

# 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）  
通貨セレクトコース（毎月分配型）

## 運用報告書（全体版）

第114期（決算日 2022年1月13日）  
第115期（決算日 2022年2月14日）  
第116期（決算日 2022年3月14日）  
第117期（決算日 2022年4月13日）  
第118期（決算日 2022年5月13日）  
満期償還（償還日 2022年6月13日）

（作成対象期間 2021年12月14日～2022年6月13日）

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

|        |   |  |
|--------|---|--|
| 商品分類   | 追加型投信／内外／不動産投信（リート）   |  |
| 信託期間   | 2012年6月27日～2022年6月13日   |  |
| 運用方針   | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。   |  |
| 主要投資対象 | 円ヘッジコース<br>（毎月分配型）  | イ. ケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－グローバル・リートα・ファンド（円ヘッジクラス）」の受益証券（円建）<br>ロ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券   |
|        | 通貨セレクトコース<br>（毎月分配型）  | イ. ケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－グローバル・リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）」の受益証券（円建）<br>ロ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券 |
| 組入制限   | 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。  |  |
| 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、継続的な分配を行なうことを目標に、基準価額の水準を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。 |  |

## 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、リート（不動産投資信託）への投資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ており、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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/>

<5735>  
<5736>

## 円ヘッジコース (毎月分配型)

## 最近30期の運用実績

| 決算期                  | 基準価額       |            |           | S & P先進国REIT指数<br>(配当込み、現地通貨建て)<br>(参考指数) |           | 公社債<br>組入比率 | 投資信託<br>組入比率 | 純資産<br>総額  |
|----------------------|------------|------------|-----------|---|-----------|-------------|--------------|------------|
|                      | (分配落)      | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (参考指数)                                    | 期中<br>騰落率 |             |              |            |
| 90 期末(2020年 1 月14日)  | 円<br>4,635 | 円<br>50    | %<br>1.1  | 21,476                                    | %<br>2.8  | %<br>-      | %<br>98.6    | 百万円<br>342 |
| 91 期末(2020年 2 月13日)  | 4,693      | 50         | 2.3       | 22,275                                    | 3.7       | -           | 98.4         | 345        |
| 92 期末(2020年 3 月13日)  | 3,627      | 50         | △21.6     | 16,895                                    | △24.2     | -           | 97.9         | 268        |
| 93 期末(2020年 4 月13日)  | 3,572      | 50         | △ 0.1     | 17,070                                    | 1.0       | -           | 98.3         | 267        |
| 94 期末(2020年 5 月13日)  | 3,336      | 50         | △ 5.2     | 15,635                                    | △ 8.4     | -           | 98.1         | 252        |
| 95 期末(2020年 6 月15日)  | 3,493      | 50         | 6.2       | 17,632                                    | 12.8      | -           | 98.3         | 266        |
| 96 期末(2020年 7 月13日)  | 3,443      | 50         | 0.0       | 17,079                                    | △ 3.1     | -           | 98.3         | 264        |
| 97 期末(2020年 8 月13日)  | 3,533      | 50         | 4.1       | 17,981                                    | 5.3       | -           | 98.4         | 271        |
| 98 期末(2020年 9 月14日)  | 3,425      | 50         | △ 1.6     | 17,620                                    | △ 2.0     | -           | 98.3         | 266        |
| 99 期末(2020年10月13日)   | 3,481      | 50         | 3.1       | 18,364                                    | 4.2       | -           | 96.1         | 279        |
| 100 期末(2020年11月13日)  | 3,452      | 50         | 0.6       | 18,711                                    | 1.9       | -           | 98.0         | 181        |
| 101 期末(2020年12月14日)  | 3,444      | 50         | 1.2       | 18,979                                    | 1.4       | -           | 98.1         | 175        |
| 102 期末(2021年 1 月13日) | 3,399      | 50         | 0.1       | 18,896                                    | △ 0.4     | -           | 98.4         | 171        |
| 103 期末(2021年 2 月15日) | 3,510      | 50         | 4.7       | 20,210                                    | 7.0       | -           | 98.3         | 178        |
| 104 期末(2021年 3 月15日) | 3,533      | 50         | 2.1       | 20,824                                    | 3.0       | -           | 98.2         | 166        |
| 105 期末(2021年 4 月13日) | 3,552      | 50         | 2.0       | 21,403                                    | 2.8       | -           | 98.4         | 162        |
| 106 期末(2021年 5 月13日) | 3,521      | 50         | 0.5       | 21,610                                    | 1.0       | -           | 97.6         | 162        |
| 107 期末(2021年 6 月14日) | 3,641      | 50         | 4.8       | 23,680                                    | 9.6       | -           | 99.4         | 168        |
| 108 期末(2021年 7 月13日) | 3,601      | 50         | 0.3       | 24,042                                    | 1.5       | -           | 98.8         | 166        |
| 109 期末(2021年 8 月13日) | 3,555      | 50         | 0.1       | 24,066                                    | 0.1       | -           | 98.2         | 163        |
| 110 期末(2021年 9 月13日) | 3,490      | 50         | △ 0.4     | 24,023                                    | △ 0.2     | -           | 98.4         | 161        |
| 111 期末(2021年10月13日)  | 3,447      | 50         | 0.2       | 23,751                                    | △ 1.1     | -           | 98.4         | 138        |
| 112 期末(2021年11月15日)  | 3,495      | 50         | 2.8       | 25,056                                    | 5.5       | -           | 97.9         | 140        |
| 113 期末(2021年12月13日)  | 3,449      | 50         | 0.1       | 25,224                                    | 0.7       | -           | 98.4         | 138        |
| 114 期末(2022年 1 月13日) | 3,457      | 50         | 1.7       | 25,492                                    | 1.1       | -           | 98.3         | 140        |
| 115 期末(2022年 2 月14日) | 3,320      | 50         | △ 2.5     | 24,090                                    | △ 5.5     | -           | 97.8         | 135        |
| 116 期末(2022年 3 月14日) | 3,265      | 50         | △ 0.2     | 24,180                                    | 0.4       | -           | 98.5         | 130        |
| 117 期末(2022年 4 月13日) | 3,281      | 50         | 2.0       | 25,295                                    | 4.6       | -           | 98.1         | 122        |
| 118 期末(2022年 5 月13日) | 2,939      | 50         | △ 8.9     | 22,350                                    | △11.6     | -           | 98.3         | 108        |
| 償還(2022年 6 月13日)     | 2,926.83   | -          | △ 0.4     | 21,936                                    | △ 1.9     | -           | -            | 108        |

(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(配当込み、現地通貨建て)は、同指数の原データをもとに、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(配当込み、現地通貨建て)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。

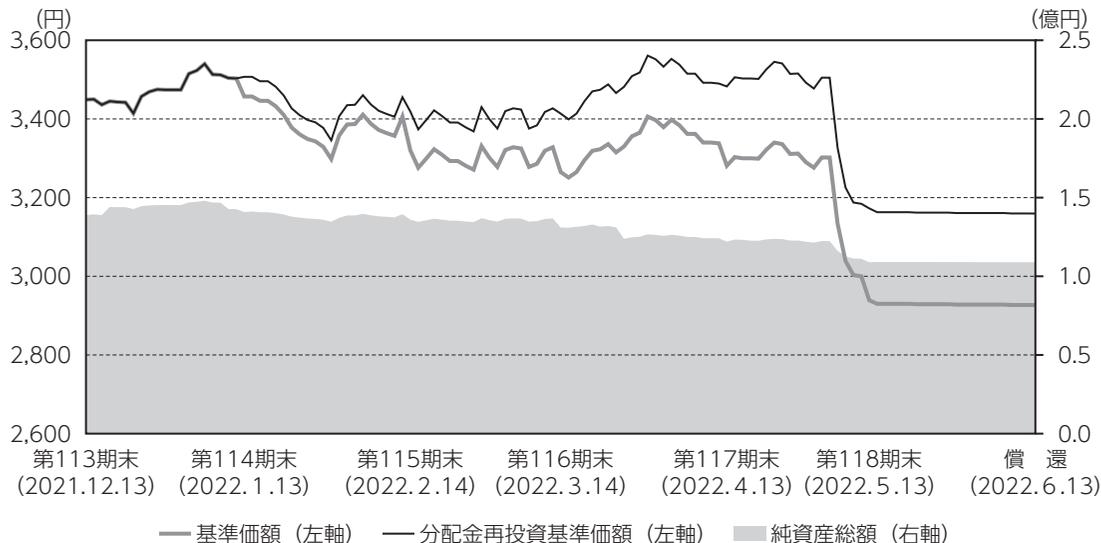
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：2,926円83銭 (既払分配金8,340円)

騰落率：13.9% (分配金再投資ベース)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

リートα・ファンド (円ヘッジクラス) の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。リートα・ファンド (円ヘッジクラス) については、先進国のリートへの投資とオプション取

引を組み合わせたカバードコール戦略を構築した結果、先進国リートが上昇したことがプラスに寄与し、上昇しました。オプション取引はマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

※リートα・ファンド (円ヘッジクラス) :  
クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト (ケイマン) II - グローバル・リートα・ファンド (円ヘッジクラス)

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)

|       | 年 月 日             | 基 準 価 額  |            | S & P先進国REIT指数<br>(配当込み、現地通貨建て)<br>(参考指数) |            | 公 社 債 率<br>組 入 比 | 投 資 信 託<br>受 益 証 券<br>組 入 比 率 |
|-------|-------------------|----------|------------|---|------------|------------------|-------------------------------|
|       |                   | 円        | 騰 落 率<br>% | 騰 落 率<br>%                                | 騰 落 率<br>% |                  |                               |
| 第114期 | (期首) 2021年12月13日  | 3,449    | —          | 25,224                                    | —          | —                | 98.4                          |
|       | 12月末              | 3,515    | 1.9        | 26,205                                    | 3.9        | —                | 97.2                          |
|       | (期末) 2022年 1 月13日 | 3,507    | 1.7        | 25,492                                    | 1.1        | —                | 98.3                          |
| 第115期 | (期首) 2022年 1 月13日 | 3,457    | —          | 25,492                                    | —          | —                | 98.3                          |
|       | 2022年 1 月末        | 3,358    | △2.9       | 24,388                                    | △ 4.3      | —                | 98.1                          |
|       | (期末) 2022年 2 月14日 | 3,370    | △2.5       | 24,090                                    | △ 5.5      | —                | 97.8                          |
| 第116期 | (期首) 2022年 2 月14日 | 3,320    | —          | 24,090                                    | —          | —                | 97.8                          |
|       | 2 月末              | 3,331    | 0.3        | 24,270                                    | 0.7        | —                | 98.3                          |
|       | (期末) 2022年 3 月14日 | 3,315    | △0.2       | 24,180                                    | 0.4        | —                | 98.5                          |
| 第117期 | (期首) 2022年 3 月14日 | 3,265    | —          | 24,180                                    | —          | —                | 98.5                          |
|       | 3 月末              | 3,397    | 4.0        | 25,712                                    | 6.3        | —                | 98.3                          |
|       | (期末) 2022年 4 月13日 | 3,331    | 2.0        | 25,295                                    | 4.6        | —                | 98.1                          |
| 第118期 | (期首) 2022年 4 月13日 | 3,281    | —          | 25,295                                    | —          | —                | 98.1                          |
|       | 4 月末              | 3,276    | △0.2       | 25,130                                    | △ 0.7      | —                | 98.5                          |
|       | (期末) 2022年 5 月13日 | 2,989    | △8.9       | 22,350                                    | △11.6      | —                | 98.3                          |
| 償 還 期 | (期首) 2022年 5 月13日 | 2,939    | —          | 22,350                                    | —          | —                | 98.3                          |
|       | 5 月末              | 2,928    | △0.4       | 23,421                                    | 4.8        | —                | —                             |
|       | (償還) 2022年 6 月13日 | 2,926.83 | △0.4       | 21,936                                    | △ 1.9      | —                | —                             |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

(2012.6.27~2022.6.13)

## ■先進国リート市況

先進国リート市況は上昇しました。

当ファンド設定時から2019年末にかけて、世界経済の回復やリーートの好調な業績動向が支援材料となり、堅調に推移しました。2020年以降は、新型コロナウイルスの感染拡大から一時急落しましたが、主要国で金融緩和政策や景気刺激策が実施されたことで、上昇しました。2022年以降は、インフレ圧力の高進を受けて主要国で金融政策の正常化が進む中、金融引き締めの加速見通しや金利上昇などが嫌気され、リート市況は上昇幅を縮小しました。

