

ロボット・テクノロジー 関連株ファンド ーロボテックー

運用報告書（全体版） 第1期 （決算日 2016年3月14日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	約9年9カ月間（2015年12月7日～2025年9月12日）	
運用方針	信託財産の成長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．アクサIM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）（以下「ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）」といいます。）の受益証券 ロ．ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	円建ての債券
当ファンドの運用方法	<p>①主として、ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）の受益証券を通じて、日本を含む世界のロボット関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、値上がり利益を追求することにより、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。</p> <p>②当ファンドは、ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）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・ファンズです。通常の状態、ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）への投資割合を高位に維持することを基本とします。</p> <p>③ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）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。</p>	
マザーファンドの運用方法	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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。	
	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、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、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、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。	

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、「ロボット・テクノロジー関連株ファンド ーロボテックー」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			MSCI AC World指数 (配当込み、円換算) (参考指数)		公社債 組入比率	投資信託 受益組入 証券比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
1期末(2016年3月14日)	円 9,162	円 0	% △8.4	8,946	% △10.5	% 0.0	% 95.5	百万円 65,314

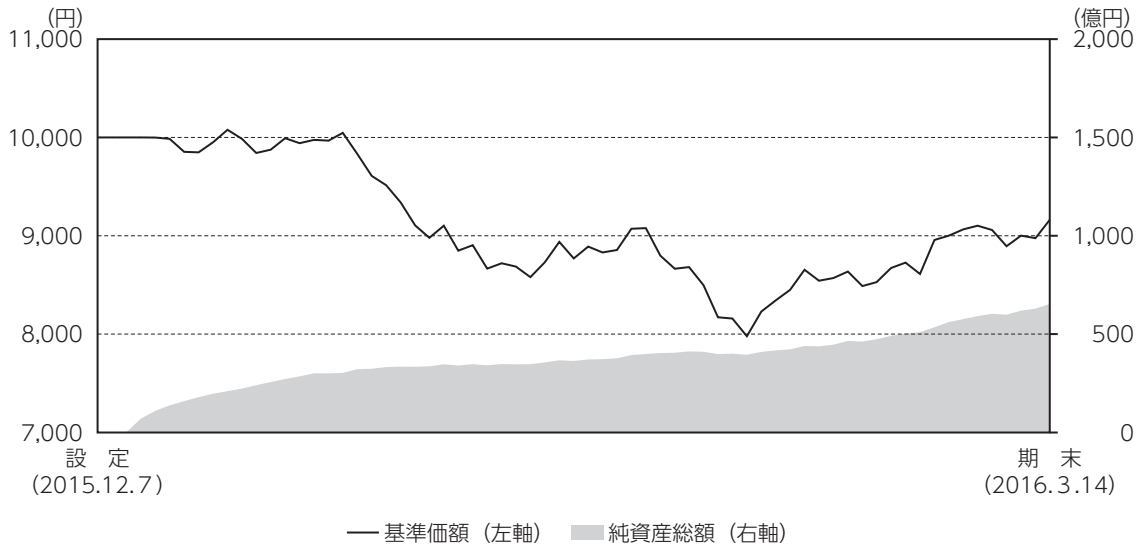
(注1) MSCI AC World 指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI All Country World Index (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCI All Country World Index (配当込み、米ドルベース) は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注3) 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。

《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：9,162円
 騰落率：△8.4%

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、米国および日本の株式市況が下落したことや対円で米ドルが下落したことなどがマイナス要因となり、下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ロボット・テクノロジー関連株ファンド -ロボテック-

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World指数 (配当込み、円換算) (参考指数)		公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(設定) 2015年12月7日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -
12月末	10,046	0.5	9,737	△ 2.6	0.1	88.6
2016年1月末	8,855	△11.5	8,876	△11.2	0.1	96.6
2月末	8,727	△12.7	8,492	△15.1	0.1	95.2
(期末) 2016年3月14日	9,162	△ 8.4	8,946	△10.5	0.0	95.5

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

○グローバル株式市況

グローバル株式市況は、設定時より、中国の株式市況や中国・人民元の下落、原油をはじめとする資源価格の低迷、米国の利上げ継続に対する不透明感などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、2016年1月中旬にかけて下落基調となりました。その後、ECB（欧州中央銀行）総裁が追加金融緩和の可能性を示唆したことをきっかけに反発に転じましたが、中国や米国の市場の予想を下回る経済統計、原油価格の下落、ドイツ大手銀行をはじめとした欧州銀行の信用問題などから、2月中旬にかけて再び下落しました。また、日本では1月末に日銀がマイナス金利を導入したものの、その効果よりも先行き不透明感が材料視され、日本株式市況は他の先進国と比較して大きく下落しました。期末にかけては、市場の予想を上回る小売売上高を受けて米国の景気懸念が後退したことやECB総裁が金融緩和策へ言及したこと、主要原油産出国が生産量維持で合意したことによる原油価格の反発などが支援材料となり、上昇基調となりました。

