

豪州高配当株 ツインαファンド (毎月分配型)

◆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	2012年8月31日から2026年4月27日まで				
運用方針	安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行います。				
主要運用対象	外国投資信託である「UBSユニバーサル・トラスト(ケイマン)II-豪州高配当株・ツインαファンド」および親投資信託である「T&Dマネーブルマザーファンド」を主要投資対象とします。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。				
	<table border="1"> <tr> <td>UBSユニバーサル・トラスト(ケイマン)II-豪州高配当株・ツインαファンド</td> <td>主としてオーストラリアの証券取引所に上場している株式および投資信託証券(不動産投資信託(リート)を含みます。)に投資することにより、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行います。また、スワップ取引を通じて、実質的に豪州株式市場全体(株価指数等)のオプション取引(コールオプションの売却)および通貨のオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。</td> </tr> <tr> <td>T&Dマネーブルマザーファンド</td> <td>わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。</td> </tr> </table>	UBSユニバーサル・トラスト(ケイマン)II-豪州高配当株・ツインαファンド	主としてオーストラリアの証券取引所に上場している株式および投資信託証券(不動産投資信託(リート)を含みます。)に投資することにより、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行います。また、スワップ取引を通じて、実質的に豪州株式市場全体(株価指数等)のオプション取引(コールオプションの売却)および通貨のオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。	T&Dマネーブルマザーファンド	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
	UBSユニバーサル・トラスト(ケイマン)II-豪州高配当株・ツインαファンド	主としてオーストラリアの証券取引所に上場している株式および投資信託証券(不動産投資信託(リート)を含みます。)に投資することにより、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行います。また、スワップ取引を通じて、実質的に豪州株式市場全体(株価指数等)のオプション取引(コールオプションの売却)および通貨のオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。			
T&Dマネーブルマザーファンド	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。				
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。外貨建資産への直接投資は行いません。株式への直接投資は行いません。				
分配方針	毎決算時(毎月25日、休業日の場合は翌営業日)に分配を行います。ただし、必ず分配を行うものではありません。分配金額は、分配対象額の範囲内で委託会社が決定するものとし、原則として、インカム収益を中心に分配を行うことを目指します。ただし、基準価額水準等によっては、売買益(評価益を含みます。)が中心となる場合があります。				

運用報告書(全体版)(第24作成期)

第137期(2024年2月26日) 第140期(2024年5月27日)
第138期(2024年3月25日) 第141期(2024年6月25日)
第139期(2024年4月25日) 第142期(2024年7月25日)

お客様へ

毎々格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「豪州高配当株ツインαファンド(毎月分配型)」は、2024年7月25日に第142期決算を行いましたので、第137期から第142期の運用状況をご報告申し上げます。

今後ともより一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

 T&Dアセットマネジメント株式会社

〒108-0014 東京都港区芝5-36-7

お問い合わせ先

投信営業部 03-6722-4810

(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

<https://www.tdasset.co.jp/>

最近5作成期の運用実績、基準価額の推移等

最近5作成期の運用実績

決算期	基準価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	U ニ バ ー サ ル ・ ト ラ ス ト (ケ イ マ ン) II ・ 豪 州 高 配 当 株 ・ ツ イ ン a フ ア ン ド 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率						
第20 作成 期	113期 (2022年2月25日)	円 1,317	円 25	% 4.5	% —	% —	% 98.9	百万円 2,528	
	114期 (2022年3月25日)	1,363	25	5.4	—	—	98.9	2,757	
	115期 (2022年4月25日)	1,390	25	3.8	—	—	98.2	2,805	
	116期 (2022年5月25日)	1,279	25	△6.2	—	—	98.7	2,920	
	117期 (2022年6月27日)	1,226	25	△2.2	—	—	98.7	3,075	
	118期 (2022年7月25日)	1,245	25	3.6	—	—	98.7	3,212	
第21 作成 期	119期 (2022年8月25日)	1,237	25	1.4	—	—	98.7	3,330	
	120期 (2022年9月26日)	1,194	25	△1.5	—	—	99.2	3,416	
	121期 (2022年10月25日)	1,160	25	△0.8	—	—	98.7	3,462	
	122期 (2022年11月25日)	1,194	25	5.1	—	—	98.7	3,668	
	123期 (2022年12月26日)	1,122	25	△3.9	—	—	92.8	3,858	
	124期 (2023年1月25日)	1,144	20	3.7	—	—	98.8	3,957	
第22 作成 期	125期 (2023年2月27日)	1,134	20	0.9	—	—	98.8	3,863	
	126期 (2023年3月27日)	1,032	20	△7.2	—	—	98.7	3,561	
	127期 (2023年4月25日)	1,089	20	7.5	—	—	98.1	3,830	
	128期 (2023年5月25日)	1,078	20	0.8	—	—	98.9	4,055	
	129期 (2023年6月26日)	1,080	20	2.0	—	—	98.8	4,218	
	130期 (2023年7月25日)	1,089	20	2.7	—	—	98.8	4,492	
第23 作成 期	131期 (2023年8月25日)	1,043	20	△2.4	—	—	98.7	4,667	
	132期 (2023年9月25日)	1,030	20	0.7	—	—	98.7	4,800	
	133期 (2023年10月25日)	991	20	△1.8	—	—	98.8	4,802	
	134期 (2023年11月27日)	1,009	20	3.8	—	—	98.9	5,128	
	135期 (2023年12月25日)	996	20	0.7	—	—	93.8	5,256	
	136期 (2024年1月25日)	994	20	1.8	—	—	98.0	5,444	
第24 作成 期	137期 (2024年2月26日)	1,013	20	3.9	—	—	96.6	5,396	
	138期 (2024年3月25日)	1,021	20	2.8	0.2	—	96.2	5,839	
	139期 (2024年4月25日)	991	20	△1.0	0.2	—	97.0	5,805	
	140期 (2024年5月27日)	977	20	0.6	0.2	—	98.5	5,903	
	141期 (2024年6月25日)	981	20	2.5	0.2	—	98.7	5,971	
	142期 (2024年7月25日)	928	20	△3.4	0.2	—	98.3	5,809	

