

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド 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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	追加型投信／海外／株式
	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	追加型投信／国内／債券
信託期間	10年間（2012年2月17日～2022年2月16日）	
運用方針	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	信託財産の成長をめざして 運用を行ないます。
	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	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	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	イ. アセアン加盟国の金融 商品取引所上場株式およ び店頭登録株式（上場予 定および店頭登録予定を 含みます。） ロ. アセアン加盟国の企業 のDR（預託証券）
	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	イ. ダイワ・マネーストック・マザーファンドの受 益証券 ロ. 円建ての債券
組入制限	ダイワ・アセアン 内需関連株ファンド	・株式組入上限比率は無制 限
	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	・マザーファンド組入上限 比率は無制限 ・株式組入上限比率は純資 産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売 買益（評価益を含みます。）等とし、原則とし て、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、分配を行なわないことがあります。	

◇SUZ0481920200817◇

運用報告書(全体版)

第17期

(決算日 2020年8月17日)

(作成対象期間 2020年2月18日～2020年8月17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
上げます。

当ファンドは、(アセアン内需関連株)ア
セアン加盟国の株式に投資し、信託財産の
成長をめざすこと、(マネー・ポートフォ
リオ)円建ての債券に投資し、安定した収益の
確保をめざすことを目的としております。当
作成期につきましてもそれに沿った運用を行
ないました。ここに、運用状況をご報告申し
上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、
お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<4819>
<4820>

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC 東南アジア指数 (配当込み、円換算)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	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
13期末(2018年8月16日)	9,708	0	△ 9.9	16,377	△ 7.3	91.8	—	—	3,055
14期末(2019年2月18日)	10,055	0	3.6	17,025	4.0	92.9	—	1.5	2,959
15期末(2019年8月16日)	9,518	0	△ 5.3	16,071	△ 5.6	92.1	—	1.9	2,399
16期末(2020年2月17日)	9,749	0	2.4	16,571	3.1	93.7	—	0.6	2,293
17期末(2020年8月17日)	8,109	0	△ 16.8	14,150	△ 14.6	93.4	—	2.9	1,675

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC 東南アジア指数(配当込み、円換算)は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI AC 東南アジア指数(配当込み、米ドルベース)をもとに円換算し、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。MSCI AC 東南アジア指数(配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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。

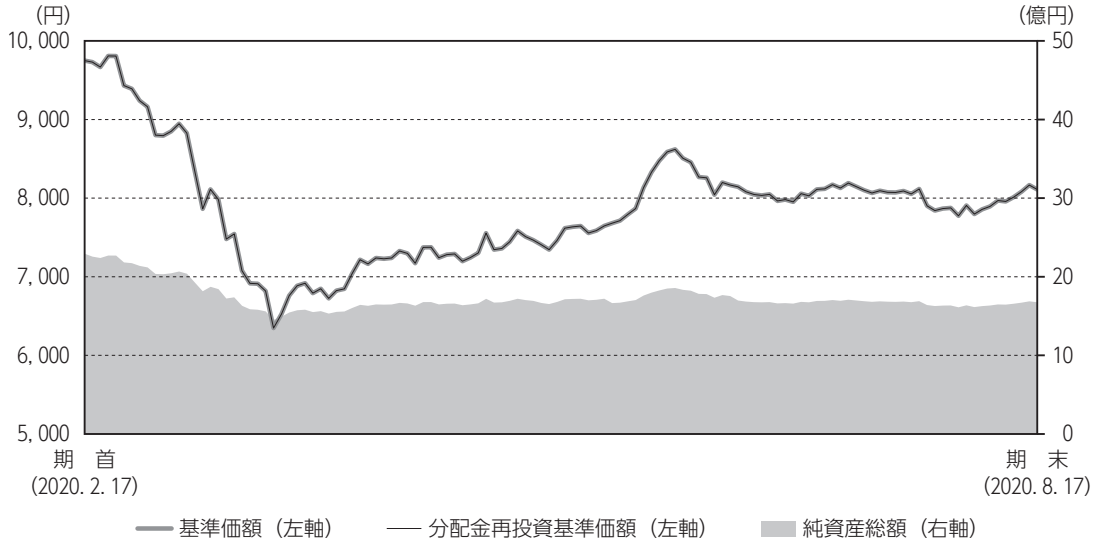
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 株式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



