

# ダイワ豪ドル建て 高利回り証券ファンド — 予想分配金提示型 —

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	追加型投信／海外／資産複合
信託期間	2012年10月18日～2024年10月17日
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
組入制限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
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、分配対象額の範囲内で、下記イ. およびロ. に基づき分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。 イ. 計算期末の前営業日の基準価額(1万口当り。既払分配金を加算しません。以下同じ。)が10,500円未満の場合、原則として、主要投資対象とする外国投資信託のポートフォリオにおける利子・配当収入相当分から経費(外国投資信託の経費を含みます。)を控除した額を分配することをめざします。 ロ. 計算期末の前営業日の基準価額が10,500円以上の場合、原則として、当該基準価額に応じ、下記の金額(1万口当り)を分配することをめざします。 a. 10,500円以上11,000円未満の場合…100円 b. 11,000円以上11,500円未満の場合…150円 c. 11,500円以上12,000円未満の場合…200円 d. 12,000円以上12,500円未満の場合…250円 e. 12,500円以上の場合…300円 なお、計算期末の前営業日から当該計算期末までに基準価額が急激に変動した場合等には、上記の分配を行わないことがあります。

## 運用報告書(全体版)

第139期 (決算日 2024年5月17日)  
第140期 (決算日 2024年6月17日)  
第141期 (決算日 2024年7月17日)  
第142期 (決算日 2024年8月19日)  
第143期 (決算日 2024年9月17日)  
満期償還 (償還日 2024年10月17日)

(作成対象期間 2024年4月18日～2024年10月17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、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、高利回りの獲得を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしており、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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/>

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比	債券 比率	投資信託 証券 組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込	期騰 落				
	円	円	%	%	%	百万円	
115期末 (2022年 5月17日)	9,515	20	△ 5.1	—	98.4	2,962	
116期末 (2022年 6月17日)	9,632	20	1.4	—	98.4	2,949	
117期末 (2022年 7月19日)	9,830	20	2.3	—	99.3	2,993	
118期末 (2022年 8月17日)	9,937	20	1.3	—	99.1	2,990	
119期末 (2022年 9月20日)	10,096	20	1.8	—	97.1	2,985	
120期末 (2022年10月17日)	9,731	30	△ 3.3	—	98.0	2,858	
121期末 (2022年11月17日)	9,831	30	1.3	—	98.7	2,880	
122期末 (2022年12月19日)	9,618	30	△ 1.9	—	98.4	2,778	
123期末 (2023年 1月17日)	9,404	30	△ 1.9	—	97.9	2,620	
124期末 (2023年 2月17日)	9,820	30	4.7	—	98.1	2,691	
125期末 (2023年 3月17日)	9,485	30	△ 3.1	—	99.3	2,580	
126期末 (2023年 4月17日)	9,497	30	0.4	—	98.8	2,556	
127期末 (2023年 5月17日)	9,593	30	1.3	—	97.7	2,571	
128期末 (2023年 6月19日)	10,157	30	6.2	—	97.7	2,694	
129期末 (2023年 7月18日)	9,964	40	△ 1.5	—	97.3	2,605	
130期末 (2023年 8月17日)	9,971	40	0.5	—	98.6	2,586	
131期末 (2023年 9月19日)	10,104	40	1.7	—	98.3	2,590	
132期末 (2023年10月17日)	10,062	40	△ 0.0	—	98.5	2,525	
133期末 (2023年11月17日)	10,286	40	2.6	—	97.5	2,574	
134期末 (2023年12月18日)	10,182	40	△ 0.6	—	97.5	2,514	
135期末 (2024年 1月17日)	10,407	40	2.6	—	97.4	2,541	
136期末 (2024年 2月19日)	10,481	100	1.7	—	98.2	2,505	
137期末 (2024年 3月18日)	10,492	40	0.5	0.0	97.0	2,507	
138期末 (2024年 4月17日)	10,561	100	1.6	0.0	97.5	2,526	
139期末 (2024年 5月17日)	10,965	150	5.2	0.0	97.7	2,612	
140期末 (2024年 6月17日)	10,903	150	0.8	0.0	97.6	2,591	
141期末 (2024年 7月17日)	11,061	150	2.8	0.0	97.1	2,616	
142期末 (2024年 8月19日)	10,272	30	△ 6.9	0.0	97.4	2,414	
143期末 (2024年 9月17日)	9,860	30	△ 3.7	0.0	97.5	2,244	
償還 (2024年10月17日)	9,973.01	—	1.1	—	—	1,986	

(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、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

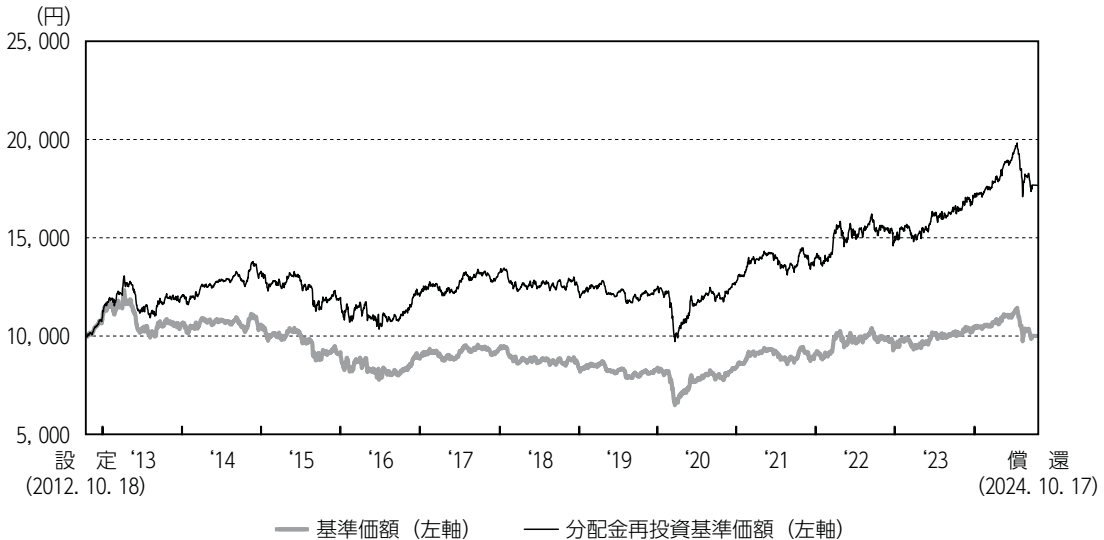
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



