

NASDAQ100トリプル (マルチアイ搭載)

運用報告書（全体版） 第4期

（決算日 2025年3月25日）
（作成対象期間 2024年3月26日～2025年3月25日）

■2024年12月19日付で信託期間終了日を2026年3月25日から2031年3月25日に変更しました。

★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～2031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．米国の株式市場の値動きを享受する債券（円建） ロ．米国の債券 ハ．わが国の債券 ニ．ダイワ・マネーデポジット・マザーファンドの受益証券 ホ．米国の株価指数先物取引	
		ダイワ・マネーデポジット・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、連動債券への投資を通じて、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/>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			NASDAQ100指数 (税引後配当込み、 米ドルベース)		公 社 債 組入比率	債券先物率 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 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(2022年 3 月25日)	11,338	0	13.4	11,609	16.1	99.5	－	2,959
2 期末(2023年 3 月27日)	10,616	0	△ 6.4	10,102	△13.0	99.9	－	2,364
3 期末(2024年 3 月25日)	21,851	0	105.8	14,593	44.5	99.9	－	7,071
4 期末(2025年 3 月25日)	22,284	0	2.0	16,147	10.6	99.9	－	7,750

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) NASDAQ100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) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
(注 7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当ファンドは、Nasdaq, Inc.またはその関連会社（以下、Nasdaq, Inc.およびその関連会社を「株式会社」と総称します。）によって、支援、推奨、販売または販売促進されるものではありません。株式会社は、ファンドの合法性もしくは適合性について、または当ファンドに関する記述および開示の正確性もしくは妥当性について認定するものではありません。株式会社は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性や、NASDAQ-100 Index®の一般的な株式市況への追従可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行ないません。株式会社と大和アセットマネジメント株式会社との関係は、Nasdaq®およびNASDAQ-100 Indexの登録商標ならびに株式会社の一定の商号について使用を許諾すること、ならびに、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドとは無関係に、ナスダックが決定、構築および算出を行なうNASDAQ-100 Indexの使用を許諾することに限られます。ナスダックは、NASDAQ-100 Indexの決定、構築および計算に関し、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。株式会社は、当ファンドの発行に関してその時期、価格もしくはその数量の決定について、または当ファンドを換金する際の算式の決定もしくは計算についての責任を負っておらず、また関与をしていません。株式会社は、NASDAQ-100 Indexとそれに含まれるデータの正確性および中断されない算出を保証しません。株式会社は、NASDAQ-100 Indexまたはそれに含まれるデータの利用により、大和アセットマネジメント株式会社、当ファンドの保有者またはその他のいかなる者もしくは組織に生じた結果についても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行ないません。株式会社は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行なわず、かつNASDAQ-100 Indexまたはそれに含まれるデータの利用に関する、特定の目的または利用のための市場商品性または適合性については、いかなる保証についても明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、株式会社は、いかなる逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的損害や損失について、たとえもし当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。



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：21,851円

期 末：22,284円（分配金0円）

騰落率：2.0%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

連動債券（米国の株式市場の値動きを享受する債券（円建））を通じて、原則として、NASDAQ 100指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の300%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、NASDAQ100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。

NASDAQ100トリプル（マルチアイ搭載）

年 月 日	基 準 価 額		N A S D A Q 100 指 数 (税引後配当込み、米ドルベース)		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 比
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2024年 3 月25日	円 21,851	% －	14,593	% －	% 99.9	% －
3 月末	21,508	△ 1.6	14,527	△ 0.5	98.7	－
4 月末	19,367	△11.4	14,154	△ 3.0	99.8	－
5 月末	21,566	△ 1.3	14,765	1.2	99.3	－
6 月末	25,739	17.8	15,771	8.1	101.1	－
7 月末	21,485	△ 1.7	14,983	2.7	100.0	－
8 月末	23,148	5.9	15,414	5.6	99.8	－
9 月末	25,051	14.6	15,968	9.4	99.8	－
10月末	26,057	19.2	16,274	11.5	100.1	－
11月末	26,893	23.1	16,569	13.5	99.9	－
12月末	28,836	32.0	17,158	17.6	99.9	－
2025年 1 月末	28,191	29.0	17,190	17.8	100.2	－
2 月末	24,153	10.5	16,433	12.6	100.3	－
(期末) 2025年 3 月25日	22,284	2.0	16,147	10.6	99.9	－