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：9,749円

期末：8,109円（分配金0円）

騰落率：△16.8%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

アセアンの内需関連企業の株式に投資した結果、基準価額は下落しました。新型コロナウイルスの感染拡大による経済への悪影響を嫌気しアセアン株式市況が下落したことや、アセアン通貨が対円で下落（円高）したことがマイナス要因となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC 東南アジア指数 (配当込み、円換算)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %			
(期首) 2020年 2月17日	9,749	—	16,571	—	93.7	—	0.6
2月末	9,162	△ 6.0	15,511	△ 6.4	92.2	—	0.6
3月末	6,791	△ 30.3	11,726	△ 29.2	92.2	—	—
4月末	7,303	△ 25.1	12,625	△ 23.8	91.4	—	2.3
5月末	7,713	△ 20.9	13,149	△ 20.6	90.1	—	2.4
6月末	7,952	△ 18.4	13,854	△ 16.4	92.7	—	2.5
7月末	7,775	△ 20.2	13,642	△ 17.7	93.5	—	3.0
(期末) 2020年 8月17日	8,109	△ 16.8	14,150	△ 14.6	93.4	—	2.9

(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

(2020. 2. 18 ~ 2020. 8. 17)

■アセアン株式市況

アセアン株式市況は下落しました。

アセアン株式市況は、当作成期首より、OPECプラス（石油輸出国機構加盟国とロシアなど非加盟国）の減産協議決裂による原油市況の急落や新型コロナウイルスの感染拡大によるアセアン各国での移動制限措置への懸念から、大きく下落しました。2020年3月後半には、米国やアセアン各国で打ち出された経済対策への期待から反発し、その後も各国での経済活動の段階的な再開などを好感して堅調に推移しました。しかし、6月には新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念から下落し、7月から当作成期末にかけてはワクチンの早期開発期待と米中対立の激化懸念が交錯する中、一進一退の展開となりました。

■為替相場

アセアン通貨は円に対して下落しました。

アセアン通貨は、当作成期首より、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や原油価格の急落を受けた投資家心理の悪化から、対円で大きく下落しました。2020年4月から6月上旬にかけては、米国やアセアン各国における経済対策への期待などから世界的に投資家心理が改善し、値を戻す展開になりました。しかし6月上旬からは、新型コロナウイルスの感染再拡大による活動の再制限懸念を受けて世界経済の早期回復期待が後退し、対円で反落しました。7月は、米中対立の激化などに伴う円高米ドル安の進行を受けて対円で下落しました。当作成期末にかけては、米国景気の先行き不透明感の後退や米国金利上昇を受けた円安米ドル高を背景に、対円で上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

アセアン加盟国の株式の中から、アセアン経済圏の内需拡大の恩恵を受けると考えられる企業で、財務内容や株価水準などを勘案し、着実な利益成長が期待できる企業を中心に組み入れてまいります。業種では、金融緩和を受けた流動性拡大の恩恵が期待されるインドネシアやフィリピンの大手銀行を中心とした金融セクターのほか、中間所得者層の拡大や都市化の進展の恩恵が中長期的に見込まれるインドネシアやフィリピン、ベトナムなどの一般消費財・サービスセクターに注目しています。

ポートフォリオについて

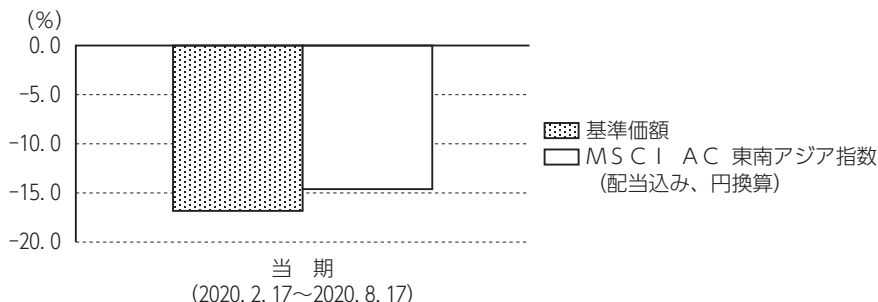
(2020. 2. 18 ~ 2020. 8. 17)

アセアンの内需関連企業の中から、財務内容や株価水準などを勘案し、中長期的に高い利益成長が期待された銘柄に分散投資を行いました。業種では、資産健全性に優れているシンガポールの大手銀行や、中長期的に貸出残高の拡大が期待されたインドネシアの大手銀行などを中心に、金融セクターを組入上位としました。また、経済活動制限下においても相対的に安定した業績の見込まれた銘柄を中心に、生活必需品セクターの組入比率を引き上げました。個別銘柄では、デジタル化で先行するシンガポールの銀行大手 DBS GROUP HOLDINGS LTD (金融) や、広範な支店網を有し優れた実績を持つインドネシアの銀行大手 BANK CENTRAL ASIA TBK PT (金融) などを組入上位としました。また、業績の速やかな回復が期待され株価バリュエーション面で魅力的だと判断したタイのコンビニ運営大手 CP ALL PCL (生活必需品) を買い付けました。

