

ダイワ米国株主還元株ファンド

運用報告書(全体版)

第15期

(決算日 2023年4月18日)

(作成対象期間 2022年10月19日～2023年4月18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	2015年10月20日～2025年10月17日	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	当ファンド	イ. ケイマン籍の外国投資信託「UBS (CAY) US トータル・イールド・ファンド (USトータル・イールド・クラス)」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、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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、継続的に株主還元を行なう米国企業の株式へ投資することで、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5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI米国指数 (配当込み、円換算)		公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
11期末(2021年4月19日)	13,132	1,400	27.1	21,188	25.0	—	98.0	5,916
12期末(2021年10月18日)	13,318	1,000	9.0	23,991	13.2	—	98.5	5,296
13期末(2022年4月18日)	13,848	500	7.7	25,867	7.8	—	99.0	5,097
14期末(2022年10月18日)	13,831	450	3.1	25,519	△ 1.3	—	98.8	4,813
15期末(2023年4月18日)	13,813	390	2.7	26,186	2.6	—	98.5	4,606

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注4) 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。

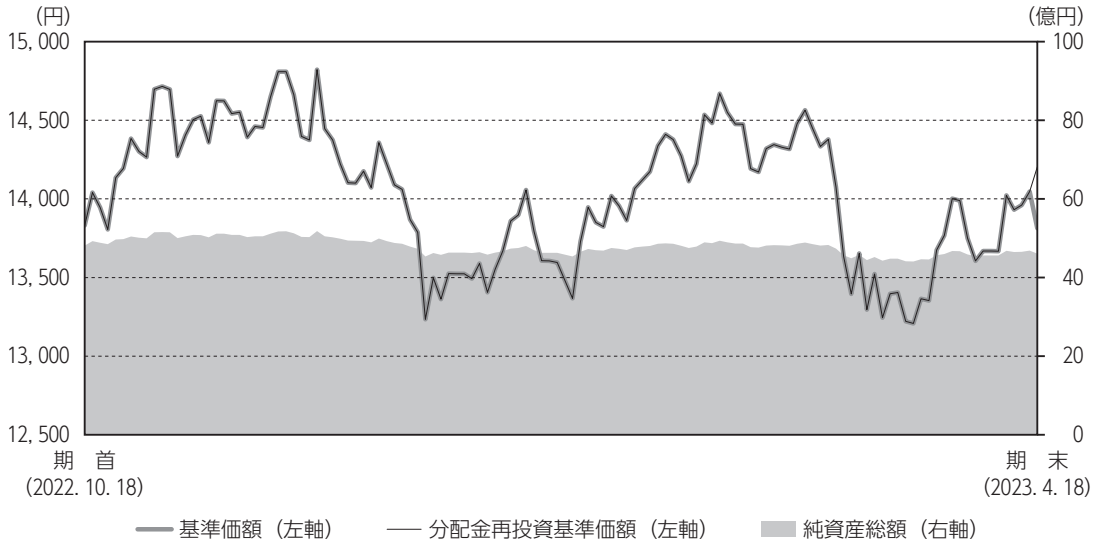
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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

期首：13,831円

期末：13,813円（分配金390円）

騰落率：2.7%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」に投資した結果、米ドルが対円で下落（円高）したことなどがマイナス要因となったものの、米国株式市況の上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※ US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）：UBS（CAY）US トータル・イールド・ファンド（US トータル・イールド・クラス）

ダイワ米国株主還元株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		M S C I 米 国 指 数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投 資 信 託 受 益 証 券 組入比率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2022年10月18日	13,831	—	25,519	—	—	98.8
10月末	14,697	6.3	26,950	5.6	—	98.8
11月末	14,375	3.9	25,606	0.3	—	99.1
12月末	13,589	△ 1.7	23,820	△ 6.7	—	98.9
2023年 1 月末	13,863	0.2	24,533	△ 3.9	—	98.6
2 月末	14,345	3.7	25,467	△ 0.2	—	98.5
3 月末	13,767	△ 0.5	25,379	△ 0.5	—	99.2
(期末) 2023年 4 月18日	14,203	2.7	26,186	2.6	—	98.5

(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

(2022. 10. 19 ~ 2023. 4. 18)

■米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より2022年11月末にかけて、英国の財政悪化懸念による混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国のインフレ率が予想を下回ったことなどが好感されて上昇しました。年末にかけては、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから下落しましたが、2023年に入ると、賃金上昇率の鈍化でF R B（米国連邦制度準備理事会）の利上げペースが減速するとの期待などから上昇しました。2月から3月半ばにかけては、予想を上回る経済指標の発表が相次ぎ金利が上昇したことや、米国の地方銀行の経営破綻を受けて下落しましたが、その後は、F R Bによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことなどが好感され、成長株を中心に上昇に転じました。4月以降は、地方銀行の経営不安が再燃する一方、予想を上回る企業決算の発表が好感されるなど好悪材料が入り交じる市況となりましたが、当作成期を通じては上昇して当作成期末を迎えました。

