

NYダウ・トリプル・レバレッジ (愛称：3σ)

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2026年3月30日)

(作成対象期間 2025年4月1日～2026年3月30日)

★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 | 2020年3月30日～2030年3月29日 | |
| 運用方針 | 日々の基準価額の値動きがダウ・ジョーンズ工業株価平均(配当込み、米ドルベース)の値動きの3倍程度となることをめざして運用を行いません。 | |
| 主要投資対象 | ベビーファンド | 米国の株価指数先物取引、米国の債券、わが国の債券およびダイワ・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 | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 | 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、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。 | |

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ダウ・ジョーンズ工業株価平均(配当込み、米ドルベース)の値動きの3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/>

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (税引後配当込み、米ドルベース) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 公社債 組入比率 | 純資産 総額 |
|--------------------|--------|------------|-----------|------------------------------------|-----------|------------|------------|-------------|-----------|
| | (分配落) | 税引み 分配金 | 期中 騰落率 | (参考指数) | 期中 騰落率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 2 期末 (2022年 3月29日) | 33,541 | 0 | 15.1 | 16,616 | 7.1 | — | 296.0 | — | 4,256 |
| 3 期末 (2023年 3月29日) | 22,617 | 0 | △ 32.6 | 15,631 | △ 5.9 | — | 300.7 | — | 3,727 |
| 4 期末 (2024年 3月29日) | 35,948 | 0 | 58.9 | 19,493 | 24.7 | — | 295.7 | 14.8 | 2,828 |
| 5 期末 (2025年 3月31日) | 34,169 | 0 | △ 4.9 | 20,617 | 5.8 | — | 300.2 | 22.6 | 2,469 |
| 6 期末 (2026年 3月30日) | 36,728 | 0 | 7.5 | 22,662 | 9.9 | — | 299.3 | 17.3 | 1,784 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注6) 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。

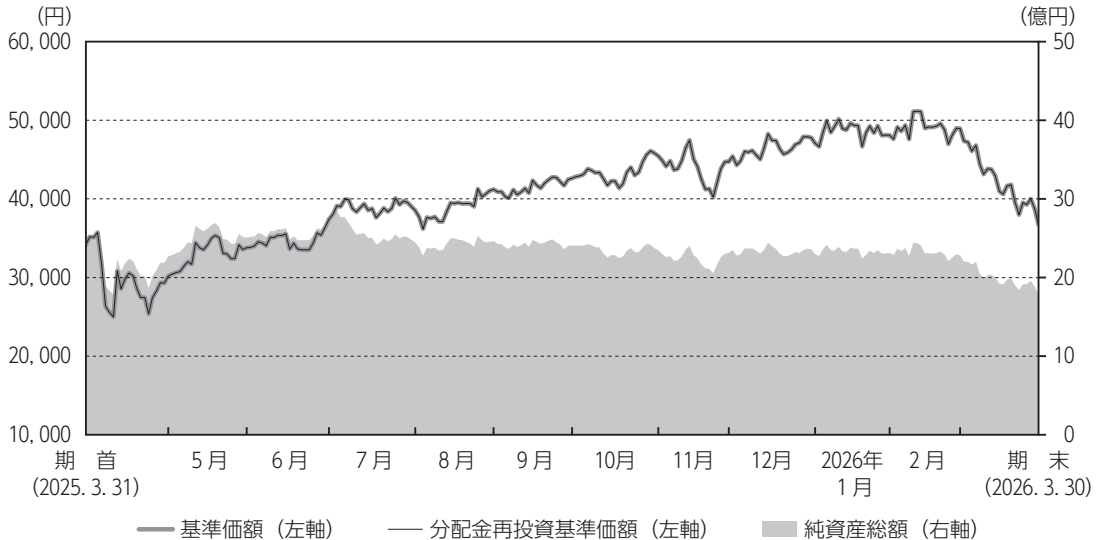
(注7) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (「当インデックス」) は S&P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社 (「SPDJ」) 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 SPDJ 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。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S & P、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、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しては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：34,169円

期末：36,728円（分配金0円）

騰落率：7.5%（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ダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、米ドルベース）の値動きの3倍程度となることをめざした運用を行った結果、米国株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。