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。参考指数はアセアン市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



分配金について

当作成期は、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	
	2020年 2月18日 ～2020年 8月17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）	1,021

- （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

アセアン加盟国の株式の中から、アセアン経済圏の内需拡大の恩恵を受けると考えられる企業で、財務内容や株価水準などを勘案し、着実な利益成長が期待できる企業を中心に組み入れてまいります。業種では、景気減速下においても資産健全性の確保が見込まれるシンガポールの大手銀行や、中長期的な貸出残高の拡大が期待されるインドネシアの大手銀行を中心とした金融セクターに注目しています。また、金利低下の恩恵が見込まれ、株価バリュエーション面で魅力的な銘柄を中心に不動産セクターにも注目しています。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 2. 18～2020. 8. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	71円	0. 902%	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7, 854円です。
(投 信 会 社)	(34)	(0. 437)	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)	(34)	(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)	(2)	(0. 027)	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	31	0. 391	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
(株 式)	(29)	(0. 375)	
(投資信託証券)	(1)	(0. 016)	
有 価 証 券 取 引 税	8	0. 106	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
(株 式)	(8)	(0. 104)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 002)	
そ の 他 費 用	10	0. 129	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
(保 管 費 用)	(10)	(0. 126)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0. 003)	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	120	1. 528	

(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。

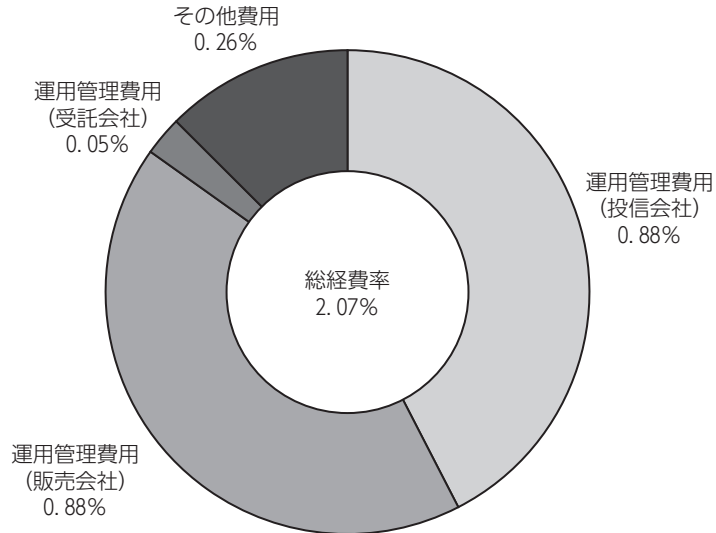
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.07%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。

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

■売買および取引の状況

(1) 株式

(2020年2月18日から2020年8月17日まで)

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外	シンガポール	百株 8,926 (—)	千シンガポール・ドル 3,837 (—)	百株 4,701	千シンガポール・ドル 3,558
	フィリピン	百株 9,231.9 (—)	千フィリピン・ペソ 40,788 (—)	百株 9,434.54	千フィリピン・ペソ 55,253
	インドネシア	百株 121,790 (—)	千インドネシア・ルピア 25,116,070 (—)	百株 126,486	千インドネシア・ルピア 25,243,762
	マレーシア	百株 6,840 (—)	千マレーシア・リンギット 5,248 (—)	百株 13,030	千マレーシア・リンギット 8,785
国	タイ	百株 19,590 (—)	千タイ・バーツ 66,717 (—)	百株 57,340	千タイ・バーツ 65,515
	ベトナム	百株 1,130 378)	千ベトナム・ドン 8,231,958 (—)	百株 6,723	千ベトナム・ドン 28,537,262

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、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) 投資信託証券

(2020年2月18日から2020年8月17日まで)

	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
外国	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
	482 (—)	1,023 (△ 0)	238 (—)	465 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 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4) 金額の単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年2月18日から2020年8月17日まで)

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	2,104,152千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,575,082千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.33

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株式

(2020年2月18日から2020年8月17日まで)

