

# ダイワ・オーストラリア 高配当株α（毎月分配型）

株式αコース

通貨αコース

株式&通貨ツインαコース

## 運用報告書（全体版）

第114期（決算日 2022年 8月17日）

第115期（決算日 2022年 9月20日）

第116期（決算日 2022年10月17日）

第117期（決算日 2022年11月17日）

第118期（決算日 2022年12月19日）

満期償還（償還日 2023年 1月17日）

（作成対象期間 2022年7月20日～2023年1月17日）

★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／株式	
信託期間	2013年1月23日～2023年1月17日	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	株式αコース	イ. ケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）」の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	通貨αコース	イ. ケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）」の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	株式&通貨ツインαコース	イ. ケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）」の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネー・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、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、予想配当利回りの高いオーストラリア株式へ投資するとともに、オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしており、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/>

<5747>

<5748>

<5749>

株式αコース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			S & P / A S X 200 指数 (円換算)		公社債 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
90 期末(2020年 8 月17日)	3,233	40	3.5	10,483	4.2	-	98.7	147
91 期末(2020年 9 月17日)	3,177	40	△ 0.5	10,171	△ 3.0	-	99.2	138
92 期末(2020年10月19日)	3,125	40	△ 0.4	10,327	1.5	-	97.8	135
93 期末(2020年11月17日)	3,246	40	5.2	11,084	7.3	-	98.3	140
94 期末(2020年12月17日)	3,358	40	4.7	11,695	5.5	-	99.5	139
95 期末(2021年 1 月18日)	3,434	40	3.5	11,985	2.5	-	98.3	143
96 期末(2021年 2 月17日)	3,557	40	4.7	12,699	6.0	-	98.0	141
97 期末(2021年 3 月17日)	3,616	40	2.8	12,879	1.4	-	99.2	143
98 期末(2021年 4 月19日)	3,682	40	2.9	13,236	2.8	-	98.2	146
99 期末(2021年 5 月17日)	3,697	40	1.5	13,318	0.6	-	98.2	145
100 期末(2021年 6 月17日)	3,735	40	2.1	13,918	4.5	-	98.3	146
101 期末(2021年 7 月19日)	3,604	40	△ 2.4	13,302	△ 4.4	-	98.4	140
102 期末(2021年 8 月17日)	3,567	40	0.1	13,558	1.9	-	97.7	119
103 期末(2021年 9 月17日)	3,444	40	△ 2.3	13,343	△ 1.6	-	98.0	107
104 期末(2021年10月18日)	3,546	40	4.1	13,929	4.4	-	98.1	109
105 期末(2021年11月17日)	3,491	40	△ 0.4	13,875	△ 0.4	-	99.1	109
106 期末(2021年12月17日)	3,403	40	△ 1.4	13,322	△ 4.0	-	98.9	104
107 期末(2022年 1 月17日)	3,415	40	1.5	13,624	2.3	-	97.9	105
108 期末(2022年 2 月17日)	3,395	40	0.6	13,527	△ 0.7	-	97.8	105
109 期末(2022年 3 月17日)	3,466	40	3.3	13,956	3.2	-	97.8	108
110 期末(2022年 4 月18日)	3,840	40	11.9	15,727	12.7	-	99.7	120
111 期末(2022年 5 月17日)	3,518	40	△ 7.3	14,303	△ 9.1	-	98.9	110
112 期末(2022年 6 月17日)	3,366	40	△ 3.2	13,772	△ 3.7	-	97.8	106
113 期末(2022年 7 月19日)	3,363	40	1.1	14,070	2.2	-	97.9	106
114 期末(2022年 8 月17日)	3,537	40	6.4	14,966	6.4	-	99.4	108
115 期末(2022年 9 月20日)	3,460	40	△ 1.0	14,462	△ 3.4	-	98.9	105
116 期末(2022年10月17日)	3,316	40	△ 3.0	13,951	△ 3.5	-	97.9	101
117 期末(2022年11月17日)	3,506	40	6.9	14,963	7.3	-	98.0	106
118 期末(2022年12月19日)	3,463	40	△ 0.1	14,581	△ 2.6	-	-	103
償還(2023年 1 月17日)	3,459.57	-	△ 0.1	14,779	1.4	-	-	102

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P / A S X 200指数 (円換算) は、S & P / A S X 200指数 (豪ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

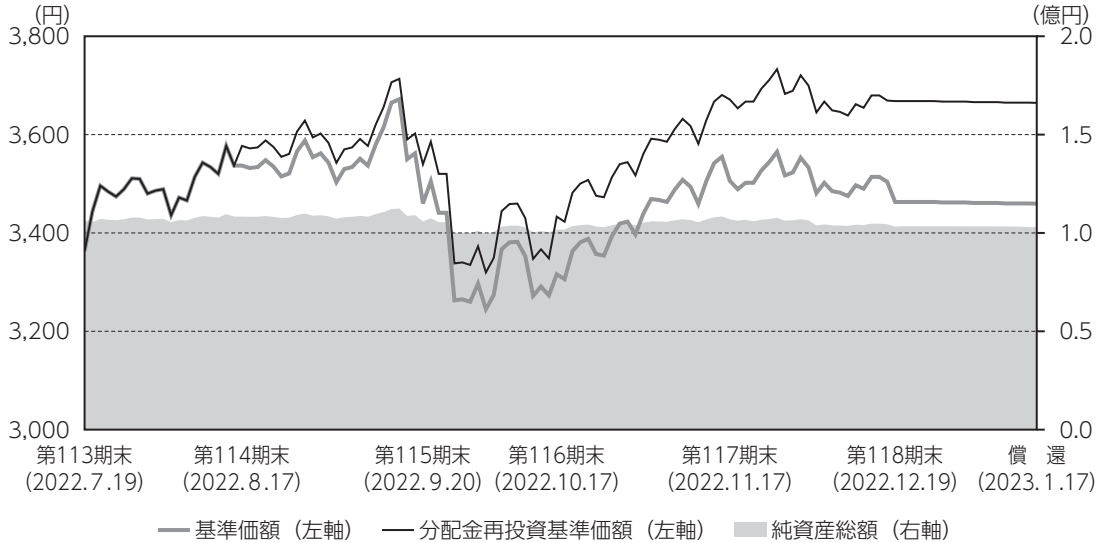
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。



## 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はありません。
- \* 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：3,459円57銭（既払分配金8,330円）

騰落率：38.8%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）については、オーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築した結果、豪ドルの値動きは軽微な影響となった一方で、株価が上昇したことがプラスに働き、上昇しました。株式オプション取引については、マイナス要因となりました。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。

※オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）：クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）

ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 株式αコース

	年 月 日	基 準 価 額		S & P / A S X 200指数 (円換算)		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 率
		騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第114期	(期首)2022年 7 月19日	円 3,363	% -	14,070	% -	% -	% 97.9
	7 月末	3,480	3.5	14,504	3.1	-	97.9
	(期末)2022年 8 月17日	3,577	6.4	14,966	6.4	-	99.4
第115期	(期首)2022年 8 月17日	3,537	-	14,966	-	-	99.4
	8 月末	3,562	0.7	14,880	△0.6	-	97.7
	(期末)2022年 9 月20日	3,500	△1.0	14,462	△3.4	-	98.9
第116期	(期首)2022年 9 月20日	3,460	-	14,462	-	-	98.9
	9 月末	3,297	△4.7	13,795	△4.6	-	98.6
	(期末)2022年10月17日	3,356	△3.0	13,951	△3.5	-	97.9
第117期	(期首)2022年10月17日	3,316	-	13,951	-	-	97.9
	10 月末	3,397	2.4	14,414	3.3	-	98.3
	(期末)2022年11月17日	3,546	6.9	14,963	7.3	-	98.0
第118期	(期首)2022年11月17日	3,506	-	14,963	-	-	98.0
	11 月末	3,523	0.5	15,041	0.5	-	99.0
	(期末)2022年12月19日	3,503	△0.1	14,581	△2.6	-	-
償 還 期	(期首)2022年12月19日	3,463	-	14,581	-	-	-
	12 月末	3,462	△0.0	14,052	△3.6	-	-
	(償還)2023年 1 月17日	3,459.57	△0.1	14,779	1.4	-	-

(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

(2013.1.23~2023.1.17)

## ■ オーストラリア株式市況

オーストラリア株式市況は上昇しました。

オーストラリア株式市況は、米国の好調な経済指標や堅調な株式市場の動向などを受けて投資家のリスク選好姿勢が強まる中、当ファンド設定時から2015年前半にかけて上昇基調で推移しました。その後は、ギリシャ債務問題や中国・人民元切下げに端を発した中国株式市場の急落により世界的に株価が下落したことで、オーストラリア株式市場も2016年前半にかけて下落しました。2016年後半以降は、堅調な米国株式市場の動向、資源価格の回復や米中貿易摩擦に対する過度な警戒感が和らいだことなどから、2019年末にかけて上昇基調で推移しました。2020年初めから2021年末にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けてオーストラリア株式市場は一時急落する場面も見られましたが、オーストラリア政府やRBA（オーストラリア準備銀行）による財政・金融支援策などを受けて反発しました。その後、当ファンドが安定運用に移行した2022年12月央までは、ロシアのウクライナ侵攻などから資源価格が上昇したことでインフレ加速が進行する中、金融引き締めに伴う世界的な金利上昇や欧米の景気後退リスクが意識されたことで、軟調に推移しました。

## ■ 為替相場

豪ドルは対円で下落しました。

豪ドル対円為替相場は、当ファンド設定時から2019年末にかけて、日銀の追加金融緩和策や米中通商協議の進展期待から一時上昇する場面も見られましたが、中国経済の減速懸念や米中貿易摩擦の激化見通しを背景に投資家心理が悪化したことで、下落しました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて豪ドルは対円で一時急落しましたが、オーストラリア政府やRBA（オーストラリア準備銀行）による財政・金融支援策が好感され、2021年末にかけて上昇しました。満期償還に備えて安定運用に移行した2022年12月央にかけては、RBAによる利上げが行われる中で、日銀が金融緩和政策の据え置きを決定したことにより、金融政策の方向性の違いが意識され、豪ドルは対円での下落幅を縮小しました。

## 信託期間中の運用方針

## ■ 当ファンド

オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）への投資割合を高位に維持します。

## ■ オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）

相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

## ■ ダイワ・マネー・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す。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2013.1.23~2023.1.17)

### ■当ファンド

オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資しました。安定運用に移行した2022年12月央までは、オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）への投資割合を高位に維持しました。

### ■オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス）

相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

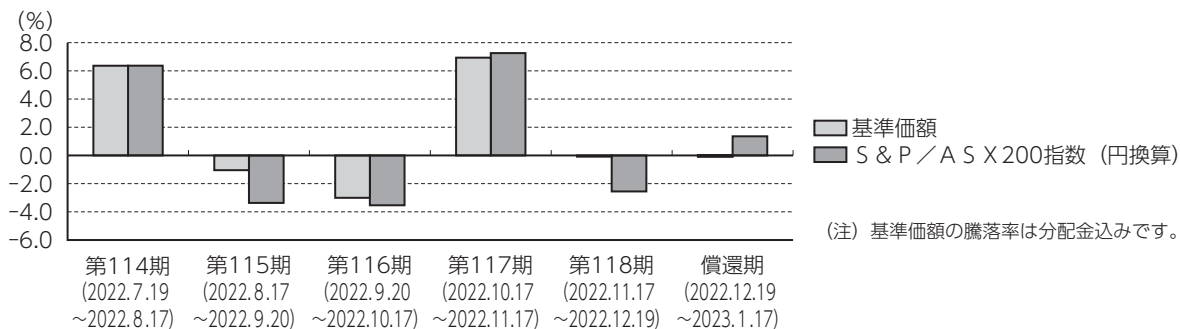
### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債や現先取引、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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期における当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。参考指数はオーストラリア株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しています。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



## 分配金について

1万口当り、第1期～第67期各90円、第68期～第80期各60円、第81期～第118期各40円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118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。なお、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114期	第115期	第116期	第117期	第118期
	2022年7月20日 ～2022年8月17日	2022年8月18日 ～2022年9月20日	2022年9月21日 ～2022年10月17日	2022年10月18日 ～2022年11月17日	2022年11月18日 ～2022年12月19日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>40</b>
対基準価額比率（%）	1.12	1.14	1.19	1.13	1.14
当期の収益（円）	39	35	34	39	36
当期の収益以外（円）	0	4	5	0	3
翌期繰越分配対象額（円）	384	380	374	374	370

