

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) －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・リアル・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)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式	
信託期間	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・リアル・コース (毎月分配型) 米ドル・コース (毎月分配型)	2011年9月22日～2026年9月7日
	通貨セレクト・コース (毎月分配型)	2013年5月31日～2026年9月7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USストラテジー・ファンド (日本円・クラス)」の受益証券 (円建) ②ダイワ・マネー・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USストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)」の受益証券 (円建) ②ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券
	ブラジル・リアル・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USストラテジー・ファンド (ブラジル・リアル・クラス)」の受益証券 (円建) ②ダイワ・マネー・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USストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)」の受益証券 (円建) ②ダイワ・マネー・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US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) ②ダイワ・マネー・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、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。通貨セレクト・コースは、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。	

運用報告書 (全体版)

日本円・コース (毎月分配型)	第150期 (決算日 2024年4月8日)
豪ドル・コース (毎月分配型)	第151期 (決算日 2024年5月7日)
ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	第152期 (決算日 2024年6月7日)
米ドル・コース (毎月分配型)	第153期 (決算日 2024年7月8日)
	第154期 (決算日 2024年8月7日)
	第155期 (決算日 2024年9月9日)
通貨セレクト・コース (毎月分配型)	第130期 (決算日 2024年4月8日)
	第131期 (決算日 2024年5月7日)
	第132期 (決算日 2024年6月7日)
	第133期 (決算日 2024年7月8日)
	第134期 (決算日 2024年8月7日)
	第135期 (決算日 2024年9月9日)

(作成対象期間 2024年3月8日～2024年9月9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、割安と判断される米国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ます。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先 (コールセンター)
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<3834>
<3835>
<3836>
<3837>
<5763>

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			S & P500指数 (税引後 配当込み、米ドルベース)		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
126期末 (2022年 4月 7日)	6,773	35	3.5	44,474	3.6	—	98.4	334
127期末 (2022年 5月 9日)	6,592	35	△ 2.2	40,950	△ 7.9	—	99.1	323
128期末 (2022年 6月 7日)	6,589	35	0.5	40,984	0.1	—	96.6	323
129期末 (2022年 7月 7日)	5,766	35	△ 12.0	38,272	△ 6.6	—	99.0	281
130期末 (2022年 8月 8日)	6,135	35	7.0	41,289	7.9	—	99.1	300
131期末 (2022年 9月 7日)	5,911	35	△ 3.1	38,977	△ 5.6	—	97.4	288
132期末 (2022年 10月 7日)	5,923	35	0.8	37,386	△ 4.1	—	97.6	286
133期末 (2022年 11月 7日)	6,078	35	3.2	37,671	0.8	—	99.3	294
134期末 (2022年 12月 7日)	6,293	35	4.1	39,430	4.7	—	97.4	303
135期末 (2023年 1月 10日)	6,386	35	2.0	38,982	△ 1.1	—	99.0	308
136期末 (2023年 2月 7日)	6,539	35	2.9	41,196	5.7	—	99.5	316
137期末 (2023年 3月 7日)	6,462	35	△ 0.6	40,623	△ 1.4	—	99.2	311
138期末 (2023年 4月 7日)	6,178	35	△ 3.9	41,240	1.5	—	99.8	297
139期末 (2023年 5月 8日)	6,067	35	△ 1.2	41,574	0.8	—	97.9	291
140期末 (2023年 6月 7日)	6,050	35	0.3	43,117	3.7	—	99.1	292
141期末 (2023年 7月 7日)	6,110	35	1.6	44,441	3.1	—	99.2	297
142期末 (2023年 8月 7日)	6,395	35	5.2	45,137	1.6	—	99.1	306
143期末 (2023年 9月 7日)	6,295	35	△ 1.0	45,067	△ 0.2	—	99.7	301
144期末 (2023年 10月 10日)	5,987	35	△ 4.3	43,800	△ 2.8	—	97.5	287
145期末 (2023年 11月 7日)	5,986	35	0.6	44,128	0.7	—	97.6	283
146期末 (2023年 12月 7日)	5,914	35	△ 0.6	46,045	4.3	—	98.9	261
147期末 (2024年 1月 9日)	6,150	35	4.6	48,254	4.8	—	97.5	270
148期末 (2024年 2月 7日)	6,168	35	0.9	50,214	4.1	—	98.2	263
149期末 (2024年 3月 7日)	6,263	35	2.1	51,799	3.2	—	97.5	264
150期末 (2024年 4月 8日)	6,342	35	1.8	52,852	2.0	0.0	98.2	268
151期末 (2024年 5月 7日)	6,071	35	△ 3.7	52,638	△ 0.4	0.0	99.0	255
152期末 (2024年 6月 7日)	6,002	35	△ 0.6	54,448	3.4	0.0	97.5	252
153期末 (2024年 7月 8日)	5,889	35	△ 1.3	56,674	4.1	0.0	97.9	248
154期末 (2024年 8月 7日)	5,956	35	1.7	53,371	△ 5.8	0.0	97.4	247
155期末 (2024年 9月 9日)	6,022	25	1.5	55,147	3.3	0.0	98.1	249

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P500指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、同指数の原データをもとに、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。

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

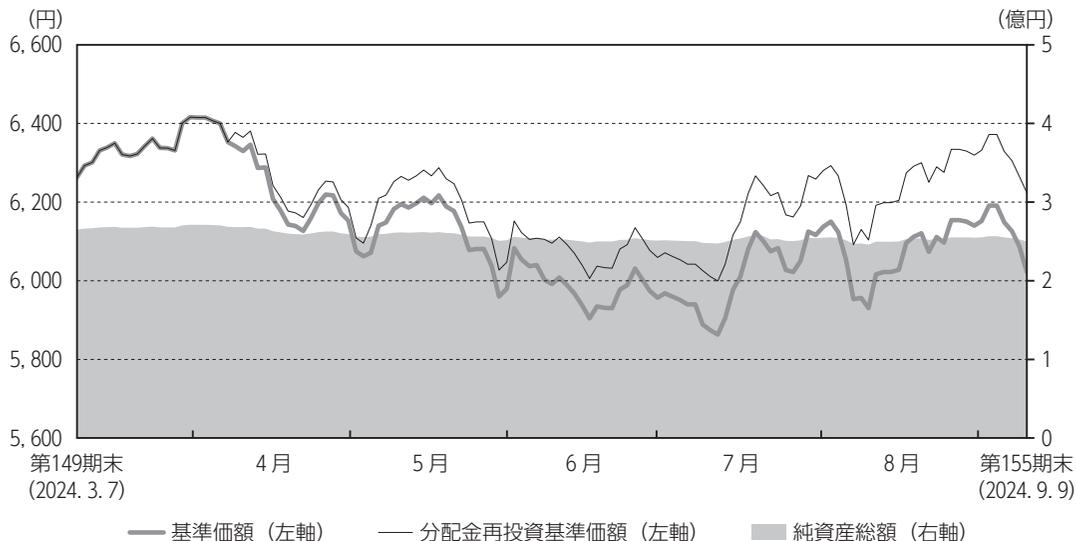
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* 分配金再投資基準価額は、分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。

* 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

第150期首：6,263円

第155期末：6,022円 (既払分配金200円)

騰落率：△0.6% (分配金再投資ベース)

■ 基準価額の主な変動要因

投資した「クロッキーUSストラテジー・ファンド (日本円・クラス)」はおおむね横ばいとなったものの、運用管理費用がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。「クロッキーUSストラテジー・ファンド (日本円・クラス)」については、米国株式市況が上昇したことがプラス要因となったものの、オプション取引戦略やヘッジコストがマイナス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※クロッキーUSストラテジー・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USストラテジー・ファンド (日本円・クラス)

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - 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		S & P 500指数 (税引後 配当込み、米ドルベース) (参考指数)		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
第150期	(期首) 2024年 3月 7日	円 6,263	% —	51,799	% —	% —	% 97.5
	3月末	6,416	2.4	53,352	3.0	0.0	97.6
	(期末) 2024年 4月 8日	6,377	1.8	52,852	2.0	0.0	98.2
第151期	(期首) 2024年 4月 8日	6,342	—	52,852	—	0.0	98.2
	4月末	6,153	△ 3.0	51,977	△ 1.7	0.0	98.5
	(期末) 2024年 5月 7日	6,106	△ 3.7	52,638	△ 0.4	0.0	99.0
第152期	(期首) 2024年 5月 7日	6,071	—	52,638	—	0.0	99.0
	5月末	5,980	△ 1.5	53,242	1.1	0.0	99.3
	(期末) 2024年 6月 7日	6,037	△ 0.6	54,448	3.4	0.0	97.5
第153期	(期首) 2024年 6月 7日	6,002	—	54,448	—	0.0	97.5
	6月末	5,957	△ 0.7	55,803	2.5	0.0	97.4
	(期末) 2024年 7月 8日	5,924	△ 1.3	56,674	4.1	0.0	97.9
第154期	(期首) 2024年 7月 8日	5,889	—	56,674	—	0.0	97.9
	7月末	6,138	4.2	55,364	△ 2.3	0.0	99.5
	(期末) 2024年 8月 7日	5,991	1.7	53,371	△ 5.8	0.0	97.4
第155期	(期首) 2024年 8月 7日	5,956	—	53,371	—	0.0	97.4
	8月末	6,152	3.3	57,001	6.8	0.0	97.7
	(期末) 2024年 9月 9日	6,047	1.5	55,147	3.3	0.0	98.1

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2024. 3. 8 ～ 2024. 9. 9）

■ 米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、インフレ再燃が懸念され米国の利下げ開始が後ずれするとの見方が強まり、下落しました。2024年4月下旬以降は、米国のインフレ率が低下傾向となり利下げ期待が高まったことなどから上昇基調となり、高成長が期待されるAI（人工知能）関連企業の株価急騰が相場をけん引しました。しかし7月中旬以降は、対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落しました。さらに8月初旬には、雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから景気の先行きに対する不透明感がにわかに強まり、急落しました。その後は、米国の経済指標の改善やFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の実質的な利下げ開始発言などを好感し、株価は急反発しました。当作成期末にかけては、経済指標が市場予想を下回ったことで再び景気後退懸念が高まったことから、株価はやや軟調に推移しました。

■ 短期金利市況

日銀は政策金利である「無担保コールレート（オーバーナイト物）」を0.25%程度に引き上げました。米国ではFRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利であるFFレート（フェデラル・ファンド・レート）の誘導目標を5.25～5.50%に据え置きました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■ 当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（日本円・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■ クロッキーUSストラテジー・ファンド（日本円・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からGICS（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2024. 3. 8 ~ 2024. 9. 9)

当ファンド

当ファンドは、「クロッキーUSストラテジー・ファンド (日本円・クラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じて「クロッキーUSストラテジー・ファンド (日本円・クラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資しました。また、「クロッキーUSストラテジー・ファンド (日本円・クラス)」への投資割合を高位に維持しました。

クロッキーUSストラテジー・ファンド (日本円・クラス)

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S (世界産業分類基準) の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40銘柄を選定しました。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した。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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した。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

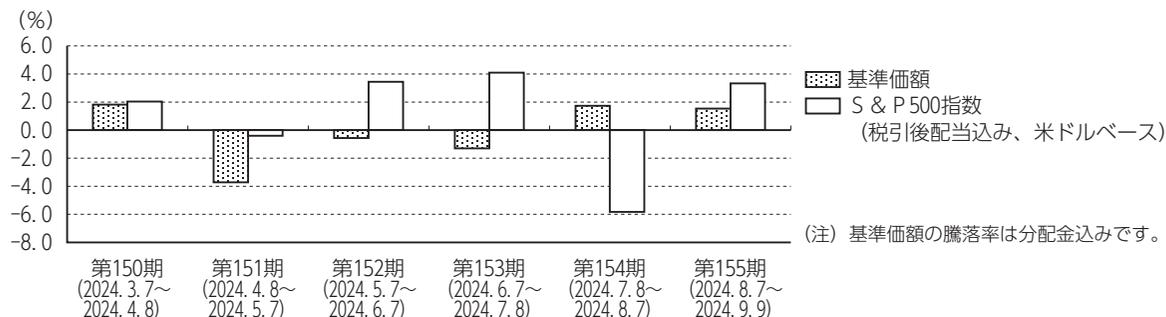
ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性及び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いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■ 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
	2024年3月8日 ～2024年4月8日	2024年4月9日 ～2024年5月7日	2024年5月8日 ～2024年6月7日	2024年6月8日 ～2024年7月8日	2024年7月9日 ～2024年8月7日	2024年8月8日 ～2024年9月9日
当期分配金(税込み) (円)	35	35	35	35	35	25
対基準価額比率 (%)	0.55	0.57	0.58	0.59	0.58	0.41
当期の収益 (円)	26	15	21	15	25	24
当期の収益以外 (円)	8	19	13	19	9	0
翌期繰越分配対象額 (円)	430	411	397	378	369	368

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

■ 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 26.99円	✓ 15.63円	✓ 21.36円	✓ 15.82円	✓ 25.87円	✓ 24.45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	0.00
(c) 収益調整金	249.83	250.13	250.50	250.83	251.13	251.31
(d) 分配準備積立金	✓ 188.88	✓ 180.58	✓ 160.86	✓ 146.90	✓ 127.42	✓ 118.11
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	465.71	446.35	432.72	413.55	404.43	393.89
(f) 分配金	35.00	35.00	35.00	35.00	35.00	25.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	430.71	411.35	397.72	378.55	369.43	368.89

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（日本円・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（日本円・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からGICS（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

※当ファンドでは40銘柄を選定して運用していますが、銘柄の見直しに伴い、一時的に40銘柄とまらない場合があります。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	第150期～第155期 (2024. 3. 8～2024. 9. 9)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42円	0. 685%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は6, 125円です。
(投 信 会 社)	(14)	(0. 224)	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)	(27)	(0. 448)	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. 014)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0. 004	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	42	0. 689	

(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。

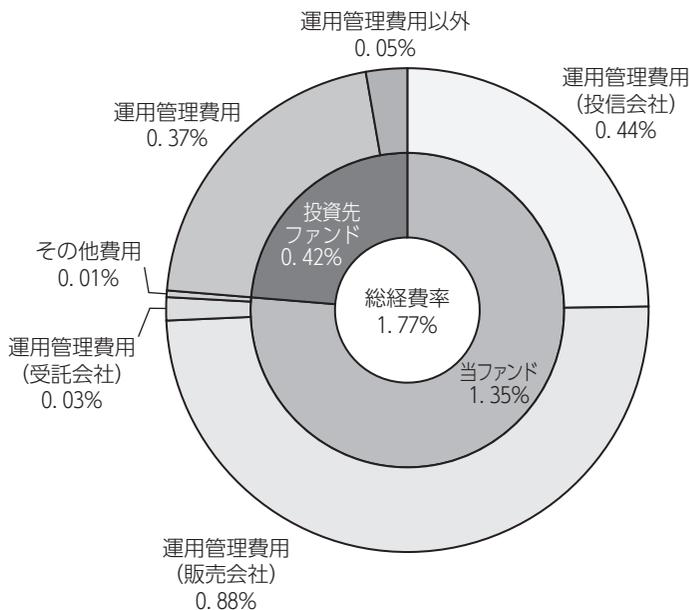
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.77%です。