■米ドル円為替相場

米ドル為替相場は、対円で下落しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高米ドル安となりました。2022年12月は、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともにさらに円高米ドル安が進行しました。2023年1月には、日銀が金融緩和政策の維持を決定したことで一時的に円安米ドル高が進行する局面もありましたが、日米金利差の縮小などにより円高米ドル安基調が継続しました。しかし2月に入り、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安米ドル高に転じました。3月は、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことや、リスク回避による円買い需要の高まりなどから、再び円高米ドル安となりました。当作成期末にかけては、5月のF O M C（米国連邦公開市場委員会）での利上げが意識され円安米ドル高となりましたが、当作成期を通じては円高米ドル安となりました。

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、「US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」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、「US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

引き続き、米国の大型・中型株の中から、株主還元比率の水準や持続性の優れた企業を選定し、セクター分散等を勘案しながら幅広く投資を行ってまいります。

■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

(2022. 10. 19 ~ 2023. 4. 18)

■当ファンド

「US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」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。「US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」への投資割合を高位に維持しました。

■US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

米国の大型・中型株の中から株主還元の積極性や持続性が優れた企業を選定し、セクター分散等を勘案した上で約100銘柄に等金額投資をして運用を行いました。当作成期の株式組入比率はおおむね90%以上の高位を維持しました。業種構成は、配当利回りおよび自社株買い比率の高い資本財・サービスや、一般消費財・サービスの組み入れがMSCI 米国指数対比で高位となりました。一方で、株主還元比率が相対的に低い情報技術やヘルスケア、コミュニケーション・サービスは低位となりました。個別銘柄の組入比率は等金額投資の結果、すべての保有銘柄でおおむね1%前後となりました。

■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、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

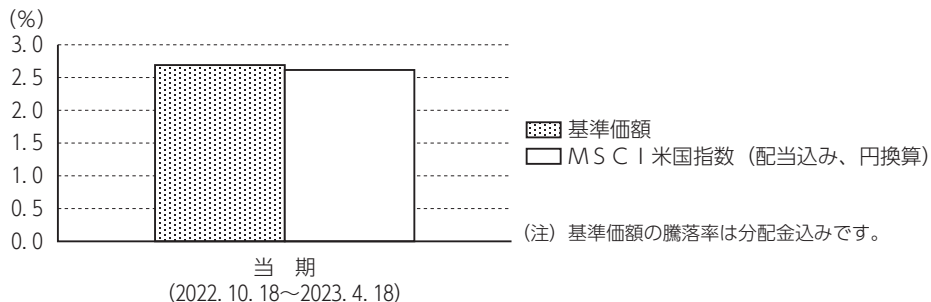
当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数（MSCI米国指数（配当込み、円換算））との騰落率の対比です。

当作成期のパフォーマンスは、参考指数のパフォーマンスを上回る結果となりました。

業種別では、ゼロコロナ政策の転換で中国経済の正常化期待が高まったことが追い風となった資本財・サービスのオーバーウエートや、出遅れが目立ったヘルスケアのアンダーウエート、米国中堅銀行の経営破綻をきっかけとした金融不安の高まりから売り圧力に押された金融のアンダーウエートなどがプラス要因となりました。その一方、当作成期の上昇をけん引した情報技術のアンダーウエートや、主力銘柄の出遅れから業種別でワーストパーフォーマーとなった一般消費財・サービスのオーバーウエートがマイナス要因となりました。

個別銘柄では、業績の先行きへの懸念から2022年末にかけて下落した大手電気自動車メーカーなどがマイナス要因となったものの、長期金利の落ち着きに加えて業績回復期待で買われた半導体関連銘柄の保有などがプラス要因となり、銘柄選択効果は全体でパフォーマンスにプラスに寄与しました。



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	当 期	
	2022年10月19日 ～2023年4月18日	
当期分配金（税込み）	（円）	390
対基準価額比率	（％）	2.75
当期の収益	（円）	390
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,812

- (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	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	393.98円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0.00
(c) 収益調整金		1,159.97
(d) 分配準備積立金		2,648.77
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		4,202.73
(f) 分配金		390.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		3,812.73

- (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、「US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」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、「US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）」への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

引き続き、米国の大型・中型株の中から、株主還元比率の水準や持続性の優れた企業を選定し、セクター分散等を勘案しながら幅広く投資を行ってまいります。

■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	当 期 (2022. 10. 19～2023. 4. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	94円	0.672%	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14,046円です。
(投 信 会 社)	(31)	(0.219)	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)	(62)	(0.439)	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)	(2)	(0.014)	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	1	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)	(1)	(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	95	0.676	

