

ダイワ豪ドル建て 高利回り証券α (毎月分配型)

運用報告書(全体版)

第99期(決算日 2022年11月17日)
第100期(決算日 2022年12月19日)
第101期(決算日 2023年1月17日)
第102期(決算日 2023年2月17日)
第103期(決算日 2023年3月17日)
第104期(決算日 2023年4月17日)

(作成対象期間 2022年10月18日～2023年4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するとともに、オプション取引を組み合わせた通貨カバードコール戦略を構築し、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／資産複合
信託期間	2014年6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(通貨αクラス)」の受益証券(円建) ロ、ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
組入制限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

最近 30 期の運用実績

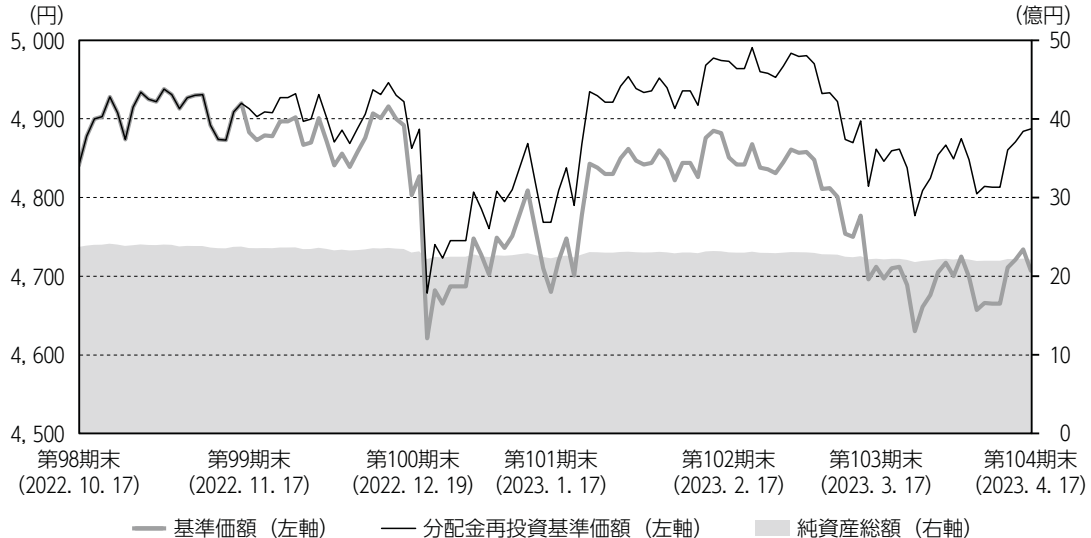
決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 率	純 資 産 額
	(分 配 落)	税 分 配 込 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
75 期末 (2020年11月17日)	4,679	30	2.4	—	99.3	3,715
76 期末 (2020年12月17日)	4,760	30	2.4	—	97.9	3,720
77 期末 (2021年 1 月18日)	4,838	30	2.3	—	99.5	3,750
78 期末 (2021年 2 月17日)	4,960	30	3.1	—	98.2	3,787
79 期末 (2021年 3 月17日)	5,030	30	2.0	—	99.3	3,756
80 期末 (2021年 4 月19日)	5,055	30	1.1	—	96.7	3,621
81 期末 (2021年 5 月17日)	5,094	30	1.4	—	98.0	3,537
82 期末 (2021年 6 月17日)	5,084	30	0.4	—	97.8	3,438
83 期末 (2021年 7 月19日)	4,877	30	△ 3.5	—	98.9	3,223
84 期末 (2021年 8 月17日)	4,781	30	△ 1.4	—	97.7	3,127
85 期末 (2021年 9 月17日)	4,760	30	0.2	—	98.3	3,016
86 期末 (2021年10月18日)	4,921	30	4.0	—	97.9	3,051
87 期末 (2021年11月17日)	4,876	30	△ 0.3	—	98.2	2,925
88 期末 (2021年12月17日)	4,759	30	△ 1.8	—	99.3	2,649
89 期末 (2022年 1 月17日)	4,782	30	1.1	—	98.6	2,649
90 期末 (2022年 2 月17日)	4,753	30	0.0	—	98.1	2,615
91 期末 (2022年 3 月17日)	4,806	30	1.7	—	97.8	2,620
92 期末 (2022年 4 月18日)	5,029	30	5.3	—	99.6	2,702
93 期末 (2022年 5 月17日)	4,810	30	△ 3.8	—	98.3	2,536
94 期末 (2022年 6 月17日)	4,826	30	1.0	—	97.8	2,506
95 期末 (2022年 7 月19日)	4,894	30	2.0	—	98.0	2,615
96 期末 (2022年 8 月17日)	4,941	30	1.6	—	97.9	2,611
97 期末 (2022年 9 月20日)	4,988	30	1.6	—	99.1	2,574
98 期末 (2022年10月17日)	4,841	30	△ 2.3	—	99.4	2,371
99 期末 (2022年11月17日)	4,883	30	1.5	—	99.4	2,358
100期末 (2022年12月19日)	4,803	30	△ 1.0	—	99.1	2,301
101期末 (2023年 1 月17日)	4,680	30	△ 1.9	—	98.8	2,226
102期末 (2023年 2 月17日)	4,851	30	4.3	—	98.1	2,302
103期末 (2023年 3 月17日)	4,712	30	△ 2.2	—	97.5	2,222
104期末 (2023年 4 月17日)	4,707	30	0.5	—	98.7	2,210

