

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	追加型投信／国内／不動産投信（リート） 追加型投信／国内／債券
信託期間	約5年間（2012年6月29日～2017年6月22日）	
運用方針	ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主投資対象	ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。） イ、ダイワ・マネー・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券 ロ、本邦通貨表示の公社債
運用方法	ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	①わが国の不動産投資信託証券（リート）市場全体の中長期的な動きを捉える投資成果をめざして運用を行ないます。 ②運用にあたっては、わが国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託証券の時価総額構成比に応じて各銘柄の組入比率を決定します。不動産投資信託証券の組入比率は通常の状態と高位に維持することを基本とします。 ③運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ①マザーファンドの受益証券およびわが国の公社債を中心に投資することにより、安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A-2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマースナル・ペーパーに投資することを基本とします。
組入制限	ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	・株組入上限比率は純資産総額の10%以下 ・マザーファンドの組入上限比率は無制限 ・株組入上限比率は純資産総額の30%以下
分配方針	ダイワ日本リート・ファンド ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。基準価額の水準によっては、ポートフォリオの流動性等を考慮し、分配金額を決定する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてペーパーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

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

## 運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2016年6月22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。

さて、「ダイワ日本リート・ファンド」および「ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ」は、このたび、第4期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/> <4829>

<4830>

設定以来の運用実績

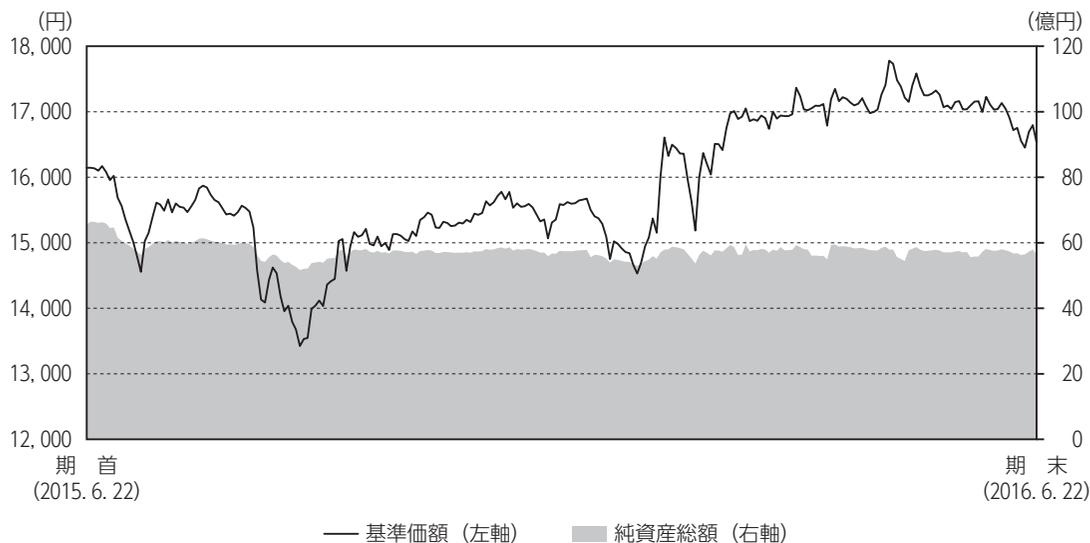
決 算 期	基 準 価 額			東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2013年 6 月24日)	12,920	700	36.2	2,110.88	42.0	97.0	2.5	6,199
2 期末 (2014年 6 月23日)	14,790	1,500	26.1	2,680.64	27.0	98.4	1.7	5,025
3 期末 (2015年 6 月22日)	16,145	1,300	18.0	3,194.47	19.2	97.3	2.0	6,552
4 期末 (2016年 6 月22日)	16,330	200	2.4	3,300.00	3.3	95.3	2.6	5,659

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

### ■ 基準価額・騰落率

期 首：16,145円

期 末：16,330円 (分配金200円)

