

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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3年9カ月間（2015年10月30日～2019年7月22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・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」（以下「コーポレート・ハイブリッド・ファンド」といいます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーポートフォリオ・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、コーポレート・ハイブリッド・ファンドの受益証券への投資を通じて、世界の企業（金融機関を含みます。）が発行するハイブリッド証券等に投資し、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、コーポレート・ハイブリッド・ファンドとダイワ・マネーポートフォリオ・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、コーポレート・ハイブリッド・ファンドへの投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③コーポレート・ハイブリッド・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	当ファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
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、元本超過額も含めて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。	

コーポレート・ハイブリッド証券
ファンド2015-10
（為替ヘッジあり）Ⅱ
（愛称：メジャー・カンパニーズ15-10Ⅱ）

運用報告書（全体版）
第1期
（決算日 2016年1月22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、「コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）Ⅱ（愛称：メジャー・カンパニーズ15-10Ⅱ）」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/>

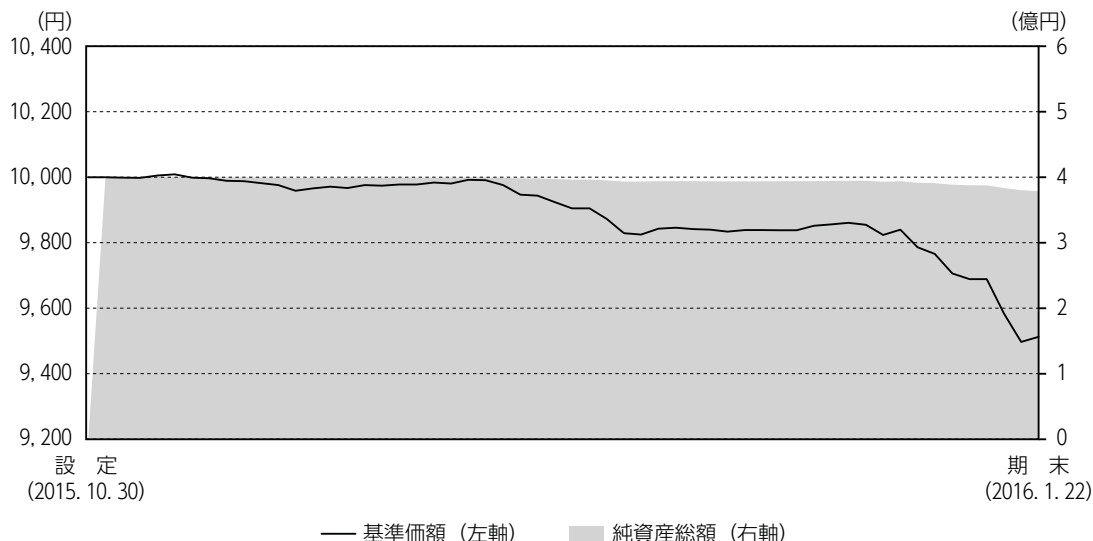
設定以来の運用実績

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 残 存 本 率
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 額	期 中 騰 落 率				
設 定 (2015年10月30日)	円 10,000	円 —	円 —	% —	% —	% —	% —	% 100.0
1 期 末 (2016年 1 月22日)	9,463	50	△ 487	△ 4.9	△ 20.9	0.0	99.1	100.0

(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



（注）期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：9,463円（分配金50円）

騰落率：△4.9%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ダイワ・プレミアム・トラストグローバル・コーポレート・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（以下「コーポレート・ハイブリッド・ファンド」といいます。）の受益証券への投資を通じて、金融機関を含む世界の企業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はプラスに寄与しましたが、主に債券価格の下落により基準価額は下落しました。

コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）Ⅱ

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 %		
（設定）2015年10月30日	10,000	—	—	—
10月末	10,000	0.0	0.0	—
11月末	9,984	△ 0.2	0.0	99.5
12月末	9,838	△ 1.6	0.0	99.6
（期末）2016年 1 月22日	9,513	△ 4.9	0.0	99.1

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

投資環境について

○ハイブリッド証券市況

設定以降、中国をはじめとする主要新興国の景気減速や原油など商品の価格下落、米国の金融政策の先行き不透明感などを背景に、金融市場ではリスク回避傾向が強まりました。こうした状況下、欧米の国債金利が低下する一方で、ハイブリッド証券市況は事業環境の悪化が懸念された企業の発行証券を中心に、軟調な展開となりました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、コーポレート・ハイブリッド・ファンドの受益証券とダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券に投資するファンド・オブ・ファンズであり、期を通じてコーポレート・ハイブリッド・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。

○コーポレート・ハイブリッド・ファンド

世界の企業が発行するハイブリッド証券を対象に、信託期間内にコール（繰上償還）等が見込まれる銘柄を中心に投資しました。業種別では景気循環に影響を受けにくい公益事業を軸とし、所在国のソブリンリスク（国家の信用リスク）が安定した大手企業の発行する証券を中心としたポートフォリオを構築しました。また、為替変動リスクを低減するため、対円での為替ヘッジを行ないました。

