

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／特殊型（ブル・ベア型）		
信託期間	無期限（設定日：2021年4月27日）		
運用方針	日々の基準価額の値動きがFactSet ATMX+指数（香港ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	イ. FactSet ATMX+指数の2倍の値動きを享受する債券（円建） ロ. 香港の株式（DR（預託証券）を含みます。） ハ. 中国（香港を含みます。）の株価指数に連動するETF（上場投資信託証券）およびETN（上場投資証券） ニ. 中国（香港を含みます。）の株価指数先物取引 ホ. わが国の債券 ヘ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券	
		ダイワ・マネースtock・マザーファンド 円建ての債券	
	組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 ベビーファンドの株式実質組入上限比率 マザーファンドの株式組入上限比率	無制限 純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

iFree レバレッジ
ATMX+

運用報告書(全体版)
第1期
(決算日 2022年4月26日)
(作成対象期間 2021年4月27日～2022年4月26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。

当ファンドは、日々の基準価額の値動きがFactSet ATMX+指数（香港ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9：00～17：00）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			FactSet ATMX+指数 (香港ドルベース)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資信託 証券組入 比 率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 額 総
	(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26日)	円 1, 674	円 0	% △ 83. 3	4, 836	% △ 51. 6	% —	% —	% 99. 2	% —	% —	百万円 255

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) FactSet ATMX+指数 (香港ドルベース) は、FactSet ATMX+指数 (香港ドルベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10, 000 として大和アセットマネジメントが計算したものです。
- (注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注 5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。
- (注 7) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

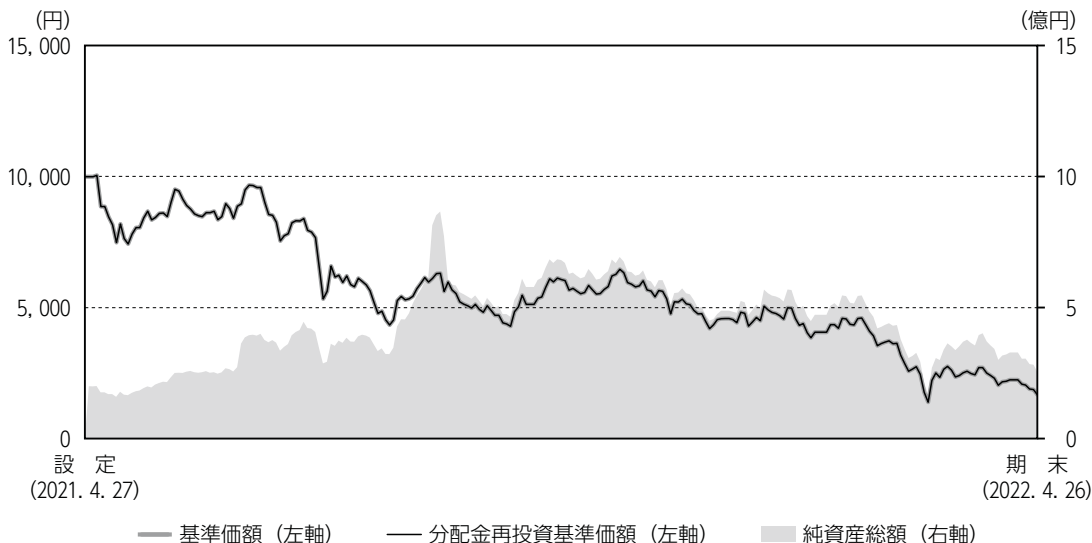
FactSet は、FactSet ATMX+指数の正確性および、または完全性を保証するものではありません。また、その中に含まれるデータおよびインデックス使用許諾者は、いかなる誤り、欠落または中断について責任を負うものではありません。FactSet は、インデックスの使用許諾者、当ファンドの所有者、または当インデックスまたはそれに含まれるすべてのデータの使用に起因する他の人物または組織によって得られる結果について、明示的または黙示的に保証されるものではありません。FactSet は、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに含まれるすべてのデータの商品性、特定の目的または使用への適合性について、一切の保証を明示的に否認します。これに限定されず、FactSet は、たとえそのような損害の可能性について知らされていたとしても、特別損害、懲罰的損害、間接的損害または派生的損害 (逸失利益を含む) に対する責任を一切負うものではありません。

FACTSET DOES NOT GUARANTEE THE ACCURACY AND/OR THE COMPLETENESS OF THE FACTSET ATMX+ INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN AND LICENSOR SHALL HAVE NO LIABILITY FOR ANY ERRORS, OMISSIONS, OR INTERRUPTIONS THEREIN. FACTSET MAKES NO WARRANTY, EXPRESS OR IMPLIED, AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY LICENSEE, OWNERS OF THE PRODUCT, OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY FROM THE USE OF THE FACTSET ATMX+ INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. FACTSET MAKES NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND EXPRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE WITH RESPECT TO THE FACTSET ATMX+ INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING, IN NO EVENT SHALL FACTSET HAVE ANY LIABILITY FOR ANY SPECIAL, PUNITIVE, INDIRECT, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES (INCLUDING LOST PROFITS), EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.



