

★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13期

（決算日 2024年4月18日）

（作成対象期間 2023年4月19日～2024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 (税引後配当込み、円換算)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資 産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
9 期末(2020年4月20日)	円 12,282	円 0	% △28.3	24,381	% △ 8.4	% 96.4	% -	百万円 5,016
10期末(2021年4月19日)	20,047	2,200	81.1	36,721	50.6	96.0	-	6,828
11期末(2022年4月18日)	21,066	650	8.3	44,023	19.9	95.6	-	6,772
12期末(2023年4月18日)	22,224	100	6.0	45,278	2.9	96.9	-	6,216
13期末(2024年4月18日)	24,332	2,100	18.9	61,307	35.4	94.5	-	6,078

(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(税引後配当込み、円換算)は、MSCI Inc. (「MSCI」)の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(税引後配当込み、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(税引後配当込み、米ドルベース)は、MSCIが開発した指数です。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に帰属します。またMSCI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。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。(https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html)

(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。

※参考指数を「MSCIコクサイ指数(配当込み、円換算)」から「MSCIコクサイ指数(税引後配当込み、円換算)」に変更しました。



## 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：22,224円

期末：24,332円 (分配金2,100円)

騰落率：18.9% (分配金込み)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

海外株式市況が上昇したことや、米ドルなどが対円で上昇 (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 (税引後配当込み、円換算)		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2023年 4月18日	円 22,224	% -	45,278	% -	% 96.9	% -
4 月末	22,023	△ 0.9	44,984	△ 0.6	97.3	-
5 月末	22,596	1.7	47,097	4.0	95.9	-
6 月末	24,362	9.6	50,815	12.2	96.6	-
7 月末	24,671	11.0	51,585	13.9	98.6	-
8 月末	24,797	11.6	52,461	15.9	96.8	-
9 月末	24,051	8.2	51,181	13.0	96.0	-
10月末	22,508	1.3	49,464	9.2	96.3	-
11月末	23,855	7.3	53,318	17.8	96.7	-
12月末	24,512	10.3	54,312	20.0	97.3	-
2024年 1 月末	25,331	14.0	57,559	27.1	97.7	-
2 月末	25,938	16.7	60,340	33.3	96.5	-
3 月末	27,254	22.6	62,861	38.8	98.3	-
(期末) 2024年 4月18日	26,432	18.9	61,307	35.4	94.5	-

(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

(2023.4.19～2024.4.18)

### ■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、米国の地方銀行の経営不安や債務上限問題への懸念が上値を抑えた一方で、予想を上回る米国企業決算の発表が好感され、底堅い展開となりました。2023年5月下旬からは、AI（人工知能）関連の半導体企業の強気見通しや米国債務上限問題の解決などが好感され、上昇しました。8月以降は、米国国債の増発やFRB（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げなどによる長期金利の大幅な上昇、パレスチナ情勢の悪化などが嫌気され、10月末にかけて下落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、FRB議長が将来の利下げについての議論を始めたことを受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、上昇しました。2024年1月以降も、欧米でインフレ率の鈍化傾向が継続したことやAI関連の半導体関連企業が良好な決算を発表したことなどが好感され、当作成期末にかけて上昇しました。

### ■為替相場

対円為替相場は上昇しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇する中、上昇して始まりました。2023年6月に入ると、FRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利見直しを引き上げた一方で、日銀は現状の金融緩和政策の維持を決定したことなどから、米ドルは対円での上昇幅を拡大しました。7月は中旬にかけて、日本の政府要人等による円安けん制発言や日銀の政策運営の柔軟化決定を受け、米ドルは対円で下落（円高）しましたが、その後は、米国金利の上昇による日米金利差の拡大が意識され、11月上旬にかけて上昇しました。11月半ばに入ると、日銀による政策修正や米国金利の大幅な低下を受けて下落に転じましたが、2024年に入ってから、米国金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に円安米ドル高に転じました。3月には、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどから、当作成期末にかけて円安基調が継続しました。その他の通貨も米ドル円に連れる展開となり、堅調な推移となりました。

## 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

(2023.4.19～2024.4.18)