\* 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

設定時：10,000円

償還時：9,973円01銭（既払分配金5,740円）

騰落率：76.6%（分配金再投資ベース）

### ■ 基準価額の主な変動要因

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券等に投資した結果、豪ドル円が上昇（円安）したことや、保有債券からの利息収入などがプラス要因となり、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド -予想分配金提示型-

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %		
第139期	(期首) 2024年4月17日	10,561	—	0.0	97.5
	4月末	10,914	3.3	0.0	97.7
	(期末) 2024年5月17日	11,115	5.2	0.0	97.7
第140期	(期首) 2024年5月17日	10,965	—	0.0	97.7
	5月末	10,991	0.2	0.0	97.9
	(期末) 2024年6月17日	11,053	0.8	0.0	97.6
第141期	(期首) 2024年6月17日	10,903	—	0.0	97.6
	6月末	11,160	2.4	0.0	97.9
	(期末) 2024年7月17日	11,211	2.8	0.0	97.1
第142期	(期首) 2024年7月17日	11,061	—	0.0	97.1
	7月末	10,514	△ 4.9	0.0	98.1
	(期末) 2024年8月19日	10,302	△ 6.9	0.0	97.4
第143期	(期首) 2024年8月19日	10,272	—	0.0	97.4
	8月末	10,341	0.7	0.0	99.1
	(期末) 2024年9月17日	9,890	△ 3.7	0.0	97.5
償還期	(期首) 2024年9月17日	9,860	—	0.0	97.5
	9月末	9,978	1.2	0.0	—
	(償還) 2024年10月17日	9,973.01	1.1	—	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

(2012. 10. 18 ~ 2024. 10. 17)

## ■ オーストラリア債券市場

オーストラリア債券市場では、金利は上昇（債券価格は下落）しました。

オーストラリア債券市場では、当ファンド設定日から2013年末にかけて、世界的な株価上昇に伴い経済環境の好転期待が高まったことなどにより上昇した米国金利につられ、オーストラリアにおいても金利は上昇しました。2014年から2016年9月末にかけては、ウクライナ情勢の悪化やRBA（オーストラリア準備銀行）が政策金利を引き下げたこと、さらに2016年6月後半には英国のEU（欧州連合）離脱の是非を問う国民投票でEU離脱派が勝利したことなどから、オーストラリア金利は低下（債券価格は上昇）基調で推移しました。その後、米国の政策金利が断続的に引き上げられたことなどを背景に欧米の金利が上昇する中、オーストラリア金利はやや水準を切上げてレンジ推移となりました。2019年に入ると、米国の利上げ打ち止めや世界的なインフレ沈静を背景にオーストラリア金利は低下に転じ、特に2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などからリスク回避的な動きが強まりました。年半ばにかけては、世界的な経済活動の低迷への懸念から株価や原油価格が下落し、RBAを含め各国の中央銀行が大幅な金融緩和に積極的な姿勢を示したことなどから、金利は低位で安定推移となりました。10月以降は、米国の追加経済対策への期待やFRB（米国連邦準備制度理事会）高官による金利上昇を容認する発言などから、米国金利に連れてオーストラリア金利は上昇しました。2022年1月以降は、米国のほか欧州においても金融引き締め観測が高まり、さらにはロシアのウクライナ侵攻やインフレ圧力なども加わったことから、世界的に金利は上昇しました。またRBAにおいても、政策金利の引き上げの実施により、オーストラリア金利は上昇しました。その後は、RBAによる追加利上げへの過度な懸念が後退したことなどから、オーストラリア金利は低下しました。

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券の信用スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は、当ファンド設定日から2014年後半にかけては、投資家などの堅調な買い需要を背景として、縮小基調の推移となりました。その後は、世界景気の先行きに対する懸念や原油価格の下落など商品市況の低迷などから、2016年2月にかけて信用スプレッドは拡大傾向となりました。2017年末にかけては、米国の景気後退懸念が弱まり世界景気への楽観的見方が大勢となったことなどに加え、需給およびファンダメンタルズ両面の好材料に支えられ、信用スプレッドは縮小しました。2019年末にかけては、新発債の起債増加や地政学リスクの高まりなどで世界的に信用スプレッドは拡大傾向となりましたが、オーストラリアでは投資家需要に支えられ、2020年初旬にかけてタイトな推移となりました。1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念からリスク回避的な動きが強ま

り、信用スプレッドは急拡大したものの各国経済対策などから低金利が続き、利回りに対する強い投資家需要から信用スプレッドは大きく縮小しました。2022年1月以降は、米国や欧州において金融引き締め観測が高まり、信用スプレッドも拡大基調となりました。2022年後半にかけても、ロシアのウクライナ侵攻、インフレ圧力の見通しや世界経済の減速懸念などを背景に、市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、軟調に推移しました。その後は、オーストラリアでの堅調な労働市場や底堅い成長見通しなどが投資家心理を下支えするなど、タイトに推移しました。

## 為替相場

豪ドルは対円で上昇（円安）しました。

豪ドル対円為替相場は、当ファンド設定日から2013年4月上旬にかけて、日本の総選挙において自民党が大勝し、4月に日銀が「量的・質的金融緩和」の導入を決定したことで、上昇しました。しかし、中国景気の減速懸念に加えて、金融当局者から通貨高をけん制する発言が見られたことから豪ドルは対円で下落しました。その後やや上昇したものの、中国景気の悪化懸念による商品市況の低迷、RBA（オーストラリア準備銀行）が政策金利の引き下げを決定したこと、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことなどから、2016年半ばにかけて下落（円高）基調で推移しました。その後は、資源価格の上昇などから豪ドルは対円で上昇基調となったものの、2018年以降は、株価や原油価格が下落したことに加え、2020年には新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などからリスク回避的な動きが強まったことから、3月まで豪ドルは対円で大きく下落しました。その後は、世界的な経済対策への期待感や、ウクライナ情勢の緊迫化などから資源価格が上昇したことで、豪ドルは対円で上昇に転じました。日銀が長短金利操作の修正など異次元の金融緩和姿勢をやや後退させたことや、欧米の銀行不安を背景に投資家心理が悪化したことから、豪ドルは対円で下落する場面もありましたが、日銀が各国政府・中央銀行に比べて著しく緩和的な金融政策を続ける中で内外金利差の拡大が意識され、2024年6月にかけて、豪ドルは上昇基調で推移しました。償還期末にかけては、オーストラリア債券の金利低下により内外金利差が縮小したことや、日銀の追加利上げへの警戒感が高まったことなどを背景に、豪ドルは対円で下落しました。

## 信託期間中の運用方針

### 当ファンド

主として、「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」の受益証券への投資を通じて、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、高利回りの獲得

