

# 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 —

★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	12年間（2012年10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」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益（評価益を含みます。）等とし、原則として、分配対象額の範囲内で、下記イ. およびロ. に基づき分配します。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。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。 イ. 計算期末の前営業日の基準価額（1万口当り。既払分配金を加算しません。以下同じ。）が10,500円未満の場合、原則として、主要投資対象とする外国投資信託のポートフォリオにおける利子・配当収入相当分から経費（外国投資信託の経費を含みます。）を控除した額を分配することをめざします。 ロ. 計算期末の前営業日の基準価額が10,500円以上の場合、原則として、当該基準価額に応じ、下記の金額（1万口当り）を分配することをめざします。 a. 10,500円以上11,000円未満の場合…100円 b. 11,000円以上11,500円未満の場合…150円 c. 11,500円以上12,000円未満の場合…200円 d. 12,000円以上12,500円未満の場合…250円 e. 12,500円以上の場合…300円 なお、計算期末の前営業日から当該計算期末までに基準価額が急激に変動した場合等には、上記の分配を行わないことがあります。

## 運用報告書（全体版）

第85期（決算日 2019年11月18日）

第86期（決算日 2019年12月17日）

第87期（決算日 2020年1月17日）

第88期（決算日 2020年2月17日）

第89期（決算日 2020年3月17日）

第90期（決算日 2020年4月17日）

（作成対象期間 2019年10月18日～2020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し、高利回りの獲得を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

最近30期の運用実績

決算期	基準価額				公社債 組入比	債券 比率	投資信託 証券 比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込	み 金	期騰 落				
	円	円		%	%	%	百万円	
61期末 (2017年11月17日)	9,128	30	△	2.0	—	98.9	7,811	
62期末 (2017年12月18日)	9,156	30		0.6	—	98.4	7,601	
63期末 (2018年1月17日)	9,378	30		2.8	—	99.0	7,675	
64期末 (2018年2月19日)	8,900	30	△	4.8	—	99.4	7,091	
65期末 (2018年3月19日)	8,686	30	△	2.1	—	98.8	6,787	
66期末 (2018年4月17日)	8,815	30		1.8	—	99.0	6,804	
67期末 (2018年5月17日)	8,730	20	△	0.7	—	98.3	6,603	
68期末 (2018年6月18日)	8,718	20		0.1	—	99.4	6,468	
69期末 (2018年7月17日)	8,838	20		1.6	—	98.4	6,477	
70期末 (2018年8月17日)	8,565	20	△	2.9	—	98.3	6,144	
71期末 (2018年9月18日)	8,642	20		1.1	—	99.5	6,145	
72期末 (2018年10月17日)	8,581	20	△	0.5	—	98.4	6,030	
73期末 (2018年11月19日)	8,804	20		2.8	—	98.7	6,044	
74期末 (2018年12月17日)	8,625	20	△	1.8	—	98.5	5,832	
75期末 (2019年1月17日)	8,304	20	△	3.5	—	98.3	5,520	
76期末 (2019年2月18日)	8,427	20		1.7	—	99.0	5,464	
77期末 (2019年3月18日)	8,504	20		1.2	—	98.6	5,370	
78期末 (2019年4月17日)	8,660	20		2.1	—	99.3	5,387	
79期末 (2019年5月17日)	8,193	20	△	5.2	—	98.7	5,024	
80期末 (2019年6月17日)	8,080	20	△	1.1	—	98.5	4,801	
81期末 (2019年7月17日)	8,312	20		3.1	—	98.3	4,841	
82期末 (2019年8月19日)	7,889	10	△	5.0	—	99.4	4,438	
83期末 (2019年9月17日)	8,114	10		3.0	—	99.5	4,445	
84期末 (2019年10月17日)	8,049	10	△	0.7	—	98.0	4,301	
85期末 (2019年11月18日)	8,100	10		0.8	—	98.2	4,211	
86期末 (2019年12月17日)	8,249	10		2.0	—	99.0	4,141	
87期末 (2020年1月17日)	8,299	10		0.7	—	98.4	4,141	
88期末 (2020年2月17日)	8,127	10	△	2.0	—	98.1	4,071	
89期末 (2020年3月17日)	6,770	10	△	16.6	—	97.6	3,349	
90期末 (2020年4月17日)	6,881	10		1.8	—	99.0	3,364	

