

# ダイワ世界リート・ファンド (毎月分配型)

## 運用報告書 (全体版)

第166期 (決算日 2021年4月15日)  
第167期 (決算日 2021年5月17日)  
第168期 (決算日 2021年6月15日)  
第169期 (決算日 2021年7月15日)  
第170期 (決算日 2021年8月16日)  
第171期 (決算日 2021年9月15日)

(作成対象期間 2021年3月16日～2021年9月15日)

■信託期間終了日を

2022年6月15日から2027年9月15日に変更しました。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/不動産投信 (リート)	
信託期間	約20年3カ月間 (2007年6月8日～2027年9月15日)	
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ世界リート・マザーファンドの受益証券
	ダイワ世界リート・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場 (上場予定を含みます。) および店頭登録 (登録予定を含みます。) の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。3、6、9、12月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配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、分配を行わないことがあります。	

## 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外のリート (不動産投資信託) に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本、円換算)		投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率		
142期末(2019年4月15日)	円 10,458	円 10	% 2.2	14,991	% 2.5	% 90.9	百万円 11,601
143期末(2019年5月15日)	10,128	10	△ 3.1	14,492	△ 3.3	91.0	11,106
144期末(2019年6月17日)	10,232	10	1.1	14,665	1.2	91.2	11,112
145期末(2019年7月16日)	10,353	10	1.3	14,728	0.4	92.0	11,091
146期末(2019年8月15日)	9,825	10	△ 5.0	14,168	△ 3.8	93.8	10,423
147期末(2019年9月17日)	10,324	10	5.2	15,014	6.0	92.9	10,840
148期末(2019年10月15日)	10,656	10	3.3	15,333	2.1	94.8	11,077
149期末(2019年11月15日)	10,772	10	1.2	15,297	△ 0.2	96.8	10,951
150期末(2019年12月16日)	10,611	300	1.3	15,146	△ 1.0	96.0	10,617
151期末(2020年1月15日)	10,987	10	3.6	15,689	3.6	95.6	11,454
152期末(2020年2月17日)	11,505	10	4.8	16,457	4.9	95.5	12,730
153期末(2020年3月16日)	8,822	10	△ 23.2	12,465	△ 24.3	91.3	9,878
154期末(2020年4月15日)	8,712	10	△ 1.1	11,947	△ 4.2	93.4	9,760
155期末(2020年5月15日)	8,072	10	△ 7.2	10,676	△ 10.6	92.3	9,022
156期末(2020年6月15日)	9,278	10	15.1	12,522	17.3	94.7	10,460
157期末(2020年7月15日)	9,260	10	△ 0.1	12,143	△ 3.0	94.8	10,611
158期末(2020年8月17日)	9,783	10	5.8	12,695	4.6	95.3	11,225
159期末(2020年9月15日)	9,780	10	0.1	12,730	0.3	94.8	11,224
160期末(2020年10月15日)	9,730	10	△ 0.4	12,627	△ 0.8	93.9	11,213
161期末(2020年11月16日)	10,363	10	6.6	13,425	6.3	96.6	11,871
162期末(2020年12月15日)	10,435	10	0.8	13,368	△ 0.4	95.7	11,697
163期末(2021年1月15日)	10,601	10	1.7	13,555	1.4	96.3	11,800
164期末(2021年2月15日)	10,867	10	2.6	14,371	6.0	95.9	12,021
165期末(2021年3月15日)	10,854	410	3.7	15,374	7.0	95.0	11,993
166期末(2021年4月15日)	11,257	10	3.8	15,777	2.6	94.1	12,630
167期末(2021年5月17日)	11,664	10	3.7	16,323	3.5	93.2	13,274
168期末(2021年6月15日)	10,859	1,610	6.9	17,803	9.1	92.1	12,283
169期末(2021年7月15日)	10,735	10	△ 1.0	17,716	△ 0.5	88.6	12,701
170期末(2021年8月16日)	10,940	10	2.0	17,923	1.2	92.5	12,893
171期末(2021年9月15日)	10,504	290	△ 1.3	17,859	△ 0.4	89.9	12,480

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本、円換算) は、S & P先進国REIT指数 (除く日本、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。S & P先進国REIT指数 (除く日本、米ドルベース) の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

