【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2021年9月1日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型） ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　豪ドル・コース（毎月分配型） ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　ブラジル・レアル・コース（毎月分配型） ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　米ドル・コース（毎月分配型） ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　通貨セレクト・コース（毎月分配型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で50兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

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

（注1）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指していうものとします。
（注2）上記を、それぞれ「日本円・コース」、「豪ドル・コース」、「ブラジル・レアル・コース」、「米ドル・コース」、「通貨セレクト・コース」という場合があります。
（注3）上記の総称を「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－」とします。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で50兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社
電話番号（コールセンター）　0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(5)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。
具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。
申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。
「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

＜スイッチング（乗換え）について＞

・「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－」を構成する各ファンドの受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって、他の構成ファンドの受益権の取得申込みを行なうことをいいます。
・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。
・スイッチング（乗換え）にかかる申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。

（「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－」の構成）

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2021年9月2日から2022年3月1日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。
大和アセットマネジメント株式会社
電話番号（コールセンター）　0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10)【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざします。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式	年1回	グローバル（　）	
一般	年2回	日本	
大型株	年4回	北米	ファミリーファンド
中小型株	年6回（隔月）	欧州	
債券	年12回（毎月）	アジア	
一般	日々	オセアニア	
公債	その他（　）	中南米	ファンド・オブ・ファンズ
社債		アフリカ	
その他債券		中近東（中東）	
クレジット属性（　）		エマージング	
不動産投信			
その他資産（投資信託証券（その他資産））			
資産複合（　）			
資産配分固定型			
資産配分変更型			

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

（注1）商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＭＦ
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信		目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産		目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合		目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分固定型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分変更型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回		目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）		目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの

投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	ＴＯＰＩＸ	目論見書等において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレスhttp://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1. 割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

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

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

◆選定時における各銘柄の構成比率は概ね均等とします。
また、銘柄の見直しは約1カ月ごとに行ないます。

◆個別銘柄ごとにコール・オプションを売却することでカバードコール戦略を構築します。
コール・オプションの満期日は、原則として売却から約1カ月後とします。

2. 為替取引を活用します。

◆当ファンドには次の5つのコースがあり、「日本円・コース」を除き、日本円売り／対象通貨買いの為替取引を行ないます。

（注）5つのコースの間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。

3. 毎月8日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

1 割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築します。

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

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

◆選定時における各銘柄の構成比率は概ね均等とします。また、銘柄の見直しは約1カ月ごとに行ないます。

銘柄選定のイメージ

※「TOPIX100」は、東証市場第一部銘柄のうち、時価総額、流動性の高い100銘柄から構成される時価総額方式の株価指数で、東京証券取引所によって算出、公表されているものです。
※金融セクターには、不動産などが含まれます。

「クロッキーモデル」とは

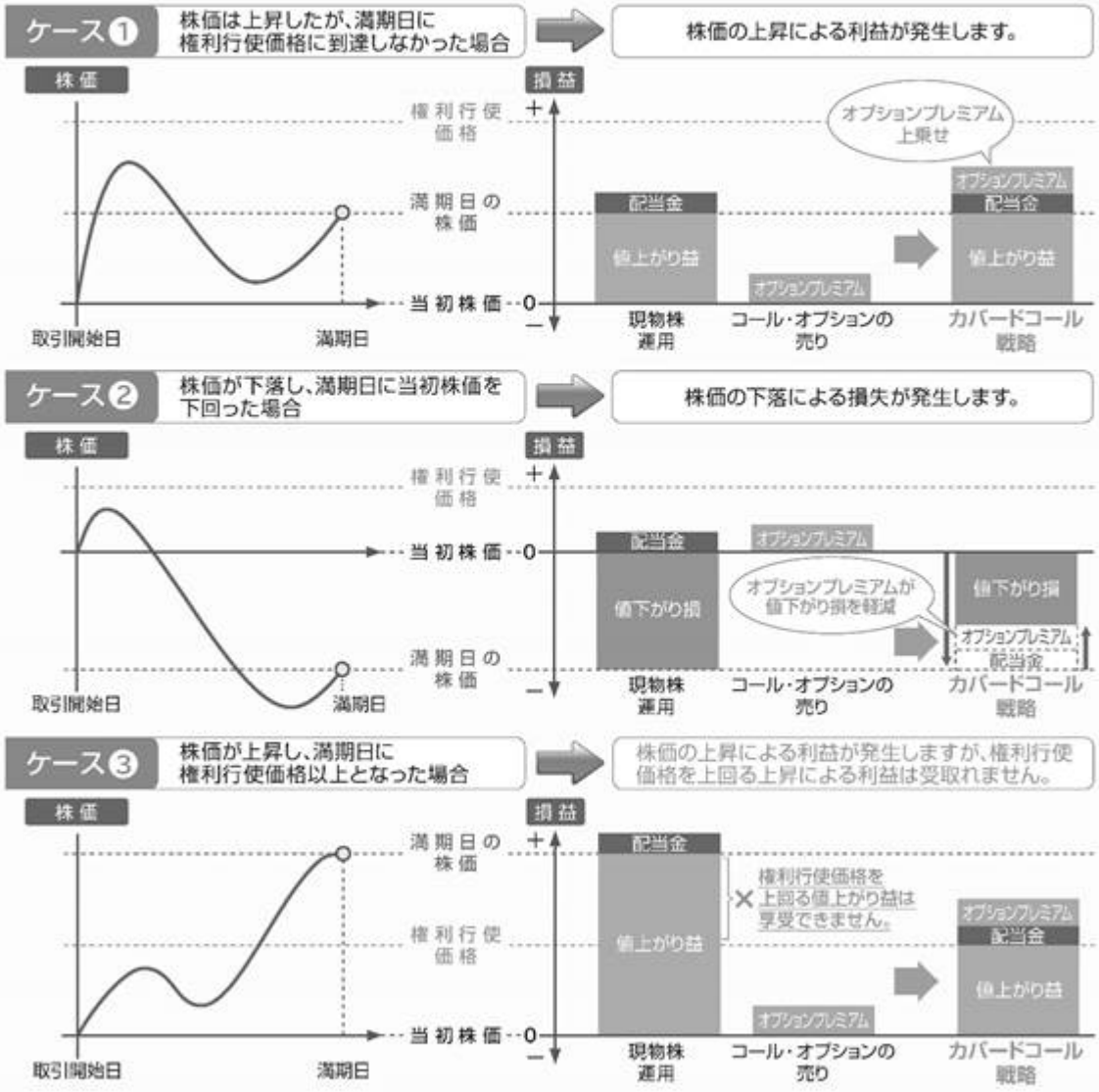
- クロッキーモデルは、ドイツ銀行グループが1995年から1996年にかけて開発した株式分析手法で、世界の機関投資家に利用されています。
- クロッキーモデルは、開発以来一貫した手法で国・業種を超えて株式投資をするために、統一した投資尺度を提供しています。
- 世界の大型株を対象として、企業が開示している会計データを徹底的に分析することで企業の本質的価値を算出しています。

※ドイツ銀行グループは、1870年にベルリンで創業されたドイツ銀行を中心とする世界最大級の総合金融グループです。世界各国で事業を展開し、幅広い金融サービスを提供しています。

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

カバードコール戦略とは

- 株式を保有しつつ、株式のコール・オプション（買う権利）を売却する戦略です。
- 株価の上昇／下落にかかわらず、オプションプレミアムを獲得することができます。
- 一方で、株価の上昇による利益は一定の水準までに限定されます。
  - ・「オプションプレミアム」とは、オプションの買い手が売り手に支払う対価をいいます。
  - ・「権利行使価格」とは、オプションの権利行使の基準となる株価をいいます。



※上記は配当金の支払いがあった場合の損益イメージを表したものです。
※当ファンドにおいて、カバードコール戦略の損益は毎営業日時価評価され、基準価額に反映されます。
※当ファンドにおけるカバードコール戦略の損益は、対象となる株式の銘柄ごとに異なります。
※上記は当ファンドの損益を示したものではありません。
※上記はイメージであり、実際の株価、配当金、オプションプレミアムとは異なります。
※上記は投資成果を示唆または保証するものではありません。

当ファンドにおけるカバードコール戦略について

- コール・オプションの満期日は、原則として売却から約1カ月後とします。
- 原則として、コール・オプションが満期を迎えるごとに、銘柄を見直すとともに新たにコール・オプションを売却することで、カバードコール戦略を再構築します。
- 権利行使が満期日のみに限定されているオプションを利用します。

2 為替取引を活用します。

◆当ファンドには次の5つのコースがあり、「日本円・コース」を除き、日本円売り／対象通貨買いの為替取引を行ないます。

コース名	為替取引の内容	取引対象通貨
日本円・コース	――	――
豪ドル・コース	日本円売り／豪ドル買い	豪ドル
ブラジル・レアル・コース	日本円売り／ブラジル・レアル買い	ブラジル・レアル
米ドル・コース	日本円売り／米ドル買い	米ドル
通貨セレクト・コース	日本円売り／選定通貨買い	選定通貨

※5つのコースの間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。

◆「日本円・コース」以外の各コースでは、為替取引を行なうことにより、「為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）／コスト（金利差相当分の費用）」が生じます。

◆「日本円・コース」以外の各コースでは、為替取引の対象通貨の対円レートの上昇（円安）／下落（円高）により、為替差益／為替差損が生じます。

◆「通貨セレクト・コース」において、選定通貨とは、以下の<通貨の運用方針>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。

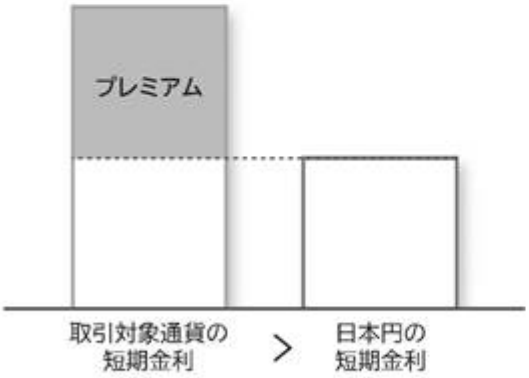
<通貨の運用方針>

- 原則として、「FTSE世界国債インデックス」および「JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ ブロード」の構成国の通貨の中から、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、6つの通貨を選定します。
  ※上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合もあります。
- 選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。
- 選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。

為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）／コスト（金利差相当分の費用）について

- 為替取引の対象通貨の短期金利が、日本円の短期金利よりも高い場合、「プレミアム（金利差相当分の収益）」が期待できます。
- 為替取引の対象通貨の短期金利が、日本円の短期金利よりも低い場合、「コスト（金利差相当分の費用）」が生じます。

●プレミアムが期待できるケース



●コストが生じるケース

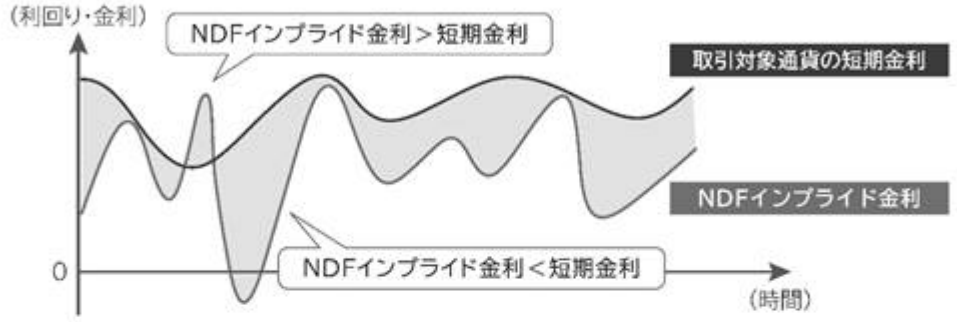
※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。
※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。
※実際の為替取引によるプレミアム／コストの水準は、需給要因等によって金利差相当分とは異なる水準となり、プレミアムの縮小、コストの拡大が生じることがあります。
※取引対象通貨が新興国通貨の場合、為替取引を行なう際にNDF（ノン・デリバラブル・フォワード）取引を利用することがあります。NDF取引を用いて為替取引を行なう際、プレミアム／コストは、需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

NDF取引とは

◆取引対象通貨を用いた受け渡しは行なわず、米ドル等の主要通貨による差金決済を相対で行なう取引です。

◆NDF取引価格から算出される“NDFインプライド金利”は、市場の流動性が低く、割高や割安を是正する動き（裁定）が働きにくいことから市場参加者の期待や需給などの要因により、取引対象通貨の短期金利の水準から大きく乖離する場合があります。

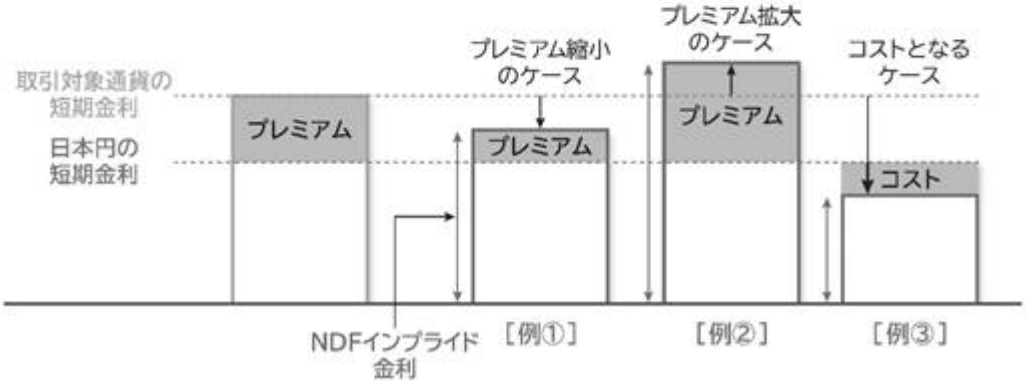
NDFインプライド金利と取引対象通貨の短期金利が乖離するイメージ



※上記はイメージであり、当ファンドのパフォーマンスとは異なります。

NDFインプライド金利の変動の影響

◆市場参加者の通貨上昇（下落）期待や需給などにより、NDFインプライド金利は低く（高く）なる可能性があります。NDFインプライド金利が取引対象通貨の短期金利より低く（高く）なると、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）が縮小［例①］（拡大［例②］）し、場合によっては為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）となるケース［例③］もあります。

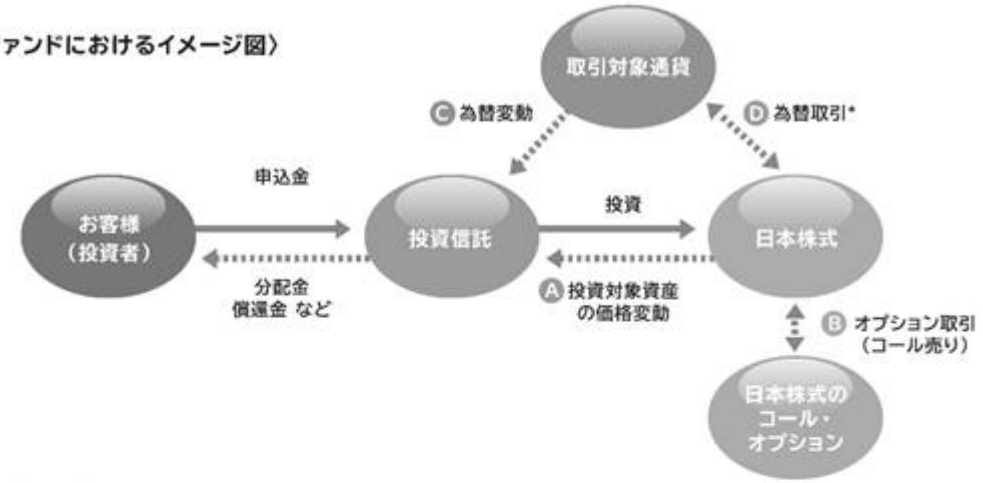


※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。
※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。

通貨選択型ファンドの収益のイメージ

- 通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。
- 当ファンドでは、日本の株式に投資するとともに、個別株オプション取引および為替取引を活用します。

〈当ファンドにおけるイメージ図〉



＊取引対象通貨が円以外の場合には、当該取引対象通貨の対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

- 当ファンドの収益源としては、以下の要素が挙げられます。

これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

収益の源泉	=	Ⓐ 日本株式の配当、値上がり／値下がり	+	Ⓑ 日本株式のコール・オプション（売り）のプレミアム／権利行使価格を上回る部分の損失	+	Ⓒ 為替差益／差損	+	Ⓓ（注）為替取引によるプレミアム／コスト（金利差相当分の収益／費用）
収益を得られるケース		権利行使価格を上回る株価の上昇 株価の上昇、配当収入		コール・オプション（売り）のプレミアムの受け取り		・円に対して取引対象通貨高 為替差益の発生		取引対象通貨の短期金利 ＞ 日本円の短期金利 プレミアム（金利差相当分の収益）の発生
損失やコストが発生するケース		株価の下落 ・発行企業の経営不安、倒産等		権利行使価格を上回る部分の損失の発生 ・権利行使価格を上回る株価の上昇		為替差損の発生 ・円に対して取引対象通貨安 ＊「日本円・コース」を除きます。		コスト（金利差相当分の費用）の発生 取引対象通貨の短期金利 ＜ 日本円の短期金利 ＊「日本円・コース」を除きます。

