

ダイワ・ブルベア・ファンド6

ブル3倍日本株ポートフォリオ6

ベア2倍日本株ポートフォリオ6

ブルベア・マネー・ポートフォリオ6

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ブル3倍日本株ポートフォリオ6	追加型投信／国内／株式／特殊型（ブル・ベア型）
	ベア2倍日本株ポートフォリオ6	
	ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	追加型投信／国内／債券
信託期間	2021年4月16日～2026年4月15日	
運用方針	ブル3倍日本株ポートフォリオ6	日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの3倍程度となることをめざして運用を行ないます。
	ベア2倍日本株ポートフォリオ6	日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行ないます。
	ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	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	ブル3倍日本株ポートフォリオ6	わが国の株価指数先物取引、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（わが国の金融商品取引所上場株式に投資することもあります。）
	ベア2倍日本株ポートフォリオ6	わが国の株価指数先物取引、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
	ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	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	ブル3倍日本株ポートフォリオ6	マザーファンドおよび株式実質組入上限比率は無制限
	ベア2倍日本株ポートフォリオ6	
	ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	・マザーファンド組入上限比率は無制限 ・株式実質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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

◇SUZ0463020240415◇

運用報告書(全体版)

第3期

(決算日 2024年4月15日)

(作成対象期間 2023年4月18日～2024年4月15日)

■信託期間終了日を2024年4月15日から2026年4月15日に変更しました。

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・ブルベア・ファンド6」は、このたび、第3期の決算を行ないました。

ここに、当作成期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/>

<4631>
<4632>
<4630>

ブル3倍日本株ポートフォリオ6

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均トータル リターン・インデックス		株式 組入比率	株式先物 比率	公社債 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 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 (2022年 4月15日)	7,063	0	△ 29.4	45,940.25	△ 6.8	—	299.5	—	34,181
2 期末 (2023年 4月17日)	7,945	0	12.5	49,474.91	7.7	—	292.0	—	27,795
3 期末 (2024年 4月15日)	19,791	0	149.1	69,339.32	40.2	—	304.1	25.8	35,445

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 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。

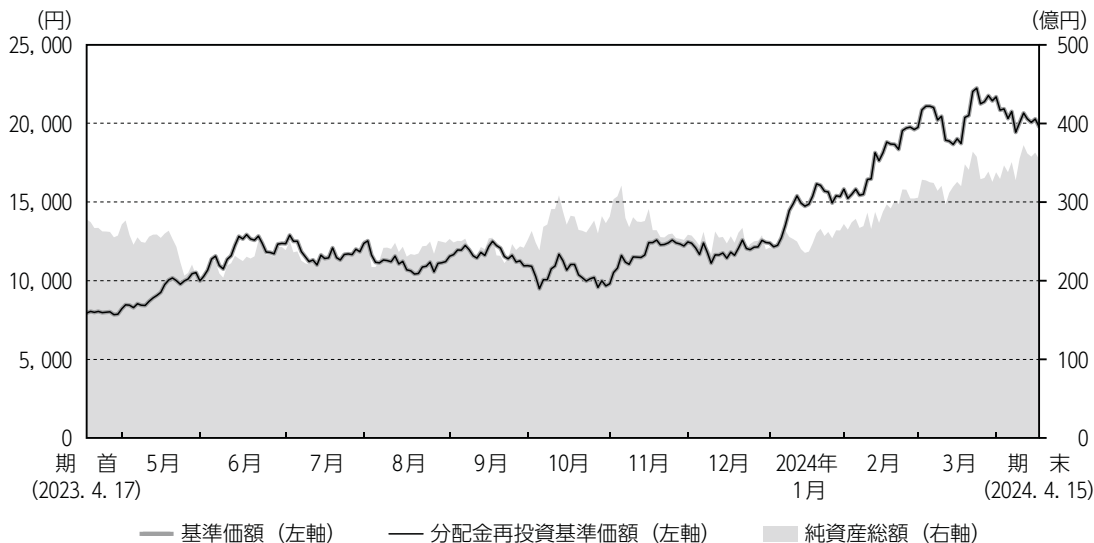
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

「日経平均トータルリターン・インデックス」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は「日経平均トータルリターン・インデックス」を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中絶に関して責任を負いません。また、当ファンドについて、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。