総経費率（①＋②＋③）	1.77%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
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	0.05%

(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) 投資先ファンドの費用には、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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期		第 150 期 ～ 第 155 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	CROCI US STRATEGY FUND JPY CLASS (ケイマン諸島)	86.0773	6,555	174.6912	13,100

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期	第 150 期 ～ 第 155 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・ マザーファンド	—	—	130	133

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年9月9日現在

項 目	第 155 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	244,999	97.5
ダイワ・マネー・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	6,156	2.5
投資信託財産総額	251,158	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 155 期 末		
	□ 数	評価額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) CROCI US STRATEGY FUND JPY CLASS	3,247.35215	244,999	98.1

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第 155 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・ マザーファンド	132	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 日本円・コース (毎月分配型)

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月8日)、(2024年5月7日)、(2024年6月7日)、(2024年7月8日)、(2024年8月7日)、(2024年9月9日)現在

項目	第150期末	第151期末	第152期末	第153期末	第154期末	第155期末
(A) 資産	269,874,625円	257,736,465円	254,359,013円	249,858,269円	249,029,484円	251,158,485円
コール・ローン等	6,672,302	4,231,228	8,379,134	6,872,805	8,122,732	6,156,874
投資信託受益証券 (評価額)	263,200,443	253,503,357	245,977,999	242,983,584	240,904,872	244,999,730
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	1,880	1,880	1,880	1,880	1,880	1,881
(B) 負債	1,799,799	1,764,848	2,037,577	1,769,002	1,744,939	1,358,803
未払収益分配金	1,479,464	1,475,698	1,471,330	1,474,400	1,453,173	1,036,985
未払解約金	1,273	6,032	265,927	—	3,011	3,316
未払信託報酬	317,135	279,496	294,911	287,449	279,901	307,777
その他未払費用	1,927	3,622	5,409	7,153	8,854	10,725
(C) 純資産総額 (A - B)	268,074,826	255,971,617	252,321,436	248,089,267	247,284,545	249,799,682
元本	422,704,165	421,628,154	420,380,010	421,257,260	415,192,571	414,794,015
次期繰越損益金	△ 154,629,339	△ 165,656,537	△ 168,058,574	△ 173,167,993	△ 167,908,026	△ 164,994,333
(D) 受益権総口数	422,704,165口	421,628,154口	420,380,010口	421,257,260口	415,192,571口	414,794,015口
1万口当り基準価額 (C/D)	6,342円	6,071円	6,002円	5,889円	5,956円	6,022円

* 当作成期首における元本額は422,532,244円、当作成期間 (第150期～第155期) 中における追加設定元本額は4,864,265円、同解約元本額は12,602,494円です。

* 第155期末の計算口数当りの純資産額は6,022円です。

* 第155期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は164,994,333円です。

■損益の状況

第150期 自2024年3月8日 至2024年4月8日 第152期 自2024年5月8日 至2024年6月7日 第154期 自2024年7月9日 至2024年8月7日
 第151期 自2024年4月9日 至2024年5月7日 第153期 自2024年6月8日 至2024年7月8日 第155期 自2024年8月8日 至2024年9月9日

項目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(A) 配当等収益	1,216,608円	940,516円	1,194,871円	955,696円	1,146,239円	1,097,248円
受取配当金	1,216,371	940,213	1,194,702	955,223	1,145,953	1,095,925
受取利息	248	303	169	473	286	1,323
支払利息	△ 11	—	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	3,912,497	△ 10,603,334	△ 2,319,762	△ 3,949,258	3,352,547	3,001,438
売買益	3,912,482	29,975	7,096	180	3,473,844	2,998,882
売買損	15	△ 10,633,309	△ 2,326,858	△ 3,949,438	△ 121,297	2,556
(C) 信託報酬等	△ 319,062	△ 281,191	△ 296,698	△ 289,193	△ 281,602	△ 309,648
(D) 当期損益金 (A + B + C)	4,810,043	△ 9,944,009	△ 1,421,589	△ 3,282,755	4,217,184	3,789,038
(E) 前期繰越損益金	△ 51,865,226	△ 48,332,990	△ 59,443,788	△ 62,327,366	△ 65,965,855	△ 63,041,556
(F) 追加信託差損益金	△ 106,094,692	△ 105,903,840	△ 105,721,867	△ 106,083,472	△ 104,706,182	△ 104,704,830
(配当等相当額)	(10,560,783)	(10,546,259)	(10,530,533)	(10,566,471)	(10,426,779)	(10,424,559)
(売買損益相当額)	(△ 116,655,475)	(△ 116,450,099)	(△ 116,252,400)	(△ 116,649,943)	(△ 115,132,961)	(△ 115,129,389)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 153,149,875	△ 164,180,839	△ 166,587,244	△ 171,693,593	△ 166,454,853	△ 163,957,348
(H) 収益分配金	△ 1,479,464	△ 1,475,698	△ 1,471,330	△ 1,474,400	△ 1,453,173	△ 1,036,985
次期繰越損益金 (G + H)	△ 154,629,339	△ 165,656,537	△ 168,058,574	△ 173,167,993	△ 167,908,026	△ 164,994,333
追加信託差損益金	△ 106,094,692	△ 105,903,840	△ 105,721,867	△ 106,083,472	△ 104,706,182	△ 104,704,830
(配当等相当額)	(10,560,783)	(10,546,259)	(10,530,533)	(10,566,471)	(10,426,779)	(10,424,559)
(売買損益相当額)	(△ 116,655,475)	(△ 116,450,099)	(△ 116,252,400)	(△ 116,649,943)	(△ 115,132,961)	(△ 115,129,389)
分配準備積立金	7,645,658	6,797,517	6,189,219	5,380,395	4,911,987	4,876,900
繰越損益金	△ 56,180,305	△ 66,550,214	△ 68,525,926	△ 72,464,916	△ 68,113,831	△ 65,166,403

(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、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,140,926円	659,325円	898,173円	666,503円	1,074,487円	1,014,355円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	10,560,783	10,546,259	10,530,533	10,566,471	10,426,779	10,424,559
(d) 分配準備積立金	7,984,196	7,613,890	6,762,376	6,188,292	5,290,673	4,899,530
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	19,685,905	18,819,474	18,191,082	17,421,266	16,791,939	16,338,444
(f) 分配金	1,479,464	1,475,698	1,471,330	1,474,400	1,453,173	1,036,985
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	18,206,441	17,343,776	16,719,752	15,946,866	15,338,766	15,301,459
(h) 受益権総口数	422,704,165口	421,628,154口	420,380,010口	421,257,260口	415,192,571口	414,794,015口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1万口当り分配金(税込み)	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
		35円	35円	35円	35円	35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。

S & P 500指数は S&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社 (「SPDJ」) の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S&P Global, Inc. またはその関連会社 (「S & P」) の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは SPDJ に付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 日本円・コース (毎月分配型) は、SPDJ、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 500指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

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			S & P 500指数 (税引後 配当込み、米ドルベース)		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
126期末(2022年4月7日)	4,709	20	12.4	44,474	3.6	92.82	9.2	—	97.5	1,064
127期末(2022年5月9日)	4,518	20	△ 3.6	40,950	△ 7.9	91.70	△ 1.2	—	98.6	1,003
128期末(2022年6月7日)	4,608	20	2.4	40,984	0.1	94.96	3.6	—	97.6	1,013
129期末(2022年7月7日)	3,922	20	△ 14.5	38,272	△ 6.6	92.19	△ 2.9	—	97.4	845
130期末(2022年8月8日)	4,250	20	8.9	41,289	7.9	93.51	1.4	—	98.0	902
131期末(2022年9月7日)	4,227	20	△ 0.1	38,977	△ 5.6	96.09	2.8	—	97.5	883
132期末(2022年10月7日)	4,110	20	△ 2.3	37,386	△ 4.1	93.02	△ 3.2	—	97.8	850
133期末(2022年11月7日)	4,298	20	5.1	37,671	0.8	94.61	1.7	—	97.5	874
134期末(2022年12月7日)	4,321	20	1.0	39,430	4.7	91.93	△ 2.8	—	98.7	848
135期末(2023年1月10日)	4,354	20	1.2	38,982	△ 1.1	91.10	△ 0.9	—	99.2	843
136期末(2023年2月7日)	4,501	20	3.8	41,196	5.7	91.39	0.3	—	97.5	869
137期末(2023年3月7日)	4,484	20	0.1	40,623	△ 1.4	91.64	0.3	—	98.3	863
138期末(2023年4月7日)	4,144	20	△ 7.1	41,240	1.5	87.90	△ 4.1	—	99.0	774
139期末(2023年5月8日)	4,228	20	2.5	41,574	0.8	91.14	3.7	—	99.6	790
140期末(2023年6月7日)	4,335	20	3.0	43,117	3.7	93.21	2.3	—	99.0	785
141期末(2023年7月7日)	4,504	20	4.4	44,441	3.1	95.43	2.4	—	97.9	792
142期末(2023年8月7日)	4,636	20	3.4	45,137	1.6	93.21	△ 2.3	—	98.9	812
143期末(2023年9月7日)	4,626	20	0.2	45,067	△ 0.2	94.31	1.2	—	95.8	787
144期末(2023年10月10日)	4,459	20	△ 3.2	43,800	△ 2.8	95.42	1.2	—	98.0	751
145期末(2023年11月7日)	4,599	20	3.6	44,128	0.7	97.28	1.9	—	99.6	767
146期末(2023年12月7日)	4,540	20	△ 0.8	46,045	4.3	96.46	△ 0.8	—	98.9	753
147期末(2024年1月9日)	4,762	20	5.3	48,254	4.8	96.81	0.4	—	98.0	761
148期末(2024年2月7日)	4,770	20	0.6	50,214	4.1	96.54	△ 0.3	—	99.4	755
149期末(2024年3月7日)	4,948	20	4.2	51,799	3.2	97.92	1.4	—	99.3	772
150期末(2024年4月8日)	5,114	20	3.8	52,852	2.0	99.60	1.7	0.0	98.0	793
151期末(2024年5月7日)	4,975	20	△ 2.3	52,638	△ 0.4	102.30	2.7	0.0	98.0	753
152期末(2024年6月7日)	5,102	20	3.0	54,448	3.4	103.91	1.6	0.0	98.6	772
153期末(2024年7月8日)	5,262	20	3.5	56,674	4.1	108.39	4.3	0.0	98.0	791
154期末(2024年8月7日)	4,641	20	△ 11.4	53,371	△ 5.8	96.12	△ 11.3	0.0	99.8	688
155期末(2024年9月9日)	4,796	20	3.8	55,147	3.3	95.28	△ 0.9	0.0	99.2	706

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 500指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、同指数の原データをもとに、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。

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

(注4) 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5) 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。

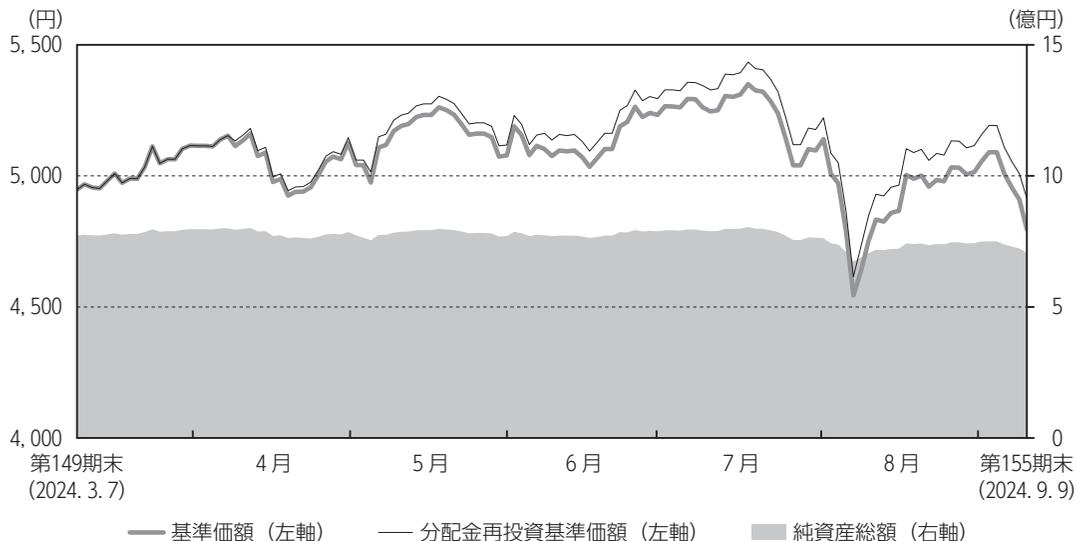
(注6) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注7) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* 分配金再投資基準価額は、分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります (分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

第150期首：4,948円

第155期末：4,796円 (既払分配金120円)

騰落率：△0.7% (分配金再投資ベース)

■ 基準価額の主な変動要因

投資した「クローキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)」はおおむね横ばいとなったものの、運用管理費用がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。「クローキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)」については、米国株式市況が上昇したことがプラス要因となったものの、豪ドルが対円で下落 (円高) したことやオプション取引戦略はマイナス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※クローキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)：オージェンタム・トラストクローキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - 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		S & P500指数 (税引後 配当込み、米ドルベース)		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
		円	%	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	騰落率		
第150期	(期首) 2024年 3月 7日	4,948	—	51,799	—	97.92	—	—	99.3
	3月末	5,116	3.4	53,352	3.0	98.61	0.7	0.0	99.7
	(期末) 2024年 4月 8日	5,134	3.8	52,852	2.0	99.60	1.7	0.0	98.0
第151期	(期首) 2024年 4月 8日	5,114	—	52,852	—	99.60	—	0.0	98.0
	4月末	5,126	0.2	51,977	△ 1.7	102.96	3.4	0.0	99.3
	(期末) 2024年 5月 7日	4,995	△ 2.3	52,638	△ 0.4	102.30	2.7	0.0	98.0
第152期	(期首) 2024年 5月 7日	4,975	—	52,638	—	102.30	—	0.0	98.0
	5月末	5,078	2.1	53,242	1.1	104.01	1.7	0.0	98.1
	(期末) 2024年 6月 7日	5,122	3.0	54,448	3.4	103.91	1.6	0.0	98.6
第153期	(期首) 2024年 6月 7日	5,102	—	54,448	—	103.91	—	0.0	98.6
	6月末	5,233	2.6	55,803	2.5	107.00	3.0	0.0	99.2
	(期末) 2024年 7月 8日	5,282	3.5	56,674	4.1	108.39	4.3	0.0	98.0
第154期	(期首) 2024年 7月 8日	5,262	—	56,674	—	108.39	—	0.0	98.0
	7月末	5,140	△ 2.3	55,364	△ 2.3	99.65	△ 8.1	0.0	99.4
	(期末) 2024年 8月 7日	4,661	△ 11.4	53,371	△ 5.8	96.12	△ 11.3	0.0	99.8
第155期	(期首) 2024年 8月 7日	4,641	—	53,371	—	96.12	—	0.0	99.8
	8月末	5,056	8.9	57,001	6.8	98.44	2.4	0.0	98.2
	(期末) 2024年 9月 9日	4,816	3.8	55,147	3.3	95.28	△ 0.9	0.0	99.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2024. 3. 8 ~ 2024. 9. 9)

