

# NYダウ・トリプル・レバレッジ (愛称：3σ)

## 運用報告書(全体版) 第3期

(決算日 2023年3月29日)

(作成対象期間 2022年3月30日～2023年3月29日)

★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	2020年3月30日～2030年3月29日	
運用方針	日々の基準価額の値動きがダウ・ジョーンズ工業株価平均(米ドルベース)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。	
主要投資対象	ベビーファンド	米国の株価指数先物取引、米国の債券、わが国の債券およびダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーポートフォリオ・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	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	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、分配を行なわないことがあります。	

### 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ダウ・ジョーンズ工業株価平均(米ドルベース)の値動きの3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			ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (配当込み、米ドルベース)		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)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2021年 3月29日)	29,140	0	191.4	15,619	56.2	—	305.7	—	1,577
2 期末 (2022年 3月29日)	33,541	0	15.1	16,818	7.7	—	296.0	—	4,256
3 期末 (2023年 3月29日)	22,617	0	△ 32.6	15,922	△ 5.3	—	300.7	—	3,727

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (配当込み、米ドルベース) は、ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (配当込み、米ドルベース) 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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注6) 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。

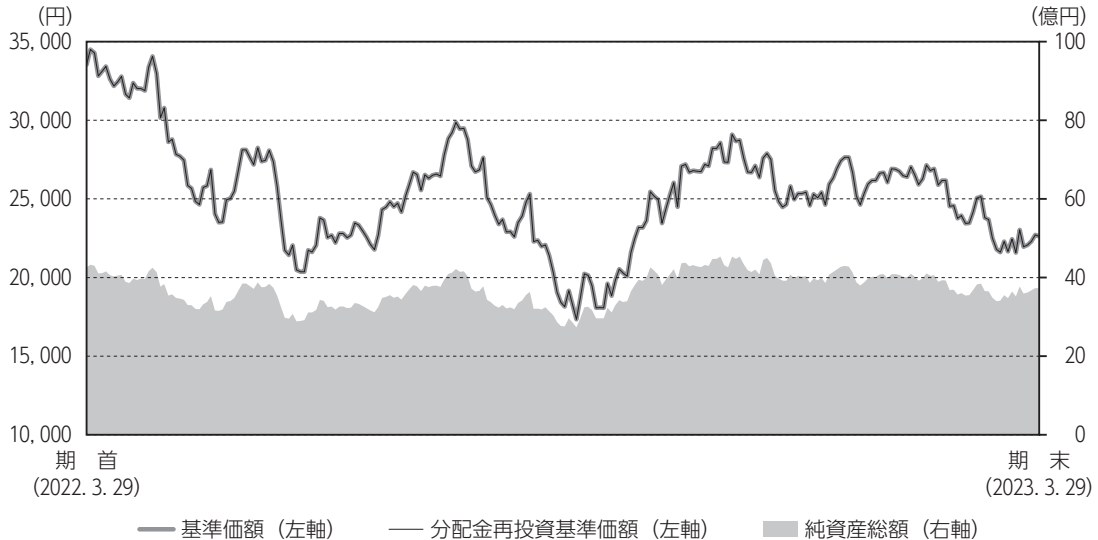
※参考指数を「ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (米ドルベース)」から「ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (配当込み、米ドルベース)」に変更しました。

ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (配当込み) は S&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社 (「SPDJII」) の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P<sup>®</sup>、S & P 500<sup>®</sup>、US 500、The 500、iBoxx<sup>®</sup>、iTraxx<sup>®</sup> および CDX<sup>®</sup> は、S&P Global, Inc. またはその関連会社 (「S & P」) の商標です。Dow Jones<sup>®</sup> は、Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは SP DJI に付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。NYダウ・トリプル・レバレッジは、SP DJI、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (配当込み) のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。



## 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、当学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：33,541円

期末：22,617円（分配金0円）

騰落率：△32.6%（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ダウ・ジョーンズ工業株価平均（米ドルベース）の値動きの3倍程度となることをめざした運用を行った結果、米国株式市況が下落したことにより、基準価額が下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

