

FANG+ブルベアファンド

FANG+2倍ブル
FANG+2倍ベア
FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ

第1期(決算日 2021年8月18日)

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/>

◇SKU0342220210818◇

<3423>
<3424>
<3422>

FANG+2倍ブル

<3423>

追加型投信/海外/株式/特殊型(ブル・ベア型)
日経新聞掲載名: F G + 2 ブル

第1期 2021年8月18日決算

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(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。

第1期末	基準価額	16,610円
	純資産総額	506百万円
第1期	騰落率	66.1%
	分配金	0円

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/>

運用報告書に関するお問い合わせ先

 コールセンター 受付時間 9:00~17:00(営業日のみ)
0120-106212

お客様の口座内容に関するご照会は、
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。

■当ファンドは、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ことを定めており、以下の手順で閲覧、ダウンロードいただけます。「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、販売会社へお問い合わせください。

**UD
FONT**

見やすく読みまちがえにくい
ユニバーサルデザインフォント
を採用しています。

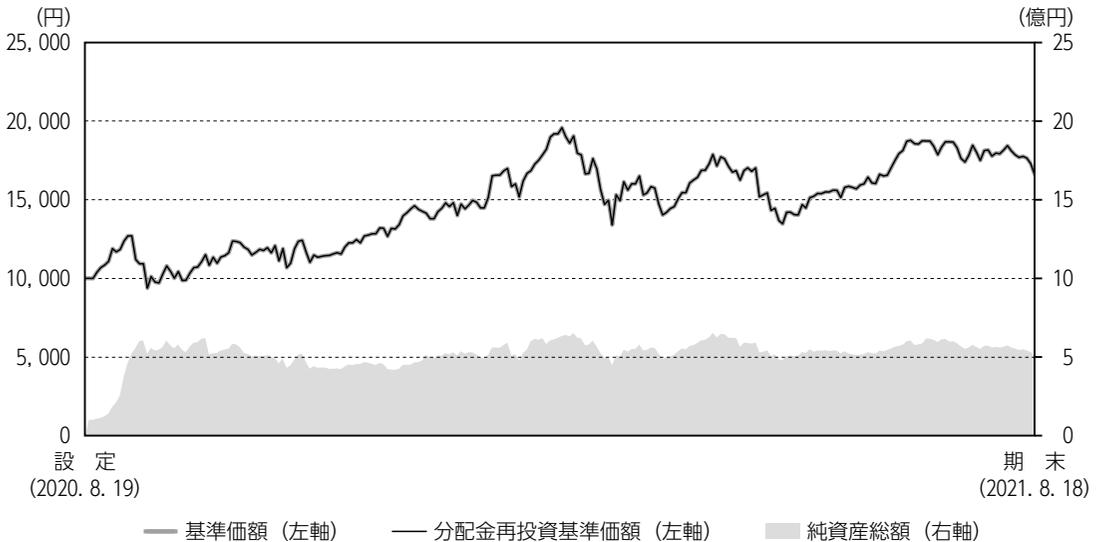
「運用報告書(全体版)」の閲覧・ダウンロード方法

上記のURLにアクセス → ファンド検索欄にファンド名を入力 → リストから当ファンドを選択 → 運用報告書(全体版)を選択



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

期末：16,610円（分配金0円）

騰落率：66.1%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+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。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 8. 19~2021. 8. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	172円	1.166%	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14,748円です。
(投 信 会 社)	(71)	(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)	(97)	(0.660)	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)	(4)	(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	9	0.063	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)	(8)	(0.051)	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)	(0.008)	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)	(0.003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	181	1.228	

