

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	追加型投信/海外/株式
	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	追加型投信/国内/債券
信託期間	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	2011年4月19日～2026年4 月17日
	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	2011年5月16日～2026年4 月17日
運用方針	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	信託財産の成長をめざして運用 を行ないます。
	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	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	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	世界（※）の金融商品取引所上 場株式および店頭登録株式（上 場予定および店頭登録予定を含 みます。また、DR（預託証 券）を含みます。）（※）日本 を除きます。
	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	イ、ダイワ・マネーストック・ マザーファンド（以下「マ ザーファンド」といいま す。）の受益証券 ロ、円建ての債券
組入制限	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	・株式組入上限比率は無制限
	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	・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10%以下
分配方針	ダイワ/ハリス世界 厳選株ファンド	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 、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、 分配対象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/ハリス世界 厳選株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	分配対象額は、経費控除後の配 当等収益とし、原則として、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、分 配対象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/ハリス世界厳選株ファンド 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

## 運用報告書（全体版） 第11期

（決算日 2022年4月18日）

（作成対象期間 2021年4月20日～2022年4月18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。

当ファンドは、（世界厳選株）世界の株式  
に投資し、信託財産の成長をめざすこと、  
（世界厳選株マネー）円建ての債券に投資  
し、安定した収益の確保をめざすことを目的  
としております。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/>

<4797>  
<4799>

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数(円換算)		株式組入比率	株式先物比率	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			
7期末(2018年4月18日)	円 16,929	円 450	% 16.2	20,961	% 12.2	% 96.5	% -	百万円 9,060
8期末(2019年4月18日)	17,138	0	1.2	22,596	7.8	94.7	-	7,805
9期末(2020年4月20日)	12,282	0	△28.3	20,317	△10.1	96.4	-	5,016
10期末(2021年4月19日)	20,047	2,200	81.1	30,152	48.4	96.0	-	6,828
11期末(2022年4月18日)	21,066	650	8.3	35,656	18.3	95.6	-	6,772

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIコクサイ指数(円換算)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、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。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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。

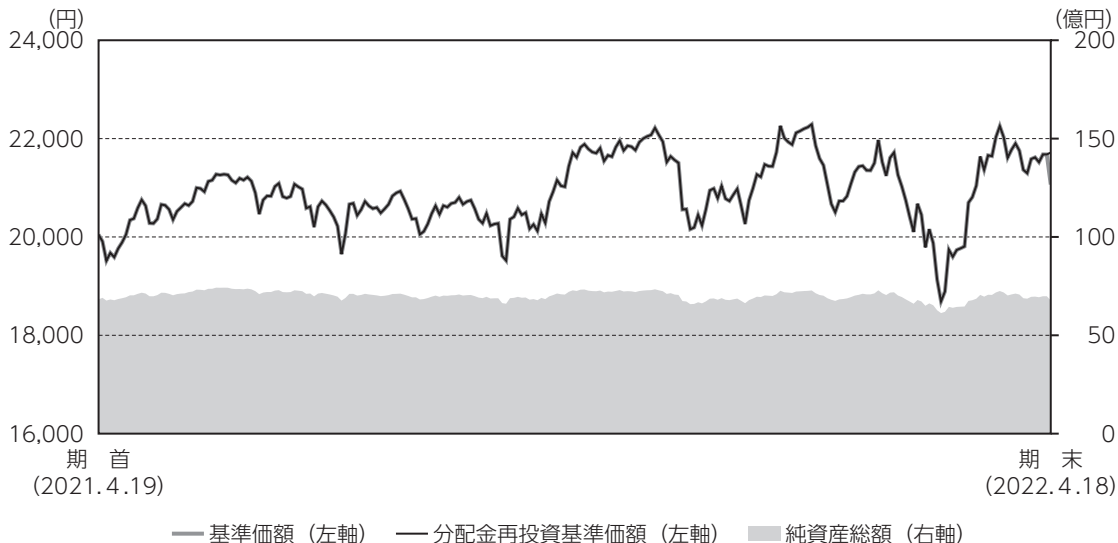
(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



