

S & P 500（マルチアイ搭載）

運用報告書（全体版） 第3期

（決算日 2024年3月25日）
（作成対象期間 2023年3月28日～2024年3月25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、米国の株価指数先物取引を買い建てるまたは売り建てる等により、信託財産の成長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/>

★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		
信託期間	2021年3月26日～2026年3月25日		
運用方針	信託財産の成長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. 米国の株価指数先物取引 ロ. 米国の債券 ハ. わが国の債券 ニ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・マネーアセット・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
	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		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。		

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			S & P 500 指 数 (税引後配当込み、 米ドルベース)		株 式 先 物 率 比	公 社 債 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 分 配	期 中 率 騰 落	(参考指数)	期 中 率 騰 落			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末(2022年 3 月 25 日)	10,853	0	8.5	11,676	16.8	19.3	－	100
2 期末(2023年 3 月 27 日)	10,148	0	△ 6.5	10,381	△ 11.1	19.5	－	107
3 期末(2024年 3 月 25 日)	12,111	0	19.3	13,835	33.3	100.2	42.3	91

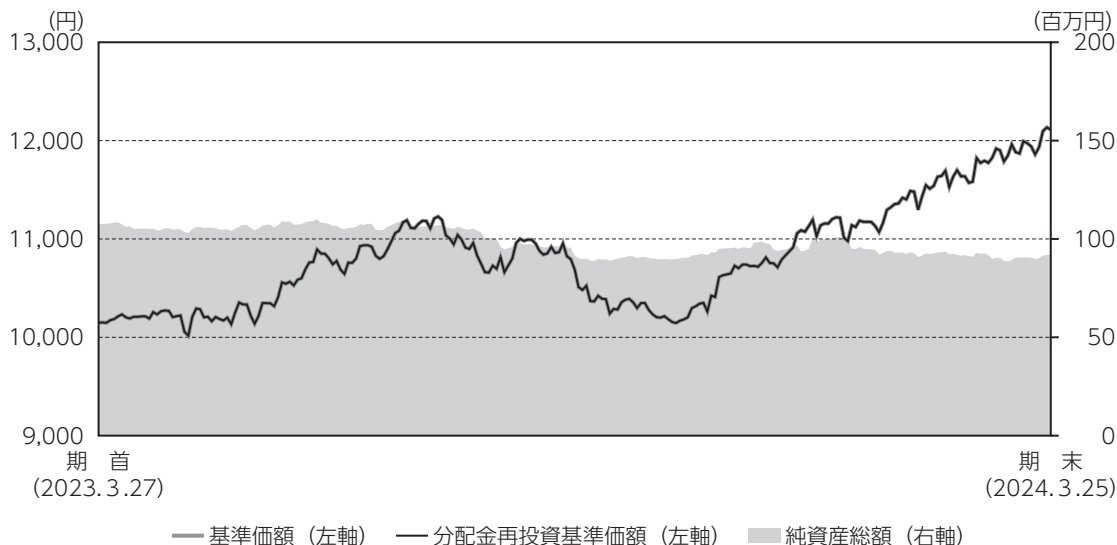
(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) S & P 500 指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
(注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注 4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注 5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 6) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。
(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。
※参考指数を「S & P 500 指数（配当込み、米ドルベース）」から「S & P 500 指数（税引後配当込み、米ドルベース）」に変更しました。

S&P500指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）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®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones®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SPDJI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。S&P500（マルチアイ搭載）は、SPDJI、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、S&P500指数のいかなる過誤、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：10,148円

期 末：12,111円（分配金0円）

騰落率：19.3%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

原則として、S & P 500指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の100%程度となるように買建てつつ、市場局面がリスク回避局面と判定される場合、基準価額の下落リスクを抑制するために、S & P 500指数先物取引の組入比率を調整した結果、米国株式市況が上昇したことにより、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。