○為替相場（米ドル／円、ユーロ／円）

為替相場は、米ドル、ユーロともに対円で下落しました。前述のように、中国の株式市況や人民元の下落、原油をはじめとする資源価格の低迷、米国の利上げ継続に対する不透明感などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、2016年1月中旬にかけて円高が進行しました。1月末に日銀がマイナス金利を導入し一時的に円安方向に動きましたが、2月に入り、中国景気に対する先行き不透明感や、ドイツ大手銀行をはじめとした欧州銀行の信用問題などから投資家のリスク回避傾向が再び強まる中、主要通貨に対して円高が進行しました。期末にかけても、米国の経済指標や利上げ時期、原油価格などを見極める動きが強く、ユーロは対円で上昇しましたが、米ドルはボックス圏での推移となりました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドは、「アクサIM・グローバル・ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」（以下「ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）」といいます。）の受益証券とダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券へ投資するファンド・オブ・ファンズです。

当期は、ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）の受益証券を高位に組み入れました。

○ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）

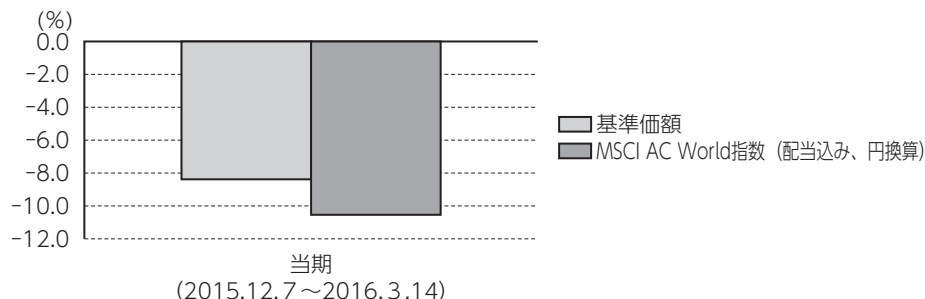
当ファンドは、「作る」、「運ぶ」、「助ける・守る」の3つのテーマに着目し、市場のさまざまなロボット関連産業の企業に投資を行ないました。企業規模の面ではアップルやアルファベット（旧Google）、トヨタ自動車のような大型株から、安川電機やアイピージー・フォトニクス、モービルアイなどの中小型株にも幅広く投資を行ない、地域別構成比ではロボット関連産業の技術革新において先進的な地域である米国、日本を中心に投資を行ないました。期末の組入上位銘柄は、米国のアルファベット（情報技術）、アップル（情報技術）、サーモ・フィッシャー・サイエンティフィック（ヘルスケア）、ジョンソン・アンド・ジョンソン（ヘルスケア）、日本のキーエンス（情報技術）などでした。

○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、分配対象額が少額であったため、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12月7日 ～2016年3月14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)		0.00

(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

ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）の受益証券の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

○ロボット関連株式ファンド（為替ヘッジなし）

当ファンドは「作る」、「運ぶ」、「助ける・守る」の3つのテーマに着目し、市場のさまざまなロボット関連産業の企業に投資を行ないます。「作る」では、ロボット産業におけるリーディング・カンパニーに加え、製造工程を監視制御するシステムを開発する企業などに注目しています。「運ぶ」では、自動運転技術向けの自動車部品企業に注目しています。「助ける・守る」では、ロボット外科手術などを手掛ける企業などに注目しています。

ファンド設定来、株式市場の値動きの大きな展開が続いていますが、株価が下落した局面では成長見通しの確信度の高い銘柄を機動的に買い増す方針です。また、運用チームはヘルスケア企業のようにマクロ経済の動向に影響されにくいビジネスモデルの企業を選好しています。引き続き、期待の高いロボット関連産業の企業に投資を行なうことでファンドの成長をめざしてまいります。

○ダイワ・マネーストック・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
	(2015.12.7~2016.3.14)		
	金 額	比 率	
信託報酬	30円	0.329%	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9,106円です。
(投信会社)	(9)	(0.102)	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)	(20)	(0.219)	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)	(0.007)	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 (監査費用)	0 (0)	0.001 (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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	30	0.330	

(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。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2015年12月7日から2016年3月14日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国		千口	千円	千口	千円
内	アクサIM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	70,314,788.466	63,825,000	-	-

(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12月7日から2016年3月14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・マネーストック・マザーファンド	49,795	50,000	-	-

(注) 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・マネーストック・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12月7日から2016年3月14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	
区 分							
公社債	百万円 25,902	百万円 5,000	% 19.3	百万円 2,822	百万円 -	% -	
コール・ローン	906,380	-	-	-	-	-	

(注) 平均保有割合0.1%

※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ビエ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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取 引 の 理 由
百万円 100	百万円 -	百万円 100	百万円 -	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■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
国内投資信託受益証券 アクサIM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	千口 70,314,788.466	千円 62,348,122	% 95.5

(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
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	千口 49,795	千円 50,000

