

ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・ マネー・ポートフォリオ

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|--|---|
| 商品分類 | ダイワ日本リート・ファンド | 追加型投信／国内／不動産投信（リート） |
| 信託期間 | 約10年間（2012年6月29日～2022年6月22日） | |
| 運用方針 | ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ | わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の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 イ、ダイワ・マネー・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券 ロ、本邦通貨表示の公社債 |
| 組入制限 | ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ | 株式組入上限比率は純資産総額の10%以下 ・マザーファンドの組入上限比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資産総額の30%以下 |
| 分配方針 | ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。基準価額の水準によっては、ポートフォリオの流動性等を考慮し、分配金額を決定する場合があります。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。 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 |

運用報告書（全体版）

第7期

（決算日 2019年6月24日）

（作成対象期間 2018年6月23日～2019年6月24日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、（ダイワ日本リート）わが国のリート（不動産投資信託）に投資し、信託財産の成長をめざすこと、（マネー・ポートフォリオ）わが国の公社債に投資し、利息収入の確保をめざすことを目的としております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

<4829>

<4830>

ダイワ日本リート・ファンド

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 東証REIT指数 (配当込み) | | 投資信託 証券 組入比率 | 不動産 投信指数 先物比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|------------|-----------|--------------------|-----------|--------------------|---------------------|-----------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (参考指数) | 期中 騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 3期末(2015年6月22日) | 16,145 | 1,300 | 18.0 | 3,194.47 | 19.2 | 97.3 | 2.0 | 6,552 |
| 4期末(2016年6月22日) | 16,330 | 200 | 2.4 | 3,300.00 | 3.3 | 95.3 | 2.6 | 5,659 |
| 5期末(2017年6月22日) | 15,473 | 400 | △ 2.8 | 3,234.16 | △ 2.0 | 98.8 | 1.1 | 4,672 |
| 6期末(2018年6月22日) | 15,797 | 500 | 5.3 | 3,433.40 | 6.2 | 98.5 | 1.4 | 3,399 |
| 7期末(2019年6月24日) | 17,346 | 600 | 13.6 | 3,935.17 | 14.6 | 98.4 | 1.5 | 2,891 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注3) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期 首：15,797円

期 末：17,346円（分配金600円）

騰落率：13.6%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

わが国のリート（不動産投資信託）市場全体の中長期的な動きを捉える投資成果をめざして運用を行った結果、国内リート市況が上昇したことを反映して、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ日本リート・ファンド

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東証REIT指数 (配当込み) | | 投資信託 証 券 組入比率 | 不 動 産 投信指数 先物比率 |
|----------------|---------|-------|--------------------|-------|---------------------|-----------------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | |
| (期首)2018年6月22日 | 15,797 | — | 3,433.40 | — | 98.5 | 1.4 |
| 6月末 | 15,875 | 0.5 | 3,450.92 | 0.5 | 98.5 | 1.4 |
| 7月末 | 15,947 | 0.9 | 3,468.88 | 1.0 | 98.4 | 1.5 |
| 8月末 | 15,884 | 0.6 | 3,457.71 | 0.7 | 98.4 | 1.5 |
| 9月末 | 16,129 | 2.1 | 3,513.39 | 2.3 | 98.4 | 1.5 |
| 10月末 | 15,871 | 0.5 | 3,459.73 | 0.8 | 98.1 | 1.6 |
| 11月末 | 16,549 | 4.8 | 3,610.49 | 5.2 | 98.3 | 1.6 |
| 12月末 | 16,231 | 2.7 | 3,543.83 | 3.2 | 98.2 | 1.6 |
| 2019年1月末 | 16,973 | 7.4 | 3,709.11 | 8.0 | 98.0 | 1.7 |
| 2月末 | 17,049 | 7.9 | 3,728.00 | 8.6 | 98.2 | 1.7 |
| 3月末 | 17,600 | 11.4 | 3,851.10 | 12.2 | 98.3 | 1.7 |
| 4月末 | 17,460 | 10.5 | 3,822.76 | 11.3 | 98.2 | 1.8 |
| 5月末 | 17,749 | 12.4 | 3,889.57 | 13.3 | 98.3 | 1.8 |
| (期末)2019年6月24日 | 17,946 | 13.6 | 3,935.17 | 14.6 | 98.4 | 1.5 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2018. 6. 23 ~ 2019. 6. 24)

