

# 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～2024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。	

◇SUZ0463020220415◇

## 運用報告書(全体版) 第1期

(決算日 2022年4月15日)

(作成対象期間 2021年4月16日～2022年4月15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1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			日経平均株価		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				
1期末 (2022年4月15日)	円 7,063	円 0	% △ 29.4	円 27,093.19	% △ 8.6	% —	% 299.5	% —	百万円 34,181

(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。

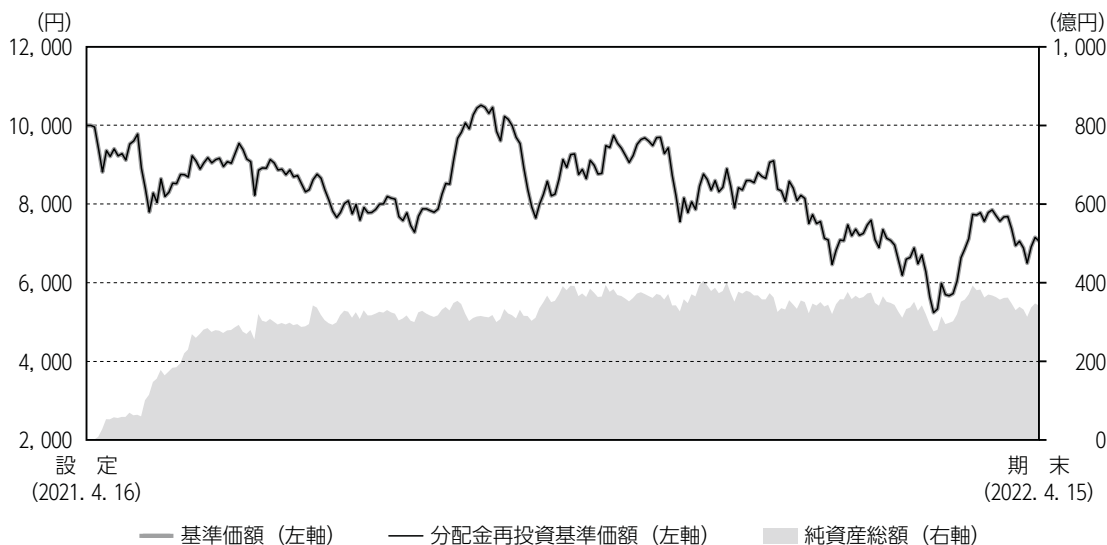
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

「日経平均株価」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株価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、「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」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



\* 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

設定時：10,000円

期末：7,063円（分配金0円）

騰落率：△29.4%（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下落したことから、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 ブル3倍日本株ポートフォリオ6

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	公 社 債 組 入 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数) 円	騰 落 率			
(期 首) 2021年 4月16日	10,000	—	29,642.69	—	—	—	—
4 月 末	9,121	△ 8.8	28,812.63	△ 2.8	—	339.0	—
5 月 末	9,090	△ 9.1	28,860.08	△ 2.6	—	317.0	—
6 月 末	8,887	△ 11.1	28,791.53	△ 2.9	—	300.9	—
7 月 末	7,591	△ 24.1	27,283.59	△ 8.0	—	307.8	—
8 月 末	8,252	△ 17.5	28,089.54	△ 5.2	—	296.4	—
9 月 末	9,542	△ 4.6	29,452.66	△ 0.6	—	306.0	—
10 月 末	8,782	△ 12.2	28,892.69	△ 2.5	—	300.6	—
11 月 末	7,558	△ 24.4	27,821.76	△ 6.1	—	306.1	—
12 月 末	8,656	△ 13.4	28,791.71	△ 2.9	—	300.5	—
2022年 1 月 末	7,086	△ 29.1	27,001.98	△ 8.9	—	300.2	—
2 月 末	6,644	△ 33.6	26,526.82	△ 10.5	—	301.5	—
3 月 末	7,709	△ 22.9	27,821.43	△ 6.1	—	299.6	—
(期 末) 2022年 4月15日	7,063	△ 29.4	27,093.19	△ 8.6	—	299.5	—

(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

(2021. 4. 16 ~ 2022. 4. 15)

