

# ダイワ高格付豪ドル債オープン (毎月分配型)

## 運用報告書 (全体版)

第258期 (決算日 2024年5月15日)

第259期 (決算日 2024年6月17日)

第260期 (決算日 2024年7月16日)

第261期 (決算日 2024年8月15日)

第262期 (決算日 2024年9月17日)

第263期 (決算日 2024年10月15日)

(作成対象期間 2024年4月16日～2024年10月15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、豪ドル建ての公社債等に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |   |
|--------|--|---|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／債券  |   |
| 信託期間   | 無期限 (設定日: 2002年10月31日)   |   |
| 運用方針   | 安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。   |   |
| 主要投資対象 | ベビーファンド  | ダイワ高格付豪ドル債マザーファンドの受益証券  |
|        | ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド  | 内外の公社債、ABS (アセットバック証券: 各種の債権や商業用不動産などの資産を裏付けとして発行された証券)、MBS (モーゲージ担保証券: 不動産担保融資の債権を裏付けとして発行された証券) および短期金融商品 |
| 組入制限   | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率  | 無制限   |
|        | マザーファンドの株式組入上限比率   | 純資産総額の10%以下   |
| 分配方針   | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことを目標に分配金額を決定します。 |   |

最近30期の運用実績

| 決算期                | 基準価額       |            |           | FTSEオーストラリア国債インデックス (円換算) |           | 公社債<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額    |
|--------------------|------------|------------|-----------|---------------------------|-----------|-------------|------------|--------------|
|                    | (分配落)      | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (参考指数)                    | 期中<br>騰落率 |             |            |              |
| 234期末(2022年5月16日)  | 円<br>6,061 | 円<br>10    | %<br>△5.5 | 31,005                    | %<br>△6.5 | %<br>97.9   | %<br>-     | 百万円<br>3,380 |
| 235期末(2022年6月15日)  | 6,104      | 10         | 0.9       | 30,985                    | △0.1      | 97.6        | -          | 3,370        |
| 236期末(2022年7月15日)  | 6,251      | 10         | 2.6       | 32,434                    | 4.7       | 97.4        | -          | 3,414        |
| 237期末(2022年8月15日)  | 6,313      | 10         | 1.2       | 32,735                    | 0.9       | 97.5        | -          | 3,312        |
| 238期末(2022年9月15日)  | 6,406      | 10         | 1.6       | 33,088                    | 1.1       | 97.5        | -          | 3,270        |
| 239期末(2022年10月17日) | 6,042      | 10         | △5.5      | 31,040                    | △6.2      | 97.8        | -          | 3,072        |
| 240期末(2022年11月15日) | 6,179      | 10         | 2.4       | 32,123                    | 3.5       | 97.6        | -          | 3,131        |
| 241期末(2022年12月15日) | 6,204      | 10         | 0.6       | 32,677                    | 1.7       | 98.0        | -          | 3,120        |
| 242期末(2023年1月16日)  | 5,939      | 10         | △4.1      | 31,090                    | △4.9      | 97.8        | -          | 2,974        |
| 243期末(2023年2月15日)  | 6,127      | 10         | 3.3       | 31,947                    | 2.8       | 97.6        | -          | 3,058        |
| 244期末(2023年3月15日)  | 6,014      | 10         | △1.7      | 31,790                    | △0.5      | 98.1        | -          | 2,991        |
| 245期末(2023年4月17日)  | 6,050      | 10         | 0.8       | 31,979                    | 0.6       | 97.5        | -          | 2,992        |
| 246期末(2023年5月15日)  | 6,105      | 10         | 1.1       | 32,283                    | 1.0       | 97.9        | -          | 3,001        |
| 247期末(2023年6月15日)  | 6,248      | 10         | 2.5       | 32,624                    | 1.1       | 97.7        | -          | 3,042        |
| 248期末(2023年7月18日)  | 6,205      | 10         | △0.5      | 32,531                    | △0.3      | 97.0        | -          | 2,931        |
| 249期末(2023年8月15日)  | 6,191      | 10         | △0.1      | 32,207                    | △1.0      | 97.2        | -          | 2,914        |
| 250期末(2023年9月15日)  | 6,266      | 10         | 1.4       | 32,707                    | 1.6       | 97.4        | -          | 2,925        |
| 251期末(2023年10月16日) | 6,165      | 10         | △1.5      | 31,911                    | △2.4      | 97.1        | -          | 2,857        |
| 252期末(2023年11月15日) | 6,319      | 10         | 2.7       | 32,741                    | 2.6       | 97.0        | -          | 2,914        |
| 253期末(2023年12月15日) | 6,327      | 10         | 0.3       | 33,336                    | 1.8       | 98.2        | -          | 2,888        |
| 254期末(2024年1月15日)  | 6,454      | 10         | 2.2       | 34,055                    | 2.2       | 97.1        | -          | 2,919        |
| 255期末(2024年2月15日)  | 6,453      | 10         | 0.1       | 33,952                    | △0.3      | 96.9        | -          | 2,899        |
| 256期末(2024年3月15日)  | 6,504      | 10         | 0.9       | 34,496                    | 1.6       | 97.8        | -          | 2,893        |
| 257期末(2024年4月15日)  | 6,583      | 10         | 1.4       | 34,805                    | 0.9       | 97.6        | -          | 2,892        |
| 258期末(2024年5月15日)  | 6,847      | 10         | 4.2       | 36,297                    | 4.3       | 97.3        | -          | 2,978        |
| 259期末(2024年6月17日)  | 6,932      | 10         | 1.4       | 37,045                    | 2.1       | 96.9        | -          | 2,989        |
| 260期末(2024年7月16日)  | 7,083      | 10         | 2.3       | 37,656                    | 1.6       | 96.4        | -          | 3,026        |
| 261期末(2024年8月15日)  | 6,572      | 10         | △7.1      | 35,238                    | △6.4      | 96.7        | -          | 2,793        |
| 262期末(2024年9月17日)  | 6,464      | 10         | △1.5      | 34,795                    | △1.3      | 97.3        | -          | 2,736        |
| 263期末(2024年10月15日) | 6,733      | 10         | 4.3       | 36,020                    | 3.5       | 97.4        | -          | 2,773        |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) FTSEオーストラリア国債インデックス (円換算) は、FTSEオーストラリア国債インデックス (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。FTSEオーストラリア国債インデックス (豪ドルベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