相殺

（注）為替取引を行なう際にNDF取引を利用することがあります。
NDF取引を用いて為替取引を行なう際、為替取引によるプレミアム／コスト（金利差相当分の収益／費用）は、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

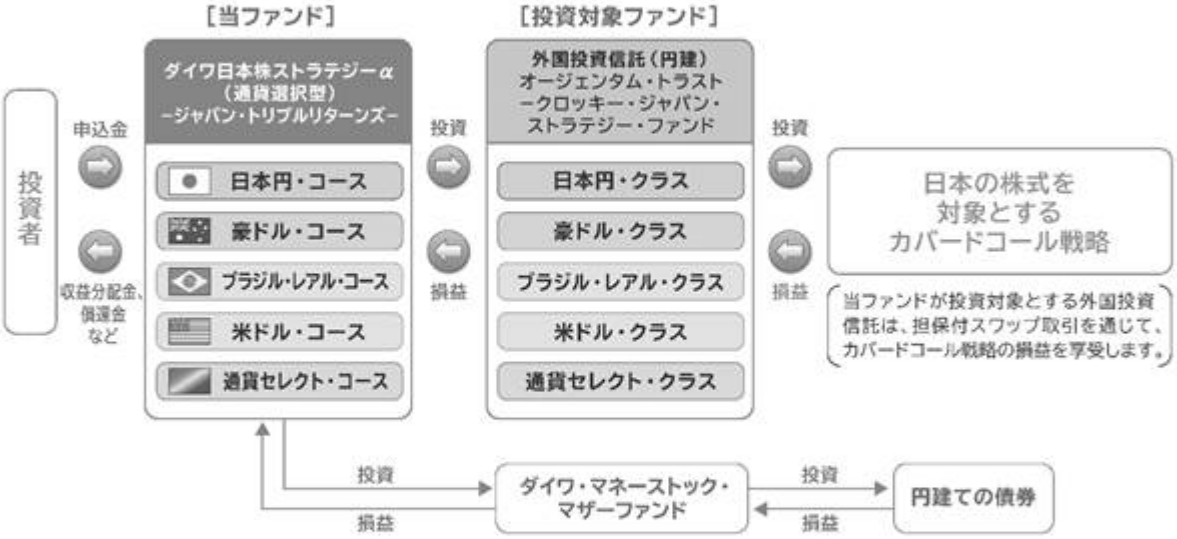
※上記はイメージであり、実際の投資成果を示唆、保証するものではありません。

ファンドの仕組み

◆当ファンドは、複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。

◆外国投資信託の受益証券を通じて、日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、「日本円・コース」を除き、為替取引を行ないます。

◆当ファンドが投資対象とする外国投資信託では、直接株式への投資やオプション取引を行なわず、担保付スワップ取引を通じて、日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の損益を享受します。



※5つのコースの間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。
※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

●当ファンドは、通常の状態で、投資対象とする外国投資信託への投資割合を高位に維持することを基本とします。

●大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1．および2．の運用が行なわれないことがあります。

3 毎月8日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

【分配方針】
❶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。）等とします。
❷原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ

※上記はイメージ図であり、**将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。**

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。**分配金が支払われない場合もあります。**

※ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

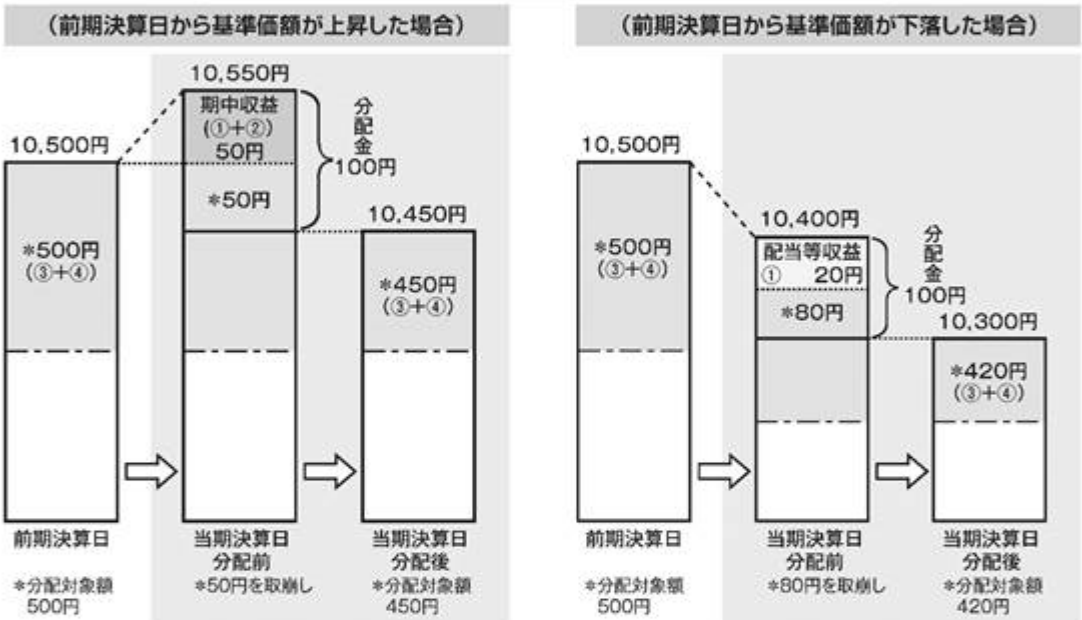
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

[収益分配金に関する留意事項]

●分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

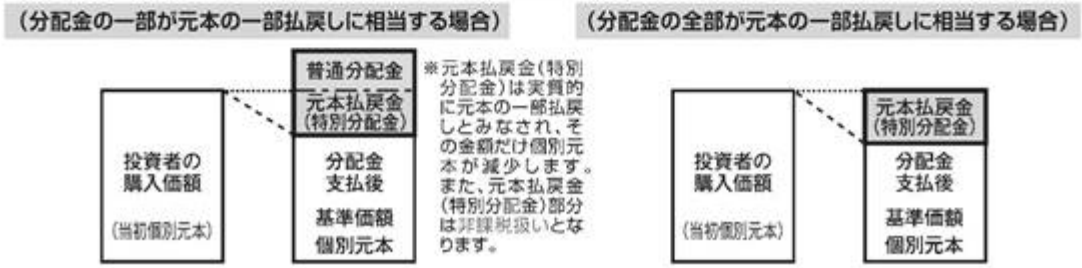
（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

●投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。



普通分配金 … 個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金） … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

＜投資対象ファンドの概要＞

①「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）」、「同（豪ドル・クラス）」、「同（ブラジル・レアル・クラス）」、「同（米ドル・クラス）」、「同（通貨セレクト・クラス）」について

形態／表示通貨	**ケイマン籍の外国投資信託／円建**
運用の基本方針	**「日本円・クラス以外」** **主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。** **「日本円・クラス」** **主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざします。**
主要投資対象	**担保付スワップ取引**

運用方針	1．主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略の投資成果を享受します。 ・担保付スワップ取引の相手方は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・ピーエルシーです。 2．カバードコール戦略の構築にあたっては、以下の点に留意します。 ・投資対象銘柄はTOPIX100構成銘柄から世界産業分類基準（GICS）の金融セクターに属する銘柄を除いた銘柄とします。 ・ドイツ銀行グループが独自に開発した株式分析手法「クロッキーモデル」を用い、会計データを重点分析し、割安と判断される30銘柄を選定します。 ・選定時における各銘柄の構成比率は概ね均等とします。 ・個別銘柄ごとに、当該株式を原資産とするヨーロピアン・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。 ※銘柄の見直しは約1か月ごとに行ないます。 ※コール・オプションの満期日は、原則として売却から約1か月後とします。 ※原則として、コール・オプションが満期を迎えるごとに、銘柄を見直すとともに新たにコール・オプションを売却することでカバードコール戦略を再構築します。 3．各クラスで以下の為替取引を行ないます。（日本円・クラスは除きます。） 「豪ドル・クラス」日本円売り／豪ドル買い 「ブラジル・レアル・クラス」日本円売り／ブラジル・レアル買い 「米ドル・クラス」日本円売り／米ドル買い 「通貨セレクト・クラス」日本円売り／選定通貨買い <通貨セレクト・クラスについて> ・大和アセットマネジメント株式会社が通貨の選定および配分比率について助言を行ないます。 ※選定通貨とは、通貨運用助言会社の助言に基づき決定した複数の通貨をいいます。 <通貨セレクト・クラスにおける通貨の運用方針> ・ 原則として、FTSE世界国債インデックスおよびＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ ブロードの構成国の通貨の中から、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、6つの通貨を選定します。 ※上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合もあります。 ・ 選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。 ・ 選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。 4．大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
設定日	2013年6月19日
信託期間	無期限
決算日	2月末日
収益分配	原則として、毎月分配を行ないます。
管理報酬・担保付スワップにかかる費用等	「日本円・クラス、豪ドル・クラス、ブラジル・レアル・クラス、米ドル・クラス」 純資産総額に対して年率0.545%程度 「通貨セレクト・クラス」 純資産総額に対して年率0.695%程度 ただしその他、監査費用、弁護士費用、有価証券売買委託手数料等、ファンドの運営に必要な各種経費等がかかります。
申込手数料	かかりません。
管理会社	IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド

備考	当外国投資信託は、担保付スワップ取引の相手方にカバードコール戦略の構築に必要な現金を支払い、当該戦略の評価額に相当する株式、国債などを担保として受け入れます。担保付スワップ取引の相手方は、日々の担保付スワップ取引の評価を行なっており、担保も洗い替えされます。担保付スワップ取引の評価には、株式等へ投資する場合にかかるコストや税金等が反映されます。

※　上記は提出日現在の情報に基づくものであり、変更となる場合があります。

■IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド■

IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッドは、IQ EQグループに属しています。IQ EQグループは専業サービスプロバイダーであり、世界の主要金融センターの大手投資銀行から専業のオルタナティブ投資運用会社にわたる広範囲の企業や機関投資家に、ファンドの運営・管理事務やコーポレート・サービスを提供するといった業務に従事しています。

②「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」について

形態／表示通貨	国内籍の証券投資信託／円建
運用の基本方針	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
投資態度	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。 ③当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
設定日	2010年3月5日
信託期間	無期限
決算日	毎年12月9日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

(2)【ファンドの沿革】

2013年6月19日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2017年9月2日	信託期間終了日を2023年6月8日に変更（当初は2018年6月8日）

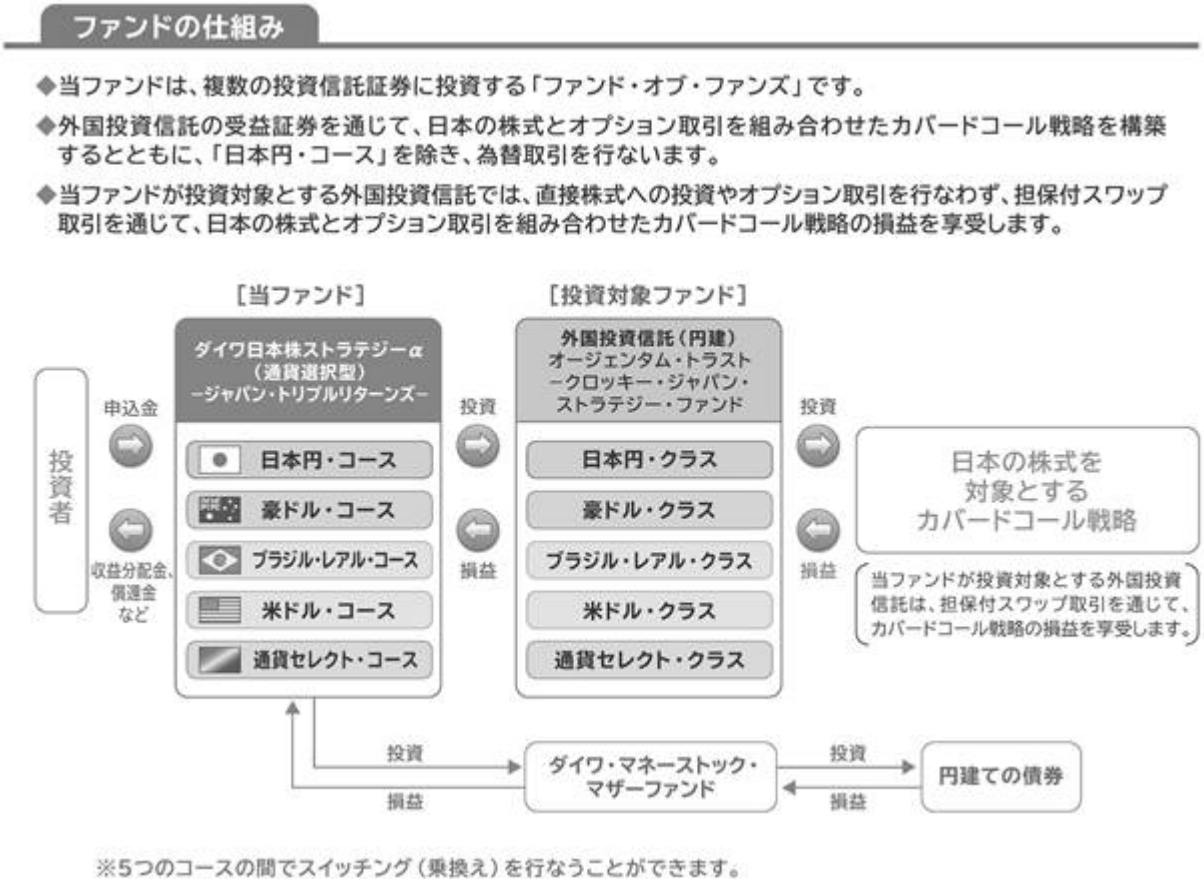
(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など
↓運用指図　↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	株式会社りそな銀行 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など
	損益↑↓投資	
投資対象	投資対象ファンドの受益証券　など	

(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。



＜委託会社の概況（2021年6月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 （金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率

		株	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

＜日本円・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）」（以下「クロッキーファンド（日本円・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）

2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

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

ロ．当ファンドは、クロッキーファンド（日本円・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、クロッキーファンド（日本円・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜豪ドル・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）」（以下「クロッキーファンド（豪ドル・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）

2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、クロッキーファンド（豪ドル・クラス）の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。

ロ．当ファンドは、クロッキーファンド（豪ドル・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、クロッキーファンド（豪ドル・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．クロッキーファンド（豪ドル・クラス）では、日本円売り／豪ドル買いの為替取引を行ないます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜ブラジル・レアル・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」（以下「クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。

ロ．当ファンドは、クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．クロッキーファンド（ブラジル・レアル・クラス）では、日本円売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行ないます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜米ドル・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）」（以下「クロッキーファンド（米ドル・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、クロッキーファンド（米ドル・クラス）の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。

ロ．当ファンドは、クロッキーファンド（米ドル・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、クロッキーファンド（米ドル・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．クロッキーファンド（米ドル・クラス）では、日本円売り／米ドル買いの為替取引を行ないます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜通貨セレクト・コース＞

①　主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」（以下「クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）

2. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券

②　投資態度

イ．主として、クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）の受益証券を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。

ロ．当ファンドは、クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）とダイワ・マネーストック・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）では、日本円売り／選定通貨買いの為替取引を行ないます。

※当ファンドにおいて、選定通貨とは、クロッキーファンド（通貨セレクト・クラス）の通貨運用助言会社の助言に基づき決定した複数の通貨をいいます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜投資先ファンドについて＞

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

1. 日本円・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）
選定の方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざすファンドである。

2. 豪ドル・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）

選定の方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／豪ドル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。

3. ブラジル・レアル・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）
選定の方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。

4. 米ドル・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）
選定の方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／米ドル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。

5. 通貨セレクト・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）
選定の方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／選定通貨買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。

くわしくは「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

(2)【投資対象】

＜日本円・コース＞

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3. から5.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

＜豪ドル・コース＞

① （日本円・コースと同規定）

② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3. から5.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③ （日本円・コースと同規定）

