

ダイワ米国株主還元株ファンド

運用報告書(全体版) 第12期

(決算日 2021年10月18日)

(作成対象期間 2021年4月20日～2021年10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	約10年間 (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
8 期末 (2019年10月18日)	11,524	0	△ 3.6	14,487	1.1	—	97.6	9,080
9 期末 (2020年4月20日)	10,180	0	△ 11.7	13,946	△ 3.7	—	97.3	6,618
10 期末 (2020年10月19日)	11,431	350	15.7	16,946	21.5	—	98.6	6,536
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

(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. 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 Inc. が開発した株価指数で、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 Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。

(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



* 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：13,132円

期末：13,318円（分配金1,000円）

騰落率：9.0%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

主として、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、米国株式市況の上昇や米ドルが対円で上昇（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。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)2021年4月19日	13,132	—	21,188	—	—	98.0
4月末	13,181	0.4	21,371	0.9	—	98.6
5月末	13,538	3.1	21,479	1.4	—	99.2
6月末	13,615	3.7	22,231	4.9	—	98.0
7月末	13,727	4.5	22,673	7.0	—	98.8
8月末	14,081	7.2	23,337	10.1	—	98.5
9月末	13,750	4.7	22,849	7.8	—	99.2
(期末)2021年10月18日	14,318	9.0	23,991	13.2	—	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

（2021. 4. 20 ~ 2021. 10. 18）

■米国株式市況

米国株式市場は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種が進み2021年6月にかけて新規感染者数が大幅に減少したことや堅調な経済指標の発表が続いたことなどにより、9月初めにかけて史上最高値を断続的に更新しました。その後は、世界的にインフレ懸念が台頭したことで米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まり金利上昇が嫌気されたこと、米国連邦政府の債務上限問題や増税に対する不透明感が高まったことなどから、9月末にかけて株価は下落しました。10月に入ると、債務上限が引き上げられたことや良好な企業決算発表が好感されたことなどから、株価は再び上昇に転じました。

■米ドル円為替相場

米ドルの対円為替相場は上昇しました。

当作成期首から2021年9月半ばまでは、新型コロナウイルスの感染状況や、金融政策をめぐるF R B（米国連邦準備制度理事会）高官の発言、米国長期金利の動向などに左右され、米ドルの対円為替相場は方向感の乏しい展開となりました。しかし、9月後半に開催されたF O M C（米国連邦公開市場委員会）において、テーパリング（量的緩和の段階的な縮小）の年内開始と利上げ開始時期の前倒しの可能性が示唆されたことに反応して、米国長期金利が大きく上昇したため、日米金利差の拡大観測から、米ドルが対円で急伸しました。

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、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）

米国では、新型コロナウイルスによる経済的打撃に対し、政府および中央銀行が迅速に対応したことに加え、ワクチン開発の進展やバイデン新政権の発足による政治的不透明感の払拭を好感し、株価は史上最高値を更新する展開となりました。当作成期においては、企業の業績、資産、成長性

に対し株価が割安であった銘柄に注目が集まり、自社株買いおよび配当という株主還元も評価される展開となりました。米国株式市場において株主還元は引き続き重要な投資テーマであると考えられるため、当ファンドはこれまでと同様に株主還元の積極性と持続性に重点を置いた投資運用をしていく方針です。

■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

(2021. 4. 20 ~ 2021. 10. 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）

現物株ポートフォリオについては、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。当作成期中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・サービスや金融の組み入れが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コミュニケーション・サービスや情報技術、公益事業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

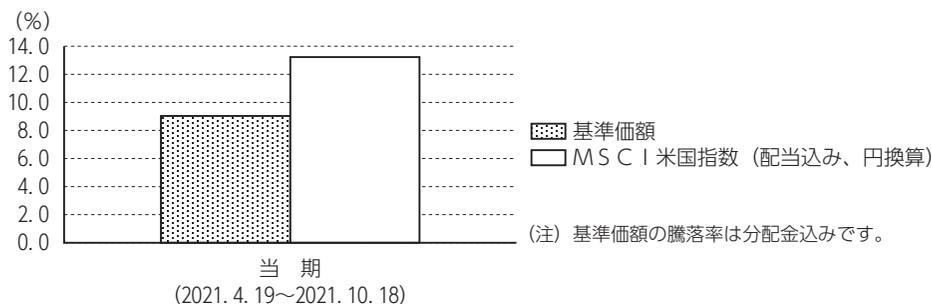
当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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下回る結果となりました。

