

# 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105期 (決算日 2023年5月17日)  
第106期 (決算日 2023年6月19日)  
第107期 (決算日 2023年7月18日)  
第108期 (決算日 2023年8月17日)  
第109期 (決算日 2023年9月19日)  
第110期 (決算日 2023年10月17日)

(作成対象期間 2023年4月18日～2023年10月17日)

### ★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。

### 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/>

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 資産証 証券比	純資産 総額
	(分配落)	税金 込金	騰落 中率			
	円	円	%	%	%	百万円
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
105 期末 (2023年 5 月17日)	4,729	30	1.1	—	98.1	2,211
106 期末 (2023年 6 月19日)	4,861	30	3.4	—	97.8	2,256
107 期末 (2023年 7 月18日)	4,798	30	△ 0.7	—	99.2	2,211
108 期末 (2023年 8 月17日)	4,810	30	0.9	—	97.9	2,201
109 期末 (2023年 9 月19日)	4,863	30	1.7	—	99.0	2,217
110 期末 (2023年10月17日)	4,844	30	0.2	—	98.5	2,184

(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。

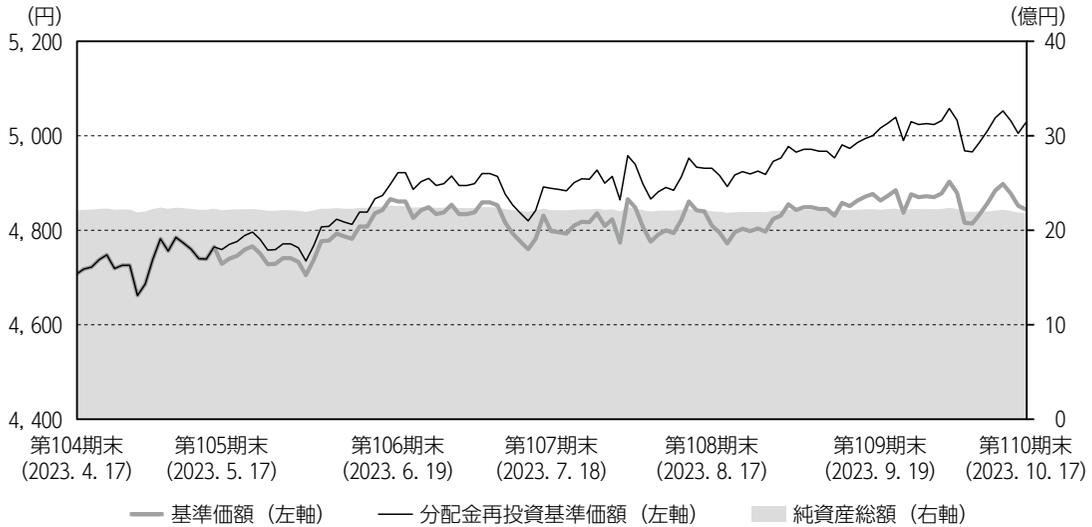
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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105期首：4,707円

第110期末：4,844円（既払分配金180円）

騰落率：6.8%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の変動要因

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た結果、豪ドル円が上昇（円安）したことや保有銘柄のインカム収入など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	騰 落 率				
第105期	(期首) 2023年4月17日	円 4,707	% —	—	—	—	% 98.7
	4月末	4,686	△ 0.4	—	—	—	98.8
	(期末) 2023年5月17日	4,759	1.1	—	—	—	98.1
第106期	(期首) 2023年5月17日	4,729	—	—	—	—	98.1
	5月末	4,733	0.1	—	—	—	98.3
	(期末) 2023年6月19日	4,891	3.4	—	—	—	97.8
第107期	(期首) 2023年6月19日	4,861	—	—	—	—	97.8
	6月末	4,834	△ 0.6	—	—	—	98.2
	(期末) 2023年7月18日	4,828	△ 0.7	—	—	—	99.2
第108期	(期首) 2023年7月18日	4,798	—	—	—	—	99.2
	7月末	4,774	△ 0.5	—	—	—	99.3
	(期末) 2023年8月17日	4,840	0.9	—	—	—	97.9
第109期	(期首) 2023年8月17日	4,810	—	—	—	—	97.9
	8月末	4,855	0.9	—	—	—	98.1
	(期末) 2023年9月19日	4,893	1.7	—	—	—	99.0
第110期	(期首) 2023年9月19日	4,863	—	—	—	—	99.0
	9月末	4,878	0.3	—	—	—	99.0
	(期末) 2023年10月17日	4,874	0.2	—	—	—	98.5