## 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はありません。
- \* 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：20,047円  
 期末：21,066円（分配金650円）  
 騰落率：8.3%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

保有株式が下落したことはマイナス要因となりましたが、米ドルおよびユーロが対円で上昇（円安）したことなどがプラス要因となり、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／ハリス世界厳選株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円 換 算) (参考指数)		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2021年 4月19日	円 20,047	% -	30,152	% -	% 96.0	% -	% -
4 月末	20,343	1.5	30,398	0.8	93.9	-	-
5 月末	20,986	4.7	30,781	2.1	94.4	-	0.2
6 月末	20,791	3.7	31,523	4.5	95.5	-	0.2
7 月末	20,723	3.4	31,948	6.0	96.7	-	0.2
8 月末	20,606	2.8	32,681	8.4	97.3	-	0.2
9 月末	20,493	2.2	31,881	5.7	98.0	-	0.2
10月末	21,661	8.1	34,186	13.4	97.3	-	0.2
11月末	20,566	2.6	33,989	12.7	97.3	-	-
12月末	21,435	6.9	35,358	17.3	97.3	-	-
2022年 1 月末	20,828	3.9	32,858	9.0	96.1	-	-
2 月末	20,675	3.1	32,613	8.2	96.3	-	-
3 月末	22,026	9.9	35,991	19.4	96.6	-	-
(期末) 2022年 4月18日	21,716	8.3	35,656	18.3	95.6	-	-

(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

(2021.4.20～2022.4.18)

### ■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より2021年末にかけて、欧米を中心に新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、経済活動の正常化が順次進んだことからおおむね上昇基調で推移しました。主要各国における企業決算が総じて順調だったことも相場を後押ししました。2022年に入ると、米国物価指数の上振れなどを背景に米国金融政策の引き締め加速懸念が強まったほか、ロシアによるウクライナ侵攻を受けて下落に転じました。3月に入りいったんは反発しましたが、4月はF R B（米国連邦準備制度理事会）によるバランスシート縮小が市場で意識され、再び下落しました。なお、当ファンドが組み入れている株式ポートフォリオは下落しました。

### ■為替相場

米ドルおよびユーロの対円為替相場は上昇しました。

米ドルおよびユーロの対円為替相場は、米国ではF R B（米国連邦準備制度理事会）が政策金利見通しを大幅に引き上げ、欧州ではE C B（欧州中央銀行）が量的緩和政策の縮小加速を決定して金融政策正常化の動きを強めた一方で、日本では日銀が指値オペを行って長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の方向性の違いが浮き彫りになったことから、対円で上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資してまいります。地政学リスクや中央銀行の政策変更などによる一時的な株価調整局面は、企業の本源的価値に対して割安な水準で投資する機会と捉え、短期的な損益ではなく、長期投資のリターンを追求していきます。

地域別では、米国に加えて本源的価値と比較して割安な銘柄が多いドイツ、英国、スイスなど欧米中心のポートフォリオを維持します。

## ポートフォリオについて

(2021.4.20～2022.4.18)

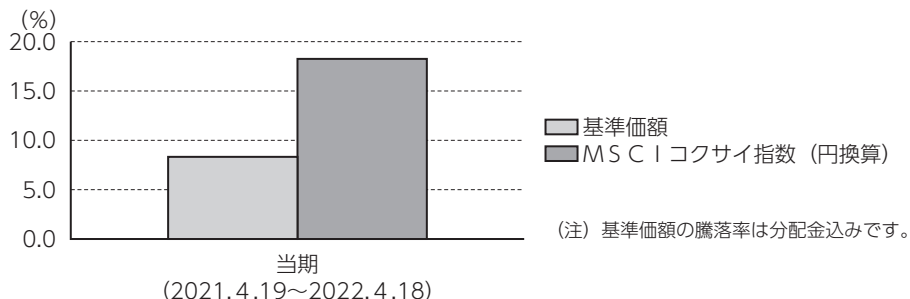
当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、ハリス・アソシエイツ・エル・ピーに運用の指図にかかる権限を委託しております。

