

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	追加型投信／国内／株式／特殊型（ブル・ベア型） 追加型投信／国内／債券
信託期間	約3年間（2015年9月10日～2018年9月7日）	
運用方針	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ	日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの3程度逆となることをめざして運用を行ないます。
	ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2程度逆となることをめざして運用を行ないます。
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	主としてわが国の債券への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資 対象	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ	わが国の株価指数先物取引、わが国の債券およびダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	わが国の株価指数先物取引、わが国の債券およびダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	イ、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券口、本邦通貨表示の債券
運用方法	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ	①主として、残存期間の短いわが国の債券およびマザーファンドの受益証券に投資するとともに、わが国の株価指数先物取引を買い建てます。 ②株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の3程度逆となるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの3程度逆となることをめざします。
	ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	①主として、残存期間の短いわが国の債券およびマザーファンドの受益証券に投資するとともに、わが国の株価指数先物取引を売り建てます。 ②株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の2程度逆となるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2程度逆となることをめざします。
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	①マザーファンドの受益証券およびわが国の債券を中心に投資することにより、安定運用を行ないます。 ②邦貨資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A-2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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	ブル3倍日本株 ポートフォリオⅣ ベア2倍日本株 ポートフォリオⅣ	・マザーファンドおよび株式組入上限比率は無制限
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオⅣ	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の30%以下
配分方針	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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者から資金をまとめてペビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ

ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ

ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ

ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ

運用報告書(全体版)

第1期

(決算日 2016年9月7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・ブルベア・ファンドⅣ」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

<4628>

<4629>

<4627>

★ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			日 経 平 均 株 価 (参考指数)		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率	純資産 総 額
	税込み 分配金	期 中 騰落率		期 中 騰落率				
1 期末(2016年 9月 7日)	円 6,614	円 0	% △ 33.9	円 17,012.44	% △ 9.4	% 303.5	% 28.3	百万円 67,688

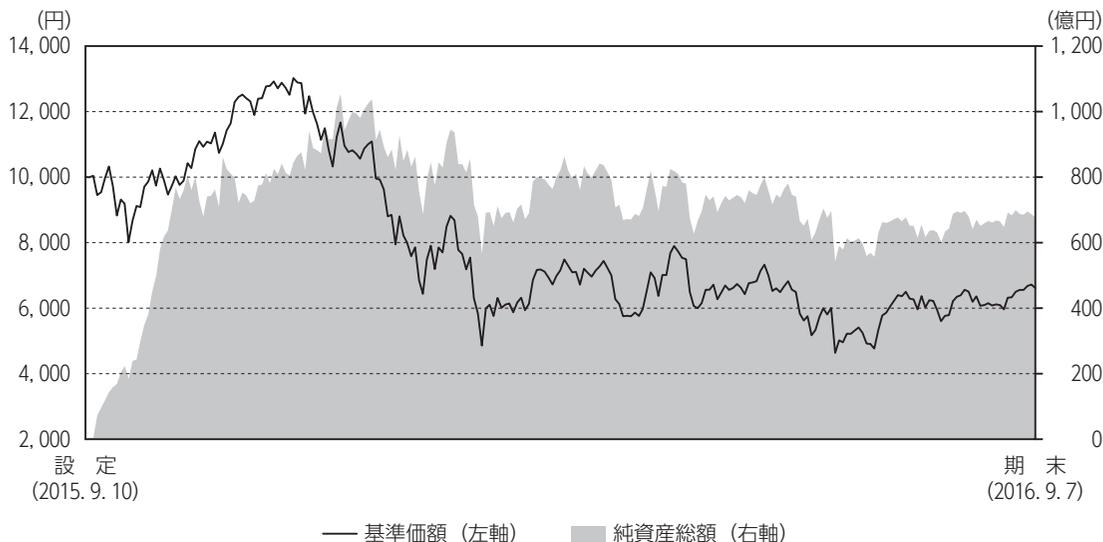
(注1) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(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。

《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

期末：6,614円

騰落率：△33.9%

■ 基準価額の主な変動要因

日々の基準価額の値動きが日経平均株価の値動きの3倍程度の動きとなることをめざして運用を行ったため、日経平均株価の下落を反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご覧ください。

ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(設定)2015年9月10日	円	%	(9/9) 円	%	%	%
	10,000	—	18,770.51	—	—	—
9月末	8,672	△ 13.3	17,388.15	△ 7.4	289.7	27.8
10月末	11,360	13.6	19,083.10	1.7	294.4	38.1
11月末	12,514	25.1	19,747.47	5.2	303.2	31.3
12月末	11,090	10.9	19,033.71	1.4	292.5	25.4
2016年1月末	8,487	△ 15.1	17,518.30	△ 6.7	300.5	10.9
2月末	5,938	△ 40.6	16,026.76	△ 14.6	299.3	7.8
3月末	7,002	△ 30.0	16,758.67	△ 10.7	299.5	—
4月末	6,494	△ 35.1	16,666.05	△ 11.2	300.7	2.0
5月末	7,327	△ 26.7	17,234.98	△ 8.2	298.5	0.0
6月末	5,218	△ 47.8	15,575.92	△ 17.0	294.9	0.1
7月末	6,243	△ 37.6	16,569.27	△ 11.7	303.1	8.3
8月末	6,501	△ 35.0	16,887.40	△ 10.0	292.4	19.0
(期末)2016年9月7日	6,614	△ 33.9	17,012.44	△ 9.4	303.5	28.3

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、設定当初より、世界経済の先行き不透明感や円高の進行などで下落しましたが、2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやE C B（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで上昇しました。12月以降は、E C Bの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびE C Bの金融緩和などにより株価は反発しましたが、3月後半からは、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でE U（欧州連合）離脱支持が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月以降は、国内の財政・金融政策への期待や、円高傾向の一服などから上昇しました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

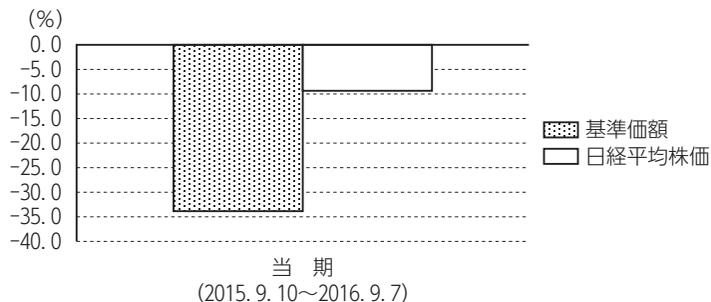
日経平均株価先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、純資産総額の3倍程度となるよう調整しました。また、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券に投資し、純資産総額に対して大きな追加設定および解約があった場合を除き、50～70%程度の組み入れを維持しました。

○ダイワ・マネー・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2015年9月10日	～2016年9月7日
当期分配金（税込み）（円）		—
対基準価額比率（%）		—
当期の収益（円）		—
当期の収益以外（円）		—
翌期繰越分配対象額（円）		0

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

《今後の運用方針》

○当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、マザーファンドの受益証券に投資するとともに、わが国の株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として信託財産の純資産総額の3倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの3倍程度となることをめざして運用を行ないます。

○ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 9. 10～2016. 9. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	79円	0.999%	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7,913円です。
(投信会社)	(25)	(0.322)	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)	(51)	(0.644)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.032)	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	19	0.235	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
(先物)	(19)	(0.235)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
			有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	0	0.003	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	98	1.237	

(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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年9月10日から2016年9月7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・マザーファンド	189,842,926	193,590,000	155,625,374	158,700,000

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等

先物取引の銘柄別取引状況・残高状況

(2015年9月10日から2016年9月7日まで)

銘柄別		買 建		売 建		当 期 末 評 価 額		
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評価損益
国 内	株 式	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
	日経平均	1,789,448	1,551,260	—	—	205,439	—	△ 1,341

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビ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9月10日から2016年9月7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	%
株式先物取引	1,789,448	1,767,879	98.8	1,551,260	1,529,234	98.6
コール・ローン	6,635,591	—	—	—	—	—

(2) 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9月10日から2016年9月7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	281,090	31,700	11.3	11,349	—	—
コール・ローン	6,802,787	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合58.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーフ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

(2015年9月10日から2016年9月7日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	174,383千円
うち利害関係人への支払額 (B)	170,970千円
(B) / (A)	98.0%

(注) 売買委託手数料総額は、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みます。

※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
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	34,217,551	34,888,215

