# ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）
## －ジャパン・トリプルリターンズ－
### 日本円・コース（毎月分配型）
### 豪ドル・コース（毎月分配型）
### ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）
### 米ドル・コース（毎月分配型）
### 通貨セレクト・コース（毎月分配型）

# 運用報告書（全体版）

**第114期（決算日　2023年1月10日）**
**第115期（決算日　2023年2月8日）**
**第116期（決算日　2023年3月8日）**
**第117期（決算日　2023年4月10日）**
**第118期（決算日　2023年5月8日）**
**満期償還（償還日　2023年6月8日）**
**（作成対象期間　2022年12月9日～2023年6月8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、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざしており、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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/

<5765>
<5766>
<5767>
<5768>
<5769>

**★当ファンドの仕組みは次の通りでした。**

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 追加型投信／国内／株式 | |
| 信託期間 | 2013年6月19日～2023年6月8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 | 日本円・コース（毎月分配型） | ①ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラストークロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）」の受益証券（円建）<br>②ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券 |
| | 豪ドル・コース（毎月分配型） | ①ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラストークロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）」の受益証券（円建）<br>②ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券 |
| | ブラジル・レアル・コース（毎月分配型） | ①ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラストークロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」の受益証券（円建）<br>②ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券 |
| | 米ドル・コース（毎月分配型） | ①ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラストークロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）」の受益証券（円建）<br>②ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券 |
| | 通貨セレクト・コース（毎月分配型） | ①ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラストークロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」の受益証券（円建）<br>②ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券 |
| 組入制限 | 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 | |
| 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、継続的な分配を行なうことを目標に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。 | |

◇SUZ0576520230608◇

## 日本円・コース（毎月分配型）

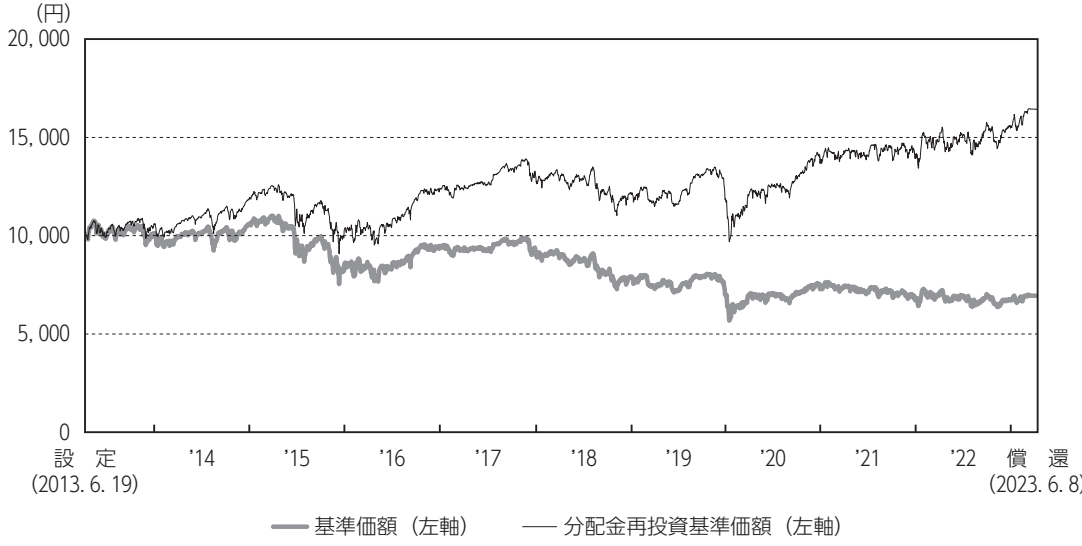
## 最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | TOPIX（配当込み） | | 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 |
| 90期末（2021年1月8日） | 7,277 | 60 | 3.8 | 19,770 | 3.9 | — | 99.4 | 1,792 |
| 91期末（2021年2月8日） | 7,400 | 60 | 2.5 | 20,471 | 3.5 | — | 99.4 | 1,537 |
| 92期末（2021年3月8日） | 7,286 | 60 | △ 0.7 | 20,535 | 0.3 | — | 98.8 | 1,447 |
| 93期末（2021年4月8日） | 7,491 | 60 | 3.6 | 21,490 | 4.7 | — | 98.4 | 1,478 |
| 94期末（2021年5月10日） | 7,348 | 60 | △ 1.1 | 21,118 | △ 1.7 | — | 99.1 | 1,426 |
| 95期末（2021年6月8日） | 7,411 | 60 | 1.7 | 21,438 | 1.5 | — | 98.9 | 1,421 |
| 96期末（2021年7月8日） | 7,279 | 60 | △ 1.0 | 21,209 | △ 1.1 | — | 98.0 | 1,393 |
| 97期末（2021年8月10日） | 7,138 | 60 | △ 1.1 | 21,120 | △ 0.4 | — | 98.0 | 1,351 |
| 98期末（2021年9月8日） | 7,347 | 60 | 3.8 | 22,594 | 7.0 | — | 98.1 | 1,361 |
| 99期末（2021年10月8日） | 6,886 | 60 | △ 5.5 | 21,406 | △ 5.3 | — | 98.1 | 1,234 |
| 100期末（2021年11月8日） | 7,199 | 60 | 5.4 | 22,532 | 5.3 | — | 98.8 | 1,274 |
| 101期末（2021年12月8日） | 7,015 | 60 | △ 1.7 | 21,970 | △ 2.5 | — | 98.1 | 1,232 |
| 102期末（2022年1月11日） | 7,097 | 60 | 2.0 | 22,062 | 0.4 | — | 98.1 | 1,233 |
| 103期末（2022年2月8日） | 6,933 | 60 | △ 1.5 | 21,294 | △ 3.5 | — | 99.2 | 1,202 |
| 104期末（2022年3月8日） | 6,517 | 60 | △ 5.1 | 19,843 | △ 6.8 | — | 97.4 | 1,130 |
| 105期末（2022年4月8日） | 6,952 | 60 | 7.6 | 21,169 | 6.7 | — | 97.5 | 1,199 |
| 106期末（2022年5月9日） | 7,047 | 60 | 2.2 | 21,427 | 1.2 | — | 98.5 | 1,194 |
| 107期末（2022年6月8日） | 7,154 | 60 | 2.4 | 21,796 | 1.7 | — | 97.7 | 1,197 |
| 108期末（2022年7月8日） | 6,683 | 60 | △ 5.7 | 21,102 | △ 3.2 | — | 99.1 | 1,112 |
| 109期末（2022年8月8日） | 6,783 | 60 | 2.4 | 21,830 | 3.5 | — | 97.5 | 1,129 |
| 110期末（2022年9月8日） | 6,669 | 60 | △ 0.8 | 21,483 | △ 1.6 | — | 99.5 | 1,111 |
| 111期末（2022年10月11日） | 6,614 | 60 | 0.1 | 21,610 | 0.6 | — | 97.6 | 1,104 |
| 112期末（2022年11月8日） | 6,696 | 60 | 2.1 | 21,920 | 1.4 | — | 97.6 | 1,108 |
| 113期末（2022年12月8日） | 6,803 | 60 | 2.5 | 22,090 | 0.8 | — | 99.8 | 1,112 |
| 114期末（2023年1月10日） | 6,367 | 60 | △ 5.5 | 21,304 | △ 3.6 | — | 99.6 | 1,036 |
| 115期末（2023年2月8日） | 6,688 | 60 | 6.0 | 22,528 | 5.7 | — | 95.3 | 1,089 |
| 116期末（2023年3月8日） | 6,855 | 60 | 3.4 | 23,235 | 3.1 | — | 99.6 | 1,115 |
| 117期末（2023年4月10日） | 6,658 | 60 | △ 2.0 | 22,595 | △ 2.8 | — | 97.7 | 1,084 |
| 118期末（2023年5月8日） | 6,955 | 60 | 5.4 | 23,862 | 5.6 | — | 7.2 | 1,111 |
| 償還（2023年6月8日） | 6,940.03 | — | △ 0.2 | 25,380 | 6.4 | — | — | 1,094 |

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）ＴＯＰＩＸ（配当込み）は、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。また、基準価額への反映を考慮して、1営業日前の日付の終値を採用しています。
（注3）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4）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5）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。
※参考指数を「ＴＯＰＩＸ」から「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」に変更しました。

# 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**

設定時：10,000円
償還時： 6,940円03銭（既払分配金7,080円）
騰落率：64.3%（分配金再投資ベース）

**■基準価額の主な変動要因**

日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略による運用の結果、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。株式ポートフォリオ（配当込み）が上昇したことがプラス要因となりました。オプション取引に関してはマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

**ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 日本円・コース（毎月分配型）**

| | 年　月　日 | 基準価額 | | TOPIX（配当込み） | | 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 | | |
| | | 円 | % | | % | % | % |
| 第114期 | （期首）2022年12月８日 | 6,803 | — | 22,090 | — | — | 99.8 |
| | 12月末 | 6,504 | △ 4.4 | 21,525 | △ 2.6 | — | 97.5 |
| | （期末）2023年１月10日 | 6,427 | △ 5.5 | 21,304 | △ 3.6 | — | 99.6 |
| 第115期 | （期首）2023年１月10日 | 6,367 | — | 21,304 | — | — | 99.6 |
| | １月末 | 6,725 | 5.6 | 22,516 | 5.7 | — | 99.2 |
| | （期末）2023年２月８日 | 6,748 | 6.0 | 22,528 | 5.7 | — | 95.3 |
| 第116期 | （期首）2023年２月８日 | 6,688 | — | 22,528 | — | — | 95.3 |
| | ２月末 | 6,752 | 1.0 | 22,641 | 0.5 | — | 98.7 |
| | （期末）2023年３月８日 | 6,915 | 3.4 | 23,235 | 3.1 | — | 99.6 |
| 第117期 | （期首）2023年３月８日 | 6,855 | — | 23,235 | — | — | 99.6 |
| | ３月末 | 6,836 | △ 0.3 | 22,801 | △ 1.9 | — | 99.6 |
| | （期末）2023年４月10日 | 6,718 | △ 2.0 | 22,595 | △ 2.8 | — | 97.7 |
| 第118期 | （期首）2023年４月10日 | 6,658 | — | 22,595 | — | — | 97.7 |
| | ４月末 | 6,945 | 4.3 | 23,367 | 3.4 | — | 96.7 |
| | （期末）2023年５月８日 | 7,015 | 5.4 | 23,862 | 5.6 | — | 7.2 |
| 償還期 | （期首）2023年５月８日 | 6,955 | — | 23,862 | — | — | 7.2 |
| | ５月末 | 6,943 | △ 0.2 | 24,826 | 4.0 | — | 7.2 |
| | （償還）2023年６月８日 | 6,940.03 | △ 0.2 | 25,380 | 6.4 | — | — |

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

### ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当ファンド設定時からアベノミクス相場を追い風に上昇し、2015年の中国・人民元切下げ、2016年の日銀のマイナス金利導入、中国経済への懸念などで調整した局面もあったものの、2017年末ごろまで上昇を続けました。しかし2018年に入ると、米国長期金利の上昇や米中通商問題の行方をにらみながら一進一退の展開となり、年末には中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、大きく下落しました。2019年には、ＦＲＢ議長が一転して引き締め方向にあった金融政策の軟化を示唆したことや、米中通商問題解決への期待が高まったこともあり、上昇しました。2020年には、国内外での新型コロナウイルスの感染拡大により大幅に下落する局面もありましたが、各国の積極的な金融政策や財政政策への期待から反発し、2021年も、新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済活動の再開が進んだことなどにより、上昇しました。2022年は、米国の金融引き締めに対する懸念の高まりから上値の重い展開で推移しました。2023年に入り、日銀新総裁就任後初の金融政策決定会合で金融緩和継続の方針が示されたことや、海外に比べて遅れていた経済正常化の動きが本格化したことなどにより、償還期末にかけて上昇しました。

## 信託期間中の運用方針

**■当ファンド**

「クロッキーファンド（日本円・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資します。主として、「クロッキーファンド（日本円・クラス）」の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざします。

※クロッキーファンド（日本円・クラス）：オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）

**■クロッキーファンド（日本円・クラス）**

主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

・投資対象銘柄は「ＴＯＰＩＸ100」構成銘柄から金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。
・ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。
・選定時における各銘柄の構成比率はおおむね均等とします。また、銘柄の見直しは約１カ月ごとに行います。
・個別銘柄ごとに、コール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。

**■ダイワ・マネーストック・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。

## 信託期間中のポートフォリオについて （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

**■当ファンド**

当ファンドは、「クロッキーファンド（日本円・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズです。信託期間中は、「クロッキーファンド（日本円・クラス）」への投資割合を高位に維持することをめざしました。

**■クロッキーファンド（日本円・クラス）**

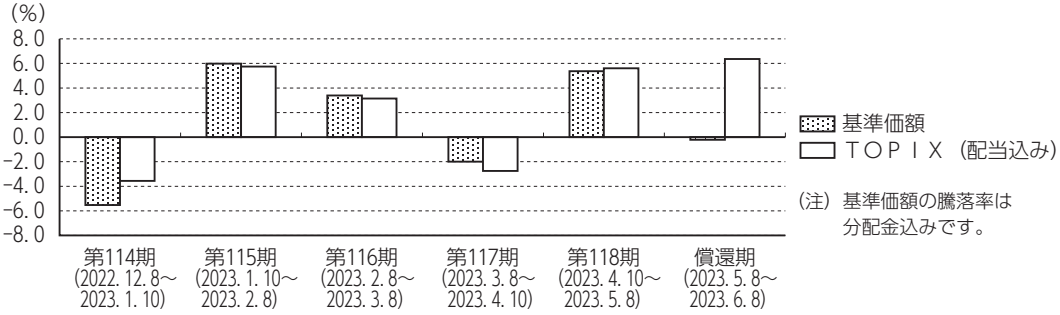
株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略のうち、クロッキーモデルによる銘柄選択効果がプラスに働き、株式ポートフォリオ（配当除く）はＴＯＰＩＸ100指数（配当除く）を上回るパフォーマンスとなりました。また、オプション取引はマイナス要因となりました。

**■ダイワ・マネーストック・マザーファンド**

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・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

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、当作成期における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。




(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## 分配金について

１万口当り、第１期～第118期各60円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（１万口当り）

| 項　　目 | 第114期<br>2022年12月９日<br>～2023年１月10日 | 第115期<br>2023年１月11日<br>～2023年２月８日 | 第116期<br>2023年２月９日<br>～2023年３月８日 | 第117期<br>2023年３月９日<br>～2023年４月10日 | 第118期<br>2023年４月11日<br>～2023年５月８日 |
|---|---|---|---|---|---|
| **当期分配金(税込み)（円）** | **60** | **60** | **60** | **60** | **60** |
| 対基準価額比率（％） | 0.93 | 0.89 | 0.87 | 0.89 | 0.86 |
| 当期の収益　（円） | 47 | 55 | 53 | 46 | 60 |
| 当期の収益以外（円） | 12 | 4 | 6 | 13 | ― |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 1,329 | 1,326 | 1,319 | 1,305 | 1,329 |

（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ございません。

### ■収益分配金の計算過程（１万口当り）

| 項　　目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| （a）経費控除後の配当等収益 | ✓ 47.32円 | ✓ 55.42円 | ✓ 53.17円 | ✓ 46.08円 | ✓ 84.00円 |
| （b）経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| （c）収益調整金 | 568.28 | 588.91 | 591.09 | 592.20 | 593.33 |
| （d）分配準備積立金 | ✓ 773.78 | ✓ 741.65 | ✓ 734.93 | ✓ 727.00 | 711.95 |
| （e）当期分配対象額（a+b+c+d） | 1,389.40 | 1,385.99 | 1,379.20 | 1,365.28 | 1,389.29 |
| （f）分配金 | 60.00 | 60.00 | 60.00 | 60.00 | 60.00 |
| （g）翌期繰越分配対象額（e－f） | 1,329.40 | 1,325.99 | 1,319.20 | 1,305.28 | 1,329.29 |

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

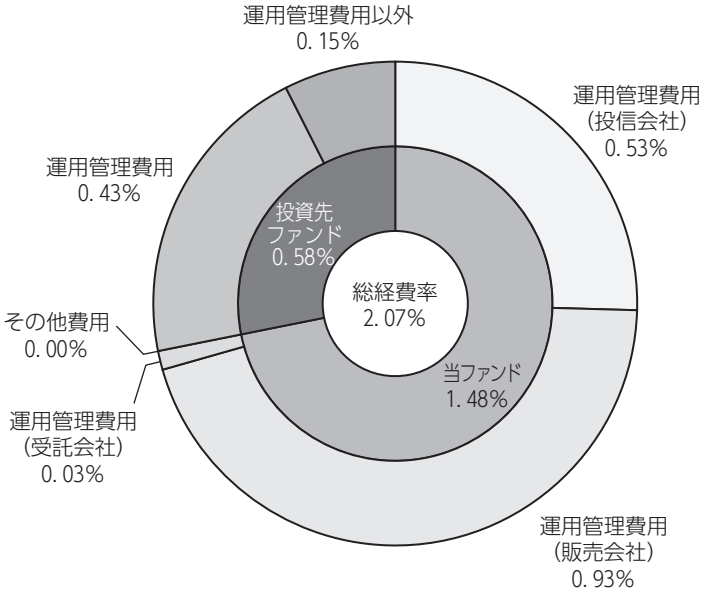
| 項　　目 | 第114期～償還期<br>(2022. 12. 9～2023. 6. 8) | | 項　目　の　概　要 |
|---|---|---|---|
| | 金　額 | 比　率 | |
| **信　託　報　酬** | 50円 | 0. 741% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>**当作成期中の平均基準価額は6, 768円です。** |
| （投 信 会 社） | (18) | (0. 262) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| （販 売 会 社） | (31) | (0. 465) | 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） | (1) | (0. 013) | 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<br>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<br>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** | — | — | 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 |
| **合　　計** | 50 | 0. 741 | |

（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2.07%です。




| 総経費率　（　①　＋　②　＋　③　） | 2.07% |
|---|---|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.48% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.43% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.15% |

（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、投資先ファンドの費用には、支払利息、担保付スワップに係る費用を含みません。
（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。

## ■売買および取引の状況

### (1) 投資信託受益証券

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 買付 | | 売付 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国（邦貨建） | 1,508.622323 | 94,799 | 18,779.083254 | 1,233,059 |

（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。

### (2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 設定 | | 解約 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | — | — | 398 | 398 |

（注）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12月９日から2023年６月８日まで）

| 第114期～償還期 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 |
| CROCI JAPAN STRATEGY FUND JPY CLASS（ケイマン諸島） | 710.760127 | 44,500 | 62 | CROCI JAPAN STRATEGY FUND JPY CLASS（ケイマン諸島） | 18,779.083254 | 1,233,059 | 65 |

（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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

### 親投資信託残高

| 種類 | 第113期末 |
|---|---|
| | □数 |
| | 千口 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | 398 |

（注）単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年６月８日現在

| 項目 | 償還時 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 1,095,660 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 1,095,660 | 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１月10日）、（2023年２月８日）、（2023年３月８日）、（2023年４月10日）、（2023年５月８日）、（2023年６月８日）現在

| 項　　目 | 第114期末 | 第115期末 | 第116期末 | 第117期末 | 第118期末 | 償還時 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）資産** | **1,049,018,189円** | **1,100,442,870円** | **1,126,395,978円** | **1,125,821,478円** | **2,161,970,053円** | **1,095,660,664円** |
| コール・ローン等 | 16,751,789 | 61,347,315 | 15,319,800 | 5,568,955 | 3,134,835 | 1,095,660,664 |
| 投資信託受益証券（評価額） | 1,031,867,517 | 1,038,696,672 | 1,110,677,295 | 1,059,853,641 | 79,499,488 | — |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド（評価額） | 398,883 | 398,883 | 398,883 | 398,883 | 398,883 | — |
| 未収入金 | — | — | — | 59,999,999 | 2,078,936,847 | — |
| **（B）負債** | **12,584,779** | **11,036,046** | **11,018,638** | **41,255,229** | **1,050,327,522** | **1,430,384** |
| 未払金 | — | — | — | 30,000,000 | 1,039,468,424 | — |
| 未払収益分配金 | 9,767,083 | 9,773,942 | 9,763,017 | 9,774,085 | 9,590,298 | — |
| 未払解約金 | 1,360,242 | 2,004 | — | — | — | — |
| 未払信託報酬 | 1,457,454 | 1,260,100 | 1,255,621 | 1,481,144 | 1,268,800 | 1,429,014 |
| 未払利息 | — | — | — | — | — | 1,370 |
| **（C）純資産総額（A－B）** | **1,036,433,410** | **1,089,406,824** | **1,115,377,340** | **1,084,566,249** | **1,111,642,531** | **1,094,230,280** |
| 元本 | 1,627,847,268 | 1,628,990,362 | 1,627,169,513 | 1,629,014,302 | 1,598,383,015 | 1,576,694,856 |
| 次期繰越損益金 | △ 591,413,858 | △ 539,583,538 | △ 511,792,173 | △ 544,448,053 | △ 486,740,484 | — |
| 償還差損益金 | — | — | — | — | — | △ 482,464,576 |
| **（D）受益権総口数** | **1,627,847,268口** | **1,628,990,362口** | **1,627,169,513口** | **1,629,014,302口** | **1,598,383,015口** | **1,576,694,856口** |
| **１万口当り基準価額（C／D）** | **6,367円** | **6,688円** | **6,855円** | **6,658円** | **6,955円** | **—** |
| **１万口当り償還価額（C／D）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **6,940円03銭** |

＊当作成期首における元本額は1,635,689,214円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は58,259,999円、同解約元本額は117,254,357円です。
＊償還時の計算口数当りの純資産額は6,940円03銭です。
＊償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は482,464,576円です。

## ■損益の状況

第114期　自 2022年12月９日　至 2023年１月10日　　第116期　自 2023年２月９日　至 2023年３月８日　　第118期　自 2023年４月11日　至 2023年５月８日
第115期　自 2023年１月11日　至 2023年２月８日　　第117期　自 2023年３月９日　至 2023年４月10日　　償 還 期　自 2023年５月９日　至 2023年６月８日

| 項　　目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 | 償還期 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）配当等収益** | **9,161,240円** | **9,216,639円** | **8,947,354円** | **8,987,650円** | **13,725,895円** | **△ 45,020円** |
| 受取配当金 | 9,161,507 | 9,216,789 | 8,947,653 | 8,987,711 | 13,726,031 | — |
| 受取利息 | — | — | — | — | — | 11 |
| 支払利息 | △ 267 | △ 150 | △ 299 | △ 61 | △ 136 | △ 45,031 |
| **（B）有価証券売買損益** | **△ 68,951,016** | **52,611,847** | **29,236,257** | **△ 29,808,135** | **44,603,155** | **△ 854,591** |
| 売買益 | 416,662 | 53,329,554 | 29,225,366 | 54,641 | 45,388,200 | 1,923 |
| 売買損 | △ 69,367,678 | △ 717,707 | 10,891 | △ 29,862,776 | △ 785,045 | △ 856,514 |
| **（C）信託報酬等** | **△ 1,457,454** | **△ 1,260,100** | **△ 1,255,621** | **△ 1,481,144** | **△ 1,268,800** | **△ 1,429,014** |
| **（D）当期損益金（A＋B＋C）** | **△ 61,247,230** | **60,568,386** | **36,927,990** | **△ 22,301,629** | **57,060,250** | **△ 2,328,625** |
| **（E）前期繰越損益金** | **△ 446,514,976** | **△ 504,656,273** | **△ 452,033,997** | **△ 424,698,330** | **△ 447,477,209** | **△ 393,989,549** |
| **（F）追加信託差損益金** | **△ 73,884,569** | **△ 85,721,709** | **△ 86,923,149** | **△ 87,674,009** | **△ 86,733,227** | **△ 86,146,402** |
| （配当等相当額） | ( 92,508,536) | ( 95,933,549) | ( 96,180,736) | ( 96,471,700) | ( 94,837,700) | ( 93,724,400) |
| （売買損益相当額） | (△ 166,393,105) | (△ 181,655,258) | (△ 183,103,885) | (△ 184,145,709) | (△ 181,570,927) | (△ 179,870,802) |
| **（G）合計（D＋E＋F）** | **△ 581,646,775** | **△ 529,809,596** | **△ 502,029,156** | **△ 534,673,968** | **△ 477,150,186** | **△ 482,464,576** |
| **（H）収益分配金** | **△ 9,767,083** | **△ 9,773,942** | **△ 9,763,017** | **△ 9,774,085** | **△ 9,590,298** | **—** |
| **次期繰越損益金（G＋H）** | **△ 591,413,858** | **△ 539,583,538** | **△ 511,792,173** | **△ 544,448,053** | **△ 486,740,484** | **—** |
| 追加信託差損益金 | △ 73,884,569 | △ 85,721,709 | △ 86,923,149 | △ 87,674,009 | △ 86,733,227 | — |
| （配当等相当額） | ( 92,508,536) | ( 95,933,549) | ( 96,180,736) | ( 96,471,700) | ( 94,837,700) | ( —) |
| （売買損益相当額） | (△ 166,393,105) | (△ 181,655,258) | (△ 183,103,885) | (△ 184,145,709) | (△ 181,570,927) | ( —) |
| 分配準備積立金 | 123,897,497 | 120,070,484 | 118,477,071 | 116,161,893 | 117,634,660 | — |
| 繰越損益金 | △ 641,426,786 | △ 573,932,313 | △ 543,346,095 | △ 572,935,937 | △ 517,641,917 | — |
| **償還差損益金（G）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **△ 482,464,576** |

（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）第114期～第118期の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 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 7,703,773円 | 9,028,756円 | 8,653,161円 | 7,506,505円 | 13,427,337円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 92,508,536 | 95,933,549 | 96,180,736 | 96,471,700 | 94,837,700 |
| (d) 分配準備積立金 | 125,960,807 | 120,815,670 | 119,586,927 | 118,429,473 | 113,797,621 |
| (e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d） | 226,173,116 | 225,777,975 | 224,420,824 | 222,407,678 | 222,062,658 |
| (f) 分配金 | 9,767,083 | 9,773,942 | 9,763,017 | 9,774,085 | 9,590,298 |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e－f） | 216,406,033 | 216,004,033 | 214,657,807 | 212,633,593 | 212,472,360 |
| (h) 受益権総口数 | 1,627,847,268口 | 1,628,990,362口 | 1,627,169,513口 | 1,629,014,302口 | 1,598,383,015口 |