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：7,945円

期末：19,791円（分配金0円）

騰落率：149.1%（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わが国の株式市場の値動きの3倍程度となることをめざして運用を行った結果、わが国の株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ブルベア・ファンド6 ブル3倍日本株ポートフォリオ6

年 月 日	基 準 価 額		日経平均トータル リターン・インデックス (参考指数)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	公 社 債 組 入 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2023年4月17日	7,945	—	49,474.91	—	—	292.0	—
4月末	8,223	3.5	50,068.10	1.2	—	295.9	—
5月末	9,987	25.7	53,593.44	8.3	—	305.3	—
6月末	12,358	55.5	57,670.18	16.6	—	301.1	—
7月末	12,369	55.7	57,645.38	16.5	—	290.7	—
8月末	11,561	45.5	56,720.29	14.6	—	292.9	—
9月末	10,958	37.9	55,787.13	12.8	—	314.0	—
10月末	9,809	23.5	54,040.84	9.2	—	300.5	—
11月末	12,467	56.9	58,651.09	18.5	—	300.5	—
12月末	12,400	56.1	58,704.41	18.7	—	301.4	—
2024年1月末	15,823	99.2	63,659.32	28.7	—	301.8	—
2月末	19,750	148.6	68,747.00	39.0	—	304.8	—
3月末	21,693	173.0	71,346.41	44.2	—	305.8	25.5
(期末) 2024年4月15日	19,791	149.1	69,339.32	40.2	—	304.1	25.8

(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

(2023. 4. 18 ~ 2024. 4. 15)

国内株式市況

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、コロナ禍からの経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調し円安が進行したこと、米国著名投資家の強気見通しにより海外投資家の資金が大量に流入したことなどから、大幅に上昇しました。2023年7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4 - 6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、再び上昇しました。9月下旬以降は、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念されて反落しました。11月には、欧米におけるインフレ率の鈍化や金利の低下、良好な企業決算や株主還元拡充の発表などが好感されて上昇しましたが、12月に入ると、日米金利差縮小による為替の円高進行などから上昇は一服しました。2024年1月以降は、企業業績面での評価に加え、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や為替の円安進行、中国市場からの資金シフト観測なども含め、海外投資家が日本株投資を積極化したことなどが好感され、急上昇して当作成期末を迎えました。

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、「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、わが国の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3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わが国の株式市場の値動きの3倍程度となることをめざして運用を行います。

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

(2023. 4. 18 ~ 2024. 4. 15)

当ファンド

わが国の株価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の3倍程度となるよう調整しました。また、「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。

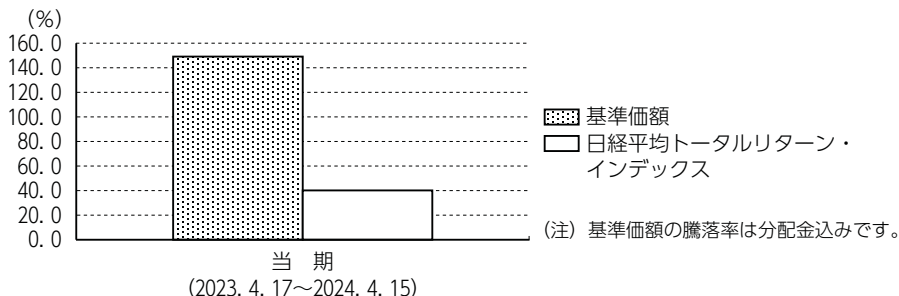
ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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少額だったため、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（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2023年4月18日 ～2024年4月15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)	9,790

- (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。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



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、「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、わが国の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3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わが国の株式市場の値動きの3倍程度となることをめざして運用を行います。

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 (2023. 4. 18~2024. 4. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	133円	1. 017%	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13, 099円です。
(投 信 会 社)	(43)	(0. 328)	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)	(86)	(0. 656)	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)	(4)	(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	7	0. 052	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)	(7)	(0. 052)	
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	1	0. 005	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)	(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	141	1. 074	

