

ダイワ・スイス 高配当株ツインα (毎月分配型)

運用報告書(全体版)

第125期(決算日 2024年7月17日)
第126期(決算日 2024年8月19日)
第127期(決算日 2024年9月17日)
第128期(決算日 2024年10月17日)
第129期(決算日 2024年11月18日)
第130期(決算日 2024年12月17日)

(作成対象期間 2024年6月18日～2024年12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／株式		
信 託 期 間	2013年12月18日～2028年12月15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（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券	
	ダ イ ワ ・ マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券	
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10%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、配当利回りの高いスイス株式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			スイスSMI指数 (配当込み、円換算)		スイス・フラン 為替レート		公 社 債 入 率 組 比	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 額 総 額
	(分配落)	税 込 期 中 分 配 金 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率	組 比			
	円	円	%		%	円	%	%	%	百万円
101期末 (2022年7月19日)	5,327	40	4.8	22,749	8.0	141.33	2.7	—	98.7	10,124
102期末 (2022年8月17日)	5,445	40	3.0	23,015	1.2	141.44	0.1	—	98.8	10,262
103期末 (2022年9月20日)	5,328	40	△ 1.4	23,060	0.2	148.57	5.0	—	98.6	9,923
104期末 (2022年10月17日)	5,131	40	△ 2.9	22,393	△ 2.9	148.09	△ 0.3	—	98.6	9,507
105期末 (2022年11月17日)	5,407	40	6.2	23,640	5.6	147.66	△ 0.3	—	98.8	9,940
106期末 (2022年12月19日)	5,297	40	△ 1.3	23,019	△ 2.6	146.00	△ 1.1	—	98.9	9,552
107期末 (2023年1月17日)	5,226	40	△ 0.6	23,240	1.0	138.82	△ 4.9	—	98.6	9,279
108期末 (2023年2月17日)	5,430	40	4.7	23,740	2.2	144.86	4.4	—	98.5	9,568
109期末 (2023年3月17日)	5,185	40	△ 3.8	22,816	△ 3.9	143.58	△ 0.9	—	99.0	9,036
110期末 (2023年4月17日)	5,483	40	6.5	25,373	11.2	149.58	4.2	—	98.7	9,464
111期末 (2023年5月17日)	5,532	40	1.6	26,431	4.2	152.28	1.8	—	98.8	9,478
112期末 (2023年6月19日)	5,592	40	1.8	27,253	3.1	158.71	4.2	—	99.4	9,502
113期末 (2023年7月18日)	5,535	40	△ 0.3	26,735	△ 1.9	161.51	1.8	—	98.6	9,348
114期末 (2023年8月17日)	5,554	40	1.1	27,570	3.1	166.31	3.0	—	98.6	9,333
115期末 (2023年9月19日)	5,564	40	0.9	27,541	△ 0.1	164.66	△ 1.0	—	98.5	9,319
116期末 (2023年10月17日)	5,471	40	△ 1.0	27,323	△ 0.8	166.16	0.9	—	99.2	9,038
117期末 (2023年11月17日)	5,451	40	0.4	27,271	△ 0.2	169.68	2.1	—	98.7	8,813
118期末 (2023年12月18日)	5,383	40	△ 0.5	27,611	1.2	163.37	△ 3.7	—	98.7	8,544
119期末 (2024年1月17日)	5,513	40	3.2	29,015	5.1	171.10	4.7	—	98.6	8,699
120期末 (2024年2月19日)	5,563	40	1.6	29,120	0.4	170.49	△ 0.4	—	98.7	8,709
121期末 (2024年3月18日)	5,678	40	2.8	30,146	3.5	168.99	△ 0.9	0.0	98.5	8,775
122期末 (2024年4月17日)	5,508	40	△ 2.3	29,232	△ 3.0	169.65	0.4	0.0	99.4	8,418
123期末 (2024年5月17日)	5,761	40	5.3	31,848	8.9	171.48	1.1	0.0	98.8	8,726
124期末 (2024年6月17日)	5,850	40	2.2	33,168	4.1	176.84	3.1	0.0	98.6	8,735
125期末 (2024年7月17日)	5,928	40	2.0	33,851	2.1	177.30	0.3	0.0	98.6	8,720
126期末 (2024年8月19日)	5,707	40	△ 3.1	32,384	△ 4.3	170.62	△ 3.8	0.0	98.6	8,349
127期末 (2024年9月17日)	5,560	40	△ 1.9	31,140	△ 3.8	166.57	△ 2.4	0.0	99.4	8,046
128期末 (2024年10月17日)	5,808	40	5.2	32,855	5.5	172.81	3.7	0.0	99.2	8,291
129期末 (2024年11月18日)	5,611	40	△ 2.7	31,528	△ 4.0	173.90	0.6	0.0	98.7	7,941
130期末 (2024年12月17日)	5,618	40	0.8	31,504	△ 0.1	172.66	△ 0.7	0.0	98.8	7,899

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) スイスSMI指数（配当込み、円換算）は、スイスSMI指数（配当込み、スイス・フランベース）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。