(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。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 39.24円	✓ 35.43円	✓ 34.58円	✓ 39.22円	✓ 36.37円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	✓ 385.57	✓ 384.82	✓ 380.27	✓ 374.86	✓ 374.08
(d) 分配準備積立金	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	424.81	420.25	414.86	414.08	410.45
(f) 分配金	40.00	40.00	40.00	40.00	40.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	384.81	380.25	374.86	374.08	370.45

(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114期～償還期 (2022.7.20～2023.1.17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	23円	0.673%	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3,466円です。
（投 信 会 社）	(8)	(0.219)	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）	(15)	(0.439)	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）	(1)	(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	23	0.673	

(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。

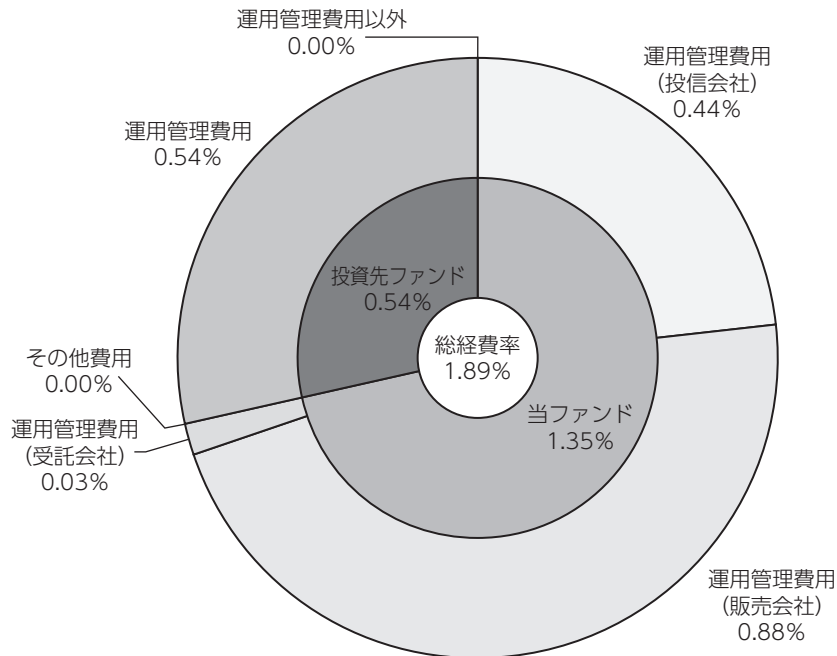
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



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1.89%です。



総経費率 (①+②+③)	1.89%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.54%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

(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。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

決算期	第 114 期 ~ 償還期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	157.24201	6,038	2,910.12038	113,790

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。  
 (注2) 金額は受渡し代金。  
 (注3) 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

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

決算期	第 114 期 ~ 償還期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	-	-	98	99

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

第 114 期 買 付				~ 償 還 期 売 付			
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
				AUSTRALIAN HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA (EQUITY ALPHA CLASS) (ケイマン諸島)	2,910.12038	113,790	39

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金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 113 期 末
	□ 数
ダイワ・マネー・マザーファンド	千□ 98

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年1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 103,359	% 100.0
投資信託財産総額	103,359	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年8月17日)、(2022年9月20日)、(2022年10月17日)、(2022年11月17日)、(2022年12月19日)、(2023年1月17日)現在

項目	第114期末	第115期末	第116期末	第117期末	第118期末	償還時
(A) 資産	109,650,563円	107,282,694円	103,045,560円	108,223,478円	104,539,670円	103,359,232円
コール・ローン等	1,889,731	2,513,752	3,342,210	3,367,080	5,205,463	103,359,232
投資信託受益証券(評価額)	107,660,999	104,669,119	99,603,527	104,756,585	—	—
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	99,833	99,823	99,823	99,813	—	—
未収入金	—	—	—	—	99,334,207	—
(B) 負債	1,344,787	1,477,579	1,331,320	1,340,235	1,317,254	395,301
未払収益分配金	1,224,965	1,223,345	1,226,978	1,219,537	1,192,121	—
未払解約金	4,623	117,081	1,631	—	—	280,388
未払信託報酬	115,199	137,153	102,711	120,698	125,133	114,872
未払利息	—	—	—	—	—	41
(C) 純資産総額(A-B)	108,305,776	105,805,115	101,714,240	106,883,243	103,222,416	102,963,931
元本	306,241,317	305,836,410	306,744,569	304,884,372	298,030,291	297,620,302
次期繰越損益金	△197,935,541	△200,031,295	△205,030,329	△198,001,129	△194,807,875	—
償還差損益金	—	—	—	—	—	△194,656,371
(D) 受益権総口数	306,241,317口	305,836,410口	306,744,569口	304,884,372口	298,030,291口	297,620,302口
1万口当り基準価額(C/D)	3,537円	3,460円	3,316円	3,506円	3,463円	—
1万口当り償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	3,459円57銭

\* 当作成期首における元本額は316,011,901円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は5,598,054円、同解約元本額は23,989,653円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は3,459円57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194,656,371円です。

■損益の状況

第114期 自2022年7月20日 至2022年8月17日 第117期 自2022年10月18日 至2022年11月17日  
 第115期 自2022年8月18日 至2022年9月20日 第118期 自2022年11月18日 至2022年12月19日  
 第116期 自2022年9月21日 至2022年10月17日 償還期 自2022年12月20日 至2023年1月17日

項目	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期	償還期
(A) 配当等収益	1,223,036円	1,220,776円	1,163,695円	1,216,501円	1,209,096円	△ 2,964円
受取配当金	1,223,042	1,220,838	1,163,738	1,216,581	1,209,233	—
受取利息	—	—	—	—	1	8
支払利息	△ 6	△ 62	△ 43	△ 80	△ 138	△ 2,972
(B) 有価証券売買損益	5,415,655	△ 2,218,278	△ 4,235,070	5,909,561	△ 1,149,854	1,381
売買益	5,411,874	414	364	5,929,211	793	—
売買損	3,781	△ 2,218,692	△ 4,235,434	△ 19,650	△ 1,150,647	1,381
(C) 信託報酬等	△ 115,199	△ 137,153	△ 102,711	△ 120,698	△ 125,133	△ 114,872
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,523,492	△ 1,134,655	△ 3,174,086	7,005,364	△ 65,891	△ 116,455
(E) 前期繰越損益金	△105,248,357	△ 99,513,407	△101,723,395	△105,002,688	△ 96,749,381	△ 97,552,989
(F) 追加信託差損益金	△ 97,985,711	△ 98,159,888	△ 98,905,870	△ 98,784,268	△ 96,800,482	△ 96,986,927
(配当等相当額)	( 11,807,858)	( 11,769,432)	( 11,664,675)	( 11,428,949)	( 11,148,907)	( 11,025,559)
(売買損益相当額)	(△109,793,569)	(△109,929,320)	(△110,570,545)	(△110,213,217)	(△107,949,389)	(△108,012,486)
(G) 合計(D+E+F)	△196,710,576	△198,807,950	△203,803,351	△196,781,592	△193,615,754	△194,656,371
(H) 収益分配金	△ 1,224,965	△ 1,223,345	△ 1,226,978	△ 1,219,537	△ 1,192,121	—
次期繰越損益金(G+H)	△197,935,541	△200,031,295	△205,030,329	△198,001,129	△194,807,875	—
追加信託差損益金	△ 98,008,860	△ 98,299,610	△ 99,071,865	△ 98,807,909	△ 96,908,642	—
(配当等相当額)	( 11,784,709)	( 11,629,710)	( 11,498,680)	( 11,405,308)	( 11,040,747)	( —)
(売買損益相当額)	(△109,793,569)	(△109,929,320)	(△110,570,545)	(△110,213,217)	(△107,949,389)	( —)
繰越損益金	△ 99,926,681	△101,731,685	△105,958,464	△ 99,193,220	△ 97,899,233	—
償還差損益金(G)	—	—	—	—	—	△194,656,371

(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114期～第118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 114 期	第 115 期	第 116 期	第 117 期	第 118 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,201,816円	1,083,623円	1,060,983円	1,195,896円	1,083,961円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	11,807,858	11,769,432	11,664,675	11,428,949	11,148,907
(d) 分配準備積立金	0	0	0	0	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	13,009,674	12,853,055	12,725,658	12,624,845	12,232,868
(f) 分配金	1,224,965	1,223,345	1,226,978	1,219,537	1,192,121
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	11,784,709	11,629,710	11,498,680	11,405,308	11,040,747
(h) 受益権総口数	306,241,317口	305,836,410口	306,744,569口	304,884,372口	298,030,291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	2013年1月23日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年1月17日		資産総額	103,359,232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	395,301円
				純資産総額	102,963,931円
受益権口数	1,393,190,320口	297,620,302口	△1,095,570,018口	受益権口数	297,620,302口
元本額	1,393,190,320円	297,620,302円	△1,095,570,018円	1単位当り償還金	3,459円57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1期	1,906,550,859	2,055,230,291	10,780	90	0.90
第2期	2,149,690,955	2,363,196,724	10,993	90	0.90
第3期	2,220,112,153	2,430,026,967	10,946	90	0.90
第4期	2,284,802,482	2,130,719,036	9,326	90	0.90
第5期	2,386,165,883	2,289,189,696	9,594	90	0.90
第6期	2,536,686,897	2,407,309,553	9,490	90	0.90
第7期	2,541,520,343	2,486,693,507	9,784	90	0.90
第8期	2,526,871,150	2,537,772,910	10,043	90	0.90
第9期	2,459,491,485	2,499,603,228	10,163	90	0.90
第10期	2,342,870,446	2,234,683,673	9,538	90	0.90
第11期	2,362,966,152	2,288,817,170	9,686	90	0.90
第12期	2,349,169,769	2,265,910,089	9,646	90	0.90
第13期	2,283,550,381	2,195,949,766	9,616	90	0.90
第14期	2,093,172,327	2,102,440,338	10,044	90	0.90
第15期	1,936,153,428	1,923,542,946	9,935	90	0.90
第16期	1,933,556,821	1,920,862,669	9,934	90	0.90

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17期	1,920,582,181	1,908,615,068	9,938	90	0.90
第18期	1,885,381,140	1,869,752,371	9,917	90	0.90
第19期	1,880,552,526	1,870,547,531	9,947	90	0.90
第20期	1,850,105,636	1,717,903,641	9,285	90	0.90
第21期	1,739,992,030	1,815,407,116	10,433	90	0.90
第22期	1,718,435,687	1,637,240,592	9,528	90	0.90
第23期	1,713,636,829	1,649,720,704	9,627	90	0.90
第24期	1,692,793,214	1,610,769,906	9,515	90	0.90
第25期	1,659,385,954	1,564,337,415	9,427	90	0.90
第26期	1,653,201,462	1,562,500,599	9,451	90	0.90
第27期	1,623,500,375	1,540,840,249	9,491	90	0.90
第28期	1,584,320,110	1,456,420,385	9,193	90	0.90
第29期	1,579,666,872	1,418,090,870	8,977	90	0.90
第30期	1,088,823,070	929,416,879	8,536	90	0.90
第31期	1,080,147,474	836,417,146	7,744	90	0.90
第32期	924,650,719	735,232,516	7,951	90	0.90
第33期	891,519,346	691,722,263	7,759	90	0.90
第34期	880,485,187	679,936,895	7,722	90	0.90
第35期	868,606,306	601,317,777	6,923	90	0.90
第36期	846,019,269	576,563,892	6,815	90	0.90
第37期	824,999,334	605,510,419	7,340	90	0.90
第38期	772,836,690	560,713,226	7,255	90	0.90
第39期	772,222,198	543,976,778	7,044	90	0.90
第40期	665,931,109	430,845,445	6,470	90	0.90
第41期	616,859,104	432,666,447	7,014	90	0.90
第42期	600,245,197	406,381,467	6,770	90	0.90
第43期	578,160,298	375,056,143	6,487	90	0.90
第44期	559,003,400	373,245,775	6,677	90	0.90
第45期	554,621,322	362,709,222	6,540	90	0.90
第46期	533,023,246	380,559,973	7,140	90	0.90
第47期	501,505,790	356,581,355	7,110	90	0.90
第48期	485,598,044	349,492,987	7,197	90	0.90
第49期	463,911,041	329,853,006	7,110	90	0.90
第50期	457,918,641	313,468,898	6,846	90	0.90
第51期	442,786,465	303,599,528	6,857	90	0.90

ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 株式αコース

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52期	439,385,870	296,341,547	6,744	90	0.90
第53期	511,716,198	353,505,250	6,908	90	0.90
第54期	555,516,154	379,842,670	6,838	90	0.90
第55期	546,103,996	373,674,026	6,843	90	0.90
第56期	528,600,845	358,224,000	6,777	90	0.90
第57期	543,893,384	360,199,313	6,623	90	0.90
第58期	551,711,156	365,732,249	6,629	90	0.90
第59期	553,632,195	364,556,693	6,585	90	0.90
第60期	548,702,788	329,959,093	6,013	90	0.90
第61期	542,129,731	319,214,444	5,888	90	0.90
第62期	564,897,973	325,217,138	5,757	90	0.90
第63期	571,288,923	324,884,734	5,687	90	0.90
第64期	585,194,469	325,316,912	5,559	90	0.90
第65期	573,256,391	319,307,339	5,570	90	0.90
第66期	562,972,487	302,128,179	5,367	90	0.90
第67期	637,947,314	333,196,368	5,223	90	0.90
第68期	634,142,219	311,587,890	4,914	60	0.60
第69期	630,717,749	309,780,624	4,912	60	0.60
第70期	597,212,334	280,542,093	4,698	60	0.60
第71期	595,676,398	271,527,216	4,558	60	0.60
第72期	563,607,520	260,031,008	4,614	60	0.60
第73期	561,083,617	261,113,672	4,654	60	0.60
第74期	556,280,975	262,571,748	4,720	60	0.60
第75期	556,669,708	246,994,457	4,437	60	0.60
第76期	558,298,906	243,769,608	4,366	60	0.60
第77期	555,410,303	244,751,139	4,407	60	0.60
第78期	513,756,292	205,960,046	4,009	60	0.60
第79期	514,677,998	219,256,382	4,260	60	0.60
第80期	503,595,415	208,497,318	4,140	60	0.60
第81期	504,738,730	211,281,352	4,186	40	0.40
第82期	495,179,645	210,169,430	4,244	40	0.40
第83期	454,584,041	194,721,821	4,284	40	0.40
第84期	455,941,647	186,705,934	4,095	40	0.40
第85期	453,538,403	116,579,460	2,570	40	0.40
第86期	454,749,919	122,688,610	2,698	40	0.40

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87期	456,168,385	123,302,322	2,703	40	0.40
第88期	462,345,876	142,348,497	3,079	40	0.40
第89期	456,587,853	144,412,868	3,163	40	0.40
第90期	456,700,480	147,673,916	3,233	40	0.40
第91期	435,128,639	138,231,418	3,177	40	0.40
第92期	434,703,408	135,852,073	3,125	40	0.40
第93期	432,227,240	140,305,286	3,246	40	0.40
第94期	414,922,014	139,345,232	3,358	40	0.40
第95期	416,725,718	143,088,421	3,434	40	0.40
第96期	397,074,403	141,228,754	3,557	40	0.40
第97期	397,101,656	143,574,809	3,616	40	0.40
第98期	397,953,335	146,519,847	3,682	40	0.40
第99期	394,554,524	145,879,201	3,697	40	0.40
第100期	393,482,651	146,958,066	3,735	40	0.40
第101期	389,410,187	140,341,002	3,604	40	0.40
第102期	334,038,893	119,151,156	3,567	40	0.40
第103期	310,814,484	107,031,199	3,444	40	0.40
第104期	308,623,568	109,437,090	3,546	40	0.40
第105期	312,250,925	109,006,026	3,491	40	0.40
第106期	308,055,843	104,838,543	3,403	40	0.40
第107期	309,337,555	105,633,265	3,415	40	0.40
第108期	310,765,024	105,494,971	3,395	40	0.40
第109期	311,989,657	108,144,459	3,466	40	0.40
第110期	312,859,215	120,140,725	3,840	40	0.40
第111期	313,724,124	110,379,009	3,518	40	0.40
第112期	314,888,872	106,007,086	3,366	40	0.40
第113期	316,011,901	106,284,721	3,363	40	0.40
第114期	306,241,317	108,305,776	3,537	40	0.40
第115期	305,836,410	105,805,115	3,460	40	0.40
第116期	306,744,569	101,714,240	3,316	40	0.40
第117期	304,884,372	106,883,243	3,506	40	0.40
第118期	298,030,291	103,222,416	3,463	40	0.40

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
	第 114 期	第 115 期	第 116 期	第 117 期	第 118 期
1万円当り分配金（税込み）	40円	40円	40円	40円	40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 円 当 り 償 還 金	3,459円57銭

S & P / A S X 200指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「S P D J I」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはS P D J Iに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 株式αコースは、S P D J I、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P / A S X 200指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。



通貨αコース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			S & P / A S X 200 指数 (円換算)		豪ドル為替レート		公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	円	%	%	%	百万円
90 期末(2020年 8月17日)	4,537	60	4.2	10,483	4.2	76.57	2.2	-	98.5	641
91 期末(2020年 9月17日)	4,425	60	△1.1	10,171	△ 3.0	76.41	△0.2	-	98.4	599
92 期末(2020年10月19日)	4,393	60	0.6	10,327	1.5	74.81	△2.1	-	99.1	577
93 期末(2020年11月17日)	4,569	60	5.4	11,084	7.3	76.49	2.2	-	98.6	578
94 期末(2020年12月17日)	4,795	60	6.3	11,695	5.5	78.35	2.4	-	98.4	594
95 期末(2021年 1月18日)	4,905	60	3.5	11,985	2.5	79.86	1.9	-	98.5	589
96 期末(2021年 2月17日)	5,046	60	4.1	12,699	6.0	82.15	2.9	-	98.6	564
97 期末(2021年 3月17日)	5,060	60	1.5	12,879	1.4	84.41	2.8	-	98.5	532
98 期末(2021年 4月19日)	5,189	60	3.7	13,236	2.8	83.85	△0.7	-	98.5	541
99 期末(2021年 5月17日)	5,200	60	1.4	13,318	0.6	84.96	1.3	-	98.6	519
100 期末(2021年 6月17日)	5,342	60	3.9	13,918	4.5	84.32	△0.8	-	98.4	505
101 期末(2021年 7月19日)	5,183	60	△1.9	13,302	△ 4.4	81.00	△3.9	-	98.3	490
102 期末(2021年 8月17日)	5,218	60	1.8	13,558	1.9	80.01	△1.2	-	98.5	493
103 期末(2021年 9月17日)	5,018	60	△2.7	13,343	△ 1.6	80.03	0.0	-	98.6	466
104 期末(2021年10月18日)	4,998	60	0.8	13,929	4.4	84.66	5.8	-	98.4	459
105 期末(2021年11月17日)	4,989	60	1.0	13,875	△ 0.4	83.67	△1.2	-	98.3	450
106 期末(2021年12月17日)	4,876	60	△1.1	13,322	△ 4.0	81.71	△2.3	-	98.7	407
107 期末(2022年 1月17日)	4,919	60	2.1	13,624	2.3	82.45	0.9	-	98.3	402
108 期末(2022年 2月17日)	4,906	60	1.0	13,527	△ 0.7	83.09	0.8	-	98.5	399
109 期末(2022年 3月17日)	4,906	60	1.2	13,956	3.2	87.03	4.7	-	98.4	394
110 期末(2022年 4月18日)	5,195	60	7.1	15,727	12.7	93.54	7.5	-	99.0	402
111 期末(2022年 5月17日)	4,693	60	△8.5	14,303	△ 9.1	90.23	△3.5	-	98.5	360
112 期末(2022年 6月17日)	4,451	60	△3.9	13,772	△ 3.7	93.50	3.6	-	98.4	340
113 期末(2022年 7月19日)	4,458	60	1.5	14,070	2.2	94.15	0.7	-	99.5	342
114 期末(2022年 8月17日)	4,728	60	7.4	14,966	6.4	94.25	0.1	-	98.5	363
115 期末(2022年 9月20日)	4,560	60	△2.3	14,462	△ 3.4	96.30	2.2	-	98.5	348
116 期末(2022年10月17日)	4,401	60	△2.2	13,951	△ 3.5	92.36	△4.1	-	98.4	336
117 期末(2022年11月17日)	4,715	60	8.5	14,963	7.3	94.01	1.8	-	103.6	309
118 期末(2022年12月19日)	4,685	60	0.6	14,581	△ 2.6	91.27	△2.9	-	-	291
償還(2023年 1月17日)	4,680.51	-	△0.1	14,779	1.4	89.51	△1.9	-	-	278

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P / A S X 200指数 (円換算) は、S & P / A S X 200指数 (豪ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 為替レートは、計算日における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を採用しています。

(注5) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

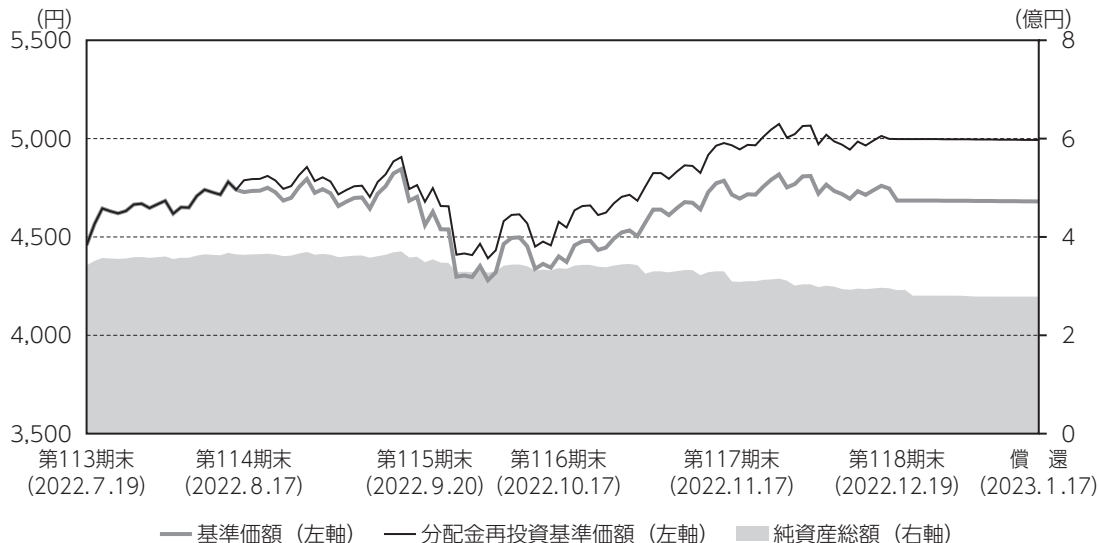
(注6) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注7) 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。



## 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はありません。

\* 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：4,680円51銭（既払分配金9,480円）

騰落率：79.6%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）については、オーストラリア株式への投資と通貨オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築した結果、豪ドルの値動きは軽微な影響となった一方で、株価が上昇したことがプラスに働き、上昇しました。通貨オプション取引については、軽微な影響となりました。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。

※オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）：クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ-ダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）

	年 月 日	基 準 価 額		S & P / A	S X 200	豪ドル為替レート		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	騰 落 率	指 数 (参考指数)	(円 換 算) 騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第114期	(期首)2022年 7月19日	円 4,458	% -	14,070	% -	円 94.15	% -	% -	% 99.5
	7月末	4,647	4.2	14,504	3.1	94.20	0.1	-	99.3
	(期末)2022年 8月17日	4,788	7.4	14,966	6.4	94.25	0.1	-	98.5
第115期	(期首)2022年 8月17日	4,728	-	14,966	-	94.25	-	-	98.5
	8月末	4,743	0.3	14,880	△0.6	95.14	0.9	-	98.4
	(期末)2022年 9月20日	4,620	△2.3	14,462	△3.4	96.30	2.2	-	98.5
第116期	(期首)2022年 9月20日	4,560	-	14,462	-	96.30	-	-	98.5
	9月末	4,352	△4.6	13,795	△4.6	94.17	△2.2	-	98.4
	(期末)2022年10月17日	4,461	△2.2	13,951	△3.5	92.36	△4.1	-	98.4
第117期	(期首)2022年10月17日	4,401	-	13,951	-	92.36	-	-	98.4
	10月末	4,504	2.3	14,414	3.3	95.05	2.9	-	98.9
	(期末)2022年11月17日	4,775	8.5	14,963	7.3	94.01	1.8	-	103.6
第118期	(期首)2022年11月17日	4,715	-	14,963	-	94.01	-	-	103.6
	11月末	4,769	1.1	15,041	0.5	92.79	△1.3	-	102.3
	(期末)2022年12月19日	4,745	0.6	14,581	△2.6	91.27	△2.9	-	-
償 還 期	(期首)2022年12月19日	4,685	-	14,581	-	91.27	-	-	-
	12月末	4,684	△0.0	14,052	△3.6	89.57	△1.9	-	-
	(償還)2023年 1月17日	4,680.51	△0.1	14,779	1.4	89.51	△1.9	-	-

