

ダイワ外国為替債券戦略ファンド (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版) 第26期

(決算日 2024年2月26日)
(作成対象期間 2023年8月26日～2024年2月26日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、内外の債券に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券
信託期間	2011年1月7日～2026年2月25日
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の債券
株式組入限	純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、継続した分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 分配	入金 期騰落 中率			
22期末 (2022年2月25日)	円 7,488	円 100	% △ 4.3	% 92.7	% 7.9	百万円 8,294
23期末 (2022年8月25日)	6,951	110	△ 5.7	92.4	4.8	7,361
24期末 (2023年2月27日)	6,421	90	△ 6.3	95.2	—	5,228
25期末 (2023年8月25日)	6,446	100	1.9	99.3	—	5,171
26期末 (2024年2月26日)	6,507	90	2.3	98.7	—	4,857

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

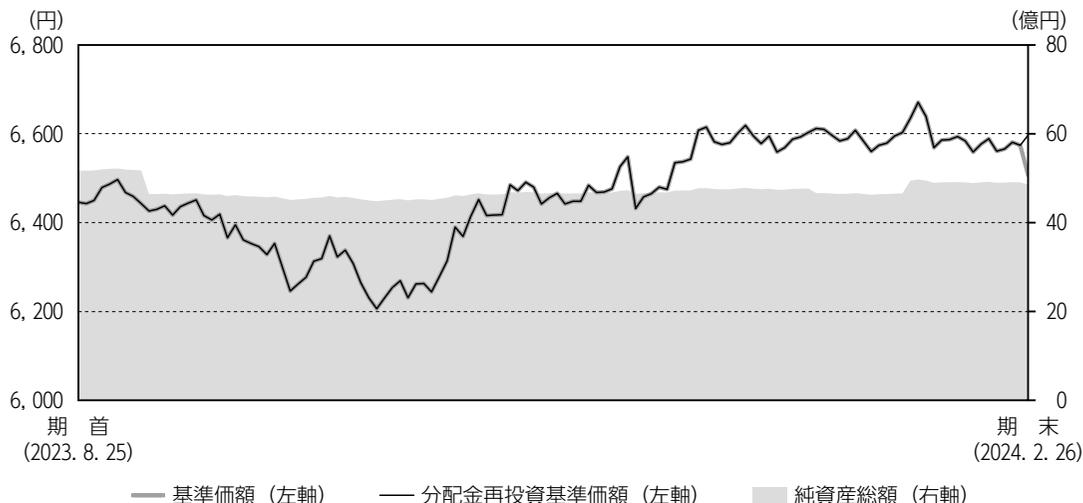
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：6,446円

期末：6,507円（分配金90円）

騰落率：2.3%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

為替相場が円安になったことや、保有する債券の価格上昇および利息収入から、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ外国為替債券戦略ファンド（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %		
(期 首) 2023年 8月25日	6,446	—	99.3	—
8月末	6,487	0.6	99.4	—
9月末	6,328	△ 1.8	99.5	—
10月末	6,244	△ 3.1	98.6	—
11月末	6,484	0.6	98.0	—
12月末	6,595	2.3	96.9	—
2024年 1月末	6,603	2.4	104.2	—
(期 末) 2024年 2月26日	6,597	2.3	98.7	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2023. 8. 26 ~ 2024. 2. 26)

■グローバル債券市況

主要国の国債利回りはおおむね低下、米国の長期ゾーンや日本の利回りは上昇しました。

グローバル債券市況は、当作成期首から2023年10月にかけて、欧州での利上げやFOMC（米国連邦公開市場委員会）での2024年と2025年の政策金利見通しの引き上げ、米国の雇用統計や小売売上高など米国経済の堅調さを示す経済指標の発表、日銀の金融政策の修正などを受け、利回りはおおむね上昇しました。12月にかけては、主要国で政策金利が横ばいになったことや物価上昇率が鈍化する動きなどから、利回りは低下しました。その後は当作成期末にかけて、欧米の早期利下げ観測の後退などを背景に、利回りは上昇しました。

