

★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10年間（2012年6月29日～2022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6期

(決算日 2018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6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>

ダイワ日本リート・ファンド

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 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
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
5期末(2017年6月22日)	15,473	400	△ 2.8	3,234.16	△ 2.0	98.8	1.1	4,672
6期末(2018年6月22日)	15,797	500	5.3	3,433.40	6.2	98.5	1.4	3,399

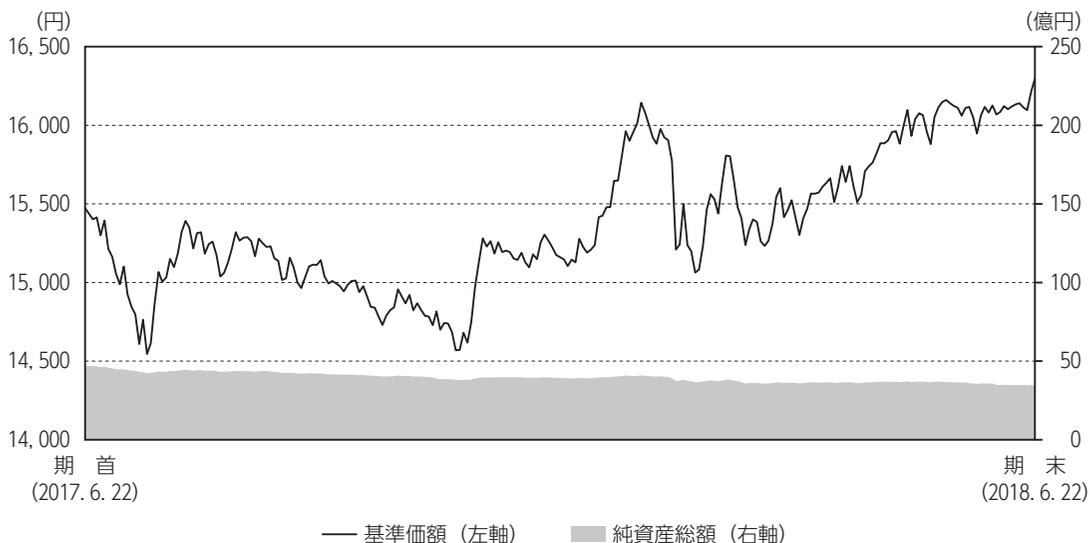
(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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：15,473円

期末：15,797円 (分配金500円)

騰落率：5.3% (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、国内リート市況が上昇したことを反映して、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ日本リート・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)2017年6月22日	15,473	—	3,234.16	—	98.8	1.1
6月末	15,214	△ 1.7	3,180.48	△ 1.7	98.3	1.1
7月末	15,392	△ 0.5	3,220.02	△ 0.4	98.8	1.1
8月末	15,230	△ 1.6	3,188.63	△ 1.4	98.6	1.3
9月末	14,986	△ 3.1	3,139.87	△ 2.9	98.7	1.3
10月末	14,784	△ 4.5	3,099.44	△ 4.2	98.4	1.3
11月末	15,203	△ 1.7	3,189.89	△ 1.4	98.5	1.4
12月末	15,190	△ 1.8	3,189.59	△ 1.4	98.4	1.4
2018年1月末	15,977	3.3	3,357.09	3.8	98.2	1.2
2月末	15,655	1.2	3,291.44	1.8	98.2	1.5
3月末	15,565	0.6	3,274.92	1.3	98.4	1.5
4月末	15,957	3.1	3,358.59	3.8	98.3	1.5
5月末	16,050	3.7	3,379.45	4.5	98.3	1.6
(期末)2018年6月22日	16,297	5.3	3,433.40	6.2	98.5	1.4

(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

(2017. 6. 23 ~ 2018. 6. 22)

### 国内リート市況

国内リート市況は、期首より、海外を中心に中期的な金利上昇への警戒感が残っていることや、海外投資家および国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、2017年7月にかけて下落基調で推移しました。その後一時反発しましたが、北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや米国の長期金利が上昇したことから、再び下落しました。11月中旬には、自己投資口取得やリート同士の合併の発表などを材料に上昇に転じました。2018年に入ると、良好な事業環境により国内外投資家からの資金が継続的に流入したことなどから、好調な推移となりました。しかし、2月に米国の長期金利が急上昇したことなどをを受けて国内外で株式市場が下落する中で、国内リート市場も下落しました。3月以降は、オフィス市況など事業環境の良好さが継続していることや日本の長期金利が低位安定推移となったことなどを背景に上昇し、期末を迎えました。

