

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

商品分類	ブル3倍日本株 ポートフォリオV	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V	
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオV	追加型投信／国内／債券
信託期間	3年間（2018年6月29日～2021年6月28日）	
運用方針	ブル3倍日本株 ポートフォリオV	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V	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V	主としてわが国の債券への投 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	ブル3倍日本株 ポートフォリオV	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・マザーファンドの受 益証券
	ベア2倍日本株 ポートフォリオV	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・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V	イ、ダイワ・マネー・マザー ファンドの受益証券 ロ、本邦通貨表示の債券
組入制限	ブル3倍日本株 ポートフォリオV	マザーファンドおよび株式組入 上限比率は無制限
	ベア2倍日本株 ポートフォリオV	
	ブルベア・マネー・ ポートフォリオV	・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30%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。	

# ダイワ・ブルベア・ファンドV

ブル3倍日本株ポートフォリオV  
ベア2倍日本株ポートフォリオV  
ブルベア・マネー・ポートフォリオV

## 運用報告書(全体版)

### 満期償還

(償還日 2021年6月28日)

(作成対象期間 2020年6月30日～2021年6月28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。

さて、「ダイワ・ブルベア・ファンドV」は、  
このたび、満期償還となりました。

ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお  
知らせいたします。

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/>

<4646>  
<4647>  
<4645>

ブル3倍日本株ポートフォリオV

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式先物比率	公社債組入比率	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	%	円	%	%	%	百万円
1 期末 (2019年 6 月28日)	8,225	0	△ 17.8	21,275.92	△ 4.5	298.9	—	67,216
2 期末 (2020年 6 月29日)	7,950	0	△ 3.3	21,995.04	3.4	301.8	—	40,450
償 還 (2021年 6 月28日)	17,463.58	—	119.7	29,048.02	32.1	—	—	721

(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) 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。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



#### ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：17,463円58銭（既払分配金0円）

騰落率：74.6％（分配金再投資ベース）

#### ■ 基準価額の変動要因

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ため、基準価額は上昇しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」および「信託期間中のポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワ・ブルベア・ファンドV ブル3倍日本株ポートフォリオV

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首)2020年6月29日	円	%	円	%	%	%
	7,950	—	21,995.04	—	301.8	—
6月末	8,186	3.0	22,288.14	1.3	296.8	—
7月末	7,571	△ 4.8	21,710.00	△ 1.3	312.7	—
8月末	9,062	14.0	23,139.76	5.2	299.0	—
9月末	9,235	16.2	23,185.12	5.4	303.4	—
10月末	8,833	11.1	22,977.13	4.5	307.4	—
11月末	13,504	69.9	26,433.62	20.2	282.0	—
12月末	15,086	89.8	27,444.17	24.8	301.8	—
2021年1月末	15,175	90.9	27,663.39	25.8	304.6	—
2月末	17,909	125.3	28,966.01	31.7	338.6	—
3月末	17,948	125.8	29,178.80	32.7	303.4	—
4月末	17,274	117.3	28,812.63	31.0	297.7	—
5月末	17,480	119.9	28,860.08	31.2	—	—
(償還)2021年6月28日	17,463.58	119.7	29,048.02	32.1	—	—

(注) 騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

(2018. 6. 29 ~ 2021. 6. 28)

## ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、設定時より、米中通商協議に関していったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、上昇しました。2018年10月以降は、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。2019年1月以降は、米国や欧州の中央銀行高官が金融緩和の可能性を示唆したことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念されて下落したことに続き、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策や新規感染者数がピークアウトしたことによる経済活動の再開が進展したことを受け、株価は上昇に転じました。11月以降は、米国大統領選挙を無難に通過して政治面での先行き不透明感が後退したことを好感し、上昇しました。2021年に入っても、1月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、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。4月からは、国内の新型コロナウイルスの感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気されて株価は下落したものの、5月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、株価は反発しました。

## ■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」が維持される中、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。

## 信託期間中の運用方針

### ■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・マザーファンド

わが国の公社債を中心に安定運用を行います。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2018.6.29 ~ 2021.6.28)

