

世界優先証券ファンド (為替ヘッジあり/限定追加型)

★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/内外/その他資産 (優先証券)	
信託期間	約3年間 (2013年1月31日~2016年1月29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「ダイワ・プレミアム・トラスト・プリファード・セキュリティーズ・ファンド」(以下「プリファード・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プリファード・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、主として、世界の金融機関が発行する優先証券に投資することにより、高利回りの獲得をめざします。 ②当ファンドはプリファード・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。プリファード・セキュリティーズ・ファンドへの投資割合を通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③プリファード・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せん。	
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、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、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。	

運用報告書(全体版) 満期償還 (償還日 2016年1月29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、「世界優先証券ファンド(為替ヘッジあり/限定追加型)」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/>

<3161>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	投資 信託 証券 組入 比率	純資 産額
	(分配 落)	税 込 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
2 期末 (2014年 1 月29日)	10,410	210	6.0	0.0	99.4	33,232
3 期末 (2014年 7 月29日)	10,429	210	2.2	0.0	99.4	21,018
4 期末 (2015年 1 月29日)	10,309	210	0.9	0.0	99.4	17,459
5 期末 (2015年 7 月29日)	10,177	210	0.8	0.0	99.4	14,980
償 還 (2016年 1 月29日)	10,211.98	—	0.3	—	—	12,920

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

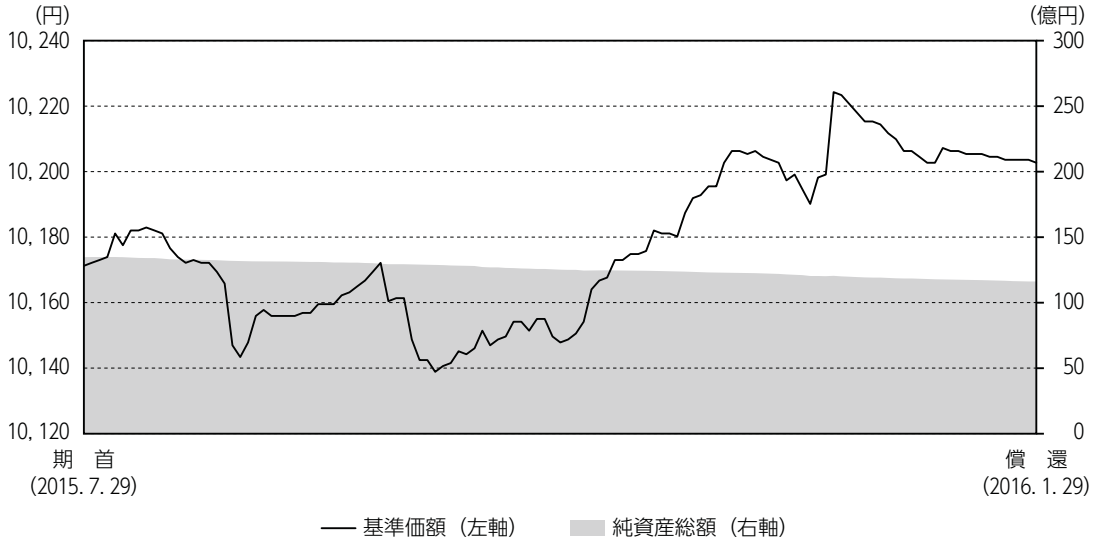
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《運用経過》

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：10,211円98銭（既払分配金1,080円）

騰落率：13.3%（分配金再投資ベース）

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・プレミアム・トラスト・プリファード・セキュリティーズ・ファンド」（以下、「プリファード・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、世界の金融機関が発行する優先証券等に投資した結果、利息収入や債券価格の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

世界優先証券ファンド（為替ヘッジあり／限定追加型）

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %		
(期 首) 2015年 7月29日	10,177	—	0.0	99.4
7月末	10,179	0.0	0.0	99.3
8月末	10,162	△ 0.1	0.0	99.5
9月末	10,152	△ 0.2	0.0	99.6
10月末	10,154	△ 0.2	0.0	99.7
11月末	10,212	0.3	0.0	99.8
12月末	10,222	0.4	0.0	99.7
(償 還) 2016年 1月29日	10,211.98	0.3	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