銘柄	当期買付			当期売付		
	株数	金額	平均単価	株数	金額	平均単価
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS (シンガポール)	千株 393	千円 85,620	円 217	千株 51.1	千円 86,467	円 1,692
TENAGA NASIONAL BHD (マレーシア)	190	56,175	295	40	67,634	1,690
WILMAR INTERNATIONAL LTD (シンガポール)	145	47,817	329	186	55,030	295
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN (タイ)	400	42,298	105	231	44,411	192
DBS GROUP HOLDINGS LTD (シンガポール)	27.1	41,461	1,529	57	41,447	727
KALBE FARMA TBK PT (インドネシア)	3,200	35,957	11	377	38,975	103
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP (シンガポール)	46	33,835	735	188	37,322	198
VIETNAM DAIRY PRODUCTS JSC (ベトナム)	68	33,683	495	695	37,076	53
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG (タイ)	50	32,619	652	90	35,583	395
UNITED OVERSEAS BANK LTD (シンガポール)	17.5	30,955	1,768	4,246.4	34,398	8

(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

(1)外国株式

銘柄	株数	金額	期首		期末		業種等
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)							
UNITED OVERSEAS BANK LTD	570		345		692	53,849	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	783.34		543.34		1,144	89,032	金融
UOL GROUP LTD	450		370		247	19,250	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	135		335		282	21,936	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	800		800		88	6,905	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100		—		—	—	一般消費財・サービス
THAI BEVERAGE PCL	—		1,670		101	7,857	生活必需品
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,292.12		1,182.12		1,057	82,280	金融
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,100		3,150		768	59,774	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	—		200		174	13,547	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	940		350		48	3,783	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	—		1,450		700	54,466	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	6,170.46	10,395.46		5,306	412,683	
	銘柄数 < 比率 >	9銘柄	11銘柄			<24.6%>	
			百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
(フィリピン)							
AYALA LAND INC	1,170		4,270		14,219	30,997	不動産
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,671.97		—		—	—	金融
SM PRIME HOLDINGS INC	1,400		3,430		10,633	23,179	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	1,119.1		—		—	—	金融
AYALA CORPORATION	80		80		5,996	13,071	資本財・サービス
UNIVERSAL ROBINA CORP	—		1,050		15,004	32,709	生活必需品
SM INVESTMENTS CORP	160		80		7,200	15,696	資本財・サービス
BDO UNIBANK INC	1,200		—		—	—	金融
ABOITIZ POWER CORP	3,000		—		—	—	公益事業
SECURITY BANK CORP	980		—		—	—	金融
PUREGOLD PRICE CLUB INC	2,712		3,212		16,220	35,360	生活必需品
WILCON DEPOT INC	12,099		14,099		22,107	48,193	一般消費財・サービス
PHILIPPINE NATIONAL BANK	745		—		—	—	金融
ALTUS PROPERTY VENTURES INC	86.57		—		—	—	不動産
フィリピン・ペソ通貨計	株数、金額	26,423.64	26,221		91,380	199,209	
	銘柄数 < 比率 >	13銘柄	7銘柄			<11.9%>	
			百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
(インドネシア)							
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	830		2,330		2,784,350	20,325	素材
UNILEVER INDONESIA TBK PT	—		1,300		1,066,000	7,781	生活必需品
UNITED TRACTORS TBK PT	—		500		1,153,750	8,422	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	—		4,360		2,343,500	17,107	一般消費財・サービス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,026		1,026		974,700	7,115	素材
KALBE FARMA TBK PT	—		32,000		5,200,000	37,960	ヘルスケア
JAPFA COMFEED INDONES-TBK PT	—		11,000		1,221,000	8,913	生活必需品
MAYORA INDAH PT	2,000		2,000		456,000	3,328	生活必需品
BANK BTPN SYARIAH TBK PT	17,058		11,009		4,260,483	31,101	金融