(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

(2013.1.23~2023.1.17)

### ■ オーストラリア株式市況

オーストラリア株式市況は上昇しました。

オーストラリア株式市況は、米国の好調な経済指標や堅調な株式市場の動向などを受けて投資家のリスク選好姿勢が強まる中、当ファンド設定時から2015年前半にかけて上昇基調で推移しました。その後は、ギリシャ債務問題や中国・人民元切下げに端を発した中国株式市場の急落により世界的に株価が下落したことで、オーストラリア株式市場も2016年前半にかけて下落しました。2016年後半以降は、堅調な米国株式市場の動向、資源価格の回復や米中貿易摩擦に対する過度な警戒感が和らいだことなどから、2019年末にかけて上昇基調で推移しました。2020年初めから2021年末にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けてオーストラリア株式市場は一時急落する場面も見られましたが、オーストラリア政府やRBA（オーストラリア準備銀行）による財政・金融支援策などを受けて反発しました。その後、当ファンドが安定運用に移行した2022年12月央までは、ロシアのウクライナ侵攻などから資源価格が上昇したことでインフレ加速が進行する中、金融引き締めに伴う世界的な金利上昇や欧米の景気後退リスクが意識されたことで、軟調に推移しました。

### ■ 為替相場

豪ドルは対円で下落しました。

豪ドル対円為替相場は、当ファンド設定時から2019年末にかけて、日銀の追加金融緩和策や米中通商協議の進展期待から一時上昇する場面も見られましたが、中国経済の減速懸念や米中貿易摩擦の激化見通しを背景に投資家心理が悪化したことで、下落しました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて豪ドルは対円で一時急落しましたが、オーストラリア政府やRBA（オーストラリア準備銀行）による財政・金融支援策が好感され、2021年末にかけて上昇しました。満期償還に備えて安定運用に移行した2022年12月央にかけては、RBAによる利上げが行われる中で、日銀が金融緩和政策の据え置きを決定したことにより、金融政策の方向性の違いが意識され、豪ドルは対円での下落幅を縮小しました。

## 信託期間中の運用方針

### ■ 当ファンド

オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）への投資割合を高位に維持します。

### ■ オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）

相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と通貨オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

### ■ ダイワ・マネー・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す。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2013.1.23~2023.1.17)

### ■当ファンド

オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資しました。安定運用に移行した2022年12月央までは、オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）への投資割合を高位に維持しました。

### ■オーストラリア高配当株α・ファンド（通貨αクラス）

相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と通貨オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

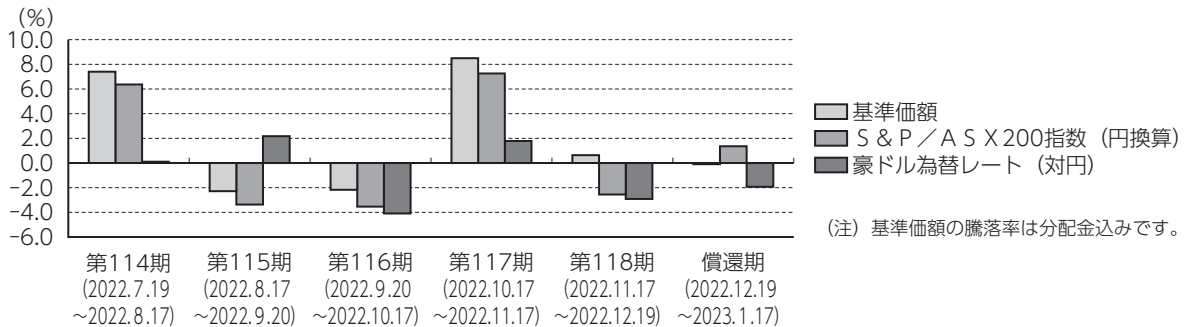
### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債や現先取引、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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期における当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。参考指数はオーストラリア株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しています。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



## 分配金について

1万口当り、第1期～第80期各90円、第81期～第118期各60円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118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。なお、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114期	第115期	第116期	第117期	第118期
	2022年7月20日 ～2022年8月17日	2022年8月18日 ～2022年9月20日	2022年9月21日 ～2022年10月17日	2022年10月18日 ～2022年11月17日	2022年11月18日 ～2022年12月19日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>60</b>
対基準価額比率（％）	1.25	1.30	1.34	1.26	1.26
当期の収益（円）	53	47	45	52	49
当期の収益以外（円）	6	12	14	7	10
翌期繰越分配対象額（円）	709	696	682	674	664

(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。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 53.45円	✓ 47.48円	✓ 45.53円	✓ 52.77円	✓ 49.45円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	✓ 715.62	✓ 709.08	✓ 696.58	✓ 682.11	✓ 674.88
(d) 分配準備積立金	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	769.08	756.57	742.11	734.88	724.33
(f) 分配金	60.00	60.00	60.00	60.00	60.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	709.08	696.57	682.11	674.88	664.33

(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114期～償還期 (2022.7.20～2023.1.17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	31円	0.674%	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4,635円です。
（投 信 会 社）	(10)	(0.219)	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）	(20)	(0.439)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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）	(1)	(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	31	0.674	

(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。

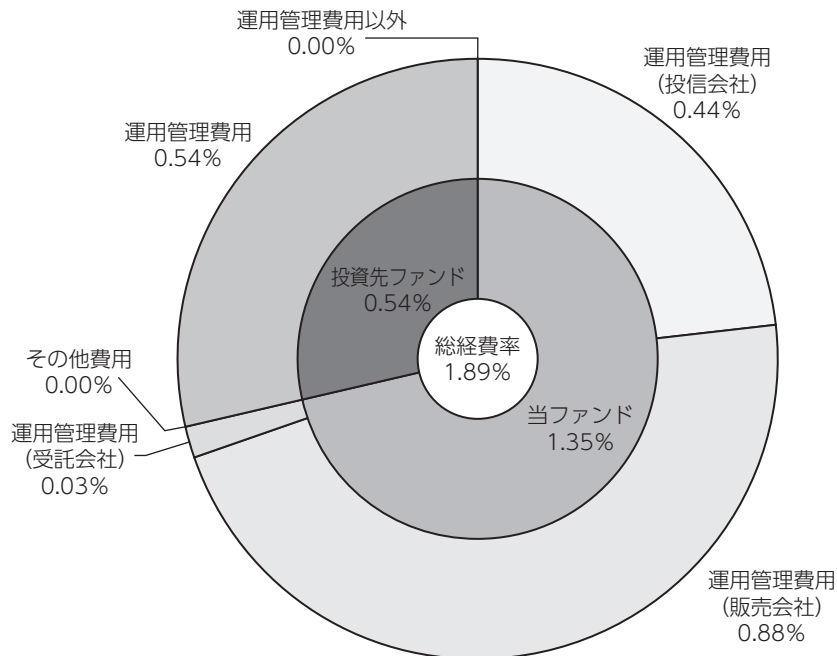
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.89%です。



総経費率 (①+②+③)	1.89%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.54%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

(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。



■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

決算期	第 114 期 ~ 償還期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	390.3056	19,390	7,418.16019	380,586

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。  
 (注2) 金額は受渡し代金。  
 (注3) 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

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

決算期	第 114 期 ~ 償還期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	-	-	98	99

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

第 114 期				~ 償 還 期			
買 付				売 付			
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
				AUSTRALIAN HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA (CURRENCY ALPHA CLASS) (ケイマン諸島)	7,418.16019	380,586	51

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金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。

■投資信託財産の構成

2023年1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 278,925	% 100.0
投資信託財産総額	278,925	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

種 類	第 113 期 末
	□ 数
ダイワ・マネー・マザーファンド	千□ 98

(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

(2022年8月17日)、(2022年9月20日)、(2022年10月17日)、(2022年11月17日)、(2022年12月19日)、(2023年1月17日)現在

項目	第114期末	第115期末	第116期末	第117期末	第118期末	償還時
(A) 資産	368,657,360円	353,764,170円	341,513,943円	331,983,010円	296,124,226円	278,925,598円
コール・ローン等	10,413,816	10,304,608	10,298,507	11,460,198	14,737,603	278,925,598
投資信託受益証券(評価額)	358,143,711	343,359,739	331,115,613	320,422,999	-	-
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	99,833	99,823	99,823	99,813	-	-
未収入金	-	-	-	-	281,386,623	-
(B) 負債	5,020,775	5,051,515	4,930,014	22,588,214	4,329,059	311,835
未払収益分配金	4,615,087	4,588,055	4,588,766	3,937,552	3,736,814	-
未払解約金	20,177	6,091	2,165	18,265,827	232,762	-
未払信託報酬	385,511	457,369	339,083	384,835	359,483	311,723
未払利息	-	-	-	-	-	112
(C) 純資産総額(A-B)	363,636,585	348,712,655	336,583,929	309,394,796	291,795,167	278,613,763
元本	769,181,199	764,675,948	764,794,360	656,258,825	622,802,358	595,263,183
次期繰越損益金	△405,544,614	△415,963,293	△428,210,431	△346,864,029	△331,007,191	-
償還差損益金	-	-	-	-	-	△316,649,420
(D) 受益権総口数	769,181,199口	764,675,948口	764,794,360口	656,258,825口	622,802,358口	595,263,183口
1万口当り基準価額(C/D)	4,728円	4,560円	4,401円	4,715円	4,685円	-
1万口当り償還価額(C/D)	-	-	-	-	-	4,680円51銭

\* 当作成期首における元本額は767,542,425円、当作成期間(第114期～償還期)中における追加設定元本額は8,668,793円、同解約元本額は180,948,035円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は4,680円51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316,649,420円です。

■損益の状況

第114期 自2022年7月20日 至2022年8月17日 第117期 自2022年10月18日 至2022年11月17日  
 第115期 自2022年8月18日 至2022年9月20日 第118期 自2022年11月18日 至2022年12月19日  
 第116期 自2022年9月21日 至2022年10月17日 償還期 自2022年12月20日 至2023年1月17日

項目	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期	償還期
(A) 配当等収益	4,174,316円	4,088,771円	3,821,433円	3,517,549円	3,439,389円	△ 8,178円
受取配当金	4,174,320	4,088,928	3,821,630	3,517,914	3,439,940	-
受取利息	-	-	-	8	7	29
支払利息	△ 4	△ 157	△ 197	△ 373	△ 558	△ 8,207
(B) 有価証券売買損益	21,556,742	△ 11,837,525	△ 11,075,483	21,381,998	△ 1,169,640	41,169
売買益	21,557,932	76,942	3,314	23,375,053	135,343	-
売買損	△ 1,190	△ 11,914,467	△ 11,078,797	△ 1,993,055	△ 1,304,983	41,169
(C) 信託報酬等	△ 385,511	△ 457,369	△ 339,083	△ 384,835	△ 359,483	△ 311,723
(D) 当期損益金(A+B+C)	25,345,547	△ 8,206,123	△ 7,593,133	24,514,712	1,910,266	△ 278,732
(E) 前期繰越損益金	△174,969,252	△152,570,253	△164,090,091	△149,986,020	△122,138,961	△117,626,900
(F) 追加信託差損益金(配当等相当額)	△251,305,822	△250,598,862	△251,938,441	△217,455,169	△207,041,682	△198,743,788
(売買損益相当額)	( 55,044,794)	( 54,222,331)	( 53,274,099)	( 44,764,324)	( 42,032,014)	( 39,545,573)
(売買損益相当額)	(△306,350,616)	(△304,821,193)	(△305,212,540)	(△262,219,493)	(△249,073,696)	(△238,289,361)
(G) 合計(D+E+F)	△400,929,527	△411,375,238	△423,621,665	△342,926,477	△327,270,377	△316,649,420
(H) 収益分配金	△ 4,615,087	△ 4,588,055	△ 4,588,766	△ 3,937,552	△ 3,736,814	-
次期繰越損益金(G+H)	△405,544,614	△415,963,293	△428,210,431	△346,864,029	△331,007,191	-
追加信託差損益金(配当等相当額)	△251,809,123	△251,555,515	△253,044,857	△217,929,551	△207,698,592	-
(売買損益相当額)	( 54,541,493)	( 53,265,678)	( 52,167,683)	( 44,289,942)	( 41,375,104)	( -)
(売買損益相当額)	(△306,350,616)	(△304,821,193)	(△305,212,540)	(△262,219,493)	(△249,073,696)	( -)
繰越損益金	△153,735,491	△164,407,778	△175,165,574	△128,934,478	△123,308,599	-
償還差損益金(G)	-	-	-	-	-	△316,649,420

