

# 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119期 (決算日2024年1月17日)  
第120期 (決算日2024年2月19日)  
第121期 (決算日2024年3月18日)  
第122期 (決算日2024年4月17日)  
第123期 (決算日2024年5月17日)  
第124期 (決算日2024年6月17日)

(作成対象期間 2023年12月19日～2024年6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 組入率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	円	%	%	%	百万円
95 期末 (2022年 1 月17日)	5,683	40	2.2	22,289	△ 1.1	125.03	1.0	—	98.5	11,585
96 期末 (2022年 2 月17日)	5,596	40	△ 0.8	21,737	△ 2.5	125.28	0.2	—	98.5	11,234
97 期末 (2022年 3 月17日)	5,457	40	△ 1.8	21,576	△ 0.7	126.53	1.0	—	98.7	10,895
98 期末 (2022年 4 月18日)	5,797	40	7.0	24,376	13.0	134.27	6.1	—	99.3	11,471
99 期末 (2022年 5 月17日)	5,369	40	△ 6.7	22,012	△ 9.7	129.08	△ 3.9	—	99.2	10,425
100 期末 (2022年 6 月17日)	5,120	40	△ 3.9	21,066	△ 4.3	137.56	6.6	—	98.5	9,759
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

(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。

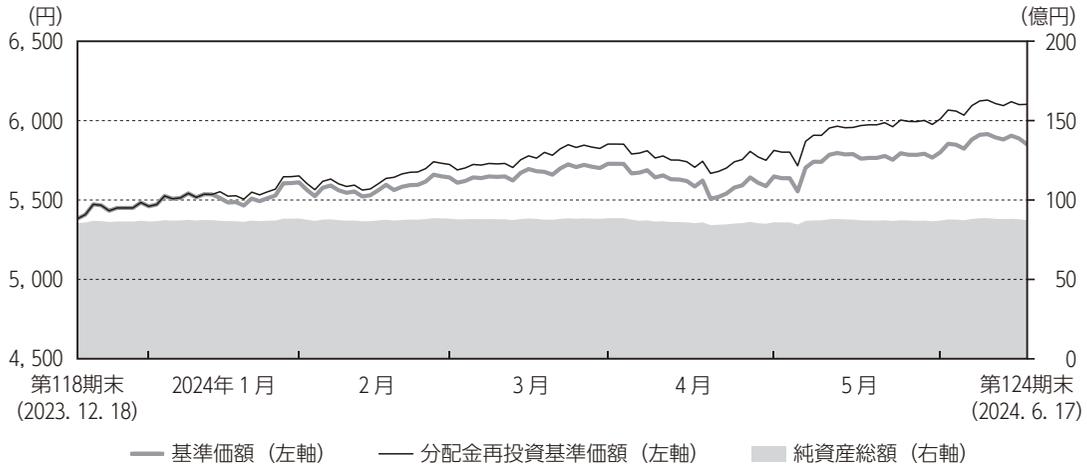
(注6) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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119期首：5,383円

第124期末：5,850円 (既払分配金240円)

騰落率：13.4% (分配金再投資ベース)

