

US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

運用報告書(全体版)

第108期 (決算日 2022年2月7日)
第109期 (決算日 2022年3月7日)
第110期 (決算日 2022年4月5日)
第111期 (決算日 2022年5月6日)
第112期 (決算日 2022年6月6日)
第113期 (決算日 2022年7月5日)

(作成対象期間 2022年1月6日～2022年7月5日)

■信託期間を5年6カ月間延長し、信託期間終了日を
2023年1月5日から2028年7月5日に変更しました。

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、米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしております。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	2013年2月4日～2028年7月5日	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	当ファンド	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ/プリンシパル・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円ヘッジクラス)」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	円建ての債券
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、当初設定から1年以内に分配を開始し、分配開始後は、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に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。	

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			公社債組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期騰 落率			
84期末(2020年2月5日)	7,806	5	△ 0.6	—	99.8	635
85期末(2020年3月5日)	7,721	5	△ 1.0	—	99.2	628
86期末(2020年4月6日)	6,855	5	△ 11.2	—	99.7	555
87期末(2020年5月7日)	7,141	5	4.2	—	99.0	579
88期末(2020年6月5日)	7,429	5	4.1	—	99.2	602
89期末(2020年7月6日)	7,374	5	△ 0.7	—	99.5	597
90期末(2020年8月5日)	7,520	5	2.0	—	99.7	609
91期末(2020年9月7日)	7,531	5	0.2	—	98.0	610
92期末(2020年10月5日)	7,484	5	△ 0.6	—	98.2	606
93期末(2020年11月5日)	7,559	5	1.1	—	98.3	612
94期末(2020年12月7日)	7,656	5	1.3	—	98.5	620
95期末(2021年1月5日)	7,669	5	0.2	—	98.8	620
96期末(2021年2月5日)	7,718	5	0.7	—	99.0	624
97期末(2021年3月5日)	7,721	5	0.1	—	99.1	624
98期末(2021年4月5日)	7,760	5	0.6	—	99.4	627
99期末(2021年5月6日)	7,784	5	0.4	—	99.7	628
100期末(2021年6月7日)	7,786	5	0.1	—	98.0	628
101期末(2021年7月5日)	7,835	5	0.7	—	98.2	632
102期末(2021年8月5日)	7,795	5	△ 0.4	—	98.3	629
103期末(2021年9月6日)	7,806	5	0.2	—	98.5	630
104期末(2021年10月5日)	7,781	5	△ 0.3	—	98.7	628
105期末(2021年11月5日)	7,770	5	△ 0.1	—	98.8	627
106期末(2021年12月6日)	7,701	5	△ 0.8	—	99.0	621
107期末(2022年1月5日)	7,737	5	0.5	—	99.2	624
108期末(2022年2月7日)	7,614	5	△ 1.5	—	99.3	614
109期末(2022年3月7日)	7,589	5	△ 0.3	—	99.5	612
110期末(2022年4月5日)	7,559	5	△ 0.3	—	99.7	609
111期末(2022年5月6日)	7,373	5	△ 2.4	—	98.0	594
112期末(2022年6月6日)	7,360	5	△ 0.1	—	98.2	593
113期末(2022年7月5日)	7,001	5	△ 4.8	—	98.2	564

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

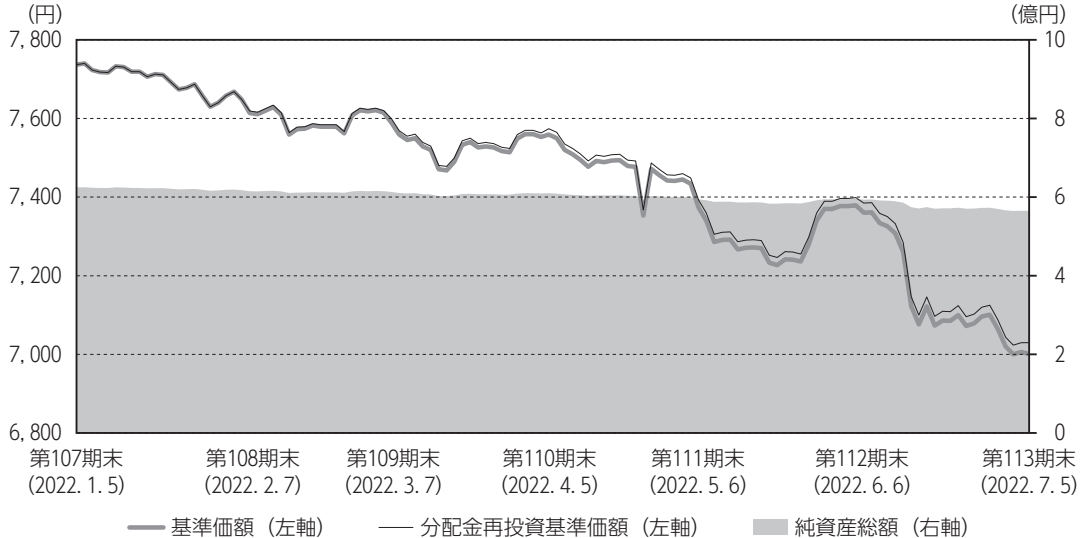
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)および債券先物を除きます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