(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**

(2023. 4. 18 ~ 2023. 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、当作成期首から、オーストラリアにおける第1四半期のCPI（消費者物価指数）の伸び率が減速したことなどで、長期金利が低下（債券価格は上昇）して始まりました。2023年7月上旬にかけては、5月および6月にRBA（オーストラリア準備銀行）が利上げを決定したことや欧米の金利上昇により、長期金利は上昇基調で推移しました。8月末にかけては一進一退の展開となったものの、9月に入ると、FOMC（米国連邦公開市場委員会）において今後の政策金利がこれまで想定されていたよりも高い水準で維持される可能性が示唆されたことを受けて、10月頭にかけて米国を中心に世界的に金利が上昇し、オーストラリアでも金利が上昇しました。その後は、米国の金利低下に連れていったん金利は低下したものの、当作成期末にかけては上昇基調の推移となりました。

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券は、オーストラリアでの堅調な労働市場や底堅い成長見通しなどが投資家心理を下支えし、当作成期を通しておおむね堅調な推移となりました。

**■ 為替相場**

豪ドルは対円で上昇しました。

当作成期首より、オーストラリアにおける第1四半期のCPI（消費者物価指数）の伸び率が減速したことなどで、豪ドルは対円で下落（円高）して始まりました。2023年6月中旬にかけては、RBA（オーストラリア準備銀行）の利上げや、予想を上回る内外の経済指標を受けてオーストラリア金利が上昇し日豪の金利差が拡大したことなどで、豪ドル円は上昇しました。しかし、7月中旬にかけてオーストラリアのCPIが市場予想を下回りRBAによる金融引き締め観測が後退したこと、8月はRBAが政策金利を据え置いたことなどで、豪ドル円は下落基調の推移となりました。9月末にかけては再び上昇基調で推移したものの、10月に入るとオーストラリア金利の低下などから豪ドル円は下落基調で推移し、当作成期末を迎えました。

**■ 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。

欧米の金融不安が後退したことや、豪ドル円が堅調に推移したことなどを背景に、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。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。

## ポートフォリオについて

（2023. 4. 18 ~ 2023. 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（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105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期
	2023年4月18日 ～2023年5月17日	2023年5月18日 ～2023年6月19日	2023年6月20日 ～2023年7月18日	2023年7月19日 ～2023年8月17日	2023年8月18日 ～2023年9月19日	2023年9月20日 ～2023年10月17日
<b>当期分配金(税込み) (円)</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>30</b>
対基準価額比率 (%)	0.63	0.61	0.62	0.62	0.61	0.62
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)	276	293	307	323	338	354

(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105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 43.56円	✓ 46.75円	✓ 44.71円	✓ 45.27円	✓ 45.68円	✓ 45.66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	47.27	47.61	48.02	48.49	48.89	49.37
(d) 分配準備積立金	215.43	228.66	245.01	259.27	274.15	289.36
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	306.26	323.02	337.75	353.04	368.73	384.40
(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)	276.26	293.02	307.75	323.04	338.73	354.40

(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105期～第110期 (2023. 4. 18～2023. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	28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4,809円です。</b>
（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)	(0.412)	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	0.008	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)	(0.008)	
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
（ 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	29	0.604	

