

ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型)

<5650>

追加型投信／海外／株式
日経新聞掲載名：英高配株ツα

| | | | |
|-------|--------------|-------|---------------|
| 第107期 | 2023年6月19日決算 | 第110期 | 2023年9月19日決算 |
| 第108期 | 2023年7月18日決算 | 第111期 | 2023年10月17日決算 |
| 第109期 | 2023年8月17日決算 | 第112期 | 2023年11月17日決算 |

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、相対的に配当利回りの高い英国の株式等へ投資するとともに、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、高水準のインカム性収益の確保と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。

| | | |
|-------------|-------|--------|
| 第112期末 | 基準価額 | 2,265円 |
| | 純資産総額 | 566百万円 |
| 第107期～第112期 | 騰落率 | 4.3% |
| | 分配金合計 | 150円 |

(注) 騰落率は分配金(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
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

運用報告書に関するお問い合わせ先



コールセンター 受付時間 9:00～17:00 (営業日のみ)
0120-106212

お客様の口座内容に関するご照会は、
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。

■当ファンドは、信託約款において「運用報告書(全体版)」に記載すべき事項を電磁的方法によりご提供することを定めており、以下の手順で閲覧、ダウンロードいただけます。「運用報告書(全体版)」は受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社へお問い合わせください。



見やすく読みまちがえにくい
ユニバーサルデザインフォント
を採用しています。

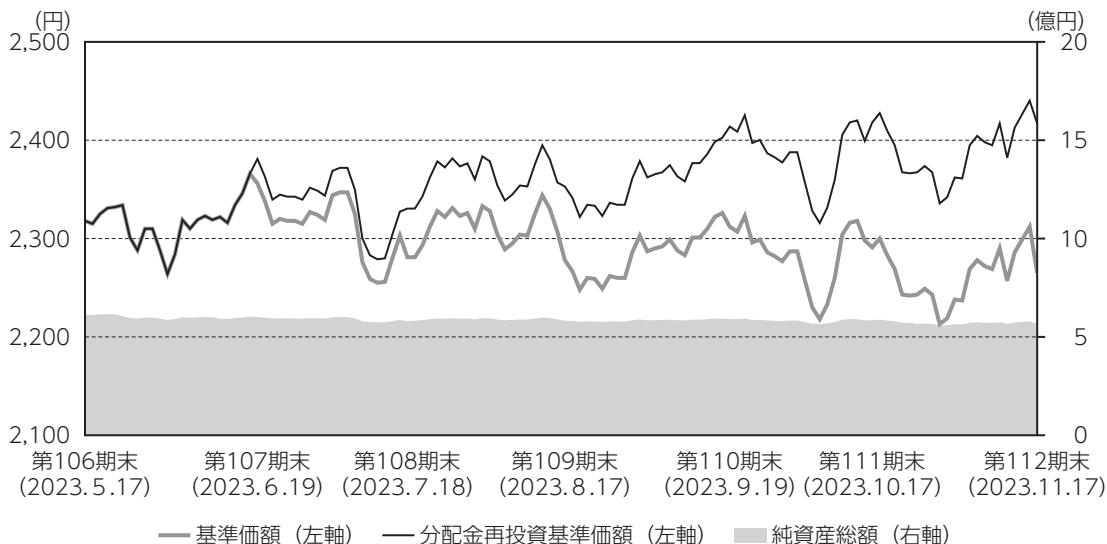
◇TKU0565020231117◇

「運用報告書(全体版)」の閲覧・ダウンロード方法
上記のURLにアクセス → ファンド検索欄にファンド名を入力 → リストから当ファンドを選択 → 運用報告書(全体版)を選択



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107期首：2,318円

第112期末：2,265円（既払分配金150円）

騰落率：4.3%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

英国株式市況は、金融引き締めや中東情勢の緊迫化などがマイナス要因となり、下落しました。一方で英ポンドは、当作成期首から2023年8月半ばにかけて、日英金利差の拡大が意識されたことが主な要因となり、対円で上昇（円安）しました。これらの結果、基準価額は上昇（分配金再投資ベース）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。

