

ダイワ米国株主還元株ファンド

運用報告書(全体版) 第10期

(決算日 2020年10月19日)

(作成対象期間 2020年4月21日～2020年10月19日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式		
信託期間	約10年間（2015年10月20日～2025年10月17日）		
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。		
主要投資 対 象	当 ファ ン ド	イ．ケイマン籍の外国投資信託「UBS（CAY）USTOTAL・イールド・ファンド（USTOTAL・イールド・クラス）」の受益証券（円建） ロ．ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券	
組入制限	当ファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、継続的に株主還元を行なう米国企業の株式へ投資することで、信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

最近5期の運用実績

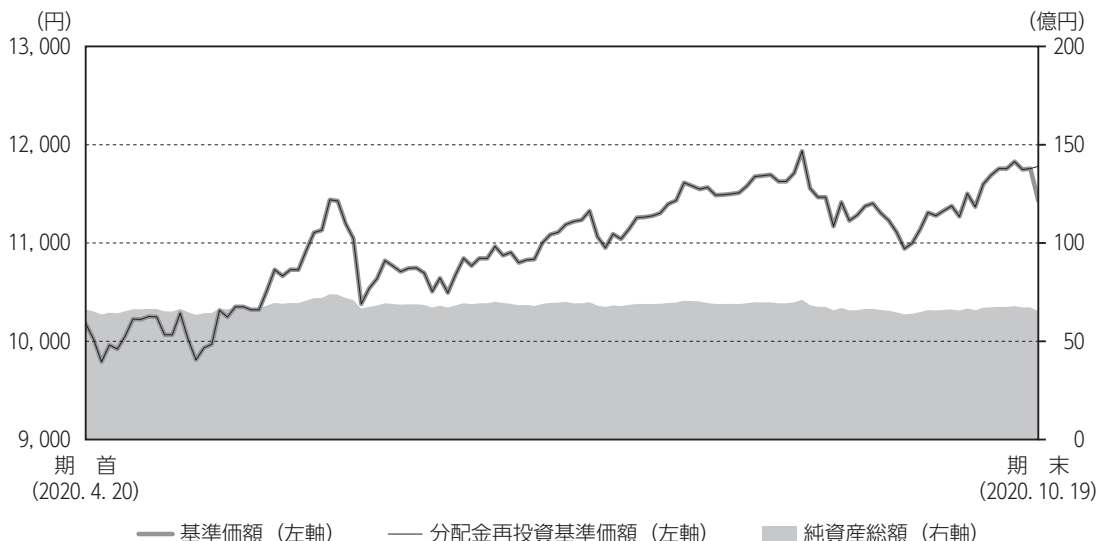
決 算 期	基 準 価 額			M S C I 米国指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
6 期末 (2018年10月18日)	11, 646	200	7. 5	13, 788	9. 9	—	96. 9	11, 782
7 期末 (2019年 4 月18日)	11, 957	100	3. 5	14, 323	3. 9	—	98. 0	10, 846
8 期末 (2019年10月18日)	11, 524	0	△ 3. 6	14, 487	1. 1	—	97. 6	9, 080
9 期末 (2020年 4 月20日)	10, 180	0	△ 11. 7	13, 946	△ 3. 7	—	97. 3	6, 618
10期末 (2020年10月19日)	11, 431	350	15. 7	16, 946	21. 5	—	98. 6	6, 536

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) M S C I 米国指数（配当込み、円換算）は、M S C I Inc. の承諾を得て、M S C I 米国指数（配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10, 000として大和アセットマネジメントが計算したものです。M S C I 米国指数（配当込み、米ドルベース）は、M S C I Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I Inc. に帰属します。またM S C I Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注 5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

基準価額・騰落率

期 首：10,180円

期 末：11,431円（分配金350円）

騰落率：15.7%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

主として、USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）に投資した結果、USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）の上昇が寄与し、基準価額は上昇しました。USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）については、米国企業の株式へ投資した結果、米ドルが対円で下落（円高）したことはマイナス要因となりましたが、米国株式が上昇したことがプラスに寄与しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

※USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）：UBS（CAY）USトータル・イールド・ファンド（USトータル・イールド・クラス）

ダイワ米国株主還元株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		M S C I 米国指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2020年 4 月20日	円	%		%	%	%
	10, 180	—	13, 946	—	—	97. 3
4 月末	10, 222	0. 4	14, 156	1. 5	—	98. 3
5 月末	10, 665	4. 8	14, 760	5. 8	—	98. 6
6 月末	10, 681	4. 9	14, 969	7. 3	—	98. 6
7 月末	11, 041	8. 5	15, 522	11. 3	—	99. 0
8 月末	11, 626	14. 2	16, 941	21. 5	—	99. 3
9 月末	11, 278	10. 8	16, 241	16. 5	—	99. 0
(期末) 2020年10月19日	11, 781	15. 7	16, 946	21. 5	—	98. 6

(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

(2020. 4. 21 ~ 2020. 10. 19)