(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) 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5) 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。

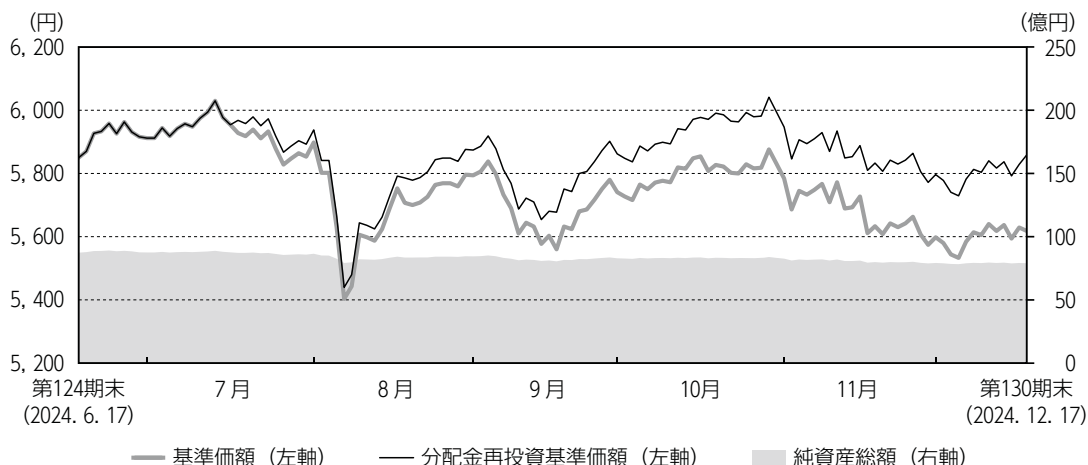
(注6) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



(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125期首：5,850円

第130期末：5,618円（既払分配金240円）

騰落率：0.1%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

スイス・フランが対円で下落（円高）したことなどはマイナス要因となったものの、保有するスイス株式の上昇などがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。オプション取引については、通貨オプションと株価指数オプションがともにプラス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		スイス S M I 指数 (配当込み、円換算)		スイス・フラン 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125期	(期 首) 2024年 6月17日	円 5,850	% —	33,168	% —	円 176.84	% —	% 0.0	% 98.6
	6月末	5,912	1.1	33,474	0.9	179.07	1.3	0.0	98.5
	(期 末) 2024年 7月17日	5,968	2.0	33,851	2.1	177.30	0.3	0.0	98.6
第126期	(期 首) 2024年 7月17日	5,928	—	33,851	—	177.30	—	0.0	98.6
	7月末	5,898	△ 0.5	33,059	△ 2.3	172.85	△ 2.5	0.0	99.0
	(期 末) 2024年 8月19日	5,747	△ 3.1	32,384	△ 4.3	170.62	△ 3.8	0.0	98.6
第127期	(期 首) 2024年 8月19日	5,707	—	32,384	—	170.62	—	0.0	98.6
	8月末	5,794	1.5	33,035	2.0	170.84	0.1	0.0	99.1
	(期 末) 2024年 9月17日	5,600	△ 1.9	31,140	△ 3.8	166.57	△ 2.4	0.0	99.4
第128期	(期 首) 2024年 9月17日	5,560	—	31,140	—	166.57	—	0.0	99.4
	9月末	5,741	3.3	32,375	4.0	169.71	1.9	0.0	98.6
	(期 末) 2024年10月17日	5,848	5.2	32,855	5.5	172.81	3.7	0.0	99.2
第129期	(期 首) 2024年10月17日	5,808	—	32,855	—	172.81	—	0.0	99.2
	10月末	5,784	△ 0.4	33,084	0.7	177.29	2.6	0.0	99.3
	(期 末) 2024年11月18日	5,651	△ 2.7	31,528	△ 4.0	173.90	0.6	0.0	98.7
第130期	(期 首) 2024年11月18日	5,611	—	31,528	—	173.90	—	0.0	98.7
	11月末	5,598	△ 0.2	31,219	△ 1.0	170.98	△ 1.7	0.0	98.8
	(期 末) 2024年12月17日	5,658	0.8	31,504	△ 0.1	172.66	△ 0.7	0.0	98.8

（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

（2024. 6. 18 ～ 2024. 12. 17）

■ スイス株式市況

スイス株式市況は下落しました。

スイス株式市況は、当作成期首より、ＳＮＢ（スイス国立銀行）が追加利下げを決定したことなどを好感して、堅調に推移しました。しかし2024年8月上旬に、米国景気の減速懸念などから米国株式市況が大幅安となり投資家心理が悪化した影響で、スイス株式市況も大幅に下落しました。その後は、米国経済の減速に対する過度な懸念が後退するにつれて、株価は反発に転じました。当作成期末にかけては、ＥＣＢ（欧州中央銀行）やＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）、ＳＮＢによる利下げが株価の下支えとなったものの、米国大統領選挙の結果を受けて、トランプ次期政権で予想される関税の引き上げが欧州企業の業績に悪影響を及ぼすとの懸念やウクライナ・ロシア情勢の緊迫化などが、投資家心理の悪化につながったため、株価は下落基調で推移しました。