(注) 基準価額および分配金は1万円当たり。基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、債券組入比率および債券先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 先物比率=買建比率-売建比率

(注) 当ファンドは豪州高配当株とオプション取引を組合わせた運用を行っており、比較対象として適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

当作成期中の基準価額等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	U B S ユニバーサル・ トラスト (ケイマン) II- 豪州高配当株・ ツインαファンド 組 入 比 率
		円	騰 落 率			
第137期	期 首 (前期末) 2024年 1 月25日	994	—	—	—	98.0
	1 月末	1,000	0.6	—	—	99.9
	期 末 2024年 2 月26日	1,033	3.9	—	—	96.6
第138期	期 首 (前期末) 2024年 2 月26日	1,013	—	—	—	96.6
	2 月末	1,019	0.6	—	—	99.0
	期 末 2024年 3 月25日	1,041	2.8	0.2	—	96.2
第139期	期 首 (前期末) 2024年 3 月25日	1,021	—	0.2	—	96.2
	3 月末	1,027	0.6	0.2	—	100.4
	期 末 2024年 4 月25日	1,011	△1.0	0.2	—	97.0
第140期	期 首 (前期末) 2024年 4 月25日	991	—	0.2	—	97.0
	4 月末	979	△1.2	0.2	—	97.6
	期 末 2024年 5 月27日	997	0.6	0.2	—	98.5
第141期	期 首 (前期末) 2024年 5 月27日	977	—	0.2	—	98.5
	5 月末	969	△0.8	0.2	—	98.9
	期 末 2024年 6 月25日	1,001	2.5	0.2	—	98.7
第142期	期 首 (前期末) 2024年 6 月25日	981	—	0.2	—	98.7
	6 月末	982	0.1	0.2	—	98.6
	期 末 2024年 7 月25日	948	△3.4	0.2	—	98.3

(注) 基準価額は1万円当たり。期末基準価額は分配金込み。騰落率は期首比。

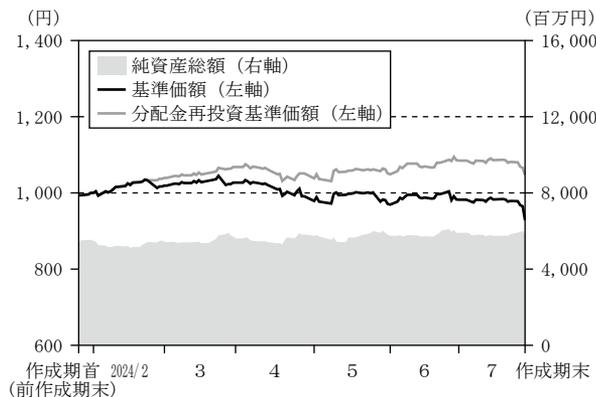
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、債券組入比率および債券先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注) 当ファンドは豪州高配当株とオプション取引を組合わせた運用を行っており、比較対象として適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

当作成期の運用状況と今後の運用方針

■ 基準価額等の推移



第137期首：994円

第142期末：928円（既払分配金120円）

騰落率：5.3%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、作成期首（2024年1月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

（注）分配金再投資基準価額は、収益分配金（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。

（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。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、お客様の損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額の主な変動要因

高位に組入れている外国投資信託において、保有しているオーストラリア高配当株式の価格上昇や、豪ドルが円に対し上昇したことなどがプラス寄与した結果、基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率

組入ファンド	騰落率
UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）II－豪州高配当株・ツインαファンド	6.2%
T&Dマネーブルマザーファンド	0.0

■ 投資環境

【オーストラリア株式市況】

オーストラリア株式市場は上昇しました。2024年3月には、2月の豪雇用統計が市場予想を大幅に上回ったことなどから、オーストラリア株式市場は上昇しました。4月には、堅調な米経済指標等を受け、FRB（米連邦準備制度理事会）の利下げ開始時期が後ずれする可能性があるとの見方が強まったことや、中東における地政学的リスクの高まりを背景にオーストラリア株式市場は下落しました。5月上旬は、4月の米雇用統計で雇用者数の増勢が市場予想よりも鈍化し、FRBによる年内の利下げ開始への期待が高まったことや、4月の豪雇用統計で失業率が市場予想以上に上昇したことから、RBA（オーストラリア準備銀行）の利下げ期待が高まり、オーストラリア株式市場は上昇しました。5月中旬から6月にかけては、横ばいで推移しました。7月前半は、6月の米雇用統計で雇用者数は拡大するも鈍化し米国の利下げ期待が高まったことや、米国の半導体関連株が牽引したこともあり、米国株が上昇したことを受けてオーストラリア株式市場も上昇しました。作成期末にかけては、米国の対中半導体輸出規制強化に対する懸念が広がったことなどから、テクノロジー株が下落し、オーストラリア株式市場も下落基調となりました。

