

★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)

第2期

(決算日 2020年6月29日)

(作成対象期間 2019年6月29日～2020年6月29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、第2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/>

<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

(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。

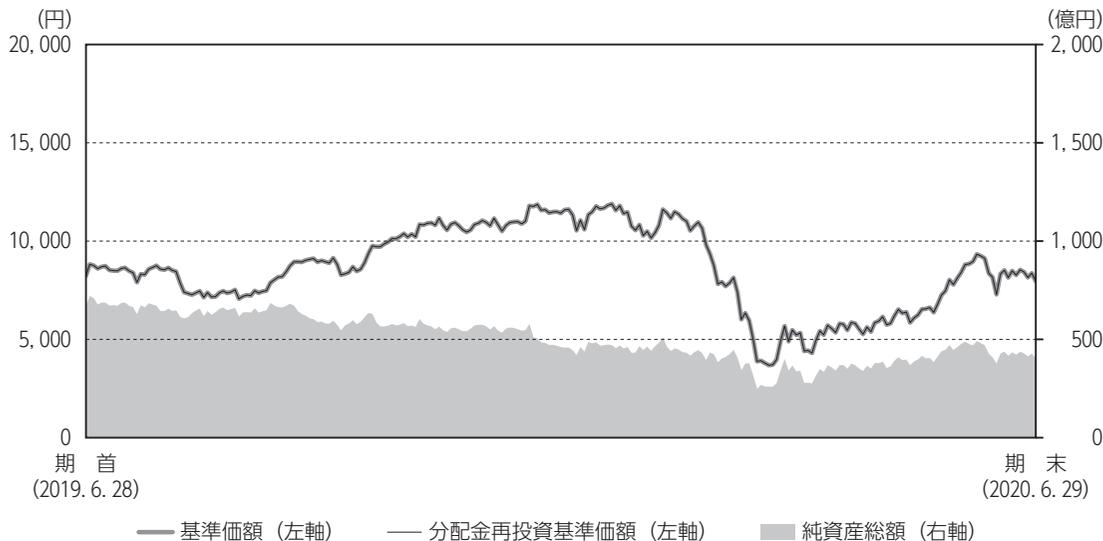
(注4) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：8,225円

期末：7,950円（分配金0円）

騰落率：△3.3%（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、わが国の株式市場は上昇したものの、株式市場が上昇・下落をしながら動いたことにより基準価額が押し下げられたため、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 組入比率	株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)			
(期首)2019年6月28日	円	%	円	%	%	%	%
	8,225	—	21,275.92	—	—	298.9	—
7月末	8,509	3.5	21,521.53	1.2	—	303.3	—
8月末	7,472	△ 9.2	20,704.37	△ 2.7	—	294.1	—
9月末	8,883	8.0	21,755.84	2.3	—	298.1	—
10月末	10,354	25.9	22,927.04	7.8	—	299.2	—
11月末	10,778	31.0	23,293.91	9.5	—	299.1	—
12月末	11,316	37.6	23,656.62	11.2	—	305.2	—
2020年1月末	10,494	27.6	23,205.18	9.1	—	295.5	—
2月末	7,821	△ 4.9	21,142.96	△ 0.6	—	312.0	—
3月末	5,327	△ 35.2	18,917.01	△ 11.1	—	295.9	—
4月末	6,147	△ 25.3	20,193.69	△ 5.1	—	294.8	—
5月末	7,789	△ 5.3	21,877.89	2.8	—	298.3	—
(期末)2020年6月29日	7,950	△ 3.3	21,995.04	3.4	—	301.8	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019. 6. 29 ~ 2020. 6. 29)

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、当作成期首より、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことなどが支えとなり、底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、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下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、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2月後半から3月中旬にかけて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を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感されました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、「ダイワ・マネー・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

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

(2019. 6. 29 ~ 2020. 6. 29)

