

# 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)

## 運用報告書(全体版)

第114期(決算日 2025年1月17日)  
第115期(決算日 2025年2月17日)  
第116期(決算日 2025年3月17日)  
第117期(決算日 2025年4月17日)  
第118期(決算日 2025年5月19日)  
満期償還(償還日 2025年6月17日)

(作成対象期間 2024年12月18日～2025年6月17日)

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

|        |                                                                                                                                                |                                                                                                                            |  |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／株式                                                                                                                                    |                                                                                                                            |  |
| 信託期間   | 2015年6月26日～2025年6月17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 | 当ファンド                                                                                                                                          | イ. ケイマン籍の外国投資信託「UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲ－ダイワ・アメリカン・ハイ・ディビデンド・エクイティ・クワトロ・インカム・ファンド」の受益証券（円建）<br>ロ. 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   | 当ファンドの投資信託証券組入上限比率                                                                                                                             | 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、当初設定から1年以内に分配を開始し、分配開始後は、原則として、毎決算時に分配を行なうことを目標に、基準価額の水準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、米国の高配当株式に投資するとともに、為替取引ならびに株式および通貨のカバードコール戦略を組み合わせることで、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざしており、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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/>

最近 30 期の運用実績

| 決 算 期               | 基 準 価 額    |              |           | 公 社 債 率<br>組 入 比 | 投 資 信 託<br>受 益 証 券 率 | 純 資 産 額 |
|---------------------|------------|--------------|-----------|------------------|----------------------|---------|
|                     | (分 配 落)    | 税 込<br>分 配 金 | 期 騰 落 中 率 |                  |                      |         |
|                     | 円          | 円            | %         | %                | %                    | 百万円     |
| 90 期末（2023年 1 月17日） | 2, 265     | 30           | 1. 4      | —                | 99. 4                | 535     |
| 91 期末（2023年 2 月17日） | 2, 308     | 30           | 3. 2      | —                | 98. 5                | 555     |
| 92 期末（2023年 3 月17日） | 2, 093     | 30           | △ 8. 0    | —                | 98. 1                | 510     |
| 93 期末（2023年 4 月17日） | 2, 221     | 30           | 7. 5      | —                | 98. 4                | 530     |
| 94 期末（2023年 5 月17日） | 2, 098     | 30           | △ 4. 2    | —                | 98. 8                | 515     |
| 95 期末（2023年 6 月19日） | 2, 222     | 30           | 7. 3      | —                | 98. 5                | 541     |
| 96 期末（2023年 7 月18日） | 2, 205     | 30           | 0. 6      | —                | 98. 2                | 529     |
| 97 期末（2023年 8 月17日） | 2, 166     | 30           | △ 0. 4    | —                | 99. 4                | 522     |
| 98 期末（2023年 9 月19日） | 2, 224     | 30           | 4. 1      | —                | 98. 4                | 545     |
| 99 期末（2023年10月17日）  | 2, 073     | 30           | △ 5. 4    | —                | 98. 4                | 523     |
| 100期末（2023年11月17日）  | 2, 141     | 30           | 4. 7      | —                | 98. 6                | 540     |
| 101期末（2023年12月18日）  | 2, 061     | 30           | △ 2. 3    | —                | 98. 5                | 526     |
| 102期末（2024年 1 月17日） | 2, 066     | 30           | 1. 7      | —                | 97. 9                | 536     |
| 103期末（2024年 2 月19日） | 2, 076     | 30           | 1. 9      | —                | 98. 5                | 531     |
| 104期末（2024年 3 月18日） | 2, 081     | 30           | 1. 7      | 0. 0             | 98. 7                | 519     |
| 105期末（2024年 4 月17日） | 2, 000     | 30           | △ 2. 5    | 0. 0             | 98. 5                | 500     |
| 106期末（2024年 5 月17日） | 2, 123     | 30           | 7. 7      | 0. 0             | 98. 3                | 536     |
| 107期末（2024年 6 月17日） | 1, 964     | 30           | △ 6. 1    | 0. 0             | 98. 5                | 484     |
| 108期末（2024年 7 月17日） | 2, 014     | 30           | 4. 1      | 0. 0             | 98. 5                | 493     |
| 109期末（2024年 8 月19日） | 1, 887     | 30           | △ 4. 8    | 0. 0             | 98. 6                | 447     |
| 110期末（2024年 9 月17日） | 1, 784     | 30           | △ 3. 9    | 0. 0             | 98. 6                | 426     |
| 111期末（2024年10月17日）  | 1, 871     | 30           | 6. 6      | 0. 0             | 98. 6                | 448     |
| 112期末（2024年11月18日）  | 1, 901     | 30           | 3. 2      | 0. 0             | 98. 1                | 461     |
| 113期末（2024年12月17日）  | 1, 764     | 30           | △ 5. 6    | 0. 0             | 98. 5                | 429     |
| 114期末（2025年 1 月17日） | 1, 742     | 30           | 0. 5      | 0. 0             | 98. 6                | 406     |
| 115期末（2025年 2 月17日） | 1, 782     | 30           | 4. 0      | 0. 0             | 98. 7                | 414     |
| 116期末（2025年 3 月17日） | 1, 685     | 30           | △ 3. 8    | 0. 0             | 98. 4                | 394     |
| 117期末（2025年 4 月17日） | 1, 484     | 30           | △ 10. 1   | 0. 0             | 98. 1                | 347     |
| 118期末（2025年 5 月19日） | 1, 588     | 30           | 9. 0      | —                | —                    | 372     |
| 償 還（2025年 6 月17日）   | 1, 587. 81 | —            | △ 0. 0    | —                | —                    | 341     |

(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、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を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

設定時：10,000円

償還時：1,587円81銭（既払分配金9,740円）

騰落率：42.5%（分配金再投資ベース）

#### 基準価額の主な変動要因

「アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド」の上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました（分配金再投資ベース）。「アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド」については、米国の株式に投資し、米ドル売り／ブ

ラジル・レアル買いの為替取引を行うとともに、株式ならびに通貨（円に対するブラジル・レアル）のカバードコール戦略を構築した結果、株式が上昇したことや、ブラジル・レアルの対円での為替収益（金利由来の収益を含む）がプラス要因となり、上昇しました。オプション取引については、株式のオプションと通貨のオプションは共にマイナス要因となりました。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