【為替市況】

豪ドルは対円で上昇しました。作成期初から2024年4月下旬にかけては、2月の豪雇用統計が強い内容であったことや、4月の金融政策決定会合において日銀が政策金利の据え置きを決定し、オーストラリアと日本の金利差が意識されたことから、豪ドル高円安となりました。5月上旬には、米利上げ観測の後退や日銀による為替介入の可能性が報道される中で円が急上昇し、豪ドル安円高となる局面もありましたが、5月中旬から7月上旬にかけては、4月および5月の豪CPI（消費者物価指数）が予想を上回る強い結果となったことや豪政策金利が4.35%に据え置かれたことなどから、豪ドル高円安で推移しました。7月中旬から作成期末にかけては、日銀による為替介入を巡る憶測が広がったことや、7月の日銀の金融政策決定会合での利上げへの警戒感が高まったことを受けて、豪ドル安円高基調となりました。

【国内短期金融市況】

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、作成期首の $\Delta 0.16\%$ から作成期末は 0.05% となりました。作成期中においては、日銀によるマイナス金利解除や国庫短期証券の入札に伴う需給悪化懸念などが金利上昇要因となり、日銀の買入オペや金融機関の担保需要などが金利低下要因となりました。

■ 当該投資信託のポートフォリオ

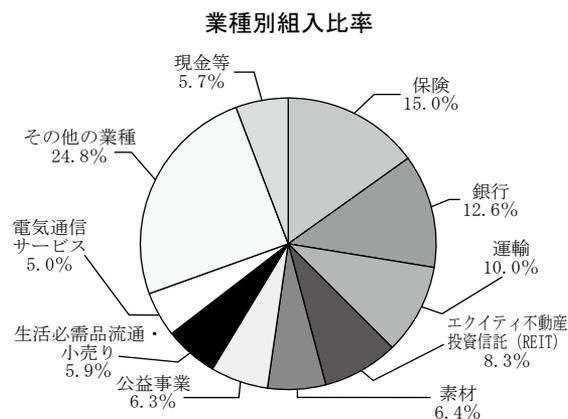
【当ファンド】

作成期を通じて、「UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツインαファンド」を概ね高位に組入れ、「T&Dマネープールマザーファンド」にも投資を行いました。

【UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツインαファンド】

主としてオーストラリアの高配当株式および投資信託証券（不動産投資信託（リート）を含む）への投資を行うと同時に、スワップ取引を通じて、オーストラリア株式市場全体（株価指数等）にかかるコールオプションを売却する「株式オプションα戦略」および、円に対する豪ドルのコールオプションを売却する「通貨オプションα戦略」を組合わせた運用を行いました。

＜UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツインαファンドの組入状況＞ 2024年6月28日現在（現地基準）



組入上位10銘柄

	銘柄名	業種	比率
1	MEDIBANK PRIVATE LTD	保険	5.2%
2	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	銀行	5.1
3	TELSTRA GROUP LTD	電気通信サービス	5.0
4	AURIZON HOLDINGS LTD	運輸	4.8
5	SUNCORP GROUP LTD	保険	4.1
6	SCENTRE GROUP	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	3.9
7	QBE INSURANCE GROUP LTD	保険	3.9
8	APA GROUP	公益事業	3.4
9	BHP GROUP LTD	素材	3.4
10	ATLAS ARTERIA	運輸	3.1

(注) 比率は、投資対象ファンドの純資産総額に対する比率（リートを含む）です。

(注) 業種はGICS（世界産業分類基準）によるものです。

(注) 組入状況は、ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン（シンガポール支店）より入手したデータをもとに当社が作成したものです。

(注) 現金等は、未払金等が多い場合、マイナスになることがあります。

世界産業分類基準（GICS[®]）は、S&PとMSCIによって作成され、同二社の独占的財産かつ商標です。MSCI、S&P、およびGICS分類の作成または編纂に関与したその他の当事者のいずれも、かかる基準または分類（またはそれを利用することで得られる結果）に関して、いかなる明示的または黙示的な保証または保証も行わず、かかる当事者はすべて、かかる基準または分類に関して、独自性、正確性、完全性、商品性または特定目的への適合性のすべての保証を本書により明示的に否認します。前述の内容に制限を加えることなく、いかなる場合でも、MSCI、S&P、その関連会社またはGICS分類の作成または編纂に関わるいかなる第三者も、いかなる直接的、間接的、特別、懲戒的、派生的、またはその他の損害（逸失利益を含む）について、たとえかかる損害の可能性について知らされていたとしても、責任を負いません。

【T&Dマネープールマザーファンド】

国庫短期証券の利回りがマイナスで推移していたため組入れを見送っていましたが、2024年3月中旬に利回りがプラスとなった国庫短期証券を60%程度組入れました。残りの資産については、全額コール・ローン等で運用を行いました。

■ 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載しておりません。

■ 分配金

1万口当たりの分配金（税込み）は、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、第137期から第142期まで各20円とさせていただきます。収益分配に充てなかった利益は、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■ 今後の運用方針

【当ファンド】

主要投資対象である「UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツイン α ファンド」への投資比率を高位に保ち、もう一方の投資対象である「T&Dマネープールマザーファンド」への投資も継続する方針です。

【UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツイン α ファンド】

主としてオーストラリアの高配当株式および投資信託証券（不動産投資信託（リート）を含む）に投資することにより、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行います。また、スワップ取引を通じて、「株式オプション α 戦略」および「為替オプション α 戦略」を活用し、引続き年率15%の目標オプション料（プレミアム収入）の獲得を目指します。

【T&Dマネープールマザーファンド】

日本経済は、雇用・所得環境が改善する下で緩やかな回復が続くことが期待されます。インフレ率については、プラス圏で推移していくと予想されます。こうしたなか、日銀はマイナス金利政策の解除を行いました。依然として緩和的な姿勢を示しており、国内金利は低位で推移すると予想します。