### 国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大で行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下を受けて政局不透明感が増したことから、上値の重い展開となりました。2021年8月下旬からは国内の感染状況が改善したことを受けて株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明を好感して急騰しました。しかし10月に入ると、新政権への期待がやや後退したことや中国の大手不動産会社の信用不安などが懸念され、株価は反落しました。10月末には、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回る議席を維持したことが好感される局面もありましたが、年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感が広がったことなどから上値の重い展開となりました。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への懸念が高まり、金利が上昇して世界的に成長株が急落しました。2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻で資源価格が急騰したことなどもあり、全体的に株価下落が加速しました。3月中旬以降は、F R Bの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや、ロシアとウクライナによる停戦協議の進展期待もあり急反発しましたが、4月に入ると、再びF R Bによる急ピッチの金融引き締めへの懸念や、新変異株が確認されるなど新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念も強まったことで、国内株式市況は当作成期末にかけて下落しました。

## ポートフォリオについて

(2021. 4. 16 ~ 2022. 4. 15)

### 当ファンド

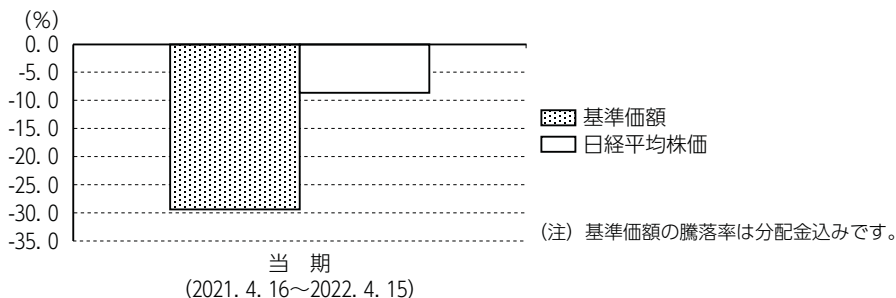
わが国の株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額の3倍程度となるよう調整しました。また、「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。

### ダイワ・マネーストック・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、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 (1万口当たり)

項 目	当 期	
	2021年 4月16日 ～2022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。



## 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 (2021. 4. 16~2022. 4. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	85円	1. 023%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当作成期中の平均基準価額は8, 324円です。</b>
(投 信 会 社)	(27)	(0. 330)	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)	(55)	(0. 660)	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)	(3)	(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	6	0. 073	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)	(6)	(0. 073)	
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
(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	92	1. 101	

(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。

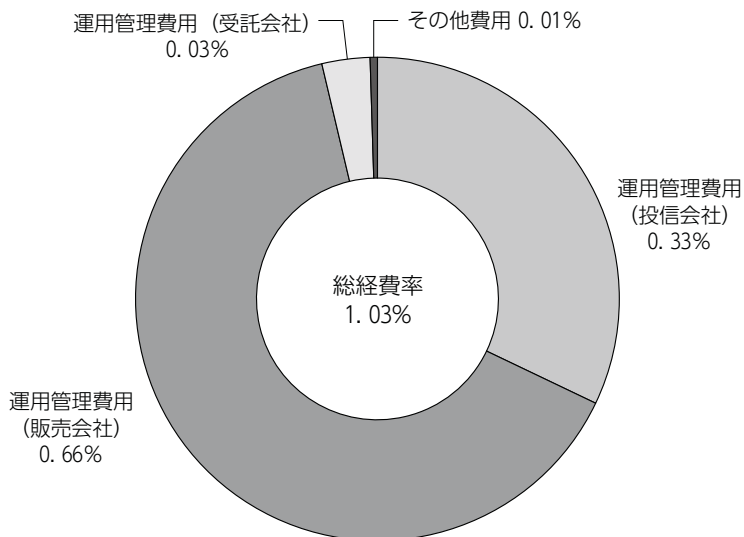
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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

(2021年4月16日から2022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	30,676,938	30,701,000	11,991,855	12,000,000

(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

(2021年4月16日から2022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
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
国内株式	日経平均	643,229	537,219	—	—	102,389	—	7,173
	ミニ日経平均	11	11	—	—	—	—	—

(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

(2021年4月16日から2022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
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式先物取引	643,241	364,138	56.6	537,231	329,985	61.4
コール・ローン	3,134,035	—	—	—	—	—

(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

(2021年4月16日から2022年4月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	23,229千円
うち利害関係人への支払額(B)	13,579千円
(B) / (A)	58.5%

(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  
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	18,685,082	18,696,293

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022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	18,696,293	43.8
コール・ローン等、その他	23,944,546	56.2
投資信託財産総額	42,640,840	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