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）

|       | 年 月 日              | 基 準 価 額    |        | 公 社 債 率<br>組 入 比 | 投 資 信 託<br>受 益 証 券<br>組 入 比 率 |
|-------|--------------------|------------|--------|------------------|-------------------------------|
|       |                    |            | 騰 落 率  |                  |                               |
| 第114期 | (期 首) 2024年12月17日  | 円<br>1,764 | %<br>— | %<br>0.0         | %<br>98.5                     |
|       | 12月末               | 1,725      | △ 2.2  | 0.0              | 98.5                          |
|       | (期 末) 2025年 1 月17日 | 1,772      | 0.5    | 0.0              | 98.6                          |
| 第115期 | (期 首) 2025年 1 月17日 | 1,742      | —      | 0.0              | 98.6                          |
|       | 1 月末               | 1,782      | 2.3    | 0.0              | 99.2                          |
|       | (期 末) 2025年 2 月17日 | 1,812      | 4.0    | 0.0              | 98.7                          |
| 第116期 | (期 首) 2025年 2 月17日 | 1,782      | —      | 0.0              | 98.7                          |
|       | 2 月末               | 1,734      | △ 2.7  | 0.0              | 98.3                          |
|       | (期 末) 2025年 3 月17日 | 1,715      | △ 3.8  | 0.0              | 98.4                          |
| 第117期 | (期 首) 2025年 3 月17日 | 1,685      | —      | 0.0              | 98.4                          |
|       | 3 月末               | 1,711      | 1.5    | 0.0              | 99.3                          |
|       | (期 末) 2025年 4 月17日 | 1,514      | △ 10.1 | 0.0              | 98.1                          |
| 第118期 | (期 首) 2025年 4 月17日 | 1,484      | —      | 0.0              | 98.1                          |
|       | 4 月末               | 1,569      | 5.7    | 0.0              | 99.1                          |
|       | (期 末) 2025年 5 月19日 | 1,618      | 9.0    | —                | —                             |
| 償 還 期 | (期 首) 2025年 5 月19日 | 1,588      | —      | —                | —                             |
|       | 5 月末               | 1,588      | 0.0    | —                | —                             |
|       | (償 還) 2025年 6 月17日 | 1,587.81   | △ 0.0  | —                | —                             |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

（2015. 6. 26 ～ 2025. 6. 17）

## ■ 米国株式市況

i シェアーズ好配当株式 E T F（配当再投資）は米ドルベースで上昇しました。

米国株式市況は、当ファンド設定時から2019年末にかけて、第一次トランプ米国政権による対中関税を受け、米中貿易摩擦への警戒感が高まる場面も見られましたが、米国経済の拡大期待を背景に、上昇しました。2020年3月末にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けてリスク回避の動きがいったん急速に広がったものの、主要国における金融緩和政策等が奏功し、2021年末まで上昇基調で推移しました。2022年から2023年にかけては、米国経済の過熱感や急速なインフレから金融引き締め政策に移行したことで、一転して景気懸念が強まり、上昇幅を縮小する展開となりました。その後2025年1月末までは、金利上昇の一服感や、市場に融和的なトランプ氏の大統領選挙での再選を支援材料に、反発しました。償還期末にかけては、米国の関税政策に左右される展開となりましたが、底堅く推移しました。

## ■ 為替相場

ブラジル・レアルは対円で下落（円高）しました。

ブラジル・レアル対円為替相場は、ブラジルの政策金利の引き上げなどにより上昇した局面もありましたが、根強い財政懸念や、現職議員による汚職事件などの政治的混迷などから、下落しました。また、コロナ禍や米中対立の激化懸念からリスク回避の動きが広がったことも、下落要因となりました。

ブラジル・レアルの対円スポットレートは下落しましたが、為替要因は金利差によるフォワードプレミアムの収益がその影響を上回ったため、プラスとなりました。

## ■ 短期金利市況

F R B（米国連邦準備制度理事会）は、政策金利の誘導目標レンジを、当ファンド設定時は0～0.25%、償還期末には4.25～4.50%としました。一方でブラジル中央銀行は、政策金利を当ファンド設定時は13.75%、償還期末には14.75%としました。

## 信託期間中の運用方針

### ■当ファンド

当ファンドは、「アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド」と「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」に投資するファンド・オブ・ファンズです。

主として、「アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド」の受益証券への投資を通じて、米国の高配当株式に投資するとともに、為替取引ならびに株式および通貨のカバードコール戦略を組み合わせることで、高水準のインカム性収益の確保と信託財産の成長をめざします。

※アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド：U B Sユニバーサル・トラスト（ケイマン）

Ⅲーダイワ・アメリカン・ハイ・ディビデンド・エクイティ・クワトロ・インカム・ファンド

### ■アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド

ダウ・ジョーンズ米国セレクト配当指数を対象としたE T F（上場投資信託証券）を活用し、米国の高配当株式への投資を行います。米ドル建ての資産に対して、原則として、米ドル売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行います。対象とする指数またはE T Fにかかるコール・オプション（買う権利）の売りを行い、株式カバードコール戦略を構築します。オプションのカバー率はファンドの純資産総額の50%程度とします。円に対するブラジル・レアルのコール・オプションの売りを行い、通貨カバードコール戦略を構築します。オプションのカバー率はファンドの純資産総額のおおむね50%程度とします。

### ■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。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2015. 6. 26 ~ 2025. 6. 17)

## ■当ファンド

「アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド」と「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」に投資しました。「アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド」への投資割合を高位に維持しました。

## ■アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド

ダウ・ジョーンズ米国セレクト配当指数を対象としたETF（上場投資信託証券）を活用し、米国の高配当株式に投資を行いました。米ドル建ての資産に対して米ドル売り／ブラジル・レアル買いの為替取引を行いました。投資対象とするETFにかかるコール・オプション（買う権利）の売りを行い、株式カバードコール戦略を構築しました。オプションのカバー率はファンドの純資産総額のおおむね50%程度としました。円に対するブラジル・レアルのコール・オプションの売りを行い、通貨カバードコール戦略を構築しました。オプションのカバー率はファンドの純資産総額のおおむね50%程度としました。

## ■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

1 万口当り、第 1 期～第29期各180円、第30期～第38期各120円、第39期～第57期各80円、第58期～第66期各40円、第67期～第118期各30円の収益分配を行いました。

また、第114期～第118期の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。留保益につきましては、運用方針に基づき運用いたしました。

■分配原資の内訳（1 万口当り）

| 項 目            | 第114期                        | 第115期                         | 第116期                         | 第117期                         | 第118期                         |
|----------------|------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                | 2024年12月18日<br>～2025年 1 月17日 | 2025年 1 月18日<br>～2025年 2 月17日 | 2025年 2 月18日<br>～2025年 3 月17日 | 2025年 3 月18日<br>～2025年 4 月17日 | 2025年 4 月18日<br>～2025年 5 月19日 |
| 当期分配金(税込み) (円) | 30                           | 30                            | 30                            | 30                            | 30                            |
| 対基準価額比率 (%)    | 1.69                         | 1.66                          | 1.75                          | 1.98                          | 1.85                          |
| 当期の収益 (円)      | 28                           | 30                            | 27                            | 29                            | 28                            |
| 当期の収益以外 (円)    | 1                            | —                             | 2                             | 0                             | 1                             |
| 翌期繰越分配対象額 (円)  | 5,328                        | 5,334                         | 5,331                         | 5,331                         | 5,330                         |