(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。

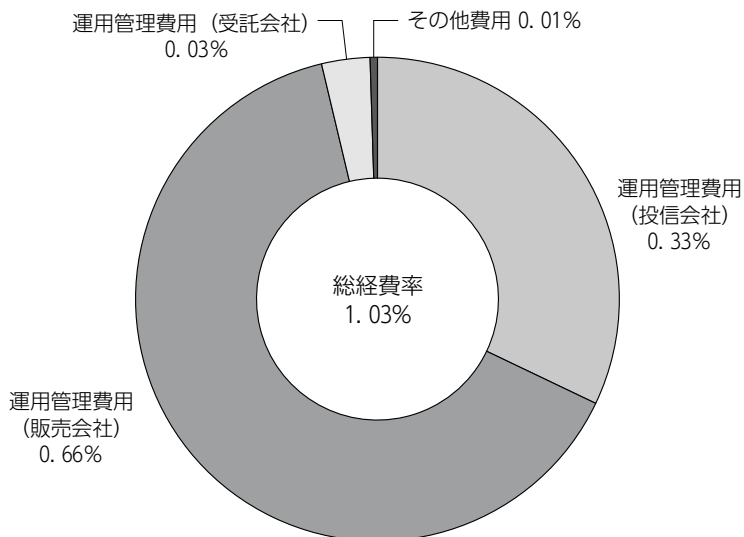
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.03%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

(2023年4月18日から2024年4月15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tock・マザーファンド	8,799,605	8,800,000	6,598,920	6,600,000

(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状況・残高状況

(2023年4月18日から2024年4月15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
国 内 株 式	日 経 平 均	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	
		449,043	448,499	—	—	107,804	—	△ 1,311	

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年4月18日から2024年4月15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	%
株式先物取引	449,043	337,260	75.1	448,499	293,625	65.5
コール・ローン	2,597,715	—	—	—	—	—

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 当作成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

(2023年4月18日から2024年4月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	14,399千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10,009千円
(B)/(A)	69.5%

(注) 売買委託手数料総額は、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まず。

※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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

■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
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	13,386,952	15,587,636	15,587,636

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年4月15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	15,587,636	42.0
コール・ローン等、その他	21,507,731	58.0
投資信託財産総額	37,095,368	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

2024年4月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	37,016,354,389円
コール・ローン等	15,469,389,422
ダイワ・マネースtock・マザーファンド (評価額)	15,587,636,953
差入委託証拠金	5,959,328,014
(B) 負債	1,570,527,408
未払金	1,316,003,000
未払解約金	110,070,870
未払信託報酬	143,681,154
その他未払費用	772,384
(C) 純資産総額 (A - B)	35,445,826,981
元本	17,910,127,279
次期繰越損益金	17,535,699,702
(D) 受益権総口数	17,910,127,279口
1万口当り基準価額 (C / D)	19,791円

* 期首における元本額は34,984,269,942円、当作成期間中における追加設定元本額は62,705,156,806円、同解約元本額は79,779,299,469円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,791円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月18日 至2024年4月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	302,053円
受取利息	3,423,770
支払利息	△ 3,121,717
(B) 有価証券売買損益	△ 2,075,185
売買益	1,242,942
売買損	△ 3,318,127
(C) 先物取引等損益	7,705,910,571
取引益	16,662,301,091
取引損	△ 8,956,390,520
(D) 信託報酬等	△ 269,231,266
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	7,434,906,173
(F) 前期繰越損益金	77,551,050
(G) 追加信託差損益金	10,023,242,479
(配当等相当額)	(1,663,147,287)
(売買損益相当額)	(8,360,095,192)
(H) 合計 (E + F + G)	17,535,699,702
次期繰越損益金 (H)	17,535,699,702
追加信託差損益金	10,023,242,479
(配当等相当額)	(1,663,147,287)
(売買損益相当額)	(8,360,095,192)
分配準備積立金	7,512,457,223

(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	302,053円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	7,434,578,298
(c) 収益調整金	10,023,242,479
(d) 分配準備積立金	77,576,872
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	17,535,699,702
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	17,535,699,702
(h) 受益権総口数	17,910,127,279口

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間終了日を2024年4月15日から2026年4月15日に変更しました。

ベア2倍日本株ポートフォリオ6

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均トータルリターン・インデックス		株式先物比率	公社債組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率			
1 期末 (2022年4月15日)	円 10,140	円 0	% 1.4	45,940.25	△ 6.8	% △ 199.0	% —	百万円 3,373
2 期末 (2023年4月17日)	7,877	0	△ 22.3	49,474.91	7.7	△ 204.0	—	5,524
3 期末 (2024年4月15日)	3,648	0	△ 53.7	69,339.32	40.2	△ 199.5	28.9	4,503

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 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。

