

★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／債券	
信託期間	3年間（2013年6月28日～2016年6月27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	為替ヘッジあり	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストークレディ・スイス・グローバルC B・ファンド（円ヘッジクラス）」（以下「グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）」）の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジなし	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストークレディ・スイス・グローバルC B・ファンド（ノンヘッジクラス）」（以下「グローバルC Bファンド（ノンヘッジクラス）」）の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
運用方法	為替ヘッジあり	①主として、グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）の受益証券を通じて、魅力的な利回り水準を有する世界の転換社債（C B）に投資することにより、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。 ②当ファンドは、グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）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。
	為替ヘッジなし	①主として、グローバルC Bファンド（ノンヘッジクラス）の受益証券を通じて、魅力的な利回り水準を有する世界の転換社債（C B）に投資することにより、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。 ②当ファンドは、グローバルC Bファンド（ノンヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、グローバルC Bファンド（ノンヘッジクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③グローバルC Bファンド（ノンヘッジクラス）では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
組入制限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	分配対象額は、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、基準価額の水準等を勘案し、元本超過額から分配を行なうことがあります。なお、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

ダイワ・グローバル
高利回りC BファンドⅡ
為替ヘッジあり／為替ヘッジなし

運用報告書（全体版）
満期償還
（償還日 2016年6月27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・グローバル高利回りC BファンドⅡ 為替ヘッジあり／為替ヘッジなし」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/>

<2674>
<2675>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受益者 利益回り	公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	元残 本率
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落額	期中 騰落率				
設定 (2013年6月28日)	円 10,000	円 -	円 -	% -	% -	% -	% -	% 100.0
1期末 (2014年3月10日)	10,025	280	305	3.1	4.3	0.1	99.0	96.9
2期末 (2014年9月10日)	10,007	100	82	0.8	3.2	0.1	98.2	86.5
3期末 (2015年3月10日)	9,827	100	△ 80	△0.8	1.8	0.0	99.3	78.5
4期末 (2015年9月10日)	9,790	100	63	0.6	1.7	0.0	99.0	71.5
5期末 (2016年3月10日)	9,599	100	△ 91	△0.9	1.0	0.0	98.6	58.9
償還 (2016年6月27日)	9,547.88	-	△51.12	△0.5	0.8	-	-	38.9

(注1) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

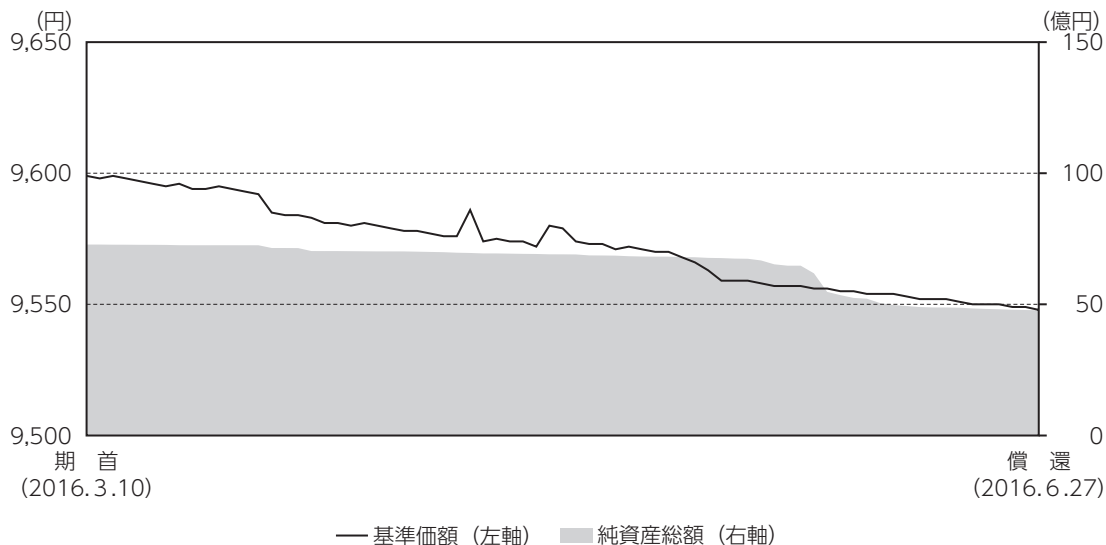
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：9,547円88銭（既払分配金680円）

騰落率：2.2%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

世界のC B（転換社債）等に投資した結果、投資したC B等が値上がりしたことから基準価額は上昇しました。また、外貨建資産への投資にあたっては、為替ヘッジを行ない為替変動リスクの低減をめざしたため、為替相場の変動の基準価額への影響は軽微でした。なお、満期償還に備えるため2016年5月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えたため、それ以降はグローバルC B等の値動きによる基準価額の変動はなくなりました。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。