(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。

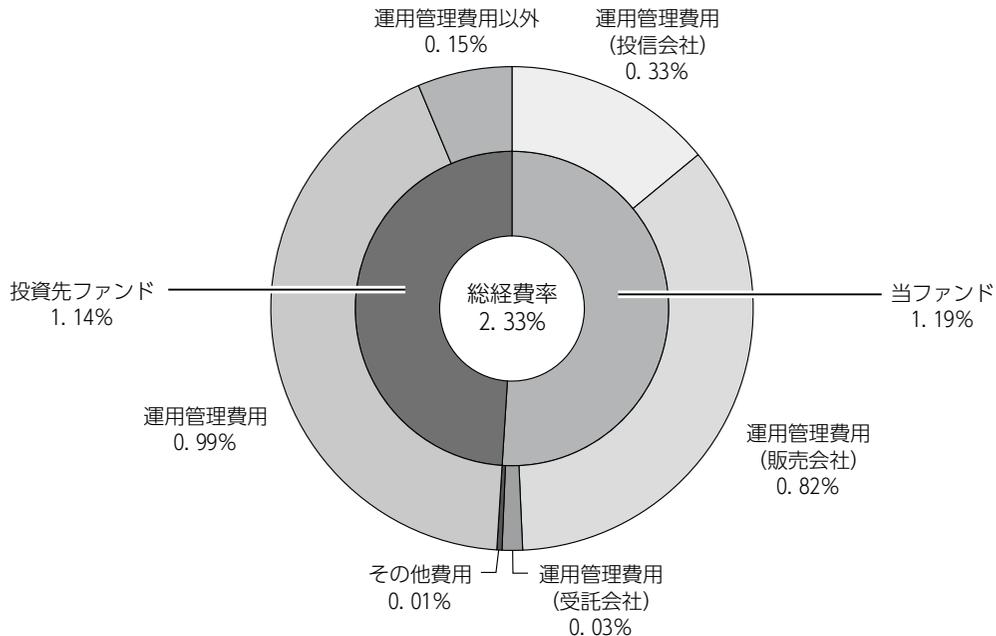
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.33%です。



総経費率 ( ① + ② + ③ )	2.33%
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	0.99%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.15%

(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

（2023年4月18日から2023年10月17日まで）

決算期	第105期		第110期	
	買付 □数	金額	売付 □数	金額
外国（邦貨建）	千口 2,921.64224	千円 135,565	千口 4,087.23181	千円 189,810

（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

（2023年4月18日から2023年10月17日まで）

第105期～第110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)	4,087.23181	189,810	46

（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110期末		
	□数	評価額	比率
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)	千口 46,091.53835	千円 2,151,921	% 98.5

（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104期末	第110期末	
	□数	□数	評価額
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	千口 9	千口 9	千円 9

（注）単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2023年10月17日現在

項目	第110期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 2,151,921	% 97.5
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	54,817	2.5
投資信託財産総額	2,206,749	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

(2023年5月17日)、(2023年6月19日)、(2023年7月18日)、(2023年8月17日)、(2023年9月19日)、(2023年10月17日) 現在

項目	第105期末	第106期末	第107期末	第108期末	第109期末	第110期末
<b>(A) 資産</b>	<b>2,229,275,248円</b>	<b>2,317,759,205円</b>	<b>2,231,272,598円</b>	<b>2,220,425,719円</b>	<b>2,234,916,349円</b>	<b>2,206,749,566円</b>
コール・ローン等	60,330,179	31,134,017	37,584,593	65,227,504	39,519,568	54,817,862
投資信託受益証券 (評価額)	2,168,935,105	2,206,695,225	2,193,678,042	2,155,188,252	2,195,386,819	2,151,921,742
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額)	9,964	9,964	9,963	9,963	9,962	9,962
未収入金	—	79,919,999	—	—	—	—
<b>(B) 負債</b>	<b>17,300,628</b>	<b>61,272,712</b>	<b>19,820,553</b>	<b>19,254,511</b>	<b>17,834,093</b>	<b>22,380,615</b>
未払金	—	39,960,000	—	—	—	—
未払収益分配金	14,031,644	13,925,826	13,825,915	13,727,463	13,676,123	13,529,406
未払解約金	1,088,850	4,972,943	3,846,100	3,308,131	1,716,679	6,749,010
未払信託報酬	2,165,119	2,382,400	2,102,411	2,157,820	2,363,798	2,010,747
その他未払費用	15,015	31,543	46,127	61,097	77,493	91,452
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>2,211,974,620</b>	<b>2,256,486,493</b>	<b>2,211,452,045</b>	<b>2,201,171,208</b>	<b>2,217,082,256</b>	<b>2,184,368,951</b>
元本	4,677,214,697	4,641,942,170	4,608,638,424	4,575,821,223	4,558,707,844	4,509,802,220
次期繰越損益金	△ 2,465,240,077	△ 2,385,455,677	△ 2,397,186,379	△ 2,374,650,015	△ 2,341,625,588	△ 2,325,433,269
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>4,677,214,697口</b>	<b>4,641,942,170口</b>	<b>4,608,638,424口</b>	<b>4,575,821,223口</b>	<b>4,558,707,844口</b>	<b>4,509,802,220口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	4,729円	4,861円	4,798円	4,810円	4,863円	4,844円