(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。

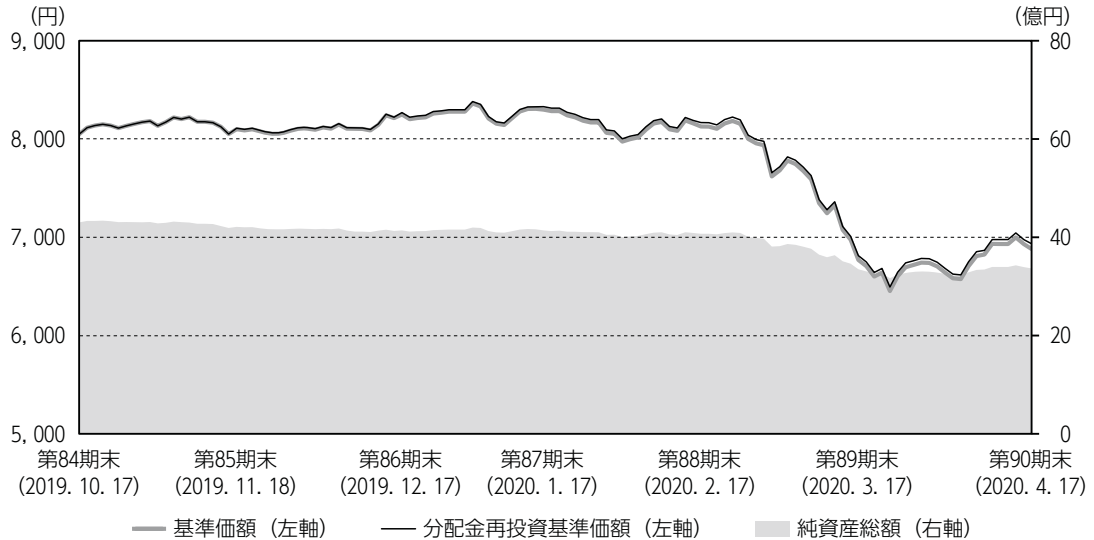
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



\* 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85期首：8,049円

第90期末：6,881円（既払分配金60円）

騰落率：△13.8%（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が軟調な動きとなったことや豪ドルが対円で下落（円高）したことなどが基準価額の下落要因となり、当ファンドの基準価額は下落しました。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ファンド -予想分配金提示型-

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %		
第85期	(期首) 2019年10月17日	8,049	—	—	98.0
	10月末	8,183	1.7	—	98.2
	(期末) 2019年11月18日	8,110	0.8	—	98.2
第86期	(期首) 2019年11月18日	8,100	—	—	98.2
	11月末	8,106	0.1	—	99.2
	(期末) 2019年12月17日	8,259	2.0	—	99.0
第87期	(期首) 2019年12月17日	8,249	—	—	99.0
	12月末	8,361	1.4	—	99.0
	(期末) 2020年1月17日	8,309	0.7	—	98.4
第88期	(期首) 2020年1月17日	8,299	—	—	98.4
	1月末	7,973	△ 3.9	—	99.2
	(期末) 2020年2月17日	8,137	△ 2.0	—	98.1
第89期	(期首) 2020年2月17日	8,127	—	—	98.1
	2月末	7,937	△ 2.3	—	98.3
	(期末) 2020年3月17日	6,780	△ 16.6	—	97.6
第90期	(期首) 2020年3月17日	6,770	—	—	97.6
	3月末	6,739	△ 0.5	—	98.6
	(期末) 2020年4月17日	6,891	1.8	—	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

(2019. 10. 18 ~ 2020. 4. 17)

### ■ オーストラリア債券市況

オーストラリア債券市況は、金利は低下（債券価格は上昇）しました。

当作成期首より、米中通商協議の進展期待が高まる中、金利は上昇基調で推移しました。しかし2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などからリスク回避的な動きが強まり、金利は低下しました。3月中旬にRBA（オーストラリア準備銀行）は、政策金利を史上最低の0.25%に引き下げるとともに国債の購入を通じて量的金融緩和を開始することを発表したほか、イールド・カーブ・コントロール（長短金利操作）の導入などを発表しました。しかし、市場の期待に届かなかったこともあり金利は急上昇しました。その後は、RBAを含めた世界各国の中央銀行が国債を買い入れる中で金利は低下に転じました。

豪ドル建ての普通社債およびハイブリッド証券は、当作成期首よりおおむね堅調に推移したものの、2020年2月後半以降は、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念からリスク回避的な動きが強まり、軟調に推移しました。経済的な危機を乗り切るために発行体は財務レバレッジの削減にフォーカスしたことから、社債等の新規発行は減少しました。

