

ダイワ米国株主還元株ファンド

運用報告書(全体版) 第14期

(決算日 2022年10月18日)

(作成対象期間 2022年4月19日～2022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	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）USTータル・イールド・ファンド（UST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

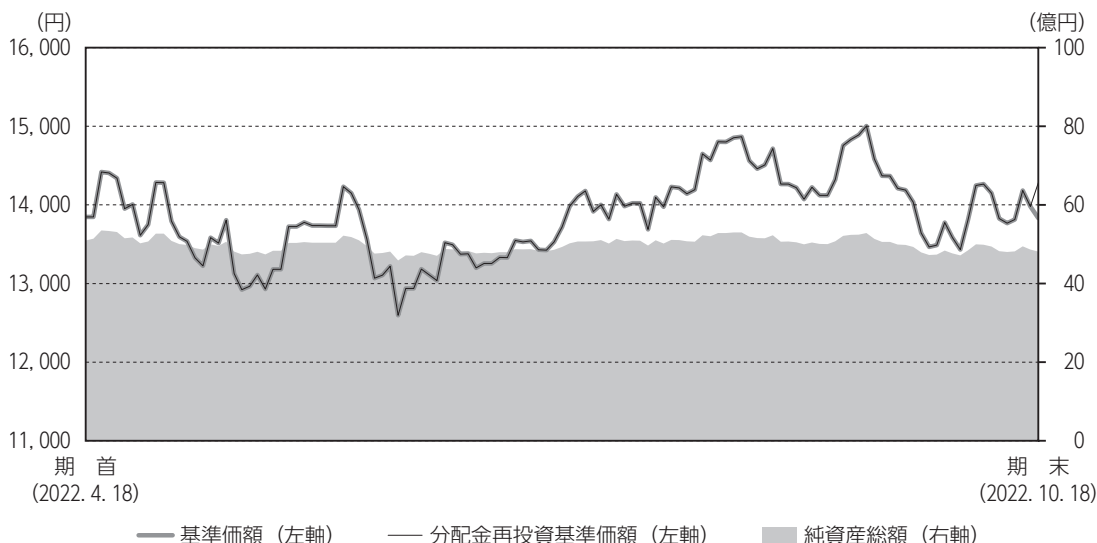
決 算 期	基 準 価 額			M S C I 米国指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
10期末 (2020年10月19日)	11, 431	350	15. 7	16, 946	21. 5	—	98. 6	6, 536
11期末 (2021年 4月19日)	13, 132	1, 400	27. 1	21, 188	25. 0	—	98. 0	5, 916
12期末 (2021年10月18日)	13, 318	1, 000	9. 0	23, 991	13. 2	—	98. 5	5, 296
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

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) M S C I 米国指数 (配当込み、円換算) は、M S C I Inc. (「M S C I」) の承諾を得て、M S C I 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。M S C I 米国指数 (配当込み、米ドルベース) は、M S C I 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M S C I に帰属します。またM S C I 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、M S C I によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、M S C I 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：13,848円

期 末：13,831円（分配金450円）

騰落率：3.1%（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、米国株式市況の下落がマイナス要因となったものの、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
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2022年 4 月18日	円	%		%	%	%
	13, 848	—	25, 867	—	—	99. 0
4 月末	13, 750	△ 0. 7	25, 007	△ 3. 3	—	98. 9
5 月末	13, 724	△ 0. 9	24, 686	△ 4. 6	—	99. 6
6 月末	13, 378	△ 3. 4	24, 198	△ 6. 5	—	98. 5
7 月末	13, 982	1. 0	25, 447	△ 1. 6	—	98. 9
8 月末	14, 218	2. 7	25, 736	△ 0. 5	—	98. 4
9 月末	13, 586	△ 1. 9	24, 567	△ 5. 0	—	98. 5
(期末) 2022年10月18日	14, 281	3. 1	25, 519	△ 1. 3	—	98. 8

(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. 18)

■米国株式市況

米国株式市場は下落しました。

米国株式市況は、2022年4月から6月半ばにかけて、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを加速すると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で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。