業種別では、金融のオーバーウエートおよび銘柄選択、資本財・サービスにおける銘柄選択などがパフォーマンスにプラス寄与しました。一方、情報技術やヘルスケアにおける銘柄選択などがマイナス要因となりました。

個別銘柄では、資産運用業務を手掛けるジャナス・ヘンダーソン・グループや、専門職に特化した人材紹介・派遣会社のロバート・ハーフ・インターナショナルなどの株価が上昇し、パフォーマンスにプラス寄与しました。一方、化粧品や栄養補助食品の製造・販売を手掛けるニュー・スキン・エンタープライズやバイオテクノロジー企業のバイオジェンなどは株価が下落し、パフォーマンスにマイナスの影響を与えました。



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	
	2021年4月20日 ～2021年10月18日	
当期分配金（税込み）	（円）	1,000
対基準価額比率	（％）	6.98
当期の収益	（円）	1,000
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,318

(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	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	236.35円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	943.98
(c) 収益調整金		887.00
(d) 分配準備積立金		2,250.77
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		4,318.12
(f) 分配金		1,000.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		3,318.12

(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います。

■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 (2021. 4. 20～2021. 10. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	91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13,604円です。
(投 信 会 社)	(30)	(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)	(60)	(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	92	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。

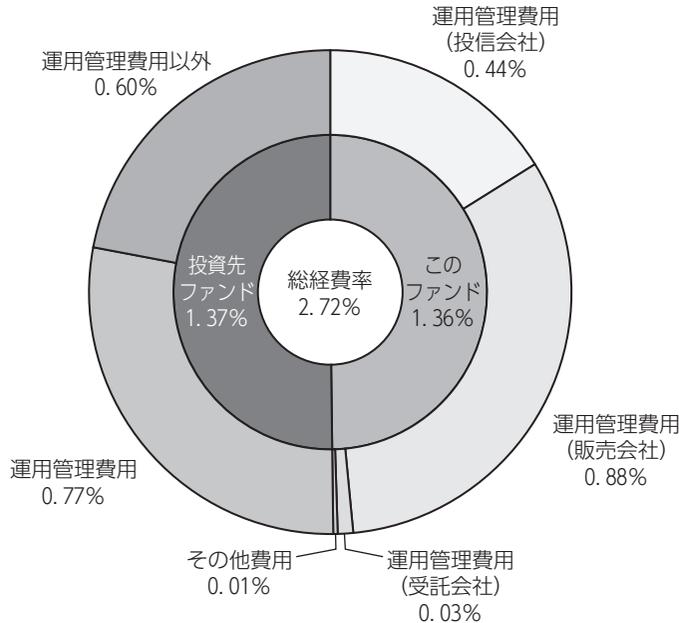
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.72%です。



総経費率 (① + ② + ③)	2.72%
①この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	0.77%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.60%

(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。

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

(2021年4月20日から2021年10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)	2,069,46173	254,464	10,013,48015	1,272,000

(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

(2021年4月20日から2021年10月18日まで)

買 付 銘 柄	当 期			平均単価 円	売 付 銘 柄	当 期		
	□ 数	金 額	平均単価			□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円	
UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	1,202,12815	145,000	120		UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	10,013,48015	1,272,000	127

(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	39,487,96612	5,217,150	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	千円	千円
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	36,730	36,730	36,667

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年10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	5,217,150	90.8
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	36,667	0.6
コール・ローン等、その他	489,519	8.6
投資信託財産総額	5,743,337	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

2021年10月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,743,337,488円
コール・ローン等	489,519,634
投資信託受益証券（評価額）	5,217,150,083
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	36,667,771
(B) 負債	447,284,514
未払収益分配金	397,657,590
未払解約金	9,529,671
未払信託報酬	39,853,332
その他未払費用	243,921
(C) 純資産総額（A－B）	5,296,052,974
元本	3,976,575,900
次期繰越損益金	1,319,477,074
(D) 受益権総口数	3,976,575,900口
1万口当り基準価額（C／D）	13,318円