相対的に配当利回りの高い株式を中心に幅広く分散投資を行った当ファンドの株式ポートフォリオについては、当作成期に総じて上昇しました。

■ スイス株価指数オプション市況

期間1カ月アット・ザ・マネーのインプライド・ボラティリティ（予想変動率）は低下しました。

当作成期首より、フランス総選挙を抑えたりスク回避姿勢の高まりにより、インプライド・ボラティリティは高い水準で始まりましたが、総選挙を通過すると低下しました。2024年8月上旬には、米国景気の減速懸念により米国株式市況が大幅に下落した影響などから、インプライド・ボラティリティは急上昇しましたが、やがて市場の動揺が収まり、株価が回復に向かうにつれて、再び低下しました。当作成期末にかけては、米国経済の先行き不透明感などから一時的にインプライド・ボラティリティは上昇する局面もみられたものの、米国大統領選挙を通過した安心感などから、低下基調となりました。

■ 為替相場

スイス・フランは対円で下落しました。

当作成期首より、2024年6月中旬に開催された日銀の金融政策決定会合後に円安が進行した流れを受けて、スイス・フランは対円で上昇（円安）して始まりしました。しかし、日本政府・日銀による円買い介入による急速な円高の進行や、7月末に日銀が追加利上げを決定したことなどを受けて円が買われると、スイス・フランは対円で下落基調に転じました。9月にはＳＮＢ（スイス国立銀行）が追加利下げを決定し、今後も政策金利のさらなる引き下げの可能性を示唆したことが嫌気され、スイス・フランは一段と下落しました。その後、中東における地政学リスクの高まりを受け

て、永世中立国であるスイスを選好し安全資産としてスイス・フランを買う動きが強まったため、スイス・フランは上昇基調に転じました。しかし11月に入り、スイスCPI（消費者物価指数）の下振れが重しとなり、スイス・フランは当作成期末にかけて下落基調で推移しました。

■スイス・フラン／円為替オプション市況

期間1カ月アット・ザ・マネーのインプライド・ボラティリティ（予想変動率）は上昇しました。

当作成期首より、スイス・フランの上昇などを背景に、インプライド・ボラティリティは安定した動きで推移しました。しかし2024年7月に入り、急速な円高の進行を背景にスイス・フランが対円で急落した影響などから、インプライド・ボラティリティは急上昇しました。9月以降は、日銀やSNB（スイス国立銀行）の金融政策の方向性などに左右される中、インプライド・ボラティリティは方向感に乏しい動きで推移しました。その後は、スイス・フランが軟調に推移する中でインプライド・ボラティリティは再び上昇する局面もみられましたが、当作成期末にかけては、落ち着きを取り戻しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」と「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」に投資します。通常の状態では、「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド

スイス株式部分に関しては、企業の本源的価値が株価に十分に反映されておらず、投資妙味の高い銘柄に焦点を当てて投資を行います。スイス株式への投資に加えて、株式カバードコール戦略および通貨カバードコール戦略の活用により、オプションプレミアム（オプションの買い手が売り手に支払う対価）の確保をめざします。株式カバードコール戦略ではスイス株価指数のコール・オプション（買う権利）の売りを、通貨カバードコール戦略では円に対するスイス・フランのコール・オプションの売りを行います。いずれのオプションも、カバー率をファンドが保有するスイス・フラン建資産の評価額に対して50%程度とすることにより、株式の値上がり益、スイス・フランの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざします。

■ダイワ・マネーアセット・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

(2024. 6. 18 ~ 2024. 12. 17)

■当ファンド

「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」と「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」に投資しました。「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」への投資割合を高位に維持しました。

■UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド

参考指数との対比では、セクター別では、金融セクターのオーバーウエートや生活必需品セクターのアンダーウエートなどが主なプラス要因となりました。一方、不動産セクターのアンダーウエートなどが主なマイナス要因となりました。個別銘柄では、主に Nestle のアンダーウエートのほか、Swiss Re のオーバーウエートなどがプラス要因となりました。一方、SoftwareOne Holding のオーバーウエートなどがマイナス要因となりました。

スイス株式への投資に加えて、株式カバードコール戦略および通貨カバードコール戦略の活用により、オプションプレミアム（オプションの買い手が売り手に支払う対価）の確保をめざしました。株式カバードコール戦略ではスイス株価指数のコール・オプション（買う権利）の売りを、通貨カバードコール戦略では円に対するスイス・フランのコール・オプションの売りを行いました。いずれのオプションも、カバー率をファンドが保有するスイス・フラン建資産の評価額に対して50%程度とすることにより、株式の値上がり益、スイス・フランの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざしました。