## 投　資　信　託　財　産　運　用　総　括　表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2013年6月19日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 投資信託契約終了日 | 2023年6月8日 | | 資産総額 | 1,095,660,664円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 1,430,384円 |
| | | | | 純資産総額 | 1,094,230,280円 |
| 受益権口数 | 9,946,723,661口 | 1,576,694,856口 | △8,370,028,805口 | 受益権口数 | 1,576,694,856口 |
| 元本額 | 9,946,723,661円 | 1,576,694,856円 | △8,370,028,805円 | 1単位当り償還金 | 6,940円03銭 |

毎計算期末の状況

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第1期 | 11,798,232,780 | 12,035,322,708 | 10,201 | 60 | 0.60 |
| 第2期 | 12,454,692,149 | 12,507,072,027 | 10,042 | 60 | 0.60 |
| 第3期 | 13,390,002,788 | 13,164,670,600 | 9,832 | 60 | 0.60 |
| 第4期 | 14,319,945,188 | 14,447,095,113 | 10,089 | 60 | 0.60 |
| 第5期 | 14,264,116,640 | 14,665,774,676 | 10,282 | 60 | 0.60 |
| 第6期 | 14,289,584,517 | 14,865,931,613 | 10,403 | 60 | 0.60 |
| 第7期 | 15,076,551,715 | 14,718,138,934 | 9,762 | 60 | 0.60 |
| 第8期 | 15,366,128,736 | 15,542,681,733 | 10,115 | 60 | 0.60 |
| 第9期 | 15,467,523,218 | 15,147,857,878 | 9,793 | 60 | 0.60 |
| 第10期 | 15,447,644,161 | 14,659,542,612 | 9,490 | 60 | 0.60 |
| 第11期 | 15,334,093,748 | 15,221,709,240 | 9,927 | 60 | 0.60 |
| 第12期 | 14,577,146,649 | 14,733,004,719 | 10,107 | 60 | 0.60 |
| 第13期 | 14,051,654,026 | 14,074,967,998 | 10,017 | 60 | 0.60 |
| 第14期 | 13,811,260,386 | 14,031,010,233 | 10,159 | 60 | 0.60 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第15期 | 13,230,226,459 | 13,326,825,954 | 10,073 | 60 | 0.60 |
| 第16期 | 13,018,308,480 | 13,163,802,845 | 10,112 | 60 | 0.60 |
| 第17期 | 12,711,348,270 | 13,202,701,707 | 10,387 | 60 | 0.60 |
| 第18期 | 12,442,593,260 | 12,131,505,085 | 9,750 | 60 | 0.60 |
| 第19期 | 12,063,628,810 | 12,201,985,368 | 10,115 | 60 | 0.60 |
| 第20期 | 11,753,615,036 | 12,479,203,039 | 10,617 | 60 | 0.60 |
| 第21期 | 11,570,766,462 | 12,389,945,342 | 10,708 | 60 | 0.60 |
| 第22期 | 11,499,428,217 | 12,151,331,093 | 10,567 | 60 | 0.60 |
| 第23期 | 11,294,732,661 | 12,327,200,489 | 10,914 | 60 | 0.60 |
| 第24期 | 11,171,178,689 | 11,816,657,812 | 10,578 | 60 | 0.60 |
| 第25期 | 11,177,790,134 | 11,688,307,680 | 10,457 | 60 | 0.60 |
| 第26期 | 11,040,588,087 | 10,003,949,692 | 9,061 | 60 | 0.60 |
| 第27期 | 11,213,598,096 | 10,416,218,502 | 9,289 | 60 | 0.60 |
| 第28期 | 10,991,557,372 | 10,640,975,631 | 9,681 | 60 | 0.60 |
| 第29期 | 10,529,919,258 | 10,351,655,323 | 9,831 | 60 | 0.60 |
| 第30期 | 10,110,846,115 | 9,014,992,388 | 8,916 | 60 | 0.60 |
| 第31期 | 9,449,516,166 | 7,959,604,750 | 8,423 | 60 | 0.60 |
| 第32期 | 9,354,794,519 | 7,996,373,306 | 8,548 | 60 | 0.60 |
| 第33期 | 9,120,080,840 | 7,234,115,151 | 7,932 | 60 | 0.60 |
| 第34期 | 9,040,481,229 | 7,383,006,718 | 8,167 | 60 | 0.60 |
| 第35期 | 8,735,970,088 | 7,341,193,880 | 8,403 | 60 | 0.60 |
| 第36期 | 8,509,996,776 | 6,548,217,786 | 7,695 | 60 | 0.60 |
| 第37期 | 8,367,515,494 | 6,808,663,174 | 8,137 | 60 | 0.60 |
| 第38期 | 7,992,355,988 | 6,864,053,280 | 8,588 | 60 | 0.60 |
| 第39期 | 7,597,126,306 | 6,589,081,463 | 8,673 | 60 | 0.60 |
| 第40期 | 7,328,131,715 | 6,412,204,598 | 8,750 | 60 | 0.60 |
| 第41期 | 6,994,707,406 | 6,416,258,742 | 9,173 | 60 | 0.60 |
| 第42期 | 6,732,468,174 | 6,377,646,407 | 9,473 | 60 | 0.60 |
| 第43期 | 6,546,777,600 | 6,052,054,027 | 9,244 | 60 | 0.60 |
| 第44期 | 6,263,221,518 | 5,886,138,359 | 9,398 | 60 | 0.60 |
| 第45期 | 6,039,904,246 | 5,511,204,916 | 9,125 | 60 | 0.60 |
| 第46期 | 5,895,380,742 | 5,482,538,587 | 9,300 | 60 | 0.60 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第47期 | 5,598,388,334 | 5,184,593,988 | 9,261 | 60 | 0.60 |
| 第48期 | 5,317,201,882 | 4,938,183,783 | 9,287 | 60 | 0.60 |
| 第49期 | 5,136,056,137 | 4,808,155,134 | 9,362 | 60 | 0.60 |
| 第50期 | 4,909,159,858 | 4,521,778,722 | 9,211 | 60 | 0.60 |
| 第51期 | 4,772,136,277 | 4,561,615,705 | 9,559 | 60 | 0.60 |
| 第52期 | 4,590,177,759 | 4,519,292,000 | 9,846 | 60 | 0.60 |
| 第53期 | 4,503,916,209 | 4,298,213,155 | 9,543 | 60 | 0.60 |
| 第54期 | 4,449,289,633 | 4,382,000,965 | 9,849 | 60 | 0.60 |
| 第55期 | 4,378,273,810 | 4,058,951,538 | 9,271 | 60 | 0.60 |
| 第56期 | 4,319,076,321 | 3,839,882,073 | 8,891 | 60 | 0.60 |
| 第57期 | 4,182,298,230 | 3,757,163,007 | 8,983 | 60 | 0.60 |
| 第58期 | 4,140,826,588 | 3,765,998,460 | 9,095 | 60 | 0.60 |
| 第59期 | 4,120,026,839 | 3,730,885,758 | 9,055 | 60 | 0.60 |
| 第60期 | 4,064,711,043 | 3,466,661,181 | 8,529 | 60 | 0.60 |
| 第61期 | 4,123,216,477 | 3,661,379,883 | 8,880 | 60 | 0.60 |
| 第62期 | 4,127,272,142 | 3,490,555,646 | 8,457 | 60 | 0.60 |
| 第63期 | 4,061,603,553 | 3,613,831,828 | 8,898 | 60 | 0.60 |
| 第64期 | 4,061,419,297 | 3,312,835,945 | 8,157 | 60 | 0.60 |
| 第65期 | 4,003,038,435 | 3,185,090,789 | 7,957 | 60 | 0.60 |
| 第66期 | 3,973,346,596 | 2,960,439,473 | 7,451 | 60 | 0.60 |
| 第67期 | 3,907,084,998 | 3,011,373,309 | 7,707 | 60 | 0.60 |
| 第68期 | 3,810,039,785 | 2,927,366,225 | 7,683 | 60 | 0.60 |
| 第69期 | 3,729,692,480 | 2,977,877,759 | 7,984 | 60 | 0.60 |
| 第70期 | 3,675,756,465 | 2,848,649,130 | 7,750 | 60 | 0.60 |
| 第71期 | 3,546,476,065 | 2,621,766,378 | 7,393 | 60 | 0.60 |
| 第72期 | 3,510,318,172 | 2,701,947,373 | 7,697 | 60 | 0.60 |
| 第73期 | 3,471,745,085 | 2,504,002,644 | 7,213 | 60 | 0.60 |
| 第74期 | 3,392,289,122 | 2,513,192,202 | 7,409 | 60 | 0.60 |
| 第75期 | 3,374,933,517 | 2,492,194,983 | 7,384 | 60 | 0.60 |
| 第76期 | 3,269,432,841 | 2,593,617,646 | 7,933 | 60 | 0.60 |
| 第77期 | 3,233,063,709 | 2,553,549,101 | 7,898 | 60 | 0.60 |
| 第78期 | 3,157,596,806 | 2,497,971,620 | 7,911 | 60 | 0.60 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第79期 | 3,109,431,826 | 2,441,083,693 | 7,851 | 60 | 0.60 |
| 第80期 | 2,946,052,430 | 1,981,412,227 | 6,726 | 60 | 0.60 |
| 第81期 | 2,938,629,922 | 1,862,873,333 | 6,339 | 60 | 0.60 |
| 第82期 | 2,863,821,950 | 1,821,180,462 | 6,359 | 60 | 0.60 |
| 第83期 | 2,857,604,873 | 2,007,037,880 | 7,023 | 60 | 0.60 |
| 第84期 | 2,737,299,737 | 1,886,532,032 | 6,892 | 60 | 0.60 |
| 第85期 | 2,698,542,542 | 1,810,690,116 | 6,710 | 60 | 0.60 |
| 第86期 | 2,621,208,386 | 1,817,705,121 | 6,935 | 60 | 0.60 |
| 第87期 | 2,598,131,274 | 1,788,402,046 | 6,883 | 60 | 0.60 |
| 第88期 | 2,575,161,390 | 1,759,115,473 | 6,831 | 60 | 0.60 |
| 第89期 | 2,437,333,523 | 1,723,111,856 | 7,070 | 60 | 0.60 |
| 第90期 | 2,462,680,747 | 1,792,118,753 | 7,277 | 60 | 0.60 |
| 第91期 | 2,077,196,373 | 1,537,097,659 | 7,400 | 60 | 0.60 |
| 第92期 | 1,987,283,884 | 1,447,942,925 | 7,286 | 60 | 0.60 |
| 第93期 | 1,973,227,977 | 1,478,240,347 | 7,491 | 60 | 0.60 |
| 第94期 | 1,941,032,258 | 1,426,224,395 | 7,348 | 60 | 0.60 |
| 第95期 | 1,918,494,588 | 1,421,807,399 | 7,411 | 60 | 0.60 |
| 第96期 | 1,914,986,336 | 1,393,867,320 | 7,279 | 60 | 0.60 |
| 第97期 | 1,893,589,505 | 1,351,716,269 | 7,138 | 60 | 0.60 |
| 第98期 | 1,852,722,440 | 1,361,212,272 | 7,347 | 60 | 0.60 |
| 第99期 | 1,792,960,222 | 1,234,614,979 | 6,886 | 60 | 0.60 |
| 第100期 | 1,770,698,436 | 1,274,676,680 | 7,199 | 60 | 0.60 |
| 第101期 | 1,756,742,954 | 1,232,400,278 | 7,015 | 60 | 0.60 |
| 第102期 | 1,738,102,630 | 1,233,447,122 | 7,097 | 60 | 0.60 |
| 第103期 | 1,733,974,730 | 1,202,086,660 | 6,933 | 60 | 0.60 |
| 第104期 | 1,734,503,658 | 1,130,455,559 | 6,517 | 60 | 0.60 |
| 第105期 | 1,725,566,160 | 1,199,530,018 | 6,952 | 60 | 0.60 |
| 第106期 | 1,695,427,331 | 1,194,848,253 | 7,047 | 60 | 0.60 |
| 第107期 | 1,674,035,169 | 1,197,685,008 | 7,154 | 60 | 0.60 |
| 第108期 | 1,665,154,177 | 1,112,882,002 | 6,683 | 60 | 0.60 |
| 第109期 | 1,664,895,088 | 1,129,308,948 | 6,783 | 60 | 0.60 |
| 第110期 | 1,666,001,642 | 1,111,108,443 | 6,669 | 60 | 0.60 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第111期 | 1,669,175,585 | 1,104,050,591 | 6,614 | 60 | 0.60 |
| 第112期 | 1,654,931,165 | 1,108,094,933 | 6,696 | 60 | 0.60 |
| 第113期 | 1,635,689,214 | 1,112,805,466 | 6,803 | 60 | 0.60 |
| 第114期 | 1,627,847,268 | 1,036,433,410 | 6,367 | 60 | 0.60 |
| 第115期 | 1,628,990,362 | 1,089,406,824 | 6,688 | 60 | 0.60 |
| 第116期 | 1,627,169,513 | 1,115,377,340 | 6,855 | 60 | 0.60 |
| 第117期 | 1,629,014,302 | 1,084,566,249 | 6,658 | 60 | 0.60 |
| 第118期 | 1,598,383,015 | 1,111,642,531 | 6,955 | 60 | 0.60 |

（注）1単位は受益権1万口。

| 収益分配金のお知らせ | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1万口当り分配金（税込み） | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
| | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60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。

| 償還金のお知らせ | |
|---|---|
| 1万口当り償還金 | 6,940円03銭 |

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

豪ドル・コース（毎月分配型）

## 最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | TOPIX（配当込み） | | 豪ドル為替レート | | 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 | （参考指数） | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 90期末（2021年1月8日） | 4,950 | 50 | 7.0 | 19,770 | 3.9 | 80.54 | 4.4 | — | 99.1 | 346 |
| 91期末（2021年2月8日） | 5,019 | 50 | 2.4 | 20,471 | 3.5 | 80.95 | 0.5 | — | 99.4 | 344 |
| 92期末（2021年3月8日） | 5,064 | 50 | 1.9 | 20,535 | 0.3 | 83.57 | 3.2 | — | 98.0 | 337 |
| 93期末（2021年4月8日） | 5,226 | 50 | 4.2 | 21,490 | 4.7 | 83.64 | 0.1 | — | 98.0 | 343 |
| 94期末（2021年5月10日） | 5,200 | 50 | 0.5 | 21,118 | △ 1.7 | 85.44 | 2.2 | — | 98.1 | 338 |
| 95期末（2021年6月8日） | 5,199 | 50 | 0.9 | 21,438 | 1.5 | 84.83 | △ 0.7 | — | 99.0 | 338 |
| 96期末（2021年7月8日） | 4,975 | 50 | △ 3.3 | 21,209 | △ 1.1 | 82.57 | △ 2.7 | — | 99.7 | 325 |
| 97期末（2021年8月10日） | 4,774 | 50 | △ 3.0 | 21,120 | △ 0.4 | 80.93 | △ 2.0 | — | 98.1 | 312 |
| 98期末（2021年9月8日） | 4,903 | 50 | 3.7 | 22,594 | 7.0 | 81.51 | 0.7 | — | 99.5 | 316 |
| 99期末（2021年10月8日） | 4,608 | 50 | △ 5.0 | 21,406 | △ 5.3 | 81.76 | 0.3 | — | 97.9 | 298 |
| 100期末（2021年11月8日） | 4,923 | 50 | 7.9 | 22,532 | 5.3 | 84.00 | 2.7 | — | 98.0 | 316 |
| 101期末（2021年12月8日） | 4,604 | 50 | △ 5.5 | 21,970 | △ 2.5 | 80.85 | △ 3.8 | — | 98.9 | 290 |
| 102期末（2022年1月11日） | 4,746 | 50 | 4.2 | 22,062 | 0.4 | 82.93 | 2.6 | — | 98.0 | 299 |
| 103期末（2022年2月8日） | 4,574 | 50 | △ 2.6 | 21,294 | △ 3.5 | 82.20 | △ 0.9 | — | 97.5 | 285 |
| 104期末（2022年3月8日） | 4,449 | 50 | △ 1.6 | 19,843 | △ 6.8 | 84.60 | 2.9 | — | 99.2 | 271 |
| 105期末（2022年4月8日） | 5,107 | 50 | 15.9 | 21,169 | 6.7 | 92.61 | 9.5 | — | 97.5 | 302 |
| 106期末（2022年5月9日） | 5,149 | 50 | 1.8 | 21,427 | 1.2 | 91.70 | △ 1.0 | — | 99.6 | 305 |
| 107期末（2022年6月8日） | 5,414 | 50 | 6.1 | 21,796 | 1.7 | 96.01 | 4.7 | — | 97.8 | 321 |
| 108期末（2022年7月8日） | 4,903 | 50 | △ 8.5 | 21,102 | △ 3.2 | 93.28 | △ 2.8 | — | 99.4 | 288 |
| 109期末（2022年8月8日） | 5,007 | 50 | 3.1 | 21,830 | 3.5 | 93.51 | 0.2 | — | 97.4 | 280 |
| 110期末（2022年9月8日） | 5,110 | 50 | 3.1 | 21,483 | △ 1.6 | 97.39 | 4.1 | — | 97.5 | 285 |
| 111期末（2022年10月11日） | 4,852 | 50 | △ 4.1 | 21,610 | 0.6 | 91.89 | △ 5.6 | — | 97.6 | 265 |
| 112期末（2022年11月8日） | 4,997 | 50 | 4.0 | 21,920 | 1.4 | 95.02 | 3.4 | — | 99.7 | 273 |
| 113期末（2022年12月8日） | 4,926 | 50 | △ 0.4 | 22,090 | 0.8 | 91.68 | △ 3.5 | — | 97.8 | 269 |
| 114期末（2023年1月10日） | 4,535 | 50 | △ 6.9 | 21,304 | △ 3.6 | 91.10 | △ 0.6 | — | 99.3 | 246 |
| 115期末（2023年2月8日） | 4,776 | 50 | 6.4 | 22,528 | 5.7 | 91.19 | 0.1 | — | 97.5 | 259 |
| 116期末（2023年3月8日） | 4,875 | 50 | 3.1 | 23,235 | 3.1 | 90.44 | △ 0.8 | — | 99.5 | 261 |
| 117期末（2023年4月10日） | 4,605 | 50 | △ 4.5 | 22,595 | △ 2.8 | 88.36 | △ 2.3 | — | 97.6 | 247 |
| 118期末（2023年5月8日） | 4,977 | 50 | 9.2 | 23,862 | 5.6 | 91.14 | 3.1 | — | 1.8 | 262 |
| 償還（2023年6月8日） | 4,965.52 | — | △ 0.2 | 25,380 | 6.4 | 93.31 | 2.4 | — | — | 240 |

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）TOPIX（配当込み）は、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。また、基準価額への反映を考慮して、1営業日前の日付の終値を採用しています。
（注3）為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。
（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。
※参考指数の「TOPIX」を「TOPIX（配当込み）」に変更しました。

# 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**

設定時：10,000円
償還時： 4,965円52銭（既払分配金7,910円）
騰落率：59.6%（分配金再投資ベース）

**■基準価額の主な変動要因**

日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略による運用と為替取引の結果、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。株式ポートフォリオ（配当込み）が上昇したことがプラス要因となりました。オプション取引に関してはマイナス要因となりました。為替取引（日本円売り／豪ドル買い）は、軽微な影響にとどまりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

## ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 豪ドル・コース（毎月分配型）

| | 年　月　日 | 基準価額 | | TOPIX（配当込み） | | 豪ドル為替レート | | 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 | （参考指数） | 騰落率 | | |
| | | 円 | % | | % | 円 | % | % | % |
| 第114期 | （期首）2022年12月８日 | 4,926 | — | 22,090 | — | 91.68 | — | — | 97.8 |
| | 12月末 | 4,621 | △ 6.2 | 21,525 | △ 2.6 | 89.57 | △ 2.3 | — | 98.0 |
| | （期末）2023年１月10日 | 4,585 | △ 6.9 | 21,304 | △ 3.6 | 91.10 | △ 0.6 | — | 99.3 |
| 第115期 | （期首）2023年１月10日 | 4,535 | — | 21,304 | — | 91.10 | — | — | 99.3 |
| | １月末 | 4,891 | 7.9 | 22,516 | 5.7 | 91.93 | 0.9 | — | 99.6 |
| | （期末）2023年２月８日 | 4,826 | 6.4 | 22,528 | 5.7 | 91.19 | 0.1 | — | 97.5 |
| 第116期 | （期首）2023年２月８日 | 4,776 | — | 22,528 | — | 91.19 | — | — | 97.5 |
| | ２月末 | 4,874 | 2.1 | 22,641 | 0.5 | 91.90 | 0.8 | — | 97.5 |
| | （期末）2023年３月８日 | 4,925 | 3.1 | 23,235 | 3.1 | 90.44 | △ 0.8 | — | 99.5 |
| 第117期 | （期首）2023年３月８日 | 4,875 | — | 23,235 | — | 90.44 | — | — | 99.5 |
| | ３月末 | 4,801 | △ 1.5 | 22,801 | △ 1.9 | 89.69 | △ 0.8 | — | 99.3 |
| | （期末）2023年４月10日 | 4,655 | △ 4.5 | 22,595 | △ 2.8 | 88.36 | △ 2.3 | — | 97.6 |
| 第118期 | （期首）2023年４月10日 | 4,605 | — | 22,595 | — | 88.36 | — | — | 97.6 |
| | ４月末 | 4,862 | 5.6 | 23,367 | 3.4 | 88.98 | 0.7 | — | 96.5 |
| | （期末）2023年５月８日 | 5,027 | 9.2 | 23,862 | 5.6 | 91.14 | 3.1 | — | 1.8 |
| 償還期 | （期首）2023年５月８日 | 4,977 | — | 23,862 | — | 91.14 | — | — | 1.8 |
| | ５月末 | 4,967 | △ 0.2 | 24,826 | 4.0 | 91.07 | △ 0.1 | — | 1.8 |
| | （償還）2023年６月８日 | 4,965.52 | △ 0.2 | 25,380 | 6.4 | 93.31 | 2.4 | — | — |

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

### ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当ファンド設定時からアベノミクス相場を追い風に上昇し、2015年の中国・人民元切下げ、2016年の日銀のマイナス金利導入、中国経済への懸念などで調整した局面もあったものの、2017年末ごろまで上昇を続けました。しかし2018年に入ると、米国長期金利の上昇や米中通商問題の行方をにらみながら一進一退の展開となり、年末には中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、大きく下落しました。2019年には、ＦＲＢ議長が一転して引き締め方向にあった金融政策の軟化を示唆したことや、米中通商問題解決への期待が高まったこともあり、上昇しました。2020年には、国内外での新型コロナウイルスの感染拡大により大幅に下落する局面もありましたが、各国の積極的な金融政策や財政政策への期待から反発し、2021年も、新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済活動の再開が進んだことなどにより、上昇しました。2022年は、米国の金融引き締めに対する懸念の高まりから上値の重い展開で推移しました。2023年に入り、日銀新総裁就任後初の金融政策決定会合で金融緩和継続の方針が示されたことや、海外に比べて遅れていた経済正常化の動きが本格化したことなどにより、償還期末にかけて上昇しました。

### ■為替相場

豪ドルは、対円でおおむね横ばいとなりました。

豪ドル対円為替相場は、当ファンド設定時から2014年にかけておおむね横ばい圏での推移となりました。2015年から2016年前半にかけては、中国景気の減速懸念や鉄鉱石などの商品市況の下落などを受け、対円で下落（円高）しました。2016年後半から2017年にかけては、オーストラリア総選挙における与党の勝利、米国大統領選挙におけるトランプ氏勝利を受けた財政政策への期待などにより投資家のリスク選好姿勢が強まり、堅調に推移しました。2018年以降は、米中貿易摩擦への懸念やＲＢＡ（オーストラリア準備銀行）による利下げなどを受け、2019年にかけて下落しました。2020年初めは、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり対円で急落しましたが、各国の金融緩和策や財政面での景気刺激策などの動きから反発しました。その後は、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展を受けた経済活動の段階的な正常化や世界景気の回復期待、日豪間における金利差の拡大などが支援材料となり、対円で上昇基調となりました。2022年９月以降は、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことなどから円高が進み、豪ドルは対円で下落しました。

**■短期金利市況**

オーストラリアの短期金利は、ＲＢＡ（オーストラリア準備銀行）が、政策金利を段階的に2.75%から0.10%まで引き下げた後、段階的に4.10%まで引き上げました。一方、日本の短期金利は、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持し、低位で推移しました。

## 信託期間中の運用方針

**■当ファンド**

「クロッキーファンド（豪ドル・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資します。主として、「クロッキーファンド（豪ドル・クラス）」の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引（日本円売り／豪ドル買い）を行い、信託財産の成長をめざします。

※クロッキーファンド（豪ドル・クラス）：オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）

**■クロッキーファンド（豪ドル・クラス）**

1．主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

・投資対象銘柄は「ＴＯＰＩＸ100」構成銘柄から金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。

・ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。

・選定時における各銘柄の構成比率はおおむね均等とします。また、銘柄の見直しは約１カ月ごとに行います。

・個別銘柄ごとに、コール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。

2．為替取引を活用します。

日本円売り／豪ドル買いの為替取引を行います。

**■ダイワ・マネーストック・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。

## 信託期間中のポートフォリオについて （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

**■当ファンド**

当ファンドは、「クロッキーファンド（豪ドル・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズです。信託期間中は、「クロッキーファンド（豪ドル・クラス）」への投資割合を高位に維持することをめざしました。

**■クロッキーファンド（豪ドル・クラス）**

株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略のうち、クロッキーモデルによる銘柄選択効果がプラスに働き、株式ポートフォリオ（配当除く）はＴＯＰＩＸ100指数（配当除く）を上回るパフォーマンスとなりました。また、オプション取引はマイナス要因となりました。