国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、オフィス市況など事業環境の良好さが継続していることや、日本の長期金利が低位安定推移となったことなどを背景に、上昇しました。2018年7月以降は、公募増資による需給悪化や、日銀の金融政策調整観測からの長期金利上昇などを受けて、軟調な推移となりました。11月に入ると国内長期金利が低下したことなどを背景に上昇しましたが、12月は米中貿易摩擦懸念の高まりで一時的に下落する局面もあり、不安定な動きとなりました。2019年に入ると、公募増資等のエクイティ調達の実績が発表されたものの、米国金融政策の軟化などにより国内株式市場が反発したことや、今後の国内外での金利上昇懸念が後退したことが好感され、当作成期末にかけて上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、わが国のリート市場全体の中長期的な動きを捉える投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ポートフォリオについて

(2018. 6. 23 ~ 2019. 6. 24)

わが国のリート市場全体の中長期的な動きを捉える投資成果をめざして、各銘柄の時価総額構成比に基づきポートフォリオを構築しました。

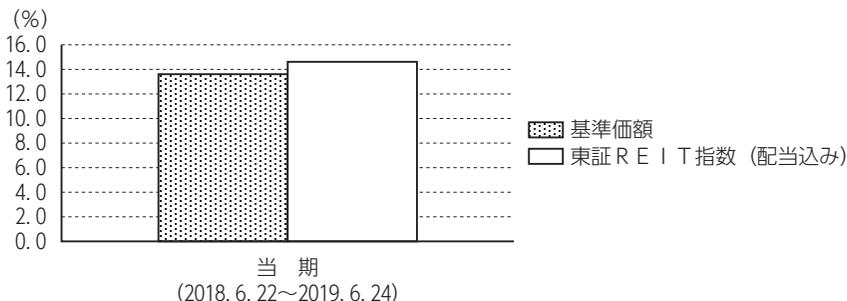
リートの実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）は、当作成期を通じて95%以上を維持しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

参考指数の騰落率は14.6%となった一方で、当ファンドの基準価額の騰落率は13.6%となりました。



分配金について

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

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

| 項目 | 当期 | |
|-------------------|---------------------------|------------|
| | 2018年6月23日 ～2019年6月24日 | |
| 当期分配金（税込み） | (円) | 600 |
| 対基準価額比率 | (%) | 3.34 |
| 当期の収益 | (円) | 600 |
| 当期の収益以外 | (円) | — |
| 翌期繰越分配対象額 | (円) | 7,345 |

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

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

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

収益分配金の計算過程（1万口当り）

| 項目 | 当期 |
|-----------------------------|-----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | ✓ 618.77円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 956.28 |
| (c) 収益調整金 | 5,634.12 |
| (d) 分配準備積立金 | 736.62 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 7,945.81 |
| (f) 分配金 | 600.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 7,345.81 |

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

当ファンドの運用方針に基づき、わが国のリート市場全体の中長期的な動きを捉える投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 (2018. 6. 23~2019. 6. 24) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|----------------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 142円 | 0.858% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,604円です。 |
| (投 信 会 社) | (63) | (0.380) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| (販 売 会 社) | (72) | (0.434) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受 託 銀 行) | (7) | (0.043) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.001 | 売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| 有 価 証 券 取 引 税 | — | — | 有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| そ の 他 費 用 | 1 | 0.005 | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数 |
| (監 査 費 用) | (1) | (0.005) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 144 | 0.864 | |