騰落率：2.4% (分配金込み)

### ■ 基準価額の変動要因

わが国のリート（不動産投資信託）市場全体の中長期的な動きを捉える投資成果をめざして運用を行なった結果、日銀のマイナス金利政策導入による長期金利の低下などを背景に国内リート市況が堅調に推移したため、基準価額は上昇しました。

ダイワ日本リート・ファンド

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首)2015年6月22日	16,145	—	3,194.47	—	97.3	2.0
6月末	15,957	△ 1.2	3,157.69	△ 1.2	98.1	1.8
7月末	15,655	△ 3.0	3,100.40	△ 2.9	98.5	1.6
8月末	14,535	△ 10.0	2,881.06	△ 9.8	98.0	2.0
9月末	14,948	△ 7.4	2,964.58	△ 7.2	98.6	1.5
10月末	15,428	△ 4.4	3,061.58	△ 4.2	98.6	1.5
11月末	15,664	△ 3.0	3,110.54	△ 2.6	98.5	1.5
12月末	15,674	△ 2.9	3,115.04	△ 2.5	96.0	1.3
2016年1月末	16,001	△ 0.9	3,182.12	△ 0.4	96.4	1.4
2月末	16,889	4.6	3,361.11	5.2	98.6	1.3
3月末	17,119	6.0	3,409.88	6.7	98.0	2.0
4月末	17,385	7.7	3,465.54	8.5	97.5	2.3
5月末	17,154	6.2	3,422.69	7.1	98.0	2.0
(期末)2016年6月22日	16,530	2.4	3,300.00	3.3	95.3	2.6

(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

### ○国内リート市況

国内リート市況は、2015年7月以降、ギリシャのデフォルト（債務不履行）リスクや中国の株式市場の調整などをを受けて先行き不透明感が強まり、大きく下落する展開となりました。その後は、米国の利上げ時期に関する思惑の変化などにより値動きが荒くなる局面もありましたが、国内株式市場が反発したことや長期金利が低下傾向となったことなどを背景に、上昇基調となりました。2016年に入ると、原油価格や中国景気の先行きに対する懸念を背景に国内株式市場が下落したことなどをを受けて軟調に転じましたが、日銀がマイナス金利の導入を柱とする追加金融緩和策を発表すると、それ以降はおおむね堅調に推移しました。期末にかけては、英国のEU（欧州連合）離脱をめぐる懸念などをを受けて軟調な展開となりました。

## 前期における「今後の運用方針」

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

## ポートフォリオについて

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

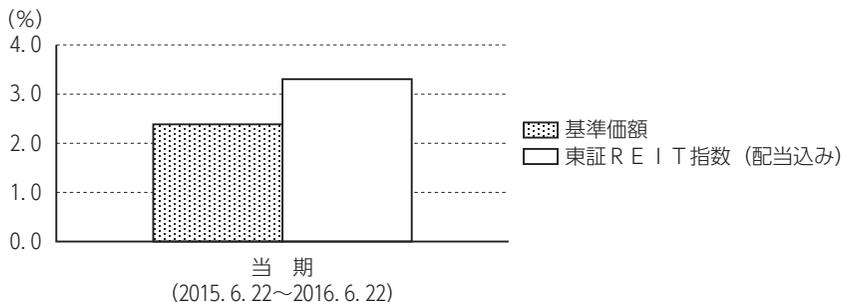
リートの実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）は、期を通じて95%以上を維持しました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。

当ファンドの基準価額と参考指数の対比では、参考指数（東証REIT指数（配当込み））の騰落率は3.3%となりました。一方、当ファンドの騰落率は2.4%となりました。



## 分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は200円といたしました。

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2015年6月23日 ～2016年6月22日	
当期分配金（税込み）	(円)	200
対基準価額比率	(%)	1.21
当期の収益	(円)	200
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	6,329