株式組入比率は、高位に維持しました。銘柄選定にあたって、ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資しました。個別銘柄では、ALPHABET（米国、コミュニケーション・サービス）、TE CONNECTIVITY（米国、情報技術）、BAYER（ドイツ、ヘルスケア）などを高位で組み入れました。

## 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。参考指数は海外株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

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20日 ～2022年4月18日	
<b>当期分配金（税込み）</b> (円)	<b>650</b>	
対基準価額比率 (%)	2.99	
当期の収益 (円)	650	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	11,066	

(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。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	160.91円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	1,453.91
(c) 収益調整金		3,516.79
(d) 分配準備積立金		6,584.74
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		11,716.36
(f) 分配金		650.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		11,066.36

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資してまいります。地政学リスクや中央銀行の政策変更などによる一時的な株価調整局面は、企業の本源的価値に対して割安な水準で投資する機会と捉え、短期的な損益ではなく、長期投資のリターンを追求していきます。

地域別では、米国に加えて本源的価値と比較して割安な銘柄が多いドイツ、英国、スイスなど欧米中心のポートフォリオを維持します。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.4.20~2022.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	413円	1.974%	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20,914円です。
(投 信 会 社)	(241)	(1.152)	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)	(161)	(0.768)	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)	(11)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	4	0.020	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
(株 式)	(4)	(0.020)	
有 価 証 券 取 引 税	3	0.014	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
(株 式)	(3)	(0.014)	
そ の 他 費 用	26	0.123	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)	(11)	(0.052)	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)	(14)	(0.066)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	446	2.132	

(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。

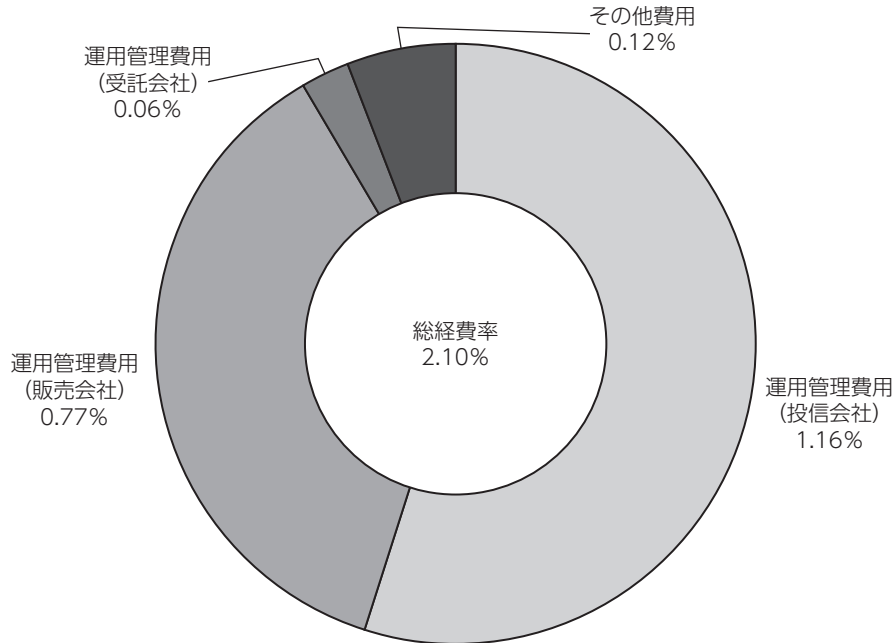
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



