

【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29年9月29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1兆1,035億円)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8,790億円)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8,846億円)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8,295億円)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29年7月31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=110.35円、1豪ドル=87.90円、1カナダ・ドル=88.46円および1ニュージーランド・ドル=82.95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29年6月30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

(2017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	192,676,499.07	11.13
	オーストラリア	119,777,309.90	6.92
	日本	112,824,808.62	6.52
	ルクセンブルグ	78,890,337.96	4.56
	イギリス	78,852,112.42	4.56
	フィンランド	65,870,032.89	3.81
	アメリカ合衆国	60,891,040.28	3.52
	カナダ	59,907,506.17	3.46
	シンガポール	51,893,607.98	3.00
	ニュージーランド	50,914,578.45	2.94
	スウェーデン	24,992,647.12	1.44
	国際機関	9,490,994.00	0.55
	小計	906,981,474.86	52.41
譲渡性預金証書	イギリス	278,727,974.74	16.11
	日本	160,000,000.00	9.25
	オーストラリア	57,913,947.36	3.35
	ベルギー	55,930,932.36	3.23
	カナダ	14,950,502.06	0.86
	小計	567,523,356.52	32.80
定期預金	アメリカ合衆国	256,553,000.00	14.83
現金およびその他の資産 (負債控除後)		-630,993.47	-0.04
合計(純資産総額)		1,730,426,837.91 (約190,953百万円)	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29年7月31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=110.35円、1豪ドル=87.90円、1カナダ・ドル=88.46円、1ニュージーランド・ドル=82.95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

(2017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	181,443,106.50	17.92
	オーストラリア	90,777,015.13	8.96
	ドイツ	90,768,655.40	8.96
	カナダ	59,889,462.89	5.91
	フィンランド	46,125,750.31	4.55
	ノルウェー	45,950,248.60	4.54
	ニュージーランド	43,969,514.96	4.34
	シンガポール	42,868,010.26	4.23
	ルクセンブルグ	19,921,687.62	1.97
	小計	621,713,451.67	61.39
譲渡性預金証書	オーストラリア	195,685,552.32	19.32
	カナダ	25,937,477.68	2.56
	小計	221,623,030.00	21.88
社債	国際機関	4,160,554.80	0.41
	オーストラリア	4,133,386.36	0.41
	オランダ	3,141,325.40	0.31
	小計	11,435,266.56	1.13
定期預金	オーストラリア	158,515,000.00	15.65
現金およびその他の資産 (負債控除後)		-495,183.74	-0.05
合計(純資産総額)		1,012,791,564.49 (約89,024百万円)	100.00

## カナダ・ドル・ポートフォリオ

(2017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 (%)
社債	カナダ	14,249,173.98	32.22
政府債	カナダ	13,896,294.38	31.42
銀行引受手形	カナダ	9,269,832.59	20.96
定期預金	カナダ	6,602,500.00	14.93
現金およびその他の資産 (負債控除後)		206,993.50	0.47
合計(純資産総額)		44,224,794.45 (約3,912百万円)	100.00

## ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

(2017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	45,898,207.36	18.27
	ノルウェー	15,994,931.12	6.37
	ルクセンブルグ	14,981,500.37	5.96
	オランダ	14,974,937.32	5.96
	ニュージーランド	14,937,622.55	5.95
	カナダ	13,940,250.23	5.55
	フィンランド	11,969,700.55	4.77
	小計	132,697,149.50	52.83
譲渡性預金証書	オーストラリア	40,867,510.06	16.27
	シンガポール	16,985,190.28	6.76
	イギリス	15,956,298.85	6.35
	小計	73,808,999.19	29.38
社債	ドイツ	7,248,833.40	2.89
定期預金	ニュージーランド	37,445,000.00	14.91
現金およびその他の資産 (負債控除後)		-1,655.21	0.00
合計(純資産総額)		251,198,326.88 (約20,837百万円)	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

(2017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	STANDARD CHARTERED BANK CD	譲渡性 預金証書	イギリス	1.33	2017年10月10日	79,000,000	1.00	79,000,000.00	1.00	79,000,000.00	4.57
1	SUMITOMO MITSUI TRUST CD	譲渡性 預金証書	イギリス	1.19	2017年8月16日	79,000,000	1.00	79,000,000.00	1.00	79,000,000.00	4.57
3	MITSUBISHI UFJ TRUST CD	譲渡性 預金証書	イギリス	1.30	2017年10月3日	79,000,000	1.00	78,820,870.03	1.00	78,820,870.03	4.55
4	RABOBANK AUS CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.22	2017年9月5日	70,000,000	1.00	69,917,238.69	1.00	69,917,238.69	4.04
5	CADES (CAISSE D'AMORT) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.29	2017年9月21日	61,000,000	1.00	60,888,884.87	1.00	60,888,884.87	3.52
6	OCBC CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.33	2017年10月16日	50,000,000	1.00	49,860,071.21	1.00	49,860,071.21	2.88
7	CHIBA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	1.25	2017年8月8日	49,000,000	1.00	49,000,000.00	1.00	49,000,000.00	2.83
8	DZ PRIVATBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	1.16	2017年8月2日	44,000,000	1.00	43,998,586.68	1.00	43,998,586.68	2.54
9	MIZUHO CORP BANK SYDNEY CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.28	2017年9月7日	42,000,000	1.00	41,944,926.57	1.00	41,944,926.57	2.42
10	BANQUE FED. CRED. MU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.16	2017年8月2日	40,000,000	1.00	39,998,720.76	1.00	39,998,720.76	2.31
11	SCHLUMBERGER FINANCE CP	コマーシャル ・ペーパー	アメリカ合衆国	1.28	2017年9月28日	40,000,000	1.00	39,917,780.22	1.00	39,917,780.22	2.31
12	DBS BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	シンガポール	1.29	2017年9月29日	40,000,000	1.00	39,915,708.04	1.00	39,915,708.04	2.31
13	MITSUBISHI CORP FINAN CP	コマーシャル ・ペーパー	イギリス	1.33	2017年10月12日	40,000,000	1.00	39,893,968.16	1.00	39,893,968.16	2.31
14	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.35	2017年10月18日	40,000,000	1.00	39,882,971.92	1.00	39,882,971.92	2.30
15	MITSUBISHI CORP FINAN CP	コマーシャル ・ペーパー	イギリス	1.25	2017年9月1日	39,000,000	1.00	38,958,144.26	1.00	38,958,144.26	2.25
16	SHIZUOKA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	1.37	2017年10月26日	37,000,000	1.00	37,000,000.00	1.00	37,000,000.00	2.14
17	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	ベルギー	1.19	2017年8月30日	35,000,000	1.00	34,966,547.95	1.00	34,966,547.95	2.02
18	DZ PRIVATBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	1.33	2017年10月24日	35,000,000	1.00	34,891,751.28	1.00	34,891,751.28	2.02
19	DEV BANK OF JAPAN INC CP	コマーシャル ・ペーパー	日本	0.00	2017年10月26日	35,000,000	1.00	34,880,895.00	1.00	34,880,895.00	2.02
20	CHUGOKU BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	日本	1.31	2017年8月10日	32,000,000	1.00	31,989,555.02	1.00	31,989,555.02	1.85
21	OP CORPORATE BANK PLC CP	コマーシャル ・ペーパー	フィンランド	1.33	2017年9月15日	32,000,000	1.00	31,946,978.20	1.00	31,946,978.20	1.85
22	CHIBA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	1.36	2017年9月29日	31,000,000	1.00	31,000,000.00	1.00	31,000,000.00	1.79
23	BANK OF MONTREAL CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	1.25	2017年9月13日	30,000,000	1.00	29,955,349.62	1.00	29,955,349.62	1.73
24	BANK OF MONTREAL CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	1.28	2017年9月15日	30,000,000	1.00	29,952,156.55	1.00	29,952,156.55	1.73
25	KIWI BANK LTD CP	コマーシャル ・ペーパー	ニュージーランド	1.20	2017年8月14日	26,000,000	1.00	25,988,768.84	1.00	25,988,768.84	1.50
26	SHIZUOKA BANK CD	譲渡性 預金証書	日本	1.23	2017年8月22日	25,000,000	1.00	25,000,000.00	1.00	25,000,000.00	1.44
27	CITY OF GOTHENBURG CP	コマーシャル ・ペーパー	スウェーデン	1.18	2017年8月10日	25,000,000	1.00	24,992,647.12	1.00	24,992,647.12	1.44
28	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.19	2017年8月22日	25,000,000	1.00	24,982,698.21	1.00	24,982,698.21	1.44
29	KIWI BANK LTD CP	コマーシャル ・ペーパー	ニュージーランド	1.34	2017年10月20日	25,000,000	1.00	24,925,809.61	1.00	24,925,809.61	1.44
30	CHUGOKU BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	日本	1.31	2017年8月24日	23,000,000	1.00	22,980,814.39	1.00	22,980,814.39	1.33



## オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

(2017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	BANQUE FED. CRED. MU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.79	2017年10月6日	45,000,000	1.00	44,852,990.16	1.00	44,852,990.16	4.43
2	KIWI BANK LTD CP	コマーシャル ・ペーパー	ニュージーランド	1.79	2017年8月15日	44,000,000	1.00	43,969,514.96	1.00	43,969,514.96	4.34
3	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.74	2017年8月31日	30,000,000	1.00	29,956,568.64	1.00	29,956,568.64	2.96
4	MIZUHO CORP BANK SYDNEY CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.78	2017年9月11日	30,000,000	1.00	29,939,464.63	1.00	29,939,464.63	2.96
5	OP CORPORATE BANK PLC CP	コマーシャル ・ペーパー	フィンランド	1.71	2017年9月27日	30,000,000	1.00	29,919,013.54	1.00	29,919,013.54	2.95
6	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.82	2017年10月23日	30,000,000	1.00	29,874,712.04	1.00	29,874,712.04	2.95
7	DNB BANK ASA CP	コマーシャル ・ペーパー	ノルウェー	1.71	2017年8月23日	26,000,000	1.00	25,972,948.46	1.00	25,972,948.46	2.56
8	DBS BANK SYDNEY CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.71	2017年8月30日	26,000,000	1.00	25,964,341.05	1.00	25,964,341.05	2.56
9	TORONTO DOMINION BANK CD	譲渡性 預金証書	カナダ	1.78	2017年9月19日	26,000,000	1.00	25,937,477.68	1.00	25,937,477.68	2.56
10	FMS WERTMANAGEMENT CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.74	2017年9月8日	25,000,000	1.00	24,954,467.62	1.00	24,954,467.62	2.46
11	STANDARD CHARTERED BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	シンガポール	1.73	2017年9月22日	25,000,000	1.00	24,937,802.73	1.00	24,937,802.73	2.46
12	CAISSE DES DEPOS ET C CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.74	2017年10月13日	25,000,000	1.00	24,912,433.36	1.00	24,912,433.36	2.46
13	TOYOTA FINANCE AUS CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.74	2017年10月13日	25,000,000	1.00	24,912,182.09	1.00	24,912,182.09	2.46
14	RABOBANK NEDERLAND AU CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.76	2017年8月8日	24,000,000	1.00	23,991,823.49	1.00	23,991,823.49	2.37
15	CADES (CAISSE D'AMORT) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.76	2017年9月20日	24,000,000	1.00	23,941,596.05	1.00	23,941,596.05	2.36
16	CADES (CAISSE D'AMORT) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.76	2017年10月10日	22,000,000	1.00	21,925,271.20	1.00	21,925,271.20	2.16
17	RABOBANK NEDERLAND AU CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.74	2017年9月26日	21,000,000	1.00	20,943,411.76	1.00	20,943,411.76	2.07
18	FMS WERTMANAGEMENT CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.74	2017年10月20日	21,000,000	1.00	20,919,159.52	1.00	20,919,159.52	2.07
19	CAISSE DES DEPOS ET C CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.67	2017年8月2日	20,000,000	1.00	19,999,076.60	1.00	19,999,076.60	1.97
20	UNITED OVERSEAS BANK CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.74	2017年8月3日	20,000,000	1.00	19,998,080.38	1.00	19,998,080.38	1.97
21	BANK OF TOKYO MITSUBISHI CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.71	2017年8月10日	20,000,000	1.00	19,991,484.41	1.00	19,991,484.41	1.97
22	TORONTO DOMINION BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	1.73	2017年8月15日	20,000,000	1.00	19,986,603.62	1.00	19,986,603.62	1.97
23	L-BANK BW FOERDERBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ドイツ	1.70	2017年8月17日	20,000,000	1.00	19,984,954.32	1.00	19,984,954.32	1.97
24	DBS BANK SYDNEY CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.73	2017年8月22日	20,000,000	1.00	19,979,905.46	1.00	19,979,905.46	1.97
25	DNB BANK ASA CP	コマーシャル ・ペーパー	ノルウェー	1.71	2017年8月25日	20,000,000	1.00	19,977,300.14	1.00	19,977,300.14	1.97
26	BANK OF MONTREAL CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	1.75	2017年9月15日	20,000,000	1.00	19,956,444.61	1.00	19,956,444.61	1.97
27	BANK OF MONTREAL CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	1.73	2017年9月26日	20,000,000	1.00	19,946,414.66	1.00	19,946,414.66	1.97
28	UNITED OVERSEAS BANK CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.72	2017年9月28日	20,000,000	1.00	19,944,820.20	1.00	19,944,820.20	1.97
29	DZ PRIVATBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	1.77	2017年10月20日	20,000,000	1.00	19,921,687.62	1.00	19,921,687.62	1.97
30	TOYOTA FINANCE AUS CP	コマーシャル ・ペーパー	オーストラリア	1.73	2017年10月23日	20,000,000	1.00	19,920,586.53	1.00	19,920,586.53	1.97

## カナダ・ドル・ポートフォリオ

(2017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	GE CAP CANADA FDG	社債	カナダ	5.53	2017年8月17日	3,400,000	1.00	3,407,133.19	1.00	3,407,133.19	7.70
2	ROYAL BANK OF CANADA	社債	カナダ	2.364	2017年9月21日	3,400,000	1.00	3,406,383.41	1.00	3,406,383.41	7.70
3	HSBC BANK CANADA	社債	カナダ	3.558	2017年10月4日	3,220,000	1.00	3,234,088.68	1.00	3,234,088.68	7.31
4	TORONTO DOMINION BANK	社債	カナダ	2.433	2017年8月15日	2,700,000	1.00	2,701,568.70	1.00	2,701,568.70	6.11
5	QUEBEC T BILL	政府債	カナダ	0.00	2017年9月15日	2,600,000	1.00	2,597,689.89	1.00	2,597,689.89	5.87
6	CANADIAN IMPERIAL BANK BA	銀行引受手形	カナダ	0.73	2017年8月25日	2,000,000	1.00	1,999,028.67	1.00	1,999,028.67	4.52
7	NATIONAL BANK OF CANADA BA	銀行引受手形	カナダ	0.73	2017年9月5日	2,000,000	1.00	1,998,583.85	1.00	1,998,583.85	4.52
8	SASKATCHEWAN (PROVINCE) PN	政府債	カナダ	0.60	2017年8月1日	1,900,000	1.00	1,900,000.00	1.00	1,900,000.00	4.30
9	MANITOBA T BILL	政府債	カナダ	0.00	2017年8月2日	1,700,000	1.00	1,699,973.36	1.00	1,699,973.36	3.84
10	BANK OF MONTREAL	社債	カナダ	4.55	2017年8月1日	1,500,000	1.00	1,500,000.00	1.00	1,500,000.00	3.39
11	ONTARIO T-BILL	政府債	カナダ	0.00	2017年8月23日	1,500,000	1.00	1,499,495.22	1.00	1,499,495.22	3.39
12	BANK OF NOVA SCOTIA BA	銀行引受手形	カナダ	1.06	2017年9月20日	1,500,000	1.00	1,497,805.80	1.00	1,497,805.80	3.39
13	CANADIAN IMPERIAL BANK BA	銀行引受手形	カナダ	1.08	2017年9月29日	1,500,000	1.00	1,497,357.06	1.00	1,497,357.06	3.39
14	NATIONAL BANK OF CANADA BA	銀行引受手形	カナダ	1.10	2017年10月16日	1,500,000	1.00	1,496,541.63	1.00	1,496,541.63	3.38
15	NEWFOUNDLAND T-BILL	政府債	カナダ	0.00	2017年10月12日	1,300,000	1.00	1,297,643.49	1.00	1,297,643.49	2.93
16	MANITOBA PROVINCE OF	政府債	カナダ	4.70	2017年9月22日	1,000,000	1.01	1,005,696.65	1.01	1,005,696.65	2.27
17	ALBERTA (PROVINCE OF) PN	政府債	カナダ	0.78	2017年9月12日	1,000,000	1.00	999,093.96	1.00	999,093.96	2.26
18	BRITISH COLUMBIA (PROVINCE OF) PN	政府債	カナダ	0.70	2017年9月20日	1,000,000	1.00	999,029.35	1.00	999,029.35	2.26
19	ALBERTA (PROVINCE OF) PN	政府債	カナダ	0.91	2017年10月3日	1,000,000	1.00	998,413.60	1.00	998,413.60	2.26
20	QUEBEC T-BILL	政府債	カナダ	0.00	2017年9月22日	900,000	1.00	899,258.86	1.00	899,258.86	2.03
21	TORONTO DOMINION BANK BA	銀行引受手形	カナダ	1.09	2017年9月25日	600,000	1.00	598,999.52	1.00	598,999.52	1.35
22	BANK OF NOVA SCOTIA BA	銀行引受手形	カナダ	1.10	2017年10月27日	182,000	1.00	181,516.06	1.00	181,516.06	0.41

## ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

(2017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	ACOSS (AGENCE CENTRAL) CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	2.05	2017年8月2日	17,000,000	1.00	16,999,036.95	1.00	16,999,036.95	6.77
2	STANDARD CHARTERED BANK CD	譲渡性 預金証書	シンガポール	1.97	2017年8月17日	17,000,000	1.00	16,985,190.28	1.00	16,985,190.28	6.76
3	DNB BANK ASA CP	コマーシャル ・ペーパー	ノルウェー	1.91	2017年8月7日	16,000,000	1.00	15,994,931.12	1.00	15,994,931.12	6.37
4	SUMITOMO MITSUI BANKING CD	譲渡性 預金証書	イギリス	1.90	2017年9月22日	16,000,000	1.00	15,956,298.85	1.00	15,956,298.85	6.35
5	DZ PRIVATBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	ルクセンブルグ	1.94	2017年8月24日	15,000,000	1.00	14,981,500.37	1.00	14,981,500.37	5.96
6	RABOBANK CP	コマーシャル ・ペーパー	オランダ	1.95	2017年9月1日	15,000,000	1.00	14,974,937.32	1.00	14,974,937.32	5.96
7	MIZUHO CORP BANK SYDNEY CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.95	2017年9月8日	15,000,000	1.00	14,969,264.86	1.00	14,969,264.86	5.96
8	CAISSE DES DEPOS ET C CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.87	2017年10月4日	15,000,000	1.00	14,950,373.05	1.00	14,950,373.05	5.95
9	BANK OF TOKYO MITSUBISHI CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	2.04	2017年9月29日	15,000,000	1.00	14,950,231.74	1.00	14,950,231.74	5.95
10	KIWI BANK LTD CP	コマーシャル ・ペーパー	ニュージーランド	1.98	2017年10月16日	15,000,000	1.00	14,937,622.55	1.00	14,937,622.55	5.95
11	BANQUE FED. CRED. MU CP	コマーシャル ・ペーパー	フランス	1.89	2017年10月10日	14,000,000	1.00	13,948,797.36	1.00	13,948,797.36	5.55
12	TORONTO DOMINION BANK CP	コマーシャル ・ペーパー	カナダ	1.93	2017年10月20日	14,000,000	1.00	13,940,250.23	1.00	13,940,250.23	5.55
13	OP CORPORATE BANK PLC CP	コマーシャル ・ペーパー	フィンランド	2.03	2017年9月15日	12,000,000	1.00	11,969,700.55	1.00	11,969,700.55	4.77
14	UNITED OVERSEAS BANK CD	譲渡性 預金証書	オーストラリア	1.97	2017年10月27日	11,000,000	1.00	10,948,013.46	1.00	10,948,013.46	4.36
15	KFW	社債	ドイツ	3.75	2017年8月16日	7,244,000	1.00	7,248,833.40	1.00	7,248,833.40	2.89

## ( )投資不動産物件

該当事項なし(2017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(2017年7月末日現在)。

## (2) 運用実績

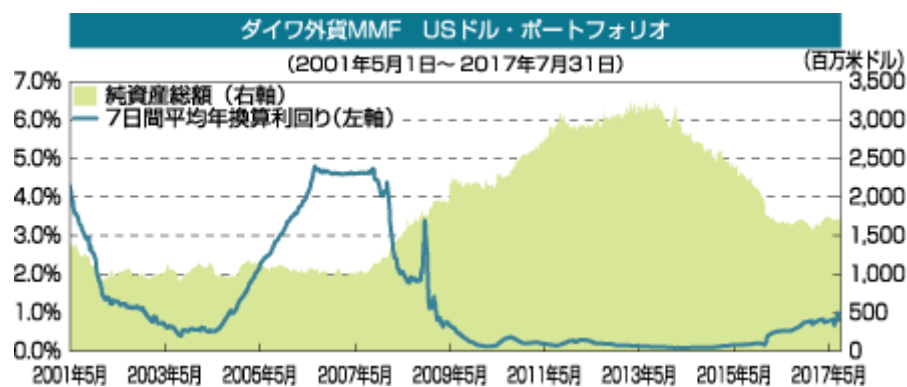
## 純資産の推移

2017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
2016年8月末日	1,664,640	183,693	0.01	1
9月末日	1,710,286	188,730	0.01	1
10月末日	1,680,053	185,394	0.01	1
11月末日	1,626,112	179,441	0.01	1
12月末日	1,588,200	175,258	0.01	1
2017年1月末日	1,631,745	180,063	0.01	1
2月末日	1,631,083	179,990	0.01	1
3月末日	1,735,131	191,472	0.01	1
4月末日	1,741,574	192,183	0.01	1
5月末日	1,695,531	187,102	0.01	1
6月末日	1,703,979	188,034	0.01	1
7月末日	1,730,427	190,953	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