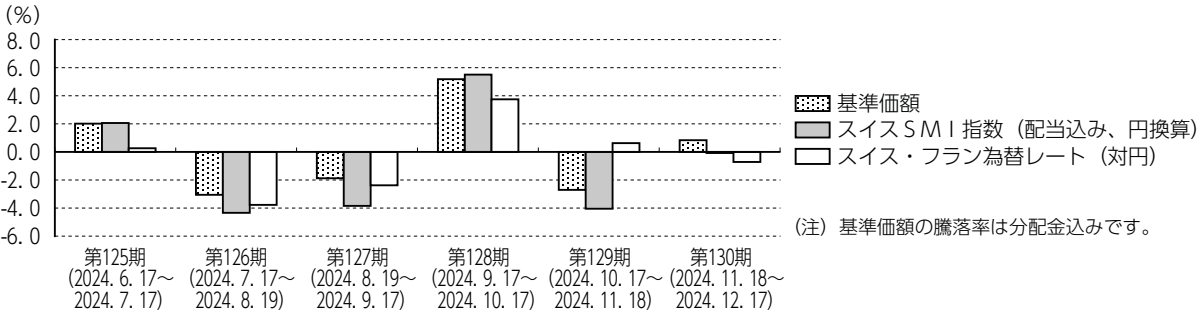
■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



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125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
	2024年 6月18日 ～2024年 7月17日	2024年 7月18日 ～2024年 8月19日	2024年 8月20日 ～2024年 9月17日	2024年 9月18日 ～2024年10月17日	2024年10月18日 ～2024年11月18日	2024年11月19日 ～2024年12月17日
当期分配金(税込み) (円)	40	40	40	40	40	40
対基準価額比率 (%)	0.67	0.70	0.71	0.68	0.71	0.71
当期の収益 (円)	40	40	40	40	40	40
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	1,891	1,900	1,908	1,925	1,937	1,941

- (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125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 74.24円	✓ 49.09円	✓ 47.85円	✓ 57.41円	✓ 51.95円	✓ 43.53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	246.65	249.54	252.11	255.11	257.58	260.53
(d) 分配準備積立金	1,610.44	1,641.80	1,648.33	1,653.21	1,668.15	1,677.15
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,931.34	1,940.44	1,948.30	1,965.73	1,977.68	1,981.23
(f) 分配金	40.00	40.00	40.00	40.00	40.00	40.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,891.34	1,900.44	1,908.30	1,925.73	1,937.68	1,941.23

(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

引き続き、「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」と「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」に投資します。通常の状態では、「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド

スイス株式部分に関しては、企業の本源的価値が株価に十分に反映されておらず、投資妙味の高い銘柄に焦点を当てて投資を行います。スイス株式への投資に加えて、株式カバードコール戦略および通貨カバードコール戦略の活用により、オプションプレミアム（オプションの買い手が売り手に支払う対価）の確保をめざします。株式カバードコール戦略ではスイス株価指数のコール・オプション（買う権利）の売りを、通貨カバードコール戦略では円に対するスイス・フランのコール・オプションの売りをを行います。いずれのオプションも、カバー率をファンドが保有するスイス・フラン建資産の評価額に対して50%程度とすることにより、株式の値上がり益、スイス・フランの円に対する値上がり益の部分的な追求をめざします。

■ダイワ・マネーアセット・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125期～第130期 (2024. 6. 18～2024. 12. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	39円	0. 674%	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5,756円です。
（投 信 会 社）	(13)	(0. 220)	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）	(25)	(0. 441)	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. 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	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0. 004	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（監 査 費 用）	(0)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	39	0. 678	

（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。

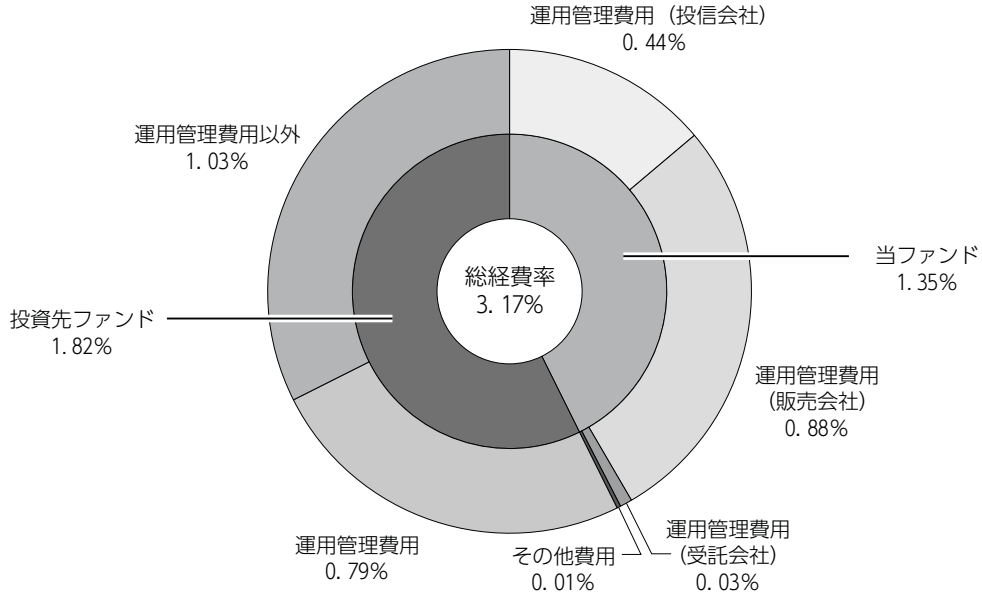
（注 3）各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

