

iFree レバレッジ S & P 500

運用報告書(全体版) 第 4 期

(決算日 2022年 8 月30日)
(作成対象期間 2021年 8 月31日～2022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（プル・ベア型）		
信託期間	無期限（設定日：2018年 8 月31日）		
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ないます。		
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 E T F（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 分 配 金	期 騰 落 中 率	(参考指数)	期 騰 落 中 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
4 期末 (2022年 8月30日)	16,097	0	△ 23.3	13,893	△ 10.6	—	200.4	—	—	—	19,222

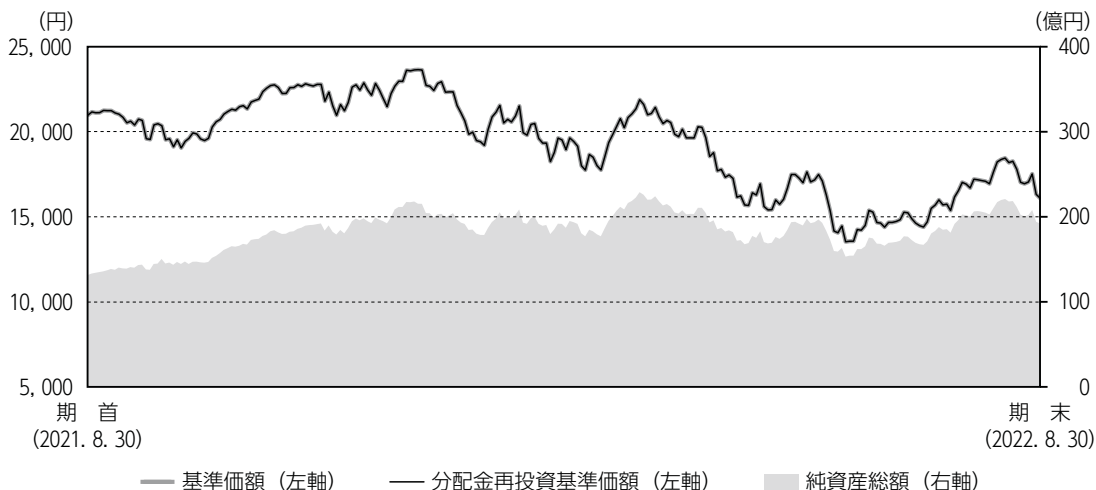
- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) S & P 500指数 (米ドルベース) は、S & P 500指数 (米ドルベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
- (注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注 5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 6) 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 (「SPDJI」) 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 SPDJI 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、SPDJI、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



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

基準価額・騰落率

期 首：20,981円

期 末：16,097円（分配金 0 円）

騰落率：△23.3%（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、米国株式が下落基調だったことから、当ファンドの基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

iFree レバレッジ S & P 500

年 月 日	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
	騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率					
(期首) 2021年 8 月30日	円	%		%	%	%	%	%	%
	20,981	—	15,543	—	—	200.9	6.7	—	—
8 月末	21,164	0.9	15,610	0.4	—	202.0	6.6	—	—
9 月末	19,586	△ 6.6	15,027	△ 3.3	—	201.2	9.9	—	—
10月末	21,746	3.6	15,844	1.9	—	200.0	8.5	—	—
11月末	22,325	6.4	16,046	3.2	—	199.5	7.8	—	—
12月末	23,639	12.7	16,521	6.3	—	198.0	—	—	—
2022年 1 月末	20,140	△ 4.0	15,276	△ 1.7	—	199.4	—	—	—
2 月末	19,628	△ 6.4	15,114	△ 2.8	—	200.7	—	—	—
3 月末	21,603	3.0	15,864	2.1	—	196.6	—	—	—
4 月末	17,788	△ 15.2	14,422	△ 7.2	—	201.5	—	—	—
5 月末	17,487	△ 16.7	14,333	△ 7.8	—	201.1	—	—	—
6 月末	14,629	△ 30.3	13,163	△ 15.3	—	200.4	—	—	—
7 月末	16,548	△ 21.1	14,037	△ 9.7	—	201.2	—	—	—
(期末) 2022年 8 月30日	16,097	△ 23.3	13,893	△ 10.6	—	200.4	—	—	—

