

iFree レバレッジ S & P 500

運用報告書(全体版) 第3期

(決算日 2021年8月30日)

(作成対象期間 2020年9月1日～2021年8月30日)

★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／海外／株式／特殊型(ブル・ベア型)		
信託期間	無期限		
運用方針	日々の基準価額の値動きがS & P 500指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度となることをめざして運用を行いません。		
主要投資対象	ベビーファンド	米国の株価指数先物取引、米国の債券、わが国の債券およびダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券。なお、米国の金融商品取引所上場株式およびETF(上場投資信託証券)に投資する場合があります。	
	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	円建ての債券	
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	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率	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、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。		

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、日々の基準価額の値動きがS & P 500指数(米ドルベース)の値動きの2倍程度とな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。

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/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P 500指数 (米ドルベース)		株式組入 比率	株式先物 比率	公社債 組入比率	債券先物 比率	投資信託 受益証券 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
1 期末 (2019年 8月30日)	9,751	0	△ 2.5	10,081	0.8	—	198.9	41.5	—	—	383
2 期末 (2020年 8月31日)	12,915	0	32.4	12,092	19.9	—	202.9	8.0	—	—	1,983
3 期末 (2021年 8月30日)	20,981	0	62.5	15,543	28.5	—	200.9	6.7	—	—	13,144

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 500指数 (米ドルベース) は、S & P 500指数 (米ドルベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

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

(注6) 先物比率は買建比率-売建比率です。

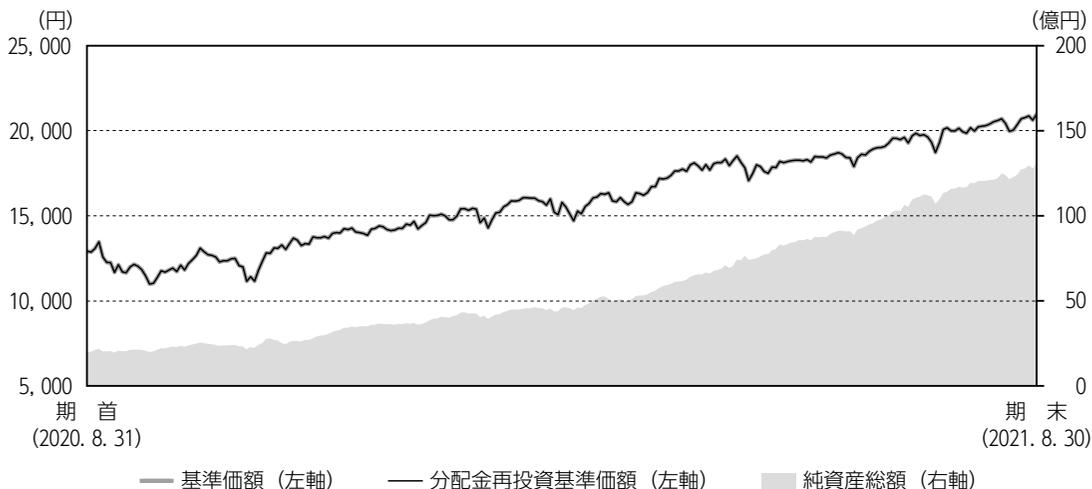
(注7) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

S & P 500 (以下「当インデックス」といいます。) は、S & P Global の一部門である S & P Dow Jones Indices LLC (「SPDJ」) の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®] および S & P[®] は、S & P Global の一部門である Standard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones[®] は Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJ に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



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：12,915円

期末：20,981円（分配金0円）

騰落率：62.5%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

日々の基準価額の値動きがS & P 500指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざした運用を行った結果、米国株式が上昇基調だったことから、当ファンドの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。

iFree レバレッジ S & P 500

決算期	基準価額		S & P 500指数 (米ドルベース)		株式組入 比	株式先物 率	公社債 組入比率	債券先物 率	投資信託 受益証券 組入比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率					
(期首) 2020年 8月31日	12,915	—	12,092	—	—	202.9	8.0	—	—
9月末	11,684	△ 9.5	11,497	△ 4.9	—	203.1	9.6	—	—
10月末	11,415	△ 11.6	11,410	△ 5.6	—	200.6	9.2	—	—
11月末	13,782	6.7	12,541	3.7	—	205.9	7.0	—	—
12月末	14,455	11.9	12,847	6.2	—	199.5	11.3	—	—
2021年 1月末	14,871	15.1	13,055	8.0	—	199.0	10.1	—	—
2月末	15,217	17.8	13,199	9.2	—	201.9	9.7	—	—
3月末	16,207	25.5	13,645	12.8	—	201.4	8.3	—	—
4月末	18,337	42.0	14,517	20.1	—	199.8	6.1	—	—
5月末	18,270	41.5	14,491	19.8	—	202.7	5.2	—	—
6月末	19,018	47.3	14,794	22.3	—	201.6	9.0	—	—
7月末	20,152	56.0	15,233	26.0	—	201.1	7.5	—	—
(期末) 2021年 8月30日	20,981	62.5	15,543	28.5	—	200.9	6.7	—	—