相対的に金利リスクの高い長期債への投資は見送り、国庫短期証券や短期金融商品等を中心とした安定的な運用を行います。

1 万口当たりの費用明細 (2024年 1 月26日から2024年 7 月25日まで)

費用の明細

項目	第137期～第142期		項目の概要
	2024/ 1 /26～2024/ 7 /25		
	金額	比率	
平均基準価額	996円		作成期間の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	7円	0.727%	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投信会社)	(3)	(0.273)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(4)	(0.438)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(0)	(0.016)	運用財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.105	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料／作成期間の平均受益権口数
(投資信託証券)	(1)	(0.105)	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
(c) その他費用	0	0.008	(c) その他費用＝作成期間のその他費用／作成期間の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.008)	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	8	0.840	

(注) 作成期間の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 平均基準価額の円未満は切捨て、それ以外の各金額は項目ごとに四捨五入してあります。

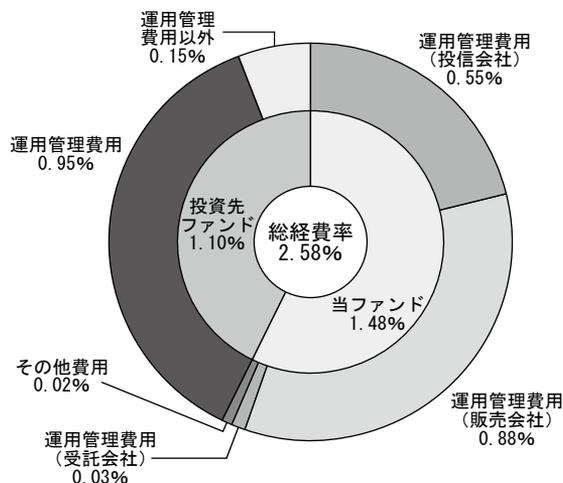
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組入れている投資信託証券(親投資信託を除く。)が支払った費用を含みません。

(注) 「比率」欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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(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除く。)を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は、2.58%です。



総経費率 (①+②+③)	2.58%
①当ファンドの費用の比率	1.48%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.95%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.15%

(注) ①の費用は、1万口当た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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券(親投資信託を除く)です。

(注) ①の費用は、親投資信託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) 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) 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は異なります。

売買および取引の状況 (2024年1月26日から2024年7月25日まで)

(1) 投資信託証券

		第 137 期 ~ 第 142 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国 (邦貨建)	UBSユニバーサル・トラスト (ケイマン) II - 豪州高配当株・ツインαファンド	口 2,731,508	千円 2,712,000	口 1,968,838	千円 1,967,068

(注) 金額は受渡代金。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

当作成期における設定、解約はありません。

利害関係人との取引状況等 (2024年1月26日から2024年7月25日まで)

当作成期における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細 (2024年7月25日現在)

(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	前作成期末 (第136期末)	当 作 成 期 末 (第 142 期 末)		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
UBSユニバーサル・トラスト (ケイマン) II - 豪州高配当株・ツインαファンド	5,353,906	6,116,576	5,712,943	98.3

(注) 比率は純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	前作成期末 (第136期末)	当 作 成 期 末 (第 142 期 末)	
	口 数	口 数	評 価 額
T & Dマネープールマザーファンド	22,818	22,818	23,124

(注) T & Dマネープールマザーファンド全体の受益権口数は242,596千口です。

(注) 単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成 (2024年7月25日現在)

項 目	当 作 成 期 末 (第 142 期 末)	
	評 価 額	比 率
UBSユニバーサル・トラスト (ケイマン) II - 豪州高配当株・ツインαファンド	5,712,943	93.8
T & Dマネープールマザーファンド	23,124	0.4
コール・ローン等、その他	353,645	5.8
投資信託財産総額	6,089,712	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ならびに損益の状況

資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年2月26日現在 2024年3月25日現在 2024年4月25日現在 2024年5月27日現在 2024年6月25日現在 2024年7月25日現在

項 目	第137期末	第138期末	第139期末	第140期末	第141期末	第142期末
(A) 資 産	5,623,524,004円	6,262,164,736円	6,187,813,216円	6,193,214,399円	6,366,610,774円	6,089,712,054円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	389,982,456	621,470,206	534,382,084	355,743,866	448,424,255	353,643,233
U B S ユ ニ バ ー サ ル ・ ト ラ ス ト (ケ イ マ ン) Ⅱ - 豪 州 高 配 当 株 ・ ツ イ ン α フ ァ ン ド (評 価 額)	5,210,419,430	5,617,571,560	5,630,308,265	5,814,345,622	5,895,061,465	5,712,943,915
T & D マ ネ ー プ ー ル マ ー ジ ン グ フ ァ ン ド (評 価 額)	23,122,118	23,122,118	23,122,118	23,124,400	23,124,400	23,124,400
未 収 利 息	-	852	749	511	654	506
(B) 負 債	226,969,511	422,975,882	381,874,458	289,245,173	395,216,845	280,690,727
未 払 金	70,000,000	250,000,000	205,000,000	143,000,000	182,000,000	134,000,000
未 払 収 益 分 配 金	106,512,235	114,361,445	117,175,225	120,880,195	121,691,179	125,241,627
未 払 解 約 金	43,594,773	52,441,358	52,702,944	17,957,184	84,693,611	14,356,164
未 払 信 託 報 酬	6,790,507	6,108,786	6,923,423	7,330,639	6,760,899	7,019,063
未 払 利 息	526	-	-	-	-	-
そ の 他 未 払 費 用	71,470	64,293	72,866	77,155	71,156	73,873
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	5,396,554,493	5,839,188,854	5,805,938,758	5,903,969,226	5,971,393,929	5,809,021,327
元 本	53,256,117,847	57,180,722,525	58,587,612,621	60,440,097,652	60,845,589,906	62,620,813,988
次 期 繰 越 損 益 金	△47,859,563,354	△51,341,533,671	△52,781,673,863	△54,536,128,426	△54,874,195,977	△56,811,792,661
(D) 受 益 権 総 口 数	53,256,117,847口	57,180,722,525口	58,587,612,621口	60,440,097,652口	60,845,589,906口	62,620,813,988口
1万口当たり基準価額(C/D)	1.013円	1.021円	991円	977円	981円	928円