(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。

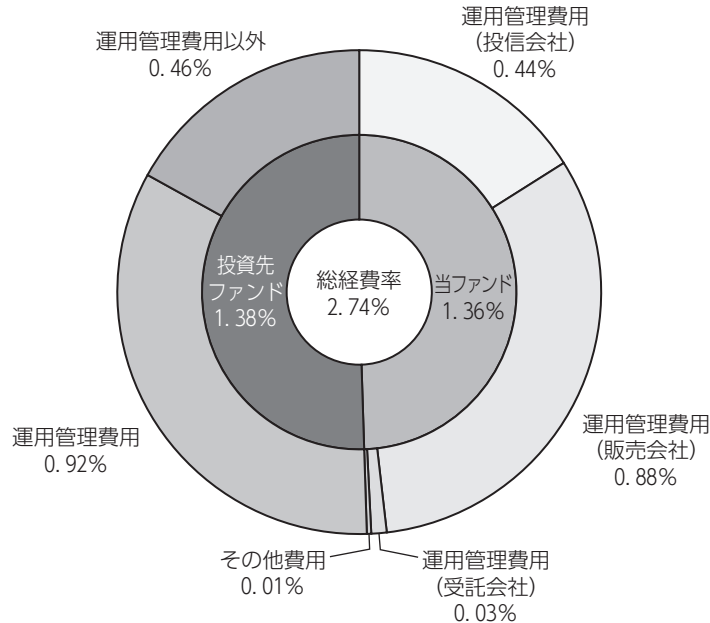
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.74%です。



総経費率 (① + ② + ③)	2.74%
①当ファンドの費用の比率	1.36%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.92%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.46%

(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。

ダイワ米国株主還元株ファンド

■売買および取引の状況 投資信託受益証券

(2022年10月19日から2023年4月18日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	1,374.92969	197,791	2,871.25802	406,000

(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

(2022年10月19日から2023年4月18日まで)

買 付	当			期			
	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
銘 柄	千口	千円	円	銘 柄	千口	千円	円
UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	205.40911	30,000	146	UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	2,871.25802	406,000	141

(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・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 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) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT	31,794.10482	4,537,813	98.5

(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	期 首	当 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	64	64	64

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	4,537,813	95.1
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	64	0.0
コール・ローン等、その他	232,383	4.9
投資信託財産総額	4,770,260	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,770,260,914円
コール・ローン等	232,383,232
投資信託受益証券（評価額）	4,537,813,610
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	64,072
(B) 負債	163,592,211
未払収益分配金	130,068,386
未払解約金	1,111,462
未払信託報酬	32,215,220
その他未払費用	197,143
(C) 純資産総額（A－B）	4,606,668,703
元本	3,335,086,838
次期繰越損益金	1,271,581,865
(D) 受益権総口数	3,335,086,838口
1万口当り基準価額（C／D）	13,813円

* 期首における元本額は3,479,999,908円、当作成期間中における追加設定元本額は74,198,336円、同解約元本額は219,111,406円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,813円です。

■損益の状況

当期 自 2022年10月19日 至 2023年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	163,810,436円
受取配当金	163,827,924
受取利息	241
支払利息	△ 17,729
(B) 有価証券売買損益	△ 9,052,194
売買益	4,873,723
売買損	△ 13,925,917
(C) 信託報酬等	△ 32,412,363
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	122,345,879
(E) 前期繰越損益金	883,390,652
(F) 追加信託差損益金	395,913,720
（配当等相当額）	（ 352,512,615）
（売買損益相当額）	（ 43,401,105）
(G) 合計（D＋E＋F）	1,401,650,251
(H) 収益分配金	△ 130,068,386
次期繰越損益金（G＋H）	1,271,581,865
追加信託差損益金	395,913,720
（配当等相当額）	（ 352,512,615）
（売買損益相当額）	（ 43,401,105）
分配準備積立金	884,720,332
繰越損益金	△ 9,052,187

（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せん。

（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	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	131,398,066円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	386,861,533
(d) 分配準備積立金	883,390,652
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1,401,650,251
(f) 分配金	130,068,386
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	1,271,581,865
(h) 受益権総口数	3,335,086,838口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	390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。

US トータル・イールド・ファンド
(トータル・イールド・クラス)

当ファンド（ダイワ米国株主還元株ファンド）はケイマン籍の外国投資信託「UBS（CAY）US トータル・イールド・ファンド（US トータル・イールド・クラス）」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。

(円建て)

貸借対照表
2022年9月30日

資産

金融資産（損益通算後の評価額）	¥	7,801,157,646
現金および現金同等物		172,162,259
担保としてブローカーに預託した現金		113,624,969
未収：		
配当		7,295,749
その他資産		7,323,091
資産合計		<u>8,101,563,714</u>

負債

金融負債（損益通算後の評価額）		97,928,252
保管会社に対する支払		39,790,139
未払：		
運用会社報酬		25,417,694
専門家報酬		8,579,765
管理会社報酬		2,937,792
受託会社報酬		2,841,059
保管会社報酬		267,993
名義書換代理人報酬		25,932
その他負債		10,357
負債（償却可能受益証券の保有者に帰属する純資産を除く）		<u>177,798,983</u>
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	¥	<u>7,923,764,731</u>

