

# ダイワ・ニッポン応援ファンド Vol. 5 －ライジング・ジャパン－

## 運用報告書(全体版) 第17期

(決算日 2022年10月17日)

(作成対象期間 2022年4月19日～2022年10月17日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式等の中から、東京圏の経済活性化により恩恵を受けることが期待される銘柄に投資し、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/>

### ★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／国内／株式		
信託期間	2014年4月17日～2024年4月16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	ベビーファンド	ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の株式および不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券をいいます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	無制限	
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。		

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	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
13期末(2020年10月16日)	12,417	500	22.1	1,617.69	13.7	97.8	—	—	7,643
14期末(2021年4月16日)	12,855	1,400	14.8	1,960.87	21.2	96.3	—	—	7,133
15期末(2021年10月18日)	13,152	100	3.1	2,019.23	3.0	92.6	—	—	6,537
16期末(2022年4月18日)	10,838	30	△ 17.4	1,880.08	△ 6.9	98.3	—	—	5,106
17期末(2022年10月17日)	10,374	0	△ 4.3	1,879.56	△ 0.0	97.2	—	—	4,725

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 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。

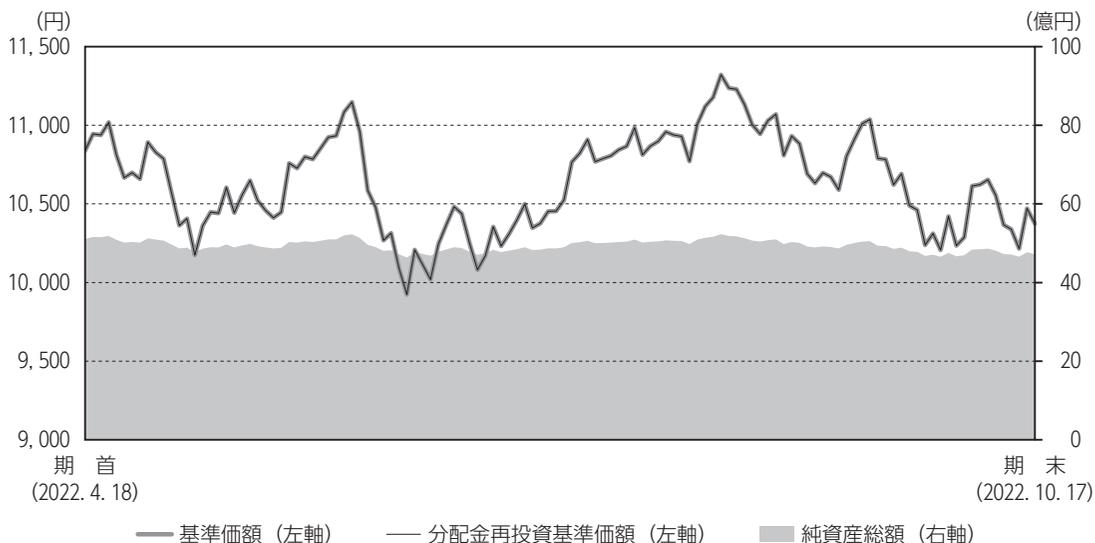
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

東証株価指数（T O P I X）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。



## 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：10,838円

期末：10,374円（分配金0円）

騰落率：△4.3%（分配金込み）

#### 基準価額の主な変動要因

国内株式市況は、物価動向や米国金融政策の動き、景気の先行き見通しなどを受けて一進一退の推移となりました。このような環境の中で、当ファンドの基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ベンチマークとの差異について」をご参照ください。