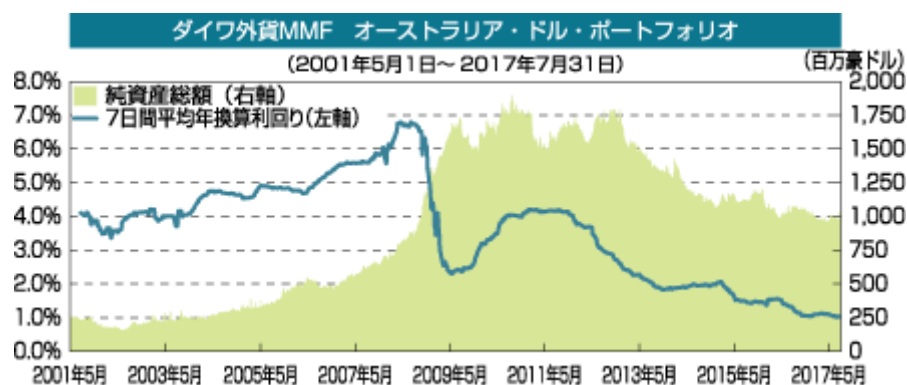


(注) 7日間平均年換算利回りとは、課税前の7日間平均利回りを年率換算したものである。以下同じ。

## 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
2016年8月末日	1,051,690	92,444	0.01	1
9月末日	1,053,643	92,615	0.01	1
10月末日	1,048,260	92,142	0.01	1
11月末日	1,011,662	88,925	0.01	1
12月末日	1,006,681	88,487	0.01	1
2017年1月末日	974,110	85,624	0.01	1
2月末日	976,790	85,860	0.01	1
3月末日	965,862	84,899	0.01	1
4月末日	968,207	85,105	0.01	1
5月末日	982,765	86,385	0.01	1
6月末日	981,749	86,296	0.01	1
7月末日	1,012,792	89,024	0.01	1

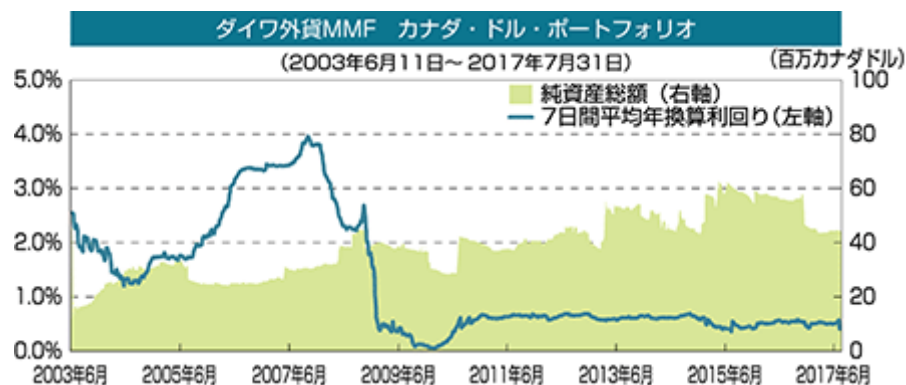
## 純資産総額および7日間平均年換算利回りの推移



## 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
2016年8月末日	55,455	4,906	0.01	1
9月末日	56,174	4,969	0.01	1
10月末日	56,361	4,986	0.01	1
11月末日	46,557	4,118	0.01	1
12月末日	45,377	4,014	0.01	1
2017年1月末日	45,131	3,992	0.01	1
2月末日	43,609	3,858	0.01	1
3月末日	43,705	3,866	0.01	1
4月末日	43,770	3,872	0.01	1
5月末日	44,404	3,928	0.01	1
6月末日	44,744	3,958	0.01	1
7月末日	44,225	3,912	0.01	1

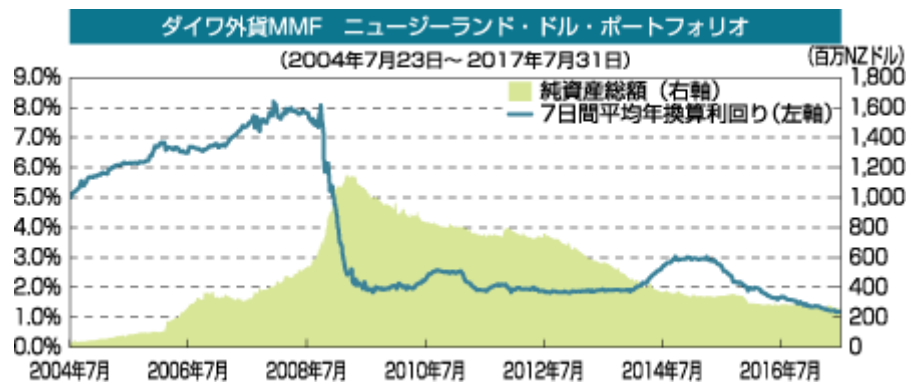
## 純資産総額および7日間平均年換算利回りの推移



## 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
2016年8月末日	284,264	23,580	0.01	1
9月末日	283,416	23,509	0.01	1
10月末日	282,625	23,444	0.01	1
11月末日	276,982	22,976	0.01	1
12月末日	263,495	21,857	0.01	1
2017年1月末日	257,599	21,368	0.01	1
2月末日	257,098	21,326	0.01	1
3月末日	264,044	21,902	0.01	1
4月末日	264,422	21,934	0.01	1
5月末日	276,622	22,946	0.01	1
6月末日	262,939	21,811	0.01	1
7月末日	251,198	20,837	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2017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)
2016年8月31日	0.05353	0.10700	0.04827	0.14946
2016年9月30日	0.05328	0.09199	0.04552	0.13036
2016年10月28日	0.05612	0.08131	0.04281	0.11892
2016年11月30日	0.06941	0.09477	0.04824	0.13347
2016年12月30日	0.06155	0.08681	0.03643	0.11803
2017年1月31日	0.06546	0.09584	0.04331	0.12080
2017年2月28日	0.06176	0.08526	0.03970	0.10494
2017年3月31日	0.06821	0.09460	0.04481	0.11518
2017年4月28日	0.05964	0.08455	0.03894	0.09927
2017年5月31日	0.07275	0.09708	0.04600	0.11280
2017年6月30日	0.06673	0.08588	0.04200	0.10056
2017年7月31日	0.07031	0.08725	0.04152	0.10078



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 (%)
2016年8月31日	0.59207	1.18348	0.53389	1.65311
2016年9月30日	0.64824	1.11921	0.55382	1.58604
2016年10月28日	0.73156	1.05993	0.55805	1.55020
2016年11月30日	0.76771	1.04821	0.53356	1.47625
2016年12月30日	0.74885	1.05618	0.44323	1.43603
2017年1月31日	0.74665	1.09317	0.49400	1.37787
2017年2月28日	0.80508	1.11142	0.51751	1.36796
2017年3月31日	0.80311	1.11383	0.52760	1.35615
2017年4月28日	0.77745	1.10216	0.50761	1.29405
2017年5月31日	0.80465	1.07376	0.50878	1.24763
2017年6月30日	0.81188	1.04487	0.51100	1.22348
2017年7月31日	0.82784	1.02729	0.48886	1.18660

2017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。

2016年8月～ 2017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)
	0.75875	1.09234	0.51755	1.40457

#### 収益率の推移

2017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。

2016年8月～ 2017年7月	収益率(%) <sup>(注)</sup>			
	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
	0.75875	1.09234	0.51755	1.40457

(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、2017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 = 2017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

2017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2017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
146,342,614,737 (146,342,614,737)	137,464,532,441 (137,464,532,441)	173,212,418,931 (173,212,418,931)

(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
64,095,637,508 (64,095,637,508)	69,811,220,866 (69,811,220,866)	101,164,949,941 (101,164,949,941)

## 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
1,142,324,917 (1,142,324,917)	2,285,838,626 (2,285,838,626)	4,422,655,564 (4,422,655,564)

## 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
14,005,083,948 (14,005,083,948)	17,404,345,811 (17,404,345,811)	25,095,566,657 (25,095,566,657)

[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、英国およびアイルランドにおける法令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29年7月31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	=	110.35円
1 豪ドル	=	87.90円
1 カナダ・ドル	=	88.46円
1 ニュージーランド・ドル	=	82.95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  
 2017年6月30日現在

	注記	2017年6月30日		2016年12月31日	
		(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
<b>資産</b>					
定期預金を含む現預金	5	250,606,279	27,654,403	257,143,537	28,375,789
未収債権	6	1,046,439	115,475	3,795,486	418,832
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	2,3,4	1,459,209,727	161,023,793	1,332,204,775	147,008,797
資産合計		<u>1,710,862,445</u>	<u>188,793,671</u>	<u>1,593,143,798</u>	<u>175,803,418</u>
<b>負債</b>					
未払債務	7	6,883,229	759,564	4,943,371	545,501
(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>6,883,229</u>	<u>759,564</u>	<u>4,943,371</u>	<u>545,501</u>
買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産		<u>1,703,979,216</u>	<u>188,034,106</u>	<u>1,588,200,427</u>	<u>175,257,917</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  
**USドル・ポートフォリオ**

包括利益計算書

2017年6月30日に終了した6か月間

	注記	2017年6月30日		2016年6月30日	
		(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
<b>収益</b>					
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	9,009,722	994,223	4,902,884	541,033
純収益合計		9,009,722	994,223	4,902,884	541,033
<b>費用</b>					
投資運用報酬	9	243,081	26,824	39,589	4,369
管理事務報酬		116,556	12,862	29,362	3,240
副保管報酬	9	125,396	13,837	31,589	3,486
受託会社報酬	9	62,540	6,901	15,753	1,738
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	1,792,129	197,761	461,477	50,924
監査報酬		13,086	1,444	16,443	1,814
その他の費用		69,653	7,686	228,684	25,235
費用合計		2,422,441	267,316	822,897	90,807
<b>ファイナンス費用</b>					
分配金	11	(6,587,281)	(726,906)	(4,079,987)	(450,227)
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