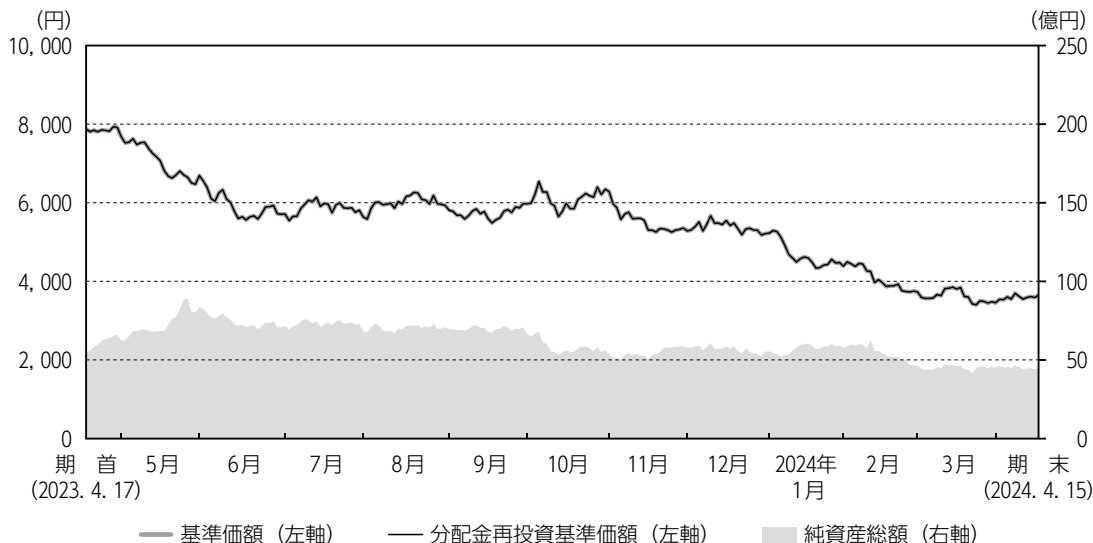
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

「日経平均トータルリターン・インデックス」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は「日経平均トータルリターン・インデックス」を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、当ファンドについて、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。



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：7,877円

期末：3,648円（分配金0円）

騰落率：△53.7%（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わが国の株式市場の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行った結果、わが国の株式市場が上昇したことから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ブルベア・ファンド6 ベア2倍日本株ポートフォリオ6

年 月 日	基 準 価 額		日経平均トータル リターン・インデックス (参考指数)		株 式 先 物 率 比	公 社 債 率 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %		
(期首) 2023年4月17日	7,877	—	49,474.91	—	△ 204.0	—
4月末	7,682	△ 2.5	50,068.10	1.2	△ 204.5	—
5月末	6,693	△ 15.0	53,593.44	8.3	△ 202.0	—
6月末	5,714	△ 27.5	57,670.18	16.6	△ 200.1	—
7月末	5,639	△ 28.4	57,645.38	16.5	△ 201.0	—
8月末	5,814	△ 26.2	56,720.29	14.6	△ 201.5	—
9月末	5,977	△ 24.1	55,787.13	12.8	△ 195.8	—
10月末	6,285	△ 20.2	54,040.84	9.2	△ 199.9	—
11月末	5,286	△ 32.9	58,651.09	18.5	△ 200.1	—
12月末	5,228	△ 33.6	58,704.41	18.7	△ 195.2	—
2024年1月末	4,389	△ 44.3	63,659.32	28.7	△ 199.6	—
2月末	3,736	△ 52.6	68,747.00	39.0	△ 198.5	—
3月末	3,456	△ 56.1	71,346.41	44.2	△ 198.0	27.1
(期末) 2024年4月15日	3,648	△ 53.7	69,339.32	40.2	△ 199.5	28.9

(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

(2023. 4. 18 ~ 2024. 4. 15)

国内株式市況

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、コロナ禍からの経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調し円安が進行したこと、米国著名投資家の強気見通しにより海外投資家の資金が大量に流入したことなどから、大幅に上昇しました。2023年7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4-6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、再び上昇しました。9月下旬以降は、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念されて反落しました。11月には、欧米におけるインフレ率の鈍化や金利の低下、良好な企業決算や株主還元拡充の発表などが好感されて上昇しましたが、12月に入ると、日米金利差縮小による為替の円高進行などから上昇は一服しました。2024年1月以降は、企業業績面での評価に加え、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や為替の円安進行、中国市場からの資金シフト観測なども含め、海外投資家が日本株投資を積極化したことなどが好感され、急上昇して当作成期末を迎えました。

