

グローバル5.5倍バランスファンド(予想分配金提示型) <愛称 ゴーゴー・バランス (予想分配金提示型)>

追加型投信／内外／資産複合

交付運用報告書

第25期(決算日2023年7月21日)

第26期(決算日2023年8月21日)

第27期(決算日2023年9月21日)

第28期(決算日2023年10月23日)

第29期(決算日2023年11月21日)

第30期(決算日2023年12月21日)

作成対象期間(2023年6月22日～2023年12月21日)

第30期末(2023年12月21日)	
基準価額	5,598円
純資産総額	1,836百万円
第25期～第30期	
騰落率	5.0%
分配金(税込み)合計	0円

(注) 騰落率は分配金(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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

○交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書(全体版)に記載しております。

○当ファンドは、投資信託約款において運用報告書(全体版)に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書(全体版)は、下記の手順にて閲覧・ダウンロードいただけます。

<運用報告書(全体版)の閲覧・ダウンロード方法>

右記URLにアクセス ⇒ ファンド検索機能を利用して該当ファンドのページを表示 ⇒ 運用報告書タブを選択 ⇒ 該当する運用報告書をクリックしてPDFファイルを表示

○運用報告書(全体版)は、受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、「グローバル5.5倍バランスファンド(予想分配金提示型)」は、2023年12月21日に第30期の決算を行ないました。

当ファンドは、主として、「グローバル5.5倍バランス・マザーファンド」受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行なっております。

ここに、当作成対象期間の運用経過等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

<645037>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

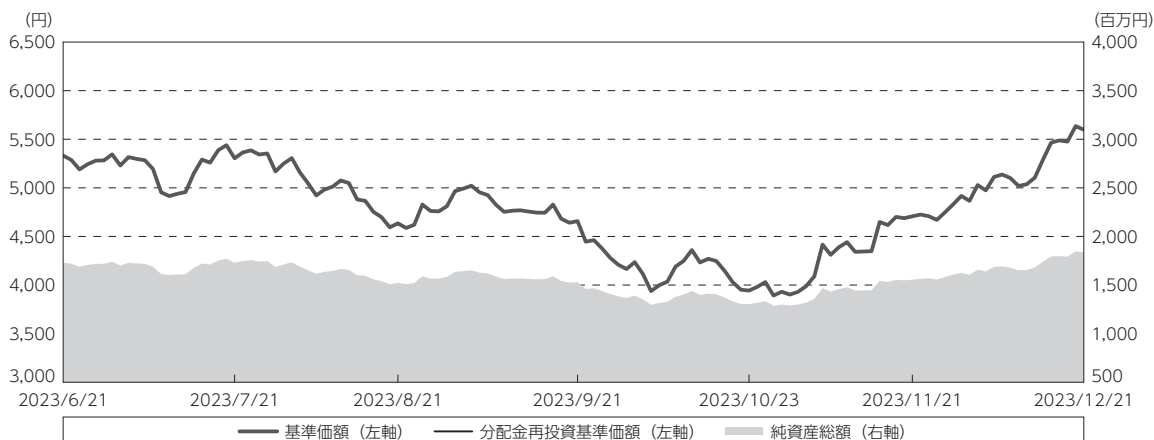
コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

運用経過

作成期間中の基準価額等の推移

(2023年6月22日～2023年12月21日)



第25期首：5,332円

第30期末：5,598円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：5.0% (分配金再投資ベース)

(注) 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。
 (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。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、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2023年6月21日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、日本を含む世界の株式、不動産投信、債券および金に実質的に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行なっております。世界の株式への投資にあたっては、主として株価指数先物取引に係る権利に投資しています。世界の不動産投信への投資にあたっては、主として不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動をめざす上場投資信託証券に投資しています。世界の債券への投資にあたっては、主として国債先物取引に係る権利および国債に投資しています。金への投資にあたっては、主として金先物取引に係る権利に投資しています。各投資対象資産の組入比率は、原則として、市況環境および投資対象資産のリスク水準などを勘案して決定しています。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・海外株式および海外債券資産を保有したこと。
- ・海外不動産投資信託資産を保有したこと。
- ・アメリカドル建て資産を保有したこと。
- ・金の値動きをとらえる資産を保有したこと。

<値下がり要因>

- ・国内債券資産を保有したこと。
- ・国内不動産投資信託資産を保有したこと。

1万口当たりの費用明細

(2023年6月22日～2023年12月21日)