ダイワ・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジあり

年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	率		
(期首) 2016年 3月10日	円	9,599	% -	% 0.0	% 98.6
3月末		9,585	△0.1	0.0	98.1
4月末		9,572	△0.3	0.0	98.8
5月末		9,557	△0.4	-	-
(償還) 2016年 6月27日		9,547.88	△0.5	-	-

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

○グローバルC B市況

設定以来のグローバルC B市況（米ドルベース）は、2014年8月末まではほぼ右肩上がりの上昇でしたが、その後は上下に振れる展開となりました。

2013年は、F R B（米国連邦準備制度理事会）が市場の予想に反して量的金融緩和縮小の先送りを決定したことなどにより、投資家のリスク選好姿勢が強まり上昇しました。2014年は、E C B（欧州中央銀行）が追加緩和を発表したことや、日銀による予想外の追加緩和の実施、中国の利下げなどが相場の追い風となり上昇しましたが、米軍によるシリア空爆の実施や香港の民主化デモの勃発など地政学リスクが高まったこと、I M F（国際通貨基金）が世界経済の成長率見通しを引き下げたこと、原油価格やロシア・ルーブルの急落、ギリシャでの政局不安が高まったことなどを背景に、下落する場面もありました。2015年は、E C Bが国債買い入れを含む量的金融緩和策の導入を決定したことや、中国政府が金融緩和と財政出動などによる景気刺激策を通じて積極的に景気を支える姿勢を示したことで、5月末まで上昇しました。しかし6月から9月末にかけては、ギリシャ債務交渉の先行き不透明感や、中国株式市況および原油価格の急落、F O M C（米国連邦公開市場委員会）で利上げが見送られ世界経済の先行き懸念が強まったことなどから下落しました。12月末までは一時上昇したもののその後は下落し、年間ではほぼ横ばいとなりました。2016年1月から償還までは、中国の株式市況や人民元の急落に加え、原油価格の下落や中東などの地政学リスクの高まり、欧州の一部大手銀行に対する信用不安などを背景に2月中旬にかけて下落しました。しかしその後は、米国の経済指標の改善により米国景気に対する過度な悲観論が後退したことや、E C Bの追加緩和、原油価格の反発などから、4月末にかけて上昇しました。償還にかけては英国が国民投票でE U（欧州連合）離脱を決定したことを背景に市場のリスク回避傾向が強まり、下落しました。

信託期間中の運用方針

○当ファンド

ダイワ・プレミアム・トラストクレディ・スイス・グローバルC B・ファンド（円ヘッジクラス）（以下、「グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）」といいます。）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。また、通常の状態、グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

○グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）

魅力的な利回り水準を有する世界のC Bに投資することにより、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。なお、投資対象C Bは信託期間終了までに償還もしくはプット行使日が到来する銘柄とします。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・マネーアセット・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、グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）への投資比率は高位を維持しました。2016年5月下旬には満期償還に備え、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えを行ないました。

○グローバルCBファンド（円ヘッジクラス）

魅力的な利回り水準を有する世界のCBに投資することにより、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した。なお、投資対象CBは信託期間終了までに償還もしくはプット行使日が到来する銘柄である一方、時間の経過とともにそうした銘柄は少なくなったため、償還あるいはプットの行使によって得られた現金の再投資先として、一部は債券へ投資しました。2016年3月以降は満期償還に備え、CBや債券の償還や売却により徐々に現金比率を高めました。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した。

○ダイワ・マネーアセット・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280円、第2期から第5期は各100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
	(2016.3.11~2016.6.27)		
	金 額	比 率	
信託報酬	35円	0.364%	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9,572円です。
(投信会社)	(12)	(0.129)	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)	(22)	(0.226)	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)	(0.010)	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	35	0.364	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年3月11日から2016年6月27日まで)

	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)	-	-	81,952.427	7,166,887

(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

(2016年3月11日から2016年6月27日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	-	-	1,006	1,008

(注) 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3月11日から2016年6月27日まで)

当				期					
買		付		売		付			
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
					CS GLOBAL CB FUND (JPY HEDGED CLASS) (ケイマン諸島)		81,952.427	7,166,887	87

(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。

親投資信託残高

種 類	期 首	
	口 数	千口
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,006	

(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

2016年6月27日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	4,829,335,415円
コール・ローン等	4,829,335,415
(B) 負債	54,774,949
未払解約金	37,097,382
未払信託報酬	17,669,883
未払利息	7,684
(C) 純資産総額(A - B)	4,774,560,466
元本	5,000,650,175
償還差損益金	△ 226,089,709
(D) 受益権総口数	5,000,650,175口
1万口当り償還価額(C/D)	9,547円88銭

*償還時の計算口数当りの純資産額は9,547円88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226,089,709円です。

■投資信託財産の構成

2016年6月27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	4,829,335	100.0
投資信託財産総額	4,829,335	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■損益の状況

