

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

|        |                                      |                                                                                                       |
|--------|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 商品分類   | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド                 | 追加型投信／海外／株式                                                                                           |
|        | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド・<br>マネー・ポートフォリオ | 追加型投信／国内／債券                                                                                           |
| 信託期間   | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド                 | 2011年4月19日～2026年4月17日                                                                                 |
|        | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド・<br>マネー・ポートフォリオ | 2011年5月16日～2026年4月17日                                                                                 |
| 運用方針   | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド                 | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。                                                                                 |
|        | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド・<br>マネー・ポートフォリオ | 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 | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド                 | 世界（※）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、D R（預託証券）を含みます。）（※）日本を除きます。                          |
|        | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド・<br>マネー・ポートフォリオ | イ．ダイワ・マネーストック・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券<br>ロ．円建ての債券                                             |
| 組入制限   | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド                 | ・株式組入上限比率は無制限                                                                                         |
|        | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド・<br>マネー・ポートフォリオ | ・マザーファンド組入上限比率は無制限<br>・株式組入上限比率は純資産総額の10％以下                                                           |
| 分配方針   | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド                 | 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、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、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 |
|        | ダイワ／ハリス世界<br>厳選株ファンド・<br>マネー・ポートフォリオ | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益とし、原則として、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、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。                 |

◇SUZ0479720260417◇

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド  
ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・  
マネー・ポートフォリオ

運用報告書（全体版）  
満期償還

（償還日 2026年4月17日）  
（作成対象期間 2025年4月19日～2026年4月17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、（世界厳選株）世界の株式に投資し、信託財産の成長をめざすこと、（世界厳選株マネー）円建ての債券に投資し、安定した収益の確保をめざすことを目的としており、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/>

<4797>  
<4799>

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド

最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額     |                |              | MSCIコクサイ指数<br>(税引後配当込み、円換算) |              | 株 式<br>組 入 比 率 | 株 式<br>先 物 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|-------------|----------------|--------------|-----------------------------|--------------|----------------|----------------|--------------|
|                  | (分配落)       | 税 込 金<br>分 配 金 | 期 中<br>騰 落 率 | (参考指数)                      | 期 中<br>騰 落 率 |                |                |              |
| 11期末(2022年4月18日) | 円<br>21,066 | 円<br>650       | %<br>8.3     | 44,023                      | %<br>19.9    | %<br>95.6      | %<br>－         | 百万円<br>6,772 |
| 12期末(2023年4月18日) | 22,224      | 100            | 6.0          | 45,278                      | 2.9          | 96.9           | －              | 6,216        |
| 13期末(2024年4月18日) | 24,332      | 2,100          | 18.9         | 61,307                      | 35.4         | 94.5           | －              | 6,078        |
| 14期末(2025年4月18日) | 22,801      | 0              | △ 6.3        | 60,851                      | △ 0.7        | 95.4           | －              | 5,327        |
| 償 還(2026年4月17日)  | 29,530.86   | －              | 29.5         | 91,069                      | 49.7         | －              | －              | 4,258        |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円換算）は、MSCI Inc.（「MSCI」）の承諾を得て、MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、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。MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）は、MSCIが開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。（<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>）

(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。

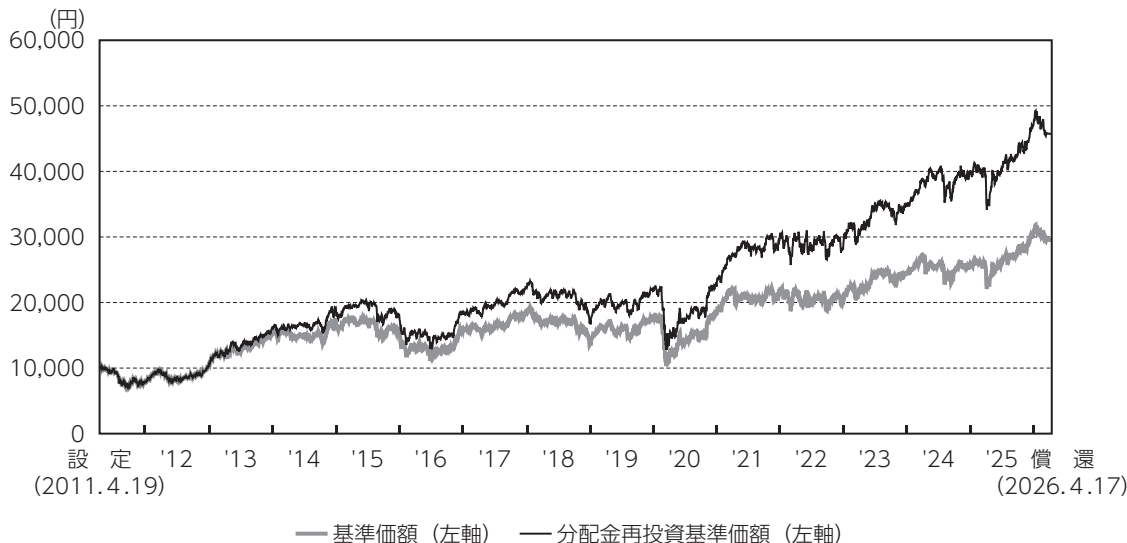
(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 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：29,530円86銭（既払分配金8,300円）

騰落率：357.1％（分配金再投資ベース）

#### ■基準価額の主な変動要因

海外株式市況が上昇したことや、米ドルなどが対円で上昇（円安）したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。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。

