

# iFreeレバレッジ NASDAQ次世代50

★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：2021年2月9日）	
運用方針	日々の基準価額の値動きがNASDAQ Q-50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	イ. 米国の株式市場の値動きを享受する債券（円建） ロ. E T F（上場投資信託証券） ハ. E T N（上場投資証券） ニ. 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、D R（預託証券）を含みます。） ホ. 米国の債券 ヘ. わが国の債券 ト. ダイワ・マネーデポジット・マザーファンドの受益証券 チ. 米国の株価指数先物取引
	ダイワ・マネーデポジット・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3期

（決算日 2024年1月12日）

（作成対象期間 2023年1月13日～2024年1月12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NASDAQ Q-50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/>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NASDAQ Q-50指数 (税引後配当込み、米ドルベース)		株式 組入比率	株式先物 比率	公社債 組入比率	投資証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
1 期末 (2022年 1月12日)	7,677	0	△ 23.2	9,229	△ 7.7	—	—	100.4	—	735
2 期末 (2023年 1月12日)	3,904	0	△ 49.1	7,338	△ 20.5	—	—	100.0	—	638
3 期末 (2024年 1月12日)	3,685	0	△ 5.6	7,749	5.6	—	—	99.8	—	605

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NASDAQ Q-50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) 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) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

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

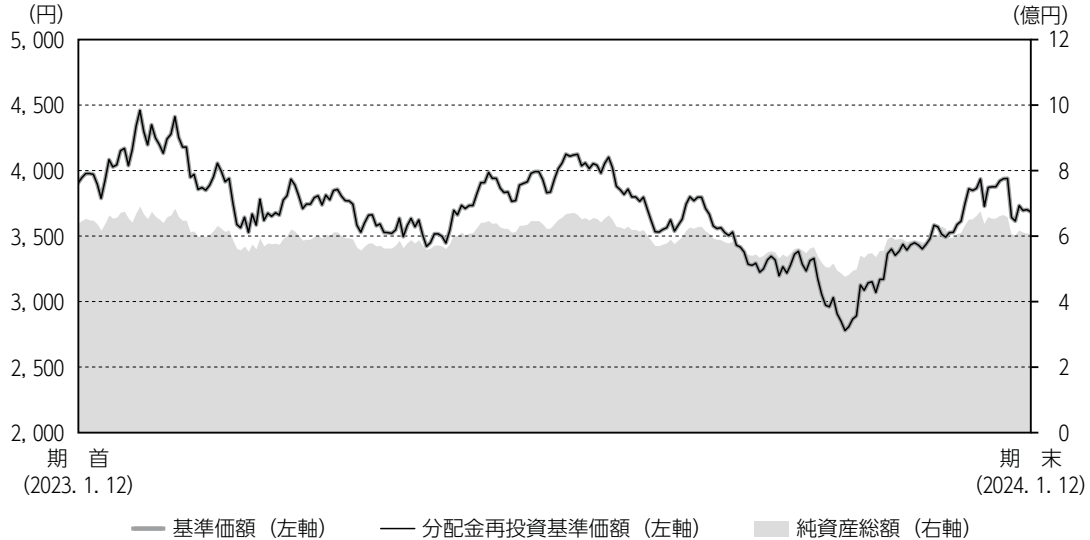
※参考指数を「NASDAQ Q-50指数 (米ドルベース)」から「NASDAQ Q-50指数 (税引後配当込み、米ドルベース)」に変更しました。