(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) 公社債および債券先物の組入比率は、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。

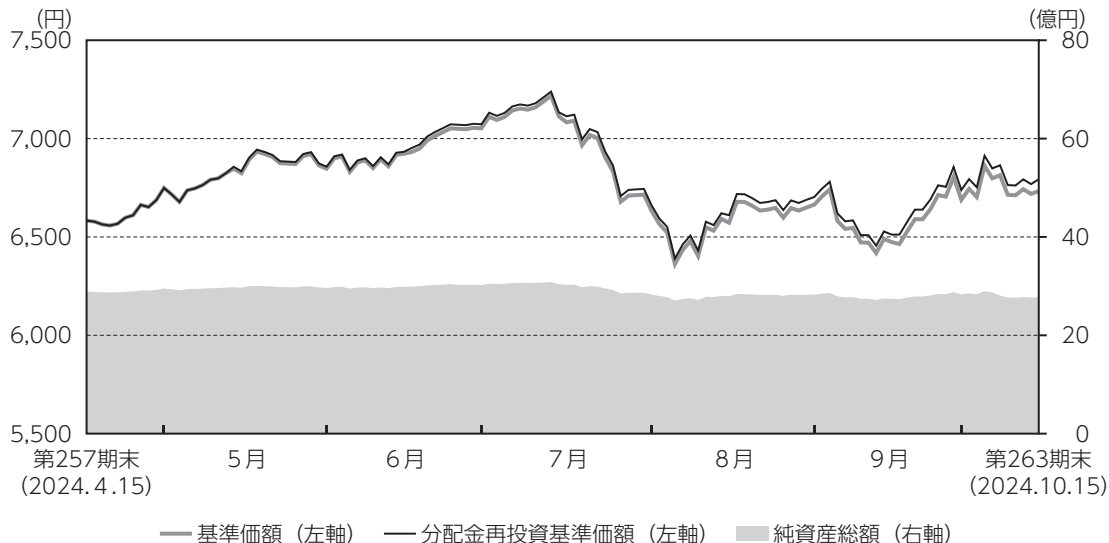
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



## 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

第258期首：6,583円

第263期末：6,733円（既払分配金60円）

騰落率：3.2%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

投資している債券からの利息収入や豪ドルが円に対して上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ高格付豪ドル債オープン（毎月分配型）

|       | 年 月 日             | 基 準 価 額    |        | FTSEオーストラリア国債<br>インデックス (円換算) |        | 公 社 債 率<br>組 入 比 率 | 債 先 物 比<br>券 率 |
|-------|-------------------|------------|--------|-------------------------------|--------|--------------------|----------------|
|       |                   |            | 騰 落 率  | (参考指数)                        | 騰 落 率  |                    |                |
| 第258期 | (期首) 2024年 4 月15日 | 円<br>6,583 | %<br>- | 34,805                        | %<br>- | %<br>97.6          | %<br>-         |
|       | 4 月末              | 6,749      | 2.5    | 35,622                        | 2.3    | 96.4               | -              |
|       | (期末) 2024年 5 月15日 | 6,857      | 4.2    | 36,297                        | 4.3    | 97.3               | -              |
| 第259期 | (期首) 2024年 5 月15日 | 6,847      | -      | 36,297                        | -      | 97.3               | -              |
|       | 5 月末              | 6,847      | 0.0    | 36,205                        | △0.3   | 96.5               | -              |
|       | (期末) 2024年 6 月17日 | 6,942      | 1.4    | 37,045                        | 2.1    | 96.9               | -              |
| 第260期 | (期首) 2024年 6 月17日 | 6,932      | -      | 37,045                        | -      | 96.9               | -              |
|       | 6 月末              | 7,052      | 1.7    | 37,388                        | 0.9    | 97.7               | -              |
|       | (期末) 2024年 7 月16日 | 7,093      | 2.3    | 37,656                        | 1.6    | 96.4               | -              |
| 第261期 | (期首) 2024年 7 月16日 | 7,083      | -      | 37,656                        | -      | 96.4               | -              |
|       | 7 月末              | 6,631      | △6.4   | 35,238                        | △6.4   | 96.6               | -              |
|       | (期末) 2024年 8 月15日 | 6,582      | △7.1   | 35,238                        | △6.4   | 96.7               | -              |
| 第262期 | (期首) 2024年 8 月15日 | 6,572      | -      | 35,238                        | -      | 96.7               | -              |
|       | 8 月末              | 6,664      | 1.4    | 35,695                        | 1.3    | 96.9               | -              |
|       | (期末) 2024年 9 月17日 | 6,474      | △1.5   | 34,795                        | △1.3   | 97.3               | -              |
| 第263期 | (期首) 2024年 9 月17日 | 6,464      | -      | 34,795                        | -      | 97.3               | -              |
|       | 9 月末              | 6,689      | 3.5    | 35,877                        | 3.1    | 97.5               | -              |
|       | (期末) 2024年10月15日  | 6,743      | 4.3    | 36,020                        | 3.5    | 97.4               | -              |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2024.4.16～2024.10.15）