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。

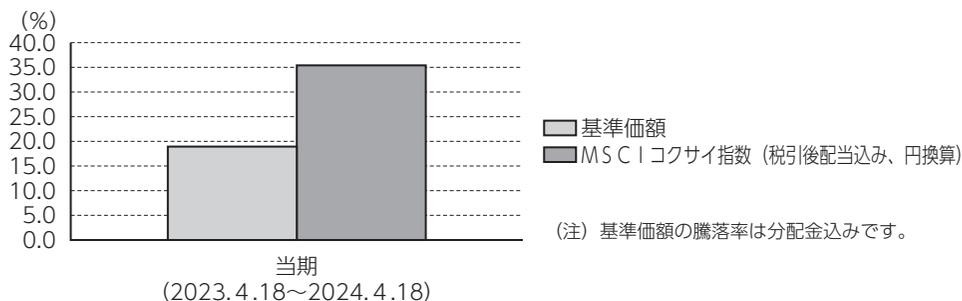
銘柄選定にあたって、ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資しました。

個別銘柄では、LLOYDS BANKING GROUP PLC（英国、金融）、ALPHABET（米国、コミュニケーション・サービス）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	
	2023年4月19日 ～2024年4月18日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>2,100</b>
対基準価額比率	（％）	7.94
当期の収益	（円）	2,100
当期の収益以外	（円）	-
翌期繰越分配対象額	（円）	14,331

（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。

### ■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	✓	498.73円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	3,680.75
(c) 収益調整金		3,868.02
(d) 分配準備積立金		8,384.06
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		16,431.58
(f) 分配金		2,100.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		14,331.58

（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 (2023.4.19~2024.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	482円	1.980%	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24,359円です。
(投 信 会 社)	(281)	(1.155)	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)	(188)	(0.770)	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)	(13)	(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	8	0.032	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)	(8)	(0.032)	
有 価 証 券 取 引 税	6	0.025	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)	(6)	(0.025)	
そ の 他 費 用	17	0.070	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)	(14)	(0.059)	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)	(1)	(0.006)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	514	2.108	

(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。

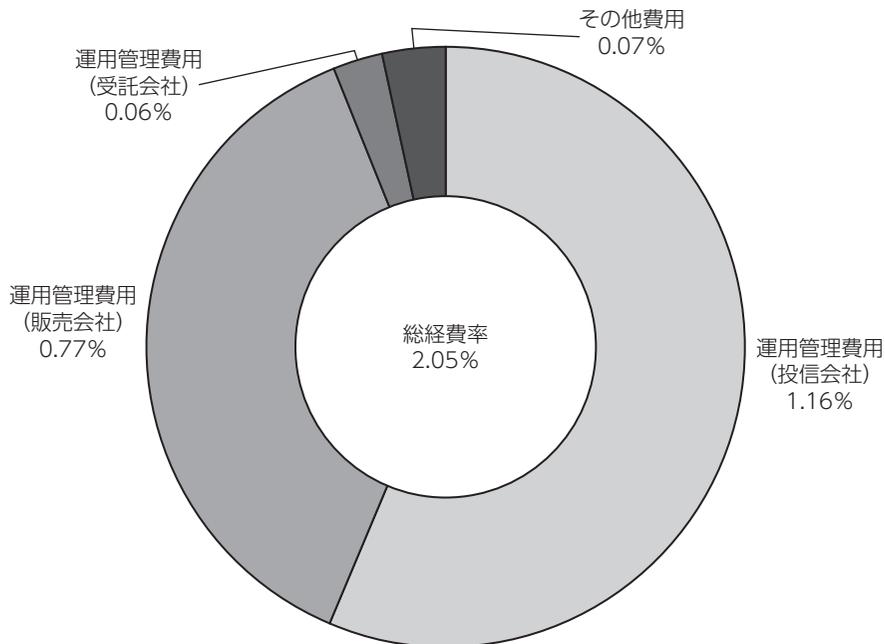
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.05%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  
株式