(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

(2024.3.26～2025.3.25)

■米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、インフレ再燃が懸念されて米国の利下げ開始が後ずれするとの見方が強まり、下落しました。2024年4月下旬以降は、インフレ率の低下傾向を受けて利下げ期待が再び高まったことなどから上昇に転じ、高成長が期待されるAI（人工知能）関連企業の株価急騰が相場をけん引して高値を更新しつつ、7月半ばまで上昇基調で推移しました。しかし7月後半に入ると、米国の対中輸出規制強化への懸念などから、半導体関連株主導で下落しました。さらに8月初旬には、雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから景気の先行きに対する不透明感がにわかに強まり、急落しました。その後は、米国の経済指標の改善や利下げ開始を強く示唆したFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などを好感し、急反発しました。実際にFRBが0.50%ポイントの利下げを決定したことなどもあり、9月中旬以降は上昇基調で推移しました。11月初旬の大統領選挙でトランプ元大統領が勝利し、米国景気の先行きに対する期待が高まったことも、上昇基調を後押ししました。12月中旬にFRBが0.25%ポイントの利下げを決定した際、今後の利下げペースの減速が示唆されたことで長期金利が上昇し、これを嫌気して株価は小幅に下落しましたが、2025年1月中旬以降は、CPI（消費者物価指数）が市場予想を下回り長期金利が低下したことや良好な企業決算などが好感され、株価は再び上昇しました。2月下旬以降は、経済指標の悪化やトランプ政権による関税引き上げへの懸念の強まりから、下落して当作成期末を迎えました。

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、主として連動債券に投資し、原則として、NASDAQ100指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の300%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、NASDAQ100指数先物取引の組入比率を調整します。

なお、ファンドの規模、流動性等によっては、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネーデポジット・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、米国の株価指数先物取引を買い建てまたは売り建てることにより、運用を行う場合があります。

■ダイワ・マネーデポジット・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

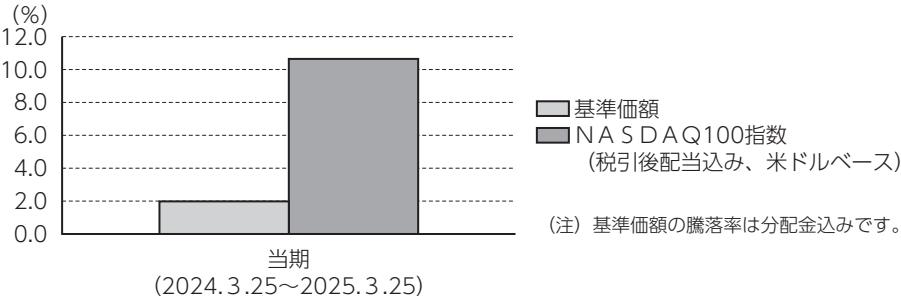
(2024. 3. 26～2025. 3. 25)

■当ファンド

連動債券に投資を行い、原則として、N A S D A Q100指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の300%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、N A S D A Q100指数先物取引の組入比率を調整しました。当作成期のN A S D A Q100指数先物取引の組入比率は、150%程度から300%程度の間で推移させました。

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	
	2024年3月26日 ～2025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）	12,283

- （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、主として連動債券に投資し、原則として、NASDAQ100指数先物取引の組入比率が信託財産の純資産総額の300%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、NASDAQ100指数先物取引の組入比率を調整します。

なお、ファンドの規模、流動性等によっては、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネーデポジット・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、米国の株価指数先物取引を買い建てまたは売り建てることにより、運用を行う場合があります。

■ダイワ・マネーデポジット・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 (2024.3.26~2025.3.25)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	333円	1.347%	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24,681円です。
(投 信 会 社)	(163)	(0.660)	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)	(163)	(0.660)	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	－	－	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	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
(保 管 費 用)	(2)	(0.007)	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)	(2)	(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)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	336	1.363	

