

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成28年9月30日

【発行者名】 エスエムティー・ファンド・サービシーズ(アイルランド)
リミテッド
(SMT Fund Services (Ireland) Limited)

【代表者の役職氏名】 取締役 田 中 博 光
取締役 ピーター・キャラハン
(Peter Callaghan)

【本店の所在の場所】 アイルランド共和国、ダブリン2、ハーコート・ロード、
ハーコート・センター、ブロック5
(Block 5, Harcourt Centre, Harcourt Road, Dublin 2,
Ireland)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号
丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【届出の対象とした募集外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】

ダイワ外貨MMF

(Daiwa Gaika MMF)

【届出の対象とした募集外国投資信託受益証券の金額】

()USドル・ポートフォリオ

100億アメリカ合衆国ドル(約1兆442億円)を上限とする。

()オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

100億オーストラリア・ドル(約7,856億円)を上限とする。

()カナダ・ドル・ポートフォリオ

100億カナダ・ドル(約7,941億円)を上限とする。

()ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

100億ニュージーランド・ドル(約7,417億円)を上限とする。

(注) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)、オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、平成28年7月29日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=104.42円、1豪ドル=78.56円、1カナダ・ドル=79.41円および1ニュージーランド・ドル=74.17円)による。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、平成28年6月24日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の関係情報を下表のとおり新たな情報により追加・訂正するため、また記載事項のうち「第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況」の「3 投資リスク、 リスクに関する参考情報」等について新たな情報により訂正すべき事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2 【訂正の内容】

(1) 半期報告書の提出に伴う訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容*と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格	(3) ファンドの仕組み 管理会社の概要 (ハ)資本金の額	4 管理会社の概況 (1) 資本金の額		更新
5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況	更新
	(2) 投資資産			
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	更新 / 追加
	(4) 販売及び買戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容及び営業の状況	更新

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

(「5 管理会社の経理の概況」は、訂正内容に該当しないため省略します。)

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

ダイワ外貨MMF(以下「ファンド」という。)の運用状況は、以下のとおりである。

(1) 投資状況

資産別及び地域別の投資状況

USドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (アメリカ合衆国ドル)	投資比率 (%)
コマーシャル・ペーパー	フランス	289,752,659.91	17.63
	ルクセンブルグ	127,861,479.39	7.78
	イギリス	77,948,165.00	4.74
	フィンランド	77,872,657.57	4.74
	ドイツ	57,921,783.05	3.52
	アメリカ合衆国	48,965,827.31	2.98
	オランダ	48,965,291.79	2.98
	日本	17,976,858.66	1.09
	小計	747,264,722.68	45.48
譲渡性預金証書	日本	288,924,449.00	17.58
	イギリス	233,850,555.46	14.23
	シンガポール	70,000,000.00	4.26
	オーストラリア	42,934,828.06	2.61
	小計	635,709,832.52	38.69
社債	カナダ	8,011,216.09	0.49
政府債	カナダ	5,007,032.58	0.30
定期預金	アメリカ合衆国	247,576,494.35	15.07
現金およびその他の資産 (負債控除後)		-342,859.09	-0.02
合計(純資産総額)		1,643,226,439.13 (約171,586百万円)	100.00

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

(注2) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)、オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、便宜上、それぞれ平成28年7月29日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=104.42円、1豪ドル=78.56円、1カナダ・ドル=79.41円、1ニュージーランド・ドル=74.17円)による。以下同じ。

(注3) ファンドは、アイルランド法に基づいて設定されているが、ファンド証券は、米ドル建、豪ドル建、カナダ・ドル建またはニュージーランド・ドル建のため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル、豪ドル、カナダ・ドルまたはニュージーランド・ドルをもって行う。

(注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。

オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (豪ドル)	投資比率 (%)
コマーシャル・ペーパー	フランス	200,488,614.73	18.75
	オーストラリア	169,571,115.28	15.86
	ドイツ	132,706,124.17	12.41
	フィンランド	47,804,036.72	4.47
	ルクセンブルグ	45,796,899.27	4.28
	オランダ	33,917,804.85	3.17
	シンガポール	26,933,845.60	2.52
	イギリス	14,941,282.87	1.40
	小計	672,159,723.49	62.85
譲渡性預金証書	オーストラリア	141,629,617.09	13.24
社債	国際機関	57,122,163.91	5.34
	オーストラリア	18,370,249.59	1.72
	アメリカ合衆国	14,356,029.72	1.34
	オランダ	3,523,301.03	0.33
	小計	93,371,744.25	8.73
定期預金	オーストラリア	161,341,155.78	15.09
現金およびその他の資産 (負債控除後)		888,876.91	0.08
合計(純資産総額)		1,069,391,117.52 (約84,011百万円)	100.00

カナダ・ドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (カナダ・ドル)	投資比率 (%)
政府債	カナダ	17,396,280.21	31.28
	スウェーデン	3,310,805.63	5.95
	小計	20,707,085.84	37.24
社債	カナダ	12,429,491.60	22.35
コマーシャル・ペーパー	フランス	3,799,447.30	6.83
	カナダ	3,298,651.98	5.93
	ドイツ	2,998,846.18	5.39
	小計	10,096,945.46	18.16
銀行引受手形	カナダ	3,995,893.67	7.19
定期預金	カナダ	8,135,037.42	14.63
現金およびその他の資産 (負債控除後)		242,919.56	0.44
合計(純資産総額)		55,607,373.55 (約4,416百万円)	100.00

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

資産の種類	国名	時価合計 (ニュージーランド・ドル)	投資比率 (%)
コマーシャル・ペーパー	フランス	46,766,550.38	16.41
	オーストラリア	30,923,406.67	10.85
	オランダ	16,983,103.28	5.96
	カナダ	16,903,218.68	5.93
	ルクセンブルグ	15,976,000.25	5.60
	フィンランド	14,989,649.15	5.26
	ニュージーランド	14,925,342.07	5.24
	ノルウェー	12,970,606.26	4.55
	小計	170,437,876.74	59.79
譲渡性預金証書	イギリス	29,941,167.87	10.50
	オーストラリア	23,925,869.72	8.39
	シンガポール	14,000,000.00	4.91
	小計	67,867,037.59	23.81
社債	アメリカ合衆国	3,952,549.94	1.39
定期預金	ニュージーランド	42,890,952.16	15.05
現金およびその他の資産 (負債控除後)		-75,194.08	-0.03
合計(純資産総額)		285,073,222.35 (約21,144百万円)	100.00

投資資産

()投資有価証券の主要銘柄

USドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

順位	銘柄	種類	発行国	利率 (%)	償還日	名目保有高	簿価(米ドル)		時価(米ドル)		投資 比率 (%)
							単価	総額	単価	総額	
1	SUMITOMO MITSUI TRUST CD	譲渡性 預金証書	イギリス	0.64	2016年8月15日	78,000,000	1.00	78,000,000.00	1.00	78,000,000.00	4.75
2	NORINCHUKIN BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	0.64	2016年9月26日	78,000,000	1.00	77,924,449.00	1.00	77,924,449.00	4.74
3	MITSUBISHI UFJ TRUST CD	譲渡性 預金証書	イギリス	0.70	2016年10月3日	78,000,000	1.00	77,906,138.25	1.00	77,906,138.25	4.74
4	STANDARD CHARTERED BK CD	譲渡性 預金証書	シンガポール	0.68	2016年10月7日	70,000,000	1.00	70,000,000.00	1.00	70,000,000.00	4.26
5	DZ PRIVATBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	0.74	2016年9月14日	59,000,000	1.00	58,947,918.99	1.00	58,947,918.99	3.59
6	MITSUBISHI CORP FINAN CP	コマーシャル ・ペーパー	イギリス	0.70	2016年9月9日	58,000,000	1.00	57,957,220.79	1.00	57,957,220.79	3.53
7	SHOKO CHUKIN BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	0.70	2016年10月6日	50,000,000	1.00	50,000,000.00	1.00	50,000,000.00	3.04
8	CLEARSTREAM CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	0.68	2016年10月14日	50,000,000	1.00	49,931,175.24	1.00	49,931,175.24	3.04
9	OP CORPORATE BANK PLC CP	コマーシャル ・ペーパー	フィンランド	0.90	2016年10月19日	50,000,000	1.00	49,902,723.72	1.00	49,902,723.72	3.04
10	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	イギリス	0.68	2016年9月2日	49,000,000	1.00	48,971,357.19	1.00	48,971,357.19	2.98
11	ING BANK NV CP	コマーシャル ・ペーパー	オランダ	0.71	2016年9月7日	49,000,000	1.00	48,965,291.79	1.00	48,965,291.79	2.98
12	CHIBA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	0.70	2016年8月5日	48,000,000	1.00	48,000,000.00	1.00	48,000,000.00	2.92
13	SNCF RESEAU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.76	2016年10月21日	45,000,000	1.00	44,924,145.72	1.00	44,924,145.72	2.73
14	MIZUHO CORP BANK SYDNEY CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	0.77	2016年10月12日	43,000,000	1.00	42,934,828.06	1.00	42,934,828.06	2.61
15	SHIZUOKA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	0.88	2016年10月27日	35,000,000	1.00	35,000,000.00	1.00	35,000,000.00	2.13
16	BANQUE FED. CRED. MU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.73	2016年9月1日	33,000,000	1.00	32,979,962.33	1.00	32,979,962.33	2.01
17	CHIBA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	0.70	2016年8月2日	30,000,000	1.00	30,000,000.00	1.00	30,000,000.00	1.83
18	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.67	2016年8月5日	30,000,000	1.00	29,998,315.20	1.00	29,998,315.20	1.83
19	CAISSE DES DEPOS ET C CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.63	2016年9月12日	30,000,000	1.00	29,978,510.48	1.00	29,978,510.48	1.82
20	SAXONY-ANHALT CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	0.75	2016年10月11日	30,000,000	1.00	29,956,333.60	1.00	29,956,333.60	1.82
21	CADES (CAISSE D'AMORT) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.75	2016年10月25日	30,000,000	1.00	29,947,600.40	1.00	29,947,600.40	1.82
22	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	イギリス	0.67	2016年9月21日	29,000,000	1.00	28,973,060.02	1.00	28,973,060.02	1.76
23	SCHLUMBERGER FINANCE CP	コマーシャル ・ペーパー	アメリカ合衆国	0.65	2016年9月23日	29,000,000	1.00	28,972,816.81	1.00	28,972,816.81	1.76
24	SHOKO CHUKIN BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	0.70	2016年9月30日	28,000,000	1.00	28,000,000.00	1.00	28,000,000.00	1.70
25	ACOSS CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.67	2016年8月9日	28,000,000	1.00	27,996,358.44	1.00	27,996,358.44	1.70
26	OP CORPORATE BANK PLC CP	コマーシャル ・ペーパー	フィンランド	0.79	2016年9月20日	28,000,000	1.00	27,969,933.85	1.00	27,969,933.85	1.70
27	CAISSE DES DEPOS ET C CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.65	2016年9月13日	21,000,000	1.00	20,984,100.63	1.00	20,984,100.63	1.28
28	SHIZUOKA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	0.62	2016年8月22日	20,000,000	1.00	20,000,000.00	1.00	20,000,000.00	1.22
29	SNCF RESEAU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.61	2016年8月10日	20,000,000	1.00	19,997,314.88	1.00	19,997,314.88	1.22
30	SCHLUMBERGER FINANCE CP	コマーシャル ・ペーパー	アメリカ合衆国	0.60	2016年8月23日	20,000,000	1.00	19,993,010.50	1.00	19,993,010.50	1.22

オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

順位	銘柄	種類	発行国	利率 (%)	償還日	名目保有高	簿価(豪ドル)		時価(豪ドル)		投資 比率 (%)
							単価	総額	単価	総額	
1	BANK OF TOKYO MITSUBISHI CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	2.05	2016年9月23日	48,000,000	1.00	47,858,615.25	1.00	47,858,615.25	4.48
2	L-BANK BW FOERDERBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.87	2016年8月16日	47,000,000	1.00	46,965,983.32	1.00	46,965,983.32	4.39
3	BANQUE FED. CRED. MU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.20	2016年10月6日	46,000,000	1.00	45,818,299.46	1.00	45,818,299.46	4.28
4	CAISSE DES DEPOS ET C CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.91	2016年8月5日	40,000,000	1.00	39,993,647.64	1.00	39,993,647.64	3.74
5	OP CORPORATE BANK PLC CP	コマーシャル ・ペーパー	フィンランド	1.97	2016年10月27日	34,000,000	1.00	33,840,793.76	1.00	33,840,793.76	3.16
6	DZ PRIVATBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	2.21	2016年10月14日	31,000,000	1.00	30,861,848.64	1.00	30,861,848.64	2.89
7	ANZ BANKING GROUP CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.97	2016年8月15日	30,000,000	1.00	29,978,772.19	1.00	29,978,772.19	2.80
8	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	2.08	2016年8月26日	30,000,000	1.00	29,958,520.93	1.00	29,958,520.93	2.80
9	COM. BK OF AUSTRALIA CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.88	2016年9月16日	30,000,000	1.00	29,929,833.61	1.00	29,929,833.61	2.80
10	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.02	2016年8月10日	28,000,000	1.00	27,987,495.37	1.00	27,987,495.37	2.62
11	UNITED OVERSEAS BANK CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.88	2016年9月2日	27,000,000	1.00	26,956,433.46	1.00	26,956,433.46	2.52
12	STANDARD CHARTERED BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	シンガポール	1.97	2016年9月16日	27,000,000	1.00	26,933,845.60	1.00	26,933,845.60	2.52
13	INTL FIN CORP	社債	国際機関	5.00	2016年8月3日	25,000,000	1.00	25,002,037.05	1.00	25,002,037.05	2.34
14	OCBC SYDNEY CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.95	2016年9月20日	25,000,000	1.00	24,933,974.78	1.00	24,933,974.78	2.33
15	ING BANK NV SYDNEY CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	2.02	2016年9月28日	25,000,000	1.00	24,920,469.99	1.00	24,920,469.99	2.33
16	TOYOTA FINANCE AUS CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.97	2016年10月21日	25,000,000	1.00	24,890,828.78	1.00	24,890,828.78	2.33
17	CADES (CAISSE D'AMORT) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.01	2016年11月2日	25,000,000	0.99	24,872,267.96	0.99	24,872,267.96	2.33
18	FMS WERTMANAGEMENT CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.94	2016年10月20日	23,000,000	1.00	22,902,566.93	1.00	22,902,566.93	2.14
19	FMS WERTMANAGEMENT CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.94	2016年10月21日	23,000,000	1.00	22,901,591.90	1.00	22,901,591.90	2.14
20	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.02	2016年9月27日	22,000,000	1.00	21,931,114.64	1.00	21,931,114.64	2.05
21	SAXONY-ANHALT CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.95	2016年8月23日	20,000,000	1.00	19,977,362.70	1.00	19,977,362.70	1.87
22	SNCF RESEAU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.96	2016年8月24日	20,000,000	1.00	19,976,163.70	1.00	19,976,163.70	1.87
23	ING BANK NV SYDNEY CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.95	2016年9月1日	20,000,000	1.00	19,967,657.80	1.00	19,967,657.80	1.87
24	SAXONY-ANHALT CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.97	2016年9月9日	20,000,000	1.00	19,958,619.32	1.00	19,958,619.32	1.87
25	CADES (CAISSE D'AMORT) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.97	2016年10月24日	20,000,000	1.00	19,909,625.96	1.00	19,909,625.96	1.86
26	WESTPAC BKG	社債	オーストラリア	7.25	2016年11月18日	18,100,000	1.01	18,370,249.59	1.01	18,370,249.59	1.72
27	RABOBANK NEDERLAND AU CP	コマーシャル ・ペーパー	オランダ	1.98	2016年10月18日	18,000,000	1.00	17,924,149.63	1.00	17,924,149.63	1.68
28	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.99	2016年10月26日	17,000,000	1.00	16,920,726.44	1.00	16,920,726.44	1.58
29	INTL BK RECON AND DEV	社債	国際機関	2.85	2016年9月26日	16,300,000	1.00	16,312,527.08	1.00	16,312,527.08	1.53
30	RABOBANK NEDERLAND AU CP	コマーシャル ・ペーパー	オランダ	2.05	2016年8月9日	16,000,000	1.00	15,993,655.22	1.00	15,993,655.22	1.50

