

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111期(決算日 2023年11月17日)
第112期(決算日 2023年12月18日)
第113期(決算日 2024年1月17日)
第114期(決算日 2024年2月19日)
第115期(決算日 2024年3月18日)
第116期(決算日 2024年4月17日)

(作成対象期間 2023年10月18日～2024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

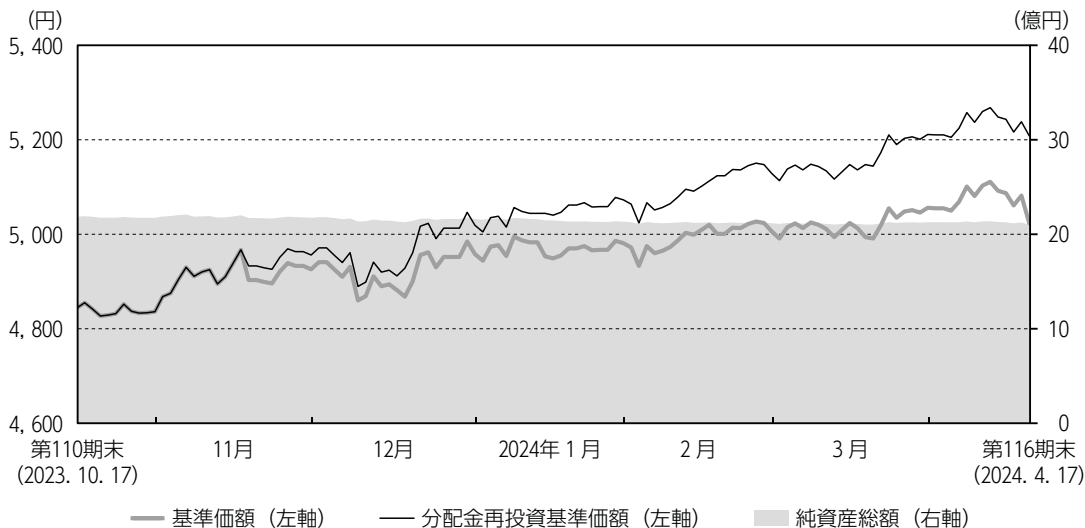
決 算 期	基 準 価 額				公 社 債 率 組 入 比 率	投 資 信 託 券 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分 配 落)	税 込 金	期 騰 落	中 率			
	円	円		%	%	%	百万円
87 期末（2021年11月17日）	4,876	30	△	0.3	—	98.2	2,925
88 期末（2021年12月17日）	4,759	30	△	1.8	—	99.3	2,649
89 期末（2022年 1 月17日）	4,782	30		1.1	—	98.6	2,649
90 期末（2022年 2 月17日）	4,753	30		0.0	—	98.1	2,615
91 期末（2022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
111期末（2023年11月17日）	4,903	30		1.8	—	99.2	2,171
112期末（2023年12月18日）	4,868	30	△	0.1	—	98.1	2,127
113期末（2024年 1 月17日）	4,953	30		2.4	—	98.1	2,146
114期末（2024年 2 月19日）	5,001	30		1.6	—	98.1	2,117
115期末（2024年 3 月18日）	4,994	30		0.5	0.0	99.4	2,102
116期末（2024年 4 月17日）	5,023	30		1.2	0.0	99.0	2,099

(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111期首：4,844円

第116期末：5,023円（既払分配金180円）

騰落率：7.5%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

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		
第111期	(期 首) 2023年10月17日	円 4,844	% —	% —	% 98.5
	10月末	4,836	△ 0.2	—	98.8
	(期 末) 2023年11月17日	4,933	1.8	—	99.2
第112期	(期 首) 2023年11月17日	4,903	—	—	99.2
	11月末	4,926	0.5	—	98.1
	(期 末) 2023年12月18日	4,898	△ 0.1	—	98.1
第113期	(期 首) 2023年12月18日	4,868	—	—	98.1
	12月末	4,958	1.8	—	98.4
	(期 末) 2024年 1 月17日	4,983	2.4	—	98.1
第114期	(期 首) 2024年 1 月17日	4,953	—	—	98.1
	1 月末	4,981	0.6	—	99.4
	(期 末) 2024年 2 月19日	5,031	1.6	—	98.1
第115期	(期 首) 2024年 2 月19日	5,001	—	—	98.1
	2 月末	5,006	0.1	—	98.3
	(期 末) 2024年 3 月18日	5,024	0.5	0.0	99.4
第116期	(期 首) 2024年 3 月18日	4,994	—	0.0	99.4
	3 月末	5,056	1.2	0.0	99.4
	(期 末) 2024年 4 月17日	5,053	1.2	0.0	99.0