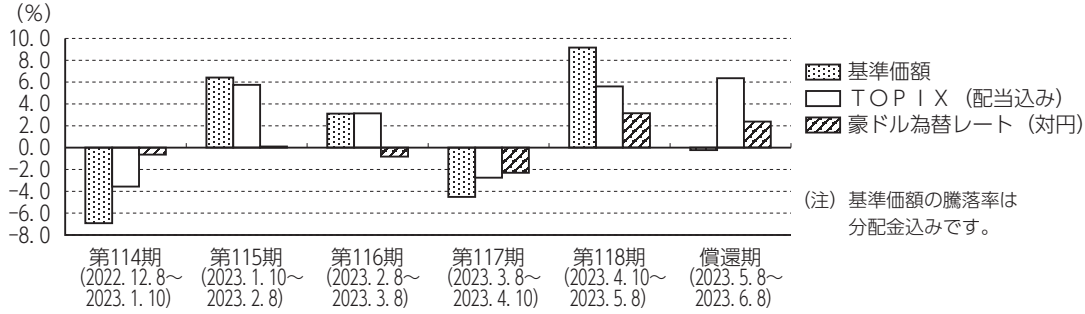
円建ての資産に対して、日本円売り／豪ドル買いの為替取引を行いました。

**■ダイワ・マネーストック・マザーファンド**

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・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、当作成期における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。




（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

## 分配金について

１万口当り、第１期～第67期各80円、第68期～第118期各50円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（１万口当り）

| 項目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 2022年12月９日～2023年１月10日 | 2023年１月11日～2023年２月８日 | 2023年２月９日～2023年３月８日 | 2023年３月９日～2023年４月10日 | 2023年４月11日～2023年５月８日 |
| **当期分配金（税込み）（円）** | **50** | **50** | **50** | **50** | **50** |
| 対基準価額比率（％） | 1.09 | 1.04 | 1.02 | 1.07 | 0.99 |
| 当期の収益（円） | 46 | 50 | 48 | 45 | 50 |
| 当期の収益以外（円） | 3 | — | 1 | 4 | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 1,021 | 1,021 | 1,020 | 1,016 | 1,038 |

（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ございません。

### ■収益分配金の計算過程（１万口当り）

| 項目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| （a）経費控除後の配当等収益 | ✓ 46.03円 | ✓ 50.23円 | ✓ 48.96円 | ✓ 45.80円 | ✓ 72.23円 |
| （b）経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| （c）収益調整金 | 847.84 | 848.49 | 849.15 | 849.63 | 850.18 |
| （d）分配準備積立金 | ✓ 177.28 | 172.66 | ✓ 172.24 | ✓ 170.73 | 165.98 |
| （e）当期分配対象額（a+b+c+d） | 1,071.15 | 1,071.39 | 1,070.36 | 1,066.17 | 1,088.41 |
| （f）分配金 | 50.00 | 50.00 | 50.00 | 50.00 | 50.00 |
| （g）翌期繰越分配対象額（e－f） | 1,021.15 | 1,021.39 | 1,020.36 | 1,016.17 | 1,038.41 |

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

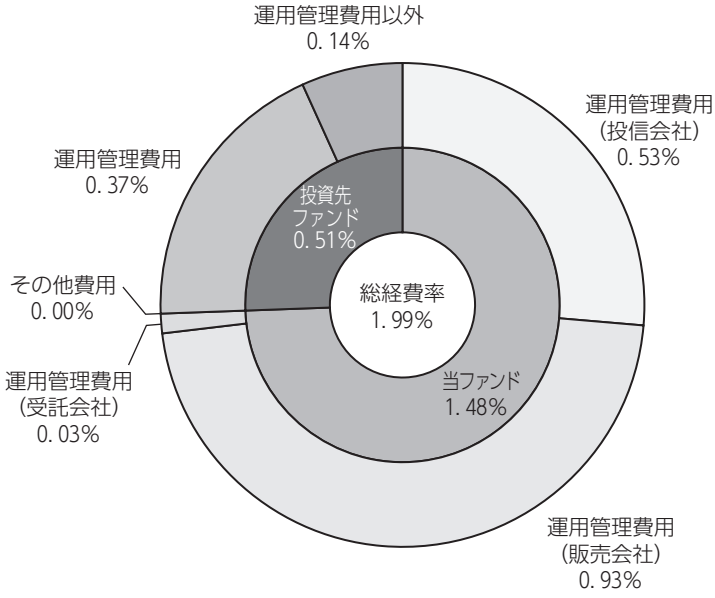
| 項　　目 | 第114期～償還期<br>(2022. 12. 9～2023. 6. 8) | | 項　目　の　概　要 |
|---|---|---|---|
| | 金　額 | 比　率 | |
| **信　託　報　酬** | 36円 | 0. 740% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>**当作成期中の平均基準価額は4, 818円です。** |
| （投 信 会 社） | (13) | (0. 262) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| （販 売 会 社） | (22) | (0. 465) | 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） | (1) | (0. 013) | 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<br>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<br>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** | — | — | 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 |
| **合　　計** | 36 | 0. 740 | |

（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1.99%です。




| 総経費率　（　①　＋　②　＋　③　） | 1.99% |
|---|---|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.48% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.37% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.14% |

（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、投資先ファンドの費用には、支払利息、担保付スワップに係る費用を含みません。
（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。

## ■売買および取引の状況

### (1) 投資信託受益証券

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 買付 | | 売付 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国（邦貨建） | 386.878034 | 20,277 | 5,210.564037 | 285,948 |

（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。

### (2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 設定 | | 解約 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | — | — | 99 | 99 |

（注）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12月９日から2023年６月８日まで）

| 第114期～償還期 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 |
| CROCI JAPAN STRATEGY FUND AUD CLASS（ケイマン諸島） | 96.55935 | 5,200 | 53 | CROCI JAPAN STRATEGY FUND AUD CLASS（ケイマン諸島） | 5,210.564037 | 285,948 | 54 |

（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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

### 親投資信託残高

| 種類 | 第113期末 |
|---|---|
| | □数 |
| | 千口 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | 99 |

（注）単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年６月８日現在

| 項目 | 償還時 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 241,270 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 241,270 | 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１月10日）、（2023年２月８日）、（2023年３月８日）、（2023年４月10日）、（2023年５月８日）、（2023年６月８日）現在

| 項　　目 | 第114期末 | 第115期末 | 第116期末 | 第117期末 | 第118期末 | 償還時 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）資産** | **250,568,646円** | **265,082,241円** | **264,184,945円** | **257,416,320円** | **524,977,367円** | **241,270,492円** |
| コール・ローン等 | 5,289,214 | 9,383,986 | 4,138,305 | 1,835,147 | 822,287 | 241,270,492 |
| 投資信託受益証券（評価額） | 245,179,712 | 252,998,535 | 259,946,920 | 241,479,691 | 4,637,666 | — |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド（評価額） | 99,720 | 99,720 | 99,720 | 99,720 | 99,720 | — |
| 未収入金 | — | 2,600,000 | — | 14,000,000 | 519,415,932 | — |
| その他未収収益 | — | — | — | 1,762 | — | — |
| **（B）負債** | **3,652,228** | **5,620,926** | **2,983,912** | **10,027,330** | **262,639,495** | **577,355** |
| 未払金 | — | 2,600,000 | — | 7,000,000 | 259,707,966 | — |
| 未払収益分配金 | 2,722,487 | 2,716,464 | 2,679,073 | 2,686,043 | 2,635,711 | — |
| 未払解約金 | 582,174 | 289 | 2,470 | — | — | 256,243 |
| 未払信託報酬 | 347,567 | 304,173 | 302,369 | 341,287 | 295,818 | 320,811 |
| 未払利息 | — | — | — | — | — | 301 |
| **（C）純資産総額（A－B）** | **246,916,418** | **259,461,315** | **261,201,033** | **247,388,990** | **262,337,872** | **240,693,137** |
| 元本 | 544,497,514 | 543,292,831 | 535,814,786 | 537,208,791 | 527,142,258 | 484,728,818 |
| 次期繰越損益金 | △ 297,581,096 | △ 283,831,516 | △ 274,613,753 | △ 289,819,801 | △ 264,804,386 | — |
| 償還差損益金 | — | — | — | — | — | △ 244,035,681 |
| **（D）受益権総口数** | **544,497,514口** | **543,292,831口** | **535,814,786口** | **537,208,791口** | **527,142,258口** | **484,728,818口** |
| **１万口当り基準価額（C／D）** | **4,535円** | **4,776円** | **4,875円** | **4,605円** | **4,977円** | **—** |
| **１万口当り償還価額（C／D）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **4,965円52銭** |

＊当作成期首における元本額は546,830,638円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は10,487,321円、同解約元本額は72,589,141円です。
＊償還時の計算口数当りの純資産額は4,965円52銭です。
＊償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は244,035,681円です。

## ■損益の状況

第114期　自 2022年12月９日　至 2023年１月10日　　第116期　自 2023年２月９日　至 2023年３月８日　　第118期　自 2023年４月11日　至 2023年５月８日
第115期　自 2023年１月11日　至 2023年２月８日　　第117期　自 2023年３月９日　至 2023年４月10日　　償 還 期　自 2023年５月９日　至 2023年６月８日

| 項　　目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 | 償還期 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）配当等収益** | **2,854,024円** | **2,781,599円** | **2,722,879円** | **2,802,035円** | **3,858,678円** | △ **10,549円** |
| 受取配当金 | 2,854,308 | 2,781,619 | 2,722,936 | 2,800,283 | 3,858,705 | — |
| 受取利息 | — | — | — | — | — | 68 |
| その他収益金 | — | — | — | 1,762 | — | — |
| 支払利息 | △ 284 | △ 20 | △ 57 | △ 10 | △ 27 | △ 10,617 |
| **（B）有価証券売買損益** | △ **21,086,349** | **13,327,585** | △ **5,563,367** | △ **14,266,353** | **18,657,466** | △ **205,928** |
| 売買益 | 60,480 | 13,336,463 | 5,582,056 | 1,239 | 18,998,485 | 22,061 |
| 売買損 | △ 21,146,829 | △ 8,878 | △ 18,689 | △ 14,267,592 | △ 341,019 | △ 227,989 |
| **（C）信託報酬等** | △ **347,567** | △ **304,173** | △ **302,369** | △ **341,287** | △ **295,818** | △ **320,811** |
| **（D）当期損益金（A＋B＋C）** | △ **18,579,892** | **15,805,011** | **7,983,877** | △ **11,805,605** | **22,220,326** | △ **537,288** |
| **（E）前期繰越損益金** | △ **216,778,189** | △ **236,671,745** | △ **219,670,291** | △ **214,327,584** | △ **223,783,910** | △ **187,293,455** |
| **（F）追加信託差損益金** | △ **59,500,528** | △ **60,248,318** | △ **60,248,266** | △ **61,000,569** | △ **60,605,091** | △ **56,204,938** |
| （配当等相当額） | ( 46,165,023) | ( 46,098,212) | ( 45,499,081) | ( 45,642,944) | ( 44,816,891) | ( 41,234,095) |
| （売買損益相当額） | (△ 105,665,551) | (△ 106,346,530) | (△ 105,747,347) | (△ 106,643,513) | (△ 105,421,982) | (△ 97,439,033) |
| **（G）合計（D＋E＋F）** | △ **294,858,609** | △ **281,115,052** | △ **271,934,680** | △ **287,133,758** | △ **262,168,675** | △ **244,035,681** |
| **（H）収益分配金** | △ **2,722,487** | △ **2,716,464** | △ **2,679,073** | △ **2,686,043** | △ **2,635,711** | **—** |
| **次期繰越損益金（G＋H）** | △ **297,581,096** | △ **283,831,516** | △ **274,613,753** | △ **289,819,801** | △ **264,804,386** | **—** |
| 追加信託差損益金 | △ 59,500,528 | △ 60,248,318 | △ 60,248,266 | △ 61,000,569 | △ 60,605,091 | — |
| （配当等相当額） | ( 46,165,023) | ( 46,098,212) | ( 45,499,081) | ( 45,642,944) | ( 44,816,891) | ( —) |
| （売買損益相当額） | (△ 105,665,551) | (△ 106,346,530) | (△ 105,747,347) | (△ 106,643,513) | (△ 105,421,982) | ( —) |
| 分配準備積立金 | 9,436,861 | 9,393,623 | 9,173,675 | 8,946,758 | 9,922,142 | — |
| 繰越損益金 | △ 247,517,429 | △ 232,976,821 | △ 223,539,162 | △ 237,765,990 | △ 214,121,437 | — |
| **償還差損益金（G）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | △ **244,035,681** |

（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）第114期～第118期の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 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 2,506,456円 | 2,729,068円 | 2,623,521円 | 2,460,748円 | 3,807,974円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 46,165,023 | 46,098,212 | 45,499,081 | 45,642,944 | 44,816,891 |
| (d) 分配準備積立金 | 9,652,892 | 9,381,019 | 9,229,227 | 9,172,053 | 8,749,879 |
| (e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d） | 58,324,371 | 58,208,299 | 57,351,829 | 57,275,745 | 57,374,744 |
| (f) 分配金 | 2,722,487 | 2,716,464 | 2,679,073 | 2,686,043 | 2,635,711 |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e－f） | 55,601,884 | 55,491,835 | 54,672,756 | 54,589,702 | 54,739,033 |
| (h) 受益権総口数 | 544,497,514口 | 543,292,831口 | 535,814,786口 | 537,208,791口 | 527,142,258口 |

## 投　資　信　託　財　産　運　用　総　括　表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2013年6月19日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 投資信託契約終了日 | 2023年6月8日 | | 資産総額 | 241,270,492円 |
| 区　分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 577,355円 |
| | | | | 純資産総額 | 240,693,137円 |
| 受益権口数 | 2,855,585,179口 | 484,728,818口 | △2,370,856,361口 | 受益権口数 | 484,728,818口 |
| 元本額 | 2,855,585,179円 | 484,728,818円 | △2,370,856,361円 | 1単位当り償還金 | 4,965円52銭 |

毎計算期末の状況

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第1期 | 3,644,417,451 | 3,582,596,852 | 9,830 | 80 | 0.80 |
| 第2期 | 3,689,012,309 | 3,738,251,610 | 10,133 | 80 | 0.80 |
| 第3期 | 3,621,792,889 | 3,609,333,341 | 9,966 | 80 | 0.80 |
| 第4期 | 4,039,389,104 | 4,222,272,366 | 10,453 | 80 | 0.80 |
| 第5期 | 4,102,339,268 | 4,358,516,570 | 10,624 | 80 | 0.80 |
| 第6期 | 4,274,227,365 | 4,581,770,788 | 10,720 | 80 | 0.80 |
| 第7期 | 4,539,099,172 | 4,481,467,405 | 9,873 | 80 | 0.80 |
| 第8期 | 4,755,304,801 | 4,975,424,384 | 10,463 | 80 | 0.80 |
| 第9期 | 4,727,935,371 | 4,879,003,573 | 10,320 | 80 | 0.80 |
| 第10期 | 4,831,794,947 | 4,797,564,814 | 9,929 | 80 | 0.80 |
| 第11期 | 4,805,211,206 | 5,027,028,513 | 10,462 | 80 | 0.80 |
| 第12期 | 4,680,150,720 | 4,970,914,332 | 10,621 | 80 | 0.80 |
| 第13期 | 4,538,722,773 | 4,745,326,577 | 10,455 | 80 | 0.80 |
| 第14期 | 4,609,795,830 | 5,061,603,681 | 10,980 | 80 | 0.80 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第15期 | 4,497,015,182 | 4,756,519,226 | 10,577 | 80 | 0.80 |
| 第16期 | 4,401,700,557 | 4,848,571,063 | 11,015 | 80 | 0.80 |
| 第17期 | 4,360,026,716 | 5,035,410,629 | 11,549 | 80 | 0.80 |
| 第18期 | 4,137,055,084 | 4,265,321,592 | 10,310 | 80 | 0.80 |
| 第19期 | 3,980,143,706 | 4,120,056,738 | 10,352 | 80 | 0.80 |
| 第20期 | 3,940,691,306 | 4,312,935,609 | 10,945 | 80 | 0.80 |
| 第21期 | 3,895,586,178 | 4,223,157,991 | 10,841 | 80 | 0.80 |
| 第22期 | 3,777,631,751 | 4,151,525,508 | 10,990 | 80 | 0.80 |
| 第23期 | 3,631,521,070 | 4,174,340,713 | 11,495 | 80 | 0.80 |
| 第24期 | 3,498,786,624 | 3,686,383,692 | 10,536 | 80 | 0.80 |
| 第25期 | 3,448,696,872 | 3,631,536,970 | 10,530 | 80 | 0.80 |
| 第26期 | 3,482,748,550 | 2,848,342,943 | 8,178 | 80 | 0.80 |
| 第27期 | 3,394,449,528 | 2,970,287,012 | 8,750 | 80 | 0.80 |
| 第28期 | 3,323,934,672 | 3,024,825,665 | 9,100 | 80 | 0.80 |
| 第29期 | 3,251,386,386 | 3,101,616,078 | 9,539 | 80 | 0.80 |
| 第30期 | 3,173,818,937 | 2,526,734,920 | 7,961 | 80 | 0.80 |
| 第31期 | 3,215,142,843 | 2,399,512,474 | 7,463 | 80 | 0.80 |
| 第32期 | 3,149,042,967 | 2,428,808,216 | 7,713 | 80 | 0.80 |
| 第33期 | 3,067,184,871 | 2,085,157,021 | 6,798 | 80 | 0.80 |
| 第34期 | 3,065,934,448 | 2,060,840,226 | 6,722 | 80 | 0.80 |
| 第35期 | 3,023,698,036 | 2,130,755,511 | 7,047 | 80 | 0.80 |
| 第36期 | 2,967,910,729 | 1,799,253,929 | 6,062 | 80 | 0.80 |
| 第37期 | 2,926,249,034 | 1,905,453,547 | 6,512 | 80 | 0.80 |
| 第38期 | 2,861,654,179 | 1,974,302,688 | 6,899 | 80 | 0.80 |
| 第39期 | 2,730,737,754 | 1,901,968,774 | 6,965 | 80 | 0.80 |
| 第40期 | 2,588,402,619 | 1,863,764,000 | 7,200 | 80 | 0.80 |
| 第41期 | 2,496,865,450 | 1,980,539,874 | 7,932 | 80 | 0.80 |
| 第42期 | 2,230,142,485 | 1,831,787,534 | 8,214 | 80 | 0.80 |
| 第43期 | 2,128,931,837 | 1,711,536,706 | 8,039 | 80 | 0.80 |
| 第44期 | 2,057,429,305 | 1,695,188,186 | 8,239 | 80 | 0.80 |
| 第45期 | 2,022,845,323 | 1,549,296,366 | 7,659 | 80 | 0.80 |
| 第46期 | 1,925,749,079 | 1,520,866,704 | 7,898 | 80 | 0.80 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第47期 | 1,876,455,739 | 1,442,034,363 | 7,685 | 80 | 0.80 |
| 第48期 | 1,815,289,168 | 1,461,652,177 | 8,052 | 80 | 0.80 |
| 第49期 | 1,778,640,062 | 1,455,248,701 | 8,182 | 80 | 0.80 |
| 第50期 | 1,709,660,842 | 1,365,642,962 | 7,988 | 80 | 0.80 |
| 第51期 | 1,557,104,860 | 1,291,975,239 | 8,297 | 80 | 0.80 |
| 第52期 | 1,523,622,983 | 1,293,425,411 | 8,489 | 80 | 0.80 |
| 第53期 | 1,487,360,447 | 1,186,107,576 | 7,975 | 80 | 0.80 |
| 第54期 | 1,460,527,126 | 1,257,748,679 | 8,612 | 80 | 0.80 |
| 第55期 | 1,430,257,414 | 1,115,485,573 | 7,799 | 80 | 0.80 |
| 第56期 | 1,307,080,216 | 936,395,717 | 7,164 | 80 | 0.80 |
| 第57期 | 1,303,982,094 | 933,987,709 | 7,163 | 80 | 0.80 |
| 第58期 | 1,312,068,551 | 950,366,955 | 7,243 | 80 | 0.80 |
| 第59期 | 1,319,720,293 | 966,212,037 | 7,321 | 80 | 0.80 |
| 第60期 | 1,305,899,834 | 876,035,699 | 6,708 | 80 | 0.80 |
| 第61期 | 1,283,461,338 | 898,176,030 | 6,998 | 80 | 0.80 |
| 第62期 | 1,252,219,650 | 797,944,157 | 6,372 | 80 | 0.80 |
| 第63期 | 1,247,407,959 | 844,776,503 | 6,772 | 80 | 0.80 |
| 第64期 | 1,239,473,534 | 783,659,651 | 6,323 | 80 | 0.80 |
| 第65期 | 1,192,105,969 | 720,354,924 | 6,043 | 80 | 0.80 |
| 第66期 | 1,196,868,059 | 639,620,161 | 5,344 | 80 | 0.80 |
| 第67期 | 1,175,010,773 | 650,951,892 | 5,540 | 80 | 0.80 |
| 第68期 | 1,158,874,060 | 642,330,714 | 5,543 | 50 | 0.50 |
| 第69期 | 1,132,432,007 | 659,000,281 | 5,819 | 50 | 0.50 |
| 第70期 | 1,069,716,370 | 589,281,497 | 5,509 | 50 | 0.50 |
| 第71期 | 922,696,315 | 473,850,520 | 5,135 | 50 | 0.50 |
| 第72期 | 884,014,287 | 471,250,349 | 5,331 | 50 | 0.50 |
| 第73期 | 868,626,213 | 408,864,513 | 4,707 | 50 | 0.50 |
| 第74期 | 863,160,241 | 426,215,728 | 4,938 | 50 | 0.50 |
| 第75期 | 830,810,166 | 402,130,122 | 4,840 | 50 | 0.50 |
| 第76期 | 807,781,029 | 436,858,079 | 5,408 | 50 | 0.50 |
| 第77期 | 757,026,079 | 401,409,240 | 5,302 | 50 | 0.50 |
| 第78期 | 735,264,428 | 391,625,140 | 5,326 | 50 | 0.50 |

## ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 豪ドル・コース（毎月分配型）

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第79期 | 730,883,821 | 379,192,923 | 5,188 | 50 | 0.50 |
| 第80期 | 724,812,090 | 305,276,719 | 4,212 | 50 | 0.50 |
| 第81期 | 725,781,253 | 275,658,042 | 3,798 | 50 | 0.50 |
| 第82期 | 727,614,924 | 281,430,474 | 3,868 | 50 | 0.50 |
| 第83期 | 720,362,788 | 338,927,958 | 4,705 | 50 | 0.50 |
| 第84期 | 718,238,382 | 323,827,038 | 4,509 | 50 | 0.50 |
| 第85期 | 712,318,475 | 314,676,657 | 4,418 | 50 | 0.50 |
| 第86期 | 714,057,559 | 328,979,169 | 4,607 | 50 | 0.50 |
| 第87期 | 714,572,691 | 319,951,311 | 4,478 | 50 | 0.50 |
| 第88期 | 706,915,961 | 311,065,753 | 4,400 | 50 | 0.50 |
| 第89期 | 698,145,090 | 326,136,144 | 4,671 | 50 | 0.50 |
| 第90期 | 699,668,692 | 346,368,349 | 4,950 | 50 | 0.50 |
| 第91期 | 687,158,654 | 344,890,616 | 5,019 | 50 | 0.50 |
| 第92期 | 667,355,103 | 337,978,106 | 5,064 | 50 | 0.50 |
| 第93期 | 656,899,366 | 343,295,741 | 5,226 | 50 | 0.50 |
| 第94期 | 650,247,786 | 338,146,977 | 5,200 | 50 | 0.50 |
| 第95期 | 651,492,717 | 338,720,994 | 5,199 | 50 | 0.50 |
| 第96期 | 653,477,154 | 325,087,428 | 4,975 | 50 | 0.50 |
| 第97期 | 655,524,457 | 312,942,728 | 4,774 | 50 | 0.50 |
| 第98期 | 645,963,849 | 316,718,937 | 4,903 | 50 | 0.50 |
| 第99期 | 648,577,389 | 298,864,990 | 4,608 | 50 | 0.50 |
| 第100期 | 643,291,679 | 316,718,166 | 4,923 | 50 | 0.50 |
| 第101期 | 631,028,007 | 290,501,941 | 4,604 | 50 | 0.50 |
| 第102期 | 630,102,489 | 299,059,819 | 4,746 | 50 | 0.50 |
| 第103期 | 624,894,089 | 285,810,652 | 4,574 | 50 | 0.50 |
| 第104期 | 611,069,388 | 271,867,338 | 4,449 | 50 | 0.50 |
| 第105期 | 592,300,260 | 302,471,390 | 5,107 | 50 | 0.50 |
| 第106期 | 592,590,160 | 305,119,567 | 5,149 | 50 | 0.50 |
| 第107期 | 593,531,838 | 321,322,695 | 5,414 | 50 | 0.50 |
| 第108期 | 589,108,813 | 288,855,198 | 4,903 | 50 | 0.50 |
| 第109期 | 560,010,936 | 280,425,391 | 5,007 | 50 | 0.50 |
| 第110期 | 558,403,406 | 285,362,411 | 5,110 | 50 | 0.50 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第111期 | 546,345,616 | 265,086,468 | 4,852 | 50 | 0.50 |
| 第112期 | 547,595,917 | 273,658,405 | 4,997 | 50 | 0.50 |
| 第113期 | 546,830,638 | 269,376,648 | 4,926 | 50 | 0.50 |
| 第114期 | 544,497,514 | 246,916,418 | 4,535 | 50 | 0.50 |
| 第115期 | 543,292,831 | 259,461,315 | 4,776 | 50 | 0.50 |
| 第116期 | 535,814,786 | 261,201,033 | 4,875 | 50 | 0.50 |
| 第117期 | 537,208,791 | 247,388,990 | 4,605 | 50 | 0.50 |
| 第118期 | 527,142,258 | 262,337,872 | 4,977 | 50 | 0.50 |