国別の現地通貨建ての騰落率を見ると、香港や日本などは相対的に堅調に推移した一方で、オランダやフランスが相対的に軟調となりました。現地通貨建てのセクター別では、産業施設や特殊施設などは相対的に堅調に推移した一方で、商業施設やホテル／リゾートなどは相対的に軟調となりました。

## ■短期金利市況

ファンドの設定時から2015年にかけては、0.00~0.10%程度で推移しました。その後、日本では、日銀が2016年に「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を開始したことで、短期金利は低位で推移しました。

一方、FRB（米国連邦準備制度理事会）は、2015年から2018年にかけて段階的な利上げを行い、政策金利の誘導目標レンジを一時2.25~2.50%に引き上げる場面も見られましたが、2020年以降は新型コロナウイルスの感染拡大を受けて0.00~0.25%に引き下げられました。2021年末以降は、主要国における繰越需要の発現に加えて、中国での新型コロナウイルスの感染拡大抑制に向けた厳格な制限措置の施行やロシアによるウクライナ侵攻を背景とした世界的なサプライチェーン（供給網）の混乱を受け、インフレ圧力が高まる中、米国の政策金利は0.75~1.00%に引き上げられました。

## 信託期間中の運用方針

## ■当ファンド

当ファンドは、リートα・ファンド（円ヘッジクラス）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。また、リートα・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

## ■リートα・ファンド（円ヘッジクラス）

安定的な配当が見込め、下値抵抗がある相対的に割安な銘柄を選定し、リーートのバリュエーションやオプション取引価格等を考慮して、リートポートフォリオを構築します。

個別銘柄ごとに、価格の方向性に基つき、保有株数の一部または全部にかかるコール・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。

為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

## ■ダイワ・マネースtock・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。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2012.6.27~2022.6.13)

## ■当ファンド

リートα・ファンド (円ヘッジクラス) とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資しました。  
 リートα・ファンド (円ヘッジクラス) への投資割合を高位に維持しました。

## ■リートα・ファンド (円ヘッジクラス)

安定的な配当が見込め、下値抵抗がある相対的に割安な銘柄を選定し、リートのバリュエーションやオプション取引価格等を考慮して、リートポートフォリオを構築しました。

個別銘柄ごとに、価格の方向性に基づき、保有株数の一部または全部にかかるコール・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した。

為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

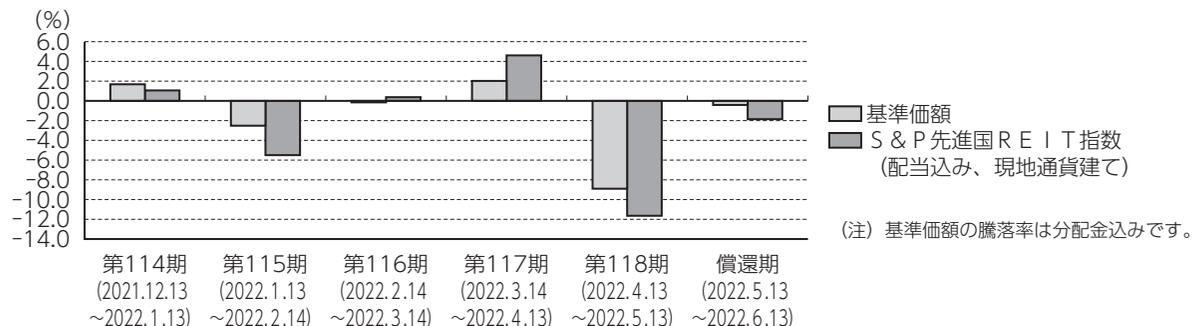
## ■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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いました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当作成期における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



## 分配金について

1万口当り、第2期～第84期各80円、第85期～第118期各50円の収益分配を行いました。なお、第1期は分配方針通り収益分配は行いませんでした。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目                  | 第114期                      | 第115期                     | 第116期                     | 第117期                     | 第118期                     |
|----------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|                      | 2021年12月14日<br>～2022年1月13日 | 2022年1月14日<br>～2022年2月14日 | 2022年2月15日<br>～2022年3月14日 | 2022年3月15日<br>～2022年4月13日 | 2022年4月14日<br>～2022年5月13日 |
| <b>当期分配金（税込み）（円）</b> | <b>50</b>                  | <b>50</b>                 | <b>50</b>                 | <b>50</b>                 | <b>50</b>                 |
| 対基準価額比率（%）           | 1.43                       | 1.48                      | 1.51                      | 1.50                      | 1.67                      |
| 当期の収益（円）             | 40                         | 39                        | 37                        | 40                        | 40                        |
| 当期の収益以外（円）           | 9                          | 10                        | 12                        | 9                         | 9                         |
| 翌期繰越分配対象額（円）         | 643                        | 633                       | 620                       | 611                       | 602                       |

(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114期    | 第115期    | 第116期    | 第117期    | 第118期    |
|----------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | ✓ 40.10円 | ✓ 39.76円 | ✓ 37.11円 | ✓ 40.68円 | ✓ 40.60円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     |
| (c) 収益調整金                  | ✓ 653.72 | ✓ 643.96 | ✓ 633.74 | ✓ 620.85 | ✓ 611.53 |
| (d) 分配準備積立金                | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 693.83   | 683.73   | 670.85   | 661.53   | 652.14   |
| (f) 分配金                    | 50.00    | 50.00    | 50.00    | 50.00    | 50.00    |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 643.83   | 633.73   | 620.85   | 611.53   | 602.14   |

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

| 項 目           | 第114期～償還期<br>(2021.12.14~2022.6.13) |         | 項 目 の 概 要   |
|---------------|-------------------------------------|---------|---|
|               | 金 額                                 | 比 率     |   |
| 信 託 報 酬       | 22円                                 | 0.671%  | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は3,276円です。                       |
| (投 信 会 社)     | (7)                                 | (0.218) | 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)     | (14)                                | (0.437) | 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)     | (1)                                 | (0.016) | 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 | —                                   | —       | 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<br>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<br>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     | —                                   | —       | 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   |
| 合 計           | 22                                  | 0.671   |   |

(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。

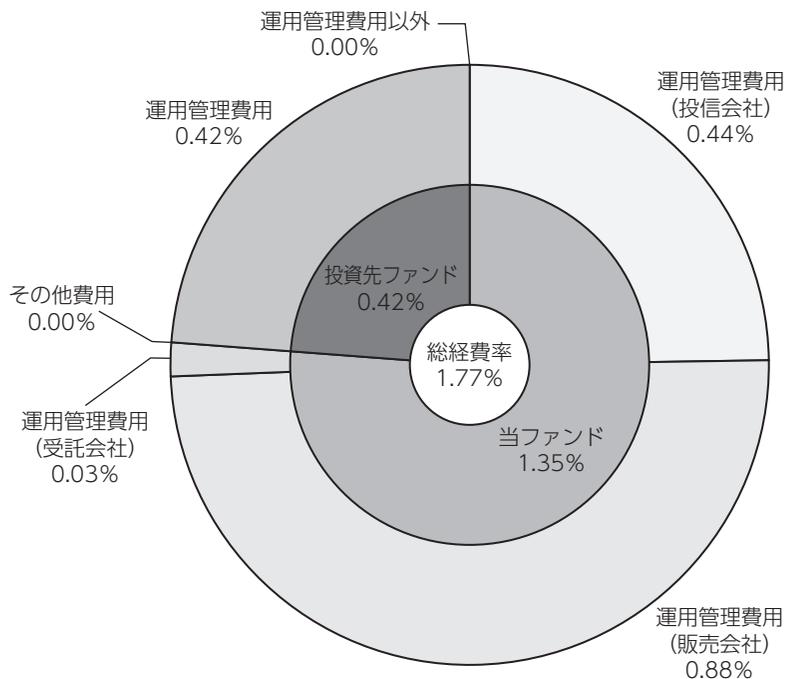
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.77%です。



|                      |       |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③)         | 1.77% |
| ①当ファンドの費用の比率         | 1.35% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.42% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.00% |

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

(注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。

(注4) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2021年12月14日から2022年6月13日まで)

| 決算期      | 第 114 期 ~ 償還期 |        |            |         |
|----------|---------------|--------|------------|---------|
|          | 買 付           |        | 売 付        |         |
|          | □ 数           | 金 額    | □ 数        | 金 額     |
|          | 千口            | 千円     | 千口         | 千円      |
| 外国 (邦貨建) | 446.73371     | 15,490 | 4,303.3359 | 134,659 |

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。  
 (注2) 金額は受渡し代金。  
 (注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年12月14日から2022年6月13日まで)

| 決算期                  | 第 114 期 ~ 償還期 |     |     |     |
|----------------------|---------------|-----|-----|-----|
|                      | 設 定           |     | 解 約 |     |
|                      | □ 数           | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
|                      | 千口            | 千円  | 千口  | 千円  |
| ダイワ・マネースtock・マザーファンド | -             | -   | 399 | 399 |

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2021年12月14日から2022年6月13日まで)

| 第 114 期 買 付                                      |           |       |      | ~ 償 還 期 売 付                                      |            |         |      |
|--|-----------|-------|------|--|------------|---------|------|
| 銘 柄  | □ 数       | 金 額   | 平均単価 | 銘 柄  | □ 数        | 金 額     | 平均単価 |
|  | 千口        | 千円    | 円    |  | 千口         | 千円      | 円    |
| GLOBAL REIT ALPHA FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島) | 199.40959 | 7,000 | 35   | GLOBAL REIT ALPHA FUND JPY HEDGED CLASS (ケイマン諸島) | 4,303.3359 | 134,659 | 31   |

(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

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

最終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

2022年6月13日現在

| 項 目          | 償 還 時         |            |
|--------------|---------------|------------|
|              | 評 価 額         | 比 率        |
| コール・ローン等、その他 | 千円<br>109,042 | %<br>100.0 |
| 投資信託財産総額     | 109,042       | 100.0      |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

| 種 類                  | 第 113 期 末 |
|----------------------|-----------|
|                      | □ 数       |
| ダイワ・マネースtock・マザーファンド | 千口<br>399 |

(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

(2022年1月13日)、(2022年2月14日)、(2022年3月14日)、(2022年4月13日)、(2022年5月13日)、(2022年6月13日)現在

| 項 目                      | 第 114 期 末    | 第 115 期 末    | 第 116 期 末    | 第 117 期 末    | 第 118 期 末    | 償 還 時        |
|--------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| (A) 資産                   | 146,948,574円 | 138,179,776円 | 139,411,608円 | 124,006,664円 | 110,902,865円 | 109,042,730円 |
| コール・ローン等                 | 8,117,382    | 4,737,930    | 4,051,768    | 3,869,463    | 3,437,549    | 109,042,730  |
| 投資信託受益証券(評価額)            | 138,431,830  | 133,042,524  | 128,978,682  | 119,737,879  | 107,065,994  | —            |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド(評価額) | 399,362      | 399,322      | 399,322      | 399,322      | 399,322      | —            |
| 未収入金                     | —            | —            | 5,981,836    | —            | —            | —            |
| (B) 負債                   | 6,143,659    | 2,211,931    | 8,455,590    | 2,001,142    | 1,991,624    | 129,368      |
| 未払金                      | —            | —            | 2,990,918    | —            | —            | —            |
| 未払収益分配金                  | 2,036,335    | 2,047,688    | 2,005,698    | 1,859,325    | 1,852,859    | —            |
| 未払解約金                    | 3,940,880    | —            | 3,318,033    | —            | 3,889        | —            |
| 未払信託報酬                   | 166,444      | 164,243      | 140,941      | 141,817      | 134,876      | 129,270      |
| 未払利息                     | —            | —            | —            | —            | —            | 98           |
| (C) 純資産総額(A-B)           | 140,804,915  | 135,967,845  | 130,956,018  | 122,005,522  | 108,911,241  | 108,913,362  |
| 元本                       | 407,267,026  | 409,537,649  | 401,139,650  | 371,865,124  | 370,571,965  | 372,120,567  |
| 次期繰越損益金                  | △266,462,111 | △273,569,804 | △270,183,632 | △249,859,602 | △261,660,724 | —            |
| 償還差損益金                   | —            | —            | —            | —            | —            | △263,207,205 |
| (D) 受益権総口数               | 407,267,026口 | 409,537,649口 | 401,139,650口 | 371,865,124口 | 370,571,965口 | 372,120,567口 |
| 1万口当り基準価額(C/D)           | 3,457円       | 3,320円       | 3,265円       | 3,281円       | 2,939円       | —            |
| 1万口当り償還価額(C/D)           | —            | —            | —            | —            | —            | 2,926円83銭    |