## ■オーストラリア債券市況

オーストラリア債券市場では、金利はおおむね横ばいとなりました。

当作成期首より、RBA（オーストラリア準備銀行）が政策金利の据え置きを継続する中、オーストラリアの経済指標が強弱入り交じる結果となったことなどを受け、金利は方向感のない動きが継続しました。2024年7月末から9月にかけては、米国の失業率が市場予想を上回ったことやオーストラリアのCPI（消費者物価指数）が市場予想を下回ったことなどから、金利は低下（債券価格は上昇）しました。当作成期末にかけては、米国の雇用統計が市場予想に反して堅調な結果となったことなどを背景に、金利は上昇（債券価格は下落）しました。

## ■為替相場

豪ドルは対円で上昇しました。

豪ドルの対円為替相場は、当作成期首より、オーストラリアのCPI（消費者物価指数）が市場予想を上回ったことや、緩和的な政策を継続する日銀の姿勢などが材料となり、豪ドルは円に対して上昇しました。2024年7月から9月は、政府・日銀が為替介入を実施したとの観測が浮上したことや日銀の利上げ観測が高まったことなどから、円高豪ドル安が進行しました。当作成期末にかけては、米国の雇用統計が堅調な結果となったことなどを背景にリスク選好が強まり、豪ドルは円に対して上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

主として「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」の受益証券に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

## ■ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

豪ドル建ての公社債等に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。ファンドの運用につきましては、金融政策と経済ファンダメンタルズの分析や金融市場の動向などを踏まえ、金利変動リスクを表す修正デュレーションを3（年）程度から5（年）程度の範囲内で変動させるとともに、債券の種別構成や年限構成を決定します。為替については、豪ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

## ポートフォリオについて

(2024.4.16~2024.10.15)

### ■当ファンド

「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」の受益証券に投資することを通して豪ドル建ての公社債等を組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

### ■ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

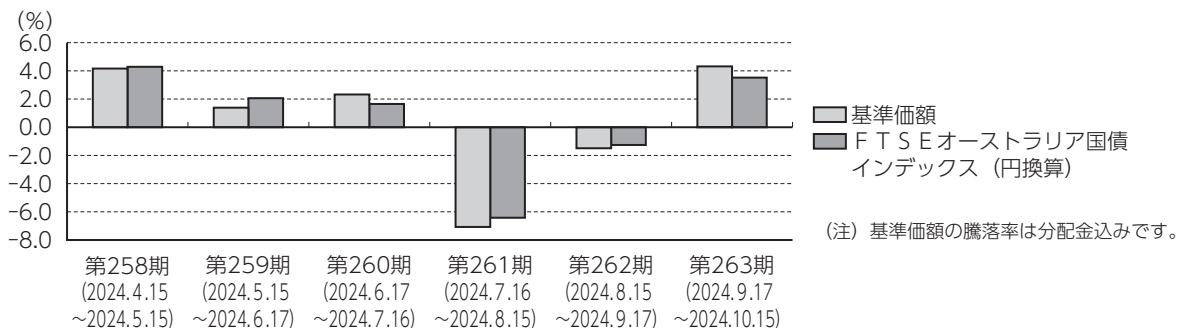
豪ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

ポートフォリオの修正デュレーションは、3（年）程度から5（年）程度の範囲内で運用しました。債券種別構成に関しては、非国債の組入比率を高めに保ちました。為替に関しては、実質外貨比率を高位に保ちました。

## 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、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



## 分配金について

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

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目                  | 第258期                     | 第259期                     | 第260期                     | 第261期                     | 第262期                     | 第263期                      |
|----------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|
|                      | 2024年4月16日<br>～2024年5月15日 | 2024年5月16日<br>～2024年6月17日 | 2024年6月18日<br>～2024年7月16日 | 2024年7月17日<br>～2024年8月15日 | 2024年8月16日<br>～2024年9月17日 | 2024年9月18日<br>～2024年10月15日 |
| <b>当期分配金（税込み）（円）</b> | <b>10</b>                 | <b>10</b>                 | <b>10</b>                 | <b>10</b>                 | <b>10</b>                 | <b>10</b>                  |
| 対基準価額比率（％）           | 0.15                      | 0.14                      | 0.14                      | 0.15                      | 0.15                      | 0.15                       |
| 当期の収益（円）             | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        | 10                        | 10                         |
| 当期の収益以外（円）           | —                         | —                         | —                         | —                         | —                         | —                          |
| 翌期繰越分配対象額（円）         | 436                       | 446                       | 455                       | 456                       | 459                       | 466                        |

(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258期    | 第259期    | 第260期    | 第261期    | 第262期    | 第263期    |
|----------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | ✓ 19.99円 | ✓ 20.41円 | ✓ 19.11円 | ✓ 11.22円 | ✓ 12.63円 | ✓ 17.33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     | 0.00     |
| (c) 収益調整金                  | 238.83   | 238.90   | 238.96   | 239.03   | 239.12   | 239.19   |
| (d) 分配準備積立金                | 187.33   | 197.27   | 207.62   | 216.67   | 217.81   | 220.37   |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 446.17   | 456.59   | 465.71   | 466.93   | 469.57   | 476.90   |
| (f) 分配金                    | 10.00    | 10.00    | 10.00    | 10.00    | 10.00    | 10.00    |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 436.17   | 446.59   | 455.71   | 456.93   | 459.57   | 466.90   |

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

主として「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」の受益証券に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

### ■ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

豪ドル建ての公社債等に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。ファンドの運用につきましては、金融政策と経済ファンダメンタルズの分析や金融市場の動向などを踏まえ、金利変動リスクを表す修正デュレーションを3（年）程度から5（年）程度の範囲内で変動させるとともに、債券の種別構成や年限構成を決定します。為替については、豪ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。