当ファンドは、Nasdaq, Inc. またはその関連会社 (以下、Nasdaq, Inc. およびその関連会社を「株式会社」と総称します。) によって、支援、推奨、販売または販売促進されるものではありません。株式会社は、ファンドの合法性もしくは適合性について、または当ファンドに関する記述および開示の正確性もしくは妥当性について認定するものではありません。株式会社は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性や、NASDAQ Q-50 Index の一般的な株式市況への追従可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行いません。株式会社と大和アセットマネジメント株式会社 (「ライセンサー」) との関係は、Nasdaq® および NASDAQ Q-50 Index の登録商標ならびに株式会社の一一定の商号について使用を許諾すること、ならびに、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドとは無関係に、ナスダックが決定、構築および算出を行なう NASDAQ Q-50 Index の使用を許諾することに限られます。ナスダックは、NASDAQ Q-50 Index の決定、構築および計算に関し、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。株式会社は、当ファンドの発行に関してその時期、価格もしくはその数量の決定について、または当ファンドを換金する際の算式の決定もしくは計算についての責任を負っておらず、また関与をしていません。株式会社は、NASDAQ Q-50 Index とそれに含まれるデータの正確性および中断されない算出を保証しません。株式会社は、NASDAQ Q-50 Index またはそれに含まれるデータの利用により、大和アセットマネジメント株式会社、当ファンドの保有者またはその他いかなる者もしくは組織に生じた結果についても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行いません。株式会社は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行わず、かつ NASDAQ Q-50 Index® またはそれに含まれるデータの利用に関する、特定の目的または利用のための市場商品性または適合性については、いかなる保証についても明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、株式会社は、いかなる逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的損害や損失について、たとえもし当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- \* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### 基準価額・騰落率

期首：3,904円

期末：3,685円（分配金 0円）

騰落率：△5.6%（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NASDAQ Q-50指数（税引後配当込み、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った結果、米国株式市況が上昇した一方で、対象指数が上昇、下落を繰り返したことや、コスト負担に伴い、基準価額は下落しました。

iFreeレバレッジ NASDAQ次世代50

年 月 日	基 準 価 額		NASDAQ Q-50指数 (税引後配当込み、米ドルベース)		株 式 組入比率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資証券 組入比率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率				
(期 首) 2023年 1月12日	3,904	—	7,338	—	—	—	100.0	—
1月末	4,040	3.5	7,495	2.1	—	—	95.1	—
2月末	3,871	△ 0.8	7,391	0.7	—	—	99.7	—
3月末	3,810	△ 2.4	7,366	0.4	—	—	100.0	—
4月末	3,602	△ 7.7	7,201	△ 1.9	—	—	100.0	—
5月末	3,499	△ 10.4	7,140	△ 2.7	—	—	99.9	—
6月末	3,915	0.3	7,600	3.6	—	—	99.9	—
7月末	4,056	3.9	7,790	6.2	—	—	100.0	—
8月末	3,801	△ 2.6	7,593	3.5	—	—	99.9	—
9月末	3,320	△ 15.0	7,150	△ 2.6	—	—	99.6	—
10月末	2,808	△ 28.1	6,635	△ 9.6	—	—	100.2	—
11月末	3,440	△ 11.9	7,397	0.8	—	—	99.7	—
12月末	3,941	0.9	7,986	8.8	—	—	99.5	—
(期 末) 2024年 1月12日	3,685	△ 5.6	7,749	5.6	—	—	99.8	—

(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. 1. 13 ~ 2024. 1. 12)

### ■ 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、賃金上昇率の鈍化でF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが減速するとの期待などから上昇しました。2023年2月から3月半ばにかけては、予想を上回る経済指標の発表が相次ぎ金利が上昇したことや、米国の地方銀行の経営破綻を受けて下落しましたが、その後は、F R Bによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことなどが好感され、成長株を中心に上昇に転じました。4月以降は、地方銀行の経営不安や米国の債務上限問題への懸念が上値を抑えた一方、予想を上回る企業決算の発表が好感され、底堅い展開となりました。5月下旬からは、AI（人工知能）関連の半導体企業の強気見通しや債務上限問題の解決、インフレ率の鈍化などが好感され、大幅に上昇しました。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、株価は下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立により政府機関の閉鎖が回避され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やF R B議長の見通しを受けて利下げ観測が高まったことなどが好感されて急上昇し、当作成期末を迎えました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■ 当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として連動債券に投資し、日々の基準価額の値動きがNASDAQ Q-50指数（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てまいります。

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・マネーデポジット・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. 1. 13 ~ 2024. 1. 12)