2017年6月30日に終了した6か月間

	2017年6月30日		2016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	1,588,200,427	175,257,917	1,741,744,204	192,201,473
買戻可能受益証券の発行手取金	746,786,995	82,407,945	621,669,656	68,601,247
買戻可能受益証券の買戻支払金	(631,008,206)	(69,631,756)	(717,922,228)	(79,222,718)
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	1,703,979,216	188,034,106	1,645,491,632	181,580,002

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  
 2017年6月30日現在

	注記	2017年6月30日		2016年12月31日	
		(豪ドル)	(千円)	(豪ドル)	(千円)
<b>資産</b>					
定期預金を含む現預金	5	164,274,356	14,439,716	153,696,064	13,509,884
未収債権	6	231,894	20,383	518,043	45,536
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	2,3,4	821,919,683	72,246,740	856,081,044	75,249,524
資産合計		986,425,933	86,706,840	1,010,295,151	88,804,944
<b>負債</b>					
未払債務	7	4,676,515	411,066	3,614,368	317,703
(買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く)負債		4,676,515	411,066	3,614,368	317,703
買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産		981,749,418	86,295,774	1,006,680,783	88,487,241

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

2017年6月30日に終了した6か月間

	注記	2017年6月30日		2016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	8,802,752	773,762	11,263,402	990,053
純収益合計		8,802,752	773,762	11,263,402	990,053
費用					
投資運用報酬	9	631,609	55,518	650,603	57,188
管理事務報酬		157,189	13,817	163,764	14,395
副保管報酬	9	169,280	14,880	176,361	15,502
受託会社報酬	9	84,640	7,440	88,180	7,751
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	2,418,287	212,567	2,562,685	225,260
監査報酬		12,134	1,067	6,988	614
その他の費用		64,653	5,683	108,521	9,539
費用合計		3,537,792	310,972	3,757,102	330,249
ファイナンス費用					
分配金	11	(5,264,960)	(462,790)	(7,506,300)	(659,804)
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

2017年6月30日に終了した6か月間

	2017年6月30日		2016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	1,006,680,783	88,487,241	1,052,532,470	92,517,604
買戻可能受益証券の発行手取金	285,136,206	25,063,473	379,350,744	33,344,930
買戻可能受益証券の買戻支払金	(310,067,571)	(27,254,939)	(399,505,790)	(35,116,559)
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	981,749,418	86,295,774	1,032,377,424	90,745,976

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  
 2017年6月30日現在

	注記	2017年6月30日		2016年12月31日	
		(カナダ・ドル)	(千円)	(カナダ・ドル)	(千円)
<b>資産</b>					
定期預金を含む現預金	5	6,879,565	608,566	8,878,150	785,361
未収債権	6	115,164	10,187	61,107	5,406
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	2,3,4	37,791,495	3,343,036	36,479,128	3,226,944
資産合計		44,786,224	3,961,789	45,418,385	4,017,710
<b>負債</b>					
未払債務	7	42,119	3,726	41,636	3,683
(買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く)負債		42,119	3,726	41,636	3,683
買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産		44,744,105	3,958,064	45,376,749	4,014,027

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

2017年6月30日に終了した6か月間

	注記	2017年6月30日		2016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	139,981	12,383	185,538	16,413
純収益合計		139,981	12,383	185,538	16,413
費用					
投資運用報酬	9	987	87	1,285	114
管理事務報酬		713	63	928	82
副保管報酬	9	768	68	999	88
受託会社報酬	9	384	34	500	44
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	10,964	970	14,267	1,262
監査報酬		382	34	511	45
その他の費用		13,146	1,163	16,511	1,461
費用合計		27,344	2,419	35,001	3,096
ファイナンス費用					
分配金	11	(112,637)	(9,964)	(150,537)	(13,317)
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

2017年6月30日に終了した6か月間

	2017年6月30日		2016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	45,376,749	4,014,027	59,164,787	5,233,717
買戻可能受益証券の発行手取金	2,445,909	216,365	3,534,785	312,687
買戻可能受益証券の買戻支払金	(3,078,553)	(272,329)	(6,649,375)	(588,204)
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	44,744,105	3,958,064	56,050,197	4,958,200

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

2017年6月30日現在

	注記	2017年6月30日		2016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)
<b>資産</b>					
定期預金を含む現預金	5	39,561,021	3,281,587	37,505,624	3,111,092
未収債権	6	333,486	27,663	185,310	15,371
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	2,3,4	223,978,967	18,579,055	226,806,424	18,813,593
資産合計		263,873,474	21,888,305	264,497,358	21,940,056
<b>負債</b>					
未払債務	7	934,920	77,552	1,001,965	83,113
(買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産を除く)負債		934,920	77,552	1,001,965	83,113
買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産		262,938,554	21,810,753	263,495,393	21,856,943

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

2017年6月30日に終了した6か月間

	注記	2017年6月30日		2016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)
<b>収益</b>					
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	2,690,797	223,202	3,628,429	300,978
純収益合計		2,690,797	223,202	3,628,429	300,978
<b>費用</b>					
投資運用報酬	9	195,680	16,232	208,631	17,306
管理事務報酬		42,397	3,517	45,203	3,750
副保管報酬	9	45,659	3,787	48,681	4,038
受託会社報酬	9	22,829	1,894	24,340	2,019
販売会社報酬および代行協会員報酬	9	652,266	54,105	711,524	59,021
監査報酬		2,203	183	2,262	188
その他の費用		26,454	2,194	32,296	2,679
費用合計		987,488	81,912	1,072,937	89,000
<b>ファイナンス費用</b>					
分配金	11	(1,703,309)	(141,289)	(2,555,492)	(211,978)
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

2017年6月30日に終了した6か月間

	2017年6月30日		2016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	263,495,393	21,856,943	291,768,851	24,202,226
買戻可能受益証券の発行手取金	90,773,615	7,529,671	67,899,492	5,632,263
買戻可能受益証券の買戻支払金	(91,330,454)	(7,575,861)	(78,343,765)	(6,498,615)
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	262,938,554	21,810,753	281,324,578	23,335,874

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

2017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(「サブ・ファンド」)。

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。

ダイワ外貨MMFのオルタナティブ投資ファンド運用会社は、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」)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」(「FRS104」)を含む、財務報告評議会によって発行される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を前提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おり、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、取引用に保有される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され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価値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号の金融商品の認識および測定に関する規定を採用する。

### 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(「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けおよび買戻しを受理する。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、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、「FRS第102号の改訂 - 公正価値ヒエラルキーの開示」を早期採用している。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戻可能であり、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。

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。

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）。

	オーストラリア USドル・ ポートフォリオ レベル2 USD	・ドル・ カナダ・ドル・ ポートフォリオ レベル2 AUD	ニュージー ランド・ドル・ ポートフォリオ レベル2 NZD
<b>2017年6月30日</b>			
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
債務証券	1,458,564,288	821,489,421	37,574,631
クーポン未収利息	645,439	430,262	216,864
	<b>1,459,209,727</b>	<b>821,919,683</b>	<b>37,791,495</b>
<b>2016年12月31日</b>			
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
債務証券	1,331,450,364	852,698,086	36,402,445
クーポン未収利息	754,411	3,382,958	76,683
	<b>1,332,204,775</b>	<b>856,081,044</b>	<b>36,479,128</b>

クラスが保有する全証券は、レベル2として分類される。2017年6月30日に終了した6か月間および2016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

2017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	250,606,279	-	-	-	250,606,279
未収債権	-	-	-	1,046,439	1,046,439
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	472,528,005	961,774,863	24,906,859	-	1,459,209,727
資産合計	<b>723,134,284</b>	<b>961,774,863</b>	<b>24,906,859</b>	<b>1,046,439</b>	<b>1,710,862,445</b>
(買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く)負債					
未払債務	-	-	-	6,883,229	6,883,229
負債合計	-	-	-	6,883,229	6,883,229
金利感度ギャップ合計	<b>723,134,284</b>	<b>961,774,863</b>	<b>24,906,859</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

(N/A: 該当なし)

## USドル・ポートフォリオ

2016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	257,143,537	-	-	-	257,143,537
未収債権	-	-	-	3,795,486	3,795,486
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	501,336,630	826,686,169	4,181,976	-	1,332,204,775
資産合計	<b>758,480,167</b>	<b>826,686,169</b>	<b>4,181,976</b>	<b>3,795,486</b>	<b>1,593,143,798</b>
（買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	4,943,371	4,943,371
負債合計	-	-	-	4,943,371	4,943,371
金利感度ギャップ合計	<b>758,480,167</b>	<b>826,686,169</b>	<b>4,181,976</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

## オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

2017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	164,274,356	-	-	-	164,274,356
未収債権	-	-	-	231,894	231,894
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	286,868,386	535,051,297	-	-	821,919,683
資産合計	<b>451,142,742</b>	<b>535,051,297</b>	<b>-</b>	<b>231,894</b>	<b>986,425,933</b>
（買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	4,676,515	4,676,515
負債合計	-	-	-	4,676,515	4,676,515
金利感度ギャップ合計	<b>451,142,742</b>	<b>535,051,297</b>	<b>-</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

## オーストラリア・ドル・ポートフォリオ

2016年12月31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	153,696,064	-	-	-	153,696,064
未収債権	-	-	-	518,043	518,043
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	271,229,002	570,955,149	13,896,893	-	856,081,044
資産合計	<b>424,925,066</b>	<b>570,955,149</b>	<b>13,896,893</b>	<b>518,043</b>	<b>1,010,295,151</b>
（買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	3,614,368	3,614,368
負債合計	-	-	-	3,614,368	3,614,368
金利感度ギャップ合計	<b>424,925,066</b>	<b>570,955,149</b>	<b>13,896,893</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

## カナダ・ドル・ポートフォリオ

2017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	6,879,565	-	-	-	6,879,565
未収債権	-	-	-	115,164	115,164
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	15,559,398	20,923,423	1,308,674	-	37,791,495
資産合計	<b>22,438,963</b>	<b>20,923,423</b>	<b>1,308,674</b>	<b>115,164</b>	<b>44,786,224</b>
（買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	42,119	42,119
負債合計	-	-	-	42,119	42,119
金利感度ギャップ合計	<b>22,438,963</b>	<b>20,923,423</b>	<b>1,308,674</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

## カナダ・ドル・ポートフォリオ

2016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	8,878,150	-	-	-	8,878,150
未収債権	-	-	-	61,107	61,107
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	18,475,043	15,500,832	2,503,253	-	36,479,128
資産合計	<b>27,353,193</b>	<b>15,500,832</b>	<b>2,503,253</b>	<b>61,107</b>	<b>45,418,385</b>
（買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	41,636	41,636
負債合計	-	-	-	41,636	41,636
金利感度ギャップ合計	<b>27,353,193</b>	<b>15,500,832</b>	<b>2,503,253</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

## ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

2017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	39,561,021	-	-	-	39,561,021
未収債権	-	-	-	333,486	333,486
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	81,743,732	142,235,235	-	-	223,978,967
資産合計	<b>121,304,753</b>	<b>142,235,235</b>	<b>-</b>	<b>333,486</b>	<b>263,873,474</b>
（買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	934,920	934,920
負債合計	-	-	-	934,920	934,920
金利感度ギャップ合計	<b>121,304,753</b>	<b>142,235,235</b>	<b>-</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

## ニュージーランド・ドル・ポートフォリオ

2016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	37,505,624	-	-	-	37,505,624
未収債権	-	-	-	185,310	185,310
損益を通じて公正価値で 測定する金融資産	70,790,157	137,627,725	18,388,542	-	226,806,424
資産合計	<b>108,295,781</b>	<b>137,627,725</b>	<b>18,388,542</b>	<b>185,310</b>	<b>264,497,358</b>
（買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産を除く）負債					
未払債務	-	-	-	1,001,965	1,001,965
負債合計	-	-	-	1,001,965	1,001,965
金利感度ギャップ合計	<b>108,295,781</b>	<b>137,627,725</b>	<b>18,388,542</b>	<b>N/A</b>	<b>N/A</b>

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。

## 2017年6月30日

	+50bps	+25bps	+6.25bps	-10bps
USドル・ポートフォリオ	-0.06%	-0.03%	-0.01%	0.01%
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ	-0.05%	-0.02%	-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	-0.05%	-0.03%	-0.01%	0.01%

## 2016年12月31日

	+50bps	+25bps	+6.25bps	-10bps
USドル・ポートフォリオ	-0.05%	-0.03%	-0.01%	0.01%
オーストラリア・ドル・ポートフォリオ	-0.06%	-0.03%	-0.01%	0.01%
カナダ・ドル・ポートフォリオ	-0.04%	-0.02%	0.00%	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）

## 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。

	オーストラリア		ニュージー	
	USドル・ ポートフォリオ	ドル・ ポートフォリオ	カナダ・ドル・ ポートフォリオ	ランド・ドル・ ポートフォリオ
<b>2017年6月30日</b>				
現金	14.66%	16.66%	15.40%	15.01%
10日以下 <10	7.78%	7.10%	9.40%	5.69%
10 - 30日 <=30	19.84%	21.96%	25.13%	20.72%
31 - 60日 <=60	21.52%	25.74%	27.13%	30.99%
61 - 90日 <=90	30.60%	28.54%	19.98%	21.93%
91 - 180日 <=180	5.60%	0.00%	2.96%	5.66%
181 - 365日	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
<b>2016年12月31日</b>				
現金	16.18%	15.21%	19.57%	14.19%
10日以下 <10	9.26%	7.22%	4.41%	3.78%
10 - 30日 <=30	22.27%	19.28%	33.59%	22.68%
31 - 60日 <=60	20.89%	32.58%	36.89%	26.80%
61 - 90日 <=90	31.14%	24.32%	0.00%	25.32%
91 - 180日 <=180	0.26%	1.39%	5.54%	7.23%
181 - 365日	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

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グローバル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、期末現在A+(2016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グローバル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。

	オーストラリア		ニュージー	
	USドル・ ポートフォリオ	・ドル・ ポートフォリオ	カナダ・ドル・ ポートフォリオ	ランド・ドル・ ポートフォリオ
<b>2017年6月30日</b>				
Aaa	2.69%	8.52%	16.97%	6.62%
Aa1	3.59%	11.13%	0.00%	9.48%
Aa2	15.53%	22.86%	21.75%	23.87%
Aa3	10.80%	14.33%	9.00%	21.42%
A1	62.78%	43.16%	52.28%	38.61%
A2	4.61%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
<b>2016年12月31日</b>				
Aaa	1.88%	14.06%	11.68%	12.28%
Aa1	3.12%	13.53%	12.15%	6.41%
Aa2	11.19%	21.17%	35.26%	23.32%
Aa3	22.21%	30.87%	32.36%	23.04%
A1	56.83%	20.37%	8.55%	34.95%
A2	4.77%	0.00%	0.00%	0.00%
未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

上表は、2017年6月30日および2016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。上位3つの格付への投資は、USドル・ポートフォリオでは僅かに増加したが、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・ポートフォリオ双方で昨年度末より僅かに減少し、カナダ・ドル・ポートフォリオでは以前の高水準より大幅に減少した。下位2つの格付への投資は、すべてのポートフォリオ、特にカナダ・ドル・ポートフォリオおよびオーストラリア・ドル・ポートフォリオでは前期末より増加した。

ニュージーランド・ドル・ポートフォリオの全体的な信用度は、前期末より若干低くなったが、USドル・ポートフォリオの信用度はほとんど同等であった。カナダ・ドル・ポートフォリオおよびオーストラリア・ドル・ポートフォリオの信用度は、元々高水準ではあるが、当期中に下落した。特にカナダ・ドル・ポートフォリオは、下位2つの格付を以前よりもかなり多く保有していた。この理由は、最近の格付機関のカナダおよびオーストラリアの銀行セクターに対して講じられた措置にあり、これによりこれらの銀行の大半に1ノッチ(1段階)の格下げが適用された。



全体的にポートフォリオの信用度は、相応に高水準であった。

- \* (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) Acoss 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、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。
- \*\*\* (カナダ・ドル・ポートフォリオで保有される) HSBC Bank Canada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・	・ドル・	カナダ・ドル・	ランド・ドル・
		ポートフォリオ	ポートフォリオ	ポートフォリオ	ポートフォリオ
<b>2017年6月30日</b>					
TD	現金	14.66%	16.66%	15.40%	15.01%
	未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
CD	預金証書	32.36%	24.98%	0.00%	28.36%
CP	コマーシャル・ペーパー	52.98%	56.81%	0.00%	50.01%
CB	社債	0.00%	1.55%	29.79%	6.62%
TB	財務省短期証券	0.00%	0.00%	25.50%	0.00%
BA	銀行引受手形	0.00%	0.00%	16.78%	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%	12.53%	0.00%
Bonds	債券	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
<b>2016年12月31日</b>					
TD	現金	16.18%	15.21%	19.57%	14.19%
	未払金	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
CD	預金証書	39.92%	10.66%	0.00%	15.46%
CP	コマーシャル・ペーパー	42.70%	62.01%	4.41%	59.28%
CB	社債	1.20%	12.12%	17.18%	11.07%
TB	財務省短期証券	0.00%	0.00%	26.45%	0.00%
BA	銀行引受手形	0.00%	0.00%	8.15%	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%	24.24%	0.00%
Bonds	債券	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

2017年6月30日に終了した6か月間および2016年6月30日に終了した6か月間の投資有価証券取引からの(損)益はすべ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、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
<b>2017年6月30日</b>				
ファンド証券売却未収金	1,046,439	231,894	115,164	333,486
	<b>1,046,439</b>	<b>231,894</b>	<b>115,164</b>	<b>333,486</b>
<b>2016年12月31日</b>				
ファンド証券売却未収金	3,795,486	518,043	61,107	185,310
	<b>3,795,486</b>	<b>518,043</b>	<b>61,107</b>	<b>185,310</b>

## 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
<b>2017年6月30日</b>				
ファンド証券買戻未払金	4,854,928	2,794,589	14,411	377,125
未払報酬（注9）	1,916,441	1,799,834	25,087	532,365
未払分配金	111,860	82,092	2,621	25,430
	<b>6,883,229</b>	<b>4,676,515</b>	<b>42,119</b>	<b>934,920</b>
<b>2016年12月31日</b>				
ファンド証券買戻未払金	3,888,236	1,593,281	14,745	405,428
未払報酬（注9）	899,641	1,874,156	24,139	546,721
未払分配金	155,494	146,931	2,752	49,816
	<b>4,943,371</b>	<b>3,614,368</b>	<b>41,636</b>	<b>1,001,965</b>

## 8. 期/年度中の買戻可能受益証券の発行および買戻し

	2017年6月30日 (口数)	2016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	158,820,031,710	174,174,416,352
発行受益証券	74,678,699,479	132,979,002,930
買戻受益証券	(63,100,817,989)	(148,333,387,572)
期末発行済受益証券	<b>170,397,913,200</b>	<b>158,820,031,710</b>
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	100,668,077,125	105,253,245,686
発行受益証券	28,513,620,644	69,988,597,462
買戻受益証券	(31,006,755,949)	(74,573,766,023)
期末発行済受益証券	<b>98,174,941,820</b>	<b>100,668,077,125</b>
カナダ・ドル・ポートフォリオ		
期首発行済受益証券	4,537,674,433	5,916,478,390
発行受益証券	244,590,947	1,345,042,198
買戻受益証券	(307,855,104)	(2,723,846,155)
期末発行済受益証券	<b>4,474,410,276</b>	<b>4,537,674,433</b>
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	26,349,538,600	29,176,883,465
発行受益証券	9,077,361,470	12,492,866,694
買戻受益証券	(9,133,045,911)	(15,320,211,559)
期末発行済受益証券	<b>26,293,854,159</b>	<b>26,349,538,600</b>

## 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。代行協会員および販売会社は、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。

	オーストラリア 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
2017年6月30日				
投資運用報酬	66,740	112,963	182	35,137
管理事務報酬	72,003	81,189	370	22,147
副保管報酬	77,464	87,434	398	23,851
受託会社報酬	38,635	43,717	199	11,925
販売会社報酬および代行協会員報酬	1,106,484	1,249,054	5,678	340,723
監査報酬	39,912	37,009	1,159	6,720
その他の費用	515,203	188,468	17,101	91,862
	<b>1,916,441</b>	<b>1,799,834</b>	<b>25,087</b>	<b>532,365</b>

## 2016年12月31日

投資運用報酬	17,883	121,981	193	37,357
管理事務報酬	21,038	87,123	439	23,352
副保管報酬	22,634	93,825	472	25,148
受託会社報酬	11,288	46,912	236	12,574
販売会社報酬および代行協会員報酬	303,048	1,340,350	6,740	359,255
監査報酬	26,826	18,727	777	4,516
その他の費用	496,924	165,238	15,282	84,519
	<b>899,641</b>	<b>1,874,156</b>	<b>24,139</b>	<b>546,721</b>

## 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、受託会社および投資運用会社、または代理人もしくはグループ会社（「関係会社」）によってダイワ外貨MMFと行われる取引はすべて、対等当事者間取引のように遂行され、受益者の最善の利益に適うものでなければならない。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している。