### ■ 為替相場

豪ドルは対円で下落しました。

当作成期首より、米中通商協議の進展期待が高まる中で市場のリスク回避姿勢が後退し、豪ドルは対円で上昇しました。一方で2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念などからリスク回避的な動きが強まる中で円が買われ、豪ドルは下落しました。3月後半以降は、世界的な経済対策への期待感から、豪ドルは対円で上昇に転じました。

## 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・ファンドの受益証券への投資割合を高位に保つことによって、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運用を行います。

※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：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

### ■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

普通社債とハイブリッド証券の起債については、今後も一定程度の募集がある状況が継続するとみています。引き続き、新規発行および流通市場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。

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性及び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

(2019. 10. 18 ~ 2020. 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

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し、高利回りの獲得をめざして運用を行いました。

### ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性及び資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

## ベンチマークとの差異について

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

## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金(税込み)は下記「分配原資の内訳(1万口当り)」の「当期分配金(税込み)」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程(1万口当り)」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳(1万口当り)

項 目	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期	第90期
	2019年10月18日 ～2019年11月18日	2019年11月19日 ～2019年12月17日	2019年12月18日 ～2020年1月17日	2020年1月18日 ～2020年2月17日	2020年2月18日 ～2020年3月17日	2020年3月18日 ～2020年4月17日
当期分配金(税込み)(円)	10	10	10	10	10	10
対基準価額比率(%)	0.12	0.12	0.12	0.12	0.15	0.15
当期の収益(円)	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外(円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額(円)	1,263	1,278	1,292	1,300	1,309	1,323

(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。

### 収益分配金の計算過程(1万口当り)

項 目	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期	第90期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 22.69円	✓ 25.05円	✓ 23.64円	✓ 18.81円	✓ 18.77円	✓ 23.88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	482.31	482.51	486.89	498.89	502.16	504.25
(d) 分配準備積立金	768.33	780.83	791.51	793.18	798.73	805.42
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,273.35	1,288.41	1,302.06	1,310.88	1,319.66	1,333.57
(f) 分配金	10.00	10.00	10.00	10.00	10.00	10.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,263.35	1,278.41	1,292.06	1,300.88	1,309.66	1,323.57

(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・ファンドの受益証券への投資割合を高位に保つことによって、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運用を行います。

### ■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

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。

### ■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85期～第90期 (2019. 10. 18～2020. 4. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	47円	0.593%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当作成期中の平均基準価額は7,846円です。</b>
(投 信 会 社)	(13)	(0.165)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(32)	(0.412)	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 銀 行)	(1)	(0.016)	受託銀行分は、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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	47	0.597	

(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。

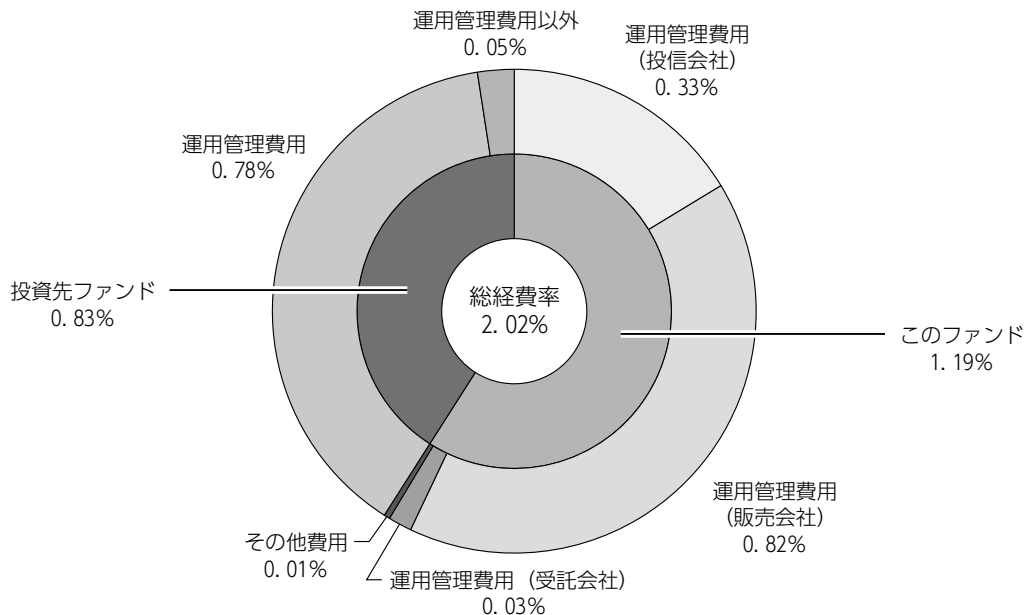
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.02%です。



総経費率 ( ① + ② + ③ )	2.02%
①このファンドの費用の比率	1.19%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.78%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.05%

