

# トレンド・キャッチ 戦略ファンド (愛称:クラッシュハンター)

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2023年12月13日)

(作成対象期間 2023年6月14日~2023年12月13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		
信託期間	2020年12月14日~2025年12月12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「米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド(円建て・クラスA)」の受益証券 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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、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、米国の株価指数先物取引の売買により信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額
	( 分 配 落 )	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
2 期末 (2021年12月13日)	7,969	0	△ 13.3	—	98.3	6,044
3 期末 (2022年 6 月13日)	7,254	0	△ 9.0	—	99.5	3,060
4 期末 (2022年12月13日)	8,496	0	17.1	—	99.5	3,207
5 期末 (2023年 6 月13日)	7,527	0	△ 11.4	—	99.6	2,632
6 期末 (2023年12月13日)	7,455	0	△ 1.0	—	99.5	2,198

(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。

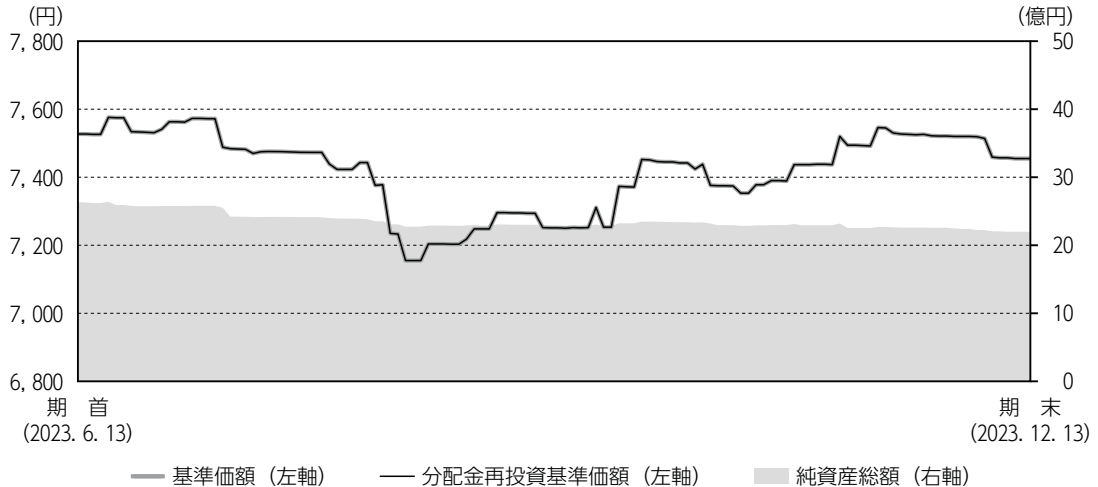
(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



(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はありません。

\* 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：7,527円

期末：7,455円（分配金0円）

騰落率：△1.0%（分配金込み）

#### 基準価額の主な変動要因

「モメンタム・ファンド」の受益証券へ投資し、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざした結果、当作成期は、特に前半期

間、日中に発生したトレンドが引けにかけて反転する局面が度々見られたため、日中の株価トレンドからリターンを獲得する当戦略が奏功しにくく、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

※モメンタム・ファンド：米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド（円建て・クラスA）

トレンド・キャッチ戦略ファンド

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 組 益 証 券 入 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 6 月13日	円 7,527	% —	% —	% 99.6
6 月末	7,563	0.5	—	99.6
7 月末	7,439	△ 1.2	—	99.9
8 月末	7,296	△ 3.1	—	99.8
9 月末	7,451	△ 1.0	—	100.1
10 月末	7,437	△ 1.2	—	100.0
11 月末	7,520	△ 0.1	—	100.5
(期 末) 2023年12月13日	7,455	△ 1.0	—	99.5

(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

(2023. 6. 14 ~ 2023. 12. 13)

### ■ 米国株式市況

米国株式市場は上昇しました。

米国株式市場は、当作成期首より、複数の物価指標の下振れによりインフレ警戒感が後退したことに加え、F R B（米国連邦準備制度理事会）高官発言などにより米国経済への見方が改善し、上昇しました。2023年8月以降は、米国国債の増発やF R Bの政策金利見通しの引き上げ、政府機関の閉鎖懸念などから長期金利が大幅に上昇したことを受け、下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立によって政府機関の閉鎖が回避されて一時的に反発しましたが、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、長期金利のさらなる上昇などが嫌気され、続落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことなどが好感され、大幅に上昇して当作成期末を迎えました。