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。

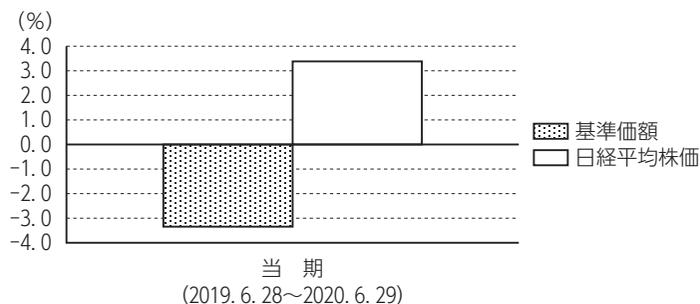
ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、現先取引やコール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が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	
	2019年6月29日 ～2020年6月29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）	536

（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・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

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 (2019. 6. 29~2020. 6. 29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	88円	1.021%	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8,612円です。
(投 信 会 社)	(28)	(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)	(57)	(0.659)	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	8	0.088	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)	(8)	(0.088)	
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)	(0.004)	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	96	1.114	

(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。

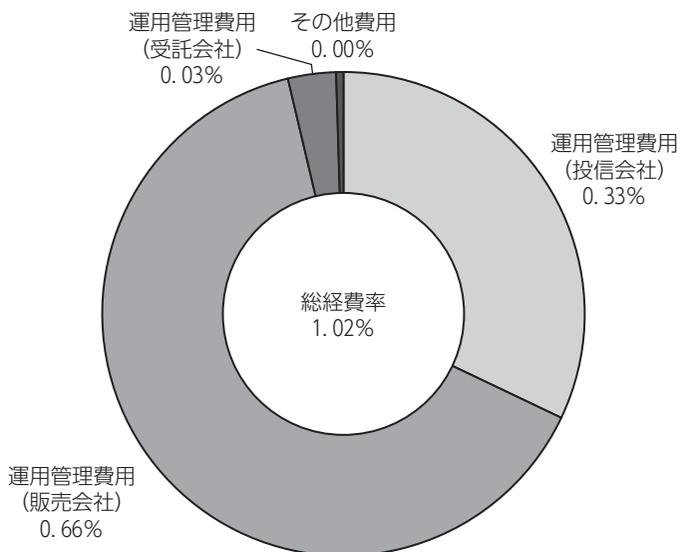
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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まず。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1.02%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

(2019年6月29日から2020年6月29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・マザーファンド	59,162,043	60,190,000	70,888,553	72,120,000

(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

(2019年6月29日から2020年6月29日まで)

銘 柄 別			買 建		売 建		当 作 成 期 末 評 価 額		
			新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評価損益
国 内 株 式	日経平均	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	
		870,540	959,253	—	—	122,068	—	△4,840	

(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

(2019年6月29日から2020年6月29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	870,540	526,604	60.5	959,253	562,958	58.7
コール・ローン	4,858,853	—	—	—	—	—

(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

(2019年6月29日から2020年6月29日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	46,437千円
うち利害関係人への支払額 (B)	27,659千円
(B) / (A)	59.6%

(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

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	31,111,980	19,385,471	19,718,901

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月29日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	19,718,901	42.7
コール・ローン等、その他	26,415,238	57.3
投資信託財産総額	46,134,139	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6月29日現在

項目	当期末
(A) 資産	46,134,139,409円
コール・ローン等	17,013,926,231
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	19,718,901,278
差入委託証拠金	9,401,311,900
(B) 負債	5,684,122,509
未払金	5,019,714,700
未払解約金	458,290,910
未払信託報酬	204,999,493
その他未払費用	1,117,406
(C) 純資産総額 (A - B)	40,450,016,900
元本	50,881,113,838
次期繰越損益金	△ 10,431,096,938
(D) 受益権総口数	50,881,113,838口
1万口当り基準価額 (C / D)	7,950円

* 期首における元本額は81,717,605,820円、当作成期間中における追加設定元本額は160,205,248,306円、同解約元本額は191,041,740,288円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,950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10,431,096,938円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月29日 至 2020年6月29日