当期 自2016年3月11日 至2016年6月27日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 288,551円
支払利息	△ 288,551
(B) 有価証券売買損益	△938,435,325
売買益	895
売買損	△938,436,220
(C) 有価証券評価差損益	926,863,491
(D) 信託報酬等	△ 23,858,938
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△ 35,719,323
(F) 前期繰越損益金	△303,880,874
(G) 解約差損益金	113,510,488
(H) 合計(E + F + G)	△226,089,709
償還差損益金(H)	△226,089,709

(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いません。

(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	2013年6月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年6月27日		資産総額	4,829,335,415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	54,774,949円
				純資産総額	4,774,560,466円
受益権口数	12,867,111,634口	5,000,650,175口	△7,866,461,459口	受益権口数	5,000,650,175口
元本額	12,867,111,634円	5,000,650,175円	△7,866,461,459円	1単位当り償還金	9,547円88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	12,474,411,061	12,505,357,811	10,025	280	2.80
第2期	11,135,423,799	11,142,687,085	10,007	100	1.00
第3期	10,104,359,327	9,929,524,950	9,827	100	1.00
第4期	9,204,217,414	9,011,235,750	9,790	100	1.00
第5期	7,584,280,074	7,280,399,200	9,599	100	1.00
信託期間中1単位当り総収益金および年平均収益率				227円88銭	0.76%

(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	9,547円88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・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジなし

設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受益者 利益回り	公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	元残 本率
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落額	期中 騰落率				
設定 (2013年6月28日)	円 10,000	円 -	円 -	% -	% -	% -	% -	% 100.0
1期末 (2014年3月10日)	10,562	280	842	8.4	12.0	0.1	97.4	72.4
2期末 (2014年9月10日)	10,486	300	224	2.1	8.8	0.1	98.1	53.7
3期末 (2015年3月10日)	11,118	300	932	8.9	11.7	0.1	99.1	46.1
4期末 (2015年9月10日)	10,921	300	103	0.9	9.5	0.1	97.3	40.8
5期末 (2016年3月10日)	10,004	180	△ 737	△6.7	5.0	0.0	98.0	29.8
償還 (2016年6月27日)	9,726.65	-	△277.35	△2.8	3.6	-	-	17.3

(注1) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

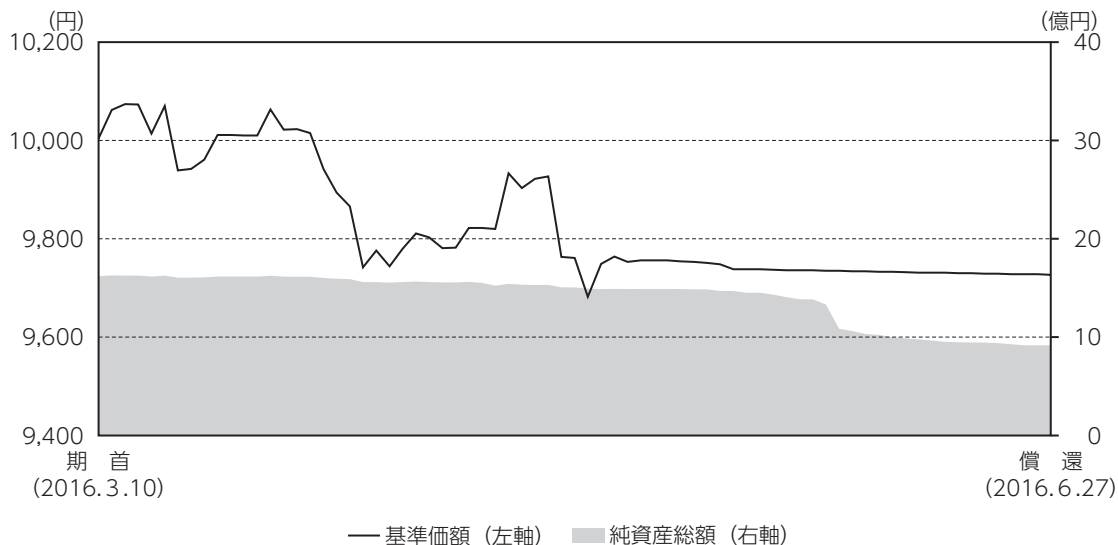
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：9,726円65銭（既払分配金1,360円）

騰落率：10.3%（分配金再投資ベース）

■基準価額の主な変動要因

世界のC B（転換社債）等に投資した結果、投資したC B等が値上がりしたことや為替相場が円安となったことから、基準価額は上昇しました。なお、満期償還に備えるため2016年5月下旬にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えたため、それ以降はグローバルC Bや為替等の値動きによる基準価額の変動はなくなりました。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		公 社 債 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	率		
(期首) 2016年 3月10日	円	10,004	%	%	%
3月末		10,022	-	0.0	98.0
4月末		10,022	0.2	0.0	98.6
5月末		9,927	△0.8	0.0	98.4
(償還) 2016年 6月27日		9,736	△2.7	-	-
		9,726.65	△2.8	-	-