(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。

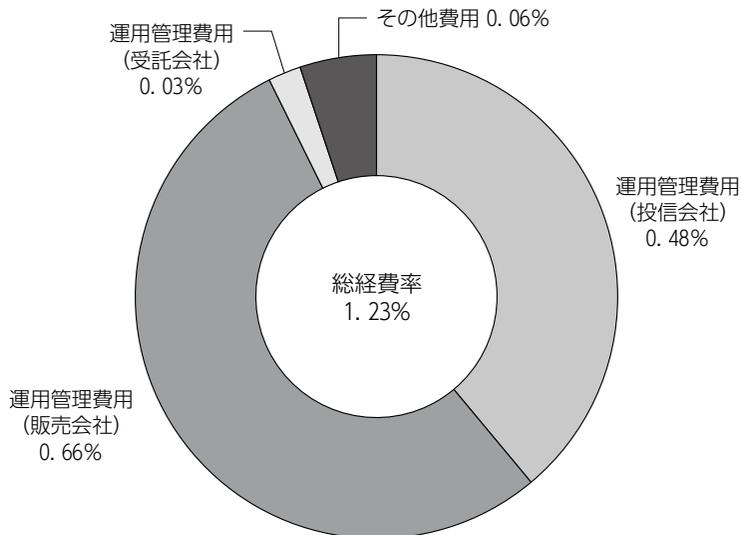
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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まず、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1.23%です。

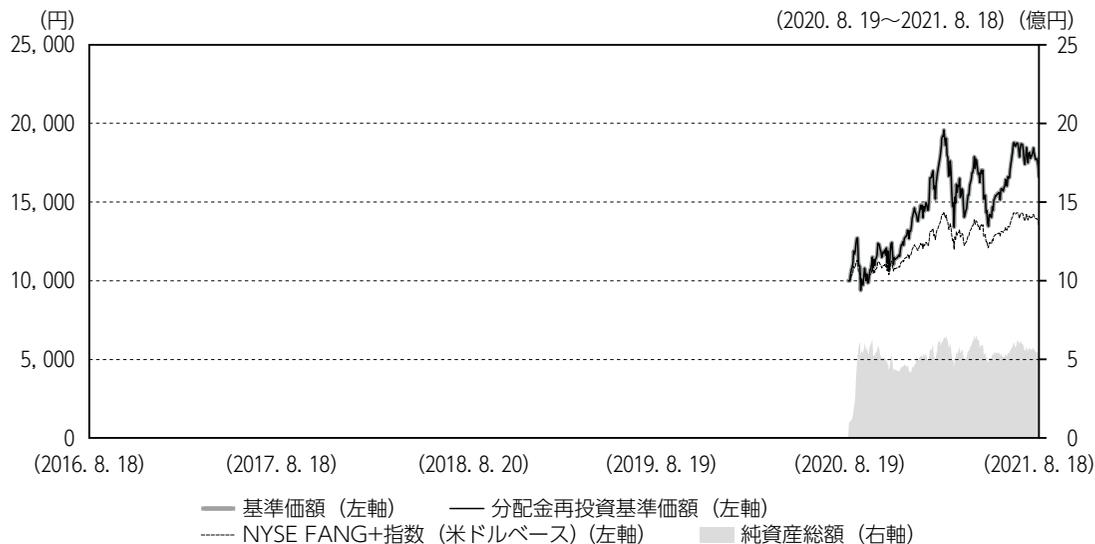


(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

最近5年間の基準価額等の推移について



(注) 参考指数は、2020年8月19日を10,000として指数化したものです。

*参考指数はNYSE FANG+指数 (米ドルベース) です。

		2020年8月19日 設定	2021年8月18日 決算日
基準価額	(円)	10,000	16,610
分配金 (税込み)	(円)	—	0
分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	66.1
NYSE FANG+指数 (米ドルベース) 騰落率	(%)	—	35.1
純資産総額	(百万円)	100	506

(注1) 比率は小数点第1位未満を四捨五入してあります。

(注2) 参考指数は投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しております。

(注3) NYSE FANG+指数 (米ドルベース) 騰落率は、NYSE FANG+指数 (米ドルベース) の原データをもとに、大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注4) 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5) 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。

投資環境について

(2020.8.19～2021.8.18)

■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、米国の追加景気対策への期待などを背景に上昇しました。2020年9月以降は、米国の景気回復に対して懐疑的な見方が広がったことなどを受け、上値の重い展開となりました。11月以降は、米国大統領選挙の結果に対する不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチンへの開発期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国における金利上昇への懸念などから調整する局面もありましたが、米国において新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇して当作成期末を迎えました。