### ■ 国内短期金融市況

日銀のマイナス金利政策の影響により、短期の国債利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■ 当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、引き続き、「モメンタム・ファンド」の受益証券を高位で組み入れ、信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

### ■ モメンタム・ファンド

円建て短期公社債等へ投資を行うとともに、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざします。

トレンド・キャッチ戦略では、米国株式市場の取引時間内におけるS & P 500株価指数先物価格のトレンドを捉えることをめざします。S & P 500株価指数先物価格が日中に前日比で一定率以上上昇した場合には株価指数先物取引を買建て、一定率以上下落した場合には株価指数先物取引を売建てます。株価指数先物取引はすべて当該取引日の取引終了までに反対売買を行って損益を確定します。株価指数先物取引の買建または売建のポジション総額は、見込み純資産総額の3倍程度を上限とします。

## ■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。

## ポートフォリオについて

(2023. 6. 14 ~ 2023. 12. 13)

### ■当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、「モメンタム・ファンド」の受益証券を高位で組み入れ、信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

### ■モメンタム・ファンド

円建て短期公社債等へ投資を行うとともに、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざしました。

トレンド・キャッチ戦略では、米国株式市場の取引時間内におけるS & P 500株価指数先物価格のトレンドを捉えることをめざしました。S & P 500株価指数先物価格が日中に前日比で一定率以上上昇した場合には株価指数先物取引を買建て、一定率以上下落した場合には株価指数先物取引を売建てました。株価指数先物取引はすべて当該取引日の取引終了までに反対売買を行って損益を確定しました。

当作成期においては、日中に発生したトレンドが引けにかけて反転する局面が度々見られ、トレンド・キャッチ戦略にとって逆風環境となりました。

### ■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、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

当作成期は、分配対象額が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

### 分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2023年6月14日	～2023年12月13日
<b>当期分配金（税込み）</b> (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)	—	

- (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

当ファンドの商品性格に鑑み、引き続き、「モメンタム・ファンド」の受益証券を高位で組み入れ、信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

### ■モメンタム・ファンド

円建て短期公社債等へ投資を行うとともに、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざします。

トレンド・キャッチ戦略では、米国株式市場の取引時間内におけるS & P 500株価指数先物価格のトレンドを捉えることをめざします。S & P 500株価指数先物価格が日中に前日比で一定率以上上昇した場合には株価指数先物取引を買建て、一定率以上下落した場合には株価指数先物取引を売建てます。株価指数先物取引はすべて当該取引日の取引終了までに反対売買を行って損益を確定します。株価指数先物取引の買建または売建のポジション総額は、見込み純資産総額の3倍程度を上限とします。

### ■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。



## 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023. 6. 14~2023. 12. 13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	46円	0.618%	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7,418円です。
(投 信 会 社)	(14)	(0.192)	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)	(31)	(0.412)	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)	(1)	(0.014)	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	0	0.004	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)	(0.004)	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	46	0.622	

(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。

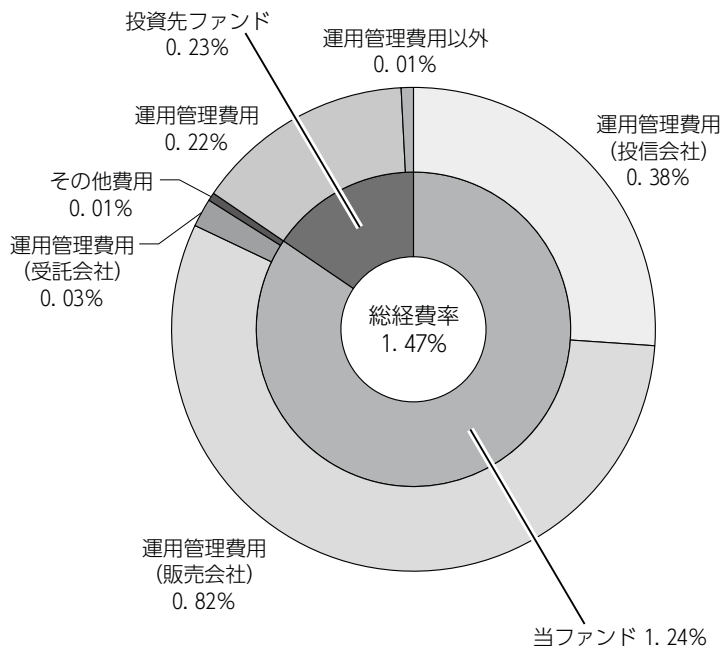
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.47%です。