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

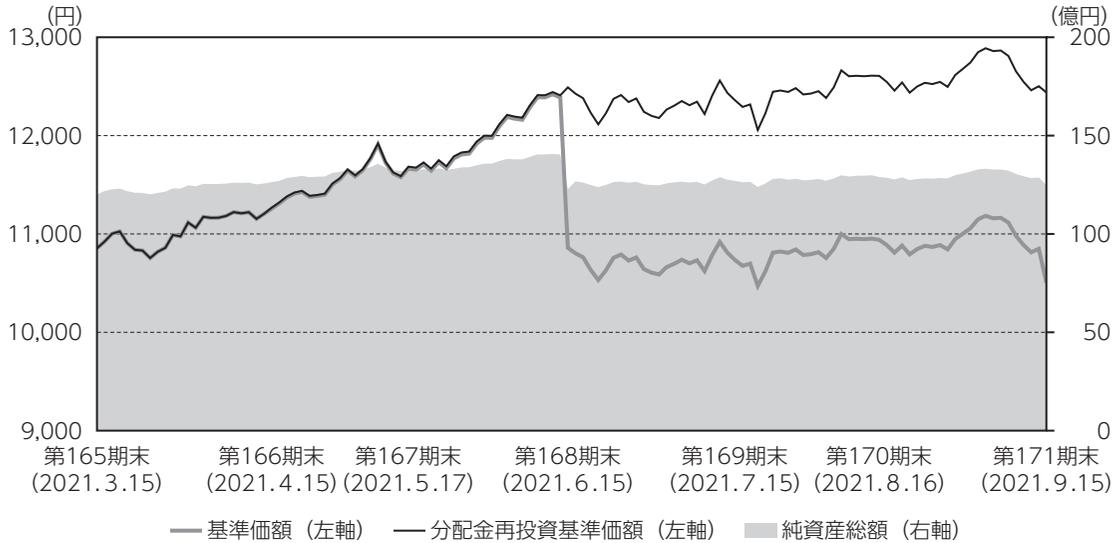
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 投資信託証券組入比率は、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。



## 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

第166期首：10,854円

第171期末：10,504円（既払分配金1,940円）

騰落率：14.6%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

海外リート市況が上昇したことや為替相場がおおむね円安に推移したことがともにプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ世界リート・ファンド（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本、円換算) (参考指数)		投資信託証券 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %	騰 落 率 %	騰 落 率 %	
第166期	(期首) 2021年3月15日	10,854	—	15,374	—	95.0
	3月末	11,116	2.4	15,678	2.0	93.7
	(期末) 2021年4月15日	11,267	3.8	15,777	2.6	94.1
第167期	(期首) 2021年4月15日	11,257	—	15,777	—	94.1
	4月末	11,645	3.4	16,421	4.1	92.8
	(期末) 2021年5月17日	11,674	3.7	16,323	3.5	93.2
第168期	(期首) 2021年5月17日	11,664	—	16,323	—	93.2
	5月末	11,979	2.7	16,798	2.9	93.5
	(期末) 2021年6月15日	12,469	6.9	17,803	9.1	92.1
第169期	(期首) 2021年6月15日	10,859	—	17,803	—	92.1
	6月末	10,607	△2.3	17,330	△2.7	88.1
	(期末) 2021年7月15日	10,745	△1.0	17,716	△0.5	88.6
第170期	(期首) 2021年7月15日	10,735	—	17,716	—	88.6
	7月末	10,786	0.5	17,782	0.4	88.8
	(期末) 2021年8月16日	10,950	2.0	17,923	1.2	92.5
第171期	(期首) 2021年8月16日	10,940	—	17,923	—	92.5
	8月末	11,002	0.6	18,153	1.3	92.3
	(期末) 2021年9月15日	10,794	△1.3	17,859	△0.4	89.9

(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**

(2021.3.16~2021.9.15)

**■海外リート市況**

海外リート市況はおおむね上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より2021年7月末にかけて、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済正常化期待や好調な決算発表、米国長期金利の低下などが支援材料となり、上昇しました。その後8月から当作成期末にかけては、米国長期金利の安定や景気回復期待の高まり、良好な業績見通しなどは支援材料となったものの、中国当局の不動産規制などが懸念され、おおむね横ばいの推移となりました。

**■為替相場**

為替相場はおおむね円安となりました。

為替相場は、当作成期首より2021年6月末にかけて、世界的に新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で、米国での追加経済政策の成立や経済指標の改善によりリスク選好度が強まり、円安に推移しました。2021年7月から当作成期末にかけては、米国などで新規感染者数が増加したことによって景気回復への不透明感が高まり、やや円高に推移しました。

**前作成期末における「今後の運用方針」****■当ファンド**

主要投資対象である「ダイワ世界リート・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持する方針です。

**■ダイワ世界リート・マザーファンド**

北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域にほぼ均等に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。今後の運用方針としては、国・地域別の配分では大きなリスクを取らず、個別銘柄選択を重視した運用とする方針です。また、外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行っていきます。

※C&S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

## ポートフォリオについて

(2021.3.16~2021.9.15)