* 期首における元本額は4,504,983,811円、当作成期間中における追加設定元本額は238,886,105円、同解約元本額は767,294,016円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,318円です。

■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	93,990,019円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	375,382,238
(c) 収益調整金	352,725,563
(d) 分配準備積立金	895,036,844
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1,717,134,664
(f) 分配金	397,657,590
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	1,319,477,074
(h) 受益権総口数	3,976,575,900口

■損益の状況

当期 自 2021年4月20日 至 2021年10月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	102,029,142円
受取配当金	102,044,777
受取利息	317
支払利息	△ 15,952
(B) 有価証券売買損益	407,440,368
売買益	436,611,124
売買損	△ 29,170,756
(C) 信託報酬等	△ 40,097,253
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	469,372,257
(E) 前期繰越損益金	895,036,844
(F) 追加信託差損益金	352,725,563
（配当等相当額）	（ 308,533,027）
（売買損益相当額）	（ 44,192,536）
(G) 合計（D＋E＋F）	1,717,134,664
(H) 収益分配金	△ 397,657,590
次期繰越損益金（G＋H）	1,319,477,074
追加信託差損益金	352,725,563
（配当等相当額）	（ 308,533,027）
（売買損益相当額）	（ 44,192,536）
分配準備積立金	966,751,511

（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 お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	1,000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) 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)

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)」に投資しておりますが、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。

(注) 2021年10月18日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

(円建て)

貸借対照表
2020年9月30日

資産

流動資産

金融資産（損益通算後の評価額）	¥	12,511,686,982
現金および現金同等物		163,542,827
担保としてブローカーに預託した現金		203,177,798
未収：		
配当		16,802,019
発行済受益証券の代金		300,000
その他資産		441,773
資産合計		<u>12,895,951,399</u>

負債

流動負債

金融負債（損益通算後の評価額）		302,574,274
保管会社に対する支払		32,922
未払：		
運用会社報酬		39,528,190
専門家報酬		5,957,227
保管会社報酬		2,898,344
受託会社報酬		2,831,413
管理会社報酬		2,261,043
名義書換代理人報酬		42,441
登録料		9,206
購入済証券		3,414
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>356,138,474</u>
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	¥	<u>12,539,812,925</u>

損益計算書

2020年9月30日に終了した年度

収益		
受取利息	¥	2,475,079
配当収益		336,225,703
その他収益		47,194
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の実現損益		(181,788,278)
デリバティブ金融資産および負債の実現損益		(1,511,237,774)
外国為替取引の実現損益		19,114,250
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の評価損益		(127,818,039)
デリバティブ金融資産および負債の評価損益		(59,420,805)
外国為替取引の評価益の変動		(1,261,045)
収益合計		<u>(1,523,663,715)</u>
費用		
運用会社報酬		95,752,693
管理会社報酬		21,216,310
保管会社報酬		7,106,140
専門家報酬		4,820,595
取引費用		2,739,413
名義書換代理人報酬		1,783,352
受託会社報酬		1,548,284
登録料		21,372
その他費用		342,374
費用合計		<u>135,330,533</u>
営業損益		<u>(1,658,994,248)</u>
金融費用		
償却可能受益証券の保有者への分配金		<u>(2,717,284,436)</u>
分配後および税引前損益		(4,376,278,684)
源泉徴収税		(95,252,103)
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>(4,471,530,787)</u></u>