項 目	第25期～第30期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	26	0.544	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(9)	(0.198)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(16)	(0.330)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	3	0.070	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数
(投 資 信 託 証 券)	(1)	(0.013)	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)	(3)	(0.057)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	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
(d) そ の 他 費 用	5	0.099	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(0)	(0.003)	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及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	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
(印 刷 費 用 等)	(2)	(0.048)	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用など
(そ の 他)	(2)	(0.045)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	34	0.713	
作成期間の平均基準価額は、4,747円です。			

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

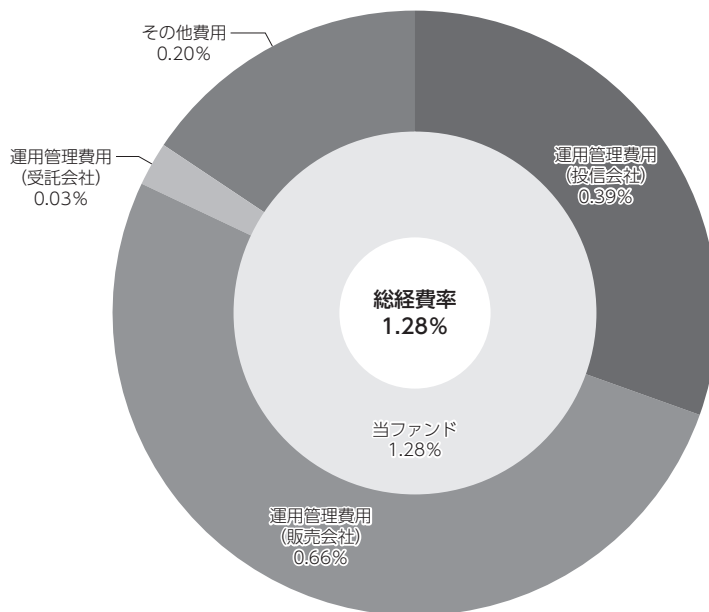
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものをみます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（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除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.28%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当た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) 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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認ください。期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

最近5年間の基準価額等の推移

（2018年12月21日～2023年12月21日）



- (注) 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。
 (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。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、お客様の損益の状況を示すものではありません。
 (注) 当ファンドの設定日は2021年6月23日です。

	2021年6月23日 設定日	2021年12月21日 決算日	2022年12月21日 決算日	2023年12月21日 決算日
基準価額 (円)	10,000	10,435	4,650	5,598
期間分配金合計(税込み) (円)	—	600	0	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	10.5	△ 55.4	20.4
純資産総額 (百万円)	10	2,995	1,488	1,836

- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
 (注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。
 (注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。
 ただし、設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しており、2021年12月21日の騰落率は設定当初との比較です。
 (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

投資環境

（2023年6月22日～2023年12月21日）

（市況）

国内株式市場では、期間の初めと比べて東証株価指数（TOPIX）は上昇、日経平均株価指数は下落しました。米国の堅調な経済指標の発表などを背景に米国の金融引き締めが長期化するとの見方が強まったことや、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが株価の重しとなる一方、米国連邦公開市場委員会（FOMC）後の米国連邦準備制度理事会（FRB）議長の記者会見を受けて米国の利上げサイクル終了への期待が強まったことや、国内債券市場で長期金利が低下し株式の相対的な割高感が薄れたこと、日銀が金融政策決定会合で現行の金融緩和政策の維持を決めたことなどが支援材料となり、国内株式市場の株価は期間の初めと比べてまちまちの動きとなりました。

海外株式市場では、期間の初めと比べて欧米諸国などの株価は概して上昇しました。期間の初めから2023年7月下旬にかけては、インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げを継続したことなどが株価の重しとなったものの、米国の消費者物価指数（CPI）などのインフレ指標が市場予想を下回り、FRBの利上げペース鈍化への期待が強まったことや、ユーロ圏のCPIが市場予想を下回りインフレ圧力の緩和が見られたこと、公表された米国の2023年4－6月期の企業業績が概ね良好な内容となったことなどを背景に、欧米諸国などの株価は総じて上昇しました。8月上旬から10月下旬にかけては、FOMCの結果を受けて米国の金融引き締めが長期化するとの見方が改めて広がり、欧米の長期金利が上昇したことや、イスラエルとイスラム組織ハマスとの間の戦闘激化による地政学的リスクの高まりなどが重しとなり、欧米諸国などの株価は総じて下落しました。11月上旬から期間末にかけては、FOMC後のFRB議長の記者会見を受けて米国の利上げサイクル終了への期待が強まったことや、欧米のCPIが市場予想を下回り欧米の長期金利が低下したことなどが支援材料となり、欧米諸国などの株価は総じて上昇しました。