2022年4月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>34,814,961,922円</b>
コール・ローン等	11,852,760,568
ダイワ・マネースtock・マザーファンド (評価額)	18,696,293,904
未収入金	7,246,559,550
差入委託証拠金	△ 2,980,652,100
<b>(B) 負債</b>	<b>633,794,802</b>
未払解約金	451,240,441
未払信託報酬	181,578,219
その他未払費用	976,142
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>34,181,167,120</b>
元本	48,394,228,314
次期繰越損益金	△ 14,213,061,194
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>48,394,228,314口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	7,063円

\* 期首における元本額は100,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は139,727,949,049円、同解約元本額は91,433,720,735円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,063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14,213,061,194円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月16日 至2022年4月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 1,509,126円</b>
受取利息	2,486,764
支払利息	△ 3,995,890
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 3,344,304</b>
売買益	1,242,669
売買損	△ 4,586,973
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>△ 3,743,559,829</b>
取引益	15,530,897,278
取引損	△ 19,274,457,107
<b>(D) 信託報酬等</b>	<b>△ 315,876,140</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	<b>△ 4,064,289,399</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 10,148,771,795</b>
(配当等相当額)	(△) 3,619,030
(売買損益相当額)	(△) 10,145,152,765
<b>(G) 合計 (E + F)</b>	<b>△ 14,213,061,194</b>
<b>次期繰越損益金 (G)</b>	<b>△ 14,213,061,194</b>
追加信託差損益金	△ 10,148,771,795
(配当等相当額)	(△) 3,619,030
(売買損益相当額)	(△) 10,145,152,765
繰越損益金	△ 4,064,289,399

(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いません。

(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。

■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	48,394,228,314口

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			日経平均株価		株式先物比率	公社債組入比率	純資産総額
	(分配落)	税金 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	円 27,093.19	% △ 8.6	% △ 199.0	% —	百万円 3,373

(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。

「日経平均株価」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株価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、「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」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



\* 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

設定時：10,000円

期末：10,140円（分配金0円）

騰落率：1.4%（分配金込み）

### 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下落したことから、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 ベア2倍日本株ポートフォリオ6

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価		株 式 先 物 率 比	公 社 債 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %	(参考指数) 円	騰 落 率 %		
(期首) 2021年4月16日	10,000	—	(4/15) 29,642.69	—	—	—
4月末	10,545	5.5	28,812.63	△ 2.8	△ 199.2	—
5月末	10,346	3.5	28,860.08	△ 2.6	△ 194.7	—
6月末	10,366	3.7	28,791.53	△ 2.9	△ 198.6	—
7月末	11,419	14.2	27,283.59	△ 8.0	△ 196.2	—
8月末	10,688	6.9	28,089.54	△ 5.2	△ 202.9	—
9月末	9,573	△ 4.3	29,452.66	△ 0.6	△ 196.0	—
10月末	9,909	△ 0.9	28,892.69	△ 2.5	△ 212.7	—
11月末	10,758	7.6	27,821.76	△ 6.1	△ 195.4	—
12月末	9,654	△ 3.5	28,791.71	△ 2.9	△ 202.1	—
2022年1月末	10,777	7.8	27,001.98	△ 8.9	△ 200.9	—
2月末	11,067	10.7	26,526.82	△ 10.5	△ 200.5	—
3月末	9,658	△ 3.4	27,821.43	△ 6.1	△ 201.3	—
(期末) 2022年4月15日	10,140	1.4	27,093.19	△ 8.6	△ 199.0	—

(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

(2021.4.16 ~ 2022.4.15)

### 国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大で行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下を受けて政局不透明感が増したことから、上値の重い展開となりました。2021年8月下旬からは国内の感染状況が改善したことを受けて株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明を好感して急騰しました。しかし10月に入ると、新政権への期待がやや後退したことや中国の大手不動産会社の信用不安などが懸念され、株価は反落しました。10月末には、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回る議席を維持したことが好感される局面もありましたが、年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感が広がったことなどから上値の重い展開となりました。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への懸念が高まり、金利が上昇して世界的に成長株が急落しました。2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻で資源価格が急騰したことなどもあり、全体的に株価下落が加速しました。3月中旬以降は、F R Bの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや、ロシアとウクライナによる停戦協議の進展期待もあり急反発しましたが、4月に入ると、再びF R Bによる急ピッチの金融引き締めへの懸念や、新変異株が確認されるなど新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念も強まったことで、国内株式市況は当作成期末にかけて下落しました。