### ■当ファンド

主要投資対象である「ダイワ世界リート・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持しました。

### ■ダイワ世界リート・マザーファンド

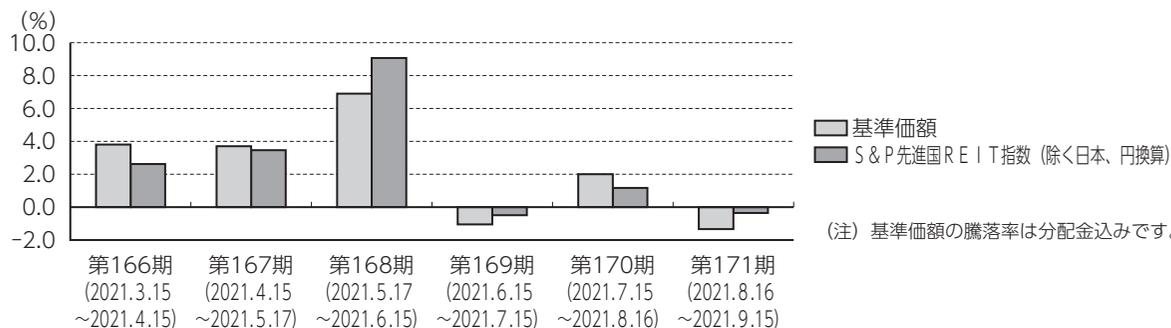
海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートを主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長をめざし、北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域にほぼ均等に投資を行いました。外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、保有不動産の価値などと比較して魅力的であると判断される銘柄を中心に分散投資を行いました。銘柄選択は、C&Sが独自の評価方法によって魅力的であると判断した銘柄を、マクロ経済分析やポートフォリオ全体のバランスを考慮しながら組み入れました。

## 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（S&P先進国REIT指数（除く日本、円換算））との騰落率の対比です。

当ファンドはスキーム上、参考指数と比較して北米の組入比率が低く、欧州やアジア・オセアニアの組入比率が高いという特徴があります。なお、参考指数は海外リート市況の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 分配金について

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

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
	2021年3月16日 ～2021年4月15日	2021年4月16日 ～2021年5月17日	2021年5月18日 ～2021年6月15日	2021年6月16日 ～2021年7月15日	2021年7月16日 ～2021年8月16日	2021年8月17日 ～2021年9月15日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	<b>10</b>	<b>10</b>	<b>1,610</b>	<b>10</b>	<b>10</b>	<b>290</b>
対基準価額比率（%）	0.09	0.09	12.91	0.09	0.09	2.69
当期の収益（円）	10	10	799	10	10	3
当期の収益以外（円）	—	—	810	—	—	286
翌期繰越分配対象額（円）	2,145	2,548	1,738	1,753	1,824	1,538

（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	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 25.74円	✓ 16.71円	✓ 17.25円	✓ 23.86円	✓ 19.28円	✓ 3.56円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	216.09	396.45	✓ 782.01	0.00	61.70	0.00
(c) 収益調整金	518.40	558.01	590.54	657.39	676.96	704.48
(d) 分配準備積立金	1,395.18	1,587.65	✓ 1,958.42	1,082.34	1,076.85	✓ 1,120.49
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	2,155.42	2,558.82	3,348.23	1,763.60	1,834.81	1,828.54
(f) 分配金	10.00	10.00	1,610.00	10.00	10.00	290.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	2,145.42	2,548.82	1,738.23	1,753.60	1,824.81	1,538.54

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

主要投資対象である「ダイワ世界リート・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持する方針です。

### ■ダイワ世界リート・マザーファンド

北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域にほぼ均等に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。今後の運用方針としては、国・地域別の配分では大きなリスクを取らず、個別銘柄選択を重視した運用とする方針です。また、外貨建資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行っていきます。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	第166期～第171期 (2021.3.16～2021.9.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	91円	0.819%	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11,168円です。
（投 信 会 社）	(49)	(0.443)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(37)	(0.332)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(5)	(0.044)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	5	0.047	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（投 資 信 託 証 券）	(5)	(0.047)	
有 価 証 券 取 引 税	4	0.040	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
（投 資 信 託 証 券）	(4)	(0.040)	
そ の 他 費 用	4	0.035	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
（保 管 費 用）	(3)	(0.030)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	105	0.941	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