基準価額・騰落率

第108期首：7,737円

第113期末：7,001円 (既払分配金30円)

騰落率：△9.1% (分配金再投資ベース)

基準価額の主な変動要因

US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・債券・ファンド(円ヘッジクラス)を通じて、米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、米ドル建ての資産に対して米ドル売り/日本円買いの為替ヘッジを行った結果、投資している短期ハイ・イールド社債が下落したことなどから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・債券・ファンド(円ヘッジクラス)：
 ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ/プリンシパル・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・債券・ファンド(円ヘッジクラス)

US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

	年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率			
			円	%	%	%
第108期	(期首)2022年 1月 5日	7,737	—	—	99.2	
	1月末	7,630	△ 1.4	—	99.2	
	(期末)2022年 2月 7日	7,619	△ 1.5	—	99.3	
第109期	(期首)2022年 2月 7日	7,614	—	—	99.3	
	2月末	7,608	△ 0.1	—	99.4	
	(期末)2022年 3月 7日	7,594	△ 0.3	—	99.5	
第110期	(期首)2022年 3月 7日	7,589	—	—	99.5	
	3月末	7,560	△ 0.4	—	99.7	
	(期末)2022年 4月 5日	7,564	△ 0.3	—	99.7	
第111期	(期首)2022年 4月 5日	7,559	—	—	99.7	
	4月末	7,445	△ 1.5	—	97.9	
	(期末)2022年 5月 6日	7,378	△ 2.4	—	98.0	
第112期	(期首)2022年 5月 6日	7,373	—	—	98.0	
	5月末	7,370	△ 0.0	—	98.1	
	(期末)2022年 6月 6日	7,365	△ 0.1	—	98.2	
第113期	(期首)2022年 6月 6日	7,360	—	—	98.2	
	6月末	7,020	△ 4.6	—	98.2	
	(期末)2022年 7月 5日	7,006	△ 4.8	—	98.2	

(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

（2022. 1. 6 ～ 2022. 7. 5）

■ 米国ハイ・イールド社債市況

米国ハイ・イールド社債市況は下落しました。

当作成期首から、地政学的リスクが高まる中でインフレ高の抑制を優先して F R B（米国連邦準備制度理事会）がタカ派的姿勢を加速させたことから、景気減速への懸念が広がりハイ・イールド市場は軟調に推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■ 当ファンド

US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に保つことによって、米国の短期ハイ・イールド社債等（※）に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

■ US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）

米国の短期ハイ・イールド社債等（※）に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

※短期ハイ・イールド社債およびバンクローン（貸付債権）をいいます。

ポートフォリオについて

（2022. 1. 6 ～ 2022. 7. 5）

■当ファンド

当ファンドは、US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じてUS・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に維持しました。

■US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）

米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行いました。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

■ダイワ・マネーストック・マザーファンド

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。

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108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	2022年1月6日 ～2022年2月7日	2022年2月8日 ～2022年3月7日	2022年3月8日 ～2022年4月5日	2022年4月6日 ～2022年5月6日	2022年5月7日 ～2022年6月6日	2022年6月7日 ～2022年7月5日
当期分配金(税込み) (円)	5	5	5	5	5	5
対基準価額比率 (%)	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07	0.07
当期の収益 (円)	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	367	375	388	403	416	433

(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108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 9.75円	✓ 13.15円	✓ 18.09円	✓ 19.77円	✓ 18.53円	✓ 22.27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	66.25	66.25	66.25	66.25	66.25	66.25
(d) 分配準備積立金	296.11	300.86	309.02	322.12	336.90	350.43
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	372.12	380.27	393.37	408.15	421.68	438.95
(f) 分配金	5.00	5.00	5.00	5.00	5.00	5.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	367.12	375.27	388.37	403.15	416.68	433.95