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

○グローバルＣＢ市況

設定以来のグローバルＣＢ市況（米ドルベース）は、2014年8月末まではほぼ右肩上がりの上昇でしたが、その後は上下に振れる展開となりました。

2013年は、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）が市場の予想に反して量的金融緩和縮小の先送りを決定したことなどにより、投資家のリスク選好姿勢が強まり上昇しました。2014年は、ＥＣＢ（欧州中央銀行）が追加緩和を発表したことや、日銀による予想外の追加緩和の実施、中国の利下げなどが相場の追い風となり上昇しましたが、米軍によるシリア空爆の実施や香港の民主化デモの勃発など地政学リスクが高まったこと、ＩＭＦ（国際通貨基金）が世界経済の成長率見通しを引き下げたこと、原油価格やロシア・ルーブルの急落、ギリシャでの政局不安が高まったことなどを背景に、下落する場面もありました。2015年は、ＥＣＢが国債買入れを含む量的金融緩和策の導入を決定したことや、中国政府が金融緩和と財政出動などによる景気刺激策を通じて積極的に景気を支える姿勢を示したことで、5月末まで上昇しました。しかし6月から9月末にかけては、ギリシャ債務交渉の先行き不透明感や、中国株式市況および原油価格の急落、ＦＯＭＣ（米国連邦公開市場委員会）で利上げが見送られ世界経済の先行き懸念が強まったことなどから下落しました。12月末までは一時上昇したもののその後は下落し、年間ではほぼ横ばいとなりました。2016年1月から償還までは、中国の株式市況や人民元の急落に加え、原油価格の下落や中東などの地政学リスクの高まり、欧州の一部大手銀行に対する信用不安などを背景に2月中旬にかけて下落しました。しかしその後は、米国の経済指標の改善により米国景気に対する過度な悲観論が後退したことや、ＥＣＢの追加緩和、原油価格の反発などから、4月末にかけて上昇しました。償還にかけては英国が国民投票でＥＵ（欧州連合）離脱を決定したことを背景に市場のリスク回避傾向が強まり、下落しました。

○為替相場

設定以来の為替相場は円安米ドル高となりました。

米ドル円為替相場は、主に2014年8月から2014年11月末にかけて、米国の金利先高観や量的金融緩和終了の決定、日銀の予想外の追加緩和の実施などから円安米ドル高となりました。一方で2016年2月から6月下旬にかけては、欧州の一部大手銀行の信用不安や英国が国民投票でＥＵ離脱を決定したことを背景に市場のリスク回避傾向が強まったこと、米国の早期利上げ観測の後退や日銀が追加金融緩和を見送ったことから円高となり、設定以来の円安幅は縮小しました。

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・クレディ・スイス・グローバルＣＢ・ファンド（ノンヘッジクラス）（以下、「グローバルＣＢファンド（ノンヘッジクラス）」といいます。）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。また、通常の状態、グローバルＣＢファンド（ノンヘッジクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

○グローバルＣＢファンド（ノンヘッジクラス）

魅力的な利回り水準を有する世界のＣＢに投資することにより、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。なお、投資対象ＣＢは信託期間終了までに償還もしくはプット行使日が到来する銘柄とします。

○ダイワ・マネーアセット・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、グローバルＣＢファンド（ノンヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。グローバルＣＢファンド（ノンヘッジクラス）への投資比率は高位を維持しました。2016年5月下旬には満期償還に備え、わが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えを行ないました。

○グローバルＣＢファンド（ノンヘッジクラス）

魅力的な利回り水準を有する世界のＣＢに投資することにより、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した。なお、投資対象ＣＢは信託期間終了までに償還もしくはプット行使日が到来する銘柄である一方、時間の経過とともにそうした銘柄は少なくなったため、償還あるいはプットの行使によって得られた現金の再投資先として、一部は債券へ投資しました。2016年3月以降は満期償還に備え、ＣＢや債券の償還や売却により徐々に現金比率を高めました。

○ダイワ・マネーアセット・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280円、第2期から第4期は各300円、第5期180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
	(2016.3.11~2016.6.27)		
	金 額	比 率	
信託報酬	36円	0.364%	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9,825円です。
(投信会社)	(13)	(0.129)	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)	(22)	(0.226)	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)	(0.010)	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	36	0.364	

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

(注2) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注3) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注4) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年3月11日から2016年6月27日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国 (邦貨建)	-	-	16,579.166	1,549,183

(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

(2016年3月11日から2016年6月27日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	-	-	503	504

(注) 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3月11日から2016年6月27日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千□	千円	円			千□	千円	円
					CS GLOBAL CB FUND (NON HEDGED CLASS) (ケイマン諸島)		16,579.166	1,549,183	93