○優先証券市況

設定後の優先証券市況は、欧州債務問題などに進展が見られる中、堅調に推移しました。2013年6月には米国の量的金融緩和の早期縮小が懸念され調整色を強めましたが、7月に入り欧米の中央銀行から緩和的な金融政策を継続する意思が示されると市場には安心感が広がり、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ましたが、新興国市場などで一時不安定化したものの優先証券市場には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、中東での地政学リスクの高まりやエボラ出血熱の感染拡大懸念、ウクライナ情勢の悪化やギリシャへの国際支援をめぐる混乱などの悪材料が続いたことから、いったんは弱含みましたが、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こと、2015年1月にはECB（欧州中央銀行）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、優先証券市況は徐々に持ち直しました。4月以降はギリシャ情勢の先行き不透明感に加え、中国をはじめとする新興国経済の減速懸念や原油など商品市況の大幅下落に対する警戒感から上値は抑えられました。しかし、優先証券市況への影響は限定され、償還日に向けて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

プリファード・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、主として、世界の金融機関が発行する優先証券に投資することにより、高利回りの獲得をめざします。

○プリファード・セキュリティーズ・ファンド

主として、世界の金融機関が発行する優先証券に投資することにより、高利回りの獲得をめざします。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す。

信託期間中のポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、プリファード・セキュリティーズ・ファンドの受益証券とダイワ・マネーストック・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、信託期間を通じてプリファード・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。

2016年1月に入ってから、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替えました。

○プリファード・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優先証券を対象に、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利回り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。

○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240円、第2期～第5期各210円の収益分配を行ないました。

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. 7. 30～2016. 1. 29)		
	金 額	比 率	
信託報酬	54円	0.532%	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10,185円です。
（投信会社）	(25)	(0.244)	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）	(28)	(0.271)	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	54	0.532	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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。

世界優先証券ファンド（為替ヘッジあり／限定追加型）

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

（2015年7月30日から2016年1月29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）	—	—	144,596.656	15,009,329

（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7月30日から2016年1月29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tock・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7月30日から2016年1月29日まで）

当 期				当 期			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
				DAIWA PREMIUM TRUST- PREFERRED SECURITIES FUND （ケイマン諸島）	144,596.656	15,009,329	103

（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7月30日から2016年1月29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	56,565	8,560	15.1	2,822	—	—
コール・ローン	1,788,417	—	—	—	—	—

（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、当期中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・マネーストック・マザーファンド		千口 0

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年1月29日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 13,024,061	% 100.0
投資信託財産総額	13,024,061	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1月29日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	13,024,061,025円
コール・ローン等	13,023,995,364
未収利息	65,661
(B) 負債	103,396,703
未払解約金	28,585,493
未払信託報酬	74,811,210
(C) 純資産総額 (A - B)	12,920,664,322
元本	12,652,453,679
償還差損益金	268,210,643
(D) 受益権総口数	12,652,453,679口
1万口当り償還価額 (C / D)	10,211円98銭

* 期首における元本額は14,720,246,829円、当期中における追加設定元本額は21,817,021円、同解約元本額は2,089,610,171円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は10,211円98銭です。

■損益の状況

当期 自2015年7月30日 至2016年1月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	545,071円
受取利息	545,071
(B) 有価証券売買損益	118,359,184
売買益	119,905,394
売買損	△ 1,546,210
(C) 信託報酬等	△ 74,811,210
(D) 当期損益金 (A + B + C)	44,093,045
(E) 前期繰越損益金	254,272,647
(F) 追加信託差損益金	△ 30,155,049
(配当等相当額)	(2,669,621)
(売買損益相当額)	(△ 32,824,670)
(G) 合計 (D + E + F)	268,210,643
償還差損益金 (G)	268,210,643