(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

US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に保つことによって、米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

■US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）

米国の短期ハイ・イールド社債等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	第108期～第113期 (2022. 1. 6～2022. 7. 5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0.588%	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7,452円です。
(投 信 会 社)	(16)	(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)	(26)	(0.354)	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	0	0.004	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
(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
合 計	44	0.592	

(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。

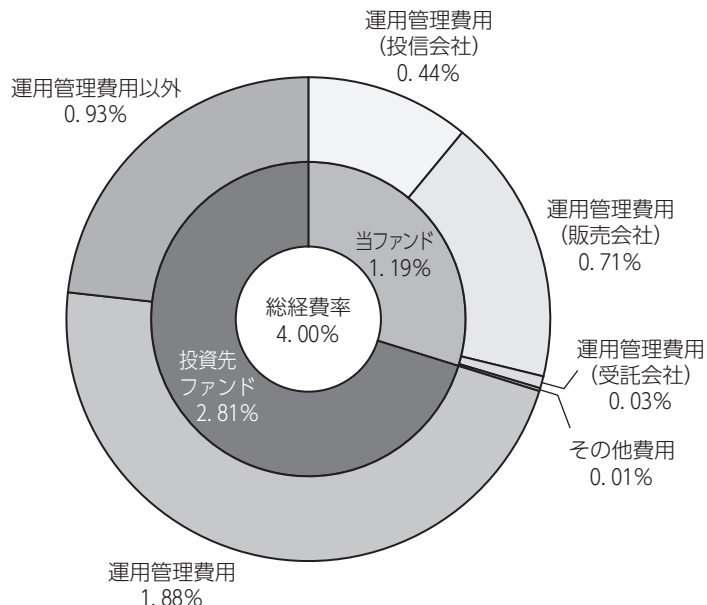
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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4.00%です。



総経費率 (① + ② + ③)	4.00%
①当ファンドの費用の比率	1.19%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	1.88%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.93%

(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
投資信託受益証券

(2022年1月6日から2022年7月5日まで)

決算期	第 108 期 ~ 第 113 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 (邦貨建)	千口 162,11578	千円 11,769	千口 154,72034	千円 11,300

(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。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2022年1月6日から2022年7月5日まで)

第 108 期 ~				第 113 期			
買 付		売 付		買 付		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
				US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	154,72034	11,300	73

(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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円 800	百万円 —	百万円 —	百万円 800	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 113 期 末		
	□ 数	評価額	比 率
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) US SHORT DURATION HIGH YIELD BOND FUND JPY HEDGED CLASS	千口 8,117,04284	千円 554,864	% 98.2

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第107期末	第 113 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	102	102	102

(注) 単位未満は切捨て。

US 短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

■投資信託財産の構成

2022年7月5日現在

項 目	第 113 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	554,864	98.1
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	102	0.0
コール・ローン等、その他	10,779	1.9
投資信託財産総額	565,746	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2月7日)、(2022年3月7日)、(2022年4月5日)、(2022年5月6日)、(2022年6月6日)、(2022年7月5日)現在

項 目	第108期末	第109期末	第110期末	第111期末	第112期末	第113期末
(A) 資産	616,008,220円	613,908,269円	610,808,944円	595,806,898円	594,759,950円	565,746,711円
コール・ローン等	5,173,335	4,101,920	2,466,685	12,789,626	11,777,802	10,779,402
投資信託受益証券 (評価額)	610,732,390	609,703,854	608,239,764	582,914,777	582,879,653	554,864,814
ダイワ・マネーストック・マザーファンド (評価額)	102,495	102,495	102,495	102,495	102,495	102,495
(B) 負債	1,075,985	971,502	989,520	1,028,308	1,018,867	971,350
未払収益分配金	403,813	403,813	403,368	403,368	403,368	403,368
未払信託報酬	667,556	559,199	573,691	608,273	594,721	543,444
その他未払費用	4,616	8,490	12,461	16,667	20,778	24,538
(C) 純資産総額 (A - B)	614,932,235	612,936,767	609,819,424	594,778,590	593,741,083	564,775,361
元本	807,627,850	807,627,850	806,737,497	806,737,497	806,737,497	806,737,497
次期繰越損益金	△ 192,695,615	△ 194,691,083	△ 196,918,073	△ 211,958,907	△ 212,996,414	△ 241,962,136
(D) 受益権総口数	807,627,850口	807,627,850口	806,737,497口	806,737,497口	806,737,497口	806,737,497口
1万口当り基準価額 (C/D)	7,614円	7,589円	7,559円	7,373円	7,360円	7,001円