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2.10%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2021年4月20日から2022年4月18日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 446.55 ( 9.2)	千アメリカ・ドル 8,124 (△ 11)	百株 1,575.87	千アメリカ・ドル 13,521
	オーストラリア	百株 504 ( -)	千オーストラリア・ドル 120 ( -)	百株 6,364.74	千オーストラリア・ドル 2,045
	香港	百株 1,006 ( -)	千香港ドル 14,434 ( -)	百株 64	千香港ドル 635
	イギリス	百株 3,374 ( 392.67)	千イギリス・ポンド 1,508 (△ 36)	百株 20,555.62	千イギリス・ポンド 2,128
	スイス	百株 669.5 ( 97.1)	千スイス・フラン 982 ( 47)	百株 668	千スイス・フラン 1,132
	インド	百株 70 ( -)	千インド・ルピー 4,663 ( -)	百株 433	千インド・ルピー 32,539
	韓国	百株 87.8 ( -)	千韓国ウォン 591,379 ( -)	百株 -	千韓国ウォン -
	南アフリカ	百株 23.4 (△ 61.85)	千南アフリカ・ランド 7,142 (△ 21,211)	百株 34.8	千南アフリカ・ランド 8,334
	ユーロ (アイルランド)	百株 - ( -)	千ユーロ - ( -)	百株 27	千ユーロ 45
	ユーロ (オランダ)	百株 250.95 ( 266.07)	千ユーロ 1,156 ( 1,236)	百株 413	千ユーロ 625
	ユーロ (ベルギー)	百株 130 ( -)	千ユーロ 646 ( -)	百株 57.45	千ユーロ 322
	ユーロ (フランス)	百株 - ( -)	千ユーロ - ( -)	百株 37.8	千ユーロ 730
	ユーロ (ドイツ)	百株 500.3 ( 122.96)	千ユーロ 2,582 ( -)	百株 338.6	千ユーロ 2,566
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 881.25 ( 389.03)	千ユーロ 4,385 ( 1,236)	百株 873.85	千ユーロ 4,290

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権付社債 (転換社債)

(2021年4月20日から2022年4月18日まで)

		買 付		売 付	
		額 面	金 額	額 面	金 額
外 国	スイス	千スイス・フラン 84 ( -)	千スイス・フラン 84 ( -)	千スイス・フラン - (84)	千スイス・フラン - (84)

(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、割当、予約権行使による増減分で、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。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年4月20日から2022年4月18日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	5,068,358千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,774,725千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.74

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
株式

(2021年4月20日から2022年4月18日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.73	464,012	268,215	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.657	457,134	275,880
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	100.6	209,832	2,085	INCITEC PIVOT LTD (オーストラリア)	636.474	174,840	274
GLENCORE PLC (ジャージイー)	290.6	143,565	494	BAYER AG-REG (ドイツ)	21.38	165,633	7,747
PROSUS NV (オランダ)	16.695	138,132	8,273	LLOYDS BANKING GROUP PLC (イギリス)	1,881.762	140,580	74
WILLIS TOWERS WATSON PLC (アイルランド)	4.17	111,257	26,680	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.425	140,431	330,426
FISERV INC (アメリカ)	7.75	94,022	12,131	ENVISTA HOLDINGS CORP (アメリカ)	22	110,869	5,039
BAYER AG-REG (ドイツ)	14.755	93,630	6,345	JOHNSON CONTROLS INTERNATION (アイルランド)	12.96	106,967	8,253
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV (ベルギー)	13	84,499	6,499	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	20.8	97,901	4,706
DAIMLER TRUCK HOLDING AG (ドイツ)	21.8	76,980	3,531	CAPGEMINI SE (フランス)	3.78	94,720	25,058
CONTINENTAL AG (ドイツ)	5.275	67,006	12,702	CNH INDUSTRIAL NV (オランダ)	40.8	78,822	1,931

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■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  
外国株式