(注) 当ファンドの第137期首元本額は54,790,990,222円、第137～142期中追加設定元本額は44,310,811,827円、第137～142期中一部解約元本額は36,480,988,061円です。

(注) 元本の欠損

第142期末現在、純資産総額は元本を下回っており、その差額は56,811,792,661円です。

(注) 第142期末の1口当たり純資産額は0.0928円です。

損益の状況

自2024年1月26日 自2024年2月27日 自2024年3月26日 自2024年4月26日 自2024年5月28日 自2024年6月26日
至2024年2月26日 至2024年3月25日 至2024年4月25日 至2024年5月27日 至2024年6月25日 至2024年7月25日

項 目	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期	第142期
(A) 配 当 等 収 益	103,651,422円	106,303,413円	108,988,295円	106,581,844円	117,143,451円	119,151,981円
受 取 配 当 金	103,659,770	106,303,021	108,977,620	106,569,267	117,134,446	119,141,978
受 取 利 息	-	3,601	10,675	12,577	9,005	10,003
支 払 利 息	△ 8,348	△ 3,209	-	-	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	99,137,840	44,484,030	△ 147,108,117	△ 65,756,989	30,765,071	△ 320,849,814
売 買 益	103,550,585	45,049,023	4,059,342	6,414,323	32,487,715	1,709,876
売 買 損	△ 4,412,745	△ 564,993	△ 151,167,459	△ 72,171,312	△ 1,722,644	△ 322,559,690
(C) 信 託 報 酬 等	△ 6,861,977	△ 6,173,079	△ 6,996,289	△ 7,407,794	△ 6,832,055	△ 7,092,936
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	195,927,285	144,614,364	△ 45,116,111	33,417,061	141,076,467	△ 208,790,769
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 609,449,444	△ 475,697,434	△ 381,685,265	△ 470,420,712	△ 483,023,638	△ 417,407,409
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△47,339,528,960	△50,896,089,156	△52,237,697,262	△53,978,244,580	△54,410,557,627	△56,060,352,856
(配 当 等 相 当 額)	(5,946,850,686)	(6,390,187,504)	(6,547,469,297)	(6,751,312,779)	(6,783,809,777)	(6,980,784,881)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△53,286,379,646)	(△57,286,276,660)	(△58,785,166,559)	(△60,729,557,359)	(△61,194,367,404)	(△63,041,137,737)
(G) 合 計 (D + E + F)	△47,753,051,119	△51,227,172,226	△52,664,498,638	△54,415,248,231	△54,752,504,798	△56,686,551,034
(H) 収 益 分 配 金	△ 106,512,235	△ 114,361,445	△ 117,175,225	△ 120,880,195	△ 121,691,179	△ 125,241,627
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△47,859,563,354	△51,341,533,671	△52,781,673,863	△54,536,128,426	△54,874,195,977	△56,811,792,661
追 加 信 託 差 損 益 金	△47,345,896,929	△50,908,499,209	△52,252,880,481	△53,999,950,725	△54,420,516,343	△56,073,535,438
(配 当 等 相 当 額)	(5,940,482,717)	(6,377,777,451)	(6,532,286,078)	(6,729,606,634)	(6,773,851,061)	(6,967,602,299)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△53,286,379,646)	(△57,286,276,660)	(△58,785,166,559)	(△60,729,557,359)	(△61,194,367,404)	(△63,041,137,737)
繰 越 損 益 金	△ 513,666,425	△ 433,034,462	△ 528,793,382	△ 536,177,701	△ 453,679,634	△ 738,257,223

(注) 損益の状況の中で

(B)有価証券売買損益は、各期末の評価換えによるものを含みます。

(C)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います。

(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。

分配金の計算過程

【第137期】

計算期間末における費用控除後の配当等収益（100,144,266円）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）および収益調整金（5,946,850,686円）より、分配対象収益は6,046,994,952円（1万口当たり1,135円）であり、うち106,512,235円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

【第138期】

計算期間末における費用控除後の配当等収益（101,951,392円）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）および収益調整金（6,390,187,504円）より、分配対象収益は6,492,138,896円（1万口当たり1,135円）であり、うち114,361,445円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

【第139期】

計算期間末における費用控除後の配当等収益（101,992,006円）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）および収益調整金（6,547,469,297円）より、分配対象収益は6,649,461,303円（1万口当たり1,134円）であり、うち117,175,225円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

【第140期】

計算期間末における費用控除後の配当等収益（99,174,050円）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）および収益調整金（6,751,312,779円）より、分配対象収益は6,850,486,829円（1万口当たり1,133円）であり、うち120,880,195円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

【第141期】

計算期間末における費用控除後の配当等収益（111,732,463円）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）および収益調整金（6,783,809,777円）より、分配対象収益は6,895,542,240円（1万口当たり1,133円）であり、うち121,691,179円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