| 年<br>月<br>日       | 基 準 価 額     |        | M S C I コクサイ 指数<br>(税引後配当込み、円換算) |        | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比 |
|-------------------|-------------|--------|----------------------------------|--------|----------------|----------------|
|                   |             | 騰 落 率  | (参考指数)                           | 騰 落 率  |                |                |
| (期首) 2025年 4 月18日 | 円<br>22,801 | %<br>－ | 60,851                           | %<br>－ | %<br>95.4      | %<br>－         |
| 4 月末              | 23,850      | 4.6    | 63,976                           | 5.1    | 95.2           | －              |
| 5 月末              | 25,126      | 10.2   | 68,558                           | 12.7   | 96.5           | －              |
| 6 月末              | 26,105      | 14.5   | 71,836                           | 18.1   | 96.2           | －              |
| 7 月末              | 26,937      | 18.1   | 75,862                           | 24.7   | 96.4           | －              |
| 8 月末              | 26,990      | 18.4   | 76,408                           | 25.6   | 95.9           | －              |
| 9 月末              | 27,491      | 20.6   | 79,205                           | 30.2   | 95.6           | －              |
| 10月末              | 28,328      | 24.2   | 83,768                           | 37.7   | 95.2           | －              |
| 11月末              | 28,890      | 26.7   | 85,103                           | 39.9   | 96.1           | －              |
| 12月末              | 30,372      | 33.2   | 86,808                           | 42.7   | 96.5           | －              |
| 2026年 1 月末        | 30,496      | 33.7   | 86,675                           | 42.4   | 97.2           | －              |
| 2 月末              | 30,890      | 35.5   | 87,999                           | 44.6   | 94.0           | －              |
| 3 月末              | 29,565      | 29.7   | 82,606                           | 35.8   | －              | －              |
| (償還) 2026年 4 月17日 | 29,530.86   | 29.5   | 91,069                           | 49.7   | －              | －              |

(注) 騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

(2011.4.19～2026.4.17)

### ■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当ファンド設定時より、ギリシャ債務問題の再燃や世界的に景気の先行き不透明感が高まったことなどを背景に、弱含んで始まりました。その後は、欧米の中央銀行による金融緩和策や企業業績の改善などを背景に調整局面を挟みつつ、2020年初めにかけておおむね上昇基調で推移しました。2月から3月にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて急落しましたが、主要各国における大胆な景気対策や中央銀行による金融緩和策、ワクチン普及期待などを背景に持ち直し、2021年末にかけて上昇しました。2022年に入ると、主要各国におけるインフレや金融引き締めへの警戒感を受けて下落しましたが、その後はインフレ鈍化期待やAI（人工知能）関連の半導体企業の強気見通しなどを背景に、持ち直しました。2025年に入ると、トランプ米国政権による関税政策をめぐり世界経済への影響が懸念されて急落しましたが、相互関税の上乗せ税率適用の90日間停止が発表されると反発しました。償還期末にかけては、FRB（米国連邦準備制度理事会）による利下げや半導体関連企業の好業績などが好感され、おおむね上昇基調で推移しました。

### ■為替相場

米ドル対円為替相場は上昇（円安）しました。

米ドル対円為替相場は、当ファンド設定時よりレンジ内での動きが続きましたが、2012年10月から2014年にかけて、日銀による金融緩和策や米国における好調なマクロ経済および金利先高観などを背景に、おおむね上昇基調で推移しました。2015年から2020年にかけては緩やかに下落する展開となりましたが、2022年3月以降は、インフレ抑制のためにFRB（米国連邦準備制度理事会）が利上げに動く一方で、日銀は金融緩和政策を維持したことから、円安米ドル高が大きく進行しました。その後も、償還期末にかけておおむね上昇基調で推移しました。

## 信託期間中の運用方針

主として、世界（日本を除きます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）の中から、割安と判断される株式を厳選して投資することにより信託財産の成長をめざします。

外貨建資産の運用にあたっては、ハリス・アソシエーツ・エル・ピーに運用の指図にかかる権限を委託します。

## 信託期間中のポートフォリオについて

(2011.4.19～2026.4.17)

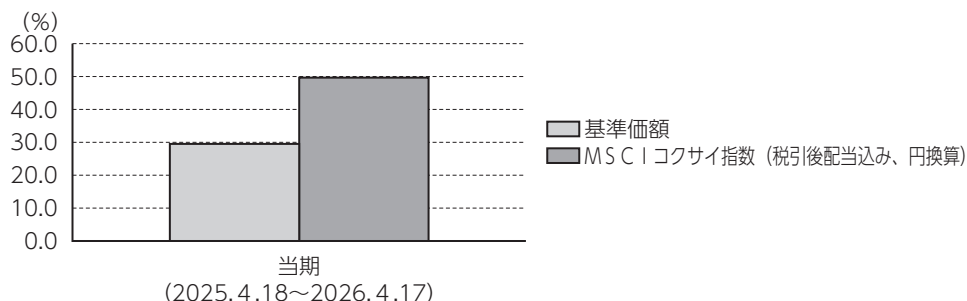
当ファンドは、外貨建資産の運用にあたっては、ハリス・アソシエイツ・エル・ピーに運用の指図にかかる権限を委託しました。

株式組入比率は、高位に維持しました。銘柄選定にあたって、ボトムアップによる企業リサーチをもとに、財務内容が健全であり、経営陣の質が高く、長期的にキャッシュフロー成長が見込まれる企業の中から、企業の本源的価値と比較して割安に放置されている銘柄に厳選投資しました。

## 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、当作成期における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。参考指数は海外株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 分配金について

1万口当り、第2期500円、第3期1,000円、第4期700円、第6期600円、第7期450円、第10期2,200円、第11期650円、第12期100円、第13期2,100円の収益分配を行いました。

なお、第1期、第5期、第8期～第9期、第14期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を行いませんでした。

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お願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2025.4.19~2026.4.17) |         | 項 目 の 概 要                                                               |
|-----------|-----------------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                         | 比 率     |                                                                         |
| 信 託 報 酬   | 553円                        | 1.975%  | 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27,986円です。                      |
| (投 信 会 社) | (322)                       | (1.152) | 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) | (215)                       | (0.768) | 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) | (15)                        | (0.055) | 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   | 16                          | 0.058   | 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 |
| (株 式)     | (16)                        | (0.058) |                                                                         |
| 有価証券取引税   | 15                          | 0.053   | 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  |
| (株 式)     | (15)                        | (0.053) |                                                                         |
| そ の 他 費 用 | 33                          | 0.116   | 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) | (20)                        | (0.070) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用                      |
| (監 査 費 用) | (1)                         | (0.003) | 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)   | (12)                        | (0.043) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                      |
| 合 計       | 616                         | 2.202   |                                                                         |