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、「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、わが国の株価指数先物取引の売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わが国の株式市場の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行います。

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

(2023. 4. 18 ~ 2024. 4. 15)

当ファンド

わが国の株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額の2倍程度となるよう調整しました。また、「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。

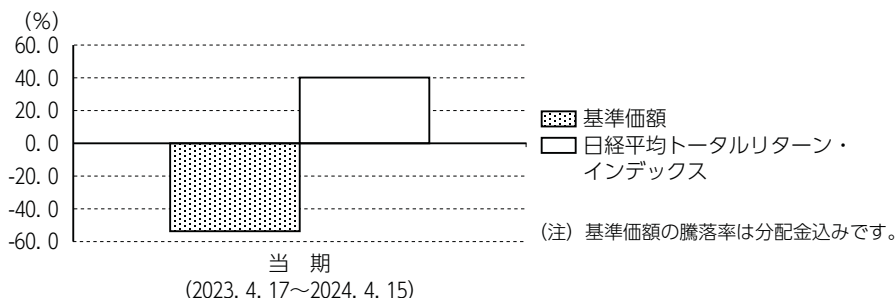
ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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、分配対象額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。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当期	
	2023年4月18日 ～2024年4月15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）	—

- (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。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



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、「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、わが国の株価指数先物取引の売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わが国の株式市場の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行います。

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 (2023. 4. 18~2024. 4. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	56円	1. 017%	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5, 466円です。
(投 信 会 社)	(18)	(0. 328)	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)	(36)	(0. 656)	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)	(2)	(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	2	0. 046	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)	(2)	(0. 046)	
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. 005	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. 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	58	1. 068	

(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。

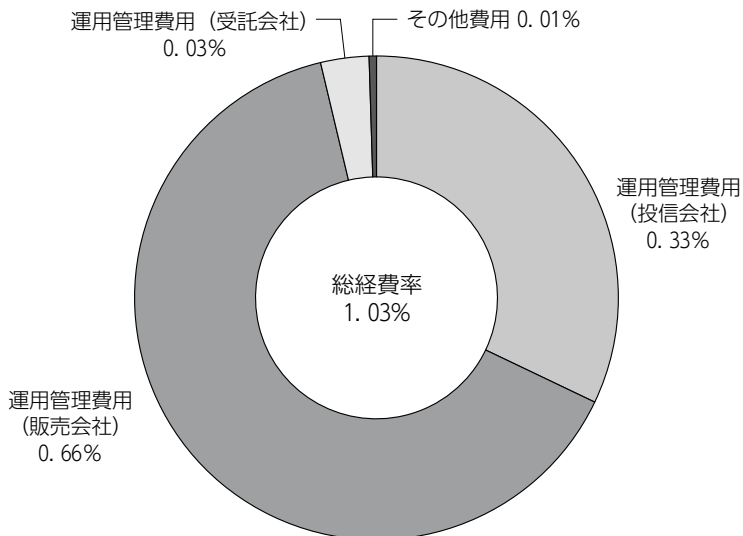
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.03%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

(2023年4月18日から2024年4月15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tock・マザーファンド	3,399,280	3,400,000	4,099,730	4,100,000

(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状況・残高状況

(2023年4月18日から2024年4月15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
国 内	株 式	日経平均	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
			—	—	83,396	90,159	—	8,983	100

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年4月18日から2024年4月15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	%
株式先物取引	90,159	82,559	91.6	83,396	76,865	92.2
コール・ローン	535,420	—	—	—	—	—

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 当作成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

(2023年4月18日から2024年4月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	2,852千円
うち利害関係人への支払額(B)	2,625千円
(B) / (A)	92.1%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

※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、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	期 首	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	2,918,051	2,217,601	2,217,601

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年4月15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	2,217,601	48.1
コール・ローン等、その他	2,389,851	51.9
投資信託財産総額	4,607,453	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

2024年4月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,562,804,186円
コール・ローン等	1,845,680,687
ダイワ・マネースtock・マザーファンド (評価額)	2,217,601,716
未収入金	100,174,050
差入委託証拠金	399,347,733
(B) 負債	59,127,312
未払解約金	32,031,448
未払信託報酬	26,951,059
その他未払費用	144,805
(C) 純資産総額 (A - B)	4,503,676,874
元本	12,344,932,797
次期繰越損益金	△ 7,841,255,923
(D) 受益権総口数	12,344,932,797口
1万口当り基準価額 (C / D)	3,648円

