

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6期

（決算日 2026年8月18日）
（作成対象期間 2025年8月19日～2026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/>

最近 5 期の運用実績

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
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
6 期末 (2026年 8 月18日)	44, 136	0	21. 8	36, 577	19. 9	99. 6	38, 566

- (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」)

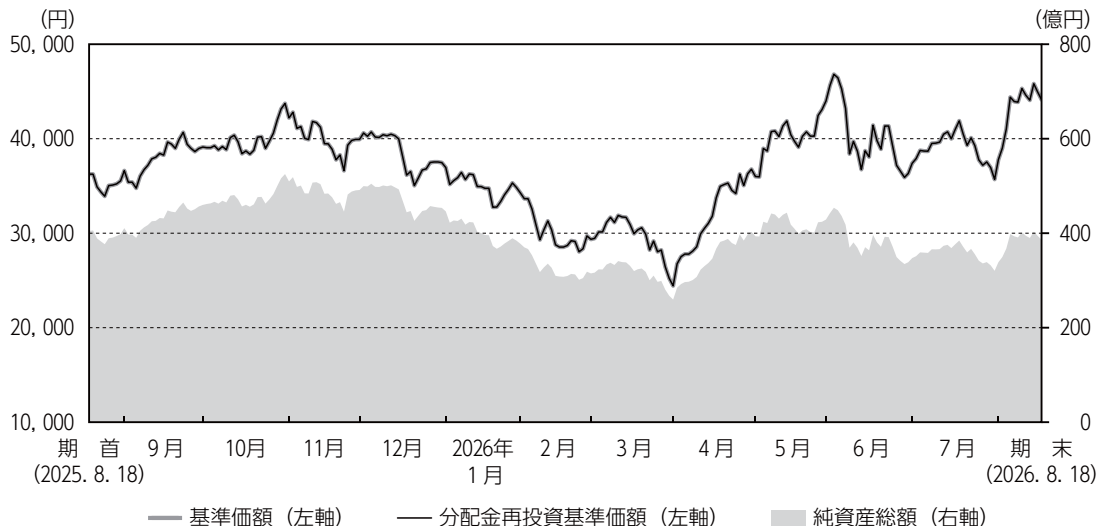
本書で言及されているインデックスデータおよびマークは、ICE データ、その関連会社またはその第三者供給元の所有物であり、大和アセットマネジメント株式会社に対して使用許諾されています。ICE データおよびその供給元は、当該インデックスデータまたはマークの使用に関して、いかなる責任も負いません。免責事項の全文は [<https://www.daiwa-am.co.jp/funds/disclaimer/index.html>] をご覧ください。

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：36,249円

期末：44,136円（分配金0円）

騰落率：21.8%（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) 2025年 8 月18日	円	%		%	%
	36, 249	—	30, 510	—	100. 1
8 月末	36, 626	1. 0	30, 714	0. 7	100. 0
9 月末	39, 116	7. 9	31, 930	4. 7	100. 4
10月末	42, 212	16. 5	33, 268	9. 0	100. 2
11月末	39, 928	10. 1	32, 541	6. 7	99. 8
12月末	36, 945	1. 9	31, 519	3. 3	99. 3
2026年 1 月末	34, 266	△ 5. 5	30, 555	0. 1	99. 6
2 月末	29, 351	△ 19. 0	28, 503	△ 6. 6	100. 0
3 月末	24, 432	△ 32. 6	26, 155	△ 14. 3	100. 0
4 月末	36, 004	△ 0. 7	32, 055	5. 1	99. 9
5 月末	43, 996	21. 4	35, 677	16. 9	99. 3
6 月末	37, 399	3. 2	33, 221	8. 9	99. 7
7 月末	37, 793	4. 3	33, 558	10. 0	99. 9
(期 末) 2026年 8 月18日	44, 136	21. 8	36, 577	19. 9	99. 6

(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. 8. 19 ~ 2026. 8. 18)