(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

(2021. 8. 31 ~ 2022. 8. 30)

■米国株式市況

米国株式市況は、2021年末にかけて上昇しましたが、その後は下落しました。

米国株式市況は、当作成期首より2021年9月末にかけて、米国の量的金融緩和の早期縮小観測や連邦政府の債務上限問題などから、軟調に推移しました。10月に入ると、債務上限問題の一時棚上げや良好な企業決算の発表を受けて上昇しました。その後も、物価の上昇加速による早期利上げ観測や、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感などで下落する局面はあったものの、多くの良好な経済指標の発表が支えとなり、年末にかけて高値圏で推移しました。2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め懸念で金利が上昇したことや、ロシアによるウクライナ侵攻で地政学リスクが顕在化したことを受け、株価は3月半ばにかけて下落しましたが、F R Bの利上げ決定後は一時的に反発しました。4月から6月にかけては、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R Bが利上げを加速するとの思惑が強まり、景気の先行き懸念が台頭したことで、株価は下落しました。その後は、資源価格の上昇一服でインフレ懸念が後退し、将来的な利下げ転換期待なども生じたことで8月半ばにかけて上昇しましたが、F R B高官の金融引き締めに積極的な発言などを受け、当作成期末にかけて株価は反落しました。

■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「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。

ポートフォリオについて

(2021. 8. 31 ~ 2022. 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。

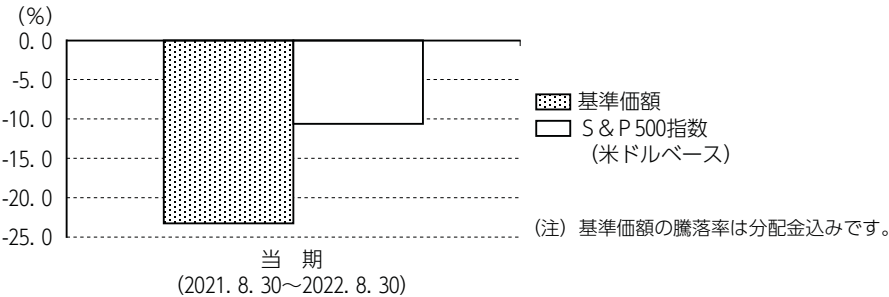
米国の株価指数先物取引については、E-mini S & P 500 株価指数先物取引を利用しました。米国の株式への直接投資は行っておりません。

■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	
	2021年 8 月31 日	～2022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)	6,097

(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 (2021. 8. 31～2022. 8. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	191円	0.990%	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19,274円です。
(投 信 会 社)	(92)	(0.478)	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)	(92)	(0.478)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(6)	(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	5	0.023	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)	(5)	(0.023)	
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	12	0.064	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)	(0.005)	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
(そ の 他)	(11)	(0.059)	CLS 決済に関わる手数料、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	208	1.077	

(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。

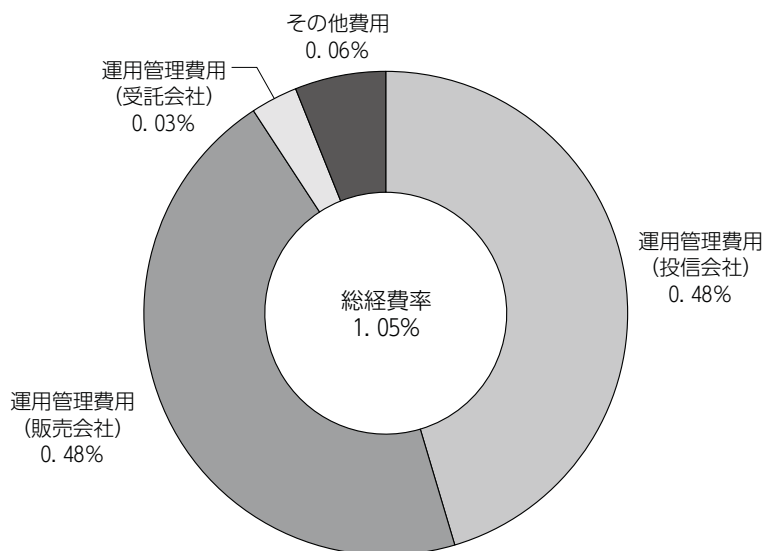
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.05%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