＜ブラジル・レアル・コース＞

①　（日本円・コースと同規定）

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3. から5.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③　（日本円・コースと同規定）

＜米ドル・コース＞

①　（日本円・コースと同規定）

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3. から5.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③　（日本円・コースと同規定）

＜通貨セレクト・コース＞

①　（日本円・コースと同規定）

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし株式会社りそな銀行を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいま

す。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3. から5.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

③　（日本円・コースと同規定）

＜投資先ファンドについて＞

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は次のとおりです。

1. 日本円・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）
運用の基本方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築し、信託財産の成長をめざすファンドである。
主要な投資対象	担保付スワップ取引
委託会社等の名称	管理会社：IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド

2. 豪ドル・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）
運用の基本方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／豪ドル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。
主要な投資対象	担保付スワップ取引
委託会社等の名称	管理会社：IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド

3. ブラジル・レアル・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）
運用の基本方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。
主要な投資対象	担保付スワップ取引
委託会社等の名称	管理会社：IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド

4. 米ドル・コース

投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）
運用の基本方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／米ドル買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。
主要な投資対象	担保付スワップ取引
委託会社等の名称	管理会社：IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド

5. 通貨セレクト・コース

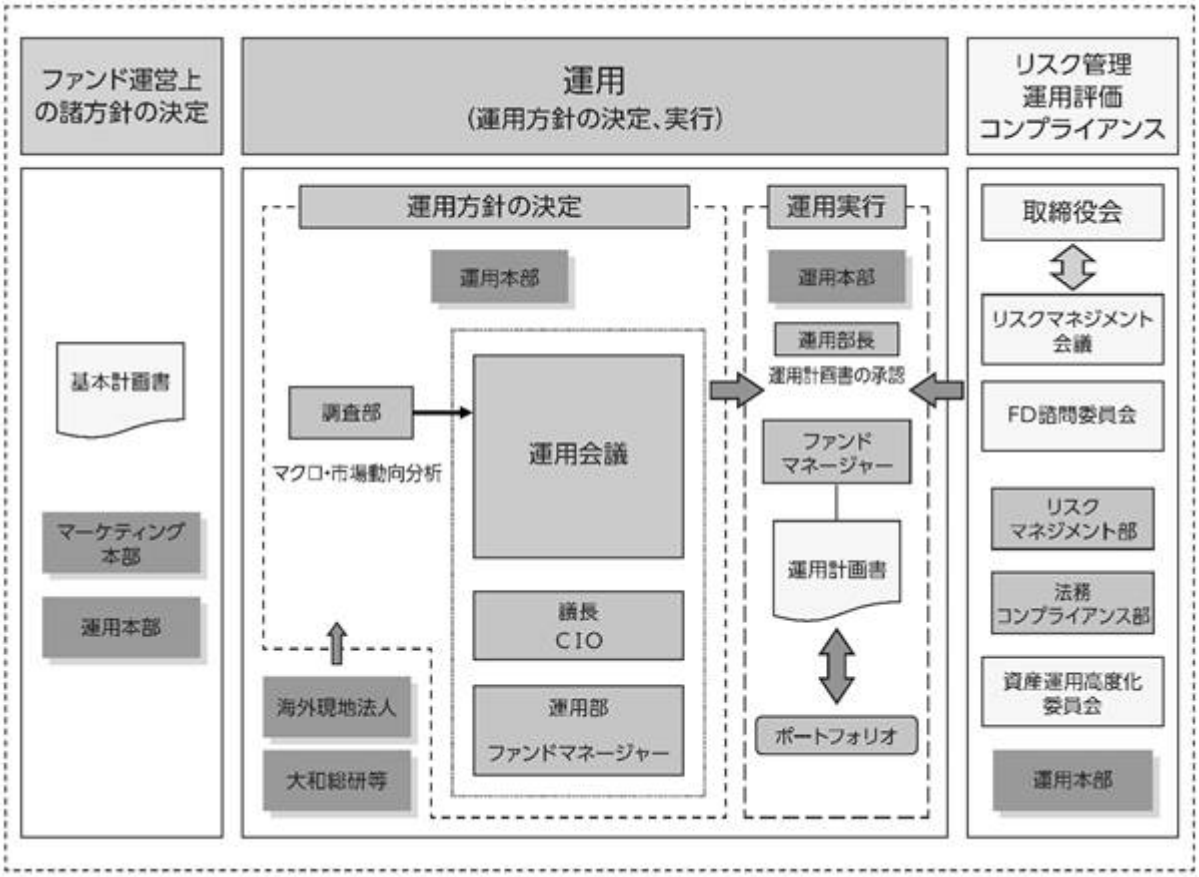
投資先ファンドの名称	オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）
運用の基本方針	主として、担保付スワップ取引を通じて、割安と判断される日本の株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築するとともに、日本円売り／選定通貨買いの為替取引を行ない、信託財産の成長をめざすファンドである。
主要な投資対象	担保付スワップ取引
委託会社等の名称	管理会社：IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド

くわしくは「1　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ハ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

③ 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO（Chief Investment Officer）（3名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は40～50名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤　受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

※　上記の運用体制は2021年6月30日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

＜各ファンド共通＞

①　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。）等とします。

②　原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

＜各ファンド共通＞

①　株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

②　投資信託証券（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

④　信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

⑤　資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10％を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞投資対象ファンドについて

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

「１　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

２．ダイワ・マネーストック・マザーファンド

※下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「１　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」をご参照下さい。

主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行ないません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

３【投資リスク】

(1)価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式とオプション取引を組み合わせたカバードコール戦略を構築しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

①　株式の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治･経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。選定銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドは、銘柄数を絞り込んだ運用を行なうため、市場動向にかかわらず基準価額の変動が大きくなる可能性があります。

②　カバードコール戦略の利用に伴うリスク

オプションプレミアムの水準は、オプション売却時の株価水準、権利行使価格、株価変動率（ボラティリティ）、満期日までの期間、金利水準、配当金額、需給等により決定されます。想定したオプションプレミアムが確保できない場合もあります。

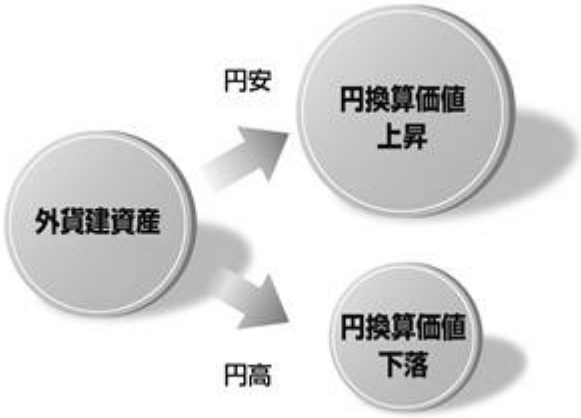
株価水準や株価変動率の変動等によりコール・オプションの評価値が変動し、損失を被る場合があります。

カバードコール戦略では、株価が上昇した場合の値上がり益が限定されるため、株式のみに投資した場合に対して投資成果が劣後する可能性があります。戦略再構築を重ねた場合、株価が下落しその後当初の水準程度まで回復しても、基準価額の回復は株価に比べて緩やかになる可能性があります。

当ファンドでは個別銘柄ごとにカバードコール戦略を構築するため、株価上昇時の値上がり益が個別銘柄ごとに限定される結果、投資成果が株式市場全体の動きに対して劣後する可能性があります。

③　為替変動リスク（日本円・コース以外）

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

取引対象通貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。新興国通貨の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国通貨と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

取引対象通貨の金利が日本円の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※各ファンドの投資対象である外国投資信託において、ＮＤＦ取引を用いて為替取引を行なう場合、コストは需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

④　スワップ取引の利用に伴うリスク

スワップ取引の相手方に債務不履行や倒産その他の事態が生じた場合、カバードコール戦略の投資成果を享受することができず、ファンドの運用の継続が困難となり、予想外の損失を被る可能性があります。また、スワップ取引の相手方から受入れた担保を想定した価格で処分できない場合があることから損失を被る可能性があります。

当ファンドが投資対象とする外国投資信託は、スワップ取引の相手方が取引する株式やオプションについて何ら権利を有しません。

⑤　その他

イ．解約資金を手当てするためカバードコール戦略を解消（株式の売却およびオプションの買戻し）する際、市場規模や市場動向によっては当初期待される価格で解消できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。

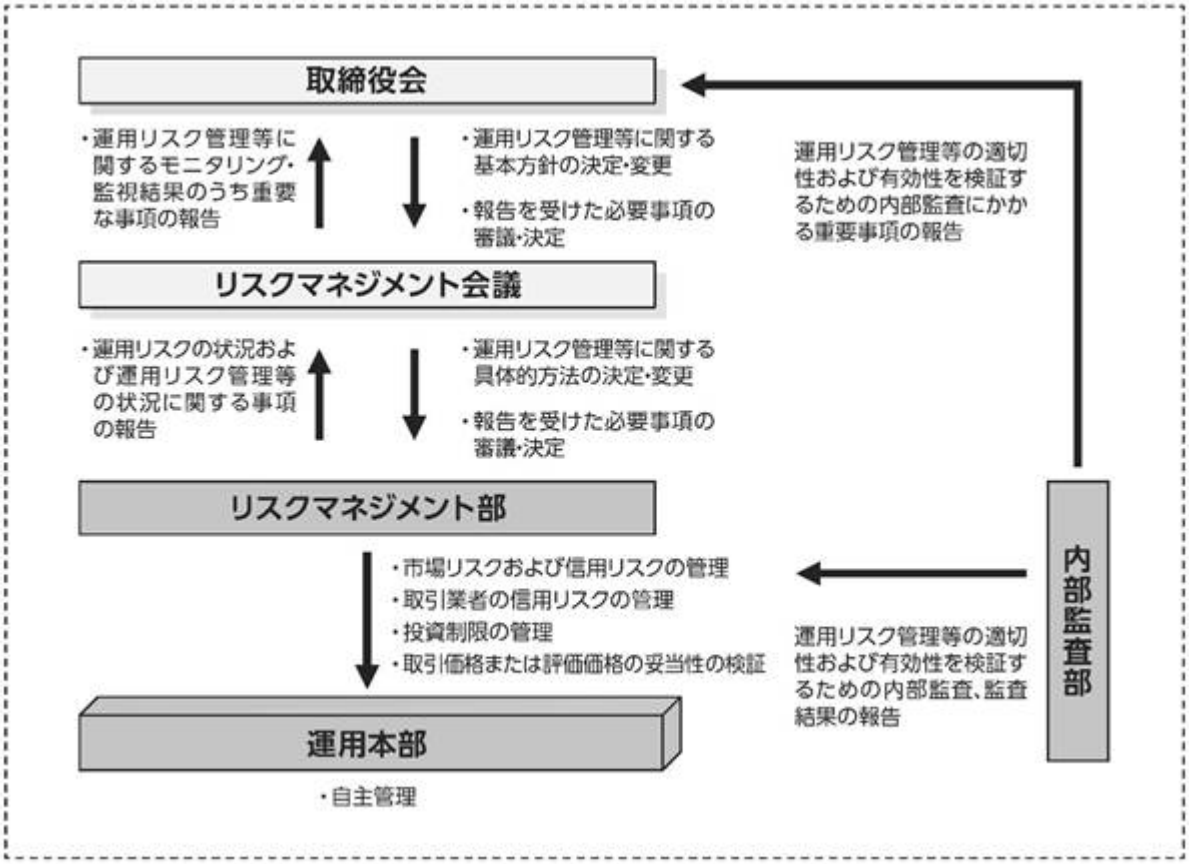
② ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」と

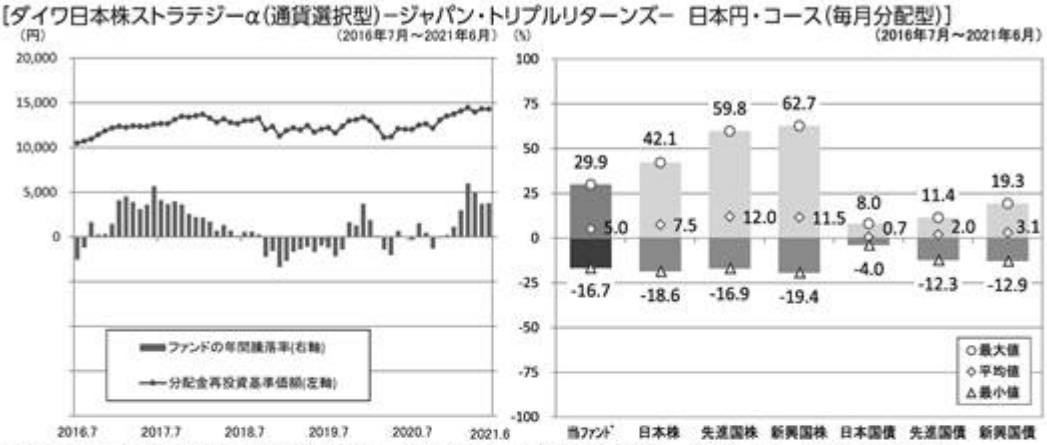
し、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

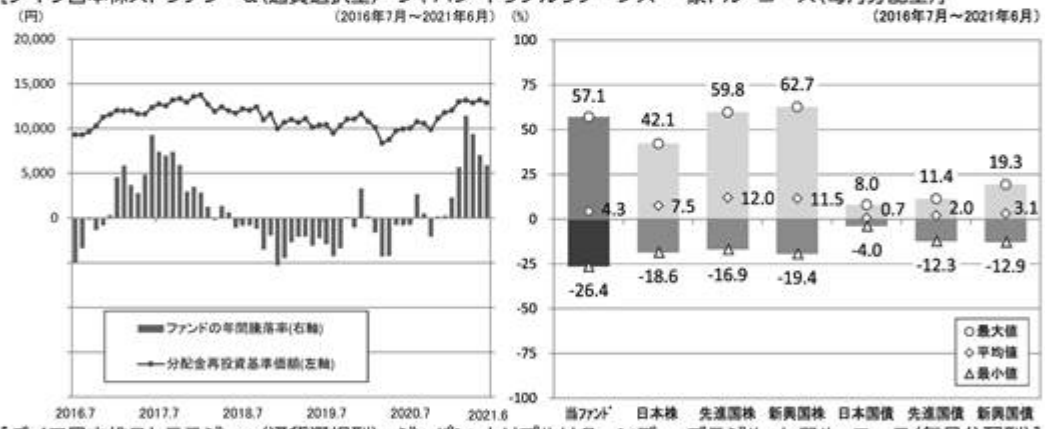
●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移　　他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

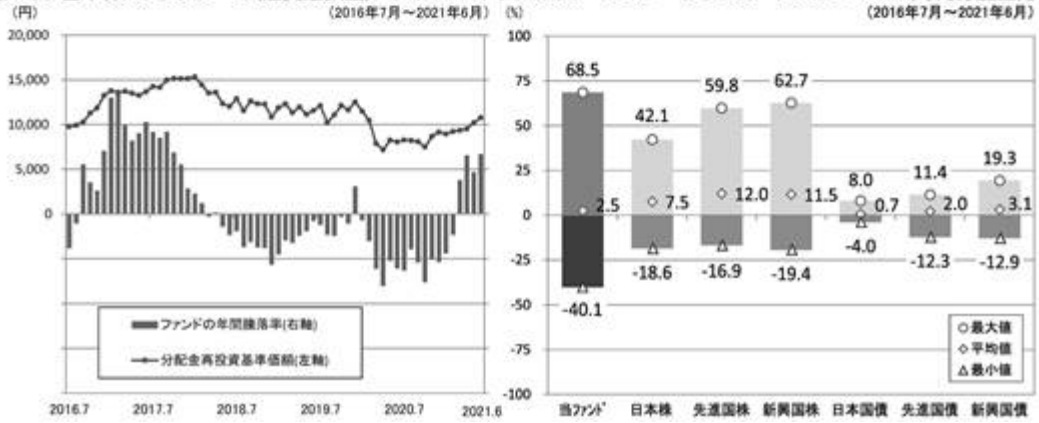
[ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース(毎月分配型)]

