

# ダイワ・ノーロード J-R E I Tファンド

## 運用報告書（全体版） 第7期

（決算日 2022年9月15日）

（作成対象期間 2021年9月16日～2022年9月15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、わが国のリート（不動産投資信託）に投資し、投資成果を東証REIT指数（配当込み）の動きに連動させること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。

### ★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／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	2015年12月9日～2025年9月12日	
運用方針	投資成果を東証REIT指数（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワJ-R E I Tマザーファンドの受益証券
	ダイワJ-R E I Tマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

◇TUZ0463420220915◇

## 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/>

<4634>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
3期末(2018年9月18日)	円 11,004	円 0	% 8.9	3,467.41	% 9.5	% 97.9	% 1.5	百万円 131
4期末(2019年9月17日)	13,651	0	24.1	4,334.17	25.0	97.7	1.9	204
5期末(2020年9月15日)	11,481	0	△15.9	3,670.48	△15.3	96.8	2.5	277
6期末(2021年9月15日)	14,583	0	27.0	4,692.90	27.9	96.6	2.5	350
7期末(2022年9月15日)	14,306	0	△ 1.9	4,637.15	△ 1.2	97.4	2.2	330

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、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。

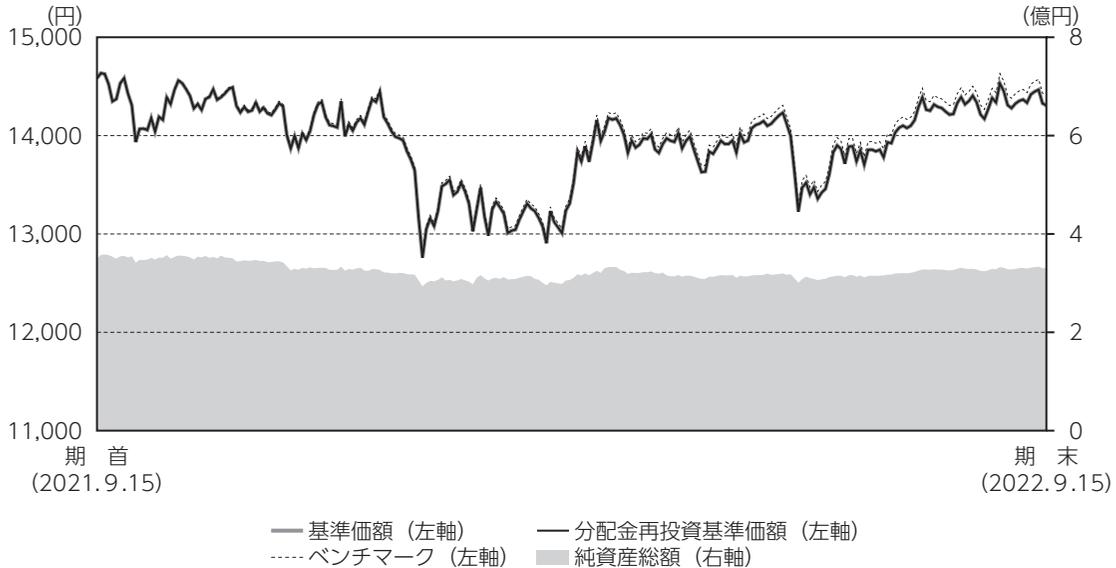
(注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。



## 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およびベンチマークは、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。
- \* ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：14,583円

期末：14,306円（分配金0円）

騰落率：△1.9%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から投資家のリスク選好姿勢が後退したことなどを背景に国内リート市況が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ノーロード J-REITファンド

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券 組入比率	不動産投信 指数先物率 比
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2021年 9月15日	14,583	% -	4,692.90	% -	% 96.6	% 2.5
9月末	14,308	△1.9	4,605.71	△1.9	97.0	2.5
10月末	14,470	△0.8	4,660.54	△0.7	97.5	2.5
11月末	13,870	△4.9	4,470.13	△4.7	97.4	2.5
12月末	14,342	△1.7	4,624.94	△1.4	97.4	2.5
2022年 1月末	13,549	△7.1	4,372.24	△6.8	97.4	2.5
2月末	13,145	△9.9	4,243.65	△9.6	97.4	2.5
3月末	14,043	△3.7	4,536.64	△3.3	97.5	2.5
4月末	13,870	△4.9	4,483.12	△4.5	97.5	2.5
5月末	14,108	△3.3	4,563.32	△2.8	97.5	2.4
6月末	13,864	△4.9	4,487.40	△4.4	97.6	2.3
7月末	14,293	△2.0	4,628.79	△1.4	97.7	2.3
8月末	14,453	△0.9	4,683.62	△0.2	97.7	2.3
(期末) 2022年 9月15日	14,306	△1.9	4,637.15	△1.2	97.4	2.2