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

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

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

## ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	271.50円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	5,364.48
(d) 分配準備積立金	893.85
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	6,529.84
(f) 分配金	200.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,329.84

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

## 《今後の運用方針》

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

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 6. 23~2016. 6. 22)		
	金 額	比 率	
信託報酬	135円	0.853%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は15,880円です。</b>
(投信会社)	(60)	(0.378)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販売会社)	(69)	(0.432)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(7)	(0.043)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	3	0.020	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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)	(3)	(0.018)	
(投資信託証券)	(0)	(0.002)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／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＝期中のその他費用／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	139	0.878	

(注1) 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) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	10.936 千口	1,842,876 千円	(12.748 千口)	(2,785,562 千円)

(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

(2015年6月23日から2016年6月22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 不動産投信指数 先物取引	2,100 百万円	2,086 百万円	— 百万円	— 百万円

(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

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

当 期				期 付			
買 付	口 数	金 額	平均単価	売 付	口 数	金 額	平均単価
銘柄	口 数	金 額	平均単価	銘柄	口 数	金 額	平均単価
日本ビルファンド	0.189 千口	120,797 千円	639,138 円	日本ビルファンド	0.367 千口	227,640 千円	620,274 円
ジャパンリアルエステイト	0.172	109,746	638,063	ジャパンリアルエステイト	0.337	209,757	622,426
日本リテールファンド	0.396	99,021	250,054	日本リテールファンド	0.645	161,967	251,112
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.466	81,330	174,529	野村不動産マスターF	0.789	124,475	157,663
野村不動産マスターF	0.443	71,481	161,358	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.66	115,060	174,333
日本プロロジスリート	0.287	69,467	242,048	日本プロロジスリート	0.453	106,276	234,606
オリックス不動産投資	0.376	64,073	170,408	オリックス不動産投資	0.571	97,347	170,486
ラサールロジポート投資	0.589	63,602	107,983	日本プライムリアルティ	0.223	96,765	433,927
インヴァンシブル投資法人	0.837	61,665	73,674	アドバンス・レジデンス	0.338	93,208	275,766
G L P 投資法人	0.451	54,912	121,757	大和証券オフィス投資法人	0.125	81,812	654,497

(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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

決 算 期	当 期			期 付		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 1,842	百万円 4	% 0.3	百万円 2,785	百万円 —	% —
不動産投信指 数先物取引	2,100	—	—	2,086	—	—
コール・ローン	22,601	—	—	—	—	—

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

種 類	当 期		期末保有額
	買 付 額	売 付 額	
投資信託証券	百万円 43	百万円 81	百万円 142

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

種類	当期
	買付額
投資信託証券	百万円 44

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

(1) 国内投資信託証券

銘柄	期首	当期	期末
	□数	□数	評価額
日本アコモデーションファンド投資法人	千口 0.288	千口 0.227	千円 97,837
MCUBS MidCity投資法人	0.114	0.125	44,687
森ヒルズリート	0.935	0.822	129,054
野村不レジデンシャル	0.096	—	—
産業ファンド	0.21	0.165	89,100
大和ハウスリート	0.209	0.165	96,030
アドバンス・レジデンス	0.774	0.61	164,700
ケネディクスレジデンシャル	0.208	0.164	45,739
API投資法人	0.165	0.281	150,897
GLP投資法人	1.423	1.217	152,125
コンフォリア・レジデンシャル	0.282	0.241	53,622
日本プロロジスリート	1.03	0.864	209,520
NMF投資法人	0.991	—	—
星野リゾート・リート	0.03	0.038	48,260
SIA不動産投資	0.045	0.035	14,682
イオンリート投資	0.649	0.615	79,888
ヒューリックリート投資法	0.465	0.449	82,211
日本リート投資法人	0.181	0.184	50,673
インベスコ・オフィス・Jリート	0.32	0.377	35,400
日本ヘルスケア投資法	0.036	0.035	6,048
積水ハウス・リート投資	0.468	0.417	55,794
トーセイ・リート投資法人	0.057	0.076	8,572
ケネディクス商業リート	0.155	0.198	53,341
ヘルスケア&メディカル投資	0.072	0.057	5,762
サムティ・レジデンシャル	—	0.077	7,168
ジャパン・シニアリビング	—	0.04	5,960
野村不動産マスターF	—	1.747	285,634
いちごホテルリート投資	—	0.065	11,895
ラサールロジポート投資	—	0.516	52,890
スターアジア不動産投	—	0.162	14,968
日本ビルファンド	0.841	0.663	419,679