\* 当作成期首における元本額は402,982,547円、当作成期間(第114期～償還期)中における追加設定元本額は24,267,339円、同解約元本額は55,129,319円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は2,926円83銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は263,207,205円です。

■損益の状況

第114期 自2021年12月14日 至2022年1月13日 第117期 自2022年3月15日 至2022年4月13日  
 第115期 自2022年1月14日 至2022年2月14日 第118期 自2022年4月14日 至2022年5月13日  
 第116期 自2022年2月15日 至2022年3月14日 償還期 自2022年5月14日 至2022年6月13日

| 項 目              | 第 114 期        | 第 115 期        | 第 116 期        | 第 117 期        | 第 118 期        | 償 還 期          |
|------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 配当等収益        | 1,746,150円     | 1,792,893円     | 1,629,572円     | 1,599,785円     | 1,639,754円     | △ 2,320円       |
| 受取配当金            | 1,746,208      | 1,792,927      | 1,629,586      | 1,599,792      | 1,639,760      | —              |
| 支払利息             | △ 58           | △ 34           | △ 14           | △ 7            | △ 6            | △ 2,320        |
| (B) 有価証券売買損益     | 829,472        | △ 5,189,639    | △ 1,706,494    | 1,007,765      | △ 12,322,042   | △ 321,424      |
| 売買益              | 844,410        | 1,512          | 28,567         | 1,123,168      | 488            | —              |
| 売買損              | △ 14,938       | △ 5,191,151    | △ 1,735,061    | △ 115,403      | △ 12,322,530   | △ 321,424      |
| (C) 信託報酬等        | △ 166,444      | △ 164,243      | △ 140,941      | △ 141,817      | △ 134,876      | △ 129,270      |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,409,178      | △ 3,560,989    | △ 217,863      | 2,465,733      | △ 10,817,164   | △ 453,014      |
| (E) 前期繰越損益金      | △136,294,097   | △135,471,258   | △137,239,015   | △128,323,361   | △126,421,126   | △138,690,307   |
| (F) 追加信託差損益金     | △130,540,857   | △132,489,869   | △130,721,056   | △122,142,649   | △122,569,575   | △124,063,884   |
| (配当等相当額)         | ( 26,624,148)  | ( 26,372,736)  | ( 25,421,867)  | ( 23,087,288)  | ( 22,661,662)  | ( 22,406,930)  |
| (売買損益相当額)        | (△157,165,005) | (△158,862,605) | (△156,142,923) | (△145,229,937) | (△145,231,237) | (△146,470,814) |
| (G) 合計(D+E+F)    | △264,425,776   | △271,522,116   | △268,177,934   | △248,000,277   | △259,807,865   | △263,207,205   |
| (H) 収益分配金        | △ 2,036,335    | △ 2,047,688    | △ 2,005,698    | △ 1,859,325    | △ 1,852,859    | —              |
| 次期繰越損益金(G+H)     | △266,462,111   | △273,569,804   | △270,183,632   | △249,859,602   | △261,660,724   | —              |
| 追加信託差損益金         | △130,943,896   | △132,908,912   | △131,238,123   | △122,489,194   | △122,917,556   | —              |
| (配当等相当額)         | ( 26,221,109)  | ( 25,953,693)  | ( 24,904,800)  | ( 22,740,743)  | ( 22,313,681)  | ( —)           |
| (売買損益相当額)        | (△157,165,005) | (△158,862,605) | (△156,142,923) | (△145,229,937) | (△145,231,237) | ( —)           |
| 繰越損益金            | △135,518,215   | △140,660,892   | △138,945,509   | △127,370,408   | △138,743,168   | —              |
| 償還差損益金(G)        | —              | —              | —              | —              | —              | △263,207,205   |

(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) 第114期～第118期の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                   | 第 114 期      | 第 115 期      | 第 116 期      | 第 117 期      | 第 118 期      |
|----------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益      | 1,633,296円   | 1,628,645円   | 1,488,631円   | 1,512,780円   | 1,504,878円   |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 0            | 0            | 0            | 0            | 0            |
| (c) 収益調整金            | 26,624,148   | 26,372,736   | 25,421,867   | 23,087,288   | 22,661,662   |
| (d) 分配準備積立金          | 0            | 0            | 0            | 0            | 0            |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 28,257,444   | 28,001,381   | 26,910,498   | 24,600,068   | 24,166,540   |
| (f) 分配金              | 2,036,335    | 2,047,688    | 2,005,698    | 1,859,325    | 1,852,859    |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e-f)   | 26,221,109   | 25,953,693   | 24,904,800   | 22,740,743   | 22,313,681   |
| (h) 受益権総口数           | 407,267,026□ | 409,537,649□ | 401,139,650□ | 371,865,124□ | 370,571,965□ |

## 投資信託財産運用総括表

| 信託期間  | 投資信託契約締結日    | 2012年6月27日   |                | 投資信託契約終了時の状況 |              |
|-------|--------------|--------------|----------------|--------------|--------------|
|       | 投資信託契約終了日    | 2022年6月13日   |                | 資産総額         | 109,042,730円 |
| 区分    | 投資信託契約締結当初   | 投資信託契約終了時    | 差引増減<br>又は追加信託 | 負債総額         | 129,368円     |
|       |              |              |                | 純資産総額        | 108,913,362円 |
| 受益権口数 | 400,000,000□ | 372,120,567□ | △27,879,433□   | 受益権口数        | 372,120,567□ |
| 元本額   | 400,000,000円 | 372,120,567円 | △27,879,433円   | 1 単位当り償還金    | 2,926円83銭    |

## 毎計算期末の状況

| 計算期  | 元本額           | 純資産総額         | 基準価額   | 1 単位当り分配金 |      |
|------|---------------|---------------|--------|-----------|------|
|      |               |               |        | 金額        | 分配率  |
|      | 円             | 円             | 円      | 円         | %    |
| 第1期  | 680,448,773   | 695,664,185   | 10,224 | 0         | 0.00 |
| 第2期  | 1,201,156,390 | 1,233,134,762 | 10,266 | 80        | 0.80 |
| 第3期  | 1,705,688,807 | 1,731,426,907 | 10,151 | 80        | 0.80 |
| 第4期  | 2,653,880,803 | 2,670,891,654 | 10,064 | 80        | 0.80 |
| 第5期  | 2,824,556,539 | 2,860,198,138 | 10,126 | 80        | 0.80 |
| 第6期  | 3,339,465,875 | 3,390,869,713 | 10,154 | 80        | 0.80 |
| 第7期  | 4,335,902,247 | 4,454,156,808 | 10,273 | 80        | 0.80 |
| 第8期  | 4,616,670,896 | 4,731,497,589 | 10,249 | 80        | 0.80 |
| 第9期  | 4,516,168,073 | 4,717,705,625 | 10,446 | 80        | 0.80 |
| 第10期 | 4,185,730,480 | 4,385,840,787 | 10,478 | 80        | 0.80 |
| 第11期 | 4,265,510,567 | 4,069,271,026 | 9,540  | 80        | 0.80 |
| 第12期 | 4,294,882,040 | 4,197,424,802 | 9,773  | 80        | 0.80 |
| 第13期 | 4,320,902,885 | 4,120,135,332 | 9,535  | 80        | 0.80 |
| 第14期 | 4,342,936,232 | 4,023,502,265 | 9,264  | 80        | 0.80 |
| 第15期 | 4,106,400,710 | 3,869,607,473 | 9,423  | 80        | 0.80 |
| 第16期 | 4,093,880,417 | 3,817,269,833 | 9,324  | 80        | 0.80 |

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)

| 計算期  | 元本額           | 純資産総額         | 基準価額  | 1 単位当り分配金 |      |
|------|---------------|---------------|-------|-----------|------|
|      |               |               |       | 金額        | 分配率  |
|      | 円             | 円             | 円     | 円         | %    |
| 第17期 | 4,057,653,657 | 3,615,356,130 | 8,910 | 80        | 0.80 |
| 第18期 | 3,961,234,566 | 3,622,574,989 | 9,145 | 80        | 0.80 |
| 第19期 | 3,665,147,315 | 3,370,301,729 | 9,196 | 80        | 0.80 |
| 第20期 | 3,420,076,893 | 3,152,395,777 | 9,217 | 80        | 0.80 |
| 第21期 | 3,071,989,787 | 2,825,007,536 | 9,196 | 80        | 0.80 |
| 第22期 | 2,911,573,013 | 2,722,919,799 | 9,352 | 80        | 0.80 |
| 第23期 | 2,801,243,922 | 2,605,991,472 | 9,303 | 80        | 0.80 |
| 第24期 | 2,776,013,635 | 2,573,809,320 | 9,272 | 80        | 0.80 |
| 第25期 | 2,695,411,214 | 2,476,011,782 | 9,186 | 80        | 0.80 |
| 第26期 | 2,622,771,031 | 2,380,497,788 | 9,076 | 80        | 0.80 |
| 第27期 | 2,511,672,028 | 2,232,540,706 | 8,889 | 80        | 0.80 |
| 第28期 | 2,372,362,143 | 2,162,854,032 | 9,117 | 80        | 0.80 |
| 第29期 | 1,946,187,910 | 1,766,895,791 | 9,079 | 80        | 0.80 |
| 第30期 | 1,837,832,053 | 1,676,902,254 | 9,124 | 80        | 0.80 |
| 第31期 | 1,835,920,902 | 1,664,913,051 | 9,069 | 80        | 0.80 |
| 第32期 | 1,813,441,722 | 1,595,094,778 | 8,796 | 80        | 0.80 |
| 第33期 | 1,778,637,486 | 1,568,957,075 | 8,821 | 80        | 0.80 |
| 第34期 | 1,778,153,772 | 1,495,403,377 | 8,410 | 80        | 0.80 |
| 第35期 | 1,736,168,820 | 1,420,875,486 | 8,184 | 80        | 0.80 |
| 第36期 | 1,689,847,629 | 1,375,639,413 | 8,141 | 80        | 0.80 |
| 第37期 | 1,684,179,229 | 1,370,843,519 | 8,140 | 80        | 0.80 |
| 第38期 | 1,647,257,427 | 1,269,276,494 | 7,705 | 80        | 0.80 |
| 第39期 | 1,605,222,647 | 1,280,886,976 | 7,979 | 80        | 0.80 |
| 第40期 | 1,564,435,361 | 1,226,695,802 | 7,841 | 80        | 0.80 |
| 第41期 | 1,580,386,029 | 1,228,985,932 | 7,776 | 80        | 0.80 |
| 第42期 | 1,501,101,044 | 1,157,941,917 | 7,714 | 80        | 0.80 |
| 第43期 | 1,513,840,446 | 1,122,880,154 | 7,417 | 80        | 0.80 |
| 第44期 | 1,469,043,549 | 1,147,517,867 | 7,811 | 80        | 0.80 |
| 第45期 | 1,396,197,529 | 1,098,540,674 | 7,868 | 80        | 0.80 |
| 第46期 | 1,384,163,548 | 1,087,976,324 | 7,860 | 80        | 0.80 |
| 第47期 | 1,349,104,001 | 1,053,084,542 | 7,806 | 80        | 0.80 |
| 第48期 | 1,263,117,934 | 996,575,541   | 7,890 | 80        | 0.80 |
| 第49期 | 1,229,170,836 | 961,447,853   | 7,822 | 80        | 0.80 |
| 第50期 | 1,190,208,311 | 899,303,798   | 7,556 | 80        | 0.80 |
| 第51期 | 1,168,548,038 | 851,881,274   | 7,290 | 80        | 0.80 |