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

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

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| | 買付 | | 売付 | |
|----|-------|---------|----------------|------------------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内 | 1.979 | 230,415 | (6.11395 —) | (1,020,375 —) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 国内 不動産投信指数 先物取引 | 291 | 304 | — | — |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| 買 付 | 当 期 | | | 売 付 | 当 期 | | | |
|------------------|-----|-------|--------|---------|-----------------|-------|--------|---------|
| | 銘 柄 | □ 数 | 金 額 | | 平均単価 | 銘 柄 | □ 数 | 金 額 |
| | | 千口 | 千円 | 円 | | 千口 | 千円 | 円 |
| GLP投資法人 | | 0.149 | 16,931 | 113,635 | 日本ビルファンド | 0.116 | 79,030 | 681,296 |
| 大和ハウスリート投資法人 | | 0.061 | 15,824 | 259,412 | ジャパンリアルエステイト | 0.117 | 71,727 | 613,058 |
| インヴィンシブル投資法人 | | 0.282 | 13,901 | 49,294 | 野村不動産マスターF | 0.346 | 53,639 | 155,026 |
| API投資法人 | | 0.023 | 10,799 | 469,536 | 日本リテールファンド | 0.222 | 47,116 | 212,237 |
| 積水ハウス・リート投資 | | 0.127 | 9,700 | 76,379 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 0.257 | 44,891 | 174,676 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | | 0.121 | 9,534 | 78,797 | オリックス不動産投資 | 0.231 | 42,101 | 182,259 |
| 野村不動産マスターF | | 0.06 | 9,123 | 152,063 | 日本プロロジスリート | 0.156 | 36,085 | 231,314 |
| 日本プロロジスリート | | 0.037 | 8,864 | 239,586 | 大和ハウスリート投資法人 | 0.139 | 35,492 | 255,342 |
| 投資法人みらい | | 0.045 | 8,499 | 188,880 | アドバンス・レジデンス | 0.108 | 32,452 | 300,483 |
| 三井不動産パーク | | 0.023 | 8,029 | 349,104 | 日本プライムリアルティ | 0.074 | 31,538 | 426,198 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) 当作成期中の利害関係人との取引状況

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | 期 | | |
|-----------------|-----------|------------------------|-----|-----------|------------------------|-----|
| | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 230 | — | — | 1,020 | 90 | 8.9 |
| 不動産投信指 数先物取引 | 291 | — | — | 304 | — | — |
| コール・ローン | 8,109 | — | — | — | — | — |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| 種 類 | 当 期 | | 期末保有額 |
|--------|-------|-------|-------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | |
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 投資信託証券 | 4 | 17 | 53 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| 種 類 | 当 期 | |
|--------|-----|-----------|
| | 買 | 付 額 |
| 投資信託証券 | | 百万円 30 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表

(1) 国内投資信託証券

| 銘 柄 | 期 首 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|---------|-------|-----|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千口 | 千円 |
| エスコンジャパンリート | — | 0.03 | | 3,234 |
| サンケイリアルエステート | — | 0.029 | | 3,308 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 0.135 | 0.097 | | 57,909 |
| MCUBS MidCity投資法人 | 0.452 | 0.33 | | 34,287 |
| 森ヒルズリート | 0.435 | 0.336 | | 50,702 |
| 産業ファンド | 0.471 | 0.36 | | 47,952 |
| アドバンス・レジデンス | 0.375 | 0.286 | | 90,233 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 0.206 | 0.181 | | 34,009 |
| API投資法人 | 0.183 | 0.154 | | 71,610 |
| GLP投資法人 | 0.841 | 0.727 | | 87,312 |
| コンフォリア・レジデンシャル | 0.154 | 0.122 | | 37,088 |
| 日本プロロジスリート | 0.54 | 0.421 | | 104,955 |
| 星野リゾート・リート | 0.064 | 0.045 | | 24,705 |
| Oneリート投資法人 | 0.044 | 0.043 | | 12,022 |
| イオンリート投資 | 0.385 | 0.301 | | 41,116 |
| ヒューリックリート投資法 | 0.275 | 0.237 | | 44,153 |
| 日本リート投資法人 | 0.109 | 0.095 | | 40,517 |
| インベスコ・オフィス・Jリート | 2.388 | 1.788 | | 32,541 |
| 日本ヘルスケア投資法 | 0.02 | 0.013 | | 2,275 |
| 積水ハウス・リート投資 | 1.01595 | 0.858 | | 68,897 |
| トーセイ・リート投資法人 | 0.065 | 0.056 | | 6,524 |
| ケネディクス商業リート | 0.147 | 0.107 | | 28,258 |
| ヘルスケア&メディカル投資 | 0.05 | 0.061 | | 7,716 |
| サムティ・レジデンシャル | 0.07 | 0.059 | | 6,490 |
| 野村不動産マスターF | 1.199 | 0.913 | | 149,092 |
| いちごホテルリート投資 | 0.063 | 0.051 | | 6,431 |
| ラサールロジポート投資 | 0.306 | 0.242 | | 30,613 |
| スターアジア不動産投 | 0.095 | 0.091 | | 10,792 |
| マリモ地方創生リート | 0.032 | 0.025 | | 3,060 |
| 三井不ロジパーク | 0.077 | 0.071 | | 25,666 |