(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99期首：4,841円

第104期末：4,707円（既払分配金180円）

騰落率：1.0%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

オーストラリア債券市場で金利が低下（債券価格は上昇）したこと、また豪ドル円が下落（円高）したものの円に対する豪ドルのコール・オプションを売却していたため、オプションプレミアムが基準価額の下落を抑制したことなどで、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。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率		
第 99 期	(期 首) 2022年10月17日	円 4,841	% —	% —	% 99.4
	10月末	4,922	1.7	—	98.0
	(期 末) 2022年11月17日	4,913	1.5	—	99.4
第100期	(期 首) 2022年11月17日	4,883	—	—	99.4
	11月末	4,870	△ 0.3	—	98.0
	(期 末) 2022年12月19日	4,833	△ 1.0	—	99.1
第101期	(期 首) 2022年12月19日	4,803	—	—	99.1
	12月末	4,727	△ 1.6	—	97.9
	(期 末) 2023年 1 月17日	4,710	△ 1.9	—	98.8
第102期	(期 首) 2023年 1 月17日	4,680	—	—	98.8
	1 月末	4,862	3.9	—	99.0
	(期 末) 2023年 2 月17日	4,881	4.3	—	98.1
第103期	(期 首) 2023年 2 月17日	4,851	—	—	98.1
	2 月末	4,831	△ 0.4	—	98.1
	(期 末) 2023年 3 月17日	4,742	△ 2.2	—	97.5
第104期	(期 首) 2023年 3 月17日	4,712	—	—	97.5
	3 月末	4,717	0.1	—	97.8
	(期 末) 2023年 4 月17日	4,737	0.5	—	98.7

（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. 10. 18 ~ 2023. 4. 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年国債利回りは低下しました。

オーストラリア債券市況は、当作成期首から2022年12月上旬にかけて、米国の利上げペースの減速観測が高まったことなどから、オーストラリアでも金利は低下基調で推移しました。12月中旬から月末にかけては、オーストラリアの雇用統計が堅調であったこと、日銀のイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）における長期金利の上限引き上げや、中国のゼロコロナ政策修正などを材料に金利は上昇しました。しかし2023年1月に入ると、米国において景況感やインフレ指標が低下したことなどから金利が低下し、オーストラリアも米国に連れて金利は低下しました。その後2月下旬にかけては、再びF R B（米国連邦準備制度理事会）が金融引き締め姿勢を継続するとの見方が強まり米国金利が上昇したことや、R B A（オーストラリア準備銀行）が利上げを行い、今後のさらなる利上げを示唆したことから、金利は上昇しました。3月に入ると、欧米の金融不安を背景に安全資産とされる国債の需要が高まり、オーストラリアの金利は低下しました。当作成期末にかけては、金利はやや上昇して当作成期末を迎えました。