（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3.17%です。



総経費率（①＋②＋③）	3.17%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.79%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	1.03%

（注1）投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

（注2）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

（注3）投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

（注4）各比率は、年率換算した値です。

（注5）①の費用は、1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

（注6）①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

（注7）①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

（注8）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2024年 6月18日から2024年12月17日まで)

決 算 期		第 125 期 ～ 第 130 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国（邦貨建）	UBS（CAY）SWISS HIGH DIVIDEND EQUITY TWIN ALPHA FUND（ケイマン諸島）	千□	千円	千□	千円
		12, 024. 37692	514, 885	20, 402. 13303	879, 000

(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 130 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
外国投資信託受益証券 （ケイマン諸島） UBS（CAY）SWISS HIGH DIVIDEND EQUITY TWIN ALPHA FUND	千□	千円	%
	185, 970. 4627	7, 802, 390	98. 8

(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12月17日現在

項 目	第 130 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円	%
	7, 802, 390	97. 7
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1	0. 0
コール・ローン等、その他	183, 023	2. 3
投資信託財産総額	7, 985, 415	100. 0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第124期末	第 130 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	千□	千□	千円
	1	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年7月17日)、(2024年8月19日)、(2024年9月17日)、(2024年10月17日)、(2024年11月18日)、(2024年12月17日) 現在

項 目	第125期末	第126期末	第127期末	第128期末	第129期末	第130期末
(A) 資産	8,799,867,056円	8,421,980,275円	8,122,264,335円	8,358,769,928円	8,030,859,483円	7,985,415,528円
コール・ローン等	198,338,873	188,919,491	124,990,240	131,179,260	190,382,667	183,023,750
投資信託受益証券（評価額）	8,601,527,167	8,233,059,768	7,997,273,079	8,227,589,652	7,840,475,800	7,802,390,762
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	1,016	1,016	1,016	1,016	1,016	1,016
(B) 負債	79,141,799	72,040,235	75,475,807	67,243,980	89,509,751	86,183,278
未払収益分配金	58,849,149	58,525,321	57,891,803	57,105,456	56,609,412	56,242,366
未払解約金	10,477,007	3,091,899	8,503,346	739,710	22,893,868	21,111,081
未払信託報酬	9,755,928	10,300,255	8,903,403	9,165,458	9,713,658	8,485,085
その他未払費用	59,715	122,760	177,255	233,356	292,813	344,746
(C) 純資産総額（A－B）	8,720,725,257	8,349,940,040	8,046,788,528	8,291,525,948	7,941,349,732	7,899,232,250
元本	14,712,287,423	14,631,330,445	14,472,950,792	14,276,364,133	14,152,353,228	14,060,591,719
次期繰越損益金	△ 5,991,562,166	△ 6,281,390,405	△ 6,426,162,264	△ 5,984,838,185	△ 6,211,003,496	△ 6,161,359,469
(D) 受益権総口数	14,712,287,423口	14,631,330,445口	14,472,950,792口	14,276,364,133口	14,152,353,228口	14,060,591,719口
1万口当り基準価額（C/D）	5,928円	5,707円	5,560円	5,808円	5,611円	5,618円

* 当作成期首における元本額は14,931,479,166円、当作成期間（第125期～第130期）中における追加設定元本額は159,363,443円、同解約元本額は1,030,250,890円です。
* 第130期末の計算口数当りの純資産額は5,618円です。
* 第130期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は6,161,359,469円です。