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	千円	千円	
HOWMET AEROSPACE INC	386	280	993	125,848	資本財・サービス		
CITIGROUP INC	96.55	—	—	—	金融		
TE CONNECTIVITY LTD	203.45	180.75	2,184	276,783	情報技術		
AMAZON.COM INC	—	1.95	591	74,950	一般消費財・サービス		
FLOWSERVE CORP	247	247	882	111,736	資本財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	526	342	862	109,264	コミュニケーション・サービス		
FISERV INC	54.35	123.75	1,233	156,249	情報技術		
GENERAL MOTORS CO	512.78	481.23	1,931	244,641	一般消費財・サービス		
GENERAL DYNAMICS CORP	36.7	32.35	788	99,887	資本財・サービス		
ALPHABET INC-CL A	—	13.05	3,307	419,013	コミュニケーション・サービス		
ALPHABET INC-CL C	16.57	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
HUMANA INC	26.8	24.35	1,121	142,067	ヘルスケア		
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	59.15	78.3	750	95,103	資本財・サービス		
TENET HEALTHCARE CORP	304.33	220.53	1,874	237,462	ヘルスケア		
PINTEREST INC- CLASS A	—	110	243	30,879	コミュニケーション・サービス		
BOOKING HOLDINGS INC	2.75	2.4	534	67,716	一般消費財・サービス		
ENVISTA HOLDINGS CORP	243	23	105	13,356	ヘルスケア		
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	27.3	25.95	1,441	182,552	コミュニケーション・サービス		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	129.6	—	—	—	資本財・サービス		
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	41.7	976	123,691	金融		
ORACLE CORP	187.25	149.35	1,186	150,316	情報技術		
MASTERCARD INC - A	37.25	30.05	1,075	136,212	情報技術		
A BANK OF AMERICA CORP	637	429	1,611	204,176	金融		
NOV INC	553.95	575.95	1,184	150,008	エネルギー		
KEURIG DR PEPPER INC	208	183	681	86,331	生活必需品		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	430	343	1,183	149,863	コミュニケーション・サービス		
GRUPO TELEVIS SA-SPON ADR	676	543	594	75,322	コミュニケーション・サービス		
ARCONIC CORP	133	133	358	45,356	素材		
アメリカ・ドル 通貨計	5,734.78 株数、金額 銘柄数<比率>	4,614.66 株数、金額 銘柄数<比率>	27,698 1銘柄	3,508,792 <51.8%>			
(オーストラリア)	百株	百株	千円	千円			
INCITEC PIVOT LTD	5,860.74	—	—	—	素材		
オーストラリア・ドル 通貨計	5,860.74 株数、金額 銘柄数<比率>	— 株数、金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	<—>			
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	365.8	1,307.8	12,489	201,705	一般消費財・サービス		
香港ドル 通貨計	365.8 株数、金額 銘柄数<比率>	1,307.8 株数、金額 銘柄数<比率>	12,489 1銘柄	201,705 <3.0%>			
(イギリス)	百株	百株	千イリス・ポンド	千円			
PRUDENTIAL PLC	332.21	559.21	597	98,773	金融		
GLENCORE PLC	—	2,035	1,072	177,132	素材		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	51,404	32,586.38	1,465	242,183	金融		
COMPASS GROUP PLC	114	—	—	—	一般消費財・サービス		
TRAVIS PERKINS PLC	479	359.67	453	74,909	資本財・サービス		
イギリス・ポンド 通貨計	52,329.21 株数、金額 銘柄数<比率>	35,540.26 株数、金額 銘柄数<比率>	3,588 4銘柄	592,999 <8.8%>			
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円			
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2,288	2,388.1	1,714	230,162	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	221.05	231.65	1,133	152,252	金融		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	
NOVARTIS AG-REG	百株	百株	千円	千円	千円	千円	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	103.5	106.7	932	125,171	ヘルスケア		
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	2,627.85 4銘柄	2,726.45 3銘柄	3,780	507,586 <7.5%>	
(インド)	百株	百株	千円	千円			
AXIS BANK LTD	529	166	13,164	21,984	金融		
インド・ルピー 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	529 1銘柄	166 1銘柄	13,164	21,984 <0.3%>	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円			
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	—	87.8	525,922	54,117	情報技術		
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	— 1銘柄	87.8 1銘柄	525,922	54,117 <0.8%>	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円			
NASPERS LTD-N SHS	73.25	—	—	—	一般消費財・サービス		
南アフリカ・ランド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	73.25 1銘柄	— —	—	— <—>	
ユーロ(アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円			
RYANAIR HOLDINGS PLC	27	—	—	—	資本財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	27 1銘柄	— —	—	— <—>	
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
IVECO GROUP NV	—	125.4	74	10,219	資本財・サービス		
PROSUS NV	—	302.62	1,423	194,647	一般消費財・サービス		
CNH INDUSTRIAL NV	962	638	924	126,404	資本財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	962 1銘柄	1,066.02 3銘柄	2,421	331,271 <4.9%>	
ユーロ(ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円			
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	117.3	189.85	1,036	141,809	生活必需品		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	117.3 1銘柄	189.85 1銘柄	1,036	141,809 <2.1%>	
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円			
CAPGEMINI SE	37.8	—	—	—	情報技術		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	37.8 1銘柄	— —	—	— <—>	
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
VITECO TECHNOLOGIES GROUP N AG	—	32.16	111	15,272	一般消費財・サービス		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	314.8	747	102,242	資本財・サービス		
BAYER AG-REG	410.15	343.9	2,314	316,570	ヘルスケア		
CONTINENTAL AG	125.25	168.75	1,071	146,568	一般消費財・サービス		
ALLIANZ SE-REG	82.8	77.15	1,690	231,206	金融		
SAP SE	83.6	83.6	812	111,100	情報技術		
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	251.7	217.8	1,379	188,634	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	953.5 7銘柄	1,238.16 7銘柄	8,126	1,111,595 <16.4%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	2,097.6 9銘柄	2,494.03 11銘柄	11,585	1,584,676 <23.4%>	
ファンダ合計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	69,618.23 45銘柄	46,937 46銘柄	—	6,471,862 <95.6%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 6,471,862	% 91.4
コール・ローン等、その他	606,350	8.6
投資信託財産総額	7,078,212	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、4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=126.68円、1オーストラリア・ドル=93.54円、1香港ドル=16.15円、1イギリス・ポンド=165.23円、1スイス・フラン=134.27円、1スウェーデン・クローネ=13.23円、1インド・ルピー=1.67円、100韓国ウォン=10.29円、1南アフリカ・ランド=8.62円、1ユーロ=136.78円です。  
 (注3) 当期末における外貨建純資産(6,771,957千円)の投資信託財産総額(7,078,212千円)に対する比率は、95.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年4月18日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>7,213,525,226円</b>
コール・ローン等	516,765,550
株式(評価額)	6,471,862,284
未収入金	209,681,043
未収配当金	15,216,349
<b>(B) 負債</b>	<b>441,414,736</b>
未払金	146,871,924
未払収益分配金	208,952,649
未払解約金	16,894,079
未払信託報酬	68,505,882
その他未払費用	190,202
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>6,772,110,490</b>
元本	3,214,656,141
次期繰越損益金	3,557,454,349
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,214,656,141口</b>
<b>1万口当り基準価額(C / D)</b>	<b>21,066円</b>