ダイワ・ニッポン応援ファンド Vol.5 -ライジング・ジャパン-

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2022年4月18日	10,838	—	1,880.08	—	98.3	—	—
4月末	10,892	0.5	1,899.62	1.0	98.0	—	—
5月末	10,726	△ 1.0	1,912.67	1.7	98.2	—	—
6月末	10,249	△ 5.4	1,870.82	△ 0.5	94.0	—	—
7月末	10,866	0.3	1,940.31	3.2	96.8	—	—
8月末	10,883	0.4	1,963.16	4.4	94.6	—	—
9月末	10,235	△ 5.6	1,835.94	△ 2.3	95.8	—	—
(期末)2022年10月17日	10,374	△ 4.3	1,879.56	△ 0.0	97.2	—	—

(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. 4. 19 ~ 2022. 10. 17)

### 国内株式市況

国内株式市況は、おおむね一進一退で推移しました。

国内株式市況は、当作成期首から2022年6月半ばにかけては、米国のインフレ率が予想以上に上昇しF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから、一時的な反発はあったものの下落しました。6月半ばにF R Bが利上げ幅拡大を決定した後は、悪材料出尽くし観測などから上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトするとの期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇が続きました。その後は、F R B議長が景気を犠牲にしていでもインフレを抑制する姿勢を強調したことや、予想以上のインフレ率の上昇を受けて欧米の金利が上昇したことなどが嫌気され、当作成期末にかけて株価は下落しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

「ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

### ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

ウクライナ情勢やサプライチェーン（供給網）の混乱などを背景に物価の上昇圧力が高まっていることから、欧米の中央銀行は金融政策の引き締め姿勢を強めています。これらを受けて、国内外の景気や企業業績の先行きに対する警戒感も高まっている状況です。他方で、国内株式市場の株価動向から、これらの不確実性を一定程度織り込んでいるものと考えます。当面の国内株式市場は、国内外のマクロ環境や企業業績などをにらみながら上下に振れやすい展開を想定しています。

銘柄選別においては、成長性および株価バリュエーションなどを分析し、アナリストとの議論を経た上で判断していきます。アナリストの専門的知見を活用し、業績動向や事業環境の動向、財務健全性などにも注意しつつ、東京圏の経済活性化により恩恵を受け、成長が期待できる企業に投資し、基準価額の上昇に努めてまいります。

## ポートフォリオについて

(2022. 4. 19 ~ 2022. 10. 17)

### ■当ファンド

「ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

### ■ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

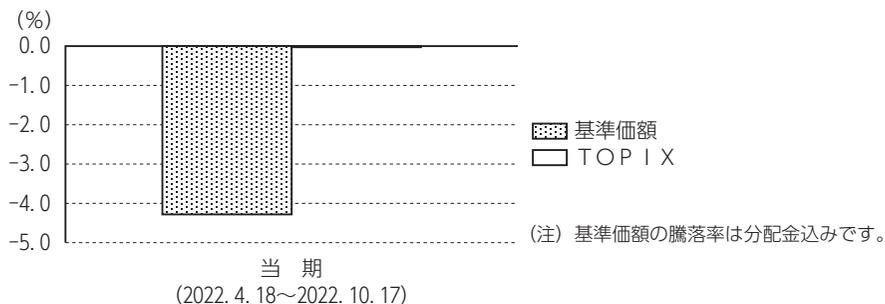
業種構成については、個別銘柄分析に基づいた銘柄選別による売買や株価変動により、食料品や小売業の比率が上昇した一方、情報・通信業や電気機器などの比率が低下しました。また個別銘柄では、マツキヨココカラ&カンパニーや三井不動産などの比率が上昇した一方、東京エレクトロンやデンソーなどの比率が低下しました。

## 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。

当ファンドは、参考指数としてTOPIXを用いています。当作成期における参考指数の騰落率は $\Delta 0.0\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 4.3\%$ となりました。基準価額へのプラスの寄与度が大きかった個別銘柄としては、大阪チタニウムテクノロジーズやBEENOSなどが挙げられます。一方で、東京エレクトロンやソニーグループなどがマイナス要因となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を見送らせていただきました。

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4月19日 ～2022年10月17日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,986

（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。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