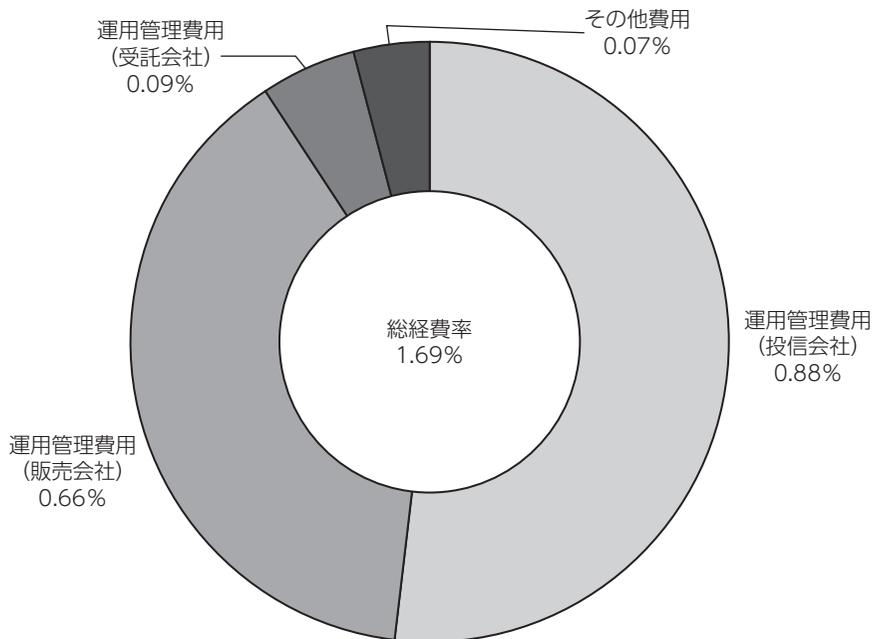
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.69%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■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

(2021年3月16日から2021年9月15日まで)

決算期	第166期～第171期			
	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ世界リート・マザーファンド	502,565	1,130,000	1,374,051	3,130,000

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	第165期末		第171期末	
	□数	評価額	□数	評価額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ世界リート・マザーファンド	6,049,040	5,177,554	11,885,594	

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月15日)、(2021年5月17日)、(2021年6月15日)、(2021年7月15日)、(2021年8月16日)、(2021年9月15日)現在

項目	第166期末	第167期末	第168期末	第169期末	第170期末	第171期末
<b>(A) 資産</b>	<b>12,684,795,508円</b>	<b>13,342,086,247円</b>	<b>14,158,524,813円</b>	<b>12,748,496,290円</b>	<b>13,016,240,780円</b>	<b>12,855,903,459円</b>
コール・ローン等	171,839,694	157,061,795	174,076,064	651,128,310	175,515,739	180,309,303
ダイワ世界リート・マザーファンド(評価額)	12,472,955,814	13,135,024,452	12,134,448,749	12,077,367,980	12,760,725,041	11,885,594,156
未収入金	40,000,000	50,000,000	1,850,000,000	20,000,000	80,000,000	790,000,000
<b>(B) 負債</b>	<b>53,958,011</b>	<b>67,519,470</b>	<b>1,875,063,345</b>	<b>46,722,094</b>	<b>122,812,677</b>	<b>375,114,824</b>
未払収益分配金	11,220,222	11,380,314	1,821,120,568	11,832,070	11,785,097	344,562,122
未払解約金	25,601,920	37,319,233	36,147,768	17,822,799	92,502,799	12,838,896
未払信託報酬	17,078,108	18,699,084	17,614,673	16,830,048	18,226,048	17,356,451
その他未払費用	57,761	120,839	180,336	237,177	298,733	357,355
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>12,630,837,497</b>	<b>13,274,566,777</b>	<b>12,283,461,468</b>	<b>12,701,774,196</b>	<b>12,893,428,103</b>	<b>12,480,788,635</b>
元本	11,220,222,703	11,380,314,922	11,311,307,876	11,832,070,411	11,785,097,729	11,881,452,517
次期繰越損益金	1,410,614,794	1,894,251,855	972,153,592	869,703,785	1,108,330,374	599,336,118
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>11,220,222,703□</b>	<b>11,380,314,922□</b>	<b>11,311,307,876□</b>	<b>11,832,070,411□</b>	<b>11,785,097,729□</b>	<b>11,881,452,517□</b>
1万口当り基準価額(C/D)	11,257円	11,664円	10,859円	10,735円	10,940円	10,504円

\*第165期末における元本額は11,050,513,926円、当作成期間(第166期～第171期)中における追加設定元本額は1,945,313,845円、同解約元本額は1,114,375,254円です。

\*第171期末の計算口数当りの純資産額は10,504円です。

■投資信託財産の構成

2021年9月15日現在

項目	第171期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ世界リート・マザーファンド	11,885,594	92.5
コール・ローン等、その他	970,309	7.5
投資信託財産総額	12,855,903	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.65円、1カナダ・ドル=86.36円、1オーストラリア・ドル=80.20円、1香港ドル=14.10円、1シンガポール・ドル=81.58円、1ニュージーランド・ドル=77.72円、1イギリス・ポンド=151.39円、1ユーロ=129.47円です。

(注3) ダイワ世界リート・マザーファンドにおいて、第171期末における外貨建純資産(11,702,201千円)の投資信託財産総額(12,688,622千円)に対する比率は、92.2%です。