## ポートフォリオについて

(2021.4.16 ~ 2022.4.15)

### 当ファンド

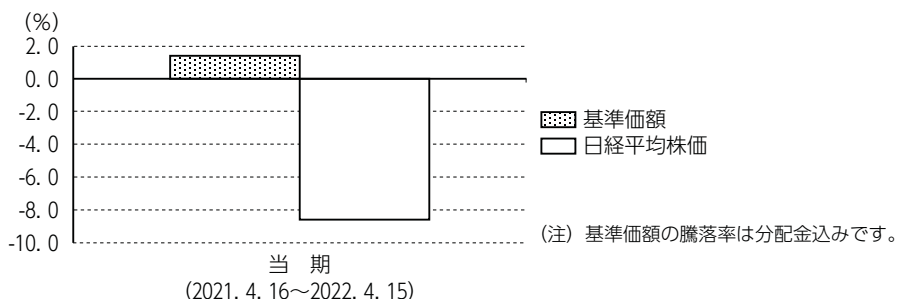
わが国の株価指数先物取引の売建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額の2倍程度となるよう調整しました。また、「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。

### 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、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4月16日 ～2022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)	141

(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、「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 (2021. 4. 16~2022. 4. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	106円	1.023%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当作成期中の平均基準価額は10,340円です。</b>
(投 信 会 社)	(34)	(0.330)	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)	(68)	(0.660)	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)	(3)	(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	6	0.063	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)	(6)	(0.063)	
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
(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	113	1.091	

(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。

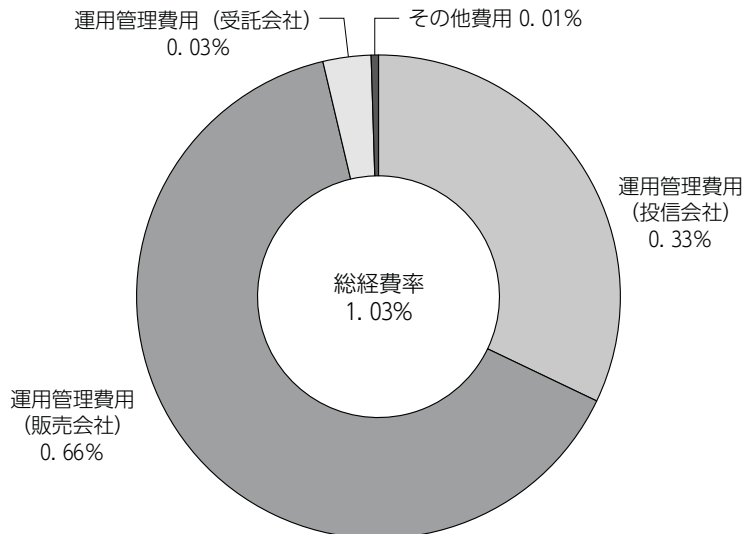
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2021年4月16日から2022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	4,196,641	4,200,000	2,158,347	2,160,000

(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

(2021年4月16日から2022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
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
国内株式	日経平均	—	—	53,400	46,573	—	6,715	△ 378
	ミニ日経平均	—	—	46	46	—	—	—

(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

(2021年4月16日から2022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
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式先物取引	46,619	36,469	78.2	53,447	39,410	73.7
コール・ローン	304,840	—	—	—	—	—

(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

(2021年4月16日から2022年4月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	1,970千円
うち利害関係人への支払額(B)	1,481千円
(B) / (A)	75.2%

(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  
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	2,038,294	2,039,517

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年4月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	2,039,517	51.1
コール・ローン等、その他	1,948,843	48.9
投資信託財産総額	3,988,360	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

2022年4月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>3,953,246,117円</b>
コール・ローン等	1,205,554,668
ダイワ・マネーストック・マザーファンド (評価額)	2,039,517,449
差入委託証拠金	708,174,000
<b>(B) 負債</b>	<b>579,290,031</b>
未払金	378,690,400
未払解約金	185,275,000
未払信託報酬	15,242,770
その他未払費用	81,861
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>3,373,956,086</b>
元本	3,327,232,833
次期繰越損益金	46,723,253
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,327,232,833口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	10,140円

\* 期首における元本額は150,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は17,595,698,210円、同解約元本額は14,418,465,377円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,140円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月16日 至2022年4月15日