○ダイワ・マネーポートフォリオ・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

当期の1万口当り分配金（税込み）は50円といたしました。

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。

■収益分配金の計算過程

計算期間末における経費控除後の配当等収益が5,955,897円であり、純資産額の元本超過額がないため、経費控除後の配当等収益5,955,897円（1万口当り148.79円）を分配対象額として、うち2,001,312円（1万口当り50円）を分配金額としております。

《今後の運用方針》

○当ファンド

主として、コーポレート・ハイブリッド・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、金融機関を含む世界の企業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。

○コーポレート・ハイブリッド・ファンド

当ファンドでは、引き続き世界の企業が発行するハイブリッド証券を対象とし、信用力のベースとなるソブリンリスクが安定した国における大手企業の発行証券を継続保有することで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざす方針です。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・マネーポートフォリオ・マザーファンド

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います。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 10. 30～2016. 1. 22)		
	金 額	比 率	
信託報酬	24円	0. 244%	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, 884円です。
(投信会社)	(9)	(0. 088)	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)	(15)	(0. 150)	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. 006)	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	0	0. 002	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 002)	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. 002	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. 002)	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
合 計	25	0. 248	

(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。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。

コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）Ⅱ

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2015年10月30日から2016年 1月22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)	4, 152. 235	404, 930	45. 616	4, 191

(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

(2015年10月30日から2016年 1月22日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・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10月30日から2016年 1月22日まで)

当 期				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
GLOBAL CORPORATE HYBRID SECURITIES FUND (ケイマン諸島)	4, 078. 913	398, 000	97	GLOBAL CORPORATE HYBRID SECURITIES FUND (ケイマン諸島)	45. 616	4, 191	91

(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・マネーポートフォリオ・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10月30日から2016年 1月22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	4, 700	200	4. 3	—	—	—
コール・ローン	133, 186	—	—	—	—	—

(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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) GLOBAL CORPORATE HYBRID SECURITIES FUND	4, 106. 618	375, 291	99. 1

(注 1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注 2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	0	1

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年 1月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	375, 291	98. 3
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	1	0. 0
コール・ローン等、その他	6, 454	1. 7
投資信託財産総額	381, 747	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22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	381, 747, 470円
コール・ローン等	6, 454, 936
投資信託受益証券（評価額）	375, 291, 534
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（評価額）	1, 000
(B) 負債	2, 977, 319
未払収益分配金	2, 001, 312
未払信託報酬	968, 677
その他未払費用	7, 330
(C) 純資産総額（A－B）	378, 770, 151
元本	400, 262, 505
次期繰越損益金	△ 21, 492, 354
(D) 受益権総口数	400, 262, 505口
1万口当り基準価額（C/D）	9, 463円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9, 463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21, 492, 354円です。

■損益の状況

当期 自2015年10月30日 至2016年 1月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	6, 931, 904円
受取配当金	6, 930, 073
受取利息	1, 831
(B) 有価証券売買損益	△ 256, 966
売買益	1
売買損	△ 256, 967
(C) 有価証券評価差損益	△ 25, 189, 973
(D) 信託報酬等	△ 976, 007
(E) 当期損益金（A+B+C+D）	△ 19, 491, 042
(F) 合計（E）	△ 19, 491, 042
(G) 収益分配金	△ 2, 001, 312
次期繰越損益金（F+G）	△ 21, 492, 354

(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) 収益分配金の計算過程は 5 ページをご参照ください。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 （ 税 込 み ）	50円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・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・トラストーグローバル・コーポレート・ハイブリッド・
セキュリティーズ・ファンド**

当ファンド（コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）Ⅱ）の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーグローバル・コーポレート・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」は、2015年12月31日に第1期決算を迎えておりますが、2016年1月22日現在、決算情報を入手できておりません。

<補足情報>

当ファンド（コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）Ⅱ）が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・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1月22日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの組入資産の内容等を11～12ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2015年10月30日から2016年1月22日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
578 国庫短期証券 2016/3/28	1,200,054		
579 国庫短期証券 2016/4/7	600,033		
560 国庫短期証券 2015/12/28	600,000		
574 国庫短期証券 2016/3/14	350,026		
582 国庫短期証券 2016/4/18	300,020		
567 国庫短期証券 2016/2/8	300,003		
554 国庫短期証券 2015/11/30	299,999		
570 国庫短期証券 2016/2/22	299,999		
573 国庫短期証券 2016/3/7	200,039		
557 国庫短期証券 2015/12/14	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1月22日現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（6,773,591千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年1月22日現在						
	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		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 3,900,000	千円 3,900,126	% 57.3	% —	% —	% —	% 57.3

(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1月22日現在					
区 分	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	566 国庫短期証券	—	200,000	199,999	2016/02/01
	567 国庫短期証券	—	600,000	600,001	2016/02/08
	570 国庫短期証券	—	300,000	299,999	2016/02/22
	573 国庫短期証券	—	200,000	200,019	2016/03/07
	574 国庫短期証券	—	350,000	350,015	2016/03/14
	576 国庫短期証券	—	150,000	150,008	2016/03/22
	578 国庫短期証券	—	1,200,000	1,200,037	2016/03/28
	579 国庫短期証券	—	600,000	600,024	2016/04/07
	582 国庫短期証券	—	300,000	300,019	2016/04/18
合 計	銘 柄 数 額	9銘柄			
	金 額		3,900,000	3,900,126	