* 期首における元本額は7,013,706,419円、当作成期間中における追加設定元本額は33,944,459,591円、同解約元本額は28,613,233,213円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は3,648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7,841,255,923円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月18日 至2024年4月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	53,917円
受取利息	701,010
支払利息	△ 754,927
(B) 有価証券売買損益	428,755
売買益	620,031
売買損	△ 1,048,786
(C) 先物取引等損益	1,550,074,749
取引益	1,175,842,635
取引損	△ 2,725,917,384
(D) 信託報酬等	63,227,753
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	1,613,785,174
(F) 前期繰越損益金	39,107,108
(G) 追加信託差損益金	6,188,363,641
(配当等相当額)	(△) 3,343,700
(売買損益相当額)	(△) 6,185,019,941
(H) 合計 (E + F + G)	7,841,255,923
次期繰越損益金 (H)	7,841,255,923
追加信託差損益金	(△) 6,188,363,641
(配当等相当額)	(△) 3,343,700
(売買損益相当額)	(△) 6,185,019,941
繰越損益金	△ 1,652,892,282

(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	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	0
(h) 受益権総口数	12,344,932,797口

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間終了日を2024年4月15日から2026年4月15日に変更しました。

ブルベア・マネー・ポートフォリオ6

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 総額
	(分配落)	税 分 配 金	込 金	期 騰 落 中 率		
1 期末 (2022年 4月15日)	円 9,997	円 0	△	0.0	% —	百万円 17,087
2 期末 (2023年 4月17日)	9,994	0	△	0.0	—	23,460
3 期末 (2024年 4月15日)	9,990	0	△	0.0	58.5	21,003

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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。

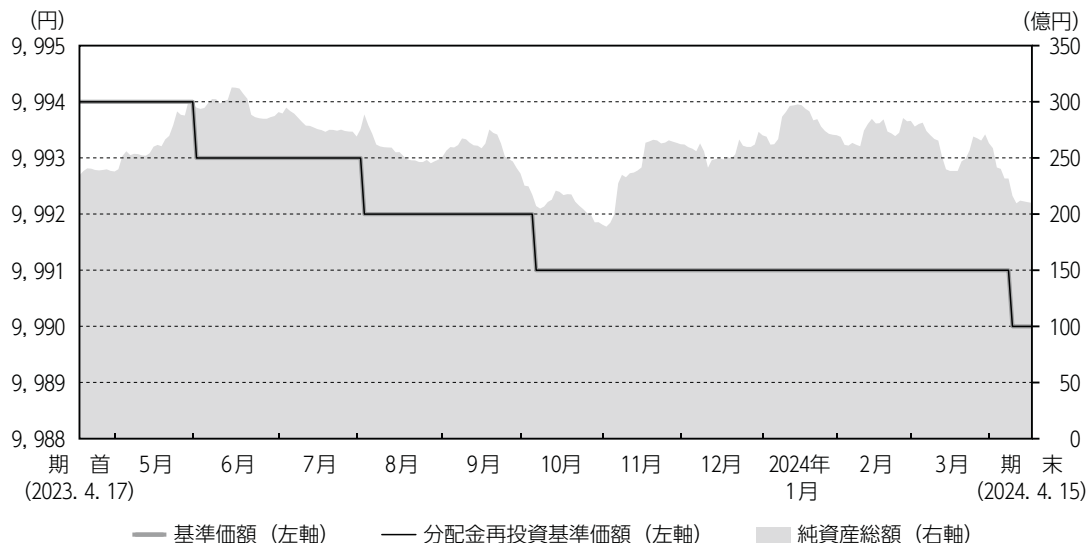
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注4) 当ファンドは「ダイワ・ブルベア・ファンド6」を構成するファンドのスイッチング資金を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記載しておりません。



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：9,994円

期末：9,990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おおむね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・ブルベア・ファンド6 ブルベア・マネー・ポートフォリオ6