投資明細表
2020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 (99.8%)		
	アイルランド (1.0%)		
	コンピューター (1.0%)		
5,181	Accenture Plc. Class A	1.0	¥ 123,560,238
	アイルランド合計		123,560,238
	英国 (2.0%)		
	化学 (1.0%)		
4,856	Linde Plc.	1.0	122,030,590
	商業サービス (1.0%)		
15,047	IHS Markit Ltd.	1.0	124,666,803
	英国合計		246,697,393
	米国 (96.8%)		
	航空宇宙・防衛 (0.9%)		
6,227	L3Harris Technologies, Inc.	0.9	111,607,857
	農業 (1.0%)		
15,787	Philip Morris International, Inc.	1.0	124,933,494
	アパレル (1.1%)		
10,115	Nike, Inc. Class B	1.1	134,005,904
	自動車 (1.0%)		
5,885	Cummins, Inc.	1.0	131,139,657
	自動車部品 (1.0%)		
44,087	Gentex Corp.	1.0	119,801,899
	飲料 (2.0%)		
14,532	Monster Beverage Corp.	1.0	122,991,665
8,804	PepsiCo, Inc.	1.0	128,771,332
			251,762,997
	バイオテクノロジー (4.1%)		
4,974	Amgen, Inc.	1.1	133,410,160
4,174	Biogen, Inc.	1.0	124,955,992
18,051	Gilead Sciences, Inc.	1.0	120,372,019
2,033	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	1.0	120,096,591
			498,834,762
	建築材料 (1.0%)		
21,021	Masco Corp.	1.0	122,297,418
	商業サービス (2.0%)		
8,951	Automatic Data Processing, Inc.	1.0	131,762,114
3,387	S&P Global, Inc.	1.0	128,889,293
			260,651,407
	コンピューター (7.8%)		
20,265	Amdocs, Ltd.	1.0	122,775,038
9,851	Apple, Inc.	1.0	120,393,296

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
18,428	Cognizant Technology Solutions Corp. Class A	1.1	135,001,544
10,129	Fortinet, Inc.	1.0	125,928,680
61,741	HP, Inc.	1.0	123,729,867
14,822	Lumentum Holdings, Inc.	0.9	117,515,762
15,358	MAXIMUS, Inc.	0.9	110,874,118
24,389	NetApp, Inc.	0.9	112,834,124
			969,052,429
	化粧品・パーソナルケア (1.0%)		
8,945	Procter & Gamble Co.	1.0	131,201,809
	総合金融サービス (6.0%)		
7,743	Ameriprise Financial, Inc.	1.0	125,926,172
2,110	BlackRock, Inc. Class A	1.0	125,484,716
11,486	Intercontinental Exchange, Inc.	1.0	121,272,360
3,496	Mastercard, Inc. Class A	1.0	124,762,028
8,949	T Rowe Price Group, Inc.	1.0	121,089,421
5,797	Visa, Inc. Class A	1.0	122,333,125
			740,867,822
	電子部品 (1.0%)		
17,399	Emerson Electric Co.	1.0	120,394,153
	電機 (2.8%)		
43,268	Avnet, Inc.	0.9	117,987,297
7,429	Honeywell International, Inc.	1.0	129,051,333
5,629	Waters Corp.	0.9	116,239,467
			363,278,097
	エンジニアリング・建設 (1.0%)		
12,385	Jacobs Engineering Group, Inc.	1.0	121,249,370
	環境制御 (1.0%)		
12,816	Tetra Tech, Inc.	1.0	129,161,117
	食品 (1.0%)		
8,066	Hershey Co.	1.0	122,011,717
	機械工具 (1.0%)		
12,541	Lincoln Electric Holdings, Inc.	1.0	121,810,493
	ヘルスケア製品 (1.0%)		
2,829	Thermo Fisher Scientific, Inc.	1.0	131,813,306
	ヘルスケアサービス (3.0%)		
2,979	Humana, Inc.	1.0	130,116,196
6,502	Molina Healthcare, Inc.	1.0	125,594,001
3,627	UnitedHealth Group, Inc.	1.0	119,332,242
			375,042,439
	住宅建設 (1.1%)		
15,371	Lennar Corp. Class A	1.1	132,493,256
	家庭用品 (1.0%)		
7,822	Kimberly-Clark Corp.	1.0	121,886,778