# NYダウ・トリプル・レバレッジ

年 月 日	基 準 価 額		ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (配当込み、米ドルベース)		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)	騰 落 率			
(期首)2022年3月29日	33,541	—	16,818	—	—	296.0	—
3月末	34,282	2.2	16,949	0.8	—	298.9	—
4月末	28,784	△ 14.2	16,036	△ 4.6	—	303.2	—
5月末	28,112	△ 16.2	16,033	△ 4.7	—	300.9	—
6月末	22,683	△ 32.4	15,007	△ 10.8	—	298.4	—
7月末	25,908	△ 22.8	15,748	△ 6.4	—	300.0	—
8月末	23,944	△ 28.6	15,427	△ 8.3	—	300.7	—
9月末	18,253	△ 45.6	14,211	△ 15.5	—	302.0	—
10月末	25,449	△ 24.1	15,995	△ 4.9	—	298.7	—
11月末	27,319	△ 18.6	16,515	△ 1.8	—	298.5	—
12月末	25,300	△ 24.6	16,240	△ 3.4	—	299.3	—
2023年1月末	26,054	△ 22.3	16,498	△ 1.9	—	298.9	—
2月末	23,937	△ 28.6	16,130	△ 4.1	—	300.7	—
(期末)2023年3月29日	22,617	△ 32.6	15,922	△ 5.3	—	300.7	—

(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

(2022. 3. 30 ~ 2023. 3. 29)

## ■米国株式市況

米国株式市況は、2022年10月まで下落し、その後は一進一退で推移しました。

米国株式市況は、当作成期首より、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから、下落しました。2022年6月半ばにF R Bが利上げ幅の拡大を決定した後は悪材料出尽くし観測から上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトするとの期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇が続きしました。10月半ばにかけては、予想以上のインフレ率の上昇や英国の財政悪化懸念などで欧米の金利が上昇したこと、企業業績の見通しの下方修正が相次いだことなどが嫌気されて下落し、当作成期中の安値を記録しました。11月末にかけては、英国市場の混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国のインフレ率が予想を下回ったことなどが好感されて上昇しました。年末にかけては米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから下落しましたが、2023年に入ると賃金上昇率の伸びが鈍化しF R Bの利上げペース鈍化期待などから上昇しました。2月から3月半ばにかけては予想を上回る経済指標の発表が相次ぎ金利が上昇したことや、米国の地方銀行の経営破綻を受けて下落しましたが、その後当作成期末にかけてはF R Bによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことや、金利が急低下したことなどが好感され、成長株を中心に上昇しました。

## ■前作成期末における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と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ダウ・ジョーンズ工業株価平均（米ドルベース）の値動きの3倍程度となることをめざします。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。

## ■ダイワ・マネーポートフォリオ・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

(2022. 3. 30 ~ 2023. 3. 29)

## ■当ファンド

米国の株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、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。「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。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。

米国の株価指数先物取引については、E-mini ダウ先物取引を利用しました。米国の株式への直接投資は行っておりません。

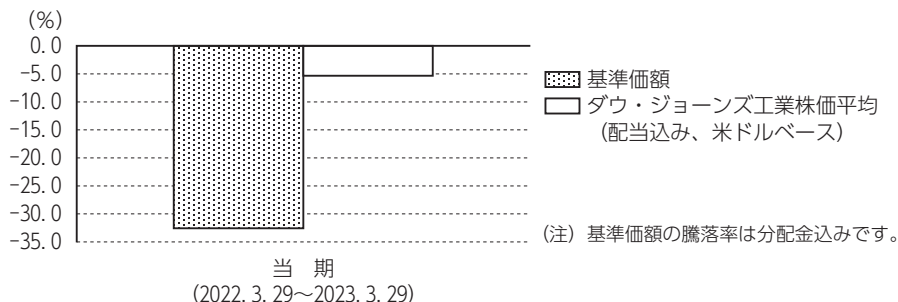
## ■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

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	
	2022年3月30日 ～2023年3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）	12,638

- （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。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



## 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、主として、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と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ダウ・ジョーンズ工業株価平均（米ドルベース）の値動きの3倍程度となることをめざします。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。

### ダイワ・マネーポートフォリオ・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 (2022. 3. 30～2023. 3. 29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	278円	1.100%	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25,296円です。
(投 信 会 社)	(136)	(0.536)	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)	(136)	(0.536)	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)	(7)	(0.027)	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	18	0.071	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)	(18)	(0.071)	
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	4	0.016	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)	(3)	(0.011)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	300	1.187	