# ダイワ世界リート・ファンド（毎月分配型）

## ■損益の状況

第166期 自2021年3月16日 至2021年4月15日 第169期 自2021年6月16日 至2021年7月15日  
 第167期 自2021年4月16日 至2021年5月17日 第170期 自2021年7月16日 至2021年8月16日  
 第168期 自2021年5月18日 至2021年6月15日 第171期 自2021年8月17日 至2021年9月15日

項 目	第 166 期	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期
(A) 配当等収益	△ 1,949円	△ 1,890円	△ 3,786円	△ 17,831円	△ 18,070円	△ 4,316円
受取利息	13	11	33	94	275	37
支払利息	△ 1,962	△ 1,901	△ 3,819	△ 17,925	△ 18,345	△ 4,353
(B) 有価証券売買損益	477,820,290	488,958,700	921,747,197	△ 114,897,152	270,343,604	△ 155,606,747
売買益	481,055,130	492,068,638	929,219,399	2,249,355	273,588,645	1,255,475
売買損	△ 3,234,840	△ 3,109,938	△ 7,472,202	△ 117,146,507	△ 3,245,041	△ 156,862,222
(C) 信託報酬等	△ 17,135,869	△ 18,762,243	△ 17,674,170	△ 16,886,889	△ 18,287,604	△ 17,415,073
(D) 当期繰越損益(A+B+C)	460,682,472	470,194,567	904,069,241	△ 131,801,872	252,037,930	△ 173,026,136
(E) 前期繰越損益金	1,376,091,209	1,806,796,742	2,215,239,980	1,280,641,356	1,112,497,885	1,331,314,731
(F) 追加信託差損益金	△ 414,938,665	△ 371,359,140	△ 326,035,061	△ 267,303,629	△ 244,420,344	△ 214,390,355
(配当等相当額)	( 581,664,527)	( 635,033,831)	( 667,982,568)	( 777,829,310)	( 797,806,616)	( 837,033,701)
(売買損益相当額)	(△ 996,603,192)	(△ 1,006,392,971)	(△ 994,017,629)	(△ 1,045,132,939)	(△ 1,042,226,960)	(△ 1,051,424,056)
(G) 合計(D + E + F)	1,421,835,016	1,905,632,169	2,793,274,160	881,535,855	1,120,115,471	943,898,240
(H) 収益分配金	△ 11,220,222	△ 11,380,314	△ 1,821,120,568	△ 11,832,070	△ 11,785,097	△ 344,562,122
次期繰越損益金(G+H)	1,410,614,794	1,894,251,855	972,153,592	869,703,785	1,108,330,374	599,336,118
追加信託差損益金	△ 414,938,665	△ 371,359,140	△ 326,035,061	△ 267,303,629	△ 244,420,344	△ 214,390,355
(配当等相当額)	( 581,664,527)	( 635,033,831)	( 667,982,568)	( 777,829,310)	( 797,806,616)	( 837,033,701)
(売買損益相当額)	(△ 996,603,192)	(△ 1,006,392,971)	(△ 994,017,629)	(△ 1,045,132,939)	(△ 1,042,226,960)	(△ 1,051,424,056)
分配準備積立金	1,825,553,459	2,265,610,995	1,298,188,653	1,297,043,365	1,352,750,718	990,984,566
繰越損益金	-	-	-	△ 160,035,951	-	△ 177,258,093

(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。

(注4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：36,217,047円（未監査）

## ■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第 166 期	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期
(a) 経費控除後の配当等収益	28,889,153円	19,018,567円	19,512,267円	28,234,079円	22,731,433円	4,231,957円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	242,459,821	451,176,000	884,556,974	0	72,720,309	0
(c) 収益調整金	581,664,527	635,033,831	667,982,568	777,829,310	797,806,616	837,033,701
(d) 分配準備積立金	1,565,424,707	1,806,796,742	2,215,239,980	1,280,641,356	1,269,084,073	1,331,314,731
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,418,438,208	2,912,025,140	3,787,291,789	2,086,704,745	2,162,342,431	2,172,580,389
(f) 分配金	11,220,222	11,380,314	1,821,120,568	11,832,070	11,785,097	344,562,122
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	2,407,217,986	2,900,644,826	1,966,171,221	2,074,872,675	2,150,557,334	1,828,018,267
(h) 受益権総口数	11,220,222,703口	11,380,314,922口	11,311,307,876口	11,832,070,411口	11,785,097,729口	11,881,452,517口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
	第 166 期	第 167 期	第 168 期	第 169 期	第 170 期	第 171 期
1 万 口 当 り 分 配 金	10円	10円	1,610円	10円	10円	290円