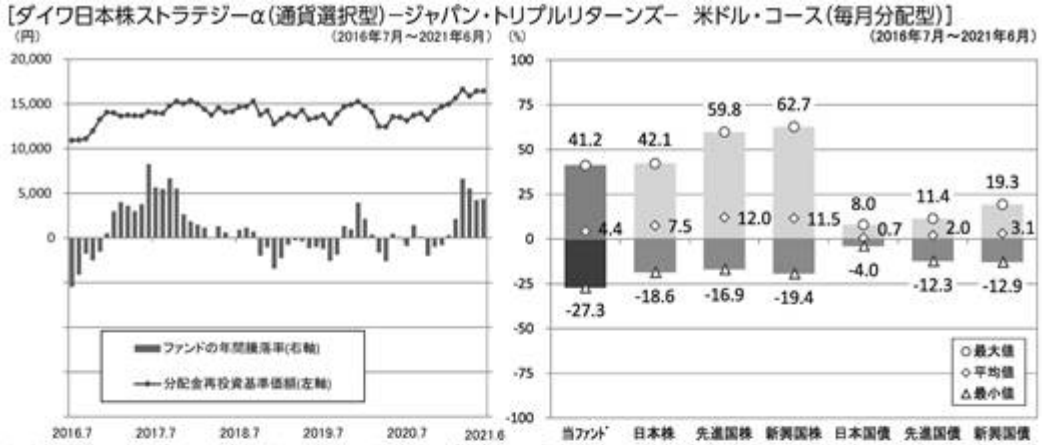


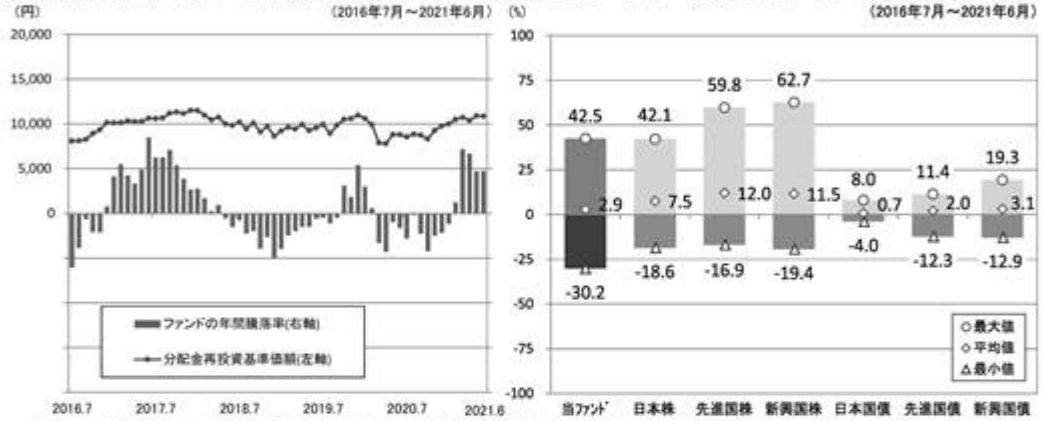
[ダイワ日本株ストラテジーα(通貨選択型)－ジャパン・トリプルリターンズ－　豪ドル・コース(毎月分配型)]



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







※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。

※資産クラスについて
日 本 株：東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
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・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド(円ベース)

※指数について
●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●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.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 Inc.に帰属します。またMSCI 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。●NOMURA-BPI国債は、野村證券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證券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・マーケッツ 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.

4 【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3%（税抜3.0%）となっています。
具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。
申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

＜スイッチング（乗換え）について＞

・「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－」を構成する各ファンドの受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって、他の構成ファンドの受益権の取得申込みを行なうことをいいます。

・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。

・スイッチング（乗換え）にかかる申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。

（「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－」の構成）

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(2)【換金（解約）手数料】

①　換金手数料

ありません。

②　信託財産留保額

信託終了前の解約の際に1万口当たり一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額の0.3%を信託財産留保額としてご負担いただきます。

(3)【信託報酬等】

①　信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.4905%（税抜1.355%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

②　信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③　信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、純資産総額に対し次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.48%（税抜）	年率0.85%（税抜）	年率0.025%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

④　前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

⑤　当ファンドの信託報酬等のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬等がかかります。当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬等（クロッキーの指数計算報酬を含みます。）を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、「通貨セレクト・コース」以外については年率2.0355%（税込）程度、「通貨セレクト・コース」については年率2.1855%（税込）程度です。

ただし、投資対象ファンドの信託報酬等に下限金額が設定されているため、純資産総額によって、実質的な信託報酬率が「通貨セレクト・コース」以外については年率2.0355%（税込）、「通貨セレクト・コース」については年率2.1855%（税込）を上回ることがあります。

（注）投資対象ファンドの信託報酬等については、「１　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞」の「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：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、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

①　信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

②　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③　信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④　信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（※）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜投資対象ファンドより支弁する手数料等＞

各ファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

② 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収※され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該投資者の個別元本となります。

④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（※）上記は、2021年6月30日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

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

(1) 【投資状況】（2021年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		1,399,246,228	99.04
	内 ケイマン諸島	1,399,246,228	99.04
親投資信託受益証券		399,122	0.03
	内 日本	399,122	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		13,152,943	0.93
純資産総額		1,412,798,293	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2021年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	CROCI JAPAN STRATEGY FUND JPY CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	20,555,385.88	68.93 1,416,987,959	68.07 1,399,246,228	99.04
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	398,764	1.0009 399,122	1.0009 399,122	0.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.04%
親投資信託受益証券	0.03%
合計	99.07%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2013年12月9日)	14,665,774,676	14,751,359,375	1.0282	1.0342
第2特定期間末 (2014年6月9日)	15,221,709,240	15,313,713,802	0.9927	0.9987
第3特定期間末 (2014年12月8日)	13,202,701,707	13,278,969,796	1.0387	1.0447
第4特定期間末 (2015年6月8日)	12,327,200,489	12,394,968,884	1.0914	1.0974
第5特定期間末 (2015年12月8日)	10,351,655,323	10,414,834,838	0.9831	0.9891
第6特定期間末 (2016年6月8日)	7,341,193,880	7,393,609,700	0.8403	0.8463
第7特定期間末 (2016年12月8日)	6,416,258,742	6,458,226,986	0.9173	0.9233
第8特定期間末 (2017年6月8日)	5,184,593,988	5,218,184,318	0.9261	0.9321
第9特定期間末 (2017年12月8日)	4,298,213,155	4,325,236,652	0.9543	0.9603
第10特定期間末 (2018年6月8日)	3,730,885,758	3,755,605,919	0.9055	0.9115
第11特定期間末 (2018年12月10日)	3,185,090,789	3,209,109,019	0.7957	0.8017

第12特定期間末 (2019年6月10日)	2,621,766,378	2,643,045,234	0.7393	0.7453
第13特定期間末 (2019年12月9日)	2,553,549,101	2,572,947,483	0.7898	0.7958
第14特定期間末 (2020年6月8日)	2,007,037,880	2,024,183,509	0.7023	0.7083
2020年6月末日	1,881,950,644	－	0.6861	－
7月末日	1,834,471,482	－	0.6799	－
8月末日	1,856,471,383	－	0.7008	－
9月末日	1,837,140,124	－	0.7030	－
10月末日	1,723,979,013	－	0.6695	－
11月末日	1,741,304,000	－	0.7139	－
第15特定期間末 (2020年12月8日)	1,723,111,856	1,737,735,857	0.7070	0.7130
12月末日	1,806,338,222	－	0.7323	－
2021年1月末日	1,537,253,064	－	0.7374	－
2月末日	1,491,475,663	－	0.7502	－
3月末日	1,512,767,917	－	0.7634	－
4月末日	1,422,374,707	－	0.7327	－
5月末日	1,429,331,196	－	0.7451	－
第16特定期間末 (2021年6月8日)	1,421,807,399	1,433,318,366	0.7411	0.7471
6月末日	1,412,798,293	－	0.7371	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0300
第2特定期間	0.0360
第3特定期間	0.0360
第4特定期間	0.0360
第5特定期間	0.0360
第6特定期間	0.0360
第7特定期間	0.0360
第8特定期間	0.0360
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0360
第11特定期間	0.0360
第12特定期間	0.0360
第13特定期間	0.0360

第14特定期間	0.0360
第15特定期間	0.0360
第16特定期間	0.0360

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	5.8
第2特定期間	0.0
第3特定期間	8.3
第4特定期間	8.5
第5特定期間	△6.6
第6特定期間	△10.9
第7特定期間	13.4
第8特定期間	4.9
第9特定期間	6.9
第10特定期間	△1.3
第11特定期間	△8.2
第12特定期間	△2.6
第13特定期間	11.7
第14特定期間	△6.5
第15特定期間	5.8
第16特定期間	9.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	5,824,089,179	1,506,696,200
第2特定期間	2,285,214,962	1,215,237,854
第3特定期間	771,194,252	3,393,939,730
第4特定期間	889,616,675	2,306,232,284
第5特定期間	1,535,220,980	2,300,034,383
第6特定期間	760,195,291	2,554,144,461
第7特定期間	176,753,243	1,918,015,925
第8特定期間	89,970,440	1,486,289,512
第9特定期間	86,043,306	1,180,515,431
第10特定期間	62,069,227	445,958,597
第11特定期間	225,822,182	342,810,586
第12特定期間	78,352,983	534,915,353
第13特定期間	47,900,278	361,312,634

第14特定期間	29,306,964	404,765,800
第15特定期間	24,618,766	444,890,116
第16特定期間	64,517,005	583,355,940

（注）　当初設定数量は9,946,723,661口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

(1) 投資状況（2021年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	97,172,577,332	100.00
純資産総額	97,172,577,332	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（2021年6月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

該当事項はありません。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

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

2021年6月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	7,371円
純資産総額	14億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.3%
3カ月間	-1.1%
6カ月間	5.7%
1年間	18.8%
3年間	12.8%
5年間	45.6%
設定来	42.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」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ています。
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　720円　　設定来分配金合計額：　5,700円

決算期	第 84 期 20年7月	第 85 期 20年8月	第 86 期 20年9月	第 87 期 20年10月	第 88 期 20年11月	第 89 期 20年12月	第 90 期 21年1月	第 91 期 21年2月	第 92 期 21年3月	第 93 期 21年4月	第 94 期 21年5月	第 95 期 21年6月
分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

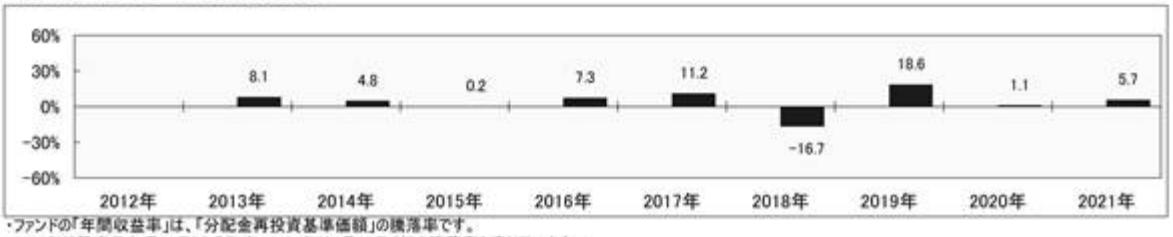
※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド

運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）	99.0%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.0%
合計		99.1%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2013年は設定日（6月19日）から年末、2021年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】（2021年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		327,064,604	98.52
	内 ケイマン諸島	327,064,604	98.52
親投資信託受益証券		99,780	0.03
	内 日本	99,780	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,825,676	1.45
純資産総額		331,990,060	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2021年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	CROCI JAPAN STRATEGY FUND AUD CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	6,084,470.06	55.53 337,914,004	53.75 327,064,604	98.52
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	99,691	1.0009 99,780	1.0009 99,780	0.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.52%
親投資信託受益証券	0.03%
合計	98.55%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2013年12月9日)	4,358,516,570	4,391,335,284	1.0624	1.0704
第2特定期間末 (2014年6月9日)	5,027,028,513	5,065,470,202	1.0462	1.0542
第3特定期間末 (2014年12月8日)	5,035,410,629	5,070,290,842	1.1549	1.1629
第4特定期間末 (2015年6月8日)	4,174,340,713	4,203,392,881	1.1495	1.1575
第5特定期間末 (2015年12月8日)	3,101,616,078	3,127,627,169	0.9539	0.9619
第6特定期間末 (2016年6月8日)	2,130,755,511	2,154,945,095	0.7047	0.7127
第7特定期間末 (2016年12月8日)	1,980,539,874	2,000,514,797	0.7932	0.8012
第8特定期間末 (2017年6月8日)	1,442,034,363	1,457,046,008	0.7685	0.7765
第9特定期間末 (2017年12月8日)	1,186,107,576	1,198,006,459	0.7975	0.8055
第10特定期間末 (2018年6月8日)	966,212,037	976,769,799	0.7321	0.7401
第11特定期間末 (2018年12月10日)	720,354,924	729,891,771	0.6043	0.6123
第12特定期間末 (2019年6月10日)	473,850,520	478,464,001	0.5135	0.5185
第13特定期間末 (2019年12月9日)	401,409,240	405,194,370	0.5302	0.5352
第14特定期間末 (2020年6月8日)	338,927,958	342,529,771	0.4705	0.4755

2020年6月末日	320,116,759	－	0.4442	－
7月末日	318,435,635	－	0.4424	－
8月末日	334,822,613	－	0.4690	－
9月末日	325,919,959	－	0.4561	－
10月末日	298,633,145	－	0.4225	－
11月末日	328,348,576	－	0.4703	－
第15特定期間末 (2020年12月8日)	326,136,144	329,626,869	0.4671	0.4721
12月末日	344,340,808	－	0.4920	－
2021年1月末日	347,886,338	－	0.4972	－
2月末日	356,059,000	－	0.5320	－
3月末日	350,371,534	－	0.5334	－
4月末日	337,202,647	－	0.5171	－
5月末日	341,482,216	－	0.5242	－
第16特定期間末 (2021年6月8日)	338,720,994	341,978,457	0.5199	0.5249
6月末日	331,990,060	－	0.5070	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0400
第2特定期間	0.0480
第3特定期間	0.0480
第4特定期間	0.0480
第5特定期間	0.0480
第6特定期間	0.0480
第7特定期間	0.0480
第8特定期間	0.0480
第9特定期間	0.0480
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0360
第13特定期間	0.0300
第14特定期間	0.0300
第15特定期間	0.0300
第16特定期間	0.0300

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1特定期間	10.2
第2特定期間	3.0
第3特定期間	15.0
第4特定期間	3.7
第5特定期間	△12.8
第6特定期間	△21.1
第7特定期間	19.4
第8特定期間	2.9
第9特定期間	10.0
第10特定期間	△2.2
第11特定期間	△10.9
第12特定期間	△9.1
第13特定期間	9.1
第14特定期間	△5.6
第15特定期間	5.7
第16特定期間	17.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	1,939,684,254	692,930,165
第2特定期間	1,314,777,518	611,905,580
第3特定期間	933,933,564	1,379,118,054
第4特定期間	374,536,235	1,103,041,881
第5特定期間	241,143,670	621,278,354
第6特定期間	201,454,561	429,142,911
第7特定期間	119,484,793	646,317,379
第8特定期間	145,211,252	765,620,963
第9特定期間	32,651,319	421,746,611
第10特定期間	50,627,292	218,267,446
第11特定期間	43,428,382	171,042,706
第12特定期間	37,366,597	306,776,251
第13特定期間	17,627,062	183,297,298
第14特定期間	15,823,597	52,486,888
第15特定期間	14,216,364	36,434,062
第16特定期間	9,797,712	56,450,085

（注） 当初設定数量は2,855,585,179口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

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

2021年6月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	5,070円
純資産総額	3.3億円

当初設定日（2013年6月19日）～2021年6月30日

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-2.4%
3カ月間	-2.2%
6カ月間	9.3%
1年間	29.3%
3年間	10.0%
5年間	52.3%
設定来	28.7%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」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ています。
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　600円　　設定来分配金合計額：　6,760円

決算期	第 84 期 20年7月	第 85 期 20年8月	第 86 期 20年9月	第 87 期 20年10月	第 88 期 20年11月	第 89 期 20年12月	第 90 期 21年1月	第 91 期 21年2月	第 92 期 21年3月	第 93 期 21年4月	第 94 期 21年5月	第 95 期 21年6月
分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

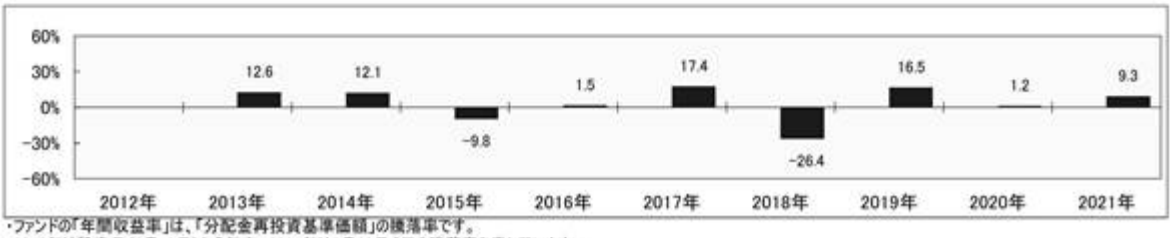
※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド

運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）	98.5%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.0%
合計		98.5%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2013年は設定日（6月19日）から年末、2021年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】（2021年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		1,362,366,476	99.10
	内 ケイマン諸島	1,362,366,476	99.10
親投資信託受益証券		399,122	0.03
	内 日本	399,122	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,911,513	0.87
純資産総額		1,374,677,111	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2021年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	CROCI JAPAN STRATEGY FUND BRL CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	53,332,020.98	25.11 1,339,232,741	25.54 1,362,366,476	99.10
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	398,764	1.0009 399,122	1.0009 399,122	0.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.10%
親投資信託受益証券	0.03%
合計	99.13%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2013年12月9日)	17,571,613,492	17,738,293,014	1.0542	1.0642
第2特定期間末 (2014年6月9日)	20,127,683,953	20,410,602,369	1.0671	1.0821
第3特定期間末 (2014年12月8日)	29,388,924,582	29,777,117,396	1.1356	1.1506
第4特定期間末 (2015年6月8日)	27,402,969,324	27,812,364,660	1.0040	1.0190
第5特定期間末 (2015年12月8日)	17,382,459,007	17,754,405,837	0.7010	0.7160
第6特定期間末 (2016年6月8日)	12,191,379,587	12,422,618,088	0.5272	0.5372
第7特定期間末 (2016年12月8日)	11,822,893,087	12,016,813,476	0.6097	0.6197
第8特定期間末 (2017年6月8日)	9,716,991,864	9,875,813,986	0.6118	0.6218
第9特定期間末 (2017年12月8日)	8,121,692,946	8,251,275,623	0.6268	0.6368
第10特定期間末 (2018年6月8日)	5,427,495,490	5,543,869,800	0.4664	0.4764
第11特定期間末 (2018年12月10日)	4,292,562,347	4,366,649,031	0.4056	0.4126
第12特定期間末 (2019年6月10日)	3,077,375,539	3,112,007,413	0.3554	0.3594
第13特定期間末 (2019年12月9日)	2,549,993,237	2,579,322,695	0.3478	0.3518
第14特定期間末 (2020年6月8日)	1,639,795,666	1,666,560,225	0.2451	0.2491

2020年6月末日	1,431,235,052	―	0.2148	―
7月末日	1,447,098,163	―	0.2168	―
8月末日	1,400,787,801	―	0.2124	―
9月末日	1,329,146,817	―	0.2068	―
10月末日	1,205,294,027	―	0.1897	―
11月末日	1,357,883,133	―	0.2168	―
第15特定期間末 (2020年12月8日)	1,400,258,639	1,415,882,457	0.2241	0.2266
12月末日	1,374,598,118	―	0.2260	―
2021年1月末日	1,312,066,502	―	0.2186	―
2月末日	1,320,720,237	―	0.2227	―
3月末日	1,292,336,631	―	0.2234	―
4月末日	1,272,863,901	―	0.2247	―
5月末日	1,341,426,661	―	0.2377	―
第16特定期間末 (2021年6月8日)	1,352,010,657	1,365,970,550	0.2421	0.2446
6月末日	1,374,677,111	―	0.2485	―

②　【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0500
第2特定期間	0.0650
第3特定期間	0.0900
第4特定期間	0.0900
第5特定期間	0.0900
第6特定期間	0.0850
第7特定期間	0.0600
第8特定期間	0.0600
第9特定期間	0.0600
第10特定期間	0.0600
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0300
第13特定期間	0.0240
第14特定期間	0.0240
第15特定期間	0.0165
第16特定期間	0.0150

③　【収益率の推移】

	収益率(%)

第1特定期間	10.4
第2特定期間	7.4
第3特定期間	14.9
第4特定期間	△3.7
第5特定期間	△21.2
第6特定期間	△12.7
第7特定期間	27.0
第8特定期間	10.2
第9特定期間	12.3
第10特定期間	△16.0
第11特定期間	△2.7
第12特定期間	△5.0
第13特定期間	4.6
第14特定期間	△22.6
第15特定期間	△1.8
第16特定期間	14.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	5,896,410,829	2,353,351,001
第2特定期間	5,645,735,518	3,452,460,001
第3特定期間	11,225,250,708	4,206,957,500
第4特定期間	4,694,840,648	3,281,339,188
第5特定期間	1,946,528,402	4,443,095,448
第6特定期間	1,761,944,537	3,434,549,807
第7特定期間	1,009,981,522	4,741,792,695
第8特定期間	1,854,349,211	5,364,175,903
第9特定期間	940,727,347	3,864,671,819
第10特定期間	416,123,844	1,736,960,572
第11特定期間	624,980,907	1,678,599,877
第12特定期間	222,792,936	2,148,636,500
第13特定期間	171,685,194	1,497,289,034
第14特定期間	159,398,038	800,622,891
第15特定期間	221,702,404	663,314,905
第16特定期間	150,431,480	816,001,504

（注） 当初設定数量は13,124,892,429口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

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

2021年6月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	2,485円
純資産総額	13億円

当初設定日（2013年6月19日）～2021年6月30日

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	5.6%
3カ月間	14.9%
6カ月間	17.5%
1年間	33.6%
3年間	−10.6%
5年間	19.3%
設定来	7.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」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ています。
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　315円　　設定来分配金合計額：　8,675円

決算期	第 84 期 20年7月	第 85 期 20年8月	第 86 期 20年9月	第 87 期 20年10月	第 88 期 20年11月	第 89 期 20年12月	第 90 期 21年1月	第 91 期 21年2月	第 92 期 21年3月	第 93 期 21年4月	第 94 期 21年5月	第 95 期 21年6月
分配金	40円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

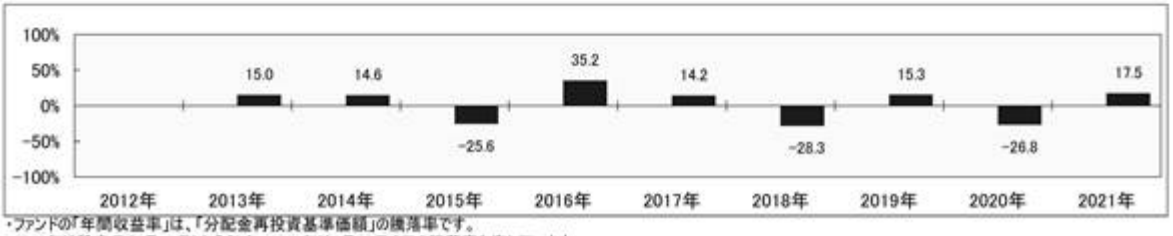
※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド

運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）	99.1%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.0%
合計		99.1%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2013年は設定日（6月19日）から年末、2021年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】（2021年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		2,001,207,834	99.40
	内 ケイマン諸島	2,001,207,834	99.40
親投資信託受益証券		399,122	0.02
	内 日本	399,122	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,778,515	0.59
純資産総額		2,013,385,471	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2021年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	CROCI JAPAN STRATEGY FUND USD CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	27,375,555.17	73.20 2,004,019,462	73.10 2,001,207,834	99.40
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	398,764	1.0009 399,122	1.0009 399,122	0.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.40%
親投資信託受益証券	0.02%
合計	99.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2013年12月9日)	16,180,928,911	16,271,460,267	1.0724	1.0784
第2特定期間末 (2014年6月9日)	19,090,843,787	19,201,725,337	1.0330	1.0390
第3特定期間末 (2014年12月8日)	18,773,804,197	18,862,296,541	1.2729	1.2789
第4特定期間末 (2015年6月8日)	18,436,910,962	18,516,361,065	1.3923	1.3983
第5特定期間末 (2015年12月8日)	14,538,149,849	14,608,824,372	1.2342	1.2402
第6特定期間末 (2016年6月8日)	9,710,353,519	9,773,638,296	0.9206	0.9266
第7特定期間末 (2016年12月8日)	9,115,058,754	9,166,765,018	1.0577	1.0637
第8特定期間末 (2017年6月8日)	6,723,309,325	6,762,087,482	1.0403	1.0463
第9特定期間末 (2017年12月8日)	5,721,510,764	5,752,270,437	1.1160	1.1220
第10特定期間末 (2018年6月8日)	4,618,542,814	4,644,994,022	1.0476	1.0536
第11特定期間末 (2018年12月10日)	3,787,791,364	3,811,542,161	0.9569	0.9629
第12特定期間末 (2019年6月10日)	3,026,370,890	3,047,239,464	0.8701	0.8761
第13特定期間末 (2019年12月9日)	2,941,911,942	2,960,501,757	0.9495	0.9555
第14特定期間末 (2020年6月8日)	2,403,110,406	2,419,893,253	0.8591	0.8651

2020年6月末日	2,285,575,367	―	0.8254	―
7月末日	2,168,696,148	―	0.7983	―
8月末日	2,200,811,182	―	0.8266	―
9月末日	2,187,773,675	―	0.8335	―
10月末日	2,039,043,094	―	0.7867	―
11月末日	2,145,855,170	―	0.8365	―
第15特定期間末 (2020年12月8日)	2,109,820,988	2,125,084,193	0.8294	0.8354
12月末日	2,144,239,082	―	0.8579	―
2021年1月末日	2,048,598,493	―	0.8699	―
2月末日	2,083,651,355	―	0.9026	―
3月末日	2,130,251,365	―	0.9530	―
4月末日	2,014,013,726	―	0.9048	―
5月末日	2,040,057,518	―	0.9296	―
第16特定期間末 (2021年6月8日)	2,008,554,049	2,021,655,023	0.9199	0.9259
6月末日	2,013,385,471	―	0.9252	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0300
第2特定期間	0.0360
第3特定期間	0.0360
第4特定期間	0.0360
第5特定期間	0.0360
第6特定期間	0.0360
第7特定期間	0.0360
第8特定期間	0.0360
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0360
第11特定期間	0.0360
第12特定期間	0.0360
第13特定期間	0.0360
第14特定期間	0.0360
第15特定期間	0.0360
第16特定期間	0.0360

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1特定期間	10.2
第2特定期間	△0.3
第3特定期間	26.7
第4特定期間	12.2
第5特定期間	△8.8
第6特定期間	△22.5
第7特定期間	18.8
第8特定期間	1.8
第9特定期間	10.7
第10特定期間	△2.9
第11特定期間	△5.2
第12特定期間	△5.3
第13特定期間	13.3
第14特定期間	△5.7
第15特定期間	0.7
第16特定期間	15.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	8,501,201,494	2,083,443,398
第2特定期間	8,325,015,671	4,933,316,751
第3特定期間	2,637,227,375	6,368,761,669
第4特定期間	2,427,637,953	3,934,678,127
第5特定期間	1,191,280,108	2,653,876,794
第6特定期間	496,840,278	1,728,464,475
第7特定期間	349,754,071	2,279,506,270
第8特定期間	276,069,522	2,430,754,062
第9特定期間	87,909,089	1,424,323,166
第10特定期間	78,095,376	796,172,777
第11特定期間	156,754,541	606,823,071
第12特定期間	78,526,480	558,896,910
第13特定期間	45,786,816	425,579,962
第14特定期間	56,895,391	358,056,804
第15特定期間	53,227,290	306,500,900
第16特定期間	32,786,496	393,158,333

（注） 当初設定数量は8,670,801,322口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

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

2021年6月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,252円
純資産総額	20億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	−1.0%
6カ月間	12.2%
1年間	21.9%
3年間	16.3%
5年間	64.4%
設定来	64.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」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ています。
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　720円　　設定来分配金合計額：　5,700円

決算期	第 84 期 20年7月	第 85 期 20年8月	第 86 期 20年9月	第 87 期 20年10月	第 88 期 20年11月	第 89 期 20年12月	第 90 期 21年1月	第 91 期 21年2月	第 92 期 21年3月	第 93 期 21年4月	第 94 期 21年5月	第 95 期 21年6月
分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

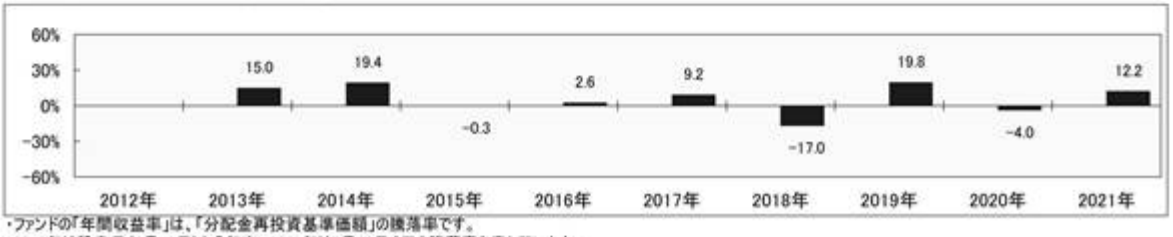
※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド

運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）	99.4%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.0%
合計		99.4%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2013年は設定日（6月19日）から年末、2021年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】（2021年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		1,718,999,706	99.16
	内 ケイマン諸島	1,718,999,706	99.16
親投資信託受益証券		1,995,614	0.12
	内 日本	1,995,614	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,518,223	0.72
純資産総額		1,733,513,543	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2021年6月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	CROCI JAPAN STRATEGY FUND CURRENCY SELECTION CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	66,105,203.26	26.35 1,742,160,600	26.00 1,718,999,706	99.16
2	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,993,820	1.0009 1,995,614	1.0009 1,995,614	0.12

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.16%
親投資信託受益証券	0.12%
合計	99.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2013年12月9日)	51,499,461,043	51,992,891,509	1.0437	1.0537
第2特定期間末 (2014年6月9日)	50,551,193,879	51,056,827,226	0.9998	1.0098
第3特定期間末 (2014年12月8日)	43,604,003,159	44,018,520,897	1.0519	1.0619
第4特定期間末 (2015年6月8日)	34,865,004,218	35,217,852,473	0.9881	0.9981
第5特定期間末 (2015年12月8日)	23,090,472,537	23,392,107,782	0.7655	0.7755
第6特定期間末 (2016年6月8日)	14,365,323,026	14,631,293,117	0.5401	0.5501
第7特定期間末 (2016年12月8日)	12,562,422,397	12,785,650,530	0.5628	0.5728
第8特定期間末 (2017年6月8日)	10,060,067,699	10,245,380,513	0.5429	0.5529
第9特定期間末 (2017年12月8日)	7,841,365,662	7,989,057,602	0.5309	0.5409
第10特定期間末 (2018年6月8日)	5,837,549,825	5,972,879,433	0.4314	0.4414
第11特定期間末 (2018年12月10日)	4,116,083,791	4,199,216,843	0.3466	0.3536
第12特定期間末 (2019年6月10日)	3,237,908,653	3,279,783,742	0.3093	0.3133
第13特定期間末 (2019年12月9日)	2,900,372,252	2,935,273,115	0.3324	0.3364
第14特定期間末 (2020年6月8日)	2,201,802,817	2,234,807,853	0.2668	0.2708

2020年6月末日	2,047,811,229	－	0.2513	－
7月末日	1,925,996,708	－	0.2404	－
8月末日	1,934,704,285	－	0.2450	－
9月末日	1,833,382,099	－	0.2381	－
10月末日	1,703,811,670	－	0.2226	－
11月末日	1,845,528,325	－	0.2436	－
第15特定期間末 (2020年12月8日)	1,807,594,944	1,837,663,140	0.2405	0.2445
12月末日	1,891,375,801	－	0.2527	－
2021年1月末日	1,878,483,813	－	0.2543	－
2月末日	1,927,166,657	－	0.2634	－
3月末日	1,873,525,654	－	0.2644	－
4月末日	1,752,214,785	－	0.2524	－
5月末日	1,783,508,969	－	0.2605	－
第16特定期間末 (2021年6月8日)	1,740,778,788	1,767,987,273	0.2559	0.2599
6月末日	1,733,513,543	－	0.2559	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0500
第2特定期間	0.0600
第3特定期間	0.0600
第4特定期間	0.0600
第5特定期間	0.0600
第6特定期間	0.0600
第7特定期間	0.0600
第8特定期間	0.0600
第9特定期間	0.0600
第10特定期間	0.0600
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0300
第13特定期間	0.0240
第14特定期間	0.0240
第15特定期間	0.0240
第16特定期間	0.0240