* 当作成期首における元本額は807,627,850円、当作成期間 (第108期~第113期) 中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は890,353円です。

* 第113期末の計算口数当りの純資産額は7,001円です。

* 第113期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は241,962,136円です。

■損益の状況

第108期 自 2022年1月6日 至 2022年2月7日 第110期 自 2022年3月8日 至 2022年4月5日 第112期 自 2022年5月7日 至 2022年6月6日
 第109期 自 2022年2月8日 至 2022年3月7日 第111期 自 2022年4月6日 至 2022年5月6日 第113期 自 2022年6月7日 至 2022年7月5日

項目	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
(A) 配当等収益	1,459,647円	1,625,734円	2,037,664円	2,208,123円	2,093,765円	2,343,817円
受取配当金	1,459,737	1,625,780	2,037,671	2,208,123	2,093,948	2,344,128
支払利息	△ 90	△ 46	△ 7	—	△ 183	△ 311
(B) 有価証券売買損益	△ 10,320,637	△ 2,654,316	△ 3,498,268	△ 16,233,110	△ 2,129,072	△ 30,358,967
売買益	—	—	3,469	1	—	—
売買損	△ 10,320,637	△ 2,654,316	△ 3,501,737	△ 16,233,111	△ 2,129,072	△ 30,358,967
(C) 信託報酬等	△ 672,172	△ 563,073	△ 577,662	△ 612,479	△ 598,832	△ 547,204
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 9,533,162	△ 1,591,655	△ 2,038,266	△ 14,637,466	△ 634,139	△ 28,562,354
(E) 前期繰越損益金	△ 186,098,880	△ 196,035,855	△ 197,812,997	△ 200,254,631	△ 215,295,465	△ 216,332,972
(F) 追加信託差損益金	3,340,240	3,340,240	3,336,558	3,336,558	3,336,558	3,336,558
(配当等相当額)	(5,350,797)	(5,350,797)	(5,344,898)	(5,344,898)	(5,344,898)	(5,344,898)
(売買損益相当額)	(△ 2,010,557)	(△ 2,010,557)	(△ 2,008,340)	(△ 2,008,340)	(△ 2,008,340)	(△ 2,008,340)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 192,291,802	△ 194,287,270	△ 196,514,705	△ 211,555,539	△ 212,593,046	△ 241,558,768
(H) 収益分配金	△ 403,813	△ 403,813	△ 403,368	△ 403,368	△ 403,368	△ 403,368
次期繰越損益金 (G + H)	△ 192,695,615	△ 194,691,083	△ 196,918,073	△ 211,958,907	△ 212,996,414	△ 241,962,136
追加信託差損益金	3,340,240	3,340,240	3,336,558	3,336,558	3,336,558	3,336,558
(配当等相当額)	(5,350,797)	(5,350,797)	(5,344,898)	(5,344,898)	(5,344,898)	(5,344,898)
(売買損益相当額)	(△ 2,010,557)	(△ 2,010,557)	(△ 2,008,340)	(△ 2,008,340)	(△ 2,008,340)	(△ 2,008,340)
分配準備積立金	24,298,980	24,957,828	25,986,947	27,179,223	28,270,788	29,664,032
繰越損益金	△ 220,334,835	△ 222,989,151	△ 226,241,578	△ 242,474,688	△ 244,603,760	△ 274,962,726

(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108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
(a) 経費控除後の配当等収益	787,475円	1,062,661円	1,460,002円	1,595,644円	1,494,933円	1,796,612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	5,350,797	5,350,797	5,344,898	5,344,898	5,344,898	5,344,898
(d) 分配準備積立金	23,915,318	24,298,980	24,930,313	25,986,947	27,179,223	28,270,788
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	30,053,590	30,712,438	31,735,213	32,927,489	34,019,054	35,412,298
(f) 分配金	403,813	403,813	403,368	403,368	403,368	403,368
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	29,649,777	30,308,625	31,331,845	32,524,121	33,615,686	35,008,930
(h) 受益権総口数	807,627,850□	807,627,850□	806,737,497□	806,737,497□	806,737,497□	806,737,497□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金（税込み）	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	5 円	5 円	5 円	5 円	5 円	5 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。