■ 米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、インフレ再燃が懸念され米国の利下げ開始が後ずれするとの見方が強まり、下落しました。2024年4月下旬以降は、米国のインフレ率が低下傾向となり利下げ期待が高まったことなどから上昇基調となり、高成長が期待されるAI（人工知能）関連企業の株価急騰が相場をけん引しました。しかし7月中旬以降は、対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落しました。さらに8月初旬には、雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから景気の先行きに対する不透明感がにわかに強まり、急落しました。その後は、米国の経済指標の改善やFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の実質的な利下げ開始発言などを好感し、株価は急反発しました。当作成期末にかけては、経済指標が市場予想を下回ったことで再び景気後退懸念が高まったことから、株価はやや軟調に推移しました。

■ 為替相場

豪ドル為替相場は、対円で下落しました。

当作成期首より、オーストラリアのCPI（消費者物価指数）が市場予想を上回ったことや、緩和的な政策を継続する日銀の姿勢などが円安豪ドル高の材料となり、豪ドルは円に対して上昇（円安）しました。2024年7月以降は、政府・日銀が為替介入を実施したとの観測が浮上したことや日銀の利上げ観測が高まったことなどから、円高豪ドル安が進行しました。

■ 短期金利市況

オーストラリアでは、RBA（オーストラリア準備銀行）が政策金利を4.35%に据え置きました。一方、米国では、FRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利であるFFレート（フェデラル・ファンド・レート）の誘導目標を5.25~5.50%に据え置きました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S (世界産業分類基準)の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。米ドル売り/豪ドル買いの為替取引を活用して、豪ドルで実質的な運用を行います。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2024. 3. 8 ~ 2024. 9. 9)

■当ファンド

当ファンドは、「クロッキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じて「クロッキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資しました。また、「クロッキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)」への投資割合を高位に維持しました。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド (豪ドル・クラス)

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S (世界産業分類基準)の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40銘柄を選定しました。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した。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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した。米ドル売り/豪ドル買いの為替取引を活用して、豪ドルで実質的な運用を行いました。

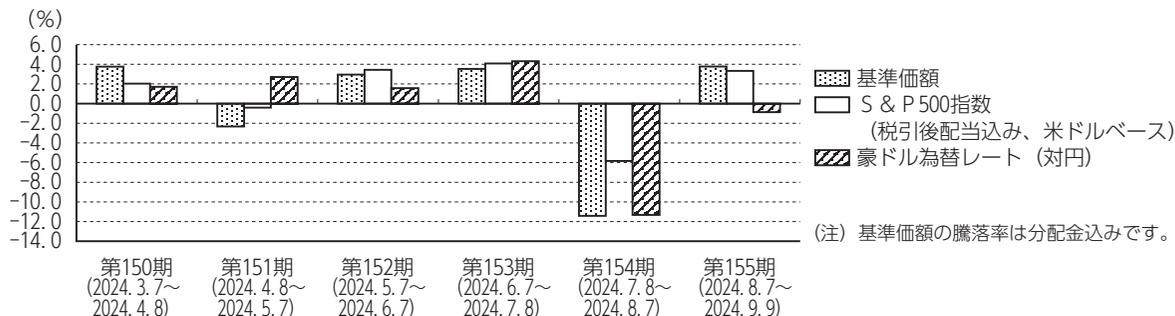
■ダイワ・マネー・マザーファンド

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いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
	2024年3月8日 ～2024年4月8日	2024年4月9日 ～2024年5月7日	2024年5月8日 ～2024年6月7日	2024年6月8日 ～2024年7月8日	2024年7月9日 ～2024年8月7日	2024年8月8日 ～2024年9月9日
当期分配金(税込み) (円)	20	20	20	20	20	20
対基準価額比率 (%)	0.39	0.40	0.39	0.38	0.43	0.42
当期の収益 (円)	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	699	712	729	748	762	781

(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、ファンドの収益率は異なります。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 37.88円	✓ 32.43円	✓ 36.78円	✓ 39.19円	✓ 34.44円	✓ 38.50円
(b) 経費控除後の有価証券売却等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	206.64	206.87	207.13	207.38	207.80	208.09
(d) 分配準備積立金	475.38	493.04	505.21	521.75	540.53	554.69
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	719.91	732.35	749.13	768.33	782.78	801.29
(f) 分配金	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	699.91	712.35	729.13	748.33	762.78	781.29

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。米ドル売り／豪ドル買いの為替取引を活用して、豪ドルで実質的な運用を行います。

※当ファンドでは40銘柄を選定して運用していますが、銘柄の見直しに伴い、一時的に40銘柄とまらない場合があります。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	第150期～第155期 (2024. 3. 8～2024. 9. 9)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	35円	0. 685%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は5, 084円です。
(投 信 会 社)	(11)	(0. 224)	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)	(23)	(0. 448)	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. 014)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0. 004	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	35	0. 689	

(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。

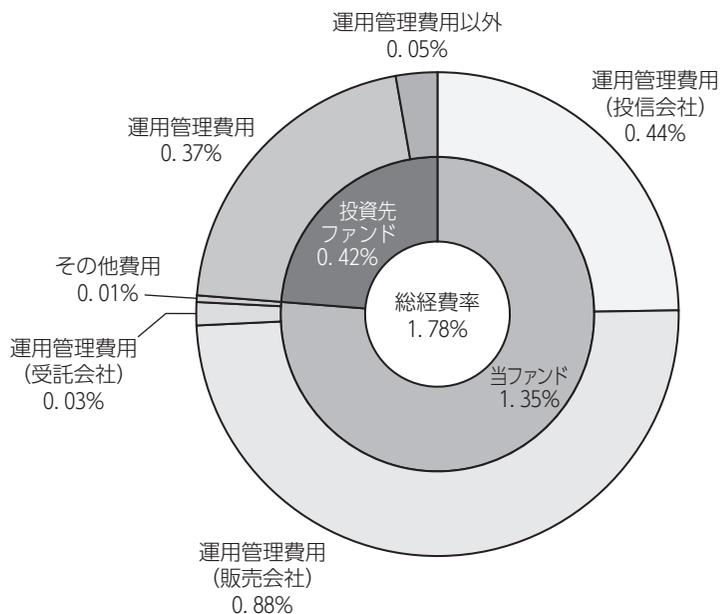
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.78%です。



総経費率（①＋②＋③）	1.78%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
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	0.05%

(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) 投資先ファンドの費用には、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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期		第 150 期 ~ 第 155 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	CROCI US STRATEGY FUND AUD CLASS (ケイマン諸島)	403.6324	35,748	772.99444	68,200

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期	第 150 期 ~ 第 155 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・ マザーファンド	—	—	51	52

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年9月9日現在

項 目	第 155 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	701,000	98.6
ダイワ・マネー・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	9,837	1.4
投資信託財産総額	710,840	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 155 期 末		
	□ 数	評価額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) CROCI US STRATEGY FUND AUD CLASS	8,456.28806	701,000	99.2

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第 155 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・ マザーファンド	52	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型)

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月8日)、(2024年5月7日)、(2024年6月7日)、(2024年7月8日)、(2024年8月7日)、(2024年9月9日)現在

項目	第150期末	第151期末	第152期末	第153期末	第154期末	第155期末
(A) 資産	800,538,220円	766,882,931円	776,915,084円	795,152,005円	692,634,450円	710,840,069円
コール・ローン等	22,268,388	28,168,056	15,045,400	19,540,045	5,584,266	9,837,324
投資信託受益証券 (評価額)	778,267,999	738,713,042	761,867,850	775,610,126	687,048,350	701,000,911
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	1,833	1,833	1,834	1,834	1,834	1,834
(B) 負債	6,618,346	13,043,379	3,941,654	3,922,984	4,151,814	4,359,156
未払収益分配金	3,104,804	3,030,693	3,030,375	3,007,147	2,966,699	2,945,983
未払解約金	2,578,272	9,172,053	—	—	303,314	487,923
未払信託報酬	929,597	829,893	895,074	894,177	854,923	892,922
その他未払費用	5,673	10,740	16,205	21,660	26,878	32,328
(C) 純資産総額 (A - B)	793,919,874	753,839,552	772,973,430	791,229,021	688,482,636	706,480,913
元本	1,552,402,226	1,515,346,942	1,515,187,958	1,503,573,542	1,483,349,913	1,472,991,605
次期繰越損益金	△ 758,482,352	△ 761,507,390	△ 742,214,528	△ 712,344,521	△ 794,867,277	△ 766,510,692
(D) 受益権総口数	1,552,402,226口	1,515,346,942口	1,515,187,958口	1,503,573,542口	1,483,349,913口	1,472,991,605口
1万口当り基準価額 (C/D)	5,114円	4,975円	5,102円	5,262円	4,641円	4,796円

* 当作成期首における元本額は1,561,151,138円、当作成期間 (第150期～第155期) 中における追加設定元本額は4,915,279円、同解約元本額は93,074,812円です。

* 第155期末の計算口数当りの純資産額は4,796円です。

* 第155期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は766,510,692円です。

■損益の状況

第150期 自2024年3月8日至2024年4月8日 第152期 自2024年5月8日至2024年6月7日 第154期 自2024年7月9日至2024年8月7日
 第151期 自2024年4月9日至2024年5月7日 第153期 自2024年6月8日至2024年7月8日 第155期 自2024年8月8日至2024年9月9日

項目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(A) 配当等収益	6,071,223円	5,749,666円	5,799,438円	6,087,842円	5,970,069円	5,870,143円
受取配当金	6,071,099	5,748,927	5,798,347	6,087,180	5,968,845	5,867,915
受取利息	135	739	1,091	662	1,224	2,228
支払利息	△ 11	—	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	23,766,671	△ 23,013,485	17,341,560	21,999,264	△ 94,241,431	20,777,850
売買益	23,838,062	460,224	17,355,167	22,056,767	334,269	21,147,765
売買損	△ 71,391	△ 23,473,709	△ 13,607	△ 57,503	△ 94,575,700	△ 369,915
(C) 信託報酬等	△ 935,270	△ 834,960	△ 900,539	△ 899,632	△ 860,141	△ 898,372
(D) 当期損益金 (A + B + C)	28,902,624	△ 18,098,779	22,240,459	27,187,474	△ 89,131,503	25,749,621
(E) 前期繰越損益金	△ 334,796,615	△ 301,485,812	△ 322,414,207	△ 300,740,748	△ 272,631,253	△ 361,992,859
(F) 追加信託差損益金	△ 449,483,557	△ 438,892,106	△ 439,010,405	△ 435,784,100	△ 430,137,822	△ 427,321,471
(配当等相当額)	(32,080,354)	(31,348,736)	(31,385,482)	(31,181,331)	(30,824,256)	(30,651,976)
(売買損益相当額)	(△ 481,563,911)	(△ 470,240,842)	(△ 470,395,887)	(△ 466,965,431)	(△ 460,962,078)	(△ 457,973,447)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 755,377,548	△ 758,476,697	△ 739,184,153	△ 709,337,374	△ 791,900,578	△ 763,564,709
(H) 収益分配金	△ 3,104,804	△ 3,030,693	△ 3,030,375	△ 3,007,147	△ 2,966,699	△ 2,945,983
次期繰越損益金 (G + H)	△ 758,482,352	△ 761,507,390	△ 742,214,528	△ 712,344,521	△ 794,867,277	△ 766,510,692
追加信託差損益金	△ 449,483,557	△ 438,892,106	△ 439,010,405	△ 435,784,100	△ 430,137,822	△ 427,321,471
(配当等相当額)	(32,080,354)	(31,348,736)	(31,385,482)	(31,181,331)	(30,824,256)	(30,651,976)
(売買損益相当額)	(△ 481,563,911)	(△ 470,240,842)	(△ 470,395,887)	(△ 466,965,431)	(△ 460,962,078)	(△ 457,973,447)
分配準備積立金	76,574,858	76,597,034	79,092,683	81,335,841	82,323,510	84,432,077
繰越損益金	△ 385,573,653	△ 399,212,318	△ 382,296,806	△ 357,896,262	△ 447,052,965	△ 423,621,298

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	5,880,896円	4,914,706円	5,573,763円	5,892,892円	5,109,928円	5,672,232円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	32,080,354	31,348,736	31,385,482	31,181,331	30,824,256	30,651,976
(d) 分配準備積立金	73,798,766	74,713,021	76,549,295	78,450,096	80,180,281	81,705,828
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	111,760,016	110,976,463	113,508,540	115,524,319	116,114,465	118,030,036
(f) 分配金	3,104,804	3,030,693	3,030,375	3,007,147	2,966,699	2,945,983
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	108,655,212	107,945,770	110,478,165	112,517,172	113,147,766	115,084,053
(h) 受益権総口数	1,552,402,226口	1,515,346,942口	1,515,187,958口	1,503,573,542口	1,483,349,913口	1,472,991,605口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1万口当り分配金(税込み)	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
		20円	20円	20円	20円	20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。