\* 期首における元本額は3,406,468,066円、当作成期間中における追加設定元本額は286,738,381円、同解約元本額は478,550,306円です。  
 \* 当期末の計算口数当りの純資産額は21,066円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>66,404,980円</b>
受取配当金	66,068,470
受取利息	297,418
その他収益金	80,494
支払利息	△ 41,402
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>599,917,616</b>
売買益	1,514,979,377
売買損	△ 915,061,761
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 147,212,571</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>519,110,025</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>2,116,769,876</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>1,130,527,097</b>
(配当等相当額)	( 1,077,922,571)
(売買損益相当額)	( 52,604,526)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>3,766,406,998</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 208,952,649</b>
<b>次期繰越損益金(G + H)</b>	<b>3,557,454,349</b>
追加信託差損益金	1,130,527,097
(配当等相当額)	( 1,077,922,571)
(売買損益相当額)	( 52,604,526)
分配準備積立金	2,426,927,252

(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。  
 (注4) 投資信託財産の運用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：45,487,264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	51,727,887円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	467,382,138
(c) 収益調整金	1,130,527,097
(d) 分配準備積立金	2,116,769,876
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,766,406,998
(f) 分配金	208,952,649
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,557,454,349
(h) 受益権総口数	3,214,656,141口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 ( 税 込 み )	650 円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

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

最近5期の運用実績

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 中 率		
7 期末(2018年 4月18日)	円 9,999	円 0	% △0.1	% -	百万円 185
8 期末(2019年 4月18日)	9,990	0	△0.1	-	166
9 期末(2020年 4月20日)	9,984	0	△0.1	-	88
10 期末(2021年 4月19日)	9,980	0	△0.0	-	300
11 期末(2022年 4月18日)	9,977	0	△0.0	-	65