■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。

米ドル対円為替相場は、米国金利が上昇したことなどから、当作成期首より上昇しました。その後は、米国景気への懸念などからリスク回避姿勢が強まり米ドルは下落しましたが、2022年6月には米国で大幅な利上げが行われたことなどから、再度上昇しました。7月後半には、米国金利が低下に転じると日米金利差の縮小が意識され、円が買い戻されたことで円高米ドル安となりました。8月は、米国金利の上昇により日米金利差が再度拡大したことなどから、円安米ドル高が進行しました。9月に入ると、F R Bが大幅な金融引き締めを決定したのに対し、日銀は金融緩和政策の維持を決定したことで急速に円安米ドル高が進行しました。これを受け、日本政府・日銀は円買い介入を実施したものの影響は限定的なものにとどまり、円安米ドル高基調のまま当作成期末を迎えました。

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、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. 4. 19 ~ 2022. 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）

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

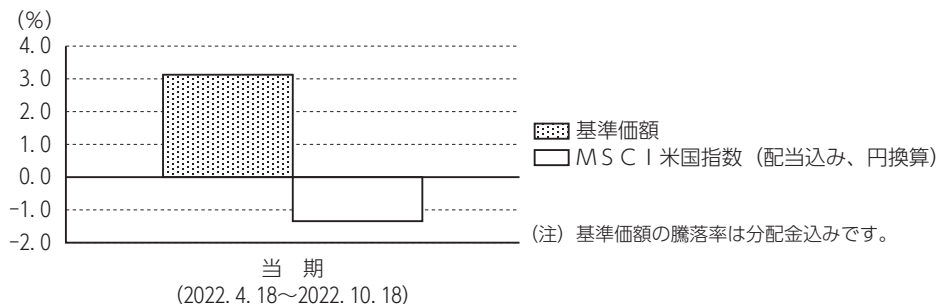
当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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、当作成期間中の金利急上昇で大きな売り圧力に押されたグロース株の一角であるコミュニケーション・サービスや、金利逆相関の不動産のアンダーウエート、株主還元への積極姿勢もあって下げ渋った資本財・サービスのオーバーウエート等はプラスとなりました。一方、利上げのミクロ・マクロ経済への影響が懸念される中、業績面での圧倒的な優位性から主要業種で唯一プラス・リターンとなったエネルギーや、医薬品を中心に下げ渋ったヘルスケアのアンダーウエート、グロース株の一角として自動車関連主体に売り込まれた一般消費財・サービスのオーバーウエートによるマイナスが、上記プラスを一部相殺したものの、全体ではプラス要因となりました。

個別銘柄では、金利上昇でバリュエーション調整を余儀なくされたグロース株（半導体のエヌビディア、電気自動車のテスラ、ネット通販世界最大手のアマゾン・ドットコムなど）の非保有が奏功した一般消費財・サービスと情報技術のほか、予想を上回る決算が好感され、下落相場に逆行高したエンジンメーカー大手のカミンズや、エンジニアリングのエムコア・グループの保有が寄与した資本財・サービスなどが大幅なプラス要因となり、当作成期に参考指数を大きく上回る主因となりました。



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4月19日 ～2022年10月18日	
当期分配金（税込み）	（円）	450
対基準価額比率	（％）	3.15
当期の収益	（円）	425
当期の収益以外	（円）	24
翌期繰越分配対象額	（円）	3,830

- （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	✓ 294.45円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓ 131.49
(c) 収益調整金	1,124.77
(d) 分配準備積立金	✓ 2,730.16
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	4,280.88
(f) 分配金	450.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	3,830.88

- （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、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. 4. 19～2022. 10. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	94円	0.676%	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13,856円です。
(投 信 会 社)	(31)	(0.221)	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)	(61)	(0.441)	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	94	0.680	