（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

（2023. 10. 18 ～ 2024. 4. 17）

■オーストラリア債券市況

オーストラリア10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。

オーストラリア債券市場では、当作成期首より、オーストラリアのCPI（消費者物価指数）が市場予想を上回ったことでRBA（オーストラリア準備銀行）の利上げ再開観測が高まったことなどから、長期金利は上昇（債券価格は下落）して始まりました。2023年12月末にかけては、米国で利下げ観測が高まったことなどを受け米国金利が低下したことに連れて、オーストラリアにおいても長期金利が低下基調で推移しました。2024年1月に入ると一進一退の展開となったものの、当作成期末にかけては、米国における利下げ回数の減少観測や米国CPIが市場予想を上回ったことから米国金利が上昇したことなどを背景に、オーストラリアにおいても長期金利は上昇基調で推移しました。

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券は、投資家による根強い需要などが下支えとなり、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。

豪ドル為替相場は、当作成期首から2023年11月末にかけて、オーストラリアにおけるCPI（消費者物価指数）が市場予想を上回ったことや、日本の7－9月期GDP（国内総生産）が市場予想を下回り日銀の政策修正観測が後退したことなどから、対円で上昇しました。12月に入ると、オーストラリア金利の低下を背景に内外金利差の縮小が意識されたことなどから、豪ドル円は下落（円高）しました。しかしその後は、米国金利の上昇に連れてオーストラリアにおいても金利が上昇したことから、内外金利差の拡大が意識されて豪ドルは上昇基調で推移し、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）は上昇しました。

当作成期首から2024年3月半ばにかけては、日銀の政策修正観測からボラティリティが上昇する場面もありましたが、豪ドル円が上昇基調となったことなどから、ボラティリティは低下しました。しかしその後は、日本政府・日銀による為替介入への警戒感から、豪ドル円のボラティリティは上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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. 10. 18 ～ 2024. 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、短期の国債やコール・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111期	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
	2023年10月18日 ～2023年11月17日	2023年11月18日 ～2023年12月18日	2023年12月19日 ～2024年1月17日	2024年1月18日 ～2024年2月19日	2024年2月20日 ～2024年3月18日	2024年3月19日 ～2024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	0.61	0.60	0.60	0.60	0.59
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)	371	385	401	415	427	440

(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111期	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 46.80円	✓ 44.03円	✓ 46.36円	✓ 44.05円	✓ 41.89円	✓ 42.70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	49.85	50.31	50.75	51.55	52.00	52.49
(d) 分配準備積立金	304.55	320.90	334.49	350.09	363.70	375.10
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	401.21	415.24	431.61	445.70	457.60	470.31
(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)	371.21	385.24	401.61	415.70	427.60	440.31

(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

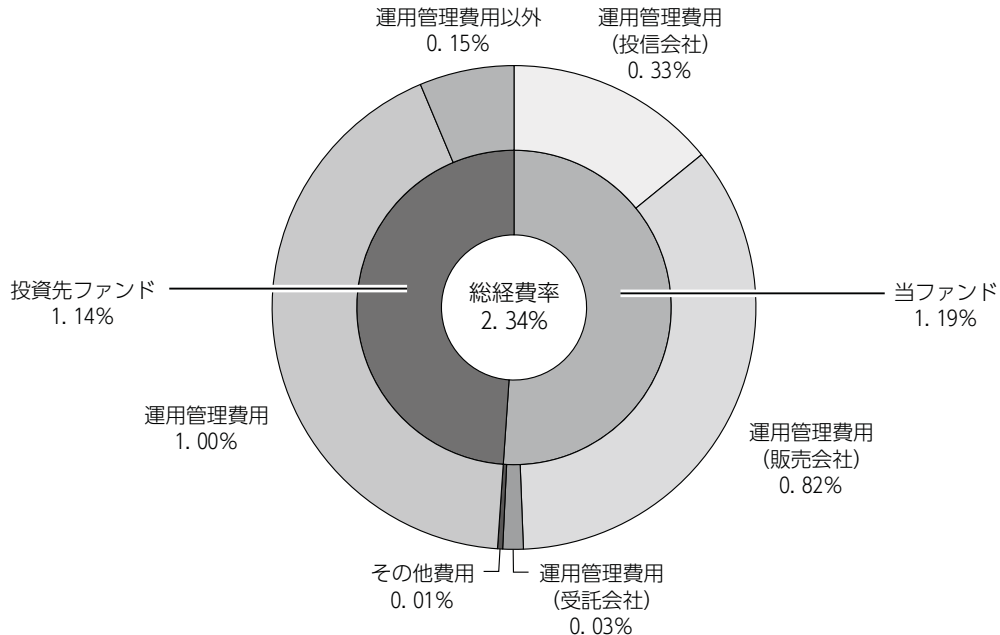
項 目	第111期～第116期 (2023. 10. 18～2024. 4. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	29円	0. 592%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は4, 966円です。
（投 信 会 社）	(8)	(0. 165)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(20)	(0. 412)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(1)	(0. 016)	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	1	0. 011	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）	(1)	(0. 011)	
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	30	0. 607	