(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。

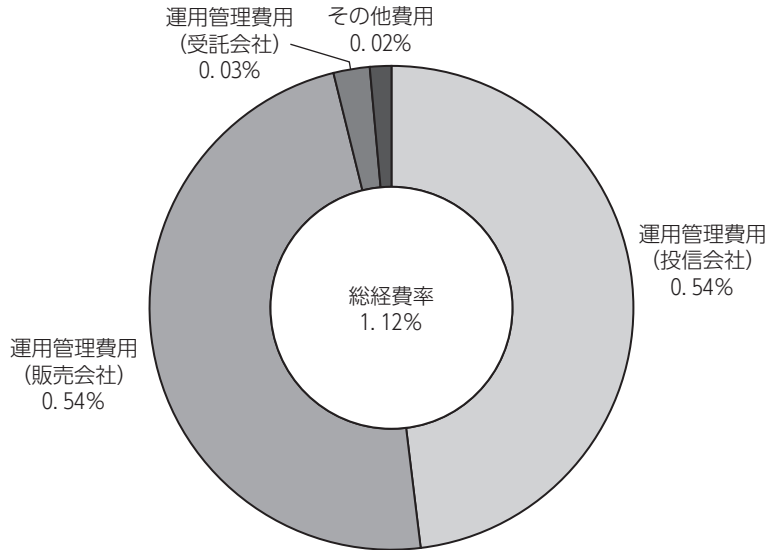
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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。

## NYダウ・トリプル・レバレッジ

### ■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

(2022年3月30日から2023年3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 ポートフォリオ・ マザーファンド	942,062	943,723	1,257,044	1,259,245

(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

(2022年3月30日から2023年3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
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
外 株 国 式	DJIA MINI E-CBOT (アメリカ)	69,936	70,769	—	—	11,208	—	163

(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	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	1,506,712	1,191,729	1,193,755	

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2023年3月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネーポートフォリオ・ マザーファンド	1,193,755	31.5
コール・ローン等、その他	2,590,277	68.5
投資信託財産総額	3,784,032	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、3月29日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝131.28円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(1,454,726千円)の投資信託財産総額(3,784,032千円)に対する比率は、38.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年3月29日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>5, 235, 224, 296円</b>
コール・ローン等	1, 082, 625, 987
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（評価額）	1, 193, 755, 235
未収入金	1, 667, 988, 495
差入委託証拠金	1, 290, 854, 579
<b>(B) 負債</b>	<b>1, 508, 066, 832</b>
未払金	1, 454, 486, 943
未払解約金	32, 340, 751
未払信託報酬	21, 133, 558
その他未払費用	105, 580
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>3, 727, 157, 464</b>
元本	1, 647, 948, 833
次期繰越損益金	2, 079, 208, 631
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1, 647, 948, 833口</b>
1万口当り基準価額（C／D）	22, 617円

\*期首における元本額は1, 268, 925, 982円、当作成期間中における追加設定元本額は1, 944, 008, 674円、同解約元本額は1, 564, 985, 823円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は22, 617円です。

■損益の状況

当期 自 2022年3月30日 至 2023年3月29日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>34, 303, 173円</b>
受取利息	1, 557
その他収益金	34, 502, 286
支払利息	△ 200, 670
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 4, 909, 487</b>
売買益	580, 305, 157
売買損	△ 585, 214, 644
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>△ 665, 036, 456</b>
取引益	1, 297, 686, 940
取引損	△ 1, 962, 723, 396
<b>(D) 信託報酬等</b>	<b>△ 41, 346, 159</b>
<b>(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）</b>	<b>△ 676, 988, 929</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 456, 715</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>2, 756, 654, 275</b>
（配当等相当額）	（ 762, 192, 346）
（売買損益相当額）	（ 1, 994, 461, 929）
<b>(H) 合計（E＋F＋G）</b>	<b>2, 079, 208, 631</b>
<b>次期繰越損益金（H）</b>	<b>2, 079, 208, 631</b>
追加信託差損益金	2, 756, 654, 275
（配当等相当額）	（ 762, 192, 346）
（売買損益相当額）	（ 1, 994, 461, 929）
分配準備積立金	3, 171, 866
繰越損益金	△ 680, 617, 510

（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の指図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：4, 257, 979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	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	2, 079, 665, 346
(d) 分配準備積立金	3, 171, 866
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	2, 082, 837, 212
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	2, 082, 837, 212
(h) 受益権総口数	1, 647, 948, 833口

<補足情報>

当ファンド（NYダウ・トリプル・レバレッジ）が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の決算日（2022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（2023年3月29日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄

2022年3月30日～2023年3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

2023年3月29日現在、有価証券等の組み入れはありません。

# ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書 第14期 (決算日 2022年12月9日)

(作成対象期間 2021年12月10日～2022年12月9日)

