慮に入れ、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う方針です。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

○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。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、「ワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンド」の受益証券とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、「ワールド フィナンシャル ハイブリッド 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維持しました。

2015年8月以降は、満期償還に備えるため、現金等を中心とした安定運用に切り替えました。

○ワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンド

主として世界を代表する金融機関が発行する投資適格のハイブリッド証券を対象に、デフォルト（債務不履行）リスクやコール延期リスクを避けて高いリターンが見込まれる証券への投資を行ないました。国・地域別では、フランスなど欧州の発行体を中心とするポートフォリオを維持しました。また、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行ないました。

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

1万口当り、第1期25円、第2期160円、第3期200円、第4期240円、第5期250円の収益分配を行いました。

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よろしく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
	(2015. 3. 11～2015. 9. 10)		
	金 額	比 率	
信託報酬	70円	0.668%	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10,511円です。
(投信会社)	(23)	(0.217)	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)	(46)	(0.434)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.016)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	—	—	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	70	0.668	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は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3月11日から2015年9月10日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	—	—	379,132.995	39,668.674

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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3月11日から2015年9月10日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー ストック・ マザーファンド	—	—	0	1

(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3月11日から2015年9月10日まで)

当				期			
買 付 銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	売 付 銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
				TII FUND-WORLD FINANCIAL HYBRID SECURITIES FUND (ケイマン諸島)	379,132.995	39,668.674	104

(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期中の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。

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

(2015年3月11日から2015年9月10日まで)

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利 害関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利 害関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	32,379	3,299	10.2	—	—	—
コール・ローン	998,089	—	—	—	—	—

(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ペーパーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 期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、当期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

最終期末における該当事項はありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	□ 数
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	千口 0

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）

■投資信託財産の構成

2015年9月10日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	19,894,006 千円	100.0 %
投資信託財産総額	19,894,006	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年9月10日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	19,894,006,690円
コール・ローン等	19,893,975,977
未収利息	30,713
(B) 負債	428,810,001
未払解約金	295,848,740
未払信託報酬	132,961,261
(C) 純資産総額 (A - B)	19,465,196,689
元本	18,562,248,243
償還差損益金	902,948,446
(D) 受益権総口数	18,562,248,243口
1万口当り償還価額 (C / D)	10,486円44銭

* 償還時の計算口数当りの純資産額は10,486円44銭です。

■損益の状況

当期 自2015年3月11日 至2015年9月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,340,488円
受取利息	1,340,488
(B) 有価証券売買損益	1,570,352,817
売買益	1,570,352,852
売買損	△ 35
(C) 有価証券評価差損益	△ 1,419,847,883
(D) 信託報酬等	△ 234,975,251
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 83,129,829
(F) 前期繰越損益金	1,946,993,656
(G) 解約差損益金	△ 960,915,381
(H) 合計 (E + F + G)	902,948,446
償還差損益金 (H)	902,948,446

(注1) 有価証券評価差損益は、有価証券の期末の評価損益と期首との差額です。

(注2) 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3) 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。

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11月21日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2015年9月10日		資産総額	19,894,006,690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	428,810,001円
				純資産総額	19,465,196,689円
受益権口数	79,482,823,021口	18,562,248,243口	△60,920,574,778口	受益権口数	18,562,248,243口
元本額	79,482,823,021円	18,562,248,243円	△60,920,574,778円	1単位当り償還金	10,486円44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	77,788,013,102	78,455,846,619	10,086	25	0.25
第2期	61,335,779,545	63,346,924,683	10,328	160	1.60
第3期	47,971,516,405	51,186,625,568	10,670	200	2.00
第4期	41,092,792,003	43,703,397,349	10,635	240	2.40
第5期	37,791,655,023	39,738,648,679	10,515	250	2.50
信託期間中1単位当り総収益金および年平均収益率				1,361円44銭	4.85%

(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	10,486円44銭

償還金の課税上の取扱いについて

- ・ 償還金の差益（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。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年3月10日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えくださいますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）」は10,642円です。」

トライアングルⅡ ファンドーワールド フィナンシャル ハイブリッド
セキュリティーズ ファンド

当ファンド（ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり））の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資信託「トライアングルⅡ ファンドーワールド フィナンシャル ハイブリッド セキュリティーズ ファンド」の受益証券（円建）の状況は次の通りです。