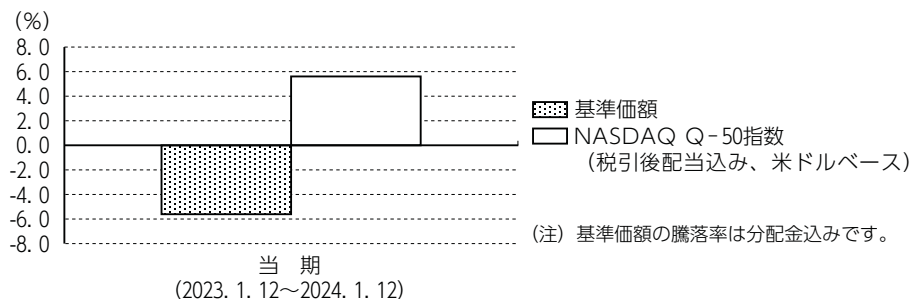
### 当ファンド

連動債券（米国の株式市場の値動きを享受する債券（円建））に投資を行い、日々の基準価額の値動きがNASDAQ Q-50指数（税引後配当込み、米ドルベース）の値動きの2倍程度となるよう調整しました。

## 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。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当期	
	2023年1月13日 ～2024年1月12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）	0

- (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（分配込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として連動債券に投資し、日々の基準価額の値動きがNASDAQ Q-50指数（税引後配当込み、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てまいります。

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・マネーデポジット・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. 1. 13~2024. 1. 12)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	36円	0. 979%	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3, 692円です。
(投 信 会 社)	(18)	(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)	(18)	(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)	(1)	(0. 022)	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. 097	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)	(3)	(0. 088)	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)	(0)	(0. 008)	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. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	40	1. 075	

(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。

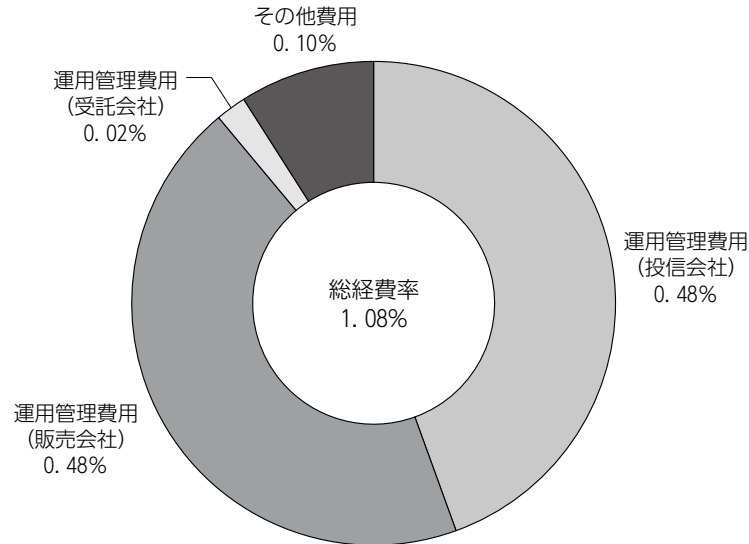
(注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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1.08%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す。

純資産総額に対して年率0.19%（税込）程度、その他各種費用等

## ■売買および取引の状況

## 公 社 債

(2023年1月13日から2024年1月12日まで)

		買付額	売付額
国内	社債券	千円 198,866	千円 209,477 ( —)

(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

(2023年1月13日から2024年1月12日まで)

当 期		期 末	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
Harp Issuer PLC 2027/2/16 (ユーロ円債)	千円 198,866	Harp Issuer PLC 2027/2/16 (ユーロ円債)	千円 209,477

(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、新株予約権付社債券(転換社債券)を除く)

作成期 区 分	当 期				期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入 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 1,597,000	千円 604,624	% 99.8	% —	% —	% 99.8	% —

(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、新株予約権付社債券(転換社債券)を除く)

区 分	当 期			期 末	
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	Harp Issuer PLC	% —	千円 1,597,000	千円 604,624	2027/02/16

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024年1月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	604,624	98.1
コール・ローン等、その他	11,499	1.9
投資信託財産総額	616,123	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