1万口当りの費用の明細

| 項 目           | 第258期～第263期<br>(2024.4.16～2024.10.15) |         | 項 目 の 概 要   |
|---------------|---------------------------------------|---------|---|
|               | 金 額                                   | 比 率     |   |
| 信 託 報 酬       | 47円                                   | 0.687%  | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は6,775円です。                       |
| （投 信 会 社）     | (19)                                  | (0.275) | 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）     | (26)                                  | (0.385) | 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)                                   | (0.027) | 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<br>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<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| そ の 他 費 用     | 1                                     | 0.017   | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数   |
| （保 管 費 用）     | (1)                                   | (0.013) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用                      |
| （監 査 費 用）     | (0)                                   | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用   |
| （そ の 他）       | (0)                                   | (0.000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用  |
| 合 計           | 48                                    | 0.703   |   |

(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。

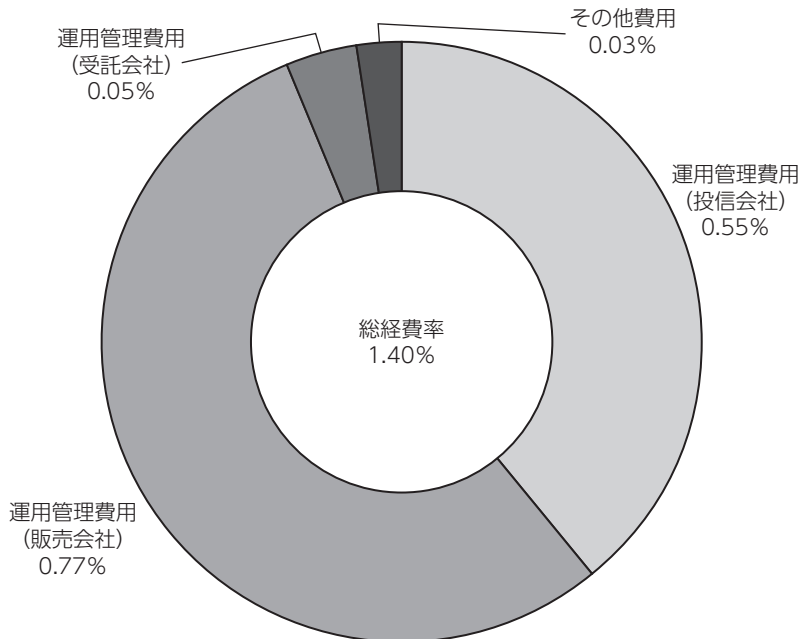
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.40%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2024年4月16日から2024年10月15日まで)

| 決算期               | 第258期～第263期 |       |        |         |
|-------------------|-------------|-------|--------|---------|
|                   | 設定          |       | 解約     |         |
|                   | □数          | 金額    | □数     | 金額      |
|                   | 千口          | 千円    | 千口     | 千円      |
| ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド | 458         | 1,671 | 62,042 | 232,807 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年10月15日現在

| 項目                | 第263期末    |       |
|-------------------|-----------|-------|
|                   | 評価額       | 比率    |
|                   | 千円        | %     |
| ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド | 2,760,235 | 99.3  |
| コール・ローン等、その他      | 20,382    | 0.7   |
| 投資信託財産総額          | 2,780,617 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月15日における邦貨換算レートは、1オーストラリア・ドル=100.67円です。

(注3) ダイワ高格付豪ドル債マザーファンドにおいて、第263期末における外貨建純資産(6,037,133千円)の投資信託財産総額(6,049,006千円)に対する比率は、99.8%です。

■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

親投資信託残高

| 種類                | 第263期末  |         |           |
|-------------------|---------|---------|-----------|
|                   | □数      | □数      | 評価額       |
|                   | 千口      | 千口      | 千円        |
| ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド | 797,549 | 735,964 | 2,760,235 |

(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15日)、(2024年6月17日)、(2024年7月16日)、(2024年8月15日)、(2024年9月17日)、(2024年10月15日)現在

| 項目                     | 第258期末         | 第259期末         | 第260期末         | 第261期末         | 第262期末         | 第263期末         |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 資産                 | 2,989,132,034円 | 2,997,392,771円 | 3,034,502,491円 | 2,800,831,220円 | 2,745,936,159円 | 2,780,617,553円 |
| コール・ローン等               | 21,547,447     | 22,019,925     | 21,987,833     | 20,472,287     | 20,784,449     | 20,382,190     |
| ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド(評価額) | 2,964,024,399  | 2,975,372,846  | 3,012,032,314  | 2,780,241,803  | 2,723,318,188  | 2,760,235,363  |
| 未収入金                   | 3,560,188      | —              | 482,344        | 117,130        | 1,833,522      | —              |
| (B) 負債                 | 10,931,427     | 8,059,000      | 7,828,005      | 7,738,061      | 9,690,774      | 7,207,213      |
| 未払収益分配金                | 4,349,523      | 4,312,655      | 4,272,929      | 4,250,259      | 4,232,995      | 4,119,070      |
| 未払解約金                  | 3,264,646      | —              | 172,736        | 179,710        | 1,875,708      | —              |
| 未払信託報酬                 | 3,297,486      | 3,704,363      | 3,320,447      | 3,226,852      | 3,479,970      | 2,968,246      |
| その他未払費用                | 19,772         | 41,982         | 61,893         | 81,240         | 102,101        | 119,897        |
| (C) 純資産総額(A-B)         | 2,978,200,607  | 2,989,333,771  | 3,026,674,486  | 2,793,093,159  | 2,736,245,385  | 2,773,410,340  |
| 元本                     | 4,349,523,901  | 4,312,655,480  | 4,272,929,176  | 4,250,259,449  | 4,232,995,573  | 4,119,070,660  |
| 次期繰越損益金                | △1,371,323,294 | △1,323,321,709 | △1,246,254,690 | △1,457,166,290 | △1,496,750,188 | △1,345,660,320 |
| (D) 受益権総口数             | 4,349,523,901□ | 4,312,655,480□ | 4,272,929,176□ | 4,250,259,449□ | 4,232,995,573□ | 4,119,070,660□ |
| 1万口当り基準価額(C/D)         | 6,847円         | 6,932円         | 7,083円         | 6,572円         | 6,464円         | 6,733円         |

