

# ダイワ豪ドル建て 高利回り証券ファンド — 予想分配金提示型 —

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## 運用報告書(全体版)

第115期 (決算日 2022年5月17日)  
第116期 (決算日 2022年6月17日)  
第117期 (決算日 2022年7月19日)  
第118期 (決算日 2022年8月17日)  
第119期 (決算日 2022年9月20日)  
第120期 (決算日 2022年10月17日)

(作成対象期間 2022年4月19日～2022年10月17日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、高利回りの獲得を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしております。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/>

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比	債券 比率	投資信託 証券 比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込 み 金	期騰 落 中 率				
91 期末 (2020年 5 月18日)	円 7,078	円 10	% 3.0	% —	% 99.5	百万円 3,455	
92 期末 (2020年 6 月17日)	7,633	10	8.0	—	99.1	3,688	
93 期末 (2020年 7 月17日)	7,791	10	2.2	—	97.9	3,700	
94 期末 (2020年 8 月17日)	8,018	10	3.0	—	99.2	3,765	
95 期末 (2020年 9 月17日)	8,014	10	0.1	—	98.5	3,729	
96 期末 (2020年10月19日)	7,844	10	△ 2.0	—	99.2	3,561	
97 期末 (2020年11月17日)	8,081	10	3.1	—	98.4	3,585	
98 期末 (2020年12月17日)	8,315	10	3.0	—	98.3	3,641	
99 期末 (2021年 1 月18日)	8,551	10	3.0	—	98.8	3,671	
100 期末 (2021年 2 月17日)	8,877	10	3.9	—	98.0	3,718	
101 期末 (2021年 3 月17日)	9,129	10	3.0	—	97.7	3,669	
102 期末 (2021年 4 月19日)	9,166	10	0.5	—	97.2	3,629	
103 期末 (2021年 5 月17日)	9,296	10	1.5	—	97.9	3,602	
104 期末 (2021年 6 月17日)	9,278	10	△ 0.1	—	97.8	3,533	
105 期末 (2021年 7 月19日)	8,897	10	△ 4.0	—	97.9	3,259	
106 期末 (2021年 8 月17日)	8,737	10	△ 1.7	—	99.3	3,161	
107 期末 (2021年 9 月17日)	8,719	10	△ 0.1	—	99.4	3,097	
108 期末 (2021年10月18日)	9,251	10	6.2	—	99.2	3,250	
109 期末 (2021年11月17日)	9,162	10	△ 0.9	—	98.3	3,134	
110 期末 (2021年12月17日)	8,928	10	△ 2.4	—	99.1	3,035	
111 期末 (2022年 1 月17日)	9,008	10	1.0	—	98.0	3,042	
112 期末 (2022年 2 月17日)	8,993	10	△ 0.1	—	99.5	2,998	
113 期末 (2022年 3 月17日)	9,239	10	2.8	—	98.6	3,044	
114 期末 (2022年 4 月18日)	10,050	10	8.9	—	98.1	3,183	
115 期末 (2022年 5 月17日)	9,515	20	△ 5.1	—	98.4	2,962	
116 期末 (2022年 6 月17日)	9,632	20	1.4	—	98.4	2,949	
117 期末 (2022年 7 月19日)	9,830	20	2.3	—	99.3	2,993	
118 期末 (2022年 8 月17日)	9,937	20	1.3	—	99.1	2,990	
119 期末 (2022年 9 月20日)	10,096	20	1.8	—	97.1	2,985	
120 期末 (2022年10月17日)	9,731	30	△ 3.3	—	98.0	2,858	

(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、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### 基準価額・騰落率

第115期首：10,050円

第120期末：9,731円（既払分配金130円）

騰落率：△1.9%（分配金再投資ベース）

#### 基準価額の主な変動要因

オーストラリア債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したことや、豪ドル円が下落（円高）したことなどから、当ファンドの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。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド -予想分配金提示型-

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %		
第115期	(期首) 2022年4月18日	10,050	—	—	98.1
	4月末	9,760	△ 2.9	—	99.4
	(期末) 2022年5月17日	9,535	△ 5.1	—	98.4
第116期	(期首) 2022年5月17日	9,515	—	—	98.4
	5月末	9,619	1.1	—	98.9
	(期末) 2022年6月17日	9,652	1.4	—	98.4
第117期	(期首) 2022年6月17日	9,632	—	—	98.4
	6月末	9,855	2.3	—	98.8
	(期末) 2022年7月19日	9,850	2.3	—	99.3
第118期	(期首) 2022年7月19日	9,830	—	—	99.3
	7月末	9,830	0.0	—	98.1
	(期末) 2022年8月17日	9,957	1.3	—	99.1
第119期	(期首) 2022年8月17日	9,937	—	—	99.1
	8月末	10,080	1.4	—	98.1
	(期末) 2022年9月20日	10,116	1.8	—	97.1
第120期	(期首) 2022年9月20日	10,096	—	—	97.1
	9月末	9,845	△ 2.5	—	97.2
	(期末) 2022年10月17日	9,761	△ 3.3	—	98.0