新興国株式市場では、期間の初めと比べて新興国各国の株価は概して上昇しました。期間の初めから2023年7月下旬にかけては、世界的なインフレ懸念を背景に欧米の主要中央銀行が利上げを継続したことなどが株価の重しとなったものの、中国人民銀行が景気下振れリスクの抑制のため最優遇貸出金利を引き下げたことや、中国共産党の中央政治局会議で景気刺激策を追加する方針が示されたことなどが支援材料となり、新興国各国の株価は総じて上昇しました。8月上旬から10月下旬にかけては、中国の貿易統計で輸出・輸入がともに低迷していることなどから中国景気の先行き不安が強まったことや、中国の不動産市況の悪化が警戒されたこと、中東情勢の緊迫化を受けた地政学的リスクの高まりが警戒され、世界経済の先行き懸念が高まったことなどが株価の重しとなり、新興国各国の株価は総じて下落しました。11月上旬から期間末にかけては、米国の利上げサイクル終了への期待が強まったことや、欧米の長期金利が低下したことなどが支援材料となり、新興国各国の株価は総じて上昇しました。

国内債券市場では、10年国債利回りは期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。期間の初めから2023年10月下旬にかけては、米国の堅調な経済指標の発表などを背景に米国の長期金利が上昇したことや、日銀が金融政策決定会合において長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を更に柔軟化することを決め、長期金利の上限の目途を1%として一定の上昇を容認したことなどから、10年国債利回りは上昇しました。11月上旬から期間末にかけては、FOMCの結果を受け、FRBの利上げ局面は終了したとの見方が強まったことなどから、10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて低

下しました。期間の初めから2023年10月上旬にかけては、公表されたF R B議事録の内容や米国の堅調な経済指標の発表などからF R Bによる追加利上げが見込まれたことや、F R B高官や欧州中央銀行（E C B）当局者によるタカ派（金融引き締めの政策を支持）的とみなされた発言などを背景に、各国の10年債利回りは総じて上昇しました。10月中旬から期間末にかけては、米国の国内総生産（G D P）成長率速報値が市場予想を上回りF R Bによる金融引き締め長期化が意識されたことなどが利回りの上昇要因となったものの、ユーロ圏の弱めな経済指標を受けてユーロ圏の景気後退観測が高まったことや、中東情勢の緊迫化を受けた地政学的リスクの高まりが懸念されたこと、米国の雇用統計における非農業部門雇用者数やインフレ指標が市場予想を下回り、F R Bの利上げ局面が終了したとの見方が広がったこと、F R BやE C Bが追加利上げを見送ったことなどを背景に、各国の10年債利回りは総じて低下しました。

国内不動産投資信託市場では、東証R E I T指数（配当込み）は期間の初めと比べて下落しました。都心部オフィスにおける空室率が低下したことや、国内株式市場が堅調に推移し投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどがR E I T価格の支援材料となったものの、都心部オフィスの平均賃料が下落したことや、インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げをしたこと、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化を決定し、国内長期金利が上昇したことなどがR E I T価格の重しとなり、東証R E I T指数（配当込み）は下落しました。

海外不動産投資信託市場では、S & P先進国R E I T指数（除く日本）は期間の初めと比べて上昇しました。期間の初めから2023年7月下旬にかけては、米国のC P I、生産者物価指数（P P I）が市場予想を下回りインフレ懸念が後退したことや、一部良好な企業決算発表を好感して株式市場が上昇したことなどが支援材料となり、同指数は上昇しました。8月上旬から10月下旬にかけては、格付け会社が米国国債の格付けを引き下げたことや、F O M Cの結果を受けて米国の金融引き締め長期化する見方が改めて広がり米国の長期金利が上昇したこと、米国連邦議会で政府の予算案を巡る協議が難航し政府機関の一部が閉鎖される懸念が高まったこと、中東情勢の緊迫化を背景に世界経済の先行き懸念が高まったこと、一部I T企業の企業決算が市場予想を下回ったことを背景に株式市場が下落したことなどが重しとなり、同指数は下落しました。11月上旬から期間末にかけては、米国の雇用統計で非農業部門の雇用者数およびインフレ指標が市場予想を下回り、F R Bの利上げ局面が終了したとの見方が広がったことや、F R B高官が利下げについて言及したことなどをを受けて米国の長期金利が低下したことが支援材料となり、同指数は上昇しました。