銘 柄	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ジャパンリアルエステイト	0.779	0.614	381,908
日本リートールファンド	1.447	1.198	308,724
オリックス不動産投資	1.331	1.136	199,936
日本プライムリアルティ プレミア投資法人	0.518	0.41	183,680
0.157	0.618	81,328	
東急リアル・エステート	0.582	0.459	67,105
グローバル・ワン不動産投資法人	0.115	0.091	36,263
野村不動産オフィスF	0.222	—	—
ユナイテッド・アーバン投資法人	1.574	1.38	248,400
森トラスト総合リート	0.786	0.619	120,147
インヴィンシブル投資法人	1.589	1.725	128,857
フロンティア不動産投資	0.295	0.233	119,995
平和不動産リート	0.566	0.476	38,508
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.494	0.413	95,485
福岡リート投資法人	0.445	0.351	69,568
ケネディクス・オフィス投資法人	0.241	0.19	115,140
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	0.606	0.478	54,731
いちごオフィスリート投資法人	0.843	0.716	57,494
大和証券オフィス投資法人	0.287	0.227	142,102
阪急リート投資法人	0.356	0.28	35,476
スタートアップシード投資法人	0.103	0.082	14,038
トップリート投資法人	0.105	0.083	35,109
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	0.445	0.351	94,524
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1.868	1.559	144,987
日本賃貸住宅投資法人	0.976	0.77	62,062
ジャパンエクセレント投資法人	0.722	0.593	86,222
合 計	□ 数、金 額	27.496	5,393,940
	銘 柄 数 < 比 率 >	51 銘柄	<95.3%>

(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
	百万円	百万円
国 内 東証REIT	148	—

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年6月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	5,393,940 千円	92.4 %
コール・ローン等、その他	444,662	7.6
投資信託財産総額	5,838,602	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

2016年6月22日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>6,141,435,946円</b>
コール・ローン等	422,485,899
投資信託証券 (評価額)	5,393,940,700
未収配当金	22,176,147
差入委託証拠金	302,833,200
<b>(B) 負債</b>	<b>482,052,623</b>
未払金	63,332,220
未払収益分配金	69,313,378
未払解約金	20,570,503
未払信託報酬	24,322,661
差入委託証拠金代用有価証券	304,360,000
その他未払費用	153,861
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>5,659,383,323</b>
元本	3,465,668,911
次期繰越損益金	2,193,714,412
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,465,668,911口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	16,330円

\*期首における元本額は4,058,429,102円、当期中における追加設定元本額は1,636,832,921円、同解約元本額は2,229,593,112円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は16,330円です。

■損益の状況

当期 自2015年6月23日 至2016年6月22日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>143,502,232円</b>
受取配当金	141,503,110
受取利息	22,110
その他収益金	1,995,960
支払利息	△ 18,948
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>36,828,089</b>
売買益	316,483,742
売買損	△ 353,311,831
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>2,409,815</b>
取引益	29,864,259
取引損	△ 27,454,444
<b>(D) 信託報酬等</b>	<b>△ 49,408,282</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	<b>59,675,676</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>309,781,431</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>1,893,570,683</b>
(配当等相当額)	( 738,785,380)
(売買損益相当額)	( 1,154,785,303)
<b>(H) 合計 (E + F + G)</b>	<b>2,263,027,790</b>
<b>(I) 収益分配金</b>	<b>△ 69,313,378</b>
<b>次期繰越損益金 (H + I)</b>	<b>2,193,714,412</b>
追加信託差損益金	1,893,570,683
(配当等相当額)	( 738,785,380)
(売買損益相当額)	( 1,154,785,303)
分配準備積立金	334,562,003
繰越損益金	△ 34,418,274