(2021年 8 月31日から2022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 12, 998	千アメリカ・ドル 20, 999 (ー)

(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

(2021年 8 月31日から2022年 8 月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	6, 995, 303	7, 000, 000	ー	ー

(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

(2021年 8 月31日から2022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 203, 385	百万円 195, 516	百万円 ー	百万円 ー	百万円 38, 516	百万円 ー	百万円 1, 665

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2021年 8 月31日から2022年 8 月30日まで)

当 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
U. S. TREASURY BILL (アメリカ) 2021/12/30	千円 1, 454, 810	U. S. TREASURY BILL (アメリカ) 2021/12/30 U. S. TREASURY BILL (アメリカ) 2021/9/30	千円 1, 495, 218 895, 350

(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

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	5, 295, 895	12, 291, 199	12, 297, 344

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年 8月30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	12, 297, 344	62. 1
コール・ローン等、その他	7, 493, 837	37. 9
投資信託財産総額	19, 791, 182	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＝138. 57円です。
(注 3) 当期末における外貨建純資産 (4, 156, 469千円) の投資信託財産総額 (19, 791, 182千円) に対する比率は、21. 0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年 8月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	23, 563, 891, 917円
コール・ローン等	3, 104, 456, 666
ダイワ・マネースtock・マザーファンド (評価額)	12, 297, 344, 694
未収入金	5, 671, 994, 145
差入委託証拠金	2, 490, 096, 412
(B) 負債	4, 341, 545, 034
未払金	4, 230, 991, 059
未払解約金	15, 553, 725
未払信託報酬	94, 475, 459
その他未払費用	524, 791
(C) 純資産総額 (A－B)	19, 222, 346, 883
元本	11, 941, 285, 265
次期繰越増益金	7, 281, 061, 618
(D) 受益権総口数	11, 941, 285, 265口
1万口当り基準価額 (C／D)	16, 097円

* 期首における元本額は6, 264, 942, 988円、当作成期間中における追加設定元本額は15, 276, 800, 928円、同解約元本額は9, 600, 458, 651円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は16, 097円です。

■損益の状況

当期 自2021年 8月31日 至2022年 8月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	8, 687, 876円
受取利息	200, 718
その他収益金	9, 640, 424
支払利息	△ 1, 153, 266
(B) 有価証券売却増益	210, 045, 360
売却益	1, 750, 146, 011
売却損	△ 1, 540, 100, 651
(C) 先物取引等損益	△ 4, 360, 364, 842
取引益	6, 016, 125, 571
取引損	△ 10, 376, 490, 413
(D) 信託報酬等	△ 194, 073, 988
(E) 当期増益金 (A + B + C + D)	△ 4, 335, 705, 594
(F) 前期繰越増益金	708, 448, 550
(G) 追加信託差増益金	10, 908, 318, 662
(配当等相当額)	(6, 467, 234, 838)
(売買損益相当額)	(4, 441, 083, 824)
(H) 合計 (E + F + G)	7, 281, 061, 618
次期繰越増益金 (H)	7, 281, 061, 618
追加信託差増益金	10, 908, 318, 662
(配当等相当額)	(6, 467, 234, 838)
(売買損益相当額)	(4, 441, 083, 824)
分配準備積立金	708, 527, 376
繰越増益金	△ 4, 335, 784, 420

(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) 追加信託差増益金とは、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：19, 356, 961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却等増益	0
(c) 収益調整金	6, 572, 613, 068
(d) 分配準備積立金	708, 527, 376
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	7, 281, 140, 444
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e－f)	7, 281, 140, 444
(h) 受益権総口数	11, 941, 285, 265口

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

<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（2021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（2022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