■米国株式市況

米国株式市場は上昇しました。

米国株式市場は、新型コロナウイルスの感染拡大と経済活動の停滞に対する警戒感が広がる中でも、世界各地の政府・中央銀行による景気対策などに下支えされて、当作成期の序盤から上昇基調で推移しました。その後、米中関係の悪化や新型コロナウイルスの感染第2波に対する警戒感などから、株式への売り圧力が高まる局面もありましたが、米国経済の改善傾向や経済活動再開の動き、またワクチンの早期開発期待などを背景に、米国株式市場は上昇基調を維持しました。2020年9月に入り、ハイテク株に対する高値警戒感や追加景気対策をめぐる与野党の対立、欧州を中心とした新型コロナウイルスの感染再拡大などを嫌気して、米国株式市場は下落に転じました。しかし当作成期末にかけては再び上昇に転じました。

■米ドル円為替相場

米ドルの対円為替相場は下落しました。

当作成期の序盤は、世界的な経済再開への期待や雇用統計をはじめとする米国経済指標の改善などを背景に、米ドルは強含みとなりました。しかしその後、2020年6月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）において景気の先行きに慎重な見方が示されたことや、7月に発表された米国の4－6月期GDP（国内総生産）成長率の落ち込みなどが悪材料となり、米ドル安が進みました。8月以降は、米国経済指標の改善傾向や米国の追加景気対策をめぐる不透明感、新型コロナウイルスの感染再拡大などの材料が交錯する中で、米ドルは方向感の定まらない動きとなりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。通常の状態では、USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■USトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

米国の安定した雇用・消費の増加に支えられた景気拡大を受け、米国株式市場は当作成期首から2020年2月中旬までは堅調に推移しました。その後、アジアの局所的問題とみられていた新型コロ

ナウウイルスが米国で爆発的に広がり、感染率の抑制を目的に生活に必須な業種以外の営業を停止または縮小させる行政命令が発動されたことで、株式市場は急落しました。米国政府および中央銀行による迅速な対応もあり株価は回復基調にありますが、新型コロナウイルスによる経済への影響を正確に推定することは困難であり、今後自社株買いおよび配当支払いを停止する企業も増加すると考えられます。このような環境の中、当ファンドは株主還元の持続性により重点を置いた投資運用をしていく方針です。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2020. 4. 21 ~ 2020. 10. 19)

■当ファンド

US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資しました。US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）への投資割合を高位に維持しました。

■US トータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

現物株ポートフォリオについては、米国の大型・中型株の中から株主還元の積極性や持続性が優れた企業を選定し、セクター分散等を勘案した上で約100銘柄に等金額投資をして運用を行いました。当作成期の株式組入比率はおおむね90%以上の高位を維持しました。業種構成は、引き続き配当利回りおよび自社株買い比率の高い資本財・サービスや生活必需品の組み入れがMSCI米国指数対比で高位となりました。一方で、株主還元比率が低いコミュニケーション・サービスや公益事業は低位組み入れとなりました。個別銘柄の組入比率は、等金額投資の結果、すべての保有銘柄でおおむね1%前後となりました。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

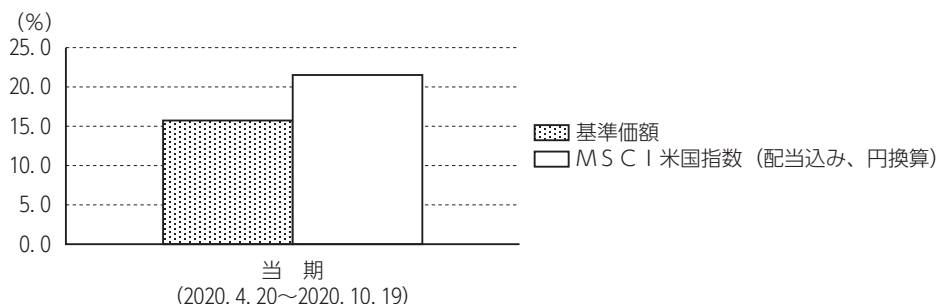
当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数（MSCI米国指数（配当込み、円換算））との騰落率の対比です。

当作成期のパフォーマンスは、参考指数のパフォーマンスを下回る結果となりました。

業種別では、エネルギーのアンダーウエートや、資本財・サービスのオーバーウエートならびに銘柄選択などがパフォーマンスにプラス寄与しました。一方、情報技術やヘルスケアにおける銘柄選択などがマイナス要因となりました。

個別銘柄では、農業用品小売りチェーンのトラクター・サプライやホームセンターを展開するロウズなどの株価が上昇し、パフォーマンスにプラス寄与しました。一方、バイオ医薬品メーカーのギリアド・サイエンスや不動産投資信託会社（REIT）のエクイティ・コモンウェルスなどは株価が下落し、マイナス要因となりました。



分配金について

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

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年4月21日 ～2020年10月19日	
当期分配金（税込み）	（円）	350
対基準価額比率	（％）	2.97
当期の収益	（円）	303
当期の収益以外	（円）	46
翌期繰越分配対象額	（円）	2,425

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 303.52円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	641.50
(d) 分配準備積立金	✓ 1,830.65
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	2,775.69
(f) 分配金	350.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	2,425.69

- （注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、ＵＳトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。通常の状態では、ＵＳトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■ＵＳトータル・イールド・ファンド（トータル・イールド・クラス）