(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。

親投資信託残高

種 類	期 首	
	□ 数	千□
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド		503

(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

2016年6月27日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	931,162,829円
コール・ローン等	931,162,829
(B) 負債	14,844,190
未払解約金	11,406,234
未払信託報酬	3,436,475
未払利息	1,481
(C) 純資産総額(A - B)	916,318,639
元本	942,070,219
償還差損益金	△ 25,751,580
(D) 受益権総口数	942,070,219□
1万口当り償還価額(C/D)	9,726円65銭

*償還時の計算口数当りの純資産額は9,726円65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25,751,580円です。

■投資信託財産の構成

2016年6月27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	931,162	100.0
投資信託財産総額	931,162	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■損益の状況

当期 自2016年3月11日 至2016年6月27日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 59,450円
支払利息	△ 59,450
(B) 有価証券売買損益	△115,674,758
売買益	446
売買損	△115,675,204
(C) 有価証券評価差損益	77,369,954
(D) 信託報酬等	△ 5,163,898
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△ 43,528,152
(F) 前期繰越損益金	676,542
(G) 解約差損益金	17,100,030
(H) 合計(E + F + G)	△ 25,751,580
償還差損益金(H)	△ 25,751,580

(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せん。

(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	2013年6月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年6月27日		資産総額	931,162,829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	14,844,190円
				純資産総額	916,318,639円
受益権口数	5,428,051,618口	942,070,219口	△4,485,981,399口	受益権口数	942,070,219口
元本額	5,428,051,618円	942,070,219円	△4,485,981,399円	1単位当り償還金	9,726円65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	3,931,366,982	4,152,381,991	10,562	280	2.80
第2期	2,915,770,315	3,057,439,167	10,486	300	3.00
第3期	2,503,522,108	2,783,459,016	11,118	300	3.00
第4期	2,218,732,446	2,423,033,442	10,921	300	3.00
第5期	1,619,928,412	1,620,604,954	10,004	180	1.80
信託期間中1単位当り総収益金および年平均収益率				1,086円65銭	3.62%

(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	9,726円65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・トラストークレディ・スイス・グローバルC B・ファンド
円ヘッジクラス／ノンヘッジクラス

当ファンド（ダイワ・グローバル高利回りC BファンドⅡ 為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストークレディ・スイス・グローバルC B・ファンド 円ヘッジクラス／ノンヘッジクラス」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除いてすべてのクラスを合算しております。

（注）2016年6月27日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（日本円建て）

貸借対照表

2015年12月30日

資産		
投資、時価（費用 8,710,338,664円）	円	8,865,653,086
現金		87,730,366
為替先渡契約による評価益		3,115,471
未収：		
売却投資証券		115,651,339
利子		101,332,743
為替先渡契約のカウンターパーティへの預託金		525,000,000
その他の資産		1,814,666
資産合計		9,700,297,671
負債		
為替先渡契約による評価損		15,857,376
未払い：		
購入投資証券		122,478,754
投資運用報酬		44,382,716
専門家報酬		6,539,387
会計および管理報酬		1,615,296
保管報酬		1,024,914
名義書換代理報酬		318,745
登録費		6,778
負債合計		192,223,966
純資産	円	9,508,073,705
純資産の内訳：		
払込資本金	円	10,063,883,727
累積赤字		(555,810,022)
純資産	円	9,508,073,705
円ヘッジクラス	円	7,650,938,222
ノンヘッジクラス		1,857,135,483
	円	9,508,073,705
発行済み受益証券数		
円ヘッジクラス		84,109,888
ノンヘッジクラス		17,540,064
1口当りの純資産		
円ヘッジクラス	円	90.964
ノンヘッジクラス	円	105.880

(日本円建て)

損益計算書

2015年12月30日に終了した年度

投資収益

利息収入

円 275,644,101

投資収益合計

275,644,101

費用

投資運用報酬

69,306,946

会計および管理報酬

7,033,485

専門家報酬

6,625,020

保管報酬

4,105,299

受託会社報酬

1,476,998

名義書換代理報酬

1,371,635

登録費

357,567

費用合計

90,276,950

純投資収益

185,367,151

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

908,289,572

為替取引および為替先渡契約

121,700,981

純実現益

1,029,990,553

評価益（損）の純変動：

有価証券への投資

(876,455,926)

為替換算および為替先渡契約

(70,544,278)

評価損の純変動

(947,000,204)

実現益および評価益

82,990,349

業務活動の結果生じた純資産の純増

円 268,357,500

(日本円建て)