S & P 500指数はS&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社 (「SPDJ」) の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S&P Global, Inc. またはその関連会社 (「S & P」) の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型) は、SPDJ、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 500指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			S & P 500指数 (税引後配当込み、米ドルベース)		ブラジル・リアル為替レート		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			
126期末 (2022年 4月 7日)	円	円	%		%	円	%	%	%	百万円
127期末 (2022年 5月 9日)	2,178	20	18.6	44,474	3.6	26,212	15.5	—	98.0	17,231
128期末 (2022年 6月 7日)	2,062	20	△ 4.4	40,950	△ 7.9	25,7450	△ 1.8	—	99.4	15,779
129期末 (2022年 7月 7日)	2,187	20	7.0	40,984	0.1	27,5786	7.1	—	99.2	16,573
130期末 (2022年 8月 8日)	1,718	20	△ 20.5	38,272	△ 6.6	25,0212	△ 9.3	—	99.2	12,842
131期末 (2022年 9月 7日)	1,926	20	13.3	41,289	7.9	26,1994	4.7	—	97.7	14,331
132期末 (2022年 10月 7日)	1,960	20	2.8	38,977	△ 5.6	27,2452	4.0	—	99.5	14,486
133期末 (2022年 11月 7日)	2,025	20	4.3	37,386	△ 4.1	27,7334	1.8	—	99.1	14,845
134期末 (2022年 12月 7日)	2,180	20	8.6	37,671	0.8	29,0454	4.7	—	96.1	15,693
135期末 (2022年 12月 7日)	2,036	20	△ 5.7	39,430	4.7	26,2037	△ 9.8	—	97.6	14,176
136期末 (2023年 1月 10日)	2,101	20	△ 0.3	38,982	△ 1.1	25,0685	△ 4.3	—	99.2	13,914
137期末 (2023年 2月 7日)	2,097	20	5.3	41,196	5.7	25,7320	2.6	—	98.8	14,393
138期末 (2023年 3月 7日)	2,136	20	2.8	40,623	△ 1.4	26,3783	2.5	—	97.8	14,484
139期末 (2023年 4月 7日)	2,041	20	△ 3.5	41,240	1.5	26,0461	△ 1.3	—	97.3	13,636
140期末 (2023年 5月 8日)	2,088	20	3.3	41,574	0.8	27,2817	4.7	—	99.1	13,867
141期末 (2023年 6月 7日)	2,199	20	6.3	43,117	3.7	28,3804	4.0	—	98.6	14,118
142期末 (2023年 7月 7日)	2,307	20	5.8	44,441	3.1	29,2985	3.2	—	98.8	14,587
143期末 (2023年 8月 7日)	2,415	20	5.5	45,137	1.6	29,0567	△ 0.8	—	99.0	15,045
144期末 (2023年 9月 7日)	2,429	20	1.4	45,067	△ 0.2	29,6982	2.2	—	98.4	14,998
145期末 (2023年 10月 10日)	2,260	20	△ 6.1	43,800	△ 2.8	28,9156	△ 2.6	—	97.5	13,879
146期末 (2023年 11月 7日)	2,408	20	7.4	44,128	0.7	30,7014	6.2	—	97.7	14,654
147期末 (2023年 12月 7日)	2,348	20	△ 1.7	46,045	4.3	29,9971	△ 2.3	—	97.5	14,057
148期末 (2024年 1月 9日)	2,416	20	3.7	48,254	4.8	29,5245	△ 1.6	—	97.6	14,228
149期末 (2024年 2月 7日)	2,460	20	2.6	50,214	4.1	29,8101	1.0	—	97.6	14,253
150期末 (2024年 3月 7日)	2,539	20	4.0	51,799	3.2	30,1110	1.0	—	98.5	14,370
151期末 (2024年 4月 8日)	2,564	20	1.8	52,852	2.0	29,9516	△ 0.5	0.0	98.8	14,262
152期末 (2024年 5月 7日)	2,473	20	△ 2.8	52,638	△ 0.4	30,3437	1.3	0.0	97.6	13,647
153期末 (2024年 6月 7日)	2,420	20	△ 1.3	54,448	3.4	29,6287	△ 2.4	0.0	99.2	13,254
154期末 (2024年 7月 8日)	2,361	20	△ 1.6	56,674	4.1	29,4343	△ 0.7	0.0	98.9	12,793
155期末 (2024年 8月 7日)	2,089	20	△ 10.7	53,371	△ 5.8	25,9660	△ 11.8	0.0	99.5	11,054
155期末 (2024年 9月 9日)	2,116	20	2.2	55,147	3.3	25,4885	△ 1.8	0.0	98.8	11,119

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 500指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、同指数の原データをもとに、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。

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

(注4) 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5) 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。

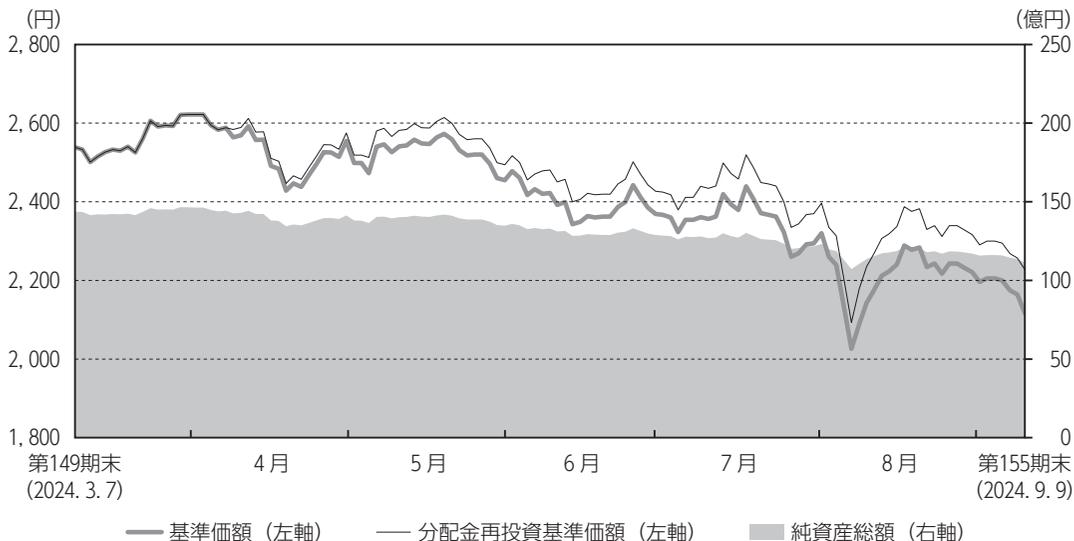
(注6) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注7) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* 分配金再投資基準価額は、分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。

* 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

第150期首：2,539円

第155期末：2,116円 (既払分配金120円)

騰落率：△12.3% (分配金再投資ベース)

■ 基準価額の主な変動要因

投資した「クロッキーUSストラテジー・ファンド (ブラジル・リアル・クラス)」の下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。「クロッキーUSストラテジー・ファンド (ブラジル・リアル・クラス)」については、米国株式市況の上昇や為替取引によるプレミアム (金利差相当分の収益) がプラス要因となったものの、ブラジル・リアルが対円で下落 (円高) したことやオプション取引戦略がマイナス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※クロッキーUSストラテジー・ファンド (ブラジル・リアル・クラス)：オージェンタム・トラストクロッキーUSストラテジー・ファンド (ブラジル・リアル・クラス)

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)

	年 月 日	基 準 価 額		S & P500指数 (税引後 配当込み、米ドルベース)		ブラジル・リアル 為替レート		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
		円	%	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	騰落率		
第150期	(期首) 2024年 3月 7日	2,539	—	51,799	—	30,1110	—	—	98.5
	3月末	2,622	3.3	53,352	3.0	30,1645	0.2	0.0	97.5
	(期末) 2024年 4月 8日	2,584	1.8	52,852	2.0	29,9516	△ 0.5	0.0	98.8
第151期	(期首) 2024年 4月 8日	2,564	—	52,852	—	29,9516	—	0.0	98.8
	4月末	2,555	△ 0.4	51,977	△ 1.7	30,6179	2.2	0.0	99.4
	(期末) 2024年 5月 7日	2,493	△ 2.8	52,638	△ 0.4	30,3437	1.3	0.0	97.6
第152期	(期首) 2024年 5月 7日	2,473	—	52,638	—	30,3437	—	0.0	97.6
	5月末	2,455	△ 0.7	53,242	1.1	30,0984	△ 0.8	0.0	98.2
	(期末) 2024年 6月 7日	2,440	△ 1.3	54,448	3.4	29,6287	△ 2.4	0.0	99.2
第153期	(期首) 2024年 6月 7日	2,420	—	54,448	—	29,6287	—	0.0	99.2
	6月末	2,369	△ 2.1	55,803	2.5	29,2613	△ 1.2	0.0	97.7
	(期末) 2024年 7月 8日	2,381	△ 1.6	56,674	4.1	29,4343	△ 0.7	0.0	98.9
第154期	(期首) 2024年 7月 8日	2,361	—	56,674	—	29,4343	—	0.0	98.9
	7月末	2,320	△ 1.7	55,364	△ 2.3	27,1380	△ 7.8	0.0	98.5
	(期末) 2024年 8月 7日	2,109	△ 10.7	53,371	△ 5.8	25,9660	△ 11.8	0.0	99.5
第155期	(期首) 2024年 8月 7日	2,089	—	53,371	—	25,9660	—	0.0	99.5
	8月末	2,196	5.1	57,001	6.8	25,7124	△ 1.0	0.0	97.7
	(期末) 2024年 9月 9日	2,136	2.2	55,147	3.3	25,4885	△ 1.8	0.0	98.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2024. 3. 8 ～ 2024. 9. 9）

■ 米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、インフレ再燃が懸念され米国の利下げ開始が後ずれするとの見方が強まり、下落しました。2024年4月下旬以降は、米国のインフレ率が低下傾向となり利下げ期待が高まったことなどから上昇基調となり、高成長が期待されるAI（人工知能）関連企業の株価急騰が相場をけん引しました。しかし7月中旬以降は、対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落しました。さらに8月初旬には、雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから景気の先行きに対する不透明感がにわかに強まり、急落しました。その後は、米国の経済指標の改善やFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の実質的な利下げ開始発言などを好感し、株価は急反発しました。当作成期末にかけては、経済指標が市場予想を下回ったことで再び景気後退懸念が高まったことから、株価はやや軟調に推移しました。

■ 為替相場

ブラジル・リアル為替相場は、対円で下落しました。

ブラジル・リアル対円為替相場は、当作成期首から2024年5月にかけて、ブラジル国営石油会社の株価下落で下落した局面や、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利下げ見通し維持で上昇（円安）した局面などもありましたが、おおむね横ばいの推移となりました。その後は、財政政策に関する先行き不透明感の高まりなどが嫌気され、ブラジル・リアルは対円で下落しました。8月以降は低金利通貨を売って高金利通貨を買うキャリートレードの巻き戻しが続き、ブラジル・リアルは対円で下落しました。

■ 短期金利市況

ブラジルでは、ブラジル中央銀行が政策金利を10.50%に引き下げました。一方、米国では、FRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利であるFFレート（フェデラル・ファンド・レート）の誘導目標を5.25～5.50%に据え置きました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。米ドル売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を活用して、ブラジル・リアルで実質的な運用を行います。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2024. 3. 8 ~ 2024. 9. 9)

■当ファンド

当ファンドは、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じて「クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資しました。また、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」への投資割合を高位に維持しました。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40銘柄を選定しました。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した。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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した。米ドル売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を活用して、ブラジル・リアルで実質的な運用を行いました。

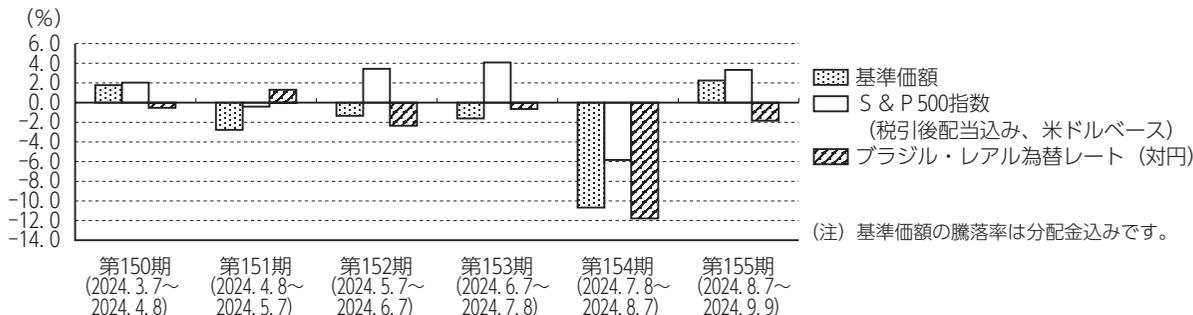
■ダイワ・マネー・マザーファンド

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いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
	2024年3月8日 ～2024年4月8日	2024年4月9日 ～2024年5月7日	2024年5月8日 ～2024年6月7日	2024年6月8日 ～2024年7月8日	2024年7月9日 ～2024年8月7日	2024年8月8日 ～2024年9月9日
当期分配金(税込み) (円)	20	20	20	20	20	20
対基準価額比率 (%)	0.77	0.80	0.82	0.84	0.95	0.94
当期の収益 (円)	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	1,331	1,340	1,345	1,354	1,358	1,364

(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、ファンドの収益率は異なります。

(注4) 投資信託の計上上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 28.90円	✓ 28.66円	✓ 25.17円	✓ 29.18円	✓ 24.51円	✓ 25.73円
(b) 経費控除後の有価証券売却等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	1,032.21	1,032.59	1,033.05	1,033.62	1,034.08	1,034.64
(d) 分配準備積立金	290.32	298.85	307.05	311.65	320.38	324.34
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	1,351.44	1,360.10	1,365.28	1,374.47	1,378.98	1,384.72
(f) 分配金	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,331.44	1,340.10	1,345.28	1,354.47	1,358.98	1,364.72

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からGICS（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。米ドル売り／ブラジル・リアル買いの為替取引を活用して、ブラジル・リアルで実質的な運用を行います。

※当ファンドでは40銘柄を選定して運用していますが、銘柄の見直しに伴い、一時的に40銘柄と異なる場合があります。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	第150期～第155期 (2024. 3. 8～2024. 9. 9)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	16円	0.683%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は2,413円です。
(投 信 会 社)	(5)	(0.223)	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)	(0.447)	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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0.002	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	17	0.685	