1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 第107期～第112期 (2023.5.18～2023.11.17) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|---------------------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 15円 | 0.673% | 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2,295円です。 |
| （投 信 会 社） | (5) | (0.220) | 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） | (10) | (0.441) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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 | 1 | 0.025 | 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 |
| （投資信託受益証券） | (1) | (0.025) | |
| 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 | 16 | 0.701 | |

(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。

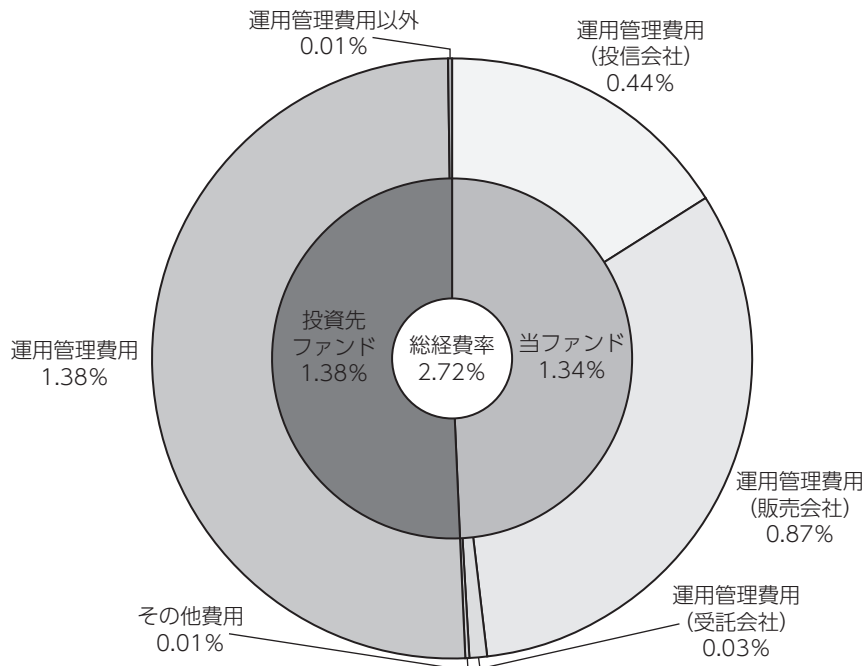
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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 | 1.38% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.01% |

(注1) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

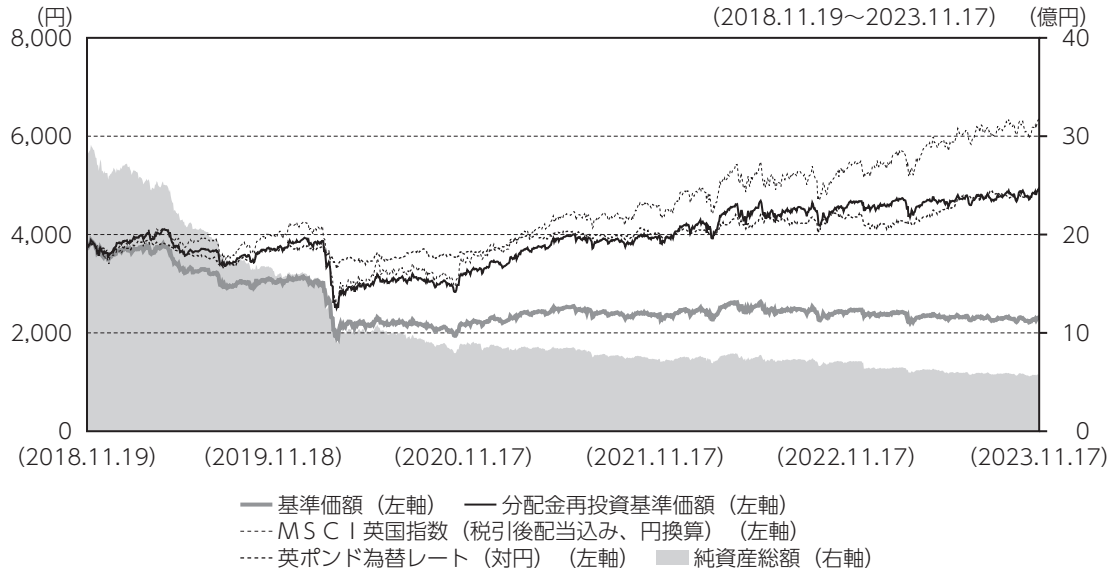
(注5) ①の費用は、1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