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2023年 4月17日	円 9,994	% —	% —
4 月 末	9,994	0.0	—
5 月 末	9,994	0.0	—
6 月 末	9,993	△ 0.0	—
7 月 末	9,993	△ 0.0	—
8 月 末	9,992	△ 0.0	—
9 月 末	9,992	△ 0.0	—
10月 末	9,991	△ 0.0	—
11月 末	9,991	△ 0.0	—
12月 末	9,991	△ 0.0	—
2024年 1 月 末	9,991	△ 0.0	—
2 月 末	9,991	△ 0.0	—
3 月 末	9,991	△ 0.0	56.7
(期 末) 2024年 4月15日	9,990	△ 0.0	58.5

(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

(2023. 4. 18 ~ 2024. 4. 15)

国内短期金融市況

当作成期首より2024年2月まで、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おおむねマイナス圏で推移しました。3月に、日銀がマイナス金利政策を解除した影響により、当作成期末にかけて、国庫短期証券（3カ月物）の利回りは上昇しました。

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

(2023. 4. 18 ~ 2024. 4. 15)

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、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。

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	
	2023年4月18日 ～2024年4月15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）	5

（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。

（注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



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。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023. 4. 18~2024. 4. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	0円	0.001%	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9,992円です。
(投 信 会 社)	(0)	(0.000)	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)	(0)	(0.001)	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)	(0)	(0.000)	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	—	—	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	0.001	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)	(0.001)	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	0	0.002	

(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。

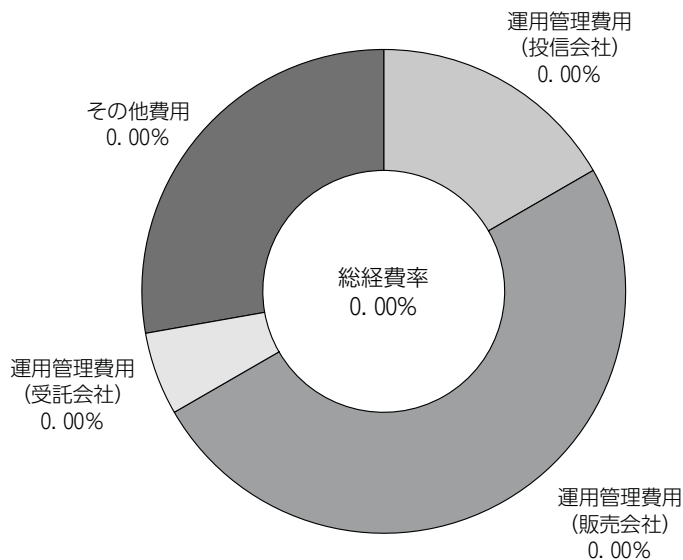
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.00%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

(2023年4月18日から2024年4月15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tock・マザーファンド	44,980,802	44,984,625	47,359,537	47,362,484

(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	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	23,336,198	20,957,463	20,957,463

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年4月15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	20,957,463	98.7
コール・ローン等、その他	276,427	1.3
投資信託財産総額	21,233,890	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

2024年4月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	21,233,890,603円
コール・ローン等	276,427,429
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	20,957,463,174
(B) 負債	230,288,198
未払解約金	229,844,734
未払信託報酬	374,299
その他未払費用	69,165
(C) 純資産総額(A-B)	21,003,602,405
元本	21,023,746,231
次期繰越損益金	△ 20,143,826
(D) 受益権総口数	21,023,746,231口
1万口当り基準価額(C/D)	9,990円

* 期首における元本額は23,475,210,685円、当作成期間中における追加設定元本額は89,558,408,990円、同解約元本額は92,009,873,444円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,990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20,143,826円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月18日 至2024年4月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	13,026円
受取利息	220,321
支払利息	△ 207,295
(B) 有価証券売買損益	△ 1,245,083
売買益	3,504,924
売買損	△ 4,750,007
(C) 信託報酬等	△ 530,371
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,762,428
(E) 前期繰越損益金	△ 54,082
(F) 追加信託差損益金	△ 18,327,316
(配当等相当額)	(6,638,436)
(売買損益相当額)	(△ 24,965,752)
(G) 合計(D+E+F)	△ 20,143,826
次期繰越損益金(G)	△ 20,143,826
追加信託差損益金	△ 18,327,316
(配当等相当額)	(6,638,436)
(売買損益相当額)	(△ 24,965,752)
分配準備積立金	4,529,519
繰越損益金	△ 6,346,029

(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ず。

(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	4,406,515
(c) 収益調整金	6,638,436
(d) 分配準備積立金	123,004
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	11,167,955
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	11,167,955
(h) 受益権総口数	21,023,746,231口