- (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                   | 第114期    | 第115期    | 第116期    | 第117期    | 第118期    |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益       | ✓ 28.60円 | ✓ 35.86円 | ✓ 27.85円 | ✓ 29.47円 | ✓ 28.21円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益   | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     | 0.00     |
| (c) 収益調整金             | 4,806.44 | 4,812.52 | 4,818.28 | 4,829.81 | 4,842.93 |
| (d) 分配準備積立金           | ✓ 522.98 | 515.60   | ✓ 515.79 | ✓ 502.47 | ✓ 489.25 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 5,358.03 | 5,363.99 | 5,361.92 | 5,361.77 | 5,360.40 |
| (f) 分配金               | 30.00    | 30.00    | 30.00    | 30.00    | 30.00    |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)   | 5,328.03 | 5,333.99 | 5,331.92 | 5,331.77 | 5,330.40 |

- (注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。



1 万口当りの費用の明細

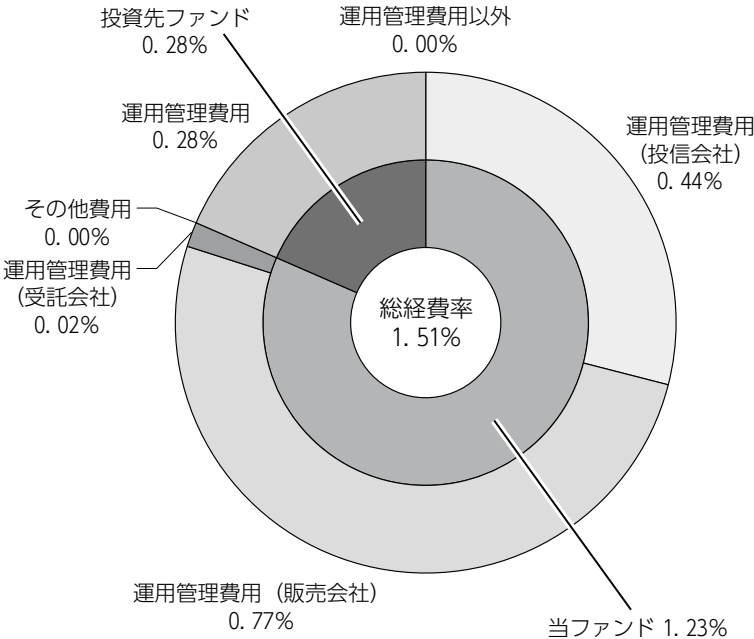
| 項 目        | 第114期～償還期<br>(2024. 12. 18～2025. 6. 17) |          | 項 目 の 概 要                                                               |
|------------|-----------------------------------------|----------|-------------------------------------------------------------------------|
|            | 金 額                                     | 比 率      |                                                                         |
| 信 託 報 酬    | 10円                                     | 0. 612%  | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は1, 672円です。                      |
| （投 信 会 社）  | (4)                                     | (0. 218) | 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）  | (6)                                     | (0. 383) | 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. 012) | 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    | 5                                       | 0. 327   | 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<br>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 |
| （投資信託受益証券） | (5)                                     | (0. 327) |                                                                         |
| 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<br>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  | —                                       | —        | 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                                         |
| 合 計        | 16                                      | 0. 939   |                                                                         |

- (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1.51%です。



|                      |       |
|----------------------|-------|
| 総経費率（①＋②＋③）          | 1.51% |
| ①当ファンドの費用の比率         | 1.23% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.28% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.00% |

- (注1) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）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) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。
- (注4) 各比率は、年率換算した値です。
- (注5) ①の費用は、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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。
- (注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- (注8) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2024年12月18日から2025年6月17日まで)

| 決 算 期   |                                                                 | 第 114 期 ～ 償 還 期 |        |              |         |
|---------|-----------------------------------------------------------------|-----------------|--------|--------------|---------|
|         |                                                                 | 買 付             |        | 売 付          |         |
|         |                                                                 | □ 数             | 金 額    | □ 数          | 金 額     |
|         |                                                                 | 千口              | 千円     | 千口           | 千円      |
| 外国（邦貨建） | DAIWA AMERICAN HIGH DIVIDEND EQUITY QUATTRO INCOME FUND（ケイマン諸島） | 7,559.78332     | 43,967 | 76,772.90038 | 425,720 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2024年12月18日から2025年6月17日まで)

| 決 算 期                      | 第 114 期 ～ 償 還 期 |     |     |     |
|----------------------------|-----------------|-----|-----|-----|
|                            | 設 定             |     | 解 約 |     |
|                            | □ 数             | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
|                            | 千□              | 千円  | 千□  | 千円  |
| ダイワ・マネーポート<br>フォリオ・マザーファンド | —               | —   | 1   | 1   |

(注) 単位未満は切捨て。

(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

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※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、大和証券株式会社です。

■利害関係人との取引状況等

(1) 当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。

(2) ダイワ・マネーポートフォリオ・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

(2024年12月18日から2025年6月17日まで)

| 決 算 期   | 第 114 期 ～ 償 還 期 |                        |      |           |                        |     |
|---------|-----------------|------------------------|------|-----------|------------------------|-----|
|         | 買付額等<br>A       | うち利害<br>関係人との<br>取引状況B | B/A  | 売付額等<br>C | うち利害<br>関係人との<br>取引状況D | D/C |
|         | 百万円             | 百万円                    | %    | 百万円       | 百万円                    | %   |
| 公社債     | 53,868          | 14,607                 | 27.1 | —         | —                      | —   |
| コール・ローン | 1,803,153       | —                      | —    | —         | —                      | —   |

(注) 平均保有割合0.0%  
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ペビーフاندのマザーファンド所有口数の割合。

■組入資産明細表

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

| 種 類                    | 第113期末 |    |
|------------------------|--------|----|
|                        | □ 数    | 千口 |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド | 1      |    |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2025年6月17日現在

| 項 目          | 償 還 時   |       |
|--------------|---------|-------|
|              | 評 価 額   | 比 率   |
|              | 千円      | %     |
| コール・ローン等、その他 | 341,713 | 100.0 |
| 投資信託財産総額     | 341,713 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