（注）1単位は受益権1万口。

| 収益分配金のお知らせ | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1万口当り分配金（税込み） | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
| | 50円 | 50円 | 50円 | 50円 | 50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。

| 償還金のお知らせ | |
|---|---|
| 1万口当り償還金 | 4,965円52銭 |

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

## ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）

## 最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | TOPIX（配当込み） | | ブラジル・レアル為替レート | | 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 | （参考指数） | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 90期末（2021年1月8日） | 2,173 | 25 | △ 1.9 | 19,770 | 3.9 | 19.22 | △ 5.6 | — | 99.3 | 1,320 |
| 91期末（2021年2月8日） | 2,239 | 25 | 4.2 | 20,471 | 3.5 | 19.62 | 2.1 | — | 98.4 | 1,337 |
| 92期末（2021年3月8日） | 2,120 | 25 | △ 4.2 | 20,535 | 0.3 | 19.06 | △ 2.9 | — | 98.1 | 1,250 |
| 93期末（2021年4月8日） | 2,244 | 25 | 7.0 | 21,490 | 4.7 | 19.5527 | 2.6 | — | 98.0 | 1,290 |
| 94期末（2021年5月10日） | 2,320 | 25 | 4.5 | 21,118 | △ 1.7 | 20.7642 | 6.2 | — | 98.2 | 1,312 |
| 95期末（2021年6月8日） | 2,421 | 25 | 5.4 | 21,438 | 1.5 | 21.6869 | 4.4 | — | 98.0 | 1,352 |
| 96期末（2021年7月8日） | 2,310 | 25 | △ 3.6 | 21,209 | △ 1.1 | 21.1296 | △ 2.6 | — | 98.0 | 1,270 |
| 97期末（2021年8月10日） | 2,266 | 25 | △ 0.8 | 21,120 | △ 0.4 | 21.0762 | △ 0.3 | — | 99.0 | 1,221 |
| 98期末（2021年9月8日） | 2,352 | 25 | 4.9 | 22,594 | 7.0 | 21.3284 | 1.2 | — | 98.5 | 1,243 |
| 99期末（2021年10月8日） | 2,100 | 25 | △ 9.7 | 21,406 | △ 5.3 | 20.2432 | △ 5.1 | — | 98.1 | 1,102 |
| 100期末（2021年11月8日） | 2,214 | 25 | 6.6 | 22,532 | 5.3 | 20.4947 | 1.2 | — | 99.2 | 1,140 |
| 101期末（2021年12月8日） | 2,128 | 25 | △ 2.8 | 21,970 | △ 2.5 | 20.2399 | △ 1.2 | — | 98.1 | 1,066 |
| 102期末（2022年1月11日） | 2,184 | 25 | 3.8 | 22,062 | 0.4 | 20.3372 | 0.5 | — | 99.5 | 1,067 |
| 103期末（2022年2月8日） | 2,278 | 25 | 5.4 | 21,294 | △ 3.5 | 21.9334 | 7.8 | — | 99.6 | 1,098 |
| 104期末（2022年3月8日） | 2,269 | 25 | 0.7 | 19,843 | △ 6.8 | 22.6496 | 3.3 | — | 97.5 | 1,094 |
| 105期末（2022年4月8日） | 2,711 | 25 | 20.6 | 21,169 | 6.7 | 26.0494 | 15.0 | — | 97.8 | 1,284 |
| 106期末（2022年5月9日） | 2,728 | 25 | 1.5 | 21,427 | 1.2 | 25.7450 | △ 1.2 | — | 98.3 | 1,270 |
| 107期末（2022年6月8日） | 2,912 | 25 | 7.7 | 21,796 | 1.7 | 27.2699 | 5.9 | — | 98.5 | 1,326 |
| 108期末（2022年7月8日） | 2,570 | 25 | △ 10.9 | 21,102 | △ 3.2 | 25.4681 | △ 6.6 | — | 97.5 | 1,148 |
| 109期末（2022年8月8日） | 2,699 | 25 | 6.0 | 21,830 | 3.5 | 26.1994 | 2.9 | — | 99.7 | 1,193 |
| 110期末（2022年9月8日） | 2,834 | 25 | 5.9 | 21,483 | △ 1.6 | 27.5004 | 5.0 | — | 99.1 | 1,245 |
| 111期末（2022年10月11日） | 2,857 | 25 | 1.7 | 21,610 | 0.6 | 28.0748 | 2.1 | — | 97.8 | 1,248 |
| 112期末（2022年11月8日） | 2,985 | 25 | 5.4 | 21,920 | 1.4 | 28.3741 | 1.1 | — | 97.5 | 1,291 |
| 113期末（2022年12月8日） | 2,810 | 25 | △ 5.0 | 22,090 | 0.8 | 26.1747 | △ 7.8 | — | 97.6 | 1,206 |
| 114期末（2023年1月10日） | 2,541 | 25 | △ 8.7 | 21,304 | △ 3.6 | 25.0685 | △ 4.2 | — | 96.8 | 1,096 |
| 115期末（2023年2月8日） | 2,701 | 25 | 7.3 | 22,528 | 5.7 | 25.1455 | 0.3 | — | 97.7 | 1,136 |
| 116期末（2023年3月8日） | 2,894 | 25 | 8.1 | 23,235 | 3.1 | 26.4499 | 5.2 | — | 99.5 | 1,207 |
| 117期末（2023年4月10日） | 2,800 | 25 | △ 2.4 | 22,595 | △ 2.8 | 26.2142 | △ 0.9 | — | 98.8 | 1,158 |
| 118期末（2023年5月8日） | 3,061 | 25 | 10.2 | 23,862 | 5.6 | 27.2817 | 4.1 | — | 10.1 | 1,247 |
| 償還（2023年6月8日） | 3,049.02 | — | △ 0.4 | 25,380 | 6.4 | 28.3992 | 4.1 | — | — | 1,225 |

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）TOPIX（配当込み）は、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。また、基準価額への反映を考慮して、1営業日前の日付の終値を採用しています。
（注3）為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。
（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。
※参考指数の「TOPIX」を「TOPIX（配当込み）」に変更しました。

# 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**

設定時：10,000円
償還時： 3,049円02銭（既払分配金9,250円）
騰落率：65.3%（分配金再投資ベース）

**■基準価額の主な変動要因**

日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略による運用と為替取引の結果、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。株式ポートフォリオ（配当込み）が上昇したことがプラス要因となりました。オプション取引に関してはマイナス要因となりました。為替取引（日本円売り／ブラジル・レアル買い）は、軽微な影響にとどまりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

## ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）

| | 年　月　日 | 基準価額 | | TOPIX（配当込み） | | ブラジル・レアル為替レート | | 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 | （参考指数） | 騰落率 | | |
| | | 円 | % | | % | 円 | % | % | % |
| 第114期 | （期首）2022年12月８日 | 2,810 | — | 22,090 | — | 26.1747 | — | — | 97.6 |
| | 12月末 | 2,616 | △ 6.9 | 21,525 | △ 2.6 | 25.0842 | △ 4.2 | — | 99.2 |
| | （期末）2023年１月10日 | 2,566 | △ 8.7 | 21,304 | △ 3.6 | 25.0685 | △ 4.2 | — | 96.8 |
| 第115期 | （期首）2023年１月10日 | 2,541 | — | 21,304 | — | 25.0685 | — | — | 96.8 |
| | １月末 | 2,745 | 8.0 | 22,516 | 5.7 | 25.4633 | 1.6 | — | 98.6 |
| | （期末）2023年２月８日 | 2,726 | 7.3 | 22,528 | 5.7 | 25.1455 | 0.3 | — | 97.7 |
| 第116期 | （期首）2023年２月８日 | 2,701 | — | 22,528 | — | 25.1455 | — | — | 97.7 |
| | ２月末 | 2,837 | 5.0 | 22,641 | 0.5 | 26.1997 | 4.2 | — | 98.3 |
| | （期末）2023年３月８日 | 2,919 | 8.1 | 23,235 | 3.1 | 26.4499 | 5.2 | — | 99.5 |
| 第117期 | （期首）2023年３月８日 | 2,894 | — | 23,235 | — | 26.4499 | — | — | 99.5 |
| | ３月末 | 2,855 | △ 1.3 | 22,801 | △ 1.9 | 26.1881 | △ 1.0 | — | 97.9 |
| | （期末）2023年４月10日 | 2,825 | △ 2.4 | 22,595 | △ 2.8 | 26.2142 | △ 0.9 | — | 98.8 |
| 第118期 | （期首）2023年４月10日 | 2,800 | — | 22,595 | — | 26.2142 | — | — | 98.8 |
| | ４月末 | 3,024 | 8.0 | 23,367 | 3.4 | 26.8611 | 2.5 | — | 97.9 |
| | （期末）2023年５月８日 | 3,086 | 10.2 | 23,862 | 5.6 | 27.2817 | 4.1 | — | 10.1 |
| 償還期 | （期首）2023年５月８日 | 3,061 | — | 23,862 | — | 27.2817 | — | — | 10.1 |
| | ５月末 | 3,050 | △ 0.4 | 24,826 | 4.0 | 27.7354 | 1.7 | — | 10.0 |
| | （償還）2023年６月８日 | 3,049.02 | △ 0.4 | 25,380 | 6.4 | 28.3992 | 4.1 | — | — |

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

### ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当ファンド設定時からアベノミクス相場を追い風に上昇し、2015年の中国・人民元切下げ、2016年の日銀のマイナス金利導入、中国経済への懸念などで調整した局面もあったものの、2017年末ごろまで上昇を続けました。しかし2018年に入ると、米国長期金利の上昇や米中通商問題の行方をにらみながら一進一退の展開となり、年末には中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、大きく下落しました。2019年には、ＦＲＢ議長が一転して引き締め方向にあった金融政策の軟化を示唆したことや、米中通商問題解決への期待が高まったこともあり、上昇しました。2020年には、国内外での新型コロナウイルスの感染拡大により大幅に下落する局面もありましたが、各国の積極的な金融政策や財政政策への期待から反発し、2021年も、新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済活動の再開が進んだことなどにより、上昇しました。2022年は、米国の金融引き締めに対する懸念の高まりから上値の重い展開で推移しました。2023年に入り、日銀新総裁就任後初の金融政策決定会合で金融緩和継続の方針が示されたことや、海外に比べて遅れていた経済正常化の動きが本格化したことなどにより、償還期末にかけて上昇しました。

### ■為替相場

ブラジル・レアルは対円で下落（円高）しました。

ブラジル・レアル対円為替相場は、当ファンド設定時から2014年にかけては方向感のない動きとなりましたが、2015年に入ると、ブラジルや中国などにおける景気悪化が懸念されたほか、ブラジル国内における汚職問題や政局不安などが悪材料となり、下落しました。2016年以降は、ブラジル国内における政権交代を受けた改革期待や原油価格の上昇が相場を下支えする場面もありましたが、米国金利の上昇を受けて新興国通貨への売り圧力が強まったほか、米中貿易摩擦に対する懸念が強まったことなどが悪材料となり、軟調な推移となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、円高ブラジル・レアル安が進行しました。2021年以降は、景気回復に伴いブラジル中央銀行が段階的に利上げを実施したことなどを受けて、ブラジル・レアルは上昇（円安）しました。また、資源価格の上昇もブラジル・レアルへのプラス材料となりました。

**■短期金利市況**

ブラジルの短期金利は、ブラジル中央銀行が、政策金利を段階的に8.00％から2.00％まで引き下げた後、段階的に13.75％まで引き上げました。一方、日本の短期金利は、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持し、低位で推移しました。

## 信託期間中の運用方針

**■当ファンド**

「クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資します。主として、「クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）」の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引（日本円売り／ブラジル・レアル買い）を行い、信託財産の成長をめざします。

※クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）：オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）

**■クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）**

1．主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

・投資対象銘柄は「ＴＯＰＩＸ100」構成銘柄から金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。

・ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。

・選定時における各銘柄の構成比率はおおむね均等とします。また、銘柄の見直しは約１カ月ごとに行います。

・個別銘柄ごとに、コール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。

2．為替取引を活用します。

日本円売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行います。

**■ダイワ・マネーストック・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。

## 信託期間中のポートフォリオについて （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

**■当ファンド**

当ファンドは、「クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズです。信託期間中は、「クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）」への投資割合を高位に維持することをめざしました。

**■クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）**

株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略のうち、クロッキーモデルによる銘柄選択効果がプラスに働き、株式ポートフォリオ（配当除く）はＴＯＰＩＸ100指数（配当除く）を上回るパフォーマンスとなりました。また、オプション取引はマイナス要因となりました。

円建ての資産に対して、日本円売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行いました。

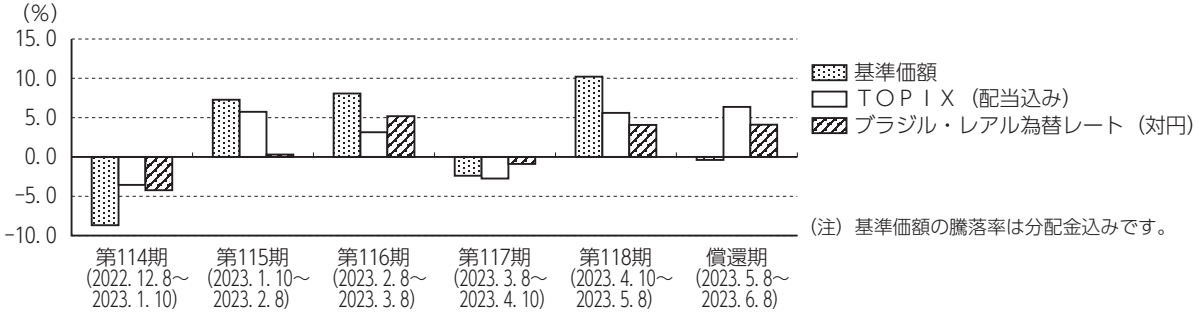
**■ダイワ・マネーストック・マザーファンド**

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・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、当作成期中における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。




（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

## 分配金について

１万口当り、第１期～第10期各100円、第11期～第34期各150円、第35期～第61期各100円、第62期～第67期各70円、第68期～第84期各40円、第85期～第118期各25円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（１万口当り）

| 項目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 2022年12月９日～2023年１月10日 | 2023年１月11日～2023年２月８日 | 2023年２月９日～2023年３月８日 | 2023年３月９日～2023年４月10日 | 2023年４月11日～2023年５月８日 |
| **当期分配金(税込み)(円)** | **25** | **25** | **25** | **25** | **25** |
| 対基準価額比率（%） | 0.97 | 0.92 | 0.86 | 0.88 | 0.81 |
| 当期の収益（円） | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 当期の収益以外（円） | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 1,389 | 1,413 | 1,435 | 1,455 | 1,491 |

（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ございません。

### ■収益分配金の計算過程（１万口当り）

| 項目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | ✓ 47.24円 | ✓ 48.55円 | ✓ 46.77円 | ✓ 45.50円 | ✓ 60.83円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| (c) 収益調整金 | 1,061.00 | 1,061.95 | 1,063.47 | 1,063.80 | 1,064.23 |
| (d) 分配準備積立金 | 306.48 | 327.83 | 349.92 | 371.37 | 391.45 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 1,414.73 | 1,438.35 | 1,460.17 | 1,480.68 | 1,516.51 |
| (f) 分配金 | 25.00 | 25.00 | 25.00 | 25.00 | 25.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e－f) | 1,389.73 | 1,413.35 | 1,435.17 | 1,455.68 | 1,491.51 |

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

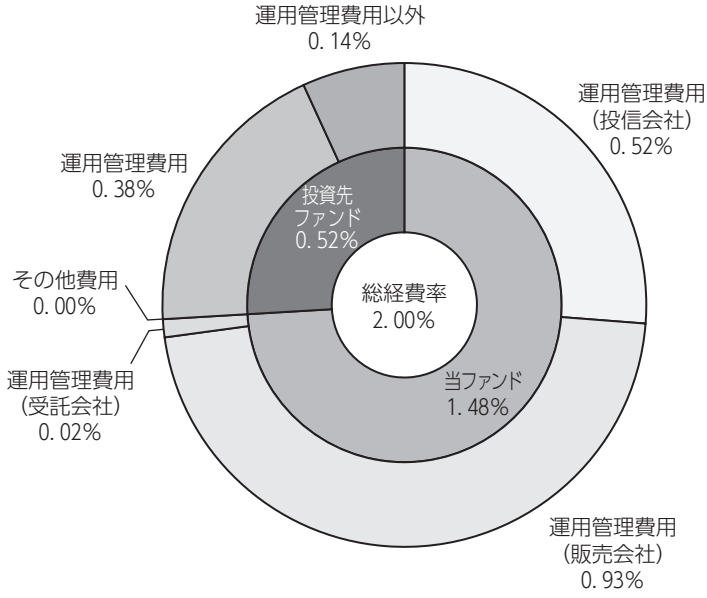
| 項　　目 | 第114期～償還期<br>(2022. 12. 9～2023. 6. 8) | | 項　目　の　概　要 |
|---|---|---|---|
| | 金　額 | 比　率 | |
| **信　託　報　酬** | 21円 | 0. 738% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>**当作成期中の平均基準価額は2, 830円です。** |
| （投 信 会 社） | (7) | (0. 261) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| （販 売 会 社） | (13) | (0. 464) | 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） | (0) | (0. 012) | 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<br>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<br>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** | — | — | 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 |
| **合　　計** | 21 | 0. 738 | |

（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2.00%です。




| 総経費率　（　①　＋　②　＋　③　） | 2.00% |
|---|---|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.48% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.38% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.14% |

（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、投資先ファンドの費用には、支払利息、担保付スワップに係る費用を含みません。
（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。

## ■売買および取引の状況

### (1) 投資信託受益証券

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 買付 | | 売付 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国（邦貨建） | 6,330.269857 | 160,918 | 50,240.249747 | 1,386,609 |

（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。

### (2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 設定 | | 解約 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | — | — | 398 | 398 |

（注）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12月９日から2023年６月８日まで）

| 第114期～償還期 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 |
| CROCI JAPAN STRATEGY FUND BRL CLASS（ケイマン諸島） | 2,038.874312 | 52,400 | 25 | CROCI JAPAN STRATEGY FUND BRL CLASS（ケイマン諸島） | 50,240.249747 | 1,386,609 | 27 |

（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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

### 親投資信託残高

| 種類 | 第113期末 |
|---|---|
| | □数 |
| | 千口 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | 398 |

（注）単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年６月８日現在

| 項目 | 償還時 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 1,227,039 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 1,227,039 | 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１月10日）、（2023年２月８日）、（2023年３月８日）、（2023年４月10日）、（2023年５月８日）、（2023年６月８日）現在

| 項　　目 | 第114期末 | 第115期末 | 第116期末 | 第117期末 | 第118期末 | 償還時 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）資産** | **1,119,419,706円** | **1,149,774,000円** | **1,219,645,912円** | **1,170,831,871円** | **2,366,918,922円** | **1,227,039,711円** |
| コール・ローン等 | 41,299,492 | 39,783,550 | 17,282,884 | 25,670,869 | 25,736,496 | 1,227,039,711 |
| 投資信託受益証券（評価額） | 1,061,721,332 | 1,109,591,567 | 1,201,964,145 | 1,144,669,124 | 125,789,484 | — |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド（評価額） | 398,883 | 398,883 | 398,883 | 398,883 | 398,883 | — |
| 未収入金 | 15,999,999 | — | — | — | 2,214,901,064 | — |
| その他未収収益 | — | — | — | 92,995 | 92,995 | — |
| **（B）負債** | **22,743,573** | **13,595,778** | **12,060,960** | **11,905,495** | **1,119,045,214** | **1,616,869** |
| 未払金 | 8,000,000 | — | — | — | 1,107,450,532 | — |
| 未払収益分配金 | 10,790,318 | 10,514,645 | 10,430,734 | 10,346,697 | 10,190,345 | — |
| 未払解約金 | 2,398,837 | 1,739,389 | 296,403 | — | — | 8,288 |
| 未払信託報酬 | 1,554,418 | 1,341,744 | 1,333,823 | 1,558,798 | 1,404,337 | 1,607,046 |
| 未払利息 | — | — | — | — | — | 1,535 |
| **（C）純資産総額（A－B）** | **1,096,676,133** | **1,136,178,222** | **1,207,584,952** | **1,158,926,376** | **1,247,873,708** | **1,225,422,842** |
| 元本 | 4,316,127,460 | 4,205,858,162 | 4,172,293,820 | 4,138,679,152 | 4,076,138,102 | 4,019,074,377 |
| 次期繰越損益金 | △ 3,219,451,327 | △ 3,069,679,940 | △ 2,964,708,868 | △ 2,979,752,776 | △ 2,828,264,394 | — |
| 償還差損益金 | — | — | — | — | — | △ 2,793,651,535 |
| **（D）受益権総口数** | **4,316,127,460口** | **4,205,858,162口** | **4,172,293,820口** | **4,138,679,152口** | **4,076,138,102口** | **4,019,074,377口** |
| **１万口当り基準価額（C／D）** | **2,541円** | **2,701円** | **2,894円** | **2,800円** | **3,061円** | **—** |
| **１万口当り償還価額（C／D）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **3,049円02銭** |

＊当作成期首における元本額は4,294,499,387円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は106,696,111円、同解約元本額は382,121,121円です。
＊償還時の計算口数当りの純資産額は3,049円02銭です。
＊償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,793,651,535円です。

## ■損益の状況

第114期　自 2022年12月９日　至 2023年１月10日　　第116期　自 2023年２月９日　至 2023年３月８日　　第118期　自 2023年４月11日　至 2023年５月８日
第115期　自 2023年１月11日　至 2023年２月８日　　第117期　自 2023年３月９日　至 2023年４月10日　　償 還 期　自 2023年５月９日　至 2023年６月８日

| 項　　目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 | 償還期 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）配当等収益** | **21,945,176円** | **20,772,848円** | **19,803,122円** | **20,391,156円** | **25,095,993円** | **△ 48,984円** |
| 受取配当金 | 21,945,921 | 20,773,247 | 19,803,465 | 20,298,354 | 25,096,698 | — |
| 受取利息 | 2 | 2 | — | — | — | 131 |
| その他収益金 | — | — | — | 92,995 | — | — |
| 支払利息 | △ 747 | △ 401 | △ 343 | △ 193 | △ 705 | △ 49,115 |
| **（B）有価証券売買損益** | **△ 125,275,910** | **58,519,448** | **72,317,942** | **△ 47,415,139** | **92,959,035** | **△ 3,325,193** |
| 売買益 | 576,024 | 59,463,120 | 72,515,649 | 700,108 | 93,924,396 | 42,282 |
| 売買損 | △ 125,851,934 | △ 943,672 | △ 197,707 | △ 48,115,247 | △ 965,361 | △ 3,367,475 |
| **（C）信託報酬等** | **△ 1,554,418** | **△ 1,341,744** | **△ 1,333,823** | **△ 1,558,798** | **△ 1,404,337** | **△ 1,607,046** |
| **（D）当期損益金（A＋B＋C）** | **△ 104,885,152** | **77,950,552** | **90,787,241** | **△ 28,582,781** | **116,650,691** | **△ 4,981,223** |
| **（E）前期繰越損益金** | **△ 2,135,532,492** | **△ 2,187,736,274** | **△ 2,094,608,140** | **△ 1,996,239,599** | **△ 2,002,244,511** | **△ 1,867,683,440** |
| **（F）追加信託差損益金** | **△ 968,243,365** | **△ 949,379,573** | **△ 950,457,235** | **△ 944,583,699** | **△ 932,480,229** | **△ 920,986,872** |
| （配当等相当額） | ( 457,944,778) | ( 446,644,249) | ( 443,713,015) | ( 440,275,525) | ( 433,795,318) | ( 427,865,799) |
| （売買損益相当額） | (△ 1,426,188,143) | (△ 1,396,023,822) | (△ 1,394,170,250) | (△ 1,384,859,224) | (△ 1,366,275,547) | (△ 1,348,852,671) |
| **（G）合計（D＋E＋F）** | **△ 3,208,661,009** | **△ 3,059,165,295** | **△ 2,954,278,134** | **△ 2,969,406,079** | **△ 2,818,074,049** | **△ 2,793,651,535** |
| **（H）収益分配金** | **△ 10,790,318** | **△ 10,514,645** | **△ 10,430,734** | **△ 10,346,697** | **△ 10,190,345** | **—** |
| **次期繰越損益金（G＋H）** | **△ 3,219,451,327** | **△ 3,069,679,940** | **△ 2,964,708,868** | **△ 2,979,752,776** | **△ 2,828,264,394** | **—** |
| 追加信託差損益金 | △ 968,243,365 | △ 949,379,573 | △ 950,457,235 | △ 944,583,699 | △ 932,480,229 | — |
| （配当等相当額） | ( 457,944,778) | ( 446,644,249) | ( 443,713,015) | ( 440,275,525) | ( 433,795,318) | ( —) |
| （売買損益相当額） | (△ 1,426,188,143) | (△ 1,396,023,822) | (△ 1,394,170,250) | (△ 1,384,859,224) | (△ 1,366,275,547) | ( —) |
| 分配準備積立金 | 141,884,572 | 147,790,875 | 155,085,669 | 162,184,510 | 174,167,798 | — |
| 繰越損益金 | △ 2,393,092,534 | △ 2,268,091,242 | △ 2,169,337,302 | △ 2,197,353,587 | △ 2,069,951,963 | — |
| **償還差損益金（G）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **△ 2,793,651,535** |

（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）第114期～第118期の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 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 20,390,744円 | 20,421,310円 | 19,516,349円 | 18,832,357円 | 24,797,422円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 457,944,778 | 446,644,249 | 443,713,015 | 440,275,525 | 433,795,318 |
| (d) 分配準備積立金 | 132,284,146 | 137,884,210 | 146,000,054 | 153,698,850 | 159,560,721 |
| (e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d） | 610,619,668 | 604,949,769 | 609,229,418 | 612,806,732 | 618,153,461 |
| (f) 分配金 | 10,790,318 | 10,514,645 | 10,430,734 | 10,346,697 | 10,190,345 |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e－f） | 599,829,350 | 594,435,124 | 598,798,684 | 602,460,035 | 607,963,116 |
| (h) 受益権総口数 | 4,316,127,460口 | 4,205,858,162口 | 4,172,293,820口 | 4,138,679,152口 | 4,076,138,102口 |

## 投　資　信　託　財　産　運　用　総　括　表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2013年6月19日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 投資信託契約終了日 | 2023年6月8日 | | 資産総額 | 1,227,039,711円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 1,616,869円 |
| | | | | 純資産総額 | 1,225,422,842円 |
| 受益権口数 | 13,124,892,429口 | 4,019,074,377口 | △9,105,818,052口 | 受益権口数 | 4,019,074,377口 |
| 元本額 | 13,124,892,429円 | 4,019,074,377円 | △9,105,818,052円 | 1単位当り償還金 | 3,049円02銭 |