(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。

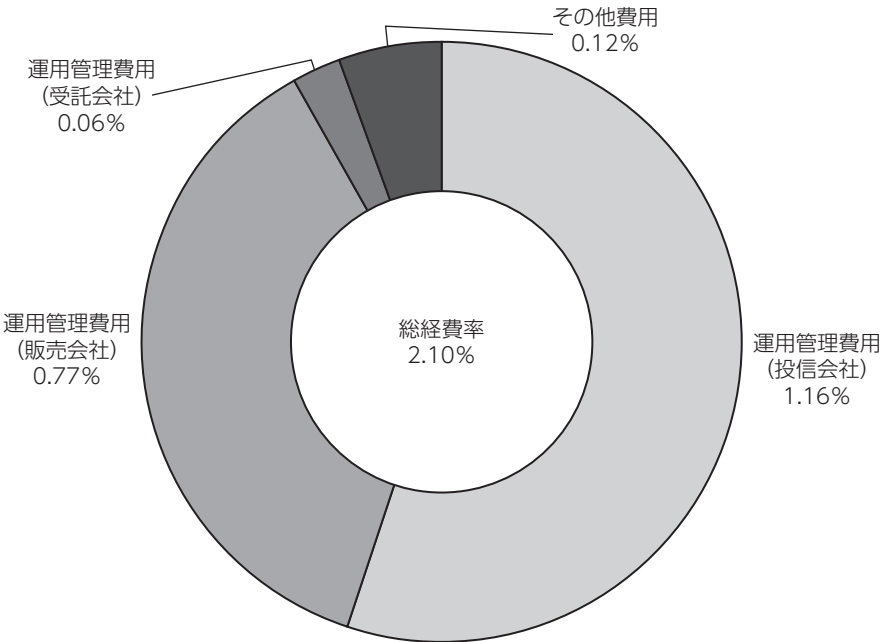
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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2.10%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  
株 式

(2025年4月19日から2026年4月17日まで)

|     |                  | 買 付                       |                               | 売 付            |                       |
|-----|------------------|---------------------------|-------------------------------|----------------|-----------------------|
|     |                  | 株 数                       | 金 額                           | 株 数            | 金 額                   |
| 外 国 | アメリカ             | 百株<br>634.84<br>( 178.21) | 千アメリカ・ドル<br>7,348<br>( 932)   | 百株<br>4,777.18 | 千アメリカ・ドル<br>31,163    |
|     | 香港               | 百株<br>117<br>( -)         | 千香港ドル<br>1,290<br>( -)        | 百株<br>535.8    | 千香港ドル<br>7,421        |
|     | イギリス             | 百株<br>462.1<br>(△171.05)  | 千イギリス・ポンド<br>902<br>(△ 748)   | 百株<br>7,780.47 | 千イギリス・ポンド<br>3,478    |
|     | スイス              | 百株<br>6.35<br>( -)        | 千スイス・フラン<br>33<br>( -)        | 百株<br>189.8    | 千スイス・フラン<br>1,827     |
|     | デンマーク            | 百株<br>7<br>( -)           | 千デンマーク・クローネ<br>1,050<br>( -)  | 百株<br>68.45    | 千デンマーク・クローネ<br>11,096 |
|     | スウェーデン           | 百株<br>733<br>( -)         | 千スウェーデン・クローネ<br>7,558<br>( -) | 百株<br>733      | 千スウェーデン・クローネ<br>7,358 |
|     | 韓国               | 百株<br>-<br>( -)           | 千韓国ウォン<br>-<br>( -)           | 百株<br>206.5    | 千韓国ウォン<br>2,468,442   |
|     | ユーロ<br>(オランダ)    | 百株<br>52.15<br>( -)       | 千ユーロ<br>244<br>( -)           | 百株<br>335      | 千ユーロ<br>1,677         |
|     | ユーロ<br>(フランス)    | 百株<br>587.07<br>( -)      | 千ユーロ<br>2,321<br>( -)         | 百株<br>788.8    | 千ユーロ<br>4,503         |
|     | ユーロ<br>(ドイツ)     | 百株<br>184.2<br>( -)       | 千ユーロ<br>2,309<br>( -)         | 百株<br>976.9    | 千ユーロ<br>5,866         |
| 国   | ユーロ<br>(ユーロ 通貨計) | 百株<br>823.42<br>( -)      | 千ユーロ<br>4,875<br>( -)         | 百株<br>2,100.7  | 千ユーロ<br>12,047        |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合  
(2025年4月19日から2026年4月17日まで)

| 項 目               | 当 期          |
|-------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額     | 11,252,960千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 5,853,766千円  |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 1.92         |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
株 式

(2025年4月19日から2026年4月17日まで)

| 当                                            |       |         |        | 期                                          |        |         |        |
|----------------------------------------------|-------|---------|--------|--------------------------------------------|--------|---------|--------|
| 買                                            |       | 付       |        | 売                                          |        | 付       |        |
| 銘 柄                                          | 株 数   | 金 額     | 平均単価   | 銘 柄                                        | 株 数    | 金 額     | 平均単価   |
|                                              | 千株    | 千円      | 円      |                                            | 千株     | 千円      | 円      |
| DASSAULT SYSTEMES (フランス)                     | 44.3  | 209,831 | 4,736  | IQVIA HOLDINGS INC (アメリカ)                  | 9.85   | 281,922 | 28,621 |
| SALESFORCE INC (アメリカ)                        | 5.9   | 208,038 | 35,260 | DSV (デンマーク)                                | 6.845  | 269,418 | 39,359 |
| ADIDAS N AG (ドイツ)                            | 5.42  | 178,284 | 32,893 | SAMSUNG ELECTRONICS<br>NON VOTING PRE (韓国) | 20.65  | 261,448 | 12,660 |
| GARTNER INC (アメリカ)                           | 4.425 | 154,167 | 34,840 | BAYER AG (ドイツ)                             | 45.335 | 256,807 | 5,664  |
| HEXAGON CLASS B (スウェーデン)                     | 73.3  | 118,203 | 1,612  | ALPHABET INC CLASS A (アメリカ)                | 6.7    | 246,934 | 36,855 |
| BMW AG (ドイツ)                                 | 8.805 | 114,541 | 13,008 | SYSCO CORP (アメリカ)                          | 16.13  | 212,715 | 13,187 |
| ASHTREAD GROUP PLC (イギリス)                    | 12.11 | 108,153 | 8,930  | AIRBNB INC CLASS A (アメリカ)                  | 9.835  | 205,762 | 20,921 |
| TARGA RESOURCES CORP (アメリカ)                  | 4.16  | 100,252 | 24,099 | GLENCORE PLC (ジャージー)                       | 202.6  | 204,771 | 1,010  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL<br>INC CLASS A (アメリカ) | 10.94 | 95,017  | 8,685  | BECTON DICKINSON (アメリカ)                    | 7.24   | 197,541 | 27,284 |
| SAP (ドイツ)                                    | 2.99  | 94,481  | 31,599 | SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC (アメリカ)        | 17.105 | 197,211 | 11,529 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