### ■ 基準価額の主な変動要因

スイス株式市況の上昇や、スイス・フランが対円で上昇 (円安) したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。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マイナ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 入 率	投資信託 受益証券 組入比率
		円	%	(参考指数)	%	(参考指数)	%		
第119期	(期首) 2023年12月18日	5,383	—	27,611	—	163.37	—	—	98.7
	12月末	5,461	1.4	28,093	1.7	168.24	3.0	—	98.9
	(期末) 2024年1月17日	5,553	3.2	29,015	5.1	171.10	4.7	—	98.6
第120期	(期首) 2024年1月17日	5,513	—	29,015	—	171.10	—	—	98.6
	1月末	5,612	1.8	29,579	1.9	171.17	0.0	—	98.8
	(期末) 2024年2月19日	5,603	1.6	29,120	0.4	170.49	△ 0.4	—	98.7
第121期	(期首) 2024年2月19日	5,563	—	29,120	—	170.49	—	—	98.7
	2月末	5,643	1.4	29,556	1.5	171.47	0.6	—	98.7
	(期末) 2024年3月18日	5,718	2.8	30,146	3.5	168.99	△ 0.9	0.0	98.5
第122期	(期首) 2024年3月18日	5,678	—	30,146	—	168.99	—	0.0	98.5
	3月末	5,729	0.9	30,156	0.0	167.92	△ 0.6	0.0	98.5
	(期末) 2024年4月17日	5,548	△ 2.3	29,232	△ 3.0	169.65	0.4	0.0	99.4
第123期	(期首) 2024年4月17日	5,508	—	29,232	—	169.65	—	0.0	99.4
	4月末	5,649	2.6	30,216	3.4	172.17	1.5	0.0	98.6
	(期末) 2024年5月17日	5,801	5.3	31,848	8.9	171.48	1.1	0.0	98.8
第124期	(期首) 2024年5月17日	5,761	—	31,848	—	171.48	—	0.0	98.8
	5月末	5,801	0.7	32,082	0.7	173.60	1.2	0.0	98.7
	(期末) 2024年6月17日	5,890	2.2	33,168	4.1	176.84	3.1	0.0	98.6

(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. 12. 19 ~ 2024. 6. 17）

## ■ スイス株式市況

スイス株式市況は上昇しました。

スイス株式市況は、当作成期首より、スイスの経済指標において強弱の材料が入り混じる中、株価は狭いレンジ内の動きで推移しました。2024年2月半ばから3月にかけては、スイスのCPI（消費者物価指数）の下振れなどを受けて、SNB（スイス国立銀行）による早期利下げ観測が高まり、株価は上昇しました。4月に入ると、中東情勢の緊迫化や米国の利下げ後ずれ観測などのマイナス材料に押され、株価は弱含む場面も見られましたが、5月以降は、米国におけるインフレ鈍化傾向などを背景にFRB（米国連邦準備制度理事会）による年内の利下げ期待が広がったことから、市場でリスク選好姿勢が強まり、株価は堅調に推移しました。

## ■ 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）は上昇しました。

当作成期首より、インプライド・ボラティリティは狭いレンジ内の動きで推移しました。2024年4月に入ると、中東情勢の悪化などを背景にリスク回避姿勢が強まり、一時的にインプライド・ボラティリティが上昇する場面も見られました。その後、市場が落ち着きを取り戻すに連れて、インプライド・ボラティリティは低下に向かいましたが、当作成期末にかけては、フランスや英国での選挙をめぐる先行き不透明感が広がったため、インプライド・ボラティリティは上昇しました。

## ■ 為替相場

スイス・フランは対円で上昇しました。

当作成期首より、中東情勢の緊迫化を受けて、永世中立国であるスイスを選好し、市場で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・フランは対円で上昇（円安）しました。その後、2024年3月にSNB（スイス国立銀行）が利下げを決定したことなどが悪材料となり、スイス・フランは上値の重い展開となりました。しかし4月以降は、1-3月期のスイスGDP（国内総生産）成長率（前期比）が市場予想を上回ったことなどが下支えとなり、スイス・フランは堅調に推移しました。

## ■ 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）は低下しました。

当作成期首より、底堅いスイス・フランの値動きなどを背景に、インプライド・ボラティリティは低下基調で推移しました。2024年3月以降は、急速な為替変動を受けて一時的にインプライド・ボラティリティが上昇する場面もありましたが、当作成期末にかけては、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」

### ■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。

## ポートフォリオについて

（2023. 12. 19 ~ 2024. 6. 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、生活必需品セクターのアンダーウエートや同セクター内の銘柄選択、素材セクターのオーバーウエートなどが主なプラス要因となりました。一方、コミュニケーション・サービスセクターのオーバーウエートや同セクター内の銘柄選択、一般消費