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）

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年 1月17日)、(2025年 2月17日)、(2025年 3月17日)、(2025年 4月17日)、(2025年 5月19日)、(2025年 6月17日) 現在

| 項 目                         | 第114期末             | 第115期末             | 第116期末             | 第117期末             | 第118期末             | 償還時                |
|-----------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| (A) 資産                      | 414, 400, 296円     | 422, 920, 966円     | 402, 134, 091円     | 355, 540, 183円     | 381, 082, 186円     | 341, 713, 463円     |
| コール・ローン等                    | 13, 481, 395       | 13, 487, 209       | 13, 843, 651       | 14, 275, 838       | 381, 082, 186      | 341, 709, 003      |
| 投資信託受益証券（評価額）               | 400, 917, 553      | 409, 432, 409      | 388, 289, 091      | 341, 262, 996      | —                  | —                  |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（評価額） | 1, 348             | 1, 348             | 1, 349             | 1, 349             | —                  | —                  |
| 未収利息                        | —                  | —                  | —                  | —                  | —                  | 4, 460             |
| (B) 負債                      | 7, 736, 377        | 7, 981, 099        | 7, 432, 421        | 7, 661, 959        | 8, 979, 445        | 668, 860           |
| 未払収益分配金                     | 7, 005, 269        | 6, 985, 943        | 7, 027, 807        | 7, 033, 771        | 7, 028, 384        | —                  |
| 未払解約金                       | 300, 594           | 558, 359           | 20, 802            | 222, 537           | 1, 553, 211        | 308, 837           |
| 未払信託報酬                      | 430, 514           | 436, 797           | 383, 812           | 405, 651           | 397, 850           | 360, 023           |
| (C) 純資産総額（A－B）              | 406, 663, 919      | 414, 939, 867      | 394, 701, 670      | 347, 878, 224      | 372, 102, 741      | 341, 044, 603      |
| 元本                          | 2, 335, 089, 676   | 2, 328, 647, 932   | 2, 342, 602, 496   | 2, 344, 590, 654   | 2, 342, 794, 744   | 2, 147, 893, 755   |
| 次期繰越損益金                     | △ 1, 928, 425, 757 | △ 1, 913, 708, 065 | △ 1, 947, 900, 826 | △ 1, 996, 712, 430 | △ 1, 970, 692, 003 | —                  |
| 償還差損益金                      | —                  | —                  | —                  | —                  | —                  | △ 1, 806, 849, 152 |
| (D) 受益権総口数                  | 2, 335, 089, 676口  | 2, 328, 647, 932口  | 2, 342, 602, 496口  | 2, 344, 590, 654口  | 2, 342, 794, 744口  | 2, 147, 893, 755口  |
| 1万口当り基準価額（C／D）              | 1, 742円            | 1, 782円            | 1, 685円            | 1, 484円            | 1, 588円            | —                  |
| 1万口当り償還価額（C／D）              | —                  | —                  | —                  | —                  | —                  | 1, 587円81銭         |

\* 当作成期首における元本額は2, 434, 393, 239円、当作成期間（第114期～償還期）中における追加設定元本額は256, 761, 693円、同解約元本額は543, 261, 177円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は1, 587円81銭です。

\* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1, 806, 849, 152円です。

■損益の状況

| 項 目                      | 第114期<br>自2024年12月18日<br>第115期<br>自2025年 1月18日 | 第115期<br>自2025年 1月17日<br>第116期<br>自2025年 2月18日 | 第116期<br>自2025年 2月17日<br>第117期<br>自2025年 3月18日 | 第117期<br>自2025年 3月17日<br>第118期<br>自2025年 4月18日 | 第118期<br>自2025年 4月17日<br>償還期<br>自2025年 5月20日 | 償還期<br>自2025年 5月19日<br>自2025年 6月17日        |
|--------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------------------------|
| (A) 配当等収益                | 7, 110, 883円                                   | 8, 575, 715円                                   | 6, 908, 470円                                   | 7, 317, 494円                                   | 6, 693, 965円                                 | 141, 394円                                  |
| 受取配当金                    | 7, 108, 968                                    | 8, 573, 114                                    | 6, 905, 585                                    | 7, 314, 843                                    | 6, 690, 010                                  | —                                          |
| 受取利息                     | 1, 915                                         | 2, 601                                         | 2, 885                                         | 2, 651                                         | 3, 955                                       | 141, 394                                   |
| (B) 有価証券売買損益             | △ 4, 878, 481                                  | 8, 197, 522                                    | △ 22, 139, 350                                 | △ 46, 603, 984                                 | 24, 698, 064                                 | 117, 034                                   |
| 売買益                      | 851, 313                                       | 8, 293, 015                                    | 39, 179                                        | 373, 866                                       | 25, 066, 499                                 | △ 12                                       |
| 売買損                      | △ 5, 729, 794                                  | △ 95, 493                                      | △ 22, 178, 529                                 | △ 46, 977, 850                                 | △ 368, 435                                   | △ 117, 046                                 |
| (C) 信託報酬等                | △ 430, 514                                     | △ 436, 797                                     | △ 383, 812                                     | △ 405, 651                                     | △ 397, 850                                   | △ 360, 023                                 |
| (D) 当期繰越損益金（A＋B＋C）       | 1, 801, 888                                    | 16, 336, 440                                   | △ 15, 614, 692                                 | △ 39, 692, 141                                 | 30, 994, 179                                 | △ 101, 595                                 |
| (E) 前期繰越損益金              | △ 356, 251, 559                                | △ 356, 316, 761                                | △ 345, 243, 322                                | △ 360, 193, 517                                | △ 396, 319, 419                              | △ 337, 539, 841                            |
| (F) 追加信託差損益金<br>(配当等相当額) | △ 1, 566, 970, 817<br>( 1, 122, 347, 289)      | △ 1, 566, 741, 801<br>( 1, 120, 668, 275)      | △ 1, 580, 015, 005<br>( 1, 128, 732, 763)      | △ 1, 589, 793, 001<br>( 1, 132, 394, 812)      | △ 1, 598, 338, 379<br>( 1, 134, 601, 240)    | △ 1, 469, 207, 716<br>( 1, 041, 388, 733)  |
| (売買損益相当額)                | △ 2, 689, 318, 106<br>(△ 2, 689, 318, 106)     | △ 2, 687, 410, 076<br>(△ 2, 687, 410, 076)     | △ 2, 708, 747, 768<br>(△ 2, 708, 747, 768)     | △ 2, 722, 187, 813<br>(△ 2, 722, 187, 813)     | △ 2, 732, 939, 619<br>(△ 2, 732, 939, 619)   | △ 2, 510, 596, 449<br>(△ 2, 510, 596, 449) |
| (G) 合計（D＋E＋F）            | △ 1, 921, 420, 488                             | △ 1, 906, 722, 122                             | △ 1, 940, 873, 019                             | △ 1, 989, 678, 659                             | △ 1, 963, 663, 619                           | △ 1, 806, 849, 152                         |
| (H) 収益分配金                | △ 7, 005, 269                                  | △ 6, 985, 943                                  | △ 7, 027, 807                                  | △ 7, 033, 771                                  | △ 7, 028, 384                                | —                                          |
| 次期繰越損益金（G＋H）             | △ 1, 928, 425, 757                             | △ 1, 913, 708, 065                             | △ 1, 947, 900, 826                             | △ 1, 996, 712, 430                             | △ 1, 970, 692, 003                           | —                                          |
| 追加信託差損益金<br>(配当等相当額)     | △ 1, 566, 970, 817<br>( 1, 122, 347, 289)      | △ 1, 566, 741, 801<br>( 1, 120, 668, 275)      | △ 1, 580, 015, 005<br>( 1, 128, 732, 763)      | △ 1, 589, 793, 001<br>( 1, 132, 394, 812)      | △ 1, 598, 338, 379<br>( 1, 134, 601, 240)    | △ 1, 469, 207, 716<br>( 1, 041, 388, 733)  |
| (売買損益相当額)                | △ 2, 689, 318, 106<br>(△ 2, 689, 318, 106)     | △ 2, 687, 410, 076<br>(△ 2, 687, 410, 076)     | △ 2, 708, 747, 768<br>(△ 2, 708, 747, 768)     | △ 2, 722, 187, 813<br>(△ 2, 722, 187, 813)     | △ 2, 732, 939, 619<br>(△ 2, 732, 939, 619)   | △ 2, 510, 596, 449<br>(△ 2, 510, 596, 449) |
| 分配準備積立金                  | 121, 797, 217                                  | 121, 432, 275                                  | 120, 326, 126                                  | 117, 688, 241                                  | 114, 203, 292                                | —                                          |
| 繰越損益金                    | △ 483, 252, 157                                | △ 468, 398, 539                                | △ 488, 211, 947                                | △ 524, 607, 670                                | △ 486, 556, 916                              | —                                          |
| 償還差損益金（G）                | —                                              | —                                              | —                                              | —                                              | —                                            | △ 1, 806, 849, 152                         |