(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。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2013年1月31日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年1月29日		資産総額	13,024,061,025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	103,396,703円
				純資産総額	12,920,664,322円
受益権口数	13,252,735,882口	12,652,453,679口	△600,282,203口	受益権口数	12,652,453,679口
元本額	13,252,735,882円	12,652,453,679円	△600,282,203円	1単位当り償還金	10,211円98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	37,136,693,024	37,222,409,143	10,023	240	2.40
第2期	31,923,959,651	33,232,894,977	10,410	210	2.10
第3期	20,154,172,280	21,018,069,739	10,429	210	2.10
第4期	16,935,524,109	17,459,553,065	10,309	210	2.10
第5期	14,720,246,829	14,980,992,142	10,177	210	2.10

(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

10,211円98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・プリファード・セキュリティーズ・ファンド

当ファンド（世界優先証券ファンド（為替ヘッジあり／限定追加型））はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・プリファード・セキュリティーズ・ファンド」に投資しております。

（注）2016年1月29日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（米ドル建て）

貸借対照表
2015年6月30日

資産		
投資、時価（費用117,145,993ドル）	ドル	118,121,479
現金		780
為替先渡契約による評価益		782,814
未収：		
売却済投資証券		8,900,799
利息		1,377,145
配当金		134,987
その他資産		8,101
資産合計		<u>129,326,105</u>
負債		
為替先渡契約による評価損		362,882
未払：		
買戻し済みの受益証券		735,504
投資運用会社報酬		50,712
専門家報酬		45,989
会計および管理報酬		35,832
保管報酬		22,590
購入済投資証券		19,796
名義書換代理会社報酬		8,112
負債合計		<u>1,281,417</u>
純資産	ドル	<u>128,044,688</u>
純資産		
クラス A	ドル	<u>128,044,688</u>
発行済み受益証券数		
クラス A		149,123,559
1口当り純資産価額		
クラス A	ドル	0.859

損益計算書

2015年6月30日に終了した年度

投資収益

利息収入	ドル	7,064,941
配当収益（20,506ドルの源泉税控除後）		539,971
投資収益合計		7,604,912

費用

投資運用会社報酬		769,166
会計および管理報酬		94,717
保管報酬		56,718
専門家報酬		47,927
名義書換代理会社報酬		23,010
受託会社報酬		5,651
登録費用		2,312
費用合計		999,501

純投資収益		6,605,411
--------------	--	------------------

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		1,463,294
外国為替取引および為替先渡契約		(16,818,337)
純実現損		(15,355,043)

評価益（損）の純変動：

有価証券への投資		(20,464,511)
外国為替換算および為替先渡契約		899,987
評価損の純変動		(19,564,524)

純実現損および純評価損		(34,919,567)
--------------------	--	---------------------

業務活動から生じた純資産の純減	ドル	(28,314,156)
------------------------	----	---------------------

投資明細表
2015年6月30日

<u>元本金額</u>		<u>有価証券の明細</u>	<u>純資産に 占める比率</u>	<u>公正価値</u>
		債券 (58.0%)		
		フランス (22.2%)		
		社債 (22.2%)		
		BNP Paribas S. A.		
EUR	8,200,000	4.73% due 04/29/49 (a), (b), (c)	ドル	9,273,487
EUR	3,700,000	5.02% due 04/29/49 (a), (b), (c)		4,304,138
		BPCE S. A.		
EUR	9,227,000	4.63% due 07/29/49 (a), (b), (c)		10,280,723
		Credit Agricole S. A.		
GBP	2,900,000	5.14% due 12/29/49 (a), (b), (c)		4,583,634
		社債計		28,441,982
		フランス計 (費用 30,131,423ドル)		28,441,982
		オランダ (7.2%)		
		社債 (7.2%)		
		ING Groep NV		
GBP	1,906,000	5.14% due 03/29/49 (a), (b), (c)		3,018,549
USD	6,182,000	5.78% due 12/29/49 (a), (b), (c)		6,214,208
		社債計		9,232,757
		オランダ計 (費用 8,525,343ドル)		9,232,757
		英国 (24.8%)		
		社債 (24.8%)		
		HBOS Capital Funding LP		
GBP	5,692,000	6.46% due 11/29/49 (a), (b), (c)		9,511,296
USD	4,500,000	6.85% due 03/29/49 (a), (c)		4,592,426
		Royal Bank of Scotland Group PLC		
EUR	5,250,000	7.09% due 10/29/49 (a), (b), (c)		6,265,511
		Standard Chartered Bank		
GBP	7,000,000	8.10% due 05/29/49 (a), (b), (c)		11,352,928
		社債計		31,722,161
		英国計 (費用 29,503,180ドル)		31,722,161
		米国 (3.8%)		
		社債 (3.8%)		
		HSBC Finance Capital Trust IX		
USD	3,200,000	5.91% due 11/30/35 (b), (c)		3,217,760
		RBS Capital Trust C		
EUR	1,500,000	4.24% due 12/29/49 (a), (b), (c)		1,664,281
		社債計		4,882,041
		米国計 (費用 5,168,322ドル)		4,882,041
		債券計 (費用 73,328,268ドル)		74,278,941