をめざします。

※ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド：ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

#### ■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

流通市場で割安に評価されている証券を発掘するとともに、新規証券の発行市場でも銘柄選択を行います。引き続き、流通市場および新規発行の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。市場の動向を注意深く観察しながら、新しい投資機会を求め姿勢を継続します。

#### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2012. 10. 18 ~ 2024. 10. 17)

### ■当ファンド

当ファンドは、「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」と「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズであり、信託期間を通じて「ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」への投資割合を高位に維持することを基本としました。

### ■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券等に投資し、高利回りの獲得をめざして運用を行いました。

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行いました。

## ベンチマークとの差異について

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



## 分配金について

1万口当り、第2期100円、第3期150円、第4期～第7期各200円、第8期～第11期各30円、第12期～第13期各100円、第14期30円、第15期100円、第16期30円、第17期～第23期各100円、第24期30円、第25期150円、第26期100円、第27期～第66期各30円、第67期～第81期各20円、第82期～第114期各10円、第115期～第119期各20円、第120期～第128期各30円、第129期～第135期各40円、第136期100円、第137期40円、第138期100円、第139期～第141期各150円、第142期～第143期各30円の収益分配を行いました。なお、第1期は、分配方針通り、収益分配を行いませんでした。

また、第139期～第143期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
	2024年4月18日 ～2024年5月17日	2024年5月18日 ～2024年6月17日	2024年6月18日 ～2024年7月17日	2024年7月18日 ～2024年8月19日	2024年8月20日 ～2024年9月17日
当期分配金(税込み) (円)	150	150	150	30	30
対基準価額比率 (%)	1.35	1.36	1.34	0.29	0.30
当期の収益 (円)	51	47	150	30	30
当期の収益以外 (円)	98	102	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	1,569	1,467	1,526	1,540	1,548

(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	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 51.38円	✓ 47.64円	✓ 52.19円	✓ 44.25円	✓ 37.64円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	✓ 156.51	0.00	0.00
(c) 収益調整金	557.70	559.65	561.92	563.73	564.13
(d) 分配準備積立金	✓ 1,110.71	✓ 1,010.14	905.53	962.43	976.30
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,719.80	1,617.44	1,676.17	1,570.43	1,578.08
(f) 分配金	150.00	150.00	150.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,569.80	1,467.44	1,526.17	1,540.43	1,548.08

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第139期～償還期 (2024. 4. 18～2024. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	63円	0.595%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当作成期中の平均基準価額は10,591円です。</b>
(投 信 会 社)	(18)	(0.165)	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)	(44)	(0.413)	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)	(0.016)	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	—	—	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
合 計	63	0.595	

(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。

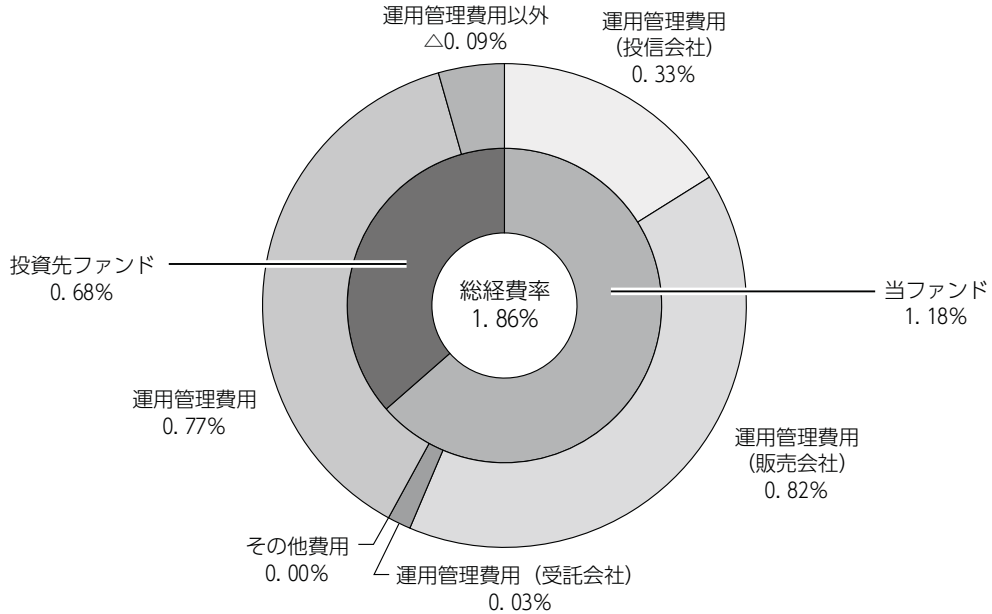
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.86%です。



総経費率 ( ① + ② + ③ )	1.86%
①当ファンドの費用の比率	1.18%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.77%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	△0.09%

- (注1) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）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) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。  
 (注4) 各比率は、年率換算した値です。  
 (注5) ①の費用は、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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。  
 (注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。  
 (注8) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。  
 (注9) 投資先ファンドの運用管理費用以外は、当初積み立てた見積費用よりも実際の費用がかからなかったことから、マイナスの費用（収入）となっています。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2024年4月18日から2024年10月17日まで)

決 算 期		第 139 期 ~ 償 還 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 (邦貨建)	DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	千口 760.48834	千円 89,950	千口 22,301.22505	千円 2,490,438

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2024年4月18日から2024年10月17日まで)

決 算 期	第 139 期 ~ 償 還 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	—	—	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年10月17日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 2,009,556	% 100.0
投資信託財産総額	2,009,556	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	第138期末	
	□ 数	千口
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年5月17日)、(2024年6月17日)、(2024年7月17日)、(2024年8月19日)、(2024年9月17日)、(2024年10月17日) 現在