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)

| 計算期  | 元本額           | 純資産総額       | 基準価額  | 1 単位当り分配金 |      |
|------|---------------|-------------|-------|-----------|------|
|      |               |             |       | 金額        | 分配率  |
|      | 円             | 円           | 円     | 円         | %    |
| 第52期 | 1,171,816,799 | 800,170,209 | 6,828 | 80        | 0.80 |
| 第53期 | 1,146,204,474 | 808,649,415 | 7,055 | 80        | 0.80 |
| 第54期 | 1,189,900,345 | 837,278,001 | 7,037 | 80        | 0.80 |
| 第55期 | 1,150,300,290 | 806,286,774 | 7,009 | 80        | 0.80 |
| 第56期 | 1,142,037,060 | 779,683,287 | 6,827 | 80        | 0.80 |
| 第57期 | 1,142,565,328 | 796,096,877 | 6,968 | 80        | 0.80 |
| 第58期 | 1,145,237,635 | 777,501,049 | 6,789 | 80        | 0.80 |
| 第59期 | 1,198,632,687 | 816,394,077 | 6,811 | 80        | 0.80 |
| 第60期 | 1,147,317,063 | 754,894,807 | 6,580 | 80        | 0.80 |
| 第61期 | 1,093,822,530 | 716,227,925 | 6,548 | 80        | 0.80 |
| 第62期 | 1,054,655,530 | 694,185,242 | 6,582 | 80        | 0.80 |
| 第63期 | 1,018,352,512 | 661,421,694 | 6,495 | 80        | 0.80 |
| 第64期 | 997,408,914   | 644,453,345 | 6,461 | 80        | 0.80 |
| 第65期 | 963,102,420   | 615,736,643 | 6,393 | 80        | 0.80 |
| 第66期 | 966,121,174   | 592,007,912 | 6,128 | 80        | 0.80 |
| 第67期 | 973,440,535   | 561,674,215 | 5,770 | 80        | 0.80 |
| 第68期 | 802,972,043   | 465,216,984 | 5,794 | 80        | 0.80 |
| 第69期 | 799,293,196   | 455,058,329 | 5,693 | 80        | 0.80 |
| 第70期 | 786,848,310   | 454,864,361 | 5,781 | 80        | 0.80 |
| 第71期 | 804,315,958   | 460,931,149 | 5,731 | 80        | 0.80 |
| 第72期 | 823,378,536   | 467,926,693 | 5,683 | 80        | 0.80 |
| 第73期 | 869,400,650   | 486,331,424 | 5,594 | 80        | 0.80 |
| 第74期 | 869,215,829   | 480,393,599 | 5,527 | 80        | 0.80 |
| 第75期 | 845,072,638   | 438,415,132 | 5,188 | 80        | 0.80 |
| 第76期 | 841,585,813   | 446,396,631 | 5,304 | 80        | 0.80 |
| 第77期 | 790,338,336   | 414,885,445 | 5,249 | 80        | 0.80 |
| 第78期 | 798,839,582   | 408,299,218 | 5,111 | 80        | 0.80 |
| 第79期 | 770,989,197   | 398,812,558 | 5,173 | 80        | 0.80 |
| 第80期 | 774,217,121   | 396,367,237 | 5,120 | 80        | 0.80 |
| 第81期 | 785,086,560   | 399,670,232 | 5,091 | 80        | 0.80 |
| 第82期 | 743,408,970   | 371,535,423 | 4,998 | 80        | 0.80 |
| 第83期 | 745,901,815   | 371,701,018 | 4,983 | 80        | 0.80 |
| 第84期 | 748,651,333   | 369,731,781 | 4,939 | 80        | 0.80 |
| 第85期 | 727,707,298   | 355,674,935 | 4,888 | 50        | 0.50 |
| 第86期 | 727,564,719   | 355,430,771 | 4,885 | 50        | 0.50 |

## 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)

| 計算期   | 元本額         | 純資産総額       | 基準価額  | 1 単位当たり分配金 |      |
|-------|-------------|-------------|-------|------------|------|
|       |             |             |       | 金額         | 分配率  |
|       | 円           | 円           | 円     | 円          | %    |
| 第87期  | 750,136,852 | 367,255,001 | 4,896 | 50         | 0.50 |
| 第88期  | 761,823,434 | 359,098,421 | 4,714 | 50         | 0.50 |
| 第89期  | 749,737,517 | 347,513,009 | 4,635 | 50         | 0.50 |
| 第90期  | 739,566,885 | 342,771,261 | 4,635 | 50         | 0.50 |
| 第91期  | 736,878,411 | 345,825,961 | 4,693 | 50         | 0.50 |
| 第92期  | 741,349,379 | 268,875,737 | 3,627 | 50         | 0.50 |
| 第93期  | 750,157,427 | 267,935,737 | 3,572 | 50         | 0.50 |
| 第94期  | 756,508,122 | 252,383,229 | 3,336 | 50         | 0.50 |
| 第95期  | 762,306,697 | 266,275,514 | 3,493 | 50         | 0.50 |
| 第96期  | 768,010,201 | 264,462,009 | 3,443 | 50         | 0.50 |
| 第97期  | 768,385,385 | 271,444,688 | 3,533 | 50         | 0.50 |
| 第98期  | 777,985,561 | 266,464,861 | 3,425 | 50         | 0.50 |
| 第99期  | 802,649,606 | 279,373,671 | 3,481 | 50         | 0.50 |
| 第100期 | 526,140,485 | 181,641,038 | 3,452 | 50         | 0.50 |
| 第101期 | 510,226,355 | 175,740,778 | 3,444 | 50         | 0.50 |
| 第102期 | 504,905,691 | 171,631,395 | 3,399 | 50         | 0.50 |
| 第103期 | 507,987,911 | 178,300,680 | 3,510 | 50         | 0.50 |
| 第104期 | 472,622,869 | 166,989,434 | 3,533 | 50         | 0.50 |
| 第105期 | 458,722,619 | 162,936,280 | 3,552 | 50         | 0.50 |
| 第106期 | 460,839,962 | 162,244,288 | 3,521 | 50         | 0.50 |
| 第107期 | 462,609,377 | 168,444,418 | 3,641 | 50         | 0.50 |
| 第108期 | 461,217,316 | 166,095,087 | 3,601 | 50         | 0.50 |
| 第109期 | 459,735,402 | 163,453,691 | 3,555 | 50         | 0.50 |
| 第110期 | 463,020,107 | 161,601,938 | 3,490 | 50         | 0.50 |
| 第111期 | 401,855,517 | 138,530,020 | 3,447 | 50         | 0.50 |
| 第112期 | 401,925,442 | 140,478,308 | 3,495 | 50         | 0.50 |
| 第113期 | 402,982,547 | 138,968,754 | 3,449 | 50         | 0.50 |
| 第114期 | 407,267,026 | 140,804,915 | 3,457 | 50         | 0.50 |
| 第115期 | 409,537,649 | 135,967,845 | 3,320 | 50         | 0.50 |
| 第116期 | 401,139,650 | 130,956,018 | 3,265 | 50         | 0.50 |
| 第117期 | 371,865,124 | 122,005,522 | 3,281 | 50         | 0.50 |
| 第118期 | 370,571,965 | 108,911,241 | 2,939 | 50         | 0.50 |

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

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)

| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ |         |         |         |         |         |
|---------------------|---------|---------|---------|---------|---------|
|                     | 第 114 期 | 第 115 期 | 第 116 期 | 第 117 期 | 第 118 期 |
| 1万口当り分配金 (税込み)      | 50円     | 50円     | 50円     | 50円     | 50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。

| 償 還 金 の お 知 ら せ |           |
|-----------------|-----------|
| 1 万 口 当 り 償 還 金 | 2,926円83銭 |

## 通貨セレクトコース (毎月分配型)

## 最近30期の運用実績

| 決算期                  | 基準価額       |            |           | S & P先進国REIT指数<br>(配当込み、現地通貨建て) |           | 公社債<br>組入比率 | 投資信託<br>組入比率 | 純資産<br>総額    |
|----------------------|------------|------------|-----------|---------------------------------|-----------|-------------|--------------|--------------|
|                      | (分配落)      | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (参考指数)                          | 期中<br>騰落率 |             |              |              |
| 90 期末(2020年 1 月14日)  | 円<br>2,791 | 円<br>50    | %<br>2.8  | 21,476                          | %<br>2.8  | %<br>-      | %<br>98.8    | 百万円<br>2,709 |
| 91 期末(2020年 2 月13日)  | 2,794      | 50         | 1.9       | 22,275                          | 3.7       | -           | 97.9         | 2,269        |
| 92 期末(2020年 3 月13日)  | 1,870      | 30         | △32.0     | 16,895                          | △24.2     | -           | 98.0         | 1,510        |
| 93 期末(2020年 4 月13日)  | 1,827      | 30         | △ 0.7     | 17,070                          | 1.0       | -           | 98.2         | 1,471        |
| 94 期末(2020年 5 月13日)  | 1,666      | 30         | △ 7.2     | 15,635                          | △ 8.4     | -           | 98.3         | 1,320        |
| 95 期末(2020年 6 月15日)  | 1,801      | 30         | 9.9       | 17,632                          | 12.8      | -           | 98.4         | 1,420        |
| 96 期末(2020年 7 月13日)  | 1,772      | 30         | 0.1       | 17,079                          | △ 3.1     | -           | 98.4         | 1,377        |
| 97 期末(2020年 8 月13日)  | 1,777      | 30         | 2.0       | 17,981                          | 5.3       | -           | 98.4         | 1,374        |
| 98 期末(2020年 9 月14日)  | 1,723      | 30         | △ 1.4     | 17,620                          | △ 2.0     | -           | 98.5         | 1,324        |
| 99 期末(2020年10月13日)   | 1,718      | 30         | 1.5       | 18,364                          | 4.2       | -           | 99.2         | 1,313        |
| 100 期末(2020年11月13日)  | 1,731      | 30         | 2.5       | 18,711                          | 1.9       | -           | 98.7         | 1,316        |
| 101 期末(2020年12月14日)  | 1,721      | 30         | 1.2       | 18,979                          | 1.4       | -           | 98.7         | 1,284        |
| 102 期末(2021年 1 月13日) | 1,734      | 30         | 2.5       | 18,896                          | △ 0.4     | -           | 98.4         | 1,287        |
| 103 期末(2021年 2 月15日) | 1,852      | 30         | 8.5       | 20,210                          | 7.0       | -           | 98.6         | 1,360        |
| 104 期末(2021年 3 月15日) | 1,887      | 20         | 3.0       | 20,824                          | 3.0       | -           | 98.8         | 1,379        |
| 105 期末(2021年 4 月13日) | 1,871      | 20         | 0.2       | 21,403                          | 2.8       | -           | 98.5         | 1,333        |
| 106 期末(2021年 5 月13日) | 1,898      | 20         | 2.5       | 21,610                          | 1.0       | -           | 98.5         | 1,279        |
| 107 期末(2021年 6 月14日) | 2,020      | 20         | 7.5       | 23,680                          | 9.6       | -           | 99.5         | 1,331        |
| 108 期末(2021年 7 月13日) | 1,985      | 20         | △ 0.7     | 24,042                          | 1.5       | -           | 98.5         | 1,290        |
| 109 期末(2021年 8 月13日) | 1,991      | 20         | 1.3       | 24,066                          | 0.1       | -           | 98.6         | 1,261        |
| 110 期末(2021年 9 月13日) | 1,986      | 20         | 0.8       | 24,023                          | △ 0.2     | -           | 99.0         | 1,249        |
| 111 期末(2021年10月13日)  | 1,991      | 20         | 1.3       | 23,751                          | △ 1.1     | -           | 98.8         | 1,236        |
| 112 期末(2021年11月15日)  | 2,008      | 20         | 1.9       | 25,056                          | 5.5       | -           | 98.5         | 1,185        |
| 113 期末(2021年12月13日)  | 1,826      | 20         | △ 8.1     | 25,224                          | 0.7       | -           | 98.6         | 1,070        |
| 114 期末(2022年 1 月13日) | 1,892      | 20         | 4.7       | 25,492                          | 1.1       | -           | 98.7         | 1,089        |
| 115 期末(2022年 2 月14日) | 1,875      | 20         | 0.2       | 24,090                          | △ 5.5     | -           | 98.5         | 1,064        |
| 116 期末(2022年 3 月14日) | 1,819      | 20         | △ 1.9     | 24,180                          | 0.4       | -           | 98.5         | 1,011        |
| 117 期末(2022年 4 月13日) | 2,030      | 20         | 12.7      | 25,295                          | 4.6       | -           | 98.5         | 1,076        |
| 118 期末(2022年 5 月13日) | 1,779      | 20         | △11.4     | 22,350                          | △11.6     | -           | 98.5         | 901          |
| 償還(2022年 6 月13日)     | 1,772.28   | -          | △ 0.4     | 21,936                          | △ 1.9     | -           | -            | 820          |

(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(配当込み、現地通貨建て)は、同指数の原データをもとに、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(配当込み、現地通貨建て)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。