ポートフォリオについて

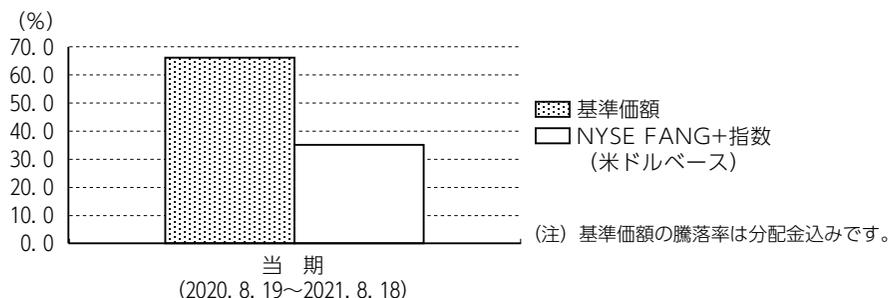
(2020.8.19～2021.8.18)

■当ファンド

スター・ヘリオス・ピーエルシーが発行する債券（円建）（以下「パフォーマンス連動債券」といいます。）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 (1万口当たり)

項 目	当 期	
	2020年 8月19日 ～2021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)		6,610

(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。



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（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・ローン等による運用を行う方針です。



当ファンドの概要

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	3年間（2020年8月19日～2023年8月18日）	
運用方針	日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+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）（以下「パフォーマンス連動債券」といいます。）、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（以下「マザーファンド」といいます。）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
ベビーファンドの運用方法	<p>①日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+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て運用を行ないます。</p> <p>※米国の営業日においてNYSE FANG+指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度となるための調整を行なうこととします。そのため、日本の休業日前後の基準価額の値動きが、NYSE FANG+指数（米ドルベース）の値動きの2倍から乖離する場合があります。</p> <p>②以下の投資対象から流動性等を考慮してその配分比率を決定します。</p> <p>イ. パフォーマンス連動債券 ロ. マザーファンドの受益証券 ハ. 米国の株価指数先物取引</p> <p>※上記投資対象以外に、上記投資対象と同様の投資成果が期待できる資産を組み入れることがあります。</p> <p>③外貨建資産の運用にあたっては、ダイワ・アセット・マネジメント（アメリカ）リミテッドに運用の指図にかかる権限の一部を委託することがあります。</p> <p>④為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。</p>	
マザーファンドの運用方法	<p>①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。</p> <p>②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。</p>	
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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

NYSE® FANG+™ は、ICE Data Indices, LLC またはその関連会社（以下「ICE データ」）の登録商標であり、NYSE® FANG+™ 指数および NYSE® FANG+™ 指数（円ベース）（以下「指数」）を利用するライセンスが FANG+ブルベアファンド（以下「ファンド」）において、大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。大和アセットマネジメント株式会社およびファンドは、ICE データによってスポンサー、販売、または販売促進されているものではなく、ICE データは、証券投資全般、特にファンドへの投資の妥当性について、または指数が一般的な株式市場のパフォーマンスを追従することについて、いかなる表明保証を行うものではありません。

ICE データおよびその第三者供給元は、明示または黙示の保証を行わず、インデックス、インデックスの値またはそれに含まれるすべてのデータに関して、商品性または特定の目的への適合性のすべての保証を明示的に否認します。ICE データは、たとえそのような損害の可能性について、特別、懲罰的損害、直接的、間接的、または結果的損害（利益の損失を含む）に対する責任は通知されていたとしても一切負いません。