(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「収益分配金の計算過程 (総額)」の表を参照。

■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	94,093,950円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,859,152,409
(d) 分配準備積立金	309,781,431
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,263,027,790
(f) 分配金	69,313,378
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,193,714,412
(h) 受益権総口数	3,465,668,911口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	200円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は、6月22日現在の基準価額（1万口当り16,330円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

#### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債組入比率	純資産額
	税込み分配金	期中騰落率	額		
	円	円	%	%	百万円
1 期末(2013年 6 月24日)	10,006	0	0.1	66.0	154
2 期末(2014年 6 月23日)	10,010	0	0.0	56.3	79
3 期末(2015年 6 月22日)	10,010	0	0.0	37.6	108
4 期末(2016年 6 月22日)	10,009	0	△ 0.0	0.3	229

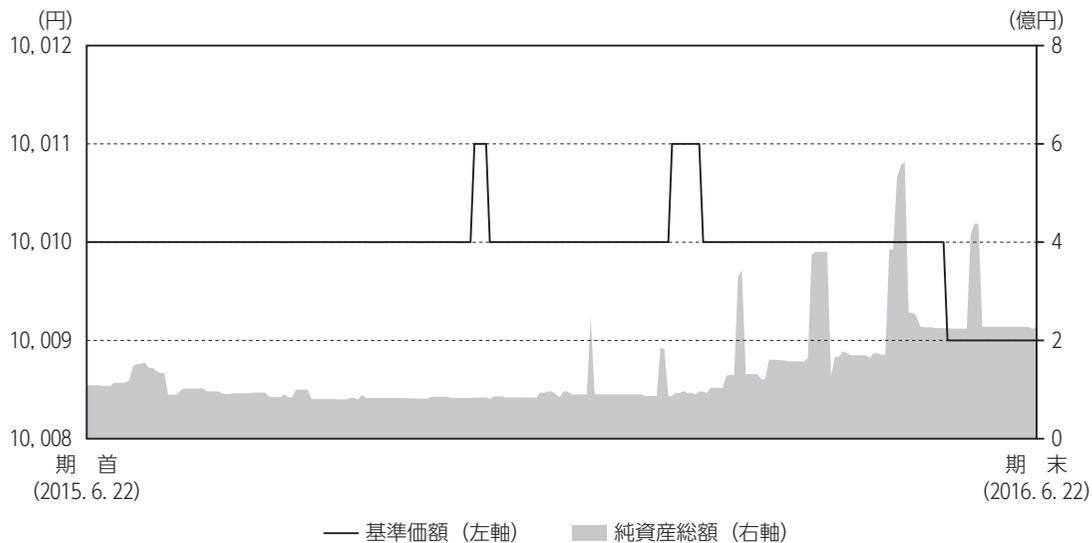
(注 1) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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

## 《運用経過》

### 基準価額等の推移について



#### ■ 基準価額・騰落率

期首：10,010円

期末：10,009円

騰落率：△0.0%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額は横ばいとなりました。

ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ

年 月 日	基 準	価 額		公社債組入比率
		騰 落 率		
(期首)2015年6月22日	円	10,010	—	% 37.6
6月末	10,010	0.0		38.3
7月末	10,010	0.0		34.9
8月末	10,010	0.0		47.4
9月末	10,010	0.0		46.8
10月末	10,010	0.0		49.3
11月末	10,010	0.0		29.9
12月末	10,010	0.0		29.1
2016年1月末	10,010	0.0		51.0
2月末	10,010	0.0		28.8
3月末	10,010	0.0		—
4月末	10,010	0.0		1.9
5月末	10,009	△ 0.0		0.0
(期末)2016年6月22日	10,009	△ 0.0		0.3