### ■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・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。

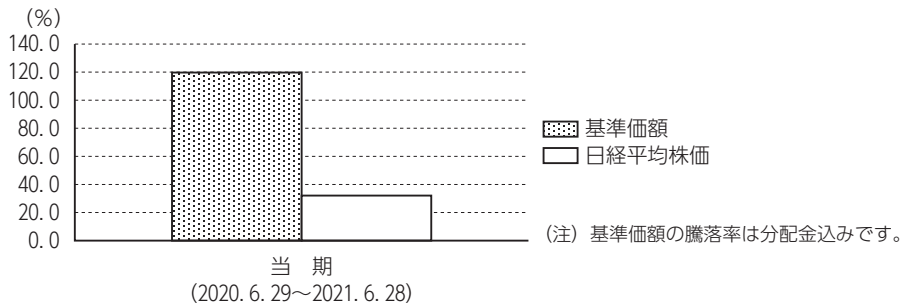
なお、満期償還に備えるため、2021年5月にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株価指数先物取引等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性及び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、当作成期における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

信託期間中の収益分配につきましては、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、見送らせていただきました。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜り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. 6. 30~2021. 6. 28)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	141円	1.020%	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13,848円です。
(投 信 会 社)	(46)	(0.329)	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)	(91)	(0.658)	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)	(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	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	0	0.003	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)	(0.003)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	149	1.075	

(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。

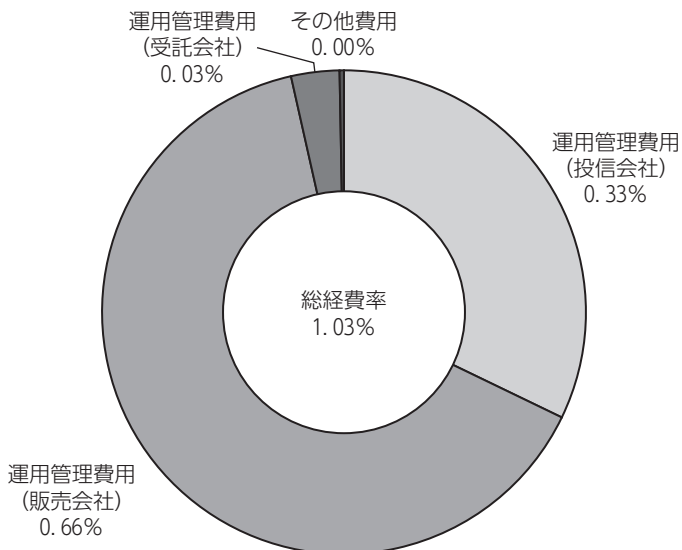
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



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

(2020年6月30日から2021年6月28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	19,567,442	19,900,000	38,952,913	39,614,129

(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

最終期末における残高はありません。

(2020年6月30日から2021年6月28日まで)

銘 柄 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式	百万円	百万円	百万円	百万円
	日経平均	383,816	532,595	—	—

(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

(2020年6月30日から2021年6月28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	383,816	209,330	54.5	532,595	290,165	54.5
コール・ローン	2,793,157	—	—	—	—	—

(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

(2020年6月30日から2021年6月28日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	19,471千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10,441千円
(B) / (A)	53.6%

(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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	口 数
	千口
ダイワ・マネー・マザーファンド	19,385,471

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年6月28日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	994,392	100.0
投資信託財産総額	994,392	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6月28日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	994,392,134円
コール・ローン等	994,392,134
(B) 負債	273,023,551
未払解約金	156,767,807
未払信託報酬	116,254,952
未払利息	792
(C) 純資産総額 (A - B)	721,368,583
元本	413,070,181
償還差損益金	308,298,402
(D) 受益権総口数	413,070,181口
1万口当り償還価額 (C / D)	17,463円58銭

\* 期首における元本額は50,881,113,838円、当作成期間中における追加設定元本額は46,857,062,029円、同解約元本額は97,325,105,686円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は17,463円58銭です。