財・サービス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、Nestle のアンダーウエートのほか、ABB や Swiss Re のオーバーウエート、Sika の非保有などが主なプラス要因となりました。一方、Alcon の非保有や CIE Financiere Richemont 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。

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。

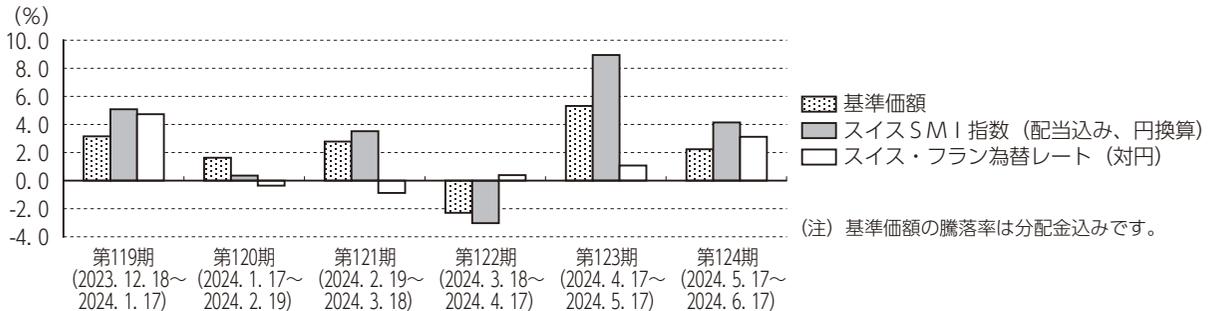
### ■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

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119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
	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	2024年4月18日 ～2024年5月17日	2024年5月18日 ～2024年6月17日
<b>当期分配金(税込み) (円)</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>40</b>
対基準価額比率 (%)	0.72	0.71	0.70	0.72	0.69	0.68
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)	1,684	1,706	1,722	1,727	1,776	1,857

(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119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 53.34円	✓ 62.25円	✓ 55.28円	✓ 45.52円	✓ 89.33円	✓ 120.12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	229.42	232.39	235.14	237.25	240.00	242.35
(d) 分配準備積立金	1,441.65	1,452.06	1,471.58	1,484.76	1,487.54	1,534.53
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,724.42	1,746.71	1,762.01	1,767.54	1,816.88	1,897.01
(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)	1,684.42	1,706.71	1,722.01	1,727.54	1,776.88	1,857.01

(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、「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119期～第124期 (2023. 12. 19～2024. 6. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	38円	0. 669%	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, 639円です。
（投信会社）	(12)	(0. 218)	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. 437)	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）	(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	38	0. 672	

(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。

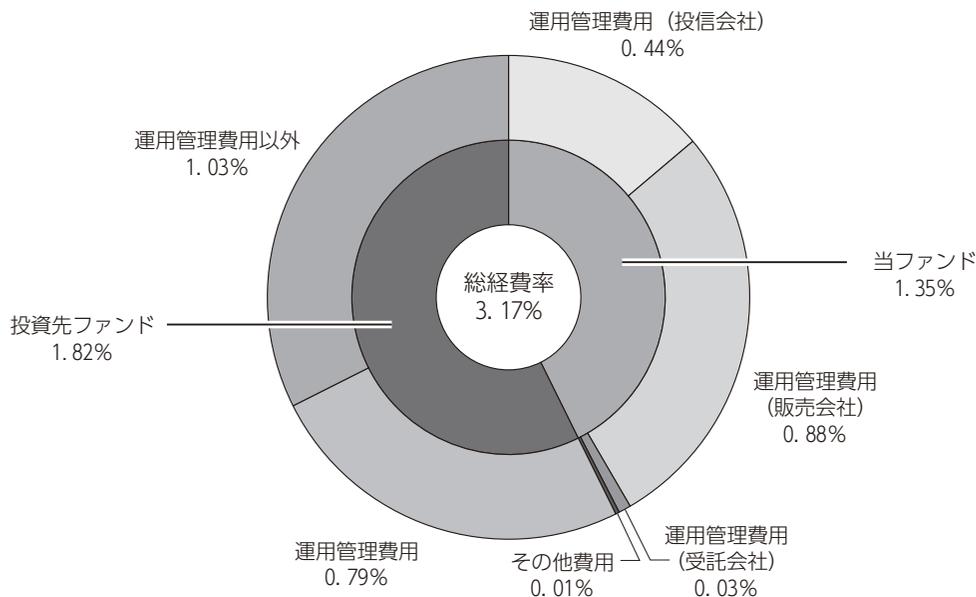
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