(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。

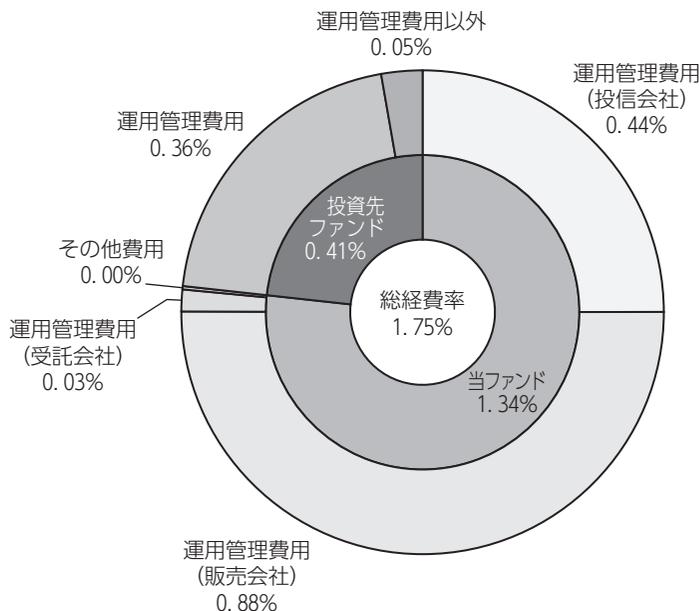
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.75%です。



総経費率 (① + ② + ③)	1.75%
①当ファンドの費用の比率	1.34%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.36%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.05%

(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) 投資先ファンドの費用には、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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期		第 150 期 ~ 第 155 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	CROCI US STRATEGY FUND BRL CLASS (ケイマン諸島)	26,659.41592	963,873	45,059.69924	1,639,200

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期	第 150 期 ~ 第 155 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・ マザーファンド	—	—	465	473

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年9月9日現在

項 目	第 155 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	10,987,396	97.6
ダイワ・マネー・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	271,899	2.4
投資信託財産総額	11,259,298	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 155 期 末		
	□ 数	評価額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) CROCI US STRATEGY FUND BRL CLASS	349,716.61313	10,987,396	98.8

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第 155 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・ マザーファンド	467	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月8日)、(2024年5月7日)、(2024年6月7日)、(2024年7月8日)、(2024年8月7日)、(2024年9月9日)現在

項目	第150期末	第151期末	第152期末	第153期末	第154期末	第155期末
(A) 資産	14,432,562,011円	13,794,872,597円	13,399,414,700円	12,943,198,373円	11,194,459,651円	11,259,298,198円
コール・ローン等	344,834,043	480,889,523	248,817,353	291,723,383	189,578,301	271,899,856
投資信託受益証券 (評価額)	14,087,726,177	13,313,981,283	13,150,595,556	12,651,473,199	11,004,879,559	10,987,396,551
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	1,791	1,791	1,791	1,791	1,791	1,791
(B) 負債	170,437,705	146,891,009	144,603,127	149,419,406	139,515,277	140,197,824
未払収益分配金	111,235,573	110,397,081	109,559,299	108,371,188	105,830,313	105,109,470
未払解約金	42,078,571	21,425,167	18,912,930	25,825,031	19,528,637	20,307,417
未払信託報酬	17,019,373	14,873,526	15,838,706	14,840,153	13,689,493	14,227,017
その他未払費用	104,188	195,235	292,192	383,034	466,834	553,920
(C) 純資産総額 (A - B)	14,262,124,306	13,647,981,588	13,254,811,573	12,793,778,967	11,054,944,374	11,119,100,374
元本	55,617,786,685	55,198,540,756	54,779,649,677	54,185,594,271	52,915,156,792	52,554,735,437
次期繰越損益金	△ 41,355,662,379	△ 41,550,559,168	△ 41,524,838,104	△ 41,391,815,304	△ 41,860,212,418	△ 41,435,635,063
(D) 受益権総口数	55,617,786,685口	55,198,540,756口	54,779,649,677口	54,185,594,271口	52,915,156,792口	52,554,735,437口
1万口当り基準価額 (C/D)	2,564円	2,473円	2,420円	2,361円	2,089円	2,116円

* 当作成期首における元本額は56,603,874,277円、当作成期間 (第150期～第155期) 中における追加設定元本額は496,965,381円、同解約元本額は4,546,104,221円です。

* 第155期末の計算口数当りの純資産額は2,116円です。

* 第155期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は41,435,635,063円です。

■損益の状況

第150期 自 2024年3月8日 至 2024年4月8日 第152期 自 2024年5月8日 至 2024年6月7日 第154期 自 2024年7月9日 至 2024年8月7日
 第151期 自 2024年4月9日 至 2024年5月7日 第153期 自 2024年6月8日 至 2024年7月8日 第155期 自 2024年8月8日 至 2024年9月9日

項目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(A) 配当等収益	171,650,273円	173,175,209円	153,842,505円	173,082,354円	143,493,777円	143,186,758円
受取配当金	171,645,411	173,166,189	153,820,196	173,068,805	143,474,014	143,146,810
受取利息	5,477	9,020	22,309	13,549	19,763	39,948
支払利息	△ 615	—	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	99,000,682	△ 554,425,727	△ 318,015,073	△ 366,886,677	△ 1,462,745,441	115,662,003
売買益	98,925,908	2,642,414	870,605	4,243,582	11,462,667	120,242,560
売買損	74,774	△ 557,068,141	△ 318,885,678	△ 371,130,259	△ 1,474,208,108	△ 4,580,557
(C) 信託報酬等	△ 17,123,561	△ 14,964,573	△ 15,935,663	△ 14,930,995	△ 13,773,293	△ 14,314,103
(D) 当期損益金 (A + B + C)	253,527,394	△ 396,215,091	△ 180,108,231	△ 208,735,318	△ 1,333,024,957	244,534,658
(E) 前期繰越損益金	△ 19,165,706,299	△ 18,855,825,823	△ 19,187,140,299	△ 19,230,077,148	△ 19,061,566,351	△ 20,325,653,395
(F) 追加信託差損益金	△ 22,332,247,901	△ 22,188,121,173	△ 22,048,030,275	△ 21,844,631,650	△ 21,359,790,797	△ 21,249,406,856
(配当等相当額)	(5,740,939,605)	(5,699,783,293)	(5,659,018,436)	(5,600,771,627)	(5,471,888,798)	(5,437,568,018)
(売買損益相当額)	(△ 28,073,187,506)	(△ 27,887,904,466)	(△ 27,707,048,711)	(△ 27,445,403,277)	(△ 26,831,679,595)	(△ 26,686,974,874)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 41,244,426,806	△ 41,440,162,087	△ 41,415,278,805	△ 41,283,444,116	△ 41,754,382,105	△ 41,330,525,593
(H) 収益分配金	△ 111,235,573	△ 110,397,081	△ 109,559,299	△ 108,371,188	△ 105,830,313	△ 105,109,470
次期繰越損益金 (G + H)	△ 41,355,662,379	△ 41,550,559,168	△ 41,524,838,104	△ 41,391,815,304	△ 41,860,212,418	△ 41,435,635,063
追加信託差損益金	△ 22,332,247,901	△ 22,188,121,173	△ 22,048,030,275	△ 21,844,631,650	△ 21,359,790,797	△ 21,249,406,856
(配当等相当額)	(5,740,939,605)	(5,699,783,293)	(5,659,018,436)	(5,600,771,627)	(5,471,888,798)	(5,437,568,018)
(売買損益相当額)	(△ 28,073,187,506)	(△ 27,887,904,466)	(△ 27,707,048,711)	(△ 27,445,403,277)	(△ 26,831,679,595)	(△ 26,686,974,874)
分配準備積立金	1,664,274,268	1,697,426,234	1,710,406,141	1,738,519,022	1,719,218,578	1,734,720,790
繰越損益金	△ 20,687,688,746	△ 21,059,864,229	△ 21,187,213,970	△ 21,285,702,676	△ 22,219,640,199	△ 21,920,948,997

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	160,790,511円	158,210,636円	137,906,842円	158,151,359円	129,720,484円	135,268,196円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	5,740,939,605	5,699,783,293	5,659,018,436	5,600,771,627	5,471,888,798	5,437,568,018
(d) 分配準備積立金	1,614,719,330	1,649,612,679	1,682,058,598	1,688,738,851	1,695,328,407	1,704,562,064
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	7,516,449,446	7,507,606,608	7,478,983,876	7,447,661,837	7,296,937,689	7,277,398,278
(f) 分配金	111,235,573	110,397,081	109,559,299	108,371,188	105,830,313	105,109,470
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	7,405,213,873	7,397,209,527	7,369,424,577	7,339,290,649	7,191,107,376	7,172,288,808
(h) 受益権総口数	55,617,786,685口	55,198,540,756口	54,779,649,677口	54,185,594,271口	52,915,156,792口	52,554,735,437口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1万口当り分配金(税込み)	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
		20円	20円	20円	20円	20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。

S & P 500指数はS&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S&P Global, Inc. またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）－トリプルリターンズー ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）は、SPDJ、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 500 指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

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			S & P 500指数 (税引後配当込み、円換算) (参考指数)		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
126期末 (2022年 4月 7日)	6,243	40	10.5	71,657	11.4	—	98.7	2,761
127期末 (2022年 5月 9日)	6,384	40	2.9	69,777	△ 2.6	—	99.4	2,737
128期末 (2022年 6月 7日)	6,415	40	1.1	70,615	1.2	—	97.6	2,735
129期末 (2022年 7月 7日)	5,811	40	△ 8.8	67,758	△ 4.0	—	97.5	2,467
130期末 (2022年 8月 8日)	6,146	40	6.5	72,809	7.5	—	99.7	2,557
131期末 (2022年 9月 7日)	6,269	40	2.7	72,683	△ 0.2	—	98.2	2,605
132期末 (2022年10月 7日)	6,375	40	2.3	70,593	△ 2.9	—	97.8	2,612
133期末 (2022年11月 7日)	6,661	40	5.1	72,170	2.2	—	99.5	2,704
134期末 (2022年12月 7日)	6,441	40	△ 2.7	70,543	△ 2.3	—	98.8	2,587
135期末 (2023年 1月10日)	6,367	40	△ 0.5	66,968	△ 5.1	—	99.6	2,541
136期末 (2023年 2月 7日)	6,571	40	3.8	71,164	6.3	—	98.2	2,617
137期末 (2023年 3月 7日)	6,670	40	2.1	72,052	1.2	—	99.1	2,651
138期末 (2023年 4月 7日)	6,214	40	△ 6.2	70,809	△ 1.7	—	97.4	2,466
139期末 (2023年 5月 8日)	6,344	40	2.7	73,204	3.4	—	99.4	2,519
140期末 (2023年 6月 7日)	6,504	40	3.2	78,374	7.1	—	99.2	2,503
141期末 (2023年 7月 7日)	6,806	40	5.3	83,468	6.5	—	99.6	2,594
142期末 (2023年 8月 7日)	7,041	40	4.0	83,335	△ 0.2	—	98.3	2,675
143期末 (2023年 9月 7日)	7,255	40	3.6	86,870	4.2	—	95.1	2,730
144期末 (2023年10月10日)	7,033	40	△ 2.5	84,804	△ 2.4	—	99.5	2,639
145期末 (2023年11月 7日)	7,083	40	1.3	86,301	1.8	—	98.2	2,646
146期末 (2023年12月 7日)	6,915	40	△ 1.8	88,292	2.3	—	99.2	2,574
147期末 (2024年 1月 9日)	7,096	40	3.2	90,522	2.5	—	98.9	2,598
148期末 (2024年 2月 7日)	7,340	40	4.0	96,751	6.9	—	97.2	2,627
149期末 (2024年 3月 7日)	7,547	40	3.4	100,575	4.0	—	93.8	2,687
150期末 (2024年 4月 8日)	7,792	40	3.8	104,533	3.9	0.0	98.3	2,667
151期末 (2024年 5月 7日)	7,625	40	△ 1.6	105,694	1.1	0.0	99.5	2,592
152期末 (2024年 6月 7日)	7,690	40	1.4	110,535	4.6	0.0	98.2	2,603
153期末 (2024年 7月 8日)	7,831	40	2.4	118,717	7.4	0.0	98.2	2,593
154期末 (2024年 8月 7日)	7,159	40	△ 8.1	102,250	△ 13.9	0.0	99.4	2,354
155期末 (2024年 9月 9日)	7,173	40	0.8	102,592	0.3	0.0	97.5	2,346

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 500指数 (税引後配当込み、円換算) は、S & P 500指数 (税引後配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

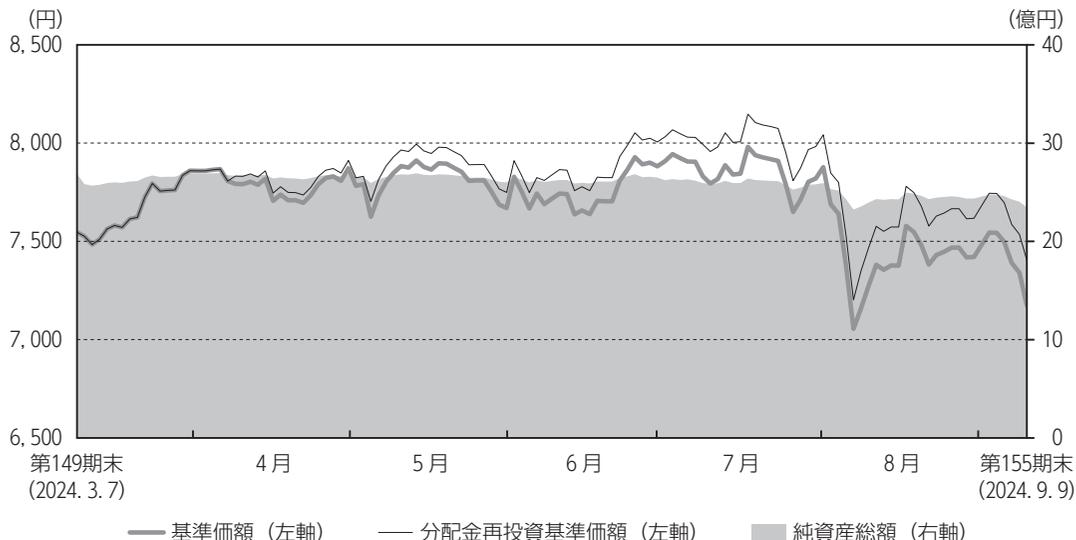
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* 分配金再投資基準価額は、分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります (分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

第150期首：7,547円

第155期末：7,173円 (既払分配金240円)

騰落率：△1.9% (分配金再投資ベース)

