

ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型)

運用報告書 (全体版)

第113期 (決算日 2023年12月18日)

第114期 (決算日 2024年1月17日)

第115期 (決算日 2024年2月19日)

第116期 (決算日 2024年3月18日)

第117期 (決算日 2024年4月17日)

満期償還 (償還日 2024年5月17日)

(作成対象期間 2023年11月18日～2024年5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、相対的に配当利回りの高い英国の株式等へ投資するとともに、オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしており、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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した。

| | | |
|--------|---|---|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／株式 | |
| 信託期間 | 2014年5月30日～2024年5月17日 | |
| 運用方針 | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 | |
| 主要投資対象 | 当ファンド | イ. ケイマン籍の外国投資信託「UBSユニバーサル・トラスト (ケイマン) III - ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド (ツインαクラス)」の受益証券 (円建) ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券 |
| | ダイワ・マネー・マザーファンド | 本邦通貨表示の公社債 |
| 組入制限 | 当ファンドの投資信託証券組入上限比率 | 無制限 |
| | マザーファンドの株式組入上限比率 | 純資産総額の30%以下 |
| 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、分配を行なわないことがあります。 | |

最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | MSCI 英国指数 (税引後配当込み、円換算) | | 英ポンド為替レート | | 公社債 組入比率 | 投資信託 受益証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|----------------------|------------|---------------|-----------------------|---------------------------------|---------------------------------|-----------|-----------------------|-------------|----------------------|------------|
| | (分配落) 円 | 税金 込み 円 | 期 騰 落 率 % | (参考指数) 期 騰 落 率 % | (参考指数) 期 騰 落 率 % | 円 | 期 騰 落 率 % | | | |
| 89 期末(2021年12月17日) | 2,357 | 25 | 1.0 | 12,199 | △ 2.0 | 151.72 | △1.6 | — | 99.2 | 百万円 723 |
| 90 期末(2022年 1 月17日) | 2,450 | 25 | 5.0 | 13,130 | 7.6 | 156.35 | 3.1 | — | 98.5 | 749 |
| 91 期末(2022年 2 月17日) | 2,470 | 25 | 1.8 | 13,318 | 1.4 | 156.94 | 0.4 | — | 98.6 | 752 |
| 92 期末(2022年 3 月17日) | 2,385 | 25 | △2.4 | 12,927 | △ 2.9 | 156.57 | △0.2 | — | 98.6 | 722 |
| 93 期末(2022年 4 月18日) | 2,594 | 25 | 9.8 | 14,392 | 11.3 | 165.23 | 5.5 | — | 98.4 | 784 |
| 94 期末(2022年 5 月17日) | 2,456 | 25 | △4.4 | 13,708 | △ 4.8 | 159.47 | △3.5 | — | 98.9 | 730 |
| 95 期末(2022年 6 月17日) | 2,412 | 25 | △0.8 | 13,398 | △ 2.3 | 164.22 | 3.0 | — | 98.6 | 708 |
| 96 期末(2022年 7 月19日) | 2,428 | 25 | 1.7 | 13,820 | 3.2 | 164.99 | 0.5 | — | 98.6 | 713 |
| 97 期末(2022年 8 月17日) | 2,477 | 25 | 3.0 | 14,222 | 2.9 | 162.62 | △1.4 | — | 98.4 | 728 |
| 98 期末(2022年 9 月20日) | 2,423 | 25 | △1.2 | 13,835 | △ 2.7 | 163.75 | 0.7 | — | 98.4 | 710 |
| 99 期末(2022年10月17日) | 2,331 | 25 | △2.8 | 13,399 | △ 3.1 | 166.80 | 1.9 | — | 99.3 | 684 |
| 100 期末(2022年11月17日) | 2,403 | 25 | 4.2 | 14,303 | 6.7 | 166.13 | △0.4 | — | 98.5 | 695 |
| 101 期末(2022年12月19日) | 2,415 | 25 | 1.5 | 14,279 | △ 0.2 | 165.82 | △0.2 | — | 98.5 | 694 |
| 102 期末(2023年 1 月17日) | 2,343 | 25 | △1.9 | 14,467 | 1.3 | 156.75 | △5.5 | — | 99.1 | 631 |
| 103 期末(2023年 2 月17日) | 2,401 | 25 | 3.5 | 15,162 | 4.8 | 160.78 | 2.6 | — | 98.5 | 642 |
| 104 期末(2023年 3 月17日) | 2,239 | 25 | △5.7 | 14,179 | △ 6.5 | 161.68 | 0.6 | — | 98.4 | 598 |
| 105 期末(2023年 4 月17日) | 2,339 | 25 | 5.6 | 15,546 | 9.6 | 166.04 | 2.7 | — | 98.6 | 625 |
| 106 期末(2023年 5 月17日) | 2,318 | 25 | 0.2 | 15,748 | 1.3 | 170.42 | 2.6 | — | 99.4 | 611 |
| 107 期末(2023年 6 月19日) | 2,356 | 25 | 2.7 | 16,600 | 5.4 | 182.02 | 6.8 | — | 98.5 | 601 |
| 108 期末(2023年 7 月18日) | 2,281 | 25 | △2.1 | 16,049 | △ 3.3 | 181.70 | △0.2 | — | 98.6 | 580 |
| 109 期末(2023年 8 月17日) | 2,278 | 25 | 1.0 | 16,462 | 2.6 | 186.36 | 2.6 | — | 99.3 | 582 |
| 110 期末(2023年 9 月19日) | 2,312 | 25 | 2.6 | 16,908 | 2.7 | 182.93 | △1.8 | — | 98.5 | 589 |
| 111 期末(2023年10月17日) | 2,291 | 25 | 0.2 | 16,928 | 0.1 | 182.65 | △0.2 | — | 98.3 | 583 |
| 112 期末(2023年11月17日) | 2,265 | 25 | △0.0 | 16,885 | △ 0.3 | 187.17 | 2.5 | — | 98.8 | 566 |
| 113 期末(2023年12月18日) | 2,210 | 25 | △1.3 | 16,644 | △ 1.4 | 180.35 | △3.6 | — | 98.7 | 548 |
| 114 期末(2024年 1 月17日) | 2,249 | 25 | 2.9 | 17,219 | 3.5 | 186.33 | 3.3 | — | 98.5 | 556 |
| 115 期末(2024年 2 月19日) | 2,267 | 25 | 1.9 | 17,877 | 3.8 | 189.35 | 1.6 | — | 98.8 | 555 |
| 116 期末(2024年 3 月18日) | 2,264 | 25 | 1.0 | 18,117 | 1.3 | 190.13 | 0.4 | 0.0 | 98.5 | 545 |
| 117 期末(2024年 4 月17日) | 2,299 | 25 | 2.7 | 18,608 | 2.7 | 192.39 | 1.2 | 0.0 | 99.0 | 536 |
| 償 還(2024年 5 月17日) | 2,271.89 | — | △1.2 | 20,659 | 11.0 | 197.04 | 2.4 | — | — | 525 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI 英国指数 (税引後配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCI 英国指数 (税引後配当込み、英ポンドベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCI 英国指数 (税引後配当込み、英ポンドベース) は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI に帰属します。またMSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCI によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCI は本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。(https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html)