## 前期における「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。

## ポートフォリオについて

(2017. 6. 23 ~ 2018. 6. 22)

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。

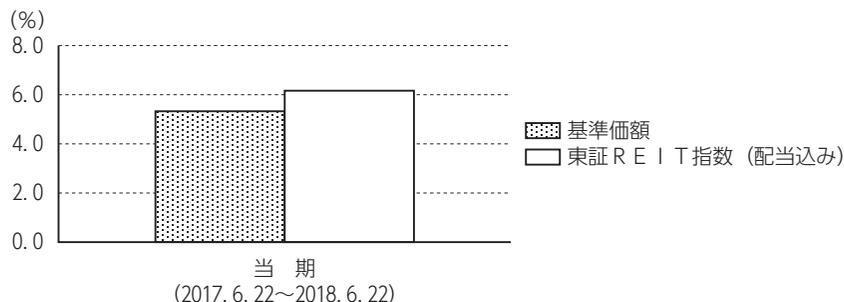
リートの実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）は、期を通じて95%以上を維持しました。

## 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（東証REIT指数（配当込み））との騰落率の対比です。

参考指数の騰落率は6.2%となった一方で、当ファンドの騰落率は5.3%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500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	
	2017年6月23日 ～2018年6月22日	
当期分配金（税込み）	(円)	500
対基準価額比率	(%)	3.07
当期の収益	(円)	500
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	6,370

(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	536.50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	5,614.66
(d) 分配準備積立金	719.28
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	6,870.45
(f) 分配金	500.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,370.45

(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

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 (2017. 6. 23~2018. 6. 22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	131円	0. 853%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は15, 377円です。
(投 信 会 社)	(58)	(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)	(66)	(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	0	0. 002	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)	(0)	(0. 001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0. 001)	
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	132	0. 861	

(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

(2017年6月23日から2018年6月22日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	6,28795	368,620	(9,368 —)	(1,668,634 —)

(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

(2017年6月23日から2018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
	百万円	百万円	百万円	百万円
国内 不動産投信指数 先物取引	371	376	—	—

(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

(2017年6月23日から2018年6月22日まで)

当 期				期 付			
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
日本プロロジスリート	0.113	26,259	232,385	日本ビルファンド	0.216	124,806	577,808
ジャパンリアルエステイト	0.045	25,050	556,678	ジャパンリアルエステイト	0.207	114,380	552,563
大和ハウスリート投資法人	0.087	22,237	255,608	野村不動産マスターF	0.621	91,590	147,488
GLP投資法人	0.19	22,079	116,205	日本リテールファンド	0.438	89,453	204,232
日本ビルファンド	0.029	16,739	577,241	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.483	79,877	165,378
野村不動産マスターF	0.105	15,558	148,172	オリックス不動産投資	0.424	69,347	163,554
インヴェンシブル投資法人	0.321	14,734	45,901	日本プロロジスリート	0.272	64,439	236,910
三菱地所物流 REIT	0.05	13,758	275,176	大和ハウスリート投資法人	0.23	60,460	262,872
オリックス不動産投資	0.075	12,255	163,402	アドバンス・レジデンス	0.203	55,663	274,205
API投資法人	0.024	11,451	477,130	日本プライムリアルティ	0.138	52,987	383,967

(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

(2017年6月23日から2018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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	368	10	2.7	1,668	12	0.7
不動産投信指 数先物取引	371	—	—	376	—	—
コール・ローン	8,731	—	—	—	—	—

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年6月23日から2018年6月22日まで)

種 類	当 期		期末保有額
	買 付 額	売 付 額	
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	3	28	55

(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

(2017年6月23日から2018年6月22日まで)