(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. 4. 19 ~ 2022. 10. 17)

### ■ オーストラリア債券市況

オーストラリア債券市場では、10年国債利回りは上昇しました。

オーストラリア債券市況は、当作成期首より、RBA（オーストラリア準備銀行）の利上げ観測の高まりから金利は上昇基調で始まり、2022年5月にRBAが市場予想を上回る利上げを行ったことを受けて金利は上昇しました。その後は、世界経済の減速懸念などから、金利は緩やかな低下基調で推移したものの、6月に入ると、オーストラリアのGDP（国内総生産）が堅調な結果だったことや、RBAが市場予想以上の上げ幅で利上げを行ったことなどから、金利は大きく上昇しました。しかし7月末にかけては、RBAのロウ総裁が市場の利上げ観測を後退させる発言をしたことや、景気減速懸念を背景に欧米の金利が低下したことなどから、オーストラリアの金利も低下しました。8月に入ると、欧米の中央銀行高官から金融引き締めを支持する発言が相次ぎ、欧米の金利が上昇したことなどから、オーストラリアの金利も上昇しました。当作成期末にかけても、欧米の中央銀行が市場予想よりもタカ派的な姿勢を示したことや英国の財政政策に対する懸念から欧米の金利が上昇したことに連れて、オーストラリアでも金利は上昇しました。

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券は、世界経済の減速懸念などを背景に、市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、軟調な推移となりました。

### ■ 為替相場

豪ドルは対円で下落しました。

当作成期首より、世界経済の減速懸念などからリスク回避姿勢が強まり、豪ドルは対円で下落基調で推移しました。2022年6月上旬にかけては、RBA（オーストラリア準備銀行）が市場予想以上の上げ幅で利上げを行ったことなどで豪ドル円は上昇したものの、大幅な利上げによる景気減速への懸念などから株価が下落する中で、市場のリスク回避姿勢が強まり、豪ドル円は上昇幅を縮小しました。8月から9月上旬にかけてはオーストラリア金利が上昇し、内外の金利差が拡大したことなどを背景に円安豪ドル高となりました。しかし当作成期末にかけては、英国の財政政策に対する懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、豪ドル円は下落しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの受益証券への投資割合を高位に保つことによって、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、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。

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

### ■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

流通市場で割安に評価されている証券を発掘するとともに、新規証券の発行市場でも銘柄選択を行います。引き続き、流通市場および新規発行の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2022. 4. 19 ~ 2022. 10. 17)

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

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

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、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115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
	2022年4月19日 ～2022年5月17日	2022年5月18日 ～2022年6月17日	2022年6月18日 ～2022年7月19日	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
当期分配金(税込み)(円)	20	20	20	20	20	30
対基準価額比率(%)	0.21	0.21	0.20	0.20	0.20	0.31
当期の収益(円)	20	20	20	20	20	30
当期の収益以外(円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額(円)	1,582	1,592	1,604	1,617	1,634	1,637

(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115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 21.92円	✓ 29.51円	✓ 32.37円	✓ 33.06円	✓ 36.83円	✓ 33.65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	538.38	539.72	544.15	544.44	544.74	545.03
(d) 分配準備積立金	1,042.17	1,042.78	1,047.86	1,059.95	1,072.71	1,089.25
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,602.48	1,612.02	1,624.39	1,637.46	1,654.29	1,667.94
(f) 分配金	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,582.48	1,592.02	1,604.39	1,617.46	1,634.29	1,637.94

(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

当ファンドは、ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンドの受益証券への投資割合を高位に保つことによって、豪ドル建てのハイブリッド証券および普通社債等に投資し、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。

### ■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

流通市場で割安に評価されている証券を発掘するとともに、新規証券の発行市場でも銘柄選択を行います。引き続き、流通市場および新規発行の状況を注視しながら、特にリスク対比で高い利回りを提供するハイブリッド証券の発掘に注力します。