(注1) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、この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5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) 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7) 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

(2019年10月18日から2020年4月17日まで)

決算期	第 85 期 ～ 第 90 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国 (邦貨建)	1,600,18824	139,540	4,833,92781	420,000

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。

(注2) 金額は受渡し代金。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄

### 投資信託受益証券

(2019年10月18日から2020年4月17日まで)

第 85 期 ～ 第 90 期							
買 付				売 付			
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	668,30773	60,000	89	DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A) (ケイマン諸島)	4,833,92781	420,000	86

(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 90 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千□	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA AUSTRALIAN HIGH INCOME SECURITIES FUND (CLASS A)	44,318,3553	3,332,031	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。

## (2) 親投資信託残高

種 類	第84期末	第 90 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	173	173	174

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2020年4月17日現在

項 目	第 90 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	3,332,031	98.6
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	174	0.0
コール・ローン等、その他	47,937	1.4
投資信託財産総額	3,380,142	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

(2019年11月18日)、(2019年12月17日)、(2020年1月17日)、(2020年2月17日)、(2020年3月17日)、(2020年4月17日)現在

項 目	第85期末	第86期末	第87期末	第88期末	第89期末	第90期末
<b>(A)資産</b>	<b>4,304,851,758円</b>	<b>4,196,546,288円</b>	<b>4,236,890,650円</b>	<b>4,081,148,181円</b>	<b>3,428,660,264円</b>	<b>3,380,142,942円</b>
コール・ローン等	49,736,817	97,081,120	43,264,206	84,704,971	38,732,966	47,937,430
投資信託受益証券(評価額)	4,134,940,618	4,099,290,862	4,073,452,139	3,996,268,922	3,269,753,010	3,332,031,224
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	174,323	174,306	174,306	174,288	174,288	174,288
未収入金	120,000,000	—	119,999,999	—	120,000,000	—
<b>(B)負債</b>	<b>93,575,541</b>	<b>55,439,889</b>	<b>95,272,804</b>	<b>9,234,690</b>	<b>78,757,535</b>	<b>15,402,598</b>
未払金	60,000,000	—	60,000,000	—	60,000,000	—
未払収益分配金	5,199,237	5,020,127	4,990,540	5,010,649	4,948,480	4,890,033
未払解約金	23,886,604	46,445,789	26,016,789	—	10,029,916	7,018,820
未払信託報酬	4,458,399	3,915,848	4,178,350	4,108,404	3,638,250	3,329,749
その他未払費用	31,301	58,125	87,125	115,637	140,889	163,996
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>4,211,276,217</b>	<b>4,141,106,399</b>	<b>4,141,617,846</b>	<b>4,071,913,491</b>	<b>3,349,902,729</b>	<b>3,364,740,344</b>
元本	5,199,237,700	5,020,127,314	4,990,540,317	5,010,649,197	4,948,480,477	4,890,033,285
次期繰越損益金	△ 987,961,483	△ 879,020,915	△ 848,922,471	△ 938,735,706	△ 1,598,577,748	△ 1,525,292,941
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>5,199,237,700口</b>	<b>5,020,127,314口</b>	<b>4,990,540,317口</b>	<b>5,010,649,197口</b>	<b>4,948,480,477口</b>	<b>4,890,033,285口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	<b>8,100円</b>	<b>8,249円</b>	<b>8,299円</b>	<b>8,127円</b>	<b>6,770円</b>	<b>6,881円</b>

\*第84期末における元本額は5,344,058,821円、当作成期間(第85期~第90期)中における追加設定元本額は138,362,446円、同解約元本額は592,387,982円です。

\*第90期末の計算口数当りの純資産額は6,881円です。

\*第90期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,525,292,941円です。

■損益の状況

第85期 自2019年10月18日 至2019年11月18日    第87期 自2019年12月18日 至2020年1月17日    第89期 自2020年2月18日 至2020年3月17日  
 第86期 自2019年11月19日 至2019年12月17日    第88期 自2020年1月18日 至2020年2月17日    第90期 自2020年3月18日 至2020年4月17日