(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。

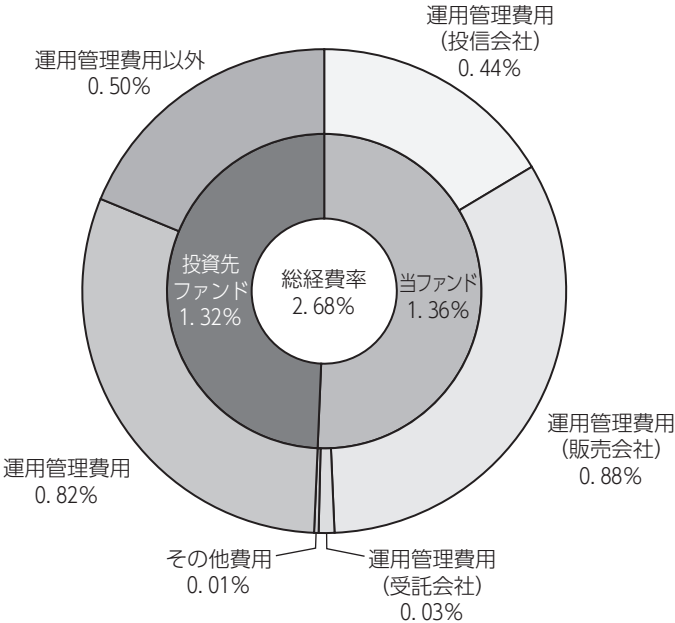
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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2.68%です。



総経費率（①＋②＋③）	2.68%
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	0.82%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.50%

- (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 4 月19日から2022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)	1, 633. 82403	228, 976	4, 125. 44264	579, 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 4 月19日から2022年10月18日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 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)	699. 4934	99, 000	141	UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	4, 125. 44264	579, 000	140

(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	33, 290. 43315	4, 754, 206	98. 8

(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

2022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	4, 754, 206	94. 8
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	260, 363	5. 2
投資信託財産総額	5, 014, 634	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18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5, 014, 634, 657円
コール・ローン等	260, 363, 814
投資信託受益証券（評価額）	4, 754, 206, 758
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	64, 085
(B) 負債	201, 486, 320
未払収益分配金	156, 599, 995
未払解約金	10, 938, 291
未払信託報酬	33, 741, 547
その他未払費用	206, 487
(C) 純資産総額（A－B）	4, 813, 148, 337
元本	3, 479, 999, 908
次期繰越損益金	1, 333, 148, 429
(D) 受益権総口数	3, 479, 999, 908口
1万口当り基準価額（C／D）	13, 831円

* 期首における元本額は3, 680, 628, 767円、当作成期間中における追加設定元本額は126, 603, 520円、同解約元本額は327, 232, 379円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は13, 831円です。

■損益の状況

当期 自 2022年 4月19日 至 2022年10月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	125, 937, 182円
受取配当金	125, 951, 975
受取利息	381
支払利息	△ 15, 174
(B) 有価証券売買損益	56, 238, 569
売買益	70, 431, 616
売買損	△ 14, 193, 047
(C) 信託報酬等	△ 33, 948, 034
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	148, 227, 717
(E) 前期繰越損益金	950, 097, 630
(F) 追加信託差損益金	391, 423, 077
(配当等相当額)	(347, 144, 062)
(売買損益相当額)	(44, 279, 015)
(G) 合計（D＋E＋F）	1, 489, 748, 424
(H) 収益分配金	△ 156, 599, 995
次期繰越損益金（G＋H）	1, 333, 148, 429
追加信託差損益金	391, 423, 077
(配当等相当額)	(347, 144, 062)
(売買損益相当額)	(44, 279, 015)
分配準備積立金	941, 725, 352

(注 1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
(注 2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、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	102, 468, 904円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	45, 758, 813
(c) 収益調整金	391, 423, 077
(d) 分配準備積立金	950, 097, 630
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1, 489, 748, 424
(f) 分配金	156, 599, 995
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	1, 333, 148, 429
(h) 受益権総口数	3, 479, 999, 908口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	450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「U B S （ C A Y ） U S トータル・イールド・ファンド（U S トータル・イールド・クラス）」に投資しております。以下の内容は、直近で入手可能な Financial Statements から抜粋し、大和アセットマネジメントが編集および一部翻訳したものです。

(円建て)