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間を 5 年 6 カ月間延長し、信託期間終了日を2023年 1 月 5 日から2028年 7 月 5 日に変更しました。

ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ／プリンシパル・
US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）

当ファンド（US 短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型））は、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ／プリンシパル・US・ショート・デュレーション・ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円ヘッジクラス）」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。（注）2022年7月5日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（米ドル建て）

貸借対照表
2021年6月30日

資産		
投資資産の評価額（簿価 \$6,289,211）	\$	6,360,961
未収：		
利息		76,353
資産合計		<u>6,437,314</u>
負債		
外国為替先渡取引による評価損		51,243
未払：		
専門家報酬		53,526
会計および管理会社報酬		7,594
保管会社報酬		4,031
受託会社報酬		3,063
運用会社報酬		2,414
登録料		1,582
名義書換代理人報酬		507
負債合計		<u>123,960</u>
純資産	\$	<u>6,313,354</u>
純資産		
円ヘッジクラス	\$	5,593,569
円ヘッジ／N1クラス		719,785
	\$	<u>6,313,354</u>
発行済み受益証券		
円ヘッジクラス		8,000,634
円ヘッジ／N1クラス		785,170
受益証券1口当り純資産額		
円ヘッジクラス	\$	0.699
円ヘッジ／N1クラス	\$	0.917

損益計算書

2021年6月30日に終了する会計年度

投資収益		
受取利息	\$	330,267
投資収益合計		<u>330,267</u>
費用		
専門家報酬		53,304
会計および管理会社報酬		45,001
保管会社報酬		31,445
運用会社報酬		30,122
受託会社報酬		15,614
登録料		5,947
名義書換代理人報酬		3,726
費用合計		<u>185,159</u>
投資利益		<u>145,108</u>
実現損益および評価損益：		
実現損益：		
証券投資		78,579
外国為替取引および外国為替先渡取引		(189,155)
実現損		<u>(110,576)</u>
評価損益の変動：		
証券投資		349,496
外国為替換算および外国為替先渡取引		(20,225)
評価損益の変動		<u>329,271</u>
純実現損益および評価損益の変動		<u>218,695</u>
運用による純資産の純増	\$	<u><u>363,803</u></u>

US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

投資明細表
2021年6月30日

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
		債券 (96.9%)		
		カナダ (3.2%)		
		社債 (3.2%)		
		First Quantum Minerals Ltd.		
USD	200,000	7.25% due 04/01/23 (a), (b)	\$	203,876
		社債合計		203,876
		カナダ合計 (簿価 \$201,774)		203,876
		多国籍企業 (3.2%)		
		社債 (3.2%)		
		CANPACK S. A. / Eastern PA Land Investment Holding LLC		
USD	200,000	3.13% due 11/01/25 (a), (b)		203,500
		社債合計		203,500
		多国籍企業合計 (簿価 \$202,848)		203,500
		アラブ首長国連邦 (0.6%)		
		社債 (0.6%)		
		Shelf Drilling Holdings Ltd.		
USD	35,000	8.88% due 11/15/24 (a), (b)		36,138
		社債合計		36,138
		アラブ首長国連邦合計 (簿価 \$34,364)		36,138
		米国 (89.9%)		
		バンクローン* (13.3%)		
		Ascent Resources Utica Holdings LLC / Aru Finance Corp		
USD	25,000	10.00% due 11/01/25		27,688
		BellRing Brands, LLC		
USD	149,394	4.75% due 10/21/24		150,785
		CCM Merger, Inc.		
USD	117,327	4.50% due 11/04/25		117,584
		Golden Nugget, Inc.		
USD	108,016	3.25% due 10/04/23		107,352
		IRB Holding Corp.		
USD	134,325	4.25% due 12/15/27		134,483
		LifePoint Health, Inc.		
USD	96,573	3.85% due 11/16/25		96,462
		Navistar, Inc.		
USD	68,931	3.60% due 11/06/24		69,069
		Russell Investments US Institutional Holdco, Inc.		
USD	133,940	4.50% due 05/30/25		133,375
		バンクローン合計		836,798
		社債 (76.6%)		
		Acrisure LLC / Acrisure Finance, Inc.		
USD	30,000	7.00% due 11/15/25 (a), (b)		30,600
		Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp.		
USD	120,000	8.25% due 02/15/26 (a), (b)		129,924
		Albertsons Cos, Inc. / Safeway, Inc. / New Albertsons LP / Albertsons LLC		
USD	125,000	4.63% due 01/15/27 (a), (b)		130,713
		AMC Networks, Inc.		
USD	30,000	4.75% due 08/01/25 (a)		30,801