## ダイワ・スイス高配当株ツイン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12月19日から2024年6月17日まで)

決 算 期		第 119 期 ～ 第 124 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
外国（邦貨建）	UBS (CAY) SWISS HIGH DIVIDEND EQUITY TWIN ALPHA FUND（ケイマン諸島）	15,987.09301	690,939	22,303.73094	971,000

(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12月19日から2024年6月17日まで)

決 算 期	第 119 期 ～ 第 124 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	—	—	2,995	2,987

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2024年6月17日現在

項 目	第 124 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	8,613,318	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	206,928	2.3
投資信託財産総額	8,820,248	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

#### (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 124 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) UBS (CAY) SWISS HIGH DIVIDEND EQUITY TWIN ALPHA FUND	194,348.21881	8,613,318	98.6

(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118期末	第 124 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	2,996	1	1

(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

(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)、(2024年6月17日) 現在

項 目	第119期末	第120期末	第121期末	第122期末	第123期末	第124期末
<b>(A)資産</b>	<b>8,784,569,622円</b>	<b>8,800,329,642円</b>	<b>8,987,776,072円</b>	<b>8,502,696,077円</b>	<b>8,823,720,650円</b>	<b>8,820,248,055円</b>
コール・ローン等	203,638,796	204,752,612	135,116,032	136,318,545	198,499,527	206,928,330
投資信託受益証券 (評価額)	8,577,942,810	8,592,589,014	8,645,672,025	8,366,376,516	8,625,220,107	8,613,318,709
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	2,988,016	2,988,016	2,988,016	1,016	1,016	1,016
未収入金	—	—	203,999,999	—	—	—
<b>(B)負債</b>	<b>85,315,775</b>	<b>90,493,908</b>	<b>212,564,676</b>	<b>83,805,568</b>	<b>97,274,026</b>	<b>85,192,335</b>
未払金	—	—	102,000,000	—	—	—
未払収益分配金	63,122,424	62,624,752	61,817,412	61,142,639	60,593,879	59,725,916
未払解約金	12,547,391	17,150,735	39,503,315	12,735,164	26,859,990	15,086,373
未払信託報酬	9,587,274	10,594,883	9,064,926	9,689,433	9,523,533	10,022,077
その他未払費用	58,686	123,538	179,023	238,332	296,624	357,969
<b>(C)純資産総額 (A - B)</b>	<b>8,699,253,847</b>	<b>8,709,835,734</b>	<b>8,775,211,396</b>	<b>8,418,890,509</b>	<b>8,726,446,624</b>	<b>8,735,055,720</b>
元本	15,780,606,217	15,656,188,077	15,454,353,019	15,285,659,755	15,148,469,996	14,931,479,166
次期繰越損益金	△ 7,081,352,370	△ 6,946,352,343	△ 6,679,141,623	△ 6,866,769,246	△ 6,422,023,372	△ 6,196,423,446
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>15,780,606,217口</b>	<b>15,656,188,077口</b>	<b>15,454,353,019口</b>	<b>15,285,659,755口</b>	<b>15,148,469,996口</b>	<b>14,931,479,166口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	5.513円	5.563円	5.678円	5.508円	5.761円	5.850円

\* 当作成期首における元本額は15,873,423,525円、当作成期間 (第119期～第124期) 中における追加設定元本額は160,662,530円、同解約元本額は1,102,606,889円です。