米国では新型コロナウイルスに対応し経済のロックダウン（感染率の抑制を目的に生活に必須な業種以外の営業を停止または縮小させる行政命令）を実施したことで経済活動は急減速したものの、米国政府や中央銀行による迅速な対応を受け、株価は2020年3月の底値から順調に回復し、年初来高値を更新する展開となりました。当作成期においては、企業の成長性や時価総額の大きさに注目が集まる展開となりましたが、自社株買いおよび配当という株主還元は米国株式市場において引き続き重要な投資テーマであると考えられるため、当ファンドはこれまでと同様に株主還元の積極性と持続性に重点を置いた投資運用をしていく方針です。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 4. 21～2020. 10. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	74円	0. 672%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10, 996円です。
(投 信 会 社)	(24)	(0. 219)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(48)	(0. 439)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0. 014)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	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
(そ の 他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	74	0. 676	

(注 1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

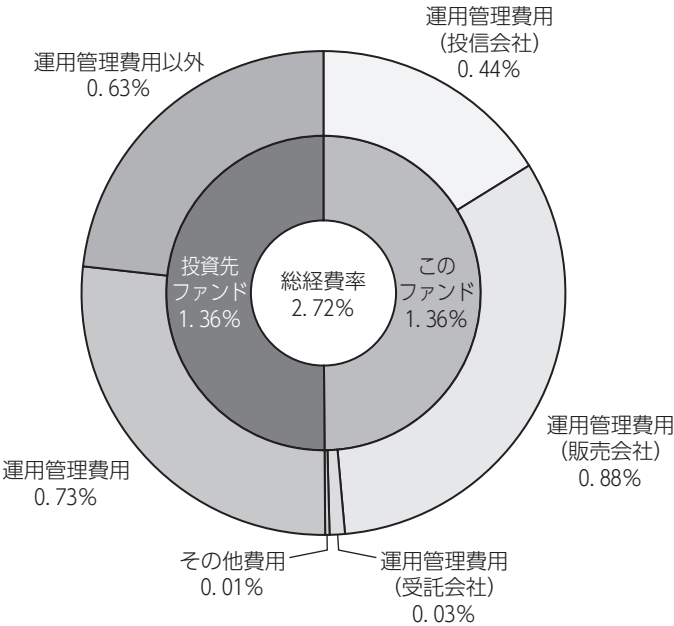
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.72%です。



総経費率（①＋②＋③）	2.72%
①このファンドの費用の比率	1.36%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.73%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.63%

(注1) ①の費用は、1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
(注3) 各比率は、年率換算した値です。
(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2020年4月21日から2020年10月19日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	2,716.96115	245,370	11,416.15565	1,092,000

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。
(注2) 金額は受渡し代金。
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2020年4月21日から2020年10月19日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	593.14092	50,000	84	UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT (ケイマン諸島)	11,416.15565	1,092,000	95

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) UBS (CAY) US TOTAL YIELD FUND US TOTAL YIELD UNIT	66,029.09761	6,444,307	98.6

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	36,730	36,730	36,682

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	6,444,307	94.7
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	36,682	0.5
コール・ローン等、その他	326,283	4.8
投資信託財産総額	6,807,273	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年10月19日現在		
項 目	当 期 末	
(A) 資産	6, 807, 273, 441円	
コール・ローン等	326, 283, 110	
投資信託受益証券（評価額）	6, 444, 307, 868	
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	36, 682, 463	
(B) 負債	270, 462, 727	
未払収益分配金	200, 153, 025	
未払解約金	24, 481, 528	
未払信託報酬	45, 549, 391	
その他未払費用	278, 783	
(C) 純資産総額（A－B）	6, 536, 810, 714	
元本	5, 718, 657, 884	
次期繰越損益金	818, 152, 830	
(D) 受益権総口数	5, 718, 657, 884口	
1万口当り基準価額（C／D）	11, 431円	

* 期首における元本額は6, 502, 004, 599円、当作成期間中における追加設定元本額は56, 079, 669円、同解約元本額は839, 426, 384円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は11, 431円です。

■損益の状況

当期 自 2020年 4月21日 至 2020年10月19日		
項 目	当 期	
(A) 配当等収益	182, 286, 696円	
受取配当金	182, 307, 702	
受取利息	323	
支払利息	△	21, 329
(B) 有価証券売買損益	777, 683, 713	
売買益	848, 014, 249	
売買損	△	70, 330, 536
(C) 信託報酬等	△	45, 829, 473
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	914, 140, 936	
(E) 前期繰越損益金	△	262, 692, 591
(F) 追加信託差損益金	366, 857, 510	
（配当等相当額）	（	322, 752, 012）
（売買損益相当額）	（	44, 105, 498）
(G) 合計（D＋E＋F）	1, 018, 305, 855	
(H) 収益分配金	△	200, 153, 025
次期繰越損益金（G＋H）	818, 152, 830	
追加信託差損益金	366, 857, 510	
（配当等相当額）	（	322, 752, 012）
（売買損益相当額）	（	44, 105, 498）
分配準備積立金	1, 020, 311, 632	
繰越損益金	△	569, 016, 312