\* 当作成期首における元本額は4,696,105,515円、当作成期間 (第105期～第110期) 中における追加設定元本額は44,584,388円、同解約元本額は230,887,683円です。

\* 第110期末の計算口数当りの純資産額は4,844円です。

\* 第110期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,325,433,269円です。

■損益の状況

第105期 自2023年4月18日 至2023年5月17日    第107期 自2023年6月20日 至2023年7月18日    第109期 自2023年8月18日 至2023年9月19日  
 第106期 自2023年5月18日 至2023年6月19日    第108期 自2023年7月19日 至2023年8月17日    第110期 自2023年9月20日 至2023年10月17日

項目	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>22,195,376円</b>	<b>22,396,858円</b>	<b>22,723,057円</b>	<b>22,888,646円</b>	<b>22,139,126円</b>	<b>22,617,568円</b>
受取配当金	22,196,517	22,398,923	22,724,730	22,889,787	22,141,333	22,618,369
受取利息	2	—	2	—	2	—
支払利息	△ 1,143	△ 2,065	△ 1,675	△ 1,141	△ 2,209	△ 801
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>4,405,888</b>	<b>55,115,674</b>	<b>△ 35,613,534</b>	<b>△ 1,522,565</b>	<b>18,059,279</b>	<b>△ 15,992,866</b>
売買益	4,587,704	55,224,195	168,337	58,108	18,062,807	361,025
売買損	△ 181,816	△ 108,521	△ 35,781,871	△ 1,580,673	△ 3,528	△ 16,353,891
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 2,180,134</b>	<b>△ 2,398,928</b>	<b>△ 2,116,995</b>	<b>△ 2,172,790</b>	<b>△ 2,380,194</b>	<b>△ 2,024,706</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>24,421,130</b>	<b>75,113,604</b>	<b>△ 15,007,472</b>	<b>19,193,291</b>	<b>37,818,211</b>	<b>4,599,996</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 1,898,939,928</b>	<b>△ 1,871,560,879</b>	<b>△ 1,794,441,117</b>	<b>△ 1,807,110,376</b>	<b>△ 1,792,352,644</b>	<b>△ 1,746,365,381</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 576,689,635</b>	<b>△ 575,082,576</b>	<b>△ 573,911,875</b>	<b>△ 573,005,467</b>	<b>△ 573,415,032</b>	<b>△ 570,138,478</b>
(配当等相当額)	( 22,109,627)	( 22,100,751)	( 22,133,688)	( 22,192,665)	( 22,288,900)	( 22,267,953)
(売買損益相当額)	(△ 598,799,262)	(△ 597,183,327)	(△ 596,045,563)	(△ 595,198,132)	(△ 595,703,932)	(△ 592,406,431)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 2,451,208,433</b>	<b>△ 2,371,529,851</b>	<b>△ 2,383,360,464</b>	<b>△ 2,360,922,552</b>	<b>△ 2,327,949,465</b>	<b>△ 2,311,903,863</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>14,031,644</b>	<b>13,925,826</b>	<b>13,825,915</b>	<b>13,727,463</b>	<b>13,676,123</b>	<b>13,529,406</b>
次期繰越損益金 (G + H)	△ 2,465,240,077	△ 2,385,455,677	△ 2,397,186,379	△ 2,374,650,015	△ 2,341,625,588	△ 2,325,433,269
追加信託差損益金	△ 576,689,635	△ 575,082,576	△ 573,911,875	△ 573,005,467	△ 573,415,032	△ 570,138,478
(配当等相当額)	( 22,109,627)	( 22,100,751)	( 22,133,688)	( 22,192,665)	( 22,288,900)	( 22,267,953)
(売買損益相当額)	(△ 598,799,262)	(△ 597,183,327)	(△ 596,045,563)	(△ 595,198,132)	(△ 595,703,932)	(△ 592,406,431)
分配準備積立金	107,106,918	113,921,356	119,698,951	125,626,161	132,130,480	137,561,542
繰越損益金	△ 1,995,657,360	△ 1,924,294,457	△ 1,942,973,455	△ 1,927,270,709	△ 1,900,341,036	△ 1,892,856,333