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

### ○国内短期金融市況

日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を導入したことを背景に、無担保コール翌日物金利は△0.06%程度まで低下、国庫短期証券（3カ月物）の利回りは△0.25%程度まで低下しました。

## 前期における「今後の運用方針」

### ○当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

### ○ダイワ・マネー・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なってまいります。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

### ○ダイワ・マネー・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定運用を行ないました。

## ベンチマークとの差異について

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

## 分配金について

当期は、基準価額の水準等を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2015年6月23日 ～2016年6月22日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	9

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

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

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

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

### ○ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 6. 23~2016. 6. 22)		
	金 額	比 率	
信託報酬	1円	0.012%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>期中の平均基準価額は10,010円です。</b>
(投信会社)	(0)	(0.003)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.008)	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
(受託銀行)	(0)	(0.001)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	0	0.001	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	1	0.012	

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■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

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	823,296	839,581	741,323	755,983

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当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期中の利害関係人との取引状況

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	165,047	10,260	6.2	11,349	—	—
コール・ローン	5,204,369	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.3%

※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) 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

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	75,351	157,324	160,424

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年6月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	160,424	68.5
コール・ローン等、その他	73,761	31.5
投資信託財産総額	234,185	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

2016年6月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	234,185,356円
コール・ローン等	73,761,325
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	160,424,031
(B) 負債	5,008,263
未払解約金	4,999,999
未払信託報酬	7,829
その他未払費用	435
(C) 純資産総額 (A - B)	229,177,093
元本	228,976,401
次期繰越損益金	200,692
(D) 受益権総口数	228,976,401口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,009円

\*期首における元本額は108,565,569円、当期中における追加設定元本額は1,659,992,160円、同解約元本額は1,539,581,328円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,009円です。

■損益の状況

当期 自2015年6月23日 至2016年6月22日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>660円</b>
受取利息	13,554
支払利息	△ 12,894
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>8,763</b>
売買益	17,030
売買損	△ 8,267
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 26,168</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 16,745</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>1</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>217,436</b>
(配当等相当額)	( 221,371)
(売買損益相当額)	(△ 3,935)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>200,692</b>
<b>次期繰越損益金 (G)</b>	<b>200,692</b>
追加信託差損益金	217,436
(配当等相当額)	( 221,371)
(売買損益相当額)	(△ 3,935)
分配準備積立金	1
繰越損益金	△ 16,745

(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せん。

(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「収益分配金の計算過程（総額）」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	221,371
(d) 分配準備積立金	1
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	221,372
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	221,372
(h) 受益権総口数	228,976,401口

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

## ダイワ・マネー・マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ）が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2015年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年6月22日）現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を21ページに併せて掲載いたしました。

### ■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2015年6月23日から2016年6月22日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
591 国庫短期証券 2016/5/30	24,330,973	567 国庫短期証券 2016/2/8	4,999,980
596 国庫短期証券 2016/6/20	14,390,312	566 国庫短期証券 2016/2/1	2,999,991
588 国庫短期証券 2016/5/16	12,500,147	342 2年国債 0.1% 2016/7/15	2,095,779
550 国庫短期証券 2015/11/9	8,509,995	100 5年国債 0.3% 2016/9/20	1,253,387
548 国庫短期証券 2015/11/2	7,399,995		
559 国庫短期証券 2015/12/21	7,049,991		
568 国庫短期証券 2016/2/15	7,000,000		
563 国庫短期証券 2016/1/18	6,099,995		
573 国庫短期証券 2016/3/7	5,800,988		
555 国庫短期証券 2015/12/7	5,499,999		

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2016年6月22日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（37,903,628千円）の内容です。

#### (1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2016年6月22日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 170,000	千円 170,002	% 0.4	% —	% —	% —	% 0.4