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：1,674円（分配金 0 円）

騰落率：△83.3%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

日々の基準価額の値動きが FactSet ATMX+ 指数（香港ドルベース）の値動きの 2 倍程度となることをめざした運用を行った結果、FactSet ATMX+ 指数で組み入れている中国テクノロジー関連銘柄が下落したことから、当ファンドの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。

iFree レバレッジ ATM+

年 月 日	基 準 価 額		FactSet ATM+指数 (香港ドルベース)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資信託 証券組入 比 率	投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率					
(期 首) 2021年 4月27日	円	%		%	%	%	%	%	%
	10,000	—	10,000	—	—	—	—	—	—
4 月末	10,054	0.5	10,067	0.7	—	—	99.5	—	—
5 月末	8,484	△ 15.2	9,293	△ 7.1	—	—	101.2	—	—
6 月末	9,666	△ 3.3	9,986	△ 0.1	—	—	99.8	—	—
7 月末	6,588	△ 34.1	8,404	△ 16.0	—	—	104.6	—	—
8 月末	5,437	△ 45.6	7,719	△ 22.8	—	—	99.9	—	—
9 月末	4,900	△ 51.0	7,377	△ 26.2	—	—	99.8	—	—
10月末	5,738	△ 42.6	8,060	△ 19.4	—	—	99.7	—	—
11月末	5,638	△ 43.6	7,999	△ 20.0	—	—	99.9	—	—
12月末	4,426	△ 55.7	7,109	△ 28.9	—	—	100.1	—	—
2022年 1 月末	3,851	△ 61.5	6,684	△ 33.2	—	—	99.8	—	—
2 月末	3,632	△ 63.7	6,513	△ 34.9	—	—	100.1	—	—
3 月末	2,573	△ 74.3	5,947	△ 40.5	—	—	100.1	—	—
(期 末) 2022年 4月26日	1,674	△ 83.3	4,836	△ 51.6	—	—	99.2	—	—

(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. 27 ~ 2022. 4. 26)

中国テクノロジー株式市況

中国テクノロジー株式市況は下落しました。

中国テクノロジー株式市況は、当作成期首より、中国当局のネットプラットフォームやテクノロジー企業への規制強化の影響から、上値が重い展開となりました。2021年7月には、米国でのIPO（新規公開）を強行した中国の配車アプリ最大手企業への中国当局の規制強化が嫌気されて下落しました。その後は、規制に関してはピークとなったという見方や、中国が預金準備率を引き下げ金融緩和姿勢を強めたことから、横ばいで推移しました。2022年3月に入ると、ロシアのウクライナ侵攻に伴って、ノルウェーのソブリン・ウェルス・ファンドが中国の大手アパレル企業を投資先から除外したことや、米国の対ロシア制裁が中国企業に飛び火する懸念などの、中国リスクが想定されたことから、米国に上場する中国企業のADR（米国預託証券）が先行する形で大きく下落しました。その後は、経済ブレーンである劉鶴副首相が国务院金融安定発展委員会の会議で株式市場の安定化の方針を発表したことを好感し、株価を戻す局面もありましたが、下落して当作成期末を迎えました。

ポートフォリオについて

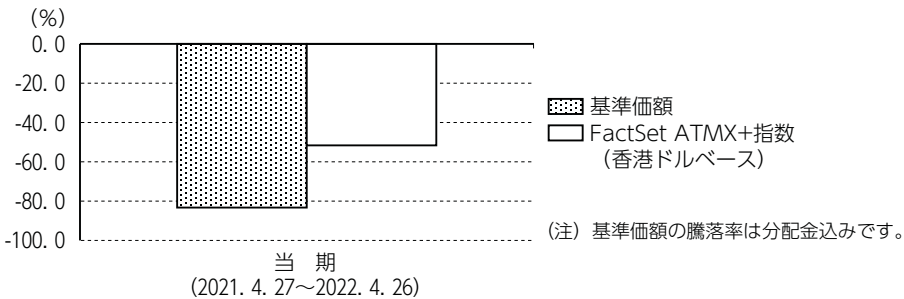
(2021. 4. 27 ~ 2022. 4. 26)