カナダ・ドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

順位	銘柄	種類	発行国	利率 (%)	償還日	名目保有高	簿価(カナダ・ドル)		時価(カナダ・ドル)		投資 比率 (%)
							単価	総額	単価	総額	
1	CANADIAN IMP BK	社債	カナダ	2.65	2016年11月8日	4,000,000	1.00	4,018,610.70	1.00	4,018,610.70	7.23
2	NOVA SCOTIA PROV	政府債	カナダ	4.60	2016年8月18日	4,000,000	1.00	4,006,896.84	1.00	4,006,896.84	7.21
3	TORONTO BANK	社債	カナダ	2.948	2016年8月2日	4,000,000	1.00	4,000,000.00	1.00	4,000,000.00	7.19
4	BANQUE FED. CRED. MU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	0.75	2016年8月9日	3,800,000	1.00	3,799,447.30	1.00	3,799,447.30	6.83
5	MANITOBA T-BILL	政府債	カナダ	0.00	2016年9月7日	3,500,000	1.00	3,497,825.16	1.00	3,497,825.16	6.29
6	SWEDISH EXPORT CREDIT	政府債	スウェーデン	2.00	2016年8月10日	3,310,000	1.00	3,310,805.63	1.00	3,310,805.63	5.95
7	MUNICIPAL FIN. AUTHOR CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	0.67	2016年8月24日	3,300,000	1.00	3,298,651.98	1.00	3,298,651.98	5.93
8	KFW CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	0.63	2016年8月24日	3,000,000	1.00	2,998,846.18	1.00	2,998,846.18	5.39
9	NATIONAL BANK OF CANADA BA	銀行引受手形	カナダ	0.74	2016年9月14日	2,600,000	1.00	2,597,704.07	1.00	2,597,704.07	4.67
10	ONTARIO T BILL	政府債	カナダ	0.00	2016年8月31日	2,000,000	1.00	1,999,002.67	1.00	1,999,002.67	3.59
11	SASKATCHEWAN (PROVINCE) PN	政府債	カナダ	0.63	2016年9月23日	2,000,000	1.00	1,998,177.44	1.00	1,998,177.44	3.59
12	NEW BRUNSWICK T-BILL	政府債	カナダ	0.00	2016年10月13日	2,000,000	1.00	1,997,634.32	1.00	1,997,634.32	3.59
13	BANK OF NOVA SCOTIA	社債	カナダ	2.10	2016年11月8日	1,800,000	1.00	1,806,048.09	1.00	1,806,048.09	3.25
14	CAISSE CENTRALE DESJARDN	社債	カナダ	2.281	2016年10月17日	1,600,000	1.00	1,604,832.81	1.00	1,604,832.81	2.89
15	SASKATCHEWAN (PROVINCE) PN	政府債	カナダ	0.60	2016年11月9日	1,500,000	1.00	1,497,525.00	1.00	1,497,525.00	2.69
16	QUEBEC T-BILL	政府債	カナダ	0.00	2016年9月2日	1,400,000	1.00	1,399,254.70	1.00	1,399,254.70	2.52
17	NATIONAL BANK OF CANADA BA	銀行引受手形	カナダ	0.75	2016年10月3日	1,400,000	1.00	1,398,189.60	1.00	1,398,189.60	2.51
18	BANK OF MONTREAL	社債	カナダ	2.96	2016年8月2日	1,000,000	1.00	1,000,000.00	1.00	1,000,000.00	1.80
19	NEWFOUNDLAND T-BILL	政府債	カナダ	0.00	2016年8月4日	1,000,000	1.00	999,964.08	1.00	999,964.08	1.80

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

(2016年7月末日現在)

順位	銘柄	種類	発行国	利率 (%)	償還日	名目保有高	簿価 (ニュージーランド・ドル)		時価 (ニュージーランド・ドル)		投資 比率 (%)
							単価	総額	単価	総額	
1	AUSTRALIA NZ BANKING CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	2.35	2016年8月5日	17,000,000	1.00	16,996,690.58	1.00	16,996,690.58	5.96
2	RABOBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	オランダ	2.40	2016年8月17日	17,000,000	1.00	16,983,103.28	1.00	16,983,103.28	5.96
3	TORONTO DOMINION BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	2.37	2016年10月28日	17,000,000	0.99	16,903,218.68	0.99	16,903,218.68	5.93
4	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.50	2016年10月25日	17,000,000	0.99	16,901,456.06	0.99	16,901,456.06	5.93
5	DZ PRIVATBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	2.47	2016年8月24日	16,000,000	1.00	15,976,000.25	1.00	15,976,000.25	5.60
6	SUMITOMO MITSUI TRUST CD	譲渡性 預金証書	イギリス	2.40	2016年9月21日	15,000,000	1.00	15,000,000.00	1.00	15,000,000.00	5.26
7	OP CORPORATE BANK PLC CP	コマーシャル ・ペーパー	フィンランド	2.50	2016年8月12日	15,000,000	1.00	14,989,649.15	1.00	14,989,649.15	5.26
8	CAISSE DES DEPOS ET C CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.44	2016年9月26日	15,000,000	1.00	14,944,437.32	1.00	14,944,437.32	5.24
9	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	イギリス	2.45	2016年9月29日	15,000,000	1.00	14,941,167.87	1.00	14,941,167.87	5.24
10	KIWI BANK LTD CP	コマーシャル ・ペーパー	ニュージー ランド	2.47	2016年10月14日	15,000,000	1.00	14,925,342.07	1.00	14,925,342.07	5.24
11	BANQUE FED. CRED. MU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.74	2016年10月11日	15,000,000	0.99	14,920,657.00	0.99	14,920,657.00	5.23
12	STANDARD CHARTERED BANK CD	譲渡性 預金証書	シンガポール	2.49	2016年9月15日	14,000,000	1.00	14,000,000.00	1.00	14,000,000.00	4.91
13	BANK OF TOKYO MITSUBISHI CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	2.43	2016年9月2日	14,000,000	1.00	13,970,872.17	1.00	13,970,872.17	4.90
14	ING BANK NV SYDNEY CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	2.40	2016年10月20日	14,000,000	0.99	13,926,716.09	0.99	13,926,716.09	4.89
15	DNB BANK ASA CP	コマーシャル ・ペーパー	ノルウェー	2.34	2016年9月6日	13,000,000	1.00	12,970,606.26	1.00	12,970,606.26	4.55
16	MIZUHO CORP BANK SYDNEY CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	2.47	2016年10月7日	10,000,000	1.00	9,954,997.55	1.00	9,954,997.55	3.49
17	GENERAL ELEC CAP CORP	社債	アメリカ合衆国	4.25	2016年8月16日	3,950,000	1.00	3,952,549.94	1.00	3,952,549.94	1.39

()投資不動産物件

該当事項なし(2016年7月末日現在)。

()その他投資資産の主要なもの

該当事項なし(2016年7月末日現在)。

(2) 運用実績

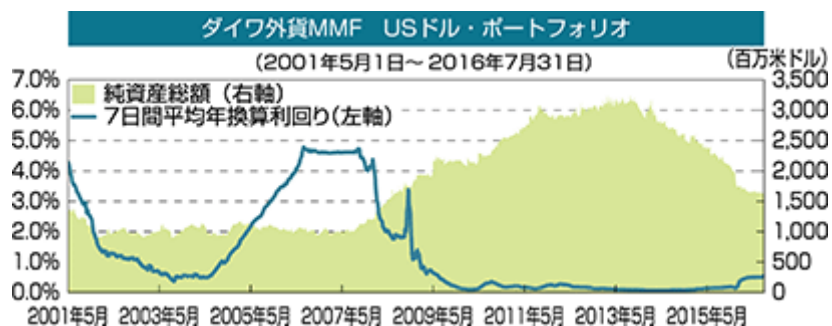
純資産の推移

2016年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は、以下のとおりである。

USドル・ポートフォリオ

	純資産総額		1口当たりの純資産価格	
	千米ドル	百万円	米ドル	円
2015年8月末日	2,256,617	235,636	0.01	1
9月末日	2,143,059	223,778	0.01	1
10月末日	2,089,339	218,169	0.01	1
11月末日	2,001,240	208,969	0.01	1
12月末日	1,741,744	181,873	0.01	1
2016年1月末日	1,726,968	180,330	0.01	1
2月末日	1,715,371	179,119	0.01	1
3月末日	1,658,353	173,165	0.01	1
4月末日	1,658,836	173,216	0.01	1
5月末日	1,651,071	172,405	0.01	1
6月末日	1,645,492	171,822	0.01	1
7月末日	1,643,226	171,586	0.01	1

純資産総額および7日間平均年換算利回りの推移

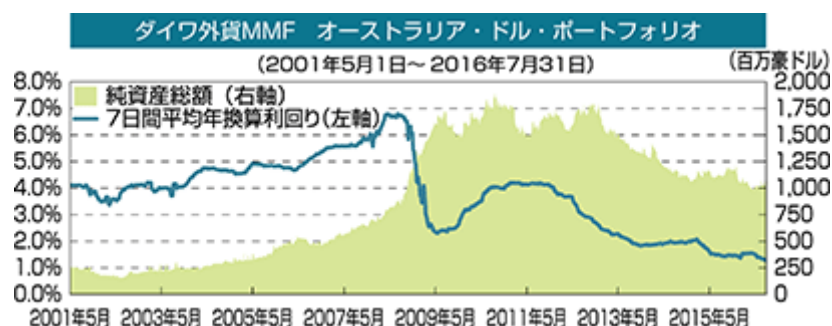


(注) 7日間平均年換算利回りとは、課税前の7日間平均利回りを年率換算したものである。以下同じ。

オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

	純資産総額		1口当たりの純資産価格	
	千豪ドル	百万円	豪ドル	円
2015年8月末日	1,120,972	88,064	0.01	1
9月末日	1,185,673	93,146	0.01	1
10月末日	1,169,014	91,838	0.01	1
11月末日	1,201,113	94,359	0.01	1
12月末日	1,052,532	82,687	0.01	1
2016年1月末日	1,055,651	82,932	0.01	1
2月末日	1,062,677	83,484	0.01	1
3月末日	995,110	78,176	0.01	1
4月末日	1,006,543	79,074	0.01	1
5月末日	1,013,301	79,605	0.01	1
6月末日	1,032,377	81,104	0.01	1
7月末日	1,069,391	84,011	0.01	1

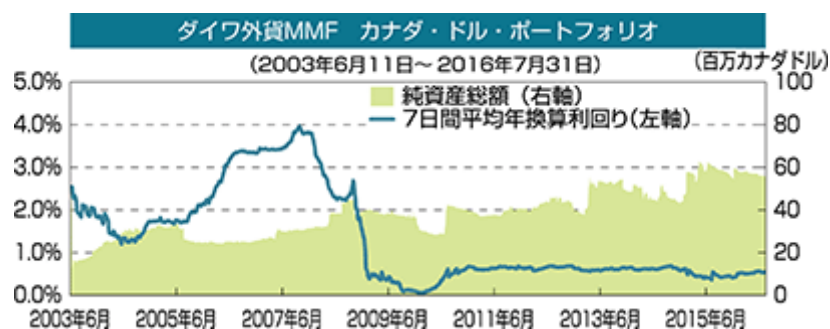
純資産総額および7日間平均年換算利回りの推移



カナダ・ドル・ポートフォリオ

	純資産総額		1口当たりの純資産価格	
	千カナダ・ドル	百万円	カナダ・ドル	円
2015年8月末日	58,963	4,682	0.01	1
9月末日	58,664	4,659	0.01	1
10月末日	57,759	4,587	0.01	1
11月末日	55,971	4,445	0.01	1
12月末日	59,165	4,698	0.01	1
2016年1月末日	57,962	4,603	0.01	1
2月末日	57,830	4,592	0.01	1
3月末日	57,419	4,560	0.01	1
4月末日	57,037	4,529	0.01	1
5月末日	56,874	4,516	0.01	1
6月末日	56,050	4,451	0.01	1
7月末日	55,607	4,416	0.01	1

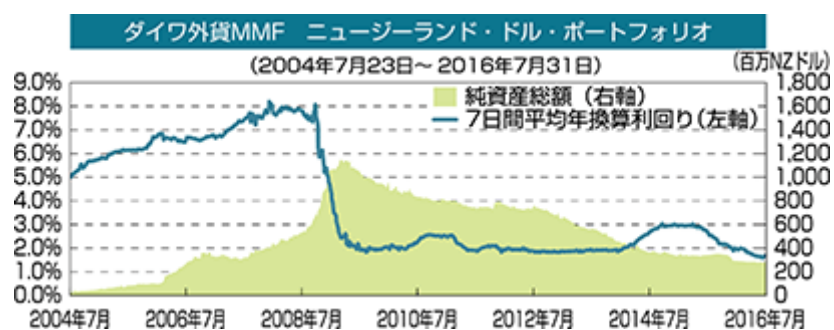
純資産総額および7日間平均年換算利回りの推移



ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

	純資産総額		1口当たりの純資産価格	
	千ニュージーランド・ドル	百万円	ニュージーランド・ドル	円
2015年8月末日	346,864	25,727	0.01	1
9月末日	351,300	26,056	0.01	1
10月末日	345,230	25,606	0.01	1
11月末日	338,696	25,121	0.01	1
12月末日	291,769	21,641	0.01	1
2016年1月末日	291,960	21,655	0.01	1
2月末日	290,024	21,511	0.01	1
3月末日	282,701	20,968	0.01	1
4月末日	284,025	21,066	0.01	1
5月末日	280,250	20,786	0.01	1
6月末日	281,325	20,866	0.01	1
7月末日	285,073	21,144	0.01	1

純資産総額および7日間平均年換算利回りの推移



分配の推移

ファンド証券の1口当たり純資産価格が1米セント、1豪セント、1カナダ・セントおよび1ニュージーランド・セント(各ポートフォリオの基準価格)となるような額の分配が日々、行われている。分配は各暦月の最終取引日の直前の取引日(分配再投資日)に宣言され、発生済未払いのすべての分配金は税金を控除後、自動的に再投資されている。下記は2016年7月までの1年間における前月最終営業日から各月最終営業日前日まで保有した場合に再投資された月次分配金の額(10,000口当たりの累計額)を表示した。