■損益の状況

第125期	自2024年6月18日	至2024年7月17日	第127期	自2024年8月20日	至2024年9月17日	第129期	自2024年10月18日	至2024年11月18日
第126期	自2024年7月18日	至2024年8月19日	第128期	自2024年9月18日	至2024年10月17日	第130期	自2024年11月19日	至2024年12月17日
項 目	第125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期		
(A) 配当等収益	115,447,663円	82,191,896円	78,216,656円	83,804,615円	83,297,996円	69,185,644円		
受取配当金	115,440,923	82,178,902	78,197,175	83,789,453	83,281,537	69,168,455		
受取利息	6,740	12,994	19,481	15,162	16,459	17,189		
(B) 有価証券売買損益	66,946,140	△ 335,983,745	△ 224,122,189	336,451,210	△ 295,062,277	4,959,721		
売買益	68,206,598	1,672,726	447,347	339,744,306	1,533,160	5,224,084		
売買損	△ 1,260,458	△ 337,656,471	△ 224,569,536	△ 3,293,096	△ 296,595,437	△ 264,363		
(C) 信託報酬等	△ 9,815,643	△ 10,363,300	△ 8,957,898	△ 9,221,559	△ 9,773,115	△ 8,537,018		
(D) 当期損益金 (A + B + C)	172,578,160	△ 264,155,149	△ 154,863,431	411,034,266	△ 221,537,396	65,608,347		
(E) 前期繰越損益金	△ 2,601,914,432	△ 2,470,163,752	△ 2,758,318,399	△ 2,925,447,085	△ 2,545,405,857	△ 2,800,331,226		
(F) 追加信託差損益金	△ 3,503,376,745	△ 3,488,546,183	△ 3,455,088,631	△ 3,413,319,910	△ 3,387,450,831	△ 3,370,394,224		
(配当等相当額)	(362,888,017)	(365,120,584)	(364,890,573)	(364,206,189)	(364,545,868)	(366,325,010)		
(売買損益相当額)	(△ 3,866,264,762)	(△ 3,853,666,767)	(△ 3,819,979,204)	(△ 3,777,526,099)	(△ 3,751,996,699)	(△ 3,736,719,234)		
(G) 合計 (D + E + F)	△ 5,932,713,017	△ 6,222,865,084	△ 6,368,270,461	△ 5,927,732,729	△ 6,154,394,084	△ 6,105,117,103		
(H) 収益分配金	△ 58,849,149	△ 58,525,321	△ 57,891,803	△ 57,105,456	△ 56,609,412	△ 56,242,366		
次期繰越損益金 (G + H)	△ 5,991,562,166	△ 6,281,390,405	△ 6,426,162,264	△ 5,984,838,185	△ 6,211,003,496	△ 6,161,359,469		
追加信託差損益金	△ 3,503,376,745	△ 3,488,546,183	△ 3,455,088,631	△ 3,413,319,910	△ 3,387,450,831	△ 3,370,394,224		
(配当等相当額)	(362,888,017)	(365,120,584)	(364,890,573)	(364,206,189)	(364,545,868)	(366,325,010)		
(売買損益相当額)	(△ 3,866,264,762)	(△ 3,853,666,767)	(△ 3,819,979,204)	(△ 3,777,526,099)	(△ 3,751,996,699)	(△ 3,736,719,234)		
分配準備積立金	2,419,710,852	2,415,488,414	2,396,994,511	2,385,044,433	2,377,741,034	2,363,163,423		
繰越損益金	△ 4,907,896,273	△ 5,208,332,636	△ 5,368,068,144	△ 4,956,562,708	△ 5,201,293,699	△ 5,154,128,668		

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
(a) 経費控除後の配当等収益	109,234,361円	71,828,596円	69,258,758円	81,965,836円	73,524,881円	61,219,753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	362,888,017	365,120,584	364,890,573	364,206,189	364,545,868	366,325,010
(d) 分配準備積立金	2,369,325,640	2,402,185,139	2,385,627,556	2,360,184,053	2,360,825,565	2,358,186,036
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,841,448,018	2,839,134,319	2,819,776,887	2,806,356,078	2,798,896,314	2,785,730,799
(f) 分配金	58,849,149	58,525,321	57,891,803	57,105,456	56,609,412	56,242,366
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	2,782,598,869	2,780,608,998	2,761,885,084	2,749,250,622	2,742,286,902	2,729,488,433
(h) 受益権総口数	14,712,287,423□	14,631,330,445□	14,472,950,792□	14,276,364,133□	14,152,353,228□	14,060,591,719□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金 (税込み)	第125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
	40円	40円	40円	40円	40円	40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。

UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・
ツイン・アルファ・ファンド

当ファンド（ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型））はケイマン籍の外国投資信託「UBS（CAY）スイス・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ツイン・アルファ・ファンド」の受益証券（円建）を主要投資対象としております。以下の内容は、直近で入手可能な Financial Statements 等から抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

財政状態計算書
2023年11月30日

資産

金融資産（損益通算後の公正価値による評価額）	¥	8,580,837,673
現金および現金同等物		395,804,885
担保としてブローカーが保有する現金		33,152,635
その他資産		841,123
資産合計		9,010,636,316

負債

金融負債（損益通算後の公正価値による評価額）		109,200,591
保管会社に対する未払金		1,024,977
未払：		
投資管理報酬		18,553,910
専門家報酬		10,122,681
管理会社報酬		1,585,571
保管会社報酬		729,271
名義書換代理人報酬		288,061
その他負債		24,195
負債合計		141,529,257
償還可能受益証券保有者に帰属する純資産	¥	8,869,107,059

包括利益計算書

2023年11月30日に終了した年度

収益

受取利息、配当収益、その他収益、金融資産および負債（損益通算後の公正価値による評価額）やデリバティブ金融資産および負債、外国為替取引に係る純実現損益および評価損益の純変動

¥ 1,324,252,124

費用

運用会社報酬

55,241,010

管理会社報酬

6,444,781

専門家報酬

5,703,211

保管会社報酬

3,313,812

取引費用

1,932,383

名義書換代理人報酬

1,345,559

受託会社報酬

920,688

登録料

811,523

その他費用

14,337

営業費用合計

75,727,304

金融費用控除前営業損益

1,248,524,820

金融費用

償還可能受益証券保有者への分配

(1,707,881,628)

