

DCダイワ・マネー・ ポートフォリオ

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年3月31日)

(作成対象期間 2021年4月1日～2022年3月31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、わが国の公社債を中心に投資し、安定した収益の確保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/>

★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／国内／債券		
信託期間	無期限（設定日：2016年 4 月 1 日）		
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	イ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券 ロ. わが国の公社債	
	ダイワ・マネー・マザーファンド	本邦通貨表示の公社債	
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
	マザーファンドの株式組入上限比率		純資産総額の30%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

最近5期の運用実績

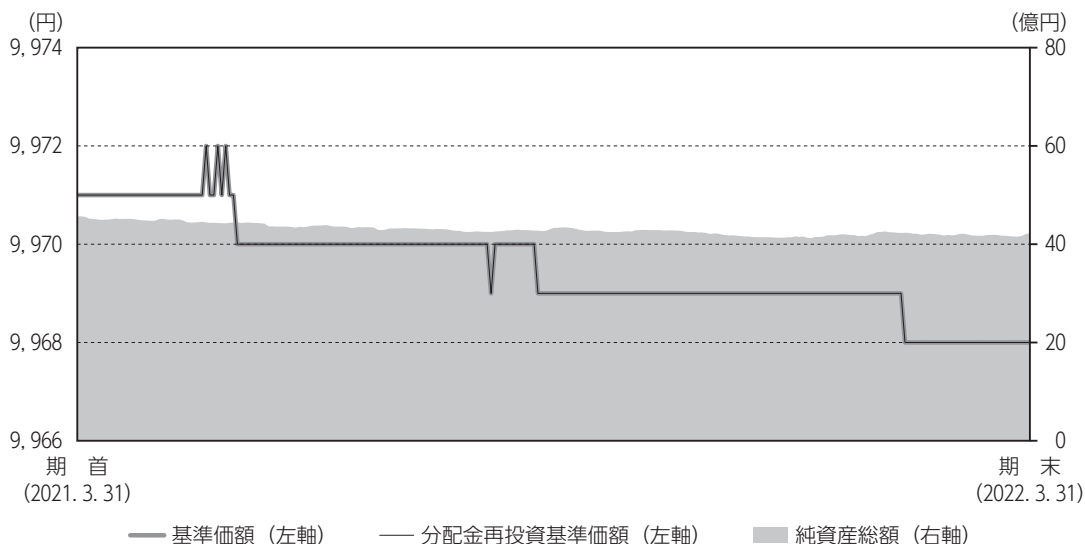
決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率		
	円	円	%	%	百万円
2 期末 (2018年 4 月 2 日)	9,988	0	△ 0.1	—	3,929
3 期末 (2019年 4 月 1 日)	9,980	0	△ 0.1	—	4,120
4 期末 (2020年 3 月31日)	9,975	0	△ 0.1	—	4,283
5 期末 (2021年 3 月31日)	9,971	0	△ 0.0	—	4,567
6 期末 (2022年 3 月31日)	9,968	0	△ 0.0	—	4,224

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



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

* 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：9,971円

期 末：9,968円（分配金 0 円）

騰落率：△0.0%（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。

DCダイワ・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) 2021年 3 月31日	円	%		%
	9, 971	—		—
4 月末	9, 971	0. 0		—
5 月末	9, 971	0. 0		—
6 月末	9, 970	△ 0. 0		—
7 月末	9, 970	△ 0. 0		—
8 月末	9, 970	△ 0. 0		—
9 月末	9, 969	△ 0. 0		—
10月末	9, 969	△ 0. 0		—
11月末	9, 969	△ 0. 0		—
12月末	9, 969	△ 0. 0		—
2022年 1 月末	9, 969	△ 0. 0		—
2 月末	9, 968	△ 0. 0		—
(期末) 2022年 3 月31日	9, 968	△ 0. 0		—

(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. 4. 1 ~ 2022. 3. 31)

国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3 カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

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

流動性及び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

(2021. 4. 1 ~ 2022. 3. 31)

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

流動性及び資産の安全性に配慮し、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、分配対象額が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年4月1日 ～2022年3月31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）	—

- （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

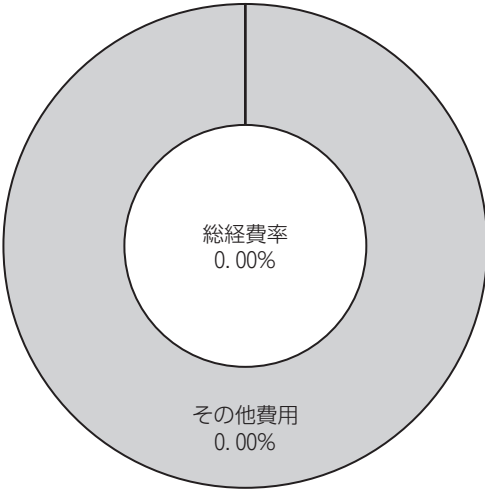
項 目	当 期 (2021. 4. 1～2022. 3. 31)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—円	—％	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,970円です。
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0.001	その他費用＝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)	(0.001)	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	0	0.001	

- (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0.00%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4月1日から2022年3月31日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	843,866	857,987	1,181,972	1,201,783

(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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	4,473,331	4,135,225	4,203,870

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年3月31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	4,203,870	99.3
コール・ローン等、その他	28,586	0.7
投資信託財産総額	4,232,457	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

2022年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,232,457,148円
コール・ローン等	28,586,767
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	4,203,870,381
(B) 負債	7,461,868
未払解約金	7,448,201
未払信託報酬	2,192
その他未払費用	11,475
(C) 純資産総額 (A－B)	4,224,995,280
元本	4,238,430,593
次期繰越損益金	△ 13,435,313
(D) 受益権総口数	4,238,430,593口
1万口当り基準価額 (C／D)	9,968円