ボルト・インベストメンツ・ピーエルシーが発行する債券（円建）（以下「パフォーマンス連動債券」といいます。）への投資割合を高位に維持しました。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

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	
	2021年 4 月27日 ～2022年 4 月26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

当ファンドの運用方針に基づき、主にパフォーマンス連動債券を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きが FactSet ATMX+ 指数（香港ドルベース）の値動きの 2 倍程度となることをめざして運用を行います。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

1 万口当りの費用の明細

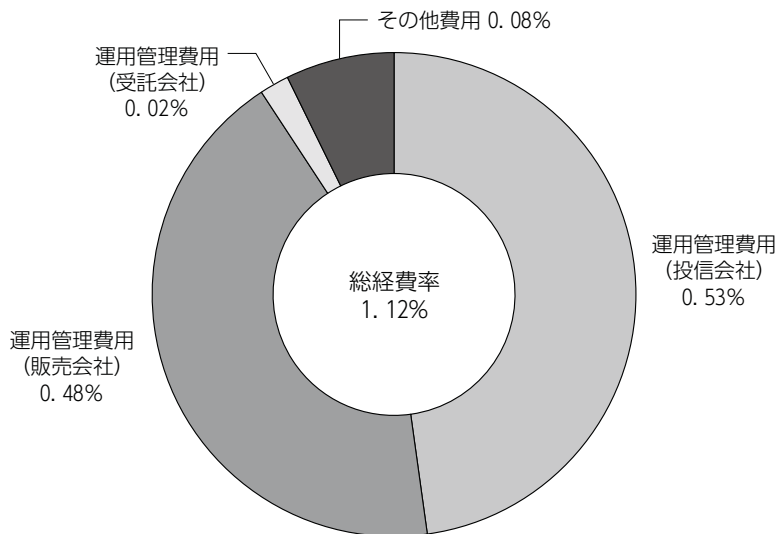
項 目	当 期 (2021. 4. 27～2022. 4. 26)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	57円	1. 034%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は5, 559円です。
(投 信 会 社)	(30)	(0. 533)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(27)	(0. 479)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、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	5	0. 081	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)	(4)	(0. 071)	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)	(0)	(0. 007)	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. 003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	62	1. 115	

- (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1.12%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
公 社 債

(2021年 4 月27日から2022年 4 月26日まで)

国 内	社債券	買 付 額	売 付 額
		千円 1, 279, 380	千円 358, 235 —

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注 2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 3) 社債券には新株予約権付社債券（転換社債券）は含まれておりません。
(注 4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2021年 4 月27日から2022年 4 月26日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
Vault Investments PLC 2026/3/31（ユーロ円債）	千円 1, 279, 380	Vault Investments PLC 2026/3/31（ユーロ円債）	千円 358, 235

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注 2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設 定 時 保 有 額	当作成期中 設 定 額	当作成期中 解 約 額	当作成期末 保 有 額	取 引 の 理 由
百万円 200	百万円 —	百万円 —	百万円 200	当初設定時における取得

(注 1) 金額は元本ベース。
(注 2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

作 成 期	当 期				末		
	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		
区 分					5 年以上	2 年以上	2 年未満
普通社債券	千円 1, 495, 000	千円 252, 924	% 99. 2	% —	% —	% 99. 2	% —

(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）

当 期 末					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
普通社債券	Vault Investments PLC	—	1,495,000	252,924	2026/03/31

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年 4月26日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	252,924	96.2
コール・ローン等、その他	9,884	3.8
投資信託財産総額	262,808	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26日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	262,808,434円
コール・ローン等	8,366,034
公社債（評価額）	252,924,100
未収入金	1,518,300
(B)負債	7,734,375
未払金	4,386,970
未払解約金	826,029
未払信託報酬	2,501,519
その他未払費用	19,857
(C)純資産総額（A－B）	255,074,059
元本	1,523,718,268
次期繰越損益金	△ 1,268,644,209
(D)受益権総口数	1,523,718,268口
1万口当り基準価額（C／D）	1,674円

* 期首における元本額は200,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は2,755,753,952円、同解約元本額は1,432,035,684円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は1,674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1,268,644,209円です。