毎計算期末の状況

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第1期 | 14,531,222,532 | 14,410,542,271 | 9,917 | 100 | 1.00 |
| 第2期 | 15,102,528,593 | 15,093,749,216 | 9,994 | 100 | 1.00 |
| 第3期 | 15,290,775,425 | 15,326,856,296 | 10,024 | 100 | 1.00 |
| 第4期 | 16,322,478,677 | 16,518,695,656 | 10,120 | 100 | 1.00 |
| 第5期 | 16,667,952,257 | 17,571,613,492 | 10,542 | 100 | 1.00 |
| 第6期 | 16,834,645,860 | 18,088,674,436 | 10,745 | 100 | 1.00 |
| 第7期 | 17,363,283,105 | 16,994,192,756 | 9,787 | 100 | 1.00 |
| 第8期 | 17,552,993,715 | 18,382,556,721 | 10,473 | 100 | 1.00 |
| 第9期 | 17,727,967,732 | 18,863,148,578 | 10,640 | 100 | 1.00 |
| 第10期 | 18,369,491,669 | 18,737,325,246 | 10,200 | 100 | 1.00 |
| 第11期 | 18,861,227,774 | 20,127,683,953 | 10,671 | 150 | 1.50 |
| 第12期 | 20,030,009,952 | 21,804,530,564 | 10,886 | 150 | 1.50 |
| 第13期 | 20,985,475,664 | 22,168,608,529 | 10,564 | 150 | 1.50 |
| 第14期 | 22,545,454,243 | 25,072,609,082 | 11,121 | 150 | 1.50 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第15期 | 24,587,687,257 | 26,224,064,010 | 10,666 | 150 | 1.50 |
| 第16期 | 25,575,705,488 | 27,326,164,189 | 10,684 | 150 | 1.50 |
| 第17期 | 25,879,520,982 | 29,388,924,582 | 11,356 | 150 | 1.50 |
| 第18期 | 25,818,620,886 | 26,191,185,044 | 10,144 | 150 | 1.50 |
| 第19期 | 26,402,772,848 | 26,838,488,476 | 10,165 | 150 | 1.50 |
| 第20期 | 27,275,406,481 | 26,918,609,741 | 9,869 | 150 | 1.50 |
| 第21期 | 27,419,394,583 | 26,376,512,112 | 9,620 | 150 | 1.50 |
| 第22期 | 27,442,931,973 | 26,270,602,644 | 9,573 | 150 | 1.50 |
| 第23期 | 27,293,022,442 | 27,402,969,324 | 10,040 | 150 | 1.50 |
| 第24期 | 26,887,749,888 | 25,244,019,787 | 9,389 | 150 | 1.50 |
| 第25期 | 26,260,664,558 | 22,536,219,631 | 8,582 | 150 | 1.50 |
| 第26期 | 25,992,318,372 | 16,572,073,314 | 6,376 | 150 | 1.50 |
| 第27期 | 25,484,461,504 | 16,630,349,740 | 6,526 | 150 | 1.50 |
| 第28期 | 25,325,606,867 | 17,320,117,584 | 6,839 | 150 | 1.50 |
| 第29期 | 24,796,455,396 | 17,382,459,007 | 7,010 | 150 | 1.50 |
| 第30期 | 24,731,244,227 | 13,941,484,208 | 5,637 | 150 | 1.50 |
| 第31期 | 24,048,991,732 | 12,824,056,881 | 5,332 | 150 | 1.50 |
| 第32期 | 23,812,105,086 | 12,878,237,635 | 5,408 | 150 | 1.50 |
| 第33期 | 23,318,421,959 | 11,157,880,929 | 4,785 | 150 | 1.50 |
| 第34期 | 23,138,272,103 | 11,579,326,953 | 5,004 | 150 | 1.50 |
| 第35期 | 23,123,850,126 | 12,191,379,587 | 5,272 | 100 | 1.00 |
| 第36期 | 22,607,024,438 | 10,587,206,918 | 4,683 | 100 | 1.00 |
| 第37期 | 22,210,583,294 | 11,554,814,522 | 5,202 | 100 | 1.00 |
| 第38期 | 21,771,313,502 | 11,874,580,617 | 5,454 | 100 | 1.00 |
| 第39期 | 20,924,293,830 | 11,596,284,939 | 5,542 | 100 | 1.00 |
| 第40期 | 20,253,787,154 | 11,475,401,409 | 5,666 | 100 | 1.00 |
| 第41期 | 19,392,038,953 | 11,822,893,087 | 6,097 | 100 | 1.00 |
| 第42期 | 19,273,922,820 | 13,125,033,381 | 6,810 | 100 | 1.00 |
| 第43期 | 18,556,766,604 | 12,188,205,100 | 6,568 | 100 | 1.00 |
| 第44期 | 17,810,334,714 | 12,081,152,152 | 6,783 | 100 | 1.00 |
| 第45期 | 17,015,632,286 | 10,853,444,985 | 6,379 | 100 | 1.00 |
| 第46期 | 16,656,662,259 | 10,815,634,276 | 6,493 | 100 | 1.00 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第47期 | 15,882,212,261 | 9,716,991,864 | 6,118 | 100 | 1.00 |
| 第48期 | 15,643,445,160 | 9,894,328,509 | 6,325 | 100 | 1.00 |
| 第49期 | 15,132,214,199 | 9,847,432,654 | 6,508 | 100 | 1.00 |
| 第50期 | 14,652,907,806 | 9,229,023,154 | 6,298 | 100 | 1.00 |
| 第51期 | 13,725,646,217 | 9,092,920,350 | 6,625 | 100 | 1.00 |
| 第52期 | 13,313,097,579 | 8,817,755,412 | 6,623 | 100 | 1.00 |
| 第53期 | 12,958,267,789 | 8,121,692,946 | 6,268 | 100 | 1.00 |
| 第54期 | 12,720,834,293 | 8,377,212,974 | 6,585 | 100 | 1.00 |
| 第55期 | 12,137,209,508 | 7,180,934,920 | 5,916 | 100 | 1.00 |
| 第56期 | 12,092,383,043 | 6,632,568,933 | 5,485 | 100 | 1.00 |
| 第57期 | 12,038,970,776 | 6,408,484,795 | 5,323 | 100 | 1.00 |
| 第58期 | 11,714,483,199 | 6,103,261,924 | 5,210 | 100 | 1.00 |
| 第59期 | 11,637,431,061 | 5,427,495,490 | 4,664 | 100 | 1.00 |
| 第60期 | 11,561,585,524 | 5,025,711,643 | 4,347 | 100 | 1.00 |
| 第61期 | 11,324,477,469 | 5,372,760,256 | 4,744 | 100 | 1.00 |
| 第62期 | 11,183,838,552 | 4,586,432,761 | 4,101 | 70 | 0.70 |
| 第63期 | 10,929,934,509 | 5,022,882,221 | 4,596 | 70 | 0.70 |
| 第64期 | 10,768,837,204 | 4,655,222,433 | 4,323 | 70 | 0.70 |
| 第65期 | 10,583,812,091 | 4,292,562,347 | 4,056 | 70 | 0.70 |
| 第66期 | 10,495,357,244 | 3,953,007,737 | 3,766 | 70 | 0.70 |
| 第67期 | 10,383,958,175 | 4,047,033,808 | 3,897 | 70 | 0.70 |
| 第68期 | 10,337,326,838 | 3,923,631,049 | 3,796 | 40 | 0.40 |
| 第69期 | 9,682,344,805 | 3,834,936,342 | 3,961 | 40 | 0.40 |
| 第70期 | 9,148,697,879 | 3,372,544,185 | 3,686 | 40 | 0.40 |
| 第71期 | 8,657,968,527 | 3,077,375,539 | 3,554 | 40 | 0.40 |
| 第72期 | 8,398,915,203 | 3,147,713,765 | 3,748 | 40 | 0.40 |
| 第73期 | 8,372,353,262 | 2,746,544,460 | 3,280 | 40 | 0.40 |
| 第74期 | 8,110,089,312 | 2,685,289,637 | 3,311 | 40 | 0.40 |
| 第75期 | 7,784,677,474 | 2,565,120,223 | 3,295 | 40 | 0.40 |
| 第76期 | 7,469,810,818 | 2,683,159,293 | 3,592 | 40 | 0.40 |
| 第77期 | 7,332,364,687 | 2,549,993,237 | 3,478 | 40 | 0.40 |
| 第78期 | 7,143,411,018 | 2,530,827,598 | 3,543 | 40 | 0.40 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第79期 | 6,877,262,573 | 2,308,479,972 | 3,357 | 40 | 0.40 |
| 第80期 | 6,833,783,804 | 1,720,377,028 | 2,517 | 40 | 0.40 |
| 第81期 | 6,785,962,229 | 1,435,751,582 | 2,116 | 40 | 0.40 |
| 第82期 | 6,719,322,785 | 1,218,260,757 | 1,813 | 40 | 0.40 |
| 第83期 | 6,691,139,834 | 1,639,795,666 | 2,451 | 40 | 0.40 |
| 第84期 | 6,664,681,066 | 1,454,303,857 | 2,182 | 40 | 0.40 |
| 第85期 | 6,674,230,524 | 1,367,337,331 | 2,049 | 25 | 0.25 |
| 第86期 | 6,493,420,824 | 1,415,396,442 | 2,180 | 25 | 0.25 |
| 第87期 | 6,414,408,358 | 1,301,901,814 | 2,030 | 25 | 0.25 |
| 第88期 | 6,389,183,428 | 1,280,101,388 | 2,004 | 25 | 0.25 |
| 第89期 | 6,249,527,333 | 1,400,258,639 | 2,241 | 25 | 0.25 |
| 第90期 | 6,076,139,592 | 1,320,414,710 | 2,173 | 25 | 0.25 |
| 第91期 | 5,973,900,410 | 1,337,828,697 | 2,239 | 25 | 0.25 |
| 第92期 | 5,898,631,402 | 1,250,596,200 | 2,120 | 25 | 0.25 |
| 第93期 | 5,750,330,135 | 1,290,651,946 | 2,244 | 25 | 0.25 |
| 第94期 | 5,659,922,114 | 1,312,845,012 | 2,320 | 25 | 0.25 |
| 第95期 | 5,583,957,309 | 1,352,010,657 | 2,421 | 25 | 0.25 |
| 第96期 | 5,498,860,358 | 1,270,465,653 | 2,310 | 25 | 0.25 |
| 第97期 | 5,393,677,376 | 1,221,994,856 | 2,266 | 25 | 0.25 |
| 第98期 | 5,287,352,094 | 1,243,426,587 | 2,352 | 25 | 0.25 |
| 第99期 | 5,251,394,032 | 1,102,592,858 | 2,100 | 25 | 0.25 |
| 第100期 | 5,151,480,838 | 1,140,613,893 | 2,214 | 25 | 0.25 |
| 第101期 | 5,010,976,864 | 1,066,460,902 | 2,128 | 25 | 0.25 |
| 第102期 | 4,888,965,839 | 1,067,808,614 | 2,184 | 25 | 0.25 |
| 第103期 | 4,823,699,679 | 1,098,977,397 | 2,278 | 25 | 0.25 |
| 第104期 | 4,820,996,942 | 1,094,096,749 | 2,269 | 25 | 0.25 |
| 第105期 | 4,739,170,869 | 1,284,814,061 | 2,711 | 25 | 0.25 |
| 第106期 | 4,656,582,208 | 1,270,470,320 | 2,728 | 25 | 0.25 |
| 第107期 | 4,555,825,507 | 1,326,792,983 | 2,912 | 25 | 0.25 |
| 第108期 | 4,469,981,225 | 1,148,857,154 | 2,570 | 25 | 0.25 |
| 第109期 | 4,420,519,224 | 1,193,130,625 | 2,699 | 25 | 0.25 |
| 第110期 | 4,395,485,858 | 1,245,690,436 | 2,834 | 25 | 0.25 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第111期 | 4,371,149,486 | 1,248,890,656 | 2,857 | 25 | 0.25 |
| 第112期 | 4,324,731,496 | 1,291,102,278 | 2,985 | 25 | 0.25 |
| 第113期 | 4,294,499,387 | 1,206,860,052 | 2,810 | 25 | 0.25 |
| 第114期 | 4,316,127,460 | 1,096,676,133 | 2,541 | 25 | 0.25 |
| 第115期 | 4,205,858,162 | 1,136,178,222 | 2,701 | 25 | 0.25 |
| 第116期 | 4,172,293,820 | 1,207,584,952 | 2,894 | 25 | 0.25 |
| 第117期 | 4,138,679,152 | 1,158,926,376 | 2,800 | 25 | 0.25 |
| 第118期 | 4,076,138,102 | 1,247,873,708 | 3,061 | 25 | 0.25 |

（注）1単位は受益権1万口。

| 収益分配金のお知らせ | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1万口当り分配金（税込み） | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
| | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25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。

| 償還金のお知らせ | |
|---|---|
| 1万口当り償還金 | 3,049円02銭 |

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

## 米ドル・コース（毎月分配型）

### 最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | TOPIX（配当込み） | | 米ドル為替レート | | 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 | （参考指数） | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 90期末（2021年1月8日） | 8,563 | 60 | 4.0 | 19,770 | 3.9 | 103.85 | △ 0.2 | — | 98.0 | 2,069 |
| 91期末（2021年2月8日） | 8,835 | 60 | 3.9 | 20,471 | 3.5 | 105.54 | 1.6 | — | 99.3 | 2,071 |
| 92期末（2021年3月8日） | 8,934 | 60 | 1.8 | 20,535 | 0.3 | 108.37 | 2.7 | — | 99.6 | 2,062 |
| 93期末（2021年4月8日） | 9,312 | 60 | 4.9 | 21,490 | 4.7 | 109.83 | 1.3 | — | 98.8 | 2,080 |
| 94期末（2021年5月10日） | 9,053 | 60 | △ 2.1 | 21,118 | △ 1.7 | 108.77 | △ 1.0 | — | 98.1 | 2,015 |
| 95期末（2021年6月8日） | 9,199 | 60 | 2.3 | 21,438 | 1.5 | 109.45 | 0.6 | — | 99.0 | 2,008 |
| 96期末（2021年7月8日） | 9,161 | 60 | 0.2 | 21,209 | △ 1.1 | 110.58 | 1.0 | — | 98.7 | 1,977 |
| 97期末（2021年8月10日） | 8,971 | 60 | △ 1.4 | 21,120 | △ 0.4 | 110.36 | △ 0.2 | — | 98.1 | 1,924 |
| 98期末（2021年9月8日） | 9,241 | 60 | 3.7 | 22,594 | 7.0 | 110.27 | △ 0.1 | — | 98.1 | 1,813 |
| 99期末（2021年10月8日） | 8,790 | 60 | △ 4.2 | 21,406 | △ 5.3 | 111.73 | 1.3 | — | 99.0 | 1,722 |
| 100期末（2021年11月8日） | 9,343 | 60 | 7.0 | 22,532 | 5.3 | 113.62 | 1.7 | — | 98.9 | 1,814 |
| 101期末（2021年12月8日） | 9,137 | 60 | △ 1.6 | 21,970 | △ 2.5 | 113.57 | △ 0.0 | — | 98.7 | 1,731 |
| 102期末（2022年1月11日） | 9,407 | 60 | 3.6 | 22,062 | 0.4 | 115.34 | 1.6 | — | 99.8 | 1,778 |
| 103期末（2022年2月8日） | 9,169 | 60 | △ 1.9 | 21,294 | △ 3.5 | 115.30 | △ 0.0 | — | 99.4 | 1,711 |
| 104期末（2022年3月8日） | 8,687 | 60 | △ 4.6 | 19,843 | △ 6.8 | 115.49 | 0.2 | — | 97.4 | 1,621 |
| 105期末（2022年4月8日） | 9,890 | 60 | 14.5 | 21,169 | 6.7 | 123.79 | 7.2 | — | 97.5 | 1,827 |
| 106期末（2022年5月9日） | 10,523 | 60 | 7.0 | 21,427 | 1.2 | 130.78 | 5.6 | — | 99.6 | 1,910 |
| 107期末（2022年6月8日） | 10,837 | 60 | 3.6 | 21,796 | 1.7 | 132.81 | 1.6 | — | 99.6 | 1,909 |
| 108期末（2022年7月8日） | 10,447 | 60 | △ 3.0 | 21,102 | △ 3.2 | 136.06 | 2.4 | — | 97.6 | 1,754 |
| 109期末（2022年8月8日） | 10,590 | 60 | 1.9 | 21,830 | 3.5 | 135.34 | △ 0.5 | — | 98.6 | 1,772 |
| 110期末（2022年9月8日） | 11,176 | 60 | 6.1 | 21,483 | △ 1.6 | 144.48 | 6.8 | — | 98.2 | 1,833 |
| 111期末（2022年10月11日） | 11,170 | 60 | 0.5 | 21,610 | 0.6 | 145.77 | 0.9 | — | 97.8 | 1,807 |
| 112期末（2022年11月8日） | 11,471 | 60 | 3.2 | 21,920 | 1.4 | 146.55 | 0.5 | — | 98.5 | 1,855 |
| 113期末（2022年12月8日） | 10,961 | 60 | △ 3.9 | 22,090 | 0.8 | 136.57 | △ 6.8 | — | 99.0 | 1,774 |
| 114期末（2023年1月10日） | 9,991 | 60 | △ 8.3 | 21,304 | △ 3.6 | 131.85 | △ 3.5 | — | 98.2 | 1,568 |
| 115期末（2023年2月8日） | 10,483 | 60 | 5.5 | 22,528 | 5.7 | 130.93 | △ 0.7 | — | 97.7 | 1,612 |
| 116期末（2023年3月8日） | 11,235 | 60 | 7.7 | 23,235 | 3.1 | 137.35 | 4.9 | — | 99.0 | 1,717 |
| 117期末（2023年4月10日） | 10,585 | 60 | △ 5.3 | 22,595 | △ 2.8 | 132.62 | △ 3.4 | — | 99.2 | 1,575 |
| 118期末（2023年5月8日） | 11,529 | 60 | 9.5 | 23,862 | 5.6 | 135.14 | 1.9 | — | 10.0 | 1,660 |
| 償還（2023年6月8日） | 11,497.39 | — | △ 0.3 | 25,380 | 6.4 | 140.00 | 3.6 | — | — | 1,543 |

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）TOPIX（配当込み）は、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。また、基準価額への反映を考慮して、1営業日前の日付の終値を採用しています。
（注3）為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。
（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。
※参考指数の「TOPIX」を「TOPIX（配当込み）」に変更しました。

# 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**

設定時：10,000円
償還時：11,497円39銭（既払分配金7,080円）
騰落率：134.2%（分配金再投資ベース）

**■基準価額の主な変動要因**

日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略による運用と為替取引の結果、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。株式ポートフォリオ（配当込み）が上昇したこと、および為替取引（日本円売り／米ドル買い）がプラス要因となりました。オプション取引に関してはマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

## ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 米ドル・コース（毎月分配型）

| | 年　月　日 | 基準価額 | | TOPIX（配当込み） | | 米ドル為替レート | | 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 | （参考指数） | 騰落率 | | |
| | | 円 | % | | % | 円 | % | % | % |
| 第114期 | （期首）2022年12月８日 | 10,961 | — | 22,090 | — | 136.57 | — | — | 99.0 |
| | 12月末 | 10,232 | △ 6.7 | 21,525 | △ 2.6 | 132.70 | △ 2.8 | — | 97.6 |
| | （期末）2023年１月10日 | 10,051 | △ 8.3 | 21,304 | △ 3.6 | 131.85 | △ 3.5 | — | 98.2 |
| 第115期 | （期首）2023年１月10日 | 9,991 | — | 21,304 | — | 131.85 | — | — | 98.2 |
| | １月末 | 10,432 | 4.4 | 22,516 | 5.7 | 130.47 | △ 1.0 | — | 98.8 |
| | （期末）2023年２月８日 | 10,543 | 5.5 | 22,528 | 5.7 | 130.93 | △ 0.7 | — | 97.7 |
| 第116期 | （期首）2023年２月８日 | 10,483 | — | 22,528 | — | 130.93 | — | — | 97.7 |
| | ２月末 | 10,984 | 4.8 | 22,641 | 0.5 | 136.33 | 4.1 | — | 98.2 |
| | （期末）2023年３月８日 | 11,295 | 7.7 | 23,235 | 3.1 | 137.35 | 4.9 | — | 99.0 |
| 第117期 | （期首）2023年３月８日 | 11,235 | — | 23,235 | — | 137.35 | — | — | 99.0 |
| | ３月末 | 10,915 | △ 2.8 | 22,801 | △ 1.9 | 133.53 | △ 2.8 | — | 98.3 |
| | （期末）2023年４月10日 | 10,645 | △ 5.3 | 22,595 | △ 2.8 | 132.62 | △ 3.4 | — | 99.2 |
| 第118期 | （期首）2023年４月10日 | 10,585 | — | 22,595 | — | 132.62 | — | — | 99.2 |
| | ４月末 | 11,281 | 6.6 | 23,367 | 3.4 | 134.13 | 1.1 | — | 97.7 |
| | （期末）2023年５月８日 | 11,589 | 9.5 | 23,862 | 5.6 | 135.14 | 1.9 | — | 10.0 |
| 償還期 | （期首）2023年５月８日 | 11,529 | — | 23,862 | — | 135.14 | — | — | 10.0 |
| | ５月末 | 11,501 | △ 0.2 | 24,826 | 4.0 | 139.77 | 3.4 | — | 10.4 |
| | （償還）2023年６月８日 | 11,497.39 | △ 0.3 | 25,380 | 6.4 | 140.00 | 3.6 | — | — |

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

### ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当ファンド設定時からアベノミクス相場を追い風に上昇し、2015年の中国・人民元切下げ、2016年の日銀のマイナス金利導入、中国経済への懸念などで調整した局面もあったものの、2017年末ごろまで上昇を続けました。しかし2018年に入ると、米国長期金利の上昇や米中通商問題の行方をにらみながら一進一退の展開となり、年末には中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、大きく下落しました。2019年には、ＦＲＢ議長が一転して引き締め方向にあった金融政策の軟化を示唆したことや、米中通商問題解決への期待が高まったこともあり、上昇しました。2020年には、国内外での新型コロナウイルスの感染拡大により大幅に下落する局面もありましたが、各国の積極的な金融政策や財政政策への期待から反発し、2021年も、新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済活動の再開が進んだことなどにより、上昇しました。2022年は、米国の金融引き締めに対する懸念の高まりから上値の重い展開で推移しました。2023年に入り、日銀新総裁就任後初の金融政策決定会合で金融緩和継続の方針が示されたことや、海外に比べて遅れていた経済正常化の動きが本格化したことなどにより、償還期末にかけて上昇しました。

### ■為替相場

米ドルは対円で上昇（円安）しました。

米ドル対円為替相場は、当ファンド設定時から2015年中ごろにかけて、日銀の量的・質的金融緩和政策の拡大などが材料視され、円安米ドル高が進行しました。2015年中ごろから2019年末にかけては、日銀のマイナス金利導入発表に加え、英国のＥＵ（欧州連合）離脱や米中貿易摩擦を背景にリスク回避の動きが広まったことから、米ドルは対円で下落（円高）しました。2019年末以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大からリスク回避の動きが広まり、円買いの動きから円高米ドル安基調で推移しました。しかし2021年に入ってからは、米国では金融政策正常化が意識されたことから米国金利が上昇した一方で、日銀は断続的に金利上昇を抑制する姿勢を示したことから、日米の金融政策の相違が意識され、円安米ドル高が急速に進行しました。2022年９月以降は、米国金利の利上げペース減速観測や、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことなどから円高が進み、米ドルは対円で下落しました。2023年以降は、日銀が金融緩和政策の維持を決定したことなどから日米金利差が意識され、円安が進みました。

**■短期金利市況**

米国の短期金利は、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）がＦＯＭＣ（米国連邦公開市場委員会）で、政策金利の誘導目標レンジを段階的に0.00～0.25％から5.00～5.25％に引き上げました。一方、日本の短期金利は、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持し、低位で推移しました。

## 信託期間中の運用方針

**■当ファンド**

「クロッキーファンド（米ドル・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資します。主として、「クロッキーファンド（米ドル・クラス）」の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引（日本円売り／米ドル買い）を行い、信託財産の成長をめざします。

※クロッキーファンド（米ドル・クラス）：オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）

**■クロッキーファンド（米ドル・クラス）**

1．主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

・投資対象銘柄は「ＴＯＰＩＸ100」構成銘柄から金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。

・ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。

・選定時における各銘柄の構成比率はおおむね均等とします。また、銘柄の見直しは約１カ月ごとに行います。

・個別銘柄ごとに、コール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。

2．為替取引を活用します。

日本円売り／米ドル買いの為替取引を行います。

**■ダイワ・マネーストック・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。

## 信託期間中のポートフォリオについて （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

**■当ファンド**

当ファンドは、「クロッキーファンド（米ドル・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズです。信託期間中は、「クロッキーファンド（米ドル・クラス）」への投資割合を高位に維持することをめざしました。

**■クロッキーファンド（米ドル・クラス）**

株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略のうち、クロッキーモデルによる銘柄選択効果がプラスに働き、株式ポートフォリオ（配当除く）はＴＯＰＩＸ100指数（配当除く）を上回るパフォーマンスとなりました。また、オプション取引はマイナス要因となりました。

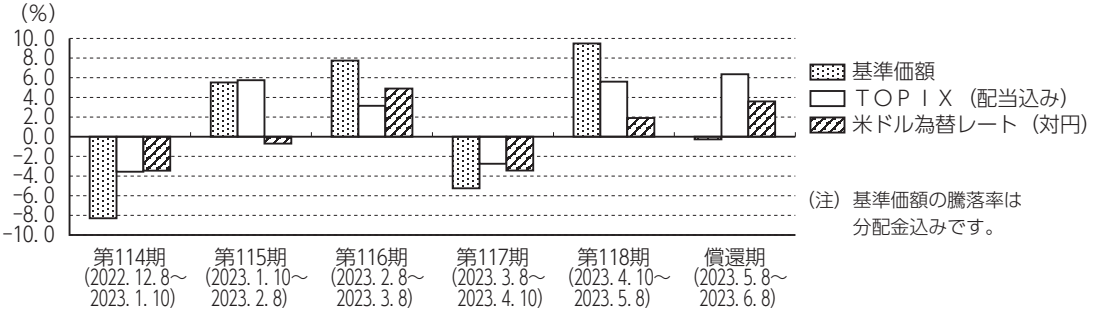
円建ての資産に対して、日本円売り／米ドル買いの為替取引を行いました。

**■ダイワ・マネーストック・マザーファンド**

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・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、当作成期中における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