\* 第124期末の計算口数当りの純資産額は5,850円です。

\* 第124期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は6,196,423,446円です。

■損益の状況

第119期 自2023年12月19日 至2024年1月17日    第121期 自2024年2月20日 至2024年3月18日    第123期 自2024年4月18日 至2024年5月17日  
 第120期 自2024年1月18日 至2024年2月19日    第122期 自2024年3月19日 至2024年4月17日    第124期 自2024年5月18日 至2024年6月17日

項 目	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>87,203,710円</b>	<b>104,803,613円</b>	<b>88,695,279円</b>	<b>79,336,184円</b>	<b>138,254,214円</b>	<b>188,712,432円</b>
受取配当金	87,206,828	104,805,036	88,696,323	79,329,685	138,248,178	188,705,988
受取利息	6	3	1	6,546	6,036	6,444
支払利息	△ 3,124	△ 1,426	△ 1,045	△ 47	—	—
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>190,658,252</b>	<b>47,605,239</b>	<b>159,867,626</b>	<b>△ 268,975,277</b>	<b>314,946,219</b>	<b>14,693,428</b>
売益	191,399,685	48,606,089	160,555,608	1,218,272	316,820,551	14,679,119
売損	△ 741,433	△ 1,000,850	△ 687,982	△ 270,193,549	△ 1,874,332	△ 14,309
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 9,645,960</b>	<b>△ 10,659,735</b>	<b>△ 9,120,411</b>	<b>△ 9,748,742</b>	<b>△ 9,581,825</b>	<b>△ 10,083,422</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>268,216,002</b>	<b>141,749,117</b>	<b>239,442,494</b>	<b>△ 199,387,835</b>	<b>443,618,608</b>	<b>193,322,438</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 3,563,696,089</b>	<b>△ 3,325,201,355</b>	<b>△ 3,198,277,369</b>	<b>△ 2,983,441,391</b>	<b>△ 3,208,942,124</b>	<b>△ 2,781,190,302</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 3,722,949,859</b>	<b>△ 3,700,275,353</b>	<b>△ 3,658,489,336</b>	<b>△ 3,622,797,381</b>	<b>△ 3,596,105,977</b>	<b>△ 3,548,829,666</b>
(配当等相当額)	( 362,049,341)	( 363,843,276)	( 363,397,611)	( 362,658,736)	( 363,574,804)	( 361,869,729)
(売買損益相当額)	(△ 4,084,999,200)	(△ 4,064,118,629)	(△ 4,021,886,947)	(△ 3,985,456,117)	(△ 3,959,680,781)	(△ 3,910,699,395)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 7,018,229,946</b>	<b>△ 6,883,727,591</b>	<b>△ 6,617,324,211</b>	<b>△ 6,805,626,607</b>	<b>△ 6,361,429,493</b>	<b>△ 6,136,697,530</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 63,122,424</b>	<b>△ 62,624,752</b>	<b>△ 61,817,412</b>	<b>△ 61,142,639</b>	<b>△ 60,593,879</b>	<b>△ 59,725,916</b>
次期繰越損益金 (G + H)	△ 7,081,352,370	△ 6,946,352,343	△ 6,679,141,623	△ 6,866,769,246	△ 6,422,023,372	△ 6,196,423,446
追加信託差損益金	△ 3,722,949,859	△ 3,700,275,353	△ 3,658,489,336	△ 3,622,797,381	△ 3,596,105,977	△ 3,548,829,666
(配当等相当額)	( 362,049,341)	( 363,843,276)	( 363,397,611)	( 362,658,736)	( 363,574,804)	( 361,869,729)
(売買損益相当額)	(△ 4,084,999,200)	(△ 4,064,118,629)	(△ 4,021,886,947)	(△ 3,985,456,117)	(△ 3,959,680,781)	(△ 3,910,699,395)
分配準備積立金	2,296,078,737	2,308,228,905	2,297,863,104	2,278,000,929	2,328,139,056	2,410,921,648
繰越損益金	△ 5,654,481,248	△ 5,554,305,895	△ 5,318,515,391	△ 5,521,972,794	△ 5,154,056,451	△ 5,058,515,428