【第142期】

計算期間末における費用控除後の配当等収益（112,059,045円）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）および収益調整金（6,980,784,881円）より、分配対象収益は7,092,843,926円（1万口当たり1,132円）であり、うち125,241,627円（1万口当たり20円）を分配金額としております。

分配金のご案内

分配金および分配原資の内訳

（単位：円・％、1万口当たり・税引前）

項目	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期	第142期
	2024年1月26日 ～2024年2月26日	2024年2月27日 ～2024年3月25日	2024年3月26日 ～2024年4月25日	2024年4月26日 ～2024年5月27日	2024年5月28日 ～2024年6月25日	2024年6月26日 ～2024年7月25日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
（対基準価額比率）	1.936	1.921	1.978	2.006	1.998	2.110
当期の収益	18	17	17	16	18	17
当期の収益以外	1	2	2	3	1	2
翌期繰越分配対象額	1,115	1,115	1,114	1,113	1,113	1,112

（注）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）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

（注）投資信託の計理上、翌期繰越分配対象額が基準価額を上回っている場合がありますが、基準価額を超える分配金をお支払いすることはありません。

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

※元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額がその後の新たな個別元本となります。

《お知らせ》

2024年3月1日適用で、以下のとおり、投資対象である外国投資信託等の名称変更を行いました。

●変更内容

	変更後	変更前
投資対象である外国投資信託	UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツインαファンド	クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツインαファンド
外国投資信託の投資顧問会社	UBS マネジメント（ケイマン）リミテッド	クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッド

補足情報

T & D マネープールマザーファンドにおける主要な売買銘柄

公社債

2024年1月26日から2024年7月25日まで

買		付		売		付	
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
			千円				千円
第1207回国庫短期証券			147,480	—			—

（注）金額は受渡代金（経過利子分は含まれておりません）。単位未満は切捨て。

T & D マネープールマザーファンドの組入資産の明細

下記は、T & D マネープールマザーファンド全体（242,596千口）の内容です。

公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債＜種類別＞

2024年7月25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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	147,500 (147,500)	147,488 (147,488)	60.0 (60.0)	— (—)	— (—)	— (—)	60.0 (60.0)
合 計	147,500 (147,500)	147,488 (147,488)	60.0 (60.0)	— (—)	— (—)	— (—)	60.0 (60.0)

（注）（ ）内は非上場債で内書きです。

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

（注）評価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。

（注）残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

（注）額面・評価額の単位未満は切捨て。

(B) 国内（邦貨建）公社債＜銘柄別＞

2024年7月25日現在

銘	柄	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)		%	千円	千円	
第1207回国庫短期証券		—	147,500	147,488	2025/1/20
合 計			147,500	147,488	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨て。

組入投資信託証券の内容

UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－豪州高配当株・ツイン α ファンド

◆当ファンドの仕組みは次の通りです。

分 類	ケイマン籍／外国投資信託／円建
基本運用方針	主としてオーストラリアの証券取引所に上場している株式および投資信託証券（不動産投資信託（リート）を含みます。）に投資することにより、安定した配当収入の確保と中長期的な値上がり益の獲得を目指して運用を行います。 また、スワップ取引を通じて、実質的に豪州株式市場全体（株価指数等）のオプション取引（コールオプションの売却）および通貨のオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。
投資態度	<p>[高配当株投資]</p> <ul style="list-style-type: none"> 主としてオーストラリアの証券取引所に上場している株式および投資信託証券（不動産投資信託（リート）を含みます。）に投資を行います。 主に配当利回りに着目し、相対的に配当利回りの高い銘柄を中心に投資します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 <p>[株式オプションα戦略・通貨オプションα戦略]</p> <ul style="list-style-type: none"> スワップ取引を通じて、実質的に豪州株価指数等*を対象としたオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。 *市場環境によっては、豪州株保有銘柄を対象とする場合があります。 スワップ取引を通じて、実質的に豪ドル（対円）を対象としたオプション取引の損益に連動する投資成果の享受を目指します。 原則として概ね保有する豪ドル建資産の評価額程度のコールオプションの売却を行います。 <p>※資金動向や市況動向等によっては、上記のような運用が行われない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>転換社債、ワラントへの投資は行いません。</p> <p>同一発行体への投資割合は、原則として、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一業種への投資割合は、原則として、純資産総額の35%以下とします。</p>
分配方針	原則として、毎月分配を行います。
投資顧問会社	UBS マネジメント（ケイマン） リミテッド（各オプション α 戦略の運用）
副投資顧問会社	<p>フランクリン・templton・オーストラリア・リミテッド*（豪州高配当株の運用）</p> <p>※フランクリン・templton・オーストラリア・リミテッドの株式運用部門は、マーティン・カリー・オーストラリアのブランド名で事業活動を行っています。</p>

※次ページ以降の記載は、バンクオブニューヨークメロン証券株式会社およびザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン（シンガポール支店）より入手した情報をもとに作成しております。(1)は監査済報告書を当社が一部翻訳したもの、(2)は保有明細をもとに当社が作成したものです。当社は、その内容の正確性・完全性を保証するものではありません。

(1) 損益計算書

計算期間：2023年2月1日～2024年1月31日

単位：円

収益

受取配当金	182,873,252
受取利息	13,275
スワップ取引に係る収益・費用	(24,303,733)
投資に係る純損益	394,373,560
投資純損益	552,956,354
その他収益	3,699,150
外国為替取引に係る純損益	9,476,577
収益合計	566,132,081