(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。

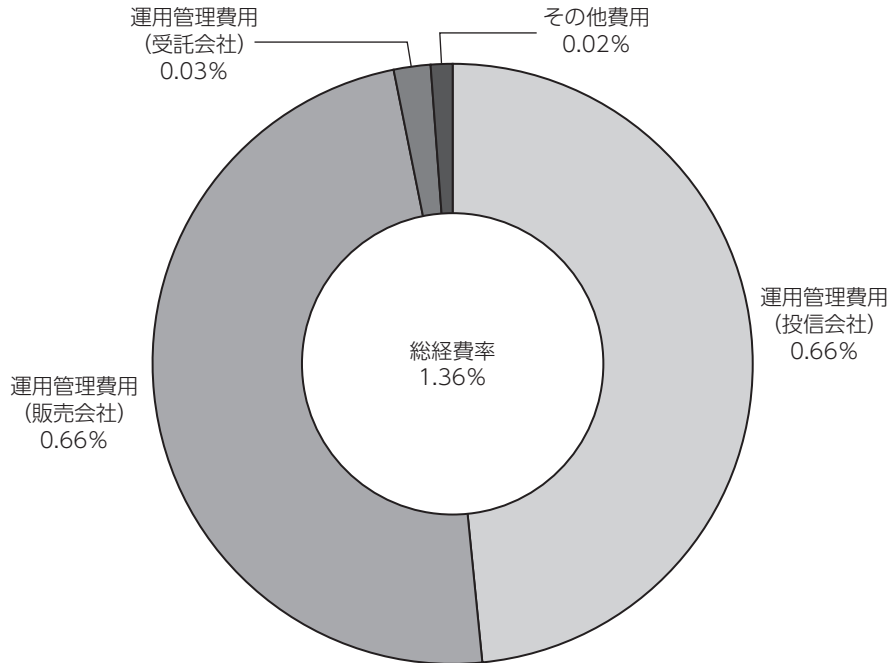
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.36%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、有価証券取引税および投資対象とする連動債券にかかる費用等を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

*当ファンドでは、上記のほか投資対象とする連動債券において次の費用がかかりました。

純資産総額に対して年率0.06%（税込）程度、その他各種費用等

■売買および取引の状況
公 社 債

(2024年3月26日から2025年3月25日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	社債券	千円 3,287,104	千円 2,748,765 (-)

(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

(2024年3月26日から2025年3月25日まで)

当		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
Vault Investments PLC 2026/3/25（ユーロ円債）	千円 3,287,104	Vault Investments PLC 2026/3/25（ユーロ円債）	千円 2,748,765

(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。

■組入資産明細表

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

作 成 期	当		期				
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
普通社債券	千円 3,287,000	千円 7,741,509	% 99.9	% -	% -	% -	% 99.9

(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
普通社債券	Vault Investments PLC	% -	千円 3,287,000	千円 7,741,509	2026/03/25

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2025年3月25日現在

項 目	当	期	末
	評 価 額	比 率	
公社債	千円 7,741,509	% 98.3	
コール・ローン等、その他	134,174	1.7	
投資信託財産総額	7,875,684	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

2025年3月25日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,875,684,115円
コール・ローン等	134,174,585
公社債(評価額)	7,741,509,530
(B) 負債	125,437,028
未払金	55,811,630
未払解約金	14,118,372
未払信託報酬	55,169,340
その他未払費用	337,686
(C) 純資産総額(A－B)	7,750,247,087
元本	3,477,948,318
次期繰越損益金	4,272,298,769
(D) 受益権総口数	3,477,948,318口
1万口当り基準価額(C／D)	22,284円

* 期首における元本額は3,236,320,777円、当作成期間中における追加設定元本額は2,647,789,592円、同解約元本額は2,406,162,051円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,284円です。

■損益の状況

当期 自2024年3月26日 至2025年3月25日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,646,514円
受取利息	144,939
その他収益金	3,501,575
(B) 有価証券売却損益	△ 549,042,338
売買益	616,966,140
売買損	△1,166,008,478
(C) 信託報酬等	△ 105,773,418
(D) 当期繰損益金(A + B + C)	△ 651,169,242
(E) 前期繰越損益金	1,022,332,104
(F) 追加信託差損益金	3,901,135,907
(配当等相当額)	(1,377,104,501)
(売買損益相当額)	(2,524,031,406)
(G) 合計(D + E + F)	4,272,298,769
次期繰越損益金(G)	4,272,298,769
追加信託差損益金	3,901,135,907
(配当等相当額)	(1,377,104,501)
(売買損益相当額)	(2,524,031,406)
分配準備積立金	1,022,332,104
繰越損益金	△ 651,169,242