(2023年4月19日から2024年4月18日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 1,958.7 ( 1,386.45)	千アメリカ・ドル 11,662 ( 1,788)	百株 2,779.58	千アメリカ・ドル 18,059
	香港	百株 151 ( -)	千香港ドル 1,123 ( -)	百株 454	千香港ドル 3,921
	イギリス	百株 5,240 ( -)	千イギリス・ポンド 1,156 (△ 65)	百株 9,800	千イギリス・ポンド 1,058
	スイス	百株 97.95 ( 12.24)	千スイス・フラン 910 ( -)	百株 107.64	千スイス・フラン 715
	韓国	百株 - ( -)	千韓国ウォン - ( -)	百株 86.35	千韓国ウォン 533,030
	ユーロ (オランダ)	百株 542 (△1,186.42)	千ユーロ 649 (△ 1,739)	百株 46.95	千ユーロ 150
	ユーロ (ベルギー)	百株 3.55 ( -)	千ユーロ 18 ( -)	百株 74.8	千ユーロ 415
	ユーロ (フランス)	百株 24.3 ( -)	千ユーロ 833 ( -)	百株 33.85	千ユーロ 754
	ユーロ (ドイツ)	百株 247.95 ( -)	千ユーロ 876 ( -)	百株 429.3	千ユーロ 3,087
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 817.8 (△1,186.42)	千ユーロ 2,377 (△ 1,739)	百株 584.9	千ユーロ 4,408

(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。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2023年4月19日から2024年4月18日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	6,267,780千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,244,562千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.00

(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

(2023年4月19日から2024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
IQVIA HOLDINGS INC (アメリカ)		5.94	182,607	30,742	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		17.665	320,005	18,115
ENVISTA HOLDINGS CORP (アメリカ)		33.8	148,903	4,405	KKR & CO INC (アメリカ)		17.25	220,700	12,794
BAYER AG-REG (ドイツ)		23.09	124,507	5,392	ORACLE CORP (アメリカ)		13.305	213,334	16,034
CENTENE CORP (アメリカ)		11.075	120,620	10,891	RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR (アイルランド)		9.98	171,858	17,220
KROGER CO (アメリカ)		18.14	119,031	6,561	AMAZON.COM INC (アメリカ)		8.195	166,110	20,269
PRUDENTIAL PLC (イギリス)		73.3	113,494	1,548	TENET HEALTHCARE CORP (アメリカ)		16.358	164,043	10,028
KERING (フランス)		1.655	111,976	67,659	DAIMLER TRUCK HOLDING AG (ドイツ)		22.645	141,393	6,243
CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)		13.445	101,035	7,514	SAP SE (ドイツ)		5.875	138,489	23,572
COREBRIDGE FINANCIAL INC (アメリカ)		39.4	97,912	2,485	PARKER HANNIFIN CORP (アメリカ)		2.1	126,636	60,302
DANAHER CORP (アメリカ)		2.965	97,813	32,989	ALLIANZ SE-REG (ドイツ)		3.33	122,622	36,823

(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		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44.3	58.85	769	118,842	金融	
TE CONNECTIVITY LTD	103.95	52.15	737	113,963	情報技術	
CISCO SYSTEMS INC	—	109.95	525	81,161	情報技術	
CNH INDUSTRIAL NV	—	1,190	1,470	227,185	資本財・サービス	
CENTENE CORP	—	95.9	690	106,651	ヘルスケア	
DEERE & CO	—	10.55	418	64,673	資本財・サービス	
VAIL RESORTS INC	—	25.2	553	85,441	一般消費財・サービス	
AMAZON.COM INC	121.5	39.55	716	110,742	一般消費財・サービス	
FLOWSERVE CORP	181	—	—	—	資本財・サービス	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	—	39.55	532	82,195	ヘルスケア	
FISERV INC	91.15	68.45	1,006	155,525	金融	
GENERAL MOTORS CO	395.23	260.13	1,104	170,602	一般消費財・サービス	
ALPHABET INC-CL A	268.8	92.15	1,432	221,288	コミュニケーション・サービス	
KROGER CO	—	155.75	860	132,939	生活必需品	
RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	138.35	38.55	525	81,188	資本財・サービス	
TENET HEALTHCARE CORP	163.58	—	—	—	ヘルスケア	
KKR & CO INC	94.25	—	—	—	金融	
PARKER HANFIN CORP	21	—	—	—	資本財・サービス	
CONOCOPHILLIPS	45.65	63.35	812	125,571	エネルギー	
ENVISTA HOLDINGS CORP	54.32	318.32	623	96,319	ヘルスケア	
ETSY INC	—	58.75	396	61,243	一般消費財・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	31.5	37.35	963	148,859	コミュニケーション・サービス	
IQVIA HOLDINGS INC	—	49.3	1,120	173,048	ヘルスケア	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	40.8	36.05	934	144,368	金融	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	358	296	243	37,627	コミュニケーション・サービス	
CUSHMAN AND WAKEFIELD PLC	177	—	—	—	不動産	
ORACLE CORP	133.05	—	—	—	情報技術	
BANK OF AMERICA CORP	383	322	1,134	175,220	金融	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	—	316	833	128,710	金融	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	80	116.85	848	130,997	金融	
NOV INC	233.95	—	—	—	エネルギー	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	70.05	76.3	1,043	161,187	金融	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	352	330	998	154,291	コミュニケーション・サービス	
ARCONIC CORP	109	—	—	—	素材	
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,691.43 24銘柄	4,257 26銘柄	21,299	3,289,848 <54.1%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,119.8	816.8	5,554	109,585	一般消費財・サービス	
香港・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,119.8 1銘柄	816.8 1銘柄	5,554	109,585 <1.8%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
PRUDENTIAL PLC	926.32	1,431.32	990	190,542	金融	
GLENCORE PLC	1,580	1,350	638	122,766	素材	
ST JAMES'S PLACE PLC	846	1,164	478	92,006	金融	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	31,754.38	26,815.38	1,352	260,022	金融	