投資明細表
2015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	元本金額	有価証券の明細	純資産に占める割合	公正価値
EUR 2,157,100	債券 (85.6%)			USD 2,000,000	社債 (5.7%)		
	ベルギー (3.0%)				Novatek OAO via Novatek Finance, Ltd.		
	転換社債 (3.0%)				5.33% due 02/03/16		240,537,143
	Cofinimmo S.A.				VEB-Leasing Via VEB Leasing Investment, Ltd.		
	3.13% due 04/28/16		円 286,323,577		5.13% due 05/27/16		300,086,665
	転換社債計		<u>286,323,577</u>		社債計		<u>540,623,808</u>
	ベルギー計 (費用 ¥289,632,140)		<u>286,323,577</u>		アイルランド計 (費用 ¥501,938,097)		<u>540,623,808</u>
	ブラジル (1.9%)				ルクセンブルグ (1.9%)		
	社債 (1.9%)				社債 (1.9%)		
	HSBC Bank Brasil S.A. - Banco Multiplo				Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.		
	4.00% due 05/11/16		181,557,978		4.95% due 05/23/16		182,149,917
	社債計		<u>181,557,978</u>		社債計		<u>182,149,917</u>
	ブラジル計 (費用 ¥188,202,754)		<u>181,557,978</u>		ルクセンブルグ計 (費用 ¥156,548,615)		<u>182,149,917</u>
	カナダ (2.5%)				オランダ (2.8%)		
	社債 (2.5%)				社債 (2.8%)		
	Thomson Reuters Corp.				Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA		
	0.88% due 05/23/16		240,941,294		3.88% due 04/20/16		266,136,657
	社債計		<u>240,941,294</u>		社債計		<u>266,136,657</u>
	カナダ計 (費用 ¥247,014,044)		<u>240,941,294</u>		オランダ計 (費用 ¥272,710,963)		<u>266,136,657</u>
	中国 (5.1%)				ノルウェー (3.8%)		
	社債 (5.1%)				社債 (3.8%)		
	ABB Treasury Center USA, Inc.				Ekspportfinans ASA		
	2.50% due 06/15/16		242,342,076		2.38% due 05/25/16		361,963,187
	CNOOC Finance 2013, Ltd.				社債計		<u>361,963,187</u>
	1.13% due 05/09/16		240,731,502		ノルウェー計 (費用 ¥329,353,992)		<u>361,963,187</u>
	社債計		<u>483,073,578</u>		南アフリカ (3.2%)		
	中国計 (費用 ¥456,592,583)		<u>483,073,578</u>		社債 (3.2%)		
	フランス (2.2%)				FirstRand Bank, Ltd.		
	社債 (2.2%)				4.38% due 06/09/16		302,495,050
	Total Capital S.A.				社債計		<u>302,495,050</u>
	2.30% due 03/15/16		205,546,597		南アフリカ計 (費用 ¥304,473,528)		<u>302,495,050</u>
	社債計		<u>205,546,597</u>		国際機関 (3.2%)		
	フランス計 (費用 ¥204,694,758)		<u>205,546,597</u>		社債 (3.2%)		
	ドイツ (2.8%)				European Investment Bank		
	社債 (2.8%)				2.25% due 03/15/16		302,423,613
	GEA Group AG				社債計		<u>302,423,613</u>
	4.25% due 04/21/16		266,149,816		国際機関計 (費用 ¥294,767,457)		<u>302,423,613</u>
	社債計		<u>266,149,816</u>		スウェーデン (2.5%)		
	ドイツ計 (費用 ¥267,390,267)		<u>266,149,816</u>		社債 (2.5%)		
	香港 (2.8%)				Nordea Bank AB		
	転換社債 (2.8%)				0.88% due 05/13/16		241,105,510
	Newford Capital, Ltd.				社債計		<u>241,105,510</u>
	0.00% due 05/12/16		266,459,693		スウェーデン計 (費用 ¥247,278,628)		<u>241,105,510</u>
	転換社債計		<u>266,459,693</u>		スイス (2.5%)		
	香港計 (費用 ¥225,547,266)		<u>266,459,693</u>		社債 (2.5%)		
	インド (0.0%)				UBS AG		
	転換社債 (0.0%)				0.75% due 03/24/16		241,033,892
	REI Agro, Ltd. ^(a)				社債計		<u>241,033,892</u>
	5.50% due 11/13/14		2,049,690		スイス計 (費用 ¥248,973,809)		<u>241,033,892</u>
	転換社債計		<u>2,049,690</u>		英国 (7.5%)		
	インド計 (費用 ¥179,499,535)		<u>2,049,690</u>		社債 (7.5%)		
	アイルランド (5.7%)				BAT International Finance Plc.		