外国株式

| 銘柄                                 | 株数                            | 業種等            |
|------------------------------------|-------------------------------|----------------|
| (アメリカ)                             | 百株                            |                |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC      | 32.55                         | 金融             |
| BECTON DICKINSON                   | 42.4                          | ヘルスケア          |
| BRUNSWICK CORP                     | 86.7                          | 一般消費財・サービス     |
| CNH INDUSTRIAL N.V. NV             | 1,098                         | 資本財・サービス       |
| CENTENE CORP                       | 113.38                        | ヘルスケア          |
| DEERE                              | 14.5                          | 資本財・サービス       |
| VAIL RESORTS INC                   | 41.5                          | 一般消費財・サービス     |
| MOLINA HEALTHCARE INC              | 11.23                         | ヘルスケア          |
| FISERV INC                         | 26.95                         | 金融             |
| GENERAL MOTORS                     | 152.03                        | 一般消費財・サービス     |
| ALPHABET INC CLASS A               | 67                            | コミュニケーション・サービス |
| RYANAIR HOLDINGS ADR REPRESENTING  | 127.25                        | 資本財・サービス       |
| CONOCOPHILLIPS                     | 97.55                         | エネルギー          |
| ENVISTA HOLDINGS CORP              | 479.32                        | ヘルスケア          |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC CLASS A | 27.3                          | コミュニケーション・サービス |
| AIRBNB INC CLASS A                 | 75.2                          | 一般消費財・サービス     |
| SYSCO CORP                         | 161.3                         | 生活必需品          |
| IQVIA HOLDINGS INC                 | 63.7                          | ヘルスケア          |
| ELEVANCE HEALTH INC                | 14.62                         | ヘルスケア          |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC           | 26.55                         | 金融             |
| WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES  | 279                           | コミュニケーション・サービス |
| BANK OF AMERICA CORP               | 180.55                        | 金融             |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC           | 345                           | 金融             |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC   | 119.35                        | 金融             |
| KEURIG DR PEPPER INC               | 122                           | 生活必需品          |
| TE CONNECTIVITY PLC                | 57.15                         | 情報技術           |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP         | 45.55                         | 金融             |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC CLASS A | 56.5                          | 生活必需品          |
| アメリカ・ドル<br>通貨計                     | 株数<br>3,964.13<br>銘柄数<br>28銘柄 |                |
| (香港)                               | 百株                            |                |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD          | 418.8                         | 一般消費財・サービス     |
| 香港・ドル<br>通貨計                       | 株数<br>418.8<br>銘柄数<br>1銘柄     |                |
| (イギリス)                             | 百株                            |                |
| PRUDENTIAL PLC                     | 849.34                        | 金融             |
| DIAGEO PLC                         | 272                           | 生活必需品          |
| GLENCORE PLC                       | 1,819                         | 素材             |
| ST JAMES'S PLACE PLC               | 455                           | 金融             |
| ASHTED GROUP PLC                   | 72.05                         | 資本財・サービス       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC           | 4,022.03                      | 金融             |
| イギリス・ポンド<br>通貨計                    | 株数<br>7,489.42<br>銘柄数<br>6銘柄  |                |
| (スイス)                              | 百株                            |                |
| ROCHE HOLDING PAR AG               | 25.3                          | ヘルスケア          |
| JULIUS BAER GRUPPE AG              | 158.15                        | 金融             |
| スイス・フラン<br>通貨計                     | 株数<br>183.45<br>銘柄数<br>2銘柄    |                |

| 銘柄                                 | 株数                             | 業種等        |
|------------------------------------|--------------------------------|------------|
| (デンマーク)                            | 百株                             |            |
| DSV                                | 61.45                          | 資本財・サービス   |
| デンマーク・クローネ<br>通貨計                  | 株数<br>61.45<br>銘柄数<br>1銘柄      |            |
| (韓国)                               | 百株                             |            |
| SAMSUNG ELECTRONICS NON VOTING PRE | 206.5                          | 情報技術       |
| 韓国・ウォン<br>通貨計                      | 株数<br>206.5<br>銘柄数<br>1銘柄      |            |
| ユーロ(オランダ)                          | 百株                             |            |
| AKZO NOBEL NV                      | 166.1                          | 素材         |
| PROSUS NV CLASS N                  | 116.75                         | 一般消費財・サービス |
| 国小計                                | 株数<br>282.85<br>銘柄数<br>2銘柄     |            |
| ユーロ(フランス)                          | 百株                             |            |
| KERING SA                          | 40.85                          | 一般消費財・サービス |
| BNP PARIBAS SA                     | 36.63                          | 金融         |
| PERNOD RICARD SA                   | 58.15                          | 生活必需品      |
| CAPGEMINI                          | 66.1                           | 情報技術       |
| 国小計                                | 株数<br>201.73<br>銘柄数<br>4銘柄     |            |
| ユーロ(ドイツ)                           | 百株                             |            |
| BAYER AG                           | 453.35                         | ヘルスケア      |
| ALLIANZ                            | 21.3                           | 金融         |
| BRENTAG                            | 128.3                          | 資本財・サービス   |
| MERCEDES-BENZ GROUP N AG           | 189.75                         | 一般消費財・サービス |
| 国小計                                | 株数<br>792.7<br>銘柄数<br>4銘柄      |            |
| ユーロ通貨計                             | 株数<br>1,277.28<br>銘柄数<br>10銘柄  |            |
| ファンド合計                             | 株数<br>13,601.03<br>銘柄数<br>49銘柄 |            |

\* 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4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 | 4,328,093 | 100.0 |
| 投資信託財産総額     | 4,328,093 | 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