(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

(2021.9.16~2022.9.15)

### ■国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、公募増資の発表が相次ぎ、株式需給の悪化懸念から下落し、2021年11月には南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことが懸念され、軟調に推移しました。2022年に入っても、年初から公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化から下落しました。加えて、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から投資家のリスク選好姿勢が後退したことや、ウクライナ情勢の悪化などを背景に下落しました。3月はウクライナでの停戦期待の高まりを受けて上昇に転じたものの、6月にはF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落しました。7月後半には米国のインフレ懸念がやや後退して米国の利上げペース鈍化期待から米国の長期金利が低下する中で上昇し、8月以降はほぼ横ばいの推移となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

## ポートフォリオについて

(2021.9.16~2022.9.15)

### ■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を組み入れることにより行いました。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99~100%程度としました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

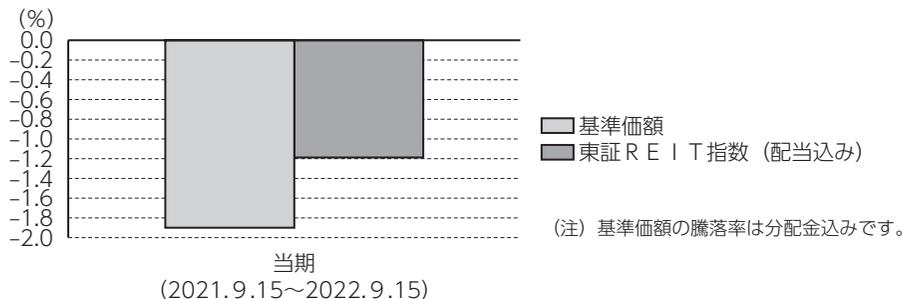
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワJ-REITマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.9%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との違い、先物取引の影響、運用管理費用、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益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。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年9月16日 ～2022年9月15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）	4,305

(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J-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.9.16~2022.9.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	92円	0.660%	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13,953円です。
(投 信 会 社)	(45)	(0.319)	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)	(43)	(0.308)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(5)	(0.033)	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	0	0.003	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.002)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	93	0.668	

(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。

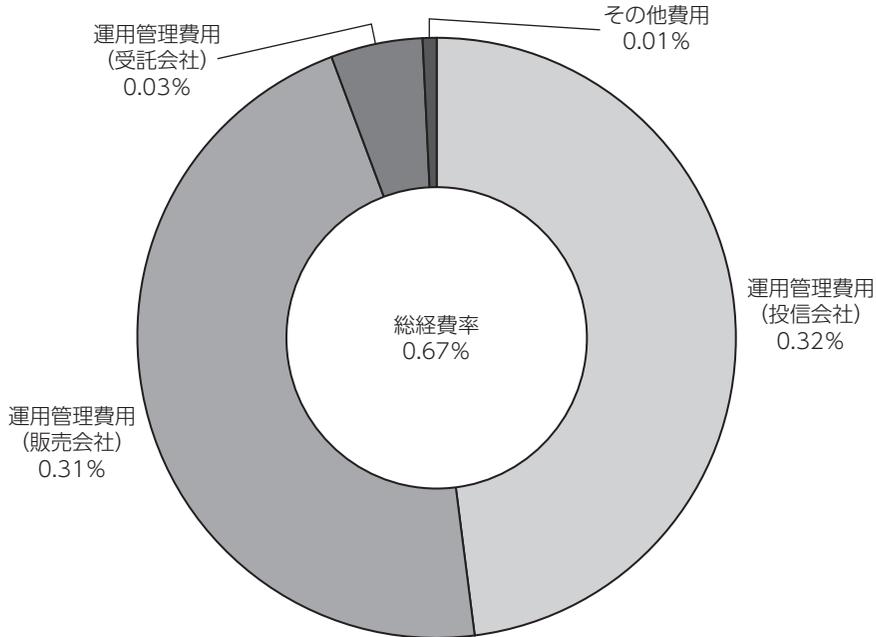
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.67%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9月16日から2022年9月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワJ-REIT マザーファンド	36,485	121,579	40,911	136,474