ダイワ・グローバル高利回りC BファンドⅡ

	元本金額	有価証券の明細	純資産に占める割合	公正価値
USD	691,000	1.13% due 03/29/16 British Telecommunications Plc.		83,298,038
USD	2,000,000	1.63% due 06/28/16 Fiat Chrysler Finance Europe		241,430,808
EUR	2,000,000	6.38% due 04/01/16 Rio Tinto Finance USA Plc.		265,982,441
USD	1,000,000	1.37% due 06/17/16 ^(b)		120,147,278
		社債計		710,858,565
		英国計 (費用 ¥732,738,008)		710,858,565
		米国 (32.2%)		
		転換社債 (13.8%)		
		Apollo Investment Corp.		
USD	5,000,000	5.75% due 01/15/16 Ares Capital Corp. ^(c)		601,342,858
	3,700,000	5.13% due 06/01/16 Fifth Street Finance Corp.		445,551,352
USD	2,200,000	5.38% due 04/01/16		265,253,993
		転換社債計		1,312,148,203
		社債 (18.4%)		
		Aon Corp.		
USD	2,000,000	3.13% due 05/27/16 AT&T, Inc.		243,015,580
USD	2,000,000	2.95% due 05/15/16 Dell, Inc.		242,611,188
USD	1,500,000	3.10% due 04/01/16 El du Pont de Nemours & Co.		181,307,133
USD	1,500,000	2.75% due 04/01/16 General Electric Capital Corp.		181,708,631
USD	694,000	5.00% due 01/08/16 Goldman Sachs Group, Inc.		83,705,618
EUR	2,000,000	4.50% due 05/23/16 Morgan Stanley		267,573,029
USD	1,000,000	3.80% due 04/29/16 Wells Fargo Bank N.A.		121,595,806

	元本金額	有価証券の明細	純資産に占める割合	公正価値
USD	1,000,000	5.60% due 03/15/16 Xerox Corp.		121,803,789
USD	2,500,000	6.40% due 03/15/16		304,237,890
		社債計		1,747,558,664
		米国計 (費用 ¥2,837,727,345)		3,059,706,867
		債券計 (費用 ¥7,985,083,789)		8,140,599,289
		フランス (3.4%)		
		定期預金 (3.4%)		
		Societe Generale		
USD	2,691,569	0.13% due 12/31/15		324,522,412
		定期預金計		324,522,412
		フランス計 (費用 ¥324,723,501)		324,522,412
		グランド・ケイマン (4.2%)		
		定期預金 (4.2%)		
		Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ, Ltd.		
JPY	400,445,046	0.01% due 01/04/16 Brown Brothers Harriman & Co.		400,445,046
CHF	—	(1.00)% due 12/31/15		14
HKD	35	0.01% due 12/31/15		540
EUR	652	(0.31)% due 12/31/15		85,785
		定期預金計		400,531,385
		グランド・ケイマン計 (費用 ¥400,531,374)		400,531,385
		短期投資計 (費用 ¥725,254,875)		725,053,797
		投資計 (費用 ¥8,710,338,664)	93.2	円 8,865,653,086
		負債を上回る現金とその他の資産	6.8	円 642,420,619
		純資産	100.0%	円 9,508,073,705

(a)デフォルト証券

(b)変動金利証券

(c)144A証券—1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関購入者に転売が可能である。他に指定がない限り、これらの証券は非流動的だとみなされない。

2015年12月30日現在未決済になっている円ヘッジクラスの為替先渡契約 (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)
JPY	CSFB	1,123,789,244	2016年1月29日	EUR	8,516,000	円 3,115,471	円 —	円 3,115,471
JPY	CSFB	5,740,710,472	2016年1月29日	USD	47,768,000	—	円 (15,857,376)	円 (15,857,376)
						円 3,115,471	円 (15,857,376)	円 (12,741,905)

通貨の略称:

CHF	—	スイス・フラン
EUR	—	ユーロ
HKD	—	香港ドル
JPY	—	日本円
USD	—	米ドル

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第4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・マネーアセット・マザーファンドの第4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

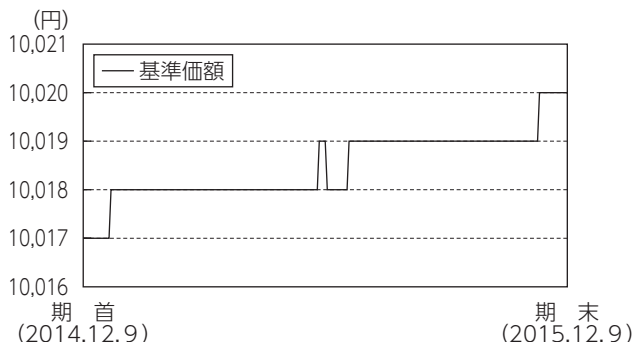
大和投資信託

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 率	
	円	騰 落 率	組 入	比 率
(期首)2014年12月9日	10,017	%	%	53.3
12月末	10,018	0.0		72.3
2015年1月末	10,018	0.0		80.5
2月末	10,018	0.0		70.3
3月末	10,018	0.0		59.6
4月末	10,018	0.0		70.6
5月末	10,018	0.0		73.2
6月末	10,019	0.0		69.3
7月末	10,019	0.0		59.4
8月末	10,019	0.0		65.5
9月末	10,019	0.0		51.5
10月末	10,019	0.0		76.0
11月末	10,020	0.0		56.8
(期末)2015年12月9日	10,020	0.0		52.7