損益計算書

2022年9月30日に終了した年度

収益		
配当収益	¥	152,604,489
受取利息		623,864
その他収益		279,021
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の実現損益		2,001,686,087
デリバティブ金融資産および負債の実現損益		(264,019,273)
外国為替取引の実現損益		88,495,550
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の評価損益の増減額		(888,238,156)
デリバティブ金融資産および負債の評価損益の増減額		107,601,408
外国為替取引の評価損益の増減額		5,172,584
収益合計		<u>1,204,205,574</u>
費用		
運用会社報酬		54,910,130
管理会社報酬		19,809,284
専門家報酬		6,616,063
保管会社報酬		5,274,320
受託会社報酬		1,242,717
名義書換代理人報酬		1,194,158
取引費用		820,933
登録料		570,270
その他費用		397,173
費用合計		<u>90,835,048</u>
営業損益		<u>1,113,370,526</u>
金融費用		
償却可能受益証券の保有者への分配金		<u>(1,496,312,268)</u>
分配後および税引前損益		(382,941,742)
源泉徴収税		(41,715,567)
運用の結果生じた償却可能受益証券の保有者に帰属する純資産の増減額	¥	<u><u>(424,657,309)</u></u>

投資明細表
2022年9月30日

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合(%)	評価額
	普通株 (98.4%)		
	バミューダ (1.0%)		
	保険 (1.0%)		
12,277	Arch Capital Group Ltd.	1.0	¥ 80,926,144
	バミューダ合計		80,926,144
	アイルランド (0.9%)		
	その他製造 (0.9%)		
3,594	Trane Technologies PLC	0.9	75,332,120
	アイルランド合計		75,332,120
	スイス (2.0%)		
	電機 (1.0%)		
4,668	TE Connectivity, Ltd.	1.0	74,566,903
	保険 (1.0%)		
3,081	Chubb Ltd.	1.0	81,111,085
	スイス合計		155,677,988
	英国 (1.1%)		
	保険 (1.1%)		
2,916	Willis Towers Watson PLC	1.1	84,812,035
	英国合計		84,812,035
	米国 (93.4%)		
	広告 (1.0%)		
8,902	Omnicom Group, Inc.	1.0	81,292,725
	航空宇宙・防衛 (1.0%)		
2,747	L3Harris Technologies, Inc.	1.0	82,636,224
	農業 (1.9%)		
12,414	Altria Group, Inc.	0.9	72,557,385
6,290	Philip Morris International, Inc.	1.0	75,576,126
			148,133,511
	アパレル (0.9%)		
17,029	Tapestry, Inc.	0.9	70,076,043
	自動車 (1.0%)		
2,664	Cummins, Inc.	1.0	78,473,594
	銀行 (3.0%)		
17,658	Bank of America Corp.	1.0	77,188,397
14,154	Bank of New York Mellon Corp.	1.0	78,916,722
13,555	Wells Fargo & Co.	1.0	78,912,382
			235,017,501
	バイオテクノロジー (1.0%)		
2,471	Amgen, Inc.	1.0	80,617,666
	建築材料 (1.9%)		
9,376	Fortune Brands Home & Security, Inc.	0.9	72,864,262

ダイワ米国株主還元株ファンド

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
11,307	Masco Corp.	1.0	76,414,334
	化学 (0.9%)		149,278,596
11,525	Dow, Inc.	0.9	73,283,416
	商業サービス (7.7%)		
2,459	Automatic Data Processing, Inc.	1.0	80,507,343
1,476	Cintas Corp.	1.0	82,934,316
2,805	FleetCor Technologies, Inc.	0.9	71,526,732
2,072	Gartner, Inc.	1.1	82,982,551
7,866	ManpowerGroup, Inc.	0.9	73,653,715
1,964	Moody's Corp.	0.9	69,111,111
7,428	Robert Half International, Inc.	1.0	82,250,187
1,636	S&P Global, Inc.	0.9	72,307,740
	コンピューター (4.8%)		615,273,695
6,917	Amdocs, Ltd.	1.0	79,545,432
3,614	Apple, Inc.	0.9	72,293,584
11,555	Fortinet, Inc.	1.0	82,171,323
42,948	Hewlett Packard Enterprise Co.	0.9	74,473,768
21,274	HP, Inc.	1.0	76,736,283
	化粧品・パーソナルケア (1.0%)		385,220,390
4,192	Procter & Gamble Co.	1.0	76,604,843
	流通・卸売		
11,273	LKQ Corp.	1.0	76,935,144
	総合金融サービス (3.7%)		
3,831	American Express Co.	0.9	74,810,035
1,732	Mastercard, Inc. Class A	0.9	71,283,565
10,685	SEI Investments Co.	1.0	75,860,745
38,366	Western Union Co.	0.9	74,969,369
	電子部品 (1.0%)		296,923,714
3,504	Acuity Brands, Inc.	1.0	79,866,654
	エンジニアリング・建設 (1.1%)		
5,286	EMCOR Group, Inc.	1.1	88,356,296
	食品 (2.0%)		
7,884	General Mills, Inc.	1.1	87,425,001
27,944	Hain Celestial Group, Inc.	0.9	68,275,452
	林産物 & 製紙 (0.8%)		155,700,453
13,890	International Paper Co.	0.8	63,733,104
	ヘルスケア製品 (1.0%)		
5,540	Abbott Laboratories	1.0	77,590,614