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

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



## 1 万口当りの費用の明細

項 目	第115期～第120期 (2022. 4. 19～2022. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	58円	0.592%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当作成期中の平均基準価額は9,868円です。</b>
(投 信 会 社)	(16)	(0.164)	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)	(41)	(0.411)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.016)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	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	59	0.596	

(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。

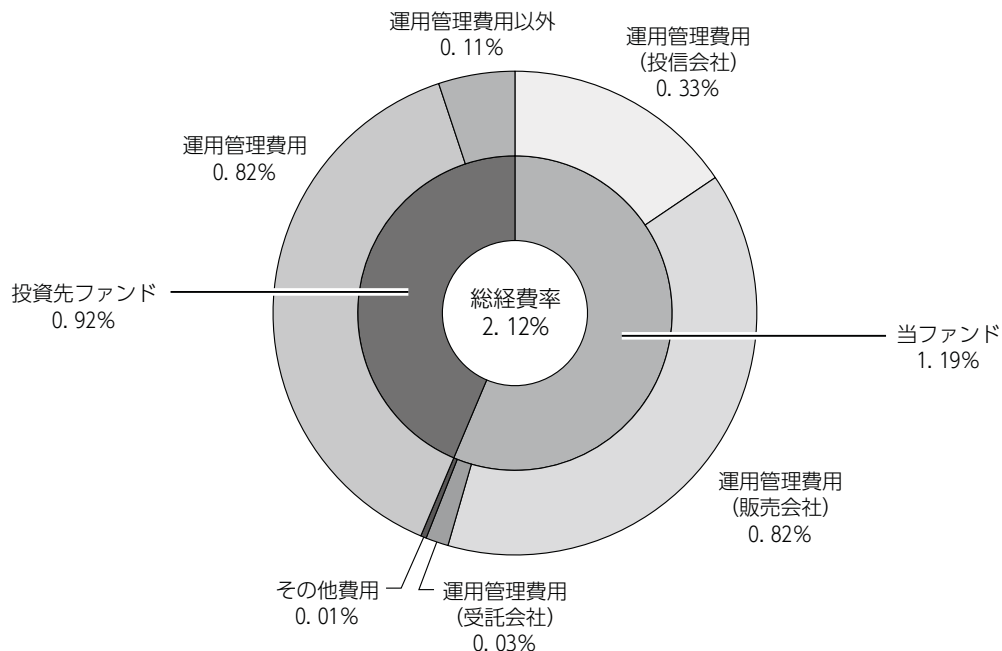
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.12%です。



総経費率 ( ① + ② + ③ )	2.12%
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	0.82%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11%

(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4月19日から2022年10月17日まで)

決算期	第 115 期 ～ 第 120 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国 (邦貨建)	609,40576	64,753	2,622,34837	280,000

(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4月19日から2022年10月17日まで)

第 115 期 ～ 第 120 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
				DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	2,622,34837	280,000	106

(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

### (1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 120 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千□	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A)	26,776,92358	2,802,954	98.0

(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114期末	第 120 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	173	173	174

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項 目	第 120 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,802,954	97.5
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	174	0.0
コール・ローン等、その他	71,516	2.5
投資信託財産総額	2,874,644	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5月17日)、(2022年6月17日)、(2022年7月19日)、(2022年8月17日)、(2022年9月20日)、(2022年10月17日) 現在

項 目	第115期末	第116期末	第117期末	第118期末	第119期末	第120期末
<b>(A) 資産</b>	<b>2,973,726,404円</b>	<b>2,959,864,591円</b>	<b>3,002,504,560円</b>	<b>2,999,455,253円</b>	<b>3,050,827,920円</b>	<b>2,874,644,961円</b>
コール・ローン等	58,400,873	58,326,522	31,272,281	36,826,107	51,518,330	71,516,041
投資信託受益証券 (評価額)	2,915,151,382	2,901,363,920	2,971,058,130	2,962,455,014	2,899,135,458	2,802,954,806
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額)	174,149	174,149	174,149	174,132	174,132	174,114
未収入金	—	—	—	—	100,000,000	—
<b>(B) 負債</b>	<b>10,928,443</b>	<b>10,249,692</b>	<b>9,246,498</b>	<b>8,921,288</b>	<b>65,271,330</b>	<b>15,768,934</b>
未払金	—	—	—	—	50,000,000	—
未払収益分配金	6,227,326	6,124,569	6,090,262	6,019,097	5,914,521	8,813,744
未払解約金	1,769,339	1,042,974	—	—	5,925,546	4,268,110
未払信託報酬	2,911,575	3,040,844	3,093,464	2,819,850	3,325,841	2,563,865
その他未払費用	20,203	41,305	62,772	82,341	105,422	123,215
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>2,962,797,961</b>	<b>2,949,614,899</b>	<b>2,993,258,062</b>	<b>2,990,533,965</b>	<b>2,985,556,590</b>	<b>2,858,876,027</b>
元本	3,113,663,295	3,062,284,863	3,045,131,329	3,009,548,757	2,957,260,838	2,937,914,987
次期繰越損益金	△ 150,865,334	△ 112,669,964	△ 51,873,267	△ 19,014,792	△ 28,295,752	△ 79,038,960
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,113,663,295口</b>	<b>3,062,284,863口</b>	<b>3,045,131,329口</b>	<b>3,009,548,757口</b>	<b>2,957,260,838口</b>	<b>2,937,914,987口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	9,515円	9,632円	9,830円	9,937円	10,096円	9,731円