### ■ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

欧米の中央銀行はインフレの抑制に向けて金融の引き締め姿勢を強めており、これらを受けて国内外の景気や企業業績の先行きに対する不透明感が高まっている状況にあります。また英国では、財政政策をめぐる債券市場に混乱が見られるなど、神経質な動きが散見されており、金融市場は変動性の高い状況が続く可能性があると考えています。

銘柄選別においては、成長性および株価バリュエーションなどを分析し、アナリストとの議論を経た上で判断していきます。アナリストの専門的知見を活用し、業績動向や事業環境の動向、財務健全性などにも注意しつつ、東京圏の経済活性化により恩恵を受け、成長が期待できる企業に投資し、基準価額の上昇に努めてまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2022. 4. 19~2022. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	85円	0.795%	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10,640円です。
(投 信 会 社)	(41)	(0.384)	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)	(41)	(0.384)	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)	(3)	(0.027)	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	30	0.285	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
(株 式)	(30)	(0.285)	
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	0.003	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)	(0.003)	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	115	1.083	

(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。

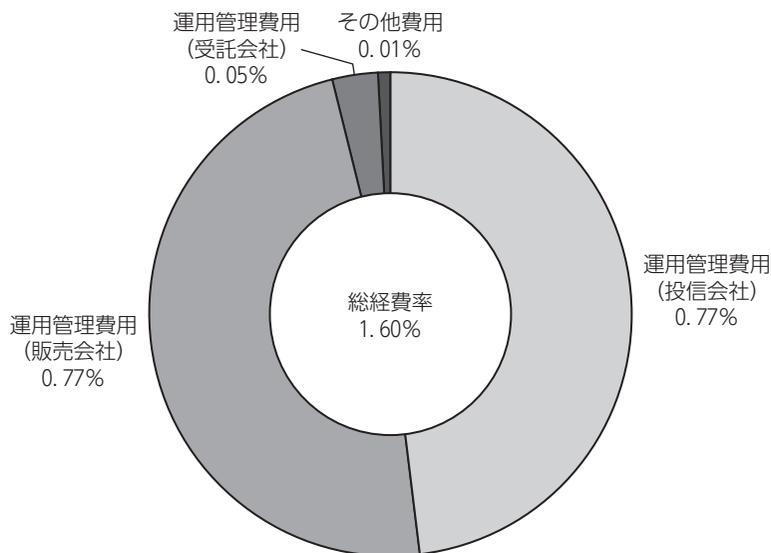
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.60%です。



(注1) 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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年4月19日から2022年10月17日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・ライジ ング・ジャパン・ マザーファンド	26,486	29,770	229,173	249,540

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年4月19日から2022年10月17日まで)

項 目	当 期
	ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,719,444千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,407,274千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.16

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2022年4月19日から2022年10月17日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区分	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C		
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	5,748	1,046	18.2	5,970	1,146	19.2
コール・ローン	21,401	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合87.9%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2022年4月19日から2022年10月17日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	14,094千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2,758千円
(B) / (A)	19.6%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている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。

※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あり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

■組入資産明細表

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・ライジ ング・ジャパン・ マザーファンド	4,662,788	4,460,101	4,721,017

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・ライジ ング・ジャパン・ マザーファンド	4,721,017	99.1
コール・ローン等、その他	45,209	0.9
投資信託財産総額	4,766,227	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10月17日現在

項 目	当 期 末
<b>(A)資産</b>	<b>4,766,227,725円</b>
コール・ローン等	43,369,868
ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド（評価額）	4,721,017,857
未収入金	1,840,000
<b>(B)負債</b>	<b>40,450,937</b>
未払解約金	1,021,600
未払信託報酬	39,293,927
その他未払費用	135,410
<b>(C)純資産総額（A－B）</b>	<b>4,725,776,788</b>
元本	4,555,431,930
次期繰越損益金	170,344,858
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>4,555,431,930口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	10,374円