種類	当期
	買付額
投資信託証券	百万円 22

(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
	千口	千口	千円
日本アコモデーションファンド投資法人	0.199	0.135	68,040
MCUBS MidCity投資法人	0.121	0.452	37,968
森ヒルズリート	0.642	0.435	61,857
産業ファンド	0.162	0.471	57,085
アドバンス・レジデンス	0.553	0.375	106,912
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.136	0.206	34,299
API投資法人	0.258	0.183	92,232
GLP投資法人	1.046	0.841	98,228
コンフォリア・レジデンシャル	0.218	0.154	40,409
日本プロロジスリート	0.699	0.54	123,552
星野リゾート・リート	0.074	0.064	36,736
Oneリート投資法人	0.065	0.044	11,167
イオンリート投資	0.524	0.385	47,470
ヒューリックリート投資法	0.383	0.275	47,025
日本リート投資法人	0.161	0.109	35,152
インベスコ・オフィス・Jリート	0.334	2.388	35,557
日本ヘルスケア投資法	0.029	0.02	3,394
積水ハウス・リート投資	0.375	1.01595	73,859
トーセイ・リート投資法人	0.075	0.065	7,338
ケネディクス商業リート	0.217	0.147	35,838
ヘルスケア&メディカル投資	0.074	0.05	5,505
サムティ・レジデンシャル	0.104	0.07	6,706
ジャパン・シニアリビング	0.033	—	—
野村不動産マスターF	1.715	1.199	187,883
いちごホテルリート投資	0.094	0.063	8,454
ラサールロジポート投資	0.451	0.306	33,843
スターアジア不動産投	0.124	0.095	10,317
マリモ地方創生リート	0.033	0.032	3,753
三井不ロジパーク	0.097	0.077	26,257
大江戸温泉リート	0.076	0.068	5,936

銘 柄	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
さくら総合リート	0.144	0.097	8,933
投資法人みらい	0.076	0.059	11,168
森トラスト・ホテルリート投	0.129	0.088	12,971
三菱地所物流 REIT	—	0.038	10,263
CRE ロジスティクスファンド	—	0.041	4,649
ザイマックス・リート	—	0.037	4,206
日本ビルファンド	0.579	0.392	245,392
ジャパンリアルエステイト	0.565	0.403	234,143
日本リートールファンド	1.15	0.765	155,524
オリックス不動産投資	1.153	0.804	142,468
日本プライムリアルティ	0.377	0.256	104,576
プレミア投資法人	0.54	0.366	40,369
東急リアル・エステート	0.401	0.272	40,908
グローバル・ワン不動産投資法人	0.096	0.257	28,449
ユナイテッド・アーバン投資法人	1.318	0.894	154,304
森トラスト総合リート	0.427	0.29	46,081
インヴェンシブル投資法人	1.333	1.112	56,267
フロンティア不動産投資	0.203	0.138	62,376
平和不動産リート	0.372	0.252	27,694
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.38	0.27	61,020
福岡リート投資法人	0.29	0.21	36,540
ケネディクス・オフィス投資法人	0.175	0.125	85,500
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	0.453	—	—
いちごオフィスリート投資法人	0.463	0.314	26,909
大和証券オフィス投資法人	0.129	0.087	55,593
阪急リート投資法人	0.245	0.177	24,142
スタートアップシード投資法人	0.094	0.064	10,425
大和ハウスリート投資法人	0.615	0.472	124,702
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1.627	1.17	98,046
日本賃貸住宅投資法人	0.672	0.456	39,900
ジャパンエクセレント投資法人	0.535	0.362	52,598
合 計	□ 数、金 額	23.613	3,348,907
	銘 柄 数 < 比 率 >	58 銘柄	<98.5%>
		20.53295	59 銘柄

(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	48	—

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	3,348,907 千円	94.9 %
コール・ローン等、その他	180,143	5.1
投資信託財産総額	3,529,051	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

2018年6月22日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>3,792,113,253円</b>
コール・ローン等	160,273,796
投資信託証券 (評価額)	3,348,907,885
未収入金	2,840,696
未収配当金	17,028,676
差入委託証拠金	263,062,200
<b>(B) 負債</b>	<b>392,308,989</b>
未払収益分配金	107,612,105
未払解約金	4,499,229
未払信託報酬	15,856,265
差入委託証拠金代用有価証券	264,240,000
その他未払費用	101,390
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>3,399,804,264</b>
元本	2,152,242,112
次期繰越損益金	1,247,562,152
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2,152,242,112口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	15,797円

\*期首における元本額は3,019,627,890円、当期中における追加設定元本額は207,658,346円、同解約元本額は1,075,044,124円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は15,797円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月23日 至 2018年6月22日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>137,223,220円</b>
受取配当金	136,271,411
受取利息	4
その他収益金	973,522
支払利息	△ 21,717
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>72,576,374</b>
売買益	181,626,154
売買損	△ 109,049,780
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>4,432,093</b>
取引益	5,844,500
取引損	△ 1,412,407
<b>(D) 信託報酬等</b>	<b>△ 33,963,382</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	<b>180,268,305</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 33,505,189</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>1,208,411,141</b>
(配当等相当額)	( 522,829,820)
(売買損益相当額)	( 685,581,321)
<b>(H) 合計 (E + F + G)</b>	<b>1,355,174,257</b>
<b>(I) 収益分配金</b>	<b>△ 107,612,105</b>
次期繰越損益金 (H + I)	<b>1,247,562,152</b>
追加信託差損益金	1,208,411,141
(配当等相当額)	( 522,829,820)
(売買損益相当額)	( 685,581,321)
分配準備積立金	162,666,072
繰越損益金	△ 123,515,061