(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。

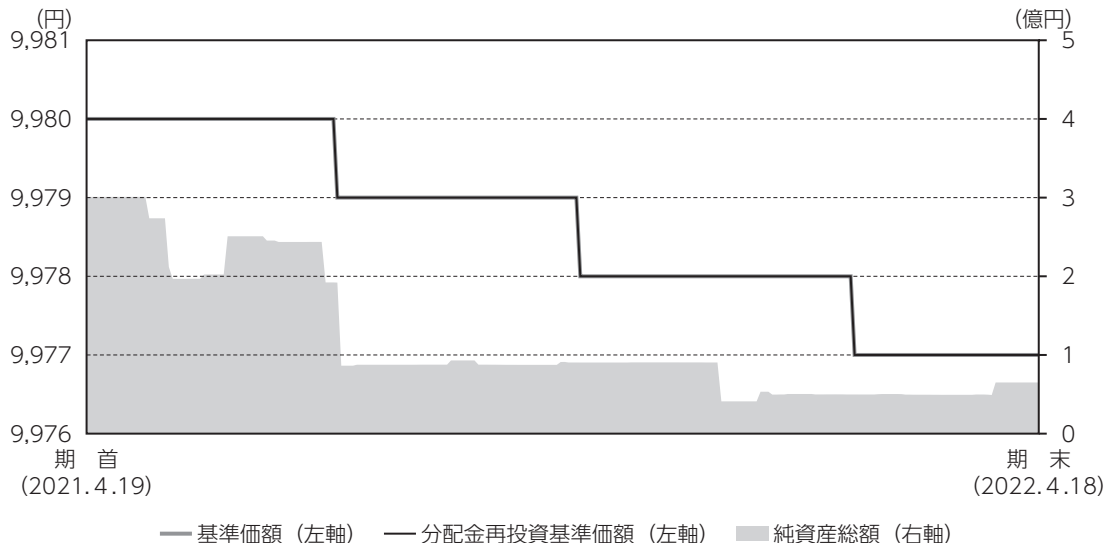
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注4) 当ファンドは、ダイワ／ハリス世界厳選株ファンドの資金をスイッチングにより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、安定運用を行ないます。そのため、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



(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はありません。

\* 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：9,980円

期末：9,977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。



年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公 組 入 社 比	債 率
		騰	落		
(期首) 2021年 4月19日	円 9,980	% -			% -
4月末	9,980	0.0			-
5月末	9,980	0.0			-
6月末	9,980	0.0			-
7月末	9,979	△0.0			-
8月末	9,979	△0.0			-
9月末	9,979	△0.0			-
10月末	9,978	△0.0			-
11月末	9,978	△0.0			-
12月末	9,978	△0.0			-
2022年 1月末	9,978	△0.0			-
2月末	9,977	△0.0			-
3月末	9,977	△0.0			-
(期末) 2022年 4月18日	9,977	△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

(2021.4.20～2022.4.18)

### ■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」

### ■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

(2021.4.20～2022.4.18)

### ■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（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年4月20日 ～2022年4月18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）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	9

（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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益です。



## 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。

上記の運用方針により、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資する場合があります。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 (2021.4.20~2022.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	一円	—%	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9,979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	0.000	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
合 計	0	0.000	