月次分配金(10,000口当たり)

最終営業日	USドル・ ポートフォリオ (米ドル)	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ (豪ドル)	カナダ・ドル・ ポートフォリオ (カナダ・ドル)	ニュージーランド ・ドル・ ポートフォリオ (ニュージーランド ・ドル)
2015年8月28日	0.01375	0.11062	0.03769	0.19280
2015年9月30日	0.01762	0.13097	0.03930	0.21238
2015年10月30日	0.01715	0.12109	0.03575	0.17856
2015年11月30日	0.01756	0.12415	0.03822	0.18133
2015年12月30日	0.01570	0.11730	0.03461	0.16362
2016年1月29日	0.02956	0.12157	0.04023	0.16075
2016年2月29日	0.03952	0.13064	0.04432	0.16712
2016年3月31日	0.04300	0.13174	0.04334	0.16268
2016年4月28日	0.04017	0.11742	0.03970	0.13799
2016年5月31日	0.04774	0.12994	0.04908	0.15470
2016年6月30日	0.04372	0.11224	0.04576	0.13568
2016年7月29日	0.04330	0.10403	0.04273	0.13070

以下は上記保有期間における平均利回りを示したものである。

最終営業日	USドル・ ポートフォリオ (%)	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ (%)	カナダ・ドル・ ポートフォリオ (%)	ニュージーランド ・ドル・ ポートフォリオ (%)
2015年8月28日	0.17924	1.44201	0.49131	2.51328
2015年9月30日	0.19488	1.44860	0.43468	2.34905
2015年10月30日	0.20865	1.47326	0.43495	2.17248
2015年11月30日	0.20675	1.46176	0.45000	2.13501
2015年12月30日	0.19101	1.42715	0.42108	1.99071
2016年1月29日	0.35964	1.47910	0.48946	1.95579
2016年2月29日	0.46531	1.53818	0.52183	1.96770
2016年3月31日	0.50629	1.55113	0.51029	1.91542
2016年4月28日	0.52364	1.53065	0.51751	1.79879
2016年5月31日	0.52803	1.43721	0.54285	1.71107
2016年6月30日	0.53192	1.36558	0.55674	1.65077
2016年7月29日	0.54498	1.30934	0.53780	1.64501

2016年7月末日までの1年間における上記月次分配金(10,000口当たり)の合計額は、以下のとおりである。

2015年8月～ 2016年7月	USドル・ ポートフォリオ (米ドル)	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ (豪ドル)	カナダ・ドル・ ポートフォリオ (カナダ・ドル)	ニュージーランド ・ドル・ ポートフォリオ (ニュージーランド ・ドル)
	0.36879	1.45171	0.49073	1.97831

収益率の推移

2016年7月末日までの1年間における収益率は、以下のとおりである。

2015年8月～ 2016年7月	収益率(%) ^(注)			
	USドル・ ポートフォリオ	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ	カナダ・ドル・ ポートフォリオ	ニュージーランド ・ドル・ ポートフォリオ
	0.36879	1.45171	0.49073	1.97831

(注) 各ポートフォリオは、1口当たり純資産価格について変動がないため、本書に開示の収益率(10,000口当たり)は、2016年7月末日までの1年間における月次分配金の累計額を用いて、以下の計算式により算出された。

$$\text{収益率}(\%) = 100 \times (a-b) / b$$

a = 2016年7月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計額を加えた額)

b = 当該期間の直前の日の1口当たり純資産価格(分配前の額)

[次へ](#)

2 販売及び買戻しの実績

2016年7月末日前1年間の販売および買戻しの実績ならびに2016年7月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

USドル・ポートフォリオ

販売口数	買戻口数	発行済口数
206,014,348,799 (206,014,348,799)	263,830,070,038 (263,830,070,038)	164,334,336,635 (164,334,336,635)

(注) ()の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。以下同じ。

オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

販売口数	買戻口数	発行済口数
96,397,247,679 (96,397,247,679)	101,424,871,807 (101,424,871,807)	106,880,533,299 (106,880,533,299)

カナダ・ドル・ポートフォリオ

販売口数	買戻口数	発行済口数
1,590,632,797 (1,590,632,797)	2,015,182,931 (2,015,182,931)	5,566,169,273 (5,566,169,273)

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

販売口数	買戻口数	発行済口数
17,410,683,825 (17,410,683,825)	23,223,427,637 (23,223,427,637)	28,494,828,520 (28,494,828,520)

[前へ](#)

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a. ダイワ外貨MMFの日本語の中間財務書類は、財務報告基準第102号「英連合王国およびアイルランド共和国において適用される財務報告基準」および財務報告基準第104号「中間財務報告」を含む、財務報告評議会によって発行されるアイルランド会計基準に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. ダイワ外貨MMFの中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c. ダイワ外貨MMFの原文の中間財務書類は、米ドル、豪ドル、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、以下の平成28年7月29日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値で換算されている。

1米ドル	=	104.42円
1豪ドル	=	78.56円
1カナダ・ドル	=	79.41円
1ニュージーランド・ドル	=	74.17円

なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

[前へ](#)

[次へ](#)

(1) 資産及び負債の状況

ダイワ外貨MMF
USドル・ポートフォリオ
 財政状態計算書
 2016年6月30日現在

	注記	2016年6月30日		2015年12月31日	
		(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
資産					
定期預金を含む現預金	5	247,149,539	25,807,355	612,115,328	63,917,083
未収債権	6	1,854,928	193,692	42,003,106	4,385,964
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	2,3,4	1,404,302,676	146,637,285	1,464,686,647	152,942,580
資産合計		1,653,307,143	172,638,332	2,118,805,081	221,245,627
負債					
未払債務	7	7,815,511	816,096	377,060,877	39,372,697
(買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く)負債		7,815,511	816,096	377,060,877	39,372,697
買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産		1,645,491,632	171,822,236	1,741,744,204	181,872,930

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF
USドル・ポートフォリオ

包括利益計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

	注記	2016年6月30日		2015年6月30日	
		(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
収益					
損益を通じて公正価値で測定する金融商品に係る純利益	2	4,902,884	511,959	2,870,076	299,693
純収益合計		4,902,884	511,959	2,870,076	299,693
費用					
投資運用報酬	9	39,589	4,134	56,337	5,883
管理事務報酬		29,362	3,066	41,783	4,363
副保管報酬	9	31,589	3,299	44,952	4,694
受託会社報酬	9	15,753	1,645	22,417	2,341
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	461,477	48,187	661,037	69,025
監査報酬		16,443	1,717	13,086	1,366
その他の費用		228,684	23,879	226,394	23,640
費用合計		822,897	85,927	1,066,006	111,312
ファイナンス費用					
分配金	11	(4,079,987)	(426,032)	(1,804,070)	(188,381)
分配後の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動					

利益および損失は、専ら継続運用から生じた。

当包括利益計算書に表示された以外に、認識損益はない。

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF

USドル・ポートフォリオ

買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

	2016年6月30日		2015年6月30日	
	(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
1月1日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	1,741,744,204	181,872,930	2,581,707,162	269,581,862
買戻可能受益証券の発行手取金	621,669,656	64,914,745	1,539,947,989	160,801,369
買戻可能受益証券の買戻支払金	(717,922,228)	(74,965,439)	(1,847,324,057)	(192,897,578)
6月30日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	1,645,491,632	171,822,236	2,274,331,094	237,485,653

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

財政状態計算書
 2016年6月30日現在

	注記	2016年6月30日		2015年12月31日	
		(豪ドル)	(千円)	(豪ドル)	(千円)
資産					
定期預金を含む現預金	5	183,767,778	14,436,797	511,017,375	40,145,525
未収債権	6	575,950	45,247	10,217,669	802,700
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	2,3,4	852,260,189	66,953,560	583,635,936	45,850,439
資産合計		<u>1,036,603,917</u>	<u>81,435,604</u>	<u>1,104,870,980</u>	<u>86,798,664</u>
負債					
未払債務	7	4,226,493	332,033	52,338,510	4,111,713
(買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く)負債		<u>4,226,493</u>	<u>332,033</u>	<u>52,338,510</u>	<u>4,111,713</u>
買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産		<u>1,032,377,424</u>	<u>81,103,570</u>	<u>1,052,532,470</u>	<u>82,686,951</u>

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ
 包括利益計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

注記	2016年6月30日		2015年6月30日		
	(豪ドル)	(千円)	(豪ドル)	(千円)	
収益					
損益を通じて公正価値で測定する金融商品に係る純利益	2	11,263,402	884,853	13,529,492	1,062,877
純収益合計		11,263,402	884,853	13,529,492	1,062,877
費用					
投資運用報酬	9	650,603	51,111	692,762	54,423
管理事務報酬		163,764	12,865	177,867	13,973
副保管報酬	9	176,361	13,855	191,549	15,048
受託会社報酬	9	88,180	6,927	95,775	7,524
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	2,562,685	201,325	2,795,805	219,638
監査報酬		6,988	549	5,831	458
その他の費用		108,521	8,525	45,473	3,572
費用合計		3,757,102	295,158	4,005,062	314,638
ファイナンス費用					
分配金	11	(7,506,300)	(589,695)	(9,524,430)	(748,239)
分配後の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動					

利益および損失は、専ら継続運用から生じた。

当包括利益計算書に表示された以外に、認識損益はない。

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF

オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

	2016年6月30日		2015年6月30日	
	(豪ドル)	(千円)	(豪ドル)	(千円)
1月1日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	1,052,532,470	82,686,951	1,082,400,148	85,033,356
買戻可能受益証券の発行手取金	379,350,744	29,801,794	550,179,090	43,222,069
買戻可能受益証券の買戻支払金	(399,505,790)	(31,385,175)	(516,463,049)	(40,573,337)
6月30日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	1,032,377,424	81,103,570	1,116,116,189	87,682,088

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF
カナダ・ドル・ポートフォリオ

財政状態計算書

2016年6月30日現在

	注記	2016年6月30日		2015年12月31日	
		(カナダ・ドル)	(千円)	(カナダ・ドル)	(千円)
資産					
定期預金を含む現預金	5	8,772,966	696,661	18,040,022	1,432,558
未収債権	6	9,594	762	232,973	18,500
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	2,3,4	47,313,740	3,757,184	44,071,932	3,499,752
資産合計		56,096,300	4,454,607	62,344,927	4,950,811
負債					
未払債務	7	46,103	3,661	3,180,140	252,535
(買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く)負債		46,103	3,661	3,180,140	252,535
買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産		56,050,197	4,450,946	59,164,787	4,698,276

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF

カナダ・ドル・ポートフォリオ

包括利益計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

	注記	2016年6月30日		2015年6月30日	
		(カナダ・ドル)	(千円)	(カナダ・ドル)	(千円)
収益					
損益を通じて公正価値で測定する金融商品に係る純利益	2	185,538	14,734	243,083	19,303
純収益合計		185,538	14,734	243,083	19,303
費用					
投資運用報酬	9	1,285	102	9,825	780
管理事務報酬		928	74	4,184	332
副保管報酬	9	999	79	4,506	358
受託会社報酬	9	500	40	2,253	179
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	14,267	1,133	65,813	5,226
監査報酬		511	41	263	21
その他の費用		16,511	1,311	23,351	1,854
費用合計		35,001	2,779	110,195	8,751
ファイナンス費用					
分配金	11	(150,537)	(11,954)	(132,888)	(10,553)
分配後の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動					

利益および損失は、専ら継続運用から生じた。

当包括利益計算書に表示された以外に、認識損益はない。

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF

カナダ・ドル・ポートフォリオ

買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

	2016年6月30日		2015年6月30日	
	(カナダ・ドル)	(千円)	(カナダ・ドル)	(千円)
1月1日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	59,164,787	4,698,276	43,730,822	3,472,665
買戻可能受益証券の発行手取金	3,534,785	280,697	38,626,849	3,067,358
買戻可能受益証券の買戻支払金	(6,649,375)	(528,027)	(20,474,870)	(1,625,909)
6月30日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	56,050,197	4,450,946	61,882,801	4,914,113

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

財政状態計算書

2016年6月30日現在

	注記	2016年6月30日		2015年12月31日	
		(ニュージーランド・ドル)	(千円)	(ニュージーランド・ドル)	(千円)
資産					
定期預金を含む現預金	5	32,723,181	2,427,078	135,740,342	10,067,861
未収債権	6	196,011	14,538	2,042,026	151,457
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	2,3,4	249,442,338	18,501,138	185,900,864	13,788,267
資産合計		282,361,530	20,942,755	323,683,232	24,007,585
負債					
未払債務	7	1,036,952	76,911	31,914,381	2,367,090
(買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く)負債		1,036,952	76,911	31,914,381	2,367,090
買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産		281,324,578	20,865,844	291,768,851	21,640,496

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

包括利益計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

注記	2016年6月30日		2015年6月30日		
	(ニュージーランド・ドル)	(千円)	(ニュージーランド・ドル)	(千円)	
収益					
損益を通じて公正価値で測定する金融商品に係る純利益	2	3,628,429	269,121	6,053,975	449,023
純収益合計		3,628,429	269,121	6,053,975	449,023
費用					
投資運用報酬	9	208,631	15,474	246,382	18,274
管理事務報酬		45,203	3,353	53,383	3,959
副保管報酬	9	48,681	3,611	57,489	4,264
受託会社報酬	9	24,340	1,805	28,745	2,132
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	711,524	52,774	839,946	62,299
監査報酬		2,262	168	1,467	109
その他の費用		32,296	2,395	13,047	968
費用合計		1,072,937	79,580	1,240,459	92,005
ファイナンス費用					
分配金	11	(2,555,492)	(189,541)	(4,813,516)	(357,018)
分配後の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動					

利益および損失は、専ら継続運用から生じた。

当包括利益計算書に表示された以外に、認識損益はない。

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

ダイワ外貨MMF

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の変動計算書

2016年6月30日に終了した6か月間

	2016年6月30日		2015年6月30日	
	(ニュージーランド・ドル)	(千円)	(ニュージーランド・ドル)	(千円)
1月1日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	291,768,851	21,640,496	337,524,731	25,034,209
買戻可能受益証券の発行手取金	67,899,492	5,036,105	116,440,635	8,636,402
買戻可能受益証券の買戻支払金	(78,343,765)	(5,810,757)	(114,909,663)	(8,522,850)
6月30日現在の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産	281,324,578	20,865,844	339,055,703	25,147,761

添付の注記および投資有価証券明細表は、当財務書類の一部である。

[前へ](#)[次へ](#)

ダイワ外貨MMF

財務書類に対する注記

2016年6月30日

1. 一般的情報

ダイワ外貨MMFは、1996年7月5日付の信託証書(1996年7月17日付の第一補足信託証書で改正済)により、アイルランドに所在するユニット・トラストとして設定された。2006年6月23日付で、ダイワ外貨MMFの存続期限は無期限に延長された。ダイワ外貨MMFは、1990年ユニット・トラスト法の下でその規定に従って設定されたアンブレラ型ユニット・トラストである。ダイワ外貨MMFは、2015年6月18日付で、個人投資家向けオルタナティブ投資ファンドとしてアイルランド中央銀行(「中央銀行」)により認可された。新目論見書は2015年6月18日付で中央銀行により認可されている。