項 目	第139期末	第140期末	第141期末	第142期末	第143期末	償還時
<b>(A) 資産</b>	<b>2,656,054,527円</b>	<b>2,630,464,048円</b>	<b>2,654,266,291円</b>	<b>2,430,732,458円</b>	<b>2,258,315,374円</b>	<b>2,009,556,612円</b>
コール・ローン等	104,532,885	101,677,718	113,466,875	78,883,334	69,642,481	2,009,543,864
投資信託受益証券 (評価額)	2,551,520,615	2,528,785,303	2,540,798,389	2,351,848,097	2,188,671,866	—
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額)	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	—
未収利息	—	—	—	—	—	12,748
<b>(B) 負債</b>	<b>43,785,687</b>	<b>39,189,858</b>	<b>38,068,541</b>	<b>16,177,915</b>	<b>14,058,055</b>	<b>23,193,469</b>
未払収益分配金	35,735,483	35,649,904	35,478,135	7,052,180	6,828,289	—
未払解約金	5,525,678	899,896	—	6,482,009	5,012,840	21,025,897
未払信託報酬	2,524,526	2,640,058	2,590,406	2,643,726	2,216,926	2,167,572
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>2,612,268,840</b>	<b>2,591,274,190</b>	<b>2,616,197,750</b>	<b>2,414,554,543</b>	<b>2,244,257,319</b>	<b>1,986,363,143</b>
元本	2,382,365,587	2,376,660,310	2,365,209,006	2,350,726,718	2,276,096,435	1,991,738,175
次期繰越損益金	229,903,253	214,613,880	250,988,744	63,827,825	△ 31,839,116	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△ 5,375,032
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2,382,365,587口</b>	<b>2,376,660,310口</b>	<b>2,365,209,006口</b>	<b>2,350,726,718口</b>	<b>2,276,096,435口</b>	<b>1,991,738,175口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,965円	10,903円	11,061円	10,272円	9,860円	—
1万口当り償還価額 (C/D)	—	—	—	—	—	9,973円01銭

\* 当作成期首における元本額は2,391,980,702円、当作成期間 (第139期～償還期) 中における追加設定元本額は20,101,959円、同解約元本額は420,344,486円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,973円01銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は5,375,032円です。

■損益の状況

第139期 自2024年4月18日 至2024年5月17日 第141期 自2024年6月18日 至2024年7月17日 第143期 自2024年8月20日 至2024年9月17日  
 第140期 自2024年5月18日 至2024年6月17日 第142期 自2024年7月18日 至2024年8月19日 償還期 自2024年9月18日 至2024年10月17日

項 目	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期	償還期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>12,475,332円</b>	<b>12,754,386円</b>	<b>12,785,075円</b>	<b>13,046,567円</b>	<b>10,786,212円</b>	<b>315,806円</b>
受取配当金	12,471,660	12,750,149	12,781,113	13,039,277	10,778,858	—
受取利息	3,672	4,237	3,962	7,290	7,354	315,806
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>122,117,333</b>	<b>10,796,064</b>	<b>62,642,677</b>	<b>△ 188,974,642</b>	<b>△ 95,381,590</b>	<b>24,338,101</b>
売買益	122,468,254	10,856,322	63,077,502	1,676,931	607,233	24,338,101
売買損	△ 350,921	△ 60,258	△ 434,825	△ 190,651,573	△ 95,988,823	—
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 2,524,526</b>	<b>△ 2,640,058</b>	<b>△ 2,590,406</b>	<b>△ 2,643,726</b>	<b>△ 2,216,926</b>	<b>△ 2,167,572</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>132,068,139</b>	<b>20,910,392</b>	<b>72,837,346</b>	<b>△ 178,571,801</b>	<b>△ 86,812,304</b>	<b>22,486,335</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>111,412,447</b>	<b>206,847,108</b>	<b>190,706,975</b>	<b>226,243,243</b>	<b>39,313,886</b>	<b>△ 47,519,223</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>22,158,150</b>	<b>22,506,284</b>	<b>22,922,558</b>	<b>23,208,563</b>	<b>22,487,591</b>	<b>19,657,856</b>
(配当等相当額)	( 132,864,565)	( 133,011,210)	( 132,907,053)	( 132,519,667)	( 128,401,810)	( 112,443,803)
(売買損益相当額)	(△ 110,706,415)	(△ 110,504,926)	(△ 109,984,495)	(△ 109,311,104)	(△ 105,914,219)	(△ 92,785,947)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>265,338,736</b>	<b>250,263,784</b>	<b>286,466,879</b>	<b>70,880,005</b>	<b>△ 25,010,827</b>	<b>△ 5,375,032</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 35,735,483</b>	<b>△ 35,649,904</b>	<b>△ 35,478,135</b>	<b>△ 7,052,180</b>	<b>△ 6,828,289</b>	<b>—</b>
次期繰越損益金 (G + H)	229,903,253	214,613,880	250,988,744	63,827,825	△ 31,839,116	—
追加信託差損益金	22,158,150	22,506,284	22,922,558	23,208,563	22,487,591	—
(配当等相当額)	( 132,864,565)	( 133,011,210)	( 132,907,053)	( 132,519,667)	( 128,401,810)	( —)
(売買損益相当額)	(△ 110,706,415)	(△ 110,504,926)	(△ 109,984,495)	(△ 109,311,104)	(△ 105,914,219)	( —)
分配準備積立金	241,119,272	215,751,642	228,066,186	229,593,904	223,956,468	—
繰越損益金	△ 33,374,169	△ 23,644,046	—	△ 188,974,642	△ 278,283,175	—
償還差損益金 (G)	—	—	—	—	—	△ 5,375,032

(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) 第139期～第143期の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	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
(a) 経費控除後の配当等収益	12,241,308円	11,324,531円	12,346,001円	10,402,841円	8,569,286円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	37,019,684	0	0
(c) 収益調整金	132,864,565	133,011,210	132,907,053	132,519,667	128,401,810
(d) 分配準備積立金	264,613,447	240,077,015	214,178,636	226,243,243	222,215,471
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	409,719,320	384,412,756	396,451,374	369,165,751	359,186,567
(f) 分配金	35,735,483	35,649,904	35,478,135	7,052,180	6,828,289
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	373,983,837	348,762,852	360,973,239	362,113,571	352,358,278
(h) 受益権総口数	2,382,365,587口	2,376,660,310口	2,365,209,006口	2,350,726,718口	2,276,096,435口