総経費率 ( ① + ② + ③ )	1.47%
①当ファンドの費用の比率	1.24%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.22%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

(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  
投資信託受益証券

(2023年6月14日から2023年12月13日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	RED ARC GLOBAL INVESTMENTS TRUST US EQUITY INTRADAY MOMENTUM FUND JPY CLASS A (ケイマン諸島)	—	—	55.7682187	424,500

(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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) RED ARC GLOBAL INVESTMENTS TRUST US EQUITY INTRADAY MOMENTUM FUND JPY CLASS A	287.2936533	2,188,028	99.5

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。  
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 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	9	9	9

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年12月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,188,028	98.8
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	25,783	1.2
投資信託財産総額	2,213,822	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

2023年12月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,229,122,239円
コール・ローン等	25,783,786
投資信託受益証券 (評価額)	2,188,028,463
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド (評価額)	9,990
未収入金	15,300,000
(B) 負債	30,576,495
未払金	15,300,000
未払解約金	628,289
未払信託報酬	14,551,290
その他未払費用	96,916
(C) 純資産総額 (A - B)	2,198,545,744
元本	2,949,130,070
次期繰越損益金	△ 750,584,326
(D) 受益権総口数	2,949,130,070口
1万口当り基準価額 (C / D)	7,455円

\* 期首における元本額は3,497,874,349円、当作成期間中における追加設定元本額は2,250,418円、同解約元本額は550,994,697円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,455円です。

\* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は750,584,326円です。

■損益の状況

当期 自2023年6月14日 至2023年12月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,586円
受取利息	258
支払利息	△ 2,844
(B) 有価証券売買損益	△ 6,677,623
売買益	3,214,253
売買損	△ 9,891,876
(C) 信託報酬等	△ 14,648,209
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 21,328,418
(E) 前期繰越損益金	△ 654,718,729
(F) 追加信託差損益金	△ 74,537,179
(配当等相当額)	(△) 23,555
(売買損益相当額)	(△) 74,513,624
(G) 合計 (D + E + F)	△ 750,584,326
次期繰越損益金 (G)	△ 750,584,326
追加信託差損益金	△ 74,537,179
(配当等相当額)	(△) 23,555
(売買損益相当額)	(△) 74,513,624
繰越損益金	△ 676,047,147

- (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いません。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	0
(h) 受益権総口数	2,949,130,070口

モメンタム・ファンド

当ファンド（トレンド・キャッチ戦略ファンド）はケイマン籍の外国投資信託「米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド（円建て・クラス A）」の受益証券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。

（日本円建て）

貸借対照表  
2023年6月30日

（円）

<b>資産</b>	
投資	
簿価	2,471,171,370
評価額	2,470,276,900
スワップ取引の評価額	12,219,950
銀行預金	83,571,293
<b>資産合計</b>	<b><u>2,566,068,143</u></b>
<b>負債</b>	
未払管理会社報酬および未払保管会社報酬	260,168
未払運用会社報酬	151,676
未払受託会社報酬	65,754
<b>負債合計</b>	<b><u>477,598</u></b>
<b>純資産</b>	<b><u>2,565,590,545</u></b>
発行済み口数	333,907,1836
1口当り純資産	7,684

損益計算書および純資産変動計算書

自2022年7月1日 至2023年6月30日

(円)

**費用**

管理会社報酬および保管会社報酬	3,468,044
運用会社報酬	2,021,882
保護預り手数料	452,561
受託会社報酬	287,243
弁護士費用	150,703
銀行利息	146,442
取引費用	40,220
<b>費用合計</b>	<b>6,567,095</b>

**投資純損失**

**(6,567,095)**

**実現損益の内訳：**

スワップ取引に係る損益	173,177,406
為替差損益	(783)
証券投資に係る損益	(4,534,460)
<b>投資純損益および実現損益</b>	<b>162,075,068</b>

**評価損益の内訳：**

証券投資に係る評価損益	(466,830)
スワップ取引に係る評価損益	(141,349,590)
<b>運用による純資産の純増減</b>	<b>20,258,648</b>