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
TRAVIS PERKINS PLC	432.67	218.67	156	30,069	資本財・サービス	
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	35,539.37 5銘柄	30,979.37 5銘柄	3,615	695,408 <11.4%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	—	22.1	486	82,492	ヘルスケア	
JULIUS BAER GROUP LTD	201.4	222.1	1,064	180,457	金融	
NOVARTIS AG-REG	74.15	33.9	287	48,781	ヘルスケア	
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	275.55 2銘柄	278.1 3銘柄	1,838	311,730 <5.1%>	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円		
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	238.8	152.45	1,010,743	113,405	情報技術	
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	238.8 1銘柄	152.45 1銘柄	1,010,743	113,405 <1.9%>	
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
PROSUS NV	164.52	331.15	942	155,332	一般消費財・サービス	
CNH INDUSTRIAL NV	858	—	—	—	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,022.52 2銘柄	331.15 1銘柄	942	155,332 <2.6%>	
ユーロ(ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	178.95	107.7	580	95,555	生活必需品	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	178.95 1銘柄	107.7 1銘柄	580	95,555 <1.6%>	
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KERING	17.6	30.2	1,029	169,642	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	42.95	20.8	420	69,350	情報技術	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	60.55 2銘柄	51 2銘柄	1,450	238,992 <3.9%>	
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	390.8	164.35	724	119,420	資本財・サービス	
BAYER AG-REG	251.8	424.35	1,113	183,495	ヘルスケア	
ALLIANZ SE-REG	65.35	32.05	837	138,008	金融	
SAP SE	74.35	15.6	263	43,367	情報技術	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	240.1	204.7	1,522	250,878	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,022.4 5銘柄	841.05 5銘柄	4,462	735,171 <12.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,284.42 10銘柄	1,330.9 9銘柄	7,436	1,225,051 <20.2%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	43,149.37 43銘柄	37,814.62 45銘柄	—	5,745,029 <94.5%>	

(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

2024年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	5,745,029	86.1
コール・ローン等、その他	926,521	13.9
投資信託財産総額	6,671,550	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=154.46円、1オーストラリア・ドル=99.41円、1香港ドル=19.73円、1イギリス・ポンド=192.32円、1スイス・フラン=169.59円、1スウェーデン・クローネ=14.11円、1インド・ルピー=1.86円、100韓国ウォン=11.22円、1南アフリカ・ランド=8.11円、1ユーロ=164.73円です。  
 (注3) 当期末における外貨建純資産(5,864,674千円)の投資信託財産総額(6,671,550千円)に対する比率は、87.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年4月18日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>6,694,327,132円</b>
コール・ローン等	867,358,879
株式(評価額)	5,745,029,048
未収入金	59,073,264
未収配当金	22,865,941
<b>(B) 負債</b>	<b>615,761,640</b>
未払金	26,023,205
未払収益分配金	524,626,154
未払解約金	1,310,764
未払信託報酬	63,624,870
その他未払費用	176,647
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>6,078,565,492</b>
元本	2,498,219,781
次期繰越損益金	3,580,345,711
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2,498,219,781口</b>
<b>1万口当り基準価額(C / D)</b>	<b>24,332円</b>