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券は、2023年3月の欧米における金融不安の影響は受けたものの、当作成期を通して見ると投資家の利回りへの強い需要などによりおおむね堅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、市場の金融引き締め観測が後退したことなどから市場のリスク選好姿勢が高まり、豪ドルは対円で上昇基調で始まりました。その後2022年12月下旬にかけては、米国のC P I（消費者物価指数）が市場予想を下振れたことなどから米ドル高の流れが一服したことや、中国のゼロコロナ政策に対するデモにより投資家心理が悪化したこと、さらに日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）における長期金利の上限引き上げを実施したことから、豪ドルは対円で下落基調で推移しました。2023年1月に入ると、オーストラリアのC P Iが市場予想を上回ったことなどを受けて上昇しました。しかし3月に入ると、欧米の銀行不安を背景に投資家心理が悪化し、豪ドルは対円で下落しました。当作成期末にかけては、豪ドルは対円でやや上昇しました。

■通貨オプション市況

通貨オプションのインプライド・ボラティリティ（予想変動率）は低下しました。

日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことで急速に円高が進行し、ボラティリティが上昇する場面もありましたが、当作成期末にかけては市場の警戒感が後退し、ボラティリティは低下しました。

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（通貨αクラス）」と「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」に投資し、「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（通貨αクラス）」への投資割合を高位に維持することをめざします。

※ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）：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（通貨αクラス）

■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（通貨αクラス）

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。

通貨カバードコール戦略については、保有する豪ドル建資産の評価額の50%程度のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの獲得をめざします。

■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. 10. 18 ～ 2023. 4. 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（通貨αクラス）」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（通貨αクラス）」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（通貨αクラス）

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券等への投資により、高利回りの獲得をめざすとともに、通貨のオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の構築により、オプションプレミアムの確保をめざして運用を行いました。円に対する豪ドルのコール・オプションのカバー率は、保有する豪ドル建資産の評価額の50%程度を維持しました。

■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99期	第100期	第101期	第102期	第103期	第104期
	2022年10月18日 ～2022年11月17日	2022年11月18日 ～2022年12月19日	2022年12月20日 ～2023年1月17日	2023年1月18日 ～2023年2月17日	2023年2月18日 ～2023年3月17日	2023年3月18日 ～2023年4月17日
当期分配金(税込み) (円)	30	30	30	30	30	30
対基準価額比率 (%)	0.61	0.62	0.64	0.61	0.63	0.63
当期の収益 (円)	30	30	30	30	30	30
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	202	212	223	237	249	262

(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99期	第100期	第101期	第102期	第103期	第104期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 40.64円	✓ 40.26円	✓ 40.90円	✓ 43.96円	✓ 42.34円	✓ 42.91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	45.54	45.74	45.96	46.27	46.55	46.89
(d) 分配準備積立金	146.09	156.53	166.58	177.18	190.87	202.88
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	232.28	242.55	253.46	267.42	279.77	292.69
(f) 分配金	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	202.28	212.55	223.46	237.42	249.77	262.69

(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（通貨αクラス）」と「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」に投資し、「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（通貨αクラス）」への投資割合を高位に維持することをめざします。

■ダイワ・オーストラリア・ハイインカム・セキュリティーズ・ファンド（通貨αクラス）

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。市場の動向と状況を注意深く観察しながら新しい投資機会を求める姿勢を継続します。