\* 期首における元本額は4,711,426,593円、当作成期間中における追加設定元本額は40,896,224円、同解約元本額は196,890,887円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,374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	305,008円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	129,402,281
(d) 分配準備積立金	1,230,939,913
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,360,647,202
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,360,647,202
(h) 受益権総口数	4,555,431,930口

■損益の状況

当期 自 2022年4月19日 至 2022年10月17日

項 目	当 期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 3,558円</b>
受取利息	35
支払利息	△ 3,593
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 171,852,758</b>
売買益	5,114,644
売買損	△ 176,967,402
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 39,429,337</b>
<b>(D)当期損益金（A + B + C）</b>	<b>△ 211,285,653</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>185,439,630</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>196,190,881</b>
（配当等相当額）	（ 129,402,281）
（売買損益相当額）	（ 66,788,600）
<b>(G)合計（D + E + F）</b>	<b>170,344,858</b>
<b>次期繰越損益金（G）</b>	<b>170,344,858</b>
追加信託差損益金	196,190,881
（配当等相当額）	（ 129,402,281）
（売買損益相当額）	（ 66,788,600）
分配準備積立金	1,231,244,921
繰越損益金	△ 1,257,090,944

（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。

# ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

## 運用報告書 第8期 (決算日 2022年10月17日)

(作成対象期間 2022年4月19日～2022年10月17日)

ダイワ・ライジング・ジャパン・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	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	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の株式および不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券をいいます。）
株式組入制限	無制限

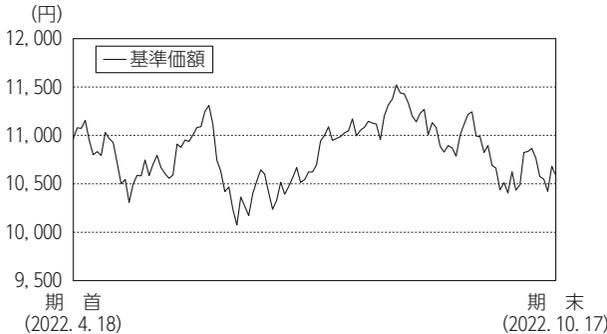
## 大和アセットマネジメント

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		T O P I X (参考指数)		株式 組入 比率	株式 先物 比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%	円	%	%	%	%
(期首) 2022年4月18日	10,970	—	1,880.08	—	98.1	—	—
4月末	11,030	△ 0.5	1,899.62	1.0	98.1	—	—
5月末	10,877	△ 0.8	1,912.67	1.7	98.3	—	—
6月末	10,408	△ 5.1	1,870.82	△ 0.5	94.1	—	—
7月末	11,049	0.7	1,940.31	3.2	96.9	—	—
8月末	11,082	1.0	1,963.16	4.4	94.7	—	—
9月末	10,435	△ 4.9	1,835.94	△ 2.3	95.9	—	—
(期末) 2022年10月17日	10,585	△ 3.5	1,879.56	△ 0.0	97.4	—	—

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) 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3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,970円 期末：10,585円 騰落率：△3.5%

【基準価額の主な変動要因】

国内株式市況は、物価動向や米国金融政策の動き、景気の先行き見通しなどを受けて一進一退の推移となりました。このような環境の中で、当ファンドの基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ベンチマークとの差異について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、おおむね一進一退で推移しました。

国内株式市況は、当作成期首から2022年6月半ばにかけては、米国のインフレ率が予想以上に上昇しF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを加速するとの感が強まったことなどから、一時的な反発はあったものの下落しました。6月半ばにF R Bが利上げ幅拡大を決定した後は、悪材料出尽くし観測などから上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトすると期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇が続きしました。その後は、F R B議長が景気を犠牲にすることでインフレを抑制する姿勢を強調したことや、予想以上のインフレ率の上昇を受けて欧米の金利が上昇したことなどが嫌気され、当作成期末にかけて株価は下落しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