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年3月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 62,348,122	% 95.3
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	50,000	0.1
コール・ローン等、その他	3,049,520	4.6
投資信託財産総額	65,447,643	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3月14日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	65,447,643,426円
コール・ローン等	3,049,520,494
投資信託受益証券(評価額)	62,348,122,932
ダイワ・マネーストック・マザーファンド(評価額)	50,000,000
(B) 負債	132,646,601
未払解約金	12,967,981
未払信託報酬	119,084,401
その他未払費用	594,219
(C) 純資産総額(A - B)	65,314,996,825
元本	71,291,670,353
次期繰越損益金	△ 5,976,673,528
(D) 受益権総口数	71,291,670,353口
1万口当り基準価額(C / D)	9,162円

* 設定時における元本額は100,000,000円、当期中における追加設定元本額は71,775,567,207円、同解約元本額は583,896,854円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,162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5,976,673,528円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月7日 至2016年3月14日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	340,630円
受取利息	340,630
(B) 有価証券売買損益	△1,436,152,522
売買益	41,151,742
売買損	△1,477,304,264
(C) 信託報酬等	△ 119,678,620
(D) 当期損益金(A + B + C)	△1,555,490,512
(E) 追加信託差損益金	△4,421,183,016
(配当等相当額)	(157)
(売買損益相当額)	(△4,421,183,173)
(F) 合計(D + E)	△5,976,673,528
次期繰越損益金(F)	△5,976,673,528
追加信託差損益金	△4,421,183,016
(配当等相当額)	(157)
(売買損益相当額)	(△4,421,183,173)
繰越損益金	△1,555,490,512

(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)」の表を参照。

■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	157
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	157
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	157
(h) 受益権総口数	71,291,670,353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。

アクサIM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)

当ファンド(ロボット・テクノロジー関連株ファンド –ロボテック–)の主要投資対象である、「アクサIM・グローバル・ロボット関連株式ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)」は、2016年3月14日現在、第1期決算を迎えておりません。

<補足情報>

当ファンド（ロボット・テクノロジー関連株ファンド（ロボテック））が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・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3月14日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を10ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2015年12月7日から2016年3月14日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
568	国庫短期証券 2016/2/15	7,000,594	575	国庫短期証券 2016/6/10	1,500,603
574	国庫短期証券 2016/3/14	5,000,640	342	2年国債 0.1% 2016/7/15	720,475
576	国庫短期証券 2016/3/22	3,500,336	100	5年国債 0.3% 2016/9/20	601,368
573	国庫短期証券 2016/3/7	3,000,321			
578	国庫短期証券 2016/3/28	2,000,106			
575	国庫短期証券 2016/6/10	1,500,448			
567	国庫短期証券 2016/2/8	1,299,999			
588	国庫短期証券 2016/5/16	1,000,333			
556	国庫短期証券 2016/3/10	1,000,123			
564	国庫短期証券 2016/1/25	599,999			

(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。

■組入資産明細表

下記は、2016年3月14日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（49,878,685千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

2016年3月14日現在								
区 分	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 6,500,000	千円 6,500,272	% 13.0	% -	% -	% -	% -	% 13.0

(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3月14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	576	国庫短期証券	%	千円 3,500,000	千円 3,500,027	2016/03/22
	578	国庫短期証券	-	2,000,000	2,000,015	2016/03/28
	588	国庫短期証券	-	1,000,000	1,000,230	2016/05/16
合 計	銘 柄 数	3銘柄		6,500,000	6,500,272	
	金 額					

(注) 単位未満は切捨て。

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

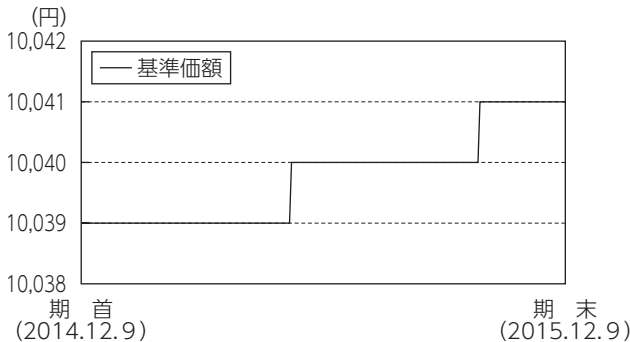
大和投資信託

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
	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)

国 内	買 付 額	売 付 額
国債証券	75,714,577	—
		(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、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)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	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）

区 分	当 期			末			
	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		
	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		償還年月日
		年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	債 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
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		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		末
	評 価 額	比 率	
	千円	%	
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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド-ロボテック-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2 Aコース999,197円、りそな毎月払出し・豪ドル債ファンド2 B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、US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、US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-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-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-TOP I Xレバレッジ(2倍) 指数2,081,906,471円、ダイワ上場投信-TOP I Xダブルインバース(一2倍) 指数796,936,766円、ダイワ上場投信-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-TOP I Xインバース(一1倍) 指数2,340,731,717円、ダイワ上場投信-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-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-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/シュローダー・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/シュローダー・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 ドル高安ポートフォリオ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-成長の権首(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US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ーン・オープン(為替ヘッジあり) 997円、ダイワ米国バンクローン・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/ミレアセット・グローバル好配当株α(毎月分配型) ブラジリアル・コース12,948,208円、通貨選択型ダイワ/ミレアセット・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) - 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) - 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 -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10,041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。