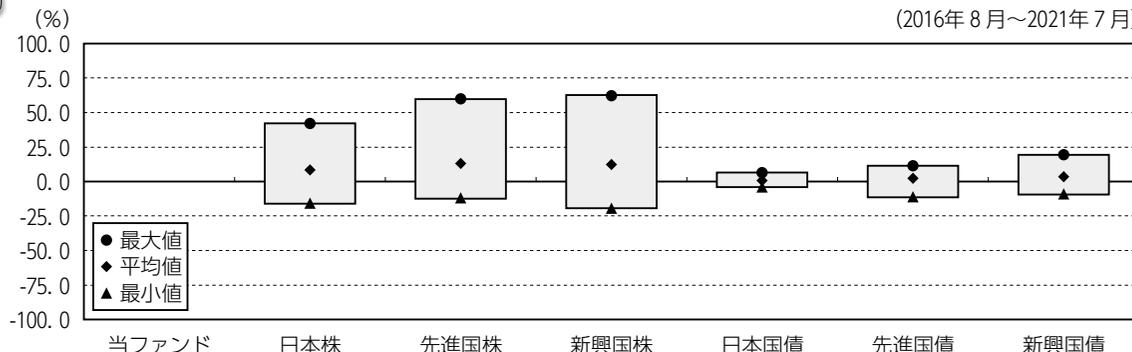
"NYSE® FANG+™" is a service/trade mark of ICE Data Indices, LLC or its affiliates ("ICE Data") and has been licensed along with the NYSE® FANG+™ Index and NYSE® FANG+™ Index (JPY) ("Indexes") for use by DAIWA ASSET MANAGEMENT in connection with FANG+ BULL BEAR FUND (the "Fund"). Neither DAIWA ASSET MANAGEMENT nor the Fund, as applicable, are sponsored, endorsed, sold or promoted by ICE Data. ICE Data makes no representations or warranties regarding the advisability of investing in securities generally, in the Fund particularly or the ability of the Indexes to track general stock market performance.

ICE DATA AND ITS RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS MAKE NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND HEREBY EXPRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE WITH RESPECT TO THE INDEXES, INDEX VALUES OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. IN NO EVENT SHALL ICE DATA HAVE ANY LIABILITY FOR ANY SPECIAL, PUNITIVE, DIRECT, INDIRECT, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES (INCLUDING LOST PROFITS), EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.



代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2016年8月～2021年7月)



	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	—	42.1	59.8	62.7	6.5	11.4	19.3
平均値	—	8.3	13.0	12.3	0.5	2.3	3.5
最小値	—	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 11.4	△ 9.4

上記の図表は、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。

②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※上記の騰落率は直近月末から60カ月さかのぼった算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

※資産クラスについて

日本株……………東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

先進国株……………MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、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（配当込み、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……………JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCI コクサイ・インデックスおよびMSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE 世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLC が有しています。●JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morgan からの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved. (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。



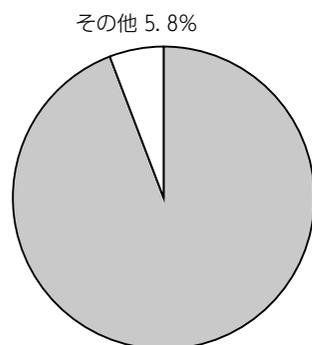
ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入上位銘柄

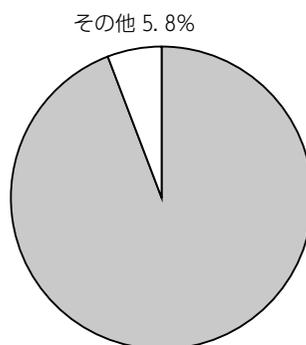
銘柄名	通貨	比率
Star Helios Plc 0.0% 2023/8/18	日本・円	94.2%
組入銘柄数	1銘柄	

資産別配分



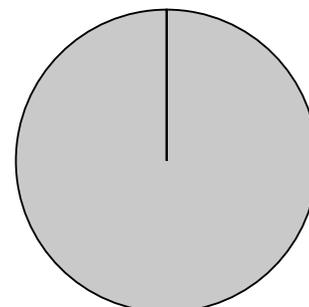
外国債券 94.2%

国別配分



アイルランド 94.2%

通貨別配分



日本・円 100.0%

(注1) 上記データは2021年8月18日現在のものです。

(注2) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 国別配分において、キャッシュ部分については「その他」に含めています。