項 目	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期	第90期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>13,487,613円</b>	<b>13,200,951円</b>	<b>13,473,673円</b>	<b>13,562,171円</b>	<b>12,953,526円</b>	<b>12,340,528円</b>
受取配当金	13,490,297	13,202,640	13,476,693	13,563,281	12,955,687	12,341,979
受取利息	66	81	35	164	7	120
支払利息	△ 2,750	△ 1,770	△ 3,055	△ 1,274	△ 2,168	△ 1,571
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>22,433,767</b>	<b>70,667,269</b>	<b>20,424,949</b>	<b>89,932,227</b>	<b>675,812,292</b>	<b>50,436,531</b>
売買益	23,828,211	71,155,699	20,694,813	838,641	3,767,239	50,609,025
売買損	△ 1,394,444	△ 488,430	△ 269,864	△ 90,770,868	△ 679,579,531	△ 172,494
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 4,489,700</b>	<b>△ 3,943,026</b>	<b>△ 4,207,350</b>	<b>△ 4,136,916</b>	<b>△ 3,663,502</b>	<b>△ 3,352,997</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>31,431,680</b>	<b>79,925,194</b>	<b>29,691,272</b>	<b>80,506,972</b>	<b>666,522,268</b>	<b>59,424,062</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>△ 1,121,069,857</b>	<b>△ 1,056,854,746</b>	<b>△ 970,787,843</b>	<b>△ 935,766,701</b>	<b>△ 1,004,509,525</b>	<b>△ 1,651,919,977</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>106,875,931</b>	<b>102,928,764</b>	<b>97,164,640</b>	<b>82,548,616</b>	<b>77,402,525</b>	<b>72,093,007</b>
(配当等相当額)	( 250,769,287)	( 242,229,191)	( 242,988,686)	( 249,977,549)	( 248,493,453)	( 246,583,078)
(売買損益相当額)	(△ 143,893,356)	(△ 139,300,427)	(△ 145,824,046)	(△ 167,428,933)	(△ 171,090,928)	(△ 174,490,071)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>△ 982,762,246</b>	<b>△ 874,000,788</b>	<b>△ 843,931,931</b>	<b>△ 933,725,057</b>	<b>△ 1,593,629,268</b>	<b>△ 1,520,402,908</b>
<b>(H)収益分配金</b>	<b>△ 5,199,237</b>	<b>△ 5,020,127</b>	<b>△ 4,990,540</b>	<b>△ 5,010,649</b>	<b>△ 4,948,480</b>	<b>△ 4,890,033</b>
次期繰越損益金(G+H)	<b>△ 987,961,483</b>	<b>△ 879,020,915</b>	<b>△ 848,922,471</b>	<b>△ 938,735,706</b>	<b>△ 1,598,577,748</b>	<b>△ 1,525,292,941</b>
追加信託差損益金	106,875,931	102,928,764	97,164,640	82,548,616	77,402,525	72,093,007
(配当等相当額)	( 250,769,287)	( 242,229,191)	( 242,988,686)	( 249,977,549)	( 248,493,453)	( 246,583,078)
(売買損益相当額)	(△ 143,893,356)	(△ 139,300,427)	(△ 145,824,046)	(△ 167,428,933)	(△ 171,090,928)	(△ 174,490,071)
分配準備積立金	406,078,994	399,551,281	401,820,281	401,851,620	399,592,670	400,647,431
繰越損益金	△ 1,500,916,408	△ 1,381,500,960	△ 1,347,907,392	△ 1,423,135,942	△ 2,075,572,943	△ 1,998,033,379

(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85期	第86期	第87期	第88期	第89期	第90期
(a) 経費控除後の配当等収益	11,801,727円	12,580,316円	11,801,243円	9,425,254円	9,290,021円	11,681,325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	250,769,287	242,229,191	242,988,686	249,977,549	248,493,453	246,583,078
(d) 分配準備積立金	399,476,504	391,991,092	395,009,578	397,437,015	395,251,129	393,856,139
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	662,047,518	646,800,599	649,799,507	656,839,818	653,034,603	652,120,542
(f) 分配金	5,199,237	5,020,127	4,990,540	5,010,649	4,948,480	4,890,033
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	656,848,281	641,780,472	644,808,967	651,829,169	648,086,123	647,230,509
(h) 受益権総口数	5,199,237,700□	5,020,127,314□	4,990,540,317□	5,010,649,197□	4,948,480,477□	4,890,033,285□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金	第85期	第86期	第87期	第88期	第89期	第90期
	10円	10円	10円	10円	10円	10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。

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

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

当ファンド（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 –）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・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」の受益証券に投資しております。以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。なお、クラス別の記載部分において「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」は「クラスA」と表記しております。

（注）2020年4月17日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（豪ドル建て）

貸借対照表  
2019年3月29日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$122,482,038）	\$	139,335,860
現金		2,747,014
外国為替先渡契約による評価益		55
未収：		
売却済みの投資		580,756
配当		69,712
利息		701,816
カウンターパーティへの預託金		270,000
その他資産		459
<b>資産合計</b>		<b>143,705,672</b>