(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105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期
(a) 経費控除後の配当等収益	20,376,272円	21,703,808円	20,606,062円	20,715,856円	20,828,353円	20,592,862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	22,109,627	22,100,751	22,133,688	22,192,665	22,288,900	22,267,953
(d) 分配準備積立金	100,762,290	106,143,374	112,918,804	118,637,768	124,978,250	130,498,086
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	143,248,189	149,947,933	155,658,554	161,546,289	168,095,503	173,358,901
(f) 分配金	14,031,644	13,925,826	13,825,915	13,727,463	13,676,123	13,529,406
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	129,216,545	136,022,107	141,832,639	147,818,826	154,419,380	159,829,495
(h) 受益権総口数	4,677,214,697口	4,641,942,170口	4,608,638,424口	4,575,821,223口	4,558,707,844口	4,509,802,220口

### 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1万口当り分配金（税込み）	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110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  
2023年3月31日

**資産**

投資資産の評価額（簿価 \$56,227,006）	\$	50,132,099
現金		2,952,949
未収：		
利息		375,891
店頭デリバティブ取引に係るカウンターパーティへの預託金		20,000
中央清算されるデリバティブ取引に係るカウンターパーティへの預託金		363,167
その他資産		8,254
<b>資産合計</b>		<b>53,852,360</b>

**負債**

売建てオプションの評価額（受取プレミアム \$281,100）		186,959
カウンターパーティに対する未払金 - 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		186,042
未払：		
購入済みの投資		325,736
償還済み受益証券		560,934
専門家報酬		171,440
運用会社報酬		58,662
保管会社報酬		17,462
会計および管理会社報酬		16,290
為替運用会社報酬		4,162
名義書換代理人報酬		1,426
<b>負債合計</b>		<b>1,529,113</b>

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

純資産	\$	<u>52,323,247</u>
純資産		
クラス A	\$	28,073,911
通貨αクラス		24,249,336
	\$	<u>52,323,247</u>
発行済み受益証券口数		
クラス A		24,683,785
通貨αクラス		46,769,522
受益証券1口当り純資産額		
クラス A	\$	1.137
通貨αクラス	\$	0.518

（豪ドル建て）

損益計算書

2023年3月31日に終了した年度

投資収益

受取利息（源泉徴収税 \$5,761 控除後）	\$	2,588,994
配当収益（源泉徴収税 \$718 控除後）		222,619
配当収益－関係会社（源泉徴収税 \$28 控除後）		9,653
<b>投資収益合計</b>		<b>2,821,266</b>

費用

運用会社報酬		369,834
専門家報酬		78,745
会計および管理会社報酬		65,802
保管会社報酬		61,243
為替運用会社報酬		26,163
受託会社報酬		11,301
名義書換代理人報酬		8,979
登録料		5,044
<b>費用合計</b>		<b>627,111</b>