(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

(2020.9.1 ~ 2021.8.30)

■ 米国株式市況

米国株式市場は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、大幅に上昇した銘柄に利益確定の動きが強まったとみられるほか、米国大統領選挙を控えてリスクを回避する動きも強まったようで、上値の重い展開となりました。2020年11月以降は、米国大統領選挙で民主党のバイデン氏が当選確定となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、新型コロナウイルスのワクチン接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月には米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、ワクチンの接種が進んで新規感染者数が減少したことなどが好感され、株価は引き続き上昇しました。その後は、インフレ懸念の高まりや金融緩和縮小の早期化観測などから一時的に調整する場面はあったものの、ワクチンの接種が進んで種々の行動制限が解除されたことや良好な企業業績の発表などが好感され、史上最高値を更新しました。

■ 国内短期金融市況

日銀のマイナス金利政策の影響により、短期の国債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

当ファンドの運用方針に基づき、主として、米国の債券、わが国の債券およびマザーファンドの受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがS & P 500指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざします。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2020. 9. 1 ~ 2021. 8. 30)

当ファンド

米国の株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、純資産総額の2倍程度となるよう調整しました。また、米国の短期国債（T-BILL）および「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

米国の株価指数先物取引については、E-mini S & P 500 株価指数先物取引を利用しました。米国の株式への直接投資は行っておりません。

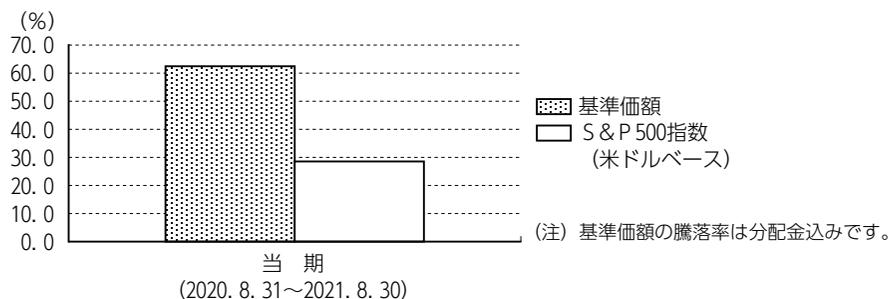
ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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。



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	
	2020年9月1日 ～2021年8月30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)	10,981

(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

当ファンドの運用方針に基づき、主として、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがS & P 500指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざします。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 9. 1~2021. 8. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	158円	0. 987%	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15, 973円です。
(投 信 会 社)	(76)	(0. 477)	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)	(76)	(0. 477)	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)	(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	4	0. 024	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)	(4)	(0. 024)	
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	18	0. 113	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)	(0)	(0. 000)	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)	(1)	(0. 006)	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)	(17)	(0. 107)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	180	1. 124	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

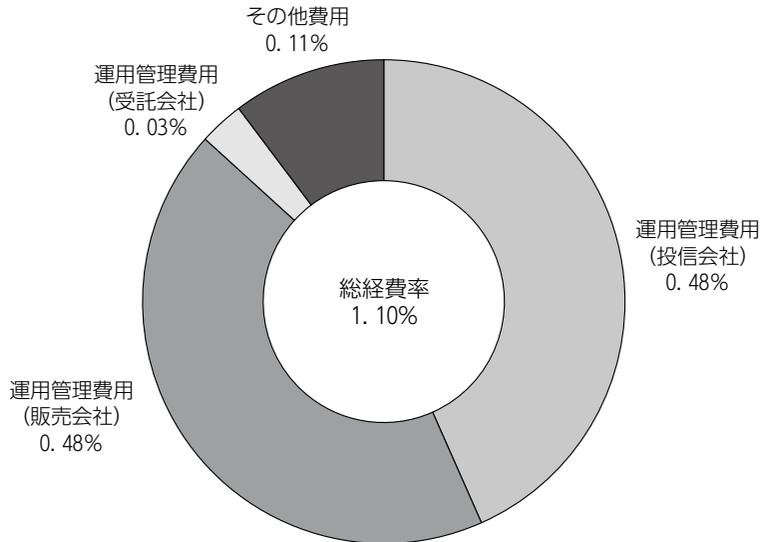
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.10%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