ダイワ外貨MMFは、異なるクラス証券を随時発行することができるアンブレラ型ファンドである。各クラス証券は、それぞれ別個の投資ポートフォリオを構成するファンドにおける権益を表章する。発行済クラス証券は、USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオ、カナダ・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオであった。

当財務書類に記載されるようにダイワ外貨MMFは、USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオ、カナダ・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオの財務情報に言及する。

エスエムティー・ファンド・サービシーズ(アイルランド)リミテッド(「管理会社」)はダイワ外貨MMFのオルタナティブ投資ファンド運用会社(AIFM)である。

2. 重要な会計方針

ダイワ外貨MMFが採用している重要な会計方針は、以下のとおりである。

作成の基準

ダイワ外貨MMFの財務書類は、損益を通じて公正価値で保有する金融商品の再評価額を計上して修正される取得原価主義に従い、財務報告基準第102号「英連合王国およびアイルランド共和国において適用される財務報告基準」(「FRS102」)および財務報告基準第104号「中間財務報告」(「FR104」)を含む、財務報告評議会によって発行されるアイルランド会計基準に準拠して作成されている。

財務書類は継続企業の前提を基礎として作成されている。

FRS102およびFRS104に準拠した財務書類の作成は、経営者が、方針の適用ならびに資産および負債、収益および費用の報告金額に影響を与える判断、見積りおよび仮定を行うことを要求している。見積りおよび関連する仮定は、状況において適切と考えられる過去の経験およびその他の様々な要因に基づいている。その結果は、その他の情報源からは容易に明らかにならない資産および負債の帳簿価額に関する判断を下す基礎を形成する。実際の結果はこれらの見積りと異なる可能性がある。見積りおよび基礎となる仮定は継続的に見直される。会計上の見積りの修正は、修正が当該事業年度だけに影響を与える場合は、見積りが修正される事業年度においてまとめられ、修正が当事業年度および将来事業年度に影響を与える場合は、修正事業年度および将来事業年度においてまとめられる。

投資有価証券

当カテゴリーは、トレーディング目的の金融資産および負債と、当初に経営陣により損益計算書を通じて公正価値で測定すると指定を受けた金融資産および負債の2つのサブカテゴリーに分けられる。

ダイワ外貨MMFは、損益を通じて公正価値で測定される金融資産として債務証券への投資を分類する。当該金融資産は、取引用の保有として分類されるかまたは開始時に損益を通じて公正価値で測定されるものと管理会社によって指定される。投資有価証券は、公正価値の最良推定値として償却原価技法を用いた公正価額(つまりプレミアムの償却またはディスカウントの付加を調整した取得価額)で評価される、短期債務証券から構成される。投資有価証券が公正な市場価格で表示されることを確保するため、管理会社は継続して評価の償却原価法を査定する。

現金その他の流動資産は、額面価額に(適用ある場合)当該日の終了までのクーポン未収利息を付して評価される。

FRS102の公正価値の測定に基づいて、ダイワ外貨MMFは、IAS39号金融商品の認識および測定の規定を採用する。

認識/承認取消

投資有価証券の通常の購入および売却は、取引日(ダイワ外貨MMFが投資有価証券の購入または売却を行う日)に認識される。投資有価証券からキャッシュ・フローを受け取る権利が終了した時、またはダイワ外貨MMFが所有権のリスクおよび利益を実質上すべて譲渡した時に、投資有価証券の承認が取り消される。

外貨

資産および負債は、個別ポートフォリオが運用する、主要な経済環境の通貨(機能通貨)を用いて計算される。これは、それぞれ米ドル、豪ドル、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルである。外貨建ての資産および負債は、期末日の為替レートで米ドル、豪ドル、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルに換算される。公正価値で計上される非貨幣性の外貨建て資産および負債は、公正価値が測定される日に各基準通貨に転換される。取引活動から生じる外貨損益は、当期の包括利益計算書に計上される。

外貨換算

ダイワ外貨MMFは、日本の受益者から、米ドル、豪ドル、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドル建ての買戻可能受益証券の買付および買戻しを受託する。ダイワ外貨MMFの主要な活動は、信託証書に列挙されている公認の証券取引所において取引される高品質の固定および変動金利の債券に投資することによって当期利益をもたらしつつ、元本価値を保持し、また高い流動性を維持することである。USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオ、カナダ・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオの運用実績は、それぞれ米ドル、豪ドル、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルで測定され受益者に報告される。管理会社は、各通貨がそれぞれのポートフォリオの対象取引、事象および状況の経済的影響を最も誠実に表示する通貨とみなしている。USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオ、カナダ・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオの財務書類は、それぞれポートフォリオの機能および表示通貨である、米ドル(「USD」)、豪ドル(「AUD」)、カナダ・ドル(「CAD」)およびニュージーランド・ドル(「NZD」)で表示される。

公正価値

ダイワ外貨MMFは、2017年1月1日以降に開始する会計期間について効力を発する、FRS102-公正価値ヒエラルキーの開示についての公開草案FRED62を早期採用した。これは、測定を行う際に使用されるインプットの重要性を反映する公正価値ヒエラルキーを使用して公正価値測定を分類することをダイワ外貨MMFに要求している。

収益

受取利息は、実効利回り基準で会計処理される。有価証券に係るディスカウントおよびプレミアムは、当該証券の期間にわたり実効利回り基準で償却され取得される。これらは、包括利益計算書に「損益を通じて公正価値で測定する金融商品に係る純利益」として表示される。

費用

費用は、発生基準で会計処理される。

買戻可能受益証券

買戻可能受益証券は、受益者の選択により買い戻され、FRS102セクション22に従って金融負債として分類される。受益証券1口当たりの純資産価格は、分配宣言により0.01米ドル/0.01豪ドル/0.01カナダ・ドル/0.01ニュージーランド・ドルで維持される。

買戻可能受益証券は、ダイワ外貨MMFの純資産額の比例的部分に相当する現金によりいつでもダイワ外貨MMFに入れ戻すことができる。受益者がダイワ外貨MMFに受益証券を戻す旨の権利行使を表明した場合、買戻可能受益証券は、期/年度末日現在の買戻金額で計上される。

配当方針

管理会社は、各取引日に各ポートフォリオに関して分配金を宣言する。各ポートフォリオから分配される1口当たりの金額は、各ポートフォリオの当該通貨の100分の1の単位に各取引日のそれぞれの1口当たり純資産価格を維持するために要求される金額に相当する。

キャッシュ・フロー計算書

ダイワ外貨MMFは、キャッシュ・フロー計算書を作成しないというFRS102セクション7.1に従うオープン・エンド型投資信託に適用可能な免除規定を享受している。

3. 金融商品の公正価値

以下の表は、公正価値で認識される金融商品を表示し、以下に基づく公正価値で分析されている。

- ・同一の資産または負債に関する活発な市場における取引値（レベル1）、
- ・（価格について）直接的にまたは（価格から派生して）間接的に、資産または負債に関して観測可能なレベル1に含まれる取引値以外のインプットを含む（レベル2）、および
- ・観測可能な市場データ（観測できないインプット）に基づかない資産または負債に関するインプット（レベル3）。

	USドル・ ポートフォリオ レベル2 USD	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ レベル2 AUD	カナダ・ドル・ ポートフォリオ レベル2 CAD	ニュージー ランド・ドル・ ポートフォリオ レベル2 NZD
2016年6月30日				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産				
債務証券	1,403,847,283	850,535,065	47,034,175	249,416,045
クーポン未収利息	455,393	1,725,124	279,565	26,293
	1,404,302,676	852,260,189	47,313,740	249,442,338
2015年12月31日				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産				
債務証券	1,464,638,368	582,309,496	43,826,138	185,780,998
クーポン未収利息	48,279	1,326,440	245,794	119,866
	1,464,686,647	583,635,936	44,071,932	185,900,864

クラスが保有する全証券は、レベル2として分類される。2016年6月30日に終了した6か月間および2015年12月31日に終了した年度に、レベル間での重要な資産譲渡はなかった。

4. 投資有価証券

ダイワ外貨MMFの金融商品から生じる主なリスクは、以下のように要約される。

市場リスク

市場リスクは、保有金融商品の将来の価格の不確実性から生じる。それは、ダイワ外貨MMFが価格変動に直面した際に保有するマーケット・ポジションを通して被る潜在的損失を表す。市場リスクは、3種類のリスク(すなわち、価格リスク、通貨リスクおよび金利リスク)から構成されている。

価格リスク

その他の価格リスクは、ダイワ外貨MMFの金融商品の公正価値が金利または為替の動向以外の要因によって引き起こされる市場価格の変動の結果として変動するというリスクである。ダイワ外貨MMFの金融商品は、直接的にはその他の価格リスクにさらされていない。

通貨リスク

通貨リスクは、機能通貨以外の通貨のエクスポージャーの不利な値動きによりダイワ外貨MMFが被る潜在的損失を表す。各クラスの投資有価証券はすべて、当該クラスの機能通貨建てであり、財政状態計算書および包括利益計算書が為替変動の重大な影響を受けることはない。

金利リスク

かかるリスクは、金融商品の公正価値が市場の金利動向に起因して変動するリスクとして定義される。リスクは、公正価値が金利環境の変化によって影響を受ける金融商品に生じる。

以下の表は、期/年度末現在の金利リスクに対するダイワ外貨MMFのエクスポージャーの概要である。契約上の価格改定日または満期日のいずれか早い時期によって分類された、公正価値でのダイワ外貨MMFの資産および取引負債が含まれている。

USドル・ポートフォリオ

2016年6月30日

	1か月未満 USD	1～3か月 USD	3か月超 USD	無利息 USD	合計 USD
資産					
定期預金を含む現預金	247,149,539	-	-	-	247,149,539
未収債権	-	-	-	1,854,928	1,854,928
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	659,985,969	739,307,027	5,009,680	-	1,404,302,676
資産合計	907,135,508	739,307,027	5,009,680	1,854,928	1,653,307,143
(買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く)負債					
未払債務	-	-	-	7,815,511	7,815,511
負債合計	-	-	-	7,815,511	7,815,511
金利感度ギャップ合計	907,135,508	739,307,027	5,009,680	N/A	N/A

(N/A: 該当なし)

USドル・ポートフォリオ

2015年12月31日

	1か月未満 USD	1～3か月 USD	3か月超 USD	無利息 USD	合計 USD
資産					
定期預金を含む現預金	612,115,328	-	-	-	612,115,328
未収債権	-	-	-	42,003,106	42,003,106
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	951,978,350	430,767,106	81,941,191	-	1,464,686,647
資産合計	1,564,093,678	430,767,106	81,941,191	42,003,106	2,118,805,081
（買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	377,060,877	377,060,877
負債合計	-	-	-	377,060,877	377,060,877
金利感度ギャップ合計	1,564,093,678	430,767,106	81,941,191	N/A	N/A

オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

2016年6月30日

	1か月未満 AUD	1～3か月 AUD	3か月超 AUD	無利息 AUD	合計 AUD
資産					
定期預金を含む現預金	183,767,778	-	-	-	183,767,778
未収債権	-	-	-	575,950	575,950
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	344,474,400	507,785,789	-	-	852,260,189
資産合計	528,242,178	507,785,789	-	575,950	1,036,603,917
（買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	4,226,493	4,226,493
負債合計	-	-	-	4,226,493	4,226,493
金利感度ギャップ合計	528,242,178	507,785,789	-	N/A	N/A

オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

2015年12月30日

	1か月未満 AUD	1～3か月 AUD	3か月超 AUD	無利息 AUD	合計 AUD
資産					
定期預金を含む現預金	511,017,375	-	-	-	511,017,375
未収債権	-	-	-	10,217,669	10,217,669
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	334,303,258	249,332,678	-	-	583,635,936
資産合計	845,320,633	249,332,678	-	10,217,669	1,104,870,980
（買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	52,338,510	52,338,510
負債合計	-	-	-	52,338,510	52,338,510
金利感度ギャップ合計	845,320,633	249,332,678	-	N/A	N/A

カナダ・ドル・ポートフォリオ

2016年6月30日

	1 か月未満 CAD	1 ~ 3 か月 CAD	3 か月超 CAD	無利息 CAD	合計 CAD
資産					
定期預金を含む現預金	8,772,966	-	-	-	8,772,966
未収債権	-	-	-	9,594	9,594
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	14,386,662	31,320,401	1,606,677	-	47,313,740
資産合計	23,159,628	31,320,401	1,606,677	9,594	56,096,300
（買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	46,103	46,103
負債合計	-	-	-	46,103	46,103
金利感度ギャップ合計	23,159,628	31,320,401	1,606,677	N/A	N/A

カナダ・ドル・ポートフォリオ

2015年12月31日

	1 か月未満 CAD	1 ~ 3 か月 CAD	3 か月超 CAD	無利息 CAD	合計 CAD
資産					
定期預金を含む現預金	18,040,022	-	-	-	18,040,022
未収債権	-	-	-	232,973	232,973
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	14,302,742	27,772,115	1,997,075	-	44,071,932
資産合計	32,342,764	27,772,115	1,997,075	232,973	62,344,927
（買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	3,180,140	3,180,140
負債合計	-	-	-	3,180,140	3,180,140
金利感度ギャップ合計	32,342,764	27,772,115	1,997,075	N/A	N/A

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

2016年6月30日

	1 か月未満 NZD	1 ~ 3 か月 NZD	3 か月超 NZD	無利息 NZD	合計 NZD
資産					
定期預金を含む現預金	32,723,181	-	-	-	32,723,181
未収債権	-	-	-	196,011	196,011
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	98,930,915	150,511,423	-	-	249,442,338
資産合計	131,654,096	150,511,423	-	196,011	282,361,530
（買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	1,036,952	1,036,952
負債合計	-	-	-	1,036,952	1,036,952
金利感度ギャップ合計	131,654,096	150,511,423	-	N/A	N/A

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

2015年12月31日

	1 か月未満 NZD	1 ~ 3 か月 NZD	3 か月超 NZD	無利息 NZD	合計 NZD
資産					
定期預金を含む現預金	135,740,342	-	-	-	135,740,342
未収債権	-	-	-	2,042,026	2,042,026
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	104,284,819	67,703,797	13,912,248	-	185,900,864
資産合計	240,025,161	67,703,797	13,912,248	2,042,026	323,683,232
（買戻可能受益証券保有者の帰属 する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	31,914,381	31,914,381
負債合計	-	-	-	31,914,381	31,914,381
金利感度ギャップ合計	240,025,161	67,703,797	13,912,248	N/A	N/A

変動利付投資有価証券に関する受取金利を決定するためのベンチマーク・レートは、USドル・ポートフォリオについてはLIBOR（ロンドン銀行間取引金利）、オーストラリア・ドル・ポートフォリオについてはBBSW（バンク・ビル・スワップ・レファレンス・レート）、カナダ・ドル・ポートフォリオについてはCDOR（カナダ・ドル・オファー・レート）、ニュージーランド・ドル・ポートフォリオについてはNZ Bank Bill Rate（ニュージーランド・バンク・ビル・レート）に、特定のベース・ポイント（bps：100分の1%）を加えるか差引いたものに基づいている。