貸借対照表
2021年 9 月30日

資産		
流動資産		
金融資産（損益通算後の評価額）	¥	9, 773, 094, 212
現金および現金同等物		173, 398, 173
担保としてブローカーに預託した現金		156, 794, 115
未収：		
売却済み有価証券		215, 752, 200
配当		4, 592, 593
その他資産		915, 262
資産合計		10, 324, 546, 555
負債		
流動負債		
金融負債（損益通算後の評価額）		166, 247, 939
保管会社に対する支払		23, 232, 698
未払：		
運用会社報酬		15, 603, 858
専門家報酬		6, 142, 808
受託会社報酬		2, 829, 085
管理会社報酬		2, 029, 768
保管会社報酬		1, 282, 691
名義書換代理人報酬		42, 043
購入済証券		6, 903
その他負債		8, 990
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）		217, 426, 783
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	¥	10, 107, 119, 772

損益計算書

2021年9月30日に終了した年度

収益

受取利息	¥	69,827
配当収益		204,763,258
その他収益		2,823
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の実現損益		3,686,975,728
デリバティブ金融資産および負債の実現損益		(66,746,117)
外国為替取引の実現損益		19,737,964
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の評価損益		259,716,661
デリバティブ金融資産および負債の評価損益		53,090,560
外国為替取引の評価益の変動		1,707,560
収益合計		4,159,318,264

費用

運用会社報酬		71,812,428
管理会社報酬		19,966,194
専門家報酬		6,193,926
保管会社報酬		4,053,896
取引費用		1,559,391
名義書換代理人報酬		1,431,899
受託会社報酬		1,181,637
登録料		458,623
その他費用		1,638,813
費用合計		108,296,807

営業損益

4,051,021,457

金融費用

償却可能受益証券の保有者への分配金	(2,182,065,802)
-------------------	-----------------

分配後および税引前損益

1,868,955,655

源泉徴収税	(58,634,610)
-------	--------------

運用の結果生じた償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産の増減額

¥ 1,810,321,045

投資明細表
2021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 (96.7%)		
	バミューダ (1.0%)		
	保険 (1.0%)		
6,332	RenaissanceRe Holdings Ltd.	1.0	98,485,108
	バミューダ合計		98,485,108
	アイルランド (1.0%)		
	コンピューター (1.0%)		
2,725	Accenture Plc. Class A	1.0	97,269,075
	アイルランド合計		97,269,075
	オランダ (0.9%)		
	半導体 (0.9%)		
4,356	NXP Semiconductors NV	0.9	95,196,873
	オランダ合計		95,196,873
	スイス (1.0%)		
	保険 (1.0%)		
5,111	Chubb Ltd.	1.0	98,928,673
	スイス合計		98,928,673
	英国 (1.0%)		
	総合金融サービス (1.0%)		
21,500	Janus Henderson Group PLC	1.0	99,144,985
	英国合計		99,144,985
	米国 (91.8%)		
	航空宇宙・防衛 (2.0%)		
4,552	General Dynamics Corp.	1.0	99,561,557
4,062	L3Harris Technologies, Inc.	1.0	99,816,653
			199,378,210
	自動車 (0.9%)		
3,867	Cummins, Inc.	0.9	96,888,774
	自動車部品・機器 (1.0%)		
27,050	Gentex Corp.	1.0	99,537,060
	銀行 (2.0%)		
16,947	Bank of New York Mellon Corp.	1.0	98,022,260
10,333	State Street Corp.	1.0	97,674,065
			195,696,325
	バイオテクノロジー (3.0%)		
4,224	Amgen, Inc.	1.0	100,220,412
3,108	Biogen, Inc.	1.0	98,133,884
20,784	Corteva, Inc.	1.0	97,582,458
			295,936,754
	建築材料 (0.9%)		
12,411	Johnson Controls International PLC	0.9	94,274,277