通貨カバードコール戦略については、保有する豪ドル建資産の評価額の50%程度のコール・オプションを売却することで、オプションプレミアムの獲得をめざします。

■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

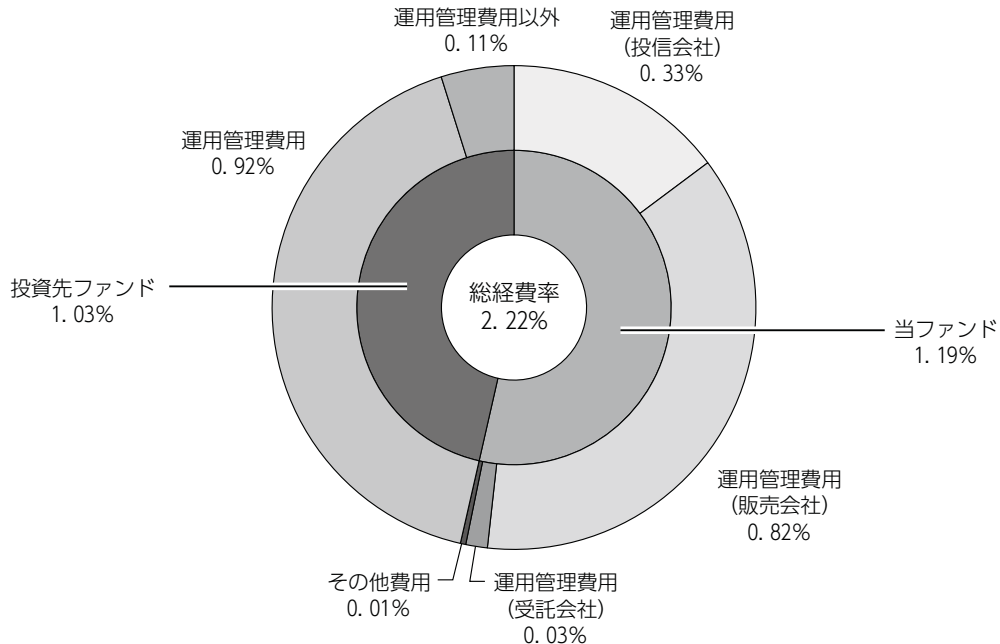
項 目	第99期～第104期 (2022. 10. 18～2023. 4. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	28円	0. 590%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は4,807円です。
（投 信 会 社）	(8)	(0. 164)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(20)	(0. 410)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(1)	(0. 016)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0. 009	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
（投資信託受益証券）	(0)	(0. 009)	
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	29	0. 603	

- (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2.22%です。



総経費率（①＋②＋③）	2.22%
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	0.92%
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。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

■売買および取引の状況

投資信託受益証券

(2022年10月18日から2023年 4月17日まで)

決 算 期	第 99 期 ～ 第 104 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国（邦貨建）	2,758.48019	130,596	4,410.08608	209,790

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

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2022年10月18日から2023年 4月17日まで)

第 99 期 ～ 第 104 期							
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
				DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CURRENCY ALPHA CLASS)（ケイマン諸島）	4,410.08608	209,790	47

(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 104 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 （ケイマン諸島） DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CURRENCY ALPHA CLASS)	47,257.12792	2,182,239	98.7

(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98期末	第 104 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	9	9	9

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年 4月17日現在

項 目	第 104 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,182,239	97.7
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	50,484	2.3
投資信託財産総額	2,232,734	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11月17日)、(2022年12月19日)、(2023年1月17日)、(2023年2月17日)、(2023年3月17日)、(2023年4月17日) 現在