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	14,800	14,100	4,272,300	31,187	コミュニケーション・サービス
ACE HARDWARE INDONESIA	13,235	9,301	1,488,160	10,863	一般消費財・サービス
RAMAYANA LESTARI SENTOSA TBK	19,227	—	—	—	一般消費財・サービス
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	—	1,000	1,017,500	7,427	生活必需品
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,940	3,130	10,023,825	73,173	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	4,800	—	—	—	金融
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	25,257	18,857	6,298,238	45,977	金融
MITRA ADIPERKASA TBK PT	43,436	—	—	—	一般消費財・サービス
PAKUWON JATI TBK PT	—	30,000	1,176,000	8,584	不動産
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	146,609 11銘柄	141,913 15銘柄	43,735,806 <19.1%>	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD	1,500	500	390	9,921	金融
PUBLIC BANK BERHAD	841	841	1,496	38,083	金融
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	967	374	9,520	資本財・サービス
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	200	—	—	—	生活必需品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,860	—	—	—	金融
TENAGA NASIONAL BHD	1,150	1,190	1,323	33,664	公益事業
BURSA MALAYSIA BHD	1,500	750	708	18,030	金融
SYARIKAT TAKAFUL MALAYSIA KE	440	1,121	538	13,688	金融
RHB BANK BHD	2,500	—	—	—	金融
HEINEKEN MALAYSIA BHD	—	242	536	13,642	生活必需品
YINSON HOLDINGS BHD	2,210	—	—	—	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	—	200	325	8,273	公益事業
DIALOG GROUP BHD	1,350	1,350	490	12,466	エネルギー
AEON CREDIT SERVICE M BHD	595	795	705	17,959	金融
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,146 11銘柄	7,956 10銘柄	6,888 <10.5%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	—	250	2,650	9,063	金融
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	750	950	4,797	16,407	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	350	300	2,670	9,131	金融
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	—	4,200	3,276	11,203	不動産
TISCO FINANCIAL-FOREIGN	1,110	900	6,097	20,853	金融
COM7 PCL-F	2,700	3,160	11,376	38,905	一般消費財・サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	8,000	3,500	5,355	18,314	一般消費財・サービス
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	—	120	2,298	7,859	コミュニケーション・サービス
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	—	3,350	11,055	37,808	生活必需品
ELECTRICITY GEN PUB CO-FOREI	100	—	—	—	公益事業
AEON THANA SINSAP THA-FOREIG	—	350	3,368	11,521	金融
PTT PCL/FOREIGN	4,130	4,130	15,590	53,320	エネルギー
CP ALL PCL-FOREIGN	1,560	2,410	15,845	54,192	生活必需品
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	1,830	1,330	7,182	24,562	資本財・サービス
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	1,200	2,250	10,462	35,781	不動産
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	756	—	—	—	金融
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	513	513	2,949	10,088	コミュニケーション・サービス
CHULARAT HOSPITAL PCL-F	42,464	—	—	—	ヘルスケア
タイ・バーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	65,463 13銘柄	27,713 15銘柄	104,974 <21.4%>	

銘柄	柄	期首		当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
(ベトナム)		百株	百株	千ベトナム・ドン	千円			
TASECO AIR SERVICES JSC		124.25	124.25	579,005	2,663			一般消費財・サービス
VIETNAM ENGINE & AGRICULTURA		1,543	—	—	—			その他
VIETTEL POST JSC		438.34	438.34	5,808,005	26,716			その他
VIETNAM DAIRY PRODUCTS JSC		370.06	540.06	6,302,500	28,991			生活必需品
BANK FOR FOREIGN TRADE JSC		1,317	417	3,419,400	15,729			金融
HOA PHAT GROUP JSC		5,210	2,268	5,465,880	25,143			素材
ベトナム・ドン通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	9,002.65 6銘柄	3,787.65 5銘柄	21,574,790	99,244	<5.9%>	
ファンド合計		株数、金額 銘柄数<比率>	267,814.75 63銘柄	217,986.11 63銘柄	—	1,564,672	<93.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	期首		当期		期末	
		□数	□数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		54	46	158	12,306		
CAPITALAND MALL TRUST		—	199	374	29,095		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	53	101	7,872		
合計		□数、金額 銘柄数<比率>	54 1銘柄	298 3銘柄	633	49,274	<2.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・アセアン内需関連株ファンド

■投資信託財産の構成

2020年8月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,564,672	89.7
投資信託証券	49,274	2.8
コール・ローン等、その他	130,889	7.5
投資信託財産総額	1,744,836	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、8月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.55円、1シンガポール・ドル=77.77円、1フィリピン・ペソ=2.18円、100インドネシア・ルピア=0.73円、1マレーシア・リンギット=25.44円、1タイ・バーツ=3.42円、100ベトナム・ドン=0.46円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(1,660,238千円)の投資信託財産総額(1,744,836千円)に対する比率は、95.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年8月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,744,836,481円
コール・ローン等	59,775,751
株式(評価額)	1,564,672,414
投資信託証券(評価額)	49,274,294
未収入金	67,167,041
未取配当金	3,946,981
(B) 負債	69,404,309
未払金	52,455,728
未払解約金	1,271,523
未払信託報酬	15,629,786
その他未払費用	47,272
(C) 純資産総額(A-B)	1,675,432,172
元本	2,066,079,790
次期繰越損益金	△ 390,647,618
(D) 受益権総口数	2,066,079,790口
1万口当り基準価額(C/D)	8,109円