項目	当	期
(A) 配当等収益	△	2,235,618円
受取利息		7,532,019
支払利息	△	9,767,637
(B) 有価証券売買損益	△	3,760,471
売買益		2,068,279
売買損	△	5,828,750
(C) 先物取引等損益		3,387,322,366
取引益		38,302,585,239
取引損	△	34,915,262,873
(D) 信託報酬等	△	516,322,289
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)		2,865,003,988
(F) 前期繰越損益金	△	137,418,818
(G) 追加信託差損益金	△	13,158,682,108
(配当等相当額)	(△)	15,119,324)
(売買損益相当額)	(△)	13,143,562,784)
(H) 合計 (E + F + G)	△	10,431,096,938
次期繰越損益金 (H)	△	10,431,096,938
追加信託差損益金	△	13,158,682,108
(配当等相当額)	(△)	15,119,324)
(売買損益相当額)	(△)	13,143,562,784)
分配準備積立金		2,729,820,788
繰越損益金	△	2,235,618

(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		2,729,820,788
(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)		2,729,820,788
(f) 分配金		0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		2,729,820,788
(h) 受益権総口数		50,881,113,838口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

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

(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。

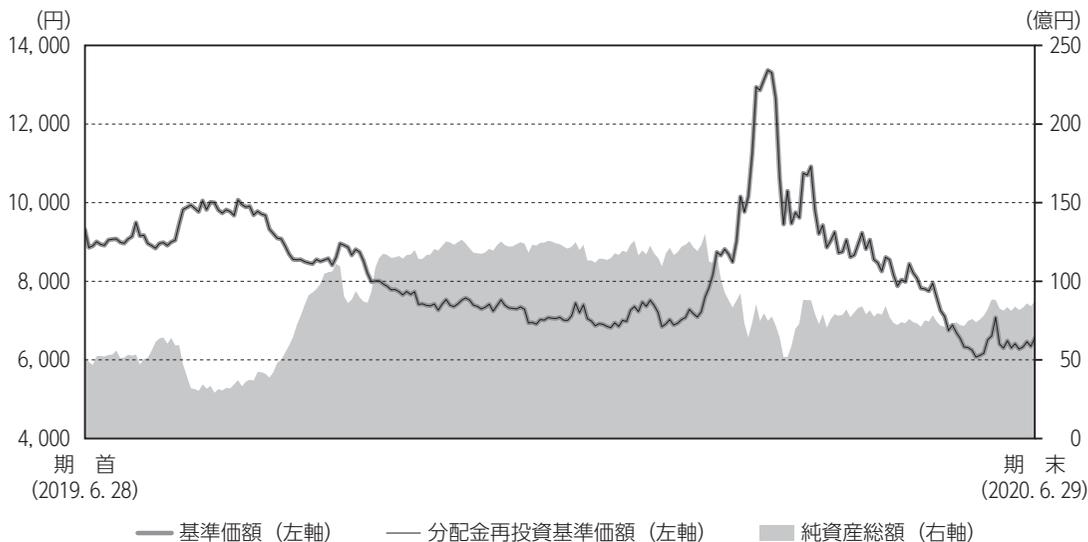
(注4) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

基準価額・騰落率

期首：9,310円

期末：6,553円（分配金0円）

騰落率：△29.6%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

日々の基準価額の値動きがわが国の株式市場の値動きの2倍程度逆となる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「投資環境について」および「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		
(期首)2019年6月28日	円	%	円	%	%	%
	9,310	—	21,275.92	—	△ 200.2	—
7月末	9,001	△ 3.3	21,521.53	1.2	△ 184.5	—
8月末	9,686	4.0	20,704.37	△ 2.7	△ 226.9	—
9月末	8,580	△ 7.8	21,755.84	2.3	△ 206.6	—
10月末	7,665	△ 17.7	22,927.04	7.8	△ 203.2	—
11月末	7,414	△ 20.4	23,293.91	9.5	△ 202.5	—
12月末	7,121	△ 23.5	23,656.62	11.2	△ 195.1	—
2020年1月末	7,364	△ 20.9	23,205.18	9.1	△ 205.0	—
2月末	8,740	△ 6.1	21,142.96	△ 0.6	△ 177.0	—
3月末	9,617	3.3	18,917.01	△ 11.1	△ 218.0	—
4月末	8,256	△ 11.3	20,193.69	△ 5.1	△ 204.8	—
5月末	6,886	△ 26.0	21,877.89	2.8	△ 207.3	—
(期末)2020年6月29日	6,553	△ 29.6	21,995.04	3.4	△ 198.6	—