毎週の値洗い評価は、投資運用会社によって行われる。このテストとは別に、投資運用会社は、少なくとも週一回値洗い評価を独自に行う。これには、イールド・カーブの変化に対して働く負荷テストが含まれる（現在投資運用会社は、並列利益曲線の上昇を25ベース・ポイントおよび50ベース・ポイントに設定している。）。

以下の表は、金利がマイナス10ベース・ポイントからプラス50ベース・ポイントの間で変動するユニット価格に影響を及ぼす比率を表示している。

2016年6月30日

	+50bps	+25bps	+6.25bps	-10bps
USドル・ポートフォリオ	-0.05%	-0.02%	-0.01%	-0.01%
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ	-0.05%	-0.03%	-0.01%	0.01%
カナダ・ドル・ポートフォリオ	-0.05%	-0.03%	-0.01%	0.01%
ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ	-0.06%	-0.03%	-0.01%	0.01%

（+6.25ベース・ポイントは買呼値に基づく価格付を提供）

2015年12月31日

	+50bps	+25bps	+6.25bps	-10bps
USドル・ポートフォリオ	-0.02%	-0.01%	0.00%	0.00%
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ	-0.03%	-0.01%	0.00%	0.01%
カナダ・ドル・ポートフォリオ	-0.04%	-0.02%	-0.01%	0.01%
ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ	-0.03%	-0.01%	0.00%	0.01%

（+6.25ベース・ポイントは買呼値に基づく価格付を提供）

流動性リスク

流動性リスクは、ボラティリティが高い金融市場の混乱時に、ダイワ外貨MMFがその投資の規模を合理的価格で早急に調整できない可能性を表す。資金は容易に換金可能な資産に投資され、オーバーナイトの現金残高として約15%が留保されるが、その数値は資金流出が判明している場合および市場混乱の場合には増加される。投資運用会社および投資顧問会社は、大量買戻しの潜在性について情報を入手するために頻繁に販売会社と連絡を取る。市場の混乱時には、資産の現金化はさらに困難になり、これが観察され監視され、必要な場合には、満期が短縮され、オーバーナイト・キャッシュが増加される。

以下の流動性リスクの表は、期/年度末日現在の約定満期日までの残存期間に基づいてグループ分けをしたダイワ外貨MMFの金融資産の分析である。

	USドル・ ポートフォリオ	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ	カナダ・ドル・ ポートフォリオ	ニュージー ランド・ドル・ ポートフォリオ
2016年6月30日				
現金	14.97%	17.74%	15.64%	11.60%
10日以下 <10	14.49%	7.33%	3.92%	13.46%
10 - 30日 <=30	25.46%	25.80%	21.40%	21.59%
31 - 60日 <=60	17.93%	25.06%	40.31%	22.97%
61 - 90日 <=90	25.76%	24.07%	15.85%	25.10%
91 - 180日 <=180	1.39%	0.00%	2.88%	5.28%
181 - 365日	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2015年12月31日				
現金	35.28%	48.55%	30.52%	46.21%
10日以下 <10	19.25%	5.03%	5.07%	5.11%
10 - 30日 <=30	35.62%	26.63%	18.86%	30.38%
31 - 60日 <=60	15.57%	13.88%	29.40%	10.18%
61 - 90日 <=90	9.30%	5.17%	17.83%	17.66%
91 - 180日 <=180	4.61%	4.72%	3.38%	0.00%
181 - 365日	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	-19.63%	-3.98%	-5.06%	-9.54%

すべての金融負債は、1か月以内に期限到来する。

信用リスク

信用リスクは、取引相手方がダイワ外貨MMFに対し債務をその条件どおりに履行しなかった場合にダイワ外貨MMFが負うこととなる損失によって測られる。ダイワ外貨MMFは、取引相手方の信用リスクにさらされ、また決済不履行のリスクも負っている。ダイワ外貨MMFは、十分な経験、知識および信用度を有する有力な取引相手方のみを選別する。上場有価証券の全取引は、承認されたブローカーを介して引渡し時に決済され/支払われる。売却有価証券の引渡しは、ブローカーが支払を受領した時点でのみ行われるので、デフォルト・リスクは非常に少ないと考えられる。買付代金の支払は、ブローカーが有価証券を受領した時点で行われる。オーバーナイト・デポジットに預託される現金はすべて、慎重に選定されたリストの銀行に預けられる。銀行の倒産または破産により、預金に関するダイワ外貨MMFの権利が妨げられるか制限されることがある。投資運用会社は、S & P社®およびムーディーズ社により報告される、当該銀行の信用格付を監視する。

受託会社のエスエムティー・トラスティー（アイルランド）リミテッドは、その保管会社（「カストディアン」）としてスミトモ・ミツイ・トラスト（ユーケー）リミテッドを任命している。スミトモ・ミツイ・トラスト（ユーケー）リミテッドは、次に副保管会社（「副保管会社」）としてブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー（「BBH」）を任命している。BBHは、当期末現在A+（2015年12月31日：A+）のフィッチ社信用格付を得ている。ダイワ外貨MMFの投資および現金は、期末現在、副保管会社に保有されている。カストディアンまたは副保管会社の倒産または破産により、カストディアンまたは副保管会社に保管されている投資債務証券に関するダイワ外貨MMFの権利が妨げられるか制限されることがある。ダイワ外貨MMFの組入証券は、副保管会社により別口座で保管される。したがって、副保管会社が破産または倒産した場合、ダイワ外貨MMFの資産は分別管理される。しかし、ダイワ外貨MMFは、ダイワ外貨MMFの現金に関し、副保管会社または（カストディアンが利用する）預託会社の信用リスクにさらされる。副保管会社が破産または倒産した場合、ダイワ外貨MMFは、ダイワ外貨MMFの現金保有高に関し、副保管会社の一般債権者とみなされる。

ダイワ外貨MMFが取引している格付適格証券をすべて記載した投資ユニバースについては、記録がなされ、ムーディーズ社またはS & P社®による格付の変更を記録するために毎日監視される。いかなる格付変更も、投資運用会社に報告される。

	USドル・ ポートフォリオ	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ	カナダ・ドル・ ポートフォリオ	ニュージー ランド・ドル・ ポートフォリオ
2016年6月30日				
Aaa	0.95%	15.00%	18.35%	8.85%
Aa1	2.60%	11.17%	13.25%	5.31%
Aa2	14.46%	22.16%	39.25%	32.54%
Aa3	21.50%	24.10%	21.13%	26.19%
A1	60.49%	27.57%	8.02%	27.11%
A2	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2015年12月31日				
Aaa	10.08%	11.64%	21.34%	8.60%
Aa1	0.00%	4.72%	0.00%	5.10%
Aa2	38.10%	30.92%	38.89%	56.07%
Aa3	32.28%	38.25%	44.83%	18.34%
A1	39.17%	18.45%	0.00%	21.43%
A2	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	-19.63%	-3.98%	-5.06%	-9.54%

上表は、2016年6月30日および2015年12月31日現在のムーディーズ社の長期格付（A2からAaaまで）による保有比率を示している。2015年12月と2016年6月を比較した際の信用度の違いの大半は、2015年度末にポートフォリオが所持していた現金投資の割合が高かったことに帰因する。この理由は、日本の税制変更により発生する可能性があった、投資家の大規模な買戻しに備えたためである。

USドル・ポートフォリオ信用度は、上位3つの格付への投資が減少したことに伴い、2015年度末より若干低くなった。この理由は、2015年度末にポートフォリオが現金および米国財務省短期証券で所持していた割合が高かったことにある。2016年度始めにポートフォリオが保有する現金が通常レベルに戻るにつれて、A1銘柄（主に日本の金融機関）に投資された額は大幅に増加した。

カナダ・ドル・ポートフォリオの信用度は、A3格付カテゴリーに投資された割合が減少した一方で、上位2つへの格付への投資が6か月で増加したにもかかわらず、ほとんど同等のままであった。これは主に、保有する銀行預金が低かったためである。

オーストラリア・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオの両方で、信用度は、オーストラリア・ドル・ポートフォリオで僅かに改善し、ニュージーランド・ドル・ポートフォリオで僅かに低下したが、昨年度末とほとんど同等であった。

全体的にポートフォリオの信用度は、依然として高水準であった。

* (USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオで保有される) Acoos Agence Centralは、ムーディーズ社の長期格付がないので、「Aa2」格付と仮定されている。

** (USドル・ポートフォリオで保有される) Clearstream Bankingは、ムーディーズ社の長期格付がないがS & P社によりAA格付を得ており、「Aa2」格付と仮定されている。

*** (USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオで保有される) DZ Privatbankは、ムーディーズ社の長期格付がないがS & P社によりAA-格付を得ており、「Aa3」格付と仮定されている。

以下の表は、各クラスが保有する有価証券の種類別百分率を表している。

		オーストラリア	ニュージー		
		USドル・	ランド・ドル・		
		ポートフォリオ	ポートフォリオ		
		・ドル・	カナダ・ドル・		
		ポートフォリオ	ポートフォリオ		
2016年6月30日					
TD	現金	14.97%	17.74%	15.64%	11.60%
	未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
CD	預金証書	37.85%	12.89%	0.00%	30.42%
CP	コマーシャル・ペーパー	46.05%	60.29%	17.99%	57.98%
CB	社債	1.13%	9.08%	34.12%	0.00%
TB	財務省短期証券	0.00%	0.00%	17.99%	0.00%
BA	銀行引受手形	0.00%	0.00%	7.13%	0.00%
BDN	銀行預金証書	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
PN	約束手形	0.00%	0.00%	7.13%	0.00%
Bonds	債券	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2015年12月31日					
TD	現金	35.28%	48.55%	30.52%	46.21%
	未払金	-19.63%	-3.98%	-5.06%	-9.54%
CD	預金証書	38.30%	6.07%	0.00%	26.53%
CP	コマーシャル・ペーパー	35.84%	42.38%	6.25%	33.30%
CB	社債	0.00%	6.98%	26.55%	3.50%
TB	財務省短期証券	10.09%	0.00%	17.41%	0.00%
BA	銀行引受手形	0.00%	0.00%	12.51%	0.00%
BDN	銀行預金証書	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
PN	約束手形	0.00%	0.00%	11.82%	0.00%
Bonds	債券	0.12%	0.00%	0.00%	0.00%

2016年6月30日に終了した6か月および2015年12月31日に終了した年度の投資有価証券取引からの(損)益は全て包括利益計算書に計上されている。

5. 定期預金を含む現預金

現預金残高は、副保管会社に保有されている。現預金残高および定期預金は、上記の注記4に詳述されている。

ダイワ外貨MMFは、未使用の米ドル建、豪ドル建、カナダ・ドル建およびニュージーランド・ドル建の要求払預金残高および未確定外貨建て要求払預金残高を、承認された金融商品の一つである無制限のオーバーナイト・デポジット商品に投資するために副保管会社のキャッシュ・マネジメント・サービスに申込みことを一定の限定された状況下で同意している。資金は、投資家からダイワ外貨MMFに拠出のため電信為替送金される場合、買戻資金がダイワ外貨MMFから電信為替送金される場合、または手数料がダイワ外貨MMFから公認の第三者ベンダーに支払われる場合、一時的に、また短期間のみその口座に保有される。かかる預金は、預託機関の管轄地域における国内行為および当該通貨の管轄地域における国内行為を服することがあり、凍結、押収もしくは減縮されることも含むが、それらに限定されるものではない。いかなる場合でも、預金が最終的に預託される機関によってかかる商品に係る元利金支払に伴うリスクは、ダイワ外貨MMFの勘定に専ら関するものである。すべての現金は、当期末現在副保管会社に保有されていた。

6. 未収債権

	USドル・ ポートフォリオ USD	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ AUD	カナダ・ドル・ ポートフォリオ CAD	ニュージー ランド・ドル・ ポートフォリオ NZD
2016年6月30日				
ファンド証券売却未収金	1,854,928	575,950	9,594	196,011
	1,854,928	575,950	9,594	196,011
2015年12月31日				
ファンド証券売却未収金	41,997,272	10,217,669	232,973	2,042,026
その他の資産	5,834			
	42,003,106	10,217,669	232,973	2,042,026

7. 未払債務

	USドル・ ポートフォリオ USD	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ AUD	カナダ・ドル・ ポートフォリオ CAD	ニュージー ランド・ドル・ ポートフォリオ NZD
2016年6月30日				
ファンド証券買戻未払金	7,005,139	2,394,603	15,587	480,409
未払報酬(注9)	786,108	1,794,245	27,287	544,011
未払分配金	24,264	37,645	3,229	12,532
	7,815,511	4,226,493	46,103	1,036,952
2015年12月31日				
投資有価証券購入未払金	341,852,514	41,852,122	2,995,980	27,833,489
ファンド証券買戻未払金	34,472,974	8,302,180	160,179	3,362,469
未払報酬(注9)	686,657	1,987,953	20,560	628,357
未払分配金	48,732	196,255	3,421	90,066
	377,060,877	52,338,510	3,180,140	31,914,381

8. 期中の買戻可能受益証券の発行および買戻し

	2016年6月30日 (口数)	2015年12月31日 (口数)
USドル・ポートフォリオ		
期首発行済受益証券	174,174,416,352	258,170,704,633
発行受益証券	62,166,965,610	318,103,998,495
買戻受益証券	(71,792,224,302)	(402,100,286,776)
期末発行済受益証券	164,549,157,660	174,174,416,352
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ		
期首発行済受益証券	105,253,245,686	108,240,008,448
発行受益証券	37,935,074,414	113,238,971,182
買戻受益証券	(39,950,582,272)	(116,225,733,944)
期末発行済受益証券	103,237,737,828	105,253,245,686
カナダ・ドル・ポートフォリオ		
期首発行済受益証券	5,916,478,390	4,373,082,251
発行受益証券	353,478,519	5,066,114,503
買戻受益証券	(664,937,278)	(3,522,718,364)
期末発行済受益証券	5,605,019,631	5,916,478,390
ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ		
期首発行済受益証券	29,176,883,465	33,752,470,479
発行受益証券	6,789,949,177	22,364,500,234
買戻受益証券	(7,834,375,751)	(26,940,087,248)
期末発行済受益証券	28,132,456,891	29,176,883,465

9. 報酬および費用

各ポートフォリオは、管理会社および受託会社に対して、合計して各ポートフォリオの純資産額の年率1%を超えない額の報酬を支払う。かかる報酬は日々発生し、各四半期末に後払いされる。管理報酬の中から投資運用会社に支払われる報酬は、日々発生し四半期につき2回支払われる。投資運用会社は、投資顧問会社に対する報酬を支払う。代行協会および販売会社は、直接当該ポートフォリオの管理事務費用から現金支出費の払戻しを受ける。各ポートフォリオはまた、管理会社に対して一切の管理事務費用の払戻しをする。