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	34,888,215	48.3
コール・ローン等、その他	37,303,548	51.7
投資信託財産総額	72,191,763	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9月7日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	72,189,730,010円
コール・ローン等	27,596,481,077
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	34,888,215,975
未収入金	173,507,958
差入委託証拠金	9,531,525,000
(B)負債	4,500,930,094
未払金	1,341,179,900
未払解約金	2,809,456,674
未払信託報酬	349,183,616
その他未払費用	1,109,904
(C)純資産総額 (A - B)	67,688,799,916
元本	102,335,123,725
次期繰越損益金	△ 34,646,323,809
(D)受益権総口数	102,335,123,725口
1万口当り基準価額 (C/D)	6,614円

* 設定時における元本額は400,000,000円、当期中における追加設定元本額は464,510,955,482円、同解約元本額は362,575,831,757円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は6,614円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は34,646,323,809円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月10日 至2016年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	999,450円
受取利息	6,802,955
支払利息	△ 5,803,505
(B) 有価証券売買損益	2,356,382
売買益	4,563,592
売買損	△ 6,919,974
(C) 先物取引等損益	670,210,740
取引益	45,207,802,215
取引損	△ 45,878,012,955
(D) 信託報酬等	705,484,527
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	1,377,052,199
(F) 追加信託差損益金	33,269,271,610
(配当等相当額)	(4,824,267)
(売買損益相当額)	(△ 33,274,095,877)
(G) 合計 (E + F)	34,646,323,809
次期繰越損益金 (G)	△ 34,646,323,809
追加信託差損益金	△ 33,269,271,610
(配当等相当額)	(4,824,267)
(売買損益相当額)	(△ 33,274,095,877)
繰越損益金	△ 1,377,052,199

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	4,824,267
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	4,824,267
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	4,824,267
(h) 受益権総口数	102,335,123,725口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《お知らせ》

●スイッチング対象ファンドの除外について

「ブルベア・マネー・ポートフォリオⅢ」、「ブル2.5倍日本株ポートフォリオⅢ」および「ベア1.5倍日本株ポートフォリオⅢ」が2015年11月13日付で満期償還したことに伴い、当ファンドのスイッチング対象から除外しました。

★ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			日 経 平 均 株 価 (参考指数)		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率	純資産 総 額
	税込み 分配金	期 中 騰落率		期 中 騰落率				
1 期末(2016年 9月 7日)	円 8,471	円 0	% △ 15.3	円 17,012.44	% △ 9.4	% △ 192.5	% 28.9	百万円 7,690

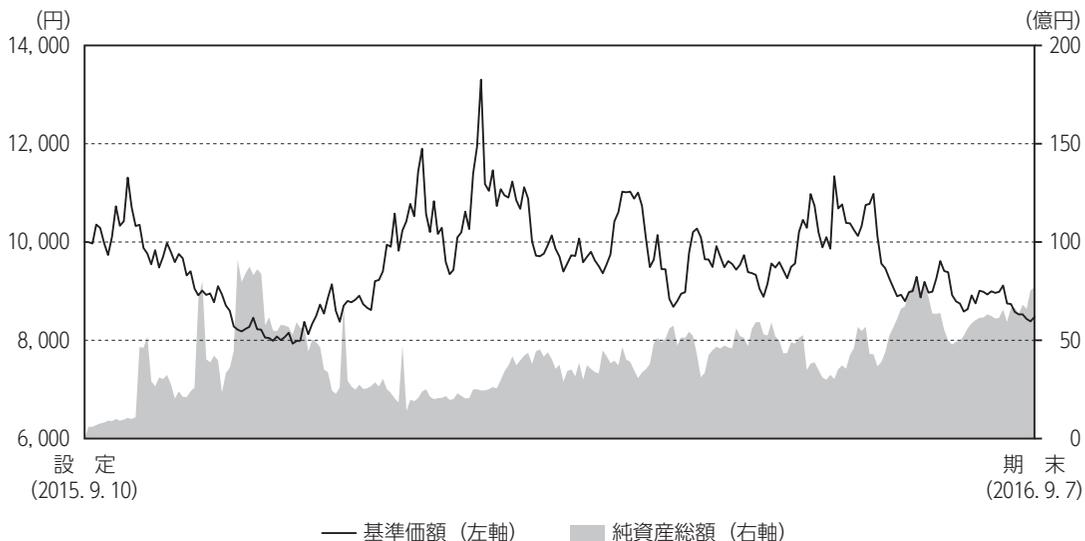
(注1) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(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。