US 短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
USD	65,000	Antero Resources Corp. 5.00% due 03/01/25 (a)		66,526
USD	35,000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp. 7.00% due 11/01/26 (a), (b)		36,617
USD	30,000	Bausch Health Americas, Inc. 8.50% due 01/31/27 (a), (b)		32,607
USD	110,000	Beazer Homes USA, Inc. 6.75% due 03/15/25 (a)		113,575
USD	190,000	Caesars Entertainment, Inc. 6.25% due 07/01/25 (a), (b)		201,486
USD	205,000	Centene Corp. 4.25% due 12/15/27 (a)		216,018
USD	55,000	CHS/Community Health Systems, Inc. 8.00% due 03/15/26 (a), (b)		59,263
USD	75,000	8.00% due 12/15/27 (a), (b) CommScope, Inc.		83,441
USD	125,000	8.25% due 03/01/27 (a), (b) Credit Acceptance Corp.		133,600
USD	30,000	5.13% due 12/31/24 (a), (b)		31,088
USD	50,000	6.63% due 03/15/26 (a) CrownRock LP / CrownRock Finance, Inc.		52,625
USD	95,000	5.63% due 10/15/25 (a), (b) CSC Holdings LLC		98,325
USD	95,000	6.75% due 11/15/21 Devon Energy Corp.		96,872
USD	65,000	5.25% due 09/15/24 (a), (b) DISH DBS Corp.		72,444
USD	85,000	5.88% due 11/15/24		91,269
USD	75,000	7.38% due 07/01/28 (a) Endeavor Energy Resources LP / EER Finance, Inc.		80,710
USD	65,000	5.50% due 01/30/26 (a), (b) EQM Midstream Partners LP		67,519
USD	95,000	6.00% due 07/01/25 (a), (b) Ford Motor Credit Co. LLC		103,313
USD	340,000	3.38% due 11/13/25 (a) Fresh Market, Inc.		352,324
USD	135,000	9.75% due 05/01/23 (a), (b) Gap, Inc.		138,422
USD	76,000	8.38% due 05/15/23 (b) HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC		85,629
USD	90,000	6.00% due 04/15/25 (a), (b) HCA, Inc.		94,870
USD	85,000	5.88% due 05/01/23 Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp.		92,370
USD	70,000	4.75% due 09/15/24 (a) ILFC E-Capital Trust II		73,150
USD	100,000	3.91% due 12/21/65 (a), (b), (c) Ingles Markets, Inc.		85,330

US 短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
USD	66,000	5.75% due 06/15/23 (a) Legacy LifePoint Health LLC		66,099
USD	35,000	6.75% due 04/15/25 (a), (b) Life Time, Inc.		37,231
USD	60,000	5.75% due 01/15/26 (a), (b) Macy's Retail Holdings LLC		62,183
USD	37,000	2.88% due 02/15/23 (a) Marriott Ownership Resorts, Inc.		37,370
USD	65,000	6.13% due 09/15/25 (a), (b) Maxim Crane Works Holdings Capital LLC		69,124
USD	60,000	10.13% due 08/01/24 (a), (b) Mesquite Energy, Inc.		61,875
USD	48,000	7.25% due 02/15/23 (a), (d) MGM Resorts International		960
USD	90,000	6.00% due 03/15/23 NCL Corp. Ltd.		96,273
USD	80,000	3.63% due 12/15/24 (a), (b) NextEra Energy Operating Partners LP		77,208
USD	60,000	4.25% due 07/15/24 (a), (b) NRG Energy, Inc.		63,300
USD	60,000	7.25% due 05/15/26 (a) NuStar Logistics LP		62,196
USD	45,000	5.75% due 10/01/25 (a) Oasis Petroleum, Inc.		48,938
USD	60,000	6.38% due 06/01/26 (a), (b) Occidental Petroleum Corp.		62,564
USD	155,000	2.90% due 08/15/24 (a)		158,487
USD	35,000	3.40% due 04/15/26 (a) OneMain Finance Corp.		35,788
USD	185,000	5.63% due 03/15/23 Patrick Industries, Inc.		198,108
USD	60,000	7.50% due 10/15/27 (a), (b) Picasso Finance Sub, Inc.		64,873
USD	55,000	6.13% due 06/15/25 (a), (b) Popular, Inc.		58,149
USD	35,000	6.13% due 09/14/23 (a) RLJ Lodging Trust LP		37,765
USD	80,000	3.75% due 07/01/26 (a), (b) Scientific Games International, Inc.		80,800
USD	65,000	8.63% due 07/01/25 (a), (b) Tenet Healthcare Corp.		71,175
USD	90,000	6.25% due 02/01/27 (a), (b) TransDigm, Inc.		93,938
USD	60,000	8.00% due 12/15/25 (a), (b) Tronox, Inc.		64,830
USD	65,000	6.50% due 05/01/25 (a), (b) VICI Properties LP / VICI Note Co., Inc.		68,789
USD	70,000	3.50% due 02/15/25 (a), (b)		71,382