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2012年10月18日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年10月17日		資産総額	2,009,556,612円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	23,193,469円
				純資産総額	1,986,363,143円
受益権口数	32,804,169,318口	1,991,738,175口	△30,812,431,143口	受益権口数	1,991,738,175口
元本額	32,804,169,318円	1,991,738,175円	△30,812,431,143円	1単位当り償還金	9,973円01銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第24期	21,759,169,728	22,143,649,484	10,177	30	0.30
第25期	21,283,921,156	23,434,859,766	11,011	150	1.50
第26期	21,018,490,321	21,687,578,893	10,318	100	1.00
第27期	20,935,867,486	21,711,825,626	10,371	30	0.30
第28期	20,523,337,534	20,374,154,958	9,927	30	0.30
第29期	20,234,401,118	20,191,191,469	9,979	30	0.30
第30期	20,104,564,600	20,040,823,576	9,968	30	0.30
第31期	19,783,005,226	20,396,732,879	10,310	30	0.30
第32期	19,527,975,633	19,927,098,542	10,204	30	0.30
第33期	19,119,808,305	18,751,431,798	9,807	30	0.30
第34期	18,307,135,275	17,782,666,011	9,714	30	0.30
第35期	17,945,826,798	16,333,828,298	9,102	30	0.30
第36期	17,373,057,738	15,793,184,640	9,091	30	0.30
第37期	16,989,602,036	15,499,460,370	9,123	30	0.30
第38期	16,599,415,446	15,112,829,311	9,104	30	0.30
第39期	16,393,315,352	13,697,401,033	8,355	30	0.30
第40期	16,060,122,228	13,212,377,142	8,227	30	0.30
第41期	15,661,895,050	13,544,910,225	8,648	30	0.30
第42期	15,339,878,505	13,169,900,593	8,585	30	0.30
第43期	14,961,618,436	12,317,942,075	8,233	30	0.30
第44期	14,599,996,679	11,460,337,928	7,850	30	0.30
第45期	14,172,264,164	11,786,413,104	8,317	30	0.30
第46期	13,803,956,357	11,095,411,605	8,038	30	0.30
第47期	13,559,660,701	10,840,449,941	7,995	30	0.30
第48期	13,210,853,278	10,957,493,089	8,294	30	0.30
第49期	12,751,613,037	10,827,022,582	8,491	30	0.30
第50期	12,267,521,088	11,028,068,851	8,990	30	0.30
第51期	12,089,756,493	10,945,717,139	9,054	30	0.30
第52期	11,782,672,315	10,825,620,905	9,188	30	0.30
第53期	11,414,352,617	10,483,338,335	9,184	30	0.30



ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -

計算期	元 本 額	純資産総額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第54期	11,053,224,974	9,737,412,913	8,810	30	0.30
第55期	10,716,940,859	9,587,531,640	8,946	30	0.30
第56期	10,403,208,267	9,297,568,568	8,937	30	0.30
第57期	9,993,000,990	9,377,710,809	9,384	30	0.30
第58期	9,490,576,701	8,822,497,625	9,296	30	0.30
第59期	9,062,114,658	8,544,783,201	9,429	30	0.30
第60期	8,721,034,930	8,149,247,560	9,344	30	0.30
第61期	8,557,828,884	7,811,932,368	9,128	30	0.30
第62期	8,302,462,813	7,601,411,656	9,156	30	0.30
第63期	8,183,764,265	7,675,021,600	9,378	30	0.30
第64期	7,967,542,201	7,091,277,966	8,900	30	0.30
第65期	7,813,870,287	6,787,235,510	8,686	30	0.30
第66期	7,718,576,710	6,804,206,051	8,815	30	0.30
第67期	7,564,254,997	6,603,242,192	8,730	20	0.20
第68期	7,419,307,744	6,468,345,200	8,718	20	0.20
第69期	7,328,313,060	6,477,122,814	8,838	20	0.20
第70期	7,173,888,547	6,144,744,312	8,565	20	0.20
第71期	7,111,584,515	6,145,726,918	8,642	20	0.20
第72期	7,027,279,752	6,030,069,476	8,581	20	0.20
第73期	6,865,708,035	6,044,713,030	8,804	20	0.20
第74期	6,762,748,095	5,832,653,600	8,625	20	0.20
第75期	6,647,890,841	5,520,434,218	8,304	20	0.20
第76期	6,483,746,136	5,464,150,272	8,427	20	0.20
第77期	6,314,699,320	5,370,011,989	8,504	20	0.20
第78期	6,221,670,947	5,387,789,700	8,660	20	0.20
第79期	6,133,209,739	5,024,707,399	8,193	20	0.20
第80期	5,941,567,339	4,801,031,393	8,080	20	0.20
第81期	5,824,569,676	4,841,186,762	8,312	20	0.20
第82期	5,625,781,060	4,438,073,148	7,889	10	0.10
第83期	5,479,554,309	4,445,972,700	8,114	10	0.10
第84期	5,344,058,821	4,301,614,490	8,049	10	0.10
第85期	5,199,237,700	4,211,276,217	8,100	10	0.10
第86期	5,020,127,314	4,141,106,399	8,249	10	0.10
第87期	4,990,540,317	4,141,617,846	8,299	10	0.10
第88期	5,010,649,197	4,071,913,491	8,127	10	0.10
第89期	4,948,480,477	3,349,902,729	6,770	10	0.10
第90期	4,890,033,285	3,364,740,344	6,881	10	0.10
第91期	4,882,441,335	3,455,634,343	7,078	10	0.10
第92期	4,832,859,564	3,688,748,409	7,633	10	0.10
第93期	4,749,165,442	3,700,297,772	7,791	10	0.10

計算期	元 本 額	純資産総額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第94期	4,696,617,419	3,765,670,089	8,018	10	0.10
第95期	4,654,406,325	3,729,961,452	8,014	10	0.10
第96期	4,540,589,191	3,561,506,766	7,844	10	0.10
第97期	4,437,374,509	3,585,700,144	8,081	10	0.10
第98期	4,379,566,116	3,641,459,871	8,315	10	0.10
第99期	4,293,927,227	3,671,653,489	8,551	10	0.10
第100期	4,189,389,250	3,718,946,026	8,877	10	0.10
第101期	4,019,289,196	3,669,255,947	9,129	10	0.10
第102期	3,959,992,358	3,629,879,530	9,166	10	0.10
第103期	3,875,177,545	3,602,372,258	9,296	10	0.10
第104期	3,808,594,343	3,533,591,840	9,278	10	0.10
第105期	3,663,780,456	3,259,547,906	8,897	10	0.10
第106期	3,618,329,082	3,161,499,523	8,737	10	0.10
第107期	3,552,073,456	3,097,017,916	8,719	10	0.10
第108期	3,513,124,782	3,250,036,206	9,251	10	0.10
第109期	3,420,943,569	3,134,365,895	9,162	10	0.10
第110期	3,399,661,283	3,035,216,632	8,928	10	0.10
第111期	3,376,945,315	3,042,011,001	9,008	10	0.10
第112期	3,334,314,162	2,998,608,107	8,993	10	0.10
第113期	3,294,765,645	3,044,102,166	9,239	10	0.10
第114期	3,167,168,209	3,183,035,818	10,050	10	0.10
第115期	3,113,663,295	2,962,797,961	9,515	20	0.20
第116期	3,062,284,863	2,949,614,899	9,632	20	0.20
第117期	3,045,131,329	2,993,258,062	9,830	20	0.20
第118期	3,009,548,757	2,990,533,965	9,937	20	0.20
第119期	2,957,260,838	2,985,556,590	10,096	20	0.20
第120期	2,937,914,987	2,858,876,027	9,731	30	0.30
第121期	2,930,368,542	2,880,826,030	9,831	30	0.30
第122期	2,888,741,885	2,778,251,288	9,618	30	0.30
第123期	2,786,762,174	2,620,801,212	9,404	30	0.30
第124期	2,740,920,372	2,691,687,416	9,820	30	0.30
第125期	2,720,355,800	2,580,269,648	9,485	30	0.30
第126期	2,692,005,194	2,556,611,098	9,497	30	0.30
第127期	2,680,104,729	2,571,151,074	9,593	30	0.30
第128期	2,652,621,229	2,694,327,947	10,157	30	0.30
第129期	2,614,901,623	2,605,406,904	9,964	40	0.40
第130期	2,593,792,485	2,586,334,797	9,971	40	0.40
第131期	2,564,239,876	2,590,952,097	10,104	40	0.40
第132期	2,509,834,130	2,525,459,894	10,062	40	0.40
第133期	2,502,867,014	2,574,555,840	10,286	40	0.40