NYダウ・トリプル・レバレッジ

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (税引後配当込み、米ドルベース) | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 公 社 債 組入比率 |
|----------------|---------|--------|------------------------------------|-------|-------------|-------------|---------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | | |
| (期首)2025年3月31日 | 34,169 | — | 20,617 | — | — | 300.2 | 22.6 |
| 4月末 | 30,190 | △ 11.6 | 20,107 | △ 2.5 | — | 300.5 | 3.4 |
| 5月末 | 33,775 | △ 1.2 | 20,969 | 1.7 | — | 299.7 | 30.9 |
| 6月末 | 37,390 | 9.4 | 21,795 | 5.7 | — | 298.9 | 19.3 |
| 7月末 | 38,540 | 12.8 | 22,126 | 7.3 | — | 298.2 | 31.2 |
| 8月末 | 41,212 | 20.6 | 22,737 | 10.3 | — | 298.7 | 25.5 |
| 9月末 | 42,620 | 24.7 | 23,105 | 12.1 | — | 298.6 | 20.6 |
| 10月末 | 45,475 | 33.1 | 23,719 | 15.0 | — | 296.9 | 31.6 |
| 11月末 | 44,713 | 30.9 | 23,697 | 14.9 | — | 300.7 | 20.1 |
| 12月末 | 47,078 | 37.8 | 24,246 | 17.6 | — | 300.5 | 15.7 |
| 2026年1月末 | 48,107 | 40.8 | 24,564 | 19.1 | — | 300.8 | 24.4 |
| 2月末 | 48,954 | 43.3 | 24,800 | 20.3 | — | 297.8 | 25.3 |
| (期末)2026年3月30日 | 36,728 | 7.5 | 22,662 | 9.9 | — | 299.3 | 17.3 |

(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

(2025. 4. 1 ~ 2026. 3. 30)

■ 米国株式市況

米国株式市況は、2025年4月の急落後上昇に転じ、史上最高値を更新しましたが、その後は中東情勢の緊迫化を受けて調整しました。

米国株式市況は、当作成期首より、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。特に、2025年4月2日に発表された米国の相互関税が事前予想よりも厳しい内容であったことから、株価はまれに見る急落に見舞われ、当作成期の安値を記録しました。しかし、同月9日に相互関税の大部分の適用が90日間停止されたことを受け、株価は急反発しました。5月以降も、米中双方による大幅な関税引き下げに加え、雇用情勢が悪化してF R B（米国連邦準備制度理事会）の利下げ観測が強まったことなどが好感され、株価は上昇しました。7月以降は、各国に対する相互関税の引き下げなど通商交渉が進展したことに加え、9月中旬のF R Bによる利下げ決定などが、株価の上昇を促しました。さらに10月下旬にかけては、成長期待が高まったA I（人工知能）・半導体関連企業が相場上昇をけん引し、株価は史上最高値を更新しました。11月には、政府機関の一部閉鎖の影響が嫌気されて下落しましたが、同月下旬には利下げ観測が再び高まったことを好感し、反発しました。12月以降も、F R Bによる利下げの決定や流動性供給の開始、半導体関連企業の好業績などが好感され、株価は上昇しました。2026年1月以降は、経済指標の改善やインフレの沈静化が好感された一方で、「A I 脅威論」の台頭を受け、情報サービスやソフトウェア関連の企業が急落しました。3月には米国とイスラエルによるイランへの軍事攻撃を受けてホルムズ海峡が事実上封鎖され、原油価格が急騰する中、世界経済の減速懸念から急落しました。その後も停戦協議の行方に一喜一憂する展開が続き、紛争長期化への懸念を背景に原油価格の高止まりへの警戒感は根強く、軟調に推移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、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の3倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、米ドルベース）の値動きの3倍程度となることをめざします。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

(2025. 4. 1 ~ 2026. 3. 30)

■当ファンド

米国の株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、信託財産の純資産総額の3倍程度となるよう調整しました。「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。

米国の株価指数先物取引については、E-mini ダウ先物取引を利用しました。米国の株式への直接投資は行っておりません。

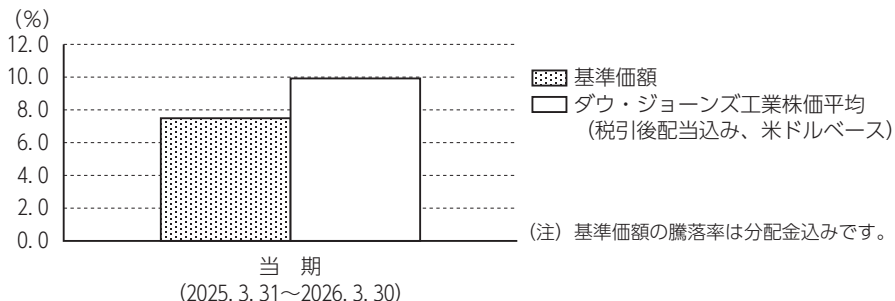
■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性及び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 | |
|------------|--------------------------|--------|
| | 2025年4月1日 ～2026年3月30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） | 28,420 |