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
	ヘルスケアサービス (6.2%)		
1,220	Chemed Corp.	1.0	77,091,649
7,016	DaVita, Inc.	1.1	84,055,493
2,871	HCA Healthcare, Inc.	1.0	76,376,304
2,476	Laboratory Corp. of America Holdings	0.9	73,401,572
3,838	Medpace Holdings, Inc.	1.1	87,312,855
4,699	Quest Diagnostics, Inc.	1.1	83,448,431
			481,686,304
	住宅建設 (1.0%)		
142	NVR, Inc.	1.0	81,949,604
	保険 (5.3%)		
10,011	Aflac, Inc.	1.0	81,436,170
4,851	Allstate Corp.	1.1	87,439,734
2,187	Aon PLC Class A	1.1	84,796,207
8,062	Principal Financial Group, Inc.	1.1	84,194,301
3,718	Travelers Cos, Inc.	1.0	82,446,404
			420,312,816
	インターネット (1.9%)		
3,631	Facebook, Inc. Class A	0.9	71,309,214
7,833	GoDaddy, Inc. Class A	1.0	80,362,863
			151,672,077
	鉄鋼 (0.9%)		
4,398	Nucor Corp.	0.9	68,108,604
	宿泊施設 (0.9%)		
17,000	MGM Resorts International	0.9	73,130,963
	建設・採掘機械 (1.0%)		
3,256	Caterpillar, Inc.	1.0	77,329,216
	メディア (1.7%)		
1,372	Charter Communications, Inc. Class A	0.8	60,242,318
16,443	Comcast Corp. Class A	0.9	69,806,632
			130,048,950
	オイル & ガス (2.9%)		
5,066	ConocoPhillips	0.9	75,043,687
5,915	Marathon Petroleum Corp.	1.1	85,043,035
2,311	Pioneer Natural Resources Co.	0.9	72,430,517
			232,517,239
	包装・容器 (0.9%)		
10,813	Sealed Air Corp.	0.9	69,663,833
	医薬品 (4.1%)		
8,570	Bristol-Myers Squibb Co.	1.1	88,184,631
2,037	Cigna Corp.	1.0	81,810,798
1,616	McKesson Corp.	1.0	79,498,284
12,457	Pfizer, Inc.	1.0	78,903,150
			328,396,863

ダイワ米国株主還元株ファンド

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
	未公開株式 (0.9%)		
6,069	Blackstone, Inc.	0.9	73,526,884
	小売 (10.1%)		
3,259	Advance Auto Parts, Inc.	0.9	73,749,322
284	AutoZone, Inc.	1.1	88,049,558
4,463	Darden Restaurants, Inc.	1.0	81,602,332
2,119	Home Depot, Inc.	1.1	84,634,841
3,008	Lowe's Cos, Inc.	1.0	81,771,151
821	O'Reilly Automotive, Inc.	1.1	83,583,050
3,716	Target Corp.	1.0	79,814,888
1,390	Ulta Beauty, Inc.	1.0	80,717,642
4,028	Williams-Sonoma, Inc.	0.9	68,710,422
5,226	Yum! Brands, Inc.	1.0	80,439,549
			803,072,755
	半導体 (9.5%)		
3,956	Analog Devices, Inc.	1.0	79,787,647
6,445	Applied Materials, Inc.	1.0	76,430,983
1,117	Broadcom, Inc.	0.9	71,787,609
1,754	KLA-Tencor Corp.	1.0	76,832,530
1,367	Lam Research Corp.	0.9	72,419,107
6,197	Qorvo, Inc.	0.9	71,229,559
4,551	Qualcomm, Inc.	0.9	74,423,822
5,936	Skyworks Solutions, Inc.	0.9	73,264,522
7,081	Teradyne, Inc.	1.0	77,024,191
3,427	Texas Instruments, Inc.	1.0	76,777,243
			749,977,213
	ソフトウェア (2.9%)		
26,580	Dropbox, Inc. Class A	1.0	79,716,513
1,305	Fair Isaac Corp.	1.0	77,825,485
7,874	Oracle Corp.	0.9	69,602,830
			227,144,828
	通信 (1.0%)		
13,297	Cisco Systems, Inc.	1.0	76,986,970
	運輸 (5.5%)		
5,097	CH Robinson Worldwide, Inc.	0.9	71,054,172
18,822	CSX Corp.	0.9	72,577,759
5,753	Expeditors International of Washington, Inc.	0.9	73,537,324
3,847	Landstar System, Inc.	1.0	80,390,126
2,448	Norfolk Southern Corp.	0.9	74,286,491
2,507	Union Pacific Corp.	0.9	70,695,446
			442,541,318
	米国合計		7,403,080,620
	普通株合計 (簿価 ¥7,442,863,751)		¥ 7,799,828,907