（注１）信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しておりません。
 （注２）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
 （注３）収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	173, 574, 043円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	366, 857, 510
(d) 分配準備積立金	1, 046, 890, 614
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1, 587, 322, 167
(f) 分配金	200, 153, 025
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	1, 387, 169, 142
(h) 受益権総口数	5, 718, 657, 884口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	350円

●〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
 - ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

UBS（CAY）US トータル・イールド・ファンド
（US トータル・イールド・クラス）

当ファンド（ダイワ米国株主還元株ファンド）はケイマン籍の外国投資信託「UBS（CAY）US トータル・イールド・ファンド（US トータル・イールド・クラス）」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。

（注）2020年10月19日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（円建て）

貸借対照表
2019年9月30日

資産

流動資産

金融資産（損益通算後の評価額）	¥	19,424,354,011
現金および現金同等物		137,648,718
担保としてブローカーが保有する現金		223,066,796
未収：		
配当		13,677,197
その他資産		1,080,750
資産合計		19,799,827,472

負債

流動負債

金融負債（損益通算後の評価額）		271,145,308
保管会社に対する支払		511,653
担保としてブローカーが保有する現金		-
未払：		
償還済み受益証券		-
運用会社報酬		29,235,250
専門家報酬		6,147,004
管理会社報酬		5,580,029
受託会社報酬		3,014,052
保管会社報酬		2,258,993
名義書換代理人報酬		150,965
登録料		10,010
その他負債		14,932
負債（償却可能受益証券の保有者に帰属する純資産を除く）		318,068,196
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	¥	19,481,759,276

損益計算書

2019年9月30日に終了した年度

収益

受取利息	¥	5,299,400
配当収益		428,634,717
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の純実現利益		12,198,338
デリバティブ金融資産および負債の純実現利益		123,504,639
外国為替取引の純実現（損失）		(10,235,762)
損益通算後のデリバティブ以外の金融資産の評価（損）		(1,042,068,251)
デリバティブ金融資産および負債の評価（損）		(187,332,445)
外国為替取引の評価益の純変動		1,759,061
収益合計		(668,240,303)

費用

運用会社報酬		113,550,771
管理会社報酬		22,455,391
保管会社報酬		5,665,514
専門家報酬		5,107,497
取引費用		3,380,917
名義書換代理人報酬		1,964,127
受託会社報酬		1,329,021
登録料		13,380
その他費用		487,036
費用合計		153,953,654

営業損益

(822,193,957)

金融費用

償却可能受益証券の保有者への分配		(2,649,198,127)
------------------	--	-----------------

分配後および税引前損益

(3,471,392,084)

源泉徴収税		(120,453,245)
-------	--	---------------

運用の結果生じた償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産の減少額

¥ (3,591,845,329)

投資明細表
2019年9月30日

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
	普通株 (99.6%)		
	アイルランド (2.0%)		
	コンピューター (1.0%)		
8,992	Accenture Plc. Class A	1.0	¥ 186,927,727
	医薬品 (1.0%)		
13,868	Jazz Pharmaceuticals Plc.	1.0	192,054,191
	アイルランド合計		378,981,918
	プエルトリコ (1.0%)		
	銀行 (1.0%)		
33,222	Popular, Inc.	1.0	194,172,487
	プエルトリコ合計		194,172,487
	スイス (1.0%)		
	電機 (1.0%)		
19,721	TE Connectivity, Ltd.	1.0	198,598,917
	スイス合計		198,598,917
	英国 (1.0%)		
	保険 (1.0%)		
9,400	Aon Plc.	1.0	196,648,727
	英国合計		196,648,727
	米国 (94.6%)		
	広告 (1.0%)		
22,640	Omnicom Group, Inc.	1.0	191,585,846
	農業 (0.9%)		
39,965	Altria Group, Inc.	0.9	176,655,987
	航空 (2.0%)		
31,403	Delta Air Lines, Inc.	1.0	195,487,440
33,633	Southwest Airlines Co.	1.0	196,320,215
			391,807,655
	アパレル (2.1%)		
18,602	Columbia Sportswear Co.	1.0	194,788,733
21,123	NIKE, Inc. Class B	1.1	214,406,980
			409,195,713
	銀行 (3.1%)		
3,921	First Citizens BancShares, Inc. Class A	1.0	199,825,003
11,803	M&T Bank Corp.	1.0	201,507,985
37,876	Wells Fargo & Co.	1.1	206,473,548
			607,806,536
	飲料 (1.9%)		
29,086	Monster Beverage Corp.	0.9	182,509,833
12,804	PepsiCo, Inc.	1.0	189,717,921
			372,227,754
	バイオテクノロジー (2.9%)		
8,564	Amgen, Inc.	0.9	179,104,009
7,862	Biogen, Inc.	1.0	197,823,809