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。

	2017年6月30日	2016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

各サブ・ファンドについての上表には、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

	2017年 6月30日	2016年 12月31日	2016年 6月30日
USドル・ポートフォリオ			
純資産額（米ドル）	1,703,979,216	1,588,200,427	1,645,491,632
受益証券数（口）	170,397,913,200	158,820,031,710	164,549,157,660
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）	981,749,418	1,006,680,783	1,032,377,424
受益証券数（口）	98,174,941,820	100,668,077,125	103,237,737,828
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）	44,744,105	45,376,749	56,050,197
受益証券数（口）	4,474,410,276	4,537,674,433	5,605,019,631
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）	262,938,554	263,495,393	281,324,578
受益証券数（口）	26,293,854,159	26,349,538,600	28,132,456,891
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

2017年6月30日の後から2017年8月23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232,977,784米ドル、178,021,473豪ドル、257,650カナダ・ドルおよび28,092,301ニュージーランド・ドルの受益証券が発行された。

2017年6月30日の後から2017年8月23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171,419,755米ドル、110,985,395豪ドル、1,573,645カナダ・ドルおよび30,843,309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. 比較数値

包括利益計算書および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上の比較数値は、2016年6月30日に終了した6か月間のものである。財政状態計算書には、ダイワ外貨MMFの直近会計年度末である2016年12月31日現在の比較数値が使われている。

## 17. 財務書類の承認

財務書類は、管理会社の取締役会により、2017年8月25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  
 2017年6月30日

	名目保有高	公正価額 (米ドル)	純資産 比率(%)
<b>債務証券</b>			
<b>オーストラリア (2016年12月31日: 4.47%)</b>			
Mizuho Corp Bank Sydney 1.28% 07-Sep-17	42,000,000	41,901,761	2.46
Mizuho Corp Bank Sydney 1.35% 22-Sep-17	16,000,000	15,951,744	0.93
Rabobank Australia 1.22% 05-Sep-17	70,000,000	69,848,665	4.10
		127,702,170	7.49
<b>ベルギー (2016年12月31日: 0.00%)</b>			
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.19% 30-Aug-17	35,000,000	34,933,096	2.05
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.25% 19-Sep-17	21,000,000	20,943,306	1.23
		55,876,402	3.28
<b>カナダ (2016年12月31日: 0.57%)</b>			
Bank of Montreal 1.25% 13-Sep-17	30,000,000	29,925,236	1.76
Bank of Montreal 1.28% 15-Sep-17	30,000,000	29,921,324	1.75
Toronto-Dominion Bank 1.13% 19-Jul-17	53,000,000	52,973,458	3.11
		112,820,018	6.62
<b>フィンランド (2016年12月31日: 4.46%)</b>			
OP Corporate Bank Plc 1.33% 15-Sep-17	32,000,000	31,912,809	1.87
OP Corporate Bank Plc 0% 20-Sep-17	21,000,000	20,937,999	1.23
OP Corporate Bank Plc 1.38% 16-Oct-17	13,000,000	12,947,909	0.76
		65,798,717	3.86
<b>フランス (2016年12月31日: 12.70%)</b>			
Across (Agence Central) 1.20% 18-Jul-17	45,000,000	44,977,661	2.64
Across (Agence Central) 1.19% 22-Aug-17	25,000,000	24,958,806	1.46
Banque Federative du Credit Mutuel 1.16% 02-Aug-17	40,000,000	39,961,614	2.35
Cades (Caisse D'Amortissement Dette) 1.29% 21-Sep-17	61,000,000	60,825,702	3.57
Cades (Caisse D'Amortissement Dette) 1.33% 04-Oct-17	12,000,000	11,958,950	0.70
		182,682,733	10.72
<b>日本 (2016年12月31日: 19.51%)</b>			
Chugoku Bank 1.31% 10-Aug-17	32,000,000	31,955,899	1.88
Chugoku Bank 1.31% 24-Aug-17	23,000,000	22,956,624	1.35
Chugoku Bank 1.34% 01-Sep-17	23,000,000	22,948,795	1.35
Chiba Bank 1.25% 08-Aug-17	49,000,000	49,000,000	2.88
Chiba Bank 1.36% 29-Sep-17	31,000,000	31,000,000	1.82
Shizuoka Bank 1.23% 03-Jul-17	18,000,000	18,000,000	1.06
Shizuoka Bank 1.22% 26-Jul-17	35,000,000	35,000,000	2.05
Shizuoka Bank 1.23% 22-Aug-17	25,000,000	25,000,000	1.47
		235,861,318	13.86

	名目保有高	公正価額 (米ドル)	純資産 比率(%)
<b>債務証券（続き）</b>			
<b>ルクセンブルグ（2016年12月31日：7.03%）</b>			
DZ Privatbank SA 1.19% 24-Jul-17	35,000,000	34,975,779	2.05
DZ Privatbank SA 1.16% 02-Aug-17	44,000,000	43,957,593	2.58
		<u>78,933,372</u>	<u>4.63</u>
<b>ニュージーランド（2016年12月31日：1.89%）</b>			
Kiwibank Ltd 1.17% 21-Jul-17	30,000,000	29,982,501	1.76
Kiwibank Ltd 1.20% 14-Aug-17	26,000,000	25,963,715	1.52
		<u>55,946,216</u>	<u>3.28</u>
<b>シンガポール（2016年12月31日：2.51%）</b>			
DBS Bank 1.29% 29-Sep-17	40,000,000	39,874,277	2.34
Oversea-Chinese Banking Corp 0% 21-Sep-17	12,000,000	11,965,333	0.70
Temasek Financial II Private Ltd 1.15% 25-Jul-17	21,000,000	20,985,261	1.23
		<u>72,824,871</u>	<u>4.27</u>
<b>国際機関（2016年12月31日：0.61%）</b>			
Eurofima 1.18% 30-Aug-17	9,500,000	9,481,988	0.56
		<u>9,481,988</u>	<u>0.56</u>
<b>スウェーデン（2016年12月31日：1.89%）</b>			
City of Gothenburg 1.18% 10-Aug-17	25,000,000	24,968,955	1.47
		<u>24,968,955</u>	<u>1.47</u>
<b>イギリス（2016年12月31日：23.52%）</b>			
Mitsubishi Corporate Finance 1.21% 10-Jul-17	40,000,000	39,990,656	2.35
Mitsubishi Corporate Finance 1.25% 01-Sep-17	39,000,000	38,918,989	2.28
Mitsubishi UFJ Trust 1.15% 03-Jul-17	80,000,000	80,000,000	4.69
Mizuho Corp Bank London 1.20% 05-Jul-17	20,000,000	19,998,671	1.17
Standard Chartered Bank 1.20% 10-Jul-17	80,000,000	80,000,000	4.69
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.30% 28-Sep-17	22,000,000	21,931,110	1.29
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 1.19% 16-Aug-17	79,000,000	79,000,000	4.64
		<u>359,839,426</u>	<u>21.11</u>
<b>アメリカ合衆国（2016年12月31日：4.65%）</b>			
Schlumberger Finance 1.14% 06-Jul-17	15,000,000	14,998,579	0.88
Schlumberger Finance 1.21% 08-Sep-17	21,000,000	20,952,853	1.23
Schlumberger Finance 1.28% 28-Sep-17	40,000,000	39,876,670	2.34
		<u>75,828,102</u>	<u>4.45</u>
クーポン未収利息（2016年12月31日：0.05%）		<u>645,439</u>	<u>0.04</u>
<b>債務証券合計（2016年12月31日：83.86%）</b>		<u><u>1,459,209,727</u></u>	<u><u>85.64</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  
 2017年6月30日

債務証券	名目保有高	公正価額 (豪ドル)	純資産 比率(%)
<b>オーストラリア</b> (2016年12月31日：28.22%)			
ANZ Bank of New Zealand Limited 5% 25-Jul-17	3,616,000	3,622,577	0.37
Bank of Tokyo-Mitsub UFJ Sydney 1.89% 07-Jul-17	25,000,000	24,994,761	2.55
Bank of Tokyo-Mitsub UFJ Sydney 1.71% 10-Aug-17	20,000,000	19,964,047	2.03
Commonwealth Bank of Australia FRN 24-Jul-17	2,990,000	2,991,014	0.30
DBS Bank 1.73% 22-Aug-17	20,000,000	19,952,156	2.03
DBS Bank 1.71% 30-Aug-17	26,000,000	25,928,682	2.64
Mizuho Corp Bank Sydney 1.85% 22-Aug-17	16,000,000	15,959,192	1.63
Mizuho Corp Bank Sydney 1.78% 11-Sep-17	30,000,000	29,896,647	3.05
National Australia Bank 5% 08-Aug-17	4,131,000	4,143,272	0.42
Oversea-Chinese Banking Corp 1.78% 12-Jul-17	24,000,000	23,989,368	2.44
Rabobank Nederland 1.76% 08-Aug-17	24,000,000	23,957,949	2.44
Rabobank Nederland 1.74% 26-Sep-17	21,000,000	20,914,107	2.13
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.81% 26-Jul-17	15,000,000	14,982,781	1.53
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.74% 31-Aug-17	30,000,000	29,914,585	3.05
United Overseas Bank 1.74% 03-Aug-17	20,000,000	19,970,251	2.03
United Overseas Bank 1.72% 28-Sep-17	20,000,000	19,917,231	2.03
		301,098,620	30.67
<b>カナダ</b> (2016年12月31日：4.56%)			
Bank of Montreal 1.73% 26-Sep-17	20,000,000	19,918,665	2.03
Bank of Montreal 1.75% 15-Sep-17	20,000,000	19,928,376	2.03
Toronto-Dominion Bank 1.73% 15-Aug-17	20,000,000	19,958,854	2.03
Toronto-Dominion Bank 1.78% 19-Sep-17	26,000,000	25,900,475	2.64
		85,706,370	8.73
<b>フィンランド</b> (2016年12月31日：4.85%)			
OP Corporate Bank Plc 1.75% 27-Jul-17	30,000,000	29,965,154	3.05
OP Corporate Bank Plc 1.88% 15-Sep-17	11,250,000	11,206,733	1.14
		41,171,887	4.19
<b>フランス</b> (2016年12月31日：15.38%)			
Across (Agence Central) 1.84% 18-Jul-17	16,000,000	15,987,823	1.63
Across (Agence Central) 1.87% 21-Jul-17	29,000,000	28,973,084	2.95
Banque Federative du Credit Mutuel 1.82% 07-Jul-17	45,000,000	44,990,942	4.58
Cades (Caisse D'Amortissement Dette) 1.76% 20-Sep-17	24,000,000	23,907,722	2.44
Caisse Des Depos ET Consignations 1.67% 02-Aug-17	20,000,000	19,972,285	2.03
		133,831,856	13.63