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
	保険 (1.0%)		
12,927	Allstate Corp.	1.0	128,424,495
	インターネット (3.6%)		
746	Alphabet, Inc. Class A	0.9	115,379,913
591	Booking Holdings, Inc.	0.8	106,692,080
22,679	eBay, Inc.	1.0	124,691,700
4,224	Facebook, Inc. Class A	0.9	116,744,205
			463,507,898
	鉄鋼 (1.0%)		
11,597	Reliance Steel & Aluminum Co.	1.0	124,879,753
	建設・採掘機械 (1.0%)		
8,041	Caterpillar, Inc.	1.0	126,563,723
	メディア (1.0%)		
1,993	Charter Communications, Inc. Class A	1.0	131,311,989
	鉱業 (0.9%)		
17,725	Newmont Corp.	0.9	118,684,442
	その他製造 (1.9%)		
12,000	Eaton Corp. PLC	1.0	129,206,706
5,852	Illinois Tool Works, Inc.	0.9	119,319,065
			248,525,771
	オイル & ガス (1.0%)		
8,859	Murphy USA, Inc.	1.0	119,918,371
	医薬品 (8.0%)		
12,970	AbbVie, Inc.	1.0	119,886,540
12,189	AmerisourceBergen Corp. Class A	1.0	124,668,693
19,314	Bristol-Myers Squibb Co.	1.0	122,883,461
8,123	Eli Lilly & Co.	1.0	126,885,728
7,870	Johnson & Johnson	1.0	123,647,977
8,087	McKesson Corp.	1.0	127,100,001
14,014	Merck & Co., Inc.	1.0	122,674,537
32,771	Pfizer, Inc.	1.0	126,920,473
			994,667,410
	不動産投資信託 (0.8%)		
37,286	Equity Commonwealth	0.8	104,783,496
	小売 (8.4%)		
3,551	Costco Wholesale Corp.	1.1	133,031,641
6,151	Dollar General Corp.	1.1	136,067,488
3,121	Domino's Pizza, Inc.	1.1	140,069,846
4,355	Home Depot, Inc.	1.0	127,630,832
7,514	Lowe's Cos, Inc.	1.0	131,519,084
8,288	Target Corp.	1.1	137,684,665
8,213	Tractor Supply Co.	1.0	124,235,338
8,455	Wal-Mart Stores, Inc.	1.0	124,835,553
			1,055,074,447

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
半導体 (8.1%)			
19,415	Applied Materials, Inc.	1.0	121,805,017
5,968	KLA-Tencor Corp.	1.0	122,018,037
2,454	NVIDIA Corp.	1.1	140,160,074
10,220	Qualcomm, Inc.	1.0	126,919,829
8,249	Skyworks Solutions, Inc.	1.0	126,660,215
15,160	Teradyne, Inc.	1.0	127,122,869
8,608	Texas Instruments, Inc.	1.0	129,710,751
11,617	Xilinx, Inc.	1.0	127,792,191
			1,022,188,983
ソフトウェア (7.2%)			
2,490	Adobe, Inc.	1.0	128,870,139
17,073	Cerner Corp.	1.0	130,245,878
8,421	Citrix Systems, Inc.	1.0	122,378,484
9,156	Electronic Arts, Inc.	1.0	126,006,399
5,490	Microsoft Corp.	1.0	121,856,721
21,641	Oracle Corp.	1.1	136,341,346
16,354	Paychex, Inc.	1.1	137,670,062
			903,369,029
通信 (3.9%)			
29,190	Cisco Systems, Inc.	1.0	121,337,767
50,585	Juniper Networks, Inc.	0.9	114,772,049
7,229	Ubiquiti, Inc.	1.0	127,140,971
19,701	Verizon Communications, Inc.	1.0	123,682,474
			486,933,261
運輸 (6.2%)			
15,989	CSX Corp.	1.0	131,054,075
13,914	Expeditors International of Washington, Inc.	1.1	132,914,532
6,704	Kansas City Southern	1.0	127,932,360
9,244	Landstar System, Inc.	1.0	122,417,915
5,796	Norfolk Southern Corp.	1.0	130,887,381
6,358	Union Pacific Corp.	1.1	132,091,839
			777,298,102
米国合計			12,141,429,351
普通株合計 (簿価 ¥11,525,014,209)			¥ 12,511,686,982