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

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

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間終了日を2022年6月15日から2027年9月15日に変更しました。

# ダイワ世界リート・マザーファンド

## 運用報告書 第29期 (決算日 2021年9月15日)

(作成対象期間 2021年3月16日～2021年9月15日)

ダイワ世界リート・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

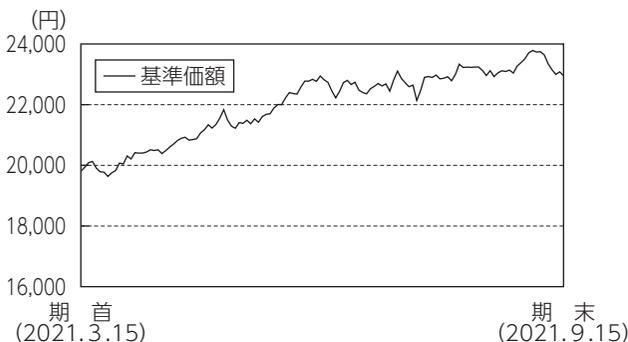
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本、円換算)		投資信託証券組入比率
	円	騰落率 (%)	(参考指数)	騰落率 (%)	
(期首)2021年3月15日	19,808	-	15,374	-	95.1
3月末	20,308	2.5	15,678	2.0	94.7
4月末	21,335	7.7	16,421	6.8	93.8
5月末	22,003	11.1	16,798	9.3	94.5
6月末	22,400	13.1	17,330	12.7	92.7
7月末	22,850	15.4	17,782	15.7	93.4
8月末	23,388	18.1	18,153	18.1	93.5
(期末)2021年9月15日	22,956	15.9	17,859	16.2	94.4

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本、円換算) は、S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本、米ドルベース) の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

《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：19,808円 期末：22,956円 騰落率：15.9%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市況が上昇したことや為替相場がおおむね円安に推移したこととともにプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況はおおむね上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より2021年7月末にかけて、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済正常化期待や好調な決算発表、米国長期金利の低下などが支援材料となり、上昇しました。その後8月から当作成期末にかけては、米国長期金利の安定や景気回復期待の高まり、良好な業績見通しなどは支援材料となったものの、中国当局の不動産規制などが懸念され、おおむね横

ばいの推移となりました。

○為替相場

為替相場はおおむね円安となりました。

為替相場は、当作成期首より2021年6月末にかけて、世界的に新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で、米国での追加経済政策の成立や経済指標の改善によりリスク選好度が強まり、円安に推移しました。2021年7月から当作成期末にかけては、米国などで新規感染者数が増加したことによって景気回復への不透明感が高まり、やや円高に推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域にほぼ均等に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。今後の運用方針としては、国・地域別の配分では大きなリスクを取らず、個別銘柄選択を重視した運用とする方針です。また、外貨建資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行っていきます。

※C & S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートを主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長をめざし、北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域にほぼ均等に投資を行いました。外貨建資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託し、保有不動産の価値などと比較して魅力的であると判断される銘柄を中心に分散投資を行いました。銘柄選択は、C & Sが独自の評価方法によって魅力的であると判断した銘柄を、マクロ経済分析やポートフォリオ全体のバランスを考慮しながら組み入れました。

◆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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

当ファンドはスキーム上、参考指数と比較して北米の組入比率が低く、欧州やアジア・オセアニアの組入比率が高いという特徴があります。なお、参考指数は海外リート市況の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

北米、欧州、アジア・オセアニアの3地域にほぼ均等に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。今後の運用方針としては、国・地域別の配分では大きなリスクを取らず、個別銘柄選択を重視した運用とする方針です。また、外貨建資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行っていきます。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (投資信託証券)	11円 (11)
有価証券取引税 (投資信託証券)	9 (9)
その他費用 (保管費用) (その他)	7 (7) (1)
合計	27

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

投資信託証券

(2021年3月16日から2021年9月15日まで)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	212.246 (-)	(11,831 -)	259.543 (-)	18,193 (-)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	1,055.832 (-)	(4,515 △53)	2,014.243 (-)	10,027 (-)
国	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	42.2 (-)	(3,152 -)	146.3 (-)	10,937 (-)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	3,236.3 (-)	(5,453 △8)	3,023.5 (-)	6,300 (-)
ニュージーランド	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル
	137.993 (-)	(333 -)	148.921 (-)	351 (-)
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	1,804.162 (1,903)	(4,152 (15))	2,258.975 (-)	7,704 (-)
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	58.885 (1,757)	(1,361 -)	18.853 (-)	529 (-)
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	73.87 (0.897)	(3,702 (47))	30.069 (-)	1,774 (-)
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	68.798 (0.71)	(3,518 (33))	135.957 (-)	5,216 (-)
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	- (-)	(-) (△45)	71.815 (-)	1,090 (-)
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	36.749 (-)	(335 △28)	39.992 (-)	378 (-)
国	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	238.302 (3,364)	(8,918 (6))	296.686 (-)	8,990 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 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4) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