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

#### (2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2016年6月22日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	597 国庫短期証券	% —	千円 170,000	千円 170,002	2016/06/27	

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネー・マザーファンド

## 運用報告書 第11期 (決算日 2015年12月9日)

(計算期間 2014年12月10日～2015年12月9日)

ダイワ・マネー・マザーファンドの第11期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行いません。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
運用方法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行いません。 ②邦貨建資産の組入れにあたっては、取得時に第二位（A - 2 格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の30%以下

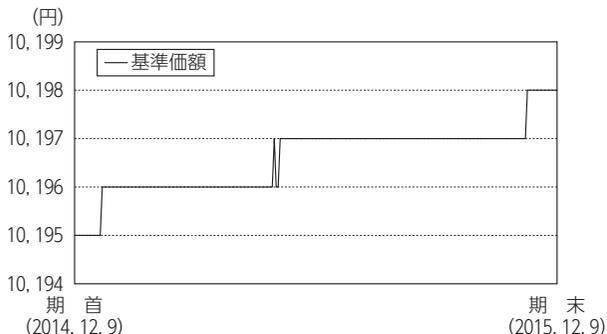
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額の推移



《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：10,195円 期末：10,198円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低金利が続き、無担保コール翌日物金利は0.07%台を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.11～0.02%程度で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

◆ポートフォリオについて

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定運用を行ないました。

◆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》

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

年月日	基準価額		公社債組入比率
	円	騰落率 %	
(期首) 2014年12月9日	10,195	—	60.0
12月末	10,196	0.0	88.5
2015年1月末	10,196	0.0	87.3
2月末	10,196	0.0	58.5
3月末	10,196	0.0	53.0
4月末	10,196	0.0	61.8
5月末	10,197	0.0	59.0
6月末	10,197	0.0	53.3
7月末	10,197	0.0	62.8
8月末	10,197	0.0	70.5
9月末	10,197	0.0	61.6
10月末	10,197	0.0	66.8
11月末	10,198	0.0	52.5
(期末) 2015年12月9日	10,198	0.0	55.2

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、利息収入の確保をめぐっ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。

■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	—
合計	—

(注) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円	千円
		120,653,910	( 92,494,000)

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

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当 期		期 末	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
550 国庫短期証券 2015/11/9	8,509,995		
548 国庫短期証券 2015/11/2	7,399,995		
559 国庫短期証券 2015/12/21	7,049,991		
563 国庫短期証券 2016/1/18	6,099,995		
555 国庫短期証券 2015/12/7	5,499,999		
557 国庫短期証券 2015/12/14	5,469,997		
568 国庫短期証券 2016/2/15	5,000,000		
567 国庫短期証券 2016/2/8	4,999,995		
573 国庫短期証券 2016/3/7	4,800,955		
520 国庫短期証券 2015/6/22	3,499,975		

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

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期 区 分	当 期			期 末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	43,554,000	43,559,849	55.2	—	—	—	55.2

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。  
 (注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

区 分	銘 柄	当 期		期 末	
		年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	537 国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,000	2015/12/10
	557 国庫短期証券	—	5,470,000	5,469,999	2015/12/14
	559 国庫短期証券	—	7,050,000	7,049,997	2015/12/21
	560 国庫短期証券	—	2,790,000	2,789,999	2015/12/28
	563 国庫短期証券	—	6,100,000	6,099,997	2016/01/18
	566 国庫短期証券	—	3,000,000	2,999,998	2016/02/01
	567 国庫短期証券	—	5,000,000	4,999,996	2016/02/08
	568 国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,000	2016/02/15
	573 国庫短期証券	—	4,800,000	4,800,934	2016/03/07
	342 2年国債	0.1000	2,094,000	2,095,675	2016/07/15
	100 5年国債	0.3000	1,250,000	1,253,250	2016/09/20
合計	銘柄数 金額	11銘柄	43,554,000	43,559,849	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	43,559,849	55.2
コール・ローン等、その他	35,332,328	44.8
投資信託財産総額	78,892,178	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネー・マザーファンド