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -

計算期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第134期	2,470,143,605	2,514,979,404	10,182	40	0.40
第135期	2,442,405,721	2,541,919,237	10,407	40	0.40
第136期	2,390,716,108	2,505,827,565	10,481	100	1.00
第137期	2,390,348,852	2,507,868,707	10,492	40	0.40
第138期	2,391,980,702	2,526,082,924	10,561	100	1.00
第139期	2,382,365,587	2,612,268,840	10,965	150	1.50
第140期	2,376,660,310	2,591,274,190	10,903	150	1.50
第141期	2,365,209,006	2,616,197,750	11,061	150	1.50
第142期	2,350,726,718	2,414,554,543	10,272	30	0.30
第143期	2,276,096,435	2,244,257,319	9,860	30	0.30

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
1 万 口 当 り 分 配 金 ( 税 込 み )	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期
		150円	150円	150円	30円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・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。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	9,973円01銭

## ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド – 予想分配金提示型 –）はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド」の受益証券（円建）を主要投資対象としております。以下の内容は、直近で入手可能な Financial Statements 等から抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

（豪ドル建て）

### 貸借対照表 2024年3月28日

#### 資産

投資資産の公正価値による評価額（簿価 \$45,320,820）	\$	44,564,582
現金		2,163,138
外国為替先渡取引による評価損益		119
未収：		
売却済みの投資		337,197
配当金		11,651
利息		404,615
中央清算されるデリバティブ取引に係るカウンターパーティへの預託金		305,146
<b>資産合計</b>		<b>47,786,448</b>

#### 負債

売建てオプションの公正価値による評価額（受取プレミアム \$142,313）		146,761
カウンターパーティに対する未払金ー中央清算されるデリバティブ取引の変動証拠金ー先物取引		170,934
未払：		
購入済みの投資		629,434
専門家報酬		50,233
投資管理報酬		25,929
保管会社報酬		18,073
会計報酬および管理会社報酬		16,675
受託会社報酬		5,088
為替運用会社報酬		3,615
登録料		1,739

名義書換代理人報酬		369
<b>負債合計</b>		<b>1,068,850</b>
<b>純資産</b>	\$	<b>46,717,598</b>
<b>純資産</b>		
クラス A	\$	25,288,959
通貨αクラス		21,428,639
	\$	<b>46,717,598</b>
<b>発行済み受益証券</b>		
クラス A		21,762,231
通貨αクラス		43,975,271
<b>受益証券 1 口当り純資産額</b>		
クラス A	\$	1.162
通貨αクラス	\$	0.487

(豪ドル建て)

**損益計算書**

2024年3月28日に終了した年度

**投資収益**

受取利息 (源泉徴収税 \$18,990 控除後)	\$	2,658,053
配当収益 (源泉徴収税 \$865 控除後)		216,228
配当収益－関係会社		11,433
その他収益		62,641
<b>投資収益合計</b>		<b>2,948,355</b>

**費用**

投資管理報酬		319,896
会計報酬および管理会社報酬		68,605
保管会社報酬		58,911
為替運用会社報酬		22,683
受託会社報酬		11,331
名義書換代理人報酬		8,219
登録料		5,058
専門家報酬		2,251
<b>費用合計</b>		<b>496,954</b>

**純投資損益**

**2,451,401**

**実現損益および評価損益：**

**実現損益：**

証券投資	(3,972,139)
先物取引	196,723
売建オプション	(432,280)
外国為替取引および外国為替先渡取引	(7,330)

**純実現損益** **(4,215,026)**

**評価損益の純変動の内訳：**

証券投資	5,338,669
売建オプション	(98,589)
先物取引	23,862
外国為替換算および外国為替先渡取引	471

**評価損益の純変動** **5,264,413**

**純実現損益および評価損益の純変動**

**1,049,387**

**運用の結果による純資産の純増減**

**\$ 3,500,788**



(豪ドル建て)

投資明細表  
2024年3月28日

<u>元本</u>		<u>証券の明細</u>	<u>公正価値による 評価額</u>
		<b>債券 (89.4%)</b>	
		<b>オーストラリア (77.7%)</b>	
		<b>社債 (77.7%)</b>	
AUD	500,000	AMP Bank, Ltd. (a), (b) 9.01% due 10/07/32	\$ 516,052
AUD	500,000	Ampol, Ltd. (a), (b) 7.75% due 12/02/81	516,192
AUD	1,000,000	7.95% due 12/09/80	1,028,079
AUD	1,000,000	Aurizon Finance Pty, Ltd. (a) 3.00% due 03/09/28	907,963
AUD	1,000,000	Aurizon Network Pty, Ltd. (a) 2.90% due 09/02/30	839,996
AUD	750,000	AusNet Services Holdings Pty, Ltd. 4.30% due 03/30/28 (a)	731,049
AUD	500,000	7.46% due 10/06/80 (a), (b)	501,820
		Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a), (b)	
AUD	1,000,000	5.91% due 08/12/32	1,017,430
AUD	500,000	6.30% due 01/16/34	501,642
AUD	1,000,000	6.41% due 09/20/34	1,038,360
AUD	500,000	6.69% due 05/16/33	510,520
AUD	500,000	6.74% due 02/10/38	529,530
		Australia Pacific Airports Melbourne Pty, Ltd. (a)	
AUD	1,000,000	3.76% due 11/25/31	891,186
AUD	1,156,600	Australian Unity, Ltd. (b) 6.85% due 12/15/28	1,157,757
AUD	500,000	Bank of Queensland, Ltd. (a), (b) 6.09% due 05/19/32	494,575
AUD	500,000	Bendigo & Adelaide Bank, Ltd. (a), (b) 6.95% due 11/03/33	510,520
AUD	600,000	Centuria Capital No 2 Fund (a), (b) 8.60% due 04/20/26	613,980
AUD	500,000	Challenger Life Co., Ltd. (a), (b) 7.19% due 09/16/37	525,394
AUD	500,000	ClearView Wealth, Ltd. (a), (b) 10.35% due 11/05/30	515,399
AUD	500,000	CNH Industrial Capital Australia Pty, Ltd. 5.80% due 07/13/26	509,112
		Commonwealth Bank of Australia (a), (b)	