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書 第7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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの第7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

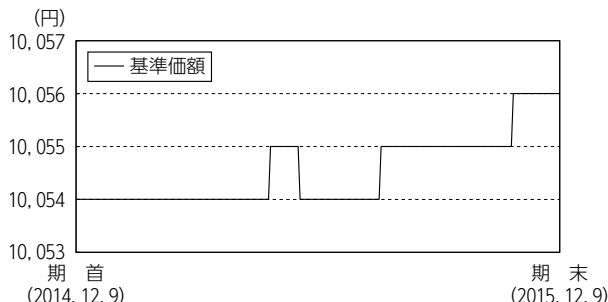
大和投資信託

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
	騰 落 率		
(期首) 2014年12月9日	円	%	%
12月末	10,054	—	62.6
2015年1月末	10,054	0.0	71.5
2月末	10,054	0.0	74.4
3月末	10,054	0.0	61.6
4月末	10,054	0.0	60.0
5月末	10,054	0.0	87.5
6月末	10,054	0.0	78.1
7月末	10,055	0.0	90.8
8月末	10,055	0.0	67.2
9月末	10,055	0.0	51.4
10月末	10,055	0.0	76.0
11月末	10,056	0.0	51.3
(期末) 2015年12月9日	10,056	0.0	51.3

(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：10,054円 期末：10,056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)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国債証券	6,780,031	399,997 (4,330,000)

(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			期 末		
買 付		金 額	売 付		金 額
銘 柄			銘 柄		
		千円			千円
554 国庫短期証券	2015/11/30	699,999	532 国庫短期証券	2015/8/17	99,999
560 国庫短期証券	2015/12/28	600,000	534 国庫短期証券	2015/8/24	99,999
540 国庫短期証券	2015/9/24	470,000	520 国庫短期証券	2015/6/22	99,999
548 国庫短期証券	2015/11/2	449,999	466 国庫短期証券	2015/7/21	99,998
555 国庫短期証券	2015/12/7	400,000			
546 国庫短期証券	2015/10/19	389,999			
536 国庫短期証券	2015/9/7	309,999			
557 国庫短期証券	2015/12/14	300,000			
563 国庫短期証券	2016/1/18	299,999			
567 国庫短期証券	2016/2/8	299,999			

(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。

■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	2,100,038	51.3
コール・ローン等、その他	1,990,861	48.7
投資信託財産総額	4,090,899	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建) 公社債 (種類別)

作 成 期	当 期			期 末			
区 分	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	2,100,000	2,100,038	51.3	—	—	—	51.3

(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)

当 期			期 末		
区 分	銘 柄	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	—	300,000	300,000	2015/12/14
	559 国庫短期証券	—	200,000	200,000	2015/12/21
	560 国庫短期証券	—	600,000	600,000	2015/12/28
	563 国庫短期証券	—	300,000	299,999	2016/01/18
	566 国庫短期証券	—	200,000	199,999	2016/02/01
	567 国庫短期証券	—	300,000	299,999	2016/02/08
	573 国庫短期証券	—	200,000	200,038	2016/03/07
合計	銘柄数	7銘柄			
	金 額		2,100,000	2,100,038	

(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

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	4,090,899,982円
コール・ローン等	1,990,861,486
公社債（評価額）	2,100,038,496
(B)負債	—
(C)純資産総額（A－B）	4,090,899,982
元本	4,068,192,218
次期繰越損益金	22,707,764
(D)受益権総口数	4,068,192,218口
1万口当り基準価額（C／D）	10,056円

*期首における元本額は79,467,922円、当期中における追加設定元本額は4,645,374,497円、同解約元本額は656,650,201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、ダイワ米ドル・プルファンド（適格機関投資家専用）188,972,589円、ダイワ米ドル・ベアファンド（適格機関投資家専用）3,808,997,814円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-07（為替ヘッジあり／限定追加型）995円、通貨選択型 米国内リート・αクワトロ（毎月分配型）159,141円、通貨選択型アメリカン・エクイティ・αクワトロ（毎月分配型）159,141円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-10（為替ヘッジあり）Ⅱ995円、コーポレート・ハイブリッド証券ファンド2015-12（為替ヘッジあり）995円、ダイワ／ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド15,363,351円、ダイワ／フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）998円、ダイワ／フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）998円、ダイワ／フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）998円、ダイワTOP I Xベア・ファンド（適格機関投資家専用）596,719円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）9,949円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンドー予想分配金提示型ー53,926,540円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,056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		299,560円
受取利息		299,560
(B)有価証券売買損益	△	1,226
売買益		597
売買損	△	1,823
(C)当期損益金（A＋B）		298,334
(D)前期繰越損益金		429,726
(E)解約差損益金	△	3,569,799
(F)追加信託差損益金		25,549,503
(G)合計（C＋D＋E＋F）		22,707,764
次期繰越損益金（G）		22,707,764

（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。