■損益の状況

当期 自 2020年6月30日 至 2021年6月28日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 49,618円
受取利息	3,401,414
支払利息	△ 3,451,032
(B) 有価証券売買損益	△ 3,487,966
売買益	1,257,904
売買損	△ 4,745,870
(C) 先物取引等損益	401,180,083
取引益	8,994,106,206
取引損	△ 8,592,926,123
(D) 信託報酬等	△ 301,894,739
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	95,747,760
(F) 前期繰越損益金	3,022,011
(G) 追加信託差損益金	209,528,631
(配当等相当額)	( 18,985,323)
(売買損益相当額)	( 190,543,308)
(H) 合計 (E + F + G)	308,298,402
償還差損益金 (H)	308,298,402

(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。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2018年6月29日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年6月28日		資 産 総 額	994,392,134円
区 分	投 資 信 託 契 約 締 結 当 初	投 資 信 託 契 約 終 了 時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	273,023,551円
				純 資 産 総 額	721,368,583円
受 益 権 口 数	400,000,000口	413,070,181口	13,070,181口	受 益 権 口 数	413,070,181口
元 本 額	400,000,000円	413,070,181円	13,070,181円	1 単 位 当 り 償 還 金	17,463円58銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第 1 期	81,717,605,820	67,216,482,187	8,225	0	0.00
第 2 期	50,881,113,838	40,450,016,900	7,950	0	0.00

(注) 1単位は受益権1万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	17,463円58銭

ベア2倍日本株ポートフォリオV

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式 先物比率	公社債 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	%	円	%	%	%	百万円
1 期末 (2019年 6 月28日)	9,310	0	△ 6.9	21,275.92	△ 4.5	△ 200.2	—	5,150
2 期末 (2020年 6 月29日)	6,553	0	△ 29.6	21,995.04	3.4	△ 198.6	—	8,735
償 還 (2021年 6 月28日)	3,308.10	—	△ 49.5	29,048.02	32.1	—	—	230

(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。

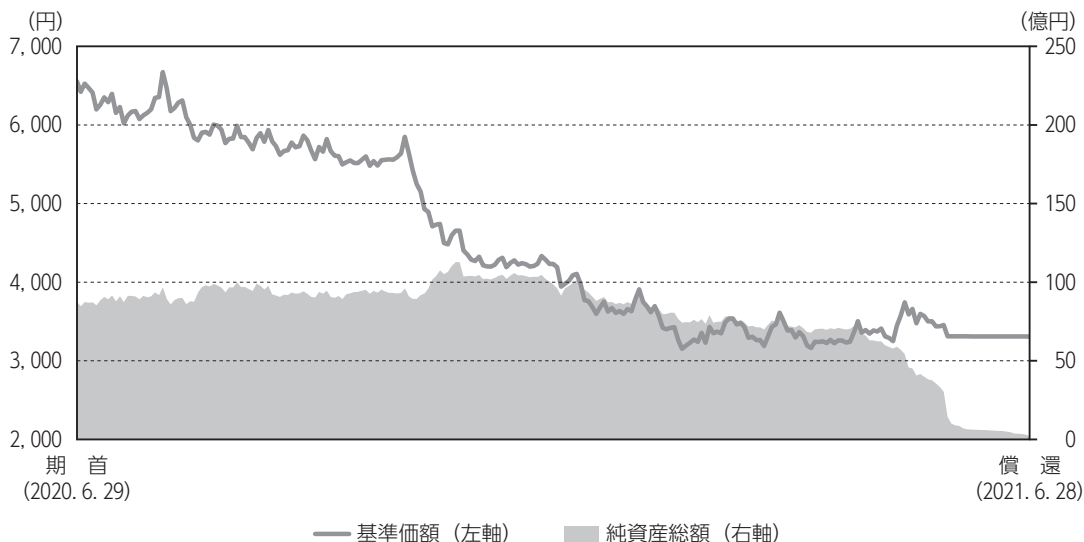
(注4) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



#### ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：3,308円10銭 (既払分配金0円)

騰落率：△66.9% (分配金再投資ベース)

#### ■ 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倍程度逆となるような運用を行いました。わが国の株式市場が上昇したため、基準価額は下落しました。くわしくは「設定以来の投資環境について」および「信託期間中のポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワ・ブルベア・ファンドV ベア2倍日本株ポートフォリオV

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
	円	%	円	%	%	%
(期首)2020年6月29日	6,553	—	21,995.04	—	△ 198.6	—
6月末	6,422	△ 2.0	22,288.14	1.3	△ 204.1	—
7月末	6,672	1.8	21,710.00	△ 1.3	△ 190.4	—
8月末	5,846	△ 10.8	23,139.76	5.2	△ 201.1	—
9月末	5,719	△ 12.7	23,185.12	5.4	△ 200.0	—
10月末	5,850	△ 10.7	22,977.13	4.5	△ 194.9	—
11月末	4,324	△ 34.0	26,433.62	20.2	△ 198.9	—
12月末	3,981	△ 39.2	27,444.17	24.8	△ 201.0	—
2021年1月末	3,909	△ 40.3	27,663.39	25.8	△ 199.0	—
2月末	3,430	△ 47.7	28,966.01	31.7	△ 192.9	—
3月末	3,364	△ 48.7	29,178.80	32.7	△ 195.9	—
4月末	3,411	△ 47.9	28,812.63	31.0	△ 197.3	—
5月末	3,311	△ 49.5	28,860.08	31.2	—	—
(償還)2021年6月28日	3,308.10	△ 49.5	29,048.02	32.1	—	—

(注) 騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

(2018. 6. 29 ~ 2021. 6. 28)

## ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、設定時より、米中通商協議に関していったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、上昇しました。2018年10月以降は、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。2019年1月以降は、米国や欧州の中央銀行高官が金融緩和の可能性を示唆したことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念されて下落したことに続き、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策や新規感染者数がピークアウトしたことによる経済活動の再開が進展したことを受け、株価は上昇に転じました。11月以降は、米国大統領選挙を無難に通過して政治面での先行き不透明感が後退したことを好感し、上昇しました。2021年に入っても、1月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、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。4月からは、国内の新型コロナウイルスの感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気されて株価は下落したものの、5月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、株価は反発しました。

## ■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」が維持される中、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。

## 信託期間中の運用方針

### ■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・マザーファンド

わが国の公社債を中心に安定運用を行います。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2018.6.29～2021.6.28)

### ■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、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・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。

なお、満期償還に備えるため、2021年5月にわが国の短期金融資産を中心とした安定運用に切替えました。そのため、それ以降は株価指数先物取引等の値動きによる変動がほとんどなくなりました。

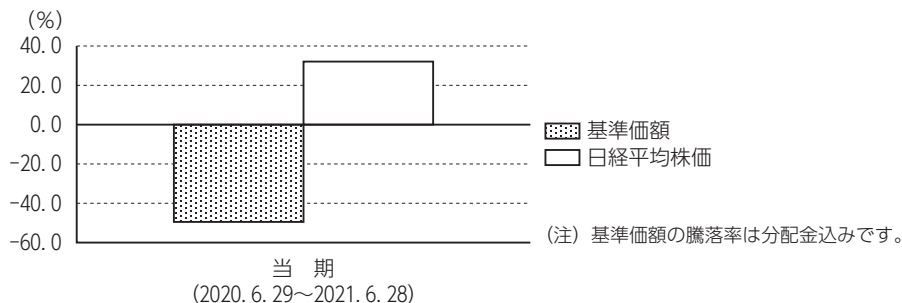
### ■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・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、当作成期における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

信託期間中の収益分配につきましては、分配対象額が計上できなかったため、見送らせていただきました。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしく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. 6. 30~2021. 6. 28)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	45円	1.020%	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4,458円です。
(投 信 会 社)	(15)	(0.329)	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)	(29)	(0.658)	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)	(1)	(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	0.051	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)	(0.051)	
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)	(0.003)	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	48	1.075	