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
化学 (2.0%)			
5,845	Celanese Corp. Class A	1.0	98,240,759
3,145	Sherwin-Williams Co.	1.0	98,158,199
			196,398,958
商業サービス (5.9%)			
4,544	Automatic Data Processing, Inc.	1.0	101,358,798
11,494	Booz Allen Hamilton Holding Corp. Class A	1.0	101,761,854
6,734	FTI Consulting, Inc.	1.0	101,206,311
10,140	Grand Canyon Education, Inc.	1.0	99,515,347
7,826	ManpowerGroup, Inc.	0.9	94,548,573
8,764	Robert Half International, Inc.	1.0	98,107,017
			596,497,900
コンピューター (3.9%)			
11,800	Amdocs, Ltd.	1.0	99,678,649
6,341	Apple, Inc.	1.0	100,110,834
11,761	Cognizant Technology Solutions Corp. Class A	1.0	97,380,852
9,587	NetApp, Inc.	0.9	96,013,535
			393,183,870
化粧品・パーソナルケア (1.9%)			
11,489	Colgate-Palmolive Co.	0.9	96,884,880
6,377	Procter & Gamble Co.	1.0	99,469,624
			196,354,504
流通・卸売 (1.9%)			
16,850	Fastenal Co.	0.9	97,028,798
2,244	VWV Grainger, Inc.	1.0	98,412,121
			195,440,919
総合金融サービス (6.0%)			
3,315	Ameriprise Financial, Inc.	1.0	97,690,360
6,535	Evercore, Inc. Class A	1.0	97,464,493
2,555	Mastercard, Inc. Class A	1.0	99,114,570
14,942	SEI Investments Co.	1.0	98,862,210
4,441	T Rowe Price Group, Inc.	1.0	97,465,748
3,977	Visa, Inc. Class A	1.0	98,841,697
			589,439,078
電子部品 (1.0%)			
5,107	Acuity Brands, Inc.	1.0	98,788,569
電機 (1.8%)			
5,257	Agilent Technologies, Inc.	0.9	92,399,184
4,057	Honeywell International Inc.	0.9	96,090,615
			188,489,799
エンジニアリング・建設 (0.9%)			
13,816	AECOM	0.9	97,346,999
食品 (1.0%)			
7,400	J. M. Smucker Co.	1.0	99,103,368

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
	ヘルスケア製品 (1.0%)		
11,109	Baxter International, Inc.	1.0	99,691,911
	ヘルスケアサービス (3.7%)		
2,328	Anthem, Inc.	0.9	96,833,531
1,910	Chemed Corp.	1.0	99,120,907
2,234	Humana, Inc.	0.9	96,998,963
5,751	Quest Diagnostics, Inc.	0.9	93,240,750
			386,194,151
	住宅建設 (2.9%)		
10,399	DR Horton, Inc.	1.0	97,427,738
182	NVR, Inc.	1.0	97,351,703
18,997	PulteGroup, Inc.	0.9	97,331,584
			292,111,025
	家庭用品 (1.0%)		
3,975	Helen of Troy Ltd.	1.0	99,647,965
	保険 (5.0%)		
16,961	Aflac, Inc.	1.0	98,652,039
3,100	Aon PLC Class A	1.0	98,842,840
5,548	Assurant, Inc.	1.0	97,650,104
3,255	Berkshire Hathaway, Inc. Class B	1.0	99,125,426
14,302	MetLife, Inc.	1.0	98,505,377
			492,775,786
	インターネット (3.8%)		
330	Alphabet, Inc. Class A	1.0	98,438,336
4,706	CDW Corp.	0.9	95,573,595
4,393	F5 Networks, Inc.	1.0	97,431,811
2,460	Facebook, Inc. Class A	0.9	93,153,899
			384,597,641
	鉄鋼 (0.9%)		
8,635	Nucor Corp.	0.9	94,890,201
	メディア (1.0%)		
1,210	Charter Communications, Inc. Class A	1.0	98,224,782
	鉱業 (0.9%)		
15,817	Newmont Corp.	0.9	95,827,649
	その他製造 (1.9%)		
13,289	A. O. Smith Corp.	0.9	90,549,719
4,401	Carlisle Cos, Inc.	1.0	97,614,153
			188,163,872
	石油・ガス (1.0%)		
8,685	Chevron Corp.	1.0	98,307,978
	医薬品 (2.9%)		
4,408	Cigna Corp.	1.0	98,443,210
5,375	Johnson & Johnson	0.9	96,854,072