(1) 公 社 債

(2020年9月1日から2021年8月30日まで)

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
			17,997	11,499 ()

(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) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年9月1日から2021年8月30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・マネーストック・マザーファンド	4,396,118	4,400,000	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引状況等

先物取引の銘柄別取引・残高状況

(2020年9月1日から2021年8月30日まで)

銘 柄 別			買 建		売 建		当 作 成 期 末 評 価 額		
			新 規 買付額	決 済 額	新 規 売付額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評 価 損 益
外国	株式	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
			65,074	46,286	—	—	26,403	—	1,326

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年9月1日から2021年8月30日まで)

当			期		
買 付			売 付		
銘 柄		金 額	銘 柄		金 額
		千円			千円
U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2021/9/30	884,599	U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2021/3/25	442,836
U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2021/6/24	442,803	U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2021/6/24	442,319
U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2021/3/25	413,904	U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2020/12/31	206,991
U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2020/12/31	211,528	U. S. TREASURY BILL (アメリカ)	2020/9/24	158,699

(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。

■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 (外貨建) 公社債 (通貨別)

区 分	額 面 金 額	当 期		組入比率	うちBB格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカ・ドル 8,000	千アメリカ・ドル 7,999	千円 877,909	% 6.7	% —	% —	% —	% 6.7

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					末		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	U. S. TREASURY BILL	国債証券	% —	千アメリカ・ドル 8,000	千アメリカ・ドル 7,999	千円 877,909	2021/09/30

(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) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(3)親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	千口 899,777	千口 5,295,895	千円 5,300,132

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年8月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 877,909	% 6.6
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	5,300,132	39.8
コール・ローン等、その他	7,137,198	53.6
投資信託財産総額	13,315,239	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30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.74円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(4,779,501千円)の投資信託財産総額(13,315,239千円)に対する比率は、35.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年8月30日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	18,967,282,959円
コール・ローン等	3,233,695,293
公社債(評価額)	877,909,036
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	5,300,132,641
未収入金	6,103,013,118
差入委託証拠金	3,452,532,871
(B)負債	5,822,513,038
未払金	4,780,504,801
未払解約金	122,074,028
未払信託報酬	41,781,519
差入委託証拠金代用有価証券	877,920,000
その他未払費用	232,690
(C)純資産総額(A-B)	13,144,769,921
元本	6,264,942,988
次期繰越損益金	6,879,826,933
(D)受益権総口数	6,264,942,988口
1万口当り基準価額(C/D)	20,981円

* 期首における元本額は1,536,045,539円、当作成期間中における追加設定元本額は11,258,680,556円、同解約元本額は6,529,783,107円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,981円です。

■損益の状況

当期 自2020年9月1日 至2021年8月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 228,100円
受取利息	231,127
その他収益金	57,402
支払利息	△ 516,629
(B) 有価証券売買損益	△ 39,155,450
売買益	181,313,134
売買損	△ 220,468,584
(C) 先物取引等損益	2,103,064,718
取引益	2,670,221,606
取引損	△ 567,156,888
(D) 信託報酬等	△ 63,408,775
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	2,000,272,393
(F) 前期繰越損益金	49,803,146
(G) 追加信託差損益金	4,829,751,394
(配当等相当額)	(1,714,541,681)
(売買損益相当額)	(3,115,209,713)
(H) 合計 (E + F + G)	6,879,826,933
次期繰越損益金 (H)	6,879,826,933
追加信託差損益金	4,829,751,394
(配当等相当額)	(1,714,541,681)
(売買損益相当額)	(3,115,209,713)
分配準備積立金	2,050,303,639
繰越損益金	△ 228,100

(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：6,113,376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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,000,500,493
(c) 収益調整金	4,829,751,394
(d) 分配準備積立金	49,803,146
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	6,880,055,033
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	6,880,055,033
(h) 受益権総口数	6,264,942,988口

<補足情報>

当ファンド（iFree レバレッジ S & P 500）が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2020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（2021年8月30日）現在におけるダイワ・マネースtock・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tock・マザーファンドの主要な売買銘柄

2020年9月1日～2021年8月30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

2021年8月30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11期 (決算日 2020年12月9日)