負債

売建てオプションの評価額（受取プレミアム \$451,254）		320,823
未払：		
購入済みの投資		22,599
専門家報酬		79,745
運用会社報酬		79,191
保管会社報酬		16,302
会計および管理会社報酬		15,185
為替運用会社報酬		6,470

名義書換代理人報酬		3,140
登録料		1,947
<b>負債合計</b>		<b>545,402</b>
<b>純資産</b>	<b>\$</b>	<b>143,160,270</b>
<b>純資産</b>		
クラス A	\$	67,239,077
通貨αクラス		75,921,193
	<b>\$</b>	<b>143,160,270</b>
<b>発行済み受益証券口数</b>		
クラス A		56,111,784
通貨αクラス		105,726,707
<b>受益証券1口当り純資産額</b>		
クラス A	\$	1.198
通貨αクラス	\$	0.718

損益計算書

2019年3月29日に終了した年度

<b>投資収益</b>	
受取利息（源泉税 \$61,789 控除後）	\$ 3,919,063
配当収益（源泉税 \$33,833 控除後）	801,889
その他収益	7,585
<b>投資収益合計</b>	<b>4,728,537</b>
<b>費用</b>	
運用会社報酬	1,033,415
会計および管理会社報酬	95,196
為替運用会社報酬	85,054
保管会社報酬	84,545
専門家報酬	78,003
受託会社報酬	35,425
名義書換代理人報酬	21,315
登録料	3,304
その他費用	259
<b>費用合計</b>	<b>1,436,516</b>
<b>投資純利益</b>	<b>3,292,021</b>
<b>実現益（損）および評価益（損）：</b>	
<b>実現益（損失）：</b>	
証券投資	9,650,758
売建オプション	1,838,516
外国為替取引および外国為替先渡契約	(27,032)
<b>純実現利益</b>	<b>11,462,242</b>
<b>評価益（損）の純変動：</b>	
証券投資	(3,174,163)
売建オプション	(237,437)
外国為替換算および外国為替先渡契約	(1,663)
<b>評価損の純変動</b>	<b>(3,413,263)</b>
<b>純実現益（損）および評価益（損）の純変動</b>	<b>8,048,979</b>
<b>運用による純資産の純増</b>	<b>\$ 11,341,000</b>



投資明細表  
2019年3月29日

元本	証券の明細	評価額
	<b>債券 (84.4%)</b>	
	<b>オーストラリア (82.8%)</b>	
	<b>社債 (82.8%)</b>	
AUD 1,250,000	AAI, Ltd. (a), (b) 4.92% due 2042/10/6	\$ 1,305,909
AUD 5,000,000	AGL Energy, Ltd. (a) 5.00% due 2021/11/5	5,246,905
AUD 5,000,000	Ale Direct Property Trust (a) 4.00% due 2022/8/20	5,127,380
AUD 5,000,000	Alumina, Ltd. (a) 5.50% due 2019/11/19	5,056,705
AUD 1,500,000	AMP, Ltd. (a), (b) 4.72% due 2028/11/15	1,497,222
AUD 5,000,000	5.87% (c)	4,998,380
AUD 940,000	Aurizon Network Pty, Ltd. (a) 4.00% due 2024/6/21	971,913
AUD 3,000,000	Australia & New Zealand Banking Group, Ltd. (b) 2.91% due 2023/12/6	3,017,664
AUD 45,406	Australian Unity, Ltd. (b) 4.86% due 2020/12/15	4,654,569
AUD 1,500,000	Bank of Queensland, Ltd. (a), (b), (c) 6.47%	1,518,047
AUD 2,000,000	Bendigo & Adelaide Bank, Ltd. (a), (b) 4.32% due 2028/11/30	2,032,160
AUD 3,000,000	Challenger Life Co., Ltd. (a), (b) 3.99% due 2042/11/24	3,007,596
AUD 3,500,000	Commonwealth Bank of Australia (b) 3.19% due 2024/1/11	3,534,643
AUD 89,958	Crown Resorts, Ltd. (a), (b) 5.85% due 2075/4/23	9,173,017
AUD 3,000,000	Downer Group Finance Pty, Ltd. (a) 4.50% due 2022/3/11	3,126,000
AUD 2,000,000	IMF Bentham, Ltd. (a), (b) 5.97% due 2022/12/22	2,002,000
AUD 2,000,000	Incitec Pivot, Ltd. (a) 4.30% due 2026/3/18	2,033,002
AUD 1,500,000	Insurance Australia Group, Ltd. (a), (b) 3.94% due 2044/6/15	1,501,628