\* 当作成期首における元本額は4,393,695,619円、当作成期間(第258期～第263期)中における追加設定元本額は8,627,195円、同解約元本額は283,252,154円です。

\* 第263期末の計算口数当りの純資産額は6,733円です。

\* 第263期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,345,660,320円です。

## ダイワ高格付豪ドル債オープン（毎月分配型）

### ■損益の状況

第258期 自2024年4月16日 至2024年5月15日 第261期 自2024年7月17日 至2024年8月15日  
 第259期 自2024年5月16日 至2024年6月17日 第262期 自2024年8月16日 至2024年9月17日  
 第260期 自2024年6月18日 至2024年7月16日 第263期 自2024年9月18日 至2024年10月15日

| 項目               | 第 258 期          | 第 259 期          | 第 260 期          | 第 261 期          | 第 262 期          | 第 263 期          |
|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益        | 1,024円           | 1,184円           | 1,052円           | 1,967円           | 3,226円           | 2,665円           |
| 受取利息             | 1,024            | 1,184            | 1,052            | 1,967            | 3,226            | 2,665            |
| (B) 有価証券売買損益     | 122,743,892      | 44,415,688       | 72,488,699       | △ 210,025,621    | △ 37,772,203     | 117,906,934      |
| 売買益              | 123,145,106      | 44,526,930       | 73,102,675       | 1,099,442        | 199,091          | 121,631,219      |
| 売買損              | △ 401,214        | △ 111,242        | △ 613,976        | △ 211,125,063    | △ 37,971,294     | △ 3,724,285      |
| (C) 信託報酬等        | △ 3,317,258      | △ 3,726,573      | △ 3,340,358      | △ 3,246,199      | △ 3,500,831      | △ 2,986,042      |
| (D) 当期繰越益(A+B+C) | 119,427,658      | 40,690,299       | 69,149,393       | △ 213,269,853    | △ 41,269,808     | 114,923,557      |
| (E) 前期繰越損益金      | △ 525,039,132    | △ 406,356,304    | △ 366,454,829    | △ 299,884,786    | △ 515,105,568    | △ 545,336,000    |
| (F) 追加信託差損益金     | △ 961,362,297    | △ 953,343,049    | △ 944,676,325    | △ 939,761,392    | △ 936,141,817    | △ 911,128,807    |
| (配当等相当額)         | ( 103,883,802)   | ( 103,030,913)   | ( 102,110,166)   | ( 101,597,720)   | ( 101,221,028)   | ( 98,527,618)    |
| (売買損益相当額)        | (△1,065,246,099) | (△1,056,373,962) | (△1,046,786,491) | (△1,041,359,112) | (△1,037,362,845) | (△1,009,656,425) |
| (G) 合計(D+E+F)    | △1,366,973,771   | △1,319,009,054   | △1,241,981,761   | △1,452,916,031   | △1,492,517,193   | △1,341,541,250   |
| (H) 収益分配金        | △ 4,349,523      | △ 4,312,655      | △ 4,272,929      | △ 4,250,259      | △ 4,232,995      | △ 4,119,070      |
| 次期繰越損益金(G+H)     | △1,371,323,294   | △1,323,321,709   | △1,246,254,690   | △1,457,166,290   | △1,496,750,188   | △1,345,660,320   |
| 追加信託差損益金         | △ 961,362,297    | △ 953,343,049    | △ 944,676,325    | △ 939,761,392    | △ 936,141,817    | △ 911,128,807    |
| (配当等相当額)         | ( 103,883,802)   | ( 103,030,913)   | ( 102,110,166)   | ( 101,597,720)   | ( 101,221,028)   | ( 98,527,618)    |
| (売買損益相当額)        | (△1,065,246,099) | (△1,056,373,962) | (△1,046,786,491) | (△1,041,359,112) | (△1,037,362,845) | (△1,009,656,425) |
| 分配準備積立金          | 85,831,349       | 89,569,782       | 92,612,131       | 92,611,975       | 93,315,329       | 93,792,583       |
| 繰越損益金            | △ 495,792,346    | △ 459,548,442    | △ 394,190,496    | △ 610,016,873    | △ 653,923,700    | △ 528,324,096    |

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

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

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

### ■収益分配金の計算過程（総額）

| 項目                   | 第 258 期        | 第 259 期        | 第 260 期        | 第 261 期        | 第 262 期        | 第 263 期        |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益      | 8,697,338円     | 8,805,783円     | 8,168,377円     | 4,770,187円     | 5,347,914円     | 7,138,467円     |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 0              | 0              | 0              | 0              | 0              | 0              |
| (c) 収益調整金            | 103,883,802    | 103,030,913    | 102,110,166    | 101,597,720    | 101,221,028    | 98,527,618     |
| (d) 分配準備積立金          | 81,483,534     | 85,076,654     | 88,716,683     | 92,092,047     | 92,200,410     | 90,773,186     |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 194,064,674    | 196,913,350    | 198,995,226    | 198,459,954    | 198,769,352    | 196,439,271    |
| (f) 分配金              | 4,349,523      | 4,312,655      | 4,272,929      | 4,250,259      | 4,232,995      | 4,119,070      |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e-f)   | 189,715,151    | 192,600,695    | 194,722,297    | 194,209,695    | 194,536,357    | 192,320,201    |
| (h) 受益権総口数           | 4,349,523,901□ | 4,312,655,480□ | 4,272,929,176□ | 4,250,259,449□ | 4,232,995,573□ | 4,119,070,660□ |

| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ |         |         |         |         |         |         |
|---------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
|                     | 第 258 期 | 第 259 期 | 第 260 期 | 第 261 期 | 第 262 期 | 第 263 期 |
| 1万口当り分配金（税込み）       | 10円     | 10円     | 10円     | 10円     | 10円     | 10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。

# ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

## 運用報告書 第44期 (決算日 2024年10月15日)

(作成対象期間 2024年4月16日～2024年10月15日)

ダイワ高格付豪ドル債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。

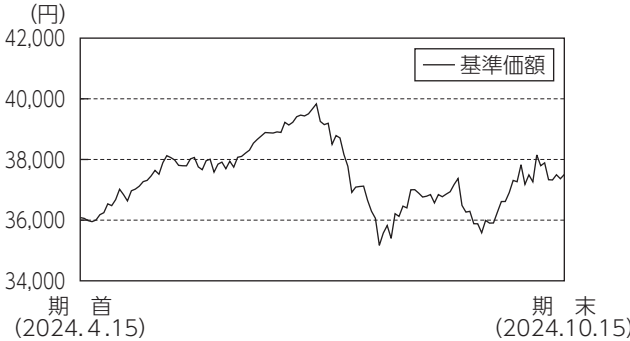
|        |  |
|--------|--|
| 運用方針   | 安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。   |
| 主要投資対象 | 内外の公社債、ABS（アセットバック証券：各種の債権や商業用不動産などの資産を裏付けとして発行された証券）、MBS（モーゲージ担保证券：不動産担保融資の債権を裏付けとして発行された証券）および短期金融商品 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下  |

## 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 |     | FTSEオーストラリア<br>国債インデックス<br>(円換算) |     | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|-----------------|---------|-----|----------------------------------|-----|---------------|-------------|
|                 | 円       | 騰落率 | 参考指数                             | 騰落率 |               |             |
| (期首)2024年 4月15日 | 36,084  | %   | 34,805                           | %   | 98.1          | %           |
| 4 月末            | 37,019  | 2.6 | 35,622                           | 2.3 | 96.8          | -           |
| 5 月末            | 37,663  | 4.4 | 36,205                           | 4.0 | 97.0          | -           |
| 6 月末            | 38,891  | 7.8 | 37,388                           | 7.4 | 98.1          | -           |
| 7 月末            | 36,658  | 1.6 | 35,238                           | 1.2 | 97.1          | -           |
| 8 月末            | 36,937  | 2.4 | 35,695                           | 2.6 | 97.4          | -           |
| 9 月末            | 37,180  | 3.0 | 35,877                           | 3.1 | 98.0          | -           |
| (期末)2024年10月15日 | 37,505  | 3.9 | 36,020                           | 3.5 | 97.9          | -           |

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) FTSEオーストラリア国債インデックス(豪ドルベース)は、FTSEオーストラリア国債インデックス(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。FTSEオーストラリア国債インデックス(豪ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。  
 (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) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。  
 (注6) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

《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：36,084円 期末：37,505円 騰落率：3.9%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や豪ドルが円に対して上昇(円安)したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○オーストラリア債券市況

オーストラリア債券市場では、金利はおおむね横ばいとなりました。

当作成期首より、RBA(オーストラリア準備銀行)が政策金利の据え置きを継続する中、オーストラリアの経済指標が強弱入り交

じる結果となったことなどを受け、金利は方向感のない動きが継続しました。2024年7月末から9月にかけては、米国の失業率が市場予想を上回ったことやオーストラリアのCPI(消費者物価指数)が市場予想を下回ったことなどから、金利は低下(債券価格は上昇)しました。当作成期末にかけては、米国の雇用統計が市場予想に反して堅調な結果となったことなどを背景に、金利は上昇(債券価格は下落)しました。

○為替相場

豪ドルは対円で上昇しました。

豪ドルの対円為替相場は、当作成期首より、オーストラリアのCPI(消費者物価指数)が市場予想を上回ったことや、緩和的な政策を継続する日銀の姿勢などが材料となり、豪ドルは円に対して上昇しました。2024年7月から9月は、政府・日銀が為替介入を実施したとの観測が浮上したことや日銀の利上げ観測が高まったことなどから、円高豪ドル安が進行しました。当作成期末にかけては、米国の雇用統計が堅調な結果となったことなどを背景にリスク選好が強まり、豪ドルは円に対して上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

豪ドル建ての公社債等に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。ファンドの運用につきましては、金融政策と経済ファンダメンタルズの分析や金融市場の動向などを踏まえ、金利変動リスクを表す修正デュレーションを3(年)程度から5(年)程度の範囲内で変動させるとともに、債券の種別構成や年限構成を決定します。為替については、豪ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

◆ポートフォリオについて

豪ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

ポートフォリオの修正デュレーションは、3(年)程度から5(年)程度の範囲内で運用しました。

債券種別構成に関しては、非国債の組入比率を高めに保ちました。

為替に関しては、実質外貨比率を高位に保ちました。

◆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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

豪ドル建ての公社債等に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。ファンドの運用につきましては、金融政策と経済ファンダメンタルズの分析や金融市場の動向などを踏まえ、金利変動リスクを表す修正デュレーションを3(年)程度から5(年)程度の範囲内で変動させるとともに、債券の種別構成や年限構成を決定します。為替については、豪ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

■ 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   | 5   |
| (保管費用)  | (5) |
| (その他)   | (0) |
| 合計      | 5   |