| 銘 柄 | 期 首 | 当 期 末 | |
|-------------------|---------------|----------|-----------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千□ | 千□ | 千円 |
| 大江戸温泉リート | 0.068 | 0.047 | 3,933 |
| さくら総合リート | 0.097 | 0.063 | 5,802 |
| 投資法人みらい | 0.059 | 0.316 | 15,989 |
| 森トラスト・ホテルリート投 | 0.088 | 0.069 | 9,584 |
| 三菱地所物流 REIT | 0.038 | 0.031 | 8,540 |
| CRE ロジスティクスファンド | 0.041 | 0.029 | 3,471 |
| ザイマックス・リート | 0.037 | 0.027 | 3,412 |
| タカラレーベン不動産投 | — | 0.044 | 4,422 |
| 伊藤忠アドバンスロジ | — | 0.045 | 4,518 |
| 日本ビルファンド | 0.392 | 0.284 | 214,704 |
| ジャパンリアルエステイト | 0.403 | 0.293 | 192,794 |
| 日本リテールファンド | 0.765 | 0.554 | 119,941 |
| オリックス不動産投資 | 0.804 | 0.584 | 114,989 |
| 日本プライムリアルティ | 0.256 | 0.186 | 90,210 |
| プレミア投資法人 | 0.366 | 0.279 | 39,478 |
| 東急リアル・エステート | 0.272 | 0.197 | 36,602 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 0.257 | 0.203 | 26,978 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 0.894 | 0.658 | 118,374 |
| 森トラスト総合リート | 0.29 | 0.21 | 36,645 |
| インヴィンシブル投資法人 | 1.112 | 1.012 | 59,606 |
| フロンティア不動産投資 | 0.138 | 0.1 | 47,650 |
| 平和不動産リート | 0.252 | 0.183 | 22,838 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 0.27 | 0.192 | 47,328 |
| 福岡リート投資法人 | 0.21 | 0.152 | 26,417 |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 0.125 | 0.091 | 70,161 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 0.314 | 0.243 | 24,664 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 0.087 | 0.068 | 53,584 |
| 阪急阪神リート投資法人 | 0.177 | 0.132 | 19,681 |
| スタートアップリート投資法人 | 0.064 | 0.046 | 8,054 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 0.472 | 0.394 | 100,470 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 1.17 | 0.944 | 81,561 |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 0.456 | 0.33 | 27,489 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 0.362 | 0.263 | 42,895 |
| 合 計 | □ 数、金 額 | 20.53295 | 2,846,270 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 59 銘柄 | <98.4%> |

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

| 銘 柄 別 | 当 期 末 | |
|--------|-------|-------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国 内 | 百万円 | 百万円 |
| 東証REIT | 42 | — |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|--------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託証券 | 2,846,270 千円 | 94.4 % |
| コール・ローン等、その他 | 170,433 | 5.6 |
| 投資信託財産総額 | 3,016,704 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------------|
| (A) 資産 | 3,053,676,341円 |
| コール・ローン等 | 60,442,705 |
| 投資信託証券 (評価額) | 2,846,270,600 |
| 未収入金 | 95,601,447 |
| 未収配当金 | 14,389,789 |
| 差入委託証拠金 | 36,971,800 |
| (B) 負債 | 162,179,561 |
| 未払金 | 859,096 |
| 未払収益分配金 | 100,018,248 |
| 未払解約金 | 11,424,063 |
| 未払信託報酬 | 12,760,178 |
| 差入委託証拠金代用有価証券 | 37,036,000 |
| その他未払費用 | 81,976 |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 2,891,496,780 |
| 元本 | 1,666,970,810 |
| 次期繰越損益金 | 1,224,525,970 |
| (D) 受益権総口数 | 1,666,970,810口 |
| 1万口当り基準価額 (C / D) | 17,346円 |