金市場では、金価格は期間の初めと比べて上昇しました。2023年10月上旬にかけては、米国の堅調な経済指標の発表などからF R Bによる追加利上げが見込まれたことや、F R B高官やE C B当局者によるタカ派的とみなされた発言などを背景に米国の長期金利が上昇したことや、これを受けたアメリカドルが主要通貨に対して上昇したことが重しとなり、金価格は下落しました。10月中旬から期間末にかけては、地政学的リスクの高まりを受けて相対的に安全資産とされる金を買う動きが優勢となったことや、インフレの鈍化を背景に米国の政策金利がピーク水準に近いと思われたことから、金への投資の相対的魅力の高まりが支援要因となり、金価格は上昇しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



当ファンドのポートフォリオ

(2023年6月22日～2023年12月21日)

（当ファンド）

当ファンドは、「グローバル5.5倍バランス・マザーファンド」 受益証券を高位に組み入れて運用を行ないました。

（グローバル5.5倍バランス・マザーファンド）

主として、日本を含む世界の株式、不動産投信、債券および金に実質的に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないました。世界の株式への投資にあたっては、主として株価指数先物取引に係る権利に投資しました。世界の不動産投信への投資にあたっては、主として不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動をめざす上場投資信託証券に投資しました。世界の債券への投資にあたっては、主として国債先物取引に係る権利および国債に投資しました。金への投資にあたっては、主として金先物取引に係る権利に投資しました。各投資対象資産の組入比率は、原則として、市況環境および投資対象資産のリスク水準などを勘案して決定しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年6月22日～2023年12月21日)

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

（2023年6月22日～2023年12月21日）

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第25期	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期
	2023年6月22日～ 2023年7月21日	2023年7月22日～ 2023年8月21日	2023年8月22日～ 2023年9月21日	2023年9月22日～ 2023年10月23日	2023年10月24日～ 2023年11月21日	2023年11月22日～ 2023年12月21日
当期分配金	－	－	－	－	－	－
（対基準価額比率）	－%	－%	－%	－%	－%	－%
当期の収益	－	－	－	－	－	－
当期の収益以外	－	－	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	396	396	400	405	410	413

（注）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）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、ファンドの基本方針に則り、「グローバル5.5倍バランス・マザーファンド」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行ないます。

（グローバル5.5倍バランス・マザーファンド）

引き続き、主として、日本を含む世界の株式、不動産投信、債券および金に実質的に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。世界の株式への投資にあたっては、主として株価指数先物取引に係る権利に投資します。世界の不動産投信への投資にあたっては、主として不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動をめざす上場投資信託証券に投資します。世界の債券への投資にあたっては、主として国債先物取引に係る権利および国債に投資します。金への投資にあたっては、主として金先物取引に係る権利に投資します。各投資対象資産の組入比率は、原則として、市況環境および投資対象資産のリスク水準などを勘案して決定します。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

お知らせ

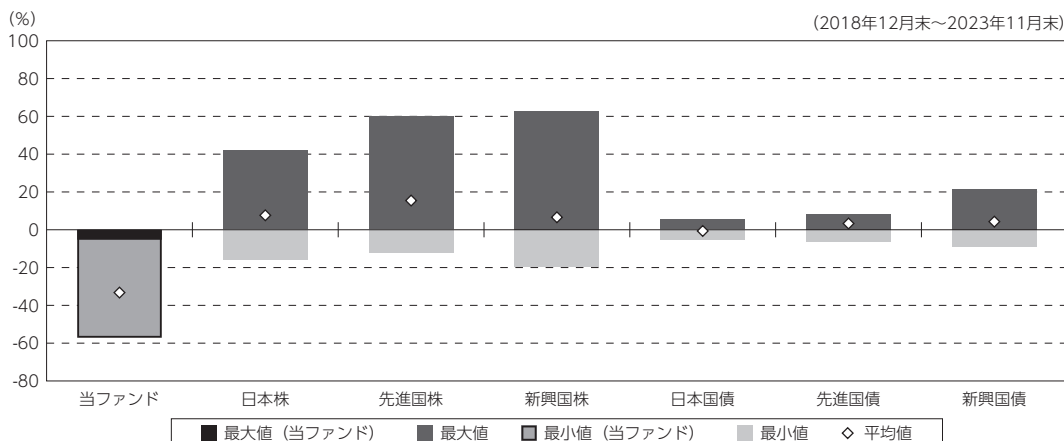
2023年6月22日から2023年12月21日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2021年6月23日から2029年12月21日までです。	
運用方針	主として、「グローバル5.5倍バランス・マザーファンド」受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と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	グローバル5.5倍バランス ファンド(予想分配金提示型)	「グローバル5.5倍バランス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	グローバル5.5倍バランス・ マザーファンド	日本を含む世界の株価指数先物取引に係る権利、不動産投資信託証券、国債先物取引に係る権利および国債ならびに金先物取引に係る権利などを主要投資対象とします。
運用方法	主として、日本を含む世界の株式、不動産投信、債券および金に実質的に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。世界の株式への投資にあたっては、主として株価指数先物取引に係る権利に投資します。また、世界各国の株式市場の動きをとらえる指数に連動をめざす上場投資信託証券に投資を行なう場合や上場株式に直接投資する場合があります。世界の不動産投信への投資にあたっては、主として不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動をめざす上場投資信託証券に投資します。また、上場不動産投信に直接投資する場合や不動産投信指数先物取引を用いる場合があります。世界の債券への投資にあたっては、主として国債先物取引に係る権利および国債に投資します。金への投資にあたっては、主として金先物取引に係る権利に投資します。また、金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行なう場合があります。なお、外貨建資産部分に対して、為替変動リスクの低減を図るため、対円での為替ヘッジを行なう場合があります。	
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。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もあります。	