最近5年間の基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、2018年11月19日の基準価額をもとに指数化したものです。

*参考指数はMSCI英国指数 (税引後配当込み、円換算) および英ポンド為替レート (対円) です。参考指数は投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しております。

| | 2018年11月19日 期初 | 2019年11月18日 決算日 | 2020年11月17日 決算日 | 2021年11月17日 決算日 | 2022年11月17日 決算日 | 2023年11月17日 決算日 |
|--------------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 基準価額 (円) | 3,782 | 3,031 | 2,172 | 2,359 | 2,403 | 2,265 |
| 期間分配金合計 (税込み) (円) | - | 675 | 450 | 300 | 300 | 300 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | - | △2.1 | △13.4 | 23.1 | 15.2 | 7.2 |
| MSCI英国指数 (税引後配当込み、円換算) 騰落率 (%) | - | 5.1 | △12.3 | 32.5 | 14.9 | 18.1 |
| 英ポンド為替レート (対円) 騰落率 (%) | - | △2.8 | △1.8 | 11.6 | 7.8 | 12.7 |
| 純資産総額 (百万円) | 2,832 | 1,628 | 882 | 729 | 695 | 566 |

(注1) 比率は小数点第1位未満を四捨五入してあります。

(注2) MSCI英国指数 (税引後配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCI英国指数 (税引後配当込み、英ポンドベース) をもとに大和アセットマネジメントが円換算したものです。MSCI英国指数 (税引後配当込み、英ポンドベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。 (<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>)

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

(注4) 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。

※参考指数の「MSCI英国指数 (配当込み、円換算)」を「MSCI英国指数 (税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

投資環境について

(2023.5.18~2023.11.17)

■英国株式市況

英国株式市況は下落しました。

英国株式市況は、当作成期首から2023年7月初めにかけて、英国CPI（消費者物価指数）の上振れや、BOE（英国中央銀行）による予想を上回る利上げなどが嫌気されて軟調に推移しましたが、7月末にかけてインフレ懸念が後退したことで値を戻しました。その後も、主要各国の金利動向や世界的な景気の先行き不透明感などを背景に、値動きの荒い展開が続きました。10月半ば以降は、中東情勢の緊迫化や米国での金融引き締め長期化懸念を受け、下落基調となりました。11月に入ると、BOEによる2会合連続での政策金利の据え置きや米国での早期利下げ期待などが支援材料となり、下げ幅を縮小して当作成期末を迎えました。

■為替相場

英ポンドは対円で上昇しました。

英ポンドの対円為替相場は、当作成期首から2023年8月半ばにかけて、日英金利差の拡大が意識されたことで上昇しました。その後10月にかけては、英国のインフレ鈍化やBOE（英国中央銀行）による政策金利据え置きを受けた英国金利の低下に加え、日銀の金融政策修正期待から、対円で弱含む値動きとなりました。11月に入ると、ベイリーBOE総裁による早期利下げに対する否定的な発言などによって上昇し、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」の組入比率を高位に維持し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

※ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）：クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲーダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

■ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨の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、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■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

(2023.5.18~2023.11.17)

当ファンド

当ファンドは、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインα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・ファンズです。主として、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」を通じて、相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨の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、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨の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、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしました。

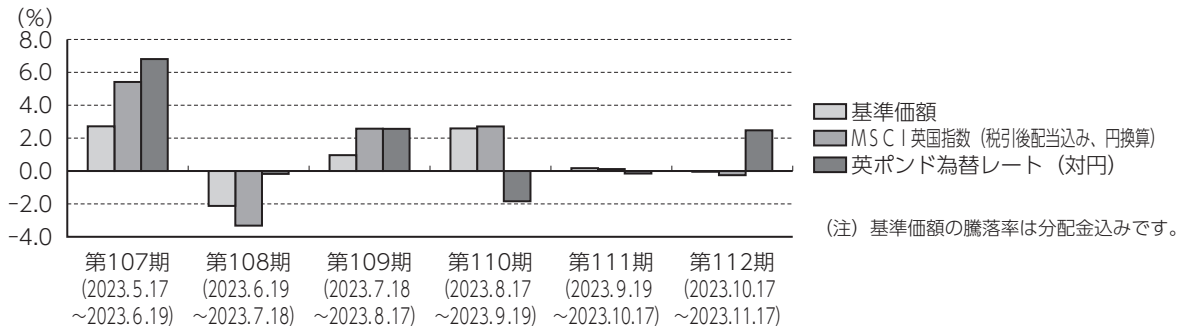
ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、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。