項 目	当 期	
<b>(A) 配当等収益</b>	△	<b>49,479円</b>
受取利息		329,684
支払利息	△	379,163
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	△	<b>234,502</b>
売買益		205,788
売買損	△	440,290
<b>(C) 先物取引等損益</b>	△	<b>48,235,405</b>
取引益		1,357,233,649
取引損	△	1,405,469,054
<b>(D) 信託報酬等</b>	△	<b>31,137,762</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	△	<b>79,657,148</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>		<b>126,380,401</b>
(配当等相当額)	(△)	360,507
(売買損益相当額)	(	126,740,908)
<b>(G) 合計 (E + F)</b>		<b>46,723,253</b>
<b>次期繰越損益金 (G)</b>		<b>46,723,253</b>
追加信託差損益金		126,380,401
(配当等相当額)	(△)	360,507
(売買損益相当額)	(	126,740,908)
繰越損益金	△	79,657,148

(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ひ、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	47,133,239
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	47,133,239
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	47,133,239
(h) 受益権総口数	3,327,232,833口

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	期騰 落率		
1 期末 (2022年 4 月15日)	円 9,997	円 0	% △ 0.0	% —	百万円 17,087

(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。

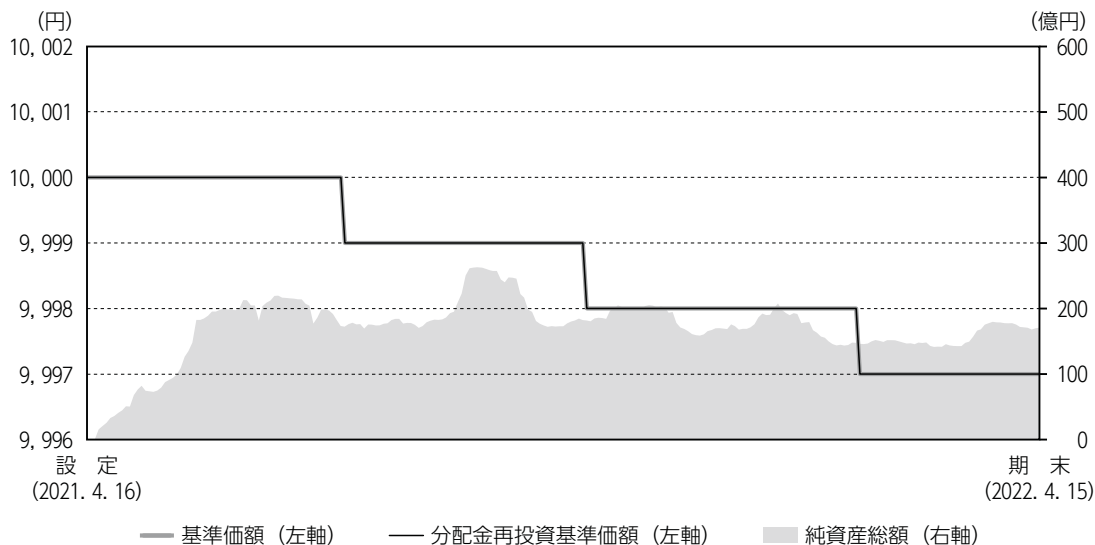
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



\* 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

設定時：10,000円

期末：9,997円（分配金0円）

騰落率：△0.0%（分配金込み）

#### 基準価額の変動要因

「ダイワ・マネーストック・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) 2021年 4月16日	円 10,000	% —	円 —
4 月 末	10,000	0.0	—
5 月 末	10,000	0.0	—
6 月 末	10,000	0.0	—
7 月 末	9,999	△ 0.0	—
8 月 末	9,999	△ 0.0	—
9 月 末	9,999	△ 0.0	—
10月 末	9,998	△ 0.0	—
11月 末	9,998	△ 0.0	—
12月 末	9,998	△ 0.0	—
2022年 1 月 末	9,998	△ 0.0	—
2 月 末	9,997	△ 0.0	—
3 月 末	9,997	△ 0.0	—
(期 末) 2022年 4月15日	9,997	△ 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

(2021. 4. 16 ~ 2022. 4. 15)

### 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。

## ポートフォリオについて

(2021. 4. 16 ~ 2022. 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、コール・ローン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（1万口当たり）

項 目	当期	
	2021年4月16日 ～2022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）	2