(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

公社債

(2024年4月16日から2024年10月15日まで)

|        |         | 買付額                   | 売付額                            |
|--------|---------|-----------------------|--------------------------------|
| 外<br>国 | オーストラリア | 千オーストラリア・ドル           | 千オーストラリア・ドル                    |
|        |         | 国債証券                  | 14,472<br>( 18,201<br>( - )    |
|        |         | 特殊債券                  | 17,479<br>( 15,408<br>( 4,000) |
|        | 社債券     | 1,000<br>( -<br>( - ) |                                |

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券（転換社債券）は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

公社債

(2024年4月16日から2024年10月15日まで)

| 当                                    |                  |         | 期   |                  |         |
|--------------------------------------|------------------|---------|---|------------------|---------|
| 買                                    | 付                |         | 売   | 付                |         |
| 銘柄                                   | 柄                | 金額      | 銘柄  | 柄                | 金額      |
|                                      |                  | 千円      |   |                  | 千円      |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア) | 3.25% 2025/4/21  | 765,405 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)        | 3.25% 2025/4/21  | 592,375 |
| QUEENSLAND TREASURY CORP. (オーストラリア)  | 4.75% 2025/7/21  | 406,826 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)        | 2.75% 2029/11/21 | 587,115 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア) | 2.75% 2029/11/21 | 371,351 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)        | 4.75% 2027/4/21  | 511,040 |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア) | 1.75% 2032/11/21 | 343,931 | QUEENSLAND TREASURY CORP. (オーストラリア)         | 4.75% 2025/7/21  | 398,672 |
| QUEENSLAND TREASURY CORP. (オーストラリア)  | 2% 2033/8/22     | 323,344 | South Australia GOV.FIN.AUTH. (オーストラリア)     | 3% 2028/5/24     | 346,994 |
| INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT (国際機関)   | 4.25% 2025/6/24  | 295,130 | TREASURY CORP VICTORIA (オーストラリア)            | 3% 2028/10/20    | 344,540 |
| TREASURY CORP VICTORIA (オーストラリア)     | 1.5% 2031/9/10   | 291,388 | NEW SOUTH WALES TREASURY CORP. (オーストラリア)    | 3% 2030/2/20     | 278,411 |
| QUEENSLAND TREASURY CORP. (オーストラリア)  | 1.25% 2031/3/10  | 251,246 | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)        | 1.75% 2032/11/21 | 167,269 |
| INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT (国際機関)   | 4.3% 2029/1/10   | 196,298 | NEW SOUTH WALES TREASURY CORP. (オーストラリア)    | 3% 2029/4/20     | 100,848 |
| BANK OF MONTREAL (カナダ)               | 5.338% 2029/6/27 | 107,000 | WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP. (オーストラリア) | 3% 2026/10/21    | 100,224 |

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。



■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

| 区 分     | 作 成 期                 | 当 期                   |                 | 末         |                          |                   |           |          |
|---------|-----------------------|-----------------------|-----------------|-----------|--------------------------|-------------------|-----------|----------|
|         |                       | 評 価 額                 |                 | 組 入 比 率   | う ち B B 格<br>以 下 組 入 比 率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 |           |          |
|         |                       | 外 貨 建 金 額             | 邦 貨 換 算 金 額     |           |                          | 5 年 以 上           | 2 年 以 上   | 2 年 未 満  |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>63,323 | 千オーストラリア・ドル<br>58,829 | 千円<br>5,922,316 | %<br>97.9 | %<br>-                   | %<br>46.1         | %<br>44.4 | %<br>7.5 |