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107期 | 第108期 | 第109期 | 第110期 | 第111期 | 第112期 |
|---------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| | 2023年5月18日 ～2023年6月19日 | 2023年6月20日 ～2023年7月18日 | 2023年7月19日 ～2023年8月17日 | 2023年8月18日 ～2023年9月19日 | 2023年9月20日 ～2023年10月17日 | 2023年10月18日 ～2023年11月17日 |
| 当期分配金（税込み）（円） | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 対基準価額比率（％） | 1.05 | 1.08 | 1.09 | 1.07 | 1.08 | 1.09 |
| 当期の収益（円） | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 当期の収益以外（円） | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 1,424 | 1,440 | 1,453 | 1,470 | 1,478 | 1,488 |

（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107期 | 第108期 | 第109期 | 第110期 | 第111期 | 第112期 |
|----------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | ✓ 42.89円 | ✓ 41.13円 | ✓ 37.35円 | ✓ 42.69円 | ✓ 32.76円 | ✓ 34.37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 | 691.14 | 694.81 | 698.84 | 701.39 | 706.05 | 708.38 |
| (d) 分配準備積立金 | 715.55 | 729.78 | 741.92 | 751.72 | 764.86 | 770.29 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 1,449.59 | 1,465.74 | 1,478.11 | 1,495.82 | 1,503.68 | 1,513.05 |
| (f) 分配金 | 25.00 | 25.00 | 25.00 | 25.00 | 25.00 | 25.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f) | 1,424.59 | 1,440.74 | 1,453.11 | 1,470.82 | 1,478.68 | 1,488.05 |

（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

主として、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」の組入比率を高位に維持し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）

相対的に配当利回りの高い英国の株式等への投資と株式等および通貨のオプション取引を組み合わせたカバーードコール戦略を構築し、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

■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。

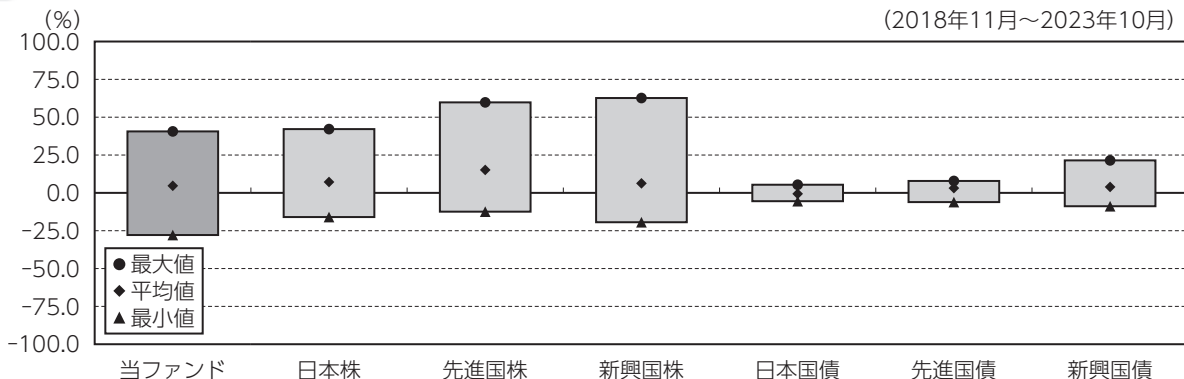


当ファンドの概要

| | | |
|--------------|--|---|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／株式 | |
| 信託期間 | 2014年5月30日～2024年5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「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲーダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」（以下「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券 |
| | ダイワ・マネー・マザーファンド | 本邦通貨表示の公社債 |
| 当ファンドの運用方法 | <p>①主として、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）の受益証券を通じて、相対的に配当利回りの高い英国の株式等（※）への投資と株式等および通貨の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、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。</p> <p>（※）不動産投資信託証券を含みます。</p> <p>②当ファンドは、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインα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・ファンズです。通常の状態、ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインα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。</p> <p>③ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> | |
| マザーファンドの運用方法 | <p>①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。</p> <p>②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A－2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。</p> | |
| 分配方針 | <p>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。</p> | |