受託会社は、当該ポートフォリオから副保管会社の報酬および立替金を含む支出経費の払戻しを受ける。

管理会社は、ポートフォリオから受領した報酬から、投資運用会社、販売会社および代行協会員の報酬を支払う。

期/年度末現在の未払報酬は、以下のとおりである。

	USドル・ ポートフォリオ USD	オーストラリア ・ドル・ ポートフォリオ AUD	カナダ・ドル・ ポートフォリオ CAD	ニュージー ランド・ドル・ ポートフォリオ NZD
2016年6月30日				
投資運用報酬	6,525	109,321	230	34,520
管理事務報酬	14,700	81,927	475	22,831
副保管報酬	15,815	88,229	511	24,587
受託会社報酬	7,887	44,114	256	12,294
販売会社報酬・代行協会員報酬	227,106	1,260,412	7,294	351,248
監査報酬	17,593	1,316	511	1,368
その他の費用	496,482	208,926	18,010	97,163
	786,108	1,794,245	27,287	544,011

2015年12月31日

投資運用報酬	8,374	130,099	239	44,788
管理事務報酬	18,579	96,949	485	28,473
副保管報酬	19,988	104,406	522	30,663
受託会社報酬	9,968	52,203	261	15,331
販売会社報酬・代行協会員報酬	287,030	1,491,517	7,461	438,019
監査報酬	33,806	14,366	594	4,691
その他の費用	308,912	98,413	10,998	66,392
	686,657	1,987,953	20,560	628,357

10. 利害関係者間取引

通常の取引で生じた以外に利害関係者とのいかなる取引も存在しなかった。投資運用会社、投資顧問会社および販売会社／代行協会員は、FRS102の下で利害関係者であるとみなされる。当期中に利害関係者に支払われた報酬は、包括利益計算書上に開示されている。期末現在の利害関係者への未払金額は、注記9に開示されている。

中央銀行のAIFルールブックの要件に準拠して、管理会社、受託会社、投資運用会社、または代理人もしくはグループ会社（「関係会社」）によってファンドと行われる取引はすべて、互いに独立して取決められ受益者の利益を最優先して行われなければならない。管理会社は、上記に示した責務が関係会社とのすべての取引に適用されることが確保されるために（文書化された手順で証明される）取決めが存在し、当期中に締結された関係会社との取引がその責務を遵守していることに満足する。

期／年度末のダイワ外貨MMFの取引評価日現在の受益証券保有者に帰属する純資産の20%以上を保有する投資家の数は、以下のとおりである。

	2016年6月30日	2015年12月31日
USドル・ポートフォリオ	2	2
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ	2	2
カナダ・ドル・ポートフォリオ	1	1
ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ	2	2

上の表には日本における販売会社である大和証券株式会社が含まれている。

11. 分配方針

管理会社は、各取引日に各ポートフォリオに関して分配金を宣言する。各ポートフォリオから分配される1口当たりの金額は、各ポートフォリオの当該通貨の100分の1の単位に各取引日のそれぞれの1口当たり純資産価格を維持するために要求される金額に相当する。

12. 純資産の推移

	2016年 6月30日	2015年 12月31日	2015年 6月30日
USドル・ポートフォリオ			
純資産額（米ドル）	1,645,491,632	1,741,744,204	2,274,331,094
受益証券数（口）	164,549,157,660	174,174,416,352	227,433,101,983
1口当たり純資産価格（米ドル）	0.01	0.01	0.01
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ			
純資産額（豪ドル）	1,032,377,424	1,052,532,470	1,116,116,189
受益証券数（口）	103,237,737,828	105,253,245,686	111,611,613,877
1口当たり純資産価格（豪ドル）	0.01	0.01	0.01
カナダ・ドル・ポートフォリオ			
純資産額（カナダ・ドル）	56,050,197	59,164,787	61,882,801
受益証券数（口）	5,605,019,631	5,916,478,390	6,188,279,713
1口当たり純資産価格（カナダ・ドル）	0.01	0.01	0.01
ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ			
純資産額（ニュージーランド・ドル）	281,324,578	291,768,851	339,055,703
受益証券数（口）	28,132,456,891	29,176,883,465	33,905,567,285
1口当たり純資産価格（ニュージーランド・ドル）	0.01	0.01	0.01

13. 税金

現行法および慣行に従って、ダイワ外貨MMFは、1997年租税統合法（改正済）の第739条Bに定義される投資信託として適格性を有している。ダイワ外貨MMFは、その収益またはキャピタル・ゲインに対してアイルランドの税金を課せられることがない。しかし、ダイワ外貨MMFに「課税対象事由」が発生した場合には、アイルランドの税金が課せられる。課税対象事由には、受益者への分配金支払、または受益証券の換金、償還もしくは譲渡が含まれる。アイルランド免税投資家（1997年租税統合法（改正済）の第739条Dに定義される。）、またはアイルランド非居住者で課税対象事由発生時に税法上アイルランドに通常居住していない受益者に関しては、課税対象事由についてダイワ外貨MMFに税金は生じない。ただし、それぞれの場合に、1997年租税統合法（改正済）のスケジュール2Bに基づき必要な署名入り法定申告書が、ダイワ外貨MMFによって保持されなければならない。ダイワ外貨MMFが受領するキャピタル・ゲイン、配当金およびクーポン利息には、投資国が徴税する源泉税が課せられることがあり、かかる税金はダイワ外貨MMFまたは受益者に還付されない。

14. ソフト・コミッション協定

ダイワ外貨MMFは、いかなるソフト・コミッション協定も締結していない。

15. 後発事象

2016年6月30日の後から2016年8月24日までに、USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオ、カナダ・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオに関してそれぞれ231,136,890米ドル、97,461,085豪ドル、1,906,952カナダ・ドルおよび24,599,989ニュージーランド・ドルの受益証券が発行された。

2016年6月30日の後から2016年8月24日までに、USドル・ポートフォリオ、オーストラリア・ドル・ポートフォリオ、カナダ・ドル・ポートフォリオおよびニュージーランド・ドル・ポートフォリオに関してそれぞれ186,453,388米ドル、60,882,638豪ドル、2,481,419カナダ・ドルおよび19,957,395ニュージーランド・ドルの受益証券が買い戻された。

当期末後から財務書類が承認された日までに、財務書類上で開示を要求されるその他の事象は発生しなかった。

16. 財務書類の承認

財務書類はダイワ外貨MMFは、管理会社の取締役会により、2016年8月24日に承認された。

[前へ](#)

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

ダイワ外貨MMF
USドル・ポートフォリオ投資有価証券明細表
2016年6月30日

	名目保有高	公正価額 (米ドル)	純資産 比率(%)
債務証券			
オーストラリア			
Mizuho Corp Bank Sydney 0.73% 12-Jul-16	43,000,000	42,990,492	2.61
Mizuho Corp Bank Sydney 0.73% 26-Jul-16	35,000,000	34,982,411	2.13
		<hr/>	<hr/>
		77,972,903	4.74
カナダ			
Export Development Canada 1.25% 26-Oct-16	5,000,000	5,009,680	0.30
Royal Bank of Canada 1.45% 09-Sep-16	8,005,000	8,016,451	0.49
		<hr/>	<hr/>
		13,026,131	0.79
フィンランド			
OP Corporate Bank 0.66% 19-Jul-16	10,000,000	9,996,706	0.61
OP Corporate Bank 0.66% 19-Jul-16	68,000,000	67,977,597	4.13
		<hr/>	<hr/>
		77,974,303	4.74
フランス			
Across (Agence Central) 0.65% 22-Jul-16	20,000,000	19,992,429	1.22
Across (Agence Central) 0.67% 05-Aug-16	30,000,000	29,980,346	1.82
Across (Agence Central) 0.67% 09-Aug-16	28,000,000	27,979,711	1.70
Banque Federative du Credit Mutuel 0.73% 01-Jul-16	24,000,000	24,000,000	1.46
Banque Federative du Credit Mutuel 0.73% 01-Sep-16	33,000,000	32,958,589	2.00
Banque Federative du Credit Mutuel 0.68% 07-Sep-16	15,000,000	14,980,767	0.91
Caisse Des Depos ET Consignations 0.63% 12-Sep-16	30,000,000	29,961,738	1.82
Caisse Des Depos ET Consignations 0.65% 13-Sep-16	21,000,000	20,971,987	1.27
SNCF Mobilities 0.62% 10-Aug-16	2,000,000	1,998,624	0.12
SNCF Reseau 0.55% 11-Jul-16	40,000,000	39,993,894	2.43
SNCF Reseau 0.61% 10-Aug-16	20,000,000	19,986,576	1.22
		<hr/>	<hr/>
		262,804,661	15.97
ドイツ			
Sachsen-Anhalt (Land) 0.70% 16-Sep-16	8,000,000	7,988,042	0.49
		<hr/>	<hr/>
		7,988,042	0.49
日本			
Chiba Bank 0.70% 02-Aug-16	30,000,000	30,000,000	1.82
Chiba Bank 0.70% 05-Aug-16	48,000,000	48,000,000	2.92
Development Bank of Japan 0.80% 29-Sep-16	18,000,000	17,964,091	1.09
Norinchukin Bank 0.64% 26-Sep-16	78,000,000	77,880,492	4.73
Shizuoka Bank 0.62% 22-Aug-16	20,000,000	20,000,000	1.22
Shoko Chukin Bank 0.70% 05-Jul-16	50,000,000	50,000,000	3.04
Shoko Chukin Bank 0.70% 05-Jul-16	28,000,000	28,000,000	1.70
		<hr/>	<hr/>
		271,844,583	16.52

	名目保有高	公正価額 (米ドル)	純資産 比率(%)
債務証券（続き）			
ルクセンブルグ			
Clearstream Banking 0.63% 14-Jul-16	50,000,000	49,988,643	3.04
DZ Privatebank SA 0.64% 12-Jul-16	59,000,000	58,988,480	3.59
DZ Privatebank SA 0.76% 15-Sep-16	19,000,000	18,969,575	1.15
		<u>127,946,698</u>	<u>7.78</u>
オランダ			
Bank Nederlandse Gemeenten 0.50% 28-Jul-16	5,650,000	5,649,090	0.34
ING Bank NV 0.71% 07-Sep-16	49,000,000	48,934,440	2.98
		<u>54,583,530</u>	<u>3.32</u>
ニュージーランド			
Kiwibank Ltd 0.61% 12-Jul-16	20,000,000	19,996,278	1.22
		<u>19,996,278</u>	<u>1.22</u>
シンガポール			
DBS Bank 0.60% 22-Jul-16	35,000,000	34,987,768	2.13
Standard Chartered Bank 0.70% 07-Jul-16	67,000,000	67,000,000	4.07
Temasek Financial II Private Ltd 0.60% 11-Jul-16	5,000,000	4,999,168	0.30
		<u>106,986,936</u>	<u>6.50</u>
イギリス			
Mitsubishi Corporation Finance 0.71% 25-Aug-16	20,000,000	19,978,345	1.21
Mitsubishi Corporation Finance 0.70% 09-Sep-16	58,000,000	57,921,196	3.52
Mitsubishi UFJ Trust 0.70% 01-Jul-16	70,000,000	70,000,000	4.25
Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.68% 02-Sep-16	49,000,000	48,941,790	2.97
Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.67% 21-Sep-16	29,000,000	28,955,818	1.76
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 0.64% 15-Aug-16	78,000,000	78,000,000	4.74
		<u>303,797,149</u>	<u>18.45</u>
アメリカ合衆国			
Schlumberger Finance BV 0.62% 25-Jul-16	30,000,000	29,987,620	1.82
Schlumberger Finance BV 0.60% 23-Aug-16	20,000,000	19,982,360	1.21
Schlumberger Finance BV 0.65% 23-Sep-16	29,000,000	28,956,089	1.76
		<u>78,926,069</u>	<u>4.79</u>
クーポン未収利息		<u>455,393</u>	<u>0.03</u>
債務証券合計		<u><u>1,404,302,676</u></u>	<u><u>85.34</u></u>

ダイワ外貨MMF
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

投資有価証券明細表
 2016年6月30日

	名目保有高	公正価額 (豪ドル)	純資産 比率(%)
債務証券			
オーストラリア			
ANZ Bank New Zealand Limited 2.26% 05-Jul-16	15,000,000	14,996,264	1.45
ANZ Bank New Zealand Limited 1.97% 15-Aug-16	30,000,000	29,926,519	2.90
Bank of Tokyo Mitsubishi 2.05% 23-Sep-16	48,000,000	47,771,609	4.63
Commonwealth Bank of Australia 1.88% 16-Sep-16	30,000,000	29,879,937	2.89
ING Bank NV 1.95% 01-Sep-16	20,000,000	19,933,159	1.93
ING Bank NV 2.02% 28-Sep-16	25,000,000	24,875,822	2.41
Mizuho Corp Bank Sydney 2.29% 15-Jul-16	30,000,000	29,973,495	2.90
Mizuho Corp Bank Sydney 2.07% 09-Sep-16	10,000,000	9,959,960	0.96
Oversea-Chinese Banking Corp Sydney 1.95% 20-Sep-16	25,000,000	24,890,856	2.41
Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.36% 26-Jul-16	16,000,000	15,973,988	1.55
Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.08% 26-Aug-16	30,000,000	29,903,216	2.90
		278,084,825	26.93
フィンランド			
OP Corporate Bank 2.30% 27-Jul-16	34,000,000	33,943,849	3.29
OP Corporate Bank 2.16% 15-Sep-16	14,000,000	13,936,510	1.35
		47,880,359	4.64
フランス			
Across (Agence Central) 2.27% 26-Jul-16	20,000,000	19,968,597	1.93
Across (Agence Central) 2.02% 10-Aug-16	28,000,000	27,937,478	2.71
Banque Federative du Credit Mutuel 2.43% 06-Jul-16	46,000,000	45,984,569	4.45
Caisse Des Depos ET Consignations 1.91% 05-Aug-16	40,000,000	39,925,887	3.87
SNCF Reseau 1.96% 24-Aug-16	20,000,000	19,941,493	1.93
		153,758,024	14.89
ドイツ			
DZ Bank AG 2.27% 15-Jul-16	31,000,000	30,972,790	3.00
FMS Wertmanagement 2.24% 20-Jul-16	23,000,000	22,972,964	2.23
FMS Wertmanagement 2.24% 20-Jul-16	23,000,000	22,972,962	2.23
Kreditanstalt Fur Wiederaufbau 5.50% 25-Jul-16	20,000,000	20,045,568	1.94
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 1.87% 16-Aug-16	47,000,000	46,888,230	4.54
Sachsen-Anhalt (Land) 1.95% 23-Aug-16	20,000,000	19,942,868	1.93
Sachsen-Anhalt (Land) 1.97% 09-Sep-16	20,000,000	19,923,773	1.93
		183,719,155	17.80
ルクセンブルグ			
DZ Privatebank SA 2.26% 08-Jul-16	15,000,000	14,993,446	1.45
		14,993,446	1.45