ダイワ米国株主還元株ファンド

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
27,951	Gilead Sciences, Inc.	1.0	191,458,574
			568,386,392
41,829	建築材料 (1.0%) Johnson Controls International Plc.	1.0	198,412,166
14,969	化学 (2.0%) Celanese Corp. Class A	1.0	197,837,661
20,911	LyondellBasell Industries NV Class A	1.0	202,198,288
			400,035,949
10,920	商業サービス (2.0%) Automatic Data Processing, Inc.	1.0	190,504,491
33,561	Robert Half International, Inc.	1.0	201,884,665
			392,389,156
27,770	コンピューター (4.0%) Amdocs, Ltd.	1.0	198,412,154
8,384	Apple, Inc.	1.1	202,939,392
27,744	Cognizant Technology Solutions Corp. Class A	0.9	180,700,549
12,492	International Business Machines Corp.	1.0	196,327,597
			778,379,692
4,173	総合金融サービス (8.0%) BlackRock, Inc. Class A	1.0	200,982,288
18,770	Intercontinental Exchange, Inc.	1.0	187,175,943
6,238	Mastercard, Inc. Class A	0.9	183,084,846
29,558	SEI Investments Co.	1.0	189,288,959
54,949	Synchrony Financial	1.0	202,447,319
15,970	T Rowe Price Group, Inc.	1.0	197,190,669
10,289	Visa, Inc. Class A	1.0	191,272,308
81,573	Western Union Co.	1.1	204,266,762
			1,555,709,094
26,851	電力 (2.0%) Eversource Energy, Inc.	1.0	193,151,913
69,435	Vistra Energy Corp.	1.0	200,586,931
			393,738,844
23,729	電機 (4.0%) Agilent Technologies, Inc.	1.0	196,518,526
41,319	Avnet, Inc.	1.0	198,650,030
10,582	Honeywell International, Inc.	1.0	193,505,517
8,100	Waters Corp.	1.0	195,417,212
			784,091,285
41,085	食品 (4.0%) Hormel Foods Corp.	1.0	194,172,626
22,360	Ingredion, Inc.	1.0	197,529,365
31,633	Mondelez International, Inc. Class A	1.0	189,124,498
23,634	Sysco Corp.	1.0	202,807,013
			783,633,502
20,051	ヘルスケア製品 (1.0%) Baxter International, Inc.	1.0	189,548,521

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
	ヘルスケアサービス (2.7%)		
13,764	Molina Healthcare, Inc.	0.8	163,213,357
7,250	UnitedHealth Group, Inc.	0.9	170,279,724
12,063	Universal Health Services, Inc. Class B	1.0	193,926,669
			527,419,750
	家庭用品 (0.9%)		
10,841	Clorox Co.	0.9	177,937,127
	保険 (5.0%)		
34,299	Aflac, Inc.	1.0	193,943,143
17,089	Allstate Corp.	1.0	200,720,401
40,800	Assured Guaranty Ltd.	1.0	196,044,588
38,707	MetLife, Inc.	1.0	197,282,492
12,308	Travelers Cos, Inc.	1.0	197,785,516
			985,776,140
	インターネット (2.0%)		
906	Booking Holdings, Inc.	1.0	192,170,819
44,289	eBay, Inc.	1.0	186,579,079
			378,749,898
	鉄鋼 (2.0%)		
35,139	Nucor Corp.	1.0	193,338,227
17,873	Reliance Steel & Aluminum Co.	1.0	192,505,691
			385,843,918
	建設機械・鉱山機械 (1.0%)		
14,237	Caterpillar, Inc.	1.0	194,348,618
	総合機械 (2.1%)		
11,434	Cummins, Inc.	1.0	201,016,122
11,458	Rockwell Automation, Inc.	1.1	204,075,684
			405,091,806
	石油・ガス (4.0%)		
14,860	Chevron Corp.	1.0	190,470,944
30,891	ConocoPhillips	1.0	190,230,280
24,761	Exxon Mobil Corp.	1.0	188,955,539
17,972	Phillips 66	1.0	198,893,964
			768,550,727
	医薬品 (5.8%)		
20,458	AmerisourceBergen Corp. Class A	0.9	182,031,491
15,445	Eli Lilly & Co.	1.0	186,668,687
13,771	Johnson & Johnson	1.0	192,556,357
12,715	McKesson Corp.	1.0	187,794,564
20,312	Merck & Co., Inc.	1.0	184,793,566
46,907	Pfizer, Inc.	0.9	182,146,198
			1,115,990,863
	不動産投資信託 (REIT) (1.9%)		
53,911	Equity Commonwealth	1.0	199,555,269
6,740	Public Storage	0.9	178,660,919
			378,216,188