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
4,424	McKesson Corp.	1.0	98,415,521
	小売 (13.5%)		293,712,803
4,186	Advance Auto Parts, Inc.	1.0	97,562,689
8,088	Best Buy Co., Inc.	0.9	95,394,668
1,938	Costco Wholesale Corp.	0.9	97,164,005
4,166	Dollar General Corp.	1.0	98,607,221
10,328	Dollar Tree, Inc.	1.1	110,302,615
2,688	Home Depot, Inc.	1.0	98,449,637
4,367	Lowe's Cos, Inc.	1.0	98,843,133
19,566	Nu Skin Enterprises, Inc. Class A	0.9	88,349,102
1,464	O'Reilly Automotive, Inc.	1.0	99,814,083
3,810	Target Corp.	0.9	97,250,297
4,334	Tractor Supply Co.	1.0	97,975,316
2,373	Ulta Beauty, Inc.	0.9	95,559,875
6,380	Wal-Mart Stores, Inc.	1.0	99,217,442
4,688	Williams-Sonoma, Inc.	0.9	92,754,867
			1,367,244,950
	半導体 (6.4%)		
6,527	Applied Materials, Inc.	0.9	93,747,624
16,609	Intel Corp.	1.0	98,735,786
2,583	KLA-Tencor Corp.	0.9	96,405,187
1,530	Lam Research Corp.	0.9	97,159,452
5,196	Qorvo, Inc.	0.9	96,927,347
6,287	Qualcomm, Inc.	0.9	90,475,860
5,254	Skyworks Solutions, Inc.	0.9	96,596,514
			670,047,770
	ソフトウェア (5.9%)		
12,514	Cerner Corp.	1.0	98,463,516
6,559	Electronic Arts, Inc.	1.0	104,101,454
5,368	Jack Henry & Associates, Inc.	1.0	98,261,209
3,162	Microsoft Corp.	1.0	99,461,416
9,914	Oracle Corp.	0.9	96,379,244
8,156	Paychex, Inc.	1.0	102,330,139
			598,996,978
	通信 (1.0%)		
16,154	Cisco Systems, Inc.	1.0	98,103,680
	運輸 (2.9%)		
3,640	Norfolk Southern Corp.	0.9	97,167,318
3,057	Old Dominion Freight Line, Inc.	1.0	97,543,422
4,484	Union Pacific Corp.	1.0	98,064,252
			292,774,992
	米国合計		9,284,069,498
	普通株合計 (簿価 ¥8,526,704,778)		¥ 9,773,094,212