\* 期首における元本額は2,797,389,840円、当作成期間中における追加設定元本額は40,634,709円、同解約元本額は339,804,768円です。  
 \* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,332円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>140,343,077円</b>
受取配当金	133,076,653
受取利息	7,276,843
その他収益金	9,256
支払利息	△ 19,675
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1,035,781,033</b>
売買益	1,950,811,536
売買損	△ 915,030,503
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 131,995,145</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>1,044,128,965</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>2,094,524,637</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>966,318,263</b>
(配当等相当額)	( 919,611,872)
(売買損益相当額)	( 46,706,391)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>4,104,971,865</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 524,626,154</b>
<b>次期繰越損益金(G + H)</b>	<b>3,580,345,711</b>
追加信託差損益金	966,318,263
(配当等相当額)	( 919,611,872)
(売買損益相当額)	( 46,706,391)
分配準備積立金	2,614,027,448

(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：41,914,926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	124,596,056円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	919,532,909
(c) 収益調整金	966,318,263
(d) 分配準備積立金	2,094,524,637
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	4,104,971,865
(f) 分配金	524,626,154
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,580,345,711
(h) 受益権総口数	2,498,219,781口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	2,100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		
9 期末(2020年 4月20日)	円 9,984	円 0	% △0.1	% -	百万円 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
12期末(2023年 4月18日)	9,974	0	△0.0	-	51
13期末(2024年 4月18日)	9,971	0	△0.0	66.7	21

(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。

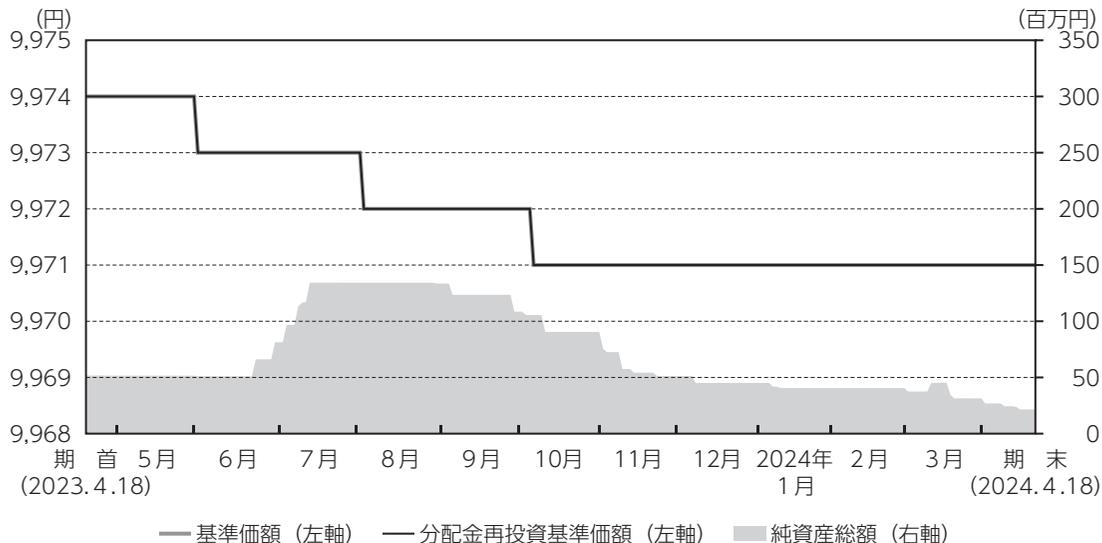
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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：9,974円

期末：9,971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・ローン等の利回りがおおむね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 率	騰 落 率		
(期首) 2023年 4月18日	円 9,974	% -			% -
4月末	9,974	0.0			-
5月末	9,974	0.0			-
6月末	9,973	△0.0			-
7月末	9,973	△0.0			-
8月末	9,972	△0.0			-
9月末	9,972	△0.0			-
10月末	9,971	△0.0			-
11月末	9,971	△0.0			-
12月末	9,971	△0.0			-
2024年 1月末	9,971	△0.0			-
2月末	9,971	△0.0			-
3月末	9,971	△0.0			54.8
(期末) 2024年 4月18日	9,971	△0.0			66.7