純資産等

項目	当期末
	2021年8月18日
純資産総額	506,715,611円
受益権総口数	305,066,447口
1万口当り基準価額	16,610円

* 当期中における追加設定元本額は1,344,510,070円、同解約元本額は1,139,443,623円です。

* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。

FANG+2倍ベア

<3424>

追加型投信／海外／株式／特殊型（ブル・ベア型）
日経新聞掲載名：F G + 2 ベア

第1期 2021年8月18日決算

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（米ドルベース）の値動きの2倍程度逆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。

第1期末	基準価額	4,439円
	純資産総額	86百万円
第1期	騰落率	△55.6%
	分配金	0円

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/>

運用報告書に関するお問い合わせ先

 コールセンター 受付時間 9:00～17:00（営業日のみ）
0120-106212

お客様の口座内容に関するご照会は、
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。

■当ファンドは、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ことを定めており、以下の手順で閲覧、ダウンロードいただけます。「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、販売会社へお問い合わせください。

UD
FONT

見やすく読みまちがえにくい
ユニバーサルデザインフォント
を採用しています。

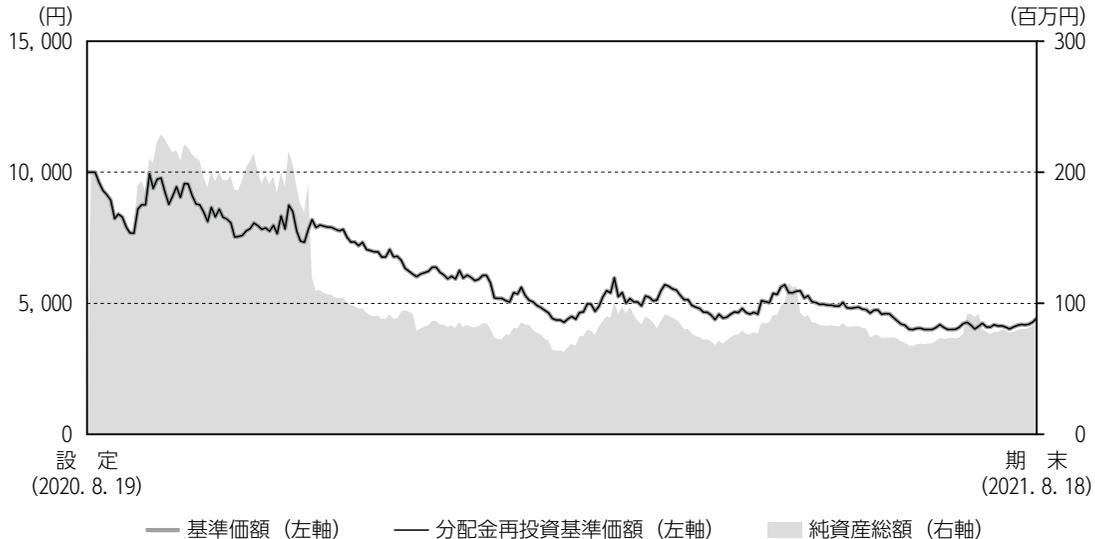
「運用報告書(全体版)」の閲覧・ダウンロード方法

上記のURLにアクセス → ファンド検索欄にファンド名を入力 → リストから当ファンドを選択 → 運用報告書(全体版)を選択



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

期 末：4,439円（分配金0円）

騰落率：△55.6%（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NYSE FANG+指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度逆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下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 8. 19~2021. 8. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	70円	1.166%	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6,006円です。
(投 信 会 社)	(29)	(0.479)	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)	(40)	(0.660)	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)	(2)	(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	12	0.193	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)	(10)	(0.172)	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)	(0.008)	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)	(1)	(0.013)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	82	1.359	