ダイワ米国株主還元株ファンド

株数	銘柄名	純資産に 占める 割合 (%)	評価額
小売 (15.3%)			
11,965	Advance Auto Parts, Inc.	1.1	213,881,610
27,408	Best Buy Co., Inc.	1.1	204,356,627
45,479	Cheesecake Factory, Inc.	1.1	204,863,153
14,912	Darden Restaurants, Inc.	1.0	190,525,051
49,348	Dick's Sporting Goods, Inc.	1.1	217,651,361
11,309	Dollar General Corp.	1.0	194,259,671
7,855	Home Depot, Inc.	1.0	196,968,532
4,585	O'Reilly Automotive, Inc.	1.0	197,471,216
16,759	Ross Stores, Inc.	1.0	198,963,494
18,359	Starbucks Corp.	0.9	175,438,445
32,432	TJX Cos, Inc.	1.0	195,373,624
17,444	Tractor Supply Co.	0.9	170,502,938
34,121	Walgreens Boots Alliance, Inc.	1.1	203,962,650
15,353	Walmart, Inc.	1.0	196,922,810
27,018	Williams-Sonoma, Inc.	1.0	198,499,581
			2,959,640,763
半導体 (2.0%)			
35,922	Intel Corp.	1.0	200,053,377
13,974	Texas Instruments, Inc.	1.0	195,183,420
			395,236,797
造船 (1.0%)			
8,345	Huntington Ingalls Industries, Inc.	1.0	191,010,406
ソフトウェア (1.0%)			
33,919	Oracle Corp.	1.0	201,728,746
通信 (1.0%)			
37,851	Cisco Systems, Inc.	1.0	202,123,797
運輸 (5.0%)			
20,378	CH Robinson Worldwide, Inc.	1.0	186,715,429
26,169	CSX Corp.	1.0	195,910,427
25,068	Expeditors International of Washington, Inc.	1.0	201,268,255
10,167	Norfolk Southern Corp.	1.0	197,410,139
10,598	Union Pacific Corp.	1.0	185,528,463
			966,832,713
米国合計			18,428,102,349
普通株合計 (簿価 ¥18,282,013,586)			¥ 19,396,504,398

US トータル・イールド・クラスの2019年9月30日現在の売建オプション残高（純資産の－0.4%）

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - Accenture Plc.	210	2019/10/9	4,250	¥ (770,752)	¥ (241)
Call - Advance Auto Parts, Inc.	157	2019/10/9	5,670	(592,406)	(5,467,761)
Call - Agilent Technologies, Inc.	77	2019/10/9	11,840	(536,901)	(1,077,790)
Call - Altria Group, Inc.	44	2019/10/9	18,930	(1,563,614)	(26,506)
Call - Amdocs, Ltd.	69	2019/10/9	13,490	(440,452)	(125,089)
Call - Amgen, Inc.	223	2019/10/9	4,050	(326,422)	-
Call - Apple, Inc.	224	2019/10/9	4,050	(859,605)	(1,374,201)
Call - Automatic Data Processing, Inc.	178	2019/10/9	5,170	(828,181)	(2,505)
Call - Avnet, Inc.	46	2019/10/9	19,580	(1,033,976)	(472,078)
Call - Baxter International, Inc.	91	2019/10/9	9,490	(965,008)	(89,908)
Call - Best Buy Co., Inc.	69	2019/10/9	13,190	(1,669,537)	(2,227,789)
Call - Biogen, Inc.	240	2019/10/9	3,790	(974,660)	(844,003)
Call - BlackRock, Inc.	438	2019/10/9	2,000	(1,146,377)	(2,443,270)
Call - Booking Holdings, Inc.	2,058	2019/10/9	420	(944,927)	(99,156)
Call - Caterpillar, Inc.	129	2019/10/9	7,060	(878,057)	(661,231)
Call - Celanese Corp.	121	2019/10/9	7,090	(1,473,113)	(2,191,586)
Call - CH Robinson Worldwide, Inc.	87	2019/10/9	9,650	(873,119)	(440,896)
Call - Cheesecake Factory, Inc.	42	2019/10/9	21,540	(1,042,939)	(1,704,410)
Call - Cisco Systems, Inc.	51	2019/10/9	17,930	(765,076)	(187,985)
Call - Clorox Co.	167	2019/10/9	5,130	(804,968)	(1,094)
Call - Columbia Sportswear Co.	102	2019/10/9	8,810	(475,516)	(148,442)
Call - ConocoPhillips	57	2019/10/9	15,290	(787,298)	(1,518,920)
Call - CSX Corp.	70	2019/10/9	12,540	(1,122,118)	(800,637)
Call - Cummins, Inc.	166	2019/10/9	5,610	(392,700)	(671,644)
Call - Darden Restaurants, Inc.	127	2019/10/9	7,060	(1,686,734)	(4,888)
Call - Delta Air Lines, Inc.	62	2019/10/9	14,880	(661,215)	(127,592)
Call - Dick's Sporting Goods, Inc.	38	2019/10/9	24,760	(1,132,584)	(7,291,466)
Call - Dollar General Corp.	168	2019/10/9	5,350	(394,202)	(55,124)
Call - eBay, Inc.	44	2019/10/9	20,980	(548,900)	(1,029)
Call - Eli Lilly & Co.	121	2019/10/9	7,310	(611,238)	(16,100)
Call - Evergy, Inc.	67	2019/10/9	12,720	(617,520)	(595,408)
Call - Expeditors International of Washington, Inc.	76	2019/10/9	11,870	(549,316)	(560,537)
Call - Exxon Mobil Corp.	74	2019/10/9	11,730	(352,976)	(32,670)
Call - First Citizens BancShares, Inc.	476	2019/10/9	1,850	(829,739)	(1,133,252)
Call - Gilead Sciences, Inc.	68	2019/10/9	13,240	(399,265)	(38,330)
Call - Home Depot, Inc.	235	2019/10/9	3,720	(746,037)	(548,700)
Call - Honeywell International, Inc.	176	2019/10/9	5,010	(778,951)	(84,298)
Call - Hormel Foods Corp.	44	2019/10/9	19,460	(1,003,683)	(1,181,609)
Call - Huntington Ingalls Industries, Inc.	221	2019/10/9	3,950	(1,020,205)	(160,397)
Call - Ingredion, Inc.	81	2019/10/9	10,790	(1,264,339)	(1,754,256)
Call - Intel Corp.	54	2019/10/9	18,040	(560,429)	(255,332)
Call - International Business Machines Corp.	145	2019/10/9	5,910	(842,521)	(1,757,158)
Call - Jazz Pharmaceuticals Plc	136	2019/10/9	6,560	(1,053,301)	(335,753)
Call - Johnson & Johnson	135	2019/10/9	6,520	(334,744)	(62,323)
Call - LyondellBasell Industries NV	82	2019/10/9	10,700	(1,333,286)	(9,209,310)
Call - M&T Bank Corp.	155	2019/10/9	5,830	(675,465)	(2,976,059)
Call - Mastercard, Inc.	301	2019/10/9	2,950	(1,176,694)	(545)
Call - McKesson Corp.	152	2019/10/9	6,180	(711,915)	(29,819)
Call - Molina Healthcare, Inc.	129	2019/10/9	6,520	(2,187,705)	(4,928)
Call - Mondelez International, Inc.	58	2019/10/9	14,980	(621,720)	(35,551)
Call - Monster Beverage Corp.	61	2019/10/9	13,780	(1,275,266)	(171,692)
Call - NIKE, Inc.	91	2019/10/9	10,230	(1,730,401)	(3,453,419)
Call - Norfolk Southern Corp.	182	2019/10/9	4,810	(1,361,733)	(957,156)
Call - Nucor Corp.	53	2019/10/9	16,880	(1,091,792)	(537,353)