■為替相場

主要通貨の対円為替相場は上昇（円安）しました。

対円為替相場は、当作成期首から2023年11月半ばにかけて、日銀の長期金利1%超えを容認する動きなどは円高材料となりましたが、欧州での利上げやFOMC（米国連邦公開市場委員会）での政策金利見通しの上方修正などを受け、円安が進行しました。12月にかけては、日本政府・日銀による為替介入への警戒が高まったことや、主要国で政策金利が横ばいになったことなどを背景に、おおむね円高の動きとなりました。その後は当作成期末にかけて、欧米の早期利下げ観測が後退した一方で、日銀副総裁がマイナス金利解除後も緩和的な金融環境を維持する考えを示したことなどの影響で、円安の動きに戻りました。

前作成期末における「今後の運用方針」

大和証券株式会社から運用にかかる助言を受けて運用を行います。なお、投資助言者の運用方針は以下の通りです。

(2022年8月31日以降の投資助言者の運用方針)

債券投資と機動的な為替ヘッジ率調整の組み合わせによって、安定した収益の確保をめざします。債券の投資対象国の割合については、米国を重視する方針です。これらは、債券と為替の市場データ分析などを参考に運用を行い、またファンダメンタルズ分析やテクニカル分析を活用し、金利と為替のリスク調整を適宜行い、収益の計上をめざします。

ポートフォリオについて

（2023. 8. 26 ~ 2024. 2. 26）

主として、内外の債券に投資するとともに為替ヘッジ取引を機動的に活用し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。また、大和証券株式会社から運用にかかる助言を受けて運用を行いました。

ドル通貨圏、欧州通貨圏および日本の各国国債への分散投資を継続しました。債券ポートフォリオの国別配分と修正デュレーションは、当作成期首とおおむね同程度で当作成期末を迎え、米国への高い配分での運用を行いました。為替ヘッジ比率については、投資通貨について下げる調整を行い、ポートフォリオのヘッジ比率は当作成期首より30%程度低くし、30%台半ばで取引を終えました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当期	
	2023年8月26日 ～2024年2月26日	
当期分配金（税込み）	(円)	90
対基準価額比率	(%)	1.36
当期の収益	(円)	90
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	409

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 102.50円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	202.45
(d) 分配準備積立金	194.96
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	499.91
(f) 分配金	90.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	409.91

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

大和証券株式会社から運用にかかる助言を受けて運用を行います。なお、投資助言者の運用方針は以下の通りです。

(2022年8月31日以降の投資助言者の運用方針)

債券投資と機動的な為替ヘッジ率調整の組み合わせによって、安定した収益の確保をめざします。債券の投資対象国の割合については、米国を重視する方針です。これらは、債券と為替の市場データ分析などを参考に運用を行い、またファンダメンタルズ分析やテクニカル分析を活用し、金利と為替のリスク調整を適宜行い、収益の計上をめざします。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023. 8. 26～2024. 2. 26)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	25円	0. 389%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は6, 466円です。
（投 信 会 社）	(16)	(0. 250)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(7)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(2)	(0. 028)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 013	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(1)	(0. 008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(0)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	26	0. 402	

(注 1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

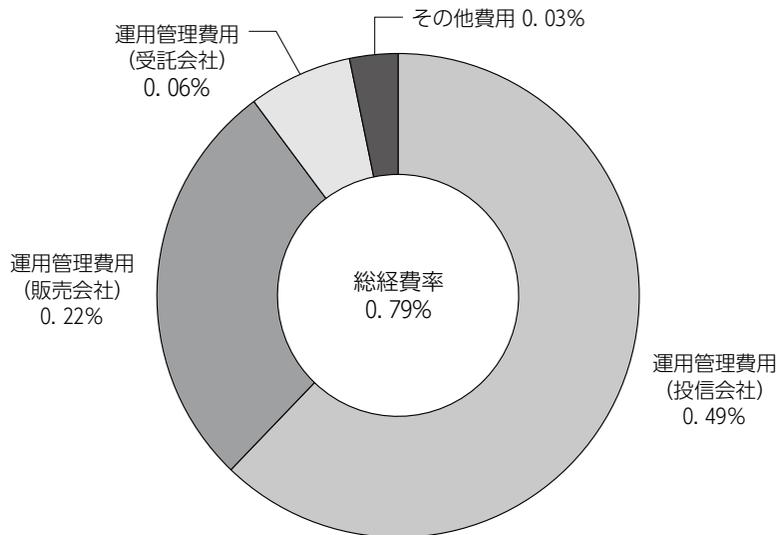
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.79%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