* 期首における元本額は4,580,316,081円、当作成期間中における追加設定元本額は1,638,249,516円、同解約元本額は1,980,135,004円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,968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13,435,313円です。

■損益の状況

当期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,146円
受取利息	1,665
支払利息	△ 7,811
(B) 有価証券売買損益	△ 958,892
売買益	236,714
売買損	△ 1,195,606
(C) 信託報酬等	△ 27,999
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	△ 993,037
(E) 前期繰越損益金	△ 2,867,343
(F) 追加信託差損益金	△ 9,574,933
(配当等相当額)	(△ 446,095)
(売買損益相当額)	(△ 9,128,838)
(G) 合計 (D＋E＋F)	△ 13,435,313
次期繰越損益金 (G)	△ 13,435,313
追加信託差損益金	△ 9,574,933
(配当等相当額)	(△ 446,095)
(売買損益相当額)	(△ 9,128,838)
繰越損益金	△ 3,860,380

(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	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	0
(h) 受益権総口数	4, 238, 430, 593口

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・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（2021年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年3月31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

2021年4月1日～2022年3月31日における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

2022年3月31日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2021年12月9日）

（作成対象期間 2020年12月10日～2021年12月9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。

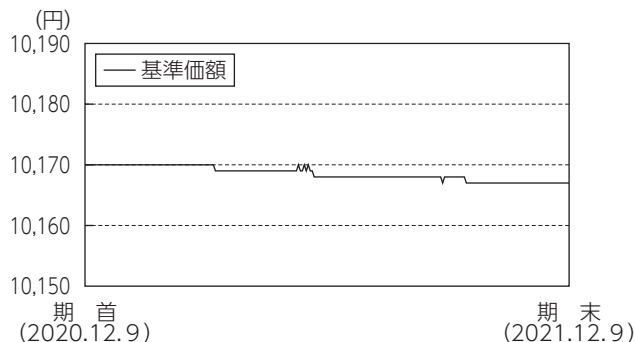
運 用 方 針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	本邦通貨表示の公社債
株 式 組 入 制 限	純資産総額の30%以下

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		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2020年12月9日	円	%	%
12月末	10,170	0.0	—
2021年1月末	10,170	0.0	—
2月末	10,170	0.0	—
3月末	10,169	△0.0	—
4月末	10,169	△0.0	—
5月末	10,169	△0.0	—
6月末	10,168	△0.0	—
7月末	10,168	△0.0	—
8月末	10,168	△0.0	—
9月末	10,167	△0.0	—
10月末	10,167	△0.0	—
11月末	10,167	△0.0	—
(期末)2021年12月9日	10,167	△0.0	—

(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：10,170円 期末：10,167円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和政策を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

流動性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

流動性や資産の安全性に配慮し、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)	0 (0)
合 計	0

(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

その他有価証券

(2020年12月10日から2021年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国内短期社債等	千円	千円
		110,997,998	111,997,992 (—)

(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

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	6,782,301	100.0
投資信託財産総額	6,782,301	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

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,782,301,285円
コール・ローン等	6,782,301,285
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	6,782,301,285
元本	6,671,046,264
次期繰越損益金	111,255,021
(D) 受益権総口数	6,671,046,264口
1万口当り基準価額(C／D)	10,167円

* 期首における元本額は66,337,383,629円、当作成期間中における追加設定元本額は24,638,372,125円、同解約元本額は84,304,709,490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：

ダイワ日経225－シフト11－ 2019－03 (適格機関投資家専用)	531,632,690円
ゴールド・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	1,965,311,641円
ターゲット・リターン (コスト控除後3%) 資金拠出用ファンド (適格機関投資家専用)	129,833円
ターゲット・リターン (コスト控除後5%) 資金拠出用ファンド (適格機関投資家専用)	160,914円
ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド－AI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－AI新時代－ (為替ヘッジなし)	977,694円
ダイワFEGグローバル・バリュー (為替ヘッジあり)	9,608円
ダイワFEGグローバル・バリュー (為替ヘッジなし)	9,608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／“RICI”コモディティ・ファンド	2,074,249円
US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
US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
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
世界セレクトティブ株式オープン	983円
世界セレクトティブ株式オープン (年2回決算型)	983円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり／毎月分配型)	983円
NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし／毎月分配型)	983円
D/Cダイワ・マネー・ポートフォリオ	4,082,297,237円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) トリプル	
リターンズー 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	
リターンズー 豪ドル・コース (毎月分配型)	52,987円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) トリプル	
リターンズー ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	467,315円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) トリプル	
リターンズー スドル・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ーパラダイムシフトー	1,988,495円
ダイワFEGグローバル・バリュー株ファンド (ダイワSMA専用)	3,666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) スドル・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
ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	80,587,771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・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー (為替ヘッジあり)	5,385円
ダイワ・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー (為替ヘッジなし)	11,530円
ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) スドルコース	9,817円
ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 日本円コース	6,964円
ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 通貨αコース	9,479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	979,761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	982,029円
ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) トリプル	
リターンズー 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	9,652円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,167円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,353,364円
受取利息	34,938
支払利息	△ 6,388,302
(B) その他費用	△ 30,929
(C) 当期損益金(A+B)	△ 6,384,293
(D) 前期繰越損益金	1,128,566,954
(E) 解約差損益金	△1,428,973,017
(F) 追加信託差損益金	418,045,377
(G) 合計(C+D+E+F)	111,255,021
次期繰越損益金(G)	111,255,021

(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。