分配後税引前損益

(459,356,808)

源泉徴収税

(95,658,109)

運用の結果による償還可能受益証券保有者に帰属する純資産の増減額

¥ (555,014,917)

ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

投資明細
2023年11月30日

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合（％）	評価額
	普通株（96.7％）		
	アイルランド（0.2％）		
	医薬品（0.2％）		
2,935	COSMO Pharmaceuticals NV	0.2	¥ 21,456,518
	アイルランド合計		21,456,518
	スイス（96.5％）		
	銀行（14.0％）		
11,653	Banque Cantonale Vaudoise	2.4	211,390,205
13,742	Cembra Money Bank AG	1.7	153,379,518
190,254	UBS Group AG*	9.0	796,674,474
4,983	Valiant Holding AG	0.9	79,803,968
			1,241,248,165
	バイオテクノロジー（0.0％）		
6,604	Idorsia, Ltd.	0.0	2,151,221
	建築材料（3.6％）		
29,557	LafargeHolcim Ltd.	3.6	323,112,693
	化学（6.3％）		
1,202	EMS-Chemie Holding AG	1.4	126,802,830
774	Givaudan SA	4.9	430,563,241
			557,366,071
	商業サービス（1.5％）		
18,464	Adecco Group AG	1.5	132,062,951
	コンピューター（1.1％）		
33,229	Softwareone Holding AG	1.1	100,558,774
	流通・卸売（0.9％）		
2,410	Bossard Holding AG	0.9	81,782,480
	総合金融サービス（0.9％）		
9,301	Vontobel Holding AG	0.9	80,171,553
	電機（6.3％）		
95,165	ABB, Ltd.	6.3	561,583,785
	エンジニアリング・建設（0.5％）		
2,729	Burkhalter Holding AG	0.5	41,942,534
	食品（10.3％）		
401	Barry Callebaut AG	1.1	99,331,414
48,285	Nestle SA	9.2	815,572,928
			914,904,342
	ヘルスケア製品（1.8％）		
3,679	Sonova Holding AG	1.8	157,808,260
	ヘルスケアサービス（2.5％）		
3,905	Lonza Group AG	2.5	224,664,310

ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合（％）	評価額
	保険（16.0％）		
2,795	Swiss Life Holding AG	3.0	266,389,805
26,655	Swiss Re AG	5.3	467,898,272
9,150	Zurich Insurance Group AG	7.7	681,206,422
			<u>1,415,494,499</u>
	総合機械（2.1％）		
17,656	Accelleron Industries AG	0.9	75,464,081
11,067	Georg Fischer AG	1.2	107,812,031
			<u>183,276,112</u>
	金属製品（1.0％）		
5,284	SFS Group AG	1.0	88,667,131
	その他製造業（1.4％）		
3,661	Daetwyler Holding AG	1.4	123,487,811
	容器・包装（1.6％）		
41,388	SIG Combibloc Group AG Class C	1.6	143,826,207
	医薬品（19.9％）		
9,753	Galenica AG	1.4	120,463,794
57,387	Novartis AG	9.4	830,477,424
20,204	Roche Holding AG	9.1	810,819,265
			<u>1,761,760,483</u>
	不動産（0.2％）		
868	Investis Holding SA	0.2	13,871,719
	小売（1.9％）		
9,314	Cie Financiere Richemont SA	1.9	172,918,542
	通信（2.7％）		
2,728	Swisscom AG	2.7	236,721,512
	スイス合計		<u>8,559,381,155</u>
	普通株合計（簿価 ¥5,638,168,287）		<u><u>¥ 8,580,837,673</u></u>

2023年11月30日時点の売建オプション残高（純資産の－1.23％）

明細	行使価格	満期日	契約数	受取プレミアム	評価額
Call - OPTIDX Index Option	¥ 10,737	12/15/2023	2,265	¥ (47,189,392)	¥ (65,781,306)
Call - OTC Swiss Franc versus Japanese Yen	169	12/15/2023	24,100,000	(29,526,927)	(43,419,285)
				<u>¥ (76,716,319)</u>	<u>¥ (109,200,591)</u>

* 利害関係人

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2024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130期の決算日（2024年12月17日）現在におけるダイワ・マネーアセット・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・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2024年6月18日から2024年12月17日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
1258国庫短期証券 2024/12/23	179,982		
1239国庫短期証券 2024/9/24	149,999		
1247国庫短期証券 2024/11/5	59,988		
1266国庫短期証券 2025/2/10	49,998		
1245国庫短期証券 2024/10/21	39,996		

(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12月17日現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンド（406,872千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

作 成 期	2024年12月17日現在						
区 分	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		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 230,000	千円 229,997	% 56.7	% —	% —	% —	% 56.7

(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12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	1258国庫短期証券	% —	千円 180,000	千円 179,998	2024/12/23	
	1266国庫短期証券	% —	50,000	49,999	2025/02/10	
	合 計					
	銘 柄 数 金 額	2銘柄				
			230,000	229,997		