《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

期末：8,471円

騰落率：△15.3%

■ 基準価額の主な変動要因

設定当初より、日々の基準価額の値動きが日経平均株価の値動きの2倍程度逆となるような運用を行ないました。2016年2月中旬には、米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで日経平均株価が下落し、基準価額が大きく上昇する場面もありましたが、その後は、日経平均株価が上昇・下落をしながら推移したため、基準価額は下落して期末を迎えました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(設定)2015年9月10日	円	%	(9/9) 円	%	%	%
	10,000	—	18,770.51	—	—	—
9月末	10,701	7.0	17,388.15	△ 7.4	△ 224.6	35.1
10月末	8,774	△ 12.3	19,083.10	1.7	△ 182.7	40.8
11月末	8,152	△ 18.5	19,747.47	5.2	△ 190.6	30.3
12月末	8,615	△ 13.9	19,033.71	1.4	△ 201.0	32.6
2016年1月末	9,593	△ 4.1	17,518.30	△ 6.7	△ 185.9	55.3
2月末	11,116	11.2	16,026.76	△ 14.6	△ 209.2	21.5
3月末	9,747	△ 2.5	16,758.67	△ 10.7	△ 193.3	—
4月末	9,780	△ 2.2	16,666.05	△ 11.2	△ 184.9	1.6
5月末	8,884	△ 11.2	17,234.98	△ 8.2	△ 191.9	0.0
6月末	10,380	3.8	15,575.92	△ 17.0	△ 219.4	0.8
7月末	8,969	△ 10.3	16,569.27	△ 11.7	△ 177.4	11.0
8月末	8,580	△ 14.2	16,887.40	△ 10.0	△ 191.9	22.4
(期末)2016年9月7日	8,471	△ 15.3	17,012.44	△ 9.4	△ 192.5	28.9

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、設定当初より、世界経済の先行き不透明感や円高の進行などで下落しましたが、2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやE C B（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで上昇しました。12月以降は、E C Bの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびE C Bの金融緩和などにより株価は反発しましたが、3月後半からは、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でE U（欧州連合）離脱支持が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月以降は、国内の財政・金融政策への期待や、円高傾向の一服などから上昇しました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

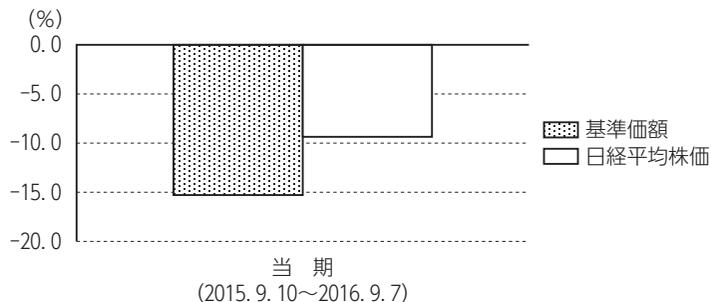
日経平均株価先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、純資産総額の2倍程度となるよう調整しました。また、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券に投資し、純資産総額に対して大きな追加設定および解約があった場合を除き、50～70%程度の組み入れを維持しました。

○ダイワ・マネー・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳 (1万口当り)

項目	当 期	
	2015年9月10日 ～2016年9月7日	
当期分配金 (税込み)	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	0

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

《今後の運用方針》

○当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、マザーファンドの受益証券に投資するとともに、わが国の株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、原則として信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行ないます。

○ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 9. 10～2016. 9. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	96円	0.999%	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9,600円です。
(投信会社)	(31)	(0.322)	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)	(62)	(0.644)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.032)	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	66	0.685	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
(先物)	(66)	(0.685)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
			有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	0	0.005	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	162	1.688	

(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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年9月10日から2016年9月7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・マザーファンド	27,791,490	28,340,000	23,829,317	24,300,000

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等

先物取引の銘柄別取引状況・残高状況

(2015年9月10日から2016年9月7日まで)

銘 柄 別			買 建		売 建		当 期 末 評 価 額		
			新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評価損益
国 内	株 式	日経平均	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	
			—	—	161,304	147,126	—	14,803	8