元本		証券の明細	公正価値による 評価額
AUD	500,000	6.45% due 10/25/33	519,095
AUD	1,000,000	6.70% due 03/15/38	1,056,165
AUD	1,000,000	7.04% due 11/09/32	1,034,730
AUD	1,000,000	Downer Group Finance Pty, Ltd. (a) 3.70% due 04/29/26	966,060
AUD	500,000	Insurance Australia Group, Ltd. (a), (b) 6.79% due 12/15/36	508,340
AUD	500,000	6.84% due 12/15/38	510,776
AUD	500,000	Judo Bank Pty, Ltd. (a), (b) 9.34% due 06/06/33	518,538
AUD	500,000	Liberty Financial Pty, Ltd. (b) 8.15% due 03/16/28	507,521
AUD	670,000	Macquarie Bank, Ltd. (a), (b) 7.05% due 06/07/32	689,688
AUD	1,000,000	National Australia Bank, Ltd. 6.16% due 03/09/33 (a), (b)	1,026,934
AUD	500,000	6.32% due 08/03/32 (a), (b)	514,036
AUD	1,400,000	8.35% (a), (b), (c) Network Finance Co. Pty, Ltd. (a)	1,425,312
AUD	1,200,000	6.06% due 06/19/30 NSW Electricity Networks Finance Pty, Ltd. (a)	1,246,945
AUD	500,000	5.77% due 05/29/30 Pacific National Finance Pty, Ltd.	510,588
AUD	2,250,000	3.80% due 09/08/31 (a)	1,879,650
AUD	1,000,000	5.40% due 05/12/27 Peet, Ltd. (a), (b)	986,207
AUD	500,000	9.19% due 09/30/26	493,695
AUD	500,000	Police & Nurses, Ltd. (a), (b), (c) 10.09%	513,445
AUD	500,000	QBE Insurance Group, Ltd. (a), (b) 7.44% due 06/28/39	523,810
AUD	1,000,000	Region Retail Trust (a) 2.45% due 09/24/29	867,520
AUD	1,500,000	Resolution Life Australasia, Ltd. (a), (b) 7.65% due 12/09/35	1,522,755
AUD	500,000	Suncorp Group, Ltd. (a), (b) 6.99% due 12/01/38	514,460
AUD	1,000,000	VER Finco Pty, Ltd. (a) 2.40% due 09/21/28	884,379
AUD	2,000,000	WestConnex Finance Co. Pty, Ltd. (a) 3.15% due 03/31/31	1,727,961
		Westpac Banking Corp. (a), (b)	

<u>元本</u>		<u>証券の明細</u>	<u>公正価値による 評価額</u>
AUD	500,000	6.23% due 04/03/34	499,542
AUD	500,000	6.65% due 06/23/33	509,727
AUD	500,000	Worley Financial Services Pty, Ltd. (a) 5.95% due 10/13/28	506,704
		<b>社債合計</b>	<b>36,321,139</b>
		<b>オーストラリア合計 (簿価 \$37,116,150)</b>	<b>36,321,139</b>
		フランス (4.2%)	
		社債 (4.2%)	
AUD	2,000,000	Societe Generale S. A. (a), (b), (c) 4.88%	1,960,500
		<b>社債合計</b>	<b>1,960,500</b>
		<b>フランス合計 (簿価 \$2,000,000)</b>	<b>1,960,500</b>
		オランダ (2.2%)	
		社債 (2.2%)	
AUD	1,000,000	Cooperatieve Rabobank UA (a), (b) 7.07% due 10/26/32	1,043,454
		<b>社債合計</b>	<b>1,043,454</b>
		<b>オランダ合計 (簿価 \$1,000,000)</b>	<b>1,043,454</b>
		ニュージーランド (2.2%)	
		社債 (2.2%)	
AUD	500,000	Air New Zealand, Ltd. (a) 6.50% due 05/25/29	524,335
AUD	500,000	Avanti Finance, Ltd. (a), (b) 9.10% due 06/08/25	497,500
		<b>社債合計</b>	<b>1,021,835</b>
		<b>ニュージーランド合計 (簿価 \$998,429)</b>	<b>1,021,835</b>
		スイス (2.1%)	
		社債 (2.1%)	
AUD	1,000,000	UBS Group AG (a), (b), (c) 4.38%	979,768
		<b>社債合計</b>	<b>979,768</b>
		<b>スイス合計 (簿価 \$1,000,000)</b>	<b>979,768</b>
		米国 (1.0%)	
		社債 (1.0%)	
AUD	500,000	Computershare US, Inc. (a) 3.15% due 11/30/27	458,530
		<b>社債合計</b>	<b>458,530</b>
		<b>米国合計 (簿価 \$462,093)</b>	<b>458,530</b>
		<b>債券合計 (簿価 \$42,576,672)</b>	<b>41,785,226</b>

株数／口数	証券の明細	公正価値による 評価額
	<b>優先株式 (5.3%)</b>	
	<b>オーストラリア (5.3%)</b>	
	<b>銀行 (2.2%)</b>	
2,500	Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a), (b), (c)	252,650
5,000	MyState, Ltd. (a), (b), (c)	513,717
2,500	Westpac Banking Corp. (a), (b), (c)	257,100
	<b>ヘルスケアサービス (0.8%)</b>	
3,500	Ramsay Health Care, Ltd. (b), (c)	368,900
	<b>保険 (2.3%)</b>	
3,200	Challenger, Ltd. (a), (b), (c)	336,640
2,500	Insurance Australia Group, Ltd. (a), (b), (c)	252,927
5,000	Latitude Group Holdings, Ltd. (a), (b), (c)	485,010
	<b>オーストラリア合計 (簿価 \$2,431,736)</b>	<b>2,466,944</b>
	<b>優先株式合計 (簿価 \$2,431,736)</b>	<b>2,466,944</b>
	<b>MMF (0.7%)</b>	
	<b>オーストラリア (0.7%)</b>	
308,520	Yarra A\$ Cash Reserves Fund Class A	312,412
	<b>オーストラリア合計 (簿価 \$312,412)</b>	<b>312,412</b>
	<b>MMF 合計 (簿価 \$312,412)</b>	<b>312,412</b>
		<b>純資産に 占める割合</b>
	<b>投資総額 (簿価 \$45,320,820)</b>	<b>95.4%</b>
	<b>負債を超過する現金およびその他の資産</b>	<b>4.6</b>
	<b>純資産</b>	<b>100.0%</b>
		\$ <b>44,564,582</b>
		<b>2,153,016</b>
		\$ <b>46,717,598</b>