US 短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

	元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
USD	95,000	WESCO Distribution, Inc. 7.13% due 06/15/25 (a), (b) Xerox Corp.		102,667
USD	70,000	4.38% due 03/15/23 (a) XPO Logistics, Inc.		73,104
USD	30,000	6.25% due 05/01/25 (a), (b)		31,989
		社債合計		4,838,596
		米国合計 (簿価 \$5,614,968)		5,675,394
		債券合計 (簿価 \$6,053,954)		6,118,908
		株数		
		普通株式 (1.7%)		
		米国 (1.7%)		
		石油・ガス (1.7%)		
1,100		EP Energy Corp.		107,800
		米国合計 (簿価 \$101,004)		107,800
		普通株式合計 (簿価 \$101,004)		107,800
		元本		
		短期投資 (2.2%)		
		日本 (0.1%)		
		定期預金 (0.1%)		
J P Y	320,624	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc (0.31) % ** due 07/01/21		2,889
		定期預金合計		2,889
		日本合計 (簿価 \$2,889)		2,889
		英国 (2.1%)		
		定期預金 (2.1%)		
USD	131,364	ANZ National Bank 0.01% due 07/01/21		131,364
		定期預金合計		131,364
		英国合計 (簿価 \$131,364)		131,364
		短期投資合計 (簿価 \$134,253)		134,253
		投資合計 (簿価 \$6,289,211)	100.8%	\$ 6,360,961
		現金およびその他の資産を超過する負債	(0.8)	(47,607)
		純資産	100.0%	\$ 6,313,354

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

* バンクローンは変動金利証券です。クーポンレートは期末時点のものを表示しております。

** 日本銀行による預金金利引き下げのため、日本円建ての短期投資の金利はゼロ%未満である可能性があります。

(a) 期前償還条項付き証券。

(b) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144A の下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関投資家への転売が可能です。他に記載がない限り、これらの証券は流動性がないとはみなされません。

(c) 2021年6月30日時点の変動金利証券。

(d) デフォルト証券。

U S 短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)

2021年6月30日現在の円ヘッジクラスの外国為替先渡取引 (純資産の -0.7%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価損	評価損益
J P Y	Barclays Bank Plc	603,731,043	09/16/2021	U S D	5,488,225	\$ -	\$ (45,081)	\$ (45,081)

2021年6月30日現在の円ヘッジ/N1クラスの外国為替先渡取引 (純資産の -0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価損	評価損益
J P Y	Barclays Bank Plc	82,514,709	09/16/2021	U S D	750,101	\$ -	\$ (6,162)	\$ (6,162)

通貨の略称:

J P Y - 日本・円
U S D - 米ドル

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（US短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型））が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2021年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの第113期の決算日（2022年7月5日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄

2022年1月6日～2022年7月5日における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

2022年7月5日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2021年12月9日）

（作成対象期間 2020年12月10日～2021年12月9日）

ダイワ・マネースtock・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

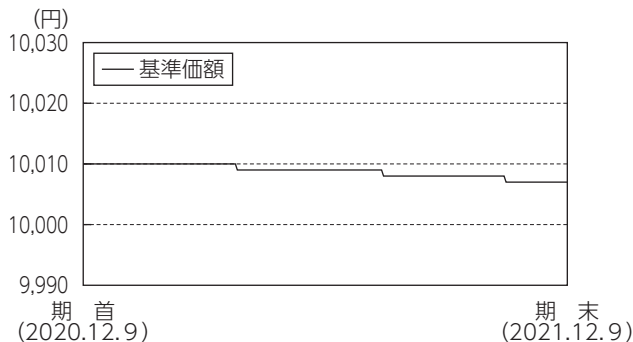
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率		
	円	%	%
(期首)2020年12月9日	10,010	-	-
12月末	10,010	0.0	-
2021年1月末	10,010	0.0	-
2月末	10,010	0.0	-
3月末	10,010	0.0	-
4月末	10,009	△0.0	-
5月末	10,009	△0.0	-
6月末	10,009	△0.0	-
7月末	10,008	△0.0	-
8月末	10,008	△0.0	-
9月末	10,008	△0.0	-
10月末	10,007	△0.0	-
11月末	10,007	△0.0	-
(期末)2021年12月9日	10,007	△0.0	-