（参考情報）

○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(単位:%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	△ 5.3	42.1	59.8	62.7	5.4	8.0	21.5
最小値	△ 57.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 8.8
平均値	△ 33.2	7.6	15.4	6.6	△ 0.6	3.3	4.3

(注) 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 2018年12月から2023年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドは2022年6月以降の年間騰落率を用いております。

(注) 上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

《各資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数（TOPIX、配当込）

先進国株：MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI 国債

先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JP モルガン GBI-EM グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

指数について

●東証株価指数（TOPIX、配当込）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社に帰属します。●MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。●MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。●NOMURA-BPI 国債は、野村フィデュシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデュシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。●FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JP モルガン GBI-EM グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

(2023年12月21日現在)

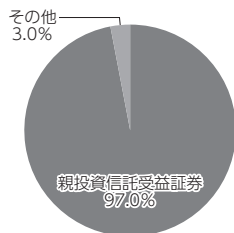
○組入上位ファンド

銘柄名	第30期末
グローバル5.5倍バランス・マザーファンド	97.0%
組入銘柄数	1銘柄

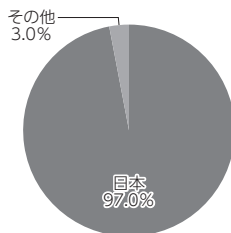
(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

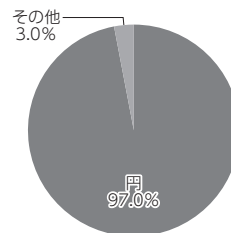
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

純資産等

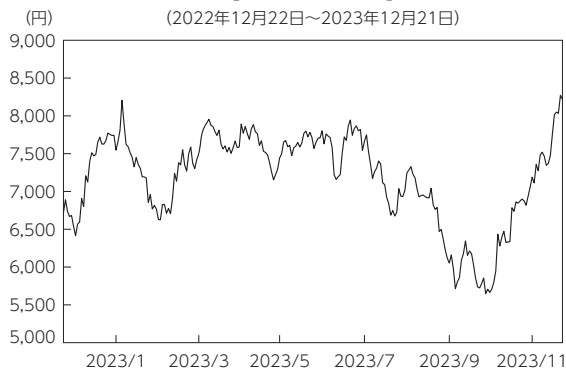
項目	第25期末	第26期末	第27期末	第28期末	第29期末	第30期末
	2023年7月21日	2023年8月21日	2023年9月21日	2023年10月23日	2023年11月21日	2023年12月21日
純資産総額	1,729,629,268円	1,522,835,132円	1,529,213,133円	1,303,819,775円	1,555,213,201円	1,836,070,885円
受益権総口数	3,260,892,431口	3,285,243,237口	3,283,069,917口	3,306,991,366口	3,303,859,027口	3,279,650,727口
1万口当たり基準価額	5,304円	4,635円	4,658円	3,943円	4,707円	5,598円