* 期首における元本額は2,152,242,112円、当作成期間中における追加設定元本額は50,578,982円、同解約元本額は535,850,284円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,346円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月23日 至 2019年6月24日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------------|----------------------|
| (A) 配当等収益 | 110,947,356円 |
| 受取配当金 | 110,972,689 |
| 受取利息 | 5 |
| その他収益金 | 6 |
| 支払利息 | △ 25,344 |
| (B) 有価証券売買損益 | 266,070,327 |
| 売買益 | 310,797,298 |
| 売買損 | △ 44,726,971 |
| (C) 先物取引等損益 | 5,683,784 |
| 取引益 | 6,785,179 |
| 取引損 | △ 1,101,395 |
| (D) 信託報酬等 | △ 26,903,241 |
| (E) 当期損益金 (A + B + C + D) | 355,798,226 |
| (F) 前期繰越損益金 | 29,554,442 |
| (G) 追加信託差損益金 | 939,191,550 |
| (配当等相当額) | (408,981,638) |
| (売買損益相当額) | (530,209,912) |
| (H) 合計 (E + F + G) | 1,324,544,218 |
| (I) 収益分配金 | △ 100,018,248 |
| 次期繰越損益金 (H + I) | 1,224,525,970 |
| 追加信託差損益金 | 939,191,550 |
| (配当等相当額) | (408,981,638) |
| (売買損益相当額) | (530,209,912) |
| 分配準備積立金 | 285,334,420 |

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 103,148,106円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 159,410,656 |
| (c) 収益調整金 | 939,191,550 |
| (d) 分配準備積立金 | 122,793,906 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 1,324,544,218 |
| (f) 分配金 | 100,018,248 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 1,224,525,970 |
| (h) 受益権総口数 | 1,666,970,810口 |

| | |
|----------------------------|-------------|
| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ | |
| 1 万 口 当 り 分 配 金 | 600円 |

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

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%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を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・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。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・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。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | 公社債組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|---------------|-------|-------|---------|------|
| | | 税金分配金 | 期中騰落率 | | |
| | 円 | 円 | % | % | 百万円 |
| 3期末(2015年6月22日) | 10,010 | 0 | 0.0 | 37.6 | 108 |
| 4期末(2016年6月22日) | 10,009 | 0 | △ 0.0 | 0.3 | 229 |
| 5期末(2017年6月22日) | 10,003 | 0 | △ 0.1 | 0.5 | 149 |
| 6期末(2018年6月22日) | 9,996 | 0 | △ 0.1 | — | 87 |
| 7期末(2019年6月24日) | 9,988 | 0 | △ 0.1 | — | 99 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

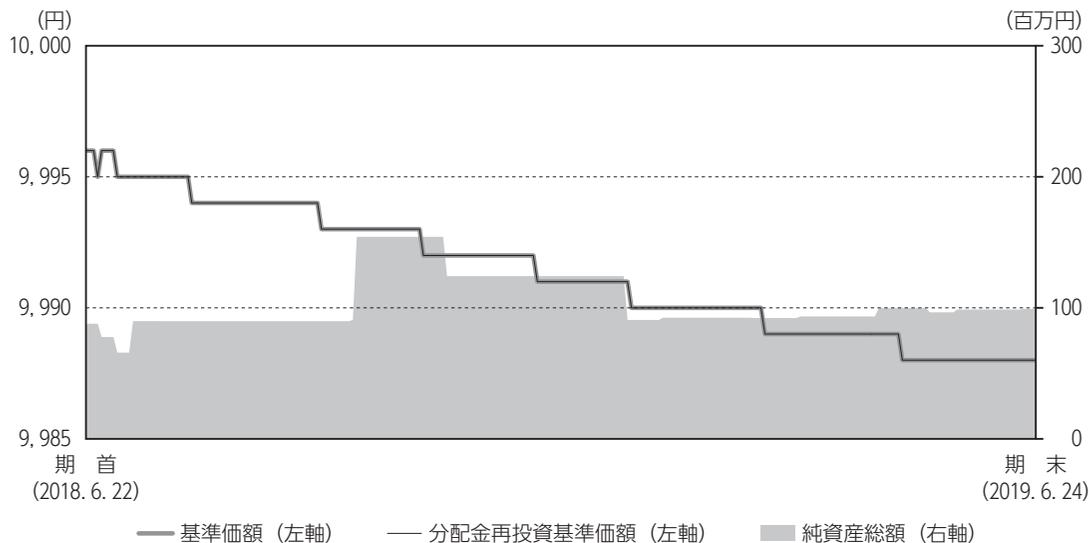
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注4) 当ファンドは、スイッチングにより一時滞留させる受け皿としての役割をもったファンドであり、わが国の現物公社債等を中心に、安定運用を行ないます。そのため、ベンチマークおよび参考指数はありません。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：9,996円