世界優先証券ファンド（為替ヘッジあり／限定追加型）

株数	有価証券の明細	純資産に 占める比率	公正価値
	優先株 (6.7%)		
	オランダ (0.1%)		
	銀行 (0.1%)		
2,195	ING Groep NV		54,832
	オランダ計 (費用 55,872ドル)		54,832
	米国 (6.6%)		
	銀行 (5.9%)		
299,381	Countrywide Capital IV		7,592,302
	総合金融サービス (0.7%)		
6,098	Merrill Lynch Capital Trust I		153,852
4,889	Morgan Stanley Capital Trust III		124,816
2,888	Morgan Stanley Capital Trust IV		73,471
9,195	Morgan Stanley Capital Trust V		232,266
10,876	Morgan Stanley Capital Trust VIII		275,707
	米国計 (費用 8,426,561ドル)		8,452,414
	優先株計 (費用 8,482,433ドル)		8,507,246
	元本金額		
	短期投資 (27.6%)		
	グランド・ケイマン (0.0%)		
	定期預金 (0.0%)		
	Brown Brothers Harriman & Co.		
JPY 872	0.01% due 07/01/15		7
GBP 21	0.08% due 07/01/15		33
	定期預金計		40
	グランド・ケイマン計 (費用 40ドル)		40
	スウェーデン (27.6%)		
	定期預金 (27.6%)		
	Skandinaviska Enskilda Banken AB		
USD 35,335,252	0.03% due 07/01/15		35,335,252
	定期預金計		35,335,252
	スウェーデン計 (費用 35,335,252ドル)		35,335,252
	短期投資計 (費用 35,335,292ドル)		35,335,292
	投資総額 (費用 117,145,993ドル)	92.3%	ドル 118,121,479
	負債を超える現金およびその他資産	7.7	9,923,209
	純資産	100.00%	ドル 128,044,688

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最良の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

(a) 永久債。

(b) 2015年6月30日時点の変動金利証券。

(c) 償還条項付き証券。

2015年6月30日時点のファンドレベルの為替先渡契約（純資産の0.1%）

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
USD	State Street Bank & Trust Co.	33,318,607	2015年7月15日	EUR	29,462,392	ドル 485,942	ドル	— 485,942
USD	State Street Bank & Trust Co.	28,572,933	2015年7月15日	GBP	18,386,523	—	(340,923)	(340,923)
USD	State Street Bank & Trust Co.	7	2015年7月15日	JPY	872	—	—*	—
						ドル 485,942	ドル (340,923)	ドル 145,019