（注）2015年9月10日で入手しうる直近の決算期分を掲載しております。

貸借対照表
2014年12月31日現在

（日本円）

資産	
現金および現金同等物	1,753,732,045
未収利息	964,082,092
取引先からの未収金	—
利益または損失を通じたフェア・バリューで測定される金融資産	39,265,372,264
資産合計	<u><u>41,983,186,401</u></u>
負債	
利益または損失を通じたフェア・バリューで測定される金融負債	350,473,853
未払解約金	66,000,000
未払費用	52,457,734
負債合計	<u><u>468,931,587</u></u>
資本	
資本金	37,110,483,670
繰越利益	4,403,771,144
資本合計	<u><u>41,514,254,814</u></u>
負債及び資本合計	<u><u>41,983,186,401</u></u>

損益計算書

2014年12月31日に終了した年度

(日本円)

収益	
受取利息	2,566,251,436
利益または損失を通じたフェア・バリューで測定される 金融資産及び負債の純実現損失	1,841,575,420
利益または損失を通じたフェア・バリューで測定される 金融資産及び負債の未実現(損失)/利益の純変動額 為替差(損)益	(1,840,510,947)
収益合計	<u>2,577,713,229</u>

費用	
運用報酬	200,014,826
管理費用等	28,511,746
保管費用	8,408,935
設立費用	—
監査費用	2,493,381
事務代行費用	859,701
その他弁護士費用	431,495
弁護士費用	89,917
その他費用	10,421
翻訳費用	200,000
費用合計	<u>241,020,422</u>

当期純利益 2,336,692,807

資金管理費用

当座貸越の支払利息 —

当期利益 2,336,692,807

利益または損失を通じたフェア・バリューで測定される金融資産

2014年12月31日
(日本円)

利益または損失を通じたフェア・バリューで測定されると指定された金融資産	
- 債券投資	39,077,428,958
売買目的で保有する金融資産	
- デリバティブ	187,943,306
合計	<u>39,265,372,264</u>

利益または損失を通じたフェア・バリューで測定される金融負債

2014年12月31日
(日本円)

売買目的で保有する金融負債	
- デリバティブ	(350,473,853)
合計	<u>(350,473,853)</u>

ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり)

外国為替先渡契約

2014年12月31日現在

売却通貨	売却通貨金額	購入通貨	購入通貨金額	決済日	フェア・バリュー (日本円)
豪ドル	1,639,000	日本円	164,604,770	2015年1月28日	4,080,924
ユーロ	130,784,000	日本円	19,159,331,556	2015年1月28日	183,862,382
米ドル	101,509,000	日本円	11,921,348,922	2015年1月28日	(246,394,744)
英ポンド	51,541,000	日本円	9,539,543,297	2015年1月28日	(92,128,104)
日本円	964,757,970	ユーロ	6,567,000	2015年1月28日	(11,951,005)
合計					<u>(162,530,547)</u>

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第5期 (決算日 2014年12月9日)

(計算期間 2013年12月10日～2014年12月9日)

ダイワ・マネースtock・マザーファンドの第5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

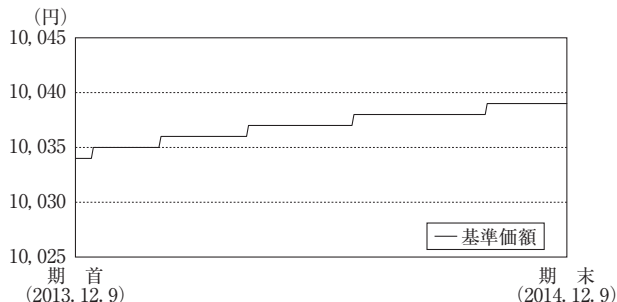
大和投資信託

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)2013年12月9日	10,034	—	69.6
12月末	10,035	0.0	63.0
2014年1月末	10,035	0.0	70.9
2月末	10,036	0.0	65.8
3月末	10,036	0.0	67.1
4月末	10,037	0.0	69.1
5月末	10,037	0.0	69.1
6月末	10,037	0.0	67.6
7月末	10,038	0.0	72.5
8月末	10,038	0.0	73.1
9月末	10,038	0.0	68.8
10月末	10,039	0.0	64.6
11月末	10,039	0.0	64.6
(期末)2014年12月9日	10,039	0.0	58.5

(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：10,034円 期末：10,039円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