代表的な資産クラスとの騰落率の比較



| | 当ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|-----|-------|-------|-------|-------|------|------|------|
| 最大値 | 40.6 | 42.1 | 59.8 | 62.7 | 5.4 | 7.9 | 21.5 |
| 平均値 | 4.7 | 7.2 | 15.2 | 6.3 | △0.6 | 3.1 | 3.9 |
| 最小値 | △27.9 | △16.0 | △12.4 | △19.4 | △5.5 | △6.1 | △8.8 |

上記の図表は、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※上記の騰落率は直近月末から60カ月さかのぼった算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

※資産クラスについて

日本株……………配当込みTOPIX

先進国株……………MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株……………MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債……………NOMURA-BPI国債

先進国債……………FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債……………JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任を負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。（<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>）●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

（注）海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



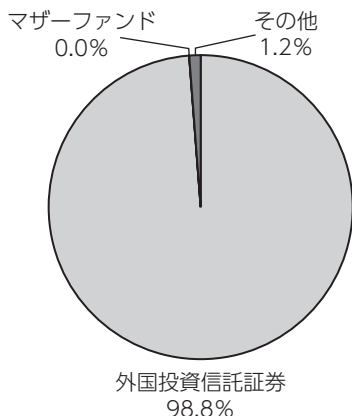
ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

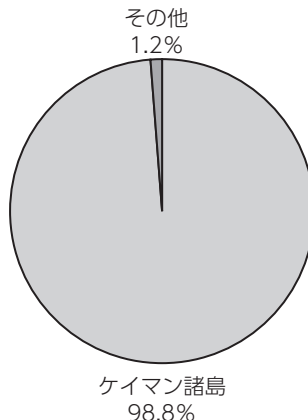
組入ファンド等

| | 比率 |
|--------------------------------------|-------|
| ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス） | 98.8% |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 0.0 |
| その他 | 1.2 |

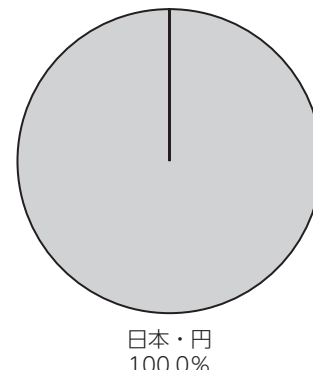
資産別配分



国別配分



通貨別配分



(注1) 上記データは2023年11月17日現在のものです。

(注2) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 国別配分において、キャッシュ部分については「その他」に含めています。

※当ファンドは、上記組入ファンドを通じて実質的な運用を行っています。次ページの「組入上位ファンドの概要」には、組入上位3ファンドまでのファンドの内容を掲載しています。

純資産等

| 項 目 | 第107期末 | 第108期末 | 第109期末 | 第110期末 | 第111期末 | 第112期末 |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2023年6月19日 | 2023年7月18日 | 2023年8月17日 | 2023年9月19日 | 2023年10月17日 | 2023年11月17日 |
| 純資産総額 | 601,098,018円 | 580,017,707円 | 582,037,811円 | 589,813,936円 | 583,772,558円 | 566,823,847円 |
| 受益権総口数 | 2,551,467,087口 | 2,543,325,515口 | 2,555,399,267口 | 2,550,840,156口 | 2,548,494,032口 | 2,502,594,452口 |
| 1万口当り基準価額 | 2,356円 | 2,281円 | 2,278円 | 2,312円 | 2,291円 | 2,265円 |

* 当作成期間（第107期～第112期）中における追加設定元本額は67,828,345円、同解約元本額は201,042,321円です。

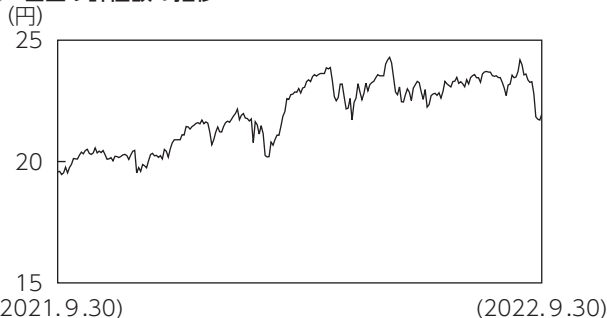
* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。