- (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・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の3倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがダウ・ジョーンズ工業株価平均（配当込み、米ドルベース）の値動きの3倍程度となることをめざします。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 (2025. 4. 1～2026. 3. 30) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|---------------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 447円 | 1.097% | 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40,716円です。 |
| (投 信 会 社) | (218) | (0.535) | 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) | (218) | (0.535) | 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) | (11) | (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 | 19 | 0.046 | 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) | (19) | (0.046) | |
| 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 | 7 | 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) | (4) | (0.010) | 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) | (0.005) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 472 | 1.159 | |

(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。

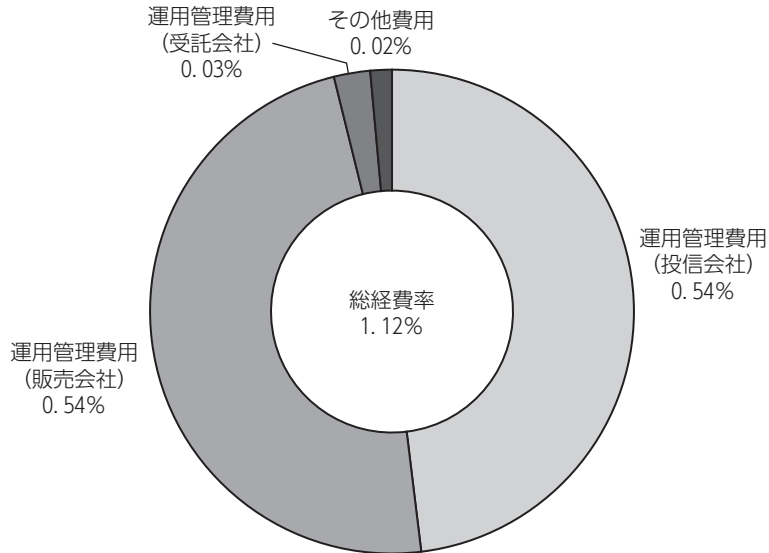
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.12%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

(2025年4月1日から2026年3月30日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネー ポートフォリオ・ マザーファンド | 3,758,005 | 3,774,441 | 4,166,403 | 4,185,649 |

(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

(2025年4月1日から2026年3月30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 |
| | | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 外 国 株 式 | DJIA MINI E-CBOT (アメリカ) | 39,205 | 42,160 | — | — | 5,341 | — | △185 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビ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

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) 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

(2025年4月1日から2026年3月30日まで)

| 区 分 | 買 付 額 等 | | う ち 利 害 関 係 人 と の 取 引 状 況 B | B/A | 売 付 額 等 | | う ち 利 害 関 係 人 と の 取 引 状 況 D | D/C |
|---------|-----------|--------|-----------------------------|-----|---------|-------|-----------------------------|-----|
| | A | | | | C | | | |
| | 百万円 | 百万円 | % | | 百万円 | 百万円 | % | |
| 公社債 | 66,329 | 19,989 | 30.1 | | 6,992 | 6,992 | 100.0 | |
| コール・ローン | 2,648,912 | — | — | | — | — | — | |

(注) 平均保有割合3.2%

*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ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(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。

■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 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド | 930,014 | 521,616 | 525,476 |

(注) 単位未満は切捨て。

*同じ銘柄名が複数表示される場合、同一銘柄名であっても市場や通貨等が異なる場合があります。また、銘柄名称が長い場合、名称の一部が表記されない場合があります。

■投資信託財産の構成

2026年3月30日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド | 525,476 | 25.9 |
| コール・ローン等、その他 | 1,500,499 | 74.1 |
| 投資信託財産総額 | 2,025,976 | 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30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.99円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(595,690千円)の投資信託財産総額(2,025,976千円)に対する比率は、29.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2026年3月30日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|-----------------------|
| (A) 資産 | 2,611,745,944円 |
| コール・ローン等 | 719,605,225 |
| ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド(評価額) | 525,476,864 |
| 未収入金 | 585,769,615 |
| 差入委託証拠金 | 780,894,240 |
| (B) 負債 | 827,235,695 |
| 未払金 | 788,952,378 |
| 未払解約金 | 25,871,526 |
| 未払信託報酬 | 12,350,132 |
| その他未払費用 | 61,659 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,784,510,249 |
| 元本 | 485,872,491 |
| 次期繰越損益金 | 1,298,637,758 |
| (D) 受益権総口数 | 485,872,491口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 36,728円 |