利息収入により、基準価額は値上がりしました。

◆投資環境について

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。また、2014年10月末には追加金融緩和を実施し、長期国債を中心とする資産買い入れを一層拡大しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場ではおおむね低位での金利水準が続き、無担保コール翌日物金利は0.06%台を中心に推移しました。国庫短期証券(3カ月物)の利回りは0.06%程度で始まりましたが、日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.01%程度まで低下して期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆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や参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

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

■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

(2013年12月10日から2014年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	2,599,774	(2,690,000)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2013年12月10日から2014年12月9日まで)

当 期		期 末	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
464 国庫短期証券 2015/1/14	149,999		
419 国庫短期証券 2014/12/22	99,999		
477 国庫短期証券 2014/12/8	99,996		
475 国庫短期証券 2014/11/25	99,992		
454 国庫短期証券 2014/8/25	99,990		
433 国庫短期証券 2014/5/26	99,988		
493 国庫短期証券 2015/2/23	89,998		
473 国庫短期証券 2014/11/17	79,995		
452 国庫短期証券 2014/8/18	79,991		
431 国庫短期証券 2014/5/19	79,991		

(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) 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	%	%	%	%
国債証券	480,000	479,995	58.5	—	—	58.5

(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	479 国庫短期証券	—	70,000	69,999	2014/12/15	
	419 国庫短期証券	—	100,000	99,999	2014/12/22	
	464 国庫短期証券	—	150,000	149,999	2015/01/14	
	490 国庫短期証券	—	70,000	69,997	2015/02/09	
	493 国庫短期証券	—	90,000	89,998	2015/02/23	
合計	銘柄数 5銘柄		480,000	479,995		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2014年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	479,995	58.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 , そ の 他	340,319	41.5
投 資 信 託 財 産 総 額	820,315	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

2014年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	820,315,287円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	340,319,449
公 社 債 (評価額)	479,995,838
(B) 負 債	—
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	820,315,287
元 本	817,136,908
次 期 繰 越 損 益 金	3,178,379
(D) 受 益 権 総 口 数	817,136,908口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,039円

* 期首における元本額は815,881,793円、当期中における追加設定元本額は358,153,378円、同解約元本額は356,898,263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・グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)998円、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、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・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、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Aコース4,988,527円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Bコース2,494,264円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド Cコース999,197円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Aコース698,255円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 Bコース458,853円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Aコース1,994,416円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド3 Bコース648,186円、りそな毎月払出し・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/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、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/モルガン・スタンレー新興4 国不動産関連ファンド - 成長の軸音(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277,939,483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155,681,197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/ミレニアム・グローバル・グレートコンシューマー株式会社ファンドⅡ 豪ドル・コース(毎月分配型)4,184,518円、通貨選択型ダイワ/ミレニアム・グローバル・グレートコンシューマー株式会社ファンドⅡ ブラジル・コース(毎月分配型)12,952,078円、通貨選択型ダイワ/ミレニアム・グローバル・グレートコンシューマー株式会社ファンド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/ミレニアム・グローバル・グレートコンシューマー株式会社ファンド(為替ヘッジあり)20,016,725円、ダイワ/ミレニアム・グローバル・グレートコンシューマー株式会社ファンド(為替ヘッジなし)4,000,959円、ダイワ/ミレニアム・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・レアル・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・レアル・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10,039円です。

■損益の状況

当期 自2013年12月10日 至2014年12月9日

項 目	当 期
(A)配当等収益	423,234円
受 取 利 息	423,234
(B)有価証券売買損益	2,048
売 買 益	2,048
(C)当期損益金(A+B)	425,282
(D)前期繰越損益金	2,803,343
(E)解約差損益金	△ 1,321,868
(F)追加信託差損益金	1,271,622
(G)合 計(C+D+E+F)	3,178,379
次期繰越損益金(G)	3,178,379

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

《お知らせ》

●書面決議手続きの改正について

重大な約款変更や繰上償還の際に行なう書面決議について、2014年12月1日施行の法改正により以下の点が変更されたことに伴い、信託約款の該当箇所の変更を行ないました。

- ・書面決議の可決要件が、「受益者の半数以上の賛成かつ受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」から「受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」に変更されました。
- ・投資信託の併合を行なう際、すべての場合で書面決議が必要とされてきましたが、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものであるときは、当該併合に関する書面決議が不要となりました。
- ・書面決議に反対した受益者による受益権買取請求の規定について、一部解約請求に応じる投資信託（当ファンドは該当します。）には適用されなくなりました。