(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。

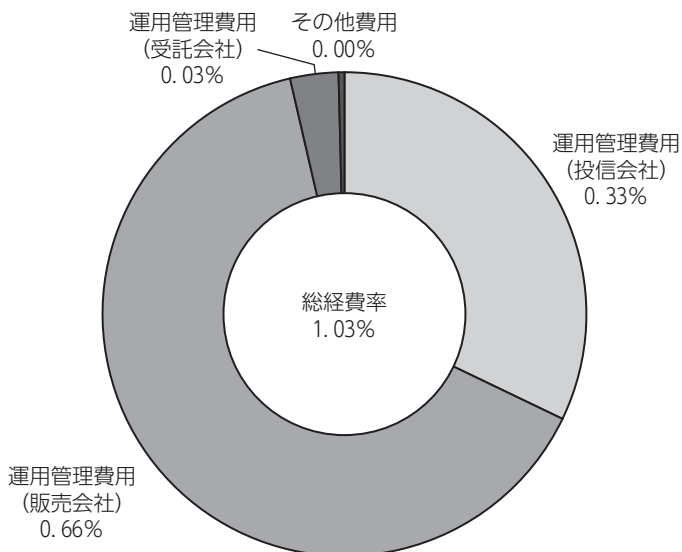
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2020年6月30日から2021年6月28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	1,278,240	1,300,000	5,944,161	6,044,888

(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

最終期末における残高はありません。

(2020年6月30日から2021年6月28日まで)

銘 柄 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式	百万円	百万円	百万円	百万円
	日経平均	—	—	85,276	108,481

(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

(2020年6月30日から2021年6月28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
株式先物取引	108,481	37,160	34.3	85,276	32,535	38.2
コール・ローン	699,822	—	—	—	—	—

(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

(2020年6月30日から2021年6月28日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4,082千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,378千円
(B) / (A)	33.8%

(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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首
	口 数
ダイワ・マネー・マザーファンド	4,665,921

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年6月28日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	383,771	100.0
投資信託財産総額	383,771	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6月28日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	383,771,288円
コール・ローン等	383,771,288
(B) 負債	153,059,716
未払解約金	121,609,726
未払信託報酬	31,449,685
未払利息	305
(C) 純資産総額 (A - B)	230,711,572
元本	697,414,582
償還差損益金	△ 466,703,010
(D) 受益権総口数	697,414,582口
1万口当り償還価額 (C / D)	3,308円10銭

\* 期首における元本額は13,331,200,638円、当作成期間中における追加設定元本額は42,892,468,803円、同解約元本額は55,526,254,859円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は3,308円10銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は466,703,010円です。

■損益の状況

当期 自 2020年6月30日 至 2021年6月28日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 20,789円
受取利息	837,375
支払利息	△ 858,164
(B) 有価証券売買損益	16,869
売買益	673,640
売買損	△ 656,771
(C) 先物取引等損益	△ 5,084,156
取引益	998,694,758
取引損	△ 1,003,778,914
(D) 信託報酬等	△ 80,854,955
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 85,943,031
(F) 前期繰越損益金	△ 9,396,659
(G) 追加信託差損益金	△ 371,363,320
(配当等相当額)	(△ 350,450)
(売買損益相当額)	(△ 371,012,870)
(H) 合計 (E + F + G)	△ 466,703,010
償還差損益金 (H)	△ 466,703,010

(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。

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2018年6月29日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年6月28日		資 産 総 額	383,771,288円
区 分	投 資 信 託 契 約 締 結 当 初	投 資 信 託 契 約 終 了 時	差 引 増 減 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	153,059,716円
受益権口数	600,000,000口	697,414,582口	97,414,582口	純 資 産 総 額	230,711,572円
元 本 額	600,000,000円	697,414,582円	97,414,582円	受 益 権 口 数	697,414,582口
				1 単 位 当 り 償 還 金	3,308円10銭

毎計算期末の状況

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 単 位 当 り 分 配 金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	円 5,532,345,581	円 5,150,491,505	円 9,310	円 0	% 0.00
第 2 期	13,331,200,638	8,735,986,584	6,553	0	0.00