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第13期（決算日 2024年12月9日）

（作成対象期間 2023年12月12日～2024年12月9日）

ダイワ・マネーアセット・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。

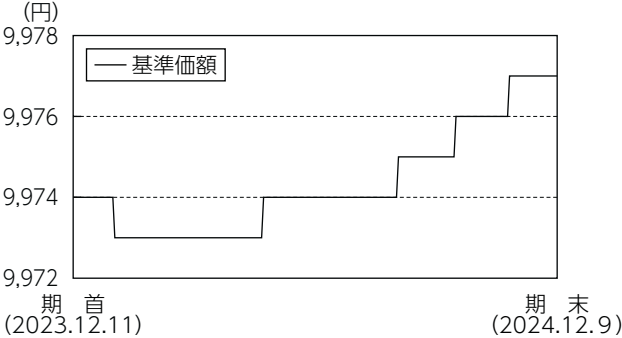
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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 率
	騰 落 率	組 入 比	
	円	%	%
(期首)2023年12月11日	9,974	—	—
12月末	9,974	0.0	—
2024年 1 月末	9,973	△0.0	—
2 月末	9,973	△0.0	—
3 月末	9,973	△0.0	59.1
4 月末	9,973	△0.0	60.1
5 月末	9,974	0.0	84.9
6 月末	9,974	0.0	58.2
7 月末	9,974	0.0	56.6
8 月末	9,975	0.0	70.5
9 月末	9,976	0.0	69.2
10月末	9,976	0.0	61.6
11月末	9,977	0.0	59.6
(期末)2024年12月 9 日	9,977	0.0	56.7

(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：9,974円 期末：9,977円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

短期の国債およびコール・ローン等の利回りが低位で推移したことなどから、基準価額はおおむね横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

当作成期首より2024年2月までは、日銀のマイナス金利政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りはおおむねマイナス圏で推移しました。その後、3月に日銀はマイナス金利政策を解除しましたが、緩和的な金融環境が継続する中、国庫短期証券（3カ月

物）の利回りは低位で推移しました。

◆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、短期の国債やコール・ローン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

公 社 債

(2023年12月12日から2024年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	千円	千円	千円
	国債証券	653,962	(424,000)

(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) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2023年12月12日から2024年12月9日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
1258国庫短期証券	2024/12/23	179,982	
1219国庫短期証券	2024/6/24	173,997	
1239国庫短期証券	2024/9/24	149,999	
1247国庫短期証券	2024/11/5	59,988	
1266国庫短期証券	2025/2/10	49,998	
1245国庫短期証券	2024/10/21	39,996	

(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

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	当 期		末				
	額面金額	評 価 額	組入比率	うち88 格以下 組入比率	残存期間別	組入比率	
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	230,000	229,996	56.7	—	—	—	56.7

(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）

当 期		末			
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	1258国庫短期証券	%	千円 180,000	千円 179,997	2024/12/23
	1266国庫短期証券	—	50,000	49,999	2025/02/10
合計	銘柄数 金 額	2銘柄	230,000	229,996	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年12月9日現在

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	229,996	56.7
コール・ローン等、その他	175,959	43.3
投資信託財産総額	405,956	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

2024年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	405,956,176円
コール・ローン等	175,959,938
公社債(評価額)	229,996,238
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A－B)	405,956,176
元本	406,872,006
次期繰越損益金	△ 915,830
(D) 受益権総口数	406,872,006口
1万口当り基準価額(C／D)	9,977円

* 期首における元本額は237,822,978円、当作成期間中における追加設定元本額は798,521,779円、同解約元本額は629,472,751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：

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）	999円
ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）	999円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム（毎月分配型）	1,995円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム（年2回決算型）	1,999円
ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（毎月分配型）	1,101円
ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（年2回決算型）	1,702円
ダイワ米国株主還元株ファンド	1,043円
ダイワDBモメンタム戦略ファンド（為替ヘッジあり）	1,952円
ダイワDBモメンタム戦略ファンド（為替ヘッジなし）	1,908円
ダイワ/パリュール・パートナーズ・チャイナ・インベーター・ファンド	1,978円
世界M&A戦略株ファンド	1,602円
ダイワ・ブラジル・リアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハイインカム－ α50コース	49,911円
ダイワ・ブラジル・リアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハイインカム－ α100コース	49,911円
S & P 500（マルチアイ搭載）	106,168,088円
i F r e e E T F S & P 500ダブルインバース	300,585,799円
ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）	1,019円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,977円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は915,830円です。

■損益の状況

当期 自2023年12月12日 至2024年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	146,307円
受取利息	159,075
支払利息	△ 12,768
(B) 有価証券売買損益	100
売買益	100
(C) 当期損益金(A＋B)	146,407
(D) 前期繰越損益金	△ 621,909
(E) 解約差損益金	1,591,751
(F) 追加信託差損益金	△ 2,032,079
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	△ 915,830
次期繰越損益金(G)	△ 915,830

(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。