\* 当作成期首における元本額は3,167,168,209円、当作成期間 (第115期～第120期) 中における追加設定元本額は19,595,354円、同解約元本額は248,848,576円です。

\* 第120期末の計算口数当りの純資産額は9,731円です。

\* 第120期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は79,038,960円です。

■損益の状況

第115期 自2022年4月19日 至2022年5月17日    第117期 自2022年6月18日 至2022年7月19日    第119期 自2022年8月18日 至2022年9月20日  
 第116期 自2022年5月18日 至2022年6月17日    第118期 自2022年7月20日 至2022年8月17日    第120期 自2022年9月21日 至2022年10月17日

項 目	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>9,758,607円</b>	<b>9,701,651円</b>	<b>10,322,058円</b>	<b>10,689,206円</b>	<b>11,581,778円</b>	<b>12,468,376円</b>
受取配当金	9,759,065	9,702,996	10,323,115	10,689,718	11,583,568	12,471,618
受取利息	1	3	5	—	2	—
支払利息	△ 459	△ 1,348	△ 1,062	△ 512	△ 1,792	△ 3,242
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 167,064,401</b>	<b>35,053,505</b>	<b>58,857,129</b>	<b>30,421,119</b>	<b>44,659,532</b>	<b>△ 108,220,173</b>
売買益	608,754	36,462,921	59,367,434	30,647,635	45,063,972	489,449
売買損	△ 167,673,155	△ 1,409,416	△ 510,305	△ 226,516	△ 404,440	△ 108,709,622
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 2,931,778</b>	<b>△ 3,061,946</b>	<b>△ 3,114,931</b>	<b>△ 2,839,419</b>	<b>△ 3,348,922</b>	<b>△ 2,581,658</b>
<b>(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 160,237,572</b>	<b>41,693,210</b>	<b>66,064,256</b>	<b>38,270,906</b>	<b>52,892,388</b>	<b>△ 98,333,455</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 13,851,278</b>	<b>△ 177,117,663</b>	<b>△ 140,163,234</b>	<b>△ 79,230,612</b>	<b>△ 46,149,879</b>	<b>822,349</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>29,450,842</b>	<b>28,879,058</b>	<b>28,315,973</b>	<b>27,964,011</b>	<b>27,467,764</b>	<b>27,285,890</b>
(配当等相当額)	( 167,635,764)	( 165,279,075)	( 165,703,076)	( 163,853,995)	( 161,094,891)	( 160,127,321)
(売買損益相当額)	(△ 138,184,922)	(△ 136,400,017)	(△ 137,387,103)	(△ 135,889,984)	(△ 133,627,127)	(△ 132,841,431)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 144,638,008</b>	<b>△ 106,545,395</b>	<b>△ 45,783,005</b>	<b>△ 12,995,695</b>	<b>34,210,273</b>	<b>△ 70,225,216</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 6,227,326</b>	<b>△ 6,124,569</b>	<b>△ 6,090,262</b>	<b>△ 6,019,097</b>	<b>△ 5,914,521</b>	<b>△ 8,813,744</b>
次期繰越損益金 (G + H)	<b>△ 150,865,334</b>	<b>△ 112,669,964</b>	<b>△ 51,873,267</b>	<b>△ 19,014,792</b>	<b>△ 28,295,752</b>	<b>△ 79,038,960</b>
追加信託差損益金	29,450,842	28,879,058	28,315,973	27,964,011	27,467,764	27,285,890
(配当等相当額)	( 167,635,764)	( 165,279,075)	( 165,703,076)	( 163,853,995)	( 161,094,891)	( 160,127,321)
(売買損益相当額)	(△ 138,184,922)	(△ 136,400,017)	(△ 137,387,103)	(△ 135,889,984)	(△ 133,627,127)	(△ 132,841,431)
分配準備積立金	325,098,091	322,244,628	322,856,850	322,929,082	322,208,826	321,087,889
繰越損益金	△ 505,414,267	△ 463,793,650	△ 403,046,090	△ 369,907,885	△ 321,380,838	△ 427,412,739