(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114期～第118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 114 期	第 115 期	第 116 期	第 117 期	第 118 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,111,786円	3,631,402円	3,482,350円	3,463,170円	3,079,904円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	55,044,794	54,222,331	53,274,099	44,764,324	42,032,014
(d) 分配準備積立金	0	0	0	0	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	59,156,580	57,853,733	56,756,449	48,227,494	45,111,918
(f) 分配金	4,615,087	4,588,055	4,588,766	3,937,552	3,736,814
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	54,541,493	53,265,678	52,167,683	44,289,942	41,375,104
(h) 受益権総口数	769,181,199口	764,675,948口	764,794,360口	656,258,825口	622,802,358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	2013年1月23日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年1月17日		資産総額	278,925,598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	311,835円
受益権口数	1,152,468,696口	595,263,183口	△557,205,513口	純資産総額	278,613,763円
元本額	1,152,468,696円	595,263,183円	△557,205,513円	受益権口数	595,263,183口
				1単位当り償還金	4,680円51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1期	2,410,629,252	2,688,671,411	11,153	90	0.90
第2期	2,456,925,764	2,697,133,130	10,978	90	0.90
第3期	2,694,216,970	3,012,157,763	11,180	90	0.90
第4期	2,797,584,313	2,614,106,776	9,344	90	0.90
第5期	2,826,992,138	2,755,293,769	9,746	90	0.90
第6期	2,851,852,521	2,760,441,753	9,679	90	0.90
第7期	2,827,700,832	2,838,687,855	10,039	90	0.90
第8期	2,689,415,051	2,779,038,943	10,333	90	0.90
第9期	2,602,161,216	2,779,022,188	10,680	90	0.90
第10期	2,447,508,037	2,450,106,373	10,011	90	0.90
第11期	2,414,666,181	2,480,272,052	10,272	90	0.90
第12期	2,346,504,936	2,385,751,982	10,167	90	0.90
第13期	2,051,948,317	2,090,370,667	10,187	90	0.90
第14期	1,936,079,911	2,032,277,975	10,497	90	0.90
第15期	1,531,656,649	1,618,763,499	10,569	90	0.90
第16期	1,460,645,089	1,546,651,218	10,589	90	0.90

ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 通貨αコース

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17期	1,425,660,814	1,526,991,569	10,711	90	0.90
第18期	1,356,347,983	1,448,034,278	10,676	90	0.90
第19期	1,392,069,343	1,457,481,217	10,470	90	0.90
第20期	1,377,009,306	1,348,292,531	9,791	90	0.90
第21期	1,369,657,575	1,442,978,292	10,535	90	0.90
第22期	1,343,608,773	1,309,240,720	9,744	90	0.90
第23期	1,342,013,086	1,342,406,967	10,003	90	0.90
第24期	1,331,893,612	1,388,090,942	10,422	90	0.90
第25期	1,432,997,022	1,492,298,143	10,414	90	0.90
第26期	1,439,075,756	1,528,665,218	10,623	90	0.90
第27期	1,393,254,150	1,449,366,011	10,403	90	0.90
第28期	1,444,319,789	1,458,916,950	10,101	90	0.90
第29期	1,435,728,016	1,438,623,283	10,020	90	0.90
第30期	952,228,590	898,724,986	9,438	90	0.90
第31期	914,080,585	783,114,973	8,567	90	0.90
第32期	893,289,579	791,988,650	8,866	90	0.90
第33期	842,413,766	727,511,990	8,636	90	0.90
第34期	840,904,790	725,177,448	8,624	90	0.90
第35期	830,165,301	645,140,854	7,771	90	0.90
第36期	806,310,460	623,008,165	7,727	90	0.90
第37期	802,924,401	665,189,334	8,285	90	0.90
第38期	809,028,895	666,236,519	8,235	90	0.90
第39期	795,039,755	651,022,383	8,189	90	0.90
第40期	807,406,331	608,757,596	7,540	90	0.90
第41期	804,276,121	653,421,898	8,124	90	0.90
第42期	776,617,268	631,175,515	8,127	90	0.90
第43期	680,634,747	531,034,939	7,802	90	0.90
第44期	669,702,558	535,486,497	7,996	90	0.90
第45期	586,919,915	453,890,516	7,733	90	0.90
第46期	577,964,614	480,718,335	8,317	90	0.90
第47期	577,793,581	492,484,566	8,524	90	0.90
第48期	545,733,151	465,536,590	8,530	90	0.90
第49期	574,742,240	489,333,967	8,514	90	0.90
第50期	582,343,912	487,313,351	8,368	90	0.90
第51期	565,043,438	475,653,202	8,418	90	0.90

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52期	589,355,785	490,567,867	8,324	90	0.90
第53期	703,039,389	581,077,875	8,265	90	0.90
第54期	721,864,211	597,947,483	8,283	90	0.90
第55期	767,644,998	626,642,266	8,163	90	0.90
第56期	794,369,064	652,224,840	8,211	90	0.90
第57期	781,800,735	637,822,289	8,158	90	0.90
第58期	788,722,496	647,004,842	8,203	90	0.90
第59期	813,047,588	649,559,425	7,989	90	0.90
第60期	809,278,884	595,304,191	7,356	90	0.90
第61期	846,929,254	614,626,347	7,257	90	0.90
第62期	863,389,587	606,227,117	7,021	90	0.90
第63期	927,924,069	658,959,549	7,101	90	0.90
第64期	935,638,337	657,976,417	7,032	90	0.90
第65期	1,060,673,222	754,762,009	7,116	90	0.90
第66期	1,134,095,326	795,861,128	7,018	90	0.90
第67期	1,182,005,618	799,746,997	6,766	90	0.90
第68期	1,198,785,424	758,246,503	6,325	90	0.90
第69期	1,242,940,444	776,553,080	6,248	90	0.90
第70期	1,388,844,522	835,077,008	6,013	90	0.90
第71期	1,377,458,404	814,740,560	5,915	90	0.90
第72期	1,420,777,856	857,200,107	6,033	90	0.90
第73期	1,549,785,486	960,215,928	6,196	90	0.90
第74期	1,591,776,146	991,654,292	6,230	90	0.90
第75期	1,573,570,237	943,980,558	5,999	90	0.90
第76期	1,497,242,261	904,958,552	6,044	90	0.90
第77期	1,626,761,509	987,585,618	6,071	90	0.90
第78期	1,670,482,588	931,762,966	5,578	90	0.90
第79期	1,693,683,484	1,007,258,085	5,947	90	0.90
第80期	1,708,636,895	996,299,523	5,831	90	0.90
第81期	1,660,979,334	980,142,762	5,901	60	0.60
第82期	1,595,339,833	952,378,051	5,970	60	0.60
第83期	1,527,886,139	923,810,759	6,046	60	0.60
第84期	1,519,725,614	899,402,700	5,918	60	0.60
第85期	1,526,003,327	555,552,337	3,641	60	0.60
第86期	1,404,650,268	540,814,871	3,850	60	0.60

ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 通貨αコース

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87期	1,408,183,477	541,166,235	3,843	60	0.60
第88期	1,407,526,282	605,471,648	4,302	60	0.60
第89期	1,414,977,900	624,375,012	4,413	60	0.60
第90期	1,413,615,149	641,359,207	4,537	60	0.60
第91期	1,354,304,205	599,329,616	4,425	60	0.60
第92期	1,313,893,217	577,197,135	4,393	60	0.60
第93期	1,266,977,936	578,886,528	4,569	60	0.60
第94期	1,240,599,290	594,823,982	4,795	60	0.60
第95期	1,201,646,466	589,439,297	4,905	60	0.60
第96期	1,118,731,521	564,463,006	5,046	60	0.60
第97期	1,052,777,596	532,711,405	5,060	60	0.60
第98期	1,043,156,964	541,267,563	5,189	60	0.60
第99期	999,830,407	519,930,589	5,200	60	0.60
第100期	946,732,174	505,744,494	5,342	60	0.60
第101期	946,918,499	490,809,648	5,183	60	0.60
第102期	945,576,238	493,395,315	5,218	60	0.60
第103期	930,235,595	466,792,105	5,018	60	0.60
第104期	918,629,512	459,127,154	4,998	60	0.60
第105期	902,934,879	450,483,795	4,989	60	0.60
第106期	836,647,971	407,978,058	4,876	60	0.60
第107期	818,689,833	402,704,765	4,919	60	0.60
第108期	814,022,199	399,396,146	4,906	60	0.60
第109期	805,081,175	394,950,324	4,906	60	0.60
第110期	773,897,523	402,056,004	5,195	60	0.60
第111期	768,391,781	360,575,973	4,693	60	0.60
第112期	764,887,526	340,478,656	4,451	60	0.60
第113期	767,542,425	342,173,795	4,458	60	0.60
第114期	769,181,199	363,636,585	4,728	60	0.60
第115期	764,675,948	348,712,655	4,560	60	0.60
第116期	764,794,360	336,583,929	4,401	60	0.60
第117期	656,258,825	309,394,796	4,715	60	0.60
第118期	622,802,358	291,795,167	4,685	60	0.60

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
	第 114 期	第 115 期	第 116 期	第 117 期	第 118 期
1万円当り分配金（税込み）	60円	60円	60円	60円	60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 円 当 り 償 還 金	4,680円51銭

S & P / A S X 200指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJ I」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJ Iに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 通貨αコースは、SPDJ I、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P / A S X 200指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

株式&通貨ツインαコース

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			S & P / A S X 200 指数 (円換算)		豪ドル為替レート		公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
90 期末(2020年 8 月17日)	円 2,192	円 30	% 3.6	10,483	% 4.2	円 76.57	% 2.2	% -	% 98.6	百万円 5,700
91 期末(2020年 9 月17日)	2,154	30	△0.4	10,171	△ 3.0	76.41	△0.2	-	98.5	5,556
92 期末(2020年10月19日)	2,139	30	0.7	10,327	1.5	74.81	△2.1	-	98.9	5,439
93 期末(2020年11月17日)	2,205	30	4.5	11,084	7.3	76.49	2.2	-	98.7	5,522
94 期末(2020年12月17日)	2,251	30	3.4	11,695	5.5	78.35	2.4	-	100.3	5,477
95 期末(2021年 1 月18日)	2,267	30	2.0	11,985	2.5	79.86	1.9	-	99.7	5,391
96 期末(2021年 2 月17日)	2,318	30	3.6	12,699	6.0	82.15	2.9	-	98.8	5,460
97 期末(2021年 3 月17日)	2,309	30	0.9	12,879	1.4	84.41	2.8	-	98.6	5,380
98 期末(2021年 4 月19日)	2,366	30	3.8	13,236	2.8	83.85	△0.7	-	98.6	5,460
99 期末(2021年 5 月17日)	2,362	30	1.1	13,318	0.6	84.96	1.3	-	99.1	5,319
100期末(2021年 6 月17日)	2,403	30	3.0	13,918	4.5	84.32	△0.8	-	98.7	5,326
101期末(2021年 7 月19日)	2,332	30	△1.7	13,302	△ 4.4	81.00	△3.9	-	98.7	5,062
102期末(2021年 8 月17日)	2,321	30	0.8	13,558	1.9	80.01	△1.2	-	98.6	4,970
103期末(2021年 9 月17日)	2,243	30	△2.1	13,343	△ 1.6	80.03	0.0	-	98.6	4,714
104期末(2021年10月18日)	2,234	30	0.9	13,929	4.4	84.66	5.8	-	98.7	4,599
105期末(2021年11月17日)	2,213	30	0.4	13,875	△ 0.4	83.67	△1.2	-	98.8	4,390
106期末(2021年12月17日)	2,168	30	△0.7	13,322	△ 4.0	81.71	△2.3	-	98.8	4,274
107期末(2022年 1 月17日)	2,177	30	1.8	13,624	2.3	82.45	0.9	-	98.6	4,283
108期末(2022年 2 月17日)	2,166	30	0.9	13,527	△ 0.7	83.09	0.8	-	98.8	4,244
109期末(2022年 3 月17日)	2,166	30	1.4	13,956	3.2	87.03	4.7	-	98.6	4,228
110期末(2022年 4 月18日)	2,253	30	5.4	15,727	12.7	93.54	7.5	-	99.1	4,347
111期末(2022年 5 月17日)	2,068	30	△6.9	14,303	△ 9.1	90.23	△3.5	-	98.5	3,918
112期末(2022年 6 月17日)	1,975	30	△3.0	13,772	△ 3.7	93.50	3.6	-	98.4	3,687
113期末(2022年 7 月19日)	1,978	30	1.7	14,070	2.2	94.15	0.7	-	98.6	3,679
114期末(2022年 8 月17日)	2,087	30	7.0	14,966	6.4	94.25	0.1	-	98.6	3,866
115期末(2022年 9 月20日)	2,034	30	△1.1	14,462	△ 3.4	96.30	2.2	-	98.8	3,730
116期末(2022年10月17日)	1,955	30	△2.4	13,951	△ 3.5	92.36	△4.1	-	98.6	3,574
117期末(2022年11月17日)	2,074	30	7.6	14,963	7.3	94.01	1.8	-	98.9	3,715
118期末(2022年12月19日)	2,057	30	0.6	14,581	△ 2.6	91.27	△2.9	-	-	3,288
償還(2023年 1 月17日)	2,054.47	-	△0.1	14,779	1.4	89.51	△1.9	-	-	3,191