組入上位ファンドの概要

◆ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド（ツインαクラス）（作成対象期間 2021年10月1日～2022年9月30日）

※直近で入手可能なFinancial Statements作成期間です。

■ 1口当り評価額の推移



(注1) 1口当り評価額は、分配金を再投資したものとみなして計算しています。

(注2) 国内の営業日の評価額を記載しています。

■ 1口当り費用の明細

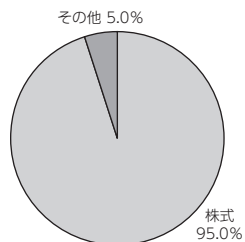
当ファンドの単位口数当りの費用のデータは取得できないため、記載しておりません。

■ 組入上位銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|----------------------------------|----------|------|
| SHELL PLC GB LINE GBP | 英ポンド | 7.3% |
| ASTRAZENECA ORD GBP | 英ポンド | 7.1% |
| UNILEVER PLC UK LINE | 英ポンド | 5.7% |
| BP PLC UK LINE | 英ポンド | 5.5% |
| HSBC HOLDINGS PLC GBP | 英ポンド | 5.3% |
| DIAGEO PLC UK LINE | 英ポンド | 4.9% |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO UK LINE | 英ポンド | 4.6% |
| RIO TINTO PLC UK LINE | 英ポンド | 3.6% |
| GLENCORE PLC GBP | 英ポンド | 3.3% |
| GSK PLC ORD GBP | 英ポンド | 3.1% |
| 組入銘柄数 | 51銘柄（株式） | |

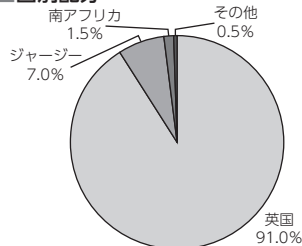
(注) 比率は純資産に対する比率です。

■ 資産別配分



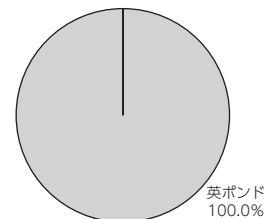
(注) 比率は純資産に対する比率です。

■ 国別配分



(注) 比率は株式ポートフォリオ全体に対する比率です。

■ 通貨別配分



(注) 比率は株式ポートフォリオ全体に対する比率です。

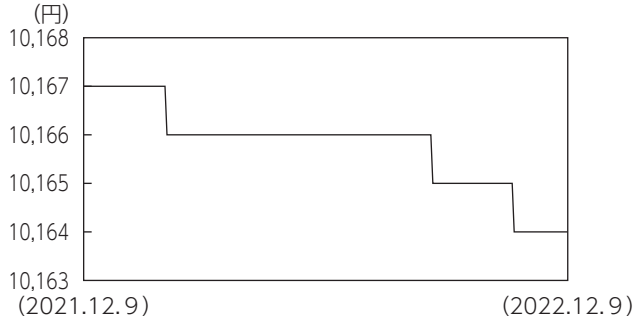
* 組入上位銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは、作成対象期間末時点のデータです。

* 組入上位銘柄、資産別配分、国別配分、通貨別配分のデータは、「ダイワ・UK・ハイ・ディビデンド・エクイティ・ファンド」の運用会社等からの情報提供をもとに作成したものであり、運用報告書（全体版）の情報とは異なる場合があります。

* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。

◆ダイワ・マネー・マザーファンド (作成対象期間 2021年12月10日～2022年12月9日)

■基準価額の推移



■1万口当りの費用の明細

| 項 | 目 | |
|---------|---|----|
| 売買委託手数料 | | -円 |
| 有価証券取引税 | | - |
| その他費用 | | - |
| 合 | 計 | - |

■組入資産

2022年12月9日現在、有価証券等の組み入れはありません。

(注1) 基準価額の推移、1万口当りの費用の明細は組入ファンドの直近の作成対象期間のものです。

(注2) 1万口当りの費用の明細における費用(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、簡便法により算出した結果です。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。また、円未満を四捨五入してあります。

*組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)をご覧ください。

Memo

Memo

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management