■ 基準価額の主な変動要因

投資した「クローキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)」の下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。「クローキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)」については、米国株式市況の上昇がプラス要因となったものの、米ドルが対円で下落 (円高) したことやオプション取引戦略がマイナス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※クローキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)：オージェンタム・トラスト
クローキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - 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		S & P 500指数 (税引後 配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
第150期	(期首) 2024年 3月 7日	7,547	—	100,575	—	—	93.8
	3月末	7,860	4.1	105,251	4.6	0.0	97.7
	(期末) 2024年 4月 8日	7,832	3.8	104,533	3.9	0.0	98.3
第151期	(期首) 2024年 4月 8日	7,792	—	104,533	—	0.0	98.3
	4月末	7,872	1.0	106,256	1.6	0.0	98.7
	(期末) 2024年 5月 7日	7,665	△ 1.6	105,694	1.1	0.0	99.5
第152期	(期首) 2024年 5月 7日	7,625	—	105,694	—	0.0	99.5
	5月末	7,670	0.6	108,732	2.9	0.0	97.5
	(期末) 2024年 6月 7日	7,730	1.4	110,535	4.6	0.0	98.2
第153期	(期首) 2024年 6月 7日	7,690	—	110,535	—	0.0	98.2
	6月末	7,882	2.5	117,109	5.9	0.0	96.2
	(期末) 2024年 7月 8日	7,871	2.4	118,717	7.4	0.0	98.2
第154期	(期首) 2024年 7月 8日	7,831	—	118,717	—	0.0	98.2
	7月末	7,878	0.6	109,964	△ 7.4	0.0	98.8
	(期末) 2024年 8月 7日	7,199	△ 8.1	102,250	△ 13.9	0.0	99.4
第155期	(期首) 2024年 8月 7日	7,159	—	102,250	—	0.0	99.4
	8月末	7,484	4.5	107,541	5.2	0.0	99.7
	(期末) 2024年 9月 9日	7,213	0.8	102,592	0.3	0.0	97.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2024. 3. 8 ~ 2024. 9. 9)

■米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、インフレ再燃が懸念され米国の利下げ開始が後ずれするとの見方が強まり、下落しました。2024年4月下旬以降は、米国のインフレ率が低下傾向となり利下げ期待が高まったことなどから上昇基調となり、高成長が期待されるAI（人工知能）関連企業の株価急騰が相場をけん引しました。しかし7月中旬以降は、対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落しました。さらに8月初旬には、雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから景気の先行きに対する不透明感がにわかに強まり、急落しました。その後は、米国の経済指標の改善やFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の実質的な利下げ開始発言などを好感し、株価は急反発しました。当作成期末にかけては、経済指標が市場予想を下回ったことで再び景気後退懸念が高まったことから、株価はやや軟調に推移しました。

■為替相場

米ドル為替相場は、対円で下落しました。

当作成期首より、米国金利の上昇などに加え、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどを背景に、円安基調となりました。2024年7月に入ると、米国雇用統計などの各種経済指標が予想を下振れ景気後退懸念が高まったことや日銀による利上げなどを背景に米ドルは対円で下落に転じ、当作成期末にかけて円高基調は継続しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からGICS（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2024. 3. 8 ~ 2024. 9. 9)

当ファンド

当ファンドは、「クロッキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じて「クロッキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資しました。「クロッキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)」への投資割合を高位に維持しました。

クロッキーUSストラテジー・ファンド (米ドル・クラス)

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S (世界産業分類基準) の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40銘柄を選定しました。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した。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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した。

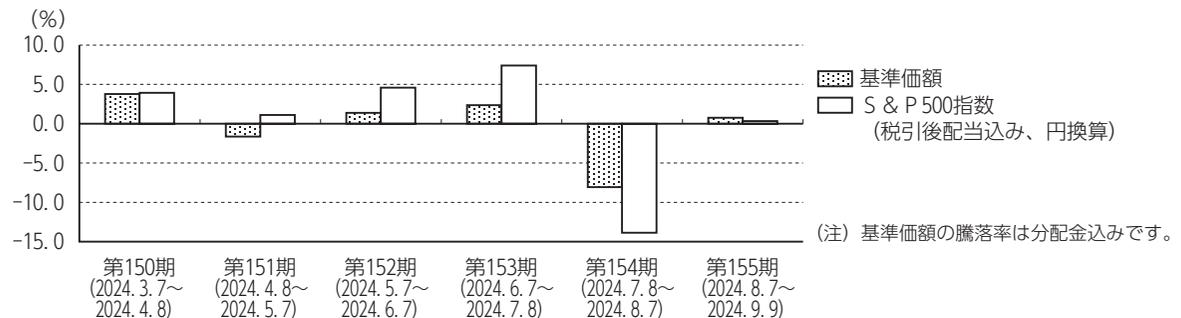
ダイワ・マネー・マザーファンド

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いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
	2024年3月8日 ～2024年4月8日	2024年4月9日 ～2024年5月7日	2024年5月8日 ～2024年6月7日	2024年6月8日 ～2024年7月8日	2024年7月9日 ～2024年8月7日	2024年8月8日 ～2024年9月9日
当期分配金(税込み) (円)	40	40	40	40	40	40
対基準価額比率 (%)	0.51	0.52	0.52	0.51	0.56	0.55
当期の収益 (円)	40	40	40	40	40	40
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	1,982	1,999	2,021	2,046	2,065	2,084

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 62.99円	✓ 57.04円	✓ 62.13円	✓ 65.22円	✓ 59.01円	✓ 58.13円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	222.18	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	754.00	755.69	757.45	765.01	767.55	770.46
(d) 分配準備積立金	983.02	1,226.51	1,241.81	1,256.64	1,279.36	1,295.52
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	2,022.21	2,039.26	2,061.39	2,086.89	2,105.93	2,124.12
(f) 分配金	40.00	40.00	40.00	40.00	40.00	40.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	1,982.21	1,999.26	2,021.39	2,046.89	2,065.93	2,084.12

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からGICS（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。

※当ファンドでは40銘柄を選定して運用していますが、銘柄の見直しに伴い、一時的に40銘柄としない場合があります。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	第150期～第155期 (2024. 3. 8～2024. 9. 9)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	53円	0. 685%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は7, 710円です。
(投 信 会 社)	(17)	(0. 224)	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)	(35)	(0. 448)	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. 014)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0. 004	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	53	0. 689	

(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。

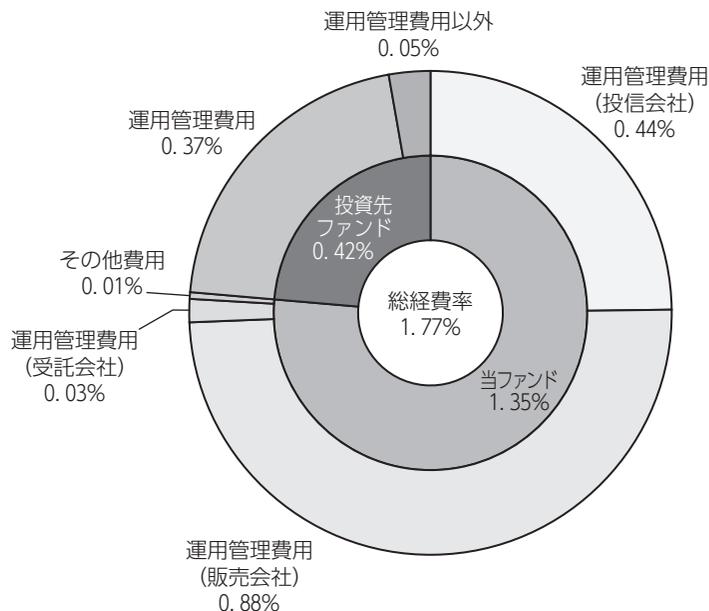
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.77%です。



総経費率（①＋②＋③）	1.77%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
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	0.05%

(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) 投資先ファンドの費用には、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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期		第 150 期 ～ 第 155 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	CROCI US STRATEGY FUND USD CLASS (ケイマン諸島)	824.28312	135,327	1,296.63321	210,800

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期	第 150 期 ～ 第 155 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・ マザーファンド	—	—	10	11

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年9月9日現在

項 目	第 155 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,288,313	96.5
ダイワ・マネー・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	83,189	3.5
投資信託財産総額	2,371,505	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 155 期 末		
	□ 数	評価額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) CROCI US STRATEGY FUND USD CLASS	15,101.98912	2,288,313	97.5

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第 155 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・ マザーファンド	12	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型)

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月8日)、(2024年5月7日)、(2024年6月7日)、(2024年7月8日)、(2024年8月7日)、(2024年9月9日)現在

項目	第150期末	第151期末	第152期末	第153期末	第154期末	第155期末
(A) 資産	2,685,389,209円	2,617,500,145円	2,624,333,323円	2,622,559,402円	2,375,066,382円	2,371,505,621円
コール・ローン等	64,410,181	37,028,506	66,842,863	76,635,003	34,451,039	83,189,834
投資信託受益証券 (評価額)	2,620,977,040	2,580,469,651	2,557,488,472	2,545,922,411	2,340,613,355	2,288,313,799
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	1,988	1,988	1,988	1,988	1,988	1,988
(B) 負債	17,826,367	24,641,910	20,430,376	29,031,329	20,599,550	24,984,142
未払収益分配金	13,693,909	13,601,997	13,544,370	13,247,883	13,154,412	13,085,125
未払解約金	990,900	8,156,867	3,798,776	12,705,676	4,510,154	8,813,369
未払信託報酬	3,122,458	2,846,539	3,032,173	3,004,338	2,844,149	2,976,603
その他未払費用	19,100	36,507	55,057	73,432	90,835	109,045
(C) 純資産総額 (A - B)	2,667,562,842	2,592,858,235	2,603,902,947	2,593,528,073	2,354,466,832	2,346,521,479
元本	3,423,477,447	3,400,499,460	3,386,092,520	3,311,970,845	3,288,603,149	3,271,281,319
次期繰越損益金	△ 755,914,605	△ 807,641,225	△ 782,189,573	△ 718,442,772	△ 934,136,317	△ 924,759,840
(D) 受益権総口数	3,423,477,447口	3,400,499,460口	3,386,092,520口	3,311,970,845口	3,288,603,149口	3,271,281,319口
1万口当り基準価額 (C/D)	7,792円	7,625円	7,690円	7,831円	7,159円	7,173円

* 当作成期首における元本額は3,561,278,947円、当作成期間 (第150期～第155期) 中における追加設定元本額は47,454,443円、同解約元本額は337,452,071円です。

* 第155期末の計算口数当りの純資産額は7,173円です。

* 第155期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は924,759,840円です。

■損益の状況

第150期 自 2024年3月8日 至 2024年4月8日 第152期 自 2024年5月8日 至 2024年6月7日 第154期 自 2024年7月9日 至 2024年8月7日
 第151期 自 2024年4月9日 至 2024年5月7日 第153期 自 2024年6月8日 至 2024年7月8日 第155期 自 2024年8月8日 至 2024年9月9日

項目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(A) 配当等収益	22,261,436円	22,262,736円	22,842,367円	22,699,716円	22,268,985円	22,011,433円
受取配当金	22,259,197	22,259,827	22,839,637	22,695,779	22,264,994	22,008,034
受取利息	2,453	2,909	2,730	3,937	3,991	3,399
支払利息	△ 214	—	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	78,511,598	△ 62,596,333	15,776,648	39,856,594	△ 226,991,509	△ 1,556,115
売買益	78,080,812	175,890	16,025,393	40,799,686	643,572	1,723,897
売買損	430,786	△ 62,772,223	△ 248,745	△ 943,092	△ 227,635,081	△ 3,280,012
(C) 信託報酬等	△ 3,141,558	△ 2,863,946	△ 3,050,723	△ 3,022,713	△ 2,861,552	△ 2,994,813
(D) 当期損益金 (A + B + C)	97,631,476	△ 43,197,543	35,568,292	59,533,597	△ 207,584,076	17,460,505
(E) 前期繰越損益金	336,536,320	417,077,017	358,246,848	369,799,282	412,341,155	190,174,150
(F) 追加信託差損益金	△ 1,176,388,492	△ 1,167,918,702	△ 1,162,460,343	△ 1,134,527,768	△ 1,125,738,984	△ 1,119,309,370
(配当等相当額)	(258,131,569)	(256,975,306)	(256,480,036)	(253,371,837)	(252,418,587)	(252,040,184)
(売買損益相当額)	(△ 1,434,520,061)	(△ 1,424,894,008)	(△ 1,418,940,379)	(△ 1,387,899,605)	(△ 1,378,157,571)	(△ 1,371,349,554)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 742,220,696	△ 794,039,228	△ 768,645,203	△ 705,194,889	△ 920,981,905	△ 911,674,715
(H) 収益分配金	△ 13,693,909	△ 13,601,997	△ 13,544,370	△ 13,247,883	△ 13,154,412	△ 13,085,125
次期繰越損益金 (G + H)	△ 755,914,605	△ 807,641,225	△ 782,189,573	△ 718,442,772	△ 934,136,317	△ 924,759,840
追加信託差損益金	△ 1,176,388,492	△ 1,167,918,702	△ 1,162,460,343	△ 1,134,527,768	△ 1,125,738,984	△ 1,119,309,370
(配当等相当額)	(258,131,569)	(256,975,306)	(256,480,036)	(253,371,837)	(252,418,587)	(252,040,184)
(売買損益相当額)	(△ 1,434,520,061)	(△ 1,424,894,008)	(△ 1,418,940,379)	(△ 1,387,899,605)	(△ 1,378,157,571)	(△ 1,371,349,554)
分配準備積立金	420,473,887	422,873,810	427,983,864	424,553,396	426,986,381	429,734,430
繰越損益金	—	△ 62,596,333	△ 47,713,094	△ 8,468,400	△ 235,383,714	△ 235,184,900

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
(a) 経費控除後の配当等収益	21,567,466円	19,398,790円	21,037,864円	21,602,773円	19,407,433円	19,016,620円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	76,064,010	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	258,131,569	256,975,306	256,480,036	253,371,837	252,418,587	252,040,184
(d) 分配準備積立金	336,536,320	417,077,017	420,490,370	416,198,506	420,733,360	423,802,935
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	692,299,365	693,451,113	698,008,270	691,173,116	692,559,380	694,859,739
(f) 分配金	13,693,909	13,601,997	13,544,370	13,247,883	13,154,412	13,085,125
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	678,605,456	679,849,116	684,463,900	677,925,233	679,404,968	681,774,614
(h) 受益権総口数	3,423,477,447口	3,400,499,460口	3,386,092,520口	3,311,970,845口	3,288,603,149口	3,271,281,319口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1万口当り分配金(税込み)	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期
		40円	40円	40円	40円	40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。

S & P 500指数はS&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S&P Global, Inc. またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）－トリプルリターンズ－米ドル・コース（毎月分配型）は、SPDJ、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 500指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