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビ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9月10日から2016年9月7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						
株式先物取引	147,126	46,481	31.6	161,304	46,049	28.5
コール・ローン	481,007	—	—	—	—	—

(2) 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9月10日から2016年9月7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						
公社債	281,090	31,700	11.3	11,349	—	—
コール・ローン	6,802,787	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.7%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーフ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

(2015年9月10日から2016年9月7日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	31,298千円
うち利害関係人への支払額 (B)	13,098千円
(B) / (A)	41.8%

(注) 売買委託手数料総額は、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みます。

※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

親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	3,962,173	4,039,832

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	4,039,832	46.9
コール・ローン等、その他	4,579,548	53.1
投資信託財産総額	8,619,381	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9月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,619,381,218円
コール・ローン等	3,415,844,329
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	4,039,832,274
未収入金	9,474,615
差入委託証拠金	1,154,230,000
(B) 負債	929,125,909
未払金	389,313,176
未払解約金	514,912,640
未払信託報酬	24,767,029
その他未払費用	133,064
(C) 純資産総額 (A - B)	7,690,255,309
元本	9,078,658,972
次期繰越増益金	△ 1,388,403,663
(D) 受益権総口数	9,078,658,972口
1万口当り基準価額 (C/D)	8,471円

* 設定時における元本額は600,000,000円、当期中における追加設定元本額は127,987,439,744円、同解約元本額は119,508,780,772円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,471円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,388,403,663円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月10日 至2016年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 101,519円
受取利息	447,561
支払利息	△ 549,080
(B) 有価証券売買損益	△ 78,177
売買益	671,418
売買損	△ 749,595
(C) 先物取引等損益	△ 304,424,503
取引益	3,169,559,682
取引損	△ 3,473,984,185
(D) 信託報酬等	△ 41,909,202
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 346,513,401
(F) 追加信託差損益金	△ 1,041,890,262
(配当等相当額)	(414,278)
(売買損益相当額)	(△ 1,042,304,540)
(G) 合計 (E + F)	△ 1,388,403,663
次期繰越増益金 (G)	△ 1,388,403,663
追加信託差損益金	△ 1,041,890,262
(配当等相当額)	(414,278)
(売買損益相当額)	(△ 1,042,304,540)
繰越増益金	△ 346,513,401

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	414,278
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	414,278
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	414,278
(h) 受益権総口数	9,078,658,972口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《お知らせ》

●スイッチング対象ファンドの除外について

「ブルベア・マネー・ポートフォリオⅢ」、「ブル2.5倍日本株ポートフォリオⅢ」および「ベア1.5倍日本株ポートフォリオⅢ」が2015年11月13日付で満期償還したことに伴い、当ファンドのスイッチング対象から除外しました。

★ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組 入 比 率	純資産総額
	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	額		
1 期末(2016年 9 月 7 日)	円 9,998	円 0	% △ 0.0	% 38.8	百万円 27,609

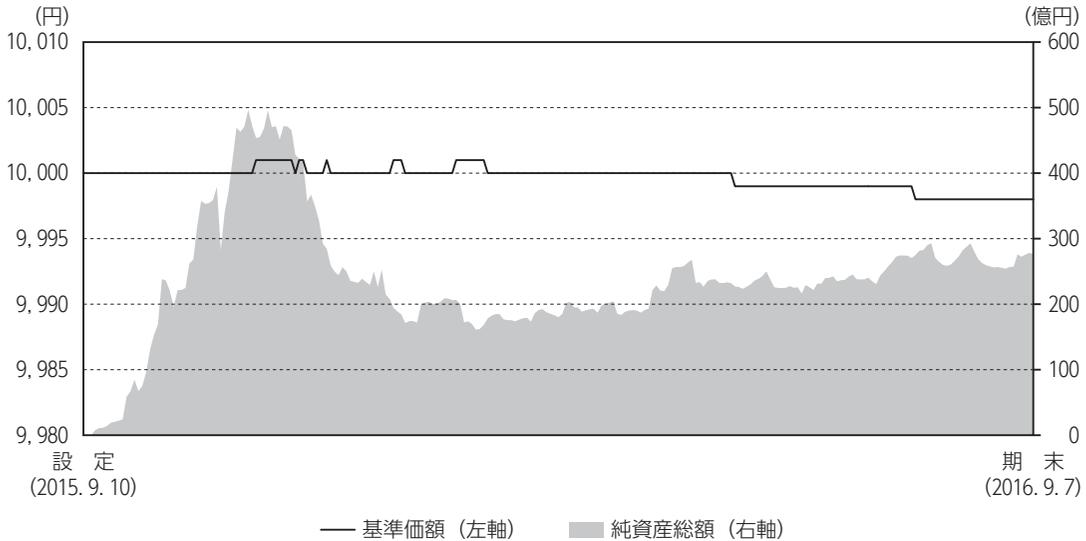
(注1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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「ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ」を構成するファンドのスイッチング資金を一時滞留させる受皿としての役割をもったファンドであり、わが国の債券を中心に安定運用を行ないます。そのため、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