- (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2.34%です。



総経費率（①＋②＋③）	2.34%
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	1.00%
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

(1) 投資信託受益証券

(2023年10月18日から2024年 4月17日まで)

決 算 期		第 111 期 ～ 第 116 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国（邦貨建）	DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CURRENCY ALPHA CLASS)（ケイマン諸島）	千口	千円	千口	千円
		2, 624. 66994	123, 970	5, 094. 97857	241, 018

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年10月18日から2024年 4月17日まで)

決 算 期	第 111 期 ～ 第 116 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	—	—	7	8

(注) 単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第110期末	第 116 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	千口	千円
	9	1	1

(注) 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 116 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)	43, 621. 22972	2, 079, 380	99. 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。

■投資信託財産の構成

2024年 4月17日現在

項 目	第 116 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円	%
	2, 079, 380	98. 3
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	1	0. 0
コール・ローン等、その他	35, 441	1. 7
投資信託財産総額	2, 114, 824	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11月17日)、(2023年12月18日)、(2024年1月17日)、(2024年2月19日)、(2024年3月18日)、(2024年4月17日) 現在

項 目	第111期末	第112期末	第113期末	第114期末	第115期末	第116期末
(A) 資産	2,191,392,125円	2,186,254,316円	2,201,182,951円	2,168,784,724円	2,117,127,928円	2,114,824,330円
コール・ローン等	36,211,099	29,329,259	29,308,106	27,260,442	27,984,787	35,441,970
投資信託受益証券（評価額）	2,155,171,064	2,086,705,375	2,106,750,065	2,077,358,542	2,089,133,180	2,079,380,399
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（評価額）	9,962	9,962	9,961	9,961	9,961	1,961
未収入金	—	70,209,720	65,114,819	64,155,779	—	—
(B) 負債	19,834,647	58,267,792	54,707,871	51,612,817	14,826,350	14,959,581
未払金	—	35,104,860	32,557,410	32,077,890	—	—
未払収益分配金	13,285,861	13,115,457	13,000,504	12,700,941	12,628,598	12,542,167
未払解約金	4,334,933	7,840,419	7,001,122	4,493,105	200,760	253,662
未払信託報酬	2,198,593	2,176,696	2,103,875	2,280,102	1,922,875	2,075,236
その他未払費用	15,260	30,360	44,960	60,779	74,117	88,516
(C) 純資産総額（A－B）	2,171,557,478	2,127,986,524	2,146,475,080	2,117,171,907	2,102,301,578	2,099,864,749
元本	4,428,620,336	4,371,819,150	4,333,501,581	4,233,647,152	4,209,532,849	4,180,722,572
次期繰越損益金	△ 2,257,062,858	△ 2,243,832,626	△ 2,187,026,501	△ 2,116,475,245	△ 2,107,231,271	△ 2,080,857,823
(D) 受益権総口数	4,428,620,336□	4,371,819,150□	4,333,501,581□	4,233,647,152□	4,209,532,849□	4,180,722,572□
1万口当り基準価額（C／D）	4,903円	4,868円	4,953円	5,001円	4,994円	5,023円

* 当作成期首における元本額は4,509,802,220円、当作成期間（第111期～第116期）中における追加設定元本額は39,170,626円、同解約元本額は368,250,274円です。

