

iFree レバレッジ FANG+

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／特殊型（ブル・ベア型）		
信託期間	無期限（設定日：2020年 8月19日）		
運用方針	日々の基準価額の値動きが NYSE FANG+指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの 2 倍程度となることをめざして運用を行ないます。		
主 要 投資対象	ベビーファンド	スター・ヘリオス・ピーエルシーが発行する債券（円建）、ETF（上場投資信託証券）、ETN（上場投資証券）、米国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。）、米国の債券、わが国の債券、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および米国の株価指数先物取引	
	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	円建ての債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組 入 上 限 比 率		無制限
	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。		

運用報告書(全体版) 第5期

（決算日 2025年8月18日）
（作成対象期間 2024年8月20日～2025年8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し上げます。

当ファンドは、日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			NYSE FANG+指数 (税引後配当込み、米ドルベース)		公 社 債 入 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 中 率	(参考指数)	期 騰 落 中 率		
	円	円	%		%	%	百万円
1 期末 (2021年 8 月18日)	16, 632	0	66. 3	13, 515	35. 2	99. 3	6, 761
2 期末 (2022年 8 月18日)	8, 965	0	△ 46. 1	11, 146	△ 17. 5	99. 8	3, 139
3 期末 (2023年 8 月18日)	11, 645	0	29. 9	14, 401	29. 2	99. 1	6, 459
4 期末 (2024年 8 月19日)	22, 760	0	95. 4	22, 130	53. 7	101. 0	20, 845
5 期末 (2025年 8 月18日)	36, 249	0	59. 3	30, 510	37. 9	100. 1	40, 459

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) NYSE FANG+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) 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 6) 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。

Source ICE Data Indices, LLC is used with permission. The index data and marks referenced herein are the property of ICE Data Indices, LLC, its affiliates ("ICE Data") and/or its third party suppliers ("ICE Data and its Suppliers") and have been licensed for use by Daiwa Asset Management Co. Ltd. ICE Data and its Suppliers accept no liability in connection with the use of such index data or marks. See [<https://www.daiwa-am.co.jp/funds/disclaimer/index.html>] for a full copy of the Disclaimer.

出所：ICE Data Indices, LLC (以下「ICE データ」)

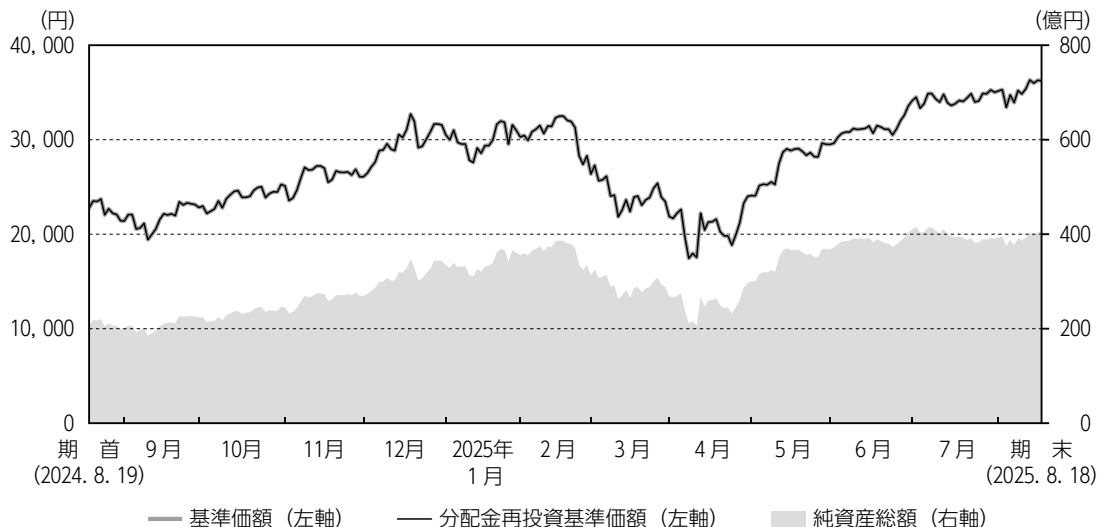
本書で言及されているインデックスデータおよびマークは、ICE データ、その関連会社またはその第三者供給元の所有物であり、大和アセットマネジメント株式会社に対して使用許諾されています。ICE データおよびその供給元は、当該インデックスデータまたはマークの使用に関して、いかなる責任も負いません。免責事項の全文は [<https://www.daiwa-am.co.jp/funds/disclaimer/index.html>] をご覧ください。

In the event of any inconsistency between the English version and the Japanese version of this disclaimer, the English version shall prevail.