ウクライナ情勢やサプライチェーン（供給網）の混乱などを背景に物価の上昇圧力が高まっていることから、欧米の中央銀行は金融政策の引き締め姿勢を強めています。これらを受けて、国内外の景気や企業業績の先行きに対する警戒感も高まっている状況です。他方で、国内株式市場の株価動向から、これらの不確実性を一定程度織り込んでいるものと考えます。当面の国内株式市場は、国内外のマクロ環境や企業業績などをにらみながら上下に振れやすい展開を想定しています。

銘柄選別においては、成長性および株価バリュエーションなどを分析し、アナリストとの議論を経た上で判断していきます。アナリストの専門的知見を活用し、業績動向や事業環境の動向、財務健全性などにも注意しつつ、東京圏の経済活性化により恩恵を受け、成長が期待できる企業に投資し、基準価額の上昇に努めてまいります。

◆ポートフォリオについて

業種構成については、個別銘柄分析に基づいた銘柄選別による売買や株価変動により、食料品や小売業の比率が上昇した一方、情報・通信業や電気機器などの比率が低下しました。また個別銘柄では、マツキョココカラ&カンパニーや三井不動産などの比率が上昇した一方、東京エレクトロンやデンソーなどの比率が低下しました。

◆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。

当ファンドは、参考指数としてT O P I Xを用いています。当作成期における参考指数の騰落率は△0.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.5%となりました。基準価額へのプラスの寄与度が大きかった個別銘柄としては、大阪チタニウムテクノロジーズやB E E N O Sなどが挙げられます。一方で、東京エレクトロンやソニーグループなどがマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

欧米の中央銀行はインフレの抑制に向けて金融の引き締め姿勢を強めており、これらを受けて国内外の景気や企業業績の先行きに対する不透明感が高まっている状況にあります。また英国では、財政政策をめぐる債券市場に混乱が見られるなど、神経質な動きが散見されており、金融市場は変動性の高い状況が続く可能性があると考えています。

銘柄選別においては、成長性および株価バリュエーションなどを分析し、アナリストとの議論を経た上で判断していきます。アナリストの専門的知見を活用し、業績動向や事業環境の動向、財務健全性などにも注意しつつ、東京圏の経済活性化により恩恵を受け、成長が期待できる企業に投資し、基準価額の上昇に努めてまいります。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	31円 ( 31)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	31

(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

株 式

(2022年4月19日から2022年10月17日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 2,045.6 ( 31.7)	千円 5,748,870 ( —)	千株 2,221.8	千円 5,970,573

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2022年4月19日から2022年10月17日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
三井不動産	千株 66	千円 194,476	円 2,946	大阪チタニウム	千株 104.3	千円 309,225	円 2,964
ペイカレントコンサルティング	4.8	192,678	40,141	ペイカレントコンサルティング	5.5	211,572	38,467
大阪チタニウム	104.4	186,216	1,783	デンソー	22.5	164,725	7,321
ウエストホールディングス	35.8	182,014	5,084	電通国際情報S	37.5	153,751	4,100
マツキヨココカラ & カンパニー	29.8	178,185	5,979	東京エレクトロン	3.6	147,130	40,869
味の素	37.4	145,526	3,891	三菱商事	34.7	146,546	4,223
東洋水産	24.7	143,819	5,822	I H I	37	132,877	3,591
日清食品HD	14.5	142,836	9,850	S M C	2.1	132,197	62,951
エービーシー・マート	20	136,456	6,822	バリューコマース	43.1	130,963	3,038
マネジメントソリューションズ	48	131,855	2,746	三菱重工業	27	130,041	4,816