(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。

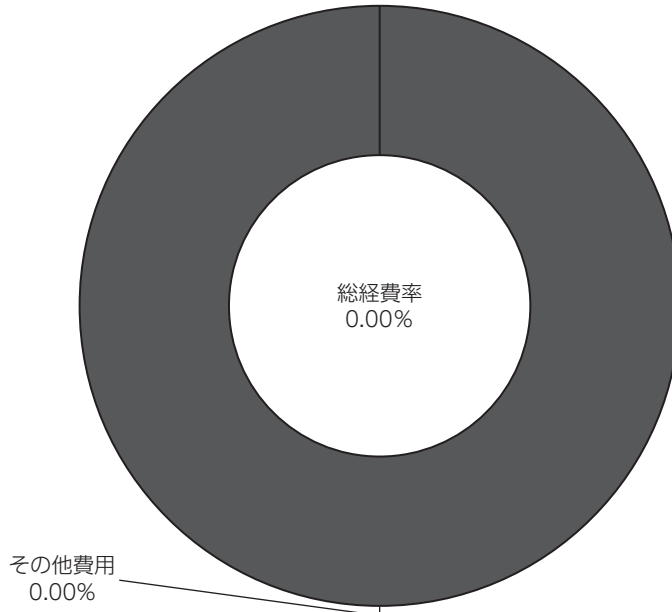
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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20日から2022年4月18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	93,976	94,051	327,285	327,558

(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	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	297,664	64,354	64,393			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年4月18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	64,393	99.0
コール・ローン等、その他	655	1.0
投資信託財産総額	65,048	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18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	65,048,587円
コール・ローン等	655,569
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	64,393,018
(B) 負債	5,169
未払解約金	4,988
その他未払費用	181
(C) 純資産総額(A - B)	65,043,418
元本	65,192,656
次期繰越損益金	△ 149,238
(D) 受益権総口数	65,192,656口
1万口当り基準価額(C / D)	9,977円

\* 期首における元本額は301,542,638円、当作成期間中における追加設定元本額は95,367,534円、同解約元本額は331,717,516円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,977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149,238円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 429円
受取利息	676
支払利息	△ 1,105
(B) 有価証券売買損益	△ 10,104
売買益	14,579
売買損	△ 24,683
(C) 信託報酬等	△ 579
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 11,112
(E) 前期繰越損益金	△ 2,117
(F) 追加信託差損益金	△ 136,009
(配当等相当額)	( 56,714)
(売買損益相当額)	(△ 192,723)
(G) 合計(D + E + F)	△ 149,238
次期繰越損益金(G)	△ 149,238
追加信託差損益金	△ 136,009
(配当等相当額)	( 56,714)
(売買損益相当額)	(△ 192,723)
分配準備積立金	5,650
繰越損益金	△ 18,879

(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	3,081
(c) 収益調整金	56,714
(d) 分配準備積立金	2,569
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	62,364
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	62,364
(h) 受益権総口数	65,192,656口

**<補足情報>**

当ファンド（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）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18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20日～2022年4月18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18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。

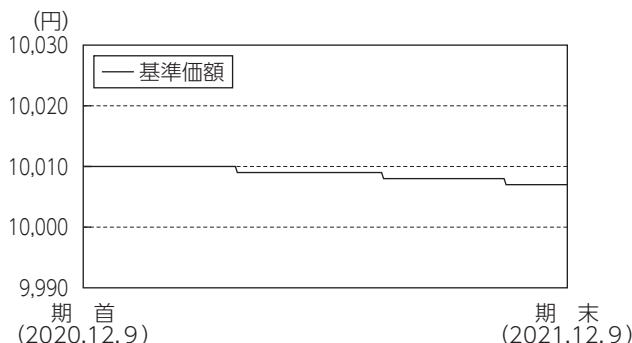
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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 円	騰 落 率 %	公 社 債 組 入 比 率 %
(期首)2020年12月9日	10,010	-	-
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
<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)	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・ショート戦略パレットファンド (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	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)	
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 - ロボテック (毎月決算/予想配分提示型)	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-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
ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - S/Lトレード	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/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 豪ドル・コース (毎月分配型)	595,106円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	987,373円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドII 通貨セレクト・コース (毎月分配型)	494,581円
ダイワ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/ミレニアセット亜細亜株式ファンド	9,958,176円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株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

ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり (毎月分配型)	399,083円
ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし (毎月分配型)	99,771円
通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース (毎月分配型)	399,083円
通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース (毎月分配型)	99,771円
ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジあり)	1,091,429円
ダイワ/ミレニアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンド (為替ヘッジなし)	315,004円
ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	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- 予想配分提示型 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- 予想配分提示型 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- 予想配分提示型 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- 予想配分提示型 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- 予想配分提示型 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)	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。