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1特定期間	9.4
第2特定期間	1.5
第3特定期間	11.2
第4特定期間	△0.4
第5特定期間	△16.5
第6特定期間	△21.6
第7特定期間	15.3
第8特定期間	7.1
第9特定期間	8.8
第10特定期間	△7.4
第11特定期間	△8.5
第12特定期間	△2.1
第13特定期間	15.2
第14特定期間	△12.5
第15特定期間	△0.9
第16特定期間	16.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1特定期間	12,694,399,349	3,054,810,384
第2特定期間	6,016,959,255	4,796,671,139
第3特定期間	2,944,626,298	12,056,187,215
第4特定期間	1,260,126,589	7,427,074,854
第5特定期間	647,672,946	5,768,973,928
第6特定期間	552,579,048	4,119,094,417
第7特定期間	564,310,519	4,838,506,377
第8特定期間	469,823,104	4,261,354,936
第9特定期間	467,967,930	4,230,055,345
第10特定期間	379,664,709	1,615,897,898
第11特定期間	430,079,022	2,086,889,599
第12特定期間	350,567,552	1,757,945,377
第13特定期間	160,271,349	1,903,827,871
第14特定期間	182,106,594	656,063,426
第15特定期間	193,740,161	927,950,088
第16特定期間	207,544,785	922,472,729

（注） 当初設定数量は39,703,457,640口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

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

2021年6月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	2,559円
純資産総額	17億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.2%
3カ月間	1.4%
6カ月間	11.2%
1年間	23.6%
3年間	10.5%
5年間	45.7%
設定来	8.7%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
※「分配金再投資基準価額」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ています。
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　480円　　設定来分配金合計額：　7,640円

決算期	第 84 期 20年7月	第 85 期 20年8月	第 86 期 20年9月	第 87 期 20年10月	第 88 期 20年11月	第 89 期 20年12月	第 90 期 21年1月	第 91 期 21年2月	第 92 期 21年3月	第 93 期 21年4月	第 94 期 21年5月	第 95 期 21年6月
分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

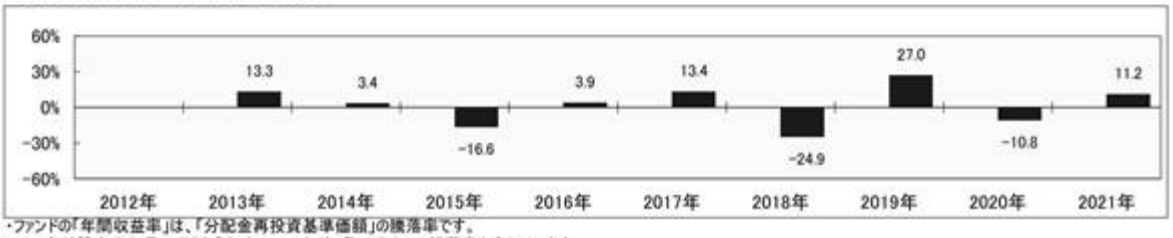
※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド

運用会社名	ファンド名	比率
IQ EQマネジメント・バミューダ・リミテッド	クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）	99.2%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	0.1%
合計		99.3%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2013年は設定日（6月19日）から年末、2021年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、次のイ．およびロ．に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けを行ないません。

イ．ロンドンの銀行の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日（当ファンドの運営および受益者に与える影響が軽微であるとして委託会社が定める日に限り除きます。）

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することができます。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

２【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、次のイ．およびロ．に掲げる日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けを行ないません。

イ．ロンドンの銀行の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）　0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－」を構成する各ファンドの受益者が、当該ファンドの一部解約金の手取金をもって他の構成ファンドの受益権の取得申込みをする場合において、当該他の構成ファンドの受益権の取得申込みの受付けが中止された場合、委託会社は、当該一部解約請求の申込みの受付けを中止することができます。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して6営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

＜信託財産留保額について＞

当ファンドにおいては、信託終了前の解約の際に1万口当たり一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額の0.3%を信託財産留保額としてご負担いただきます。

一部解約に対応して有価証券等の取引を行なう場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを信託財産が負うことになります。

信託財産留保額は、こうしたコスト等の負担について、受益権を継続して保有される方との公平性に資する目的で導入されているもので、解約の際に控除され、信託財産に繰入れられます。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・組入外国投資信託の受益証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・本邦通貨表示の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

2.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

3.価格情報会社の提供する価額

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）　0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2013年6月19日から2023年6月8日までとします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

毎月9日から翌月8日までとします。ただし、第1計算期間は、2013年6月19日から2013年8月8日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、当ファンドが主要投資対象とする組入外国投資信託が存続しないこととなる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
4. 前3. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本4. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.から前5.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資

信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1．から7．までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2．委託会社は、前1．の事項（前1．の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1．の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3．前2．の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3．において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4．前2．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5．書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6．前2．から前5．までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7．前1．から前6．までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8．委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1．から前7．までの規定にしたがいます。

③　反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

④　運用報告書

1．委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年6月および12月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2．委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

3．前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤　公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

https://www.daiwa-am.co.jp/

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥　関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「２　換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第３　【ファンドの経理状況】

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

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年12月9日から2021年6月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,292,589	29,027,932
投資信託受益証券	1,713,539,483	1,405,634,117
親投資信託受益証券	399,162	399,122
流動資産合計	1,741,231,234	1,435,061,171
資産合計	1,741,231,234	1,435,061,171
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	14,624,001	11,510,967
未払解約金	1,364,687	－
未払受託者報酬	37,906	30,973
未払委託者報酬	2,017,167	1,648,164
その他未払費用	75,617	63,668
流動負債合計	18,119,378	13,253,772
負債合計	18,119,378	13,253,772
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,437,333,523	※1 1,918,494,588
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 714,221,667	※2 △ 496,687,189
（分配準備積立金）	226,440,065	170,229,380
元本等合計	1,723,111,856	1,421,807,399
純資産合計	1,723,111,856	1,421,807,399
負債純資産合計	1,741,231,234	1,435,061,171

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
営業収益		
受取配当金	100,232,095	78,877,524
受取利息	242	53
有価証券売買等損益	14,409,021	90,017,070
営業収益合計	114,641,358	168,894,647
営業費用		
支払利息	5,887	2,832
受託者報酬	252,282	212,493
委託者報酬	13,423,748	11,307,162
その他費用	75,791	63,699
営業費用合計	13,757,708	11,586,186
営業利益	100,883,650	157,308,461
経常利益	100,883,650	157,308,461
当期純利益	100,883,650	157,308,461
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,748,802	4,777,177
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 850,566,993	△ 714,221,667
剰余金増加額又は欠損金減少額	138,892,205	157,063,171
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	138,892,205	157,063,171
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,675,668	17,900,485
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,675,668	17,900,485
分配金	※1 94,006,059	※1 74,159,492
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 714,221,667	△ 496,687,189

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1.　※1　期首元本額	2,857,604,873円	2,437,333,523円
期中追加設定元本額	24,618,766円	64,517,005円
期中一部解約元本額	444,890,116円	583,355,940円
2.　特定期間末日における受益権の総数	2,437,333,523口	1,918,494,588口

3．　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は714,221,667円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は496,687,189円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
※1　分配金の計算過程	（自2020年6月9日　至2020年7月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,482,829円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（136,476,943円）及び分配準備積立金（261,560,638円）より分配対象額は410,520,410円（1万口当たり1,499.73円）であり、うち16,423,798円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2020年12月9日　至2021年1月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,423,414円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（128,506,538円）及び分配準備積立金（224,874,624円）より分配対象額は366,804,576円（1万口当たり1,489.45円）であり、うち14,776,084円（1万口当たり60円）を分配金額としております。

		（自2020年7月9日　至2020年8月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,047,665円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（134,978,543円）及び分配準備積立金（253,543,733円）より分配対象額は403,569,941円（1万口当たり1,495.51円）であり、うち16,191,255円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2020年8月12日　至2020年9月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,355,154円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（131,514,197円）及び分配準備積立金（244,767,700円）より分配対象額は392,637,051円（1万口当たり1,497.92円）であり、うち15,727,250円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2021年1月9日　至2021年2月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,865,970円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（108,635,707円）及び分配準備積立金（188,292,644円）より分配対象額は308,794,321円（1万口当たり1,486.59円）であり、うち12,463,178円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2021年2月9日　至2021年3月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,893,461円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（104,239,274円）及び分配準備積立金（179,270,665円）より分配対象額は294,403,400円（1万口当たり1,481.44円）であり、うち11,923,703円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	

		（自2020年9月9日　至2020年10月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（14,196,553円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（130,724,318円）及び分配準備積立金（242,869,820円）より分配対象額は387,790,691円（1万口当たり1,492.58円）であり、うち15,588,787円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2020年10月9日　至2020年11月9日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（17,882,866円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（129,925,823円）及び分配準備積立金（238,989,087円）より分配対象額は386,797,776円（1万口当たり1,502.03円）であり、うち15,450,968円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2021年3月9日　至2021年4月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,860,251円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（104,270,870円）及び分配準備積立金（176,213,189円）より分配対象額は292,344,310円（1万口当たり1,481.55円）であり、うち11,839,367円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2021年4月9日　至2021年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,873,848円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（102,973,667円）及び分配準備積立金（172,963,061円）より分配対象額は287,810,576円（1万口当たり1,482.77円）であり、うち11,646,193円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	

	（自2020年11月10日　至2020年12月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,892,714円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（123,301,802円）及び分配準備積立金（228,171,352円）より分配対象額は364,365,868円（1万口当たり1,494.94円）であり、うち14,624,001円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年6月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,790,181円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（102,009,189円）及び分配準備積立金（170,950,166円）より分配対象額は283,749,536円（1万口当たり1,479.02円）であり、うち11,510,967円（1万口当たり60円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2021年6月8日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2020年12月8日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当　期 2021年6月8日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	61,793,449	13,363,197
親投資信託受益証券	△40	0
合計	61,793,409	13,363,197

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7070円 (7,070円)	0.7411円 (7,411円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	CROCI JAPAN STRATEGY FUND JPY CLASS	20,383,916.549	1,405,634,117	
投資信託受益証券　合計			1,405,634,117	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	398,764	399,122	
親投資信託受益証券　合計			399,122	
合計			1,406,033,239	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（日本円・クラス）」受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

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

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（日本円建て）

貸借対照表
2020年2月29日

資産		
投資資産の評価額（簿価 \11,240,424,000）	\	9,297,349,600
現金および現金同等物		30,213,068
資産合計		9,327,562,668
負債		
スワップ取引による評価損		320,123,426
未払：		
終了したスワップ取引		23,905,351
専門家報酬		10,279,212
管理会社報酬		4,044,090
運用会社報酬		1,332,392
為替投資アドバイザー報酬		1,077,428
名義書換代理人報酬		235,724
登録料		81,288
受託会社報酬		10,280
負債合計		361,089,191
純資産	\	8,966,473,477
豪ドル・クラス	\	315,764,957
ブラジル・レアル・クラス		1,897,507,925
日本円・クラス		2,037,817,933
通貨セレクト・クラス		2,311,346,657
米ドル・クラス		2,404,036,005
	\	8,966,473,477
発行済み受益証券		
豪ドル・クラス		7,037,313
ブラジル・レアル・クラス		67,778,394
日本円・クラス		31,720,472
通貨セレクト・クラス		82,222,893
米ドル・クラス		35,379,308
受益証券1口当り純資産額		
豪ドル・クラス	\	44.870

ブラジル・レアル・クラス	\	27.996
日本円・クラス	\	64.243
通貨セレクト・クラス	\	28.111
米ドル・クラス	\	67.950

損益計算書
2020年2月29日に終了した会計年度

費用		
運用会社報酬	¥	19,411,767
管理会社報酬		10,784,579
専門家報酬		5,321,612
為替投資アドバイザー報酬		4,720,955
受託会社報酬		1,423,645
名義書換代理人報酬		1,210,531
支払利息		191,063
登録料		81,288
費用合計		43,145,440
投資損失		(43,145,440)
実現損益および評価損益：		
実現損益の内訳:		
証券投資		280,622,304
スワップ取引		(231,335,961)
実現損益		49,286,343
評価損益の変動の内訳：		
証券投資		(208,141,800)
スワップ取引		(382,275,721)
外国為替先渡取引		(5,725)
評価損益の変動		(590,423,246)
実現損益および評価損益の変動		(541,136,903)
運用による純資産の増減	¥	(584,282,343)

投資明細表
2020年2月29日

投資資産の明細	受益証券口数	純資産に占める割合		評価額
CROCI Japan Covered Call Strategy* - トータル・リターン・スワップ	137,210,000	103.69%	\	9,297,349,600
ストラクチャード商品合計(簿価 \11,240,424,000)				**9,297,349,600**
投資資産合計(簿価 \11,240,424,000)		**103.69%**	\	**9,297,349,600**

＊当ファンドはDeutsche Bank A.G., ロンドン支店との間で締結したファンドの残高に評価額が連動するように出資されたパフォーマンス・スワップを通してCROCI Japan Covered Call Strategyに対するエクスポージャーを有しています。

豪ドル・クラス外国為替スワップ取引

買い	取引相手	想定元本	満期日	売り	想定元本		評価損益	純資産に占める割合
AUD	Deutsche Bank A.G.	4,776,983	2020/3/31	JPY	(346,003,324)	\	(11,255,626)	(0.00%)

ブラジル・レアル・クラス外国為替スワップ取引

買い	取引相手	想定元本	満期日	売り	想定元本		評価損益	純資産に占める割合
BRL	Deutsche Bank A.G.	85,492,550	2020/3/31	JPY	(2,180,075,003)	\	(137,284,801)	(0.02%)

通貨セレクト・クラス外国為替スワップ取引

買い	取引相手	想定元本	満期日	売り	想定元本		評価損益	純資産に占める割合
IDR	Deutsche Bank A.G.	51,453,657,726	2020/3/31	JPY	(405,777,942)	\	(23,769,914)	(0.00%)

INR	Deutsche Bank A.G.	253,107,389	2020/3/31	JPY	(390,239,710)	(15,735,528)	(0.00%)
MXN	Deutsche Bank A.G.	75,229,502	2020/3/31	JPY	(433,361,034)	(24,496,419)	(0.01%)
RON	Deutsche Bank A.G.	14,404,559	2020/3/31	JPY	(359,608,512)	(4,861,479)	(0.00%)
RUB	Deutsche Bank A.G.	237,944,291	2020/3/31	JPY	(403,098,157)	(22,597,702)	(0.00%)
TRY	Deutsche Bank A.G.	29,472,140	2020/3/31	JPY	(526,345,440)	(22,261,035)	(0.00%)
合計						**\ (113,722,077)**	**(0.01%)**

米ドル・クラス外国為替スワップ取引

買い	取引相手	想定元本	満期日	売り	想定元本	評価損益	純資産に占める割合
USD	Deutsche Bank A.G.	23,774,328	2020/3/31	JPY	(2,624,914,082)	\ (57,860,922)	(0.01%)

語集：

AUD	豪ドル
BRL	ブラジル・レアル
IDR	インドネシア・ルピア
INR	インド・ルピー
MXN	メキシコ・ペソ
RON	ルーマニア・レイ
RUB	ロシア・ルーブル
TRY	トルコ・リラ
USD	米ドル

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年12月8日現在	2021年6月8日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	88,310,695,530	94,796,152,514
流動資産合計	88,310,695,530	94,796,152,514
資産合計	88,310,695,530	94,796,152,514
負債の部		
流動負債		
未払解約金	—	200,000,000
流動負債合計	—	200,000,000
負債合計	—	200,000,000
純資産の部		
元本等		

元本 ※1	88,220,021,695	94,511,359,875
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	90,673,835	84,792,639
元本等合計	88,310,695,530	94,596,152,514
純資産合計	88,310,695,530	94,596,152,514
負債純資産合計	88,310,695,530	94,796,152,514

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年12月8日現在	2021年6月8日現在
1.　※1　期首	2020年6月9日	2020年12月9日
期首元本額	68,280,430,268円	88,220,021,695円
期中追加設定元本額	43,310,046,246円	68,679,689,506円
期中一部解約元本額	23,370,454,819円	62,388,351,326円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本株ロング・ショート戦略パイロットファンド（適格機関投資家専用）	－円	254,770,707円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド －ロボテック－	947,268円	947,268円
ダイワ／ミレーアセット・インド株式ファンド －インドの匠－	29,910,270円	29,910,270円
ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジあり）	998円	998円
ワールド・フィンテック革命ファンド（為替ヘッジなし）	998円	998円
新興国ソブリン・豪ドルファンド（毎月決算型）	999円	－円
新興国ソブリン・ブラジルレアルファンド（毎月決算型）	999円	－円