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>78,892,178,168円</b>
コール・ローン等	35,330,663,234
公社債(評価額)	43,559,849,888
未収利息	1,114,825
前払費用	550,221
<b>(B) 負債</b>	<b>—</b>
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>78,892,178,168</b>
元本	77,361,886,547
次期繰越損益金	1,530,291,621
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>77,361,886,547口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	10,198円

\*期首における元本額は25,162,158,471円、当期中における追加設定元本額は125,627,714,743円、同解約元本額は73,427,986,667円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、深センA株資本金拠出用ファンド(適格機関投資家専用)1,000,294,205円、ダイワ/RIC I (R)コモディティ・ファンド8,952,508円、US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型)740,564円、US債券NB戦略ファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型)1,623,350円、スマート・アロケーション・Dガード161,095,201円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>米ドルコース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>円コース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<クラブ>世界通貨分散コース981円、ダイワファンドラップ コモディティセレクト317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー 日本円・コース(毎月分配型)132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー 豪ドル・コース(毎月分配型)643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー 米ドル・コース(毎月分配型)12,784円、ダイワ/フィデリティ北米株式ファンドーパラダイムシフトー49,096,623円、(適格機関投資家専用)スマート・シックス・Dガード1,919,351,400円、ブルベア・マネー・ポートフォリオIV23,032,151,009円、プル3倍日本株ポートフォリオIV47,552,576,868円、ベア2倍日本株ポートフォリオIV2,618,628,748円、ダイワFEグローバル・バリュー株ファンド(ダイワSMA専用)13,896,435円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・コース(毎月分配型)98,290,744円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)日本円・コース(毎月分配型)23,590,527円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)米ドル・コース(毎月分配型)2,163,360円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)豪ドル・コース(毎月分配型)13,761,552円、ダイワ/UBSエマーシングCBファンド2,498,575円、ダイワ/アムンディ食糧増産関連ファンド14,780,160円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ46,913,699円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスIIー金積立型ー1,972,537円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド(償還条項付き) 為替ヘッジあり4,926,716円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(資産成長コース)49,082,149円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド(通貨αコース)196,290,094円、ダイワ・ダブルバランス・ファンド(Dガード付/部分為替ヘッジあり)140,042,061円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー(為替ヘッジあり)9,813,543円、ダイワ・インフラビジネス・ファンドーインフラ革命ー(為替ヘッジなし)29,440,629円、ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)米ドルコース13,732,222円、ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)日本円コース3,874,449円、ダイワ米国MLPファンド(毎月分配型)通貨αコース13,437,960円、ダイワ英国高配当株ツインα(毎月分配型)98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ7,567,671円、DCスマート・アロケーション・Dガード3,224,448円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド(ダイワSMA専用)490,418円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)南アフリカ・ランド・コース(毎月分配型)98,252円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)トルコ・リラ・コース(毎月分配型)2,554,212円、ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)通貨セレクト・コース(毎月分配型)1,178,976円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 通貨αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α(毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース982,029円、ダイワ米国株ストラテジーα(通貨選択型)ートリプルリターンズー通貨セレクト・コース(毎月分配型)98,174円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,198円です。

## ■損益の状況

当期 自2014年12月10日 至2015年12月9日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>10,433,273円</b>
受取利息	10,433,273
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 362,189</b>
売買益	43,331
売買損	△ 405,520
<b>(C) 当期損益金(A+B)</b>	<b>10,071,084</b>
<b>(D) 前期繰越損益金</b>	<b>491,354,312</b>
<b>(E) 解約差損益金</b>	<b>△ 1,446,302,032</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>2,475,168,257</b>
<b>(G) 合計(C+D+E+F)</b>	<b>1,530,291,621</b>
次期繰越損益金(G)	1,530,291,621

(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。