投資明細表のすべての有価証券は、運用会社の最善の判断に基づき、有価証券の所在地ではなくリスクの所在国によって分類されています。

- (a) 償還条項付証券。
- (b) 2024年3月28日時点の変動金利証券。
- (c) 永久債。

2024年3月28日現在の先物取引残高（純資産の0.1%）：

ポジション	明細	限月	想定元本	枚数	評価損益
Long	90-Day Bank Bill Futures	12/2024	34,659,012	35	\$ 847
Long	90-Day Bank Bill Futures	06/2024	34,646,344	35	(11,012)
Long	90-Day Bank Bill Futures	09/2024	34,606,465	35	39,857
Short	Australian 10-Year Treasury Bond Futures	06/2024	(7,464,304)	(64)	3,452
Long	Australian 3-Year Treasury Bond Futures	06/2024	2,246,185	21	(988)
					\$ 32,156

2024年3月28日現在の通貨αクラスの売建オプション残高（純資産の-0.3%）：

取引内容	行使価格	満期日	想定元本	受取プレミアム	公正価値による 評価額
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	\$ 98	04/24/2024	\$ 5,000,000	\$ (56,410)	\$ (68,457)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	98	05/31/2024	6,000,000	(85,903)	(78,304)
				\$ (142,313)	\$ (146,761)

2024年3月28日現在の通貨αクラスの外国為替先渡契約残高（純資産の0.0%\*）：

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
JPY	Goldman Sachs Japan Co., Ltd.	4,268,400	04/02/2024	AUD	43,111	\$ 119	\$ —	\$ 119
						\$ 119	\$ —	\$ 119

\*0.05%未満

通貨の略称：

AUD - 豪ドル

JPY - 日本円

# ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

## 運用報告書 第15期 (決算日 2023年12月11日)

(作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11日)

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

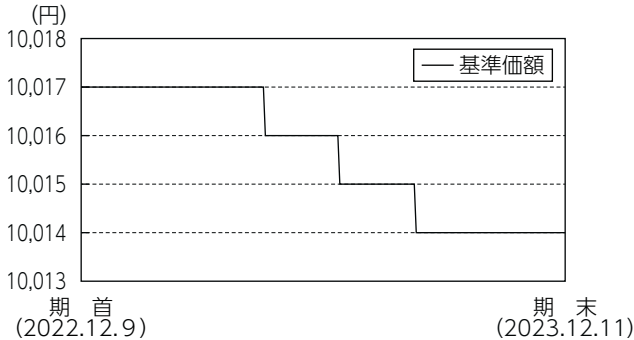
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率		
(期首)2022年12月9日	円	%	%
	10,017	-	-
12月末	10,017	0.0	-
2023年1月末	10,017	0.0	-
2月末	10,017	0.0	-
3月末	10,017	0.0	-
4月末	10,016	△0.0	-
5月末	10,016	△0.0	-
6月末	10,015	△0.0	-
7月末	10,015	△0.0	-
8月末	10,014	△0.0	-
9月末	10,014	△0.0	-
10月末	10,014	△0.0	-
11月末	10,014	△0.0	-
(期末)2023年12月11日	10,014	△0.0	-

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。  
 (注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,017円 期末：10,014円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

◆ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	62,664,638	100.0
投資信託財産総額	62,664,638	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。



# ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	62,664,638,644円
コール・ローン等	62,664,638,644
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	62,664,638,644
元本	62,579,567,123
次期繰越損益金	85,071,521
(D) 受益権総口数	62,579,567,123口
1万口当り基準価額(C / D)	10,014円

\* 期首における元本額は44,855,160,815円、当作成期間中における追加設定元本額は94,438,728,484円、同解約元本額は76,714,322,176円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ米ドル・フルファンド (適格機関投資家専用)	394,341,311円
ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用)	7,178,107,283円
ダイワ・マネーポートフォリオ (FOF s用) (適格機関投資家専用)	1,089,639円
ダイワJリートベア・ファンド (適格機関投資家専用)	905,310,638円
米国国債プラス日本株式ファンド2021-01 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	1,518,511円
米国国債プラス日本株式ファンド2021-07 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	1,993,906円
ダイワ/パリュール・パートナーズ チャイナ・ヘルスケア・フォーカス	9,976円
通貨選択型 米国リート・αクワトロ (毎月分配型)	159,141円
通貨選択型アメリカン・エグジティ・αクワトロ (毎月分配型)	159,141円
オール・マーケット・インカム戦略 (資産成長重視コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (奇数月定額分配コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (奇数月定率分配コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (予想分配金提示型コース)	9,963円
NYダウ・トリプル・レバレッジ	930,471,926円
世界セレクトティブ株式オープン (為替ヘッジあり/年1回決算型)	998円
世界セレクトティブ株式オープン (為替ヘッジあり/年2回決算型)	998円
ポーレン米国グロース株式ファンド (資産成長型)	998円
ポーレン米国グロース株式ファンド (予想分配金提示型)	998円
トレンド・キャッチ戦略ファンド	9,977円
AHLターゲットリスクリイト戦略ファンド (適格機関投資家専用)	7,916,611,556円
ダイワJGBベア・ファンド2 (適格機関投資家専用)	45,246,139,138円
ダイワ/ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド	2,417,017円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン ド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン ド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン ド (通貨選択型) アジア通貨・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券α (毎月分配型)	9,949円
ダイワ米国債7-10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - USトリアングル -	997,374円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -	173,802円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,014円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 25,212,071円
受取利息	17,750
支払利息	△ 25,229,821
(B) その他費用	△ 16,282
(C) 当期損益金(A + B)	△ 25,228,353
(D) 前期繰越損益金	78,288,990
(E) 解約差損益金	△121,056,632
(F) 追加信託差損益金	153,067,516
(G) 合計(C + D + E + F)	85,071,521
次期繰越損益金(G)	85,071,521

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

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