S & P 500（マルチアイ搭載）

年 月 日	基 準 価 額		S & P 500 指 数 (税引後配当込み、米ドルベース) (参考指数)		株 式 先 物 率 比	公 社 債 率 組 入 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期首) 2023年 3 月27日	円 10,148	% －	10,381	% －	% 19.5	% －
3 月末	10,185	0.4	10,591	2.0	20.1	－
4 月末	10,206	0.6	10,819	4.2	100.7	－
5 月末	10,346	2.0	11,016	6.1	49.4	－
6 月末	10,801	6.4	11,528	11.0	100.0	－
7 月末	11,208	10.4	12,023	15.8	100.4	－
8 月末	11,001	8.4	11,860	14.2	98.0	－
9 月末	10,422	2.7	11,305	8.9	101.2	－
10月末	10,169	0.2	10,962	5.6	20.8	－
11月末	10,717	5.6	11,987	15.5	99.0	－
12月末	11,216	10.5	12,612	21.5	101.8	－
2024年 1 月末	11,480	13.1	12,994	25.2	98.6	－
2 月末	11,774	16.0	13,389	29.0	96.0	－
(期末) 2024年 3 月25日	12,111	19.3	13,835	33.3	100.2	42.3

(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

(2023.3.28~2024.3.25)

■米国株式市況

米国株式市況は、大幅に上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、米国の地方銀行の経営不安や米国の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債務上限問題の解決、インフレ率の鈍化などが好感され、大幅に上昇しました。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、政府機関の閉鎖懸念などによる長期金利の大幅な上昇、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化などが嫌気され、10月末まで下落しました。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と述べたことを受けて利下げ観測が高まったこと、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、急上昇して当作成期末を迎えました。

■国内短期金融市況

当作成期首より2024年2月まで、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。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）の利回りはプラスに転じて推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、原則として、S & P 500指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の100%程度となるように買い建てつつ、市場局面がリスク回避局面と判定される場合、基準価額の下落リスクを抑制するために、S & P 500指数先物取引の組入比率を調整します。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・マネーアセット・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

(2023.3.28～2024.3.25)

■当ファンド

原則として、S & P 500指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の100%程度となるように買建てつつ、市場局面がリスク回避局面と判定される場合、基準価額の下落リスクを抑制するために、S & P 500指数先物取引の組入比率を調整しました。当作成期中のS & P 500指数先物取引の組入比率は、20%程度から100%程度の間で推移させました。「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。

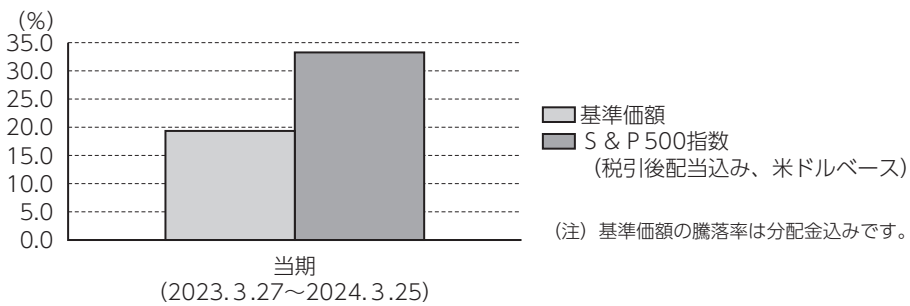
また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

■ダイワ・マネーアセット・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、信託財産の成長に資することを目的に、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3月28日 ～2024年3月25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）	2,111

- （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・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、原則として、S & P 500指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の100%程度となるように買建てつつ、市場局面がリスク回避局面と判定される場合、基準価額の下落リスクを抑制するために、S & P 500指数先物取引の組入比率を調整します。

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・マネーアセット・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 (2023.3.28~2024.3.25)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	50円	0.465%	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10,828円です。
(投 信 会 社)	(26)	(0.241)	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)	(21)	(0.197)	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)	(0.027)	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	17	0.155	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)	(17)	(0.155)	
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	10	0.097	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)	(9)	(0.083)	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)	(0.008)	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	78	0.716	