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間終了日を2024年4月15日から2026年4月15日に変更しました。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・ブルベア・ファンド6）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（2023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（2024年4月15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
公 社 債

(2023年4月18日から2024年4月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
1219国庫短期証券 2024/6/24	千円 129,997,160		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) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年4月15日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（221,637,513千口）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2024年4月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB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 130,000,000	千円 129,997,971	% 58.7	% —	% —	% —	% 58.7

(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。

(注3) 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)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2024年4月15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	1219国庫短期証券	% —	千円 130,000,000	千円 129,997,971	2024/06/24	

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第14期 (決算日 2023年12月11日)

(作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11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。

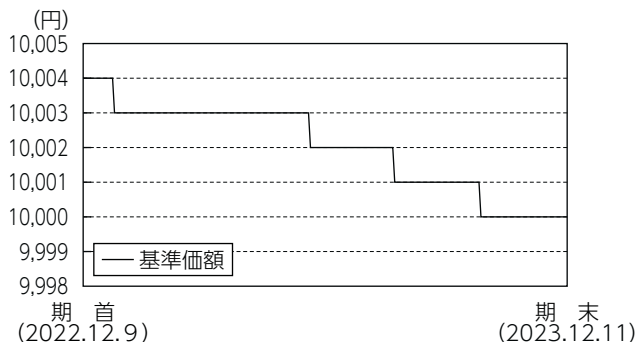
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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		
(期首)2022年12月9日	円	%	%
	10,004	-	-
12月末	10,004	0.0	-
2023年1月末	10,003	△0.0	-
2月末	10,003	△0.0	-
3月末	10,003	△0.0	-
4月末	10,003	△0.0	-
5月末	10,003	△0.0	-
6月末	10,002	△0.0	-
7月末	10,002	△0.0	-
8月末	10,001	△0.0	-
9月末	10,001	△0.0	-
10月末	10,000	△0.0	-
11月末	10,000	△0.0	-
(期末)2023年12月11日	10,000	△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：10,004円 期末：10,000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	-
合 計	-

(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

2023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	224,869,425	100.0
投資信託財産総額	224,869,425	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	224,869,425,628円
コール・ローン等	224,869,425,628
(B) 負債	1,500,000,000
未払解約金	1,500,000,000
(C) 純資産総額(A - B)	223,369,425,628
元本	223,366,515,143
次期繰越損益金	2,910,485
(D) 受益権総口数	223,366,515,143口
1万口当り基準価額(C/D)	10,000円

* 期首における元本額は159,095,941,234円、当作成期間中における追加設定元本額は314,669,316,126円、同解約元本額は250,398,742,217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：

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
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 - 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)	3,985円
- ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり)	
iFreeレバレッジ S&P500	8,578,400,572円
iFreeレバレッジ NASDAQ100	136,597,495,537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 - ロボテック (毎月決算/予想分配金提示型)	999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
iFreeETF 日経平均レバレッジ・インデックス	3,766,275,979円
iFreeETF 日経平均ダブルインバース・インデックス	7,383,524,817円
iFreeETF TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,207,970,593円
iFreeETF TOPIXダブルインバース (-2倍) 指数	926,253,680円
iFreeETF 日経平均インバース・インデックス	8,758,653,432円
iFreeETF TOPIXインバース (-1倍) 指数	11,471,375,420円
iFreeETF JPX日経400レバレッジ・インデックス	788,263,236円
iFreeETF JPX日経400インバース・インデックス	114,002,117円
iFreeETF JPX日経400ダブルインバース・インデックス	78,926,070円
iFreeETF S&P500レバレッジ	556,085,029円
iFreeETF S&P500インバース	2,883,612,458円
先進国トータルターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用)	207,414,601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 - S1トレード	4,992,083円
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	25,460,730,955円
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	11,487,636,953円
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	3,017,601,716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	44,637,919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/ミレニアセット亜細亜株式ファンド	4,148円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 米ドル・コース	10,833円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株Q (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	10,788円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース	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) - ロボテック (年1回)	100,588円
ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	5,813円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,000円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△69,335,817円
支払利息	△69,335,817
(B) 当期損益金(A)	△69,335,817
(C) 前期繰越損益金	62,057,963
(D) 解約差損益金	△51,876,027
(E) 追加信託差損益金	62,064,366
(F) 合計(B + C + D + E)	2,910,485
次期繰越損益金(F)	2,910,485

(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。