設定時：10,000円

期末：9,998円

騰落率：△0.0%

■ 基準価額の主な変動要因

低金利環境であったことなどから、基準価額は横ばいとなりました。

ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ

年 月 日	基 準	価 額		公社債組入比率
		騰	落 率	
(設定) 2015年 9月10日	円		%	%
	10,000		—	—
9月末	10,000		0.0	35.4
10月末	10,000		0.0	38.0
11月末	10,001		0.0	28.4
12月末	10,000		0.0	28.8
2016年 1月末	10,000		0.0	50.4
2月末	10,000		0.0	27.1
3月末	10,000		0.0	—
4月末	10,000		0.0	1.9
5月末	9,999	△	0.0	0.0
6月末	9,999	△	0.0	1.1
7月末	9,998	△	0.0	13.4
8月末	9,998	△	0.0	31.1
(期末) 2016年 9月 7日	9,998	△	0.0	38.8

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

○国内短期金融市況

日銀がマイナス金利付き量的・質的金融緩和を導入したことを背景に、無担保コール翌日物金利は△0.05%程度まで低下、国庫短期証券（3カ月物）の利回りは△0.28%程度まで低下しました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

○ダイワ・マネー・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

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2015年9月10日 ～2016年9月7日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	0

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

《今後の運用方針》

○当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

○ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 9. 10～2016. 9. 7)		
	金 額	比 率	
信託報酬	2円	0.017%	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10,000円です。
(投信会社)	(0)	(0.004)	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)	(1)	(0.012)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(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	0	0.001	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	2	0.018	

(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。

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年9月10日から2016年9月7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・マザーファンド	52,056,225	53,082,342	32,949,774	33,600,739

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビー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) 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9月10日から2016年9月7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	281,090	31,700	11.3	11,349	—	—
コール・ローン	6,802,787	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合29.7%

*平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーフ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
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	19,106,450	19,480,937

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	19,480,937	65.9
コール・ローン等、その他	10,080,481	34.1
投資信託財産総額	29,561,418	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9月7日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	29,561,418,722円
コール・ローン等	10,080,481,354
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	19,480,937,368
(B) 負債	1,952,211,260
未払解約金	1,952,147,514
その他未払費用	63,746
(C) 純資産総額 (A - B)	27,609,207,462
元本	27,614,789,079
次期繰越損益金	△ 5,581,617
(D) 受益権総口数	27,614,789,079口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,998円

*設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は268,947,745,907円、同解約元本額は241,333,956,828円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,998円です。

*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は5,581,617円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月10日 至2016年9月7日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	504,544円
受取利息	2,351,828
支払利息	△ 1,847,284
(B) 有価証券売買損益	2,525,090
売買益	4,811,350
売買損	△ 2,286,260
(C) 信託報酬等	△ 4,539,351
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,509,717
(E) 追加信託差損益金	△ 4,071,900
(配当等相当額)	(1,613,032)
(売買損益相当額)	(△ 5,684,932)
(F) 合計 (D + E)	△ 5,581,617
次期繰越損益金 (F)	△ 5,581,617
追加信託差損益金	△ 4,071,900
(配当等相当額)	(1,613,032)
(売買損益相当額)	(△ 5,684,932)
繰越損益金	△ 1,509,717

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,613,032
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,613,032
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,613,032
(h) 受益権総口数	27,614,789,079口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《お知らせ》

●スイッチング対象ファンドの除外について

「ブルベア・マネー・ポートフォリオⅢ」、「ブル2.5倍日本株ポートフォリオⅢ」および「ベア1.5倍日本株ポートフォリオⅢ」が2015年11月13日付で満期償還したことに伴い、当ファンドのスイッチング対象から除外しました。