(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	115,469,674円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,208,411,141
(d) 分配準備積立金	154,808,503
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,478,689,318
(f) 分配金	107,612,105
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,371,077,213
(h) 受益権総口数	2,152,242,112口

<b>収 益 分 配 金 の お 知 ら せ</b>	
<b>1 万 口 当 り 分 配 金</b>	<b>500円</b>

- 〈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15,797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。

ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債組入比率	純資産額
	税 分 配	込 み 金	期 騰 落 率		
2 期末 (2014年 6月23日)	円 10,010	円 0	% 0.0	% 56.3	百万円 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
5 期末 (2017年 6月22日)	10,003	0	△ 0.1	0.5	149
6 期末 (2018年 6月22日)	9,996	0	△ 0.1	—	87

(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。

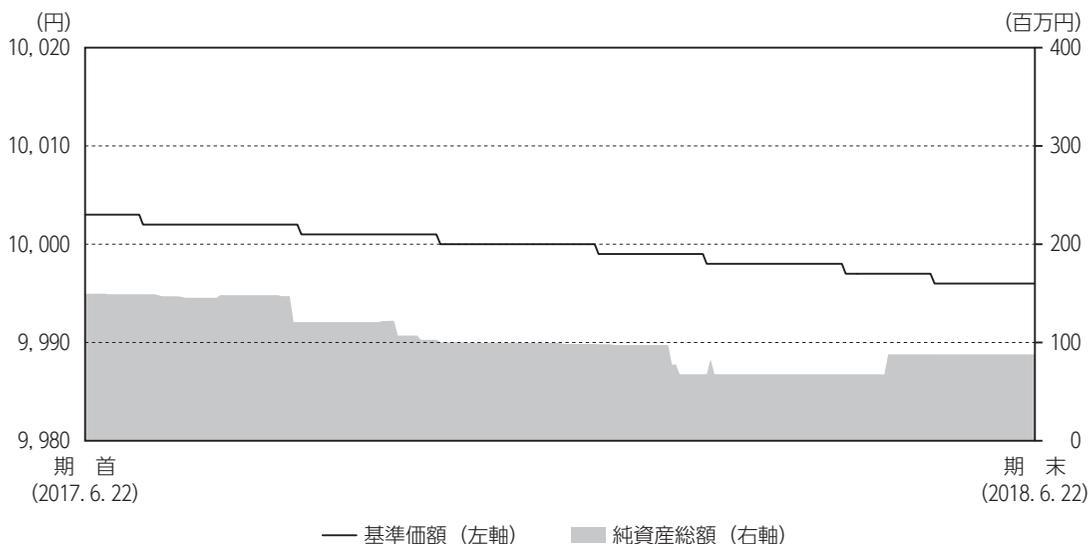
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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け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：10,003円

期末：9,996円

騰落率：△0.1%

#### ■ 基準価額の変動要因

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券を通じて投資した短期の国債やコール・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。

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)2017年6月22日	円	10,003	% —	% 0.5
6月末	10,003	0.0		0.4
7月末	10,002	△ 0.0		0.1
8月末	10,002	△ 0.0		—
9月末	10,001	△ 0.0		—
10月末	10,001	△ 0.0		—
11月末	10,000	△ 0.0		—
12月末	10,000	△ 0.0		—
2018年1月末	9,999	△ 0.0		—
2月末	9,998	△ 0.0		0.3
3月末	9,998	△ 0.0		—
4月末	9,997	△ 0.1		—
5月末	9,996	△ 0.1		—
(期末)2018年6月22日	9,996	△ 0.1		—

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2017. 6. 23 ~ 2018. 6. 22)

### 国内短期金融市況

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が維持されるなか、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

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なう方針です。

## ポートフォリオについて

(2017. 6. 23 ~ 2018. 6. 22)

### 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

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・ローン等による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	
	2017年6月23日 ～2018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（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

上記の運用方針により、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資する場合があります。今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご留意くださいますようお願い申し上げます。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 23~2018. 6. 22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—円	—%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,000円です。
(投 信 会 社)	(—)	(—)	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)	(—)	(—)	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)	(—)	(—)	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	0.004	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)	(0.003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.004	