(注) 当作成期間（第25期～第30期）中における追加設定元本額は311,932,368円、同解約元本額は277,459,868円です。

組入上位ファンドの概要

グローバル5.5倍バランス・マザーファンド

【基準価額の推移】



【1万円当たりの費用明細】

(2022年12月22日～2023年12月21日)

項目	当期	
	金額	比率
	円	%
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券) (先物・オプション)	11 (2) (8)	0.150 (0.032) (0.118)
(b) 有価証券取引税 (投資信託証券)	0 (0)	0.000 (0.000)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	8 (1) (7)	0.109 (0.008) (0.102)
合計	19	0.259

期中の平均基準価額は、7,083円です。

(注) 上記項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万円当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

【現物資産上位10銘柄】

(2023年12月21日現在)

	銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
1	VANGUARD REAL ESTATE-ETF	投資信託受益証券	アメリカドル	アメリカ	15.8%
2	第372回利付国債(10年)	国債証券	円	日本	6.3
3	第362回利付国債(10年)	国債証券	円	日本	4.0
4	第363回利付国債(10年)	国債証券	円	日本	4.0
5	第370回利付国債(10年)	国債証券	円	日本	3.4
6	第364回利付国債(10年)	国債証券	円	日本	3.3
7	VANGUARD AU PROP SEC IDX-ETF	投資信託受益証券	オーストラリアドル	オーストラリア	3.2
8	第361回利付国債(10年)	国債証券	円	日本	2.7
9	ISHARES UK PROPERTY-ETF	投資信託受益証券	イギリスポンド	アイルランド	2.6
10	上場インデックスファンド(東証1部)隔年分配	投資信託受益証券	円	日本	2.1
組入銘柄数			13銘柄		

(注) 比率は、純資産総額に対する割合です。

(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

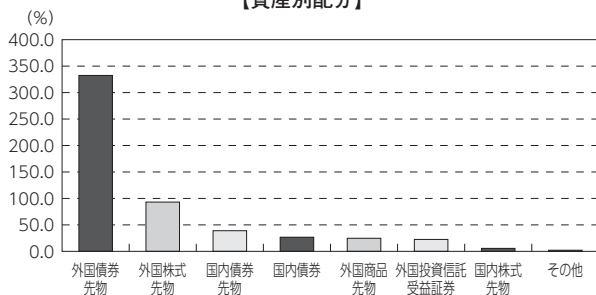
(注) 国(地域)につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

【派生商品上位10銘柄】

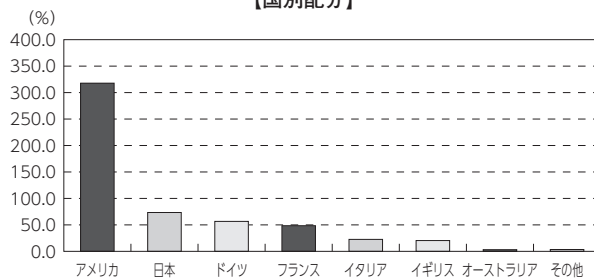
(2023年12月21日現在)

	銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
1	TNOTE2Y	債券先物(買建)	アメリカドル	アメリカ	88.6%
2	TNOTE10Y	債券先物(買建)	アメリカドル	アメリカ	86.1
3	SP EMINI	株式先物(買建)	アメリカドル	アメリカ	69.7
4	OAT10Y	債券先物(買建)	ユーロ	フランス	48.5
5	長期国債先物	債券先物(買建)	円	日本	39.0
6	BUND10Y	債券先物(買建)	ユーロ	ドイツ	35.3
7	TBOND30Y	債券先物(買建)	アメリカドル	アメリカ	24.9
8	GOLD100	商品先物(買建)	アメリカドル	アメリカ	24.7
9	FBTP10Y	債券先物(買建)	ユーロ	イタリア	22.6
10	GILT10Y	債券先物(買建)	イギリスポンド	イギリス	16.8
組入銘柄数			15銘柄		

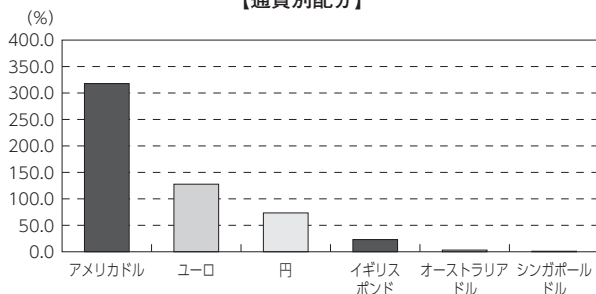
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書（全体版）をご参照ください。