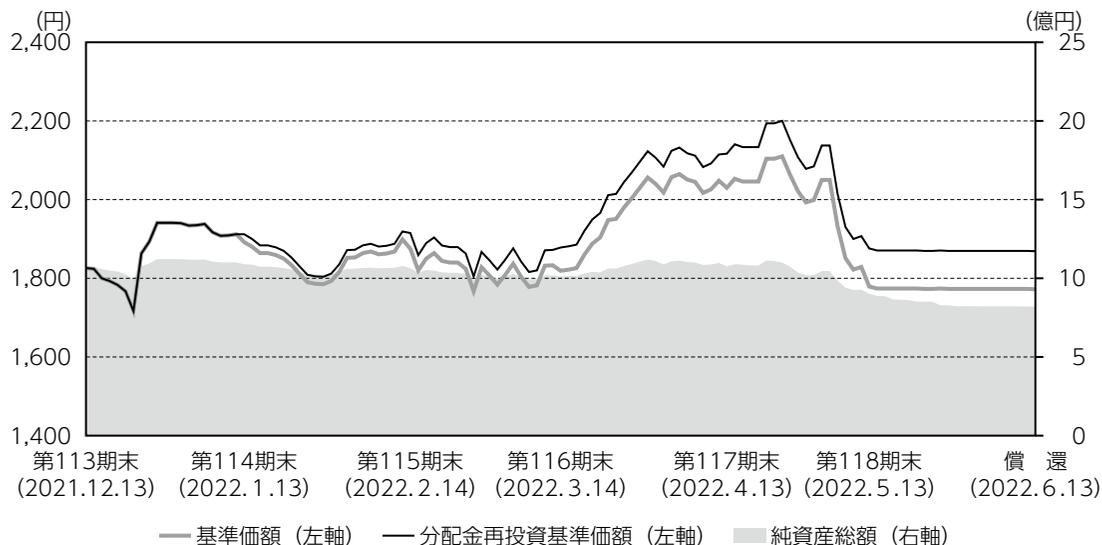
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。



## 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

設定時：10,000円

償還時：1,772円28銭（既払分配金11,350円）

騰落率：38.7%（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）の上昇がプラスに寄与したことで、基準価額は上昇しました。リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）については、先進国のリートへの投資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、原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を活用した結果、先進国リートが上昇したことや選定通貨が対円で上昇（円安）したことから、上昇しました。オプション取引はマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

※リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）：クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ グローバル・リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）

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)

|       | 年 月 日             | 基 準 価 額  |            | S & P先進国REIT指数<br>(配当込み、現地通貨建て)<br>(参考指数) |            | 公 社 債 率<br>組 入 比 | 投 資 信 託<br>受 益 証 券<br>組 入 比 率 |
|-------|-------------------|----------|------------|---|------------|------------------|-------------------------------|
|       |                   | 円        | 騰 落 率<br>% | 騰 落 率<br>%                                | 騰 落 率<br>% |                  |                               |
| 第114期 | (期首) 2021年12月13日  | 1,826    | —          | 25,224                                    | —          | —                | 98.6                          |
|       | 12月末              | 1,934    | 5.9        | 26,205                                    | 3.9        | —                | 97.1                          |
|       | (期末) 2022年 1 月13日 | 1,912    | 4.7        | 25,492                                    | 1.1        | —                | 98.7                          |
| 第115期 | (期首) 2022年 1 月13日 | 1,892    | —          | 25,492                                    | —          | —                | 98.7                          |
|       | 2022年 1 月末        | 1,816    | △ 4.0      | 24,388                                    | △ 4.3      | —                | 99.2                          |
|       | (期末) 2022年 2 月14日 | 1,895    | 0.2        | 24,090                                    | △ 5.5      | —                | 98.5                          |
| 第116期 | (期首) 2022年 2 月14日 | 1,875    | —          | 24,090                                    | —          | —                | 98.5                          |
|       | 2 月末              | 1,828    | △ 2.5      | 24,270                                    | 0.7        | —                | 98.5                          |
|       | (期末) 2022年 3 月14日 | 1,839    | △ 1.9      | 24,180                                    | 0.4        | —                | 98.5                          |
| 第117期 | (期首) 2022年 3 月14日 | 1,819    | —          | 24,180                                    | —          | —                | 98.5                          |
|       | 3 月末              | 2,040    | 12.1       | 25,712                                    | 6.3        | —                | 98.9                          |
|       | (期末) 2022年 4 月13日 | 2,050    | 12.7       | 25,295                                    | 4.6        | —                | 98.5                          |
| 第118期 | (期首) 2022年 4 月13日 | 2,030    | —          | 25,295                                    | —          | —                | 98.5                          |
|       | 4 月末              | 1,999    | △ 1.5      | 25,130                                    | △ 0.7      | —                | 98.8                          |
|       | (期末) 2022年 5 月13日 | 1,799    | △11.4      | 22,350                                    | △11.6      | —                | 98.5                          |
| 償 還 期 | (期首) 2022年 5 月13日 | 1,779    | —          | 22,350                                    | —          | —                | 98.5                          |
|       | 5 月末              | 1,773    | △ 0.3      | 23,421                                    | 4.8        | —                | —                             |
|       | (償還) 2022年 6 月13日 | 1,772.28 | △ 0.4      | 21,936                                    | △ 1.9      | —                | —                             |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

(2012.6.27～2022.6.13)

## ■先進国リート市況

先進国リート市況は上昇しました。

当ファンド設定時から2019年末にかけて、世界経済の回復やリーートの好調な業績動向が支援材料となり、堅調に推移しました。2020年以降は、新型コロナウイルスの感染拡大から一時急落しましたが、主要国で金融緩和政策や景気刺激策が実施されたことで、上昇しました。2022年以降は、インフレ圧力の高進を受けて主要国で金融政策の正常化が進む中、金融引き締めの加速見通しや金利上昇などが嫌気され、リート市況は上昇幅を縮小しました。

国別の現地通貨建ての騰落率を見ると、香港や日本などは相対的に堅調に推移した一方で、オランダやフランスが相対的に軟調となりました。現地通貨建てのセクター別では、産業施設や特殊施設などは相対的に堅調に推移した一方で、商業施設やホテル／リゾートなどは相対的に軟調となりました。

## ■為替相場

選定通貨（※）は、個別国要因などを背景に対円でまちまちな動きとなりました。

モディ政権による構造改革期待などが好感されたインド・ルピーや、当局による通貨安誘導が後退した中国・人民元などは対円で上昇（円安）しました。一方で、ロシアと欧米との関係悪化が嫌気されたロシア・ルーブルや、中央銀行に対する信認低下が懸念されたトルコ・リラなどは対円で下落（円高）しました。

※選定通貨とは、通貨の選定方針により、為替取引の対象通貨として選定された通貨をいいます。

## ■短期金利市況

選定通貨の短期金利は、高い経済成長率やインフレ率を背景に、米ドルの短期金利をおおむね上回って推移しました。

## 信託期間中の運用方針

### ■当ファンド

当ファンドは、リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。また、リートα・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。

### ■リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）

安定的な配当が見込め、下値抵抗力がある相対的に割安な銘柄を選定し、リーートのバリュエーションやオプション取引価格等を考慮して、リートポートフォリオを構築します。

個別銘柄ごとに、価格の方向性に基づき、保有株数の一部または全部にかかるコール・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。

原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を活用して、選定通貨で実質的な運用を行います。選定通貨については原則として、F T S E世界国債インデックスおよびJ P 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。

### ■ダイワ・マネースtock・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。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2012.6.27～2022.6.13)

### ■当ファンド

リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）とダイワ・マネースtock・マザーファンドに投資しました。リートα・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しました。

### ■リートα・ファンド（通貨セレクトクラス）

安定的な配当が見込め、下値抵抗力がある相対的に割安な銘柄を選定し、リーートのバリュエーションやオプション取引価格等を考慮して、リートポートフォリオを構築しました。

個別銘柄ごとに、価格の方向性に基づき、保有株数の一部または全部にかかるコール・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した。

原資産通貨売り／選定通貨買いの為替取引を活用して、選定通貨で実質的な運用を行いました。取引対象通貨においては、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を勘案し、中長期的な視点から安定したキャリー（利息収入）収益が享受できる6通貨を毎月選定し、運用を行いました。当ファンド設定日以降、インド・ルピー、インドネシア・ルピア、フィリピン・ペソ、中国・人民元、豪ドル、ニュージーランド・ドル、ロシア・ルーブル、南アフリカ・ランド、トルコ・リラ、ルーマニ

ア・レイ、ブラジル・レアル、メキシコ・ペソ、コロンビア・ペソ、チリ・ペソ、ハンガリー・フォリント、チェコ・コルナを選定通貨に組み入れました。

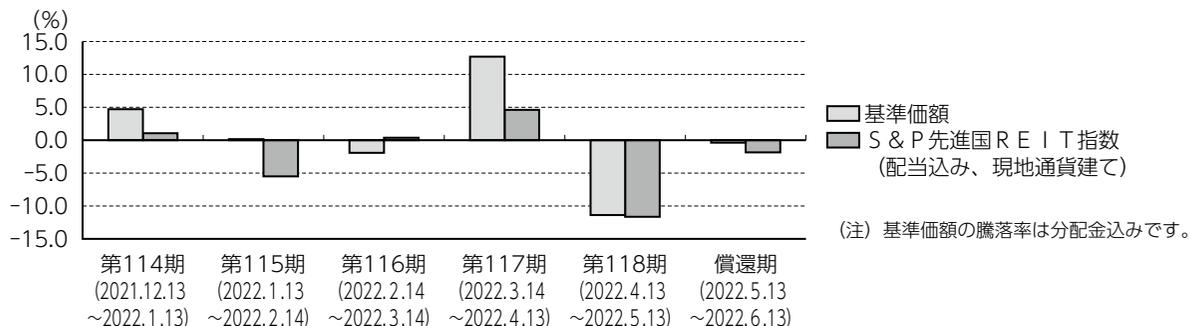
### ■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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いました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当作成期における当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドはカバードコール戦略を構築していますので、オプション取引要因は参考指数との差異の要因に含まれます。



## 分配金について

1万口当り、第2期～第26期各140円、第27期～第38期各200円、第39期～第50期各140円、第51期～第68期各100円、第69期～第76期各70円、第77期～第91期各50円、第92期～第103期各30円、第104期～第118期各20円の収益分配を行いました。なお、第1期は分配方針通り収益分配は行いませんでした。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目           | 第114期                      | 第115期                     | 第116期                     | 第117期                     | 第118期                     |
|---------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|               | 2021年12月14日<br>～2022年1月13日 | 2022年1月14日<br>～2022年2月14日 | 2022年2月15日<br>～2022年3月14日 | 2022年3月15日<br>～2022年4月13日 | 2022年4月14日<br>～2022年5月13日 |
| 当期分配金（税込み）（円） | 20                         | 20                        | 20                        | 20                        | 20                        |
| 対基準価額比率（％）    | 1.05                       | 1.06                      | 1.09                      | 0.98                      | 1.11                      |
| 当期の収益（円）      | 20                         | 20                        | 20                        | 20                        | 20                        |
| 当期の収益以外（円）    | —                          | —                         | —                         | —                         | —                         |
| 翌期繰越分配対象額（円）  | 3,192                      | 3,204                     | 3,214                     | 3,227                     | 3,242                     |

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

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

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

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

| 項 目                        | 第114期    | 第115期    | 第116期    | 第117期    | 第118期    |
|----------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | ✓ 32.50円 | ✓ 31.77円 | ✓ 29.53円 | ✓ 33.42円 | ✓ 34.36円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     |
| (c) 収益調整金                  | 2,658.52 | 2,660.17 | 2,661.59 | 2,663.03 | 2,664.10 |
| (d) 分配準備積立金                | 521.94   | 532.80   | 543.17   | 551.27   | 563.63   |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 3,212.97 | 3,224.76 | 3,234.30 | 3,247.73 | 3,262.09 |
| (f) 分配金                    | 20.00    | 20.00    | 20.00    | 20.00    | 20.00    |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 3,192.97 | 3,204.76 | 3,214.30 | 3,227.73 | 3,242.09 |

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

| 項 目           | 第114期～償還期<br>(2021.12.14~2022.6.13) |         | 項 目 の 概 要   |
|---------------|-------------------------------------|---------|---|
|               | 金 額                                 | 比 率     |   |
| 信 託 報 酬       | 13円                                 | 0.671%  | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は1,882円です。                       |
| (投 信 会 社)     | (4)                                 | (0.218) | 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)     | (8)                                 | (0.437) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                         |
| (受 託 会 社)     | (0)                                 | (0.015) | 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 | —                                   | —       | 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<br>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<br>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     | —                                   | —       | 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   |
| 合 計           | 13                                  | 0.671   |   |