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。

(注5) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注6) 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7) 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。



運用経過

基準価額等の推移について



* 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

設定時：10,000円

償還時：2,271円89銭（既払分配金7,730円）

騰落率：23.7%（分配金再投資ベース）

■ 基準価額の主な変動要因

英国株式市況の上昇や英ポンドの対円での上昇（円安）、また株式および通貨のカバードコール戦略におけるオプションプレミアムの獲得を背景に、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型)

| | 年 月 日 | 基 準 価 額 | | M S C I 英 国 指 数 (税引後配当込み、円換算) | | 英ポンド為替レート | | 公 社 債 組入比率 | 投資信託 受益証券 組入比率 |
|-------|------------------|------------|--------|----------------------------------|--------|-------------|--------|---------------|----------------------|
| | | | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | |
| 第113期 | (期首) 2023年11月17日 | 円 2,265 | % - | 16,885 | % - | 円 187.17 | % - | % - | % 98.8 |
| | 11月末 | 2,284 | 0.8 | 16,900 | 0.1 | 186.84 | △0.2 | - | 98.6 |
| | (期末) 2023年12月18日 | 2,235 | △1.3 | 16,644 | △ 1.4 | 180.35 | △3.6 | - | 98.7 |
| 第114期 | (期首) 2023年12月18日 | 2,210 | - | 16,644 | - | 180.35 | - | - | 98.7 |
| | 12月末 | 2,238 | 1.3 | 17,017 | 2.2 | 180.68 | 0.2 | - | 98.5 |
| | (期末) 2024年 1月17日 | 2,274 | 2.9 | 17,219 | 3.5 | 186.33 | 3.3 | - | 98.5 |
| 第115期 | (期首) 2024年 1月17日 | 2,249 | - | 17,219 | - | 186.33 | - | - | 98.5 |
| | 1月末 | 2,268 | 0.8 | 17,529 | 1.8 | 187.33 | 0.5 | - | 98.8 |
| | (期末) 2024年 2月19日 | 2,292 | 1.9 | 17,877 | 3.8 | 189.35 | 1.6 | - | 98.8 |
| 第116期 | (期首) 2024年 2月19日 | 2,267 | - | 17,877 | - | 189.35 | - | - | 98.8 |
| | 2月末 | 2,257 | △0.4 | 17,846 | △ 0.2 | 190.75 | 0.7 | - | 98.5 |
| | (期末) 2024年 3月18日 | 2,289 | 1.0 | 18,117 | 1.3 | 190.13 | 0.4 | 0.0 | 98.5 |
| 第117期 | (期首) 2024年 3月18日 | 2,264 | - | 18,117 | - | 190.13 | - | 0.0 | 98.5 |
| | 3月末 | 2,325 | 2.7 | 18,766 | 3.6 | 191.22 | 0.6 | 0.0 | 99.0 |
| | (期末) 2024年 4月17日 | 2,324 | 2.7 | 18,608 | 2.7 | 192.39 | 1.2 | 0.0 | 99.0 |
| 償 還 期 | (期首) 2024年 4月17日 | 2,299 | - | 18,608 | - | 192.39 | - | 0.0 | 99.0 |
| | 4月末 | 2,295 | △0.2 | 19,890 | 6.9 | 197.02 | 2.4 | - | 5.4 |
| | (償還) 2024年 5月17日 | 2,271.89 | △1.2 | 20,659 | 11.0 | 197.04 | 2.4 | - | - |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2014.5.30～2024.5.17)

■英国株式市況

英国株式市況は上昇しました。

英国株式市況は、2015年5月以降、ギリシャの政局混乱や、中国・人民元の切下げを受けた中国景気の減速懸念などから、2016年2月にかけて下落しました。また、英国の国民投票でEU（欧州連合）からの離脱が選択されたことも、相場の重しとなりました。しかし、2016年末にかけては、好調な中国の経済指標や、英ポンドの下落を背景とした輸出関連企業の上昇から値を戻しました。2017年は、ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持するとの見方や、世界景気の拡大基調が支援材料となり、上昇しました。2018年から2019年にかけては、米中貿易摩擦や世界的な景気減速が懸念される一方で、英国のEU離脱期限の延長や金融緩和期待など好悪材料が入り交じり、おおむね横ばい圏で推移しました。2020年は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大やそれを受けた世界経済の減速懸念から大きく下落しましたが、2021年以降は、景気回復期待が株式市況の追い風となり、株式市況は反発しました。2023年は、急速な利上げによる景気後退懸念が上値を抑え、おおむね横ばい圏で推移しました。2024年は、AI（人工知能）関連企業への業績期待などを背景に上昇しました。

■為替相場

英ポンドは対円で上昇（円安）しました。

当ファンド設定時から2015年半ばにかけて、日銀による金融緩和政策の発表を背景に、日英金利差の拡大が意識されたことなどから、英ポンドは対円で上昇しました。2015年後半から2016年にかけては、中国景気の悪化懸念や国民投票における英国のEU（欧州連合）離脱派の勝利などからリスク回避の姿勢が強まり、英ポンドは対円で大きく下落（円高）しました。その後、中国景気悪化の過度な懸念は後退した一方で、EU離脱交渉をめぐる政治的不透明感の継続などが嫌気され、2016年から2019年まで英ポンドは対円でおおむね横ばい圏で推移しました。2020年には、新型コロナウイルスの感染拡大などをを受けて英ポンドが一時的に下落する局面も見られましたが、2024年にかけては、世界経済の回復や英国と日本の金融政策の方向性の違いなどが意識され、英ポンドは対円で上昇しました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

主として、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」の組入比率を高位に維持し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

※ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）：UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ－ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）（2024年3月に名称変更をしました。）

■ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド (ツインαクラス)

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および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を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・マネー・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。

信託期間中のポートフォリオについて

(2014.5.30~2024.5.17)

■当ファンド

当ファンドは、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド (ツインαクラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズです。主として、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド (ツインαクラス)」を通じて、相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および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を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

■ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド (ツインαクラス)

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および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を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

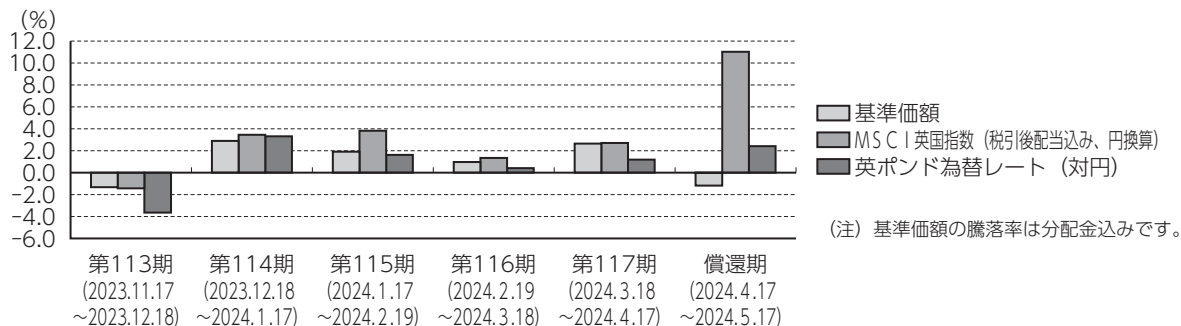
■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・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を設けておりません。

以下のグラフは、当作成期における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

1万口当り、第1期～第48期各110円、第49期～第55期各75円、第56期～第70期各50円、第71期～第117期各25円の収益分配を行いました。

また、第113期～第117期の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いたしました。

■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目 | 第113期 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 |
|----------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 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） | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 対基準価額比率（％） | 1.12 | 1.10 | 1.09 | 1.09 | 1.08 |
| 当期の収益（円） | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 当期の収益以外（円） | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 1,498 | 1,508 | 1,513 | 1,518 | 1,524 |

(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却等損益」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113期 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 |
|----------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | ✓ 35.84円 | ✓ 34.37円 | ✓ 29.87円 | ✓ 30.74円 | ✓ 30.63円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売却等損益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| (c) 収益調整金 | 711.03 | 713.86 | 716.53 | 718.78 | 721.05 |
| (d) 分配準備積立金 | 777.02 | 785.03 | 791.75 | 794.37 | 797.84 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 1,523.90 | 1,533.28 | 1,538.15 | 1,543.90 | 1,549.53 |
| (f) 分配金 | 25.00 | 25.00 | 25.00 | 25.00 | 25.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f) | 1,498.90 | 1,508.28 | 1,513.15 | 1,518.90 | 1,524.53 |

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 第113期～償還期 (2023.11.18～2024.5.17) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|-------------------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 15円 | 0.666% | 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2,277円です。 |
| （投 信 会 社） | (5) | (0.217) | 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） | (10) | (0.436) | 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） | (0) | (0.013) | 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 | 5 | 0.223 | 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） | (5) | (0.223) | |
| 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 | － | － | 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 |
| 合 計 | 20 | 0.889 | |

(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。

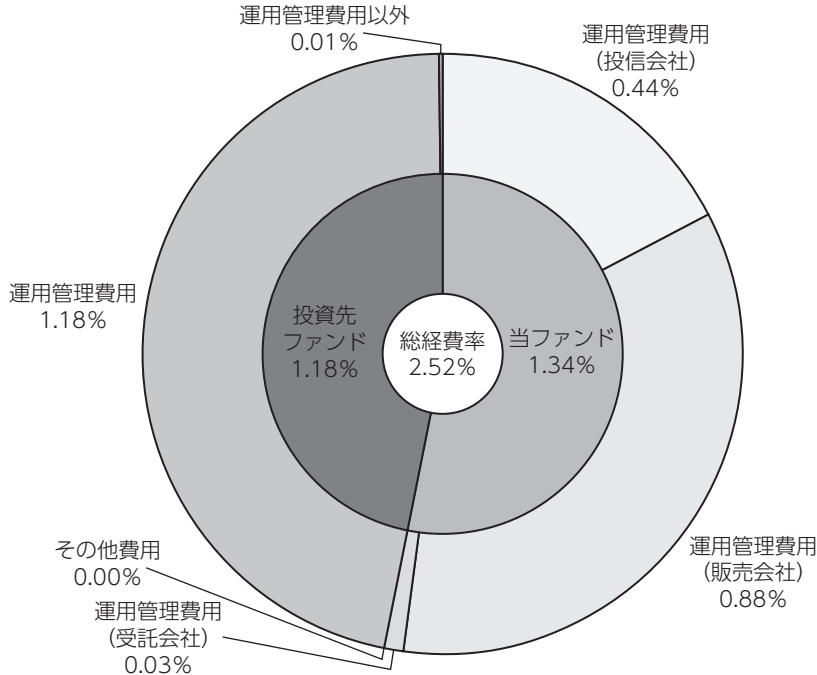
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.52%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 2.52% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.34% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 1.18% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.01% |

(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。

ダイワ英国高配当株ツイン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11月18日から2024年5月17日まで)

| 決 算 期 | | 第 113 期 ~ 償 還 期 | | | |
|---------|---|-------------------|--------------|--------------------|---------------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外国（邦貨建） | UK HIGH DIVIDEND EQUITY FUND TWIN ALPHA CLASS（ケイマン諸島） | 千□ 2,603.39055 | 千円 42,002 | 千□ 36,863.64981 | 千円 596,048 |

(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11月18日から2024年5月17日まで)

| 決 算 期 | 第 113 期 ~ 償 還 期 | | | |
|-----------------|-----------------|-----|-----|-----|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | - | - | 98 | 99 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年5月17日現在

| 項 目 | 償 還 時 | |
|--------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 528,395 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 528,395 | 100.0 |

(注) 評価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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

| 種 類 | 第 112 期 末 | |
|-----------------|-----------|----|
| | □ 数 | 千□ |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 98 | |