2026年4月17日現在

| 項 目            | 償 還 時          |
|----------------|----------------|
| (A) 資産         | 4,328,093,456円 |
| コール・ローン等       | 4,327,831,103  |
| 未収利息           | 262,353        |
| (B) 負債         | 69,429,091     |
| 未払解約金          | 10,501,223     |
| 未払信託報酬         | 58,927,868     |
| (C) 純資産総額(A－B) | 4,258,664,365  |
| 元本             | 1,442,106,483  |
| 償還差損益金         | 2,816,557,882  |
| (D) 受益権総口数     | 1,442,106,483口 |
| 1万口当り償還価額(C／D) | 29,530円86銭     |

\* 期首における元本額は2,336,382,968円、当作成期間中における追加設定元本額は38,441円、同解約元本額は894,314,926円です。  
\* 償還時の計算口数当りの純資産額は29,530円86銭です。

■損益の状況

当期 自2025年4月19日 至2026年4月17日

| 項 目                  | 当 期            |
|----------------------|----------------|
| (A) 配当等収益            | 75,526,687円    |
| 受取配当金                | 66,255,908     |
| 受取利息                 | 8,453,258      |
| その他収益金               | 817,521        |
| (B) 有価証券売買損益         | 1,020,920,376  |
| 売買益                  | 1,710,059,192  |
| 売買損                  | △ 689,138,816  |
| (C) 信託報酬等            | △ 125,874,204  |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 970,572,859    |
| (E) 前期繰越損益金          | 1,264,544,508  |
| (F) 追加信託差損益金         | 581,440,515    |
| (配当等相当額)             | ( 554,401,833) |
| (売買損益相当額)            | ( 27,038,682)  |
| (G) 合計(D + E + F)    | 2,816,557,882  |
| 償還差損益金(G)            | 2,816,557,882  |

(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) 投資信託財産の運用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：38,913,895円 (未監査)

投資信託財産運用総括表

|          |                     |                     |                  |              |                |
|----------|---------------------|---------------------|------------------|--------------|----------------|
| 信託期間     | 投資信託契約締結日           | 2011年4月19日          |                  | 投資信託契約終了時の状況 |                |
|          | 投資信託契約終了日           | 2026年4月17日          |                  | 資産総額         | 4,328,093,456円 |
| 区分       | 投資信託契約締結当初          | 投資信託契約終了時           | 差引増減又は追加信託       | 負債総額         | 69,429,091円    |
|          |                     |                     |                  | 純資産総額        | 4,258,664,365円 |
| 受益権口数    | 74,812,137,735口     | 1,442,106,483口      | △73,370,031,252口 | 受益権口数        | 1,442,106,483口 |
| 元本額      | 74,812,137,735円     | 1,442,106,483円      | △73,370,031,252円 | 1単位当り償還金     | 29,530円86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            |
| 第1期      | 円<br>79,718,134,256 | 円<br>73,585,036,061 | 円<br>9,231       | 円<br>0       | %<br>0.00      |
| 第2期      | 27,813,512,885      | 32,447,659,471      | 11,666           | 500          | 5.00           |
| 第3期      | 11,907,058,895      | 17,374,740,630      | 14,592           | 1,000        | 10.00          |
| 第4期      | 10,146,113,328      | 16,852,097,862      | 16,609           | 700          | 7.00           |
| 第5期      | 9,039,046,700       | 11,813,794,204      | 13,070           | 0            | 0.00           |
| 第6期      | 6,979,690,048       | 10,443,206,172      | 14,962           | 600          | 6.00           |
| 第7期      | 5,352,035,242       | 9,060,306,283       | 16,929           | 450          | 4.50           |
| 第8期      | 4,554,505,408       | 7,805,633,319       | 17,138           | 0            | 0.00           |
| 第9期      | 4,084,721,368       | 5,016,783,540       | 12,282           | 0            | 0.00           |
| 第10期     | 3,406,468,066       | 6,828,845,638       | 20,047           | 2,200        | 22.00          |
| 第11期     | 3,214,656,141       | 6,772,110,490       | 21,066           | 650          | 6.50           |
| 第12期     | 2,797,389,840       | 6,216,929,550       | 22,224           | 100          | 1.00           |
| 第13期     | 2,498,219,781       | 6,078,565,492       | 24,332           | 2,100        | 21.00          |
| 第14期     | 2,336,382,968       | 5,327,089,791       | 22,801           | 0            | 0.00           |

(注) 1単位は受益権1万口。

|          |            |
|----------|------------|
| 償還金のお知らせ |            |
| 1万口当り償還金 | 29,530円86銭 |

ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ

最近5期の運用実績

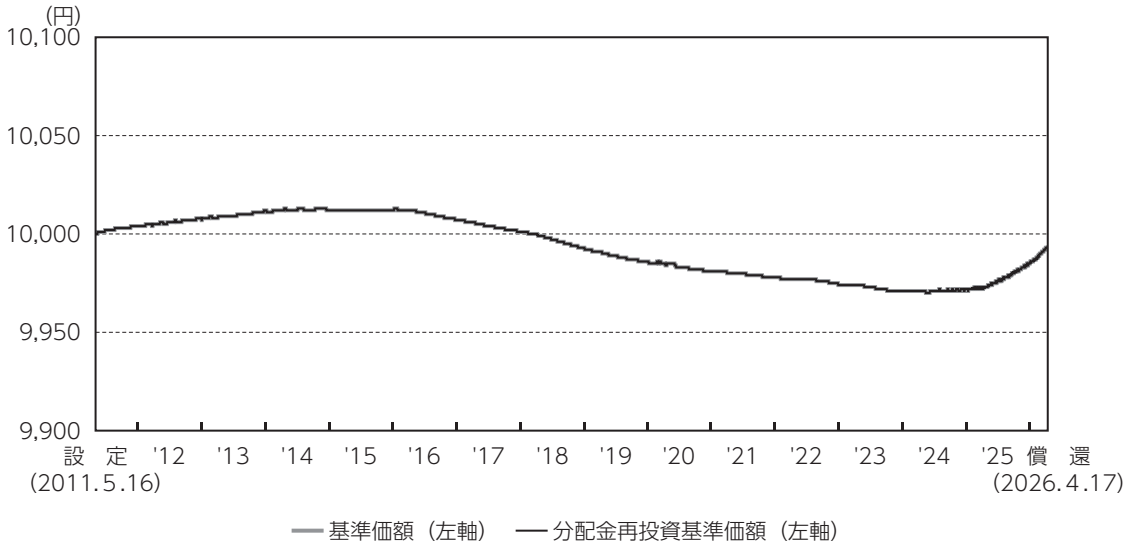
| 決 算 期            | 基 準 価 額<br>(分配落) | 税 込 金     |     |        | 公 社 債 率<br>組 入 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|------------------|------------------|-----------|-----|--------|--------------------|-----------|
|                  |                  | 期 騰 落 中 率 | 分 配 | み 金    |                    |           |
| 11期末(2022年4月18日) | 円<br>9,977       | %<br>△0.0 |     | 円<br>0 | %<br>－             | 百万円<br>65 |
| 12期末(2023年4月18日) | 9,974            | △0.0      |     | 0      | －                  | 51        |
| 13期末(2024年4月18日) | 9,971            | △0.0      |     | 0      | 66.7               | 21        |
| 14期末(2025年4月18日) | 9,972            | 0.0       |     | 0      | 60.6               | 19        |
| 償 還(2026年4月17日)  | 9,994.00         | 0.2       |     | －      | －                  | 11        |