2015年6月30日時点のクラスA 為替先渡契約（純資産の0.2%）

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
JPY	State Street Bank & Trust Co.	16,247,639,016	2015年7月15日	USD	132,503,841	ドル 296,872	ドル	— 296,872
USD	State Street Bank & Trust Co.	179,286	2015年7月15日	JPY	22,000,000	—	(532)	(532)
USD	State Street Bank & Trust Co.	81,342	2015年7月15日	JPY	10,000,000	—	(393)	(393)
USD	State Street Bank & Trust Co.	104,973	2015年7月15日	JPY	13,000,000	—	(1,283)	(1,283)
USD	State Street Bank & Trust Co.	408,651	2015年7月15日	JPY	50,000,000	—	(26)	(26)
USD	State Street Bank & Trust Co.	380,070	2015年7月15日	JPY	47,000,000	—	(4,087)	(4,087)
USD	State Street Bank & Trust Co.	81,051	2015年7月15日	JPY	10,000,000	—	(684)	(684)
USD	State Street Bank & Trust Co.	177,976	2015年7月15日	JPY	22,000,000	—	(1,842)	(1,842)
USD	State Street Bank & Trust Co.	3,835,826	2015年7月15日	JPY	470,353,249	—	(8,624)	(8,624)
USD	State Street Bank & Trust Co.	284,045	2015年7月15日	JPY	35,000,000	—	(2,029)	(2,029)
USD	State Street Bank & Trust Co.	326,137	2015年7月15日	JPY	40,000,000	—	(805)	(805)
USD	State Street Bank & Trust Co.	186,337	2015年7月15日	JPY	23,000,000	—	(1,654)	(1,654)
						ドル 296,872	ドル (21,959)	ドル 274,913

* 1 ドル未満。

通貨の略称：

EUR — ユーロ

GBP — 英ポンド

JPY — 日本円

USD — 米ドル

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

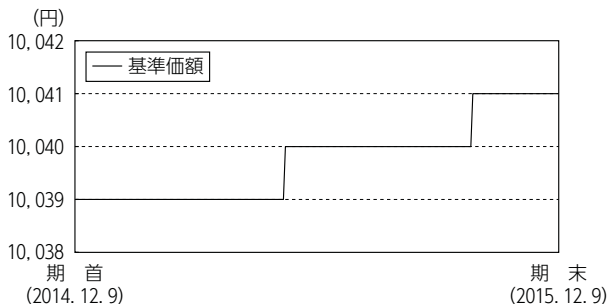
大和投資信託

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おります。

◆ポートフォリオについて

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当	期
売買委託手数料		—円
有価証券取引税		—
その他費用		—
合計		—

(注) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

■売買および取引の状況

公社債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

国	買付額	売付額
内	千円 75,714,577	千円 — (43,770,000)

(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。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

■主要な売買銘柄

公社債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	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(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期	当 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		
区分	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	当 期		末	
		年利率	額面金額	評価額	償還年月日
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	
	評 価 額	比 率
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。

■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・テクノロジー関連株ファンドーロポテックー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、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド A コース2,996,693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、ダイワ上場投信ー日経平均レバレッジ・インデックス14,063,387,856円、ダイワ上場投信ー日経平均ダブルインバース・インデックス2,983,307,364円、ダイワ上場投信ーTOPIX レバレッジ(2倍)指数2,081,906,471円、ダイワ上場投信ーTOPIX ダブルインバース(ー2倍)指数796,936,766円、ダイワ上場投信ー日経平均インバース・インデックス37,546,378,604円、ダイワ上場投信ーTOPIX インバース(ー1倍)指数2,340,731,717円、ダイワ上場投信ーJ P X 日経400レバレッジ・インデックス687,286,710円、ダイワ上場投信ーJ P X 日経400インバース・インデックス278,916,205円、ダイワ上場投信ー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・プルベア・セレクト マネー・ポートフォリオ4,980,676円、ダイワ・プルベア・セレクト 円高ドル安ポートフォリオ258,995,899円、ダイワ・プルベア・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ー成長の権音(つちおと)ー11,000,000円、ダイワ/ハリス世界厳選株ファンドーマネー・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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ン・オープン(為替ヘッジあり)997円、ダイワ米国バンクロン・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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)ージャパン・トリプルリターンズー 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)ージャパン・トリプルリターンズー 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)ージャパン・トリプルリターンズー 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)ージャパン・トリプルリターンズー 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)ージャパン・トリプルリターンズー 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ーイーグルアイⅡー 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ーイーグルアイⅡー 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ーイーグルアイⅡー 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ーイーグルアイⅡー 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ーイーグルアイⅡー 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。