(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

(2017年6月23日から2018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	27,511	28,025	69,898	71,214

(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

(2017年6月23日から2018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	2,800	230	8.2	—	—	—
コール・ローン	16,165,481	—	—	—	—	—
現先取引 (その他有価証券)	245,999	—	—	245,999	—	—

(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) 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	102,769	60,382	61,499

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018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	61,499	70.0
コール・ローン等、その他	26,356	30.0
投資信託財産総額	87,856	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

2018年6月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	87,856,272円
コール・ローン等	26,356,293
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	61,499,979
(B) 負債	657
その他未払費用	657
(C) 純資産総額 (A - B)	87,855,615
元本	87,888,784
次期繰越損益金	△ 33,169
(D) 受益権総口数	87,888,784口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,996円

\* 期首における元本額は149,575,237円、当期中における追加設定元本額は43,318,136円、同解約元本額は105,004,589円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,996円です。

\* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は33,169円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月23日 至 2018年6月22日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 11,185円</b>
受取利息	7,249
支払利息	△ 18,434
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 26,234</b>
売買益	12,560
売買損	△ 38,794
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 1,423</b>
<b>(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 38,842</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 20,268</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>25,941</b>
(配当等相当額)	( 76,882)
(売買損益相当額)	(△ 50,941)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 33,169</b>
<b>次期繰越損益金 (G)</b>	<b>△ 33,169</b>
追加信託差損益金	25,941
(配当等相当額)	( 76,882)
(売買損益相当額)	(△ 50,941)
分配準備積立金	6,841
繰越損益金	△ 65,951

(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)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	76,882
(d) 分配準備積立金	6,841
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	83,723
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	83,723
(h) 受益権総口数	87,888,784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（2017年12月11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（2018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

(2017年6月23日から2018年6月22日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
679 国庫短期証券 2017/7/31	1,700,018		
675 国庫短期証券 2017/7/10	300,001		
707 国庫短期証券 2017/12/11	230,001		
723 国庫短期証券 2018/3/5	210,001		
355 2年国債 0.1% 2017/8/15	170,008		
673 国庫短期証券 2017/7/3	80,000		
682 国庫短期証券 2017/8/14	60,000		
680 国庫短期証券 2017/8/7	50,001		

(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、2018年6月22日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（78,869,439千円）の内容です。

#### 国内その他有価証券

	2018年6月22日現在	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999,999	<1.2>

(注1) < >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。

# ダイワ・マネー・マザーファンド

## 運用報告書 第13期 (決算日 2017年12月11日)

(計算期間 2016年12月10日～2017年12月11日)

ダイワ・マネー・マザーファンドの第13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ないます。
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

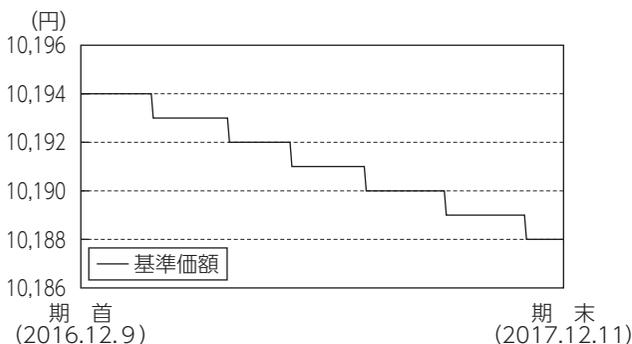
## 大和投資信託

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



年 月 日	基準 価 額	騰 落 率		公 社 債 組 入 比 率	
		騰 落 率	%	組 入 比 率	%
(期首)2016年12月9日	10,194	-	-	-	30.1
12月末	10,194	0.0	-	-	-
2017年1月末	10,194	0.0	30.7	-	-
2月末	10,193	△0.0	24.6	-	-
3月末	10,193	△0.0	-	-	-
4月末	10,192	△0.0	32.5	-	-
5月末	10,191	△0.0	5.2	-	-
6月末	10,191	△0.0	0.5	-	-
7月末	10,190	△0.0	0.1	-	-
8月末	10,190	△0.0	-	-	-
9月末	10,189	△0.0	-	-	-
10月末	10,189	△0.0	-	-	-
11月末	10,188	△0.1	-	-	-
(期末)2017年12月11日	10,188	△0.1	-	-	-