１万口当り、第１期～第118期各60円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（１万口当り）

| 項目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 2022年12月９日～2023年１月10日 | 2023年１月11日～2023年２月８日 | 2023年２月９日～2023年３月８日 | 2023年３月９日～2023年４月10日 | 2023年４月11日～2023年５月８日 |
| **当期分配金(税込み)（円）** | **60** | **60** | **60** | **60** | **60** |
| 対基準価額比率（％） | 0.60 | 0.57 | 0.53 | 0.56 | 0.52 |
| 当期の収益（円） | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 |
| 当期の収益以外（円） | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 6,514 | 6,578 | 6,639 | 6,691 | 6,803 |

（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ございません。

### ■収益分配金の計算過程（１万口当り）

| 項目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| （a）経費控除後の配当等収益 | ✓ 113.75円 | ✓ 123.66円 | ✓ 121.43円 | ✓ 111.46円 | ✓ 171.77円 |
| （b）経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| （c）収益調整金 | 2,230.77 | 2,237.36 | 2,243.66 | 2,249.30 | 2,255.02 |
| （d）分配準備積立金 | 4,230.25 | 4,277.42 | 4,334.80 | 4,390.59 | 4,436.33 |
| （e）当期分配対象額（a+b+c+d） | 6,574.78 | 6,638.45 | 6,699.89 | 6,751.36 | 6,863.13 |
| （f）分配金 | 60.00 | 60.00 | 60.00 | 60.00 | 60.00 |
| （g）翌期繰越分配対象額（e－f） | 6,514.78 | 6,578.45 | 6,639.89 | 6,691.36 | 6,803.13 |

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

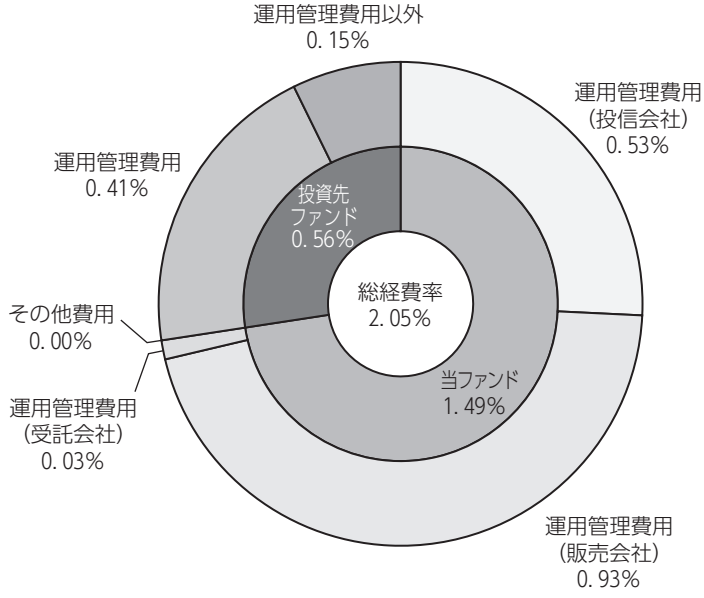
| 項　　目 | 第114期～償還期<br>(2022. 12. 9～2023. 6. 8) | | 項　目　の　概　要 |
|---|---|---|---|
| | 金　額 | 比　率 | |
| **信　託　報　酬** | 80円 | 0. 741% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>**当作成期中の平均基準価額は10, 843円です。** |
| （投 信 会 社） | (28) | (0. 263) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| （販 売 会 社） | (50) | (0. 465) | 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） | (1) | (0. 013) | 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<br>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<br>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** | ― | ― | 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 |
| **合　　計** | 80 | 0. 741 | |

（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2.05%です。




| 総経費率　（　①　＋　②　＋　③　） | 2.05% |
|---|---|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.49% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.41% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.15% |

（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、投資先ファンドの費用には、支払利息、担保付スワップに係る費用を含みません。
（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。

## ■売買および取引の状況

### (1) 投資信託受益証券

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 買付 | | 売付 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国（邦貨建） | 1,295.715394 | 102,482 | 22,233.976467 | 1,890,242 |

（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。

### (2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 設定 | | 解約 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | — | — | 398 | 398 |

（注）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12月９日から2023年６月８日まで）

| 第114期～償還期 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 |
| | | | | CROCI JAPAN STRATEGY FUND USD CLASS（ケイマン諸島） | 22,233.976467 | 1,890,242 | 85 |

（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

**最終期末における有価証券等の組み入れはありません。**

### 親投資信託残高

| 種類 | 第113期末 |
|---|---|
| | □数 |
| | 千口 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | 398 |

（注）単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年６月８日現在

| 項目 | 償還時 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 1,545,941 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 1,545,941 | 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１月10日）、（2023年２月８日）、（2023年３月８日）、（2023年４月10日）、（2023年５月８日）、（2023年６月８日）現在

| 項　　目 | 第114期末 | 第115期末 | 第116期末 | 第117期末 | 第118期末 | 償還時 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）資産** | **1,579,878,687円** | **1,703,336,783円** | **1,728,365,896円** | **1,587,061,272円** | **3,136,424,930円** | **1,545,941,479円** |
| コール・ローン等 | 39,494,989 | 20,769,700 | 27,439,444 | 22,762,275 | 38,640,761 | 1,545,941,479 |
| 投資信託受益証券（評価額） | 1,539,984,815 | 1,574,368,201 | 1,700,527,569 | 1,563,680,693 | 166,445,006 | — |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド（評価額） | 398,883 | 398,883 | 398,883 | 398,883 | 398,883 | — |
| 未収入金 | — | 107,799,999 | — | — | 2,930,720,859 | — |
| その他未収収益 | — | — | — | 219,421 | 219,421 | — |
| **（B）負債** | **11,660,598** | **91,244,948** | **11,067,141** | **11,115,532** | **1,475,863,343** | **2,905,662** |
| 未払金 | — | 53,900,000 | — | — | 1,465,360,430 | — |
| 未払収益分配金 | 9,417,859 | 9,226,822 | 9,170,811 | 8,932,970 | 8,641,941 | — |
| 未払解約金 | 98 | 26,228,824 | 1,111 | — | — | 836,690 |
| 未払信託報酬 | 2,242,641 | 1,889,302 | 1,895,219 | 2,182,562 | 1,860,972 | 2,067,038 |
| 未払利息 | — | — | — | — | — | 1,934 |
| **（C）純資産総額（A－B）** | **1,568,218,089** | **1,612,091,835** | **1,717,298,755** | **1,575,945,740** | **1,660,561,587** | **1,543,035,817** |
| 元本 | 1,569,643,283 | 1,537,803,696 | 1,528,468,585 | 1,488,828,387 | 1,440,323,523 | 1,342,074,714 |
| 次期繰越損益金 | △ 1,425,194 | 74,288,139 | 188,830,170 | 87,117,353 | 220,238,064 | — |
| 償還差損益金 | — | — | — | — | — | 200,961,103 |
| **（D）受益権総口数** | **1,569,643,283口** | **1,537,803,696口** | **1,528,468,585口** | **1,488,828,387口** | **1,440,323,523口** | **1,342,074,714口** |
| **１万口当り基準価額（C／D）** | **9,991円** | **10,483円** | **11,235円** | **10,585円** | **11,529円** | **—** |
| **１万口当り償還価額（C／D）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **11,497円39銭** |

＊当作成期首における元本額は1,619,030,943円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は12,848,523円、同解約元本額は289,804,752円です。
＊償還時の計算口数当りの純資産額は11,497円39銭です。

## ■損益の状況

第114期　自 2022年12月９日　至 2023年１月10日　　第116期　自 2023年２月９日　至 2023年３月８日　　第118期　自 2023年４月11日　至 2023年５月８日
第115期　自 2023年１月11日　至 2023年２月８日　　第117期　自 2023年３月９日　至 2023年４月10日　　償還期　自 2023年５月９日　至 2023年６月８日

| 項　　目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 | 償還期 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）配当等収益** | **20,097,512円** | **19,440,695円** | **18,843,598円** | **18,777,723円** | **25,060,196円** | △ **62,055円** |
| 受取配当金 | 20,098,983 | 19,441,120 | 18,844,094 | 18,559,377 | 25,061,218 | — |
| 受取利息 | 10 | 2 | — | 1 | — | 1,005 |
| その他収益金 | — | — | — | 218,708 | — | — |
| 支払利息 | △ 1,481 | △ 427 | △ 496 | △ 363 | △ 1,022 | △ 63,060 |
| **（B）有価証券売買損益** | △ **160,729,322** | **67,357,435** | **107,209,340** | △ **104,477,726** | **121,401,670** | △ **2,124,760** |
| 売買益 | 90,615 | 68,664,745 | 107,284,857 | 1,805,976 | 123,751,349 | 154,202 |
| 売買損 | △ 160,819,937 | △ 1,307,310 | △ 75,517 | △ 106,283,702 | △ 2,349,679 | △ 2,278,962 |
| **（C）信託報酬等** | △ **2,242,641** | △ **1,889,302** | △ **1,895,219** | △ **2,182,562** | △ **1,860,972** | △ **2,067,038** |
| **（D）当期損益金（A＋B＋C）** | △ **142,874,451** | **84,908,828** | **124,157,719** | △ **87,882,565** | **144,600,894** | △ **4,253,853** |
| **（E）前期繰越損益金** | **44,366,796** | △ **105,573,695** | △ **29,667,227** | **83,000,330** | △ **13,347,888** | **114,111,690** |
| **（F）追加信託差損益金** | **106,500,320** | **104,179,828** | **103,510,489** | **100,932,558** | **97,626,999** | **91,103,266** |
| （配当等相当額） | ( 350,152,330) | ( 344,063,444) | ( 342,936,467) | ( 334,882,270) | ( 324,796,818) | ( 303,366,503) |
| （売買損益相当額） | (△ 243,652,010) | (△ 239,883,616) | (△ 239,425,978) | (△ 233,949,712) | (△ 227,169,819) | (△ 212,263,237) |
| **（G）合計（D＋E＋F）** | **7,992,665** | **83,514,961** | **198,000,981** | **96,050,323** | **228,880,005** | **200,961,103** |
| **（H）収益分配金** | △ **9,417,859** | △ **9,226,822** | △ **9,170,811** | △ **8,932,970** | △ **8,641,941** | **—** |
| **次期繰越損益金（G＋H）** | △ **1,425,194** | **74,288,139** | **188,830,170** | **87,117,353** | **220,238,064** | **—** |
| 追加信託差損益金 | 106,500,320 | 104,179,828 | 103,510,489 | 100,932,558 | 97,626,999 | — |
| （配当等相当額） | ( 350,152,330) | ( 344,063,444) | ( 342,936,467) | ( 334,882,270) | ( 324,796,818) | ( —) |
| （売買損益相当額） | (△ 243,652,010) | (△ 239,883,616) | (△ 239,425,978) | (△ 233,949,712) | (△ 227,169,819) | ( —) |
| 分配準備積立金 | 672,436,758 | 667,574,247 | 671,950,745 | 661,346,463 | 655,075,392 | — |
| 繰越損益金 | △ 780,362,272 | △ 697,465,936 | △ 586,631,064 | △ 675,161,668 | △ 532,464,327 | — |
| **償還差損益金（G）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **200,961,103** |

（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）第114期～第118期の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 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 17,854,858円 | 19,017,490円 | 18,560,262円 | 16,595,160円 | 24,741,775円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 350,152,330 | 344,063,444 | 342,936,467 | 334,882,270 | 324,796,818 |
| (d) 分配準備積立金 | 663,999,759 | 657,783,579 | 662,561,294 | 653,684,273 | 638,975,558 |
| (e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d） | 1,032,006,947 | 1,020,864,513 | 1,024,058,023 | 1,005,161,703 | 988,514,151 |
| (f) 分配金 | 9,417,859 | 9,226,822 | 9,170,811 | 8,932,970 | 8,641,941 |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e－f） | 1,022,589,088 | 1,011,637,691 | 1,014,887,212 | 996,228,733 | 979,872,210 |
| (h) 受益権総口数 | 1,569,643,283口 | 1,537,803,696口 | 1,528,468,585口 | 1,488,828,387口 | 1,440,323,523口 |

## 投　資　信　託　財　産　運　用　総　括　表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2013年6月19日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 投資信託契約終了日 | 2023年6月8日 | | 資産総額 | 1,545,941,479円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 2,905,662円 |
| | | | | 純資産総額 | 1,543,035,817円 |
| 受益権口数 | 8,670,801,322口 | 1,342,074,714口 | △7,328,726,608口 | 受益権口数 | 1,342,074,714口 |
| 元本額 | 8,670,801,322円 | 1,342,074,714円 | △7,328,726,608円 | 1単位当り償還金 | 11,497円39銭 |

毎計算期末の状況

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第1期 | 12,148,265,121 | 12,180,011,342 | 10,026 | 60 | 0.60 |
| 第2期 | 13,049,629,963 | 13,179,652,776 | 10,100 | 60 | 0.60 |
| 第3期 | 14,536,942,067 | 14,126,140,880 | 9,717 | 60 | 0.60 |
| 第4期 | 15,272,815,045 | 15,524,634,840 | 10,165 | 60 | 0.60 |
| 第5期 | 15,088,559,418 | 16,180,928,911 | 10,724 | 60 | 0.60 |
| 第6期 | 17,549,457,301 | 19,379,304,280 | 11,043 | 60 | 0.60 |
| 第7期 | 19,299,764,026 | 19,526,025,773 | 10,117 | 60 | 0.60 |
| 第8期 | 18,164,002,415 | 19,281,641,678 | 10,615 | 60 | 0.60 |
| 第9期 | 18,097,933,285 | 18,546,503,414 | 10,248 | 60 | 0.60 |
| 第10期 | 18,355,162,100 | 17,978,875,508 | 9,795 | 60 | 0.60 |
| 第11期 | 18,480,258,338 | 19,090,843,787 | 10,330 | 60 | 0.60 |
| 第12期 | 17,859,822,732 | 18,656,978,057 | 10,446 | 60 | 0.60 |
| 第13期 | 17,236,077,574 | 17,900,756,523 | 10,386 | 60 | 0.60 |
| 第14期 | 16,928,596,820 | 18,295,060,662 | 10,807 | 60 | 0.60 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第15期 | 15,703,300,948 | 17,355,124,902 | 11,052 | 60 | 0.60 |
| 第16期 | 15,506,264,363 | 18,233,022,527 | 11,758 | 60 | 0.60 |
| 第17期 | 14,748,724,044 | 18,773,804,197 | 12,729 | 60 | 0.60 |
| 第18期 | 14,322,201,727 | 16,860,327,831 | 11,772 | 60 | 0.60 |
| 第19期 | 14,107,031,894 | 17,181,771,344 | 12,180 | 60 | 0.60 |
| 第20期 | 13,746,683,907 | 17,894,299,080 | 13,017 | 60 | 0.60 |
| 第21期 | 14,096,000,054 | 18,395,569,858 | 13,050 | 60 | 0.60 |
| 第22期 | 13,756,598,942 | 17,624,711,474 | 12,812 | 60 | 0.60 |
| 第23期 | 13,241,683,870 | 18,436,910,962 | 13,923 | 60 | 0.60 |
| 第24期 | 13,260,352,760 | 17,434,866,010 | 13,148 | 60 | 0.60 |
| 第25期 | 13,067,710,440 | 17,304,984,654 | 13,243 | 60 | 0.60 |
| 第26期 | 12,928,386,661 | 14,225,097,169 | 11,003 | 60 | 0.60 |
| 第27期 | 12,393,941,331 | 14,050,721,898 | 11,337 | 60 | 0.60 |
| 第28期 | 12,073,554,788 | 14,653,340,803 | 12,137 | 60 | 0.60 |
| 第29期 | 11,779,087,184 | 14,538,149,849 | 12,342 | 60 | 0.60 |
| 第30期 | 11,695,900,743 | 12,555,078,348 | 10,735 | 60 | 0.60 |
| 第31期 | 11,663,350,628 | 11,695,294,855 | 10,027 | 60 | 0.60 |
| 第32期 | 11,555,009,200 | 11,412,510,758 | 9,877 | 60 | 0.60 |
| 第33期 | 11,281,336,902 | 9,825,529,818 | 8,710 | 60 | 0.60 |
| 第34期 | 10,917,244,577 | 9,694,869,033 | 8,880 | 60 | 0.60 |
| 第35期 | 10,547,462,987 | 9,710,353,519 | 9,206 | 60 | 0.60 |
| 第36期 | 10,378,117,569 | 8,184,546,086 | 7,886 | 60 | 0.60 |
| 第37期 | 10,092,249,839 | 8,492,732,878 | 8,415 | 60 | 0.60 |
| 第38期 | 9,898,775,630 | 8,807,161,154 | 8,897 | 60 | 0.60 |
| 第39期 | 9,478,463,202 | 8,650,949,070 | 9,127 | 60 | 0.60 |
| 第40期 | 9,291,153,913 | 8,669,268,780 | 9,331 | 60 | 0.60 |
| 第41期 | 8,617,710,788 | 9,115,058,754 | 10,577 | 60 | 0.60 |
| 第42期 | 8,120,845,317 | 9,122,139,714 | 11,233 | 60 | 0.60 |
| 第43期 | 7,812,309,631 | 8,256,680,056 | 10,569 | 60 | 0.60 |
| 第44期 | 7,527,021,759 | 8,233,726,942 | 10,939 | 60 | 0.60 |
| 第45期 | 6,982,413,620 | 7,213,625,017 | 10,331 | 60 | 0.60 |
| 第46期 | 6,809,280,534 | 7,277,310,970 | 10,687 | 60 | 0.60 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第47期 | 6,463,026,248 | 6,723,309,325 | 10,403 | 60 | 0.60 |
| 第48期 | 6,180,767,269 | 6,738,300,818 | 10,902 | 60 | 0.60 |
| 第49期 | 5,963,212,282 | 6,378,174,351 | 10,696 | 60 | 0.60 |
| 第50期 | 5,762,741,010 | 5,940,713,270 | 10,309 | 60 | 0.60 |
| 第51期 | 5,554,858,363 | 6,194,006,481 | 11,151 | 60 | 0.60 |
| 第52期 | 5,334,163,605 | 6,209,960,166 | 11,642 | 60 | 0.60 |
| 第53期 | 5,126,612,171 | 5,721,510,764 | 11,160 | 60 | 0.60 |
| 第54期 | 4,950,671,593 | 5,749,787,308 | 11,614 | 60 | 0.60 |
| 第55期 | 4,934,550,544 | 5,224,800,732 | 10,588 | 60 | 0.60 |
| 第56期 | 4,905,266,682 | 4,840,776,329 | 9,869 | 60 | 0.60 |
| 第57期 | 4,895,248,834 | 4,937,880,682 | 10,087 | 60 | 0.60 |
| 第58期 | 4,797,246,571 | 5,037,439,794 | 10,501 | 60 | 0.60 |
| 第59期 | 4,408,534,770 | 4,618,542,814 | 10,476 | 60 | 0.60 |
| 第60期 | 4,122,358,241 | 4,097,739,428 | 9,940 | 60 | 0.60 |
| 第61期 | 4,048,989,138 | 4,226,989,664 | 10,440 | 60 | 0.60 |
| 第62期 | 4,028,077,976 | 4,014,030,231 | 9,965 | 60 | 0.60 |
| 第63期 | 3,984,792,513 | 4,285,104,284 | 10,754 | 60 | 0.60 |
| 第64期 | 4,035,632,337 | 3,972,201,012 | 9,843 | 60 | 0.60 |
| 第65期 | 3,958,466,240 | 3,787,791,364 | 9,569 | 60 | 0.60 |
| 第66期 | 3,894,387,644 | 3,371,199,882 | 8,657 | 60 | 0.60 |
| 第67期 | 3,783,561,683 | 3,443,616,716 | 9,102 | 60 | 0.60 |
| 第68期 | 3,724,880,171 | 3,442,971,507 | 9,243 | 60 | 0.60 |
| 第69期 | 3,624,323,786 | 3,500,613,382 | 9,659 | 60 | 0.60 |
| 第70期 | 3,579,153,448 | 3,326,590,647 | 9,294 | 60 | 0.60 |
| 第71期 | 3,478,095,810 | 3,026,370,890 | 8,701 | 60 | 0.60 |
| 第72期 | 3,466,805,136 | 3,164,838,710 | 9,129 | 60 | 0.60 |
| 第73期 | 3,360,195,820 | 2,808,454,105 | 8,358 | 60 | 0.60 |
| 第74期 | 3,248,298,780 | 2,820,640,998 | 8,683 | 60 | 0.60 |
| 第75期 | 3,176,214,919 | 2,759,237,830 | 8,687 | 60 | 0.60 |
| 第76期 | 3,132,819,507 | 2,996,342,840 | 9,564 | 60 | 0.60 |
| 第77期 | 3,098,302,664 | 2,941,911,942 | 9,495 | 60 | 0.60 |
| 第78期 | 2,991,295,812 | 2,850,664,072 | 9,530 | 60 | 0.60 |

## ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－ 米ドル・コース（毎月分配型）

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第79期 | 2,942,375,624 | 2,820,165,758 | 9,585 | 60 | 0.60 |
| 第80期 | 2,890,354,076 | 2,275,320,057 | 7,872 | 60 | 0.60 |
| 第81期 | 2,829,031,105 | 2,172,664,835 | 7,680 | 60 | 0.60 |
| 第82期 | 2,832,815,317 | 2,136,609,474 | 7,542 | 60 | 0.60 |
| 第83期 | 2,797,141,251 | 2,403,110,406 | 8,591 | 60 | 0.60 |
| 第84期 | 2,749,890,778 | 2,278,901,960 | 8,287 | 60 | 0.60 |
| 第85期 | 2,661,547,716 | 2,116,486,572 | 7,952 | 60 | 0.60 |
| 第86期 | 2,625,803,594 | 2,170,527,955 | 8,266 | 60 | 0.60 |
| 第87期 | 2,620,973,427 | 2,147,268,112 | 8,193 | 60 | 0.60 |
| 第88期 | 2,591,083,250 | 2,057,336,637 | 7,940 | 60 | 0.60 |
| 第89期 | 2,543,867,641 | 2,109,820,988 | 8,294 | 60 | 0.60 |
| 第90期 | 2,416,805,978 | 2,069,501,980 | 8,563 | 60 | 0.60 |
| 第91期 | 2,344,081,721 | 2,071,070,484 | 8,835 | 60 | 0.60 |
| 第92期 | 2,308,246,272 | 2,062,220,776 | 8,934 | 60 | 0.60 |
| 第93期 | 2,234,282,326 | 2,080,490,362 | 9,312 | 60 | 0.60 |
| 第94期 | 2,226,056,875 | 2,015,210,084 | 9,053 | 60 | 0.60 |
| 第95期 | 2,183,495,804 | 2,008,554,049 | 9,199 | 60 | 0.60 |
| 第96期 | 2,158,806,606 | 1,977,648,762 | 9,161 | 60 | 0.60 |
| 第97期 | 2,144,917,732 | 1,924,124,956 | 8,971 | 60 | 0.60 |
| 第98期 | 1,962,805,593 | 1,813,820,166 | 9,241 | 60 | 0.60 |
| 第99期 | 1,959,817,159 | 1,722,713,524 | 8,790 | 60 | 0.60 |
| 第100期 | 1,941,969,793 | 1,814,366,951 | 9,343 | 60 | 0.60 |
| 第101期 | 1,895,497,998 | 1,731,856,072 | 9,137 | 60 | 0.60 |
| 第102期 | 1,890,758,210 | 1,778,549,106 | 9,407 | 60 | 0.60 |
| 第103期 | 1,866,240,456 | 1,711,068,618 | 9,169 | 60 | 0.60 |
| 第104期 | 1,866,529,527 | 1,621,538,215 | 8,687 | 60 | 0.60 |
| 第105期 | 1,847,881,743 | 1,827,557,331 | 9,890 | 60 | 0.60 |
| 第106期 | 1,815,118,625 | 1,910,125,558 | 10,523 | 60 | 0.60 |
| 第107期 | 1,762,055,120 | 1,909,558,133 | 10,837 | 60 | 0.60 |
| 第108期 | 1,679,351,893 | 1,754,356,756 | 10,447 | 60 | 0.60 |
| 第109期 | 1,673,730,704 | 1,772,397,392 | 10,590 | 60 | 0.60 |
| 第110期 | 1,640,367,092 | 1,833,290,983 | 11,176 | 60 | 0.60 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第111期 | 1,618,333,097 | 1,807,656,587 | 11,170 | 60 | 0.60 |
| 第112期 | 1,617,730,280 | 1,855,639,554 | 11,471 | 60 | 0.60 |
| 第113期 | 1,619,030,943 | 1,774,666,123 | 10,961 | 60 | 0.60 |
| 第114期 | 1,569,643,283 | 1,568,218,089 | 9,991 | 60 | 0.60 |
| 第115期 | 1,537,803,696 | 1,612,091,835 | 10,483 | 60 | 0.60 |
| 第116期 | 1,528,468,585 | 1,717,298,755 | 11,235 | 60 | 0.60 |
| 第117期 | 1,488,828,387 | 1,575,945,740 | 10,585 | 60 | 0.60 |
| 第118期 | 1,440,323,523 | 1,660,561,587 | 11,529 | 60 | 0.60 |