(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。

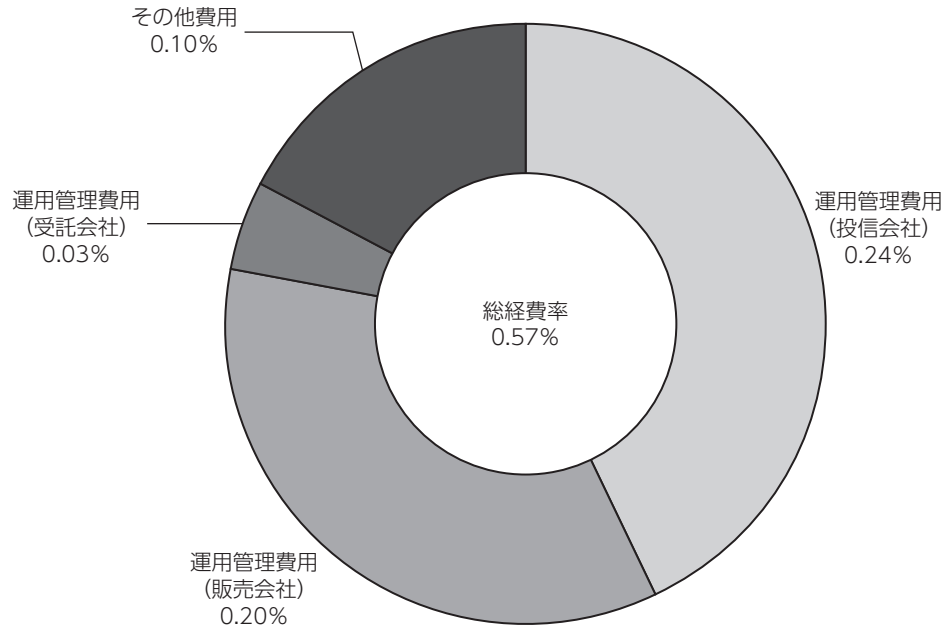
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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前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0.57%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3月28日から2024年3月25日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	千□	千円	千□	千円
	—	—	10,026	10,000

(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

(2023年3月28日から2024年3月25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
外国株式	SP500 MIC EMIN FUT(アメリカ)	百万円 775	百万円 734	百万円 —	百万円 —	百万円 92	百万円 —	百万円 1

(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
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	千□	千□	千円
	76,101	66,075	65,897

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年3月25日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	千円	%
	65,897	71.4
コール・ローン等、その他		
	26,456	28.6
投資信託財産総額	92,353	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25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝151.43円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（12,242千円）の投資信託財産総額（92,353千円）に対する比率は、13.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年3月25日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	104,210,696円
コール・ローン等	14,213,516
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド(評価額)	65,897,468
未収入金	13,710,724
差入委託証拠金	10,388,988
(B) 負債	12,239,566
未払金	11,991,488
未払解約金	30,228
未払信託報酬	214,152
その他未払費用	3,698
(C) 純資産総額(A－B)	91,971,130
元本	75,937,865
次期繰越損益金	16,033,265
(D) 受益権総口数	75,937,865口
1万口当り基準価額(C／D)	12,111円

* 期首における元本額は105,753,060円、当作成期間中における追加設定元本額は42,557,076円、同解約元本額は72,372,271円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,111円です。

■損益の状況

当期 自2023年3月28日 至2024年3月25日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	405,713円
受取利息	132
その他収益金	412,678
支払利息	△ 7,097
(B) 有価証券売買損益	△ 1,415,775
売買益	1,216,812
売買損	△ 2,632,587
(C) 先物取引等損益	14,080,346
取引益	21,461,765
取引損	△ 7,381,419
(D) 信託報酬等	△ 555,384
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	12,514,900
(F) 前期繰越損益金	△ 2,523,233
(G) 追加信託差損益金	6,041,598
(配当等相当額)	(98,154)
(売買損益相当額)	(5,943,444)
(H) 合計(E + F + G)	16,033,265
次期繰越損益金(H)	16,033,265
追加信託差損益金	6,041,598
(配当等相当額)	(98,154)
(売買損益相当額)	(5,943,444)
分配準備積立金	9,991,667