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)および債券先物を除きます。  
 (注3) 当ファンドは、利息収入の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,194円 期末：10,188円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

期首より、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。このような日銀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。

◆前期における「今後の運用方針」

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。

◆ポートフォリオについて

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・ローン等による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、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
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 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、簡便法により算出した結果です。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。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

国 内	買 付 額	売 付 額	
		千円	千円
国債証券	210,925,408	(231,500,000)	—

(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。

(2) その他有価証券

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

国 内	買 付 額	売 付 額	
		千円	千円
国内短期社債等	246,999,814	246,999,819	(—)

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

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

買 付		売 付	
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
645 国庫短期証券	2017/2/20	27,570,641	
657 国庫短期証券	2017/4/17	17,880,344	
642 国庫短期証券	2017/2/6	17,230,250	
652 国庫短期証券	2017/3/27	16,550,132	
659 国庫短期証券	2017/4/24	16,270,410	
669 国庫短期証券	2017/6/12	15,870,490	
651 国庫短期証券	2017/3/21	13,160,344	
644 国庫短期証券	2017/5/12	11,970,533	
638 国庫短期証券	2017/1/16	9,360,075	
648 国庫短期証券	2017/3/6	7,370,272	

(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  
国内その他有価証券

	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999,999	<1.4>

(注1) < >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。

■投資信託財産の構成

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	69,737,046	100.0
投資信託財産総額	69,737,046	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

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	69,737,046,159円
コール・ローン等	68,737,047,077
現先取引(その他有価証券)	999,999,082
(B) 負債	60,400,000
未払解約金	60,400,000
(C) 純資産総額(A-B)	69,676,646,159
元本	68,390,547,168
次期繰越損益金	1,286,098,991
(D) 受益権総口数	68,390,547,168口
1万口当り基準価額(C/D)	10,188円

\* 期首における元本額は66,967,614,984円、当期中における追加設定元本額は143,241,011,614円、同解約元本額は141,818,079,430円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド - A I 新時代 - (為替ヘッジあり) 977,694円、ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド - A I 新時代 - (為替ヘッジなし) 977,694円、ダイワ F E グローバル・バリュー (為替ヘッジあり) 98,069円、ダイワ F E グローバル・バリュー (為替ヘッジなし) 98,069円、ダイワ / "R I C I" 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) 1,676円、US 債券 NB 戦略ファンド (為替ヘッジなし/年1回決算型) 1,330円、NB ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>米ドルコース981円、NB ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース981円、NB ストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>世界通貨分散コース981円、DCダイワ・マネー・ポートフォリオ 2,898,147,134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) - トリプルリターンズ - 日本円・コース (毎月分配型) 132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 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) - トリプルリターンズ - 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) - トリプルリターンズ - 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 - パラダイムシフター - 9,853,995円、プルベア・マネー・ポートフォリオ IV 25,987,316,146円、ブル3倍日本株ポートフォリオ IV 31,864,786,854円、ベア2倍日本株ポートフォリオ IV 7,199,848,570円、ダイワ F E グローバル・バリュー株ファンド (ダイワ S M A 専用) 4,090,590円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) 155,317円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配

型) 38,024円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 米ドル・コース (毎月分配型) 4,380円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型) 22,592円、ダイワ/アムンディ食糧増産関連ファンド 164,735円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ 68,368,780円、ダイワ新興国ハイインカム・プラス II - 金積立型 - 501,660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 1,004,378円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース) 33,689円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース) 96,254円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジあり) 988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジなし) 4,926,018円、ダイワ米国 M L P ファンド (毎月分配型) 米ドルコース 285,029円、ダイワ米国 M L P ファンド (毎月分配型) 日本円コース 144,570円、ダイワ米国 M L P 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 1,229,944円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド (ダイワ S M A 専用) 235,407円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 南アフリカ・ランド・コース (毎月分配型) 1,097円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース 2,690円、ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 1,350円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 通貨αコース 98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース 98,202円、ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) - トリプルリターンズ - 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10,188円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月10日 至2017年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 41,076,414円
受取利息	△ 5,752,611
支払利息	△ 35,323,803
(B) 有価証券売買損益	△ 9,224
売買損	△ 9,224
(C) その他費用	△ 196,417
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 41,282,055
(E) 前期繰越損益金	1,302,196,055
(F) 解約差損益金	△ 2,715,466,915
(G) 追加信託差損益金	2,740,651,906
(H) 合計(D+E+F+G)	1,286,098,991
次期繰越損益金(H)	1,286,098,991

(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。