	名目保有高	公正価額 (豪ドル)	純資産 比率(%)
債務証券（続き）			
オランダ			
ING Bank NV 4.25% 23-Aug-16	3,520,000	3,528,332	0.34
Rabobank Nederland 2.27% 19-Jul-16	18,000,000	17,979,686	1.74
Rabobank Nederland 2.05% 09-Aug-16	16,000,000	15,964,652	1.55
Rabobank Australia FRN 27-Jul-16	13,000,000	13,011,106	1.26
		<u>50,483,776</u>	<u>4.89</u>
シンガポール			
DBS Bank 2.20% 22-Jul-16	20,000,000	19,974,475	1.93
Standard Chartered Bank 1.97% 16-Sep-16	27,000,000	26,886,802	2.61
		<u>46,861,277</u>	<u>4.54</u>
国際機関			
International Bank for Reconstruction and Development 2.85% 26-Sep-16	16,300,000	16,319,816	1.58
International Finance Corp 5% 03-Aug-16	25,000,000	25,067,221	2.43
		<u>41,387,037</u>	<u>4.01</u>
イギリス			
Standard Chartered Bank 2.30% 13-Jul-16	19,000,000	18,985,517	1.84
		<u>18,985,517</u>	<u>1.84</u>
アメリカ合衆国			
General Electric Co 4.25% 21-Sep-16	14,316,000	14,381,649	1.39
		<u>14,381,649</u>	<u>1.39</u>
クーポン未収利息		<u>1,725,124</u>	<u>0.17</u>
債務証券合計		<u><u>852,260,189</u></u>	<u><u>82.55</u></u>

ダイワ外貨MMF
カナダ・ドル・ポートフォリオ

投資有価証券明細表
 2016年6月30日

	名目保有高	公正価額 (カナダ・ドル)	純資産 比率(%)
債務証券			
カナダ			
Caisse Centrale Des Jard Du Quebec 2.281% 17-Oct-16	1,600,000	1,606,677	2.87
Manitoba T-Bill 0% 07-Sep-16	3,500,000	3,496,073	6.24
Municipal Finance Authority 0.67% 24-Aug-16	3,300,000	3,296,874	5.88
National Bank of Canada 0.83% 20-Jul-16	2,600,000	2,599,046	4.64
National Bank of Canada 0.83% 25-Jul-16	1,400,000	1,399,326	2.50
New Brunswick T-Bill 0% 05-Jul-16	2,200,000	2,199,962	3.91
New Brunswick 4.70% 21-Jul-16	1,900,000	1,903,613	3.40
Newfoundland T-Bill 0% 04-Aug-16	1,000,000	999,440	1.78
Nova Scotia (Province Of) 4.6% 18-Aug-16	4,000,000	4,019,397	7.17
Ontario T-Bill 0% 31-Aug-16	2,000,000	1,998,005	3.56
Quebec T-Bill 0% 02-Sep-16	1,400,000	1,398,557	2.50
Royal Bank of Canada 3.03% 26-Jul-16	4,000,000	4,005,391	7.15
Saskatchewan Province 0.62% 11-Jul-16	2,000,000	1,999,759	3.57
Saskatchewan Province 0.63% 23-Sep-16	2,000,000	1,997,161	3.56
Toronto-Dominion Bank 2.948% 02-Aug-16	4,000,000	4,006,690	7.15
		36,925,971	65.88
フランス			
Banque Federative du Credit Mutuel 0.75% 09-Aug-16	3,800,000	3,797,156	6.77
		3,797,156	6.77
ドイツ			
KFW 0.63% 24-Aug-16	3,000,000	2,997,325	5.35
		2,997,325	5.35
スウェーデン			
Swedish Export Credit Corp 2% 10-Aug-16	3,310,000	3,313,723	5.91
		3,313,723	5.91
クーポン未収利息		279,565	0.50
債務証券合計		47,313,740	84.41

ダイワ外貨MMF
ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

投資有価証券明細表
 2016年6月30日

	名目保有高	公正価額 (ニュージーランド・ドル)	純資産 比率(%)
債務証券			
オーストラリア			
ANZ Bank New Zealand Limited 2.35% 05-Aug-16	17,000,000	16,961,389	6.03
Bank of Tokyo Mitsubishi 2.43% 02-Sep-16	14,000,000	13,940,805	4.96
Mizuho Corp Bank Sydney 2.40% 08-Jul-16	13,000,000	12,993,943	4.62
New South Wales Treasury Corp 2.32% 08-Jul-16	10,000,000	9,995,516	3.55
United Overseas Bank 2.34% 28-Jul-16	15,000,000	14,973,830	5.32
		68,865,483	24.48
フィンランド			
OP Corporate Bank 2.50% 12-Aug-16	15,000,000	14,956,528	5.32
		14,956,528	5.32
フランス			
Acoss (Agence Central) 2.42% 26-Jul-16	17,000,000	16,971,604	6.03
Banque Federative du Credit Mutuel 2.54% 01-Jul-16	15,000,000	15,000,000	5.33
Caisse Des Depos ET Consignations 2.44% 26-Sep-16	15,000,000	14,912,110	5.30
		46,883,714	16.66
ドイツ			
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 2.32% 20-Jul-16	15,000,000	14,981,740	5.33
		14,981,740	5.33
ルクセンブルグ			
DZ Privatebank SA 2.47% 24-Aug-16	16,000,000	15,941,092	5.67
		15,941,092	5.67
オランダ			
Rabobank Nederland 2.40% 17-Aug-16	17,000,000	16,947,058	6.02
		16,947,058	6.02
ニュージーランド			
Kiwibank Ltd 2.39% 14-Jul-16	14,000,000	13,987,989	4.97
		13,987,989	4.97
ノルウェー			
DNB Bank ASA 2.34% 06-Sep-16	13,000,000	12,943,732	4.60
		12,943,732	4.60
シンガポール			
Standard Chartered Bank 2.49% 15-Sep-16	14,000,000	14,000,000	4.98
		14,000,000	4.98
イギリス			
Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.45% 29-Sep-16	15,000,000	14,908,709	5.30
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 2.40% 21-Sep-16	15,000,000	15,000,000	5.33
		29,908,709	10.63
クーポン未収利息		26,293	0.01
債務証券合計		249,442,338	88.67

ダイワ外貨MMF
USドル・ポートフォリオ

組入証券変動明細表
 2016年6月30日

	名目取得高	名目売却高
Chiba Bank 0.58% 05-Feb-16	80,000,000	-
Chiba Bank 0.71% 06-May-16	70,000,000	-
DZ Privatebank SA 0.61% 12-Apr-16	60,000,000	-
DZ Privatebank SA 0.64% 12-Jul-16	59,000,000	-
Mitsubishi Corporation Finance 0.51% 09-Mar-16	55,000,000	-
Mitsubishi Corporation Finance 0.70% 09-Sep-16	58,000,000	-
Mitsubishi UFJ Trust 0.68% 01-Apr-16	80,000,000	-
Mitsubishi UFJ Trust 0.70% 01-Jul-16	70,000,000	-
Norinchukin Bank 0.63% 28-Jun-16	78,000,000	-
Norinchukin Bank 0.64% 26-Sep-16	78,000,000	-
OP Corporate Bank 0.66% 19-Jul-16	68,000,000	-
Pohjola Bank Plc 0.63% 19-Apr-16	72,000,000	-
Shizuoka Bank 0.63% 24-Mar-16	80,000,000	-
Shoko Chukin Bank 0.72% 06-Apr-16	80,000,000	-
Standard Chartered Bank 0.62% 07-Apr-16	80,000,000	-
Standard Chartered Bank 0.70% 07-Jul-16	67,000,000	-
Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.54% 04-Mar-16	80,000,000	-
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 0.43% 16-Feb-16	80,000,000	-
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 0.70% 16-May-16	80,000,000	-
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 0.64% 15-Aug-16	78,000,000	-

上記の表は、アイルランド中央銀行によって要求される、当期中の投資有価証券の変動計算書を表示する。同表は、当期中における取得有価証券の上位20銘柄を表示している。同表は、期首現在保有高および期末現在保有高間の調整について表示するものではない。

注：当期において投資有価証券の売却は行われなかった。通常の事業活動において、すべての投資有価証券は満期を迎えた。

ダイワ外貨MMF
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

組入証券変動明細表
 2016年6月30日

	名目保有高	名目売却高
Bank of Tokyo Mitsubishi 2.30% 22-Mar-16	50,000,000	-
Bank of Tokyo Mitsubishi 2.39% 22-Jun-16	48,000,000	-
Bank of Tokyo Mitsubishi 2.05% 23-Sep-16	48,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 2.48% 06-Apr-16	49,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 2.43% 06-Jul-16	46,000,000	-
Caisse Des Depos ET Consignations 2.22% 06-May-16	40,000,000	-
Caisse Des Depos ET Consignations 1.91% 05-Aug-16	40,000,000	-
DBS Bank 2.25% 15-Mar-16	48,000,000	-
DNB Bank ASA 2.11% 09-Feb-16	48,000,000	-
DNB Bank ASA 2.23% 17-Jun-16	46,000,000	-
DZ Bank AG 2.27% 15-Jul-16	31,000,000	-
ING Bank NV 2.25% 03-Jun-16	35,000,000	-
Landwirtschaftliche Rentenbank 2.12% 04-Mar-16	42,000,000	-
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 2.17% 16-Feb-16	48,000,000	-
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 2.19% 16-May-16	48,000,000	-
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 1.87% 16-Aug-16	47,000,000	-
OP Corporate Bank 2.30% 27-Jul-16	34,000,000	-
Pohjola Bank Plc 2.28% 27-Apr-16	36,000,000	-
United Overseas Bank 2.28% 30-Jun-16	46,000,000	-
Westpac Banking Corporation 6.75% 09-May-16	45,700,000	-

上記の表は、アイルランド中央銀行によって要求される、当期中の投資有価証券の変動計算書を表示する。同表は、当期中における取得有価証券の上位20銘柄を表示している。同表は、期首現在保有高および期末現在保有高間の調整について表示するものではない。

注：当期において投資有価証券の売却は行われなかった。通常の事業活動において、すべての投資有価証券は満期を迎えた。

ダイワ外貨MMF
カナダ・ドル・ポートフォリオ

組入証券変動明細表
 2016年6月30日

	名目保有高	名目売却高
Alberta (Province Of) 0.62% 22-Mar-16	3,000,000	-
Alberta Capital Finance Auth 4.35% 15-Jun-16	4,000,000	-
Bank of Nova Scotia 1.80% 09-May-16	4,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 0.65% 09-May-16	3,700,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 0.75% 09-Aug-16	3,800,000	-
Canada Housing Trust No 1 FRN 15-Mar-16	2,322,000	-
Canada Imperial Bank 0.83% 27-Jun-16	2,200,000	-
KFW 0.63% 24-Aug-16	3,000,000	-
Manitoba T-Bill 0% 18-May-16	4,000,000	-
Manitoba T-Bill 0% 07-Sep-16	3,500,000	-
Municipal Finance Authority 0.64% 01-Jun-16	4,000,000	-
Municipal Finance Authority 0.67% 24-Aug-16	3,300,000	-
National Bank of Canada 3.58% 26-Apr-16	2,750,000	-
National Bank of Canada 0.83% 20-Jul-16	2,600,000	-
Nova Scotia (Province Of) 0.59% 07-Apr-16	4,000,000	-
Nova Scotia (Province Of) 4.60% 18-Aug-16	4,000,000	-
Royal Bank of Canada 2.07% 17-Jun-16	2,500,000	-
Royal Bank of Canada 3.03% 26-Jul-16	4,000,000	-
Swedish Export Credit Corp 2% 10-Aug-16	3,310,000	-
Toronto-Dominion Bank 2.948% 02-Aug-16	4,000,000	-

上記の表は、アイルランド中央銀行によって要求される、当期中の投資有価証券の変動計算書を表示する。同表は、当期中における取得有価証券の上位20銘柄を表示している。同表は、期首現在保有高および期末現在保有高間の調整について表示するものではない。

注：当期において投資有価証券の売却は行われなかった。通常の事業活動において、すべての投資有価証券は満期を迎えた。

ダイワ外貨MMF
ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

組入証券変動明細表
 2016年6月30日

	名目保有高	名目売却高
Across (Agence Central) 2.72% 26-Apr-16	17,300,000	-
Across (Agence Central) 2.42% 26-Jul-16	17,000,000	-
ANZ Bank New Zealand Limited 2.35% 05-Aug-16	17,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 2.54% 01-Jul-16	15,000,000	-
Caisse Des Depos ET Consignations 2.64% 06-May-16	17,000,000	-
Caisse Des Depos ET Consignations 2.44% 26-Sep-16	15,000,000	-
DBS Bank 2.69% 14-Mar-16	15,000,000	-
DZ Privatebank SA 2.71% 24-May-16	15,000,000	-
DZ Privatebank SA 2.47% 24-Aug-16	16,000,000	-
KFW 2.64% 17-May-16	20,000,000	-
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 2.32% 20-Jul-16	15,000,000	-
Landwirtschaftliche Rentenbank 2.61% 17-Feb-16	20,000,000	-
OP Corporate Bank 2.50% 12-Aug-16	15,000,000	-
Rabobank Nederland 2.40% 17-Aug-16	17,000,000	-
Standard Chartered Bank 2.55% 15-Jun-16	15,000,000	-
Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.37% 27-Jun-16	15,000,000	-
Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.45% 29-Sep-16	15,000,000	-
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 2.37% 22-Jun-16	15,000,000	-
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 2.40% 21-Sep-16	15,000,000	-
United Overseas Bank 2.34% 28-Jul-16	15,000,000	-

上記の表は、アイルランド中央銀行によって要求される、当期中の投資有価証券の変動計算書を表示する。同表は、当期中における取得有価証券の上位20銘柄を表示している。同表は、期首現在保有高および期末現在保有高間の調整について表示するものではない。

注：当期において投資有価証券の売却は行われなかった。通常の事業活動において、すべての投資有価証券は満期を迎えた。

[前へ](#) [次へ](#)

4 管理会社の概況

(1) 資本金の額

授権株式資本は、1株当たり1スターリング・ポンドの普通スターリング・ポンド株式40万株および1株当たり1ユーロの普通ユーロ株式1億株である。2016年7月末日現在、払込済株式資本は、40万スターリング・ポンド(約5,501万円)および6,250万ユーロ(約72億2,938万円)である。

(注) スターリング・ポンド(以下「英ポンド」という。)およびユーロの円貨換算は、平成28年7月29日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1英ポンド=137.53円、1ユーロ=115.67円)による。以下同じ。

(2) 事業の内容及び営業の状況

管理会社は、投資信託の管理を行うことを主たる目的とする。また、管理会社は、アイルランド中央銀行によりオルタナティブ投資ファンド運用会社として認可されている。ダイワ外貨MMFおよび受益者に代わり、組入証券の購入、売却、申込みおよび交換ならびにダイワ外貨MMFの資産に直接または間接に付随する権利の行使を含む管理運用業務を行う。管理会社は、各ポートフォリオの資産の投資について管理会社に運用業務を提供する投資運用会社としてダイワ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)リミテッドを任命している。

管理会社は、信託証書の終了まで、管理会社として行為するものとするが、アイルランド中央銀行が承認する他の会社のために辞任する権利を有する。()管理会社が清算手続(受託会社により予め書面をもって承認される条件に従って組織変更または合併の目的で行う任意清算を除き)に入った場合、または管理会社の資産に管財人が選任された場合、または()十分な理由に基づき受託会社が管理会社の変更が受益者の利益にとって好ましいという意見を書面をもって述べた場合、または()受益者が特別決議をもって管理会社が退任すべき旨を決定した場合、受託会社は、()の場合には直ちに、()および()の場合は3か月経過後、(アイルランド中央銀行の承認に基づき)後任の管理会社を任命するが、信託証書を終了し、ダイワ外貨MMFを解散することもできる。アイルランド中央銀行は、管理会社を、退任させるかまたは交替させることができる。管理会社は、自己の故意による違法行為または過失についてのみ責任を負い、それ以外の場合は、信託証書に基づき管理会社が行う活動の結果生じる損失について、受託会社、ダイワ外貨MMFまたは受益者に対し責任を負わない。特に、管理会社は、投資運用会社またはその投資顧問会社の助言により善意により行うことについて責任を負わない。管理会社は、管理会社とその職務の適切な遂行において、(管理会社の過失または故意による違法行為を理由とする場合は別として)管理会社が被る一切の行為、実費、請求、損失、損害および費用についてダイワ外貨MMFに対し、賠償責任を負わない。