(注) 1単位は受益権1万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	3,308円10銭

ブルベア・マネー・ポートフォリオV

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 配 分 金		期 騰 落 中 率		公 社 債 組 入 比 率	純資産総額
		円	円	△	○		
1 期末 (2019年 6 月28日)	9,992	0	△	0.1	—	百万円	
2 期末 (2020年 6 月29日)	9,988	0	△	0.0	—	21,115	
償 還 (2021年 6 月28日)	9,985.53	—	△	0.0	—	33,048	
							2,108

(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。

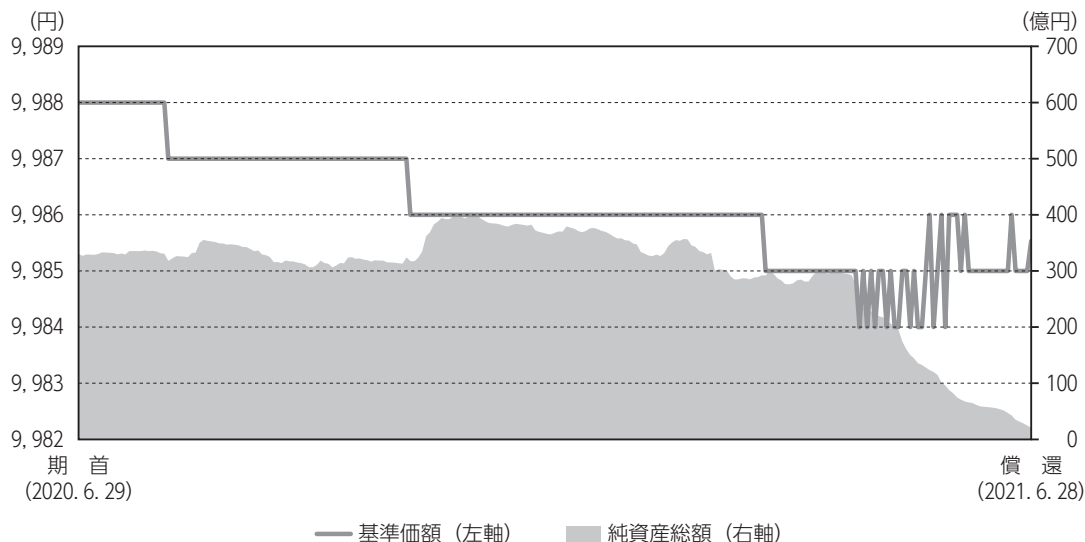
(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注 4) 当ファンドは「ダイワ・ブルベア・ファンドV」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、わが国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



#### ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

償還時：9,985円53銭（既払分配金0円）

騰落率：△0.1%（分配金再投資ベース）

#### ■ 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・ブルベア・ファンドⅤ ブルベア・マネー・ポートフォリオⅤ

年 月 日	基 準	価 額		公社債組入比率
		騰 落 率		
		円	%	%
(期首)2020年6月29日	9,988		—	—
6月末	9,988		0.0	—
7月末	9,988		0.0	—
8月末	9,987	△	0.0	—
9月末	9,987	△	0.0	—
10月末	9,987	△	0.0	—
11月末	9,986	△	0.0	—
12月末	9,986	△	0.0	—
2021年1月末	9,986	△	0.0	—
2月末	9,986	△	0.0	—
3月末	9,985	△	0.0	—
4月末	9,985	△	0.0	—
5月末	9,986	△	0.0	—
(償還)2021年6月28日	9,985.53	△	0.0	—

(注) 騰落率は期首比。



## 設定以来の投資環境について

(2018. 6. 29 ~ 2021. 6. 28)

### 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」が維持される中、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。

## 信託期間中の運用方針

### 当ファンド

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の受益証券およびわが国の債券を中心に投資することにより、安定運用を行います。

### ダイワ・マネー・マザーファンド

わが国の公社債を中心に安定運用を行います。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2018. 6. 29 ~ 2021. 6. 28)