項 目	第99期末	第100期末	第101期末	第102期末	第103期末	第104期末
(A) 資産	2,376,638,787円	2,322,708,243円	2,247,137,376円	2,320,243,543円	2,279,900,709円	2,232,734,240円
コール・ローン等	33,298,028	40,849,318	47,681,100	62,368,001	31,735,699	50,484,622
投資信託受益証券（評価額）	2,343,330,793	2,281,848,960	2,199,446,311	2,257,865,577	2,168,239,045	2,182,239,653
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（評価額）	9,966	9,965	9,965	9,965	9,965	9,965
未収入金	—	—	—	—	79,920,000	—
(B) 負債	18,391,901	20,792,192	20,323,450	17,474,647	56,960,143	22,262,448
未払金	—	—	—	—	39,960,000	—
未払収益分配金	14,489,378	14,378,784	14,275,826	14,240,064	14,152,998	14,088,316
未払解約金	1,477,375	3,931,459	3,866,383	858,340	683,138	5,854,887
未払信託報酬	2,408,437	2,448,250	2,132,747	2,311,708	2,085,007	2,224,808
その他未払費用	16,711	33,699	48,494	64,535	79,000	94,437
(C) 純資産総額（A－B）	2,358,246,886	2,301,916,051	2,226,813,926	2,302,768,896	2,222,940,566	2,210,471,792
元本	4,829,792,874	4,792,928,194	4,758,608,891	4,746,688,297	4,717,666,131	4,696,105,515
次期繰越損益金	△ 2,471,545,988	△ 2,491,012,143	△ 2,531,794,965	△ 2,443,919,401	△ 2,494,725,565	△ 2,485,633,723
(D) 受益権総口数	4,829,792,874口	4,792,928,194口	4,758,608,891口	4,746,688,297口	4,717,666,131口	4,696,105,515口
1万口当り基準価額（C／D）	4,883円	4,803円	4,680円	4,851円	4,712円	4,707円

* 当作成期首における元本額は4,897,418,809円、当作成期間（第99期～第104期）中における追加設定元本額は41,928,093円、同解約元本額は243,241,387円です。

* 第104期末の計算口数当りの純資産額は4,707円です。

* 第104期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,485,633,723円です。

■損益の状況

第99期	自2022年10月18日	至2022年11月17日	第101期	自2022年12月20日	至2023年1月17日	第103期	自2023年2月18日	至2023年3月17日
第100期	自2022年11月18日	至2022年12月19日	第102期	自2023年1月18日	至2023年2月17日	第104期	自2023年3月18日	至2023年4月17日
項 目	第99期	第100期	第101期	第102期	第103期	第104期	第103期	第104期
(A) 配当等収益	21,015,423円	21,764,339円	21,614,959円	21,375,979円	22,075,187円	22,394,645円		
受取配当金	21,017,388	21,766,562	21,615,994	21,376,469	22,075,659	22,395,030		
受取利息	5	2	3	3	—	5		
支払利息	△ 1,970	△ 2,225	△ 1,038	△ 493	△ 472	△ 390		
(B) 有価証券売買損益	15,808,955	△ 43,251,464	△ 63,809,243	76,713,267	△ 71,564,672	△ 8,375,452		
売買益	16,182,959	249,569	273,175	76,976,471	258,156	54,410		
売買損	△ 374,004	△ 43,501,033	△ 64,082,418	△ 263,204	△ 71,822,828	△ 8,429,862		
(C) 信託報酬等	△ 2,425,148	△ 2,465,238	△ 2,147,542	△ 2,327,749	△ 2,099,472	△ 2,240,245		
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	34,399,230	△ 23,952,363	△ 44,341,826	95,761,497	△ 51,588,957	11,778,948		
(E) 前期繰越損益金	△ 1,913,684,108	△ 1,876,888,544	△ 1,899,006,777	△ 1,949,388,706	△ 1,853,770,926	△ 1,907,559,274		
(F) 追加信託差損益金	△ 577,771,732	△ 575,792,452	△ 574,170,536	△ 576,052,128	△ 575,212,684	△ 575,765,081		
(配当等相当額)	(21,996,917)	(21,926,812)	(21,874,848)	(21,965,233)	(21,963,317)	(22,023,079)		
(売買損益相当額)	(△ 599,768,649)	(△ 597,719,264)	(△ 596,045,384)	(△ 598,017,361)	(△ 597,176,001)	(△ 597,788,160)		
(G) 合計（D＋E＋F）	△ 2,457,056,610	△ 2,476,633,359	△ 2,517,519,139	△ 2,429,679,337	△ 2,480,572,567	△ 2,471,545,407		
(H) 収益分配金	△ 14,489,378	△ 14,378,784	△ 14,275,826	△ 14,240,064	△ 14,152,998	△ 14,088,316		
次期繰越損益金（G＋H）	△ 2,471,545,988	△ 2,491,012,143	△ 2,531,794,965	△ 2,443,919,401	△ 2,494,725,565	△ 2,485,633,723		
追加信託差損益金	△ 577,771,732	△ 575,792,452	△ 574,170,536	△ 576,052,128	△ 575,212,684	△ 575,765,081		
(配当等相当額)	(21,996,917)	(21,926,812)	(21,874,848)	(21,965,233)	(21,963,317)	(22,023,079)		
(売買損益相当額)	(△ 599,768,649)	(△ 597,719,264)	(△ 596,045,384)	(△ 598,017,361)	(△ 597,176,001)	(△ 597,788,160)		
分配準備積立金	75,701,683	79,947,010	84,461,824	90,735,191	95,873,151	101,342,193		
繰越損益金	△ 1,969,475,939	△ 1,995,166,701	△ 2,042,086,253	△ 1,958,602,464	△ 2,015,386,032	△ 2,011,210,835		