(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115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
(a) 経費控除後の配当等収益	6,826,829円	9,037,820円	9,857,309円	9,950,957円	10,892,232円	9,886,714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	167,635,764	165,279,075	165,703,076	163,853,995	161,094,891	160,127,321
(d) 分配準備積立金	324,498,588	319,331,377	319,089,803	318,997,222	317,231,115	320,014,919
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	498,961,181	493,648,272	494,650,188	492,802,174	489,218,238	490,028,954
(f) 分配金	6,227,326	6,124,569	6,090,262	6,019,097	5,914,521	8,813,744
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	492,733,855	487,523,703	488,559,926	486,783,077	483,303,717	481,215,210
(h) 受益権総口数	3,113,663,295□	3,062,284,863□	3,045,131,329□	3,009,548,757□	2,957,260,838□	2,937,914,987□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1万口当り分配金（税込み）	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
	20円	20円	20円	20円	20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。

ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド

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

（豪ドル建て）

貸借対照表  
2022年3月31日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$68,158,625）	\$	63,572,561
未収：		
売却済みの投資		18,172
配当		231
利息		266,387
カウンターパーティへの預託金		1,280,000
中央清算されるデリバティブ取引に係るブローカーへの預託金		650,899
<b>資産合計</b>		<b>65,788,250</b>

負債

売建てオプションの評価額（受取プレミアム \$285,020）		1,058,206
保管会社に対する未払金		179,956
ブローカーに対する未払金 – 中央清算されるデリバティブ取引の変動証拠金 – 先物取引		339,133
未払：		
償還済み受益証券		877,707
専門家報酬		124,993
運用会社報酬		35,839
会計および管理会社報酬		10,378
保管会社報酬		9,484
為替運用会社報酬		2,541
名義書換代理人報酬		1,721
<b>負債合計</b>		<b>2,639,958</b>

純資産	\$	<b>63,148,292</b>
純資産		
クラス A	\$	34,030,485
通貨αクラス		29,117,807
	\$	<b>63,148,292</b>
発行済み受益証券口数		
クラス A		29,355,681
通貨αクラス		53,444,164
受益証券1口当り純資産額		
クラス A	\$	1.159
通貨αクラス	\$	0.545

(豪ドル建て)

**損益計算書**

2022年3月31日に終了した年度

<b>投資収益</b>	
受取利息	\$ 2,731,349
配当収益 (源泉税 \$1,500 控除後)	366,855
配当収益－関係会社 (源泉税 \$6,988 控除後)	22,204
<b>投資収益合計</b>	<b>3,120,408</b>
<b>費用</b>	
運用会社報酬	487,793
専門家報酬	78,746
会計および管理会社報酬	61,638
保管会社報酬	61,242
為替運用会社報酬	36,367
名義書換代理人報酬	11,483
受託会社報酬	11,299
登録料	5,043
<b>費用合計</b>	<b>753,611</b>
<b>投資純利益</b>	<b>2,366,797</b>
<b>実現益 (損) および評価益 (損) :</b>	
<b>実現益 (損) :</b>	
証券投資	1,703,050
先物取引	607,102
売建オプション	66,448
外国為替取引および外国為替先渡取引	(11,748)
<b>純実現益</b>	<b>2,364,852</b>
<b>評価益 (損) の純変動 :</b>	
証券投資	(3,690,945)
売建オプション	(691,233)
先物取引	408,739
外国為替換算および外国為替先渡取引	(297)
<b>評価損の純変動</b>	<b>(3,973,736)</b>
<b>純実現益および評価益 (損) の純変動</b>	<b>(1,608,884)</b>
<b>運用による純資産の純増</b>	<b>\$ 757,913</b>



(豪ドル建て)