(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

(2019. 6. 29 ~ 2020. 6. 29)

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、当作成期首より、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことなどが支えとなり、底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、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下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、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2月後半から3月中旬にかけて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を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感されました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、「ダイワ・マネー・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

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

(2019. 6. 29 ~ 2020. 6. 29)

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・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。

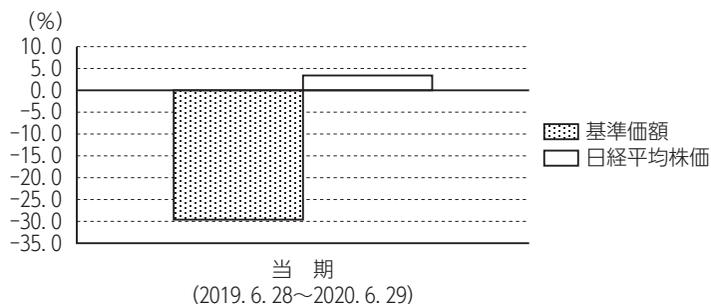
ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、現先取引やコール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマーク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、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	
	2019年6月29日 ～2020年6月29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・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

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 (2019. 6. 29~2020. 6. 29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	84円	1.021%	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8,276円です。
(投 信 会 社)	(27)	(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)	(55)	(0.659)	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	0.076	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)	(0.076)	
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	0.006	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	91	1.102	

(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。

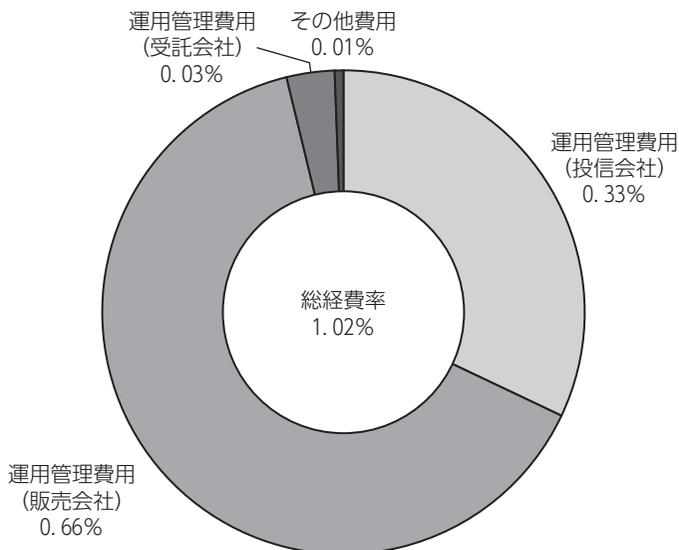
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.02%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

(2019年6月29日から2020年6月29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・マザーファンド	10,222,092	10,400,000	8,649,779	8,800,000

(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

(2019年6月29日から2020年6月29日まで)

銘 柄 別			買 建		売 建		当 作 成 期 末 評 価 額		
			新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評価損益
国 内	株 式	日経平均	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
			—	—	140,928	135,167	—	17,353	421

(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

(2019年6月29日から2020年6月29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	135,167	12,126	9.0	140,928	15,400	10.9
コール・ローン	884,077	—	—	—	—	—

(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

(2019年6月29日から2020年6月29日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	7,041千円
うち利害関係人への支払額 (B)	711千円
(B) / (A)	10.1%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	3,093,608	4,665,921	4,746,175