(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。

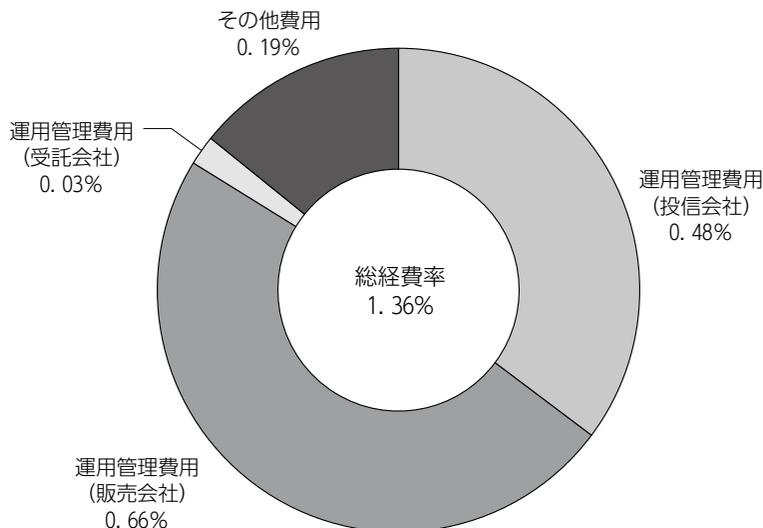
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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まず、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1.36%です。

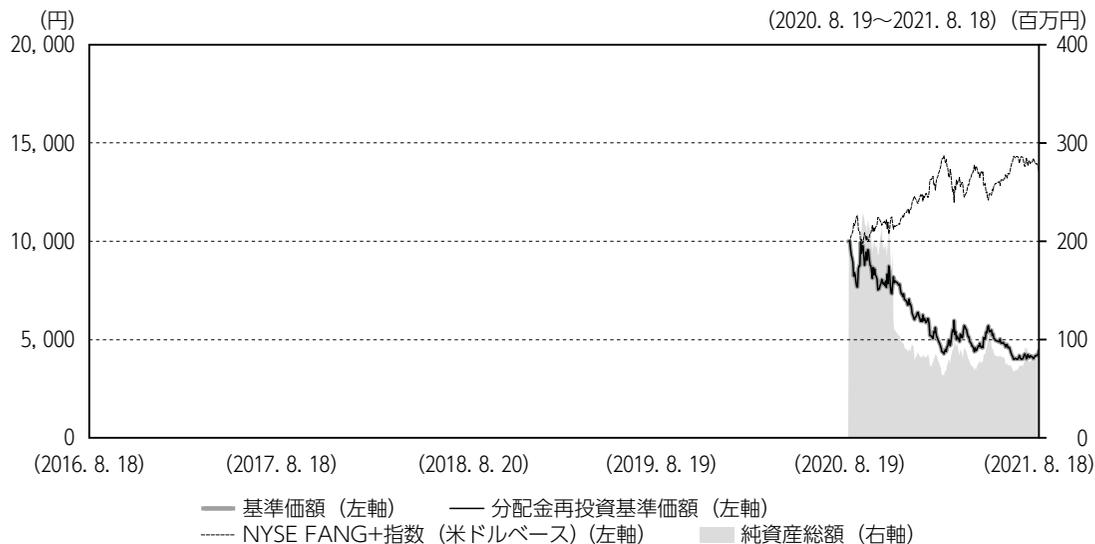


(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

最近5年間の基準価額等の推移について



(注) 参考指数は、2020年8月19日を10,000として指数化したものです。

*参考指数は NYSE FANG+指数 (米ドルベース) です。

		2020年8月19日 設定	2021年8月18日 決算日
基準価額	(円)	10,000	4,439
分配金 (税込み)	(円)	—	0
分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	△55.6
NYSE FANG+指数 (米ドルベース) 騰落率	(%)	—	35.1
純資産総額	(百万円)	200	86

(注1) 比率は小数点第1位未満を四捨五入してあります。

(注2) 参考指数は投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しております。

(注3) NYSE FANG+指数 (米ドルベース) 騰落率は、NYSE FANG+指数 (米ドルベース) の原データをもとに、大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注4) 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5) 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。

投資環境について

(2020.8.19～2021.8.18)