純投資損益

**2,194,155**

実現損益および評価損益：

実現損益：

証券投資		566,083
先物取引		835,612
売建オプション		(326,788)
外国為替取引および外国為替先渡取引		4,396
<b>純実現利益</b>		<b>1,079,303</b>

評価損益の純変動の内訳：

証券投資		(1,508,843)
売建オプション		867,327
先物取引		(502,171)
外国為替換算および外国為替先渡取引		(210)
<b>評価損益の純変動</b>		<b>(1,143,897)</b>

純実現損益および評価損益の純変動

**(64,594)**

運用による純資産の純増

\$ **2,129,561**

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  
2023年3月31日

元本	証券の明細	評価額
	<b>債券 (88.6%)</b>	
	<b>オーストラリア (74.7%)</b>	
	<b>社債 (74.7%)</b>	
AUD 500,000	AMP Bank, Ltd. (a), (b) 7.98% due 10/07/32	\$ 522,433
AUD 1,000,000	AMP, Ltd. (a), (b) 6.24% due 11/15/28	992,330
AUD 500,000	Ampol, Ltd. (a), (b) 7.09% due 12/02/81	497,570
AUD 1,500,000	7.24% due 12/09/80	1,502,771
AUD 1,000,000	Aurizon Finance Pty, Ltd. (a) 3.00% due 03/09/28	872,420
AUD 1,000,000	Aurizon Network Pty, Ltd. (a) 2.90% due 09/02/30	788,179
AUD 750,000	AusNet Services Holdings Pty, Ltd. 4.30% due 03/30/28 (a)	724,567
AUD 1,500,000	6.42% due 10/06/80 (a), (b)	1,502,028
AUD 1,000,000	Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a), (b) 5.91% due 08/12/32	1,008,414
AUD 1,000,000	6.41% due 09/20/34	1,017,753
AUD 500,000	6.74% due 02/10/38	512,430
AUD 1,000,000	Australia Pacific Airports Melbourne Pty, Ltd. (a) 3.76% due 11/25/31	881,937
AUD 3,390,600	Australian Unity, Ltd. (b) 5.31% due 12/15/24	3,375,681
AUD 500,000	Bank of Queensland, Ltd. (a), (b) 5.22% due 05/19/32	479,595
AUD 2,500,000	Brisbane Airport Corp. Pty, Ltd. (a) 4.50% due 12/30/30	2,349,632
AUD 1,000,000	Centuria Capital No 2 Fund (a), (b) 7.52% due 04/20/26	1,019,100
AUD 500,000	Challenger Life Co., Ltd. (a), (b) 7.19% due 09/16/37	512,584
AUD 500,000	ClearView Wealth, Ltd. (a), (b) 9.36% due 11/05/30	516,500
AUD 1,000,000	Commonwealth Bank of Australia (a), (b) 6.16% due 11/09/32	1,020,291
AUD 1,000,000	6.70% due 03/15/38	1,017,283