(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) 第114期～第118期の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                   | 第114期          | 第115期          | 第116期          | 第117期          | 第118期          |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益       | 6,680,369円     | 8,352,381円     | 6,524,658円     | 6,911,843円     | 6,609,143円     |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益   | 0              | 0              | 0              | 0              | 0              |
| (c) 収益調整金             | 1,122,347,289  | 1,120,668,275  | 1,128,732,763  | 1,132,394,812  | 1,134,601,240  |
| (d) 分配準備積立金           | 122,122,117    | 120,065,837    | 120,829,275    | 117,810,169    | 114,622,533    |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 1,251,149,775  | 1,249,086,493  | 1,256,086,696  | 1,257,116,824  | 1,255,832,916  |
| (f) 分配金               | 7,005,269      | 6,985,943      | 7,027,807      | 7,033,771      | 7,028,384      |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)   | 1,244,144,506  | 1,242,100,550  | 1,249,058,889  | 1,250,083,053  | 1,248,804,532  |
| (h) 受益権総口数            | 2,335,089,676□ | 2,328,647,932□ | 2,342,602,496□ | 2,344,590,654□ | 2,342,794,744□ |

投 資 信 託 財 産 運 用 総 括 表

| 信 託 期 間         | 投資信託契約締結日      | 2015年 6月26日    |                | 投資信託契約終了時の状況    |                |
|-----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|----------------|
|                 | 投資信託契約終了日      | 2025年 6月17日    |                | 資 産 総 額         | 341,713,463円   |
| 区 分             | 投資信託<br>契約締結当初 | 投資信託<br>契約終了時  | 差引増減又は<br>追加信託 | 負 債 総 額         | 668,860円       |
|                 |                |                |                | 純資産総額           | 341,044,603円   |
| 受益権口数           | 100,000,000□   | 2,147,893,755□ | 2,047,893,755□ | 受益権口数           | 2,147,893,755□ |
| 元 本 額           | 100,000,000円   | 2,147,893,755円 | 2,047,893,755円 | 1単位当り償還金        | 1,587円81銭      |
| 毎 計 算 期 末 の 状 況 |                |                |                |                 |                |
| 計 算 期           | 元 本 額          | 純 資 産 総 額      | 基 準 価 額        | 1 単 位 当 り 分 配 金 |                |
|                 |                |                |                | 金 額             | 分 配 率          |
|                 | 円              | 円              | 円              | 円               | %              |
| 第 1 期           | 160,006,001    | 148,738,749    | 9,296          | 180             | 1.80           |
| 第 2 期           | 160,086,001    | 124,704,873    | 7,790          | 180             | 1.80           |
| 第 3 期           | 160,130,851    | 126,169,693    | 7,879          | 180             | 1.80           |
| 第 4 期           | 161,146,673    | 129,686,030    | 8,048          | 180             | 1.80           |
| 第 5 期           | 161,303,426    | 126,439,302    | 7,839          | 180             | 1.80           |
| 第 6 期           | 173,165,523    | 120,432,011    | 6,955          | 180             | 1.80           |
| 第 7 期           | 162,005,669    | 112,854,939    | 6,966          | 180             | 1.80           |
| 第 8 期           | 162,902,258    | 121,128,595    | 7,436          | 180             | 1.80           |
| 第 9 期           | 163,889,469    | 125,314,532    | 7,646          | 180             | 1.80           |
| 第10期            | 175,706,205    | 135,857,984    | 7,732          | 180             | 1.80           |
| 第11期            | 183,835,650    | 138,150,267    | 7,515          | 180             | 1.80           |
| 第12期            | 213,241,736    | 172,464,726    | 8,088          | 180             | 1.80           |
| 第13期            | 246,910,079    | 193,567,384    | 7,840          | 180             | 1.80           |
| 第14期            | 316,167,175    | 237,610,184    | 7,515          | 180             | 1.80           |
| 第15期            | 768,039,857    | 584,289,167    | 7,608          | 180             | 1.80           |
| 第16期            | 1,250,893,485  | 942,768,847    | 7,537          | 180             | 1.80           |