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			S & P 500指数 (税引後 配当込み、米ドルベース)		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	期騰 落率	(参考指数)	期騰 落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
106期末 (2022年 4月 7日)	2,903	30	15.1	30,541	3.6	—	99.7	125
107期末 (2022年 5月 9日)	2,816	30	△ 2.0	28,121	△ 7.9	—	98.5	122
108期末 (2022年 6月 7日)	2,861	30	2.7	28,144	0.1	—	97.5	123
109期末 (2022年 7月 7日)	2,427	30	△ 14.1	26,282	△ 6.6	—	99.2	104
110期末 (2022年 8月 8日)	2,622	30	9.3	28,354	7.9	—	99.2	110
111期末 (2022年 9月 7日)	2,646	30	2.1	26,766	△ 5.6	—	98.5	112
112期末 (2022年 10月 7日)	2,664	30	1.8	25,674	△ 4.1	—	99.6	113
113期末 (2022年 11月 7日)	2,860	30	8.5	25,869	0.8	—	97.5	122
114期末 (2022年 12月 7日)	2,803	30	△ 0.9	27,077	4.7	—	97.0	119
115期末 (2023年 1月 10日)	2,813	30	1.4	26,769	△ 1.1	—	99.1	121
116期末 (2023年 2月 7日)	2,924	30	5.0	28,290	5.7	—	99.3	130
117期末 (2023年 3月 7日)	3,033	30	4.8	27,896	△ 1.4	—	98.5	138
118期末 (2023年 4月 7日)	2,845	30	△ 5.2	28,320	1.5	—	98.9	126
119期末 (2023年 5月 8日)	2,923	30	3.8	28,550	0.8	—	99.1	131
120期末 (2023年 6月 7日)	3,074	30	6.2	29,609	3.7	—	98.5	137
121期末 (2023年 7月 7日)	3,129	30	2.8	30,518	3.1	—	98.9	142
122期末 (2023年 8月 7日)	3,226	30	4.1	30,997	1.6	—	97.6	144
123期末 (2023年 9月 7日)	3,293	30	3.0	30,948	△ 0.2	—	99.3	148
124期末 (2023年 10月 10日)	3,106	30	△ 4.8	30,078	△ 2.8	—	99.4	143
125期末 (2023年 11月 7日)	3,234	30	5.1	30,303	0.7	—	97.6	149
126期末 (2023年 12月 7日)	3,156	30	△ 1.5	31,620	4.3	—	99.1	147
127期末 (2024年 1月 9日)	3,265	30	4.4	33,137	4.8	—	97.5	152
128期末 (2024年 2月 7日)	3,339	30	3.2	34,483	4.1	—	98.5	150
129期末 (2024年 3月 7日)	3,421	30	3.4	35,571	3.2	—	99.4	154
130期末 (2024年 4月 8日)	3,596	30	6.0	36,294	2.0	0.0	97.5	162
131期末 (2024年 5月 7日)	3,478	30	△ 2.4	36,147	△ 0.4	0.0	99.0	156
132期末 (2024年 6月 7日)	3,506	30	1.7	37,390	3.4	0.0	99.1	158
133期末 (2024年 7月 8日)	3,518	30	1.2	38,919	4.1	0.0	96.8	152
134期末 (2024年 8月 7日)	3,173	30	△ 9.0	36,651	△ 5.8	0.0	98.1	136
135期末 (2024年 9月 9日)	3,214	30	2.2	37,871	3.3	0.0	99.2	138

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 500指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、同指数の原データをもとに、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。

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

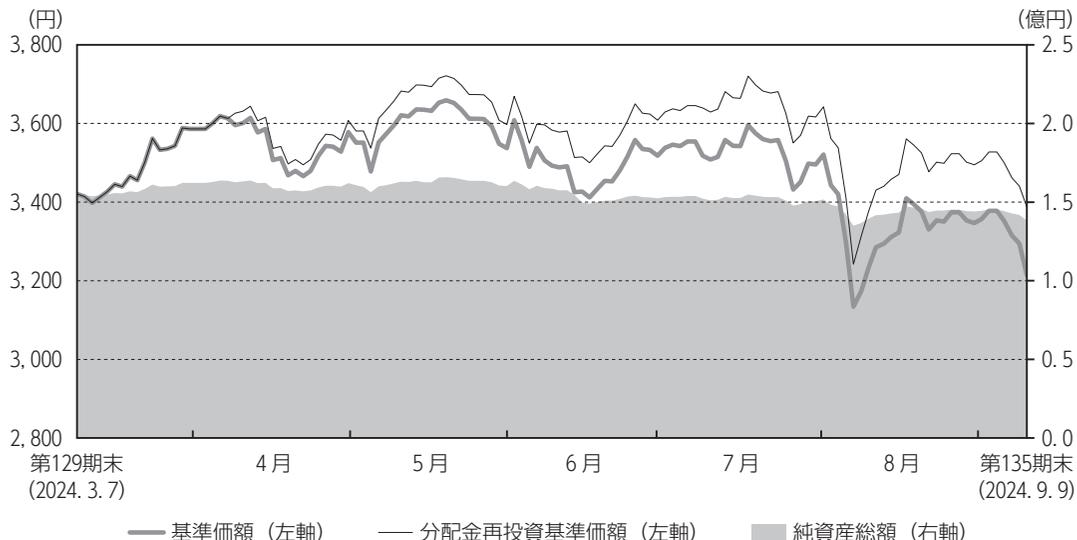
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。

* 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

第130期首：3,421円

第135期末：3,214円（既払分配金180円）

騰落率：△1.0%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

投資した「クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」はおおむね横ばいとなったものの、運用管理費用がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。「クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」については、米国株式市況の上昇や為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）がプラス要因となったものの、選定通貨が対円でおおむね下落（円高）したことやオプション取引戦略がマイナス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※クロッキーUSストラテジー・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USストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型)

	年 月 日	基 準 価 額		S & P 500指数 (税引後 配当込み、米ドルベース)		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			
第130期	(期首) 2024年 3月 7日	円 3,421	% —	35,571	% —	% —	% 99.4
	3月末	3,586	4.8	36,638	3.0	0.0	99.3
	(期末) 2024年 4月 8日	3,626	6.0	36,294	2.0	0.0	97.5
第131期	(期首) 2024年 4月 8日	3,596	—	36,294	—	0.0	97.5
	4月末	3,578	△ 0.5	35,693	△ 1.7	0.0	97.5
	(期末) 2024年 5月 7日	3,508	△ 2.4	36,147	△ 0.4	0.0	99.0
第132期	(期首) 2024年 5月 7日	3,478	—	36,147	—	0.0	99.0
	5月末	3,537	1.7	36,562	1.1	0.0	98.3
	(期末) 2024年 6月 7日	3,536	1.7	37,390	3.4	0.0	99.1
第133期	(期首) 2024年 6月 7日	3,506	—	37,390	—	0.0	99.1
	6月末	3,518	0.3	38,320	2.5	0.0	98.3
	(期末) 2024年 7月 8日	3,548	1.2	38,919	4.1	0.0	96.8
第134期	(期首) 2024年 7月 8日	3,518	—	38,919	—	0.0	96.8
	7月末	3,521	0.1	38,020	△ 2.3	0.0	97.4
	(期末) 2024年 8月 7日	3,203	△ 9.0	36,651	△ 5.8	0.0	98.1
第135期	(期首) 2024年 8月 7日	3,173	—	36,651	—	0.0	98.1
	8月末	3,357	5.8	39,144	6.8	0.0	98.3
	(期末) 2024年 9月 9日	3,244	2.2	37,871	3.3	0.0	99.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2024. 3. 8 ～ 2024. 9. 9）

■ 米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、インフレ再燃が懸念され米国の利下げ開始が後ずれするとの見方が強まり、下落しました。2024年4月下旬以降は、米国のインフレ率が低下傾向となり利下げ期待が高まったことなどから上昇基調となり、高成長が期待されるAI（人工知能）関連企業の株価急騰が相場をけん引しました。しかし7月中旬以降は、対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落しました。さらに8月初旬には、雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから景気の先行きに対する不透明感がにわかに強まり、急落しました。その後は、米国の経済指標の改善やFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の実質的な利下げ開始発言などを好感し、株価は急反発しました。当作成期末にかけては、経済指標が市場予想を下回ったことで再び景気後退懸念が高まったことから、株価はやや軟調に推移しました。

■ 為替相場

選定通貨（※）の対円為替相場は、おおむね下落しました。

米国の景気悪化懸念が高まったことに加え、日銀が利上げを実施したことなどから円高が進行し、メキシコ・ペソ、トルコ・リラ、ブラジル・レアル、コロンビア・ペソ、ハンガリー・フォリント、インド・ルピー、ルーマニア・レイ、ニュージーランド・ドル、英ポンドは対円で下落しました。一方で、南アフリカ・ランドは対円で上昇（円安）しました。

※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。

■ 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米ドルの短期金利をおおむね上回って推移しました。米国では、FRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利であるFFレート（フェデラル・ファンド・レート）の誘導目標を5.25～5.50%に据え置きました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。米ドル売り／選定通貨買いの為替取引を活用して、選定通貨で実質的な運用を行います。選定通貨については原則として、F T S E世界国債インデックスおよびJ P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットズ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。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2024. 3. 8 ~ 2024. 9. 9)

■当ファンド

当ファンドは、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じて「クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資しました。また、「クロッキーUSストラテジー・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しました。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40銘柄を選定しました。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した。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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した。米ドル売り／選定通貨買いの為替取引を活用して、選定通貨で実質的な運用を行いました。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収益が享受できる通貨を毎月6通貨選定し、運用を行いました。また、選定通貨合計の比率は、原資産に対しておおむね100%を維持しました。

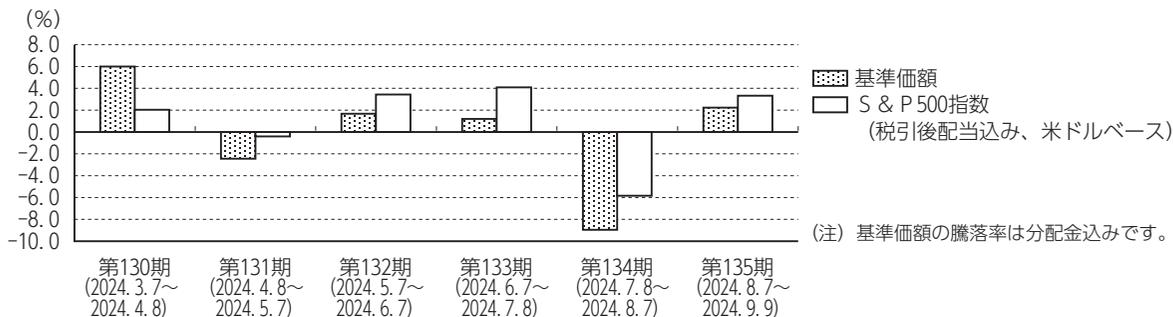
■ダイワ・マネー・マザーファンド

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いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期
	2024年3月8日 ～2024年4月8日	2024年4月9日 ～2024年5月7日	2024年5月8日 ～2024年6月7日	2024年6月8日 ～2024年7月8日	2024年7月9日 ～2024年8月7日	2024年8月8日 ～2024年9月9日
当期分配金(税込み) (円)	30	30	30	30	30	30
対基準価額比率 (%)	0.83	0.86	0.85	0.85	0.94	0.92
当期の収益 (円)	30	30	30	30	30	30
当期の収益以外 (円)	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	885	929	967	1,020	1,059	1,094

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 68.37円	✓ 74.25円	✓ 68.10円	✓ 82.83円	✓ 68.56円	✓ 64.95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	0.00
(c) 収益調整金	444.63	445.99	453.74	455.67	456.97	458.51
(d) 分配準備積立金	402.06	439.15	475.78	512.08	563.64	600.69
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	915.07	959.40	997.63	1,050.59	1,089.18	1,124.15
(f) 分配金	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	885.07	929.40	967.63	1,020.59	1,059.18	1,094.15

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、「クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」と「ダイワ・マネー・マザーファンド」に投資します。また、「クロッキーUSストラテジー・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基本とします。

■クロッキーUSストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）

S & P 500種株価指数構成銘柄の時価総額上位半数程度の銘柄からG I C S（世界産業分類基準）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄を投資対象銘柄とし、「クロッキーモデル」を用いて会計データを重点分析し、割安と判断される40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。個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするコール・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。米ドル売り／選定通貨買いの為替取引を活用して、選定通貨で実質的な運用を行います。選定通貨については原則として、F T S E 世界国債インデックスおよびJ P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットズ 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。

※当ファンドでは40銘柄を選定して運用していますが、銘柄の見直しに伴い、一時的に40銘柄とまらない場合があります。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	第130期～第135期 (2024. 3. 8～2024. 9. 9)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	24円	0.684%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は3,492円です。
(投 信 会 社)	(8)	(0.223)	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)	(16)	(0.447)	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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0.003	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	24	0.687	

(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。

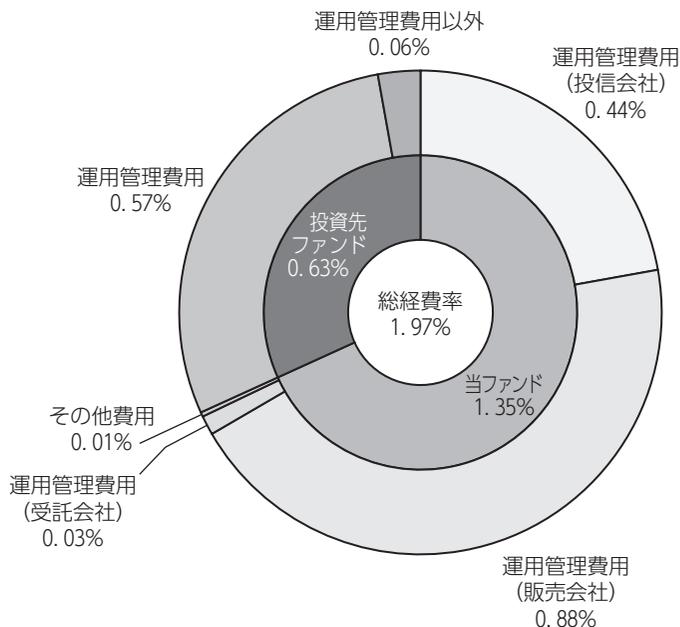
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.97%です。



総経費率（①＋②＋③）	1.97%
①当ファンドの費用の比率	1.35%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.57%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(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) 投資先ファンドの費用には、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。

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型)

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期		第 130 期 ~ 第 135 期			
		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	CROCI US STRATEGY FUND CURRENCY SELECTION CLASS (ケイマン諸島)	627.93712	19,862	508.64783	16,300

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

決 算 期	第 130 期 ~ 第 135 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・ マザーファンド	—	—	7	8