- *期首における元本額は722,797,043円、当作成期間中における追加設定元本額は589,002,139円、同解約元本額は825,926,691円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は36,728円です。

■損益の状況

当期 自 2025年4月1日 至 2026年3月30日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|----------------------|
| (A) 配当等収益 | 19,997,553円 |
| 受取利息 | 1,924,610 |
| その他収益金 | 18,072,943 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 70,951,809 |
| 売買益 | 122,446,308 |
| 売買損 | 193,398,117 |
| (C) 先物取引等損益 | △ 29,868,191 |
| 取引益 | 799,485,666 |
| 取引損 | 829,353,857 |
| (D) 信託報酬等 | △ 26,172,278 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 106,994,725 |
| (F) 前期繰越損益金 | △ 55,930,382 |
| (G) 追加信託差損益金 | 1,461,562,865 |
| (配当等相当額) | (647,235,019) |
| (売買損益相当額) | (814,327,846) |
| (H) 合計(E+F+G) | 1,298,637,758 |
| 次期繰越損益金(H) | 1,298,637,758 |
| 追加信託差損益金 | 1,461,562,865 |
| (配当等相当額) | (647,235,019) |
| (売買損益相当額) | (814,327,846) |
| 分配準備積立金 | 26,306,133 |
| 繰越損益金 | △ 189,231,240 |

- (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:2,693,593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 | 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 | 1,354,568,140 |
| (d) 分配準備積立金 | 26,306,133 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 1,380,874,273 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e-f) | 1,380,874,273 |
| (h) 受益権総口数 | 485,872,491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。

<補足情報>

当ファンド（NYダウ・トリプル・レバレッジ）が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の決算日（2025年12月9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（2026年3月30日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・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・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

2025年4月1日から2026年3月30日まで

| 買 付 | | 売 付 | |
|-----------------------|------------|----------------------|-----------|
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 |
| 1325国庫短期証券 2025/11/17 | 20,677,312 | 1344国庫短期証券 2026/2/24 | 6,992,426 |
| 1306国庫短期証券 2025/8/18 | 19,989,400 | | |
| 1344国庫短期証券 2026/2/24 | 16,779,856 | | |
| 1364国庫短期証券 2026/5/25 | 8,883,214 | | |

(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、2026年3月30日現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（14,988,336千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

| 区 分 | 2026年3月30日現在 | | | | | | |
|------|--------------|-----------|-------|-----------------------------|-------------------|------|-------|
| | 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 | 8,900,000 | 8,889,555 | 58.9% | —% | —% | —% | 58.9% |

(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）

| 2026年3月30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 | 1364国庫短期証券 | —% | 8,900,000 | 8,889,555 | 2026/05/25 | |

(注) 単位未満は切捨て。

* 同じ銘柄名が複数表示される場合、同一銘柄名であっても市場や通貨等が異なる場合があります。また、銘柄名称が長い場合、名称の一部が表記されない場合があります。

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17期 (決算日 2025年12月9日)

(作成対象期間 2024年12月10日～2025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。

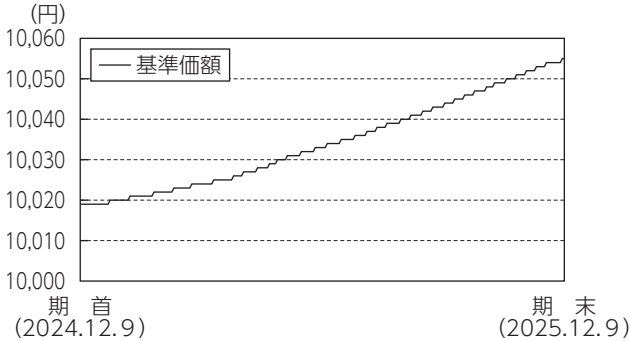
| | |
|--------|---------------------------|
| 運用方針 | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 円建ての債券 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下 |