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：22,760円

期末：36,249円（分配金 0 円）

騰落率：59.3%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

日々の基準価額の値動きが NYSE FANG + 指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの 2 倍程度となることをめざした運用を行った結果、NYSE FANG + 指数で組み入れているハイテク銘柄が上昇したことから、当ファンドの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。

iFree レバレッジ FANG+

年 月 日	基 準 価 額		NYSE FANG + 指数 (税引後配当込み、米ドルベース)		公 社 債 組 入 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	
(期 首) 2024年 8 月19日	円 22,760	% —	22,130	% —	% 101.0
8 月末	21,396	△ 6.0	21,501	△ 2.8	99.8
9 月末	22,834	0.3	22,392	1.2	99.7
10月末	25,110	10.3	23,616	6.7	100.7
11月末	26,087	14.6	24,241	9.5	99.8
12月末	30,515	34.1	26,494	19.7	99.6
2025年 1 月末	30,283	33.1	26,615	20.3	100.3
2 月末	26,368	15.9	24,940	12.7	100.3
3 月末	21,876	△ 3.9	22,814	3.1	99.9
4 月末	24,091	5.8	24,374	10.1	99.8
5 月末	29,498	29.6	27,174	22.8	100.5
6 月末	34,129	50.0	29,389	32.8	99.9
7 月末	35,164	54.5	29,970	35.4	99.9
(期 末) 2025年 8 月18日	36,249	59.3	30,510	37.9	100.1

(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. 8. 20 ~ 2025. 8. 18)

■米国株式市況

米国株式市況は、上昇基調で推移した後に急落しましたが、その後の急騰で史上最高値を更新しました。

米国株式市況は、当作成期首より、米国の経済指標の改善や利下げ開始を強く示唆したF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などを好感して上昇すると、2024年9月中旬以降も、F R Bにより利下げが行われたことや11月初旬の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことなどが好感され、上昇基調で推移しました。12月中旬にF R Bが0.25%ポイントの利下げを決定した際には、今後の利下げペースの減速が示唆されたことで株価は小幅に下落しましたが、2025年1月中旬以降は、C P I（消費者物価指数）が市場予想を下回っ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が強まり、大幅に下落しました。4月2日に米国の相互関税が発表されると、事前予想よりも厳しい内容となったことから株価は急落し、当作成期の安値を記録しました。しかし、同月9日に相互関税の上乗せ部分が発動された直後、その大部分の適用が90日間停止されたことなどが好感され、株価は急反発しました。5月以降は、米中双方が関税を大幅に引き下げるなど米国の関税を巡る懸念が後退する中で、A I（人工知能）関連企業の成長期待が高まったことなどが相場をけん引し、史上最高値を更新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、主にスター・ヘリオス・ピーエルシーが発行する債券（円建）（以下「パフォーマンス連動債券」といいます。）を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きがNYSE FANG + 指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざして運用を行います。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

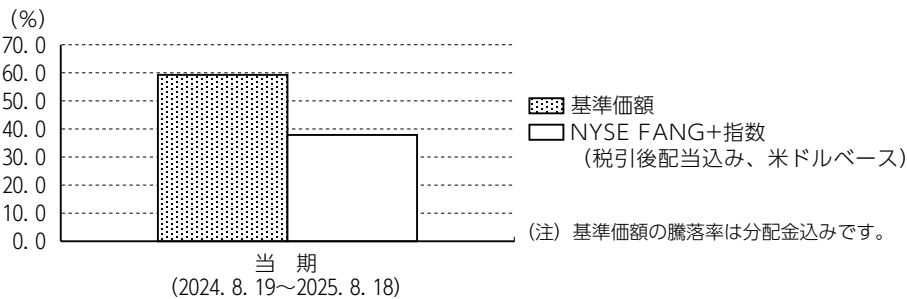
(2024. 8. 20 ~ 2025. 8. 18)

当ファンド

パフォーマンス連動債券への投資割合を高位に維持しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が少額であったため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当期	
	2024年8月20日 ～2025年8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)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	26,249

- (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、主にパフォーマンス連動債券を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きがNYSE FANG + 指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざして運用を行います。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローンによる運用を行う方針です。

1 万口当りの費用の明細

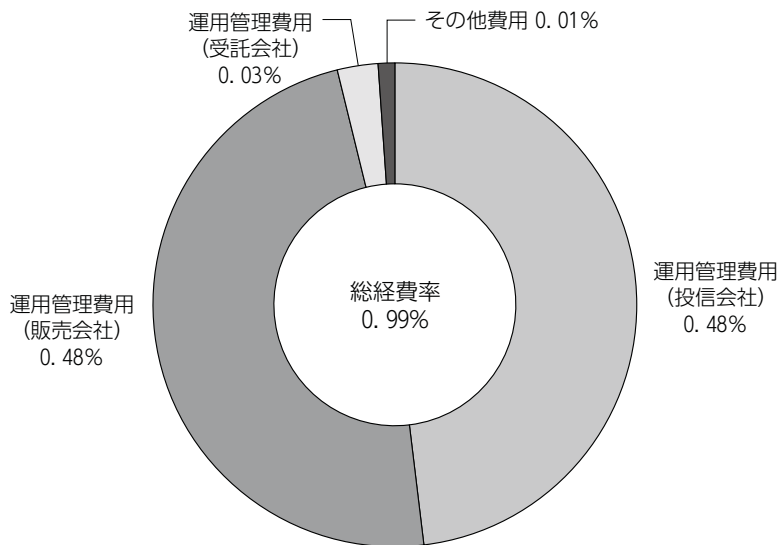
項 目	当 期 (2024. 8. 20～2025. 8. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	270円	0. 982%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は 27, 533円です。
(投 信 会 社)	(131)	(0. 477)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(131)	(0. 477)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(8)	(0. 027)	受託会社分は、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	3	0. 011	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)	(1)	(0. 004)	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. 007)	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	273	0. 993	