期末：9,988円（分配金 0円）

騰落率：△0.1%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券を通じて投資した短期の国債やコール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ

| 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 公社債組入比率 |
|----------------|-------|-------|--|---------|
| | | 騰 落 率 | | |
| (期首)2018年6月22日 | 円 | % | | % |
| | 9,996 | — | | — |
| 6月末 | 9,996 | 0.0 | | — |
| 7月末 | 9,995 | △ 0.0 | | — |
| 8月末 | 9,994 | △ 0.0 | | — |
| 9月末 | 9,993 | △ 0.0 | | — |
| 10月末 | 9,992 | △ 0.0 | | — |
| 11月末 | 9,992 | △ 0.0 | | — |
| 12月末 | 9,991 | △ 0.1 | | — |
| 2019年1月末 | 9,990 | △ 0.1 | | — |
| 2月末 | 9,990 | △ 0.1 | | — |
| 3月末 | 9,989 | △ 0.1 | | — |
| 4月末 | 9,989 | △ 0.1 | | — |
| 5月末 | 9,988 | △ 0.1 | | — |
| (期末)2019年6月24日 | 9,988 | △ 0.1 | | — |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2018. 6. 23 ~ 2019. 6. 24)

国内短期金融市況

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が維持される中、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

ダイワ・マネー・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2018. 6. 23 ~ 2019. 6. 24)

当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目 | 当 期 | |
|------------|---------------------------|---|
| | 2018年6月23日 ～2019年6月24日 | |
| 当期分配金（税込み） | （円） | — |
| 対基準価額比率 | （％） | — |
| 当期の収益 | （円） | — |
| 当期の収益以外 | （円） | — |
| 翌期繰越分配対象額 | （円） | 9 |

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



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

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

上記の運用方針により、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資する場合があります。今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご留意くださいますようお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 (2018. 6. 23~2019. 6. 24) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|----------------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | —円 | —% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,991円です。 |
| 売 買 委 託 手 数 料 | — | — | 売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| 有 価 証 券 取 引 税 | — | — | 有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| そ の 他 費 用 | 1 | 0.009 | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.000) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (1) | (0.009) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 1 | 0.009 | |

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|-----------------|---------|---------|--------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 123,457 | 125,709 | 86,873 | 88,447 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | |
|-------------------|------------|------------------------|------|-----------|------------------------|-----|
| | 買付額等 A | うち利害 関係人との 取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害 関係人との 取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 1,030 | 350 | 34.0 | — | — | — |
| コール・ローン | 17,936,285 | — | — | — | — | — |
| 現先取引 (その他有価証券) | 241,999 | — | — | 241,999 | — | — |

(注) 平均保有割合0.1%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | 当 期 末 | |
|-----------------|--------|--------|--------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 60,382 | 96,967 | 98,683 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年6月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------|--------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 98,683 | 99.5 |
| コール・ローン等、その他 | 497 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 99,180 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年6月24日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-------------|
| (A) 資産 | 99,180,782円 |
| コール・ローン等 | 497,073 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額) | 98,683,709 |
| (B) 負債 | 2,180 |
| 未払解約金 | 1,996 |
| その他未払費用 | 184 |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 99,178,602 |
| 元本 | 99,294,086 |
| 次期繰越損益金 | △ 115,484 |
| (D) 受益権総口数 | 99,294,086口 |
| 1万口当り基準価額 (C/D) | 9,988円 |

* 期首における元本額は87,888,784円、当作成期間中における追加設定元本額は100,369,134円、同解約元本額は88,963,832円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,988円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は115,484円です。

■損益の状況

当期 自 2018年6月23日 至 2019年6月24日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------------|------------------|
| (A) 配当等収益 | △ 670円 |
| 受取利息 | 251 |
| 支払利息 | △ 921 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 54,662 |
| 売買益 | 18,854 |
| 売買損 | △ 73,516 |
| (C) 信託報酬等 | △ 701 |
| (D) 当期繰越損益金 (A + B + C) | △ 56,033 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 25,165 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 34,286 |
| (配当等相当額) | (89,793) |
| (売買損益相当額) | (△ 124,079) |
| (G) 合計 (D + E + F) | △ 115,484 |
| 次期繰越損益金 (G) | △ 115,484 |
| 追加信託差損益金 | △ 34,286 |
| (配当等相当額) | (89,793) |
| (売買損益相当額) | (△ 124,079) |
| 分配準備積立金 | 2,914 |
| 繰越損益金 | △ 84,112 |