* 第116期末の計算口数当りの純資産額は5,023円です。

* 第116期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,080,857,823円です。

■損益の状況

項 目	第111期 自2023年10月18日 第112期 自2023年11月18日	第112期 自2023年11月17日 第113期 自2023年12月18日	第113期 自2023年12月19日 第114期 自2024年1月18日	第114期 自2024年1月17日 第115期 自2024年2月19日	第115期 自2024年2月20日 第116期 自2024年3月19日	第116期 自2024年3月18日 第117期 自2024年4月17日
(A) 配当等収益	21,881,068円	21,442,377円	20,940,635円	19,955,690円	19,572,658円	19,377,282円
受取配当金	21,881,450	21,442,681	20,941,261	19,955,870	19,572,802	19,376,020
受取利息	1	—	—	—	—	1,263
支払利息	△ 383	△ 304	△ 626	△ 180	△ 144	△ 1
(B) 有価証券売買損益	20,125,036	△ 21,854,742	31,317,209	15,190,192	△ 7,819,191	7,203,347
売買益	20,329,364	365,215	31,574,431	15,213,055	23,247	7,335,152
売買損	△ 204,328	△ 22,219,957	△ 257,222	△ 22,863	△ 7,842,438	△ 131,805
(C) 信託報酬等	△ 2,213,853	△ 2,191,796	△ 2,118,475	△ 2,295,921	△ 1,936,213	△ 2,089,635
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	39,792,251	△ 2,604,161	50,139,369	32,849,961	9,817,254	24,490,994
(E) 前期繰越損益金	△ 1,721,012,037	△ 1,670,407,972	△ 1,669,123,148	△ 1,590,938,460	△ 1,559,923,631	△ 1,549,991,509
(F) 追加信託差損益金	△ 562,557,211	△ 557,705,036	△ 555,042,218	△ 545,685,805	△ 544,496,296	△ 542,815,141
(配当等相当額)	(22,078,872)	(21,995,396)	(21,996,043)	(21,826,866)	(21,891,062)	(21,948,555)
(売買損益相当額)	(△ 584,636,083)	(△ 579,700,432)	(△ 577,038,261)	(△ 567,512,671)	(△ 566,387,358)	(△ 564,763,696)
(G) 合計（D＋E＋F）	△ 2,243,776,997	△ 2,230,717,169	△ 2,174,025,997	△ 2,103,774,304	△ 2,094,602,673	△ 2,068,315,656
(H) 収益分配金	△ 13,285,861	△ 13,115,457	△ 13,000,504	△ 12,700,941	△ 12,628,598	△ 12,542,167
次期繰越損益金（G＋H）	△ 2,257,062,858	△ 2,243,832,626	△ 2,187,026,501	△ 2,116,475,245	△ 2,107,231,271	△ 2,080,857,823
追加信託差損益金	△ 562,557,211	△ 557,705,036	△ 555,042,218	△ 545,685,805	△ 544,496,296	△ 542,815,141
(配当等相当額)	(22,078,872)	(21,995,396)	(21,996,043)	(21,826,866)	(21,891,062)	(21,948,555)
(売買損益相当額)	(△ 584,636,083)	(△ 579,700,432)	(△ 577,038,261)	(△ 567,512,671)	(△ 566,387,358)	(△ 564,763,696)
分配準備積立金	142,316,832	146,428,059	152,042,602	154,169,724	158,111,116	162,133,555
繰越損益金	△ 1,836,822,479	△ 1,832,555,649	△ 1,784,026,885	△ 1,724,959,164	△ 1,720,846,091	△ 1,700,176,237

(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111期	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
(a) 経費控除後の配当等収益	20,727,872円	19,250,581円	20,091,762円	18,652,066円	17,636,445円	17,853,938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	22,078,872	21,995,396	21,996,043	21,826,866	21,891,062	21,948,555
(d) 分配準備積立金	134,874,821	140,292,935	144,951,344	148,218,599	153,103,269	156,821,784
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	177,681,565	181,538,912	187,039,149	188,697,531	192,630,776	196,624,277
(f) 分配金	13,285,861	13,115,457	13,000,504	12,700,941	12,628,598	12,542,167
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	164,395,704	168,423,455	174,038,645	175,996,590	180,002,178	184,082,110
(h) 受益権総口数	4,428,620,336□	4,371,819,150□	4,333,501,581□	4,233,647,152□	4,209,532,849□	4,180,722,572□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金（税込み）	第111期	第112期	第113期	第114期	第115期	第116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
資産合計		53, 852, 360

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
負債合計		1, 529, 113

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

純資産	\$	52, 323, 247
純資産		
クラス A	\$	28, 073, 911
通貨αクラス		24, 249, 336
	\$	52, 323, 247
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
投資収益合計		2,821,266

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
費用合計		627,111

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

純実現利益

1,079,303

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)

評価損益の純変動

(1,143,897)

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
		債券 (88.6%)	
		オーストラリア (74.7%)	
		社債 (74.7%)	
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
		Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (a), (b)	
AUD	1,000,000	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
		Australia Pacific Airports Melbourne Pty, Ltd. (a)	
AUD	1,000,000	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

元本		証券の明細	評価額
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
社債合計			39,084,843
オーストラリア合計（簿価 \$44,928,657）			39,084,843

ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）

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

株数／口数	証券の明細	評価額
	優先株式 (6.0%)	
	オーストラリア (6.0%)	
	銀行 (2.7%)	
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
	総合金融サービス (1.1%)	
5,853	AMP, Ltd. (a), (b), (c)	599,933
	保険 (2.2%)	
2,500	Insurance Australia Group, Ltd. (a), (b), (c)	253,750
10,000	Latitude Group Holdings, Ltd. (a), (b), (c)	905,700
	オーストラリア合計 (簿価 \$3,219,056)	3,172,468
	優先株式合計 (簿価 \$3,219,056)	3,172,468
	MMF (0.6%)	
	オーストラリア (0.6%)	
298,658	Yarra A\$ Cash Reserves Fund Class A	302,560
	オーストラリア合計 (簿価 \$302,549)	302,560
	MMF 合計 (簿価 \$302,549)	302,560
		純資産に占める割合
	投資総額 (簿価 \$56,227,006)	95.8%
	負債を超過する現金およびその他の資産	4.2%
	純資産	100.0%
		\$ 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（2023年12月11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116期の決算日（2024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
公 社 債

(2023年10月18日から2024年4月17日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
1219国庫短期証券 2024/6/24	32,999,307		

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024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（58,846,969千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

作 成 期	2024年4月17日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
区 分					5 年以上	2 年以上	2 年未満
国債証券	千円 33,000,000	千円 32,999,519	% 56.0	% —	% —	% —	% 56.0

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2024年4月17日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日	
国債証券	1219国庫短期証券	% —	千円 33,000,000	千円 32,999,519	2024/06/24	

(注) 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

運用報告書 第15期（決算日 2023年12月11日）

（作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11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。

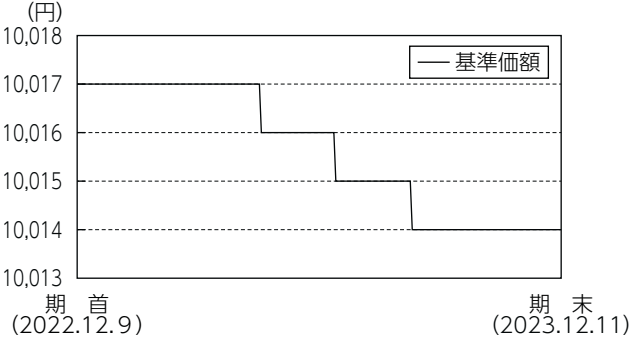
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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		
(期首)2022年12月 9 日	円	%	%
12月末	10,017	0.0	—
2023年 1 月末	10,017	0.0	—
2 月末	10,017	0.0	—
3 月末	10,017	0.0	—
4 月末	10,016	△0.0	—
5 月末	10,016	△0.0	—
6 月末	10,015	△0.0	—
7 月末	10,015	△0.0	—
8 月末	10,014	△0.0	—
9 月末	10,014	△0.0	—
10月末	10,014	△0.0	—
11月末	10,014	△0.0	—
(期末)2023年12月11日	10,014	△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：10,017円 期末：10,014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

2023年12月11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	62,664,638	100.0
投資信託財産総額	62,664,638	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12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	62,664,638,644円
コール・ローン等	62,664,638,644
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	62,664,638,644
元本	62,579,567,123
次期繰越損益金	85,071,521
(D) 受益権総口数	62,579,567,123口
1万口当り基準価額(C／D)	10,014円

* 期首における元本額は44,855,160,815円、当作成期間中における追加設定元本額は94,438,728,484円、同解約元本額は76,714,322,176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：

ダイワミドル・ブルファンド（適格機関投資家専用）	394,341,311円
ダイワミドル・ベアファンド（適格機関投資家専用）	7,178,107,283円
ダイワ・マネーポートフォリオ（FOFs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）	905,310,638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）	1,993,906円
ダイワ／パリュール・パートナーズ チャイナ・ヘルスケア・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）	9,976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）	159,141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	930,471,926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
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）	7,916,611,556円
ダイワJGBベア・ファンド2（適格機関投資家専用）	45,246,139,138円
ダイワ／ロジャーズ国際コモディティT.M.・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.トライアングル -	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10,014円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 25,212,071円
受取利息	17,750
支払利息	△ 25,229,821
(B) その他費用	△ 16,282
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 25,228,353
(D) 前期繰越損益金	78,288,990
(E) 解約差損益金	△121,056,632
(F) 追加信託差損益金	153,067,516
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	85,071,521
次期繰越損益金(G)	85,071,521

(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。