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

| 区 分     | 銘 柄                            | 種 類       | 年 利 率  | 額 面 金 額 | 評 価 額       |             | 償 還 年 月 日  |
|---------|--------------------------------|-----------|--------|---------|-------------|-------------|------------|
|         |                                |           |        |         | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
|         |                                |           |        |         | 千オーストラリア・ドル | 千円          |            |
| オーストラリア | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND     | 国 債 証 券   | 3.2500 | 1,500   | 1,492       | 150,225     | 2025/04/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND     | 国 債 証 券   | 2.7500 | 4,000   | 3,789       | 381,486     | 2029/11/21 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND     | 国 債 証 券   | 1.7500 | 2,000   | 1,668       | 167,933     | 2032/11/21 |
|         | NZ LOCAL GOVT FUND AGENC       | 地 方 債 証 券 | 4.7000 | 1,500   | 1,512       | 152,312     | 2028/08/01 |
|         | NZ LOCAL GOVT FUND AGENC       | 地 方 債 証 券 | 5.0000 | 616     | 612         | 61,688      | 2034/03/08 |
|         | Province of Alberta Canada     | 地 方 債 証 券 | 2.4000 | 500     | 430         | 43,365      | 2030/10/02 |
|         | AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY   | 地 方 債 証 券 | 3.0000 | 2,000   | 1,921       | 193,447     | 2028/04/18 |
|         | EXPORT DEVELOPMENT CANADA      | 特 殊 債 券   | 4.5000 | 833     | 839         | 84,516      | 2028/09/06 |
|         | SWEDISH EXPORT CREDIT          | 特 殊 債 券   | 4.3000 | 1,064   | 1,057       | 106,445     | 2028/05/30 |
|         | SWEDISH EXPORT CREDIT          | 特 殊 債 券   | 5.4000 | 1,000   | 1,033       | 104,069     | 2030/11/01 |
|         | AIRSERVICES AUSTRALIA          | 特 殊 債 券   | 5.4000 | 2,000   | 2,052       | 206,639     | 2028/11/15 |
|         | NEW SOUTH WALES TREASURY CORP. | 特 殊 債 券   | 3.0000 | 6,000   | 5,610       | 564,831     | 2030/02/20 |
|         | TREASURY CORP VICTORIA         | 特 殊 債 券   | 1.5000 | 8,300   | 6,746       | 679,185     | 2031/09/10 |
|         | QUEENSLAND TREASURY CORP.      | 特 殊 債 券   | 1.2500 | 3,000   | 2,452       | 246,914     | 2031/03/10 |
|         | QUEENSLAND TREASURY CORP.      | 特 殊 債 券   | 1.5000 | 2,000   | 1,600       | 161,110     | 2032/03/02 |
|         | QUEENSLAND TREASURY CORP.      | 特 殊 債 券   | 2.0000 | 4,000   | 3,166       | 318,753     | 2033/08/22 |
|         | INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT    | 特 殊 債 券   | 4.2500 | 3,000   | 2,996       | 301,683     | 2025/06/24 |
|         | INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT    | 特 殊 債 券   | 4.3000 | 2,000   | 2,001       | 201,482     | 2029/01/10 |
|         | INTL. FIN. CORP.               | 特 殊 債 券   | 3.1500 | 500     | 475         | 47,859      | 2029/06/26 |
|         | EUROPEAN INVESTMENT BANK       | 特 殊 債 券   | 1.8000 | 500     | 474         | 47,771      | 2027/01/19 |
|         | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 社 債 券     | 5.4000 | 1,600   | 1,646       | 165,743     | 2028/11/16 |
|         | COOPERATIEVE RABOBANK UA       | 社 債 券     | 5.7080 | 2,000   | 2,067       | 208,133     | 2028/11/21 |
|         | TORONTO-DOMINION BANK/THE      | 社 債 券     | 4.9500 | 2,000   | 2,024       | 203,764     | 2028/09/15 |
|         | BNP PARIBAS SA                 | 社 債 券     | 5.2880 | 1,860   | 1,868       | 188,092     | 2029/02/15 |
|         | CREDIT AGRICOLE SA             | 社 債 券     | 5.4110 | 2,190   | 2,226       | 224,182     | 2029/01/18 |
|         | UNIVERSITY OF TASMANIA         | 社 債 券     | 3.9700 | 630     | 574         | 57,870      | 2032/03/24 |
|         | MONASH UNIVERSITY              | 社 債 券     | 4.0500 | 840     | 809         | 81,519      | 2029/04/06 |
|         | BANK OF MONTREAL               | 社 債 券     | 5.3380 | 1,000   | 1,010       | 101,682     | 2029/06/27 |
|         | Macquarie University           | 社 債 券     | 3.5000 | 1,000   | 949         | 95,573      | 2028/09/07 |
|         | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 社 債 券     | 2.4000 | 2,290   | 2,188       | 220,273     | 2027/01/14 |
|         | WESTPAC BANKING CORP           | 社 債 券     | 2.4000 | 1,600   | 1,527       | 153,759     | 2027/01/25 |
| 合 計     | 銘 柄 数<br>金 額                   | 31銘柄      |        | 63,323  | 58,829      | 5,922,316   |            |

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2024年10月15日現在

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 公社債          | 5,922,316 | 97.9  |
| コール・ローン等、その他 | 126,690   | 2.1   |
| 投資信託財産総額     | 6,049,006 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月15日における邦貨換算レートは、1オーストラリア・ドル=100.67円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(6,037,133千円)の投資信託財産総額(6,049,006千円)に対する比率は、99.8%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年10月15日現在

| 項 目                   | 当 期 末                 |
|-----------------------|-----------------------|
| <b>(A) 資産</b>         | <b>6,049,006,890円</b> |
| コール・ローン等              | 55,524,973            |
| 公社債(評価額)              | 5,922,316,703         |
| 未取利息                  | 47,944,708            |
| 前払費用                  | 5,268,564             |
| 差入委託証拠金               | 17,951,942            |
| <b>(B) 負債</b>         | <b>-</b>              |
| <b>(C) 純資産総額(A-B)</b> | <b>6,049,006,890</b>  |
| 元本                    | 1,612,845,222         |
| 次期繰越損益金               | 4,436,161,668         |
| <b>(D) 受益権総口数</b>     | <b>1,612,845,222口</b> |
| 1万口当り基準価額(C/D)        | 37,505円               |

\* 期首における元本額は1,767,243,496円、当作成期間中における追加設定元本額は2,525,217円、同解約元本額は156,923,491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：  
 ダイワ世界債券ファンドM(FOFs用) (適格機関投資家専用) 84,317,368円  
 ダイワ世界債券ファンドVA (適格機関投資家専用) 3,776,430円  
 ダイワ世界債券ファンド (毎月分配型) 786,368,126円  
 ダイワ世界債券ファンド (年2回決算型) 2,418,663円  
 ダイワ高格付豪ドル債オープン (毎月分配型) 735,964,635円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は37,505円です。

## ■損益の状況

当期 自2024年4月16日 至2024年10月15日

| 項 目                     | 当 期                  |
|-------------------------|----------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>        | <b>112,349,438円</b>  |
| 受取利息                    | 112,044,100          |
| その他収益金                  | 305,338              |
| <b>(B) 有価証券売買損益</b>     | <b>141,470,843</b>   |
| 売買益                     | 157,634,237          |
| 売買損                     | △ 16,163,394         |
| <b>(C) その他費用</b>        | <b>△ 826,708</b>     |
| <b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b> | <b>252,993,573</b>   |
| <b>(E) 前期繰越損益金</b>      | <b>4,609,603,797</b> |
| <b>(F) 解約差損益金</b>       | <b>△ 433,221,171</b> |
| <b>(G) 追加信託差損益金</b>     | <b>6,785,469</b>     |
| <b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>  | <b>4,436,161,668</b> |
| 次期繰越損益金(H)              | 4,436,161,668        |

(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。