(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、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。

## ドイツ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
(a) 経費控除後の配当等収益	84,176,706円	97,473,945円	85,441,093円	69,587,442円	135,330,799円	179,357,033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	362,049,341	363,843,276	363,397,611	362,658,736	363,574,804	361,869,729
(d) 分配準備積立金	2,275,024,455	2,273,379,712	2,274,239,423	2,269,556,126	2,253,402,136	2,291,290,531
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,721,250,502	2,734,696,933	2,723,078,127	2,701,802,304	2,752,307,739	2,832,517,293
(f) 分配金	63,122,424	62,624,752	61,817,412	61,142,639	60,593,879	59,725,916
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	2,658,128,078	2,672,072,181	2,661,260,715	2,640,659,665	2,691,713,860	2,772,791,377
(h) 受益権総口数	15,780,606,217口	15,656,188,077口	15,454,353,019口	15,285,659,755口	15,148,469,996口	14,931,479,166口

### 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1万口当り分配金(税込み)	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124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		<u>9,010,636,316</u>

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		<u>141,529,257</u>
償還可能受益証券保有者に帰属する純資産	¥	<u>8,869,107,059</u>

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)

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
	<b>普通株 (96.7%)</b>		
	<b>アイルランド (0.2%)</b>		
	<b>医薬品 (0.2%)</b>		
2,935	COSMO Pharmaceuticals NV	0.2	¥ 21,456,518
	<b>アイルランド合計</b>		21,456,518
	<b>スイス (96.5%)</b>		
	<b>銀行 (14.0%)</b>		
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
	<b>バイオテクノロジー (0.0%)</b>		
6,604	Idorsia, Ltd.	0.0	2,151,221
	<b>建築材料 (3.6%)</b>		
29,557	LafargeHolcim Ltd.	3.6	323,112,693
	<b>化学 (6.3%)</b>		
1,202	EMS-Chemie Holding AG	1.4	126,802,830
774	Givaudan SA	4.9	430,563,241
			557,366,071
	<b>商業サービス (1.5%)</b>		
18,464	Adecco Group AG	1.5	132,062,951
	<b>コンピューター (1.1%)</b>		
33,229	Softwareone Holding AG	1.1	100,558,774
	<b>流通・卸売 (0.9%)</b>		
2,410	Bossard Holding AG	0.9	81,782,480
	<b>総合金融サービス (0.9%)</b>		
9,301	Vontobel Holding AG	0.9	80,171,553
	<b>電機 (6.3%)</b>		
95,165	ABB, Ltd.	6.3	561,583,785
	<b>エンジニアリング・建設 (0.5%)</b>		
2,729	Burkhalter Holding AG	0.5	41,942,534
	<b>食品 (10.3%)</b>		
401	Barry Callebaut AG	1.1	99,331,414
48,285	Nestle SA	9.2	815,572,928
			914,904,342
	<b>ヘルスケア製品 (1.8%)</b>		
3,679	Sonova Holding AG	1.8	157,808,260
	<b>ヘルスケアサービス (2.5%)</b>		
3,905	Lonza Group AG	2.5	224,664,310

## ドイツ・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
	<b>保険 (16.0%)</b>		
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
			<hr/> 1,415,494,499 <hr/>
	<b>総合機械 (2.1%)</b>		
17,656	Accelleron Industries AG	0.9	75,464,081
11,067	Georg Fischer AG	1.2	107,812,031
			<hr/> 183,276,112 <hr/>
	<b>金属製品 (1.0%)</b>		
5,284	SFS Group AG	1.0	88,667,131
	<b>その他製造業 (1.4%)</b>		
3,661	Daetwyler Holding AG	1.4	123,487,811
	<b>容器・包装 (1.6%)</b>		
41,388	SIG Combibloc Group AG Class C	1.6	143,826,207
	<b>医薬品 (19.9%)</b>		
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
			<hr/> 1,761,760,483 <hr/>
	<b>不動産 (0.2%)</b>		
868	Investis Holding SA	0.2	13,871,719
	<b>小売 (1.9%)</b>		
9,314	Cie Financiere Richemont SA	1.9	172,918,542
	<b>通信 (2.7%)</b>		
2,728	Swisscom AG	2.7	236,721,512
	<b>スイス合計</b>		8,559,381,155
	<b>普通株合計 (簿価 ¥5,638,168,287)</b>		<hr/> <b>¥ 8,580,837,673</b> <hr/>