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）

| 計 算 期 | 元 本 額         | 純 資 産 総 額     | 基 準 価 額 | 1 単 位 当 り 分 配 金 |       |
|-------|---------------|---------------|---------|-----------------|-------|
|       |               |               |         | 金 額             | 分 配 率 |
|       | 円             | 円             | 円       | 円               | %     |
| 第17期  | 2,361,474,286 | 1,903,173,695 | 8,059   | 180             | 1.80  |
| 第18期  | 3,460,126,053 | 2,790,704,442 | 8,065   | 180             | 1.80  |
| 第19期  | 4,743,104,078 | 3,917,992,487 | 8,260   | 180             | 1.80  |
| 第20期  | 5,299,348,481 | 4,275,524,320 | 8,068   | 180             | 1.80  |
| 第21期  | 5,104,253,915 | 3,878,449,980 | 7,598   | 180             | 1.80  |
| 第22期  | 5,087,080,688 | 3,949,098,409 | 7,763   | 180             | 1.80  |
| 第23期  | 5,144,060,574 | 3,722,565,967 | 7,237   | 180             | 1.80  |
| 第24期  | 4,990,418,979 | 3,586,892,230 | 7,188   | 180             | 1.80  |
| 第25期  | 4,772,968,940 | 3,346,566,747 | 7,011   | 180             | 1.80  |
| 第26期  | 4,470,159,754 | 3,138,872,295 | 7,022   | 180             | 1.80  |
| 第27期  | 4,375,280,074 | 3,044,530,697 | 6,958   | 180             | 1.80  |
| 第28期  | 4,285,948,984 | 2,866,010,671 | 6,687   | 180             | 1.80  |
| 第29期  | 4,258,216,869 | 2,827,469,739 | 6,640   | 180             | 1.80  |
| 第30期  | 4,211,354,260 | 2,801,314,105 | 6,652   | 120             | 1.20  |
| 第31期  | 3,876,813,884 | 2,408,382,032 | 6,212   | 120             | 1.20  |
| 第32期  | 3,799,818,409 | 2,296,559,317 | 6,044   | 120             | 1.20  |
| 第33期  | 3,741,288,474 | 2,171,260,057 | 5,804   | 120             | 1.20  |
| 第34期  | 3,712,661,286 | 2,056,396,000 | 5,539   | 120             | 1.20  |
| 第35期  | 3,470,638,233 | 1,874,232,534 | 5,400   | 120             | 1.20  |
| 第36期  | 3,440,186,198 | 1,836,594,789 | 5,339   | 120             | 1.20  |
| 第37期  | 3,310,937,907 | 1,736,048,480 | 5,243   | 120             | 1.20  |
| 第38期  | 3,241,461,418 | 1,600,167,098 | 4,937   | 120             | 1.20  |
| 第39期  | 3,263,673,425 | 1,669,393,310 | 5,115   | 80              | 0.80  |
| 第40期  | 3,157,222,208 | 1,604,183,906 | 5,081   | 80              | 0.80  |
| 第41期  | 2,995,418,284 | 1,423,459,361 | 4,752   | 80              | 0.80  |
| 第42期  | 2,906,706,519 | 1,346,538,270 | 4,633   | 80              | 0.80  |
| 第43期  | 2,894,110,618 | 1,385,935,938 | 4,789   | 80              | 0.80  |
| 第44期  | 2,807,285,577 | 1,323,502,846 | 4,715   | 80              | 0.80  |
| 第45期  | 2,753,077,701 | 1,292,472,580 | 4,695   | 80              | 0.80  |
| 第46期  | 2,778,078,545 | 1,213,304,636 | 4,367   | 80              | 0.80  |
| 第47期  | 2,788,701,038 | 1,222,649,481 | 4,384   | 80              | 0.80  |
| 第48期  | 2,770,537,249 | 1,239,656,432 | 4,474   | 80              | 0.80  |
| 第49期  | 2,774,083,971 | 1,086,661,652 | 3,917   | 80              | 0.80  |
| 第50期  | 2,778,460,983 | 1,113,075,956 | 4,006   | 80              | 0.80  |

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）

| 計 算 期 | 元 本 額         | 純 資 産 総 額     | 基 準 価 額 | 1 単 位 当 り 分 配 金 |       |
|-------|---------------|---------------|---------|-----------------|-------|
|       |               |               |         | 金 額             | 分 配 率 |
|       | 円             | 円             | 円       | 円               | %     |
| 第51期  | 2,739,888,771 | 1,057,980,257 | 3,861   | 80              | 0.80  |
| 第52期  | 2,774,129,087 | 1,071,896,542 | 3,864   | 80              | 0.80  |
| 第53期  | 2,758,370,177 | 1,085,117,720 | 3,934   | 80              | 0.80  |
| 第54期  | 2,532,485,644 | 979,974,622   | 3,870   | 80              | 0.80  |
| 第55期  | 2,513,863,698 | 923,163,391   | 3,672   | 80              | 0.80  |
| 第56期  | 2,478,605,098 | 473,085,956   | 1,909   | 80              | 0.80  |
| 第57期  | 2,621,017,380 | 511,831,573   | 1,953   | 80              | 0.80  |
| 第58期  | 2,749,515,583 | 474,995,754   | 1,728   | 40              | 0.40  |
| 第59期  | 2,745,433,411 | 541,757,580   | 1,973   | 40              | 0.40  |
| 第60期  | 2,753,429,161 | 522,390,534   | 1,897   | 40              | 0.40  |
| 第61期  | 2,779,932,582 | 531,790,604   | 1,913   | 40              | 0.40  |
| 第62期  | 2,780,241,552 | 529,647,346   | 1,905   | 40              | 0.40  |
| 第63期  | 2,797,604,352 | 502,533,720   | 1,796   | 40              | 0.40  |
| 第64期  | 2,767,702,481 | 528,584,474   | 1,910   | 40              | 0.40  |
| 第65期  | 2,748,938,300 | 543,400,526   | 1,977   | 40              | 0.40  |
| 第66期  | 2,739,027,305 | 540,062,484   | 1,972   | 40              | 0.40  |
| 第67期  | 2,733,774,244 | 543,761,393   | 1,989   | 30              | 0.30  |
| 第68期  | 2,592,996,484 | 543,111,591   | 2,095   | 30              | 0.30  |
| 第69期  | 2,537,893,657 | 542,542,639   | 2,138   | 30              | 0.30  |
| 第70期  | 2,515,970,795 | 571,131,840   | 2,270   | 30              | 0.30  |
| 第71期  | 2,506,024,850 | 575,392,473   | 2,296   | 30              | 0.30  |
| 第72期  | 2,489,446,250 | 546,529,226   | 2,195   | 30              | 0.30  |
| 第73期  | 2,445,783,047 | 530,361,674   | 2,168   | 30              | 0.30  |
| 第74期  | 2,412,835,878 | 517,592,564   | 2,145   | 30              | 0.30  |
| 第75期  | 2,401,077,431 | 524,564,872   | 2,185   | 30              | 0.30  |
| 第76期  | 2,371,004,530 | 525,772,590   | 2,218   | 30              | 0.30  |
| 第77期  | 2,379,505,649 | 506,089,403   | 2,127   | 30              | 0.30  |
| 第78期  | 2,337,055,977 | 521,210,889   | 2,230   | 30              | 0.30  |
| 第79期  | 2,314,819,029 | 533,526,995   | 2,305   | 30              | 0.30  |
| 第80期  | 2,302,885,460 | 547,757,066   | 2,379   | 30              | 0.30  |
| 第81期  | 2,266,444,179 | 595,513,872   | 2,628   | 30              | 0.30  |
| 第82期  | 2,250,937,479 | 551,042,751   | 2,448   | 30              | 0.30  |
| 第83期  | 2,229,278,455 | 527,107,236   | 2,364   | 30              | 0.30  |
| 第84期  | 2,262,729,992 | 527,999,402   | 2,333   | 30              | 0.30  |