(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。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第99期	第100期	第101期	第102期	第103期	第104期
(a) 経費控除後の配当等収益	19,631,391円	19,299,101円	19,467,417円	20,868,762円	19,975,715円	20,154,400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	21,996,917	21,926,812	21,874,848	21,965,233	21,963,317	22,023,079
(d) 分配準備積立金	70,559,670	75,026,693	79,270,233	84,106,493	90,050,434	95,276,109
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	112,187,978	116,252,606	120,612,498	126,940,488	131,989,466	137,453,588
(f) 分配金	14,489,378	14,378,784	14,275,826	14,240,064	14,152,998	14,088,316
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	97,698,600	101,873,822	106,336,672	112,700,424	117,836,468	123,365,272
(h) 受益権総口数	4,829,792,874□	4,792,928,194□	4,758,608,891□	4,746,688,297□	4,717,666,131□	4,696,105,515□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金（税込み）	第99期	第100期	第101期	第102期	第103期	第104期
	30円	30円	30円	30円	30円	30円

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

・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。 ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。 ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。 ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

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（通貨αクラス）

当ファンド（ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型））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（通貨αクラス）」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
資産合計		65, 788, 250

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
負債合計		2, 639, 958

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

純資産	\$	63,148,292
純資産		
クラス A	\$	34,030,485
通貨αクラス		29,117,807
	\$	63,148,292
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

投資収益

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
投資収益合計		3,120,408

費用

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
費用合計		753,611

投資純利益

2,366,797

実現益（損）および評価益（損）：

実現益（損）：

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)

純実現益

2,364,852

評価益（損）の純変動：

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)

評価損の純変動

(3,973,736)

純実現益および評価益（損）の純変動

(1,608,884)

運用による純資産の純増

\$ 757,913

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

（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
		債券 (82.8%)	
		オーストラリア (73.1%)	
		社債 (73.1%)	
		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

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
	社債合計	46,136,612
	オーストラリア合計（簿価 \$51,188,717）	46,136,612
	フランス（3.1%）	
	社債（3.1%）	
AUD 2,000,000	Societe Generale S. A. (a), (b), (c) 4.88%	1,937,500
	社債合計	1,937,500
	フランス合計（簿価 \$2,000,000）	1,937,500
	ニュージーランド（4.4%）	
	社債（4.4%）	
AUD 500,000	Avanti Finance, Ltd. (a), (b) 4.89% due 06/08/25	504,020

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

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
		社債合計	2,751,612
		ニュージーランド合計（簿価 \$2,483,889）	2,751,612
		スイス（1.5%）	
AUD	1,000,000	社債（1.5%）	
		UBS Group AG (a), (b), (c)	
		4.38%	971,392
		社債合計	971,392
		スイス合計（簿価 \$1,000,000）	971,392
AUD	500,000	アメリカ（0.7%）	
		社債（0.7%）	
		Computershare US, Inc.	
		3.15% due 11/30/27	471,195
		社債合計	471,195
		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