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P / A S X 200指数 (円換算) は、S & P / A S X 200指数 (豪ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 為替レートは、計算日における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を採用しています。

(注5) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注6) 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。

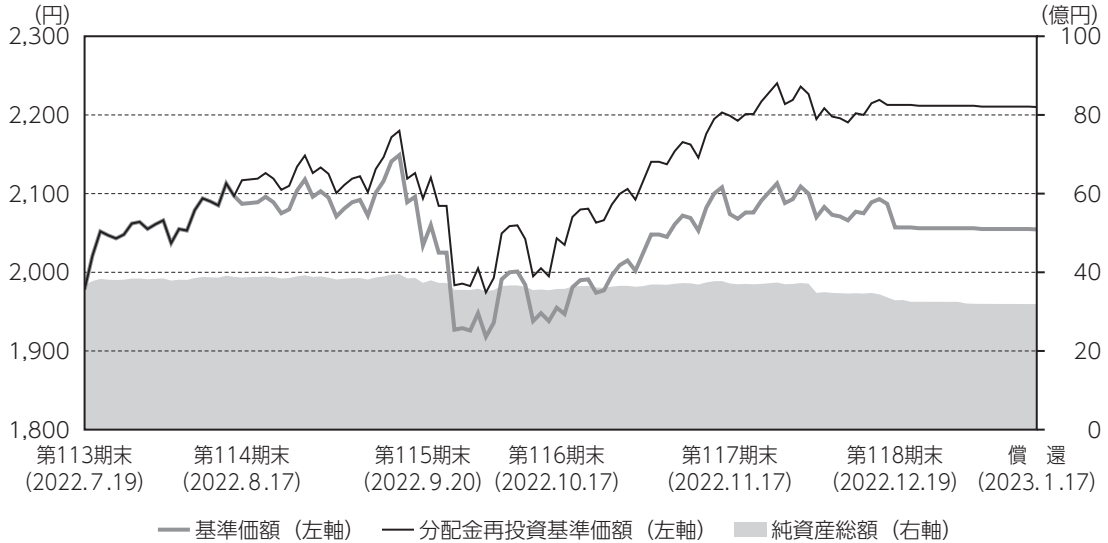
(注7) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。





## 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はありません。
- \* 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：2,054円47銭（既払分配金9,395円）

騰落率：40.0%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）については、オーストラリア株式への投資と株式および通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築した結果、豪ドルの値動きは軽微な影響となった一方で、株価が上昇したことがプラスに働き、上昇しました。オプション取引については、通貨オプション取引は軽微な影響となりましたが、株式オプション取引はマイナス要因となりました。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。

※オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）：クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）IIーダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）

ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 株式&通貨ツインαコース

	年 月 日	基 準 価 額		S & P / A	S X 200	豪ドル為替レート		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	騰 落 率	指 数 (参考指数)	(円 換 算) 騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第114期	(期首)2022年 7月19日	円 1,978	% -	14,070	% -	円 94.15	% -	% -	% 98.6
	7月末	2,055	3.9	14,504	3.1	94.20	0.1	-	98.6
	(期末)2022年 8月17日	2,117	7.0	14,966	6.4	94.25	0.1	-	98.6
第115期	(期首)2022年 8月17日	2,087	-	14,966	-	94.25	-	-	98.6
	8月末	2,103	0.8	14,880	△0.6	95.14	0.9	-	98.6
	(期末)2022年 9月20日	2,064	△1.1	14,462	△3.4	96.30	2.2	-	98.8
第116期	(期首)2022年 9月20日	2,034	-	14,462	-	96.30	-	-	98.8
	9月末	1,948	△4.2	13,795	△4.6	94.17	△2.2	-	98.5
	(期末)2022年10月17日	1,985	△2.4	13,951	△3.5	92.36	△4.1	-	98.6
第117期	(期首)2022年10月17日	1,955	-	13,951	-	92.36	-	-	98.6
	10月末	2,002	2.4	14,414	3.3	95.05	2.9	-	99.4
	(期末)2022年11月17日	2,104	7.6	14,963	7.3	94.01	1.8	-	98.9
第118期	(期首)2022年11月17日	2,074	-	14,963	-	94.01	-	-	98.9
	11月末	2,093	0.9	15,041	0.5	92.79	△1.3	-	99.0
	(期末)2022年12月19日	2,087	0.6	14,581	△2.6	91.27	△2.9	-	-
償 還 期	(期首)2022年12月19日	2,057	-	14,581	-	91.27	-	-	-
	12月末	2,056	△0.0	14,052	△3.6	89.57	△1.9	-	-
	(償還)2023年 1月17日	2,054.47	△0.1	14,779	1.4	89.51	△1.9	-	-

(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

(2013.1.23~2023.1.17)

### ■オーストラリア株式市況

オーストラリア株式市況は上昇しました。

オーストラリア株式市況は、米国の好調な経済指標や堅調な株式市場の動向などを受けて投資家のリスク選好姿勢が強まる中、当ファンド設定時から2015年前半にかけて上昇基調で推移しました。その後は、ギリシャ債務問題や中国・人民元切下げに端を発した中国株式市場の急落により世界的に株価が下落したことで、オーストラリア株式市場も2016年前半にかけて下落しました。2016年後半以降は、堅調な米国株式市場の動向、資源価格の回復や米中貿易摩擦に対する過度な警戒感が和らいだことなどから、2019年末にかけて上昇基調で推移しました。2020年初めから2021年末にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けてオーストラリア株式市場は一時急落する場面も見られましたが、オーストラリア政府やRBA（オーストラリア準備銀行）による財政・金融支援策などを受けて反発しました。その後、当ファンドが安定運用に移行した2022年12月央までは、ロシアのウクライナ侵攻などから資源価格が上昇したことでインフレ加速が進行する中、金融引き締めに伴う世界的な金利上昇や欧米の景気後退リスクが意識されたことで、軟調に推移しました。

### ■為替相場

豪ドルは対円で下落しました。

豪ドル対円為替相場は、当ファンド設定時から2019年末にかけて、日銀の追加金融緩和策や米中通商協議の進展期待から一時上昇する場面も見られましたが、中国経済の減速懸念や米中貿易摩擦の激化見通しを背景に投資家心理が悪化したことで、下落しました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて豪ドルは対円で一時急落しましたが、オーストラリア政府やRBA（オーストラリア準備銀行）による財政・金融支援策が好感され、2021年末にかけて上昇しました。満期償還に備えて安定運用に移行した2022年12月央にかけては、RBAによる利上げが行われる中で、日銀が金融緩和政策の据え置きを決定したことにより、金融政策の方向性の違いが意識され、豪ドルは対円での下落幅を縮小しました。

## 信託期間中の運用方針

### ■当ファンド

オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）への投資割合を高位に維持します。

### ■オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）

相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせた株式カバードコール戦略に加えて、通貨オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

### ■ダイワ・マネー・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す。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2013.1.23~2023.1.17)

### ■当ファンド

オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）とダイワ・マネー・マザーファンドに投資しました。安定運用に移行した2022年12月央までは、オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）への投資割合を高位に維持しました。

### ■オーストラリア高配当株α・ファンド（ツインαクラス）

相対的に予想配当利回りの高いオーストラリア株式への投資と株式オプション取引を組み合わせた株式カバードコール戦略に加えて、通貨オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

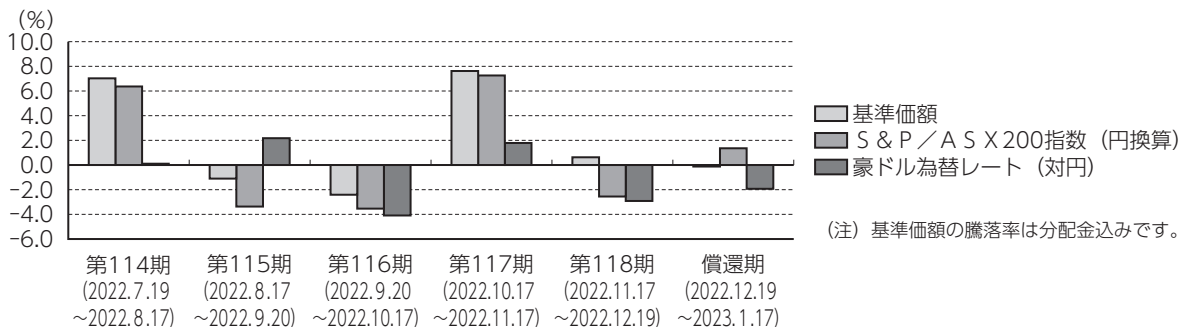
### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債や現先取引、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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期における当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。参考指数はオーストラリア株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しています。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



## 分配金について

1万口当り、第1期～第40期各140円、第41期～第46期各100円、第47期～第67期各70円、第68期～第80期各45円、第81期～第118期各30円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118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。なお、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114期	第115期	第116期	第117期	第118期
	2022年7月20日 ～2022年8月17日	2022年8月18日 ～2022年9月20日	2022年9月21日 ～2022年10月17日	2022年10月18日 ～2022年11月17日	2022年11月18日 ～2022年12月19日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>30</b>
対基準価額比率（%）	1.42	1.45	1.51	1.43	1.44
当期の収益（円）	30	30	30	30	30
当期の収益以外（円）	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額（円）	383	386	388	393	396

（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。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 35.19円	✓ 33.25円	✓ 31.74円	✓ 34.78円	✓ 33.59円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	83.36	84.47	86.02	87.50	88.66
(d) 分配準備積立金	294.94	299.03	300.75	301.01	304.64
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	413.50	416.76	418.51	423.30	426.89
(f) 分配金	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	383.50	386.76	388.51	393.30	396.89

（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114期～償還期 (2022.7.20～2023.1.17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	14円	0.671%	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2,049円です。
（投 信 会 社）	(4)	(0.218)	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）	(9)	(0.438)	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）	(0)	(0.015)	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	14	0.671	

(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。

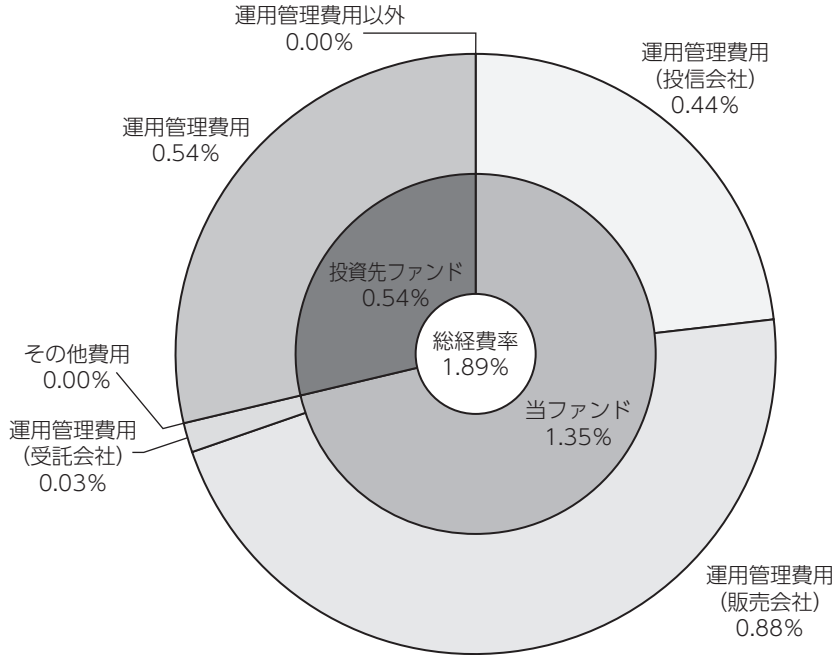
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.89%です。