### 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)
				<hr/> ¥ (76,716,319)	<hr/> ¥ (109,200,591) <hr/>

\* 利害関係人

<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（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124期の決算日（2024年6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

(2023年12月19日から2024年6月17日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
1219国庫短期証券 2024/6/24	千円 173,997		千円

(注1) 金額は受渡し代金（経過利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6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（205,481千口）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

作 成 期	2024年6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 174,000	千円 173,999	% 84.9	% —	% —	% —	% 84.9	

(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6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 174,000	千円 173,999	2024/06/24	

(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12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。

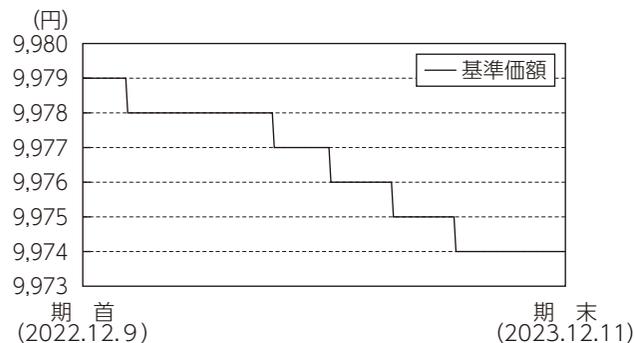
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率		
	円	%	%
(期首)2022年12月9日	9,979	-	-
12月末	9,979	0.0	-
2023年1月末	9,978	△0.0	-
2月末	9,978	△0.0	-
3月末	9,978	△0.0	-
4月末	9,978	△0.0	-
5月末	9,977	△0.0	-
6月末	9,976	△0.0	-
7月末	9,976	△0.0	-
8月末	9,975	△0.0	-
9月末	9,974	△0.1	-
10月末	9,974	△0.1	-
11月末	9,974	△0.1	-
(期末)2023年12月11日	9,974	△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：9,979円 期末：9,974円 騰落率：△0.1%

【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	-
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	237,201	100.0
投資信託財産総額	237,201	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## ■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	237,201,069円
コール・ローン等	237,201,069
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	237,201,069
元本	237,822,978
次期繰越損益金	△ 621,909
(D) 受益権総口数	237,822,978口
1万口当り基準価額(C/D)	9,974円

\* 期首における元本額は88,294,563円、当作成期間中における追加設定元本額は948,869,489円、同解約元本額は799,341,074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) 219,583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) 10,021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) 848,389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) 6,716円
- ダイワ米国株主還元株ファンド 64,214円
- ダイワD B モメンタム戦略ファンド (為替ヘッジあり) 6,592,748円
- ダイワD B モメンタム戦略ファンド (為替ヘッジなし) 10,288,683円
- ダイワ/パリュール・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド 10,000円
- 世界M&A戦略株ファンド 1,001,302円
- ダイワ・フジリ・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・フジリ・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) 66,075,873円
- i Free ETF S & P 500ダブルインバース 149,607,523円
- ダイワ・スイス高配当株ツインα (毎月分配型) 2,996,106円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,974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621,909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	△ 158,856円
受取利息	1,183
支払利息	△ 160,039
(B) 当期損益金(A)	△ 158,856
(C) 前期繰越損益金	△ 184,238
(D) 解約差損益金	2,052,274
(E) 追加信託差損益金	△2,331,089
(F) 合計(B + C + D + E)	△ 621,909
次期繰越損益金(F)	△ 621,909

(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。