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 –

	元本	証券の明細	評価額
AUD	1,000,000	4.13% due 2045/6/15 Macquarie Bank, Ltd. (a), (b), (c)	1,002,761
AUD	4,818	5.17% Macquarie Finance, Ltd. (a), (b), (c)	489,268
AUD	128,538	3.76% Macquarie Group, Ltd. (a), (b), (c)	11,221,367
AUD	5,190	5.84% National Australia Bank, Ltd. (a), (b), (c)	535,089
AUD	145,283	3.22% NEXTDC, Ltd. (a)	12,990,334
AUD	2,500,000	5.61% due 2022/6/9 (b)	2,505,475
AUD	500,000	6.00% due 2022/6/9	507,290
AUD	2,000,000	6.25% due 2021/6/9 PACCAR Financial Pty, Ltd. (a)	2,030,894
AUD	2,000,000	3.00% due 2022/9/13 Pacific National Finance Pty, Ltd.	2,042,984
AUD	750,000	5.25% due 2025/5/19 Peet, Ltd. (b)	814,595
AUD	20,000	6.71% due 2022/10/5 Qube Holdings, Ltd. (b)	2,020,000
AUD	20,000	5.96% due 2023/10/5 SEEK, Ltd. (b)	2,140,000
AUD	5,000,000	4.37% due 2022/4/28 Suncorp Group, Ltd. (a), (b)	5,038,540
AUD	3,500,000	4.03% due 2028/12/5 Suncorp-Metway, Ltd. (a), (b), (c)	3,529,064
AUD	33,991	2.72% Teachers Mutual Bank, Ltd. (b)	2,729,239
AUD	2,000,000	3.14% due 2021/7/2 Virgin Australia Holdings, Ltd.	2,004,766
AUD	2,000,000	8.25% due 2023/5/30 Westpac Banking Corp. (b)	2,059,648
AUD	4,000,000	2.71% due 2023/3/6	4,005,228
AUD	1,000,000	3.61% due 2028/6/22 (a)	994,830
		<b>社債合計</b>	<b>118,466,112</b>
		<b>オーストラリア合計 (簿価 \$102,655,399)</b>	<b>118,466,112</b>

元本	証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	ニュージーランド (1.6%)		
	社債 (1.6%)		
AUD 27,335	Nufarm Finance NZ, Ltd. (a), (b), (c) 6.00%		2,338,509
	社債合計		<u>2,338,509</u>
	ニュージーランド合計 (簿価 \$2,194,099)		<u>2,338,509</u>
	債券合計 (簿価 \$104,849,498)		<u>120,804,621</u>
株数	優先株式 (10.6%)		
	オーストラリア (10.6%)		
	銀行 (6.5%)		
38,504	Commonwealth Bank of Australia (a), (b)		3,759,916
15,508	Commonwealth Bank of Australia/New Zealand (a), (b)		1,578,404
2,000,000	Members Equity Bank, Ltd. (a), (b)		2,044,940
20,000	Westpac Banking Corp. (a), (b)		2,003,800
			<u>9,387,060</u>
	保険 (0.6%)		
7,859	AMP, Ltd. (a), (b)		818,515
	不動産投資信託 (REIT) (3.5%)		
52,692	Multiplex SITES Trust (a), (b)		4,989,932
	オーストラリア合計 (簿価 \$14,295,655)		<u>15,195,507</u>
	優先株式合計 (簿価 \$14,295,655)		<u>15,195,507</u>
口数	MMF (2.3%)		
	オーストラリア (2.3%)		
3,333,809	Yarra A\$ Cash Reserves Fund Class A		3,335,732
	オーストラリア合計		<u>3,335,732</u>
	MMF 合計 (簿価 \$3,336,885)		<u>3,335,732</u>
	投資総額 (簿価 \$122,482,038)	97.3%	\$ 139,335,860
	負債を超過する現金およびその他の資産	2.7	3,824,410
	純資産	<u>100.0%</u>	<u>\$ 143,160,270</u>

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いて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) 償還条項付き証券
- (b) 2019年3月29日時点の変動利付証券
- (c) 永久債

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 –

2019年3月29日現在の通貨αクラスの外国為替先渡契約残高（純資産の0.0%）：

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益 / （損）
AUD	Citibank N. A.	227,233	2019/4/1	JPY	17,861,900	\$ 55	\$ —	\$ 55
						\$ 55	\$ —	\$ 55