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 89,793 |
| (d) 分配準備積立金 | 2,914 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 92,707 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 92,707 |
| (h) 受益権総口数 | 99,294,086口 |

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA (ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

ダイワ・マネー・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ）が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2018年12月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2019年6月24日）現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を21ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄

公 社 債

(2018年6月23日から2019年6月24日まで)

| 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------|---------|-----|-----|
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 |
| | 千円 | | 千円 |
| 757 国庫短期証券 2018/8/13 | 400,002 | | |
| 801 国庫短期証券 2019/3/18 | 350,004 | | |
| 731 国庫短期証券 2018/7/10 | 280,000 | | |

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2019年6月24日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（65,073,542千円）の内容です。

国内その他有価証券

| | 2019年6月24日現在 | |
|---------|--------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内短期社債等 | 999,998 | <1.5> |

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第14期 (決算日 2018年12月10日)

(作成対象期間 2017年12月12日～2018年12月10日)

ダイワ・マネー・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

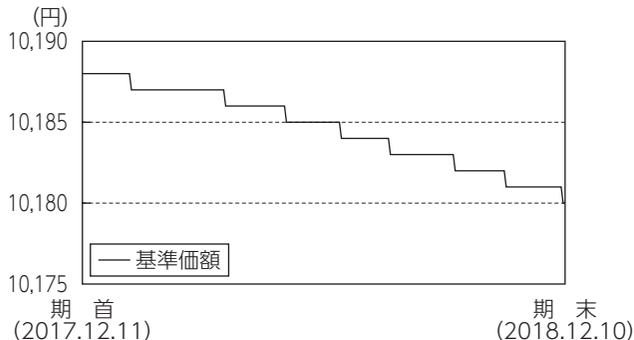
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



| 年 月 日 | 基準 価 額 | | 公 社 債 組 入 比 率 |
|-----------------|--------|-------|---------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | |
| (期首)2017年12月11日 | 円 | % | % |
| 12月末 | 10,188 | 0.0 | - |
| 2018年1月1月末 | 10,187 | △0.0 | - |
| 2月末 | 10,187 | △0.0 | 0.5 |
| 3月末 | 10,186 | △0.0 | - |
| 4月末 | 10,186 | △0.0 | - |
| 5月末 | 10,185 | △0.0 | - |
| 6月末 | 10,184 | △0.0 | - |
| 7月末 | 10,184 | △0.0 | - |
| 8月末 | 10,183 | △0.0 | - |
| 9月末 | 10,182 | △0.1 | - |
| 10月末 | 10,181 | △0.1 | - |
| 11月末 | 10,181 | △0.1 | - |
| (期末)2018年12月10日 | 10,180 | △0.1 | - |

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
 (注3) 当ファンドは、利息収入の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,188円 期末：10,180円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

マイナス金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

当作成期首より、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持し、2018年7月には金融緩和継続のための枠組み強化を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行います。

◆ポートフォリオについて

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・ローン等による運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|----------|
| 売買委託手数料 | —円 |
| 有価証券取引税 | — |
| その他費用 (その他) | 1 (1) |
| 合 計 | 1 |

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
 (注2) 項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2017年12月12日から2018年12月10日まで)

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|------|---------|-----------|
| 国 | | 千円 | 千円 |
| 内 | 国債証券 | 890,004 | (890,000) |

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
 (注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
 (注3) 単位未満は切捨て。

(2) その他有価証券

(2017年12月12日から2018年12月10日まで)

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|---------|-------------|--------------------|
| 国 | | 千円 | 千円 |
| 内 | 国内短期社債等 | 245,999,587 | 245,999,594 () |

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
 (注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年12月12日から2018年12月10日まで)

| 当 期 | | 期 | |
|----------------------|---------|---|-------|
| 買 | 付 | 売 | 付 |
| 銘 | 柄 金 額 | 銘 | 柄 金 額 |
| | 千円 | | 千円 |
| 757 国庫短期証券 2018/8/13 | 400,002 | | |
| 731 国庫短期証券 2018/7/10 | 280,000 | | |
| 723 国庫短期証券 2018/3/5 | 210,001 | | |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
国内その他有価証券

| | 当 期 | 末 |
|---------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内短期社債等 | 999,997 | <1.2> |