*期首における元本額は2,352,129,859円、当作成期間中における追加設定元本額は5,331,692円、同解約元本額は291,381,761円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は8,109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390,647,618円です。

■損益の状況

当期 自 2020年2月18日 至 2020年8月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	37,756,957円
受取配当金	37,706,654
受取利息	54,994
支払利息	△ 4,691
(B) 有価証券売買損益	357,862,595
売買益	113,434,527
売買損	△ 471,297,122
(C) 信託報酬等	17,864,472
△	
(D) 当期損益金(A+B+C)	337,970,110
△	
(E) 前期繰越損益金	141,637,100
△	
(F) 追加信託差損益金	88,959,592
(配当等相当額)	(73,292,399)
(売買損益相当額)	(15,667,193)
(G) 合計(D+E+F)	390,647,618
△	
次期繰越損益金(G)	390,647,618
追加信託差損益金	88,959,592
(配当等相当額)	(73,292,399)
(売買損益相当額)	(15,667,193)
分配準備積立金	137,841,796
繰越損益金	△ 617,449,006

(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。

(注4) 投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用:4,125,414円(未監査)

■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	19,892,485円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	73,292,399
(d) 分配準備積立金	117,949,311
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	211,134,195
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	211,134,195
(h) 受益権総口数	2,066,079,790口

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 分 配 金		期 騰 落 率	公 社 債 組 入 比 率	純 資 産 額
		円	円			
13期末(2018年8月16日)	9,992	0	△ 0.0	—	183	
14期末(2019年2月18日)	9,987	0	△ 0.1	—	152	
15期末(2019年8月16日)	9,982	0	△ 0.1	—	9	
16期末(2020年2月17日)	9,978	0	△ 0.0	—	8	
17期末(2020年8月17日)	9,976	0	△ 0.0	—	8	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

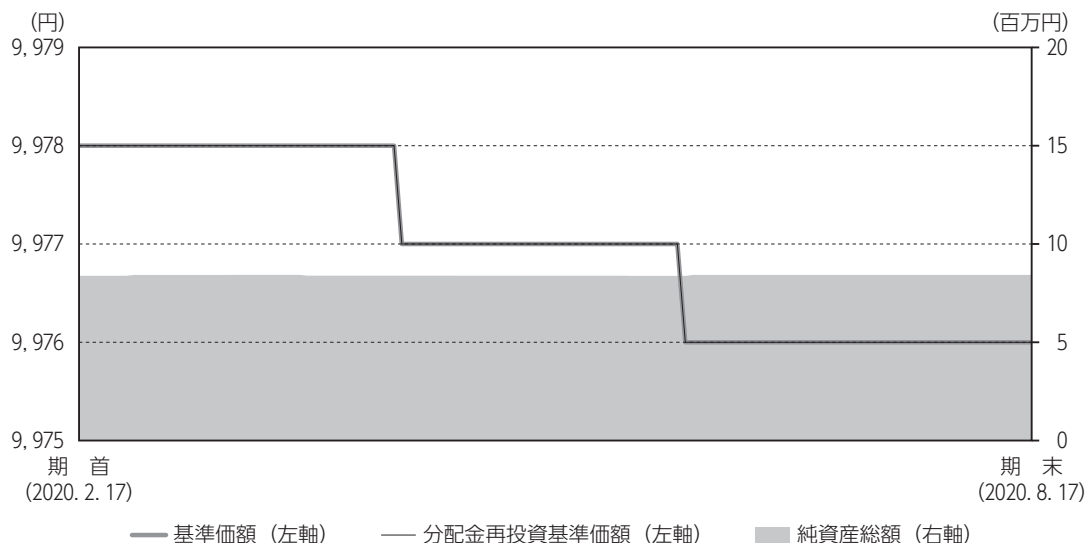
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注4) 当ファンドは、ダイワ・アセアン内需関連株ファンドの資金を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、円建ての債券を中心に、安定運用を行います。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



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：9,978円

期末：9,976円（分配金0円）

騰落率：△0.0%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券を通じて投資したコール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公社債組入比率
	円		%	%
(期首)2020年2月17日	9,978	—	—	—
2月末	9,978	0.0	—	—
3月末	9,978	0.0	—	—
4月末	9,977	△	0.0	—
5月末	9,977	△	0.0	—
6月末	9,976	△	0.0	—
7月末	9,976	△	0.0	—
(期末)2020年8月17日	9,976	△	0.0	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2020. 2. 18 ~ 2020. 8. 17)