U S トータル・イールド・ファンドの2020年9月30日現在の売建オプション残高 (純資産の-0.3%)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - AbbVie, Inc.	¥ 98	2020/10/6	5,400	¥ (235,663)	¥ (40)
Call - Accenture PLC.	246	2020/10/6	2,150	(1,249,331)	(6,320)
Call - Adobe, Inc.	494	2020/10/6	1,030	(2,376,593)	(801,737)
Call - Alphabet, Inc.	1,594	2020/10/6	310	(1,387,240)	(17,923)
Call - Ameriprise Financial, Inc.	161	2020/10/6	3,220	(613,069)	(338,158)
Call - AmerisourceBergen Corp.	103	2020/10/6	5,070	(568,666)	(39,536)
Call - Amgen, Inc.	263	2020/10/6	2,070	(483,223)	(203,514)
Call - Apple, Inc.	121	2020/10/6	4,100	(2,483,496)	(277,516)
Call - Applied Materials, Inc.	59	2020/10/6	8,080	(1,184,563)	(1,155,664)
Call - Automatic Data Processing, Inc.	140	2020/10/6	3,720	(1,061,492)	(794,773)
Call - Avnet, Inc.	29	2020/10/6	18,020	(928,844)	(3,963)
Call - Biogen, Inc.	292	2020/10/6	1,730	(589,642)	(939,808)
Call - BlackRock, Inc.	588	2020/10/6	870	(575,268)	(76,396)
Call - Booking Holdings, Inc.	1,927	2020/10/6	240	(1,145,648)	(9,970)
Call - Bristol-Myers Squibb Co.	63	2020/10/6	8,040	(196,450)	(42,296)
Call - Caterpillar, Inc.	157	2020/10/6	3,340	(1,176,919)	(98,503)
Call - Cerner Corp.	74	2020/10/6	7,110	(908,437)	(539,501)
Call - Charter Communications, Inc.	644	2020/10/6	830	(367,663)	(247,779)
Call - Cisco Systems, Inc.	43	2020/10/6	12,150	(275,189)	(64,284)
Call - Citrix Systems, Inc.	148	2020/10/6	3,500	(855,824)	(24,421)
Call - Cognizant Technology Solutions Corp.	70	2020/10/6	7,670	(592,294)	(725,359)
Call - Costco Wholesale Corp.	357	2020/10/6	1,470	(1,274,123)	(464,224)
Call - CSX Corp.	79	2020/10/6	6,650	(941,432)	(560,034)
Call - Cummins, Inc.	223	2020/10/6	2,450	(657,509)	(61,031)
Call - Dollar General Corp.	211	2020/10/6	2,560	(327,660)	(429,484)
Call - Domino's Pizza, Inc.	400	2020/10/6	1,290	(1,076,474)	(3,507,686)
Call - Eaton Corp. PLC	106	2020/10/6	4,990	(845,530)	(139,847)
Call - eBay, Inc.	57	2020/10/6	9,440	(937,472)	(39,004)
Call - Electronic Arts, Inc.	138	2020/10/6	3,810	(654,733)	(407,214)
Call - Eli Lilly & Co.	160	2020/10/6	3,380	(748,347)	(24,428)
Call - Emerson Electric Co.	72	2020/10/6	7,240	(796,754)	(1,065)
Call - Expeditors International of Washington, Inc.	94	2020/10/6	5,790	(711,303)	(230,750)
Call - Facebook, Inc.	282	2020/10/6	1,750	(1,692,833)	(48,931)
Call - Fortinet, Inc.	125	2020/10/6	4,210	(1,207,126)	(130,299)
Call - Gilead Sciences, Inc.	66	2020/10/6	7,510	(962,576)	(89,226)
Call - Hershey Co.	155	2020/10/6	3,350	(353,503)	(12,287)
Call - Home Depot, Inc.	285	2020/10/6	1,810	(890,108)	(211,245)
Call - Honeywell International, Inc.	171	2020/10/6	3,090	(923,117)	(220,263)
Call - HP, Inc.	21	2020/10/6	25,710	(1,173,368)	(43,188)
Call - Humana, Inc.	436	2020/10/6	1,240	(390,307)	(61,645)
Call - IHS Markit Ltd.	80	2020/10/6	6,260	(1,119,247)	(246,745)
Call - Illinois Tool Works, Inc.	200	2020/10/6	2,430	(707,670)	(130,613)
Call - Intercontinental Exchange, Inc.	104	2020/10/6	4,780	(661,719)	(64,174)
Call - Jacobs Engineering Group, Inc.	95	2020/10/6	5,150	(841,948)	(294,795)
Call - Johnson & Johnson	157	2020/10/6	3,270	(341,934)	(15,207)
Call - Juniper Networks, Inc.	24	2020/10/6	21,060	(1,513,764)	(1,565)
Call - Kansas City Southern	191	2020/10/6	2,790	(1,238,934)	(104,561)
Call - Kimberly-Clark Corp.	159	2020/10/6	3,250	(283,945)	(2,225)
Call - KLA-Tencor Corp.	187	2020/10/6	2,480	(979,476)	(2,252,245)
Call - Landstar System, Inc.	142	2020/10/6	3,840	(675,838)	(2,001)
Call - Lennar Corp.	80	2020/10/6	6,400	(1,850,699)	(2,023,092)
Call - Linde PLC	259	2020/10/6	2,020	(862,328)	(2,058)
Call - Lowe's Cos, Inc.	171	2020/10/6	3,120	(529,231)	(227,608)
Call - Lumentum Holdings, Inc.	78	2020/10/6	6,170	(1,321,886)	(558,329)