(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 (2021. 4. 16~2022. 4. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—	—	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9,999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)	(0.001)	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
（ 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	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。

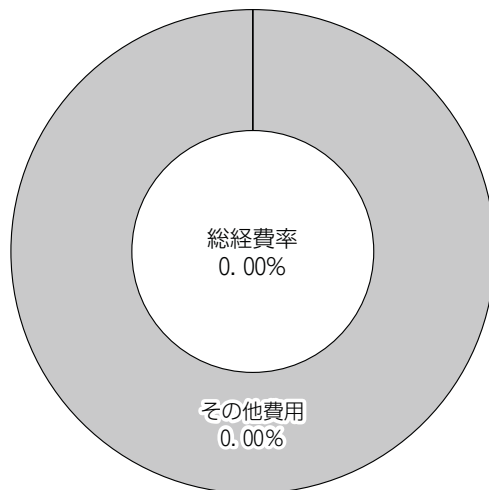
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2021年4月16日から2022年4月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千円		千円	
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	58,389,753	58,437,091	41,397,995	41,430,131

(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	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千円	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	16,991,758	17,001,953

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022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	17,001,953	98.2
コール・ローン等、その他	303,403	1.8
投資信託財産総額	17,305,356	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

2022年4月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	17,305,356,539円
コール・ローン等	303,403,295
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	17,001,953,244
(B) 負債	217,966,780
未払解約金	217,910,631
未払信託報酬	9,295
その他未払費用	46,854
(C) 純資産総額(A-B)	17,087,389,759
元本	17,092,793,348
次期繰越損益金	△ 5,403,589
(D) 受益権総口数	17,092,793,348口
1万口当り基準価額(C/D)	9,997円

\*期首における元本額は1,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は91,908,233,518円、同解約元本額は74,816,440,170円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は9,997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5,403,589円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月16日 至2022年4月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 28,018円
受取利息	136,361
支払利息	△ 164,379
(B) 有価証券売買損益	△ 1,406,292
売買益	1,992,514
売買損	△ 3,398,806
(C) 信託報酬等	△ 111,100
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,545,410
(E) 追加信託差損益金	△ 3,858,179
(配当等相当額)	(△) 512,501
(売買損益相当額)	(△) 3,345,678
(F) 合計(D+E)	△ 5,403,589
次期繰越損益金(F)	△ 5,403,589
追加信託差損益金	△ 3,858,179
(配当等相当額)	(△) 512,501
(売買損益相当額)	(△) 3,345,678
分配準備積立金	3,714,509
繰越損益金	△ 5,259,919

(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	3,714,509
(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)	3,714,509
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	3,714,509
(h) 受益権総口数	17,092,793,348口

<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（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

2021年4月16日～2022年4月15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4月15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

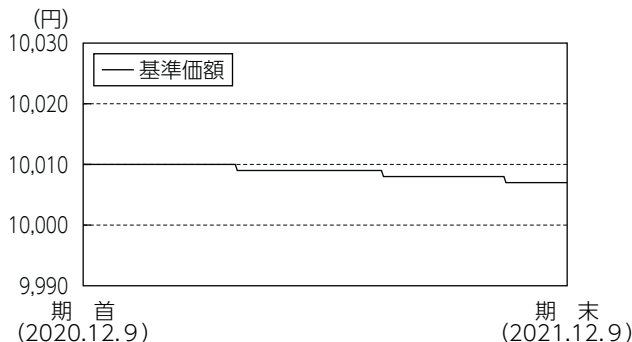
## 大和アセットマネジメント

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1日	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：10,010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・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
コール・ローン等、その他	千円 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。

# 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

2021年12月9日現在

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

\* 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 - ロボット	947,268円
ダイワ/ミレーアセット・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 - ロボット	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
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回)	3,985円
i Freeレバレッジ S&P500	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 - ロボット (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/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 - TOP1Xレバレッジ (2倍) 指数	1,334,794,630円
ダイワ上場投信 - TOP1X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 - TOP1Xインバース (-1倍) 指数	3,084,973,807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	574,295,634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	861,497,868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	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 (リスクリミット/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)	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 - S/Lトレード	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 豪ドル・コース (毎月分配型)	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 ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	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 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	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) 米ドル・コース	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) ブラジル・リアル・コース	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) 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) - ロボット (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 - 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・リアル・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)	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・リアル・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

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

(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。