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	4,746,175	51.8
コール・ローン等、その他	4,416,618	48.2
投資信託財産総額	9,162,793	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6月29日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,931,300,528円
コール・ローン等	3,050,018,033
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	4,746,175,345
未収入金	421,197,150
差入委託証拠金	713,910,000
(B) 負債	195,313,944
未払解約金	148,133,678
未払信託報酬	46,918,237
その他未払費用	262,029
(C) 純資産総額 (A - B)	8,735,986,584
元本	13,331,200,638
次期繰越損益金	△ 4,595,214,054
(D) 受益権総口数	13,331,200,638口
1万口当り基準価額 (C/D)	6,553円

* 期首における元本額は5,532,345,581円、当作成期間中における追加設定元本額は78,830,044,361円、同解約元本額は71,031,189,304円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は6,553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4,595,214,054円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月29日 至 2020年6月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 247,359円
受取利息	1,332,856
支払利息	△ 1,580,215
(B) 有価証券売買損益	△ 537,649
売買益	965,810
売買損	△ 1,503,459
(C) 先物取引等損益	△ 1,565,390,195
取引益	5,114,940,059
取引損	△ 6,680,330,254
(D) 信託報酬等	△ 90,381,490
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 1,656,556,693
(F) 前期繰越損益金	△ 35,685
(G) 追加信託差損益金	△ 2,938,621,676
(配当等相当額)	(△ 6,298,889)
(売買損益相当額)	(△ 2,932,322,787)
(H) 合計 (E + F + G)	△ 4,595,214,054
次期繰越損益金 (H)	△ 4,595,214,054
追加信託差損益金	△ 2,938,621,676
(配当等相当額)	(△ 6,298,889)
(売買損益相当額)	(△ 2,932,322,787)
繰越損益金	△ 1,656,592,378

(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「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	13,331,200,638口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

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	
							33,048

(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。

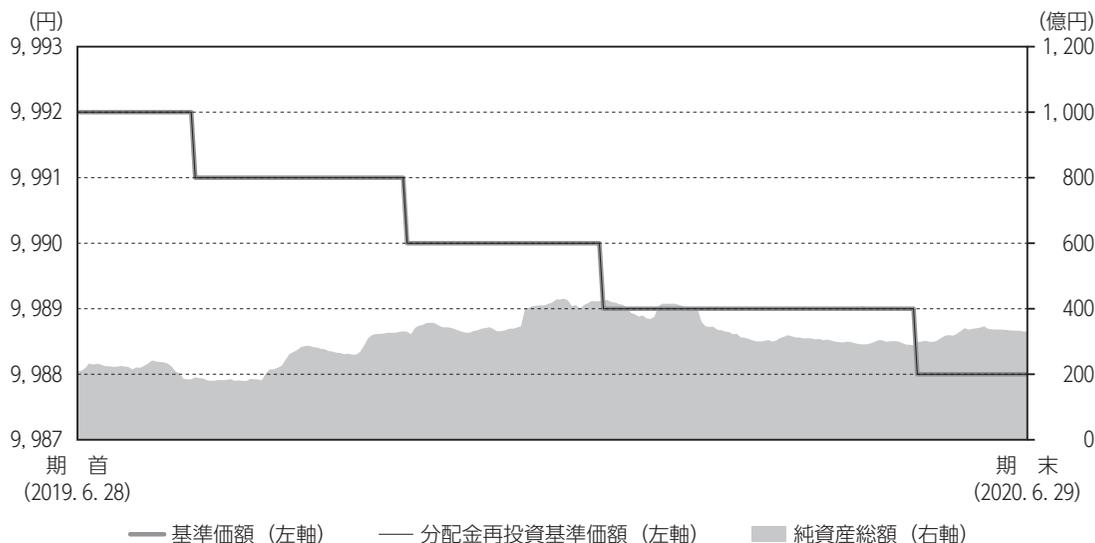
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：9,992円