ダイワ・マネーポートフォリオ・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。

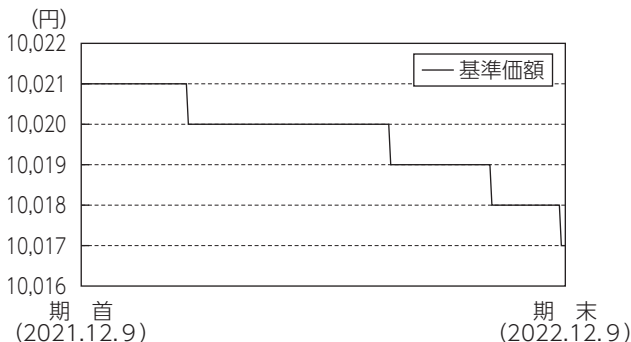
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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		
(期首)2021年12月9日	円	%	%
	10,021	-	-
12月末	10,021	0.0	-
2022年1月末	10,021	0.0	-
2月末	10,021	0.0	-
3月末	10,020	△0.0	-
4月末	10,020	△0.0	-
5月末	10,020	△0.0	-
6月末	10,020	△0.0	-
7月末	10,020	△0.0	-
8月末	10,019	△0.0	-
9月末	10,019	△0.0	-
10月末	10,018	△0.0	-
11月末	10,018	△0.0	-
(期末)2022年12月9日	10,017	△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：10,021円 期末：10,017円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。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	-
合 計	-

(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

2022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	44,934,654	100.0
投資信託財産総額	44,934,654	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12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	44,934,654,863円
コール・ローン等	44,934,654,863
(B) 負債	1,205,058
未払解約金	1,205,058
(C) 純資産総額(A - B)	44,933,449,805
元本	44,855,160,815
次期繰越損益金	78,288,990
(D) 受益権総口数	44,855,160,815口
1万口当り基準価額(C/D)	10,017円

\* 期首における元本額は94,938,109,576円、当作成期間中における追加設定元本額は94,531,696,979円、同解約元本額は144,614,645,740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：

ダイワ米ドル・ブルファンド (適格機関投資家専用)	3,974,859,681円
ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用)	9,984,542,130円
ダイワ・マネーポートフォリオ (F O F 専用) (適格機関投資家専用)	1,089,639円
ダイワJリートベア・ファンド (適格機関投資家専用)	2,083,616,103円
米国国債プラス日本株式ファンド2021-01 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	1,518,511円
米国国債プラス日本株式ファンド2021-07 (部分為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	9,980,330円
ダイワ/バリュー・パートナーズ チャイナ・ヘルスケア・フォーカス	9,976円
通貨選択型 米国リート・αクワトロ (毎月分配型)	159,141円
通貨選択型アメリカン・エクイティ・αクワトロ (毎月分配型)	159,141円
オール・マーケット・インカム戦略 (資産成長重視コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (奇数月定額分配コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (奇数月定率分配コース)	9,963円
オール・マーケット・インカム戦略 (予想分配金提示型コース)	9,963円
NYダウ・トリプル・レバレッジ	1,486,750,161円
世界セレクトティブ株式オープン (為替ヘッジあり/年1回決算型)	998円
世界セレクトティブ株式オープン (為替ヘッジあり/年2回決算型)	998円
FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ	992,420円
ポーレン米国グロース株式ファンド (資産成長型)	998円
ポーレン米国グロース株式ファンド (予想分配金提示型)	998円
トレンド・キャッチ戦略ファンド	9,977円
AHLターゲットリスク・ライト戦略ファンド (適格機関投資家専用)	8,364,886,518円
ダイワJGBベア・ファンド2 (適格機関投資家専用)	18,942,942,107円
ダイワ/ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド	2,417,017円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド (通貨選択型) アジア通貨・コース (毎月分配型)	998円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券α (毎月分配型)	9,949円
ダイワ米国債7-10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - USトライアングル -	997,374円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -	173,802円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,017円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月10日 至2022年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 16,492,067円
支払利息	△ 16,492,067
(B) 当期損益金(A)	△ 16,492,067
(C) 前期繰越損益金	201,304,649
(D) 解約差損益金	△293,300,613
(E) 追加信託差損益金	186,777,021
(F) 合計(B + C + D + E)	78,288,990
次期繰越損益金(F)	78,288,990

(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。