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年9月16日から2022年9月15日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 100,168	百万円 2,263	% 2.3	百万円 53,050	百万円 686	% 1.3
不動産投資指数 先物取引	47,696	-	-	48,100	-	-
コール・ローン	2,059,795	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.1%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年9月16日から2022年9月15日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITマザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資信託証券	百万円 3,019	百万円 1,514	百万円 14,967

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2021年9月16日から2022年9月15日まで)

種 類	当 期	
	ダイワJ-REITマザーファンド	
	買 付 額	額
投資信託証券		百万円 1,310

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、大和証券オフィス投資法人、サムディ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワJ-REITマザーファンド	100,608	96,182	330,523

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワJ-REITマザーファンド	330,523	99.6
コール・ローン等、その他	1,383	0.4
投資信託財産総額	331,906	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9月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	331,906,833円
コール・ローン等	1,383,823
ダイワJ-REITマザーファンド(評価額)	330,523,010
(B) 負債	1,218,064
未払解約金	146,968
未払信託報酬	1,062,330
その他未払費用	8,766
(C) 純資産総額(A-B)	330,688,769
元本	231,159,431
次期繰越増益金	99,529,338
(D) 受益権総口数	231,159,431口
1万口当り基準価額(C/D)	14,306円

\*期首における元本額は240,195,521円、当作成期間中における追加設定元本額は119,377,244円、同解約元本額は128,413,334円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は14,306円です。

■損益の状況

当期 自2021年9月16日 至2022年9月15日

項 目	当	期
(A) 配当等収益	△	102円
受取利息		15
支払利息	△	117
(B) 有価証券売買損益		2,257,944
売買益		6,002,845
売買損	△	3,744,901
(C) 信託報酬等	△	2,160,818
(D) 当期損益金(A + B + C)		97,024
(E) 前期繰越損益金		22,296,291
(F) 追加信託差損益金		77,136,023
(配当等相当額)	(	62,361,210)
(売買損益相当額)	(	14,774,813)
(G) 合計(D + E + F)		99,529,338
次期繰越損益金(G)		99,529,338
追加信託差損益金		77,136,023
(配当等相当額)	(	62,361,210)
(売買損益相当額)	(	14,774,813)
分配準備積立金		22,393,417
繰越損益金	△	102

- (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		96,993
(c) 収益調整金		77,136,023
(d) 分配準備積立金		22,296,424
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		99,529,440
(f) 分配金		0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		99,529,440
(h) 受益権総口数		231,159,431口

《お知らせ》

■マザーファンドの指数の算出会社の変更について

当ファンドの主要投資対象である「ダイワJ-REITマザーファンド」において、2022年4月1日付で株式会社東京証券取引所が東証REIT指数の算出等にかかる業務を株式会社JPX総研に移管したことに伴い、所要の変更を行いました。

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## 運用報告書 第37期（決算日 2022年9月15日）

（作成対象期間 2022年3月16日～2022年9月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴ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。

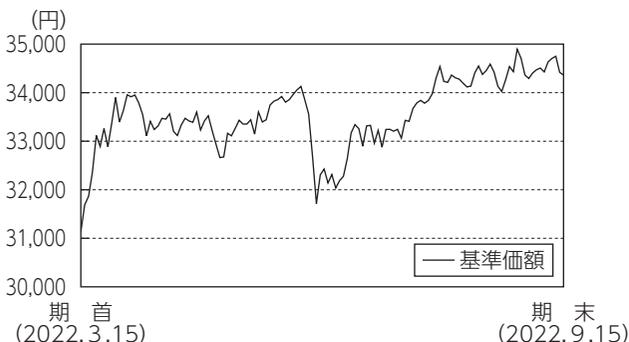
運用方針	「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託	不動産投信
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率	証券組入比率	指数先物比率
(期首)2022年3月15日	31,141	% -	4,200.48	% -	97.0	2.5
3月末	33,629	8.0	4,536.64	8.0	97.5	2.5
4月末	33,231	6.7	4,483.12	6.7	97.5	2.5
5月末	33,824	8.6	4,563.32	8.6	97.6	2.4
6月末	33,257	6.8	4,487.40	6.8	97.7	2.3
7月末	34,303	10.2	4,628.79	10.2	97.7	2.3
8月末	34,708	11.5	4,683.62	11.5	97.7	2.3
(期末)2022年9月15日	34,364	10.3	4,637.15	10.4	97.5	2.2