優先株式（14.9%）			
オーストラリア（14.9%）			
銀行（10.7%）			
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
総合金融サービス（1.8%）			
10,853	AMP, Ltd. (a), (b), (c)		1,120,572
保険（2.4%）			
5,000	Challenger, Ltd. (a), (b), (c)		525,000
10,000	Latitude Group Holdings, Ltd. (a), (b), (c)		1,005,000
オーストラリア合計（簿価 \$9,094,925）			9,413,156

口数	有価証券の明細	評価額
1,887,323	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%）	
	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 α （毎月分配型））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（2022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104期の決算日（2023年4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10月18日～2023年4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

2023年4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14期（決算日 2022年12月9日）

（作成対象期間 2021年12月10日～2022年12月9日）

ダイワ・マネーポートフォリオ・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。

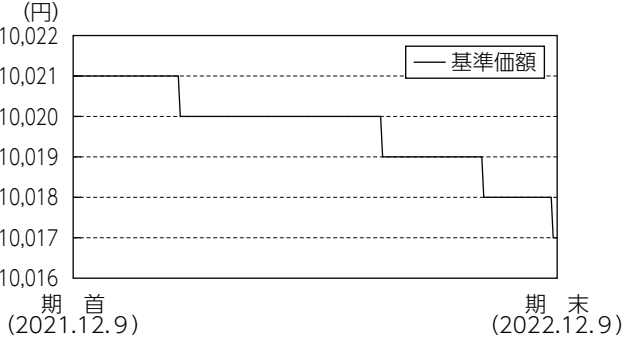
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2021年12月9日	円	%	%
	10,021	—	—
12月末	10,021	0.0	—
2022年1月末	10,021	0.0	—
2月末	10,021	0.0	—
3月末	10,020	△0.0	—
4月末	10,020	△0.0	—
5月末	10,020	△0.0	—
6月末	10,020	△0.0	—
7月末	10,020	△0.0	—
8月末	10,019	△0.0	—
9月末	10,019	△0.0	—
10月末	10,018	△0.0	—
11月末	10,018	△0.0	—
(期末)2022年12月9日	10,017	△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：10,021円 期末：10,017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	—
合 計	—

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2022年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	44,934,654	100.0
投資信託財産総額	44,934,654	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	44,934,654,863円
コール・ローン等	44,934,654,863
(B) 負債	1,205,058
未払解約金	1,205,058
(C) 純資産総額(A－B)	44,933,449,805
元本	44,855,160,815
次期繰越損益金	78,288,990
(D) 受益権総口数	44,855,160,815口
1万口当り基準価額(C／D)	10,017円

* 期首における元本額は94,938,109,576円、当作成期間中における追加設定元本額は94,531,696,979円、同解約元本額は144,614,645,740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・ブルファンド (適格機関投資家専用)	3,974,859,681円
ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用)	9,984,542,130円
ダイワ・マネーポートフォリオ (F O F s用) (適格機関投資家専用)	1,089,639円
ダイワJリートベア・ファンド (適格機関投資家専用)	2,083,616,103円
米国国債プラス日本株式ファンド2021-01 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	1,518,511円
米国国債プラス日本株式ファンド2021-07 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	9,980,330円
ダイワ/パリュウ・パートナーズ チャイナ・ヘルスケア・フォーカス	9,976円
通貨選択型 米国リート・αクワトロ (毎月分配型)	159,141円
通貨選択型アメリカン・エクイティ・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	1,486,750,161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+ブルベア・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)	8,364,886,518円
ダイワJGBベア・ファンド2 (適格機関投資家専用)	18,942,942,107円
ダイワ/ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド	2,417,017円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン ド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン ド (通貨選択型) ブラジル・レアル・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 - U S T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10,017円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月10日 至2022年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 16,492,067円
支払利息	△ 16,492,067
(B) 当期損益金(A)	△ 16,492,067
(C) 前期繰越損益金	201,304,649
(D) 解約差損益金	△293,300,613
(E) 追加信託差損益金	186,777,021
(F) 合計(B + C + D + E)	78,288,990
次期繰越損益金(F)	78,288,990

(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。