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,010円 期末：10,007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

○国内短期金融市況

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 (その他)	0 (0)
合 計	0

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2021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	147,987,988	100.0
投資信託財産総額	147,987,988	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

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	147,987,988,484円
コール・ローン等	147,987,988,484
(B) 負債	210,000,000
未払解約金	210,000,000
(C) 純資産総額(A - B)	147,777,988,484
元本	147,676,216,454
次期繰越損益金	101,772,030
(D) 受益権総口数	147,676,216,454口
1万口当り基準価額(C/D)	10,007円

* 期首における元本額は88,319,921,795円、当作成期間中における追加設定元本額は176,557,677,368円、同解約元本額は117,201,382,709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：

日本株ロング・ショート戦略ハイリターンファンド (適格機関投資家専用)	266,761,115円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック	947,268円
ダイワ/ミレニアセット・インド株式ファンド - インドの匠	29,910,270円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジあり)	998円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジなし)	998円
US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)	102,434円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (為替ヘッジあり)	39,849円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	3,985円
ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり)	3,985円
i Freeレバレッジ S&P500	8,293,797,395円
i Freeレバレッジ NASDAQ100	70,959,132,903円
クリーンテック株式ファンド (資産成長型)	998,802円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (毎月決算/予想分配金提示型)	999円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型)	1,000円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	499,501円
ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス	5,345,339,466円
ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス	6,483,785,045円
ダイワ上場投信-TOP1Xレバレッジ(2倍) 指数	1,334,794,630円
ダイワ上場投信-TOP1Xダブルインバース(-2倍) 指数	936,360,631円
ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス	6,676,062,567円
ダイワ上場投信-TOP1Xインバース(-1倍) 指数	3,084,973,807円
ダイワ上場投信-JPX日経400レバレッジ・インデックス	574,295,634円
ダイワ上場投信-JPX日経400インバース・インデックス	861,497,868円
ダイワ上場投信-JPX日経400ダブルインバース・インデックス	104,920,073円
ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016-07	997円
ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016-10	997円
先進国トータルリターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用)	6,988,339,549円
ダイワ日本株ベア・ファンド (適格機関投資家専用)	101,154,451円
ダイワ日本債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - S1トレード	301,448,680円
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	16,464,882,107円
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	17,685,532,691円
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	1,058,922,067円
ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ	89,553,240円
ダイワ/アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ	2,938,475円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 豪ドル・コース (毎月分配型)	595,106円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	987,373円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	494,581円
ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型)	9,957円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	997円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり)	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジなし)	997円
ダイワ/ミレニアセット亜細亜株式ファンド	9,958,176円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 米ドル・コース	10,833円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	10,788円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース	12,751円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回) -	100,588円

ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし (毎月分配型)	399,083円
ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり (毎月分配型)	99,771円
通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース (毎月分配型)	399,083円
通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース (毎月分配型)	99,771円
ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジあり)	1,091,429円
ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジなし)	315,004円
ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	10,009,811円
ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 日本円・コース (毎月分配型)	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型)	99,691円
ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型)	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	15,402円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII- 予想分配金提示型 日本円・コース	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII- 予想分配金提示型 豪ドル・コース	200,861円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII- 予想分配金提示型 ブラジル・リアル・コース	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII- 予想分配金提示型 米ドル・コース	1,999,177円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイII- 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース	505,900円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,007円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 31,130,963円
受取利息	469,134
支払利息	△ 31,600,097
(B) その他費用	△ 147,839
(C) 当期損益金(A + B)	△ 31,278,802
(D) 前期繰越損益金	90,693,506
(E) 解約差損益金	△106,126,697
(F) 追加信託差損益金	148,484,023
(G) 合計(C + D + E + F)	101,772,030
次期繰越損益金(G)	101,772,030

(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。