ダイワ米国株主還元株ファンド

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - Oracle Corp.	56	2019/10/9	16,060	(1,488,503)	(591,997)
Call - O'Reilly Automotive, Inc	409	2019/10/9	2,170	(1,207,116)	(454,861)
Call - PepsiCo, Inc.	140	2019/10/9	6,060	(785,020)	(377,892)
Call - Pfizer, Inc.	38	2019/10/9	22,230	(851,226)	(124,604)
Call - Phillips 66	105	2019/10/9	8,780	(750,415)	(459,882)
Call - Popular, Inc.	57	2019/10/9	15,740	(446,179)	(116,878)
Call - Public Storage	264	2019/10/9	3,190	(777,026)	(1,016)
Call - Reliance Steel & Aluminum Co.	105	2019/10/9	8,460	(861,810)	(109,933)
Call - Robert Half International, Inc.	58	2019/10/9	15,890	(473,055)	(301,175)
Call - Rockwell Automation, Inc.	164	2019/10/9	5,420	(1,654,239)	(2,065,059)
Call - Ross Stores, Inc.	115	2019/10/9	7,930	(757,650)	(147,190)
Call - Southwest Airlines Co.	56	2019/10/9	16,680	(453,362)	(245,125)
Call - Starbucks Corp.	99	2019/10/9	8,700	(804,953)	(169)
Call - Synchrony Financial	36	2019/10/9	26,030	(507,145)	(212,913)
Call - Sysco Corp.	76	2019/10/9	11,190	(564,206)	(3,385,908)
Call - T Rowe Price Group, Inc.	120	2019/10/9	7,840	(470,412)	(73,590)
Call - Texas Instruments, Inc.	133	2019/10/9	6,620	(776,065)	(537,459)
Call - TJX Cos, Inc.	58	2019/10/9	15,360	(1,046,918)	(274,995)
Call - Tractor Supply Co.	110	2019/10/9	8,260	(540,885)	(14)
Call - Union Pacific Corp.	171	2019/10/9	5,020	(1,165,171)	(103,717)
Call - UnitedHealth Group, Inc.	240	2019/10/9	3,430	(753,970)	(23,086)
Call - Visa, Inc.	191	2019/10/9	4,870	(799,882)	(1,944)
Call - Vistra Energy Corp.	27	2019/10/9	33,260	(548,671)	(554,046)
Call - Walgreens Boots Alliance, Inc.	55	2019/10/9	16,170	(860,480)	(1,689,489)
Call - Waters Corp.	229	2019/10/9	4,010	(856,952)	(863,561)
Call - Wells Fargo & Co.	49	2019/10/9	18,150	(1,058,135)	(3,013,093)
Call - Western Union Co.	24	2019/10/9	39,070	(487,255)	(692,564)
Call - Williams-Sonoma, Inc.	68	2019/10/9	12,790	(1,284,418)	(1,672,092)
				¥ (71,852,717)	¥ (74,043,448)

B R L オーバーレイ & カバードコール・クラスの2019年9月30日現在の売建オプション残高 (純資産の-0.1%)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - OTC Brazilian Real versus Japanese Yen	26	2019/10/9	148,500,000	¥ (59,547,164)	¥ (17,315,221)