**資本の移動：**

解約	(557,800,000)
<b>資本の純移動</b>	<b>(557,800,000)</b>

**期首純資産**

3,103,131,897

**期末純資産**

**2,565,590,545**

投資明細表  
2023年6月30日

元本	銘柄	通貨	簿価 (円)	評価額 (円)	純資産 に占める 割合 (%)
<b>債券</b>					
1,670,000,000	JAPAN T-BILL 0 10JUL23 SER 1148	JPY	1,670,920,170	1,670,116,900	65.10
800,000,000	JAPAN T-BILL 0 25SEP23 SER 1165	JPY	800,251,200	800,160,000	31.18
<b>債券合計</b>			<u>2,471,171,370</u>	<u>2,470,276,900</u>	<u>96.28</u>
<b>投資合計</b>			<u>2,471,171,370</u>	<u>2,470,276,900</u>	<u>96.28</u>

スワップ取引 (2023年6月30日時点)

契約口数	指数スワップ	通貨	満期日	参照指数	評価額 (円)
5,504,482.00	S46 Index Swap	JPY	07/12/2023	CIEQCU13	12,219,950

## ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（トレンド・キャッチ戦略ファンド）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（2023年12月11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（2023年12月13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

2023年6月14日～2023年12月13日における主要な売買銘柄はありません。

### ■組入資産明細表

2023年12月13日現在、有価証券等の組み入れはありません。



# 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15期 (決算日 2023年12月11日)

(作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11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。

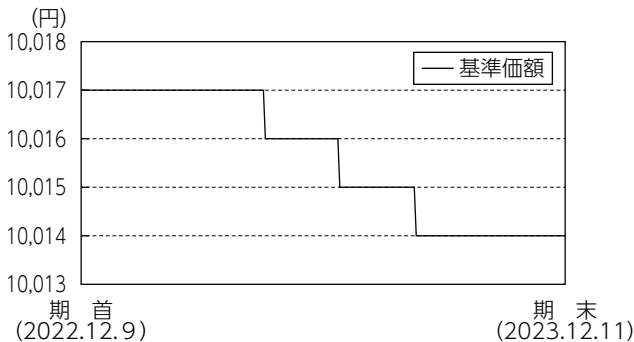
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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		
(期首)2022年12月9日	円	%	%
	10,017	-	-
12月末	10,017	0.0	-
2023年1月末	10,017	0.0	-
2月末	10,017	0.0	-
3月末	10,017	0.0	-
4月末	10,016	△0.0	-
5月末	10,016	△0.0	-
6月末	10,015	△0.0	-
7月末	10,015	△0.0	-
8月末	10,014	△0.0	-
9月末	10,014	△0.0	-
10月末	10,014	△0.0	-
11月末	10,014	△0.0	-
(期末)2023年12月11日	10,014	△0.0	-

(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：10,017円 期末：10,014円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆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、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。

《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 (その他)	0 (0)
合 計	0

(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

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	62,664,638	100.0
投資信託財産総額	62,664,638	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

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	62,664,638,644円
コール・ローン等	62,664,638,644
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	62,664,638,644
元本	62,579,567,123
次期繰越損益金	85,071,521
(D) 受益権総口数	62,579,567,123口
1万口当り基準価額(C/D)	10,014円

\* 期末における元本額は44,855,160,815円、当作成期間中における追加設定元本額は94,438,728,484円、同解約元本額は76,714,322,176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・プルファンド (適格機関投資家専用)	394,341,311円
ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用)	7,178,107,283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)	905,310,638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クワトロ (毎月分配型)	159,141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)	159,141円
オール・マーケット・インカム戦略 (資産成長重視コース)	9,963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)	9,963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)	9,963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)	9,963円
NYダウ・トリプル・レバレッジ	930,471,926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
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ターゲットリスクリイト戦略ファンド (適格機関投資家専用)	7,916,611,556円
ダイワJGBベア・ファンド2 (適格機関投資家専用)	45,246,139,138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
ダイワ豪ドル建て高利回り証券α (毎月分配型)	9,949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 -	997,374円
ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド - 予想分配金提示型 -	173,802円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,014円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 25,212,071円
受取利息	17,750
支払利息	△ 25,229,821
(B) その他費用	△ 16,282
(C) 当期損益金(A + B)	△ 25,228,353
(D) 前期繰越損益金	78,288,990
(E) 解約差損益金	△121,056,632
(F) 追加信託差損益金	153,067,516
(G) 合計(C + D + E + F)	85,071,521
次期繰越損益金(G)	85,071,521

(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。