管理会社の取締役は、本書中の情報に対して責任を負う。取締役の知りまたは信じる限りにおいて、本書中の情報は事実に基づくものであり、かかる情報の意味に影響を与え得る事項は省略されていない(取締役はこれらの点が確保されるよう、あらゆる合理的な注意を払う。)。取締役はこれに従った責任を負う。

信託証書は、アイルランド中央銀行の承認に基づき、管理会社が、管理会社の職務を他の当事者に委託することを許容している。管理会社は、日本における販売会社をダイワ外貨MMFの販売会社として任命している。

また、管理会社はファンドの管理事務の業務および機能も担う。管理会社は、信託証書に基づき、ファンドの投資目的および投資方針を考慮した上で、ファンドの一般的な管理運用業務および2013年欧州共同体(オルタナティブ投資ファンド運用会社)規則(2013年法律第257号)の確実な遵守(投資対象および投資方針を考慮しながら、各ポートフォリオの資産の投資および再投資を含む。)につき責任を負う。管理会社は、投資運用契約に従い、各ポートフォリオに関するポートフォリオ運用機能およびリスク管理機能の一部を、投資運用会社に委託した。

管理会社は、法律上および営業上、投資運用会社から独立しており、かかる委託を受けた者らと管理会社の間にはいかなる関係も存在しない。

管理会社は、その意思決定手続および組織構造がファンドの受益者を確実に公平に取り扱うよう確保する。

受益者の公平な取扱い

ファンドおよび管理会社は、その全ての決定において、ファンドの受益者を公平に取り扱うよう確保し、また、管理会社が一または複数の受益者を優先的に取り扱うことが、他の受益者に全体的に重大な不利益を生じさせないよう確保するものとする。

管理会社は、ファンドの投資方針、流動性特性および買戻方針の一貫性の確保に努める。ファンドの投資方針、流動性特性および買戻方針は、受益者が全受益者の公平な取扱いに沿う方法で、かつ、ファンドの買戻方針および義務に従って自己の投資対象を買い戻す能力を有する場合に、一貫しているとみなされる。投資方針、流動性特性および買戻方針の一貫性の評価において、管理会社は、かかる買戻しが原資産価格またはファンドの個別資産のスプレッドに及ぼしうる影響につき考慮するものとする。

2016年7月末日現在、管理会社は、ダイワ外貨MMFを含むアイルランド籍契約型投資信託5本（純資産総額：1,898,360,181.33米ドル、1,120,764,385.81豪ドル、4,924,903.36ユーロ、78,479,966.09カナダ・ドル、9,827,348,133円、285,073,222.35ニュージーランド・ドルおよび732,706,306.42ノルウェー・クローネ）の管理および運用を行っている。

設立国	基本的性格	ファンドの本数	純資産総額
アイルランド	MMF	1	1,643,226,439.13米ドル
			1,069,391,117.52豪ドル
			55,607,373.55カナダ・ドル
			285,073,222.35ニュージーランド・ドル
アイルランド	その他	4	255,133,742.20米ドル
			51,373,268.29豪ドル
			4,924,903.36ユーロ
			22,872,592.54カナダ・ドル
			9,827,348,133円
			732,706,306.42ノルウェー・クローネ

(3) その他

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事および与えることが予想される事実はない。

[前へ](#)

[次へ](#)

(2) その他の訂正

訂正箇所は下線で示します。

表紙

<訂正前>

(前 略)

届出の対象とした募集外国投資信託受益証券の金額

- ()USドル・ポートフォリオ
100億アメリカ合衆国ドル(約1兆975億円)を上限とする。
 - ()オーストラリア・ドル・ポートフォリオ
100億オーストラリア・ドル(約8,340億円)を上限とする。
 - ()カナダ・ドル・ポートフォリオ
100億カナダ・ドル(約8,719億円)を上限とする。
 - ()ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ
100億ニュージーランド・ドル(約7,587億円)を上限とする。
- (注) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)、オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、平成28年4月28日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=109.75円、1豪ドル=83.40円、1カナダ・ドル=87.19円および1ニュージーランド・ドル=75.87円)による。

(後 略)

<訂正後>

(前略)

届出の対象とした募集外国投資信託受益証券の金額

- ()USドル・ポートフォリオ
100億アメリカ合衆国ドル(約1兆442億円)を上限とする。
 - ()オーストラリア・ドル・ポートフォリオ
100億オーストラリア・ドル(約7,856億円)を上限とする。
 - ()カナダ・ドル・ポートフォリオ
100億カナダ・ドル(約7,941億円)を上限とする。
 - ()ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ
100億ニュージーランド・ドル(約7,417億円)を上限とする。
- (注) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)、オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、平成28年7月29日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=104.42円、1豪ドル=78.56円、1カナダ・ドル=79.41円および1ニュージーランド・ドル=74.17円)による。

(後略)

第一部 証券情報

(3) 発行（売出）価額の総額

<訂正前>

() USドル・ポートフォリオ

100億米ドル(約1兆975億円)を上限とする。

() オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

100億豪ドル(約8,340億円)を上限とする。

() カナダ・ドル・ポートフォリオ

100億カナダ・ドル(約8,719億円)を上限とする。

() ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

100億ニュージーランド・ドル(約7,587億円)を上限とする。

(注1) 米ドル、豪ドル、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、便宜上、それぞれ平成28年4月28日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=109.75円、1豪ドル=83.40円、1カナダ・ドル=87.19円および1ニュージーランド・ドル=75.87円)による。

(後略)

<訂正後>

() USドル・ポートフォリオ

100億米ドル(約1兆442億円)を上限とする。

() オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

100億豪ドル(約7,856億円)を上限とする。

() カナダ・ドル・ポートフォリオ

100億カナダ・ドル(約7,941億円)を上限とする。

() ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

100億ニュージーランド・ドル(約7,417億円)を上限とする。

(注1) 米ドル、豪ドル、カナダ・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、便宜上、それぞれ平成28年7月29日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=104.42円、1豪ドル=78.56円、1カナダ・ドル=79.41円および1ニュージーランド・ドル=74.17円)による。

(後略)

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

管理会社の概況

(ホ)大株主の状況

<訂正前>

(2016年4月末日現在)

名称	住所	所有株式数	比率
スミトモ・ミツイ・トラスト(アイルランド)リミテッド (Sumitomo Mitsui Trust (Ireland) Limited)	アイルランド共和国、ダブリン2、ハーコート・ロード、ハーコート・センター、ブロック5 (Block 5, Harcourt Centre, Harcourt Road, Dublin 2, Ireland)	普通英ポンド株式 400,000株 および 普通ユーロ株式 62,500,000株	100%

<訂正後>

(2016年7月末日現在)

名称	住所	所有株式数	比率
スミトモ・ミツイ・トラスト(アイルランド)リミテッド (Sumitomo Mitsui Trust (Ireland) Limited)	アイルランド共和国、ダブリン2、ハーコート・ロード、ハーコート・センター、ブロック5 (Block 5, Harcourt Centre, Harcourt Road, Dublin 2, Ireland)	普通英ポンド株式 400,000株 および 普通ユーロ株式 62,500,000株	100%

3 投資リスク

リスクに関する参考情報

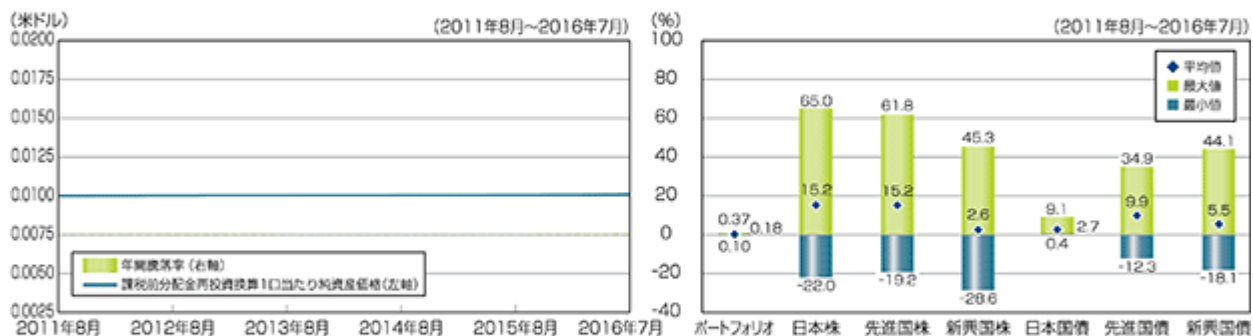
以下の内容に更新されます。

下記のグラフは、ポートフォリオと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものである。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ポートフォリオおよび他の代表的な資産クラスについて表示している。また、左のグラフは、ポートフォリオの過去5年間に於ける分配金再投資換算1口当たり純資産価格(各月末時点)と、年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の推移を表示している。分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、2010年8月末の1口当たり純資産価格を起点として、分配金(税引前)を分配時にポートフォリオへ再投資したものとみなして計算したものである。

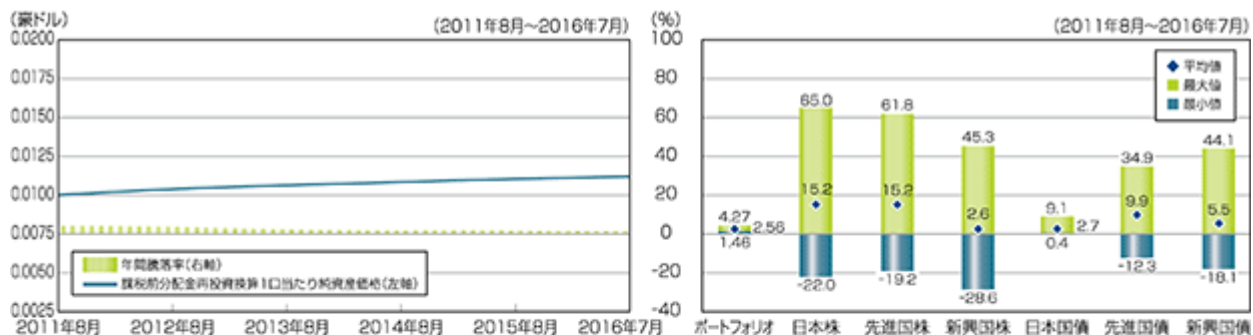
ポートフォリオの課税前分配金再投資換算
1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

ポートフォリオと他の代表的な資産クラスとの
年間騰落率の比較

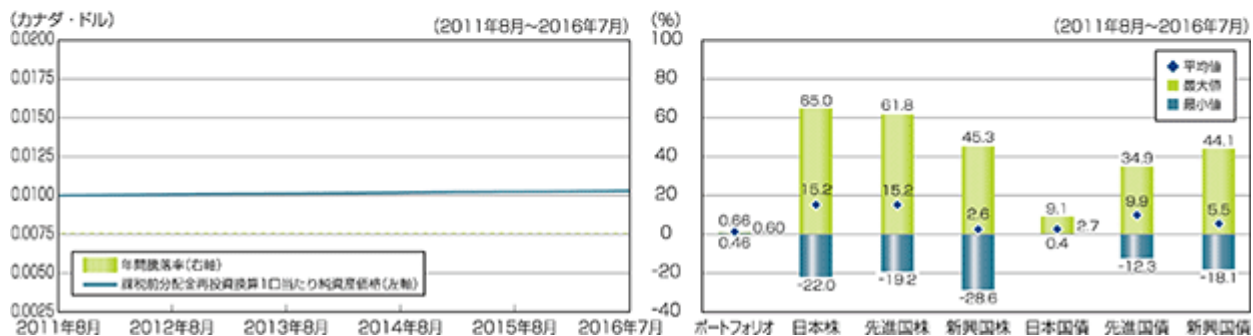
USドル・ポートフォリオ



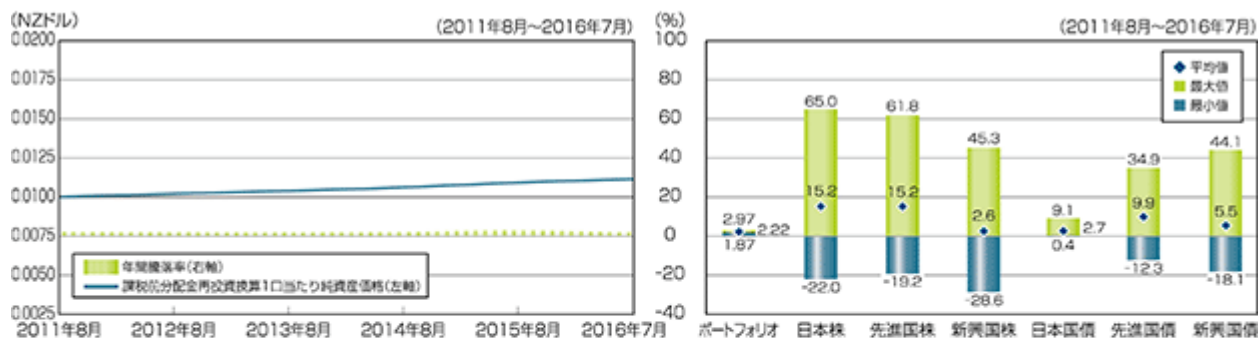
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ



カナダ・ドル・ポートフォリオ



ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ



出所：投資運用会社、Bloomberg L.P. および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

※各資産クラスは、ポートフォリオの投資対象を表しているものではない。

※ポートフォリオの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にポートフォリオへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の1口当たり純資産価格に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合がある。

※ポートフォリオの年間騰落率は、各受益証券の基準通貨建てで計算されており、円貨に為替換算されていない。したがって、円貨に為替換算した場合、上記とは異なる騰落率となる。

○各資産クラスの指数

日本株…TOPIX（配当込み）

先進国株…ラッセル先進国（除く日本）大型株インデックス

新興国株…S&P 新興国総合指数

日本国債…ブルームバーグ/EFFAS ボンド・インデックス・ジャパン・ガバメント・オール（1年超）

先進国債…シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債…シティ新興国市場国債インデックス（円ベース）

（注）ラッセル先進国（除く日本）大型株インデックスおよび S&P 新興国総合指数は、Bloomberg L.P. が円換算している。

TOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有している。なお、ファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

ラッセル・インデックスに関連する登録商標、トレードマーク、サービスマークおよび著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利は、ラッセル・インベストメントに帰属する。インデックスは資産運用管理の対象とはならない。またインデックス自体は直接的に投資の対象となるものではない。

シティ世界国債インデックスおよびシティ新興国市場国債インデックスはCitigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている債券インデックスである。

[前へ](#)