■米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利下げ期待などから、底堅く推移しました。2025年9月中旬には、実際にF R Bが利下げを決定したことが好感されたほか、成長期待が高まったA I（人工知能）・半導体関連株が上昇をけん引しました。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が好感され、反発しました。12月は、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たものの、大手I T（情報技術）企業の巨額なA I投資への警戒感が高まり、株価は下落しました。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」による情報サービス・ソフトウェア関連株の下落やプライベート・クレジット市場への懸念などもあり、軟調に推移しました。3月には米国とイスラエルによるイランへの軍事作戦の開始やホルムズ海峡の封鎖で大幅に下落しましたが、4月以降はA I・半導体関連株の集中物色で急反発したほか、イランとの和平交渉の進展期待も相場を押し上げ、史上最高値を更新しました。6月以降は、イランとの一時的な和平合意が成立し、ホルムズ海峡の通航状況が改善したことや、好調な企業業績が好感された一方で、スペースXの史上最大規模の資金調達による需給悪化や大手I T企業の過剰投資懸念などが上値を抑え、高値圏での保合相場となり、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・ローンによる運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

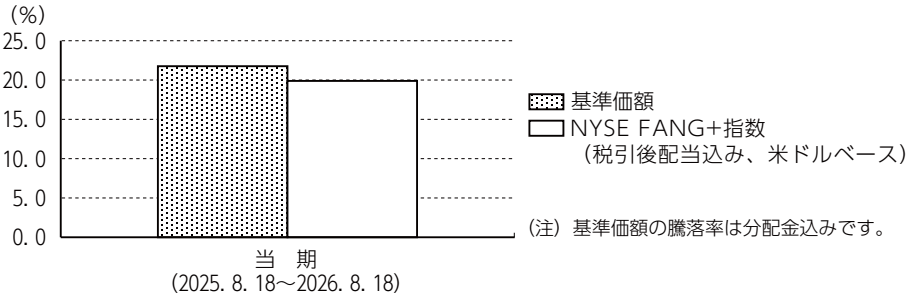
(2025. 8. 19 ~ 2026. 8. 18)

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	
		2025年8月19日 ～2026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)	34,136	

- (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

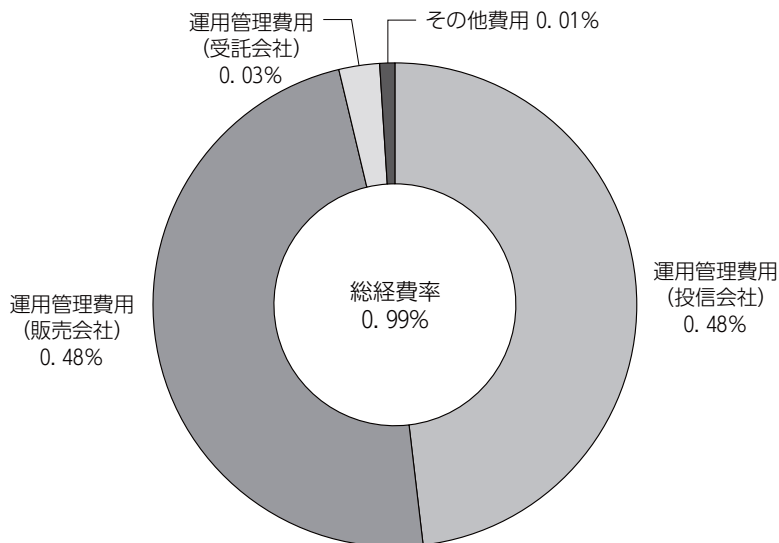
項 目	当 期 (2025. 8. 19～2026. 8. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	364円	0. 984%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は36, 942円です。
(投 信 会 社)	(177)	(0. 478)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(177)	(0. 478)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(10)	(0. 027)	受託会社分は、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	4	0. 010	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)	(2)	(0. 005)	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. 006)	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	367	0. 995	

- (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

(2025年 8 月19日から2026年 8 月18日まで)