U S トータル・イールド・ファンドの2022年9月30日現在の売建オプション残高 (株式の-0.1%)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - Abbott Laboratories	¥ 108	10/13/2022	1,900	¥ (480,611)	¥ (13,176)
Call - Acuity Brands, Inc.	173	10/13/2022	1,200	(811,068)	(278,466)
Call - Advance Auto Parts, Inc.	183	10/13/2022	1,110	(617,707)	(6,622)
Call - Aflac, Inc.	65	10/13/2022	3,430	(117,362)	(2,575)
Call - Allstate Corp.	129	10/13/2022	1,660	(512,657)	(273,740)
Call - Altria Group, Inc.	46	10/13/2022	4,260	(204,732)	(1,476)
Call - Amdocs, Ltd.	89	10/13/2022	2,370	(105,408)	(38,787)
Call - American Express Co.	160	10/13/2022	1,310	(537,675)	(7,585)
Call - Amgen, Inc.	253	10/13/2022	840	(342,122)	(7,441)
Call - Analog Devices, Inc.	159	10/13/2022	1,350	(544,300)	(24,890)
Call - Aon PLC	298	10/13/2022	750	(482,480)	(9,660)
Call - Apple, Inc.	167	10/13/2022	1,240	(321,958)	(1,340)
Call - Applied Materials, Inc.	97	10/13/2022	2,210	(983,549)	(25,809)
Call - Arch Capital Group Ltd.	49	10/13/2022	4,210	(433,796)	(99,699)
Call - Automatic Data Processing, Inc.	258	10/13/2022	840	(166,478)	(4,034)
Call - AutoZone, Inc.	2,314	10/13/2022	90	(476,364)	(62,591)
Call - Bank of America Corp.	35	10/13/2022	6,060	(526,348)	(26,124)
Call - Bank of New York Mellon Corp.	45	10/13/2022	4,860	(428,441)	(21,871)
Call - Blackstone, Inc.	100	10/13/2022	2,080	(1,118,526)	(38,669)
Call - Bristol-Myers Squibb Co.	70	10/13/2022	2,940	(514,706)	(600,825)
Call - Broadcom, Inc.	517	10/13/2022	380	(725,709)	(6,263)
Call - Caterpillar, Inc.	190	10/13/2022	1,110	(548,629)	(16,003)
Call - CH Robinson Worldwide, Inc.	122	10/13/2022	1,750	(271,149)	(20)
Call - Charter Communications, Inc.	424	10/13/2022	470	(585,060)	(1,219)
Call - Chemed Corp.	491	10/13/2022	410	(469,542)	(17,287)
Call - Chubb Ltd.	199	10/13/2022	1,050	(397,855)	(25,079)
Call - Cigna Corp.	305	10/13/2022	690	(307,430)	(29,907)
Call - Cintas Corp.	451	10/13/2022	500	(382,168)	(3,740)
Call - Cisco Systems, Inc.	48	10/13/2022	4,560	(165,581)	(631)
Call - Comcast Corp.	37	10/13/2022	5,640	(577,638)	(4,290)
Call - ConocoPhillips	109	10/13/2022	1,730	(1,094,071)	(322,765)
Call - CSX Corp.	34	10/13/2022	6,460	(372,069)	(4,782)
Call - Cummins, Inc.	232	10/13/2022	910	(209,451)	(13,768)
Call - Darden Restaurants, Inc.	133	10/13/2022	1,530	(702,054)	(169,760)
Call - DaVita, Inc.	93	10/13/2022	2,400	(904,284)	(42,494)
Call - Dow, Inc.	53	10/13/2022	3,950	(371,904)	(7,436)
Call - Dropbox, Inc.	23	10/13/2022	9,120	(648,882)	(88,782)
Call - Expeditors International of Washington, Inc.	109	10/13/2022	1,970	(252,034)	(126)
Call - Facebook, Inc.	166	10/13/2022	1,240	(1,212,004)	(10,817)
Call - Fair Isaac Corp.	482	10/13/2022	440	(482,791)	(32,340)
Call - FleetCor Technologies, Inc.	224	10/13/2022	960	(476,571)	0
Call - Fortinet, Inc.	52	10/13/2022	3,960	(1,093,074)	(364,604)
Call - Fortune Brands Home & Security, Inc.	66	10/13/2022	3,210	(694,352)	(21,820)
Call - Gartner, Inc.	312	10/13/2022	710	(562,704)	(47,896)
Call - General Mills, Inc.	81	10/13/2022	2,700	(198,892)	(37,561)
Call - GoDaddy, Inc.	80	10/13/2022	2,680	(414,238)	(17,898)