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）

| 計 算 期 | 元 本 額            | 純 資 産 総 額     | 基 準 価 額 | 1 単 位 当 り 分 配 金 |       |
|-------|------------------|---------------|---------|-----------------|-------|
|       |                  |               |         | 金 額             | 分 配 率 |
|       | 円                | 円             | 円       | 円               | %     |
| 第85期  | 2, 302, 347, 340 | 573, 842, 421 | 2, 492  | 30              | 0. 30 |
| 第86期  | 2, 288, 711, 173 | 541, 144, 851 | 2, 364  | 30              | 0. 30 |
| 第87期  | 2, 324, 920, 887 | 528, 825, 483 | 2, 275  | 30              | 0. 30 |
| 第88期  | 2, 340, 890, 590 | 536, 377, 101 | 2, 291  | 30              | 0. 30 |
| 第89期  | 2, 349, 660, 306 | 531, 968, 451 | 2, 264  | 30              | 0. 30 |
| 第90期  | 2, 366, 329, 939 | 535, 936, 351 | 2, 265  | 30              | 0. 30 |
| 第91期  | 2, 405, 836, 016 | 555, 245, 853 | 2, 308  | 30              | 0. 30 |
| 第92期  | 2, 438, 433, 338 | 510, 419, 601 | 2, 093  | 30              | 0. 30 |
| 第93期  | 2, 388, 720, 070 | 530, 485, 662 | 2, 221  | 30              | 0. 30 |
| 第94期  | 2, 456, 655, 454 | 515, 371, 209 | 2, 098  | 30              | 0. 30 |
| 第95期  | 2, 436, 862, 817 | 541, 504, 318 | 2, 222  | 30              | 0. 30 |
| 第96期  | 2, 399, 757, 495 | 529, 130, 626 | 2, 205  | 30              | 0. 30 |
| 第97期  | 2, 412, 626, 141 | 522, 644, 600 | 2, 166  | 30              | 0. 30 |
| 第98期  | 2, 451, 912, 468 | 545, 398, 599 | 2, 224  | 30              | 0. 30 |
| 第99期  | 2, 526, 654, 697 | 523, 661, 678 | 2, 073  | 30              | 0. 30 |
| 第100期 | 2, 525, 929, 097 | 540, 749, 921 | 2, 141  | 30              | 0. 30 |
| 第101期 | 2, 552, 220, 844 | 526, 019, 290 | 2, 061  | 30              | 0. 30 |
| 第102期 | 2, 597, 839, 866 | 536, 645, 484 | 2, 066  | 30              | 0. 30 |
| 第103期 | 2, 560, 957, 507 | 531, 572, 601 | 2, 076  | 30              | 0. 30 |
| 第104期 | 2, 497, 746, 078 | 519, 859, 299 | 2, 081  | 30              | 0. 30 |
| 第105期 | 2, 502, 677, 441 | 500, 482, 449 | 2, 000  | 30              | 0. 30 |
| 第106期 | 2, 525, 508, 541 | 536, 063, 972 | 2, 123  | 30              | 0. 30 |
| 第107期 | 2, 465, 861, 150 | 484, 269, 107 | 1, 964  | 30              | 0. 30 |
| 第108期 | 2, 450, 304, 811 | 493, 606, 006 | 2, 014  | 30              | 0. 30 |
| 第109期 | 2, 373, 387, 634 | 447, 899, 665 | 1, 887  | 30              | 0. 30 |
| 第110期 | 2, 390, 398, 858 | 426, 417, 436 | 1, 784  | 30              | 0. 30 |
| 第111期 | 2, 396, 171, 772 | 448, 257, 236 | 1, 871  | 30              | 0. 30 |
| 第112期 | 2, 429, 443, 483 | 461, 827, 079 | 1, 901  | 30              | 0. 30 |
| 第113期 | 2, 434, 393, 239 | 429, 541, 736 | 1, 764  | 30              | 0. 30 |
| 第114期 | 2, 335, 089, 676 | 406, 663, 919 | 1, 742  | 30              | 0. 30 |
| 第115期 | 2, 328, 647, 932 | 414, 939, 867 | 1, 782  | 30              | 0. 30 |
| 第116期 | 2, 342, 602, 496 | 394, 701, 670 | 1, 685  | 30              | 0. 30 |
| 第117期 | 2, 344, 590, 654 | 347, 878, 224 | 1, 484  | 30              | 0. 30 |
| 第118期 | 2, 342, 794, 744 | 372, 102, 741 | 1, 588  | 30              | 0. 30 |

(注) 1単位は受益権1万口。



| 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ    |       |       |       |       |       |
|------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万 口 当 り 分 配 金（税 込 み） | 第114期 | 第115期 | 第116期 | 第117期 | 第118期 |
|                        | 30円   | 30円   | 30円   | 30円   | 30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。

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <ul style="list-style-type: none"><li>・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。</li><li>・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。</li><li>・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。</li><li>・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。</li></ul> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

| 償 還 金 の お 知 ら せ |           |
|-----------------|-----------|
| 1 万 口 当 り 償 還 金 | 1,587円81銭 |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>《お知らせ》</p> <p>■運用報告書にかかる信託約款の条文変更について</p> <p>2025年4月1日付の投資信託及び投資法人に関する法律の改正により、運用報告書にかかる規定が変更されたため、運用報告書にかかる信託約款の条文を以下のとおり変更しました。（下線部を変更）</p> <p>＜変更前＞</p> <p>（運用報告書に記載すべき事項の提供）</p> <p>① 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める<u>運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。</u></p> <p>② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から<u>運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。</u></p> <p>＜変更後＞</p> <p>（運用状況にかかる情報の提供）</p> <p>① 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める事項にかかる情報を電磁的方法により提供します。</p> <p>② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、<u>書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行なうものとします。</u></p> <p>-----</p> <p>2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。</p> |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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）

アメリカン・エクイティ・クワトロ・ファンド

当ファンド（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））はケイマン籍の外国投資信託「UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅲーダイワ・アメリカン・ハイ・ディビデンド・エクイティ・クワトロ・インカム・ファンド」の受益証券（円建）を主要投資対象としております。以下の内容は、直近で入手可能な Financial Statements 等から抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

（円建て）

財政状態計算書  
2024年 9 月30日

資産

|                        |   |               |
|------------------------|---|---------------|
| 金融資産（損益通算後の公正価値による評価額） | ¥ | 443, 907, 530 |
| 資産合計                   |   | 443, 907, 530 |

|                               |   |               |
|-------------------------------|---|---------------|
| 資本（償還可能資本参加型受益証券の保有者に帰属する純資産） | ¥ | 443, 907, 530 |
|-------------------------------|---|---------------|

包括利益計算書  
2024年 9 月30日に終了した年度

収益

|                                        |   |                 |
|----------------------------------------|---|-----------------|
| 金融商品（損益通算後の公正価値による評価額）からの純損益           |   |                 |
| 手数料収入                                  | ¥ | 123, 856, 329   |
| 金融資産および負債（損益通算後の公正価値による評価額）に係る純実現損益    |   | 21, 320, 239    |
| 金融資産および負債（損益通算後の公正価値による評価額）に係る評価損益の純変動 |   | (106, 872, 390) |
| 収益合計                                   |   | 38, 304, 178    |