ダイワ外国為替債券戦略ファンド（ダイワSMA専用）

■売買および取引の状況

公 社 債

(2023年8月26日から2024年2月26日まで)

		買付額	売付額
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 8,937	千アメリカ・ドル 10,530 (ー)
	カナダ	千カナダ・ドル 393	千カナダ・ドル 672 (ー)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 893	千オーストラリア・ドル ー (ー)
	ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル ー	千ニュージーランド・ドル 588 (ー)

		買付額	売付額
外 国	イギリス	千イギリス・ポンド 1,115	千イギリス・ポンド 1,758 (ー)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ ー	千ユーロ 1,173 (ー)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2023年8月26日から2024年2月26日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3% 2024/6/30	563,016	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3.125% 2029/8/31	703,825
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4.5% 2033/11/15	241,927	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3% 2024/6/30	510,520
UNITED KINGDOM GILT (イギリス) 3.25% 2033/1/31	204,154	United Kingdom Gilt (イギリス) 4.5% 2042/12/7	257,969
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4.125% 2053/8/15	182,786	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 6.625% 2027/2/15	175,163
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4.75% 2053/11/15	158,820	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 6.5% 2027/7/4	125,510
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4% 2031/1/31	88,201	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4.125% 2053/8/15	100,452
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) (オーストラリア) 3% 2033/11/21	86,662	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 8% 2027/6/1	72,694
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4.25% 2026/1/31	73,688	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 4.75% 2040/7/4	60,086
CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 3.25% 2033/12/1	43,349	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3.625% 2053/2/15	52,674
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND (ニュージーランド) 4.5% 2027/4/15	52,495

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	額 面 金 額	当 期			末		
		評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 90,000	千円 105,132	% 2.2	% —	% 2.2	% —	% —

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(2)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国債証券	29 30年国債	% 2.4000	千円 60,000	千円 70,812	2038/09/20
	34 30年国債	2.2000	30,000	34,320	2041/03/20
合 計	2銘柄		90,000	105,132	

(注) 単位未満は切捨て。

(3)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期		組入比率	うちBB格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額					
アメリカ	千アメリカ・ドル 18,570	千アメリカ・ドル 17,487	千円 2,629,351	% 54.1	% —	% 51.3	% —	% 2.8
カナダ	千カナダ・ドル 1,400	千カナダ・ドル 1,508	167,830	3.5	—	3.5	—	—
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 2,600	千オーストラリア・ドル 2,396	236,168	4.9	—	4.9	—	—
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 1,300	千ニュージーランド・ドル 1,200	111,299	2.3	—	1.7	0.6	—
イギリス	千イギリス・ポンド 4,120	千イギリス・ポンド 4,112	782,985	16.1	—	12.7	3.4	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 6,000	千スウェーデン・クローネ 6,666	97,063	2.0	—	2.0	—	—
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 3,500	千ユーロ 4,071	662,251	13.6	—	12.9	0.8	—
合 計	—	—	4,686,950	96.5	—	88.9	4.7	2.8