ダイワ・マネー・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・ブルベア・ファンドⅣ）が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2015年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年9月7日）現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を27ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2015年9月10日から2016年9月7日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
613 国庫短期証券 2016/9/12	27,280,379	567 国庫短期証券 2016/2/8	4,999,980
591 国庫短期証券 2016/5/30	24,330,973	566 国庫短期証券 2016/2/1	2,999,991
611 国庫短期証券 2016/9/5	19,330,584	342 2年国債 0.1% 2016/7/15	2,095,779
601 国庫短期証券 2016/7/19	19,020,392	100 5年国債 0.3% 2016/9/20	1,253,387
596 国庫短期証券 2016/6/20	14,390,312		
588 国庫短期証券 2016/5/16	12,500,147		
609 国庫短期証券 2016/8/22	10,870,238		
610 国庫短期証券 2016/8/29	10,390,257		
607 国庫短期証券 2016/8/15	9,490,188		
545 国庫短期証券 2016/7/20	9,200,000		

(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

下記は、2016年9月7日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（58,750,161千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年9月7日現在						
	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		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 32,940,000	千円 32,940,474	% 55.0	% —	% —	% —	% 55.0

(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）

2016年9月7日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	593 国庫短期証券	—	千円 3,380,000	千円 3,380,045	2016/09/12	
	613 国庫短期証券	—	27,280,000	27,280,342	2016/09/12	
	558 国庫短期証券	—	30,000	30,001	2016/09/20	
	615 国庫短期証券	—	1,950,000	1,950,069	2016/09/20	
	616 国庫短期証券	—	300,000	300,015	2016/09/26	
合 計	銘 柄 数	5銘柄				
	金 額		32,940,000	32,940,474		

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第11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・マザーファンドの第11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	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行いません。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
運用方法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行いません。 ②邦貨建資産の組入れにあたっては、取得時に第二位 (A - 2 格相当) 以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、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30%以下

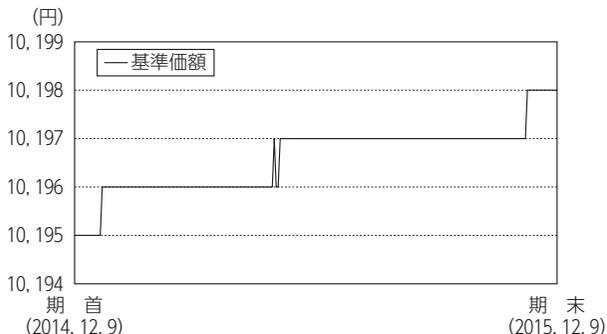
大和投資信託

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



《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：10,195円 期末：10,198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。

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	10,195	—	60.0
12月末	10,196	0.0	88.5
2015年1月末	10,196	0.0	87.3
2月末	10,196	0.0	58.5
3月末	10,196	0.0	53.0
4月末	10,196	0.0	61.8
5月末	10,197	0.0	59.0
6月末	10,197	0.0	53.3
7月末	10,197	0.0	62.8
8月末	10,197	0.0	70.5
9月末	10,197	0.0	61.6
10月末	10,197	0.0	66.8
11月末	10,198	0.0	52.5
(期末) 2015年12月9日	10,198	0.0	55.2

(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、利息収入の確保をめぐっ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。

■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 120,653,910	千円 (92,494,000)

- (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	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
550 国庫短期証券 2015/11/9	8,509,995		
548 国庫短期証券 2015/11/2	7,399,995		
559 国庫短期証券 2015/12/21	7,049,991		
563 国庫短期証券 2016/1/18	6,099,995		
555 国庫短期証券 2015/12/7	5,499,999		
557 国庫短期証券 2015/12/14	5,469,997		
568 国庫短期証券 2016/2/15	5,000,000		
567 国庫短期証券 2016/2/8	4,999,995		
573 国庫短期証券 2016/3/7	4,800,955		
520 国庫短期証券 2015/6/22	3,499,975		

- (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 区 分	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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	43,554,000	43,559,849	55.2	—	—	—	55.2