投資信託証券

(2021年3月16日から2021年9月15日まで)

買付	当			期			売付	
	銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数		金額
		千口	千円	円		千口	千円	円
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	30.929	301,333	9,742	KLEPIERRE (フランス)	105.236	326,167	3,099
	WELLTOWER INC (アメリカ)	23.95	215,738	9,007	SEGRO PLC (イギリス)	158.504	254,107	1,603
	WAREHOUSES DE PAUW SCA (ベルギー)	42.582	203,586	4,781	MIRVAC GROUP (オーストラリア)	1,065.322	246,119	231
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI (シンガポール)	1,538	188,495	122	KEPPEL DC REIT (シンガポール)	1,083.7	226,559	209
	DEXUS (オーストラリア)	219.972	188,253	855	BRITISH LAND CO PLC (イギリス)	285.298	222,883	781
	EUROCOMMERCIAL PROPRIETE-CV (オランダ)	51.066	143,559	2,811	CHARTER HALL GROUP (オーストラリア)	151.832	196,494	1,294
	COFINIMMO (ベルギー)	7.05	122,716	17,406	EQUINIX INC (アメリカ)	2.035	185,272	91,042
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC (イギリス)	348.218	120,801	346	WELLTOWER INC (アメリカ)	21.547	181,792	8,437
	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	4.793	112,793	23,532	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	101.933	176,135	1,727
	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	6.177	106,529	17,246	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	9.636	166,538	17,282

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
外国投資信託証券

銘柄	期首		期末		
	口数	口数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	-	0.587	131	14,436	
EQUINIX INC	16,587	16,504	2,138	234,460	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2,378	1,512	1,262	138,417	
CYRUSONE INC	85,648	89,956	1,495	164,032	
KIMCO REALTY CORP	23,011	19,383	1,483	162,716	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	7.53	38,779	842	92,398	
INVITATION HOMES INC	19,298	26,946	826	90,648	
AMERICOLD REALTY TRUST	33,903	16,347	663	72,737	
VICI PROPERTIES INC	19,692	29,802	1,052	115,385	
APARTMENT INCOME REIT CO	55,209	45,932	1,374	150,690	
VENTAS INC	14,537	17,905	902	98,988	
WEYERHAEUSER CO	32,381	23,499	1,348	147,874	
VEREIT INC	15,435	11,603	395	43,371	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	38,385	36,989	1,771	194,234	
SUN COMMUNITIES INC	14,026	11,727	582	63,843	
PROLOGIS INC	11,598	5,013	1,001	109,792	
COUSINS PROPERTIES INC	10,631	5,756	762	83,658	
DUKE REALTY CORP	-	15,086	563	61,733	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	52,207	40,666	2,056	225,492	
WELLTOWER INC	4,787	4,251	1,379	151,237	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,547	23,95	2,096	229,890	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	57,69	46,452	1,643	180,155	
PUBLIC STORAGE	3,999	-	-	-	
REGENCY CENTERS CORP	9,798	7,899	2,507	274,925	
UDR INC	-	7,737	522	57,272	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,877	31,849	1,702	186,695	
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.093	-	-	-	
EXTRA SPACE STORAGE INC	7,923	4,464	688	75,482	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	10,228	4,972	912	100,073	
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	632,863 27銘柄	585,566 27銘柄	32,108 <29.6%>	3,520,646 <29.6%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	
DEXUS/AU	-	194,832	2,098	168,286	
NATIONAL STORAGE REIT	-	529,895	1,197	96,044	
MIRVAC GROUP	1,302,165	988.76	2,333	187,144	
GOODMAN GROUP	2,643,366	1,655,299	5,032	403,575	
CHARTER HALL GROUP	438.35	346,384	7,797	625,327	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	477,456	325,624	5,737	460,147	
オーストラリア・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	5,335,417 5銘柄	4,377,006 7銘柄	26,341 <17.8%>	2,112,557 <17.8%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円	
LINK REIT	555,671	451,571	31,203	439,970	
CHAMPION REIT	147	147	615	8,684	
香港ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	702,671 2銘柄	598,571 2銘柄	31,819 <3.8%>	448,654 <3.8%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	
KEPPEL DC REIT	1,102,837	261,937	665	54,276	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	643	1,452.8	2,164	176,593	
KEPPEL REIT	2,028,676	1,939,276	3,917	319,576	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	1,976.7	2,381.1	2,547	207,847	
シンガポール・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	6,634,713 5銘柄	6,847,513 5銘柄	13,154 <9.0%>	1,073,103 <9.0%>