	<u>元本</u>	<u>証券の明細</u>	<u>評価額</u>
AUD	1,000,000	Downer Group Finance Pty, Ltd. (a) 3.70% due 04/29/26	937,350
AUD	500,000	Insurance Australia Group, Ltd. (a), (b) 6.11% due 12/15/36	496,985
AUD	500,000	Liberty Financial Pty, Ltd. (b) 7.46% due 03/16/28	497,190
AUD	500,000	6.14% due 03/17/25	489,105
AUD	670,000	Macquarie Bank, Ltd. (a), (b) 6.33% due 06/07/32	676,808
AUD	500,000	Members Equity Bank, Ltd. (a), (b), (c) 8.63%	502,152
AUD	1,000,000	National Australia Bank, Ltd. 6.16% due 03/09/33 (a), (b)	1,016,516
AUD	500,000	6.32% due 08/03/32 (a), (b)	510,107
AUD	1,400,000	7.32% (a), (b), (c)	1,421,910
AUD	1,350,000	New Terminal Financing Co. Pty, Ltd. (b) 4.78% due 07/12/24	1,341,814
AUD	2,250,000	Pacific National Finance Pty, Ltd. 3.80% due 09/08/31 (a)	1,819,186
AUD	1,000,000	5.40% due 05/12/27	985,405
AUD	500,000	Peet, Ltd. (a), (b) 8.57% due 09/30/26	492,750
AUD	500,000	Police & Nurses, Ltd. (a), (b), (c) 9.30%	515,462
AUD	500,000	Qantas Airways, Ltd. (a) 3.15% due 09/27/28	444,024
AUD	1,500,000	Resolution Life Australasia, Ltd. (a), (b) 6.94% due 12/09/35	1,478,955
AUD	500,000	SEEK, Ltd. (a), (b) 7.39% due 06/20/26	498,330
AUD	1,000,000	Shopping Centres Australasia Property Retail Trust (a) 2.45% due 09/24/29	844,636
AUD	500,000	Suncorp Group, Ltd. (a), (b) 6.24% due 12/01/38	498,015
AUD	1,000,000	VER Finco Pty, Ltd. (a) 2.40% due 09/21/28	828,741
AUD	2,000,000	Virgin Australia Holdings Pty, Ltd. (a) 8.00% due 11/26/24	5,000
AUD	2,000,000	8.25% due 05/30/23	5,000
AUD	2,000,000	WestConnex Finance Co. Pty, Ltd. (a) 3.15% due 03/31/31	1,665,904
		<b>社債合計</b>	<b>39,084,843</b>
		<b>オーストラリア合計 (簿価 \$44,928,657)</b>	<b>39,084,843</b>

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α (毎月分配型)

<u>元本</u>		<u>証券の明細</u>	<u>評価額</u>
		フランス (3.1%)	
		社債 (3.1%)	
		Societe Generale S. A. (a), (b), (c)	
AUD	2,000,000	4.88%	1,611,500
		<b>社債合計</b>	<b>1,611,500</b>
		<b>フランス合計 (簿価 \$2,000,000)</b>	<b>1,611,500</b>
		オランダ (2.9%)	
		社債 (2.9%)	
		Cooperatieve Rabobank UA (a), (b)	
AUD	500,000	6.33% due 10/26/32	507,405
AUD	1,000,000	7.07% due 10/26/32	1,029,470
		<b>社債合計</b>	<b>1,536,875</b>
		<b>オランダ合計 (簿価 \$1,506,148)</b>	<b>1,536,875</b>
		ニュージーランド (5.4%)	
		社債 (5.4%)	
		Air New Zealand, Ltd. (a)	
AUD	500,000	6.50% due 05/25/29	516,031
		Avanti Finance, Ltd. (a), (b)	
AUD	500,000	8.38% due 06/08/25	497,500
		Nufarm Finance NZ, Ltd. (a), (b), (c)	
AUD	1,901,800	7.37%	1,792,447
		<b>社債合計</b>	<b>2,805,978</b>
		<b>ニュージーランド合計 (簿価 \$2,497,633)</b>	<b>2,805,978</b>
		スイス (1.6%)	
		社債 (1.6%)	
		UBS Group AG (a), (b), (c)	
AUD	1,000,000	4.38%	840,000
		<b>社債合計</b>	<b>840,000</b>
		<b>スイス合計 (簿価 \$1,000,000)</b>	<b>840,000</b>
		米国 (0.9%)	
		社債 (0.9%)	
		Computershare US, Inc. (a)	
AUD	500,000	3.15% due 11/30/27	457,875
		<b>社債合計</b>	<b>457,875</b>
		<b>米国合計 (簿価 \$452,963)</b>	<b>457,875</b>
		<b>債券 (簿価 \$52,385,401)</b>	<b>46,337,071</b>
		<b>株数/口数</b>	
		普通株式 (0.6%)	
		オーストラリア (0.6%)	
		保険 (0.6%)	
	3,200	Challenger, Ltd.	\$ 320,000
		<b>オーストラリア合計 (簿価 \$320,000)</b>	<b>320,000</b>
		<b>普通株式合計 (簿価 \$320,000)</b>	<b>320,000</b>