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 | 組 入 比 率 | |
| | 円 | % | % |
| (期首)2024年12月9日 | 10,019 | - | 62.9 |
| 12月末 | 10,020 | 0.0 | 57.6 |
| 2025年1月末 | 10,021 | 0.0 | 71.6 |
| 2月末 | 10,023 | 0.0 | 64.8 |
| 3月末 | 10,025 | 0.1 | 59.8 |
| 4月末 | 10,028 | 0.1 | 56.2 |
| 5月末 | 10,032 | 0.1 | 67.9 |
| 6月末 | 10,035 | 0.2 | 60.0 |
| 7月末 | 10,039 | 0.2 | 61.0 |
| 8月末 | 10,042 | 0.2 | 60.0 |
| 9月末 | 10,046 | 0.3 | 65.8 |
| 10月末 | 10,050 | 0.3 | 71.4 |
| 11月末 | 10,054 | 0.3 | 57.8 |
| (期末)2025年12月9日 | 10,055 | 0.4 | 61.4 |

(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：10,019円 期末：10,055円 騰落率：0.4%

【基準価額の主な変動要因】

利息収入により、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

日銀の利上げを受けて、短期金利は上昇しました。

◆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

(2024年12月10日から2025年12月9日まで)

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|------|-------------|----------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 内 | 国債証券 | 111,315,497 | 6,992,426 (127,200,000) |

(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

(2024年12月10日から2025年12月9日まで)

| 当 期 | | | | |
|-----------------------|------------|----------------------|-----------|--|
| 買 付 | | 売 付 | | |
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 | |
| | | 千円 | | |
| 1277国庫短期証券 2025/3/31 | 31,088,809 | 1344国庫短期証券 2026/2/24 | 6,992,426 | |
| 1296国庫短期証券 2025/6/30 | 22,780,118 | | | |
| 1325国庫短期証券 2025/11/17 | 20,677,312 | | | |
| 1306国庫短期証券 2025/8/18 | 19,989,400 | | | |
| 1344国庫短期証券 2026/2/24 | 16,779,856 | | | |

(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。

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

■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BB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | 2年未満 | |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 9,800,000 | 9,790,567 | 61.4 | - | - | - | 61.4 |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

| 区 分 | 銘 柄 | 年 利率 | 期 末 | | |
|------|------------|------|-----------|-----------|------------|
| | | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | 1344国庫短期証券 | - | 9,800,000 | 9,790,567 | 2026/02/24 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2025年12月9日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 9,790,567 | 61.4 |
| コール・ローン等、その他 | 6,156,857 | 38.6 |
| 投資信託財産総額 | 15,947,424 | 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12月9日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------|------------------------|
| (A) 資産 | 15,947,424,800円 |
| コール・ローン等 | 6,156,857,300 |
| 公社債(評価額) | 9,790,567,500 |
| (B) 負債 | 4,379,900 |
| 未払解約金 | 4,379,900 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 15,943,044,900 |
| 元本 | 15,856,162,308 |
| 次期繰越損益金 | 86,882,592 |
| (D) 受益権総口数 | 15,856,162,308口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 10,055円 |

* 期首における元本額は51,764,911,701円、当作成期間中における追加設定元本額は28,677,006,619円、同解約元本額は64,585,756,012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) | 53,058,966円 |
| ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用) | 1,829,881,549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) | 1,084,248円 |
| ダイワJリートベア・ファンド (適格機関投資家専用) | 347,542,829円 |
| 米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) | 44,359,998円 |
| 米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) | 51,809,589円 |
| ダイワ/パリュウ・パートナーズ チャイナ・ヘルスケア・フォーカス | 9,976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 | 799,549,002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 | 307,024,261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 |
| 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) | 5,092,876,184円 |
| ダイワJGBベア・ファンドII (適格機関投資家専用) | 7,289,276,819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・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・ハンダーソン・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・ハンダーソン・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・ハンダーソン・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・ハンダーソン・バランス・ファンド (為替ヘッジあり/年4回決算型) | 999円 |
| マネーファンド (ラップ専用) | 36,260,578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ライアングル - | 992,418円 |

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,055円です。

■損益の状況

当期 自2024年12月10日 至2025年12月9日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|--------------|
| (A) 配当等収益 | 126,830,737円 |
| 受取利息 | 126,830,737 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 448,640 |
| 売買益 | 286 |
| 売買損 | △ 448,926 |
| (C) 当期損益金(A + B) | 126,382,097 |
| (D) 前期繰越損益金 | 97,235,029 |
| (E) 解約差損益金 | △222,140,815 |
| (F) 追加信託差損益金 | 85,406,281 |
| (G) 合計(C + D + E + F) | 86,882,592 |
| 次期繰越損益金(G) | 86,882,592 |

(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。

《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)

委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

<変更後>

(運用状況にかかる情報)

委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める事項にかかる情報を提供しません。