（注）1単位は受益権1万口。

| 収益分配金のお知らせ | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1万口当り分配金（税込み） | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
| | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60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。

| 償還金のお知らせ | |
|---|---|
| 1万口当り償還金 | 11,497円39銭 |

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

## 通貨セレクト・コース（毎月分配型）

### 最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | TOPIX（配当込み） | | 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 |
| 90期末（2021年1月8日） | 2,515 | 40 | 6.2 | 19,770 | 3.9 | — | 98.2 | 1,878 |
| 91期末（2021年2月8日） | 2,596 | 40 | 4.8 | 20,471 | 3.5 | — | 98.6 | 1,907 |
| 92期末（2021年3月8日） | 2,531 | 40 | △ 1.0 | 20,535 | 0.3 | — | 98.1 | 1,840 |
| 93期末（2021年4月8日） | 2,572 | 40 | 3.2 | 21,490 | 4.7 | — | 98.0 | 1,810 |
| 94期末（2021年5月10日） | 2,525 | 40 | △ 0.3 | 21,118 | △ 1.7 | — | 98.1 | 1,748 |
| 95期末（2021年6月8日） | 2,559 | 40 | 2.9 | 21,438 | 1.5 | — | 98.6 | 1,740 |
| 96期末（2021年7月8日） | 2,493 | 40 | △ 1.0 | 21,209 | △ 1.1 | — | 98.0 | 1,683 |
| 97期末（2021年8月10日） | 2,451 | 40 | △ 0.1 | 21,120 | △ 0.4 | — | 98.0 | 1,573 |
| 98期末（2021年9月8日） | 2,542 | 40 | 5.3 | 22,594 | 7.0 | — | 98.5 | 1,614 |
| 99期末（2021年10月8日） | 2,355 | 40 | △ 5.8 | 21,406 | △ 5.3 | — | 98.0 | 1,471 |
| 100期末（2021年11月8日） | 2,444 | 30 | 5.1 | 22,532 | 5.3 | — | 99.5 | 1,497 |
| 101期末（2021年12月8日） | 2,169 | 30 | △ 10.0 | 21,970 | △ 2.5 | — | 98.2 | 1,312 |
| 102期末（2022年1月11日） | 2,239 | 30 | 4.6 | 22,062 | 0.4 | — | 98.2 | 1,340 |
| 103期末（2022年2月8日） | 2,198 | 30 | △ 0.5 | 21,294 | △ 3.5 | — | 97.9 | 1,282 |
| 104期末（2022年3月8日） | 2,003 | 30 | △ 7.5 | 19,843 | △ 6.8 | — | 99.5 | 1,165 |
| 105期末（2022年4月8日） | 2,345 | 30 | 18.6 | 21,169 | 6.7 | — | 97.5 | 1,340 |
| 106期末（2022年5月9日） | 2,396 | 30 | 3.5 | 21,427 | 1.2 | — | 99.4 | 1,363 |
| 107期末（2022年6月8日） | 2,473 | 30 | 4.5 | 21,796 | 1.7 | — | 99.2 | 1,380 |
| 108期末（2022年7月8日） | 2,255 | 30 | △ 7.6 | 21,102 | △ 3.2 | — | 98.8 | 1,228 |
| 109期末（2022年8月8日） | 2,314 | 30 | 3.9 | 21,830 | 3.5 | — | 97.6 | 1,262 |
| 110期末（2022年9月8日） | 2,417 | 30 | 5.7 | 21,483 | △ 1.6 | — | 97.6 | 1,312 |
| 111期末（2022年10月11日） | 2,371 | 30 | △ 0.7 | 21,610 | 0.6 | — | 97.5 | 1,256 |
| 112期末（2022年11月8日） | 2,511 | 30 | 7.2 | 21,920 | 1.4 | — | 97.6 | 1,314 |
| 113期末（2022年12月8日） | 2,422 | 30 | △ 2.3 | 22,090 | 0.8 | — | 99.3 | 1,262 |
| 114期末（2023年1月10日） | 2,230 | 30 | △ 6.7 | 21,304 | △ 3.6 | — | 97.5 | 1,151 |
| 115期末（2023年2月8日） | 2,356 | 30 | 7.0 | 22,528 | 5.7 | — | 99.3 | 1,217 |
| 116期末（2023年3月8日） | 2,551 | 30 | 9.6 | 23,235 | 3.1 | — | 99.8 | 1,309 |
| 117期末（2023年4月10日） | 2,428 | 30 | △ 3.6 | 22,595 | △ 2.8 | — | 98.9 | 1,229 |
| 118期末（2023年5月8日） | 2,635 | 30 | 9.8 | 23,862 | 5.6 | — | 7.2 | 1,294 |
| 償還（2023年6月8日） | 2,624.46 | — | △ 0.4 | 25,380 | 6.4 | — | — | 1,239 |

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）TOPIX（配当込み）は、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。また、基準価額への反映を考慮して、1営業日前の日付の終値を採用しています。
（注3）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4）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5）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。
※参考指数を「TOPIX」から「TOPIX（配当込み）」に変更しました。

# 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**

設定時：10,000円
償還時：　2,624円46銭（既払分配金8,370円）
騰落率：51.4%（分配金再投資ベース）

**■基準価額の主な変動要因**

日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略による運用と為替取引の結果、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。株式ポートフォリオ（配当込み）が上昇したことがプラス要因となりました。オプション取引および為替取引（日本円売り／選定通貨（※）買い）は、マイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

※選定通貨とは、通貨の選定方針により、為替取引の対象通貨として選定された通貨をいいます。

| | 年　月　日 | 基準価額 | | TOPIX（配当込み） | | 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 | | |
| | | 円 | % | | % | % | % |
| 第114期 | （期首）2022年12月８日 | 2,422 | — | 22,090 | — | — | 99.3 |
| | 12月末 | 2,306 | △ 4.8 | 21,525 | △ 2.6 | — | 97.4 |
| | （期末）2023年１月10日 | 2,260 | △ 6.7 | 21,304 | △ 3.6 | — | 97.5 |
| 第115期 | （期首）2023年１月10日 | 2,230 | — | 21,304 | — | — | 97.5 |
| | １月末 | 2,393 | 7.3 | 22,516 | 5.7 | — | 97.9 |
| | （期末）2023年２月８日 | 2,386 | 7.0 | 22,528 | 5.7 | — | 99.3 |
| 第116期 | （期首）2023年２月８日 | 2,356 | — | 22,528 | — | — | 99.3 |
| | ２月末 | 2,495 | 5.9 | 22,641 | 0.5 | — | 98.4 |
| | （期末）2023年３月８日 | 2,581 | 9.6 | 23,235 | 3.1 | — | 99.8 |
| 第117期 | （期首）2023年３月８日 | 2,551 | — | 23,235 | — | — | 99.8 |
| | ３月末 | 2,514 | △ 1.5 | 22,801 | △ 1.9 | — | 97.6 |
| | （期末）2023年４月10日 | 2,458 | △ 3.6 | 22,595 | △ 2.8 | — | 98.9 |
| 第118期 | （期首）2023年４月10日 | 2,428 | — | 22,595 | — | — | 98.9 |
| | ４月末 | 2,613 | 7.6 | 23,367 | 3.4 | — | 96.4 |
| | （期末）2023年５月８日 | 2,665 | 9.8 | 23,862 | 5.6 | — | 7.2 |
| 償還期 | （期首）2023年５月８日 | 2,635 | — | 23,862 | — | — | 7.2 |
| | ５月末 | 2,625 | △ 0.4 | 24,826 | 4.0 | — | 7.2 |
| | （償還）2023年６月８日 | 2,624.46 | △ 0.4 | 25,380 | 6.4 | — | — |

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

### ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当ファンド設定時からアベノミクス相場を追い風に上昇し、2015年の中国・人民元切下げ、2016年の日銀のマイナス金利導入、中国経済への懸念などで調整した局面もあったものの、2017年末ごろまで上昇を続けました。しかし2018年に入ると、米国長期金利の上昇や米中通商問題の行方をにらみながら一進一退の展開となり、年末には中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、大きく下落しました。2019年には、ＦＲＢ議長が一転して引き締め方向にあった金融政策の軟化を示唆したことや、米中通商問題解決への期待が高まったこともあり、上昇しました。2020年には、国内外での新型コロナウイルスの感染拡大により大幅に下落する局面もありましたが、各国の積極的な金融政策や財政政策への期待から反発し、2021年も、新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済活動の再開が進んだことなどにより、上昇しました。2022年は、米国の金融引き締めに対する懸念の高まりから上値の重い展開で推移しました。2023年に入り、日銀新総裁就任後初の金融政策決定会合で金融緩和継続の方針が示されたことや、海外に比べて遅れていた経済正常化の動きが本格化したことなどにより、償還期末にかけて上昇しました。

### ■為替相場

選定通貨は、対円でおおむね下落（円高）しました。

選定通貨の対円為替相場は、ロシアと欧米との関係悪化が嫌気されたロシア・ルーブルや、中央銀行に対する信認低下が懸念されたトルコ・リラなどは対円で下落しました。一方で、中国当局による通貨安誘導が後退した中国・人民元などは対円で上昇（円安）しました。

### ■短期金利市況

選定通貨の短期金利は、高い経済成長率やインフレ率を背景に、日本円の短期金利をおおむね上回って推移しました。日本の短期金利は、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持し、低位で推移しました。

## 信託期間中の運用方針

**■当ファンド**

「クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資します。主として、「クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）」の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引（日本円売り／選定通貨買い）を行い、信託財産の成長をめざします。

※クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）：オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）

**■クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）**

1．主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

・投資対象銘柄は「ＴＯＰＩＸ100」構成銘柄から金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。

・ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。

・選定時における各銘柄の構成比率はおおむね均等とします。また、銘柄の見直しは約１カ月ごとに行います。

・個別銘柄ごとに、コール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。

2．為替取引を活用します。

・日本円売り／選定通貨買いの為替取引を行います。

・大和アセットマネジメント株式会社が通貨の選定および配分比率について助言を行います。

［通貨の運用方針］

・原則として、「ＦＴＳＥ世界国債インデックス」および「ＪＰモルガン　ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ　ブロード」の構成国の通貨の中から、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、６つの通貨を選定します。

※上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合もあります。

・選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。

・選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。

**■ダイワ・マネーストック・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。

## 信託期間中のポートフォリオについて （2013. 6. 19 ～ 2023. 6. 8）

**■当ファンド**

当ファンドは、「クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）」と「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズです。信託期間中は、「クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）」への投資割合を高位に維持することをめざしました。

**■クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）**

株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略のうち、クロッキーモデルによる銘柄選択効果がプラスに働き、株式ポートフォリオ（配当除く）はＴＯＰＩＸ100指数（配当除く）を上回るパフォーマンスとなりました。また、オプション取引はマイナス要因となりました。

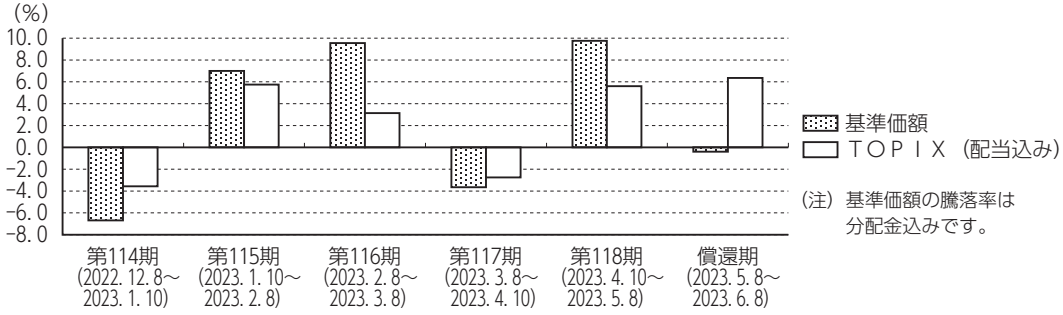
選定通貨においては、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を勘案し、中長期的な視点から安定したキャリー（利息）収益が享受できる通貨を毎月6通貨選定し、円建ての資産に対して、日本円売り／選定通貨買いの為替取引を行いました。また、取引対象通貨合計の比率は、原資産に対しておおむね100％を維持しました。

**■ダイワ・マネーストック・マザーファンド**

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・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、当作成期中における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。




（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

## 分配金について

１万口当り、第１期～第61期各100円、第62期～第67期各70円、第68期～第99期各40円、第100期～第118期各30円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（１万口当り）

| 項目 | 第114期<br>2022年12月９日<br>～2023年１月10日 | 第115期<br>2023年１月11日<br>～2023年２月８日 | 第116期<br>2023年２月９日<br>～2023年３月８日 | 第117期<br>2023年３月９日<br>～2023年４月10日 | 第118期<br>2023年４月11日<br>～2023年５月８日 |
|---|---|---|---|---|---|
| **当期分配金（税込み）（円）** | **30** | **30** | **30** | **30** | **30** |
| 対基準価額比率（%） | 1.33 | 1.26 | 1.16 | 1.22 | 1.13 |
| 当期の収益（円） | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 当期の収益以外（円） | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 709 | 716 | 725 | 732 | 754 |

（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ございません。

### ■収益分配金の計算過程（１万口当り）

| 項目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| （a）経費控除後の配当等収益 | ✓ 37.46円 | ✓ 36.75円 | ✓ 39.11円 | ✓ 36.69円 | ✓ 51.80円 |
| （b）経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| （c）収益調整金 | 355.01 | 356.27 | 358.53 | 359.37 | 360.29 |
| （d）分配準備積立金 | 347.32 | 353.53 | 358.05 | 366.32 | 372.09 |
| （e）当期分配対象額（a+b+c+d） | 739.80 | 746.56 | 755.70 | 762.39 | 784.19 |
| （f）分配金 | 30.00 | 30.00 | 30.00 | 30.00 | 30.00 |
| （g）翌期繰越分配対象額（e－f） | 709.80 | 716.56 | 725.70 | 732.39 | 754.19 |

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

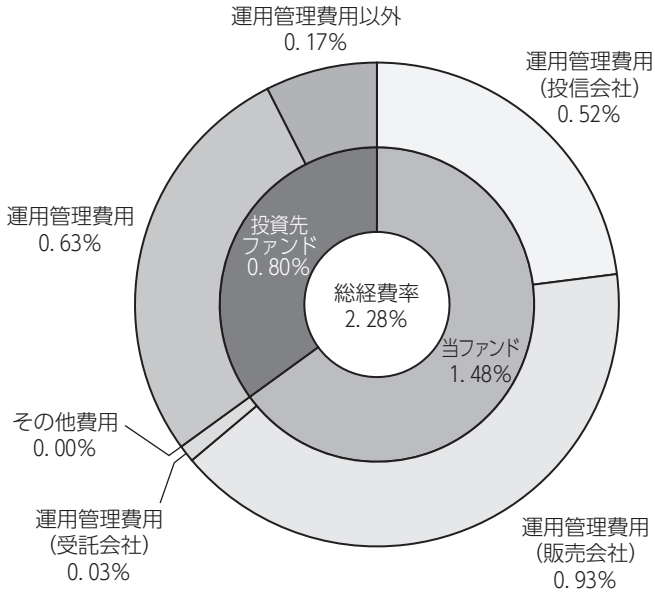
| 項　　目 | 第114期～償還期<br>(2022. 12. 9～2023. 6. 8) | | 項　目　の　概　要 |
|---|---|---|---|
| | 金　額 | 比　率 | |
| **信　託　報　酬** | 18円 | 0. 738% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>**当作成期中の平均基準価額は2, 470円です。** |
| （投 信 会 社） | (6) | (0. 261) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| （販 売 会 社） | (11) | (0. 464) | 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） | (0) | (0. 013) | 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<br>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<br>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** | — | — | 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 |
| **合　　計** | 18 | 0. 738 | |

（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2.28%です。




| 総経費率　（　①　＋　②　＋　③　） | 2.28% |
|---|---|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.48% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.63% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.17% |

（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、投資先ファンドの費用には、支払利息、担保付スワップに係る費用を含みません。
（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。

## ■売買および取引の状況

### (1) 投資信託受益証券

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 買付 | | 売付 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国（邦貨建） | 4,717.09851 | 111,828 | 55,912.23759 | 1,446,145 |

（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。

### (2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2022年12月９日から2023年６月８日まで）

| 決算期 | 第114期～償還期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 設定 | | 解約 | |
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | — | — | 15 | 15 |

（注）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12月９日から2023年６月８日まで）

| 第114期～償還期 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 |
| CROCI JAPAN STRATEGY FUND CURRENCY SELECTION CLASS（ケイマン諸島） | 215.460381 | 4,900 | 22 | CROCI JAPAN STRATEGY FUND CURRENCY SELECTION CLASS（ケイマン諸島） | 55,912.23759 | 1,446,145 | 25 |

（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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

### 親投資信託残高

| 種類 | 第113期末 |
|---|---|
| | □数 |
| | 千口 |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド | 15 |

（注）単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年６月８日現在

| 項目 | 償還時 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 1,240,934 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 1,240,934 | 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１月10日）、（2023年２月８日）、（2023年３月８日）、（2023年４月10日）、（2023年５月８日）、（2023年６月８日）現在

| 項　　目 | 第114期末 | 第115期末 | 第116期末 | 第117期末 | 第118期末 | 償還時 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）資産** | **1,179,426,735円** | **1,235,283,074円** | **1,327,755,932円** | **1,246,066,844円** | **2,519,173,309円** | **1,240,934,339円** |
| コール・ローン等 | 52,554,930 | 26,202,083 | 21,347,727 | 30,079,192 | 8,763,417 | 1,240,934,339 |
| 投資信託受益証券（評価額） | 1,121,956,399 | 1,209,065,585 | 1,306,392,799 | 1,215,831,553 | 93,556,092 | — |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド（評価額） | 15,406 | 15,406 | 15,406 | 15,406 | 15,406 | — |
| 未収入金 | 4,900,000 | — | — | — | 2,416,697,701 | — |
| その他未収収益 | — | — | — | 140,693 | 140,693 | — |
| **（B）負債** | **28,163,424** | **17,419,538** | **18,135,571** | **16,866,048** | **1,224,558,467** | **1,684,231** |
| 未払金 | 4,900,000 | — | — | — | 1,208,348,851 | — |
| 未払収益分配金 | 15,489,548 | 15,508,612 | 15,401,858 | 15,188,186 | 14,738,360 | — |
| 未払解約金 | 6,134,371 | 484,606 | 1,285,039 | — | — | 54,094 |
| 未払信託報酬 | 1,639,505 | 1,426,320 | 1,448,674 | 1,677,862 | 1,471,256 | 1,628,585 |
| 未払利息 | — | — | — | — | — | 1,552 |
| **（C）純資産総額（A－B）** | **1,151,263,311** | **1,217,863,536** | **1,309,620,361** | **1,229,200,796** | **1,294,614,842** | **1,239,250,108** |
| 元本 | 5,163,182,845 | 5,169,537,391 | 5,133,952,893 | 5,062,728,769 | 4,912,786,790 | 4,721,930,922 |
| 次期繰越損益金 | △ 4,011,919,534 | △ 3,951,673,855 | △ 3,824,332,532 | △ 3,833,527,973 | △ 3,618,171,948 | — |
| 償還差損益金 | — | — | — | — | — | △ 3,482,680,814 |
| **（D）受益権総口数** | **5,163,182,845口** | **5,169,537,391口** | **5,133,952,893口** | **5,062,728,769口** | **4,912,786,790口** | **4,721,930,922口** |
| **１万口当り基準価額（C／D）** | **2,230円** | **2,356円** | **2,551円** | **2,428円** | **2,635円** | **—** |
| **１万口当り償還価額（C／D）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **2,624円46銭** |

＊当作成期首における元本額は5,213,242,638円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は116,533,880円、同解約元本額は607,845,596円です。
＊償還時の計算口数当りの純資産額は2,624円46銭です。
＊償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,482,680,814円です。

## ■損益の状況

第114期　自 2022年12月９日　至 2023年１月10日
第115期　自 2023年１月11日　至 2023年２月８日
第116期　自 2023年２月９日　至 2023年３月８日
第117期　自 2023年３月９日　至 2023年４月10日
第118期　自 2023年４月11日　至 2023年５月８日
償 還 期　自 2023年５月９日　至 2023年６月８日

| 項　　目 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 | 償還期 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **（A）配当等収益** | **20,984,530円** | **19,334,860円** | **20,332,772円** | **20,253,338円** | **25,772,071円** | **△ 51,124円** |
| 受取配当金 | 20,985,463 | 19,335,318 | 20,332,975 | 20,112,969 | 25,772,373 | — |
| 受取利息 | 1 | — | 1 | — | — | 189 |
| その他収益金 | — | — | — | 140,615 | — | — |
| 支払利息 | △ 934 | △ 458 | △ 204 | △ 246 | △ 302 | △ 51,313 |
| **（B）有価証券売買損益** | **△ 103,291,305** | **62,767,815** | **96,593,543** | **△ 65,638,483** | **92,256,569** | **△ 3,375,113** |
| 売買益 | 570,864 | 62,855,966 | 96,956,321 | 905,541 | 94,416,132 | 99,331 |
| 売買損 | △ 103,862,169 | △ 88,151 | △ 362,778 | △ 66,544,024 | △ 2,159,563 | △ 3,474,444 |
| **（C）信託報酬等** | **△ 1,639,505** | **△ 1,426,320** | **△ 1,448,674** | **△ 1,677,862** | **△ 1,471,256** | **△ 1,628,585** |
| **（D）当期損益金（A＋B＋C）** | **△ 83,946,280** | **80,676,355** | **115,477,641** | **△ 47,063,007** | **116,557,384** | **△ 5,054,822** |
| **（E）前期繰越損益金** | **△ 2,942,103,021** | **△ 3,034,467,514** | **△ 2,930,602,896** | **△ 2,784,828,370** | **△ 2,755,972,373** | **△ 2,536,715,283** |
| **（F）追加信託差損益金** | **△ 970,380,685** | **△ 982,374,084** | **△ 993,805,419** | **△ 986,448,410** | **△ 964,018,599** | **△ 940,910,709** |
| （配当等相当額） | ( 183,298,396) | ( 184,178,803) | ( 184,068,429) | ( 181,943,073) | ( 177,004,597) | ( 171,172,744) |
| （売買損益相当額） | (△ 1,153,679,081) | (△ 1,166,552,887) | (△ 1,177,873,848) | (△ 1,168,391,483) | (△ 1,141,023,196) | (△ 1,112,083,453) |
| **（G）合計（D＋E＋F）** | **△ 3,996,429,986** | **△ 3,936,165,243** | **△ 3,808,930,674** | **△ 3,818,339,787** | **△ 3,603,433,588** | **△ 3,482,680,814** |
| **（H）収益分配金** | **△ 15,489,548** | **△ 15,508,612** | **△ 15,401,858** | **△ 15,188,186** | **△ 14,738,360** | **—** |
| **次期繰越損益金（G＋H）** | **△ 4,011,919,534** | **△ 3,951,673,855** | **△ 3,824,332,532** | **△ 3,833,527,973** | **△ 3,618,171,948** | **—** |
| 追加信託差損益金 | △ 970,380,685 | △ 982,374,084 | △ 993,805,419 | △ 986,448,410 | △ 964,018,599 | — |
| （配当等相当額） | ( 183,298,396) | ( 184,178,803) | ( 184,068,429) | ( 181,943,073) | ( 177,004,597) | ( —) |
| （売買損益相当額） | (△ 1,153,679,081) | (△ 1,166,552,887) | (△ 1,177,873,848) | (△ 1,168,391,483) | (△ 1,141,023,196) | ( —) |
| 分配準備積立金 | 183,187,911 | 186,252,366 | 188,504,054 | 188,847,953 | 193,517,165 | — |
| 繰越損益金 | △ 3,224,726,760 | △ 3,155,552,137 | △ 3,019,031,167 | △ 3,035,927,516 | △ 2,847,670,514 | — |
| **償還差損益金（G）** | **—** | **—** | **—** | **—** | **—** | **△ 3,482,680,814** |

（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）第114期～第118期の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 | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|---|---|---|---|---|---|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 19,345,025円 | 18,998,962円 | 20,080,848円 | 18,575,476円 | 25,450,749円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 183,298,396 | 184,178,803 | 184,068,429 | 181,943,073 | 177,004,597 |
| (d) 分配準備積立金 | 179,332,434 | 182,762,016 | 183,825,064 | 185,460,663 | 182,804,776 |
| (e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d） | 381,975,855 | 385,939,781 | 387,974,341 | 385,979,212 | 385,260,122 |
| (f) 分配金 | 15,489,548 | 15,508,612 | 15,401,858 | 15,188,186 | 14,738,360 |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e－f） | 366,486,307 | 370,431,169 | 372,572,483 | 370,791,026 | 370,521,762 |
| (h) 受益権総口数 | 5,163,182,845口 | 5,169,537,391口 | 5,133,952,893口 | 5,062,728,769口 | 4,912,786,790口 |

## 投　資　信　託　財　産　運　用　総　括　表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2013年6月19日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 投資信託契約終了日 | 2023年6月8日 | | 資産総額 | 1,240,934,339円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 1,684,231円 |
| | | | | 純資産総額 | 1,239,250,108円 |
| 受益権口数 | 39,703,457,640口 | 4,721,930,922口 | △34,981,526,718口 | 受益権口数 | 4,721,930,922口 |
| 元本額 | 39,703,457,640円 | 4,721,930,922円 | △34,981,526,718円 | 1単位当り償還金 | 2,624円46銭 |