2019年3月29日現在の通貨αクラスの売建オプション残高（純資産の-0.2%）：

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	\$ 79.05	2019/4/12	¥ 10,000,000	\$ (115,392)	\$ (41,099)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	78.55	2019/4/12	9,000,000	(91,164)	(63,992)
Call - Japanese Yen vs. Australian Dollar	78.56	2019/5/10	19,000,000	(244,698)	(215,732)
				\$ (451,254)	\$ (320,823)

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ファンド（一予想分配金提示型））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（2019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90期の決算日（2020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**

2019年10月18日～2020年4月17日における主要な売買銘柄はありません。

**■組入資産明細表**

2020年4月17日現在、有価証券等の組み入れはありません。

# ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

## 運用報告書 第11期 (決算日 2019年12月9日)

(作成対象期間 2018年12月11日～2019年12月9日)

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

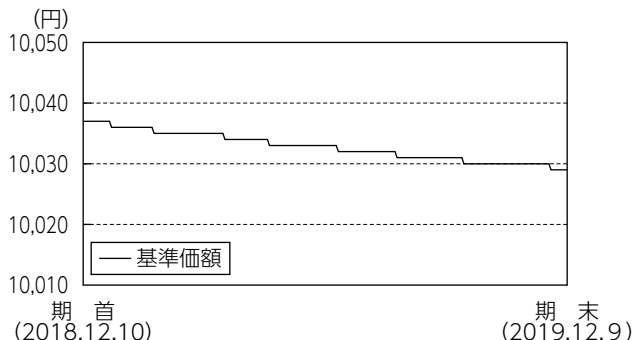
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社  
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	騰 落 率	
(期首)2018年12月10日	円	%	%
	10,037	-	-
12月末	10,037	0.0	-
2019年 1 月末	10,036	△0.0	-
2 月末	10,035	△0.0	-
3 月末	10,034	△0.0	-
4 月末	10,034	△0.0	-
5 月末	10,033	△0.0	-
6 月末	10,032	△0.0	-
7 月末	10,032	△0.0	-
8 月末	10,031	△0.1	-
9 月末	10,030	△0.1	-
10月末	10,030	△0.1	-
11月末	10,029	△0.1	-
(期末)2019年12月 9 日	10,029	△0.1	-

(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：10,037円 期末：10,029円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

短期の国債やコール・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

流動性と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。

《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)	2 (2)
合 計	2

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の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

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国債証券	330,004	(330,000)

(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

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

		当 期			
		買 付	売 付		
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
801	国庫短期証券	2019/3/18	330,004		千円

(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

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

2019年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	38,397,784	100.0
投資信託財産総額	38,397,784	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

2019年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	38,397,784,417円
コール・ローン等	38,397,784,417
(B) 負債	231,026
その他未払費用	231,026
(C) 純資産総額(A - B)	38,397,553,391
元本	38,285,006,118
次期繰越損益金	112,547,273
(D) 受益権総口数	38,285,006,118口
1万口当り基準価額(C/D)	10,029円

\* 期首における元本額は69,103,393,644円、当作成期間中における追加設定元本額は48,176,499,313円、同解約元本額は78,994,886,839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は、ダイワ米ドル・プルファンド (適格機関投資家専用) 5,951,591,455円、ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用) 17,806,836,243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) 965,948,988円、通貨選択型米国リート・αクワトロ (毎月分配型) 159,141円、通貨選択型アメリカン・エクイティ・αクワトロ (毎月分配型) 159,141円、オール・マーケット・インカム戦略 (資産成長重視コース) 9,963円、オール・マーケット・インカム戦略 (奇数月定額分配コース) 9,963円、オール・マーケット・インカム戦略 (予想分配金提示型コース) 9,963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) 3,421,817,396円、ダイワユーロベア・ファンド (2倍、非リバランス型) (適格機関投資家専用) 963,651,156円、ダイワ米ドルベア・ファンド (2倍、非リバランス型) (適格機関投資家専用) 1,531,319,164円、ダイワ/ロジャーズ国際コモディティ<sup>TM</sup>・ファンド5,408,343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TOPIXベア・ファンド (適格機関投資家専用) 7,635,801,481円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券α (毎月分配型) 9,949円、ダイワ米国国債7-10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - UST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円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,029円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月11日 至2019年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 33,300,262円
受取利息	347,877
支払利息	△ 33,648,139
(B) その他費用	△ 13,012,117
(C) 当期損益金(A + B)	△ 46,312,379
(D) 前期繰越損益金	255,922,474
(E) 解約差損益金	△ 260,877,509
(F) 追加信託差損益金	163,814,687
(G) 合計(C + D + E + F)	112,547,273
次期繰越損益金(G)	112,547,273

(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。