期末：9,988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・マザーファンド」の受益証券を通じて投資したコール・ローン等の利回りが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
	円	騰 落 率 %	
(期首) 2019年 6月28日	9,992	—	—
7月末	9,992	0.0	—
8月末	9,991	△ 0.0	—
9月末	9,991	△ 0.0	—
10月末	9,991	△ 0.0	—
11月末	9,990	△ 0.0	—
12月末	9,990	△ 0.0	—
2020年 1月末	9,989	△ 0.0	—
2月末	9,989	△ 0.0	—
3月末	9,989	△ 0.0	—
4月末	9,989	△ 0.0	—
5月末	9,988	△ 0.0	—
(期末) 2020年 6月29日	9,988	△ 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

(2019. 6. 29 ~ 2020. 6. 29)

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。

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・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・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

(2019. 6. 29 ~ 2020. 6. 29)

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

流動性や資産の安全性に配慮し、現先取引やコール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2019年6月29日 ～2020年6月29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）	6

（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・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・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 (2019. 6. 29~2020. 6. 29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	0円	0.000%	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9,990円です。
(販売会社)	(0)	(0.000)	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
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)	(0.001)	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。

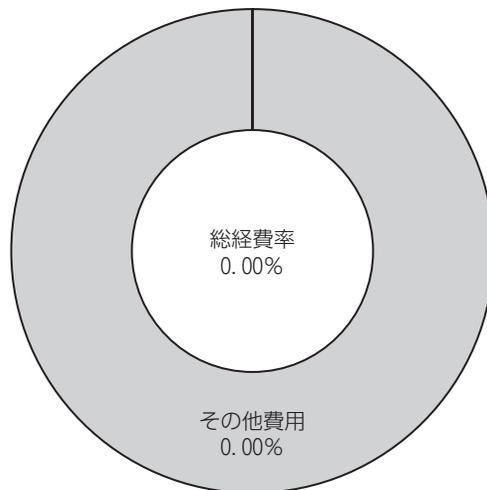
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2019年6月29日から2020年6月29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	59,279,772	60,311,984	47,645,285	48,473,661

(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	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネー・マザーファンド	20,692,811	32,327,298	32,883,328

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネー・マザーファンド	32,883,328	97.6
コール・ローン等、その他	822,615	2.4
投資信託財産総額	33,705,943	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6月29日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	33,705,943,889円
コール・ローン等	822,615,419
ダイワ・マネー・マザーファンド (評価額)	32,883,328,470
(B) 負債	657,375,769
未払解約金	657,259,024
未払信託報酬	18,733
その他未払費用	98,012
(C) 純資産総額 (A - B)	33,048,568,120
元本	33,089,350,160
次期繰越損益金	△ 40,782,040
(D) 受益権総口数	33,089,350,160口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,988円

* 期首における元本額は21,133,181,981円、当作成期間中における追加設定元本額は153,359,222,615円、同解約元本額は141,403,054,436円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,988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40,782,040円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月29日 至 2020年6月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 113,922円
受取利息	379,022
支払利息	△ 492,944
(B) 有価証券売買損益	△ 3,395,044
売買益	5,549,133
売買損	△ 8,944,177
(C) 信託報酬等	△ 211,230
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 3,720,196
(E) 前期繰越損益金	△ 37,803
(F) 追加信託差損益金	△ 37,024,041
(配当等相当額)	(10,173,929)
(売買損益相当額)	(△ 47,197,970)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 40,782,040
次期繰越損益金 (G)	△ 40,782,040
追加信託差損益金	△ 37,024,041
(配当等相当額)	(10,173,929)
(売買損益相当額)	(△ 47,197,970)
分配準備積立金	9,978,340
繰越損益金	△ 13,736,339

(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「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	9,881,841
(c) 収益調整金	10,173,929
(d) 分配準備積立金	96,499
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	20,152,269
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	20,152,269
(h) 受益権総口数	33,089,350,160口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・ブルベア・ファンドV）が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2019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（2020年6月29日）現在におけるダイワ・マネー・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・マザーファンドの主要な売買銘柄

2019年6月29日～2020年6月29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

下記は、2020年6月29日現在におけるダイワ・マネー・マザーファンド（65,195,424千円）の内容です。

国内その他有価証券

	2020年6月29日現在	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999,981	<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。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第15期（決算日 2019年12月9日）