(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、ダイワ／ハリス世界厳選株ファンドの資金をスイッチングにより一時滞留させる受け皿としての役割をもったファンドであり、円建ての債券を中心に、安定運用を行ないます。そのため、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



- \* 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：9,994円00銭（既払分配金0円）

騰落率：△0.1%（分配金再投資ベース）

#### ■基準価額の主な変動要因

短期金利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。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。

| 年<br>月<br>日       | 基<br>準     | 価<br>額 |   | 公<br>組<br>入<br>社<br>比<br>債<br>率 |
|-------------------|------------|--------|---|---------------------------------|
|                   |            | 騰<br>落 | 率 |                                 |
| (期首) 2025年 4 月18日 | 円<br>9,972 | %<br>－ |   | %<br>60.6                       |
| 4 月末              | 9,973      | 0.0    |   | 50.9                            |
| 5 月末              | 9,974      | 0.0    |   | 59.2                            |
| 6 月末              | 9,976      | 0.0    |   | 58.8                            |
| 7 月末              | 9,977      | 0.1    |   | 58.5                            |
| 8 月末              | 9,979      | 0.1    |   | 59.5                            |
| 9 月末              | 9,980      | 0.1    |   | 54.5                            |
| 10月末              | 9,981      | 0.1    |   | 69.8                            |
| 11月末              | 9,983      | 0.1    |   | 72.2                            |
| 12月末              | 9,985      | 0.1    |   | 73.4                            |
| 2026年 1 月末        | 9,986      | 0.1    |   | 73.6                            |
| 2 月末              | 9,989      | 0.2    |   | 53.7                            |
| 3 月末              | 9,992      | 0.2    |   | －                               |
| (償還) 2026年 4 月17日 | 9,994.00   | 0.2    |   | －                               |

(注) 騰落率は期首比。

## 設定以来の投資環境について

(2011.5.16～2026.4.17)

### ■国内短期金融市況

当ファンド設定時より、日銀による「包括的な金融緩和政策」のもと、短期金利は低位での推移が続きました。2016年1月には日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を、同年9月には「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入したことにより、短期金利はマイナス圏まで低下しました。その後、2024年3月にマイナス金利政策が解除されて短期金利は上昇し、償還期末を迎えました。

## 信託期間中の運用方針

### ■当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券および円建ての債券を中心に投資することにより、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

### ■ダイワ・マネースtock・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

(2011.5.16～2026.4.17)

### ■当ファンド

「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

### ■ダイワ・マネースtock・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

信託期間中の収益分配は、基準価額の水準等を勘案し、行いませんでした。

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       | 当期<br>(2025.4.19～2026.4.17) |         | 項 目 の 概 要                                                               |
|-----------|-----------------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                         | 比 率     |                                                                         |
| 信 託 報 酬   | 29円                         | 0.290%  | 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9,982円です。                       |
| (投 信 会 社) | (7)                         | (0.072) | 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) | (19)                        | (0.193) | 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) | (2)                         | (0.025) | 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<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 |
| 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 | 0                           | 0.001   | 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                                         |
| (監 査 費 用) | (0)                         | (0.001) | 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                                             |
| 合 計       | 29                          | 0.291   |                                                                         |

(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。

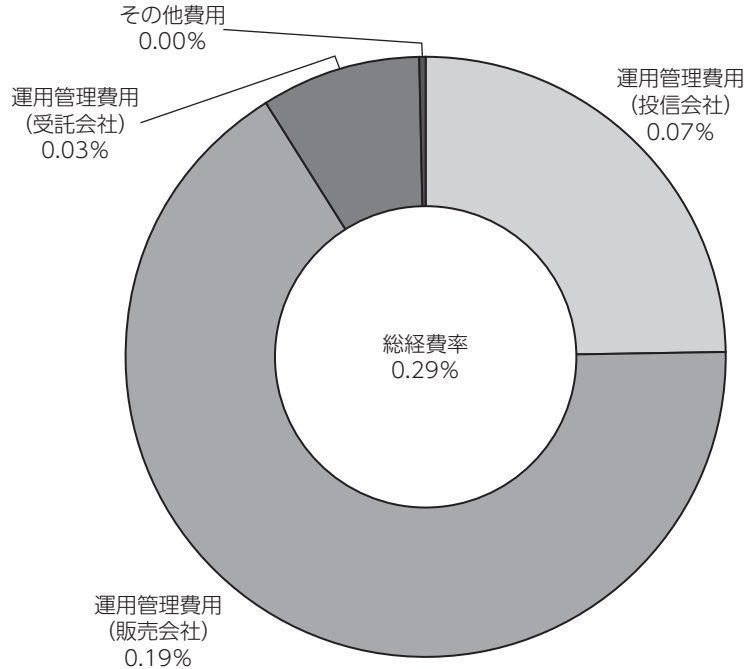
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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0.29%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19日から2026年4月17日まで)

|                      | 設 定 |     | 解 約    |        |
|----------------------|-----|-----|--------|--------|
|                      | 口 数 | 金 額 | 口 数    | 金 額    |
|                      | 千口  | 千円  | 千口     | 千円     |
| ダイワ・マネースtock・マザーファンド | －   | －   | 19,622 | 19,716 |