国内短期金融市況

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

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

ダイワ・マネース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。

ポートフォリオについて

(2020. 2. 18 ~ 2020. 8. 17)

当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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。

分配金について

当作成期は、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	
	2020年2月18日 ～2020年8月17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

- (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・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

■ダイワ・マネース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。

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 (2020. 2. 18~2020. 8. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—円	—%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,977円です。
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0.004	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.002)	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)	(0.001)	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) 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。

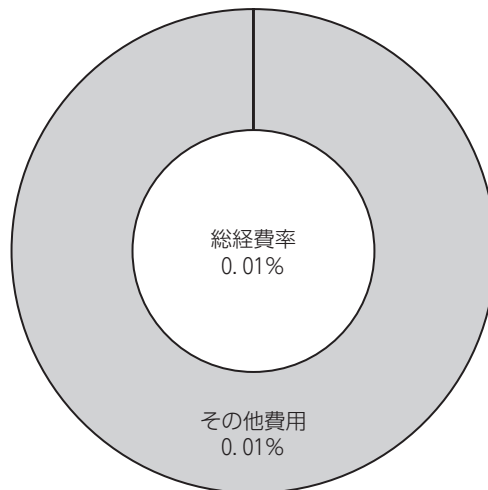
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.01%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

(2020年2月18日から2020年8月17日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネー ストック・ マザーファンド	97	97	52	52

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 数	評 価 額	□ 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	8,329	8,329	8,375	8,385

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年8月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	8,385	99.5
コール・ローン等、その他	42	0.5
投資信託財産総額	8,427	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

2020年8月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,427,431円
コール・ローン等	42,264
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド(評価額)	8,385,167
(B) 負債	182
その他未払費用	182
(C) 純資産総額(A-B)	8,427,249
元本	8,447,348
次期繰越損益金	△ 20,099
(D) 受益権総口数	8,447,348口
1万口当り基準価額(C/D)	9,976円

* 期首における元本額は8,401,129円、当作成期間中における追加設定元本額は97,469円、同解約元本額は51,250円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,976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20,099円です。

■損益の状況

当期 自 2020年2月18日 至 2020年8月17日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△ 1,660円
売買益	1
売買損	△ 1,661
(B) 信託報酬等	△ 182
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,842
(D) 前期繰越損益金	△ 6,285
(E) 追加信託差損益金	△ 11,972
(配当等相当額)	(3,544)
(売買損益相当額)	(△ 15,516)
(F) 合計(C+D+E)	△ 20,099
次期繰越損益金(F)	△ 20,099
追加信託差損益金	△ 11,972
(配当等相当額)	(3,544)
(売買損益相当額)	(△ 15,516)
分配準備積立金	5
繰越損益金	△ 8,132

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,544
(d) 分配準備積立金	5
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	3,549
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	3,549
(h) 受益権総口数	8,447,348口

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（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）が投資対象としている「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の決算日（2019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（2020年8月17日）現在におけるダイワ・マネーストック・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・マネーストック・マザーファンドの主要な売買銘柄

2020年2月18日～2020年8月17日における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

2020年8月17日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第10期（決算日 2019年12月9日）

（作成対象期間 2018年12月11日～2019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。

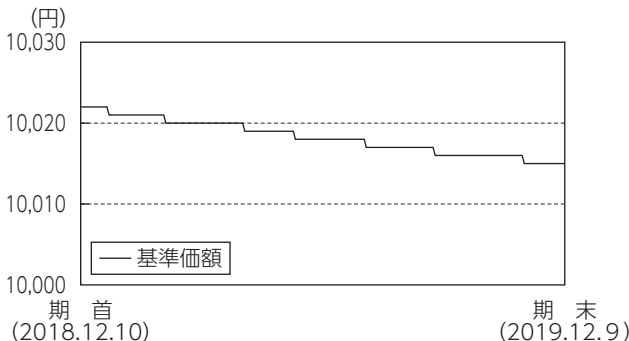
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2018年12月10日	円	%	%
	10,022	-	-
12月末	10,022	0.0	-
2019年1月末	10,021	△0.0	-
2月末	10,020	△0.0	-
3月末	10,020	△0.0	-
4月末	10,019	△0.0	-
5月末	10,018	△0.0	-
6月末	10,018	△0.0	-
7月末	10,017	△0.0	-
8月末	10,017	△0.0	-
9月末	10,016	△0.1	-
10月末	10,016	△0.1	-
11月末	10,015	△0.1	-
(期末)2019年12月9日	10,015	△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、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：10,022円 期末：10,015円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