(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

(2023.4.19～2024.4.18)

### ■国内短期金融市況

当作成期首より、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おおむねマイナス圏で推移しました。2024年3月に、日銀がマイナス金利政策を解除した影響により、当作成期末にかけて国庫短期証券（3カ月物）の利回りは上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「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

(2023.4.19～2024.4.18)

### ■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、短期の国債やコール・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、基準価額の水準等を勘案し、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	
	2023年4月19日 ～2024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。

（注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配可能額」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。

※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。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2023.4.19~2024.4.18)		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9,972円です。
(投 信 会 社)	(0)	(0.000)	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)	(0)	(0.000)	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)	(0)	(0.000)	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	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
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。

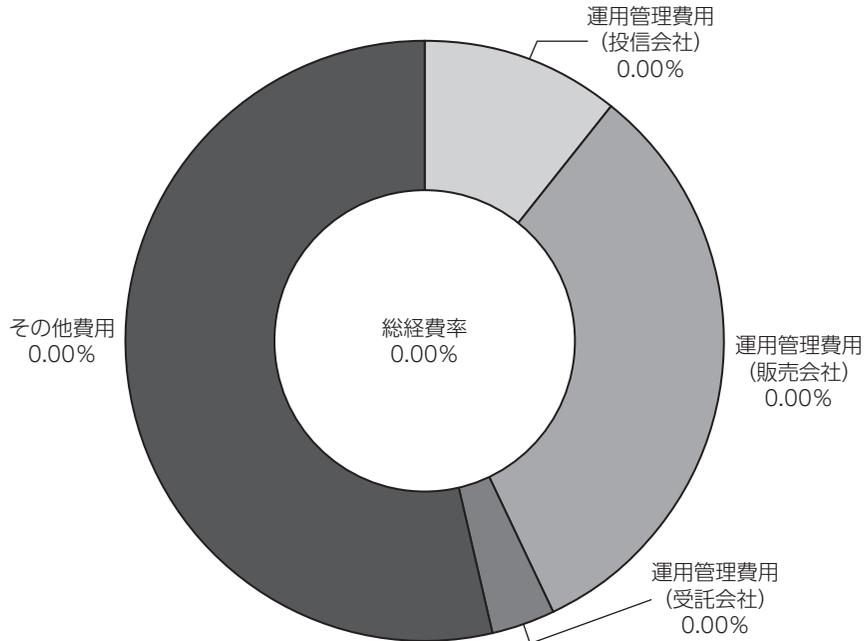
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2023年4月19日から2024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	90,248	90,265	120,111	120,114

(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	51,208	21,346	21,346			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024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	21,346	99.0
コール・ローン等、その他	216	1.0
投資信託財産総額	21,562	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

2024年4月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	21,562,107円
コール・ローン等	216,081
ダイワ・マネースtock・マザーファンド(評価額)	21,346,026
(B) 負債	645
未払信託報酬	462
その他未払費用	183
(C) 純資産総額(A - B)	21,561,462
元本	21,624,527
次期繰越損益金	△ 63,065
(D) 受益権総口数	21,624,527口
1万口当り基準価額(C / D)	9,971円

\* 期首における元本額は51,875,984円、当作成期間中における追加設定元本額は91,330,373円、同解約元本額は121,581,830円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,971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63,065円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 13円
受取利息	364
支払利息	△ 377
(B) 有価証券売買損益	△ 3,777
売買益	11,450
売買損	△15,227
(C) 信託報酬等	△ 883
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 4,673
(E) 前期繰越損益金	△ 2,557
(F) 追加信託差損益金	△55,835
(配当等相当額)	( 19,298)
(売買損益相当額)	(△75,133)
(G) 合計(D + E + F)	△63,065
次期繰越損益金(G)	△63,065
追加信託差損益金	△55,835
(配当等相当額)	( 19,298)
(売買損益相当額)	(△75,133)
分配準備積立金	759
繰越損益金	△ 7,989

(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	330
(c) 収益調整金	19,298
(d) 分配準備積立金	429
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	20,057
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	20,057
(h) 受益権総口数	21,624,527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（2023年12月11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（2024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  
公 社 債