	名目保有高	公正価額 (豪ドル)	純資産 比率(%)
<b>債務証券（続き）</b>			
<b>ドイツ（2016年12月31日：16.44%）</b>			
FMS Wertmanagement 1.75% 20-Jul-17	20,000,000	19,983,592	2.04
FMS Wertmanagement 1.74% 08-Sep-17	25,000,000	24,919,719	2.54
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 1.70% 14-Jul-17	15,000,000	14,992,230	1.53
Landeskreditbk Baden-Wuertt Foerdbk 1.70% 17-Aug-17	20,000,000	19,957,684	2.03
		<u>79,853,225</u>	<u>8.14</u>
<b>ルクセンブルグ（2016年12月31日：0.00%）</b>			
DZ Privatbank SA 1.83% 13-Jul-17	44,000,000	43,977,736	4.48
		<u>43,977,736</u>	<u>4.48</u>
<b>オランダ（2016年12月31日：2.20%）</b>			
	-	-	-
<b>ニュージーランド（2016年12月31日：3.97%）</b>			
Kiwibank Ltd 1.79% 15-Aug-17	44,000,000	43,906,368	4.47
		<u>43,906,368</u>	<u>4.47</u>
<b>ノルウェー（2016年12月31日：0.50%）</b>			
DNB Bank ASA 1.71% 23-Aug-17	26,000,000	25,937,289	2.64
DNB Bank ASA 1.71% 25-Aug-17	20,000,000	19,949,871	2.03
		<u>45,887,160</u>	<u>4.67</u>
<b>シンガポール（2016年12月31日：5.45%）</b>			
Standard Chartered Bank 1.83% 18-Jul-17	17,000,000	16,987,062	1.73
Standard Chartered Bank 1.73% 22-Sep-17	25,000,000	24,903,116	2.54
		<u>41,890,178</u>	<u>4.27</u>
<b>国際機関（2016年12月31日：1.65%）</b>			
International Bank of Reconstruction and Development 3.5% 26-Sep-17	4,150,000	4,166,021	0.43
		<u>4,166,021</u>	<u>0.43</u>
<b>イギリス（2016年12月31日：1.49%）</b>			
	-	-	-
クーポン未収利息（2016年12月31日：0.34%）		<u>430,262</u>	<u>0.04</u>
<b>債務証券合計（2016年12月31日：85.05%）</b>		<u><b>821,919,683</b></u>	<u><b>83.72</b></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  
 2017年6月30日

	名目保有高	公正価額 (カナダ・ドル)	純資産 比率(%)
<b>債務証券</b>			
<b>カナダ</b> (2016年12月31日 : 75.81%)			
Bank of Montreal 2.39% 12-Jul-17	1,000,000	1,000,348	2.24
Bank of Montreal 4.55% 01-Aug-17	1,500,000	1,504,540	3.36
British Columbia (Province Of) 0.60% 19-Jul-17	1,200,000	1,199,699	2.68
British Columbia (Province Of) 0.70% 20-Sep-17	1,000,000	998,486	2.23
Canadian Imperial Bank of Commerce 3.95% 14-Jul-17	1,500,000	1,501,264	3.36
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.73% 25-Aug-17	2,000,000	1,997,895	4.47
GE Capital Canada Funding Co 5.53% 17-Aug-17	3,400,000	3,419,616	7.64
HSBC Bank of Canada 3.558% 04-Oct-17	1,300,000	1,308,674	2.93
Manitoba (Province Of) 4.7% 22-Sep-17	1,000,000	1,008,764	2.25
Manitoba T-Bill 0% 02-Aug-17	1,700,000	1,699,220	3.80
National Bank of Canada 0.72% 19-Jul-17	1,500,000	1,499,550	3.35
National Bank of Canada 0.73% 05-Sep-17	2,000,000	1,997,451	4.46
Newfoundland T-Bill 0% 06-Jul-17	2,700,000	2,699,909	6.03
Ontario T-Bill 0% 12-Jul-17	2,000,000	1,999,737	4.47
Ontario T-Bill 0% 23-Aug-17	1,500,000	1,498,853	3.35
Quebec T-Bill 0% 15-Sep-17	2,600,000	2,596,253	5.80
Quebec T-Bill 0% 22-Sep-17	900,000	898,860	2.01
Royal Bank of Canada 0.70% 18-Jul-17	2,000,000	1,999,454	4.47
Royal Bank of Canada 2.364% 21-Sep-17	1,400,000	1,404,370	3.14
Saskatchewan (Province Of) 0.59% 04-Jul-17	1,500,000	1,500,000	3.35
Saskatchewan (Province Of) 0.60% 01-Aug-17	1,900,000	1,899,115	4.25
		35,632,058	79.64
<b>フランス</b> (2016年12月31日 : 4.40%)	-	-	-
<b>オランダ</b> (2016年12月31日 : 0.00%)	1,941,000	1,942,573	4.34
Bank Nederlandse Gemeenten 2.375% 24-Jul-17		1,942,573	4.34
クーポン未収利息 (2016年12月31日 : 0.17%)		216,864	0.48
<b>債務証券合計</b> (2016年12月31日 : 80.38%)		37,791,495	84.46

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  
 2017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(%)
<b>債務証券</b>			
<b>オーストラリア</b> (2016年12月31日: 19.81%)			
Bank of Tokyo Mitsubishi 2.04% 29-Sep-17	15,000,000	14,925,769	5.68
Mizuho Corp Bank Sydney 1.95% 08-Sep-17	15,000,000	14,945,809	5.68
United Overseas Bank 1.99% 31-Jul-17	12,000,000	11,981,522	4.56
		41,853,100	15.92
<b>カナダ</b> (2016年12月31日: 7.59%)			
	-	-	-
<b>フィンランド</b> (2016年12月31日: 5.68%)			
OP Corporate Bank Plc 2.03% 15-Sep-17	12,000,000	11,950,174	4.54
		11,950,174	4.54
<b>フランス</b> (2016年12月31日: 18.17%)			
Across (Agence Central) 2.05% 02-Aug-17	17,000,000	16,971,110	6.45
Banque Federative du Credit Mutuel 2.14% 10-Jul-17	15,000,000	14,993,777	5.70
Caisse Des Depos ET Consignations 1.95% 03-Jul-17	15,000,000	15,000,000	5.70
		46,964,887	17.85
<b>ドイツ</b> (2016年12月31日: 8.38%)			
KFW 3.75% 16-Aug-17	4,663,000	4,672,001	1.78
		4,672,001	1.78
<b>ルクセンブルグ</b> (2016年12月31日: 6.43%)			
DZ Privatbank SA 1.94% 24-Aug-17	15,000,000	14,958,174	5.69
		14,958,174	5.69
<b>オランダ</b> (2016年12月31日: 0.00%)			
Nederlandse Waterschapsbank NV 4.25% 26-Jul-17	2,012,000	2,014,777	0.77
Rabobank 1.95% 01-Sep-17	15,000,000	14,951,492	5.69
		16,966,269	6.46
<b>ニュージーランド</b> (2016年12月31日: 5.31%)			
Kiwibank Ltd 2.08% 14-Jul-17	14,000,000	13,991,149	5.32
		13,991,149	5.32
<b>ノルウェー</b> (2016年12月31日: 5.68%)			
DNB Bank ASA 1.91% 07-Aug-17	16,000,000	15,970,432	6.07
		15,970,432	6.07
<b>シンガポール</b> (2016年12月31日: 2.65%)			
DBS Bank 1.97% 12-Jul-17	13,000,000	12,993,630	4.94
Standard Chartered Bank 1.97% 17-Aug-17	17,000,000	16,958,347	6.45
		29,951,977	11.39

	名目保有高	公正価額 (ニュージール ランド・ドル)	純資産 比率(%)
<b>債務証券（続き）</b>			
<b>国際機関（2016年12月31日：0.00%）</b>			
Asian Development Bank 3.25% 20-Jul-17	10,372,000	10,377,615	3.95
		<u>10,377,615</u>	<u>3.95</u>
<b>イギリス（2016年12月31日：6.04%）</b>			
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.90% 22-Sep-17	16,000,000	15,931,927	6.06
		<u>15,931,927</u>	<u>6.06</u>
クーポン未収利息（2016年12月31日：0.32%）		<u>391,262</u>	<u>0.15</u>
<b>債務証券合計（2016年12月31日：86.06%）</b>		<u><b>223,978,967</b></u>	<u><b>85.18</b></u>

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  
 2017年6月30日

	名目取得高	名目売却高
Across (Agence Central) 1.20% 18-Jul-17	45,000,000	-
Bank of Montreal 1.09% 14-Jun-17	45,000,000	-
Cades (Caisse D'Amortissement Dette) 1.18% 22-Jun-17	60,000,000	-
Cades (Caisse D'Amortissement Dette) 1.29% 21-Sep-17	61,000,000	-
Chiba Bank 1.14% 08-May-17	50,000,000	-
Chiba Bank 1.25% 08-Aug-17	49,000,000	-
DZ Privatbank SA 1.16% 02-Aug-17	44,000,000	-
Mitsubishi UFJ Trust 1.05% 04-Apr-17	75,000,000	-
Mitsubishi UFJ Trust 1.15% 03-Jul-17	80,000,000	-
Mizuho Corp Bank Sydney 1.28% 07-Sep-17	42,000,000	-
OP Corporate Bank Plc 1.10% 16-Jun-17	43,000,000	-
Rabobank Australia 1.06% 02-Jun-17	75,000,000	-
Rabobank Australia 1.22% 05-Sep-17	70,000,000	-
Shoko Chukin Bank 1.15% 05-Apr-17	49,000,000	-
Standard Chartered Bank 1.05% 10-Apr-17	75,000,000	-
Standard Chartered Bank 1.20% 10-Jul-17	80,000,000	-
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 1.10% 16-May-17	70,000,000	-
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 1.19% 16-Aug-17	79,000,000	-
Totonto-Dominion Bank 1.02% 19-Apr-17	49,000,000	-
Toronto-Dominion Bank 1.13% 19-Jul-17	53,000,000	-

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  
 2017年6月30日

	名目取得高	名目売却高
Acoss (Agence Central) 1.87% 21-Jul-17	29,000,000	-
Acoss (Agence Central) 1.96% 21-Apr-17	28,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 1.82% 07-Jul-17	45,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 2.04% 07-Apr-17	47,000,000	-
Cades (Caisse D'Amortissement Dette) 1.86% 15-May-17	45,000,000	-
Caisse Des Depos ET Consignations 1.76% 23-May-17	25,000,000	-
DBS Bank 1.71% 30-Aug-17	26,000,000	-
DNB Bank ASA 1.71% 23-Aug-17	26,000,000	-
DZ Privatbank SA 1.83% 13-Jul-17	44,000,000	-
DZ Privatbank SA 1.99% 13-Apr-17	45,000,000	-
Kiwibank Ltd 1.79% 15-Aug-17	44,000,000	-
Kiwibank Ltd 1.87% 12-May-17	40,000,000	-
Mizuho Corp Bank Sydney 1.78% 11-Sep-17	30,000,000	-
Mizuho Corp Bank Sydney 1.85% 09-Jun-17	30,000,000	-
OP Corporate Bank Plc 1.75% 27-Jul-17	30,000,000	-
OP Corporate Bank Plc 1.91% 27-Apr-17	30,000,000	-
Standard Chartered Bank 1.87% 22-Jun-17	27,000,000	-
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.74% 31-Aug-17	30,000,000	-
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.91% 31-May-17	29,000,000	-
Toronto-Dominion Bank 1.78% 19-Sep-17	26,000,000	-