(注) 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)、(2024年5月17日)現在

| 項 目 | 第 113 期 末 | 第 114 期 末 | 第 115 期 末 | 第 116 期 末 | 第 117 期 末 | 償 還 時 |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 資産 | 556,219,314円 | 564,648,940円 | 564,291,594円 | 553,022,520円 | 545,796,123円 | 528,395,581円 |
| コール・ローン等 | 14,956,623 | 15,745,159 | 15,100,185 | 15,012,670 | 14,658,466 | 528,392,008 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 541,163,015 | 548,804,105 | 549,091,733 | 537,910,174 | 531,037,981 | - |
| ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額) | 99,676 | 99,676 | 99,676 | 99,676 | 99,676 | - |
| 未収利息 | - | - | - | - | - | 3,573 |
| (B) 負債 | 7,843,406 | 7,686,582 | 8,392,766 | 7,195,701 | 9,331,093 | 3,191,418 |
| 未払収益分配金 | 6,203,530 | 6,190,317 | 6,128,989 | 6,026,783 | 5,832,525 | - |
| 未払解約金 | 991,167 | 877,539 | 1,587,882 | 600,535 | 2,887,582 | 2,582,158 |
| 未払信託報酬 | 648,709 | 618,726 | 675,895 | 568,383 | 610,986 | 609,260 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 548,375,908 | 556,962,358 | 555,898,828 | 545,826,819 | 536,465,030 | 525,204,163 |
| 元本 | 2,481,412,217 | 2,476,126,864 | 2,451,595,867 | 2,410,713,234 | 2,333,010,076 | 2,311,751,541 |
| 次期繰越増益金 | △1,933,036,309 | △1,919,164,506 | △1,895,697,039 | △1,864,886,415 | △1,796,545,046 | - |
| 償還差増益金 | - | - | - | - | - | △1,786,547,378 |
| (D) 受益権総口数 | 2,481,412,217口 | 2,476,126,864口 | 2,451,595,867口 | 2,410,713,234口 | 2,333,010,076口 | 2,311,751,541口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 2,210円 | 2,249円 | 2,267円 | 2,264円 | 2,299円 | - |
| 1万口当り償還価額(C/D) | - | - | - | - | - | 2,271円89銭 |

* 当作成期首における元本額は2,502,594,452円、当作成期間(第113期～償還期)中における追加設定元本額は46,045,023円、同解約元本額は236,887,934円です。

* 償還時の計算口数当りの償還価額は2,271円89銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,786,547,378円です。

■損益の状況

第113期 自2023年11月18日 至2023年12月18日 第116期 自2024年2月20日 至2024年3月18日
 第114期 自2023年12月19日 至2024年1月17日 第117期 自2024年3月19日 至2024年4月17日
 第115期 自2024年1月18日 至2024年2月19日 償還期 自2024年4月18日 至2024年5月17日

| 項 目 | 第 113 期 | 第 114 期 | 第 115 期 | 第 116 期 | 第 117 期 | 償 還 期 |
|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 9,542,413円 | 8,842,647円 | 7,791,327円 | 7,980,223円 | 7,458,519円 | 30,977円 |
| 受取配当金 | 9,542,485 | 8,842,752 | 7,791,362 | 7,980,240 | 7,458,086 | - |
| 受取利息 | - | - | - | - | 433 | 30,977 |
| 支払利息 | △ 72 | △ 105 | △ 35 | △ 17 | - | - |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 16,341,794 | 7,719,939 | 3,468,900 | △ 2,186,584 | 7,216,680 | △ 5,793,986 |
| 売買益 | 58,523 | 7,756,039 | 3,543,700 | 57,182 | 7,414,581 | 198,506 |
| 売買損 | △ 16,400,317 | △ 36,100 | △ 74,800 | △ 2,243,766 | △ 197,901 | △ 5,992,492 |
| (C) 信託報酬等 | △ 648,709 | △ 618,726 | △ 675,895 | △ 568,383 | △ 610,986 | △ 609,260 |
| (D) 当期増益金(A+B+C) | △ 7,448,090 | 15,943,860 | 10,584,332 | 5,225,256 | 14,064,213 | △ 6,372,269 |
| (E) 前期繰越増益金 | △1,108,667,202 | △1,115,905,999 | △1,091,526,825 | △1,065,918,866 | △1,029,407,356 | △1,009,077,736 |
| (F) 追加信託差増益金 | △ 810,717,487 | △ 813,012,050 | △ 808,625,557 | △ 798,166,022 | △ 775,369,378 | △ 771,097,373 |
| (配当等相当額) | (176,438,055) | (176,763,196) | (175,664,216) | (173,278,262) | (168,222,902) | (167,202,731) |
| (売買損益相当額) | (△ 987,155,542) | (△ 989,775,246) | (△ 984,289,773) | (△ 971,444,284) | (△ 943,592,280) | (△ 938,300,104) |
| (G) 合計(D+E+F) | △1,926,832,779 | △1,912,974,189 | △1,889,568,050 | △1,858,859,632 | △1,790,712,521 | △1,786,547,378 |
| (H) 収益分配金 | △ 6,203,530 | △ 6,190,317 | △ 6,128,989 | △ 6,026,783 | △ 5,832,525 | - |
| 次期繰越増益金(G+H) | △1,933,036,309 | △1,919,164,506 | △1,895,697,039 | △1,864,886,415 | △1,796,545,046 | - |
| 追加信託差増益金 | △ 810,717,487 | △ 813,012,050 | △ 808,625,557 | △ 798,166,022 | △ 775,369,378 | - |
| (配当等相当額) | (176,438,055) | (176,763,196) | (175,664,216) | (173,278,262) | (168,222,902) | (-) |
| (売買損益相当額) | (△ 987,155,542) | (△ 989,775,246) | (△ 984,289,773) | (△ 971,444,284) | (△ 943,592,280) | (-) |
| 分配準備積立金 | 195,501,533 | 196,706,448 | 195,300,265 | 192,885,102 | 187,453,627 | - |
| 繰越増益金 | △1,317,820,355 | △1,302,858,904 | △1,282,371,747 | △1,259,605,495 | △1,208,629,295 | (-) |
| 償還差増益金(G) | - | - | - | - | - | △1,786,547,378 |