- (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0.99%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0.29%程度以下、その他各種費用等

■売買および取引の状況

公 社 債

(2024年 8 月20日から2025年 8 月18日まで)

		買 付 額	売 付 額
国内	社債券	千円 14, 979, 160	千円 10, 922, 954 (—)

(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 8 月20日から2025年 8 月18日まで)

当 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
Star Helios Plc 2029/8/20 (ユーロ円債)	千円 14, 979, 160	Star Helios Plc 2029/8/20 (ユーロ円債)	千円 10, 922, 954

(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 末						
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 10, 614, 000	千円 40, 517, 883	% 100. 1	% —	% —	% 100. 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）

当 期 末					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
普通社債券	Star Helios Plc	—	10,614,000	40,517,883	2029/08/20

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2025年8月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	40,517,883	98.0
コール・ローン等、その他	827,231	2.0
投資信託財産総額	41,345,115	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8月18日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	41,345,115,394円
コール・ローン等	827,231,794
公社債（評価額）	40,517,883,600
(B)負債	886,027,611
未払金	297,182,800
未払解約金	421,863,495
未払信託報酬	165,860,941
その他未払費用	1,120,375
(C)純資産総額（A－B）	40,459,087,783
元本	11,161,314,593
次期繰越損益金	29,297,773,190
(D)受益権総口数	11,161,314,593口
1万口当り基準価額（C／D）	36,249円

* 期首における元本額は9,158,459,107円、当作成期間中における追加設定元本額は16,055,047,358円、同解約元本額は14,052,191,872円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は36,249円です。

■損益の状況

当期 自2024年8月20日 至2025年8月18日

項 目	当 期
(A)配当等収益	7,960,481円
受取利息	1,408,326
その他収益金	6,552,155
(B)有価証券売買損益	10,410,596,601
売買益	16,182,117,934
売買損	△ 5,771,521,333
(C)信託報酬等	△ 307,185,659
(D)当期損益金（A＋B＋C）	10,111,371,423
(E)前期繰越損益金	996,114,853
(F)追加信託差損益金	18,190,286,914
(配当等相当額)	(4,136,164,091)
(売買損益相当額)	(14,054,122,823)
(G)合計（D＋E＋F）	29,297,773,190
次期繰越損益金（G）	29,297,773,190
追加信託差損益金	18,190,286,914
(配当等相当額)	(4,136,164,091)
(売買損益相当額)	(14,054,122,823)
分配準備積立金	11,107,486,276

(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	7,714,732円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	10,103,656,691
(c)収益調整金	18,190,286,914
(d)分配準備積立金	996,114,853
(e)当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	29,297,773,190
(f)分配金	0
(g)翌期繰越分配対象額（e－f）	29,297,773,190
(h)受益権総口数	11,161,314,593口

《お知らせ》

■運用報告書にかかる信託約款の条文変更について

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)

＜変更前＞

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

- 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。
- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から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。

＜変更後＞

(運用状況にかかる情報の提供)

- 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。
- 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、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。

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。

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。

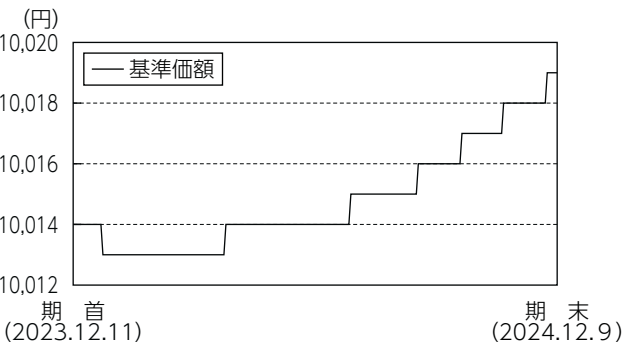
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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	
	円	%	%
(期首)2023年12月11日	10,014	—	—
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)

	買 付 額	売 付 額
国 内	千円	千円
	95,595,643	(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	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
1219国庫短期証券	2024/6/24	32,999,307			
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）

区 分	当 期		期 末			
	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	
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上 2年未満
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）

区 分	銘 柄	当 期		期 末	
		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 32,600,000	千円 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		期 末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公社債	千円 32,599,453	% 62.9	千円 32,599,453	% 62.9
コール・ローン等、その他	19,265,458	37.1	19,265,458	37.1
投資信託財産総額	51,864,911	100.0	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：
ダイワ米ドル・ブルファンド（適格機関投資家専用）48,964,798円
ダイワ米ドル・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（FOFs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/バリュース・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グワトロ（毎月分配型）1,346円
通貨選択型アメリカン・エクイティ・αグワトロ（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/ロジャース国際コモディティ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・レアル・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（為替ヘッジあり/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/年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 - USトライアングル - 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。