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  
カナダ・ドル・ポートフォリオ

組入証券変動明細表  
 2017年6月30日

	名目取得高	名目売却高
Banque Federative du Credit Mutuel 0.85% 30-May-17	3,500,000	-
Bank Nederlandse Gemeenten 2.375% 24-Jul-17	1,941,000	-
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.73% 25-Aug-17	2,000,000	-
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.81% 01-Jun-17	2,000,000	-
Canadian Imperial Bank of Commerce 0.84% 10-Mar-17	2,000,000	-
GE Capital Canada Funding Co 5.53% 17-Aug-17	3,400,000	-
Manitoba FRN 03-Apr-17	1,855,000	-
National Bank of Canada 0.73% 05-Sep-17	2,000,000	-
New Brunswick T-Bill 0% 11-Apr-17	3,000,000	-
New Brunswick 6.75% 27-Jun-17	2,072,000	-
Newfoundland T-Bill 0% 06-Apr-17	1,900,000	-
Newfoundland T-Bill 0% 06-Jul-17	2,700,000	-
Ontario T-Bill 0% 12-Jul-17	2,000,000	-
Ontario T-Bill 0% 19-Apr-17	2,000,000	-
Quebec (Province Of) 0.59% 31-Mar-17	1,800,000	-
Quebec T-Bill 0% 15-Sep-17	2,600,000	-
Quebec T-Bill 0% 29-Jun-17	2,700,000	-
Royal Bank of Canada 0.70% 18-Jul-17	2,000,000	-
Royal Bank of Canada 2.58% 13-Apr-17	2,500,000	-
Saskatchewan (Province Of) 0.60% 01-Aug-17	1,900,000	-

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  
 2017年6月30日

	名目取得高	名目売却高
Acoss (Agence Central) 2.05% 02-Aug-17	17,000,000	-
Acoss (Agence Central) 2.13% 02-May-17	17,000,000	-
Bank of Tokyo Mitsubishi 2.04% 29-Sep-17	15,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 2.14% 10-Jul-17	15,000,000	-
Banque Federative du Credit Mutuel 2.34% 10-Apr-17	15,000,000	-
Cades (Caisse D'Amortissement Dette) 1.96% 28-Jun-17	16,000,000	-
Caisse Des Depos ET Consignations 1.95% 03-Jul-17	15,000,000	-
DNB Bank ASA 1.91% 07-Aug-17	16,000,000	-
DNB Bank ASA 2.02% 08-May-17	16,000,000	-
DZ Privatbank SA 1.94% 24-Aug-17	15,000,000	-
Kiwibank Ltd 2.08% 14-Jul-17	14,000,000	-
Kiwibank Ltd 2.16% 13-Apr-17	14,000,000	-
Mizuho Corp Bank Sydney 1.95% 08-Sep-17	15,000,000	-
OP Corporate Bank Plc 2.05% 19-Jun-17	15,000,000	-
OP Corporate Bank Plc 2.26% 18-Apr-17	15,000,000	-
Rabobank 1.95% 01-Sep-17	15,000,000	-
Rabobank 2.05% 01-Jun-17	14,000,000	-
Standard Chartered Bank 1.97% 17-Aug-17	17,000,000	-
Sumitomo Mitsui Banking Corp 1.90% 22-Sep-17	16,000,000	-
Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.03% 23-Jun-17	16,000,000	-

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。2017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5,798万円)および6,250万ユーロ(約81億313万円)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29年7月31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=144.94円、1ユーロ=129.65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年欧州連合(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

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。

2017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：1,978,773,733.55米ドル、1,065,427,799.68豪ドル、5,071,155.63ユーロ、63,734,714.78カナダ・ドル、251,198,326.88ニュージーランド・ドル、21,783,966,579円および1,013,557,521.96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	1,730,426,837.91米ドル
			1,012,791,564.49豪ドル
			44,224,794.45カナダ・ドル
			251,198,326.88ニュージーランド・ドル
アイルランド	その他	4	248,346,895.64米ドル
			52,636,235.19豪ドル
			5,071,155.63ユーロ
			19,509,920.33カナダ・ドル
			21,783,966,579円
			1,013,557,521.96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1兆1,129億円)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8,324億円)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8,163億円)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7,657億円)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29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=111.29円、1豪ドル=83.24円、1カナダ・ドル=81.63円および1ニュージーランド・ドル=76.57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1兆1,035億円)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8,790億円)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8,846億円)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8,295億円)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29年7月31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=110.35円、1豪ドル=87.90円、1カナダ・ドル=88.46円および1ニュージーランド・ドル=82.95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1兆1,129億円)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8,324億円)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8,163億円)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7,657億円)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29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=111.29円、1豪ドル=83.24円、1カナダ・ドル=81.63円および1ニュージーランド・ドル=76.57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1兆1,035億円)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8,790億円)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8,846億円)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8,295億円)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29年7月31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=110.35円、1豪ドル=87.90円、1カナダ・ドル=88.46円および1ニュージーランド・ドル=82.95円)による。

(後略)

## (8) 申込取扱場所

&lt; 訂正前 &gt;

(前 略)

SMBCフレンド証券株式会社<sup>(注5)</sup> 東京都中央区日本橋兜町7番12号

(以下「SMBCフレンド証券」という。)

丸三証券株式会社<sup>(注6)</sup> 東京都千代田区麹町三丁目3番6

(以下「丸三証券」という。)

ひろぎん証券株式会社<sup>(注7)</sup> 広島県広島市中区立町2番30号

(以下「ひろぎん証券」という。)

(中 略)

(注7) ひろぎん証券においては、USドル・ポートフォリオのみの申込みの取扱いを行う。なお、ひろぎん証券は、平成29年6月1日付で、「ひろぎんウツミ屋証券株式会社」から「ひろぎん証券株式会社」へ商号を変更した。

&lt; 訂正後 &gt;

(前 略)

SMBCフレンド証券株式会社<sup>(注5)(\*)</sup> 東京都中央区日本橋兜町7番12号

(以下「SMBCフレンド証券」という。)

丸三証券株式会社<sup>(注6)</sup> 東京都千代田区麹町三丁目3番6

(以下「丸三証券」という。)

ひろぎん証券株式会社<sup>(注7)</sup> 広島県広島市中区立町2番30号

(以下「ひろぎん証券」という。)

(中 略)

(注7) ひろぎん証券においては、USドル・ポートフォリオのみの申込みの取扱いを行う。

\*平成30年1月1日付でSMBCフレンド証券株式会社はSMBC日興証券株式会社と合併する。合併後の存続会社はSMBC日興証券であり、合併後の社名はSMBC日興証券株式会社となる。以下同じ。



## 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>

(2017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>

(2017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

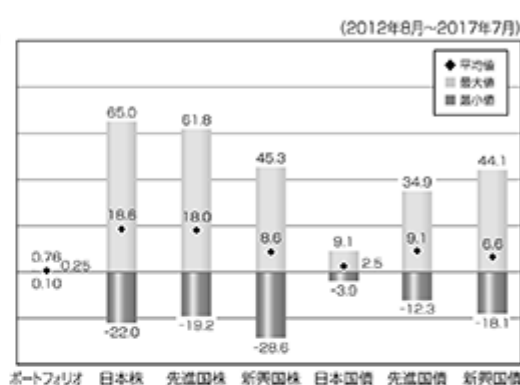
以下の内容に更新されます。

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、2011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。

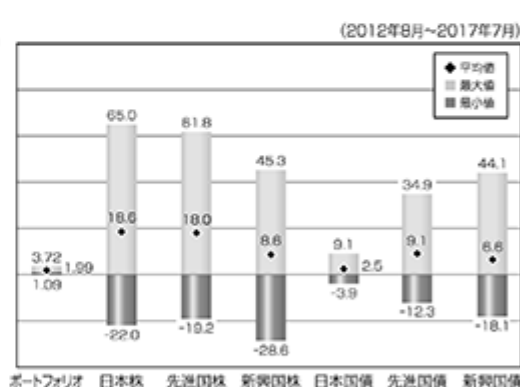
ポートフォリオの課税前分配金再投資換算  
1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

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

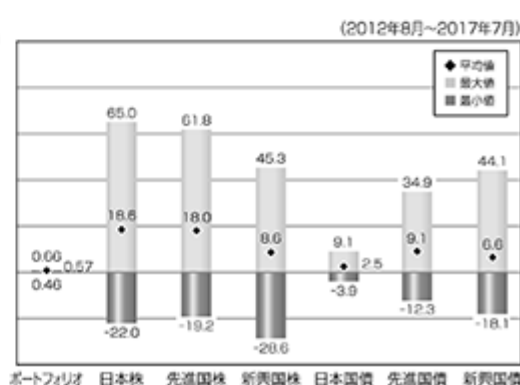
#### USドル・ポートフォリオ



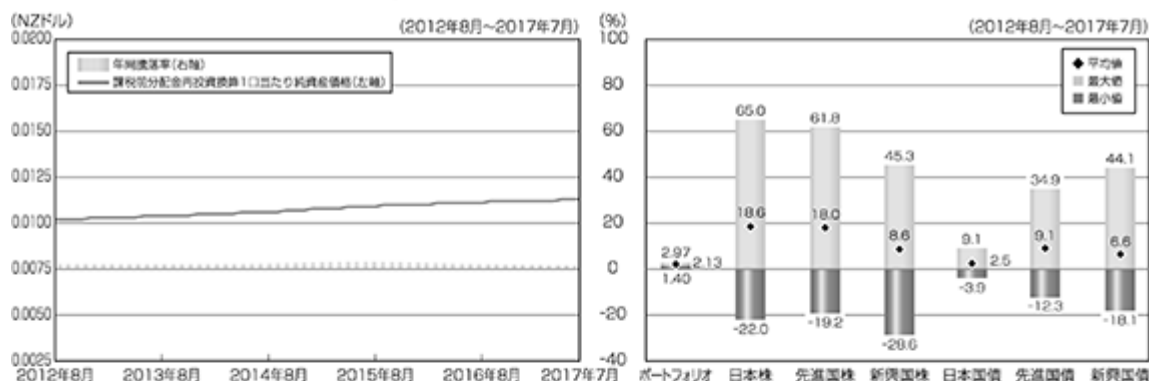
#### オーストラリア・ドル・ポートフォリオ



#### 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](#)