2021年8月31日～2022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

2022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12期（決算日 2021年12月9日）

（作成対象期間 2020年12月10日～2021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。

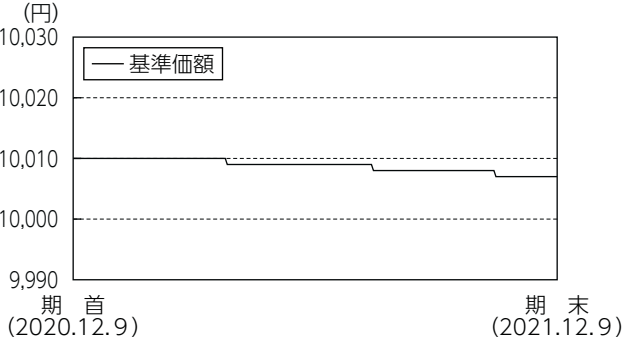
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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)2020年12月9日	円	%	%
12月末	10,010	0.0	—
2021年1月末	10,010	0.0	—
2月末	10,010	0.0	—
3月末	10,010	0.0	—
4月末	10,009	△0.0	—
5月末	10,009	△0.0	—
6月末	10,009	△0.0	—
7月末	10,008	△0.0	—
8月末	10,008	△0.0	—
9月末	10,008	△0.0	—
10月末	10,007	△0.0	—
11月末	10,007	△0.0	—
(期末)2021年12月9日	10,007	△0.0	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 公社債組入比率是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：10,010円 期末：10,007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

2021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	147,987,988	100.0
投資信託財産総額	147,987,988	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

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	147,987,988,484円
コール・ローン等	147,987,988,484
(B) 負債	210,000,000
未払解約金	210,000,000
(C) 純資産総額(A－B)	147,777,988,484
元本	147,676,216,454
次期繰越損益金	101,772,030
(D) 受益権総口数	147,676,216,454口
1万口当り基準価額(C／D)	10,007円

* 期首における元本額は88,319,921,795円、当作成期間中における追加設定元本額は176,557,677,368円、同解約元本額は117,201,382,709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：

日本株ロング・ショート戦略パイロットファンド (適格機関投資家専用)	266,761,115円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド	947,268円
ダイワ/ミレーアセット・インド株式ファンド	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
US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	39,499円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	
ロボット・テクノロジー (年1回) (為替ヘッジあり)	3,985円
i Freeレバレッジ S & P 500	8,293,797,395円
i Freeレバレッジ NASDAQ100	70,959,132,903円
ク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	999円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型)	1,000円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	499,501円
ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	5,345,339,466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	6,483,785,045円
ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,334,794,630円
ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース (－2倍) 指数	936,360,631円
ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	6,676,062,567円
ダイワ上場投信－TOPIXインバース (－1倍) 指数	3,084,973,807円
ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス	574,295,634円
ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス	861,497,868円
ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス	104,920,073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 (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5セクターファンド (適格機関投資家専用)	101,154,451円
ダイワ日本株15－20年ラダー型ファンド・マザーポートフォリオ	301,448,680円
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	16,464,882,107円
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	17,685,532,691円
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	1,058,922,067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	89,553,240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	2,938,475円
通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	595,106円
通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	987,373円
通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	494,581円
ダイワUS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/ミレー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/ミレーアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型)	10,833円
通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型)	10,788円
通貨選択型ダイワ/ミレーアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型)	12,751円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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/ミレーアセット・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ー	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ー	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ー	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ー	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ー	15,402円
通貨選択型ダイワ米国厳選株ファンド－イーグルアイⅠ－ 予想分配金提示型	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Ⅰ－ 予想分配金提示型	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	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	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	505,900円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,007円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 31,130,963円
受取利息	469,134
支払利息	△ 31,600,097
(B) その他費用	△ 147,839
(C) 当期損益金(A+B)	△ 31,278,802
(D) 前期繰越損益金	90,693,506
(E) 解約差損益金	△106,126,697
(F) 追加信託差損益金	148,484,023
(G) 合計(C+D+E+F)	101,772,030
次期繰越損益金(G)	101,772,030

(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。