ＵＳ トータル・イールド・ファンドの2021年9月30日現在の売建オプション残高（株式の－0.3％）

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - A. O. Smith Corp.	¥ 72	10/18/2021	4, 840	¥ (253, 860)	¥ (6, 592)
Call - Accenture Plc.	357	10/18/2021	990	(266, 328)	(21, 348)
Call - Acuity Brands, Inc.	174	10/18/2021	1, 950	(1, 139, 366)	(1, 765, 219)
Call - AECOM	66	10/18/2021	5, 320	(606, 319)	(322, 275)
Call - Agilent Technologies, Inc.	181	10/18/2021	1, 910	(251, 592)	(29, 959)
Call - Ameriprise Financial, Inc.	275	10/18/2021	1, 330	(481, 837)	(381, 055)
Call - Anthem, Inc.	392	10/18/2021	900	(181, 538)	(314, 671)
Call - Aon PLC	306	10/18/2021	1, 160	(211, 836)	(115, 057)
Call - Apple, Inc.	153	10/18/2021	2, 310	(559, 065)	(83, 213)
Call - Applied Materials, Inc.	150	10/18/2021	2, 380	(398, 663)	(38, 895)
Call - Baxter International, Inc.	84	10/18/2021	4, 200	(375, 689)	(188, 219)
Call - Biogen, Inc.	311	10/18/2021	1, 130	(825, 428)	(262, 115)
Call - Booz Allen Hamilton Holding Corp.	82	10/18/2021	4, 190	(323, 333)	(252, 742)
Call - Carlisle Cos, Inc.	201	10/18/2021	1, 670	(418, 952)	(430, 442)
Call - Celanese Corp.	160	10/18/2021	2, 160	(187, 953)	(205, 501)
Call - Charter Communications, Inc.	785	10/18/2021	440	(443, 870)	(119, 876)
Call - Chemed Corp.	500	10/18/2021	690	(207, 399)	(81, 946)
Call - Chevron Corp.	101	10/18/2021	3, 360	(350, 919)	(1, 201, 231)
Call - Cigna Corp.	214	10/18/2021	1, 600	(384, 757)	(173, 653)
Call - Cisco Systems, Inc.	60	10/18/2021	6, 100	(213, 254)	(28, 710)
Call - Corteva, Inc.	45	10/18/2021	7, 580	(172, 479)	(93, 172)
Call - Cummins, Inc.	243	10/18/2021	1, 410	(250, 903)	(68, 866)
Call - Electronic Arts, Inc.	153	10/18/2021	2, 390	(363, 332)	(230, 885)
Call - Evercore, Inc.	148	10/18/2021	2, 540	(280, 430)	(81, 056)
Call - F5 Networks, Inc.	216	10/18/2021	1, 600	(243, 428)	(89, 868)
Call - Facebook, Inc.	403	10/18/2021	890	(187, 417)	(8, 080)
Call - Fastenal Co.	55	10/18/2021	6, 140	(521, 414)	(333, 229)
Call - FTI Consulting, Inc.	138	10/18/2021	2, 510	(460, 212)	(590, 319)
Call - General Dynamics Corp.	201	10/18/2021	1, 730	(318, 583)	(257, 574)
Call - Gentex Corp.	34	10/18/2021	10, 890	(136, 736)	(347, 038)
Call - Humana, Inc.	413	10/18/2021	810	(478, 401)	(136, 000)
Call - Jack Henry & Associates, Inc.	175	10/18/2021	1, 950	(200, 109)	(122, 882)
Call - Janus Henderson Group PLC	45	10/18/2021	8, 240	(599, 267)	(48, 625)
Call - Johnson Controls International PLC	76	10/18/2021	4, 520	(442, 330)	(22, 925)
Call - KLA-Tencor Corp.	381	10/18/2021	960	(341, 413)	(57, 732)
Call - L3Harris Technologies, Inc.	234	10/18/2021	1, 480	(364, 697)	(95, 085)
Call - Lam Research Corp.	644	10/18/2021	560	(474, 377)	(111, 186)
Call - ManpowerGroup, Inc.	126	10/18/2021	2, 850	(220, 366)	(17, 842)
Call - Mastercard, Inc.	356	10/18/2021	970	(507, 599)	(429, 132)
Call - McKesson Corp.	214	10/18/2021	1, 630	(240, 646)	(90, 148)
Call - Microsoft Corp.	315	10/18/2021	1, 180	(170, 690)	(26, 845)
Call - Norfolk Southern Corp.	252	10/18/2021	1, 320	(403, 942)	(170, 401)
Call - Nucor Corp.	113	10/18/2021	3, 150	(807, 060)	(202, 287)
Call - NXP Semiconductors NV	222	10/18/2021	1, 600	(541, 738)	(71, 205)
Call - Old Dominion Freight Line, Inc.	297	10/18/2021	1, 160	(485, 187)	(272, 127)
Call - Oracle Corp.	89	10/18/2021	3, 770	(467, 865)	(516, 272)
Call - O'Reilly Automotive, Inc.	609	10/18/2021	560	(319, 214)	(985, 560)
Call - Paychex, Inc.	115	10/18/2021	2, 970	(210, 722)	(394, 529)
Call - PulteGroup, Inc.	50	10/18/2021	7, 090	(409, 581)	(145, 792)
Call - Qorvo, Inc.	195	10/18/2021	1, 890	(301, 974)	(23, 324)