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

ダイワ外国為替債券戦略ファンド（ダイワSMA専用）

(4)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区分	銘柄	種類	当 期 年利率	期 額面金額	末 評 価 額		償還年月日
					外貨建金額		
					千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,000	987	148,468	2041/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	420	416	62,639	2024/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	7,300	6,510	978,985	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	4,620	4,358	655,289	2029/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	650	612	92,114	2033/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	200	174	26,225	2053/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	680	649	97,730	2053/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	1,600	1,628	244,935	2033/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	1,000	1,062	159,686	2053/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	600	589	88,700	2031/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	500	495	74,576	2026/01/31
通貨小計	銘柄数 金額	11銘柄		18,570	17,487	2,629,351	
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	400	471	52,420	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	600	644	71,693	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	400	392	43,716	2033/12/01
通貨小計	銘柄数 金額	3銘柄		1,400	1,508	167,830	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,000	1,024	100,941	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	467	46,026	2047/03/21
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,000	905	89,200	2033/11/21
通貨小計	銘柄数 金額	3銘柄		2,600	2,396	236,168	
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	300	297	27,559	2027/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,000	903	83,740	2033/04/14
通貨小計	銘柄数 金額	2銘柄		1,300	1,200	111,299	
イギリス	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.2500	1,150	1,081	205,953	2033/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	800	869	165,617	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,100	2,092	398,440	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	70	68	12,973	2040/12/07
通貨小計	銘柄数 金額	4銘柄		4,120	4,112	782,985	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,000	6,666	97,063	2039/03/30
通貨小計	銘柄数 金額	1銘柄		6,000	6,666	97,063	

ダイワ外国為替債券戦略ファンド（ダイワSMA専用）

区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000%	200	224	36,580	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,000	1,209	196,737	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,200	1,552	252,465	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,100	1,084	176,467	2029/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	4銘柄		3,500	4,071	662,251	
合 計	銘柄数 金 額	28銘柄				4,686,950	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年2月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,792,083	96.2
コール・ローン等、その他	191,113	3.8
投資信託財産総額	4,983,196	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、2月26日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝150.36円、1カナダ・ドル＝111.24円、1オーストラリア・ドル＝98.53円、1ニュージーランド・ドル＝92.68円、1イギリス・ポンド＝190.40円、1スウェーデン・クローネ＝14.56円、1ユーロ＝162.67円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（4,854,587千円）の投資信託財産総額（4,983,196千円）に対する比率は、97.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年2月26日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,879,920,698円
コール・ローン等	49,235,119
公社債（評価額）	4,792,083,179
未収入金	1,989,062,603
未収利息	44,784,661
前払費用	2,892,809
その他未収収益	1,784,380
差入委託証拠金	77,947
(B) 負債	2,022,544,772
未払金	1,936,791,030
未払収益分配金	67,183,447
未払信託報酬	18,373,531
その他未払費用	196,764
(C) 純資産総額（A－B）	4,857,375,926
元本	7,464,827,504
次期繰越損益金	△ 2,607,451,578
(D) 受益権総口数	7,464,827,504口
1万口当り基準価額（C/D）	6,507円

* 期首における元本額は8,022,391,708円、当作成期間中における追加設定元本額は416,779,734円、同解約元本額は974,343,938円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は6,507円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,607,451,578円です。

ダイワ外国為替債券戦略ファンド（ダイワSMA専用）

■損益の状況

当期 自2023年8月26日 至2024年2月26日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	90,190,399円
受取利息	88,530,678
その他収益金	1,660,681
支払利息	△ 960
(B) 有価証券売買損益	35,054,234
売買益	285,064,786
売買損	△ 250,010,552
(C) 信託報酬等	△ 18,989,333
(D) 当期損益金 (A + B + C)	106,255,300
(E) 前期繰越損益金	△ 2,547,671,397
(F) 追加信託差損益金	△ 98,852,034
(配当等相当額)	(151,127,537)
(売買損益相当額)	(△ 249,979,571)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 2,540,268,131
(H) 収益分配金	△ 67,183,447
次期繰越損益金 (G + H)	△ 2,607,451,578
追加信託差損益金	△ 98,852,034
(配当等相当額)	(151,127,537)
(売買損益相当額)	(△ 249,979,571)
分配準備積立金	154,867,653
繰越損益金	△ 2,663,467,197

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	76,516,180円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	151,127,537
(d) 分配準備積立金	145,534,920
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	373,178,637
(f) 分配金	67,183,447
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	305,995,190
(h) 受益権総口数	7,464,827,504口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 （ 税 込 み ）

90円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。