(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19日から2026年4月17日まで)

| 決 算 期   | 期          |                        |     |           |                        |     |
|---------|------------|------------------------|-----|-----------|------------------------|-----|
| 区 分     | 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     | 457,530    | 36,445                 | 8.0 | －         | －                      | －   |
| コール・ローン | 18,818,897 | －                      | －   | －         | －                      | －   |

(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

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                  | 期 首    |
|----------------------|--------|
|                      | 口 数    |
|                      | 千口     |
| ダイワ・マネースtock・マザーファンド | 19,622 |

(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4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 | 11,768 100.0 |
| 投資信託財産総額     | 11,768 100.0 |

(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

2026年4月17日現在

| 項 目            | 償 還 時       |
|----------------|-------------|
| (A) 資産         | 11,768,670円 |
| コール・ローン等       | 11,767,959  |
| 未収利息           | 711         |
| (B) 負債         | 21,151      |
| 未払信託報酬         | 21,151      |
| (C) 純資産総額(A－B) | 11,747,519  |
| 元本             | 11,754,572  |
| 償還差損益金         | △ 7,053     |
| (D) 受益権総口数     | 11,754,572口 |
| 1万口当り償還価額(C／D) | 9,994円00銭   |

\* 期首における元本額は19,902,091円、当作成期間中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は8,147,519円です。

\* 償還時の計算口数当りの純資産額は9,994円00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7,053円です。

■損益の状況

当期 自2025年4月19日 至2026年4月17日

| 項 目              | 当 期       |
|------------------|-----------|
| (A) 配当等収益        | 11,513円   |
| 受取利息             | 11,513    |
| (B) 有価証券売買損益     | 59,744    |
| 売買益              | 66,780    |
| 売買損              | △ 7,036   |
| (C) 信託報酬等        | △45,969   |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 25,288    |
| (E) 前期繰越損益金      | △ 1,933   |
| (F) 追加信託差損益金     | △30,408   |
| (配当等相当額)         | ( 10,501) |
| (売買損益相当額)        | (△40,909) |
| (G) 合計(D＋E＋F)    | △ 7,053   |
| 償還差損益金(G)        | △ 7,053   |

(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。

投資信託財産運用総括表

|          |                  |                  |             |              |             |
|----------|------------------|------------------|-------------|--------------|-------------|
| 信託期間     | 投資信託契約締結日        | 2011年5月16日       |             | 投資信託契約終了時の状況 |             |
|          | 投資信託契約終了日        | 2026年4月17日       |             | 資産総額         | 11,768,670円 |
| 区分       | 投資信託契約締結当初       | 投資信託契約終了時        | 差引増減又は追加信託  | 負債総額         | 21,151円     |
|          |                  |                  |             | 純資産総額        | 11,747,519円 |
| 受益権口数    | 1,000,000口       | 11,754,572口      | 10,754,572口 | 受益権口数        | 11,754,572口 |
| 元本額      | 1,000,000円       | 11,754,572円      | 10,754,572円 | 1単位当り償還金     | 9,994円00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         |
| 第 1 期    | 円<br>402,829,307 | 円<br>403,036,453 | 円<br>10,005 | 円<br>0       | %<br>0.00   |
| 第 2 期    | 440,589,621      | 440,984,791      | 10,009      | 0            | 0.00        |
| 第 3 期    | 464,439,652      | 464,983,913      | 10,012      | 0            | 0.00        |
| 第 4 期    | 394,448,523      | 394,917,375      | 10,012      | 0            | 0.00        |
| 第 5 期    | 285,307,385      | 285,655,815      | 10,012      | 0            | 0.00        |
| 第 6 期    | 615,919,777      | 616,289,157      | 10,006      | 0            | 0.00        |
| 第 7 期    | 185,251,275      | 185,240,626      | 9,999       | 0            | 0.00        |
| 第 8 期    | 166,719,358      | 166,560,464      | 9,990       | 0            | 0.00        |
| 第 9 期    | 89,037,889       | 88,899,580       | 9,984       | 0            | 0.00        |
| 第10期     | 301,542,638      | 300,941,532      | 9,980       | 0            | 0.00        |
| 第11期     | 65,192,656       | 65,043,418       | 9,977       | 0            | 0.00        |
| 第12期     | 51,875,984       | 51,741,569       | 9,974       | 0            | 0.00        |
| 第13期     | 21,624,527       | 21,561,462       | 9,971       | 0            | 0.00        |
| 第14期     | 19,902,091       | 19,847,332       | 9,972       | 0            | 0.00        |

(注) 1単位は受益権1万口。

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| 償 還 金 の お 知 ら せ |           |
| 1 万 口 当 り 償 還 金 | 9,994円00銭 |

# ダイワ・マネースtock・マザーファンド

## 運用報告書 第16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・マネースtock・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。

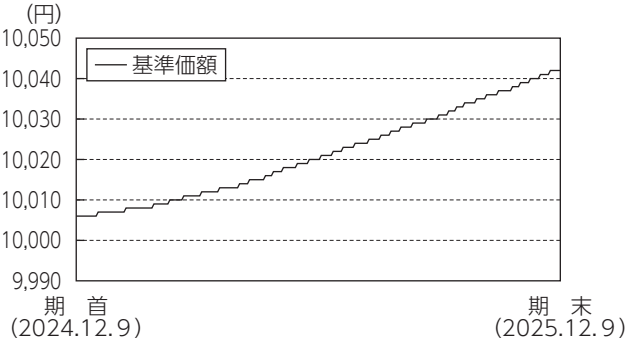
|        |                           |
|--------|---------------------------|
| 運用方針   | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 円建ての債券                    |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下               |

## 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   |     |               |
|                | 円       | %   | %             |
| (期首)2024年12月9日 | 10,006  | —   | 56.2          |
| 12月末           | 10,007  | 0.0 | 69.8          |
| 2025年1月末       | 10,008  | 0.0 | 69.8          |
| 2月末            | 10,010  | 0.0 | 60.8          |
| 3月末            | 10,013  | 0.1 | 60.0          |
| 4月末            | 10,015  | 0.1 | 51.4          |
| 5月末            | 10,019  | 0.1 | 59.8          |
| 6月末            | 10,023  | 0.2 | 59.4          |
| 7月末            | 10,026  | 0.2 | 59.1          |
| 8月末            | 10,030  | 0.2 | 60.1          |
| 9月末            | 10,034  | 0.3 | 55.1          |
| 10月末           | 10,037  | 0.3 | 70.5          |
| 11月末           | 10,041  | 0.3 | 72.9          |
| (期末)2025年12月9日 | 10,042  | 0.4 | 64.7          |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。  
(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】  
期首：10,006円 期末：10,042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  
○国内短期金融市況