- (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	3,249,966,665
(d) 分配準備積立金	1,022,332,104
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	4,272,298,769
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	4,272,298,769
(h) 受益権総口数	3,477,948,318口

《お知らせ》

■信託期間の延長について

2024年12月19日付で信託期間終了日を2026年3月25日から2031年3月25日に変更しました。

ダイワ・マネーデポジット・マザーファンド

運用報告書 第4期（決算日 2024年12月9日）

（作成対象期間 2023年12月12日～2024年12月9日）

ダイワ・マネーデポジット・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。

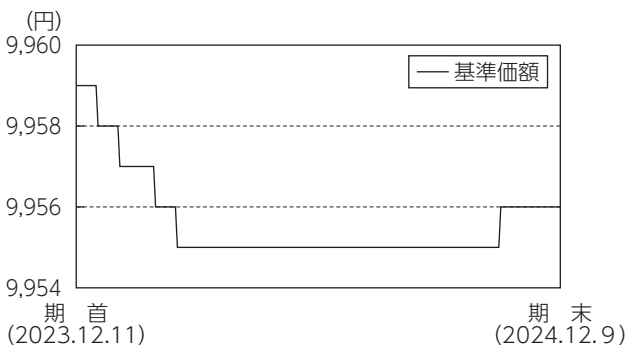
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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 比 率 組 入 比
(期首)2023年12月11日	円 % —	% —
12月末	9,958 △0.0	—
2024年 1 月末	9,957 △0.0	—
2 月末	9,955 △0.0	—
3 月末	9,955 △0.0	61.4
4 月末	9,955 △0.0	61.4
5 月末	9,955 △0.0	61.4
6 月末	9,955 △0.0	61.4
7 月末	9,955 △0.0	61.4
8 月末	9,955 △0.0	61.4
9 月末	9,955 △0.0	61.4
10月末	9,956 △0.0	61.7
11月末	9,956 △0.0	61.7
(期末)2024年12月 9 日	9,956 △0.0	61.7

(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：9,959円 期末：9,956円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

短期の国債およびコール・ローン等の利回りが低位で推移したことなどから、基準価額はおおむね横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

当作成期首より2024年2月までは、日銀のマイナス金利政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りはおおむねマイナス圏で推移しました。その後、3月に日銀はマイナス金利政策を解除し

ましたが、緩和的な金融環境が継続する中、国庫短期証券（3カ月物）の利回りは低位で推移しました。

◆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、短期の国債やコール・ローン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

公 社 債

(2023年12月12日から2024年12月9日まで)

国 内	買 付 額 千円 1,799	売 付 額 千円 (1,200)
国債証券		

(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) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2023年12月12日から2024年12月9日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
1239国庫短期証券 2024/9/24	千円 599		千円
1219国庫短期証券 2024/6/24	599		
1258国庫短期証券 2024/12/23	599		

(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

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

作成期 区分	当 期			未 期			
	額面金額	評価額	組入比率	うち88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 600	千円 599	% 61.7	% —	% —	% —	% 61.7

(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			未		
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国債証券	1258国庫短期証券	% —	千円 600	千円 599	2024/12/23

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年12月9日現在

項 目	当 期		未 期	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公社債	千円 599	% 61.7	千円 599	% 61.7
コール・ローン等、その他	372	38.3	372	38.3
投資信託財産総額	972	100.0	972	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12月9日現在

項 目	当 期	未 期
(A) 資産		972,055円
コール・ローン等		372,115
公社債(評価額)		599,940
(B) 負債		—
(C) 純資産総額(A－B)		972,055
元本		976,354
次期繰越損益金	△ 4,299	
(D) 受益権総口数		976,354口
1万口当り基準価額(C／D)		9,956円

* 期首における元本額は1,080,673円、当作成期間中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は104,319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：
 マネーデポジット資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用） 974,700円
 ダイワ/バリュー・パートナーズ チャイナ・エネルギー・シフト・フォーカス 1,654円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,956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4,299円です。

■損益の状況

当期 自2023年12月12日 至2024年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 369円
受取利息	130
支払利息	△ 499
(B) 有価証券売買損益	11
売買益	11
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 358
(D) 前期繰越損益金	△4,411
(E) 解約差損益金	470
(F) 合計(C＋D＋E)	△4,299
次期繰越損益金(F)	△4,299

(注) 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。