(2023年4月19日から2024年4月18日まで)

買		付		売		付	
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
1219国庫短期証券	2024/6/24		千円 129,997,160				千円

(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

下記は、2024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（192,903,401千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

2024年4月18日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
国債証券	千円 130,000,000	千円 129,998,058	% 67.4	% -	% -	% -	% -	% 67.4

(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）

2024年4月18日現在							
区 分	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	1219国庫短期証券		% -	千円 130,000,000	千円 129,998,058	2024/06/24	

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド

## 運用報告書 第14期 (決算日 2023年12月11日)

(作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11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。

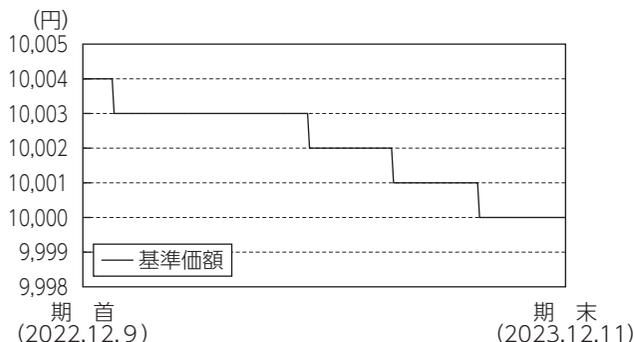
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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)2022年12月9日	円	%	%
12月末	10,004	-	-
2023年1月末	10,004	0.0	-
2月末	10,003	△0.0	-
3月末	10,003	△0.0	-
4月末	10,003	△0.0	-
5月末	10,003	△0.0	-
6月末	10,002	△0.0	-
7月末	10,002	△0.0	-
8月末	10,001	△0.0	-
9月末	10,001	△0.0	-
10月末	10,000	△0.0	-
11月末	10,000	△0.0	-
(期末)2023年12月11日	10,000	△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：10,004円 期末：10,000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	-
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

2023年12月11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 224,869,425	% 100.0
投資信託財産総額	224,869,425	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

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	224,869,425,628円
コール・ローン等	224,869,425,628
(B) 負債	1,500,000,000
未払解約金	1,500,000,000
(C) 純資産総額(A - B)	223,369,425,628
元本	223,366,515,143
次期繰越損益金	2,910,485
(D) 受益権総口数	223,366,515,143口
1万口当り基準価額(C / D)	10,000円

\* 期首における元本額は159,095,941,234円、当作成期間中における追加設定元本額は314,669,316,126円、同解約元本額は250,398,742,217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：

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 (為替ヘッジあり)	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 & P 500	8,578,400,572円
i Freeレバレッジ NASDAQ100	136,597,495,537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/資産成長型)	499,501円
i FreeETF 日経平均レバレッジ・インデックス	3,766,275,979円
i FreeETF 日経平均ダブルインバース・インデックス	7,383,524,817円
i FreeETF TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,207,970,593円
i FreeETF TOPIXダブルインバース (-2倍) 指数	926,253,680円
i FreeETF 日経平均インバース・インデックス	8,758,653,432円
i FreeETF TOPIXインバース (-1倍) 指数	11,471,375,420円
i FreeETF JPX日経400レバレッジ・インデックス	788,263,236円
i FreeETF JPX日経400インバース・インデックス	114,002,117円
i FreeETF JPX日経400ダブルインバース・インデックス	78,926,070円
i FreeETF S & P 500レバレッジ	556,085,029円
i FreeETF S & P 500インバース	2,883,612,458円
先進国トータルリターン戦略ファンド (リス抑制型/適格機関投資家専用)	207,414,601円
ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネポートフォリオ - SLトレード	4,992,083円
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	25,460,730,955円
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	11,487,636,953円
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	3,017,601,716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	44,637,919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/ミレアセット亜細亜株式ファンド	4,148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/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	5,813円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,000円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△69,335,817円
支払利息	△69,335,817
(B) 当期損益金(A)	△69,335,817
(C) 前期繰越損益金	62,057,963
(D) 解約差損益金	△51,876,027
(E) 追加信託差損益金	62,064,366
(F) 合計(B + C + D + E)	2,910,485
次期繰越損益金(F)	2,910,485

(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。