総経費率 (①+②+③)	1.89%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.54%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

- (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。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

決算期	第 114 期 ~ 償還期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国（邦貨建）	16,566.83489	318,649	207,216.88807	4,064,476

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。  
 (注2) 金額は受渡し代金。  
 (注3) 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

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

決算期	第 114 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・マザーファンド	-	-	982	998

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2022年7月20日から2023年1月17日まで)

第 114 期 買 付				~ 償 還 期 売 付			
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
				AUSTRALIAN HIGH DIVIDEND EQUITY ALPHA (TWIN ALPHA CLASS) (ケイマン諸島)	207,216.88807	4,064,476	19

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金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 113 期 末
	□ 数
ダイワ・マネー・マザーファンド	千口 982

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年1月17日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	3,197,623	100.0
投資信託財産総額	3,197,623	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。



■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年8月17日)、(2022年9月20日)、(2022年10月17日)、(2022年11月17日)、(2022年12月19日)、(2023年1月17日)現在

項目	第114期末	第115期末	第116期末	第117期末	第118期末	償還時
(A) 資産	3,927,150,529円	3,802,221,396円	3,636,097,489円	3,785,508,438円	3,476,217,286円	3,197,623,595円
コール・ローン等	115,198,974	114,685,785	110,697,795	110,991,680	151,495,729	3,197,623,595
投資信託受益証券(評価額)	3,810,953,225	3,686,537,379	3,524,401,462	3,673,518,624	-	-
ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額)	998,330	998,232	998,232	998,134	-	-
未収入金	-	-	-	-	3,324,721,557	-
(B) 負債	61,059,118	71,470,618	61,131,057	70,038,951	188,095,384	5,628,157
未払収益分配金	55,573,951	55,032,326	54,852,994	53,734,211	47,963,699	-
未払解約金	1,368,399	11,560,654	2,645,054	12,086,075	135,869,131	2,046,311
未払信託報酬	4,116,768	4,877,638	3,633,009	4,218,665	4,262,554	3,580,553
未払利息	-	-	-	-	-	1,293
(C) 純資産総額(A-B)	3,866,091,411	3,730,750,778	3,574,966,432	3,715,469,487	3,288,121,902	3,191,995,438
元本	18,524,650,494	18,344,108,702	18,284,331,663	17,911,403,788	15,987,899,873	15,536,842,207
次期繰越損益金	△14,658,559,083	△14,613,357,924	△14,709,365,231	△14,195,934,301	△12,699,777,971	-
償還差損益金	-	-	-	-	-	△12,344,846,769
(D) 受益権総口数	18,524,650,494口	18,344,108,702口	18,284,331,663口	17,911,403,788口	15,987,899,873口	15,536,842,207口
1万口当り基準価額(C/D)	2,087円	2,034円	1,955円	2,074円	2,057円	47銭
1万口当り償還価額(C/D)	-	-	-	-	-	2,054円47銭

\* 当作成期首における元本額は18,600,252,994円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は463,877,836円、同解約元本額は3,527,288,623円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は2,054円47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12,344,846,769円です。

■損益の状況

第114期 自2022年7月20日 至2022年8月17日 第117期 自2022年10月18日 至2022年11月17日  
 第115期 自2022年8月18日 至2022年9月20日 第118期 自2022年11月18日 至2022年12月19日  
 第116期 自2022年9月21日 至2022年10月17日 償還期 自2022年12月20日 至2023年1月17日

項目	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期	償還期
(A) 配当等収益	66,247,777円	65,876,604円	61,683,144円	63,286,200円	57,974,062円	△ 93,267円
受取配当金	66,248,246	65,878,643	61,685,604	63,289,161	57,979,273	-
受取利息	1	3	6	21	104	914
支払利息	△ 470	△ 2,042	△ 2,466	△ 2,982	△ 5,315	△ 94,181
(B) 有価証券売買損益	195,051,114	△ 103,629,960	△ 146,776,875	208,086,569	△ 34,089,123	311,531
売買益	196,015,132	1,086,854	1,367,429	210,152,967	1,342,122	-
売買損	△ 964,018	△ 104,716,814	△ 148,144,304	△ 2,066,398	△ 35,431,245	311,531
(C) 信託報酬等	△ 4,116,768	△ 4,877,638	△ 3,633,009	△ 4,218,665	△ 4,262,554	△ 3,580,553
(D) 当期損益金(A+B+C)	257,182,123	△ 42,630,994	△ 88,726,740	267,154,104	19,622,385	△ 3,362,289
(E) 前期繰越損益金	△ 8,181,843,935	△ 7,873,293,936	△ 7,904,563,582	△ 7,845,199,413	△ 6,786,503,676	△ 6,600,882,906
(F) 追加信託差損益金	△ 6,678,323,320	△ 6,642,400,668	△ 6,661,221,915	△ 6,564,154,781	△ 5,884,932,981	△ 5,740,601,574
(配当等相当額)	( 154,430,205)	( 154,959,900)	( 157,282,459)	( 156,740,563)	( 141,752,652)	( 139,322,573)
(売買損益相当額)	(△ 6,832,753,525)	(△ 6,797,360,568)	(△ 6,818,504,374)	(△ 6,720,895,344)	(△ 6,026,685,633)	(△ 5,879,924,147)
(G) 合計(D+E+F)	△14,602,985,132	△14,558,325,598	△14,654,512,237	△14,142,200,090	△12,651,814,272	△12,344,846,769
(H) 収益分配金	△ 55,573,951	△ 55,032,326	△ 54,852,994	△ 53,734,211	△ 47,963,699	-
次期繰越損益金(G+H)	△14,658,559,083	△14,613,357,924	△14,709,365,231	△14,195,934,301	△12,699,777,971	-
追加信託差損益金	△ 6,678,323,320	△ 6,642,400,668	△ 6,661,221,915	△ 6,564,154,781	△ 5,884,932,981	-
(配当等相当額)	( 154,430,205)	( 154,959,900)	( 157,282,459)	( 156,740,563)	( 141,752,652)	( -)
(売買損益相当額)	(△ 6,832,753,525)	(△ 6,797,360,568)	(△ 6,818,504,374)	(△ 6,720,895,344)	(△ 6,026,685,633)	( -)
分配準備積立金	556,005,967	554,521,633	553,099,885	547,720,934	492,804,567	-
繰越損益金	△ 8,536,241,730	△ 8,525,478,889	△ 8,601,243,201	△ 8,179,500,454	△ 7,307,649,557	-
償還差損益金(G)	-	-	-	-	-	△12,344,846,769

(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114期～第118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 114 期	第 115 期	第 116 期	第 117 期	第 118 期
(a) 経費控除後の配当等収益	65,204,172円	60,998,938円	58,050,103円	62,302,359円	53,711,462円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	154,430,205	154,959,900	157,282,459	156,740,563	141,752,652
(d) 分配準備積立金	546,375,746	548,555,021	549,902,776	539,152,786	487,056,804
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	766,010,123	764,513,859	765,235,338	758,195,708	682,520,918
(f) 分配金	55,573,951	55,032,326	54,852,994	53,734,211	47,963,699
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	710,436,172	709,481,533	710,382,344	704,461,497	634,557,219
(h) 受益権総口数	18,524,650,494□	18,344,108,702□	18,284,331,663□	17,911,403,788□	15,987,899,873□

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2013年1月23日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年1月17日		資産総額	3,197,623,595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	5,628,157円
				純資産総額	3,191,995,438円
受益権口数	35,667,320,075□	15,536,842,207□	△20,130,477,868□	受益権口数	15,536,842,207□
元本額	35,667,320,075円	15,536,842,207円	△20,130,477,868円	1単位当り償還金	2,054円47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1期	58,955,467,550	62,928,406,882	10,674	140	1.40
第2期	66,175,056,782	69,290,384,188	10,471	140	1.40
第3期	74,313,853,521	77,395,182,493	10,415	140	1.40
第4期	77,718,901,857	69,012,928,658	8,880	140	1.40
第5期	79,586,253,672	72,731,434,627	9,139	140	1.40
第6期	80,952,723,514	72,838,710,797	8,998	140	1.40
第7期	81,712,568,981	74,845,740,838	9,160	140	1.40
第8期	82,684,256,576	76,859,198,454	9,296	140	1.40
第9期	81,679,387,294	77,130,175,135	9,443	140	1.40
第10期	82,318,671,526	73,313,618,073	8,906	140	1.40
第11期	81,597,914,238	73,751,076,011	9,038	140	1.40
第12期	80,643,129,344	71,745,778,518	8,897	140	1.40
第13期	76,591,166,673	67,751,017,215	8,846	140	1.40
第14期	73,010,291,916	65,978,614,519	9,037	140	1.40
第15期	71,379,281,486	63,873,340,864	8,948	140	1.40
第16期	71,302,816,275	63,125,341,941	8,853	140	1.40

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17期	70,146,856,704	62,033,199,389	8,843	140	1.40
第18期	70,078,205,134	61,075,535,529	8,715	140	1.40
第19期	69,861,540,524	59,464,796,650	8,512	140	1.40
第20期	69,750,960,045	55,470,841,832	7,953	140	1.40
第21期	69,302,604,707	58,082,818,816	8,381	140	1.40
第22期	67,823,482,952	52,613,951,681	7,757	140	1.40
第23期	66,999,995,362	52,249,290,867	7,798	140	1.40
第24期	66,488,584,283	51,307,767,096	7,717	140	1.40
第25期	65,999,919,552	50,203,845,058	7,607	140	1.40
第26期	65,175,241,068	49,602,457,320	7,611	140	1.40
第27期	64,486,464,381	48,090,120,113	7,457	140	1.40
第28期	62,981,776,320	45,451,680,763	7,217	140	1.40
第29期	61,431,429,551	43,373,873,925	7,061	140	1.40
第30期	60,214,227,423	40,147,523,330	6,667	140	1.40
第31期	59,121,714,659	35,608,224,163	6,023	140	1.40
第32期	57,645,943,120	35,201,183,863	6,106	140	1.40
第33期	56,976,764,355	33,757,537,003	5,925	140	1.40
第34期	55,733,687,140	32,589,321,857	5,847	140	1.40
第35期	55,272,653,995	28,903,322,924	5,229	140	1.40
第36期	54,718,894,837	27,915,699,486	5,102	140	1.40
第37期	54,199,062,497	29,118,597,477	5,373	140	1.40
第38期	53,703,558,762	28,378,457,382	5,284	140	1.40
第39期	53,047,886,031	27,118,763,979	5,112	140	1.40
第40期	52,291,071,467	24,477,432,190	4,681	140	1.40
第41期	51,954,705,891	25,611,039,909	4,929	100	1.00
第42期	50,476,929,971	24,624,784,383	4,878	100	1.00
第43期	48,876,834,618	22,824,826,133	4,670	100	1.00
第44期	47,524,789,566	22,496,475,854	4,734	100	1.00
第45期	46,798,182,878	21,269,067,592	4,545	100	1.00
第46期	45,930,442,701	21,818,311,072	4,750	100	1.00
第47期	45,519,062,273	21,763,832,908	4,781	70	0.70
第48期	43,883,326,034	21,128,613,191	4,815	70	0.70
第49期	42,949,837,023	20,580,489,153	4,792	70	0.70
第50期	42,811,112,175	19,875,087,782	4,643	70	0.70
第51期	42,015,690,301	19,545,971,387	4,652	70	0.70

ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 株式&通貨ツインαコース

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52期	41,397,016,814	18,939,498,592	4,575	70	0.70
第53期	40,579,153,006	18,413,313,578	4,538	70	0.70
第54期	40,132,832,895	18,119,691,253	4,515	70	0.70
第55期	39,325,043,146	17,609,918,025	4,478	70	0.70
第56期	38,868,323,627	17,403,916,419	4,478	70	0.70
第57期	38,063,390,021	16,773,456,699	4,407	70	0.70
第58期	37,426,469,935	16,426,154,715	4,389	70	0.70
第59期	37,382,299,551	16,018,911,998	4,285	70	0.70
第60期	37,025,903,675	14,650,803,519	3,957	70	0.70
第61期	36,537,688,724	14,198,678,170	3,886	70	0.70
第62期	36,302,193,981	13,665,737,923	3,764	70	0.70
第63期	35,658,266,764	13,375,340,242	3,751	70	0.70
第64期	35,945,501,381	13,222,126,015	3,678	70	0.70
第65期	36,009,904,443	13,217,611,021	3,671	70	0.70
第66期	35,850,399,736	12,845,282,993	3,583	70	0.70
第67期	35,548,989,852	12,332,763,604	3,469	70	0.70
第68期	36,063,109,673	11,865,749,358	3,290	45	0.45
第69期	35,321,030,547	11,494,487,415	3,254	45	0.45
第70期	35,219,003,105	11,088,931,298	3,149	45	0.45
第71期	35,119,071,444	10,799,435,861	3,075	45	0.45
第72期	34,960,309,539	10,866,661,875	3,108	45	0.45
第73期	33,739,790,628	10,602,710,609	3,142	45	0.45
第74期	33,406,145,151	10,560,690,043	3,161	45	0.45
第75期	33,167,805,560	10,104,817,173	3,047	45	0.45
第76期	32,991,425,424	9,942,518,426	3,014	45	0.45
第77期	32,933,861,762	9,964,253,423	3,026	45	0.45
第78期	32,744,346,840	9,146,943,295	2,793	45	0.45
第79期	32,118,433,728	9,434,871,903	2,938	45	0.45
第80期	31,424,964,277	9,099,910,714	2,896	45	0.45
第81期	30,928,505,974	9,024,767,416	2,918	30	0.30
第82期	30,056,273,706	8,844,583,408	2,943	30	0.30
第83期	29,558,101,774	8,771,609,875	2,968	30	0.30
第84期	28,720,964,544	8,266,632,941	2,878	30	0.30
第85期	28,209,969,101	5,155,985,530	1,828	30	0.30
第86期	27,624,161,473	5,322,180,839	1,927	30	0.30

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87期	27,508,036,717	5,316,800,216	1,933	30	0.30
第88期	27,123,077,434	5,659,734,187	2,087	30	0.30
第89期	26,773,925,706	5,740,137,025	2,144	30	0.30
第90期	26,000,595,388	5,700,010,979	2,192	30	0.30
第91期	25,792,393,039	5,556,880,985	2,154	30	0.30
第92期	25,424,110,997	5,439,044,541	2,139	30	0.30
第93期	25,044,228,354	5,522,973,051	2,205	30	0.30
第94期	24,330,063,130	5,477,072,040	2,251	30	0.30
第95期	23,787,272,916	5,391,758,655	2,267	30	0.30
第96期	23,561,397,170	5,460,862,734	2,318	30	0.30
第97期	23,304,969,953	5,380,622,436	2,309	30	0.30
第98期	23,079,350,899	5,460,980,670	2,366	30	0.30
第99期	22,521,934,324	5,319,431,157	2,362	30	0.30
第100期	22,165,432,170	5,326,633,025	2,403	30	0.30
第101期	21,706,364,875	5,062,844,050	2,332	30	0.30
第102期	21,417,703,763	4,970,491,070	2,321	30	0.30
第103期	21,016,866,415	4,714,237,075	2,243	30	0.30
第104期	20,589,044,652	4,599,047,185	2,234	30	0.30
第105期	19,841,763,710	4,390,426,263	2,213	30	0.30
第106期	19,716,767,561	4,274,457,609	2,168	30	0.30
第107期	19,677,794,456	4,283,209,368	2,177	30	0.30
第108期	19,596,549,724	4,244,712,849	2,166	30	0.30
第109期	19,526,147,782	4,228,461,288	2,166	30	0.30
第110期	19,292,649,198	4,347,480,711	2,253	30	0.30
第111期	18,947,384,115	3,918,927,878	2,068	30	0.30
第112期	18,665,809,317	3,687,078,370	1,975	30	0.30
第113期	18,600,252,994	3,679,392,259	1,978	30	0.30
第114期	18,524,650,494	3,866,091,411	2,087	30	0.30
第115期	18,344,108,702	3,730,750,778	2,034	30	0.30
第116期	18,284,331,663	3,574,966,432	1,955	30	0.30
第117期	17,911,403,788	3,715,469,487	2,074	30	0.30
第118期	15,987,899,873	3,288,121,902	2,057	30	0.30

(注) 1単位は受益権1万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
	第 114 期	第 115 期	第 116 期	第 117 期	第 118 期
1万円当り分配金（税込み）	30円	30円	30円	30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 円 当 り 償 還 金	2,054円47銭

S & P / A S X 200指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「S P D J I」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P<sup>®</sup>、S&P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup>およびCDX<sup>®</sup>は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはS P D J Iに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 株式&通貨ツインαコースは、S P D J I、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P / A S X 200指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

オーストラリア高配当株α・ファンド  
 (株式αクラス／通貨αクラス／ツインαクラス)

当ファンド（ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型） 株式αコース／通貨αコース／株式&通貨ツインαコース）はケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱーダイワ・オーストラリア高配当株α・ファンド（株式αクラス／通貨αクラス／ツインαクラス）」の受益証券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。

貸借対照表

2021年12月31日

		(円)
<b>資産</b>		
担保付スワップ投資評価額（簿価：¥10,191,745,471円）		4,896,585,171
未収利息		2,920,942
<b>資産合計</b>		<b>4,899,506,113</b>
<b>負債</b>		
未払代行会社報酬		2,920,942
<b>負債合計</b>		<b>2,920,942</b>
<b>償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産</b>		<b>4,896,585,171</b>
帰属先別純資産	ツインαクラス受益証券	4,370,043,293
	通貨αクラス受益証券	418,543,211
	株式αクラス受益証券	107,998,667
発行済受益証券数	ツインαクラス受益証券	199,531,212
	通貨αクラス受益証券	7,715,993
	株式αクラス受益証券	2,732,666
受益証券一口当り純資産	ツインαクラス受益証券	21,902
	通貨αクラス受益証券	54,244
	株式αクラス受益証券	39,521

包括利益計算書

2021年12月31日終了年度

(円)

収入

適正価値による損益通算後の金融商品純損益  
手数料収入  
担保付スワップ投資純損益

1,181,140,635  
(230,296,656)  
950,843,979

収入合計

950,843,979

営業費用

36,863,526

営業費用合計

36,863,526

金融費用控除前営業損益

913,980,453

償還可能受益証券の保有者への分配金

(1,144,277,109)

償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産変動額（分配金支払後）

(230,296,656)

当トラストが保有していた担保付スワップ投資

2021年12月31日時点

	簿価 (円)	評価額 (円)
ツインαクラス受益証券	9,497,864,735	4,370,043,293
通貨αクラス受益証券	517,742,553	418,543,211
株式αクラス受益証券	176,138,183	107,998,667
	<u>10,191,745,471</u>	<u>4,896,585,171</u>



# ダイワ・マネー・マザーファンド

## 運用報告書 第18期 (決算日 2022年12月9日)

(作成対象期間 2021年12月10日～2022年12月9日)

ダイワ・マネー・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。

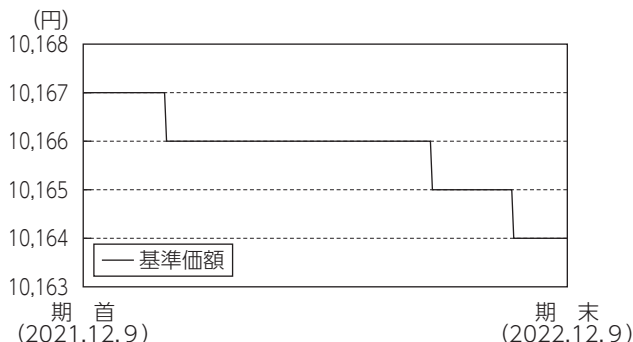
運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

## 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)2021年12月9日	円	%	%
12月9日	10,167	-	-
12月末	10,167	0.0	-
2022年1月1日	10,167	0.0	-
2月末	10,166	△0.0	-
3月末	10,166	△0.0	-
4月末	10,166	△0.0	-
5月末	10,166	△0.0	-
6月末	10,166	△0.0	-
7月末	10,166	△0.0	-
8月末	10,165	△0.0	-
9月末	10,165	△0.0	-
10月末	10,164	△0.0	-
11月末	10,164	△0.0	-
(期末)2022年12月9日	10,164	△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、利息収入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：10,167円 期末：10,164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的・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	-
合 計	-

(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

2022年12月9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	14,815,299	100.0
投資信託財産総額	14,815,299	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年12月9日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>14,815,299,248円</b>
コール・ローン等	14,815,299,248
<b>(B) 負債</b>	<b>113,000</b>
未払解約金	113,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>14,815,186,248</b>
元本	14,576,480,402
次期繰越損益金	238,705,846
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>14,576,480,402口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	10,164円

\* 期首における元本額は6,671,046,264円、当作成期間中における追加設定元本額は21,845,860,602円、同解約元本額は13,940,426,464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:

ゴールド・ファンド (FOF5用) (適格機関投資家専用)	3,627,565,740円
ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド -A I新時代- (為替ヘッジあり)	977,694円
ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド -A I新時代- (為替ヘッジなし)	977,694円
ダイワF Eグローバル・バリュー (為替ヘッジあり)	9,608円
ダイワF Eグローバル・バリュー (為替ヘッジなし)	9,608円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,107円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし)	49,107円
ダイワワ R I C I <sup>®</sup> コモディティ・ファンド	2,074,249円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジあり)	5,973,809円
スマート・アロケーション・Dガード	23,929,224円
堅実バランスファンド -ハジメの一步-	236,205,446円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/隔月分配型)	180,729円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/隔月分配型)	737,649円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/資産成長型)	95,276円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	337,885円
世界セレクティブ株式オープン	983円
世界セレクティブ株式オープン (年2回決算型)	983円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/毎月分配型)	983円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型)	983円
iFreeETF NASDAQ100インバース	5,509,329,948円
iFreeETF NASDAQ100レバレッジ	595,238,099円
iFreeETF NASDAQ100ダブルインバース	309,917,358円
D Cダイワ・マネー・ポートフォリオ	4,031,730,013円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 日本円・コース (毎月分配型)	132,757円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型)	52,987円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	467,315円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型)	12,784円
ダイワ/フィデリティ北米株ファンド -パラダイムシフト-	1,988,495円
ダイワF Eグローバル・バリュー株ファンド (ダイワSMA専用)	3,666円
ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	155,317円
ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型)	38,024円
ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 米ドル・コース (毎月分配型)	4,380円
ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型)	22,592円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース)	33,689円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース)	96,254円
ダイワ・ダブルバランス・ファンド (Dガード付/部分為替ヘッジあり)	104,785,071円
ダイワ6資産バランス・ファンド (Dガード付/為替ヘッジあり)	112,805,921円
ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジあり)	5,385円
ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジなし)	11,530円
ダイワ米国M L Pファンド (毎月分配型) 米ドルコース	9,817円
ダイワ米国M L Pファンド (毎月分配型) 日本円コース	6,964円
ダイワ米国M L Pファンド (毎月分配型) 通貨αコース	9,479円
ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型)	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	982,368円
D Cスマート・アロケーション・Dガード	8,073,994円

ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 南アフリカ・ランド・コース (毎月分配型)	1,097円
ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース (毎月分配型)	2,690円
ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	1,350円
ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式αコース	98,203円
ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 通貨αコース	98,203円
ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース	982,029円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	9,652円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,164円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月10日 至2022年12月9日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 3,985,061円</b>
受取利息	2,618
支払利息	△ 3,987,679
<b>(B) 当期損益金(A)</b>	<b>△ 3,985,061</b>
<b>(C) 前期繰越損益金</b>	<b>111,255,021</b>
<b>(D) 解約差損益金</b>	<b>△230,350,932</b>
<b>(E) 追加信託差損益金</b>	<b>361,786,818</b>
<b>(F) 合計(B + C + D + E)</b>	<b>238,705,846</b>
次期繰越損益金(F)	238,705,846

(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。