(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。

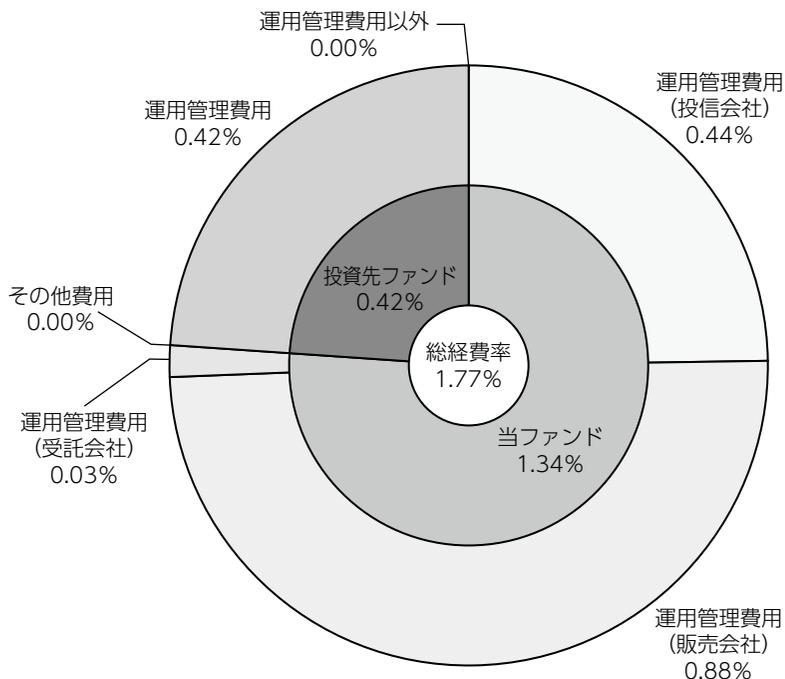
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.77%です。



|                      |       |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③)         | 1.77% |
| ①当ファンドの費用の比率         | 1.34% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.42% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.00% |

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

(注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。

(注4) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2021年12月14日から2022年6月13日まで)

| 決算期     | 第 114 期 ~ 償還期 |         |              |           |
|---------|---------------|---------|--------------|-----------|
|         | 買 付           |         | 売 付          |           |
|         | □ 数           | 金 額     | □ 数          | 金 額       |
|         | 千口            | 千円      | 千口           | 千円        |
| 外国（邦貨建） | 6,592,1273    | 120,393 | 65,342,42657 | 1,124,831 |

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。  
 (注2) 金額は受渡し代金。  
 (注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年12月14日から2022年6月13日まで)

| 決算期                  | 第 114 期 ~ 償還期 |     |     |     |
|----------------------|---------------|-----|-----|-----|
|                      | 設 定           |     | 解 約 |     |
|                      | □ 数           | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
|                      | 千口            | 千円  | 千口  | 千円  |
| ダイワ・マネースtock・マザーファンド | -             | -   | 99  | 99  |

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2021年12月14日から2022年6月13日まで)

| 第 114 期   |             |        |      | ~ 償 還 期   |              |           |      |
|---|-------------|--------|------|---|--------------|-----------|------|
| 買 付   |             |        |      | 売 付   |              |           |      |
| 銘 柄   | □ 数         | 金 額    | 平均単価 | 銘 柄   | □ 数          | 金 額       | 平均単価 |
|   | 千口          | 千円     | 円    |   | 千口           | 千円        | 円    |
| GLOBAL REIT ALPHA FUND CURRENCY SELECT CLASS (ケイマン諸島) | 1,459,22283 | 27,000 | 18   | GLOBAL REIT ALPHA FUND CURRENCY SELECT CLASS (ケイマン諸島) | 65,342,42657 | 1,124,831 | 17   |

(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

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

最終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

2022年6月13日現在

| 項 目          | 償 還 時         |            |
|--------------|---------------|------------|
|              | 評 価 額         | 比 率        |
| コール・ローン等、その他 | 千円<br>822,144 | %<br>100.0 |
| 投資信託財産総額     | 822,144       | 100.0      |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

| 種 類                  | 第 113 期 末 |
|----------------------|-----------|
|                      | □ 数       |
| ダイワ・マネースtock・マザーファンド | 千口<br>99  |

(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

(2022年1月13日)、(2022年2月14日)、(2022年3月14日)、(2022年4月13日)、(2022年5月13日)、(2022年6月13日)現在

| 項 目                      | 第 114 期 末      | 第 115 期 末      | 第 116 期 末      | 第 117 期 末      | 第 118 期 末      | 償 還 時          |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 資産                   | 1,131,121,809円 | 1,084,276,734円 | 1,026,105,149円 | 1,117,243,328円 | 915,956,471円   | 822,144,555円   |
| コール・ローン等                 | 55,977,812     | 35,601,858     | 29,763,358     | 29,613,918     | 27,632,756     | 822,144,555    |
| 投資信託(受益証券(評価額))          | 1,075,044,157  | 1,048,575,046  | 996,241,961    | 1,059,614,346  | 888,223,885    | -              |
| ダイワ・マネーストック・マザーファンド(評価額) | 99,840         | 99,830         | 99,830         | 99,830         | 99,830         | -              |
| 未収入金                     | -              | -              | -              | 27,915,234     | -              | -              |
| (B) 負債                   | 41,496,346     | 19,938,710     | 15,097,263     | 41,204,152     | 14,382,232     | 1,480,367      |
| 未払金                      | 27,000,000     | -              | -              | 13,957,617     | -              | -              |
| 未払収益分配金                  | 11,518,050     | 11,353,610     | 11,114,350     | 10,601,154     | 10,134,159     | -              |
| 未払解約金                    | 1,723,975      | 7,327,628      | 2,922,701      | 15,452,480     | 3,083,404      | 479,479        |
| 未払信託報酬                   | 1,254,321      | 1,257,472      | 1,060,212      | 1,192,901      | 1,164,669      | 1,000,143      |
| 未払利息                     | -              | -              | -              | -              | -              | 745            |
| (C) 純資産総額(A-B)           | 1,089,625,463  | 1,064,338,024  | 1,011,007,886  | 1,076,039,176  | 901,574,239    | 820,664,188    |
| 元本                       | 5,759,025,169  | 5,676,805,368  | 5,557,175,135  | 5,300,577,250  | 5,067,079,787  | 4,630,565,149  |
| 次期繰越増益金                  | △4,669,399,706 | △4,612,467,344 | △4,546,167,249 | △4,224,538,074 | △4,165,505,548 | -              |
| 償還差損益金                   | -              | -              | -              | -              | -              | △3,809,900,961 |
| (D) 受益権総口数               | 5,759,025,169口 | 5,676,805,368口 | 5,557,175,135口 | 5,300,577,250口 | 5,067,079,787口 | 4,630,565,149口 |
| 1万口当り基準価額(C/D)           | 1,892円         | 1,875円         | 1,819円         | 2,030円         | 1,779円         | -              |
| 1万口当り償還価額(C/D)           | -              | -              | -              | -              | -              | 1,772円28銭      |

\* 当作成期首における元本額は5,863,388,449円、当作成期間(第114期～償還期)中における追加設定元本額は86,055,222円、同解約元本額は1,318,878,522円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は1,772円28銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,809,900,961円です。

■損益の状況

第114期 自2021年12月14日 至2022年1月13日 第117期 自2022年3月15日 至2022年4月13日  
 第115期 自2022年1月14日 至2022年2月14日 第118期 自2022年4月14日 至2022年5月13日  
 第116期 自2022年2月15日 至2022年3月14日 償還期 自2022年5月14日 至2022年6月13日

| 項 目             | 第 114 期          | 第 115 期          | 第 116 期          | 第 117 期          | 第 118 期          | 償 還 期            |
|-----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益       | 19,190,697円      | 19,297,790円      | 17,475,246円      | 17,890,984円      | 18,577,725円      | △ 17,802円        |
| 受取配当金           | 19,191,119       | 19,298,030       | 17,475,440       | 17,891,077       | 18,577,977       | -                |
| 受取利息            | -                | -                | 1                | -                | 2                | 155              |
| 支払利息            | △ 422            | △ 240            | △ 195            | △ 93             | △ 254            | △ 17,957         |
| (B) 有価証券売買損益    | 31,658,748       | △ 16,405,507     | △ 36,196,622     | 105,617,178      | △ 134,342,846    | △ 2,223,723      |
| 売買益             | 32,088,561       | 554,634          | 737,384          | 108,818,590      | 1,579,179        | -                |
| 売買損             | △ 429,813        | △ 16,960,141     | △ 36,934,006     | △ 3,201,412      | △ 135,922,025    | △ 2,223,723      |
| (C) 信託報酬等       | △ 1,254,321      | △ 1,257,472      | △ 1,060,212      | △ 1,192,901      | △ 1,164,669      | △ 1,000,143      |
| (D) 当期損益(A+B+C) | 49,595,124       | 1,634,811        | △ 19,781,588     | 122,315,261      | △ 116,929,790    | △ 3,241,668      |
| (E) 前期繰越増益金     | △3,509,209,167   | △3,411,091,239   | △3,340,047,008   | △3,206,924,701   | △2,953,265,978   | △2,807,698,883   |
| (F) 追加信託差損益金    | △1,198,267,613   | △1,191,657,306   | △1,175,224,303   | △1,129,327,480   | △1,085,175,621   | △ 998,960,410    |
| (配当等相当額)        | ( 1,531,054,013) | ( 1,510,131,901) | ( 1,479,094,211) | ( 1,411,560,733) | ( 1,349,920,812) | ( 1,234,320,085) |
| (売買損益相当額)       | (△2,729,321,626) | (△2,701,789,207) | (△2,654,318,514) | (△2,540,888,213) | (△2,435,096,433) | (△2,233,280,495) |
| (G) 合計(D+E+F)   | △4,657,881,656   | △4,601,113,734   | △4,535,052,899   | △4,213,936,920   | △4,155,371,389   | △3,809,900,961   |
| (H) 収益分配金       | △ 11,518,050     | △ 11,353,610     | △ 11,114,350     | △ 10,601,154     | △ 10,134,159     | -                |
| 次期繰越増益金(G+H)    | △4,669,399,706   | △4,612,467,344   | △4,546,167,249   | △4,224,538,074   | △4,165,505,548   | -                |
| 追加信託差損益金        | △1,198,267,613   | △1,191,657,306   | △1,175,224,303   | △1,129,327,480   | △1,085,175,621   | -                |
| (配当等相当額)        | ( 1,531,054,013) | ( 1,510,131,901) | ( 1,479,094,211) | ( 1,411,560,733) | ( 1,349,920,812) | ( -)             |
| (売買損益相当額)       | (△2,729,321,626) | (△2,701,789,207) | (△2,654,318,514) | (△2,540,888,213) | (△2,435,096,433) | ( -)             |
| 分配準備積立金         | 307,786,488      | 309,149,350      | 307,151,227      | 299,323,306      | 292,875,406      | -                |
| 繰越増益金           | △3,778,918,581   | △3,729,959,388   | △3,678,094,173   | △3,394,533,900   | △3,373,205,333   | -                |
| 償還差損益金(G)       | -                | -                | -                | -                | -                | △3,809,900,961   |

(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) 第114期～第118期の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                   | 第 114 期        | 第 115 期        | 第 116 期        | 第 117 期        | 第 118 期        |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益      | 18,717,316円    | 18,040,318円    | 16,415,034円    | 17,718,133円    | 17,413,056円    |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 0              | 0              | 0              | 0              | 0              |
| (c) 収益調整金            | 1,531,054,013  | 1,510,131,901  | 1,479,094,211  | 1,411,560,733  | 1,349,920,812  |
| (d) 分配準備積立金          | 300,587,222    | 302,462,642    | 301,850,543    | 292,206,327    | 285,596,509    |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 1,850,358,551  | 1,830,634,861  | 1,797,359,788  | 1,721,485,193  | 1,652,930,377  |
| (f) 分配金              | 11,518,050     | 11,353,610     | 11,114,350     | 10,601,154     | 10,134,159     |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e-f)   | 1,838,840,501  | 1,819,281,251  | 1,786,245,438  | 1,710,884,039  | 1,642,796,218  |
| (h) 受益権総口数           | 5,759,025,169口 | 5,676,805,368口 | 5,557,175,135口 | 5,300,577,250口 | 5,067,079,787口 |

投資信託財産運用総括表

| 信託期間  | 投資信託契約締結日    | 2012年6月27日     |                | 投資信託契約終了時の状況 |                |
|-------|--------------|----------------|----------------|--------------|----------------|
|       | 投資信託契約終了日    | 2022年6月13日     |                | 資産総額         | 822,144,555円   |
| 区分    | 投資信託契約締結当初   | 投資信託契約終了時      | 差引増減<br>又は追加信託 | 負債総額         | 1,480,367円     |
|       |              |                |                | 純資産総額        | 820,664,188円   |
| 受益権口数 | 100,000,000口 | 4,630,565,149口 | 4,530,565,149口 | 受益権口数        | 4,630,565,149口 |
| 元本額   | 100,000,000円 | 4,630,565,149円 | 4,530,565,149円 | 1単位当り償還金     | 1,772円28銭      |