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

■投資信託財産の構成

2018年12月10日現在

| 項 目 | 当 期 | 末 |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| コール・ローン等、その他 | 80,270,040 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 80,270,040 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年12月10日現在

| 項 目 | 当 期 | 末 |
|------------------|-----------------|---|
| (A) 資産 | 80,270,040,211円 | |
| コール・ローン等 | 79,270,042,938 | |
| 現先取引(その他有価証券) | 999,997,273 | |
| (B) 負債 | 241,522,286 | |
| 未払解約金 | 240,343,000 | |
| その他未払費用 | 1,179,286 | |
| (C) 純資産総額(A - B) | 80,028,517,925 | |
| 元本 | 78,610,288,449 | |
| 次期繰越損益金 | 1,418,229,476 | |
| (D) 受益権総口数 | 78,610,288,449口 | |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 10,180円 | |

* 期首における元本額は68,390,547,168円、当作成期間中における追加設定元本額は259,276,972,092円、同解約元本額は249,057,230,811円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・グローバルIOT関連株ファンド -A I 新時代- (為替ヘッジあり) 977,694円、ダイワ・グローバルIOT関連株ファンド -A I 新時代- (為替ヘッジなし) 977,694円、ダイワF Eグローバル・バリュ- (為替ヘッジあり) 98,069円、ダイワF Eグローバル・バリュ- (為替ヘッジなし) 98,069円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり) 49,107円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし) 49,107円、ダイワ/ "R I C I"*

コモディティ・ファンド5,024,392円、U S 債券NB戦略ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型) 1,676円、U S 債券NB戦略ファンド (為替ヘッジなし/年1回決算型) 1,330円、スマート・アロケーション・Dガード53,768,983円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>米ドルコース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>円コース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>世界通貨分散コース981円、堅実バランスファンド -ハジメの歩- 327,110,605円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/隔月分配型) 180,729円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/隔月分配型) 737,649円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/資産成長型) 95,276円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型) 337,885円、D Cダイワ・マネー・ポートフォリオ3,941,012,171円、ダイワファンドクラブ コモディティセレクト317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 日本円・コース (毎月分配型) 132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型) 643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型) 12,784円、ダイワ/フィデリティ北米株式ファンド -パラダイムシフト- 9,853,995円、低リスク型アロケーションファンドII (適格機関投資家専用) 13,743,005,794円、プルベア・マネー・ポートフォリオV 18,757,636,566円、プル3倍日本株ポートフォリオV 39,796,042,643円、ベア2倍日本株ポートフォリオV 1,364,716,363円、ダイワF Eグローバル・バリュ-株ファンド (ダイワSMA専用) 4,090,590円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 155,317円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型) 38,024円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 米ドル・コース (毎月分配型) 4,380円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型) 22,592円、ダイワ/アムンディ食糧増産関連ファンド164,735円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ121,376,415円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース) 33,689円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース) 96,254円、ダイワ・ダブルバランス・ファンド (Dガード付/部分為替ヘッジあり) 145,491,182円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジあり) 988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジなし) 4,926,018円、ダイワ米国ML Pファンド (毎月分配型) 米ドルコース285,029円、ダイワ米国ML Pファンド (毎月分配型) 日本円コース144,570円、ダイワ米国ML Pファンド (毎月分配型) 通貨αコース677,850円、ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型) 98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ1,747,902円、D Cスマート・アロケーション・Dガード4,510,003円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 南アフリカ・ランド・コース (毎月分配型) 1,097円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース (毎月分配型) 2,690円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 1,350円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 通貨αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース98,202円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ-通貨セレクト・コース (毎月分配型) 98,174円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,180円です。

ダイワ・マネー・マザーファンド

■損益の状況

当期 自2017年12月12日 至2018年12月10日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|----------------|
| (A) 配当等収益 | △ 53,286,101円 |
| 受取利息 | 18,213 |
| 支払利息 | △ 53,304,314 |
| (B) その他費用 | △ 8,395,849 |
| (C) 当期損益金(A + B) | △ 61,681,950 |
| (D) 前期繰越損益金 | 1,286,098,991 |
| (E) 解約差損益金 | △4,593,187,480 |
| (F) 追加信託差損益金 | 4,786,999,915 |
| (G) 合計(C + D + E + F) | 1,418,229,476 |
| 次期繰越損益金(G) | 1,418,229,476 |

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

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