### 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いました。

### ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性及び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

信託期間中の収益分配につきましては、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、見送らせていただきました。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしく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. 6. 30~2021. 6. 28)		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9,986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	0.001	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)	(0.000)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.001	

(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。

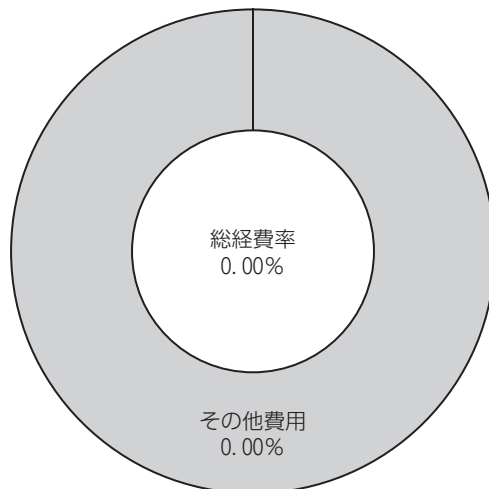
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2020年6月30日から2021年6月28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・マザーファンド	30,591,280	31,112,172	62,918,579	63,987,356

(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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	期 首	
	□	数
		千□
ダイワ・マネー・マザーファンド		32,327,298

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年6月28日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	2,848,409	100.0
投資信託財産総額	2,848,409	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6月28日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	2,848,409,705円
コール・ローン等	2,848,409,705
(B) 負債	739,637,609
未払解約金	739,621,807
未払信託報酬	13,532
未払利息	2,270
(C) 純資産総額 (A - B)	2,108,772,096
元本	2,111,828,198
償還差損益金	△ 3,056,102
(D) 受益権総口数	2,111,828,198□
1万口当り償還価額 (C / D)	9,985円53銭

\* 期首における元本額は33,089,350,160円、当作成期間中における追加設定元本額は75,868,822,532円、同解約元本額は106,846,344,494円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,985円53銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,056,102円です。

■損益の状況

当期 自 2020年6月30日 至 2021年6月28日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 73,878円
受取利息	278,007
支払利息	△ 351,885
(B) 有価証券売買損益	84,874
売買益	4,240,527
売買損	△ 4,155,653
(C) 信託報酬等	△ 132,422
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 121,426
(E) 前期繰越損益金	△ 25,065
(F) 追加信託差損益金	△ 2,909,611
(配当等相当額)	( 1,212,317)
(売買損益相当額)	(△ 4,121,928)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 3,056,102
償還差損益金 (G)	△ 3,056,102

(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。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2018年6月29日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年6月28日		資産総額	2,848,409,705円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減 又は追加信託	負債総額	739,637,609円
				純資産総額	2,108,772,096円
受益権口数	1,000,000口	2,111,828,198口	2,110,828,198口	受益権口数	2,111,828,198口
元本額	1,000,000円	2,111,828,198円	2,110,828,198円	1単位当り償還金	9,985円53銭

毎計算期末の状況

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第1期	21,133,181,981	21,115,449,212	9,992	0	0.00
第2期	33,089,350,160	33,048,568,120	9,988	0	0.00

(注) 1単位は受益権1万口。

償還金のお知らせ

1万口当り償還金	9,985円53銭
----------	-----------

# ダイワ・マネー・マザーファンド

## 運用報告書 第16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・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	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
株式組入制限	純資産総額の30%以下