- (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
		%	千円	千円	
国債証券	537 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,000	2015/12/10
	557 国庫短期証券	—	5,470,000	5,469,999	2015/12/14
	559 国庫短期証券	—	7,050,000	7,049,997	2015/12/21
	560 国庫短期証券	—	2,790,000	2,789,999	2015/12/28
	563 国庫短期証券	—	6,100,000	6,099,997	2016/01/18
	566 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,998	2016/02/01
	567 国庫短期証券	—	5,000,000	4,999,996	2016/02/08
	568 国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,000	2016/02/15
	573 国庫短期証券	—	4,800,000	4,800,934	2016/03/07
	342 2年国債	0.1000	2,094,000	2,095,675	2016/07/15
	100 5年国債	0.3000	1,250,000	1,253,250	2016/09/20
合計	銘柄数 金額	11銘柄	43,554,000	43,559,849	

- (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	43,559,849	55.2
コール・ローン等、その他	35,332,328	44.8
投資信託財産総額	78,892,178	100.0

- (注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネー・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	78,892,178,168円
コール・ローン等	35,330,663,234
公社債(評価額)	43,559,849,888
未収利息	1,114,825
前払費用	550,221
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A-B)	78,892,178,168
元本	77,361,886,547
次期繰越損益金	1,530,291,621
(D) 受益権総口数	77,361,886,547口
1万口当り基準価額(C/D)	10,198円

*期首における元本額は25,162,158,471円、当期中における追加設定元本額は125,627,714,743円、同解約元本額は73,427,986,667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、深センA株資本金拠出用ファンド(適格機関投資家専用)1,000,294,205円、ダイワ/RIC I (R)コモディティ・ファンド8,952,508円、US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)740,564円、US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)1,623,350円、スマート・アロケーション・Dガード161,095,201円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>米ドルコース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>円コース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>世界通貨分散コース981円、ダイワファンドラップ コモディティセレクト317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー 日本円・コース(毎月分配型)132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー 豪ドル・コース(毎月分配型)643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ー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)4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー 米ドル・コース(毎月分配型)12,784円、ダイワ/フィデリティ北米株式ファンドーパラダイムシフトー49,096,623円、(適格機関投資家専用)スマート・シックス・Dガード1,919,351,400円、ブルベア・マネー・ポートフォリオIV23,032,151,009円、ブル3倍日本株ポートフォリオIV47,552,576,868円、ベア2倍日本株ポートフォリオIV2,618,628,748円、ダイワFEグローバル・バリュー株ファンド(ダイワSMA専用)13,896,435円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)98,290,744円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)23,590,527円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)米ドル・コース(毎月分配型)2,163,360円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)豪ドル・コース(毎月分配型)13,761,552円、ダイワ/UBSエマーシングCBファンド2,498,575円、ダイワ/アムンディ食糧増産関連ファンド14,780,160円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ46,913,699円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスIIー金積立型ー1,972,537円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド(償還条項付き)為替ヘッジあり4,926,716円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(資産成長コース)49,082,149円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(通貨αコース)196,290,094円、ダイワ・ダブルバランス・ファンド(Dガード付/部分為替ヘッジあり)140,042,061円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー(為替ヘッジあり)9,813,543円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー(為替ヘッジなし)29,440,629円、ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)米ドルコース13,732,222円、ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)日本円コース3,874,449円、ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)通貨αコース13,437,960円、ダイワ英国高配当株ツインα(毎月分配型)98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ7,567,671円、DCスマート・アロケーション・Dガード3,224,448円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド(ダイワSMA専用)490,418円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)南アフリカ・ランド・コース(毎月分配型)98,252円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)トルコ・リラ・コース(毎月分配型)2,554,212円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)通貨セレクト・コース(毎月分配型)1,178,976円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型)株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型)通貨αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型)株式&通貨ツインαコース982,029円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー通貨セレクト・コース(毎月分配型)98,174円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,198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	10,433,273円
受取利息	10,433,273
(B) 有価証券売買損益	△ 362,189
売買益	43,331
売買損	△ 405,520
(C) 当期損益金(A+B)	10,071,084
(D) 前期繰越損益金	491,354,312
(E) 解約差損益金	△ 1,446,302,032
(F) 追加信託差損益金	2,475,168,257
(G) 合計(C+D+E+F)	1,530,291,621
次期繰越損益金(G)	1,530,291,621

(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。