費用

|          |  |             |
|----------|--|-------------|
| 報酬代行会社報酬 |  | 1, 762, 839 |
| 費用合計     |  | 1, 762, 839 |

|      |  |              |
|------|--|--------------|
| 営業損益 |  | 36, 541, 339 |
|------|--|--------------|

|                                                  |   |              |
|--------------------------------------------------|---|--------------|
| 包括利益合計<br>（運用の結果生じた償還可能資本参加型受益証券の保有者に帰属する純資産の増減） | ¥ | 36, 541, 339 |
|--------------------------------------------------|---|--------------|

2024年9月30日現在の担保付スワップの残高

|            |                      |
|------------|----------------------|
| ストラテジー     | U. S. 高配当株式クワトロ戦略    |
| 満期日        | 2027年7月8日            |
| カウンターパーティ  | UBS AG               |
| 簿価         | 3, 287, 377, 015 円   |
| 公正価値による評価額 | 443, 907, 530 円      |
| 評価損益       | (2, 843, 469, 485) 円 |

（注）担保付スワップ取引を通じて、上場外国投資信託証券に投資し実質的に米国の高配当株へ投資するとともに、為替取引ならびに株式および通貨のカバードコール戦略を組み合わせています。

# 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16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。

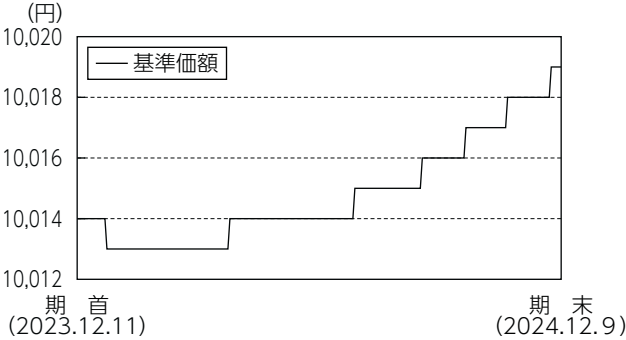
|             |                           |
|-------------|---------------------------|
| 運 用 方 針     | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主 要 投 資 対 象 | 円建ての債券                    |
| 株 式 組 入 制 限 | 純資産総額の10%以下               |

## 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   | 騰 落 率 |               |
| (期首)2023年12月11日 | 円       | %     | %             |
| 12月末            | 10,014  | 0.0   | —             |
| 2024年1月末        | 10,013  | △0.0  | —             |
| 2月末             | 10,013  | △0.0  | —             |
| 3月末             | 10,013  | △0.0  | 56.8          |
| 4月末             | 10,014  | 0.0   | 55.6          |
| 5月末             | 10,014  | 0.0   | 58.1          |
| 6月末             | 10,014  | 0.0   | 54.0          |
| 7月末             | 10,015  | 0.0   | 54.0          |
| 8月末             | 10,016  | 0.0   | 55.0          |
| 9月末             | 10,017  | 0.0   | 60.0          |
| 10月末            | 10,018  | 0.0   | 59.1          |
| 11月末            | 10,018  | 0.0   | 62.9          |
| (期末)2024年12月9日  | 10,019  | 0.0   | 62.9          |

(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：10,014円 期末：10,019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

○国内短期金融市場

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」

流動性及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

流動性及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》

流動性及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)

|     |      | 買 付 額      | 売 付 額             |
|-----|------|------------|-------------------|
| 国 内 | 国債証券 | 千円         | 千円                |
|     |      | 95,595,643 | —<br>(63,000,000) |

(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                     | 金 額              | 銘   | 金 額 |
| 1219国庫短期証券 2024/6/24  | 千円<br>32,999,307 |     | 千円  |
| 1258国庫短期証券 2024/12/23 | 32,596,486       |     |     |
| 1239国庫短期証券 2024/9/24  | 29,999,850       |     |     |

(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  | 当 期        |            |      | 末               |           |      |      |
|------|------------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| 区 分  | 額面金額       | 評 価 額      | 組入比率 | うちBB格以下<br>組入比率 | 残存期間別組入比率 |      |      |
|      | 千円         | 千円         | %    | %               | 5年以上      | 2年以上 | 2年末満 |
| 国債証券 | 32,600,000 | 32,599,453 | 62.9 | —               | —         | —    | 62.9 |

(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      |
| 国債証券 | 1258国庫短期証券 | %<br>— | 千円<br>32,600,000 | 千円<br>32,599,453 | 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        |       | 末 |
|--------------|------------|-------|---|
|              | 評 価 額      | 比 率   |   |
|              | 千円         | %     |   |
| 公社債          | 32,599,453 | 62.9  |   |
| コール・ローン等、その他 | 19,265,458 | 37.1  |   |
| 投資信託財産総額     | 51,864,911 | 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 | 末               |
|----------------|-----|-----------------|
| (A) 資産         |     | 51,864,911,730円 |
| コール・ローン等       |     | 19,265,458,266  |
| 公社債(評価額)       |     | 32,599,453,464  |
| (B) 負債         |     | 2,765,000       |
| 未払解約金          |     | 2,765,000       |
| (C) 純資産総額(A－B) |     | 51,862,146,730  |
| 元本             |     | 51,764,911,701  |
| 次期繰越損益金        |     | 97,235,029      |
| (D) 受益権総口数     |     | 51,764,911,701口 |
| 1万口当り基準価額(C／D) |     | 10,019円         |

\* 期首における元本額は62,579,567,123円、当作成期間中における追加設定元本額は19,540,096,318円、同解約元本額は30,354,751,740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：  
    ダイワミドル・ブルファンド（適格機関投資家専用） 48,964,798円  
    ダイワミドル・ベアファンド（適格機関投資家専用） 3,520,288,985円  
    ダイワ・マネーポートフォリオ（FOF s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） 595,752,000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） 1,993,906円  
    ダイワ/パリュール・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） 1,346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） 1,346円  
    オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース） 1,973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） 1,973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） 1,973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） 1,973円  
    NYダウ・トリプル・レバレッジ 1,079,436,135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  
    NASDAQ100 3倍ベア 675,399,527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） 8,076,387,870円  
    ダイワJGBベア・ファンド2（適格機関投資家専用） 37,760,624,420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  
    ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド（為替ヘッジなし/資産成長型） 999円  
    ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド（為替ヘッジなし/資産成長型） 999円  
    ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド（為替ヘッジなし/4回決算型） 999円  
    ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド（為替ヘッジあり/年4回決算型） 999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 - USTライアンブル - 997,374円  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,019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             | 27,861,093円 |
| 受取利息                  | 29,709,921  |
| 支払利息                  | △ 1,848,828 |
| (B) 有価証券売買損益          | 82          |
| 売買益                   | 82          |
| (C) 当期損益金(A + B)      | 27,861,175  |
| (D) 前期繰越損益金           | 85,071,521  |
| (E) 解約差損益金            | △44,514,349 |
| (F) 追加信託差損益金          | 28,816,682  |
| (G) 合計(C + D + E + F) | 97,235,029  |
| 次期繰越損益金(G)            | 97,235,029  |

(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。