U S D カバードコール・クラスの2019年9月30日現在の売建オプション残高 (純資産の-0.0%)

銘柄	行使価格	満期日	契約数	プレミアム	評価額
Call - OTC United States Dollar versus Japanese Yen	107	2019/10/9	11,500,000	¥ (8,904,414)	¥ (12,472,125)

B R L オーバーレイ & カバードコール・クラスの2019年9月30日現在の外国為替先渡契約 (純資産の-0.8%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益(損)
B R L	Morgan Stanley & Co.	297,000,000	2019/10/16	U S D	72,521,274	¥ 27,849,613	¥ (167,314,514)	¥ (139,464,901)
						¥ 27,849,613	¥ (167,314,514)	¥ (139,464,901)

通貨の略称：

B R L	-	ブラジル・レアル
J P Y	-	日本円
U S D	-	米ドル

<補足情報>

当ファンド（ダイワ米国株主還元株ファンド）が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2019年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2020年10月19日）現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄

2020年4月21日～2020年10月19日における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

2020年10月19日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第8期（決算日 2019年12月9日）

（作成対象期間 2018年12月11日～2019年12月9日）

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

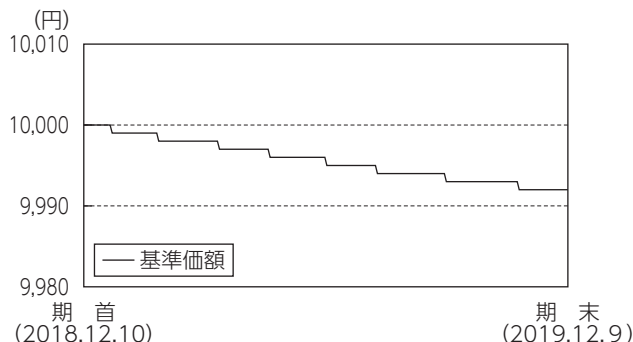
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
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)2018年12月10日	円	%	%
	10,000	—	—
12月末	10,000	0.0	—
2019年1月末	9,999	△0.0	—
2月末	9,998	△0.0	—
3月末	9,997	△0.0	—
4月末	9,997	△0.0	—
5月末	9,996	△0.0	—
6月末	9,995	△0.1	—
7月末	9,994	△0.1	—
8月末	9,994	△0.1	—
9月末	9,993	△0.1	—
10月末	9,993	△0.1	—
11月末	9,992	△0.1	—
(期末)2019年12月9日	9,992	△0.1	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,000円 期末：9,992円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

短期の国債やコール・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」

流動性及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

流動性及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》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	2 (2)
合 計	2

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の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

公 社 債

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 40,000	千円 — (40,000)

(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) ()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
801 国庫短期証券 2019/3/18	千円 40,000		千円

(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

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

2019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	7,324,100	100.0
投資信託財産総額	7,324,100	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

2019年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,324,100,953円
コール・ローン等	7,324,100,953
(B) 負債	44,082
その他未払費用	44,082
(C) 純資産総額(A－B)	7,324,056,871
元本	7,329,994,437
次期繰越損益金	△ 5,937,566
(D) 受益権総口数	7,329,994,437口
1万口当り基準価額(C／D)	9,992円

* 期首における元本額は9,018,625,641円、当作成期間中における追加設定元本額は4,065,530,242円、同解約元本額は5,754,161,446円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし) 999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αフットロプレミアム (毎月分配型) 219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αフットロプレミアム (年2回決算型) 24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (毎月分配型) 848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (年2回決算型) 66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド (為替ヘッジあり) 6,592,748円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド (為替ヘッジなし) 10,288,683円、ダイワ／パリュール・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド10,000円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型) 4,995円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型) 4,995円、ダイワ・ブラジル・レアル債α (毎月分配型) ースーパー・ハイインカムー α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α (毎月分配型) ースーパー・ハイインカムー α100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ118,909,472円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver6ー 1,052,878,511円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver7ー 1,327,444,782円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver4ー 858,767,992円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver5ー 3,405,863,412円、ダイワ円債セレクト マネーコース504,712,528円、ダイワ・スイス高配当株ツインα (毎月分配型) 2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 為替ヘッジなしコース1,490,665円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 日本円コース497,633円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) ブラジル・レアル・コース994,307円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 通貨セレクト コース397,742円、ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型) 為替ヘッジあり40,885円、ダイワ世界インカム・ハンター (年2回決算型) 為替ヘッジなし100,789円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (毎月分配型) 1,235円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (毎月分配型) 1,598円、通貨選択型 ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース (毎月分配型) 1,544円、通貨選択型ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース (毎月分配型) 1,984円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,992円です。
* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は5,937,566円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月11日 至2019年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△4,832,170円
受取利息	2,318
その他収益金	4
支払利息	△4,834,492
(B) その他費用	△1,752,564
(C) 当期損益金(A＋B)	△6,584,734
(D) 前期繰越損益金	119,826
(E) 解約差損益金	2,559,971
(F) 追加信託差損益金	△2,032,629
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	△5,937,566
次期繰越損益金(G)	△5,937,566

(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。