(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) 追加信託差増益金とは、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) 第113期～第117期の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 113 期 | 第 114 期 | 第 115 期 | 第 116 期 | 第 117 期 |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 8,893,704円 | 8,512,309円 | 7,323,675円 | 7,411,840円 | 7,148,016円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 176,438,055 | 176,763,196 | 175,664,216 | 173,278,262 | 168,222,902 |
| (d) 分配準備積立金 | 192,811,359 | 194,384,456 | 194,105,579 | 191,500,045 | 186,138,136 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 378,143,118 | 379,659,961 | 377,093,470 | 372,190,147 | 361,509,054 |
| (f) 分配金 | 6,203,530 | 6,190,317 | 6,128,989 | 6,026,783 | 5,832,525 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e-f) | 371,939,588 | 373,469,644 | 370,964,481 | 366,163,364 | 355,676,529 |
| (h) 受益権総口数 | 2,481,412,217口 | 2,476,126,864口 | 2,451,595,867口 | 2,410,713,234口 | 2,333,010,076口 |

投資信託財産運用総括表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2014年5月30日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|-------|-----------------|----------------|------------------|--------------|----------------|
| | 投資信託契約終了日 | 2024年5月17日 | | 資産総額 | 528,395,581円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 3,191,418円 |
| | | | | 純資産総額 | 525,204,163円 |
| 受益権口数 | 12,975,867,512口 | 2,311,751,541口 | △10,664,115,971口 | 受益権口数 | 2,311,751,541口 |
| 元本額 | 12,975,867,512円 | 2,311,751,541円 | △10,664,115,971円 | 1単位当り償還金 | 2,271円89銭 |

毎計算期末の状況

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|------|----------------|----------------|--------|----------|------|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第1期 | 15,200,035,732 | 14,838,934,802 | 9,762 | 110 | 1.10 |
| 第2期 | 15,836,649,762 | 15,770,682,342 | 9,958 | 110 | 1.10 |
| 第3期 | 16,341,074,761 | 14,667,163,361 | 8,976 | 110 | 1.10 |
| 第4期 | 16,882,964,040 | 16,628,443,498 | 9,849 | 110 | 1.10 |
| 第5期 | 17,123,244,444 | 16,382,430,222 | 9,567 | 110 | 1.10 |
| 第6期 | 16,981,667,006 | 15,980,082,758 | 9,410 | 110 | 1.10 |
| 第7期 | 17,056,082,613 | 16,764,813,211 | 9,829 | 110 | 1.10 |
| 第8期 | 16,891,919,177 | 16,516,107,131 | 9,778 | 110 | 1.10 |
| 第9期 | 16,978,621,460 | 16,696,721,275 | 9,834 | 110 | 1.10 |
| 第10期 | 16,247,400,549 | 16,413,373,377 | 10,102 | 110 | 1.10 |
| 第11期 | 15,715,561,719 | 15,593,303,592 | 9,922 | 110 | 1.10 |
| 第12期 | 14,834,360,995 | 14,834,393,805 | 10,000 | 110 | 1.10 |
| 第13期 | 14,261,754,229 | 13,914,192,541 | 9,756 | 110 | 1.10 |
| 第14期 | 13,819,630,274 | 12,464,161,210 | 9,019 | 110 | 1.10 |
| 第15期 | 13,015,709,531 | 11,660,037,888 | 8,958 | 110 | 1.10 |
| 第16期 | 12,836,466,865 | 11,425,140,326 | 8,901 | 110 | 1.10 |

ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型)

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1 単位当り分配金 | |
|------|----------------|----------------|-------|-----------|------|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第17期 | 12,423,043,390 | 10,721,023,174 | 8,630 | 110 | 1.10 |
| 第18期 | 12,203,799,902 | 9,206,780,347 | 7,544 | 110 | 1.10 |
| 第19期 | 11,766,013,086 | 8,552,548,926 | 7,269 | 110 | 1.10 |
| 第20期 | 11,444,367,259 | 8,417,604,405 | 7,355 | 110 | 1.10 |
| 第21期 | 11,100,537,895 | 7,918,817,475 | 7,134 | 110 | 1.10 |
| 第22期 | 10,707,819,715 | 7,380,461,767 | 6,893 | 110 | 1.10 |
| 第23期 | 10,137,135,592 | 6,257,146,286 | 6,172 | 110 | 1.10 |
| 第24期 | 9,559,635,760 | 6,023,455,875 | 6,301 | 110 | 1.10 |
| 第25期 | 9,309,060,937 | 5,570,427,678 | 5,984 | 110 | 1.10 |
| 第26期 | 8,824,762,476 | 5,177,339,503 | 5,867 | 110 | 1.10 |
| 第27期 | 8,459,959,358 | 4,868,198,260 | 5,754 | 110 | 1.10 |
| 第28期 | 8,268,936,808 | 4,770,481,461 | 5,769 | 110 | 1.10 |
| 第29期 | 7,998,926,231 | 4,893,999,139 | 6,118 | 110 | 1.10 |
| 第30期 | 7,860,389,833 | 4,556,667,090 | 5,797 | 110 | 1.10 |
| 第31期 | 7,674,229,850 | 4,489,766,684 | 5,850 | 110 | 1.10 |
| 第32期 | 7,499,412,361 | 4,359,838,348 | 5,814 | 110 | 1.10 |
| 第33期 | 7,309,765,738 | 4,121,947,727 | 5,639 | 110 | 1.10 |
| 第34期 | 7,134,899,639 | 4,205,102,156 | 5,894 | 110 | 1.10 |
| 第35期 | 7,068,004,402 | 3,994,593,481 | 5,652 | 110 | 1.10 |
| 第36期 | 7,026,975,279 | 3,949,044,813 | 5,620 | 110 | 1.10 |
| 第37期 | 7,091,115,229 | 3,847,545,620 | 5,426 | 110 | 1.10 |
| 第38期 | 7,748,235,232 | 4,123,288,902 | 5,322 | 110 | 1.10 |
| 第39期 | 7,798,847,472 | 4,231,089,750 | 5,425 | 110 | 1.10 |
| 第40期 | 7,778,933,951 | 4,035,930,994 | 5,188 | 110 | 1.10 |
| 第41期 | 7,741,589,156 | 4,018,078,651 | 5,190 | 110 | 1.10 |
| 第42期 | 7,695,261,620 | 4,056,503,604 | 5,271 | 110 | 1.10 |
| 第43期 | 7,794,185,468 | 3,724,987,294 | 4,779 | 110 | 1.10 |
| 第44期 | 7,816,013,429 | 3,589,049,437 | 4,592 | 110 | 1.10 |
| 第45期 | 7,841,611,602 | 3,611,009,496 | 4,605 | 110 | 1.10 |
| 第46期 | 7,785,969,908 | 3,550,289,274 | 4,560 | 110 | 1.10 |
| 第47期 | 7,929,696,261 | 3,507,099,937 | 4,423 | 110 | 1.10 |
| 第48期 | 7,939,393,745 | 3,422,012,738 | 4,310 | 110 | 1.10 |
| 第49期 | 8,007,808,016 | 3,267,452,529 | 4,080 | 75 | 0.75 |
| 第50期 | 7,716,837,843 | 3,113,271,543 | 4,034 | 75 | 0.75 |
| 第51期 | 7,472,258,649 | 2,924,250,816 | 3,913 | 75 | 0.75 |

ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型）

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1 単位当り分配金 | |
|------|---------------|---------------|-------|-----------|------|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第52期 | 7,487,531,791 | 2,832,110,516 | 3,782 | 75 | 0.75 |
| 第53期 | 7,377,221,835 | 2,641,528,315 | 3,581 | 75 | 0.75 |
| 第54期 | 7,375,147,353 | 2,652,025,674 | 3,596 | 75 | 0.75 |
| 第55期 | 7,171,818,017 | 2,605,661,031 | 3,633 | 75 | 0.75 |
| 第56期 | 6,823,353,722 | 2,548,321,544 | 3,735 | 50 | 0.50 |
| 第57期 | 6,663,186,358 | 2,503,057,378 | 3,757 | 50 | 0.50 |
| 第58期 | 6,525,819,006 | 2,220,900,825 | 3,403 | 50 | 0.50 |
| 第59期 | 6,359,281,073 | 2,053,576,602 | 3,229 | 50 | 0.50 |
| 第60期 | 6,167,673,205 | 1,979,769,237 | 3,210 | 50 | 0.50 |
| 第61期 | 5,877,320,051 | 1,718,529,281 | 2,924 | 50 | 0.50 |
| 第62期 | 5,727,189,430 | 1,729,425,289 | 3,020 | 50 | 0.50 |
| 第63期 | 5,485,196,216 | 1,644,475,324 | 2,998 | 50 | 0.50 |
| 第64期 | 5,373,329,945 | 1,628,777,123 | 3,031 | 50 | 0.50 |
| 第65期 | 5,152,850,842 | 1,610,708,684 | 3,126 | 50 | 0.50 |
| 第66期 | 5,139,353,592 | 1,598,223,564 | 3,110 | 50 | 0.50 |
| 第67期 | 5,103,854,453 | 1,519,682,107 | 2,978 | 50 | 0.50 |
| 第68期 | 4,746,517,065 | 907,262,814 | 1,911 | 50 | 0.50 |
| 第69期 | 4,654,580,772 | 998,165,245 | 2,144 | 50 | 0.50 |
| 第70期 | 4,666,008,948 | 987,553,013 | 2,116 | 50 | 0.50 |
| 第71期 | 4,635,667,683 | 1,026,372,672 | 2,214 | 25 | 0.25 |
| 第72期 | 4,491,603,761 | 992,111,242 | 2,209 | 25 | 0.25 |
| 第73期 | 4,312,729,725 | 946,056,435 | 2,194 | 25 | 0.25 |
| 第74期 | 4,225,453,970 | 897,155,892 | 2,123 | 25 | 0.25 |
| 第75期 | 4,117,529,337 | 847,740,020 | 2,059 | 25 | 0.25 |
| 第76期 | 4,062,701,328 | 882,394,832 | 2,172 | 25 | 0.25 |
| 第77期 | 4,001,511,990 | 888,927,612 | 2,221 | 25 | 0.25 |
| 第78期 | 3,798,799,875 | 865,565,577 | 2,279 | 25 | 0.25 |
| 第79期 | 3,580,964,441 | 832,031,313 | 2,323 | 25 | 0.25 |
| 第80期 | 3,534,725,563 | 851,330,669 | 2,408 | 25 | 0.25 |
| 第81期 | 3,446,549,468 | 835,888,781 | 2,425 | 25 | 0.25 |
| 第82期 | 3,385,118,004 | 842,795,870 | 2,490 | 25 | 0.25 |
| 第83期 | 3,352,900,206 | 844,591,792 | 2,519 | 25 | 0.25 |
| 第84期 | 3,248,414,809 | 781,012,243 | 2,404 | 25 | 0.25 |
| 第85期 | 3,219,179,115 | 771,887,490 | 2,398 | 25 | 0.25 |
| 第86期 | 3,200,734,914 | 749,761,732 | 2,342 | 25 | 0.25 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1 単位当り分配金 | |
|-------|---------------|-------------|-------|-----------|------|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第87期 | 3,183,474,295 | 764,132,407 | 2,400 | 25 | 0.25 |
| 第88期 | 3,091,314,433 | 729,335,534 | 2,359 | 25 | 0.25 |
| 第89期 | 3,067,112,007 | 723,022,643 | 2,357 | 25 | 0.25 |
| 第90期 | 3,058,438,586 | 749,211,903 | 2,450 | 25 | 0.25 |
| 第91期 | 3,045,188,351 | 752,122,013 | 2,470 | 25 | 0.25 |
| 第92期 | 3,031,113,785 | 722,782,693 | 2,385 | 25 | 0.25 |
| 第93期 | 3,022,235,424 | 784,000,743 | 2,594 | 25 | 0.25 |
| 第94期 | 2,974,045,142 | 730,335,055 | 2,456 | 25 | 0.25 |
| 第95期 | 2,936,393,759 | 708,251,968 | 2,412 | 25 | 0.25 |
| 第96期 | 2,936,099,491 | 713,005,482 | 2,428 | 25 | 0.25 |
| 第97期 | 2,940,905,286 | 728,329,110 | 2,477 | 25 | 0.25 |
| 第98期 | 2,931,155,311 | 710,218,031 | 2,423 | 25 | 0.25 |
| 第99期 | 2,937,400,362 | 684,850,153 | 2,331 | 25 | 0.25 |
| 第100期 | 2,892,608,401 | 695,062,573 | 2,403 | 25 | 0.25 |
| 第101期 | 2,876,175,267 | 694,525,674 | 2,415 | 25 | 0.25 |
| 第102期 | 2,696,038,861 | 631,551,600 | 2,343 | 25 | 0.25 |
| 第103期 | 2,677,021,860 | 642,882,325 | 2,401 | 25 | 0.25 |
| 第104期 | 2,674,822,520 | 598,965,644 | 2,239 | 25 | 0.25 |
| 第105期 | 2,672,437,187 | 625,109,271 | 2,339 | 25 | 0.25 |
| 第106期 | 2,635,808,428 | 611,078,812 | 2,318 | 25 | 0.25 |
| 第107期 | 2,551,467,087 | 601,098,018 | 2,356 | 25 | 0.25 |
| 第108期 | 2,543,325,515 | 580,017,707 | 2,281 | 25 | 0.25 |
| 第109期 | 2,555,399,267 | 582,037,811 | 2,278 | 25 | 0.25 |
| 第110期 | 2,550,840,156 | 589,813,936 | 2,312 | 25 | 0.25 |
| 第111期 | 2,548,494,032 | 583,772,558 | 2,291 | 25 | 0.25 |
| 第112期 | 2,502,594,452 | 566,823,847 | 2,265 | 25 | 0.25 |
| 第113期 | 2,481,412,217 | 548,375,908 | 2,210 | 25 | 0.25 |
| 第114期 | 2,476,126,864 | 556,962,358 | 2,249 | 25 | 0.25 |
| 第115期 | 2,451,595,867 | 555,898,828 | 2,267 | 25 | 0.25 |
| 第116期 | 2,410,713,234 | 545,826,819 | 2,264 | 25 | 0.25 |
| 第117期 | 2,333,010,076 | 536,465,030 | 2,299 | 25 | 0.25 |