費用

投資顧問料	20,906,030
その他費用	6,207,392
取引手数料	3,699,150
管理・保管費用	17,235,882
事務代行手数料	1,944,291
運用報酬	651,890
運用費用合計	50,644,635
税引前損益	515,487,446
源泉徴収税	(6,687,205)
キャピタルゲイン課税	94,595,063
期中の純資産変動	603,395,304

(注) 日付は現地基準です。

(注) () 書きは負数です。

(2) 組入資産の明細

作成基準日：2024年1月31日

1. 株式現物

銘柄名	株数	評価額		業種
		株	円	
COLES GROUP LTD	86,318	132,700,684	株式	
ATLAS ARTERIA	315,477	165,222,277	生活必需品流通・小売り	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	108,950	286,350,372	運輸	
WESTPAC BANKING CORP	44,500	103,972,364	銀行	
TELSTRA GROUP LTD	686,095	267,834,941	銀行	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	89,813	85,395,683	電気通信サービス	
BHP GROUP LTD	25,859	118,113,338	銀行	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	174,467	74,513,880	素材	
TRANSURBAN GROUP	87,339	114,015,836	一般消費財・サービス流通・小売り	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	7,840	89,036,158	運輸	
CHARTER HALL RETAIL REIT	80,160	28,813,914	銀行	
APA GROUP	210,224	172,461,277	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	150,698	87,952,065	公益事業	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	26,729	54,986,995	保険	
ELDERS LTD.	64,441	55,916,531	消費者サービス	
G. U. D. HOLDINGS LTD	31,513	37,392,950	食品・飲料・タバコ	
GPT GROUP	170,766	76,893,377	自動車・自動車部品	
GWA GROUP LTD	151,894	33,463,940	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	
DOWNER EDI LTD	187,241	76,170,124	資本財	
WORLEY LTD	34,601	49,549,408	商業・専門サービス	
SUNCORP GROUP LTD	140,775	193,023,215	資本財	
MONADELPHOUS GROUP LTD	14,784	19,771,046	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	43,773	137,887,699	資本財	
PERPETUAL LTD	20,881	52,459,755	銀行	
JB HI-FI LTD	16,454	90,927,071	金融サービス	
INSIGNIA FINANCIAL LTD	254,759	52,926,065	一般消費財・サービス流通・小売り	
QBE INSURANCE GROUP LTD	124,901	191,291,994	金融サービス	
STOCKLAND	131,925	58,129,095	保険	
WESFARMERS LTD	29,166	163,937,213	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	
WOOLWORTHS GROUP LTD	27,512	95,729,744	一般消費財・サービス流通・小売り	
MACQUARIE GROUP LTD	7,679	141,314,673	生活必需品流通・小売り	
AURIZON HOLDINGS LTD	733,222	268,519,797	金融サービス	
NINE ENTERTAINMENT CO HOLDINGS	543,588	104,000,796	運輸	
ORORA LTD	252,510	68,318,485	メディア・娯楽	
SCENTRE GROUP	830,255	246,292,671	素材	
AMPOL LTD	15,968	56,117,128	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	38,194	119,612,285	エネルギー	
LOTTERY CORP LTD/THE	243,648	119,128,310	エネルギー	
VENTIA SERVICES GROUP PTY LTD	245,100	77,918,543	消費者サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	135,706	73,694,823	資本財	
REGION RE LTD	155,001	33,998,673	生活必需品流通・小売り	
MEDIBANK PRIVATE LTD	766,163	284,285,044	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	
AGL ENERGY LTD	139,521	116,885,406	保険	
SOUTH32 LTD	202,610	65,585,419	公益事業	
VICINITY CENTRES	875,075	173,340,782	素材	
合計		5,115,851,846	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	

2. スワップ

想定元本額	評価額
円	円
5,535,817,098	(59,775,770)

(注) () 書きは負数です。

(注) 日付は現地基準です。

(注) リートを含みます。

(注) 業種はG I C S (世界産業分類基準) によるものです。

T & D マネープールマザーファンド

運用報告書（全体版） 第39期（決算日 2024年6月10日）
（計算期間 2023年12月12日から2024年6月10日）

「T & D マネープールマザーファンド」は、2024年6月10日に第39期決算を行いましたので、期中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。

信託期間	信託期間は原則無期限です。
運用方針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債および短期金融商品等を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。

最近5期の運用実績、基準価額の推移等

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純資産総額
	円	騰落率					
35期（2022年6月10日）	10,143	△0.0	—	—	—	—	百万円 396
36期（2022年12月12日）	10,140	△0.0	—	—	—	—	348
37期（2023年6月12日）	10,138	△0.0	—	—	—	—	237
38期（2023年12月11日）	10,134	△0.0	—	—	—	—	245
39期（2024年6月10日）	10,134	0.0	60.0	—	—	—	245

（注）基準価額は1万円当たり。

（注）先物比率＝買建比率－売建比率

（注）当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はありません。

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額 円	騰 落 率	債券組入比率 %	債券先物比率 %
		%		
期首（前期末） 2023年12月11日	10,134	—	—	—
12月末	10,134	0.0	—	—
2024年1月末	10,133	△0.0	—	—
2月末	10,133	△0.0	—	—
3月末	10,133	△0.0	60.0	—
4月末	10,133	△0.0	60.0	—
5月末	10,134	0.0	60.0	—
期 末 2024年6月10日	10,134	0.0	60.0	—