(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：10,017円 期末：10,020円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内短期金融市場

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低金利が続き、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		千円	千円
内	国債証券	32,338,160	－ (32,240,000)

(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

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄	銘	柄
	金 額		金 額
	千円		千円
491	国庫短期証券 2015/5/14		1,999,998
540	国庫短期証券 2015/9/24		1,699,999
555	国庫短期証券 2015/12/7		1,500,000
557	国庫短期証券 2015/12/14		1,500,000
541	国庫短期証券 2015/9/28		1,499,998
532	国庫短期証券 2015/8/17		1,499,995
514	国庫短期証券 2015/5/25		1,499,968
521	国庫短期証券 2015/6/29		1,499,925
502	国庫短期証券 2015/3/30		1,199,993
563	国庫短期証券 2016/1/18		1,150,000

(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）

区 分	当 期			末		
	額面金額	評 価 額	組入比率	5年以上 格以下 組入比率	残存期間別組入比率 5年以上 2年以上 2年末満	
	千円	千円	%	%	%	%
国債証券	6,435,000	6,437,978	52.7	-	-	52.7

(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	償還年月日	
		%	千円	千円		
国債証券	557 国庫短期証券	-	1,500,000	1,500,000	2015/12/14	
	336 2年国債	0.1000	185,000	185,022	2016/01/15	
	563 国庫短期証券	-	1,150,000	1,150,000	2016/01/18	
	566 国庫短期証券	-	1,000,000	999,999	2016/02/01	
	567 国庫短期証券	-	1,000,000	999,999	2016/02/08	
	573 国庫短期証券	-	500,000	500,097	2016/03/07	
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,102,860	2016/09/20	
合計	銘柄数 金額	7銘柄	6,435,000	6,437,978		

(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	6,437,978	52.7		
コール・ローン等、その他	5,772,311	47.3		
投資信託財産総額	12,210,290	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	12,210,290,310円	
コール・ローン等	5,771,514,330	
公社債(評価額)	6,437,978,324	
未収利息	668,726	
前払費用	128,930	
(B) 負債	-	
(C) 純資産総額(A - B)	12,210,290,310	
元本	12,186,116,869	
次期繰越増益金	24,173,441	
(D) 受益権総口数	12,186,116,869口	
1万口当り基準価額(C/D)	10,020円	

* 期首における元本額は11,884,993,463円、当期中における追加設定元本額は8,064,725,261円、同解約元本額は7,763,601,855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・グローバル高利回りC BファンドⅡ 為替ヘッジあり4,998,495円、ダイワ・グローバル高利回りC BファンドⅡ 為替ヘッジなし2,499,247円、ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンドⅡ（為替ヘッジあり）999円、ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）999円、ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクトロプレミアム（毎月分配型）219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクトロプレミアム（年2回決算型）24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（毎月分配型）848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（年2回決算型）66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワ/N B・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）4,995円、ダイワ/N B・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）4,995円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04（為替ヘッジあり/限定追加型）999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07（為替ヘッジあり/限定追加型）999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10（為替ヘッジあり/限定追加型）999円、世界ハイブリッド証券ファンド2015-01（為替ヘッジあり/限定追加型）999円、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）- スーパー・ハインカム- α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）- スーパー・ハインカム- α100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ26,536,157円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド- シフト11 Ver 3- 2,395,687,762円、ダイワ日本株式ベア・ファンド- ベアシフト11- 71,870,634円、ダイワ日本株式ベア・ファンド- ベアシフト11 Ver 2- 29,945,799円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド- シフト11 Ver 5- 2,095,808,384円、ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース10,980,236円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース7,487,022円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース3,593,631円、ダイワ/N B・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）29,988,005円、ダイワ/N B・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）1,999,201円、通貨選択型 ダイワ/N B・米国債券戦略ファンド 日本円コース（毎月分配型）1,002,195円、通貨選択型 ダイワ/N B・米国債券戦略ファンド通貨セレクトコース（毎月分配型）3,011,774円、ダイワ新興国ハイインカム・プラス - インカムチェンジ（横立型）- 7,515,709円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド（限定追加型）- シフト11- 3,536,610,361円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド（限定追加型）- シフト12- 2,626,169,333円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド（限定追加型）- シフト13- 1,287,713,056円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,020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	3,173,485円
受取利息	3,173,485
(B) 有価証券売買損益	△ 382,400
売買益	1,050
売買損	△ 383,450
(C) 当期損益金(A + B)	2,791,085
(D) 前期繰越増益金	20,640,762
(E) 解約差損益金	△ 14,198,145
(F) 追加信託差損益金	14,939,739
(G) 合計(C + D + E + F)	24,173,441
次期繰越増益金(G)	24,173,441

(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。