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

ダイワ英国高配当株ツインα（毎月分配型）

| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ | | | | | |
|---------------------|---------|---------|---------|---------|---------|
| | 第 113 期 | 第 114 期 | 第 115 期 | 第 116 期 | 第 117 期 |
| 1万口当り分配金（税込み） | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25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。

| 償 還 金 の お 知 ら せ | |
|-----------------|-----------|
| 1 万 口 当 り 償 還 金 | 2,271円89銭 |

《お知らせ》

■投資対象ファンドの名称変更について

UBSグループによるクレディ・スイスの吸収合併に伴い、投資対象とする外国投資信託の名称を変更しました。

- ・変更前：クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ-ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）
- ・変更後：UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ-ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド (ツインαクラス)

当ファンド (ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型)) はケイマン籍の外国投資信託「UBSユニバーサル・トラスト (ケイマン) IIIーダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド (ツイン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。

純資産計算書

2023年9月30日現在

資産

| | | |
|---------------------------------------|-----|------------------|
| 現金および現金同等物 | GBP | 110,712 |
| 投資有価証券の公正価値による評価額 (簿価: GBP 3,403,977) | | 3,717,550 |
| その他未収金 | | 17,884 |
| 資産合計 | | 3,846,146 |

負債

| | | |
|--------------------------------------|--|---------------|
| スワップ取引の公正価値による評価額 (取引金額: GBP 34,578) | | 20,728 |
| その他未払金 | | 18,106 |
| 負債合計 | | 38,834 |

償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産

3,807,312

内訳:

資産成長クラス

| | | |
|---------------------------------------|-------|-------------|
| 償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産 (GBP 649,923) | J P Y | 118,375,129 |
| 発行済み償還可能参加型受益証券数 | | 1,181,595 |
| 償還可能参加型受益証券 1口当り純資産額 (GBP 0.5500) | J P Y | 100.1830 |

ツインαクラス

| | | |
|---|-------|-------------|
| 償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産 (GBP 3,157,389) | J P Y | 575,077,926 |
| 発行済み償還可能参加型受益証券数 | | 34,528,817 |
| 償還可能参加型受益証券 1口当り純資産額 (GBP 0.0914) | J P Y | 16.6550 |

包括利益計算書

2023年9月30日に終了した会計年度

| | | |
|-----------------------------------|-------|------------------|
| 投資による純損益 | G B P | 232,734 |
| 外国為替取引による為替純損益 | | (1,557) |
| 純投資損益 | | 231,177 |
| 副投資運用会社報酬 | | 15,258 |
| 報酬代行会社報酬 | | 8,026 |
| 管理会社報酬 | | 2,180 |
| 保管会社報酬 | | 6,183 |
| 監査報酬 | | 16,579 |
| 受託会社報酬 | | 9,067 |
| その他費用 | | 225 |
| 営業費用合計 | | 57,518 |
| 償還可能参加型受益証券保有者への分配金 | | (880,551) |
| 税引前損失 | | (706,892) |
| 税金費用 | | (2,426) |
| 償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産の変動 | | (709,318) |

組入明細表

(普通株式)

| 銘柄名 | 株数 | 評価額 (GBP) |
|---------------------------------------|---------|-----------|
| 3I GROUP PLC GBP | 2,520 | 52,240 |
| ADMIRAL GROUP PLC GBP | 1,100 | 26,147 |
| ANGLO AMERICAN PLC GBP | 2,780 | 62,981 |
| ASHTAD GROUP PLC GBP | 830 | 41,517 |
| ASTRAZENECA ORD GBP | 2,050 | 227,591 |
| AVIVA PLC GBP | 12,732 | 49,629 |
| BAE SYSTEMS PLC UK LINE | 8,200 | 81,820 |
| BERKELEY GP HOLDINGS PLC GBP | 850 | 34,910 |
| BP PLC UK LINE | 38,350 | 203,792 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO UK LINE | 7,200 | 185,544 |
| BT GROUP PLC GBP | 15,200 | 17,738 |
| BURBERRY GROUP PLC GBP | 1,070 | 20,421 |
| COMPASS GROUP PLC GBP | 3,600 | 72,000 |
| DCC PLC GBP | 1,210 | 55,769 |
| DIAGEO PLC UK LINE | 4,520 | 137,137 |
| EXPERIAN PLC GBP | 1,500 | 40,365 |
| GLENCORE PLC GBP | 27,700 | 130,162 |
| GSK PLC ORD GBP | 11,180 | 166,806 |
| HALEON PLC GBP | 5,500 | 18,747 |
| HSBC HOLDINGS PLC GBP | 44,750 | 288,593 |
| IMPERIAL BRANDS PLC UK LINE | 4,050 | 67,514 |
| INFORMA PLC GBP | 2,500 | 18,760 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC GBP | 400 | 24,296 |
| LEGAL AND GENERAL GROUP PLC GBP | 22,500 | 50,063 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC GBP | 164,400 | 72,944 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GRP UK LINE | 535 | 44,052 |
| M AND G PLC GBP | 37,500 | 73,988 |
| NATIONAL GRID PLC GBP | 11,700 | 114,660 |
| NATWEST GROUP PLC GBP | 30,600 | 72,124 |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC GBP | 17,400 | 83,903 |
| PRUDENTIAL PLC UK LINE | 1,500 | 13,332 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC GBP | 1,580 | 91,545 |
| RELX PLC UK LINE GBP | 4,700 | 130,425 |
| RIO TINTO PLC UK LINE | 2,900 | 150,046 |
| SAGE GROUP PLC THE GBP | 4,400 | 43,516 |
| SHELL PLC GB LINE GBP | 10,650 | 277,539 |