ダイワ米国株主還元株ファンド

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - Hain Celestial Group, Inc.	20	10/13/2022	9,590	(1,160,114)	(95,005)
Call - HCA Healthcare, Inc.	223	10/13/2022	980	(736,049)	(13,414)
Call - Hewlett Packard Enterprise Co.	14	10/13/2022	14,740	(407,655)	(14,894)
Call - Home Depot, Inc.	313	10/13/2022	720	(387,744)	(12,868)
Call - HP, Inc.	29	10/13/2022	7,300	(528,883)	(25,319)
Call - International Paper Co.	43	10/13/2022	4,760	(338,189)	(449)
Call - KLA-Tencor Corp.	356	10/13/2022	600	(898,684)	(43,581)
Call - L3Harris Technologies, Inc.	241	10/13/2022	940	(618,589)	(16,204)
Call - Laboratory Corp. of America Holdings	240	10/13/2022	850	(535,449)	(3,768)
Call - Lam Research Corp.	445	10/13/2022	460	(1,214,191)	(11,286)
Call - Landstar System, Inc.	155	10/13/2022	1,320	(440,822)	(177,469)
Call - LKQ Corp.	57	10/13/2022	3,870	(310,018)	(7,654)
Call - Lowe's Cos, Inc.	216	10/13/2022	1,030	(325,446)	(9,779)
Call - ManpowerGroup, Inc.	75	10/13/2022	2,700	(955,561)	(42,037)
Call - Marathon Petroleum Corp.	106	10/13/2022	2,030	(690,692)	(313,147)
Call - Masco Corp.	54	10/13/2022	3,880	(466,173)	(31,084)
Call - Mastercard, Inc.	339	10/13/2022	590	(620,055)	(1,513)
Call - McKesson Corp.	386	10/13/2022	550	(318,541)	(7,621)
Call - Medpace Holdings, Inc.	165	10/13/2022	1,310	(858,537)	(691,280)
Call - MGM Resorts International	35	10/13/2022	5,830	(1,164,458)	(75,969)
Call - Moody's Corp.	304	10/13/2022	670	(632,374)	(4,390)
Call - Norfolk Southern Corp.	261	10/13/2022	840	(220,976)	(398)
Call - Nucor Corp.	142	10/13/2022	1,510	(1,020,223)	(2,194)
Call - NVR, Inc.	4,353	10/13/2022	40	(615,065)	(85,290)
Call - Omnicom Group, Inc.	71	10/13/2022	3,050	(258,168)	(16,164)
Call - Oracle Corp.	77	10/13/2022	2,700	(901,293)	(622)
Call - O'Reilly Automotive, Inc.	763	10/13/2022	280	(279,209)	(52,396)
Call - Pfizer, Inc.	48	10/13/2022	4,270	(557,145)	(39,899)
Call - Philip Morris International, Inc.	98	10/13/2022	2,150	(271,272)	(1,905)
Call - Pioneer Natural Resources Co.	242	10/13/2022	790	(1,102,802)	(115,981)
Call - Principal Financial Group, Inc.	81	10/13/2022	2,760	(300,342)	(52,272)
Call - Procter & Gamble Co.	148	10/13/2022	1,430	(113,232)	(1,689)
Call - Qorvo, Inc.	95	10/13/2022	2,120	(822,648)	(17,869)
Call - Qualcomm, Inc.	138	10/13/2022	1,560	(627,728)	(10,248)
Call - Quest Diagnostics, Inc.	131	10/13/2022	1,610	(474,393)	(124,760)
Call - Robert Half International, Inc.	80	10/13/2022	2,550	(855,017)	(371,300)
Call - S&P Global, Inc.	376	10/13/2022	560	(578,785)	(4,707)
Call - Sealed Air Corp.	55	10/13/2022	3,710	(558,269)	(1,434)
Call - SEI Investments Co.	57	10/13/2022	3,660	(510,395)	(25,231)
Call - Skyworks Solutions, Inc.	105	10/13/2022	2,030	(768,482)	(25,216)
Call - Tapestry, Inc.	37	10/13/2022	5,840	(719,721)	(13,896)
Call - Target Corp.	176	10/13/2022	1,270	(833,661)	(14,994)
Call - TE Connectivity, Ltd.	133	10/13/2022	1,600	(413,579)	(8,838)
Call - Teradyne, Inc.	88	10/13/2022	2,430	(1,222,926)	(62,223)
Call - Texas Instruments, Inc.	171	10/13/2022	1,170	(659,974)	(68,858)
Call - Trane Technologies PLC	170	10/13/2022	1,230	(442,012)	(14,405)
Call - Travelers Cos, Inc.	175	10/13/2022	1,270	(132,438)	(5,777)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - Ulta Beauty, Inc.	459	10/13/2022	470	(810, 796)	(19, 147)
Call - Union Pacific Corp.	241	10/13/2022	860	(298, 561)	(120)
Call - Wells Fargo & Co.	47	10/13/2022	4, 650	(438, 483)	(12, 952)
Call - Western Union Co.	15	10/13/2022	13, 170	(354, 719)	(51, 477)
Call - Williams-Sonoma, Inc.	157	10/13/2022	1, 380	(887, 364)	(4, 992)
Call - Willis Towers Watson PLC	221	10/13/2022	1, 000	(413, 834)	(22, 852)
Call - Yum! Brands, Inc.	119	10/13/2022	1, 790	(423, 171)	(9, 340)
				¥ (56, 341, 331)	¥ (5, 690, 845)