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

国内株式

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円
<b>建設業 (1.4%)</b>					<b>電気機器 (13.4%)</b>					SHIFT	1.4	1.4	27,286	
ウエストホールディングス	11.3	17.7	72,835		日本電産	1.5	1.5	11,349		テクマトリックス	21.3	—	—	
<b>食料品 (8.4%)</b>					ルネサスエレクトロニクス	11.3	—	—		インターネットイニシアティブ	13.7	4.8	10,718	
味の素	—	37.4	150,273		ソニーグループ	21.8	33.5	323,141		ラクス	28.5	—	—	
東洋水産	—	24.7	148,447		TDK	3.3	—	—		ユーザベース	—	39.9	27,371	
日清食品HD	—	14.5	141,520		アルプスアルパイン	54	—	—		マネーフォワード	17.6	—	—	
<b>繊維製品 (5.1%)</b>					キーエンス	5.3	5.3	255,884		SUN ASTERISK	26.3	—	—	
東レ	94	55.4	40,148		オペテックスグループ	—	17	33,932		ボードルア	—	5.2	15,225	
セーレン	—	5.4	12,225		日本電子	6.3	—	—		サーバーワークス	—	19.4	42,136	
ゴールドウイン	—	14.1	108,429		芝浦電子	—	2	8,710		Sansan	22	—	—	
デサント	—	30.3	108,019		新光電気工業	12	2.5	8,137		メドレー	36	—	—	
<b>化学 (3.1%)</b>					太陽誘電	5.5	1.1	4,141		JMDC	—	2.8	13,160	
旭化成	127.6	28.1	26,976		村田製作所	5.4	0.8	5,581		サイバーセキュリティクラウド	37	—	—	
信越化学	9.2	9.2	135,424		東京エレクトロン	5	1.4	51,408		フューチャー	26.3	9.6	14,688	
<b>医薬品 (5.3%)</b>					<b>輸送用機器 (6.5%)</b>					S Bテクノロジ	15.7	—	—	
塩野義製薬	14	14	95,648		デンソー	26.3	3.8	26,733		電通国際情報S	18.5	—	—	
日本新薬	2.5	—	—		トヨタ自動車	138	156	312,000		ウェザーニューズ	—	1.5	10,560	
ロート製薬	—	16.6	76,526		<b>精密機器 (0.5%)</b>					IMAGICA GROUP	—	28.9	26,472	
第一三共	—	25	106,425		テルモ	8.7	0.1	423		日本電信電話	83.5	65.5	260,100	
<b>非鉄金属 (1.4%)</b>					タムロン	—	8.6	26,746		学研ホールディングス	—	4.5	4,221	
大紀アルミニウム	38.5	12.6	15,863		<b>その他製品 (3.9%)</b>					スクウェア・エニックス・HD	26.7	26.7	173,817	
住友鉱山	5	—	—		フルヤ金属	9.1	2.8	21,392		<b>卸売業 (1.3%)</b>				
大阪チタニウム	—	0.1	311		任天堂	3	30	183,150		ダイワボウHD	—	26	48,256	
昭和電線 HLDGS	1.6	—	—		<b>電気・ガス業 (0.3%)</b>					パイク王&カンパニー	—	22.2	22,089	
リョービ	—	43.9	56,235		イーレックス	29.6	5.9	15,469		BUYSELL TECH	6.3	—	—	
<b>金属製品 (0.4%)</b>					<b>陸運業 (2.8%)</b>					三井物産	28.7	—	—	
リンナイ	—	2.1	21,735		東急	9.6	—	—		三菱商事	34.7	—	—	
<b>機械 (6.2%)</b>					京浜急行	—	36.1	54,005		<b>小売業 (9.5%)</b>				
日本製鋼所	1	—	—		京成電鉄	4.5	—	—		エービーシー・マート	—	20	134,200	
ディスコ	2.5	1.6	50,080		東日本旅客鉄道	2.2	—	—		コメ兵 HLDGS	—	0.1	346	
SMC	0.9	—	—		東海旅客鉄道	1	—	—		Monotaro	11.7	—	—	
クボタ	5.5	—	—		鴻池運輸	—	59	90,447		マツキヨココカラ&カンパニー	—	29.8	182,674	
ダイキン工業	4.4	10	219,650		<b>空運業 (2.0%)</b>					ネクステージ	—	0.1	278	
日立造船	—	63.8	52,890		日本航空	—	38.1	104,432		ゴルフダイジェスト・オン	—	0.1	124	
三菱重工業	27	—	—		<b>情報・通信業 (12.0%)</b>					BEENOS	—	51.8	139,549	
IHI	37	—	—		日鉄ソリューションズ	10	—	—		日本瓦斯	0.1	—	—	

# ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円
ファーストリテイリング	1	0.5	42,100		<b>サービス業 (10.4%)</b>					ライトアップ	11.8	—	—	
<b>銀行業 (1.0%)</b>					UTグループ	—	6.5	14,098		マネジメントソリューションズ	—	37.4	111,938	
三菱UFJフィナンシャルG	148.8	76.8	51,863		ケアネット	—	8.6	10,810		ダイレクトマーケティングミクス	19.5	—	—	
三井住友フィナンシャルG	2.6	—	—		ディップ	12.6	2.9	11,063		アイドマ・ホールディングス	19.3	—	—	
千葉銀行	33.5	—	—		新日本科学	—	15.4	41,888		リログループ	—	12.5	27,262	
<b>保険業 (0.4%)</b>					パリュウコマース	27.6	—	—		GREEN EARTH INST	—	53.9	35,412	
ライフネット生命保険	—	22.5	23,017		オリエンタルランド	0.1	6.3	125,874			千株	千株	千円	
SOMPOホールディングス	4.7	—	—		リゾートトラスト	30.1	—	—		合計	株数、金額	1,732.7	1,588.2	5,234,126
MS & AD	4.4	—	—		エン・ジャパン	13.6	—	—		銘柄数<比率>	80銘柄	75銘柄	<97.4%>	
第一生命HLDGS	11.7	—	—		ジャパンマテリアル	27.1	34.9	64,355						
<b>その他金融業 (0.5%)</b>					チャームケアコーポレーション	47.1	—	—						
日本取引所グループ	14.6	14.6	28,703		リクルートホールディングス	44.2	20.9	88,971						
<b>不動産業 (4.1%)</b>					ペルシステム24HLDGS	20.3	—	—						
三井不動産	25.9	74.3	214,169		アトラエ	—	7.9	12,576						
平和不動産	0.1	—	—		ペイカレントコンサルティング	0.7	—	—						

(注1) 銘柄欄の( )内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。  
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	5,234,126	95.4
コール・ローン等、その他	254,323	4.6
投資信託財産総額	5,488,449	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10月17日現在

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>5,488,449,881円</b>
コール・ローン等	112,991,028
株式(評価額)	5,234,126,070
未収入金	107,224,258
未収配当金	34,108,525
<b>(B) 負債</b>	<b>111,917,141</b>
未払金	109,949,141
未払解約金	1,968,000
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>5,376,532,740</b>
元本	5,079,560,602
次期繰越損益金	296,972,138
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>5,079,560,602口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	10,585円

\* 期首における元本額は5,294,561,473円、当作成期間中における追加設定元本額は27,038,275円、同解約元本額は242,039,146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：  
 きらぼし・東京圏応援株式ファンド 619,458,705円  
 ダイワ・ニッポン応援ファンドVol.5-ライジング・ジャパン 4,460,101,897円  
 \* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,585円です。

■損益の状況

当期 自 2022年4月19日 至 2022年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	45,969,975円
受取配当金	44,617,325
受取利息	31
その他収益金	1,374,375
支払利息	△ 21,756
(B) 有価証券売買損益	△ 244,388,773
売買益	535,601,034
売買損	△ 779,989,807
(C) 当期損益金 (A + B)	△ 198,418,798
(D) 前期繰越損益金	513,702,065
(E) 解約差損益金	△ 21,653,854
(F) 追加信託差損益金	3,342,725
(G) 合計 (C + D + E + F)	296,972,138
次期繰越損益金 (G)	296,972,138

(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。

東証株価指数 (TOPIX) の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」といいます。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。