毎計算期末の状況

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第1期 | 44,584,362,381 | 44,654,487,795 | 10,016 | 100 | 1.00 |
| 第2期 | 45,372,682,458 | 44,609,413,938 | 9,832 | 100 | 1.00 |
| 第3期 | 46,534,509,852 | 45,245,831,661 | 9,723 | 100 | 1.00 |
| 第4期 | 48,812,483,584 | 48,541,046,784 | 9,944 | 100 | 1.00 |
| 第5期 | 49,343,046,605 | 51,499,461,043 | 10,437 | 100 | 1.00 |
| 第6期 | 49,092,829,447 | 51,675,190,419 | 10,526 | 100 | 1.00 |
| 第7期 | 49,455,139,681 | 46,605,814,469 | 9,424 | 100 | 1.00 |
| 第8期 | 50,682,016,549 | 49,998,213,447 | 9,865 | 100 | 1.00 |
| 第9期 | 50,351,039,277 | 49,362,315,072 | 9,804 | 100 | 1.00 |
| 第10期 | 50,691,270,271 | 47,640,559,853 | 9,398 | 100 | 1.00 |
| 第11期 | 50,563,334,721 | 50,551,193,879 | 9,998 | 100 | 1.00 |
| 第12期 | 47,844,390,634 | 48,138,326,689 | 10,061 | 100 | 1.00 |
| 第13期 | 46,199,414,195 | 45,093,380,146 | 9,761 | 100 | 1.00 |
| 第14期 | 45,254,700,635 | 45,988,858,466 | 10,162 | 100 | 1.00 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第15期 | 44,216,621,729 | 43,351,284,853 | 9,804 | 100 | 1.00 |
| 第16期 | 43,430,307,227 | 43,421,921,089 | 9,998 | 100 | 1.00 |
| 第17期 | 41,451,773,804 | 43,604,003,159 | 10,519 | 100 | 1.00 |
| 第18期 | 40,966,283,658 | 37,819,016,975 | 9,232 | 100 | 1.00 |
| 第19期 | 40,358,438,793 | 37,812,680,428 | 9,369 | 100 | 1.00 |
| 第20期 | 39,665,377,698 | 38,151,624,219 | 9,618 | 100 | 1.00 |
| 第21期 | 38,751,023,096 | 37,677,771,867 | 9,723 | 100 | 1.00 |
| 第22期 | 37,365,430,075 | 34,924,812,824 | 9,347 | 100 | 1.00 |
| 第23期 | 35,284,825,539 | 34,865,004,218 | 9,881 | 100 | 1.00 |
| 第24期 | 34,146,489,918 | 31,702,903,000 | 9,284 | 100 | 1.00 |
| 第25期 | 33,268,527,916 | 29,731,791,742 | 8,937 | 100 | 1.00 |
| 第26期 | 32,511,921,742 | 22,069,383,695 | 6,788 | 100 | 1.00 |
| 第27期 | 31,965,728,521 | 23,335,457,618 | 7,300 | 100 | 1.00 |
| 第28期 | 31,119,805,965 | 23,834,676,316 | 7,659 | 100 | 1.00 |
| 第29期 | 30,163,524,557 | 23,090,472,537 | 7,655 | 100 | 1.00 |
| 第30期 | 29,053,145,931 | 18,415,259,707 | 6,338 | 100 | 1.00 |
| 第31期 | 28,360,394,360 | 16,702,788,273 | 5,889 | 100 | 1.00 |
| 第32期 | 28,007,427,006 | 16,498,610,254 | 5,891 | 100 | 1.00 |
| 第33期 | 27,580,919,362 | 14,365,712,829 | 5,209 | 100 | 1.00 |
| 第34期 | 27,205,650,679 | 14,321,552,384 | 5,264 | 100 | 1.00 |
| 第35期 | 26,597,009,188 | 14,365,323,026 | 5,401 | 100 | 1.00 |
| 第36期 | 26,098,715,085 | 12,048,145,699 | 4,616 | 100 | 1.00 |
| 第37期 | 25,528,824,070 | 12,508,178,324 | 4,900 | 100 | 1.00 |
| 第38期 | 25,098,752,066 | 12,982,521,226 | 5,173 | 100 | 1.00 |
| 第39期 | 23,979,660,455 | 12,371,103,937 | 5,159 | 100 | 1.00 |
| 第40期 | 23,342,855,600 | 12,086,548,733 | 5,178 | 100 | 1.00 |
| 第41期 | 22,322,813,330 | 12,562,422,397 | 5,628 | 100 | 1.00 |
| 第42期 | 21,809,515,054 | 13,004,109,263 | 5,963 | 100 | 1.00 |
| 第43期 | 20,919,377,833 | 11,685,316,338 | 5,586 | 100 | 1.00 |
| 第44期 | 20,410,254,172 | 11,830,807,109 | 5,797 | 100 | 1.00 |
| 第45期 | 19,773,879,127 | 10,692,732,210 | 5,408 | 100 | 1.00 |
| 第46期 | 19,259,589,623 | 10,832,065,275 | 5,624 | 100 | 1.00 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第47期 | 18,531,281,498 | 10,060,067,699 | 5,429 | 100 | 1.00 |
| 第48期 | 17,962,079,113 | 9,935,516,288 | 5,531 | 100 | 1.00 |
| 第49期 | 17,536,228,088 | 9,554,362,366 | 5,448 | 100 | 1.00 |
| 第50期 | 16,900,858,963 | 8,958,266,754 | 5,300 | 100 | 1.00 |
| 第51期 | 16,028,965,062 | 8,845,984,613 | 5,519 | 100 | 1.00 |
| 第52期 | 15,505,410,956 | 8,614,935,467 | 5,556 | 100 | 1.00 |
| 第53期 | 14,769,194,083 | 7,841,365,662 | 5,309 | 100 | 1.00 |
| 第54期 | 14,439,124,148 | 8,034,080,147 | 5,564 | 100 | 1.00 |
| 第55期 | 14,147,500,794 | 7,135,190,332 | 5,043 | 100 | 1.00 |
| 第56期 | 14,013,762,091 | 6,462,709,513 | 4,612 | 100 | 1.00 |
| 第57期 | 13,937,180,739 | 6,416,504,844 | 4,604 | 100 | 1.00 |
| 第58期 | 13,796,839,909 | 6,288,282,584 | 4,558 | 100 | 1.00 |
| 第59期 | 13,532,960,894 | 5,837,549,825 | 4,314 | 100 | 1.00 |
| 第60期 | 13,246,751,187 | 5,292,086,738 | 3,995 | 100 | 1.00 |
| 第61期 | 12,966,576,952 | 5,228,308,800 | 4,032 | 100 | 1.00 |
| 第62期 | 12,650,688,921 | 4,509,381,424 | 3,565 | 70 | 0.70 |
| 第63期 | 12,281,268,595 | 4,724,821,760 | 3,847 | 70 | 0.70 |
| 第64期 | 12,080,424,123 | 4,312,606,173 | 3,570 | 70 | 0.70 |
| 第65期 | 11,876,150,317 | 4,116,083,791 | 3,466 | 70 | 0.70 |
| 第66期 | 11,785,250,106 | 3,689,872,686 | 3,131 | 70 | 0.70 |
| 第67期 | 11,714,680,842 | 3,837,827,579 | 3,276 | 70 | 0.70 |
| 第68期 | 11,589,531,083 | 3,805,193,096 | 3,283 | 40 | 0.40 |
| 第69期 | 10,920,068,897 | 3,794,791,354 | 3,475 | 40 | 0.40 |
| 第70期 | 10,669,693,660 | 3,497,241,730 | 3,278 | 40 | 0.40 |
| 第71期 | 10,468,772,492 | 3,237,908,653 | 3,093 | 40 | 0.40 |
| 第72期 | 10,304,281,466 | 3,403,257,288 | 3,303 | 40 | 0.40 |
| 第73期 | 10,110,781,906 | 3,005,001,865 | 2,972 | 40 | 0.40 |
| 第74期 | 9,865,652,856 | 3,014,629,927 | 3,056 | 40 | 0.40 |
| 第75期 | 9,285,254,487 | 2,826,203,440 | 3,044 | 40 | 0.40 |
| 第76期 | 9,036,297,123 | 3,047,583,753 | 3,373 | 40 | 0.40 |
| 第77期 | 8,725,215,970 | 2,900,372,252 | 3,324 | 40 | 0.40 |
| 第78期 | 8,548,220,460 | 2,848,667,439 | 3,332 | 40 | 0.40 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第79期 | 8,492,983,045 | 2,824,511,032 | 3,326 | 40 | 0.40 |
| 第80期 | 8,356,505,596 | 2,188,856,653 | 2,619 | 40 | 0.40 |
| 第81期 | 8,230,686,965 | 1,894,705,686 | 2,302 | 40 | 0.40 |
| 第82期 | 8,241,510,812 | 1,835,648,673 | 2,227 | 40 | 0.40 |
| 第83期 | 8,251,259,138 | 2,201,802,817 | 2,668 | 40 | 0.40 |
| 第84期 | 8,096,604,068 | 2,035,788,113 | 2,514 | 40 | 0.40 |
| 第85期 | 7,986,783,470 | 1,863,259,132 | 2,333 | 40 | 0.40 |
| 第86期 | 7,819,593,771 | 1,887,578,393 | 2,414 | 40 | 0.40 |
| 第87期 | 7,693,422,861 | 1,797,230,551 | 2,336 | 40 | 0.40 |
| 第88期 | 7,614,515,257 | 1,713,554,641 | 2,250 | 40 | 0.40 |
| 第89期 | 7,517,049,211 | 1,807,594,944 | 2,405 | 40 | 0.40 |
| 第90期 | 7,469,220,590 | 1,878,167,170 | 2,515 | 40 | 0.40 |
| 第91期 | 7,347,464,649 | 1,907,291,027 | 2,596 | 40 | 0.40 |
| 第92期 | 7,272,742,332 | 1,840,573,375 | 2,531 | 40 | 0.40 |
| 第93期 | 7,039,664,205 | 1,810,705,139 | 2,572 | 40 | 0.40 |
| 第94期 | 6,924,539,258 | 1,748,408,071 | 2,525 | 40 | 0.40 |
| 第95期 | 6,802,121,267 | 1,740,778,788 | 2,559 | 40 | 0.40 |
| 第96期 | 6,754,303,939 | 1,683,526,365 | 2,493 | 40 | 0.40 |
| 第97期 | 6,420,856,958 | 1,573,880,001 | 2,451 | 40 | 0.40 |
| 第98期 | 6,350,517,582 | 1,614,321,738 | 2,542 | 40 | 0.40 |
| 第99期 | 6,246,325,906 | 1,471,291,439 | 2,355 | 40 | 0.40 |
| 第100期 | 6,126,919,048 | 1,497,595,412 | 2,444 | 30 | 0.30 |
| 第101期 | 6,049,655,723 | 1,312,144,000 | 2,169 | 30 | 0.30 |
| 第102期 | 5,987,511,990 | 1,340,611,124 | 2,239 | 30 | 0.30 |
| 第103期 | 5,831,791,798 | 1,282,116,864 | 2,198 | 30 | 0.30 |
| 第104期 | 5,818,960,842 | 1,165,336,379 | 2,003 | 30 | 0.30 |
| 第105期 | 5,714,092,844 | 1,340,070,498 | 2,345 | 30 | 0.30 |
| 第106期 | 5,690,971,902 | 1,363,486,850 | 2,396 | 30 | 0.30 |
| 第107期 | 5,584,041,185 | 1,380,878,641 | 2,473 | 30 | 0.30 |
| 第108期 | 5,450,707,840 | 1,228,963,713 | 2,255 | 30 | 0.30 |
| 第109期 | 5,458,593,173 | 1,262,964,803 | 2,314 | 30 | 0.30 |
| 第110期 | 5,430,691,800 | 1,312,790,158 | 2,417 | 30 | 0.30 |

| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1単位当り分配金 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 金額 | 分配率 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第111期 | 5,301,259,901 | 1,256,984,360 | 2,371 | 30 | 0.30 |
| 第112期 | 5,235,196,731 | 1,314,624,555 | 2,511 | 30 | 0.30 |
| 第113期 | 5,213,242,638 | 1,262,853,854 | 2,422 | 30 | 0.30 |
| 第114期 | 5,163,182,845 | 1,151,263,311 | 2,230 | 30 | 0.30 |
| 第115期 | 5,169,537,391 | 1,217,863,536 | 2,356 | 30 | 0.30 |
| 第116期 | 5,133,952,893 | 1,309,620,361 | 2,551 | 30 | 0.30 |
| 第117期 | 5,062,728,769 | 1,229,200,796 | 2,428 | 30 | 0.30 |
| 第118期 | 4,912,786,790 | 1,294,614,842 | 2,635 | 30 | 0.30 |

（注）1単位は受益権1万口。

| 収益分配金のお知らせ | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1万口当り分配金（税込み） | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
| | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30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。

| 償還金のお知らせ | |
|---|---|
| 1万口当り償還金 | 2,624円46銭 |

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

## クロッキーファンド
## （日本円・クラス／豪ドル・クラス／ブラジル・レアル・クラス／米ドル・クラス／通貨セレクト・クラス）

当ファンド（ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）／豪ドル・コース（毎月分配型）／ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）／米ドル・コース（毎月分配型）／通貨セレクト・コース（毎月分配型））はケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス／豪ドル・クラス／ブラジル・レアル・クラス／米ドル・クラス／通貨セレクト・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。

（日本円建て）

**貸借対照表**
2022年２月28日

| | | |
|---|---|---|
| **資産** | | |
| 投資資産の評価額（簿価 ¥5, 494, 680, 113） | ¥ | 5, 385, 435, 350 |
| 現金および現金同等物 | | 30, 519, 466 |
| スワップ取引による評価益 | | 456, 004 |
| 終了したスワップ取引に係る未収入金 | | 89, 201, 838 |
| **資産合計** | | 5, 505, 612, 658 |
| **負債** | | |
| スワップ取引による評価損 | | 22, 915, 551 |
| 未払： | | |
| 担保金利不足額 | | 19, 565, 000 |
| 専門家報酬 | | 12, 533, 166 |
| 償還済み受益証券 | | 8, 000, 000 |
| 管理会社報酬 | | 2, 667, 782 |
| 運用会社報酬 | | 1, 181, 061 |
| 登録料 | | 485, 151 |
| 為替投資アドバイザー報酬 | | 475, 619 |
| 受託会社報酬 | | 170, 911 |
| 名義書換代理人報酬 | | 168, 410 |
| **負債合計** | | 68, 162, 651 |
| **純資産** | ¥ | 5, 437, 450, 007 |
| 豪ドル・クラス | ¥ | 274, 751, 469 |
| ブラジル・レアル・クラス | | 1, 111, 160, 127 |
| 日本円・クラス | | 1, 171, 240, 874 |
| 通貨セレクト・クラス | | 1, 206, 906, 278 |
| 米ドル・クラス | | 1, 673, 391, 259 |
| | ¥ | 5, 437, 450, 007 |

| | | |
|---|---|---|
| **発行済み受益証券** | | |
| 豪ドル・クラス | | 5, 517, 995 |
| ブラジル・レアル・クラス | | 47, 240, 630 |
| 日本円・クラス | | 18, 502, 954 |
| 通貨セレクト・クラス | | 56, 168, 849 |
| 米ドル・クラス | | 23, 689, 951 |
| **受益証券１口当り純資産額** | | |
| 豪ドル・クラス | ¥ | 49. 792 |
| ブラジル・レアル・クラス | ¥ | 23. 521 |
| 日本円・クラス | ¥ | 63. 300 |
| 通貨セレクト・クラス | ¥ | 21. 487 |
| 米ドル・クラス | ¥ | 70. 637 |

**損益計算書**

2022年２月28日に終了した会計年度

| | | |
|---|---|---|
| **費用** | | |
| 支払利息 | ¥ | 17, 364, 577 |
| 担保不足費用 | | 15, 695, 000 |
| 運用会社報酬 | | 15, 587, 122 |
| 管理会社報酬 | | 10, 760, 470 |
| 専門家報酬 | | 9, 813, 146 |
| 為替投資アドバイザー報酬 | | 2, 335, 048 |
| 受託会社報酬 | | 1, 292, 860 |
| 名義書換代理人報酬 | | 791, 897 |
| その他費用 | | 437, 996 |
| **費用合計** | | 74, 078, 116 |
| **投資損失** | | (74, 078, 116) |
| **実現益（損）および評価益（損）：** | | |
| **実現益（損）の内訳：** | | |
| 証券投資 | | 355, 549, 372 |
| スワップ取引の評価益 | | 397, 722, 585 |
| 外国為替取引および為替先渡取引 | | (2, 231, 564) |
| **純実現損益** | | 751, 040, 393 |
| **評価益（損）の純変動の内訳：** | | |
| 証券投資 | | 57, 110, 053 |
| スワップ取引の評価額 | | (73, 515, 881) |
| 外国為替換算および為替先渡取引 | | (53, 580) |
| **評価益（損）の純変動** | | (16, 459, 408) |
| **純実現損益および評価益（損）の純変動** | | 734, 580, 985 |
| **運用による純資産の増加** | ¥ | 660, 502, 869 |

## 証券投資明細表

2022年２月28日

| 投資資産の明細 | 受益証券口数 | 純資産に占める割合 | | 評価額 |
|---|---|---|---|---|
| 株式バスケットスワップ取引＊- トータル・リターン・スワップ | 47, 921, 653 | 99. 04% | ￥ | 5, 385, 435, 350 |
| **ストラクチャード商品合計（簿価 ¥5, 494, 680, 113）** | | | | **5, 385, 435, 350** |
| **投資資産合計（簿価 ¥5, 494, 680, 113）** | | **99. 04%** | ￥ | **5, 385, 435, 350** |

＊当ファンドは J. P. Morgan Securities plc. との間で締結したファンドの残高と同金額の元本のパフォーマンス・スワップを通して株式バスケットスワップ取引と同様のエクスポージャーを有しています。

**豪ドル・クラス外国為替スワップ取引**

| 買い | 取引相手 | 想定元本 | 満期日 | 売り | 想定元本 | 純評価（損） | 純資産に占める割合 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ＡＵＤ | J. P. Morgan Securities plc | 3, 311, 085 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (2, 402, 689) | ￥ (93, 661) | (0. 00) % |

**ブラジル・レアル・クラス外国為替スワップ取引**

| 買い | 取引相手 | 想定元本 | 満期日 | 売り | 想定元本 | 純評価（損） | 純資産に占める割合 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ＢＲＬ | J. P. Morgan Securities plc | 47, 489, 334 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (9, 218, 187) | ￥ (5, 563, 633) | (0. 10) % |

**通貨セレクト・クラス外国為替スワップ取引**

| 買い | 取引相手 | 想定元本 | 満期日 | 売り | 想定元本 | 純評価益（損） | 純資産に占める割合 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ＢＲＬ | J. P. Morgan Securities plc | 11, 171, 993 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (2, 168, 603) | ￥ (1, 308, 860) | (0. 02) % |
| ＣＬＰ | J. P. Morgan Securities plc | 1, 318, 051, 589 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (1, 658, 344) | 456, 004 | 0. 01 % |
| ＣＯＰ | J. P. Morgan Securities plc | 6, 467, 549, 350 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (1, 658, 344) | (804, 387) | (0. 02) % |
| ＣＺＫ | J. P. Morgan Securities plc | 1, 038, 719 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (46, 326) | (851, 400) | (0. 02) % |
| ＩＮＲ | J. P. Morgan Securities plc | 128, 155, 947 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (1, 700, 865) | (1, 785, 136) | (0. 03) % |
| ＭＸＮ | J. P. Morgan Securities plc | 37, 359, 400 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (1, 828, 430) | (953, 006) | (0. 02) % |
| ＲＯＮ | J. P. Morgan Securities plc | 7, 118, 908 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (1, 615, 822) | (1, 310, 479) | (0. 02) % |
| ＲＵＢ | J. P. Morgan Securities plc | 10, 010, 798 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (93, 395) | (3, 301, 672) | (0. 06) % |
| 合計 | | | | | | ￥ (9, 858, 936) | (0. 18) % |

**米ドル・クラス外国為替スワップ取引**

| 買い | 取引相手 | 想定元本 | 満期日 | 売り | 想定元本 | 純評価（損） | 純資産に占める割合 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ＵＳＤ | J. P. Morgan Securities plc | 1, 718, 522, 374 | 3/31/2022 | ＪＰＹ | (14, 920, 967) | ￥ (6, 943, 317) | (0. 13) % |

**用語集：**

| | | | |
|---|---|---|---|
| AUD | 豪ドル | JPY | 日本・円 |
| BRL | ブラジル・レアル | MXN | メキシコ・ペソ |
| CLP | チリ・ペソ | RON | ルーマニア・レイ |
| COP | コロンビア・ペソ | RUB | ロシア・ルーブル |
| CZK | チェコ・コルナ | USD | 米ドル |
| INR | インド・ルピー | | |

# ダイワ・マネーストック・マザーファンド

## 運用報告書　第13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・マネーストック・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

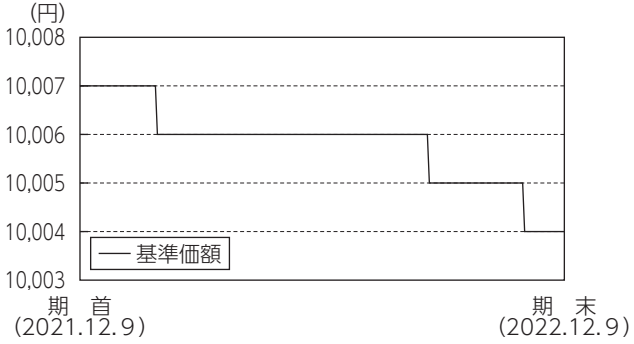
**★当ファンドの仕組みは次の通りです。**

| | |
|---|---|
| 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 | |
| | 円 | % | % |
| (期首)2021年12月9日 | 10,007 | − | − |
| 12月末 | 10,007 | 0.0 | − |
| 2022年1月末 | 10,007 | 0.0 | − |
| 2月末 | 10,006 | △0.0 | − |
| 3月末 | 10,006 | △0.0 | − |
| 4月末 | 10,006 | △0.0 | − |
| 5月末 | 10,006 | △0.0 | − |
| 6月末 | 10,006 | △0.0 | − |
| 7月末 | 10,006 | △0.0 | − |
| 8月末 | 10,005 | △0.0 | − |
| 9月末 | 10,005 | △0.0 | − |
| 10月末 | 10,005 | △0.0 | − |
| 11月末 | 10,004 | △0.0 | − |
| (期末)2022年12月9日 | 10,004 | △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：10,007円　期末：10,004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**

2022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 | 159,157,999 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 159,157,999 | 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** | **159,157,999,197円** |
| コール・ローン等 | 159,157,999,197 |
| **(B) 負債** | **－** |
| **(C) 純資産総額(A－B)** | **159,157,999,197** |
| 元本 | 159,095,941,234 |
| 次期繰越損益金 | 62,057,963 |
| **(D) 受益権総口数** | **159,095,941,234口** |
| **１万口当り基準価額(C／D)** | **10,004円** |

＊期首における元本額は147,676,216,454円、当作成期間中における追加設定元本額は146,804,060,770円、同解約元本額は135,384,335,990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：

| | |
|---|---|
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド　－ロボテック－ | 947,268円 |
| ダイワ／ミレーアセット・インド株式ファンド　－インドの匠－ | 29,910,270円 |
| ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジあり） | 998円 |
| ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジなし） | 998円 |
| ＵＳ短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型） | 102,434円 |
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド　－ロボテック－（為替ヘッジあり） | 39,849円 |
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年１回決算型）－ロボテック（年１回）－（為替ヘッジあり） | 3,985円 |
| ｉＦｒｅｅレバレッジ　Ｓ＆Ｐ500 | 10,791,948,720円 |
| ｉＦｒｅｅレバレッジ　ＮＡＳＤＡＱ100 | 75,953,937,119円 |
| クリーンテック株式ファンド（資産成長型） | 998,802円 |
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド　－ロボテック－（毎月決算／予想分配金提示型） | 999円 |
| 世界インフラ戦略ファンド（為替ヘッジなし／毎月分配型） | 1,000円 |
| 世界インフラ戦略ファンド（為替ヘッジなし／資産成長型） | 499,501円 |
| ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス | 4,236,015,061円 |
| ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス | 6,234,269,565円 |
| ダイワ上場投信－ＴＯＰＩＸレバレッジ（２倍）指数 | 1,010,016,980円 |
| ダイワ上場投信－ＴＯＰＩＸダブルインバース（－２倍）指数 | 926,363,625円 |
| ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス | 7,290,053,955円 |
| ダイワ上場投信－ＴＯＰＩＸインバース（－１倍）指数 | 12,970,925,555円 |
| ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400レバレッジ・インデックス | 538,317,221円 |
| ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400インバース・インデックス | 151,994,519円 |
| ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400ダブルインバース・インデックス | 107,919,373円 |
| ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016－07 | 997円 |
| ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016－10 | 997円 |
| 先進国トータルリターン戦略ファンド（リスク抑制型／適格機関投資家専用） | 207,414,601円 |
| ダイワ日本株式ベア・ファンド（適格機関投資家専用） | 45,188,231円 |
| ダイワ日本国債15－20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ　－ＳＬトレード－ | 4,992,083円 |
| ブルベア・マネー・ポートフォリオ６ | 19,642,480,283円 |
| ブル３倍日本株ポートフォリオ６ | 17,085,842,499円 |
| ベア２倍日本株ポートフォリオ６ | 1,818,361,471円 |
| ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ | 42,615,540円 |
| ダイワＵＳ短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年１回決算型） | 9,957円 |
| ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジあり） | 997円 |
| ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジなし） | 997円 |
| ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり） | 997円 |
| ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジなし） | 997円 |
| ダイワ／ミレーアセット亜細亜株式ファンド | 4,148円 |
| 通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース | 10,833円 |
| 通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース | 10,788円 |
| 通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース | 12,751円 |
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年１回決算型）　－ロボテック（年１回）－ | 100,588円 |
| ダイワ／ミレーアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド | 5,813円 |
| ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型） | 398,764円 |
| ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　豪ドル・コース（毎月分配型） | 99,691円 |
| ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　ブラジル・レアル・コース（毎月分配型） | 398,764円 |
| ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　米ドル・コース（毎月分配型） | 398,764円 |
| ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　通貨セレクト・コース（毎月分配型） | 15,402円 |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイ２－　予想分配金提示型　日本円・コース | 300,273円 |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイ２－　予想分配金提示型　豪ドル・コース | 200,861円 |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイ２－　予想分配金提示型　ブラジル・レアル・コース | 300,273円 |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイ２－　予想分配金提示型　米ドル・コース | 1,999,177円 |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイ２－　予想分配金提示型　通貨セレクト・コース | 505,900円 |

＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,004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** | **△ 48,809,986円** |
| 支払利息 | △ 48,809,986 |
| **(B) 当期損益金(A)** | **△ 48,809,986** |
| **(C) 前期繰越損益金** | **101,772,030** |
| **(D) 解約差損益金** | **△ 77,894,524** |
| **(E) 追加信託差損益金** | **86,990,443** |
| **(F) 合計(B＋C＋D＋E)** | **62,057,963** |
| **次期繰越損益金(F)** | **62,057,963** |

（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。