B R L オーバーレイ&カバードコール・クラスの2022年9月30日現在の売建オプション残高 (純資産の-0.2%)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - OTC Brazilian Real versus Japanese Yen	¥ 27	10/13/2022	47, 300, 000	¥ (30, 941, 792)	¥ (12, 803, 410)

B R L オーバーレイ&カバードコール・クラスの2022年9月30日現在の外国為替先渡取引 (純資産の-0.9%)

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)
B R L	Morgan Stanley	94, 600, 000	10/20/2022	U S D	17, 897, 007	¥ -	¥ (69, 283, 071)	¥ (69, 283, 071)
B R L	Morgan Stanley	5, 000, 000	10/20/2022	U S D	961, 742	-	(5, 947, 097)	(5, 947, 097)
U S D	UBS AG	1, 167, 301	10/20/2022	B R L	6, 290, 000	1, 328, 739	-	1, 328, 739
						¥ 1, 328, 739	¥ (75, 230, 168)	¥ (73, 901, 429)

U S D カバードコール・クラスの2022年9月30日現在の売建オプション残高 (純資産の-0.1%)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - OTC United States Dollar versus Japanese Yen	144	10/13/2022	3, 150, 000	¥ (7, 596, 153)	¥ (4, 203, 829)

通貨の略称：

B R L	-	ブラジル・レアル
J P Y	-	日本円
U S D	-	米ドル

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（ダイワ米国株主還元株ファンド）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（2022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、当ファンドの決算日（2023年4月18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

2022年10月19日～2023年4月18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

2023年4月18日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2022年12月9日)

(作成対象期間 2021年12月10日～2022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。

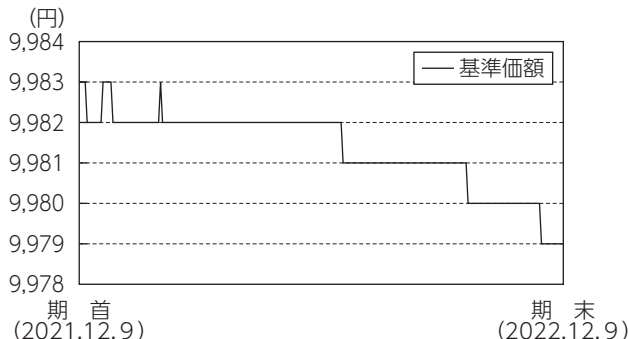
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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		公社債組入比率
	騰落率	騰落率	
(期首)2021年12月9日	円	%	%
12月末	9,983	0.0	-
2022年1月末	9,982	△0.0	-
2月末	9,982	△0.0	-
3月末	9,982	△0.0	-
4月末	9,982	△0.0	-
5月末	9,982	△0.0	-
6月末	9,981	△0.0	-
7月末	9,981	△0.0	-
8月末	9,981	△0.0	-
9月末	9,980	△0.0	-
10月末	9,980	△0.0	-
11月末	9,979	△0.0	-
(期末)2022年12月9日	9,979	△0.0	-

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、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：9,983円 期末：9,979円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

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

2022年12月9日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
コール・ローン等、その他	千円 88,110	% 100.0
投資信託財産総額	88,110	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

2022年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	88,110,325円
コール・ローン等	88,110,325
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	88,110,325
元本	88,294,563
次期繰越損益金	△ 184,238
(D) 受益権総口数	88,294,563口
1万口当り基準価額(C / D)	9,979円

* 期首における元本額は603,229,011円、当作成期間中における追加設定元本額は15,027,049円、同解約元本額は529,961,497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）	24,953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）	66,873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/バリュー・パートナーズ・チャイナ・インベーター・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・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）	66,079,892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9,979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184,238円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月10日 至2022年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 57,441円
受取利息	1,247
支払利息	△ 58,688
(B) 当期損益金(A)	△ 57,441
(C) 前期繰越損益金	△ 1,053,685
(D) 解約差損益金	953,937
(E) 追加信託差損益金	△ 27,049
(F) 合計(B + C + D + E)	△ 184,238
次期繰越損益金(F)	△ 184,238

(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。