- (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：49,150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	388,496円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	9,603,171
(c) 収益調整金	6,041,598
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	16,033,265
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	16,033,265
(h) 受益権総口数	75,937,865口

<補足情報>

当ファンド（Ｓ＆Ｐ５００（マルチアイ搭載））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・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３月２５日）現在におけるダイワ・マネーアセット・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・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2023年3月28日から2024年3月25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 173,997			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3月25日現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンド（295,237千口）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

2024年3月25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 174,000	千円 173,997	% 59.1	% －	% －	% －	% －	% 59.1

(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3月25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 174,000	千円 173,997	2024/06/24

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第12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・マネーアセット・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。

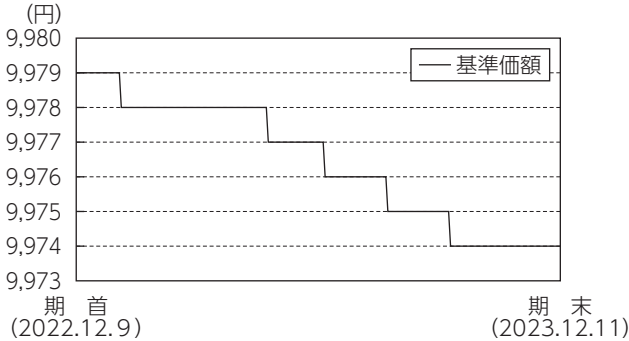
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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	騰 落 率		公 社 債 組 入 比 率
		円	%	
(期首)2022年12月 9 日	9,979	円	%	—
12月末	9,979		0.0	—
2023年 1 月末	9,978		△0.0	—
2 月末	9,978		△0.0	—
3 月末	9,978		△0.0	—
4 月末	9,978		△0.0	—
5 月末	9,977		△0.0	—
6 月末	9,976		△0.0	—
7 月末	9,976		△0.0	—
8 月末	9,975		△0.0	—
9 月末	9,974		△0.1	—
10月末	9,974		△0.1	—
11月末	9,974		△0.1	—
(期末)2023年12月11日	9,974		△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、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：9,979円 期末：9,974円 騰落率：△0.1%

【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
	千円	%
コール・ローン等、その他	237,201	100.0
投資信託財産総額	237,201	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	237,201,069円
コール・ローン等	237,201,069
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	237,201,069
元本	237,822,978
次期繰越損益金	△ 621,909
(D) 受益権総口数	237,822,978口
1万口当り基準価額(C／D)	9,974円

* 期首における元本額は88,294,563円、当作成期間中における追加設定元本額は948,869,489円、同解約元本額は799,341,074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：

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）	999円
ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）	999円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム（毎月分配型）	219,583円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム（年2回決算型）	10,021円
ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（毎月分配型）	848,389円
ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（年2回決算型）	6,716円
ダイワ米国株主還元株ファンド	64,214円
ダイワDBモメンタム戦略ファンド（為替ヘッジあり）	6,592,748円
ダイワDBモメンタム戦略ファンド（為替ヘッジなし）	10,288,683円
ダイワ/パリュール・パートナーズ・チャイナ・イノベーション・ファンド	10,000円
世界M&A戦略株ファンド	1,001,302円
ダイワ・ブラジル・リアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハイインカム－ α50コース	49,911円
ダイワ・ブラジル・リアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハイインカム－ α100コース	49,911円
S & P 500（マルチアディ搭載）	66,075,873円
i F r e e E T F S & P 500ダブリンバース	149,607,523円
ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）	2,996,106円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,974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621,909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	△ 158,856円
受取利息	1,183
支払利息	△ 160,039
(B) 当期損益金(A)	△ 158,856
(C) 前期繰越損益金	△ 184,238
(D) 解約差損益金	2,052,274
(E) 追加信託差損益金	△2,331,089
(F) 合計(B＋C＋D＋E)	△ 621,909
次期繰越損益金(F)	△ 621,909

(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。