投資明細表  
2022年3月31日

元本	有価証券の明細	評価額
	<b>債券 (82.8%)</b>	
	<b>オーストラリア (73.1%)</b>	
	<b>社債 (73.1%)</b>	
	AMP, Ltd. (a), (b)	
AUD 1,000,000	1.89% due 12/01/27	\$ 982,589
AUD 2,000,000	2.83% due 11/15/28	1,944,871
	Ampol, Ltd. (a), (b)	
AUD 500,000	3.58% due 12/02/81	496,946
AUD 1,500,000	3.75% due 12/09/80	1,501,020
	Aurizon Finance Pty, Ltd. (a)	
AUD 1,000,000	3.00% due 03/09/28	889,258
	Aurizon Network Pty, Ltd. (a)	
AUD 1,000,000	2.90% due 09/02/30	837,611
	AusNet Services Holdings Pty, Ltd. (a)	
AUD 1,500,000	3.17% due 10/06/80	1,500,497
AUD 750,000	4.30% due 03/30/28	746,757
	Australia Pacific Airports Melbourne Pty, Ltd. (a)	
AUD 1,000,000	3.76% due 11/25/31	904,322
	Australian Prime Property Fund Retail (a)	
AUD 1,000,000	3.75% due 05/22/24	990,492
	Australian Unity, Ltd. (b)	
AUD 40,406	2.07% due 12/15/24	4,063,591
	Bank of Queensland, Ltd. (a), (b)	
AUD 500,000	1.83% due 05/19/32	490,128
	Brisbane Airport Corp. Pty, Ltd. (a)	
AUD 2,500,000	4.50% due 12/30/30	2,409,745
	Centuria Capital No 2 Fund (a), (b)	
AUD 10,000	4.32% due 04/20/26	1,020,000
	ClearView Wealth, Ltd. (b)	
AUD 500,000	6.01% due 11/05/30	530,565
	Commonwealth Bank of Australia (b)	
AUD 7,500	2.98% due 06/15/29	758,581
	Crown Resorts, Ltd. (a), (b)	
AUD 27,009	4.15% due 04/23/75	2,625,275
	Insurance Australia Group, Ltd. (a), (b)	
AUD 500,000	2.60% due 12/15/36	506,959
	Liberty Financial Pty, Ltd. (b)	
AUD 500,000	2.61% due 03/17/25	496,580

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド – 予想分配金提示型 –

	元本	有価証券の明細	評価額
AUD	1,000,000	Llitst Finance Pty, Ltd. (a) 2.85% due 06/28/30	863,199
AUD	4,000,000	National Australia Bank, Ltd. (a), (b), (c) 4.07%	4,116,560
AUD	1,350,000	New Terminal Financing Co. Pty, Ltd. (b) 1.52% due 07/12/24	1,342,816
AUD	2,000,000	Omni Bridgeway, Ltd. (a), (b) 5.43% due 12/22/22	2,004,200
AUD	2,250,000	Pacific National Finance Pty, Ltd. 3.80% due 09/08/31 (a)	1,986,310
AUD	1,000,000	5.40% due 05/12/27 Peet, Ltd.	1,016,788
AUD	500,000	5.08% due 09/30/26 (a), (b)	506,510
AUD	20,000	4.72% due 10/05/22 (b)	2,012,840
AUD	500,000	Qantas Airways, Ltd. (a) 3.15% due 09/27/28	441,161
AUD	20,000	Qube Holdings, Ltd. (b) 3.97% due 10/05/23	2,034,000
AUD	2,000,000	Resolution Life Australasia, Ltd. (a), (b) 3.45% due 12/09/35	2,034,641
AUD	500,000	SEEK, Ltd. (a), (b) 3.88% due 06/20/26	497,500
AUD	1,000,000	Shopping Centres Australasia Property Retail Trust (a) 2.45% due 09/24/29	860,051
AUD	1,000,000	VER Finco Pty, Ltd. (a) 2.40% due 09/21/28	885,344
AUD	20,000	Virgin Australia Holdings Pty, Ltd. (a) 8.00% due 11/26/24	60,000
AUD	2,000,000	8.25% due 05/30/23	60,000
AUD	2,000,000	WestConnex Finance Co. Pty, Ltd. (a) 3.15% due 03/31/31	1,718,905
		<b>社債合計</b>	<b>46,136,612</b>
		<b>オーストラリア合計 (簿価 \$51,188,717)</b>	<b>46,136,612</b>
		<b>フランス (3.1%)</b>	
		<b>社債 (3.1%)</b>	
AUD	2,000,000	Societe Generale S. A. (a), (b), (c) 4.88%	1,937,500
		<b>社債合計</b>	<b>1,937,500</b>
		<b>フランス合計 (簿価 \$2,000,000)</b>	<b>1,937,500</b>
		<b>ニュージーランド (4.4%)</b>	
		<b>社債 (4.4%)</b>	
AUD	500,000	Avanti Finance, Ltd. (a), (b) 4.89% due 06/08/25	504,020