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。  
 (注3) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,141円 期末：34,364円 騰落率：10.3%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、米国の利上げペース鈍化期待などを背景に国内リート市況が上昇したことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、ウクライナでの停戦期待の高まりを受けて上昇したものの、2022年6月には、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落しました。7月後半には米国のインフレ懸念がやや後退して米国の利上げペース鈍化期待から米国の長期金利が低下する中で上昇し、8月以降はほぼ横ばいの推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度となりました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は10.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は10.3%となりました。ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。  
 \*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 (0) (1)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	1

(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

(1) 投資信託証券

(2022年3月16日から2022年9月15日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内	396.504	73,024,004	90.55 ( - )	17,133,562 ( - )

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2022年3月16日から2022年9月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	22,398	22,600	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2022年3月16日から2022年9月15日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千□	千円	円			千□	千円	円
日本ビルファンド		7.318	5,044,999	689,395	ＧＬＰ投資法人		11.236	1,937,336	172,422
ジャパンリアルエステイト		6.274	3,974,507	633,488	日本ビルファンド		1.598	1,092,071	683,398
日本プロロジスリート		10.274	3,566,119	347,101	ジャパンリアルエステイト		1.395	877,394	628,956
ＧＬＰ投資法人		20.081	3,436,035	171,108	ケネディクス・オフィス投資法人		1.084	767,360	707,897
野村不動産マスターＦ		20.292	3,370,435	166,096	日本プロロジスリート		2.182	756,736	346,808
日本都市ファンド投資法人		31.658	3,338,567	105,457	野村不動産マスターＦ		4.515	744,837	164,969
大和ハウスリート投資法人		9.586	3,034,448	316,549	日本都市ファンド投資法人		7.042	740,702	105,183
オリックス不動産投資		12.502	2,285,221	182,788	イオンリート投資		4.554	691,130	151,763
アドバンス・レジデンス		6.275	2,235,776	356,299	大和ハウスリート投資法人		2.005	629,086	313,758
産業ファンド		12.116	2,220,175	183,243	オリックス不動産投資		2.781	505,555	181,789

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内投資信託証券

銘 柄	期 首		当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	
	千口	千口	千円	
エスコンジャパンリート	7.818	8.883	1,063,295	
サンケイリアルエステート	12.297	14	1,384,600	
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	18.061	20.429	3,170,580	
東海道リート投資法	2.973	5.299	651,247	
日本アコモデーションファンド投資法人	13.405	15.09	10,170,660	
森ヒルズリート	45.653	51.39	8,114,481	
産業ファンド	55.115	65.307	11,572,400	
アドバンス・レジデンス	38.817	43.695	15,664,657	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	27.781	31.343	6,958,146	
ＡＰＩ投資法人	20.691	23.072	10,174,752	
ＧＬＰ投資法人	125.738	134.583	22,085,070	
コンフォリア・レジデンシャル	18.06	20.33	6,800,385	
日本プロロジスリート	63.518	71.61	23,846,130	
星野リゾート・リート	6.506	7.643	5,090,238	
Oneリート投資法人	6.737	7.623	2,080,316	
イオンリート投資	45.657	48.376	7,624,057	
ヒューリックリート投資法	36.218	40.888	6,963,226	
日本リート投資法人	11.98	14.195	5,436,685	
積水ハウス・リート投資	117.845	132.808	11,036,344	
トーセイ・リート投資法人	8.112	9.694	1,366,854	
ケネディクス商業リート	15.501	18.367	5,219,901	
ヘルスケア&メディカル投資	9.51	10.775	1,923,337	
サムティ・レジデンシャル	8.794	11.36	1,431,360	
野村不動産マスターF	125.545	141.322	23,614,906	
いちごホテルリート投資	6.432	7.24	734,860	
ラサールロジポート投資	47.527	53.499	9,078,780	
スターアジア不動産投	40.121	54.565	3,241,161	
マリモ地方創生リート	4.547	5.458	731,917	
三井不ロジパーク	15.293	17.264	9,011,808	
大江戸温泉リート	6.266	7.054	478,966	
投資法人みらい	47.027	53.093	2,713,052	
森トラスト・ホテルリート投	9.109	10.253	1,383,129	
三菱地所物流REIT	11.279	13.485	6,344,692	
CREOロジスティクスファンド	15.035	16.925	3,569,482	
ザイマックス・リート	6.266	7.089	899,594	
タカラレーベン不動産投	15.31	19.14	2,049,894	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	15.138	17.04	2,649,720	
日本ビルファンド	45.261	50.981	34,259,232	
ジャパンリアルエステイト	38.823	43.702	28,144,088	
日本都市ファンド投資法人	195.883	220.499	23,990,291	
オリックス不動産投資	77.354	87.075	16,944,795	
日本プライムリアルティ	26.528	29.887	12,253,670	
NTT都市開発リート投資法人	37.213	42.009	6,351,760	