毎計算期末の状況

| 計算期  | 元本額            | 純資産総額          | 基準価額   | 1 単位当り分配金 |      |
|------|----------------|----------------|--------|-----------|------|
|      |                |                |        | 金額        | 分配率  |
|      | 円              | 円              | 円      | 円         | %    |
| 第1期  | 1,379,077,366  | 1,445,575,721  | 10,482 | 0         | 0.00 |
| 第2期  | 5,805,355,014  | 6,043,204,869  | 10,410 | 140       | 1.40 |
| 第3期  | 9,880,080,453  | 10,256,338,442 | 10,381 | 140       | 1.40 |
| 第4期  | 17,155,400,599 | 17,672,048,748 | 10,301 | 140       | 1.40 |
| 第5期  | 24,539,884,918 | 26,517,203,885 | 10,806 | 140       | 1.40 |
| 第6期  | 29,981,870,921 | 35,023,762,419 | 11,682 | 140       | 1.40 |
| 第7期  | 35,311,250,086 | 43,918,820,119 | 12,438 | 140       | 1.40 |
| 第8期  | 37,879,582,785 | 48,056,186,955 | 12,687 | 140       | 1.40 |
| 第9期  | 38,156,153,488 | 50,853,550,797 | 13,328 | 140       | 1.40 |
| 第10期 | 37,246,232,162 | 50,955,733,799 | 13,681 | 140       | 1.40 |
| 第11期 | 34,585,960,914 | 38,494,827,819 | 11,130 | 140       | 1.40 |
| 第12期 | 34,066,240,319 | 39,261,898,804 | 11,525 | 140       | 1.40 |
| 第13期 | 33,049,385,100 | 36,068,908,586 | 10,914 | 140       | 1.40 |
| 第14期 | 32,582,238,893 | 34,800,719,878 | 10,681 | 140       | 1.40 |
| 第15期 | 32,300,125,833 | 35,562,161,785 | 11,010 | 140       | 1.40 |
| 第16期 | 31,636,038,423 | 33,549,647,718 | 10,605 | 140       | 1.40 |

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)

| 計算期  | 元本額            | 純資産総額          | 基準価額   | 1 単位当り分配金 |      |
|------|----------------|----------------|--------|-----------|------|
|      |                |                |        | 金額        | 分配率  |
|      | 円              | 円              | 円      | 円         | %    |
| 第17期 | 31,046,312,190 | 32,648,028,030 | 10,516 | 140       | 1.40 |
| 第18期 | 30,732,512,351 | 32,999,604,717 | 10,738 | 140       | 1.40 |
| 第19期 | 30,270,386,130 | 31,480,189,469 | 10,400 | 140       | 1.40 |
| 第20期 | 28,939,831,336 | 29,928,793,577 | 10,342 | 140       | 1.40 |
| 第21期 | 27,522,371,178 | 29,364,687,032 | 10,669 | 140       | 1.40 |
| 第22期 | 27,050,290,008 | 29,664,088,106 | 10,966 | 140       | 1.40 |
| 第23期 | 26,261,581,808 | 28,635,230,011 | 10,904 | 140       | 1.40 |
| 第24期 | 25,530,236,655 | 27,637,016,565 | 10,825 | 140       | 1.40 |
| 第25期 | 24,831,666,261 | 26,200,234,086 | 10,551 | 140       | 1.40 |
| 第26期 | 24,274,953,704 | 25,862,265,994 | 10,654 | 140       | 1.40 |
| 第27期 | 23,898,761,723 | 24,093,212,238 | 10,081 | 200       | 2.00 |
| 第28期 | 24,476,971,088 | 26,229,028,592 | 10,716 | 200       | 2.00 |
| 第29期 | 25,184,046,087 | 25,649,925,698 | 10,185 | 200       | 2.00 |
| 第30期 | 25,625,577,337 | 25,876,973,642 | 10,098 | 200       | 2.00 |
| 第31期 | 26,117,861,692 | 24,883,643,237 | 9,527  | 200       | 2.00 |
| 第32期 | 26,642,907,652 | 24,100,830,597 | 9,046  | 200       | 2.00 |
| 第33期 | 26,631,596,102 | 24,026,197,962 | 9,022  | 200       | 2.00 |
| 第34期 | 25,669,106,532 | 21,613,017,878 | 8,420  | 200       | 2.00 |
| 第35期 | 25,514,473,602 | 20,817,724,526 | 8,159  | 200       | 2.00 |
| 第36期 | 24,857,482,009 | 19,865,398,543 | 7,992  | 200       | 2.00 |
| 第37期 | 23,942,929,965 | 18,190,224,293 | 7,597  | 200       | 2.00 |
| 第38期 | 22,883,896,102 | 14,766,025,773 | 6,453  | 200       | 2.00 |
| 第39期 | 22,364,839,381 | 15,652,297,130 | 6,999  | 140       | 1.40 |
| 第40期 | 22,227,661,988 | 15,181,701,619 | 6,830  | 140       | 1.40 |
| 第41期 | 21,529,869,815 | 13,747,312,066 | 6,385  | 140       | 1.40 |
| 第42期 | 21,363,383,797 | 12,778,786,900 | 5,982  | 140       | 1.40 |
| 第43期 | 20,517,713,883 | 11,285,118,814 | 5,500  | 140       | 1.40 |
| 第44期 | 20,233,812,675 | 12,123,141,284 | 5,992  | 140       | 1.40 |
| 第45期 | 19,670,177,348 | 11,402,735,189 | 5,797  | 140       | 1.40 |
| 第46期 | 19,570,734,182 | 11,105,070,390 | 5,674  | 140       | 1.40 |
| 第47期 | 19,278,182,453 | 10,613,327,056 | 5,505  | 140       | 1.40 |
| 第48期 | 18,884,312,547 | 10,349,585,887 | 5,481  | 140       | 1.40 |
| 第49期 | 18,634,278,879 | 9,748,997,682  | 5,232  | 140       | 1.40 |
| 第50期 | 18,464,296,413 | 9,114,301,228  | 4,936  | 140       | 1.40 |
| 第51期 | 18,184,857,182 | 8,862,597,160  | 4,874  | 100       | 1.00 |

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)

| 計算期  | 元本額            | 純資産総額         | 基準価額  | 1 単位当り分配金 |      |
|------|----------------|---------------|-------|-----------|------|
|      |                |               |       | 金額        | 分配率  |
|      | 円              | 円             | 円     | 円         | %    |
| 第52期 | 17,366,410,864 | 7,654,807,174 | 4,408 | 100       | 1.00 |
| 第53期 | 17,104,055,021 | 8,496,524,037 | 4,968 | 100       | 1.00 |
| 第54期 | 16,797,624,372 | 8,236,918,449 | 4,904 | 100       | 1.00 |
| 第55期 | 16,408,250,462 | 8,062,291,427 | 4,914 | 100       | 1.00 |
| 第56期 | 16,079,287,841 | 7,740,826,688 | 4,814 | 100       | 1.00 |
| 第57期 | 15,772,904,230 | 7,463,236,995 | 4,732 | 100       | 1.00 |
| 第58期 | 15,669,183,346 | 7,521,616,796 | 4,800 | 100       | 1.00 |
| 第59期 | 15,163,387,565 | 7,066,436,130 | 4,660 | 100       | 1.00 |
| 第60期 | 14,835,378,105 | 6,780,023,293 | 4,570 | 100       | 1.00 |
| 第61期 | 14,666,922,598 | 6,470,535,460 | 4,412 | 100       | 1.00 |
| 第62期 | 14,588,389,181 | 6,589,631,889 | 4,517 | 100       | 1.00 |
| 第63期 | 14,503,787,104 | 6,383,923,452 | 4,402 | 100       | 1.00 |
| 第64期 | 13,686,355,080 | 5,893,783,979 | 4,306 | 100       | 1.00 |
| 第65期 | 12,702,792,428 | 5,413,802,719 | 4,262 | 100       | 1.00 |
| 第66期 | 12,569,098,209 | 5,130,613,936 | 4,082 | 100       | 1.00 |
| 第67期 | 12,348,428,931 | 4,571,198,927 | 3,702 | 100       | 1.00 |
| 第68期 | 12,302,769,587 | 4,457,586,356 | 3,623 | 100       | 1.00 |
| 第69期 | 12,129,919,955 | 4,270,898,368 | 3,521 | 70        | 0.70 |
| 第70期 | 11,894,983,069 | 4,179,005,019 | 3,513 | 70        | 0.70 |
| 第71期 | 11,664,424,420 | 3,982,307,182 | 3,414 | 70        | 0.70 |
| 第72期 | 11,560,044,926 | 3,932,014,212 | 3,401 | 70        | 0.70 |
| 第73期 | 11,432,079,235 | 3,524,028,297 | 3,083 | 70        | 0.70 |
| 第74期 | 11,334,983,508 | 3,418,886,099 | 3,016 | 70        | 0.70 |
| 第75期 | 11,358,474,344 | 3,279,025,714 | 2,887 | 70        | 0.70 |
| 第76期 | 11,277,131,229 | 3,392,083,005 | 3,008 | 70        | 0.70 |
| 第77期 | 11,258,246,184 | 3,407,570,988 | 3,027 | 50        | 0.50 |
| 第78期 | 11,083,997,386 | 3,193,902,793 | 2,882 | 50        | 0.50 |
| 第79期 | 10,845,771,320 | 3,273,768,779 | 3,018 | 50        | 0.50 |
| 第80期 | 10,772,983,925 | 3,234,872,991 | 3,003 | 50        | 0.50 |
| 第81期 | 10,638,569,332 | 3,234,096,861 | 3,040 | 50        | 0.50 |
| 第82期 | 10,555,721,513 | 3,039,134,897 | 2,879 | 50        | 0.50 |
| 第83期 | 9,864,711,674  | 2,872,388,062 | 2,912 | 50        | 0.50 |
| 第84期 | 9,765,607,921  | 2,863,600,426 | 2,932 | 50        | 0.50 |
| 第85期 | 9,664,304,127  | 2,720,601,951 | 2,815 | 50        | 0.50 |
| 第86期 | 9,683,206,041  | 2,776,111,396 | 2,867 | 50        | 0.50 |

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）

| 計算期   | 元本額           | 純資産総額         | 基準価額  | 1 単位当り分配金 |      |
|-------|---------------|---------------|-------|-----------|------|
|       |               |               |       | 金額        | 分配率  |
|       | 円             | 円             | 円     | 円         | %    |
| 第87期  | 9,668,927,487 | 2,775,352,946 | 2,870 | 50        | 0.50 |
| 第88期  | 9,600,686,939 | 2,679,527,007 | 2,791 | 50        | 0.50 |
| 第89期  | 9,542,125,956 | 2,636,080,792 | 2,763 | 50        | 0.50 |
| 第90期  | 9,708,354,667 | 2,709,291,953 | 2,791 | 50        | 0.50 |
| 第91期  | 8,124,788,603 | 2,269,923,844 | 2,794 | 50        | 0.50 |
| 第92期  | 8,076,817,838 | 1,510,217,840 | 1,870 | 30        | 0.30 |
| 第93期  | 8,054,065,911 | 1,471,248,311 | 1,827 | 30        | 0.30 |
| 第94期  | 7,921,804,770 | 1,320,159,052 | 1,666 | 30        | 0.30 |
| 第95期  | 7,888,543,073 | 1,420,738,541 | 1,801 | 30        | 0.30 |
| 第96期  | 7,774,237,841 | 1,377,743,841 | 1,772 | 30        | 0.30 |
| 第97期  | 7,733,272,004 | 1,374,519,940 | 1,777 | 30        | 0.30 |
| 第98期  | 7,686,102,732 | 1,324,553,506 | 1,723 | 30        | 0.30 |
| 第99期  | 7,647,366,806 | 1,313,968,401 | 1,718 | 30        | 0.30 |
| 第100期 | 7,604,315,885 | 1,316,592,976 | 1,731 | 30        | 0.30 |
| 第101期 | 7,463,665,387 | 1,284,726,302 | 1,721 | 30        | 0.30 |
| 第102期 | 7,427,444,484 | 1,287,640,181 | 1,734 | 30        | 0.30 |
| 第103期 | 7,345,324,218 | 1,360,264,598 | 1,852 | 30        | 0.30 |
| 第104期 | 7,310,681,728 | 1,379,187,041 | 1,887 | 20        | 0.20 |
| 第105期 | 7,127,048,706 | 1,333,290,234 | 1,871 | 20        | 0.20 |
| 第106期 | 6,737,890,352 | 1,279,068,911 | 1,898 | 20        | 0.20 |
| 第107期 | 6,593,470,265 | 1,331,927,456 | 2,020 | 20        | 0.20 |
| 第108期 | 6,501,228,920 | 1,290,743,613 | 1,985 | 20        | 0.20 |
| 第109期 | 6,334,350,711 | 1,261,386,248 | 1,991 | 20        | 0.20 |
| 第110期 | 6,292,777,485 | 1,249,589,588 | 1,986 | 20        | 0.20 |
| 第111期 | 6,206,700,484 | 1,236,049,963 | 1,991 | 20        | 0.20 |
| 第112期 | 5,903,023,537 | 1,185,209,915 | 2,008 | 20        | 0.20 |
| 第113期 | 5,863,388,449 | 1,070,600,940 | 1,826 | 20        | 0.20 |
| 第114期 | 5,759,025,169 | 1,089,625,463 | 1,892 | 20        | 0.20 |
| 第115期 | 5,676,805,368 | 1,064,338,024 | 1,875 | 20        | 0.20 |
| 第116期 | 5,557,175,135 | 1,011,007,886 | 1,819 | 20        | 0.20 |
| 第117期 | 5,300,577,250 | 1,076,039,176 | 2,030 | 20        | 0.20 |
| 第118期 | 5,067,079,787 | 901,574,239   | 1,779 | 20        | 0.20 |