銘柄	期首		期末		
	口数	口数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	
GOODMAN PROPERTY TRUST	730.42	719,492	1,870	145,389	
ニュージーランド・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	730.42 1銘柄	719,492 1銘柄	1,870 <1.2%>	145,389 <1.2%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	
ASSURA PLC	2,372,248	1,910,974	1,448	219,291	
NEWRIVER REIT PLC	-	370,356	275	41,658	
SEGRO PLC	340,793	182,289	2,327	352,410	
UNITE GROUP PLC/THE	28,673	-	-	-	
BRITISH LAND CO PLC	586.38	434,158	2,247	340,203	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	-	67,995	522	79,107	
DERWENT LONDON PLC	5.62	9,622	354	53,707	
WORKSPACE GROUP PLC	76,066	66,763	593	89,802	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	155,588	97,352	1,096	165,951	
BIG YELLOW GROUP PLC	94,146	26,238	383	58,073	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	461,828	473,906	1,194	180,796	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	751,998	780,777	1,841	278,719	
イギリス・ポ ンド通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	4,873.34 10銘柄	4,420.43 11銘柄	12,284 <15.6%>	1,859,722 <15.6%>
ユーロ (オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	-	42,828	860	111,453	
NSI NV	13	11,961	397	51,490	
国小計	口数、金額 銘柄数 <比率>	13 1銘柄	54,789 2銘柄	1,258 <1.4%>	162,943 <1.4%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	
AEDIFICA	15,738	16.39	1,922	248,912	
COFINIMMO	7,099	10,557	1,413	183,016	
BEFIMMO	-	17,108	597	77,413	
WAREHOUSES DE PALUW SCA	32,191	58,806	2,232	289,012	
XIOR STUDENT HOUSING NV	10.78	7,645	388	50,281	
国小計	口数、金額 銘柄数 <比率>	65,808 4銘柄	110,506 5銘柄	6,554 <7.1%>	848,636 <7.1%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	-	23.75	1,587	205,527	
ICADE	26,599	21,601	1,519	196,746	
ARGAN	7.13	5,964	685	88,798	
GECINA SA	8,991	2,917	362	46,905	
KLEPIERRE	194,328	119,903	2,306	298,678	
COVIVIO	3,536	-	-	-	
国小計	口数、金額 銘柄数 <比率>	240,584 5銘柄	174,135 5銘柄	6,462 <7.0%>	836,656 <7.0%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千口	千ユーロ	千円	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	118,159	46,344	742	96,182	
国小計	口数、金額 銘柄数 <比率>	118,159 1銘柄	46,344 1銘柄	742 <0.8%>	96,182 <0.8%>
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	95,008	91,765	857	111,061	
国小計	口数、金額 銘柄数 <比率>	95,008 1銘柄	91,765 1銘柄	857 <0.9%>	111,061 <0.9%>
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	532,559 12銘柄	477,539 14銘柄	15,876 <17.3%>	2,055,481 <17.3%>
合計	口数、金額 銘柄数 <比率>	19,441,983 62銘柄	18,026,117 67銘柄	-	11,215,556 <94.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	11,215,556	88.4
コール・ローン等、その他	1,473,066	11.6
投資信託財産総額	12,688,622	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.65円、1カナダ・ドル=86.36円、1オーストラリア・ドル=80.20円、1香港ドル=14.10円、1シンガポール・ドル=81.58円、1ニュージーランド・ドル=77.72円、1イギリス・ポンド=151.39円、1ユーロ=129.47円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(11,702,201千円)の投資信託財産総額(12,688,622千円)に対する比率は、92.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>12,688,622,272円</b>
コール・ローン等	1,428,304,925
投資信託証券(評価額)	11,215,556,134
未収入金	27,586,071
未収配当金	17,175,142
<b>(B) 負債</b>	<b>802,951,859</b>
未払金	12,951,859
未払解約金	790,000,000
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>11,885,670,413</b>
元本	5,177,554,520
次期繰越損益金	6,708,115,893
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>5,177,554,520口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>22,956円</b>

\*期首における元本額は6,049,040,998円、当作成期間中における追加設定元本額は502,565,321円、同解約元本額は1,374,051,799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、ダイワ世界リート・ファンド(毎月分配型)5,177,554,520円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は22,956円です。

■損益の状況

当期 自2021年3月16日 至2021年9月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>160,659,793円</b>
受取配当金	160,781,159
受取利息	1,867
支払利息	△ 123,233
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1,747,208,159</b>
売買益	2,043,007,593
売買損	△ 295,799,434
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 4,236,171</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>1,903,631,781</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>5,932,997,634</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△1,755,948,201</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>627,434,679</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>6,708,115,893</b>
次期繰越損益金(H)	6,708,115,893

(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。