		買 付 額	売 付 額
国内	社債券	千円 8, 366, 928	千円 18, 242, 102 (—)

(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

(2025年 8 月19日から2026年 8 月18日まで)

当 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
千円 Star Helios Plc 2029/8/20（ユーロ円債）		千円 Star Helios Plc 2029/8/20（ユーロ円債）	
8, 366, 928		18, 242, 102	

(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 8, 185, 000	千円 38, 399, 109	% 99. 6	% —	% —	% 99. 6	% —

(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
普通社債券	Star Helios Plc	% —	千円 8,185,000	千円 38,399,109	2029/08/20

(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

項 目	2026年 8 月18日現在	
	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	38,399,109	98.3
コール・ローン等、その他	671,727	1.7
投資信託財産総額	39,070,836	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

項 目	2026年 8 月18日現在	
	当 期 末	
(A)資産	39,070,836,810円	
コール・ローン等	392,146,710	
公社債（評価額）	38,399,109,000	
未収入金	279,581,100	
(B)負債	504,663,916	
未払解約金	325,971,046	
未払信託報酬	177,551,427	
その他未払費用	1,141,443	
(C)純資産総額（A－B）	38,566,172,894	
元本	8,737,982,310	
次期繰越損益金	29,828,190,584	
(D)受益権総口数	8,737,982,310口	
1万口当り基準価額（C／D）	44,136円	

*期首における元本額は11,161,314,593円、当作成期間中における追加設定元本額は8,716,086,476円、同解約元本額は11,139,418,759円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は44,136円です。

■損益の状況

項 目	当 期
(A)配当等収益	27,193,443円
受取利息	2,905,259
その他収益金	24,288,184
(B)有価証券売買損益	6,827,069,361
売買益	9,594,387,630
売買損	2,767,318,269
(C)信託報酬等	△ △ 399,020,667
(D)当期損益金（A＋B＋C）	6,455,242,137
(E)前期繰越損益金	3,989,092,604
(F)追加信託差損益金	19,383,855,843
(配当等相当額)	(7,946,707,834)
(売買損益相当額)	(11,437,148,009)
(G)合計（D＋E＋F）	29,828,190,584
次期繰越損益金（G）	29,828,190,584
追加信託差損益金	19,383,855,843
(配当等相当額)	(7,946,707,834)
(売買損益相当額)	(11,437,148,009)
分配準備積立金	10,444,334,741

(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	25,597,360円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	6,429,644,777
(c)収益調整金	19,383,855,843
(d)分配準備積立金	3,989,092,604
(e)当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	29,828,190,584
(f)分配金	0
(g)翌期繰越分配対象額（e－f）	29,828,190,584
(h)受益権総口数	8,737,982,310口

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。

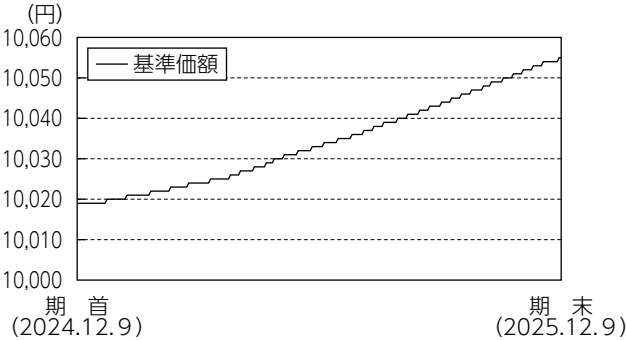
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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		
	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
国 内	国債証券	千円	千円
		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		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。

■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88 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
	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	当 期		期 末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国債証券	1344国庫短期証券	% —	千円 9,800,000	千円 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	
	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/ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド 2,417,017円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン
ド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型） 998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン
ド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型） 998円
ダイワ/フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファン
ド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型） 998円
ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド（為替ヘッジなし/資産成長型） 999円
ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド（為替ヘッジあり/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
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 - U\$トライアングル - 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。