（作成対象期間 2018年12月11日～2019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。

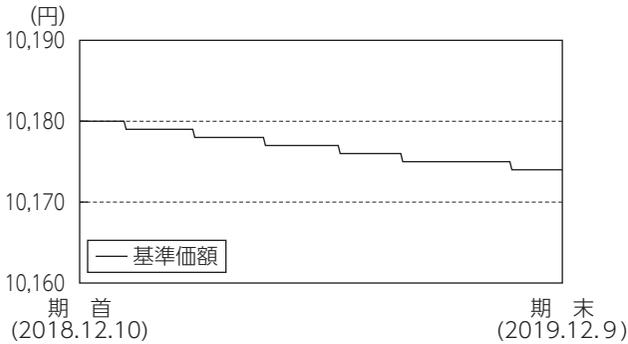
運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行いません。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
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)2018年12月10日	円	%	%
12月末日	10,180	-	-
2019年1月末日	10,180	0.0	-
2月末日	10,179	△0.0	-
3月末日	10,178	△0.0	-
4月末日	10,178	△0.0	-
5月末日	10,177	△0.0	-
6月末日	10,176	△0.0	-
7月末日	10,176	△0.0	-
8月末日	10,175	△0.0	-
9月末日	10,175	△0.0	-
10月末日	10,175	△0.0	-
11月末日	10,174	△0.1	-
(期末)2019年12月9日	10,174	△0.1	-

- (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：10,180円 期末：10,174円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

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。

◆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、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。

《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の「1万口当りの費用の明細」の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

(1) 公 社 債

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国債証券	350,004	(350,000)

- (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、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。

(2) その他有価証券

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国内短期社債等	238,999,542	(238,999,547)

- (注1) 金額は受渡し代金。
- (注2) ()内は償還による減少分、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。

ダイワ・マネー・マザーファンド

■主要な売買銘柄 公 社 債

(2018年12月11日から2019年12月9日まで)

当 期		期 末	
買 付	売 付	買 付	売 付
銘	柄 金 額	銘	柄 金 額
	千円		千円
801 国庫短期証券 2019/3/18	350,004		

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

■組入資産明細表 国内その他有価証券

	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内短期社債等	999,997	<1.2>

(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

2019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	83,690,918	100.0
投資信託財産総額	83,690,918	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

2019年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	83,690,918,350円
コール・ローン等	82,690,920,679
現先取引(その他有価証券)	999,997,671
(B) 負債	51,646
その他未払費用	51,646
(C) 純資産総額(A-B)	83,690,866,704
元本	82,259,129,638
次期繰越損益金	1,431,737,066
(D) 受益権総口数	82,259,129,638口
1万口当り基準価額(C/D)	10,174円

* 期首における元本額は78,610,288,449円、当作成期間中における追加設定元本額は112,484,550,034円、同解約元本額は108,835,708,845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) 1,850,319,411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® 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、NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>

米ドルコース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース981円、NBストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>世界通貨分散コース981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、DCダイワ・マネー・ポートフォリオ4,249,607,706円、ダイワファンドラップ コモディティセレクト317,107,941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-9,853,995円、低リスク型アロケーションファンドII (適格機関投資家専用) 4,212,646,194円、プルベア・マネー・ポートフォリオV 32,678,414,397円、プル3倍日本株ポートフォリオV 31,868,647,270円、ベア2倍日本株ポートフォリオV 6,946,381,074円、ダイワF Eグローバル・バリュー株ファンド (ダイワSMA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 109,485,524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・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980,367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10,174円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月11日 至2019年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 42,819,286円
受取利息	111,756
支払利息	△ 42,931,042
(B) その他費用	△ 2,381,736
(C) 当期損益金(A+B)	△ 45,201,022
(D) 前期繰越損益金	1,418,229,476
(E) 解約差損益金	△ 1,927,237,136
(F) 追加信託差損益金	1,985,945,748
(G) 合計(C+D+E+F)	1,431,737,066
次期繰越損益金(G)	1,431,737,066

(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。