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。

◆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

流動性と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および参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	1 (1)
合 計	1

(注1) 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) 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

公 社 債

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

国 内	買 付 額 千円	売 付 額 千円

(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、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

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

銘	買 付 額		売 付 額	
	柄	金 額 千円	柄	金 額 千円
801 国庫短期証券 2019/3/18		250,003		

(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

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

2019年12月9日現在

項 目	当 期 末		
	評 価 額	比 率	
	千円		%
コール・ローン等、その他	103,888,808		100.0
投資信託財産総額	103,888,808		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

2019年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	103,888,808,252円
コール・ローン等	103,888,808,252
(B) 負債	200,442,764
未払解約金	200,000,000
その他未払費用	442,764
(C) 純資産総額(A - B)	103,688,365,488
元本	103,532,314,258
次期繰越損益金	156,051,230
(D) 受益権総口数	103,532,314,258口
1口当り基準価額(C / D)	10,015円

* 期首における元本額は40,969,233,796円、当作成期間中における追加設定元本額は198,584,973,661円、同解約元本額は136,021,893,199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、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック-947,268円、ダイワ/ミレリアセット・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、新興国ソブリン・豪ドルファンド (毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ブラジルリアルファンド (毎月決算型) 999円、新興国ソブリン・ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型) 999円、U S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) - ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり) 3,985円、iFreeレバレッジ S & P 500 995,814円、iFreeレバレッジN A S D A Q 100 29,943,109円、米国4資産リスク分散ファンド (年2回決算型) 658,945円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス3,526,781,327円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインパース・インデックス6,932,995,956円、ダイワ上場投信-TOP 1 Xレバレッジ (2倍) 指数1,154,855,756円、ダイワ上場投信-TOP 1 Xダブルインパース (-2倍) 指数1,136,478,065円、ダイワ上場投信-日経平均インパース・インデックス46,620,451,844円、ダイワ上場投信-TOP 1 Xインパース (-1倍) 指数10,870,537,799円、ダイワ上場投信-J P X日経400レバレッジ・インデックス413,400,603円、ダイワ上場投信-J P X日経400インパース・インデックス811,328,174円、ダイワ上場投信-J P X日経400ダブルインパース・インデックス401,731,588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 (部分為替ヘッジあり) 2016-07 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (部分為替ヘッジあり) 2017-06 997円、ダイワ米国投資法人債ファンド (部分為替ヘッジあり) 2017-06 997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、ダイワ米国投資法人債ファンド (部分為替ヘッジあり) 2016-10 997円、先進国トータルリターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用) 6,289,387,976円、ダイワ日本株式ベア・ファンド (適格機関投資家専用) 10,596,789,950円、低リスク型アロケーションファンド (金利トレンド判断付き/適格機関投資家専用) 179,433,743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 - S L T

レード-186,241,301円、ダイワ/モルガン・スタンレー新興4カ国不動産関連ファンド-成長の植音 (つちおと) -5,020,480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339,840,055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8,383,335円、低リスク型アロケーションファンド (適格機関投資家専用) 13,958,125,625円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・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/ミレリアセット・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・レアル・コース (毎月分配型) 987,373円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・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U S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/ミレリアセット亜細亜株式ファンド9,958,176円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり49,806円、<奇数月定額払出型>ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし49,806円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 米ドル・コース1,989,053円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・レアル・コース2,978,118円、通貨選択型ダイワ/ミレリアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース1,691,241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/ミレリアセット・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/ミレリアセット・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/ミレリアセット・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・レアル・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- 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 1,993,820円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イーグルアイII- 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 -イーグルアイII- 予想分配金提示型 日本円・コース200,861円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド -イーグルアイII- 予想分配金提示型 ブラジル・レアル・コース300,273円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド-イーグルアイ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 -イーグルアイII- 予想分配金提示型 通貨セレクト・コース505,900円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,015円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月11日 至2019年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 46,990,800円
受取利息	413,173
支払利息	△ 47,403,973
(B) その他費用	△ 10,190,474
(C) 当期損益金(A + B)	△ 57,181,274
(D) 前期繰越損益金	90,073,869
(E) 解約差損益金	△254,373,622
(F) 追加信託差損益金	377,532,257
(G) 合計(C + D + E + F)	156,051,230
次期繰越損益金(G)	156,051,230

(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。