新興国ソブリン・ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）	999円	－円	
ＵＳ短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／毎月決算型）	102,434円	102,434円	
ロボット・テクノロジー関連株ファンド －ロボテック－（為替ヘッジあり）	39,849円	39,849円	
ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型）－ロボテック（年1回）－（為替ヘッジあり）	3,985円	3,985円	
iFreeレバレッジ S&P500	1,249,412,852円	3,797,094,965円	
iFreeレバレッジ NASDAQ100	11,006,295,149円	20,996,604,572円	
米国4資産リスク分散ファンド（年2回決算型）	689,912円	699,904円	
クリーンテック株式ファンド（資産成長型）	998,802円	998,802円	
ロボット・テクノロジー関連株ファンド －ロボテック－（毎月決算／予想分配金提示型）	999円	999円	
世界インフラ戦略ファンド（為替ヘッジなし／毎月分配型）	－円	1,000円	
世界インフラ戦略ファンド（為替ヘッジなし／資産成長型）	－円	499,501円	
ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	2,777,625,402円	4,046,388,611円	
ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	6,683,086,104円	4,385,323,917円	
ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ（2倍）指数	1,085,050,377円	1,304,830,597円	
ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース（-2倍）指数	1,226,094,880円	1,036,280,697円	
ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	25,058,858,800円	11,072,545,380円	
ダイワ上場投信－TOPIXインバース（-1倍）指数	11,170,317,850円	4,526,881,354円	

ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400レバレッジ・インデックス	437,419,121円	507,349,191円	
ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400インバース・インデックス	611,537,975円	161,987,525円	
ダイワ上場投信－ＪＰＸ日経400ダブルインバース・インデックス	141,884,108円	109,916,076円	
ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-07	997円	997円	
ダイワ米国投資法人債ファンド（為替ヘッジあり）2016-10	997円	997円	
先進国トータルリターン戦略ファンド（リスク抑制型／適格機関投資家専用）	6,988,339,549円	6,988,339,549円	
ダイワ日本株式ベア・ファンド（適格機関投資家専用）	19,374,063,390円	842,519,994円	
低リスク型アロケーションファンド（金利トレンド判断付き／適格機関投資家専用）	179,433,743円	179,433,743円	
ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ －SLトレード－	5,091,608円	5,140,459円	
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	－円	19,667,832,938円	
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	－円	12,289,939,063円	
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	－円	2,068,138,681円	
ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ	149,382,442円	200,028,352円	
ダイワ・アセアン内需関連株ファンド・マネー・ポートフォリオ	5,609,419円	5,611,122円	

通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 豪ドル・コース（毎月分配型）	595,106円	595,106円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）	987,373円	987,373円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 通貨セレクト・コース（毎月分配型）	494,581円	494,581円	
ダイワＵＳ短期ハイ・イールド社債ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）	9,957円	9,957円	
ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）	997円	997円	
ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）	997円	997円	
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）	997円	997円	
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジなし）	997円	997円	
ダイワ／ミレーアセット亜細亜株式ファンド	9,958,176円	9,958,176円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）米ドル・コース	1,989,053円	10,833円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース	2,978,118円	10,788円	
通貨選択型ダイワ／ミレーアセット・グローバル好配当株α（毎月分配型）通貨セレクト・コース	1,691,241円	12,751円	

ロボット・テクノロジー関連株ファンド（年1回決算型）－ロボテック（年1回）－	100,588円	100,588円
ダイワ先進国リートα　為替ヘッジあり（毎月分配型）	399,083円	399,083円
ダイワ先進国リートα　為替ヘッジなし（毎月分配型）	99,771円	99,771円
通貨選択型ダイワ先進国リートα　円ヘッジコース（毎月分配型）	399,083円	399,083円
通貨選択型ダイワ先進国リートα　通貨セレクトコース（毎月分配型）	99,771円	99,771円
ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジあり）	1,091,429円	1,091,429円
ダイワ／ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド（為替ヘッジなし）	315,004円	315,004円
ダイワ／ミレーアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	10,009,811円	10,009,811円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－日本円・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－豪ドル・コース（毎月分配型）	99,691円	99,691円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円

ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－米ドル・コース（毎月分配型）	398,764円	398,764円
ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－通貨セレクト・コース（毎月分配型）	1,993,820円	1,993,820円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　日本円・コース	300,273円	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　豪ドル・コース	200,861円	200,861円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　ブラジル･レアル・コース	300,273円	300,273円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　米ドル・コース	1,999,177円	1,999,177円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド　－イーグルアイⅡ－　予想分配金提示型　通貨セレクト・コース	505,900円	505,900円
計	88,220,021,695円	94,511,359,875円
2.　期末日における受益権の総数	88,220,021,695口	94,511,359,875口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、信用リスクであります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年6月8日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

2020年12月8日現在	2021年6月8日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2020年12月8日現在	2021年6月8日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2020年12月8日現在	2021年6月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0010円 (10,010円)	1.0009円 (10,009円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)　株式

該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年12月9日から2021年6月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,142,782	7,116,123
投資信託受益証券	319,810,991	335,175,415
親投資信託受益証券	99,790	99,780
流動資産合計	330,053,563	342,391,318
資産合計	330,053,563	342,391,318
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,490,725	3,257,463
未払解約金	32,572	156
未払受託者報酬	7,016	7,351
未払委託者報酬	373,849	391,320
その他未払費用	13,257	14,034
流動負債合計	3,917,419	3,670,324
負債合計	3,917,419	3,670,324
純資産の部		
元本等		
元本	※1 698,145,090	※1 651,492,717
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 372,008,946	※2 △ 312,771,723
（分配準備積立金）	28,720,900	22,298,709
元本等合計	326,136,144	338,720,994
純資産合計	326,136,144	338,720,994
負債純資産合計	330,053,563	342,391,318

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
営業収益		
受取配当金	18,048,722	17,131,582
受取利息	28	9
有価証券売買等損益	2,619,204	42,132,832
営業収益合計	20,667,954	59,264,423
営業費用		
支払利息	724	612
受託者報酬	44,468	47,032
委託者報酬	2,368,148	2,503,432
その他費用	13,284	14,036
営業費用合計	2,426,624	2,565,112
営業利益	18,241,330	56,699,311
経常利益	18,241,330	56,699,311
当期純利益	18,241,330	56,699,311
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 234,690	517,935
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 381,434,830	△ 372,008,946
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,039,296	28,001,082
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,039,296	28,001,082
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,768,195	4,881,127
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,768,195	4,881,127
分配金	※1 21,321,237	※1 20,064,108
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 372,008,946	△ 312,771,723

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1．※1　期首元本額	720,362,788円	698,145,090円
期中追加設定元本額	14,216,364円	9,797,712円
期中一部解約元本額	36,434,062円	56,450,085円
2．特定期間末日における受益権の総数	698,145,090口	651,492,717口

3．　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は372,008,946円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は312,771,723円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
※1　分配金の計算過程	（自2020年6月9日　至2020年7月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,053,963円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（58,589,019円）及び分配準備積立金（35,226,197円）より分配対象額は95,869,179円（1万口当たり1,334.78円）であり、うち3,591,191円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2020年12月9日　至2021年1月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,533,537円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（57,678,817円）及び分配準備積立金（28,706,776円）より分配対象額は88,919,130円（1万口当たり1,270.87円）であり、うち3,498,343円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

	（自2020年7月9日　至2020年8月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,787,202円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（58,210,778円）及び分配準備積立金（33,308,769円）より分配対象額は94,306,749円（1万口当たり1,323.94円）であり、うち3,561,592円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2020年8月12日　至2020年9月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,944,764円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（58,433,178円）及び分配準備積立金（32,534,151円）より分配対象額は93,912,093円（1万口当たり1,315.19円）であり、うち3,570,287円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2021年1月9日　至2021年2月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,632,521円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（56,712,468円）及び分配準備積立金（27,181,464円）より分配対象額は86,526,453円（1万口当たり1,259.19円）であり、うち3,435,793円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2021年2月9日　至2021年3月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,649,426円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（55,144,506円）及び分配準備積立金（25,552,438円）より分配対象額は83,346,370円（1万口当たり1,248.91円）であり、うち3,336,775円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	

		（自2020年9月9日　至2020年10月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,692,634円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（58,647,861円）及び分配準備積立金（31,759,425円）より分配対象額は93,099,920円（1万口当たり1,302.88円）であり、うち3,572,863円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2020年10月9日　至2020年11月9日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,294,928円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（58,091,644円）及び分配準備積立金（30,476,506円）より分配対象額は91,863,078円（1万口当たり1,299.49円）であり、うち3,534,579円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2021年3月9日　至2021年4月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,743,238円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（54,343,107円）及び分配準備積立金（24,414,089円）より分配対象額は81,500,434円（1万口当たり1,240.68円）であり、うち3,284,496円（1万口当たり50円）を分配金額としております。 （自2021年4月9日　至2021年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,816,600円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（53,846,033円）及び分配準備積立金（23,578,585円）より分配対象額は80,241,218円（1万口当たり1,234.01円）であり、うち3,251,238円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	

	（自2020年11月10日　至2020年12月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,455,013円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（57,476,230円）及び分配準備積立金（29,756,612円）より分配対象額は89,687,855円（1万口当たり1,284.66円）であり、うち3,490,725円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年6月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,417,073円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（53,998,549円）及び分配準備積立金（23,139,099円）より分配対象額は79,554,721円（1万口当たり1,221.11円）であり、うち3,257,463円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2021年6月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2020年12月8日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当　期 2021年6月8日現在 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	19,844,930	864,398
親投資信託受益証券	△10	0
合計	19,844,920	864,398

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.4671円 (4,671円)	0.5199円 (5,199円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	CROCI JAPAN STRATEGY FUND AUD CLASS	6,032,132.023	335,175,415	
投資信託受益証券　合計			335,175,415	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	99,691	99,780	
親投資信託受益証券　合計			99,780	
合計			335,275,195	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（豪ドル・クラス）」受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

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

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

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

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年12月9日から2021年6月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,695,879	18,521,759
投資信託受益証券	1,397,375,685	1,325,564,947
親投資信託受益証券	399,162	399,122
未収入金	－	37,099,999
流動資産合計	1,418,470,726	1,381,585,827
資産合計	1,418,470,726	1,381,585,827
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	15,623,818	13,959,893
未払解約金	935,038	14,007,356
未払受託者報酬	29,436	28,661
未払委託者報酬	1,566,319	1,525,174
その他未払費用	57,476	54,086
流動負債合計	18,212,087	29,575,170
負債合計	18,212,087	29,575,170
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,249,527,333	※1 5,583,957,309
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 4,849,268,694	※2 △ 4,231,946,652
（分配準備積立金）	64,590,927	39,876,885
元本等合計	1,400,258,639	1,352,010,657
純資産合計	1,400,258,639	1,352,010,657
負債純資産合計	1,418,470,726	1,381,585,827

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
営業収益		
受取配当金	118,839,962	74,949,253
受取利息	154	47
有価証券売買等損益	△ 146,394,679	123,439,968
営業収益合計	△ 27,554,563	198,389,268
営業費用		
支払利息	4,907	2,327
受託者報酬	191,851	180,550
委託者報酬	10,209,124	9,607,810
その他費用	57,530	54,146
営業費用合計	10,463,412	9,844,833
営業利益又は営業損失（△）	△ 38,017,975	188,544,435
経常利益又は経常損失（△）	△ 38,017,975	188,544,435
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 38,017,975	188,544,435
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,088,854	2,546,594
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 5,051,344,168	△ 4,849,268,694
剰余金増加額又は欠損金減少額	523,784,253	635,774,611
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	523,784,253	635,774,611
剰余金減少額又は欠損金増加額	174,391,302	117,093,210
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	174,391,302	117,093,210
分配金	※1 107,210,648	※1 87,357,200
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 4,849,268,694	△ 4,231,946,652

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1．※1　期首元本額	6,691,139,834円	6,249,527,333円
期中追加設定元本額	221,702,404円	150,431,480円
期中一部解約元本額	663,314,905円	816,001,504円
2．特定期間末日における受益権の総数	6,249,527,333口	5,583,957,309口

3．　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,849,268,694円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,231,946,652円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
※1　分配金の計算過程	（自2020年6月9日　至2020年7月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,673,593円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（694,691,247円）及び分配準備積立金（67,384,927円）より分配対象額は774,749,767円（1万口当たり1,162.47円）であり、うち26,658,724円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2020年12月9日　至2021年1月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,411,514円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（635,329,610円）及び分配準備積立金（62,681,412円）より分配対象額は708,422,536円（1万口当たり1,165.91円）であり、うち15,190,348円（1万口当たり25円）を分配金額としております。

		（自2020年7月9日　至2020年8月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（23,188,644円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（696,208,840円）及び分配準備積立金（52,962,831円）より分配対象額は772,360,315円（1万口当たり1,157.23円）であり、うち16,685,576円（1万口当たり25円）を分配金額としております。 （自2020年8月12日　至2020年9月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（20,954,248円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（677,475,256円）及び分配準備積立金（57,732,520円）より分配対象額は756,162,024円（1万口当たり1,164.50円）であり、うち16,233,552円（1万口当たり25円）を分配金額としております。	（自2021年1月9日　至2021年2月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,529,880円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（625,435,105円）及び分配準備積立金（56,235,678円）より分配対象額は693,200,663円（1万口当たり1,160.38円）であり、うち14,934,751円（1万口当たり25円）を分配金額としております。 （自2021年2月9日　至2021年3月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,698,185円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（617,668,944円）及び分配準備積立金（52,053,017円）より分配対象額は680,420,146円（1万口当たり1,153.52円）であり、うち14,746,578円（1万口当たり25円）を分配金額としております。	

		（自2020年9月9日　至2020年10月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（19,652,232円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（669,790,370円）及び分配準備積立金（61,138,086円）より分配対象額は750,580,688円（1万口当たり1,170.15円）であり、うち16,036,020円（1万口当たり25円）を分配金額としております。 （自2020年10月9日　至2020年11月9日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,489,732円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（667,775,796円）及び分配準備積立金（64,010,202円）より分配対象額は754,275,730円（1万口当たり1,180.55円）であり、うち15,972,958円（1万口当たり25円）を分配金額としております。	（自2021年3月9日　至2021年4月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,459,309円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（602,401,485円）及び分配準備積立金（46,565,030円）より分配対象額は660,425,824円（1万口当たり1,148.50円）であり、うち14,375,825円（1万口当たり25円）を分配金額としております。 （自2021年4月9日　至2021年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,643,064円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（593,025,764円）及び分配準備積立金（42,869,892円）より分配対象額は649,538,720円（1万口当たり1,147.61円）であり、うち14,149,805円（1万口当たり25円）を分配金額としております。

	（自2020年11月10日　至2020年12月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,385,328円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（653,337,747円）及び分配準備積立金（68,829,417円）より分配対象額は733,552,492円（1万口当たり1,173.77円）であり、うち15,623,818円（1万口当たり25円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年6月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,121,543円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（585,146,593円）及び分配準備積立金（41,715,235円）より分配対象額は638,983,371円（1万口当たり1,144.32円）であり、うち13,959,893円（1万口当たり25円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2021年6月8日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	153,853,861	58,693,501
親投資信託受益証券	△40	0
合計	153,853,821	58,693,501

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.2241円 (2,241円)	0.2421円 (2,421円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	CROCI JAPAN STRATEGY FUND BRL CLASS	52,771,405.969	1,325,564,947	
投資信託受益証券　合計			1,325,564,947	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	398,764	399,122	
親投資信託受益証券　合計			399,122	
合計			1,325,964,069	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）」受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

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

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

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

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年12月9日から2021年6月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,357,024	37,382,811
投資信託受益証券	2,092,927,048	1,987,731,917
親投資信託受益証券	399,162	399,122
流動資産合計	2,127,683,234	2,025,513,850
資産合計	2,127,683,234	2,025,513,850
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	15,263,205	13,100,974
未払解約金	83	1,402,802
未払受託者報酬	46,280	43,740
未払委託者報酬	2,462,346	2,327,336
その他未払費用	90,332	84,949
流動負債合計	17,862,246	16,959,801
負債合計	17,862,246	16,959,801
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,543,867,641	※1 2,183,495,804
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 434,046,653	※2 △ 174,941,755
（分配準備積立金）	988,383,334	851,437,743
元本等合計	2,109,820,988	2,008,554,049
純資産合計	2,109,820,988	2,008,554,049
負債純資産合計	2,127,683,234	2,025,513,850

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
営業収益		
受取配当金	125,631,857	104,772,359
受取利息	306	73
有価証券売買等損益	△ 100,404,391	207,632,470
営業収益合計	25,227,772	312,404,902
営業費用		
支払利息	7,286	3,346
受託者報酬	301,328	283,425
委託者報酬	16,033,312	15,081,293
その他費用	90,470	85,098
営業費用合計	16,432,396	15,453,162
営業利益	8,795,376	296,951,740
経常利益	8,795,376	296,951,740
当期純利益	8,795,376	296,951,740
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 353,469	4,449,856
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 394,030,845	△ 434,046,653
剰余金増加額又は欠損金減少額	55,005,426	52,874,186
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	55,005,426	52,874,186
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,411,084	3,993,362
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,411,084	3,993,362
分配金	※1 94,758,995	※1 82,277,810
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 434,046,653	△ 174,941,755