銘 柄	期 首		当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	
	千口	千口	千円	
東急リアル・エステート	26.029	29.3	5,842,420	
グローバル・ワン不動産投資法人	26.959	29.94	3,377,232	
ユナイテッド・アーバン投資法人	87.397	98.38	14,865,218	
森トラスト総合リート	27.747	31.234	4,541,423	
インヴィンシブル投資法人	170.876	192.349	8,713,409	
フロンティア不動産投資	13.61	16.215	1,707,455	
平和不動産リート	25.151	29.867	4,647,305	
日本ロジスティクスファンド投資法人	26.177	29.467	9,429,440	
福岡リート投資法人	20.079	22.602	3,851,380	
ケネディクス・オフィス投資法人	12.01	12.843	9,131,373	
いちごオフィスリート投資法人	31.811	35.809	3,133,287	
大和証券オフィス投資法人	8.208	9.134	6,476,006	
阪急阪神リート投資法人	17.536	19.74	1,310,764	
スタートアップリート投資法人	6.046	6.805	1,781,549	
大和ハウスリート投資法人	58.293	65.874	20,783,247	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	118.937	140.93	10,104,681	
大和証券リビング投資法人	52.459	59.128	7,059,883	
ジャパンエクセレント投資法人	36.024	40.09	5,408,141	
合 計	□ 数、金 額	2,268.093	2,574.047	489,258,744
	銘 柄 数<比率>	61銘柄	61銘柄	<97.5%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 東証REIT	百万円 11,208	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	千円 489,258,744	% 97.4
コール・ローン等、その他	13,183,320	2.6
投資信託財産総額	502,442,065	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年9月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>507,471,440,496円</b>
コール・ローン等	6,530,297,704
投資信託証券(評価額)	489,258,744,600
未収入金	1,297,753,764
未収配当金	5,317,189,428
差入委託証拠金	5,067,455,000
<b>(B) 負債</b>	<b>5,623,101,000</b>
未払金	58,296,000
未払解約金	535,430,000
差入委託証拠金代用有価証券	5,029,375,000
<b>(C) 純資産総額(A－B)</b>	<b>501,848,339,496</b>
元本	146,038,189,431
次期繰越損益金	355,810,150,065
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>146,038,189,431口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	34,364円

\*期首における元本額は132,282,348,763円、当作成期間中における追加設定元本額は23,341,766,124円、同解約元本額は9,585,925,456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Ｊ－ＲＥＩＴオープン	4,585,546,552円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン(毎月分配型)	129,237,184,733円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン(年1回決算型)	351,518,136円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	12,750,205円
i Free J－ＲＥＩＴインデックス	621,113,864円
i Free 8資産バランス	1,632,984,544円
DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,480,094,654円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,439,997円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,780,467円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	782,103円
ダイワ・ノーロード J－ＲＥＩＴファンド	96,182,927円
ダイワファンドラップ J－ＲＥＩＴインデックス	2,258,097,789円
ダイワJ－REITインデックス(ダイワSMA専用)	321,441,449円
ダイワファンドラップオンライン J－REITインデックス	494,672,035円
ダイワ・インデックスセレクト J－REIT	933,599,976円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は34,364円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年3月16日 至2022年9月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>8,649,425,163円</b>
受取配当金	8,650,230,353
受取利息	889
その他収益金	504
支払利息	△ 806,583
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>33,941,550,618</b>
売買益	36,056,348,935
売買損	△ 2,114,798,317
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>1,072,736,000</b>
取引益	1,131,032,000
取引損	△ 58,296,000
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>43,663,711,781</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>279,659,950,862</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 21,972,792,334</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>54,459,279,756</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>355,810,150,065</b>
次期繰越損益金(H)	355,810,150,065

(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。

東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

### 《お知らせ》

#### ■指数の算出会社の変更について

2022年4月1日付で株式会社東京証券取引所が東証REIT指数の算出等にかかる業務を株式会社J P X総研に移管したことに伴い、所要の変更を行いました。