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年9月9日現在

項 目	第 135 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	137,278	98.2
ダイワ・マネー・マザーファンド	1	0.0
コール・ローン等、その他	2,557	1.8
投資信託財産総額	139,837	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 135 期 末		
	□ 数	評価額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) CROCI US STRATEGY FUND CURRENCY SELECTION CLASS	4,845.67755	137,278	99.2

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第 129 期末			第 135 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・ マザーファンド	9	1	1			

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型)

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月8日)、(2024年5月7日)、(2024年6月7日)、(2024年7月8日)、(2024年8月7日)、(2024年9月9日)現在

項目	第130期末	第131期末	第132期末	第133期末	第134期末	第135期末
(A) 資産	164,211,953円	159,071,795円	160,525,260円	157,502,806円	138,191,122円	139,837,140円
コール・ローン等	5,578,741	4,233,933	2,926,758	2,670,312	4,139,329	2,557,291
投資信託受益証券 (評価額)	158,631,407	154,836,057	157,596,697	147,430,690	134,049,988	137,278,044
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	1,805	1,805	1,805	1,805	1,805	1,805
未収入金	—	—	—	7,399,999	—	—
(B) 負債	1,546,043	2,718,124	1,553,098	5,183,160	1,548,950	1,473,728
未払金	—	—	—	3,700,000	—	—
未払収益分配金	1,357,210	1,348,718	1,360,412	1,299,078	1,291,829	1,291,585
未払解約金	—	1,195,989	3,757	4,112	85,232	659
未払信託報酬	187,702	171,250	185,644	175,630	166,542	175,080
その他未払費用	1,131	2,167	3,285	4,340	5,347	6,404
(C) 純資産総額 (A - B)	162,665,910	156,353,671	158,972,162	152,319,646	136,642,172	138,363,412
元本	452,403,643	449,572,787	453,470,998	433,026,287	430,609,864	430,528,566
次期繰越損益金	△ 289,737,733	△ 293,219,116	△ 294,498,836	△ 280,706,641	△ 293,967,692	△ 292,165,154
(D) 受益権総口数	452,403,643口	449,572,787口	453,470,998口	433,026,287口	430,609,864口	430,528,566口
1万口当り基準価額 (C/D)	3,596円	3,478円	3,506円	3,518円	3,173円	3,214円

* 当作成期首における元本額は451,550,639円、当作成期間 (第130期~第135期) 中における追加設定元本額は13,233,261円、同解約元本額は34,255,334円です。

* 第135期末の計算口数当りの純資産額は3,214円です。

* 第135期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は292,165,154円です。

■損益の状況

第130期 自 2024年3月8日 至 2024年4月8日

第132期 自 2024年5月8日 至 2024年6月7日

第134期 自 2024年7月9日 至 2024年8月7日

第131期 自 2024年4月9日 至 2024年5月7日

第133期 自 2024年6月8日 至 2024年7月8日

第135期 自 2024年8月8日 至 2024年9月9日

項目	第130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期
(A) 配当等収益	3,156,549円	3,510,800円	3,275,076円	3,763,664円	3,119,908円	2,958,795円
受取配当金	3,156,513	3,510,541	3,274,921	3,763,450	3,119,541	2,958,216
受取利息	36	259	155	214	367	579
(B) 有価証券売買損益	6,280,055	△ 7,280,543	△ 559,164	△ 1,775,177	△ 16,484,307	251,171
売買益	6,280,166	43,995	13	145,511	12,849	262,033
売買損	△ 111	△ 7,324,538	△ 559,177	△ 1,920,688	△ 16,497,156	△ 10,862
(C) 信託報酬等	△ 188,833	△ 172,286	△ 186,762	△ 176,685	△ 167,549	△ 176,137
(D) 当期損益金 (A + B + C)	9,247,771	△ 3,942,029	2,529,150	1,811,802	△ 13,531,948	3,033,829
(E) 前期繰越損益金	△ 20,227,920	△ 12,224,212	△ 17,388,115	△ 15,433,705	△ 14,804,308	△ 29,547,791
(F) 追加信託差損益金	△ 277,400,374	△ 275,704,157	△ 278,279,459	△ 265,785,660	△ 264,339,607	△ 264,359,607
(配当等相当額)	(20,115,404)	(20,050,824)	(20,576,017)	(19,731,925)	(19,677,613)	(19,740,207)
(売買損益相当額)	(△ 297,515,778)	(△ 295,754,981)	(△ 298,855,476)	(△ 285,517,585)	(△ 284,017,220)	(△ 284,099,814)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 288,380,523	△ 291,870,398	△ 293,138,424	△ 279,407,563	△ 292,675,863	△ 290,873,569
(H) 収益分配金	△ 1,357,210	△ 1,348,718	△ 1,360,412	△ 1,299,078	△ 1,291,829	△ 1,291,585
次期繰越損益金 (G + H)	△ 289,737,733	△ 293,219,116	△ 294,498,836	△ 280,706,641	△ 293,967,692	△ 292,165,154
追加信託差損益金	△ 277,400,374	△ 275,704,157	△ 278,279,459	△ 265,785,660	△ 264,339,607	△ 264,359,607
(配当等相当額)	(20,115,404)	(20,050,824)	(20,576,017)	(19,731,925)	(19,677,613)	(19,740,207)
(売買損益相当額)	(△ 297,515,778)	(△ 295,754,981)	(△ 298,855,476)	(△ 285,517,585)	(△ 284,017,220)	(△ 284,099,814)
分配準備積立金	19,925,839	21,732,900	23,303,409	24,462,482	25,931,731	27,366,303
繰越損益金	△ 32,263,198	△ 39,247,859	△ 39,522,786	△ 39,383,463	△ 55,559,816	△ 55,171,850

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型)

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	第130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期
(a) 経費控除後の配当等収益	3,093,384円	3,338,514円	3,088,314円	3,586,979円	2,952,359円	2,796,432円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	20,115,404	20,050,824	20,576,017	19,731,925	19,677,613	19,740,207
(d) 分配準備積立金	18,189,665	19,743,104	21,575,507	22,174,581	24,271,201	25,861,456
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	41,398,453	43,132,442	45,239,838	45,493,485	46,901,173	48,398,095
(f) 分配金	1,357,210	1,348,718	1,360,412	1,299,078	1,291,829	1,291,585
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	40,041,243	41,783,724	43,879,426	44,194,407	45,609,344	47,106,510
(h) 受益権総口数	452,403,643口	449,572,787口	453,470,998口	433,026,287口	430,609,864口	430,528,566口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1万口当り分配金(税込み)	第130期	第131期	第132期	第133期	第134期	第135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。

S & P 500指数はS&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社 (「SPDJ」) の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S&P Global, Inc. またはその関連会社 (「S & P」) の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型) は、SPDJ、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 500指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

クロッキーUS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・リアル・クラス/
 米ドル・クラス/通貨セレクト・クラス)

当ファンド（ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）－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・リアル・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US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・リアル・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
 2024年2月28日

資産

投資資産の公正価値による評価額（簿価 ¥2,887,188）	¥	315,284,583
現金および現金同等物		17,998,568,957
投資資産売却に係る未収入金		334,053,359
その他資産		569,904
資産合計		18,648,476,803

負債

未払：		
償還済み受益証券		334,200,000
購入済みの投資		327,873,680
清算済みスワップ取引		69,805,197
専門家報酬		37,670,453
運用会社報酬		2,373,684
登録料		696,360
管理会社報酬		182,674
為替投資アドバイザー報酬		55,245
受託会社報酬		37,997
負債合計		772,895,290

純資産

	¥	17,875,581,513
豪ドル・クラス	¥	759,955,231
ブラジル・リアル・クラス		14,057,507,228
日本円・クラス		263,971,170
通貨セレクト・クラス		153,192,130

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ-

米ドル・クラス		2,640,955,754
	¥	<u>17,875,581,513</u>
発行済み受益証券		
豪ドル・クラス		8,825,650
ブラジル・リアル・クラス		368,116,896
日本円・クラス		3,421,460
通貨セレクト・クラス		4,726,388
米ドル・クラス		16,343,599
受益証券1口当り純資産額		
豪ドル・クラス	¥	86.108
ブラジル・リアル・クラス	¥	38.188
日本円・クラス	¥	77.152
通貨セレクト・クラス	¥	32.412
米ドル・クラス	¥	161.590

(日本円建て)

損益計算書

2024年2月28日に終了した年度

投資収益	
受取利息	¥ 759,949,487
その他収益	42,592,657
投資収益合計	<u>802,542,144</u>
費用	
運用会社報酬	32,263,701
担保不足費用	15,734,267
管理会社報酬	12,668,772
専門家報酬	8,094,398
名義書換代理人報酬	1,791,990
受託会社報酬	1,438,305
為替投資アドバイザー報酬	212,161
その他費用	19,449,934
費用合計	<u>91,653,528</u>
純投資損益	<u>710,888,616</u>
実現損益および評価損益の変動：	
実現損益：	
ストラクチャード商品への投資	1,403,393,014
外国為替スワップ取引	820,050,292
外国為替取引および外国為替先渡取引	2,426,120,426
純実現損益	<u>4,649,563,732</u>
評価損益の変動の内訳：	
ストラクチャード商品への投資	321,331,530
外国為替スワップ取引	365,316,140
外国為替換算	(120,920,886)
評価損益の純変動	<u>565,726,784</u>
純実現損益および評価損益の純変動	<u>5,215,290,516</u>
運用の結果による純資産の純増減	<u>¥ 5,926,179,132</u>

ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ-

(日本円建て)

投資明細表
2024年 2月28日

ストラクチャード商品

投資資産の明細	受益証券数	純資産に 占める割合	公正価値による 評価額
Share Basket Swap Transaction* - トータル・リターン・スワップ	961,887	1.76%	¥ 315,284,583
ストラクチャード商品計 (簿価 ¥2,887,188)			315,284,583
投資資産計 (簿価 ¥2,887,188)		1.76%	¥ 315,284,583

当ファンドは J.P. Morgan Securities plc. との間で締結したアンファンデッド・スワップを通じて Share Basket Swap Transaction と同様のエクスポージャーを有しています。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）－トリプルリターンズ－）が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2023年12月11日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、2024年9月9日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2024年3月8日から2024年9月9日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
1219国庫短期証券 2024/6/24	10,999,769		
1239国庫短期証券 2024/9/24	9,999,950		

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年9月9日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（18,230,442千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2024年9月9日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組 入率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	10,000,000	9,999,991	54.0	—	—	—	54.0

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2024年9月9日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	1239国庫短期証券	—	10,000,000	9,999,991	2024/09/24	

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第19期 (決算日 2023年12月11日)

(作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11日)

ダイワ・マネー・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。

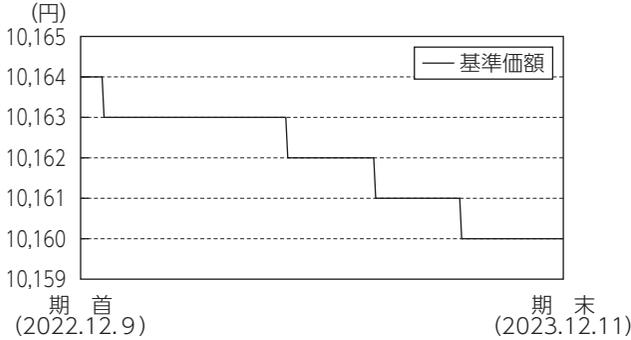
運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準価額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2022年12月9日	円	%	%
	10,164	-	-
12月末日	10,163	△0.0	-
2023年1月末日	10,163	△0.0	-
2月末日	10,163	△0.0	-
3月末日	10,163	△0.0	-
4月末日	10,163	△0.0	-
5月末日	10,162	△0.0	-
6月末日	10,162	△0.0	-
7月末日	10,161	△0.0	-
8月末日	10,161	△0.0	-
9月末日	10,160	△0.0	-
10月末日	10,160	△0.0	-
11月末日	10,160	△0.0	-
(期末)2023年12月11日	10,160	△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、利息収入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：10,164円 期末：10,160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

○国内短期金融市場

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

2023年12月11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	19,535,266	100.0
投資信託財産総額	19,535,266	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネー・マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	19,535,266,323円
コール・ローン等	19,535,266,323
(B) 負債	29,184,000
未払解約金	29,184,000
(C) 純資産総額(A - B)	19,506,082,323
元本	19,198,713,135
次期繰越増益金	307,369,188
(D) 受益権総口数	19,198,713,135口
1万口当り基準価額(C / D)	10,160円

* 期首における元本額は14,576,480,402円、当作成期間中における追加設定元本額は27,183,021,765円、同解約元本額は22,560,789,032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：

ゴールド・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	6,471,708,187円
ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド - A1新時代- (為替ヘッジあり)	977,694円
ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド - A1新時代- (為替ヘッジなし)	977,694円
ダイワFEGグローバル・バリュー (為替ヘッジあり)	9,608円
ダイワFEGグローバル・バリュー (為替ヘッジなし)	9,608円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,107円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし)	49,107円
世界水資源関連株ファンド	984円
ダイワ / "R I C I"® コモディティ・ファンド	2,074,249円
堅実バランスファンド - ハジメの一歩-	82,551,045円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/隔月分配型)	180,729円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/隔月分配型)	737,649円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/資産成長型)	95,276円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	337,885円
世界セレクトティブ株式オープン	983円
世界セレクトティブ株式オープン (年2回決算型)	983円
iFreeETF NASDAQ100インバース	3,668,122,787円
iFreeETF NASDAQ100レバレッジ	3,404,533,061円
iFreeETF NASDAQ100ダブルインバース	1,690,708,296円
D Cダイワ・マネー・ポートフォリオ	3,873,348,807円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル	132,757円
リターンズ- 日本円・コース (毎月分配型)	
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル	52,987円
リターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型)	
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル	467,315円
リターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル	12,784円
リターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型)	
ダイワFEGグローバル・バリュー株ファンド (ダイワSMA専用)	3,666円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	155,317円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型)	38,024円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 米ドル・コース (毎月分配型)	4,380円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型)	22,592円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース)	33,689円
ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース)	96,254円
ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 米ドルコース	9,817円
ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 日本円コース	6,964円
ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 通貨αコース	9,479円
ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型)	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	982,368円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 南アフリカ・ランド・コース (毎月分配型)	1,097円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース (毎月分配型)	2,690円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	1,350円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプル	9,652円
リターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,160円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,497,360円
受取利息	7,522
支払利息	△ 6,504,882
(B) 当期損益金(A)	△ 6,497,360
(C) 前期繰越損益金	238,705,846
(D) 解約差損益金	△ 365,355,257
(E) 追加信託差損益金	440,515,959
(F) 合計(B + C + D + E)	307,369,188
次期繰越損益金(F)	307,369,188

(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。