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 - RenaissanceRe Holdings Ltd.	155	10/18/2021	2, 310	(284, 650)	(80, 282)
Call - Robert Half International, Inc.	109	10/18/2021	3, 310	(155, 172)	(32, 394)
Call - SEI Investments Co.	62	10/18/2021	5, 720	(216, 968)	(194, 850)
Call - Sherwin-Williams Co.	308	10/18/2021	1, 140	(347, 460)	(58, 836)
Call - Skyworks Solutions, Inc.	187	10/18/2021	1, 910	(425, 332)	(28, 322)
Call - State Street Corp.	90	10/18/2021	3, 920	(499, 978)	(243, 178)
Call - Tractor Supply Co.	211	10/18/2021	1, 650	(516, 853)	(352, 486)
Call - Union Pacific Corp.	210	10/18/2021	1, 630	(464, 900)	(105, 682)
Call - Visa, Inc.	234	10/18/2021	1, 510	(217, 896)	(164, 656)
Call - Williams-Sonoma, Inc.	191	10/18/2021	1, 890	(536, 175)	(253, 585)
Call - WW Grainger, Inc.	422	10/18/2021	810	(415, 042)	(142, 631)
				¥ (23, 084, 496)	¥ (13, 719, 607)

B R L オーバーレイ & カバードコール・クラスの2021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 Brazilian Real versus Japanese Yen	21	10/18/2021	84, 200, 000	¥ (30, 460, 542)	¥ (7, 936, 173)

B R L オーバーレイ & カバードコール・クラスの2021年9月30日現在の外国為替先渡取引（純資産の－1.3％）

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	168, 000, 000	10/25/2021	USD	31, 928, 237	¥ -	¥ (133, 887, 453)	¥ (133, 887, 453)
						¥ -	¥ (133, 887, 453)	¥ (133, 887, 453)

U S D カバードコール・クラスの2021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	110	10/18/2021	5, 400, 000	¥ (3, 381, 256)	¥ (10, 704, 706)

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

＜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（2021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（2022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

2022年4月19日～2022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

2022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10期（決算日 2021年12月9日）

（作成対象期間 2020年12月10日～2021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。

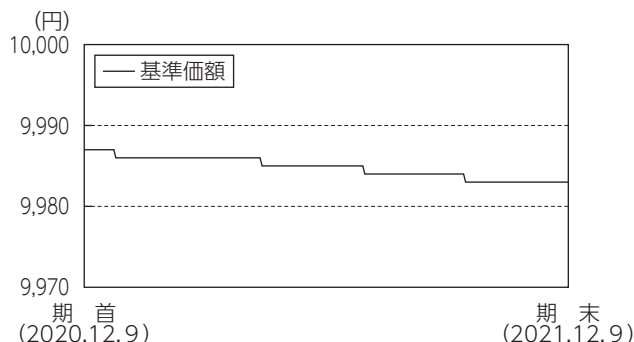
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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	騰 落 率	
		公 社 債 組 入 比 率	比 率
(期首)2020年12月9日	円 9,987	% -	% -
12月末	9,987	0.0	-
2021年1月末	9,986	△0.0	-
2月末	9,986	△0.0	-
3月末	9,986	△0.0	-
4月末	9,985	△0.0	-
5月末	9,985	△0.0	-
6月末	9,985	△0.0	-
7月末	9,984	△0.0	-
8月末	9,984	△0.0	-
9月末	9,983	△0.0	-
10月末	9,983	△0.0	-
11月末	9,983	△0.0	-
(期末)2021年12月9日	9,983	△0.0	-

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率是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：9,987円 期末：9,983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 (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

2021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	602,175	100.0
投資信託財産総額	602,175	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	602,175,326円
コール・ローン等	602,175,326
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	602,175,326
元本	603,229,011
次期繰越損益金	△ 1,053,685
(D) 受益権総口数	603,229,011口
1万口当り基準価額(C／D)	9,983円

* 期首における元本額は563,730,093円、当作成期間中における追加設定元本額は181,060,125円、同解約元本額は141,561,207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	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
世界M&A戦略株ファンド	1,001,302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）	487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
S & P 500（マルチアイ搭載）	60,069,073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	4,473,311円
ダイワ円債セレクト マネーコース	479,794,114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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,983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1,053,685円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 273,658円
受取利息	5,799
支払利息	△ 279,457
(B) その他費用	△ 1,940
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 275,598
(D) 前期繰越損益金	△ 746,310
(E) 解約差損益金	234,610
(F) 追加信託差損益金	△ 266,387
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	△1,053,685
次期繰越損益金(G)	△1,053,685

(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。