株数／口数	証券の明細	評価額
	<b>優先株式 (6.0%)</b>	
	<b>オーストラリア (6.0%)</b>	
	<b>銀行 (2.7%)</b>	
5,000	Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a), (b), (c)	499,005
2,053	Macquarie Bank, Ltd. (a), (b), (c)	215,750
1,850	Macquarie Group, Ltd. (a), (b), (c)	190,291
5,000	MyState, Ltd. (a), (b), (c)	508,039
	<b>総合金融サービス (1.1%)</b>	
5,853	AMP, Ltd. (a), (b), (c)	599,933
	<b>保険 (2.2%)</b>	
2,500	Insurance Australia Group, Ltd. (a), (b), (c)	253,750
10,000	Latitude Group Holdings, Ltd. (a), (b), (c)	905,700
	<b>オーストラリア合計 (簿価 \$3,219,056)</b>	<b>3,172,468</b>
	<b>優先株式合計 (簿価 \$3,219,056)</b>	<b>3,172,468</b>
	<b>MMF (0.6%)</b>	
	<b>オーストラリア (0.6%)</b>	
298,658	Yarra A\$ Cash Reserves Fund Class A	302,560
	<b>オーストラリア合計 (簿価 \$302,549)</b>	<b>302,560</b>
	<b>MMF 合計 (簿価 \$302,549)</b>	<b>302,560</b>
		<b>純資産に 占める割合</b>
	<b>投資総額 (簿価 \$56,227,006)</b>	<b>95.8%</b>
	<b>負債を超過する現金およびその他の資産</b>	<b>4.2%</b>
	<b>純資産</b>	<b>100.0%</b>
		\$ 50,132,099
		2,191,148
		\$ 52,323,247

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) 2023年3月31日時点の変動金利証券。
- (c) 永久債。

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

2023年3月31日現在の先物取引残高（純資産の0.0%\*）：

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	03/2024	34,640,947	35	\$ 61,280
Long	90-Day Bank Bill Futures	12/2023	34,671,711	35	26,274
Long	90-Day Bank Bill Futures	09/2023	34,684,050	35	10,544
Long	90-Day Bank Bill Futures	06/2023	34,605,192	35	85,160
Short	Australian 10-Year Treasury Bond Futures	06/2023	(6,715,112)	(56)	(166,528)
Short	Australian 3-Year Treasury Bond Futures	06/2023	(753,274)	(7)	(8,436)
					\$ 8,294

\*0.05% 未満

2023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-0.4%）：

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	\$ 91	04/27/2023	\$ 6,000,000	\$ (123,897)	\$ (34,550)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	88	06/01/2023	6,000,000	(157,203)	(152,409)
				\$ (281,100)	\$ (186,959)

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 $\alpha$ （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110期の決算日（2023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

2023年4月18日～2023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

2023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。

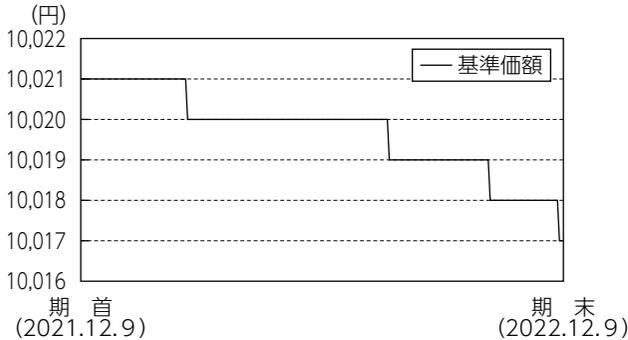
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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)2021年12月9日	10,021	-	-
12月末	10,021	0.0	-
2022年1月1日	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

○国内短期金融市場

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用	-
合 計	-

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2022年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	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。

# 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

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・プルファンド (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+プルベア・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・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
ダイワ米ドル建て7-10年ラダー証券ファンド・マネーポートフォリオ - USトラインブル	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。