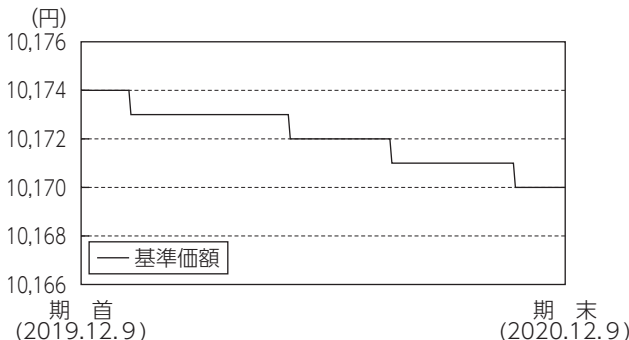
## 大和アセットマネジメント

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/>

# ダイワ・マネー・マザーファンド

## ■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	%	%
12月末	10,174	0.0	-
2020年1月1日	10,173	△0.0	-
2月末	10,173	△0.0	-
3月末	10,173	△0.0	-
4月末	10,173	△0.0	-
5月末	10,172	△0.0	-
6月末	10,172	△0.0	-
7月末	10,172	△0.0	-
8月末	10,171	△0.0	-
9月末	10,171	△0.0	-
10月末	10,171	△0.0	-
11月末	10,170	△0.0	-
(期末)2020年12月9日	10,170	△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、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：10,174円 期末：10,170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

#### ○国内短期金融市場

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩利を維持しました。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、現先取引およびコール・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

### その他有価証券

(2019年12月10日から2020年12月9日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国内短期社債等	242,997,393	242,997,453 (—)

(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

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

### 国内その他有価証券

銘柄	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内短期社債等	千円 999,970	% <1.5>

(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

2020年12月9日現在

項目	当期		比率
	評価額	期末	
	千円	%	
コール・ローン等、その他	68,466,438	100.0	
投資信託財産総額	68,466,438	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12月9日現在

項目	当期	期末
(A) 資産	68,466,438,583円	
コール・ローン等	67,466,468,172	
現先取引(その他有価証券)	999,970,411	
(B) 負債	1,000,488,000	
未払解約金	1,000,488,000	
(C) 純資産総額(A - B)	67,465,950,583	
元本	66,337,383,629	
次期繰越損益金	1,128,566,954	
(D) 受益権総口数	66,337,383,629口	
1万口当り基準価額(C/D)	10,170円	

\* 期首における元本額は82,259,129,638円、当作成期間中における追加設定元本額は106,172,802,530円、同解約元本額は122,094,548,539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、ダイワ日経225-シフト11- 2019-03 (適格機関投資家専用) 531,632,690円、ゴールド・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 4,718,749,101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) 9,608円、ダイワF E グローバル・バリュー (為替ヘッジなし) 9,608円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり) 49,107円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし) 49,107円、ダイワ/ \*R I C I \*<sup>®</sup> コモディティ・ファンド5,024,392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、スマート・アロケーション・Dガード99,008,902円、堅実バランスファンド - ハジメの一步- 569,302,583円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/隔月分配型) 180,729円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/隔月分配型) 737,649円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/資産成長型) 95,276円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型) 337,885円、世界セレクトティブ株式オープン983円、世界セレクトティブ株式オープン (年2回決算型) 983円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/毎月分配型) 983円、NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型) 983円、DCダイワ・マネー・ポートフォリオ4,455,466,034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 - ミドル・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 - パラダイムシフト- 1,988,495円、ブルベア・マネー・ポートフォリオV 37,213,381,442円、ブル3倍日本株ポートフォリオV 12,502,578,661円、ベア2倍日本株ポートフォリオV 5,944,161,915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) 3,666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) ミドル・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47,833,280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・ダブルバランス・ファンド (Dガード付/部分為替ヘッジあり) 224,685,913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) 5,385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) 11,530円、ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) ミドルコース9,817円、ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 日本円コース6,964円、ダイワ米国MLPファンド (毎月分配型) 通貨αコース9,479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979,761円、DCスマート・アロケーション・Dガード11,929,087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 (毎月分配型) 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982,029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10,170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	△ 26,744,855円
受取利息	309,257
支払利息	△ 27,054,112
(B) その他費用	△ 610,483
(C) 当期損益金(A + B)	△ 27,355,338
(D) 前期繰越損益金	1,431,737,066
(E) 解約差損益金	△ 2,104,683,137
(F) 追加信託差損益金	1,828,868,363
(G) 合計(C + D + E + F)	1,128,566,954
次期繰越損益金(G)	1,128,566,954

(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。