■損益の状況

当期 自2021年 4月27日 至2022年 4月26日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,214円
受取利息	3,386
支払利息	△ 5,600
(B) 有価証券売買損益	△ 455,219,302
売買益	107,918,047
売買損	△ 563,137,349
(C) 信託報酬等	△ 4,925,526
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 460,147,042
(E) 追加信託差損益金	△ 808,497,167
（配当等相当額）	（△ 15,631）
（売買損益相当額）	（△ 808,481,536）
(F) 合計（D＋E）	△ 1,268,644,209
次期繰越損益金（F）	△ 1,268,644,209
追加信託差損益金	△ 808,497,167
（配当等相当額）	（△ 15,631）
（売買損益相当額）	（△ 808,481,536）
繰越損益金	△ 460,147,042

(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	1,523,718,268口

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。

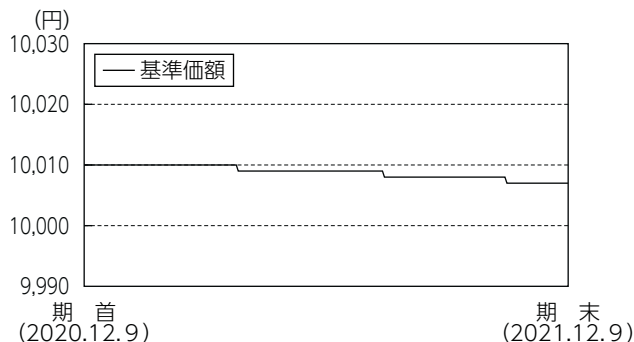
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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 率
	騰 落 率	組 入 比	
(期首)2020年12月9日	円	%	%
	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
(A) 資産	147,987,988,484円
コール・ローン等	147,987,988,484
(B) 負債	210,000,000
未払解約金	210,000,000
(C) 純資産総額(A－B)	147,777,988,484
元本	147,676,216,454
次期繰越損益金	101,772,030
(D) 受益権総口数	147,676,216,454口
1万口当り基準価額(C／D)	10,007円

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：	
日本株ロング・ショート戦略パイロットファンド (適格機関投資家専用)	266,761,115円
ロボット・テックノロジー関連株ファンド	947,268円
ダイワ/ミレアセット・インド株式ファンド	29,910,270円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジあり)	998円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジなし)	998円
US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)	102,434円
ロボット・テックノロジー関連株ファンド	39,499円
ロボット・テッ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)	3,985円
i Freeレバレッジ S & P 500	8,293,797,395円
i Freeレバレッジ NASDAQ100	70,959,132,903円
クリーンテック株式ファンド (資産成長型)	998,802円
ロボット・テックノロジー関連株ファンド	999円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型)	1,000円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	499,501円
ダイワ上場投信－日経平均レバレッジ・インデックス	5,345,339,466円
ダイワ上場投信－日経平均ダブルインバース・インデックス	6,483,785,045円
ダイワ上場投信－TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,334,794,630円
ダイワ上場投信－TOPIXダブルインバース (－2倍) 指数	936,360,631円
ダイワ上場投信－日経平均インバース・インデックス	6,676,062,567円
ダイワ上場投信－TOPIXインバース (－1倍) 指数	3,084,973,807円
ダイワ上場投信－JPX日経400レバレッジ・インデックス	574,295,634円
ダイワ上場投信－JPX日経400インバース・インデックス	861,497,868円
ダイワ上場投信－JPX日経400ダブルインバース・インデックス	104,920,073円
ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016－07	997円
ダイワ米国投資法人債ファンド (為替ヘッジあり) 2016－10	997円
先進国トータルリターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用)	6,988,339,549円
ダイワ日本株ベア・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	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/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	595,106円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	987,373円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル・グレートコンシューマー株式ファンドⅡ	494,581円
ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型)	9,957円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	997円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり)	997円
ダイワ新グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジなし)	997円
ダイワ/ミレ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・テックノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	100,588円

ダイワ先進国リートα 為替ヘッジあり (毎月分配型)	399,083円
ダイワ先進国リートα 為替ヘッジなし (毎月分配型)	99,771円
通貨選択型ダイワ先進国リートα 円ヘッジコース (毎月分配型)	399,083円
通貨選択型ダイワ先進国リートα 通貨セレクトコース (毎月分配型)	99,771円
ダイワ/ミレアセット・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Ⅰ－ 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Ⅰ－ 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 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 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
(A) 配当等収益	△ 31,130,963円
受取利息	469,134
支払利息	△ 31,600,097
(B) その他費用	△ 147,839
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 31,278,802
(D) 前期繰越損益金	90,693,506
(E) 解約差損益金	△106,126,697
(F) 追加信託差損益金	148,484,023
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	101,772,030
次期繰越損益金(G)	101,772,030

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。