(作成対象期間 2019年12月10日～2020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。

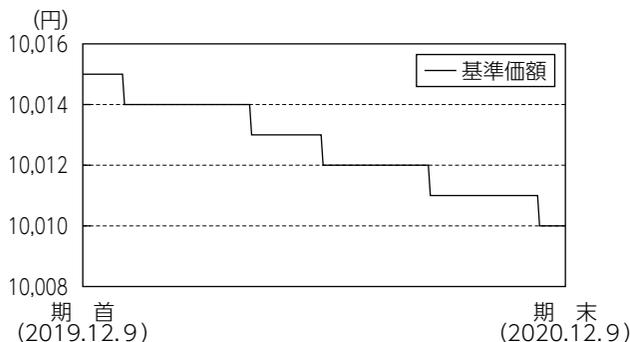
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2019年12月9日	円	%	%
	10,015	-	-
12月末	10,015	0.0	-
2020年1月末	10,014	△0.0	-
2月末	10,014	△0.0	-
3月末	10,014	△0.0	-
4月末	10,013	△0.0	-
5月末	10,013	△0.0	-
6月末	10,012	△0.0	-
7月末	10,012	△0.0	-
8月末	10,011	△0.0	-
9月末	10,011	△0.0	-
10月末	10,011	△0.0	-
11月末	10,010	△0.0	-
(期末)2020年12月9日	10,010	△0.0	-

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,015円 期末：10,010円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2020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	88,460,615	100.0
投資信託財産総額	88,460,615	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	88,460,615,301円
コール・ローン等	88,460,615,301
(B) 負債	50,000,000
未払解約金	50,000,000
(C) 純資産総額(A-B)	88,410,615,301
元本	88,319,921,795
次期繰越損益金	90,693,506
(D) 受益権総口数	88,319,921,795口
1万口当り基準価額(C/D)	10,010円

* 期首における元本額は103,532,314,258円、当作成期間中における追加設定元本額は103,255,612,211円、同解約元本額は118,468,004,674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/ミレニアセット・インド株式ファンド - インドの匠 - 29,910,270円、ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジあり) 998円、ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジなし) 998円、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・ブラジルレアルファンド (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 1,249,412,852円、iFreeレバレッジ N A S D A Q 100 11,006,295,149円、米国4資産リスク分散ファンド (年2回決算型) 689,912円、グリーンテック株式ファンド (資産成長型) 998,802円、ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (毎月決算/予想分配金提示型) 999円、ダイワ上場投信-日経平均レバレッジ・インデックス2,927,475,552円、ダイワ上場投信-日経平均ダブルインバース・インデックス6,683,086,104円、ダイワ上場投信-TOP I Xレバレッジ (2倍) 指数1,085,050,377円、ダイワ上場投信-TOP I Xダブルインバース (-2倍) 指数1,226,094,880円、ダイワ上場投信-日経平均インバース・インデックス25,058,858,800円、ダイワ上場投信-TOP I Xインバース (-1倍) 指数11,170,317,850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387,469,071円、ダイワ上場投信-J P X日経400インバース・インデックス611,537,975円、ダイワ上場投信-J P X日経400ダブルインバース・インデックス141,884,108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 (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) 6,988,339,549円、ダイワ日本株式ベア・ファンド (適格機関投資家専用) 19,374,063,390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トレード - 5,091,608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149,382,442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5,609,419円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 豪ドル・コース (毎月分配型) 595,106円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ ブラジル・レアル・コース (毎月分配型) 987,373円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 494,581円、ダイワ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/ミレニアセット亜細亜株式ファンド9,958,176円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配株α (毎月分配型) 米ドル・コース1,989,053円、通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配株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/ミレニアセット・グローバル好配株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/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジあり) 1,091,429円、ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジなし) 315,004円、ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株式ファンド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 - 米ドル・コース (毎月分配型) 398,764円、ダイワ日本株ストラテジーα (通貨選択型) - ジャパン・トリプルリターンズ - 通貨セレクト・コース (毎月分配型) 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 豪ドル・コース200,861円、通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド - イーグルアイ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、10,010円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月10日 至2020年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 34,974,173円
受取利息	1,075,374
支払利息	△ 36,049,547
(B) その他費用	△ 1,522,123
(C) 当期損益金(A+B)	△ 36,496,296
(D) 前期繰越損益金	156,051,230
(E) 解約差損益金	△161,476,434
(F) 追加信託差損益金	132,615,006
(G) 合計(C+D+E+F)	90,693,506
次期繰越損益金(G)	90,693,506

(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。