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ |         |         |         |         |         |
|---------------------|---------|---------|---------|---------|---------|
|                     | 第 114 期 | 第 115 期 | 第 116 期 | 第 117 期 | 第 118 期 |
| 1万口当り分配金（税込み）       | 20円     | 20円     | 20円     | 20円     | 20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。

| 償 還 金 の お 知 ら せ |           |
|-----------------|-----------|
| 1 万 口 当 り 償 還 金 | 1,772円28銭 |

クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－グローバル・リートα・ファンド  
円ヘッジクラス／通貨セレクトクラス

当ファンド（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）／通貨セレクトコース（毎月分配型））はケイマン籍の外国投資信託「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－グローバル・リートα・ファンド 円ヘッジクラス／通貨セレクトクラス」に投資しておりますが、以下の内容はすべてのクラスを合算しております。

（注）2022年6月13日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

## 貸借対照表

2021年2月28日

|                                   | (円)                         |
|-----------------------------------|-----------------------------|
| <b>資産</b>                         |                             |
| 担保付スワップ投資の評価額（簿価： 9,670,122,383円） | 4,514,514,216               |
| デリバティブ金融商品の評価額                    | 14,591,005                  |
| 未収利息                              | 825,926                     |
| 約定未収金                             | 5,000,000                   |
| <b>資産合計</b>                       | <u><u>4,534,931,147</u></u> |
| <b>負債</b>                         |                             |
| デリバティブ金融商品の評価額                    | 52,011,313                  |
| 未払報酬代行会社報酬                        | 825,926                     |
| 未払解約金                             | 5,000,000                   |
| <b>負債合計</b>                       | <u><u>57,837,239</u></u>    |
| <b>換金可能受益証券の保有者に帰属する純資産</b>       | <u><u>4,477,093,908</u></u> |
| 次に属する純資産：                         |                             |
| ノンヘッジクラス受益証券                      | 934,594,418                 |
| 円ヘッジクラス受益証券                       | 2,219,039,862               |
| 通貨セレクトクラス受益証券                     | <u>1,323,459,628</u>        |
| 次に属する発行済受益証券口数：                   |                             |
| ノンヘッジクラス受益証券                      | 19,854,222.07               |
| 円ヘッジクラス受益証券                       | 63,841,574.51               |
| 通貨セレクトクラス受益証券                     | <u>68,911,225.08</u>        |
| 次に属する受益証券1口当り純資産額：                |                             |
| ノンヘッジクラス受益証券                      | 47.072                      |
| 円ヘッジクラス受益証券                       | 34.758                      |
| 通貨セレクトクラス受益証券                     | <u>19.205</u>               |

## 包括利益計算書

2021年2月28日に終了した会計年度

(円)

|                                |                               |
|--------------------------------|-------------------------------|
| 収益                             |                               |
| 時価による損益通算後の金融商品からの収益           |                               |
| 手数料収入                          | 953,327,919                   |
| 担保付スワップ投資による純損失                | (1,389,795,759)               |
| デリバティブの純損失                     | (19,950,943)                  |
|                                | <u>(456,418,783)</u>          |
| <b>収益合計</b>                    | <b><u>(456,418,783)</u></b>   |
| 営業費用                           | 25,620,061                    |
| <b>営業費用合計</b>                  | <b><u>25,620,061</u></b>      |
| 営業利益（金融費用控除前および控除後を含む）         | (482,038,844)                 |
| 換金可能受益証券の保有者への分配金              | (927,707,858)                 |
| 分配金支払後の換金可能受益証券の保有者に帰属する純資産の変動 | <u><u>(1,409,746,702)</u></u> |

## デリバティブ金融商品（為替先渡取引）

2021年2月28日時点での建玉残高

| 決済日          | 取引数 | 受取（評価益）<br>（円）    | 支払（評価損）<br>（円）      | 差引評価額<br>（円）        |
|--------------|-----|-------------------|---------------------|---------------------|
| 2021年3月16日   | 18  | 7,039,790         | (24,822,523)        | (17,782,733)        |
| 2021年3月24日   | 23  | 7,551,215         | (27,188,790)        | (19,637,575)        |
| <b>評価額合計</b> |     | <b>14,591,005</b> | <b>(52,011,313)</b> | <b>(37,420,308)</b> |

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド

## 運用報告書 第12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・マネースtock・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。

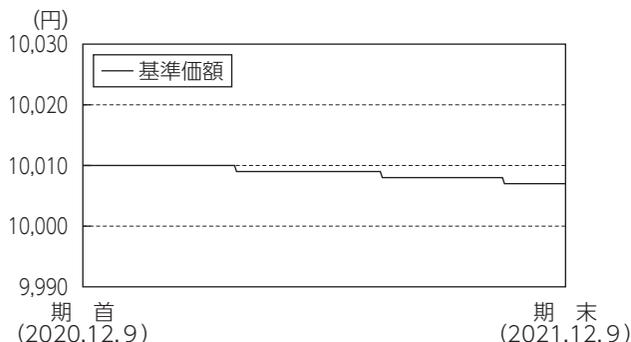
|        |                           |
|--------|---------------------------|
| 運用方針   | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 円建ての債券                    |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下               |

## 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 |
|----------------|--------|-------|---------|
|                | 円      | 騰落率 % |         |
| (期首)2020年12月9日 | 10,010 | -     | -       |
| 12月末           | 10,010 | 0.0   | -       |
| 2021年1月末       | 10,010 | 0.0   | -       |
| 2月末            | 10,010 | 0.0   | -       |
| 3月末            | 10,010 | 0.0   | -       |
| 4月末            | 10,009 | △0.0  | -       |
| 5月末            | 10,009 | △0.0  | -       |
| 6月末            | 10,009 | △0.0  | -       |
| 7月末            | 10,008 | △0.0  | -       |
| 8月末            | 10,008 | △0.0  | -       |
| 9月末            | 10,008 | △0.0  | -       |
| 10月末           | 10,007 | △0.0  | -       |
| 11月末           | 10,007 | △0.0  | -       |
| (期末)2021年12月9日 | 10,007 | △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、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

【基準価額・騰落率】

期首：10,010円 期末：10,007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、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<br>(その他) | 0<br>(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

当作成期中における売買および取引はありません。

■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         |
| コール・ローン等、その他 | 千円<br>147,987,988 | %<br>100.0 |
| 投資信託財産総額     | 147,987,988       | 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                   |
|-----------------------|-------------------------|
| <b>(A) 資産</b>         | <b>147,987,988,484円</b> |
| コール・ローン等              | 147,987,988,484         |
| <b>(B) 負債</b>         | <b>210,000,000</b>      |
| 未払解約金                 | 210,000,000             |
| <b>(C) 純資産総額(A-B)</b> | <b>147,777,988,484</b>  |
| 元本                    | 147,676,216,454         |
| 次期繰越損益金               | 101,772,030             |
| <b>(D) 受益権総口数</b>     | <b>147,676,216,454口</b> |
| 1万口当り基準価額(C/D)        | 10,007円                 |

\* 期首における元本額は88,319,921,795円、当作成期間中における追加設定元本額は176,557,677,368円、同解約元本額は117,201,382,709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：

|   |                 |
|---|-----------------|
| 日本株ロング・ショート戦略パレットファンド (適格機関投資家専用)                               | 266,761,115円    |
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド -ロボトテック                                      | 947,268円        |
| ダイワ/ミレニアセット・インド株式ファンド -インドの匠                                    | 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            |
| 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            |
| 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        |
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド -ロボトテック (為替ヘッジあり)                            | 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)                                     | 3,985円          |
| -ロボトテック (年1回) - (為替ヘッジあり)                                       |                 |
| i Freeレバレッジ S&P500  | 8,293,797,395円  |
| i Freeレバレッジ NASDAQ100   | 70,959,132,903円 |
| クリーンテック株式ファンド (資産成長型)   | 998,802円        |
| ロボット・テクノロジー関連株ファンド -ロボトテック (毎月決算/予想分配金提示型)                      | 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)                                    | 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)                                    | 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  | 5,345,339,466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                                     | 6,483,785,045円  |
| ダイワ上場投信-TOP1Xレバレッジ(2倍) 指数                                       | 1,334,794,630円  |
| ダイワ上場投信-TOP1Xダブルインバース(-2倍) 指数                                   | 936,360,631円    |
| ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス  | 6,676,062,567円  |
| ダイワ上場投信-TOP1Xインバース(-1倍) 指数                                      | 3,084,973,807円  |
| ダイワ上場投信-JPX日経400レバレッジ・インデックス                                    | 574,295,634円    |
| ダイワ上場投信-JPX日経400インバース・インデックス                                    | 861,497,868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                                 | 104,920,073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            |
| 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            |
| 先進国トータルリターン戦略ファンド (リスクリミット/適格機関投資家専用)                           | 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)                                      | 101,154,451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 -SITレバ                         | 301,448,680円    |
| ブルベア・マネー・ポートフォリオ6   | 16,464,882,107円 |
| ブル3倍日本株ポートフォリオ6   | 17,685,532,691円 |
| ベア2倍日本株ポートフォリオ6   | 1,058,922,067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                                    | 89,553,240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                                   | 2,938,475円      |
| 通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・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        |
| 通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・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・リアル・コース (毎月分配型) | 987,373円        |
| 通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・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        |
| 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          |
| ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)                                      | 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            |
| 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            |
| 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            |
| ダイワ/ミレニアセット亜細亜株式ファンド  | 9,958,176円      |
| 通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 米ドル・コース                     | 10,833円         |
| 通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース                | 10,788円         |
| 通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース                  | 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) -ロボトテック (年1回) -                     | 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    |
| 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     |
| 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    |
| 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     |
| ダイワ/ミレニアセット・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  |
| ダイワ/ミレニアセット・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    |
| ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド                               | 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    |
| 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     |
| 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・リアル・コース (毎月分配型) | 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    |
| 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)   | 15,402円     |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イギリスアイI- 予想分配金提示型 日本円・コース                | 300,273円    |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イギリスアイII- 予想分配金提示型 豪ドル・コース               | 200,861円    |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イギリスアイII- 予想分配金提示型 ブラジル・リアル・コース          | 300,273円    |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イギリスアイII- 予想分配金提示型 米ドル・コース               | 1,999,177円  |
| 通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イギリスアイII- 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース            | 505,900円    |

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,007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                  |
|------------------------|----------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>       | <b>△ 31,130,963円</b> |
| 受取利息                   | 469,134              |
| 支払利息                   | △ 31,600,097         |
| <b>(B) その他費用</b>       | <b>△ 147,839</b>     |
| <b>(C) 当期損益金(A+B)</b>  | <b>△ 31,278,802</b>  |
| <b>(D) 前期繰越損益金</b>     | <b>90,693,506</b>    |
| <b>(E) 解約差損益金</b>      | <b>△106,126,697</b>  |
| <b>(F) 追加信託差損益金</b>    | <b>148,484,023</b>   |
| <b>(G) 合計(C+D+E+F)</b> | <b>101,772,030</b>   |
| 次期繰越損益金(G)             | 101,772,030          |

(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。