	元本	有価証券の明細	評価額
AUD	24,835	Nufarm Finance NZ, Ltd. (a), (b), (c) 3.97%	2,247,592
		<b>社債合計</b>	<b>2,751,612</b>
		ニュージーランド合計 (簿価 \$2,483,889)	2,751,612
		スイス (1.5%)	
		<b>社債 (1.5%)</b>	
AUD	1,000,000	UBS Group AG (a), (b), (c) 4.38%	971,392
		<b>社債合計</b>	<b>971,392</b>
		スイス合計 (簿価 \$1,000,000)	971,392
		アメリカ (0.7%)	
		<b>社債 (0.7%)</b>	
AUD	500,000	Computershare US, Inc. 3.15% due 11/30/27	471,195
		<b>社債合計</b>	<b>471,195</b>
		アメリカ合計 (簿価 \$500,000)	471,195
		債券合計 (簿価 \$57,172,606)	52,268,311

**株数**

		<b>優先株式 (14.9%)</b>	
		<b>オーストラリア (14.9%)</b>	
		<b>銀行 (10.7%)</b>	
5,000		Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a), (b), (c)	512,700
2,500		Bank of Queensland, Ltd. (a), (b), (c)	259,475
2,000		Bendigo & Adelaide Bank, Ltd. series CPS 4 (a), (b), (c)	204,700
2,500		Bendigo & Adelaide Bank, Ltd. series CN (a), (b), (c)	257,025
2,500		Commonwealth Bank of Australia. series X (a), (b), (c)	262,500
2,500		Commonwealth Bank of Australia. series XII (a), (b), (c)	256,925
7,500		Commonwealth Bank of Australia. series XIII (a), (b), (c)	761,100
12,500		Macquarie Bank, Ltd. (a), (b), (c)	1,342,750
1,000		Macquarie Group, Ltd. (a), (b), (c)	106,400
2,000,000		Members Equity Bank, Ltd. (a), (b), (c)	2,015,184
7,500		Westpac Banking Corp. (a), (b), (c)	783,825
		<b>総合金融サービス (1.8%)</b>	
10,853		AMP, Ltd. (a), (b), (c)	1,120,572
		<b>保険 (2.4%)</b>	
5,000		Challenger, Ltd. (a), (b), (c)	525,000
10,000		Latitude Group Holdings, Ltd. (a), (b), (c)	1,005,000
		<b>オーストラリア合計 (簿価 \$9,094,925)</b>	<b>9,413,156</b>

ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド – 予想分配金提示型 –

口数	有価証券の明細	評価額
	優先株式合計 (簿価 \$9,094,925)	9,413,156
	MMF (3.0%)	
	オーストラリア (3.0%)	
1,887,323	Yarra A\$ Cash Reserves Fund Class A	1,891,094
	オーストラリア合計	1,891,094
	MMF 合計 (簿価 \$1,891,094)	1,891,094
		純資産に 占める割合
	投資総額 (簿価 \$68,158,625)	100.7 % \$ 63,572,561
	現金およびその他の資産を超過する負債	(0.7) (424,269)
	純資産	100.0% \$ 63,148,292

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

- (a) 償還条項付証券。
- (b) 2022年3月31日時点の変動金利証券。
- (c) 永久債。

2022年3月31日現在の先物取引残高 (純資産の0.8%) :

ポジション	明細	限月	想定元本	枚数	評価損益
Long	90-Day Bank Bill Futures	2022年12月	50,759,613	51	\$ (12,374)
Long	90-Day Bank Bill Futures	2022年9月	50,875,615	51	(61,051)
Short	Australian 10-Year Treasury Bond Futures	2022年6月	(14,905,852)	(113)	583,890
					\$ 510,465

2022年3月31日現在の通貨αクラスの売建オプション残高 (純資産の-1.7%) :

取引内容	行使価格	満期日	想定元本	受取プレミアム	評価額
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	\$ 82.80	2022/ 4 /27	JPY 8,000,000	\$ (149,238)	\$ (736,391)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	87.60	2022/ 5 /27	7,000,000	(135,782)	(321,815)
				\$ (285,020)	\$ (1,058,206)

通貨の略称:

AUD - 豪ドル  
JPY - 日本円

**<補足情報>**

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド（一予想分配金提示型））が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・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120期の決算日（2022年10月17日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄**

2022年4月19日～2022年10月17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10月17日現在、有価証券等の組み入れはありません。

# ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

## 運用報告書 第13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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

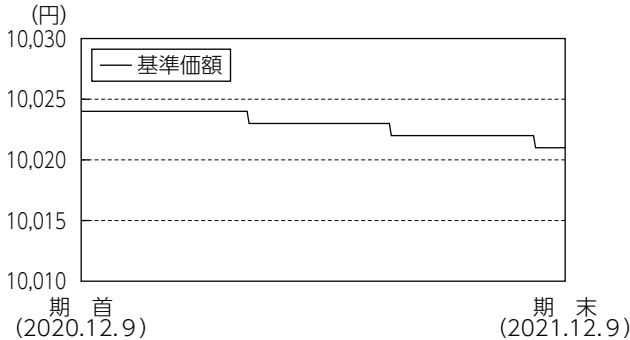
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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	10,024	-	-
12月末	10,024	0.0	-
2021年1月末	10,024	0.0	-
2月末	10,024	0.0	-
3月末	10,024	0.0	-
4月末	10,023	△0.0	-
5月末	10,023	△0.0	-
6月末	10,023	△0.0	-
7月末	10,023	△0.0	-
8月末	10,022	△0.0	-
9月末	10,022	△0.0	-
10月末	10,022	△0.0	-
11月末	10,021	△0.0	-
(期末)2021年12月9日	10,021	△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：10,024円 期末：10,021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	95,139,414	100.0
投資信託財産総額	95,139,414	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	95,139,414,225円
コール・ローン等	95,139,414,225
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	95,139,414,225
元本	94,938,109,576
次期繰越損益金	201,304,649
(D) 受益権総口数	94,938,109,576口
1万口当り基準価額(C / D)	10,021円

\* 期首における元本額は73,320,433,569円、当作成期間中における追加設定元本額は101,534,469,895円、同解約元本額は79,916,793,888円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ米ドル・フルファンド (適格機関投資家専用)	1,781,662,390円
ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用)	9,727,670,751円
ダイワ・マネーポートフォリオ (FOF s用) (適格機関投資家専用)	1,089,639円
ダイワリリートベア・ファンド (適格機関投資家専用)	1,135,439,591円
米国債プラス日本株式ファンド2021-01 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	12,595,101円
米国債プラス日本株式ファンド2021-07 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	504,894,014円
ダイワ/パリュール・パートナーズ チャイナ・ヘルスクエア・フォーカス通貨選択型 米国リート・αクワトロ (毎月分配型)	159,141円
通貨選択型アメリカン・エグイティ・αクワトロ (毎月分配型)	159,141円
オール・マーケット・インカム戦略 (資産成長重視コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (奇数月定額分配コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (奇数月定率分配コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (予想分配金提示型コース)	9,963円
NYダウ・トリプル・レバレッジ	907,909,838円
世界セレクトティブ株式オープン (為替ヘッジあり/年1回決算型)	998円
世界セレクトティブ株式オープン (為替ヘッジあり/年2回決算型)	998円
FANG+プラスベア・マネーポートフォリオ	992,420円
ポーレン米国グロース株式ファンド (資産成長型)	998円
ポーレン米国グロース株式ファンド (予想分配金提示型)	998円
トレンド・キャッチ戦略ファンド	9,977円
AHL ターゲットリスク・ライト戦略ファンド (適格機関投資家専用)	8,871,272,012円
ダイワユーロベア・ファンド2 (2倍、非リバランス型) (適格機関投資家専用)	66,013,931,447円
ダイワユーロベア・ファンド (2倍、非リバランス型) (適格機関投資家専用)	678,845,270円
ダイワ米ドルベア・ファンド (2倍、非リバランス型) (適格機関投資家専用)	1,316,281,503円
ダイワJGBベア・ファンド2 (適格機関投資家専用)	3,981,542,385円
ダイワ/ロジャース国際コモディティTM・ファンド	2,417,017円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (通貨選択型) アジア通貨・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券α (毎月分配型)	9,949円
ダイワ米国債7-10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - USTライアングル -	997,374円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -	173,802円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,021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	△ 28,899,045円
受取利息	657,510
支払利息	△ 29,556,555
(B) その他費用	△ 218,657
(C) 当期損益金(A + B)	△ 29,117,702
(D) 前期繰越損益金	178,846,436
(E) 解約差損益金	△ 186,978,215
(F) 追加信託差損益金	238,554,130
(G) 合計(C + D + E + F)	201,304,649
次期繰越損益金(G)	201,304,649

(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。