2024年1月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	616,123,811円
コール・ローン等	11,499,611
公社債 (評価額)	604,624,200
(B) 負債	10,176,567
未払金	760,800
未払解約金	6,470,428
未払信託報酬	2,920,816
その他未払費用	24,523
(C) 純資産総額 (A - B)	605,947,244
元本	1,644,214,177
次期繰越損益金	△ 1,038,266,933
(D) 受益権総口数	1,644,214,177口
1万口当り基準価額 (C / D)	3,685円

\* 期首における元本額は1,634,731,001円、当作成期間中における追加設定元本額は1,086,754,012円、同解約元本額は1,077,270,836円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は3,685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1,038,266,933円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年1月13日 至2024年1月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	474,578円
その他収益金	479,949
支払利息	△ 5,371
(B) 有価証券売買損益	△ 9,155,013
売買益	29,551,961
売買損	△ 38,706,974
(C) 信託報酬等	△ 6,463,924
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 15,144,359
(E) 前期繰越損益金	△ 179,819,631
(F) 追加信託差損益金	△ 843,302,943
(配当等相当額)	( 85,915)
(売買損益相当額)	(△ 843,388,858)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,038,266,933
次期繰越損益金 (G)	△ 1,038,266,933
追加信託差損益金	△ 843,302,943
(配当等相当額)	( 85,915)
(売買損益相当額)	(△ 843,388,858)
繰越損益金	△ 194,963,990

(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	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	85,915
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	85,915
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	85,915
(h) 受益権総口数	1,644,214,177口

## 《お知らせ》

## ■参考指数の変更について

参考指数としている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：NASDAQ Q-50指数 (米ドルベース)

変更後：NASDAQ Q-50指数 (配当込み、米ドルベース)

# ダイワ・マネーデポジット・マザーファンド

## 運用報告書 第3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・マネーデポジット・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。

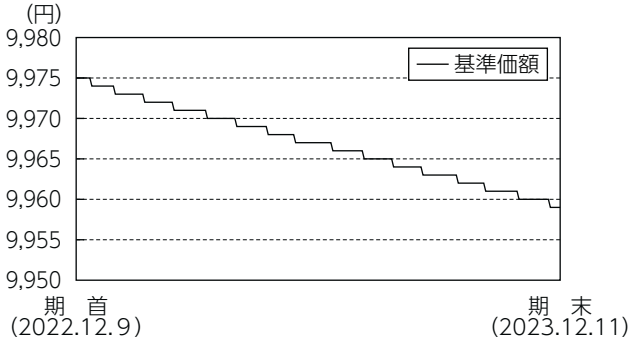
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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
	円	騰落率 %	
(期首)2022年12月9日	9,975	-	%
12月末	9,974	△0.0	-
2023年1月末	9,973	△0.0	-
2月末	9,971	△0.0	-
3月末	9,970	△0.1	-
4月末	9,969	△0.1	-
5月末	9,967	△0.1	-
6月末	9,966	△0.1	-
7月末	9,965	△0.1	-
8月末	9,963	△0.1	-
9月末	9,962	△0.1	-
10月末	9,961	△0.1	-
11月末	9,960	△0.2	-
(期末)2023年12月11日	9,959	△0.2	-

(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：9,975円 期末：9,959円 騰落率：△0.2%

【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

○国内短期金融市況

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	-
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

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
コール・ローン等、その他	千円 1,076	% 100.0
投資信託財産総額	1,076	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ・マネーデポジット・マザーファンド

## ■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	1,076,262円
コール・ローン等	1,076,262
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	1,076,262
元本	1,080,673
次期繰越損益金	△ 4,411
(D) 受益権総口数	1,080,673口
1万口当り基準価額(C/D)	9,959円

\* 期首における元本額は1,090,486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9,813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：  
 マネーデポジット資金拠出用ファンド (適格機関投資家専用) 979,571円  
 ダイワ/パリュール・パートナーズ チャイナ・カーボン・ニュートラル・フォーカス 101,102円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,959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4,411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	△1,728円
受取利息	9
支払利息	△1,737
(B) 当期損益金(A)	△1,728
(C) 前期繰越損益金	△2,718
(D) 解約差損益金	35
(E) 合計(B + C + D)	△4,411
次期繰越損益金(E)	△4,411

(注) 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。