| 銘柄名 | 株数 | 評価額 (GBP) |
|------------------------------|--------|-----------|
| SMITH AND NEPHEW PLC GBP | 2,600 | 26,598 |
| SSE PLC UK LINE | 3,500 | 56,350 |
| TAYLOR WIMPEY PLC GBP | 30,700 | 36,011 |
| TESCO PLC UK LINE GBP | 18,205 | 48,098 |
| UNILEVER PLC UK LINE | 4,530 | 184,009 |
| UNITED UTILITIES GBP UK LINE | 2,500 | 23,705 |
| VODAFONE GROUP PLC GBP | 86,500 | 66,449 |
| WPP 2012 PLC GBP | 4,600 | 33,718 |

(スワップ取引)

| 取引 | 想定元本 (GBP) | 評価額 (GBP) |
|---------------------------|--------------|------------|
| DAIWA UK HD EQ/CS SWP GBP | 3,172,334.00 | -20,728.03 |

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第19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・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。

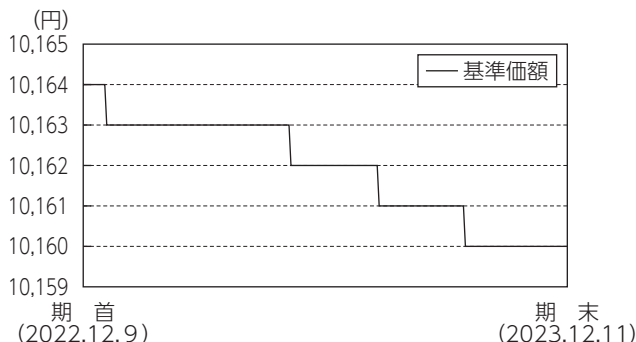
| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行いません。 |
| 主要投資対象 | 本邦通貨表示の公社債 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の30%以下 |

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 | | |
| (期首)2022年12月9日 | 円 | % | % |
| | 10,164 | - | - |
| 12月末 | 10,163 | △0.0 | - |
| 2023年1月末 | 10,163 | △0.0 | - |
| 2月末 | 10,163 | △0.0 | - |
| 3月末 | 10,163 | △0.0 | - |
| 4月末 | 10,163 | △0.0 | - |
| 5月末 | 10,162 | △0.0 | - |
| 6月末 | 10,162 | △0.0 | - |
| 7月末 | 10,161 | △0.0 | - |
| 8月末 | 10,161 | △0.0 | - |
| 9月末 | 10,160 | △0.0 | - |
| 10月末 | 10,160 | △0.0 | - |
| 11月末 | 10,160 | △0.0 | - |
| (期末)2023年12月11日 | 10,160 | △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、利息収入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：10,164円 期末：10,160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

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 | 19,535,266 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 19,535,266 | 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 | 19,535,266,323円 |
| コール・ローン等 | 19,535,266,323 |
| (B) 負債 | 29,184,000 |
| 未払解約金 | 29,184,000 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 19,506,082,323 |
| 元本 | 19,198,713,135 |
| 次期繰越損益金 | 307,369,188 |
| (D) 受益権総口数 | 19,198,713,135口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 10,160円 |

* 期首における元本額は14,576,480,402円、当作成期間中における追加設定元本額は27,183,021,765円、同解約元本額は22,560,789,032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：

| | |
|--|----------------|
| ゴールド・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) | 6,471,708,187円 |
| ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド - A1新時代- (為替ヘッジあり) | 977,694円 |
| ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド - A1新時代- (為替ヘッジなし) | 977,694円 |
| ダイワFEGグローバル・バリュー (為替ヘッジあり) | 9,608円 |
| ダイワFEGグローバル・バリュー (為替ヘッジなし) | 9,608円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり) | 49,107円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし) | 49,107円 |
| 世界水資源関連株式ファンド | 984円 |
| ダイワ/“RICI” コモディティ・ファンド | 2,074,249円 |
| 堅実バランスファンド - ハジメの一步- | 82,551,045円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/隔月分配型) | 180,729円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/隔月分配型) | 737,649円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/資産成長型) | 95,276円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型) | 337,885円 |
| 世界セレクトティブ株式オープン | 983円 |
| 世界セレクトティブ株式オープン (年2回決算型) | 983円 |
| iFreeETF NASDAQ100インバース | 3,668,122,787円 |
| iFreeETF NASDAQ100レバレッジ | 3,404,533,061円 |
| iFreeETF NASDAQ100ダブルインバース | 1,690,708,296円 |
| DCダイワ・マネー・ポートフォリオ | 3,873,348,807円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル | |
| リターンズ- 日本円・コース (毎月分配型) | 132,757円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル | |
| リターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型) | 52,987円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル | |
| リターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) | 467,315円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル | |
| リターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型) | 12,784円 |
| ダイワFEGグローバル・バリュー株ファンド (ダイワSMA専用) | 3,666円 |
| ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) | 155,317円 |
| ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型) | 38,024円 |
| ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 米ドル・コース (毎月分配型) | 4,380円 |
| ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型) | 22,592円 |
| ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース) | 33,689円 |
| ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース) | 96,254円 |
| ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 米ドルコース | 9,817円 |
| ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 日本円コース | 6,964円 |
| ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 通貨αコース | 9,479円 |
| ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型) | 98,107円 |
| ダイワ英国高配当株ファンド | 98,107円 |
| ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ | 982,368円 |
| ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 南アフリカ・ランド・コース (毎月分配型) | 1,097円 |
| ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース (毎月分配型) | 2,690円 |
| ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型) | 1,350円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル | |
| リターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型) | 9,652円 |

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,160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 | △ 6,497,360円 |
| 受取利息 | 7,522 |
| 支払利息 | △ 6,504,882 |
| (B) 当期損益金(A) | △ 6,497,360 |
| (C) 前期繰越損益金 | 238,705,846 |
| (D) 解約差損益金 | △365,355,257 |
| (E) 追加信託差損益金 | 440,515,959 |
| (F) 合計(B + C + D + E) | 307,369,188 |
| 次期繰越損益金(F) | 307,369,188 |

(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。