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 - Masco Corp.	61	2020/10/6	8,750	(538,492)	(3,572)
Call - Mastercard, Inc.	350	2020/10/6	1,450	(925,415)	(116,066)
Call - McKesson Corp.	160	2020/10/6	3,360	(977,399)	(47,189)
Call - Merck & Co., Inc.	88	2020/10/6	5,830	(356,684)	(10,076)
Call - Microsoft Corp.	218	2020/10/6	2,280	(1,493,260)	(134,916)
Call - Molina Healthcare, Inc.	188	2020/10/6	2,700	(860,245)	(709,006)
Call - Monster Beverage Corp.	87	2020/10/6	6,050	(1,105,675)	(36,598)
Call - Murphy USA, Inc.	146	2020/10/6	3,680	(712,927)	(12,457)
Call - NetApp, Inc.	48	2020/10/6	10,150	(1,596,833)	(23,958)
Call - Newmont Corp.	73	2020/10/6	7,380	(1,020,787)	(5,832)
Call - Nike, Inc.	118	2020/10/6	4,210	(1,433,121)	(3,275,930)
Call - Norfolk Southern Corp.	219	2020/10/6	2,410	(939,771)	(321,364)
Call - NVIDIA Corp.	534	2020/10/6	1,020	(2,314,693)	(1,805,693)
Call - Oracle Corp.	59	2020/10/6	9,010	(1,383,408)	(1,428,671)
Call - Paychex, Inc.	78	2020/10/6	6,810	(1,184,160)	(1,771,305)
Call - PepsiCo, Inc.	141	2020/10/6	3,660	(630,122)	(317,505)
Call - Philip Morris International, Inc.	83	2020/10/6	6,570	(456,608)	(1,001)
Call - Procter & Gamble Co.	142	2020/10/6	3,720	(433,647)	(127,397)
Call - Qualcomm, Inc.	122	2020/10/6	4,250	(759,060)	(394,466)
Call - Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	611	2020/10/6	840	(788,064)	(41,362)
Call - Reliance Steel & Aluminum Co.	113	2020/10/6	4,820	(449,633)	(1,164)
Call - Skyworks Solutions, Inc.	147	2020/10/6	3,430	(1,148,290)	(745,301)
Call - T Rowe Price Group, Inc.	137	2020/10/6	3,720	(260,670)	(29,662)
Call - Target Corp.	158	2020/10/6	3,450	(307,869)	(697,929)
Call - Teradyne, Inc.	82	2020/10/6	6,310	(1,187,378)	(344,071)
Call - Tetra Tech, Inc.	95	2020/10/6	5,330	(923,922)	(1,364,311)
Call - Texas Instruments, Inc.	147	2020/10/6	3,580	(595,735)	(477,685)
Call - Thermo Fisher Scientific, Inc.	431	2020/10/6	1,170	(1,033,451)	(1,666,876)
Call - Ubiquiti, Inc.	173	2020/10/6	3,010	(885,052)	(286,060)
Call - Union Pacific Corp.	199	2020/10/6	2,640	(756,486)	(557,053)
Call - UnitedHealth Group, Inc.	333	2020/10/6	1,510	(329,092)	(11,392)
Call - Verizon Communications, Inc.	63	2020/10/6	8,200	(165,775)	(11,344)
Call - Visa, Inc.	210	2020/10/6	2,410	(850,033)	(42,459)
Call - Wal-Mart Stores, Inc.	144	2020/10/6	3,520	(1,409,631)	(164,584)
Call - Waters Corp.	212	2020/10/6	2,340	(1,149,704)	(47,536)
Call - Xilinx, Inc.	103	2020/10/6	4,830	(1,310,240)	(1,366,643)
				¥ (81,421,740)	¥ (37,412,964)