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1．※1　期首元本額	2,797,141,251円	2,543,867,641円
期中追加設定元本額	53,227,290円	32,786,496円
期中一部解約元本額	306,500,900円	393,158,333円
2．特定期間末日における受益権の総数	2,543,867,641口	2,183,495,804口

3．　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は434,046,653円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は174,941,755円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
※1　分配金の計算過程	（自2020年6月9日　至2020年7月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,420,489円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（536,439,820円）及び分配準備積立金（1,069,170,599円）より分配対象額は1,621,030,908円（1万口当たり5,894.89円）であり、うち16,499,344円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2020年12月9日　至2021年1月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,894,473円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（491,459,681円）及び分配準備積立金（935,786,721円）より分配対象額は1,443,140,875円（1万口当たり5,971.27円）であり、うち14,500,835円（1万口当たり60円）を分配金額としております。

		（自2020年7月9日　至2020年8月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（18,696,121円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（521,739,391円）及び分配準備積立金（1,031,246,055円）より分配対象額は1,571,681,567円（1万口当たり5,905.14円）であり、うち15,969,286円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2020年8月12日　至2020年9月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（20,241,832円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（518,165,013円）及び分配準備積立金（1,016,655,213円）より分配対象額は1,555,062,058円（1万口当たり5,922.23円）であり、うち15,754,821円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2021年1月9日　至2021年2月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,531,017円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（478,380,888円）及び分配準備積立金（907,270,405円）より分配対象額は1,402,182,310円（1万口当たり5,981.80円）であり、うち14,064,490円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2021年2月9日　至2021年3月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,983,872円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（472,541,252円）及び分配準備積立金（894,356,028円）より分配対象額は1,382,881,152円（1万口当たり5,991.05円）であり、うち13,849,477円（1万口当たり60円）を分配金額としております。

		（自2020年9月9日　至2020年10月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（18,253,844円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（519,522,580円）及び分配準備積立金（1,016,953,872円）より分配対象額は1,554,730,296円（1万口当たり5,931.88円）であり、うち15,725,840円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2020年10月9日　至2020年11月9日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（23,076,256円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（516,088,490円）及び分配準備積立金（1,005,365,874円）より分配対象額は1,544,530,620円（1万口当たり5,960.95円）であり、うち15,546,499円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2021年3月9日　至2021年4月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,324,772円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（460,636,239円）及び分配準備積立金（864,527,756円）より分配対象額は1,341,488,767円（1万口当たり6,004.11円）であり、うち13,405,693円（1万口当たり60円）を分配金額としております。 （自2021年4月9日　至2021年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（17,344,397円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（460,254,206円）及び分配準備積立金（862,940,484円）より分配対象額は1,340,539,087円（1万口当たり6,022.03円）であり、うち13,356,341円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	

	（自2020年11月10日　至2020年12月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（16,349,652円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（513,898,546円）及び分配準備積立金（987,296,887円）より分配対象額は1,517,545,085円（1万口当たり5,965.50円）であり、うち15,263,205円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年6月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,566,879円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（452,836,462円）及び分配準備積立金（848,971,838円）より分配対象額は1,317,375,179円（1万口当たり6,033.33円）であり、うち13,100,974円（1万口当たり60円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2021年6月8日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	90,353,087	30,909,964
親投資信託受益証券	△40	0
合計	90,353,047	30,909,964

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8294円 (8,294円)	0.9199円 (9,199円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	CROCI JAPAN STRATEGY FUND USD CLASS	27,145,907.325	1,987,731,917	
投資信託受益証券　合計			1,987,731,917	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	398,764	399,122	
親投資信託受益証券　合計			399,122	
合計			1,988,131,039	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（米ドル・クラス）」受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

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

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

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

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年12月9日から2021年6月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,911,885	62,453,725
投資信託受益証券	1,777,150,951	1,717,224,224
親投資信託受益証券	1,995,813	1,995,614
流動資産合計	1,846,058,649	1,781,673,563
資産合計	1,846,058,649	1,781,673,563
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	30,068,196	27,208,485
未払解約金	6,165,110	11,536,364
未払受託者報酬	39,693	38,262
未払委託者報酬	2,111,927	2,035,949
その他未払費用	78,779	75,715
流動負債合計	38,463,705	40,894,775
負債合計	38,463,705	40,894,775
純資産の部		
元本等		
元本	※1 7,517,049,211	※1 6,802,121,267
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 5,709,454,267	※2 △ 5,061,342,479
（分配準備積立金）	273,803,261	217,485,822
元本等合計	1,807,594,944	1,740,778,788
純資産合計	1,807,594,944	1,740,778,788
負債純資産合計	1,846,058,649	1,781,673,563

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
営業収益		
受取配当金	196,091,761	155,340,561
受取利息	168	35
有価証券売買等損益	△ 209,661,194	147,232,513
営業収益合計	△ 13,569,265	302,573,109
営業費用		
支払利息	6,205	3,073
受託者報酬	262,842	252,645
委託者報酬	13,985,139	13,443,010
その他費用	78,842	75,798
営業費用合計	14,333,028	13,774,526
営業利益又は営業損失（△）	△ 27,902,293	288,798,583
経常利益又は経常損失（△）	△ 27,902,293	288,798,583
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 27,902,293	288,798,583
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	595,750	3,240,926
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 6,049,456,321	△ 5,709,454,267
剰余金増加額又は欠損金減少額	702,426,774	689,044,714
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	702,426,774	689,044,714
剰余金減少額又は欠損金増加額	147,014,805	155,067,576
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	147,014,805	155,067,576
分配金	※1 186,911,872	※1 171,423,007
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 5,709,454,267	△ 5,061,342,479

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1．※1　期首元本額	8,251,259,138円	7,517,049,211円
期中追加設定元本額	193,740,161円	207,544,785円
期中一部解約元本額	927,950,088円	922,472,729円
2．特定期間末日における受益権の総数	7,517,049,211口	6,802,121,267口

3．　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,709,454,267円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,061,342,479円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2020年6月9日 至　2020年12月8日	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
※1　分配金の計算過程	（自2020年6月9日　至2020年7月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（26,088,008円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（254,336,023円）及び分配準備積立金（304,855,113円）より分配対象額は585,279,144円（1万口当たり722.87円）であり、うち32,386,416円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2020年12月9日　至2021年1月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（23,397,147円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（241,717,403円）及び分配準備積立金（270,832,299円）より分配対象額は535,946,849円（1万口当たり717.54円）であり、うち29,876,882円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

		（自2020年7月9日　至2020年8月11日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（33,383,147円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（252,117,938円）及び分配準備積立金（293,295,463円）より分配対象額は578,796,548円（1万口当たり724.69円）であり、うち31,947,133円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2020年8月12日　至2020年9月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（32,500,621円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（247,980,692円）及び分配準備積立金（287,422,548円）より分配対象額は567,903,861円（1万口当たり726.26円）であり、うち31,278,375円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2021年1月9日　至2021年2月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（23,215,182円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（238,812,428円）及び分配準備積立金（259,010,866円）より分配対象額は521,038,476円（1万口当たり709.14円）であり、うち29,389,858円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2021年2月9日　至2021年3月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（24,535,420円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（237,517,569円）及び分配準備積立金（249,147,606円）より分配対象額は511,200,595円（1万口当たり702.90円）であり、うち29,090,969円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	

		（自2020年9月9日　至2020年10月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（34,029,178円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（245,299,380円）及び分配準備積立金（282,689,524円）より分配対象額は562,018,082円（1万口当たり730.52円）であり、うち30,773,691円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2020年10月9日　至2020年11月9日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（34,766,745円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（243,933,615円）及び分配準備積立金（281,865,765円）より分配対象額は560,566,125円（1万口当たり736.18円）であり、うち30,458,061円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2021年3月9日　至2021年4月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（24,561,254円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（231,085,216円）及び分配準備積立金（235,584,500円）より分配対象額は491,230,970円（1万口当たり697.80円）であり、うち28,158,656円（1万口当たり40円）を分配金額としております。 （自2021年4月9日　至2021年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（26,645,007円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（228,606,019円）及び分配準備積立金（226,911,838円）より分配対象額は482,162,864円（1万口当たり696.31円）であり、うち27,698,157円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	

	（自2020年11月10日　至2020年12月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,564,160円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（242,017,155円）及び分配準備積立金（281,307,297円）より分配対象額は545,888,612円（1万口当たり726.20円）であり、うち30,068,196円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自2021年5月11日　至2021年6月8日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（23,960,304円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（225,710,219円）及び分配準備積立金（220,734,003円）より分配対象額は470,404,526円（1万口当たり691.56円）であり、うち27,208,485円（1万口当たり40円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2021年6月8日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	123,396,984	26,733,497
親投資信託受益証券	△200	0
合計	123,396,784	26,733,497

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2020年12月9日 至　2021年6月8日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2020年12月8日現在	当　期 2021年6月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.2405円 (2,405円)	0.2559円 (2,559円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資信託受益証券	CROCI JAPAN STRATEGY FUND CURRENCY SELECTION CLASS	65,108,027.472	1,717,224,224	
投資信託受益証券　合計			1,717,224,224	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	1,993,820	1,995,614	
親投資信託受益証券　合計			1,995,614	
合計			1,719,219,838	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「オージェンタム・トラスト－クロッキー・ジャパン・ストラテジー・ファンド（通貨セレクト・クラス）」受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

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

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

２【ファンドの現況】

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

【純資産額計算書】

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	1,414,083,467円
Ⅱ	負債総額	1,285,174円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,412,798,293円
Ⅳ	発行済数量	1,916,667,018口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7371円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

純資産額計算書

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	97,172,577,332円
Ⅱ	負債総額	0円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	97,172,577,332円
Ⅳ	発行済数量	97,087,217,324口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0009円

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

純資産額計算書

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	332,293,214円
Ⅱ	負債総額	303,154円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	331,990,060円
Ⅳ	発行済数量	654,791,605口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.5070円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

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

純資産額計算書

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	1,376,170,142円
Ⅱ	負債総額	1,493,031円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,374,677,111円
Ⅳ	発行済数量	5,530,842,203口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.2485円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

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

純資産額計算書

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	2,016,615,483円
Ⅱ	負債総額	3,230,012円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,013,385,471円
Ⅳ	発行済数量	2,176,091,498口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9252円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

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

純資産額計算書

2021年6月30日

Ⅰ	資産総額	1,736,853,673円
Ⅱ	負債総額	3,340,130円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,733,513,543円
Ⅳ	発行済数量	6,773,038,460口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.2559円

(参考) ダイワ・マネーストック・マザーファンド

前記「ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型） －ジャパン・トリプルリターンズ－ 日本円・コース（毎月分配型）」の記載と同じ。

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2021年6月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

ロ．商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

ハ．運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2　【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2021年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	47	106,733
追加型株式投資信託	747	21,024,994
株式投資信託　　合計	794	21,131,728
単位型公社債投資信託	66	193,167
追加型公社債投資信託	14	1,515,899
公社債投資信託　合計	80	1,709,066
総合計	874	22,840,794

３【委託会社等の経理状況】

１．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度（2020年４月１日から2021年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

		前事業年度 （2020年３月31日）		当事業年度 （2021年３月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		2,741		4,860
有価証券		22,167		333
前払費用		205		237
未収委託者報酬		10,847		13,150
未収収益		63		49
関係会社短期貸付金		-		18,700
その他		62		207
流動資産計		36,088		37,539
固定資産				
有形固定資産	※1	217	※1	224
建物		7		6
器具備品		209		218
無形固定資産		2,362		1,937
ソフトウェア		2,028		1,882
ソフトウェア仮勘定		333		54
投資その他の資産		15,844		16,121
投資有価証券		9,153		10,159
関係会社株式		3,972		3,705
出資金		183		183
長期差入保証金		1,069		1,068

繰延税金資産	1,431	973
その他	33	30
固定資産計	18,424	18,283
資産合計	54,512	55,822

（単位:百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	69	68
未払金	7,573	8,405
未払収益分配金	14	13
未払償還金	39	39
未払手数料	3,988	4,734
その他未払金	※2 3,530	※2 3,617
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
固定負債		
退職給付引当金	2,574	2,452
役員退職慰労引当金	88	74
その他	5	3
固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,749	10,574

利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△363	947
評価・換算差額等合計	△363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51
諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37

租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860
税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	△78	△ 109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,302	△1,302	△1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△410	△410	△410
当期変動額合計	△410	△410	△410
当期末残高	△363	△363	38,430

当事業年度（自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,564	△10,564	△10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,175	△1,175	△1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△363	△363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（１）子会社株式及び関連会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産
定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員･参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年３月31日）第３項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年２月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

（追加情報）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日）第44－２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2019年７月４日）第７-４項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（重要な会計上の見積り）
該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）
収益認識に関する会計基準等
・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年３月30日）
・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年３月30日）

(1) 概要
収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。
ステップ１：顧客との契約を識別する。
ステップ２：契約における履行義務を識別する。
ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響
当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）
（損益計算書関係）
前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。
この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。
この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

（注記に関する表示方法の変更）
「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号　2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という）が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、（重要な会計上の見積り）を開示しております。
見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第６項及び第７項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

※２　関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
未払金	3,397百万円	3,473百万円

３　保証債務

前事業年度（2020年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2021年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	１株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年６月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 ３月31日	2019年 ６月24日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2020年６月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　10,564百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,050円
④ 基準日　2020年３月31日
⑤ 効力発生日　2020年６月24日

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年６月23日定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年３月31日	2020年６月24日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年６月22日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　9,388百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,599円
④ 基準日　2021年３月31日
⑤ 効力発生日　2021年６月23日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、

株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ii）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

②信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下３つのレベルに分類しております。

レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル２の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度（2020年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額	時価	差額
投資有価証券（※１）	60	60	－
資産合計	60	60	－

（※1）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、コマーシャル・ペーパー、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

当事業年度（2021年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券（※１）	85	－	－	85
資産合計	85	－	－	85

（※１）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2020年３月31日）
　子会社株式（貸借対照表計上額　1,944百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2021年３月31日）
　子会社株式（貸借対照表計上額　1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（2020年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	60	55	5
（２）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	△764
小計	27,589	28,354	△764
合計	30,654	31,181	△526

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（2021年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	85	55	30
（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	△160
小計	2,561	2,721	△160
合計	9,826	8,474	1,352

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	△183	△ 378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

(２)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452

（３）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度181百万円、当事業年度186百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750
賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	△173	△ 254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
繰延税金負債		

連結法人間取引（譲渡益）	△159	△ 159
その他有価証券評価差額金	△71	△ 453
繰延税金負債合計	△230	△ 612
繰延税金資産の純額	1,431	973

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2020年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2021年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］
当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］
１.サービスごとの情報
単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２.地域ごとの情報
（１）営業収益
内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３.主要な顧客ごとの情報
営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）
該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]
　該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]
　該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引
（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）
　該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,300 0	関係会社短期貸付金 ―	18,700 ―

取引条件及び取引条件の決定方針等
(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は１年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,603	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等
(注) シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,727	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注）シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	―	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	―	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	―	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,061	長期差入保証金	1,054

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）

同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注4）	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	527	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

(注５)大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
１株当たり純資産額　14,732.52円	１株当たり純資産額　14,784.79円
１株当たり当期純利益　4,050.66円	１株当たり当期純利益　3,599.54円

(注１)潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,556	9,389
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５ 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2020年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	株式会社りそな銀行	279,928百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円 （2020年07月27日現在）	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行ないます。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

・使用開始日を記載することがあります。

・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

・次の事項を記載することがあります。

①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

②請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

・ファンドの形態等を記載することがあります。

・図案を採用することがあります。

・ファンドの管理番号等を記載することがあります。

・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2021年５月21日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注) １．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年7月9日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）の2020年12月9日から2021年6月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　日本円・コース（毎月分配型）の2021年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年7月9日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　豪ドル・コース（毎月分配型）の2020年12月9日から2021年6月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　豪ドル・コース（毎月分配型）の2021年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年7月9日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）の2020年12月9日から2021年6月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）の2021年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年7月9日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　米ドル・コース（毎月分配型）の2020年12月9日から2021年6月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　米ドル・コース（毎月分配型）の2021年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年7月9日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　通貨セレクト・コース（毎月分配型）の2020年12月9日から2021年6月8日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日本株ストラテジーα（通貨選択型）　－ジャパン・トリプルリターンズ－　通貨セレクト・コース（毎月分配型）の2021年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。