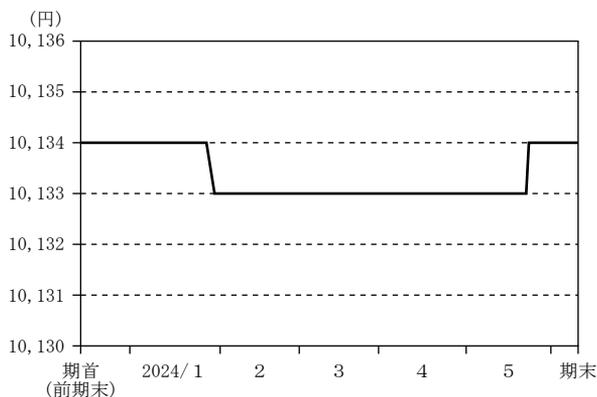
(注) 基準価額は1万円当たり。騰落率は期首比。

(注) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注) 当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はありません。

当期の運用状況と今後の運用方針

■ 基準価額の推移



■ 基準価額の変動要因

基準価額は、期首、期末ともに10,134円となりました。運用対象である国庫短期証券や短期金融商品等の利回りは、期前半はマイナスで推移しましたが、期後半はプラスでの推移となりました。

■ 投資環境

【国内短期金融市況】

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期首の△0.16%から期末は0.02%となりました。期中においては、日銀によるマイナス金利解除や国庫短期証券の入札に伴う需給悪化懸念などが金利上昇要因となり、日銀の買入オペや金融機関の担保需要などが金利低下要因となりました。

■ 当該投資信託のポートフォリオ

国庫短期証券の利回りがマイナスで推移していたため組入れを見送っていましたが、2024年3月中旬に利回りがプラスとなった国庫短期証券を60%程度組入れました。残りの資産については、全額コール・ローン等で運用を行いました。

■ 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載しておりません。

■ 今後の運用方針

日本経済は、雇用・所得環境が改善する下で緩やかな回復が続くことが期待されます。インフレ率については、プラス圏で推移していくと予想されます。こうしたなか、日銀はマイナス金利政策の解除を行いました。依然として緩和的な姿勢を示しており、国内金利は低位で推移すると予想します。

相対的に金利リスクの高い長期債への投資は見送り、国庫短期証券や短期金融商品等を中心とした安定的な運用を行います。

1万口当たりの費用明細 (2023年12月12日から2024年6月10日まで)

当期において発生した費用はありません。

売買および取引の状況 (2023年12月12日から2024年6月10日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 147,480	千円 —

(注) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)。単位未満は切捨て。

主要な売買銘柄 (2023年12月12日から2024年6月10日まで)

公社債

買 付	売 付
銘 柄	銘 柄
金 額	金 額
千円 147,480	千円 —
第1207回国庫短期証券	—

(注) 金額は受渡代金(経過利子分は含まれておりません)。単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2023年12月12日から2024年6月10日まで)

当期における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細 (2024年6月10日現在)

下記は、T&Dマネープールマザーファンド全体(242,596千口)の内容です。

公社債

(A) 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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	147,500 (147,500)	147,486 (147,486)	60.0 (60.0)	— (—)	— (—)	— (—)	60.0 (60.0)
合 計	147,500 (147,500)	147,486 (147,486)	60.0 (60.0)	— (—)	— (—)	— (—)	60.0 (60.0)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価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。

(注) 残存期間が1年以内の公社債は、原則として償却原価法により評価しております。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(B) 国内(邦貨建)公社債<銘柄別>

銘 柄	当 期			末
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第1207回国庫短期証券	—	147,500	147,486	2025/1/20
合 計		147,500	147,486	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成 (2024年6月10日現在)

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
公 社 債	千円	%	
	147,486	60.0	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	98,352	40.0	
投 資 信 託 財 産 総 額	245,838	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ならびに損益の状況

資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年6月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	245,838,879円
コール・ローン等	98,352,484
公 社 債(評価額)	147,486,252
未 収 利 息	143
(B) 純 資 産 総 額(A)	245,838,879
元 本	242,596,156
次 期 繰 越 損 益 金	3,242,723
(C) 受 益 権 総 口 数	242,596,156口
1 万口当たり基準価額(B/C)	10,134円

(注) 期首元本額 242,596,156円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 0円

(注) 1口当たり純資産額は1,0134円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本の内訳

T & D インド中小型株ファンド	69,040,591円
米国リート・プレミアムファンド(毎月分配型)円ヘッジ・コース	1,653,709円
米国リート・プレミアムファンド(毎月分配型)通貨プレミアム・コース	19,809,785円
米国リート・プレミアムファンド(年2回決算型)マネーボール・コース	88,475円
豪州高配当株ツインαファンド(毎月分配型)	22,818,631円
エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	5,339,572円
エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	1,731,068円
エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	6,884,550円
エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	1,424,313円
エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	6,489,753円
エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	664,851円
エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	50,273,085円
エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	2,834,026円
エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	614,593円
エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	131,726円
エマージング債券投信(カナダドルコース)毎月分配型	555,674円
エマージング債券投信(カナダドルコース)年2回決算型	71,774円
エマージング債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	23,292,362円
エマージング債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	3,988,327円
エマージング債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	15,489,184円
エマージング債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	2,464,915円
エマージング債券投信(金コース)毎月分配型	3,974,765円
エマージング債券投信(金コース)年2回決算型	2,773,196円
エマージング債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	187,231円

損益の状況

当期 自2023年12月12日 至2024年6月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 13,787円
受 取 利 息	17,718
支 払 利 息	△ 31,505
(B) 当 期 損 益 金(A)	△ 13,787
(C) 前 期 繰 越 損 益 金	3,256,510
(D) 合 計(B+C)	3,242,723
次 期 繰 越 損 益 金(D)	3,242,723