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                       |
|-----|------|-------------|-----------------------------|
| 国 内 | 国債証券 | 千円          | 千円                          |
|     |      | 460,355,293 | 32,086,550<br>(430,600,000) |

(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        |            | 金 額              | 売 付        |           | 金 額              |
| 銘          | 柄          |                  | 銘          | 柄         |                  |
| 1277国庫短期証券 | 2025/3/31  | 千円<br>43,884,327 | 1231国庫短期証券 | 2025/5/20 | 千円<br>32,086,550 |
| 1324国庫短期証券 | 2025/11/10 | 42,456,310       |            |           |                  |
| 1305国庫短期証券 | 2025/8/12  | 42,359,507       |            |           |                  |
| 1343国庫短期証券 | 2026/2/16  | 40,949,406       |            |           |                  |
| 1296国庫短期証券 | 2025/6/30  | 35,369,131       |            |           |                  |
| 1337国庫短期証券 | 2026/1/19  | 32,658,667       |            |           |                  |
| 1340国庫短期証券 | 2026/2/2   | 30,962,304       |            |           |                  |
| 1341国庫短期証券 | 2026/2/9   | 28,066,195       |            |           |                  |
| 1322国庫短期証券 | 2025/11/4  | 27,971,020       |            |           |                  |
| 1303国庫短期証券 | 2025/8/4   | 26,054,513       |            |           |                  |

(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B B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年末満 |
| 国債証券 | 132,800,000 | 132,703,244 | 64.7 | —            | —         | —    | 64.7 |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。  
(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。  
(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

| 当 期  |            | 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 | 1337国庫短期証券 | —     | 千円<br>32,700,000 | 千円<br>32,682,529 | 2026/01/19 |
|      | 1340国庫短期証券 | —     | 31,000,000       | 30,977,943       | 2026/02/02 |
|      | 1341国庫短期証券 | —     | 28,100,000       | 28,078,393       | 2026/02/09 |
|      | 1343国庫短期証券 | —     | 41,000,000       | 40,964,377       | 2026/02/16 |
| 合計   | 銘柄数<br>金 額 | 4銘柄   | 132,800,000      | 132,703,244      |            |

(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               |           | 期 末   |     |
|--------------|-------------------|-----------|-------|-----|
|              | 評 価 額             | 比 率       | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債          | 千円<br>132,703,244 | %<br>64.7 |       |     |
| コール・ローン等、その他 | 72,294,456        | 35.3      |       |     |
| 投資信託財産総額     | 204,997,700       | 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         | 204,997,700,368円 |
| コール・ローン等       | 72,294,456,353   |
| 公社債(評価額)       | 132,703,244,015  |
| (B) 負債         | —                |
| (C) 純資産総額(A－B) | 204,997,700,368  |
| 元本             | 204,130,644,571  |
| 次期繰越損益金        | 867,055,797      |
| (D) 受益権総口数     | 204,130,644,571口 |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 10,042円          |

\* 期首における元本額は239,423,796,545円、当作成期間中における追加設定元本額は443,018,350,908円、同解約元本額は478,311,502,882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：  
    ロボット・テクノロジー関連株ファンド　－ロボテック　1,268円  
    ダイワ／ミレアセット・インド株式ファンド　－インドの匠－　1,270円  
    ワールド・フィンテック革命ファンド(為替ヘッジあり)　998円  
    ワールド・フィンテック革命ファンド(為替ヘッジなし)　998円  
    ロボット・テクノロジー関連株ファンド　－ロボテック(為替ヘッジあり)　1,849円  
    ロボット・テクノロジー関連株ファンド(年1回決算型)　－ロボテック(年1回)－(為替ヘッジあり)　1,985円  
    i Freeレバレッジ　S&P500　10,594,492,058円  
    i Freeレバレッジ　NASDAQ100　131,022,793,738円  
    クリーンテック株式ファンド(資産成長型)　1,802円  
    ロボット・テクノロジー関連株ファンド　－ロボテック(毎月決算/予想分配金提示型)　999円  
    世界インフラ戦略ファンド(為替ヘッジなし/資産成長型)　1,501円  
    i FreeETF　日経平均レバレッジ・インデックス　5,075,253,288円  
    i FreeETF　日経平均ダブルインバース・インデックス　4,076,800,989円  
    i FreeETF　TOPIXレバレッジ(2倍)指数　1,788,504,305円  
    i FreeETF　TOPIXダブルインバース(－2倍)指数　640,407,643円  
    i FreeETF　日経平均インバース・インデックス　5,059,702,292円  
    i FreeETF　TOPIXインバース(－1倍)指数　7,911,533,868円  
    i FreeETF　JPX日経400ダブルインバース・インデックス　79,873,923円  
    i FreeETF　S&P500レバレッジ　977,167,177円  
    i FreeETF　S&P500インバース　2,285,058,968円  
    ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ　－SLトレード－　5,039,566円  
    ブルベア・マネー・ポートフォリオ6　19,300,063,267円  
    ブル3倍日本株ポートフォリオ6　11,789,858,577円  
    ベア2倍日本株ポートフォリオ6　3,512,508,363円  
    ダイワ／ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ　11,569,330円  
    ダイワ／ミレアセット亜細亜株式ファンド　1,148円  
    ロボット・テクノロジー関連株ファンド(年1回決算型)　－ロボテック(年1回)－　1,588円  
    ダイワ／ミレアセット・アジア・セクターラダー株ファンド　1,813円  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,042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             | 705,454,602円 |
| 受取利息                  | 705,454,602  |
| (B) 有価証券売買損益          | △ 7,808,839  |
| 売買益                   | 837          |
| 売買損                   | △ 7,809,676  |
| (C) 当期損益金(A + B)      | 697,645,763  |
| (D) 前期繰越損益金           | 138,942,634  |
| (E) 解約差損益金            | △960,649,455 |
| (F) 追加信託差損益金          | 991,116,855  |
| (G) 合計(C + D + E + F) | 867,055,797  |
| 次期繰越損益金(G)            | 867,055,797  |

(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。