B R L オーバーレイ & カバードコール・クラスの2020年9月30日現在の売建オプション残高 (純資産の-0.0%)

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	20	2020/10/6	114,800,000	¥ (53,131,124)	¥ (212,788)

U S D カバードコール・クラスの2020年9月30日現在の売建オプション残高 (純資産の-0.0%)

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	106	2020/10/13	8,080,000	¥ (5,609,205)	¥ (386,265)

B R L オーバーレイ & カバードコール・クラスの2020年9月30日現在の外国為替先渡取引 (純資産の-2.1%)

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	UBS AG	230,000,000	2020/10/6	U S D	43,299,823	¥ -	¥ (264,562,257)	¥ (264,562,257)
						¥ -	¥ (264,562,257)	¥ (264,562,257)

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（2020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（2021年10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

2021年4月20日～2021年10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

2021年10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9期 (決算日 2020年12月9日)

(作成対象期間 2019年12月10日～2020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

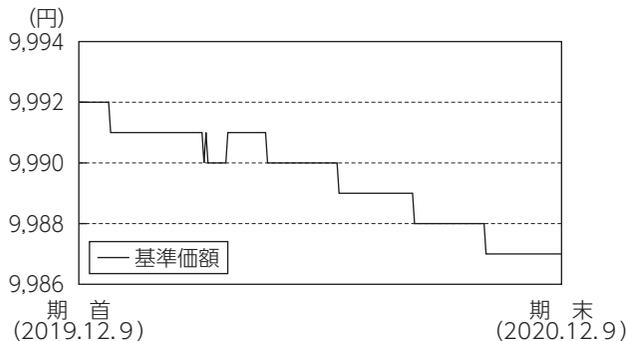
大和アセットマネジメント

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/>

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■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	
	円	%	%
(期首)2019年12月9日	9,992	-	-
12月末	9,992	0.0	-
2020年1月1日	9,991	△0.0	-
2月末	9,991	△0.0	-
3月末	9,990	△0.0	-
4月末	9,991	△0.0	-
5月末	9,990	△0.0	-
6月末	9,989	△0.0	-
7月末	9,989	△0.0	-
8月末	9,988	△0.0	-
9月末	9,988	△0.0	-
10月末	9,987	△0.1	-
11月末	9,987	△0.1	-
(期末)2020年12月9日	9,987	△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：9,992円 期末：9,987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 (その他)	0 (0)
合 計	0

(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

2020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	562,983	100.0
投資信託財産総額	562,983	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

2020年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	562,983,783円
コール・ローン等	562,983,783
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	562,983,783
元本	563,730,093
次期繰越損益金	△ 746,310
(D) 受益権総口数	563,730,093口
1万口当り基準価額(C / D)	9,987円

* 期首における元本額は7,329,994,437円、当作成期間中における追加設定元本額は128,103,486円、同解約元本額は6,894,367,830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36,730,213円、ダイワDB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DB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・イノベーター・ファンド10,000円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）4,995円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）4,995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、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ15,828,234円、ダイワ円債セレクト マネーコース490,006,140円、ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）2,996,106円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）1,235円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）1,598円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース（毎月分配型）1,544円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース（毎月分配型）1,984円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,987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746,310円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月10日 至2020年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△1,615,475円
受取利息	7,741
支払利息	△1,623,216
(B) その他費用	△ 23,537
(C) 当期損益金(A + B)	△1,639,012
(D) 前期繰越損益金	△5,937,566
(E) 解約差損益金	6,947,603
(F) 追加信託差損益金	△ 117,335
(G) 合計(C + D + E + F)	△ 746,310
次期繰越損益金(G)	△ 746,310

(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。