■ 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、米国の追加景気対策への期待などを背景に上昇しました。2020年9月以降は、米国の景気回復に対して懐疑的な見方が広がったことなどを受け、上値の重い展開となりました。11月以降は、米国大統領選挙の結果に対する不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチンへの開発期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国における金利上昇への懸念などから調整する局面もありましたが、米国において新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇して当作成期末を迎えました。

ポートフォリオについて

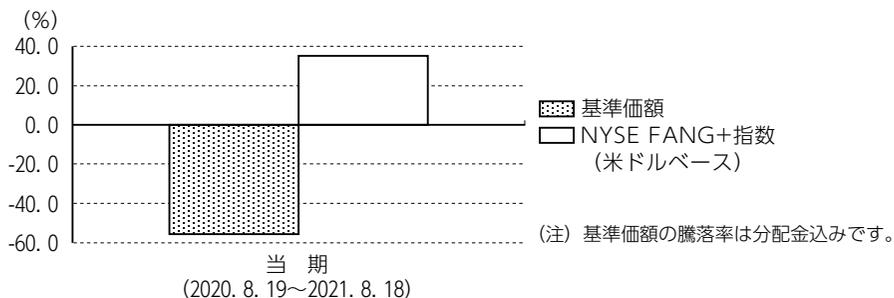
(2020.8.19～2021.8.18)

■ 当ファンド

スター・ヘリオス・ピーエルシーが発行する債券（円建）（以下「パフォーマンス連動債券」といいます。）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、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	
	2020年8月19日 ～2021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)		—

- (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。



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（米ドルベース）の値動きの2倍程度逆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・ローン等による運用を行う方針です。



当ファンドの概要

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	3年間（2020年8月19日～2023年8月18日）	
運用方針	日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度逆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）（以下「パフォーマンス連動債券」といいます。）、ETF（上場投資信託証券）、ETN（上場投資証券）、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（以下「マザーファンド」といいます。）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
ベビーファンドの運用方法	<p>①日々の基準価額の値動きがNYSE FANG+指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度逆となることをめざして運用を行ないます。 ※米国の営業日においてNYSE FANG+指数（米ドルベース）の値動きの2倍程度逆となるための調整を行なうこととします。そのため、日本の休業日前後の基準価額の値動きが、NYSE FANG+指数（米ドルベース）の値動きの2倍逆から乖離する場合があります。</p> <p>②以下の投資対象から流動性等を考慮してその配分比率を決定します。 イ. パフォーマンス連動債券 ロ. マザーファンドの受益証券 ハ. 米国の株価指数先物取引 ※上記投資対象以外に、上記投資対象と同様の投資成果が期待できる資産を組み入れることがあります。</p> <p>③外貨建資産の運用にあたっては、ダイワ・アセット・マネジメント（アメリカ）リミテッドに運用の指図にかかる権限の一部を委託することがあります。</p> <p>④為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。</p>	
マザーファンドの運用方法	<p>①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。</p> <p>②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。</p>	
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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

NYSE® FANG+™ は、ICE Data Indices, LLC またはその関連会社（以下「ICE データ」）の登録商標であり、NYSE® FANG+™ 指数および NYSE® FANG+™ 指数（円ベース）（以下「指数」）を利用するライセンスが FANG+ブルベアファンド（以下「ファンド」）において、大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。大和アセットマネジメント株式会社およびファンドは、ICE データによってスポンサー、販売、または販売促進されているものではなく、ICE データは、証券投資全般、特にファンドへの投資の妥当性について、または指数が一般的な株式市場のパフォーマンスを追従することについて、いかなる表明保証を行うものではありません。

ICE データおよびその第三者供給元は、明示または黙示の保証を行わず、インデックス、インデックスの値またはそれに含まれるすべてのデータに関して、商品性または特定の目的への適合性のすべての保証を明示的に否認します。ICE データは、たとえそのような損害の可能性について、特別、懲罰的損害、直接的、間接的、または結果的損害（利益の損失を含む）に対する責任は通知されていたとしても一切負いません。

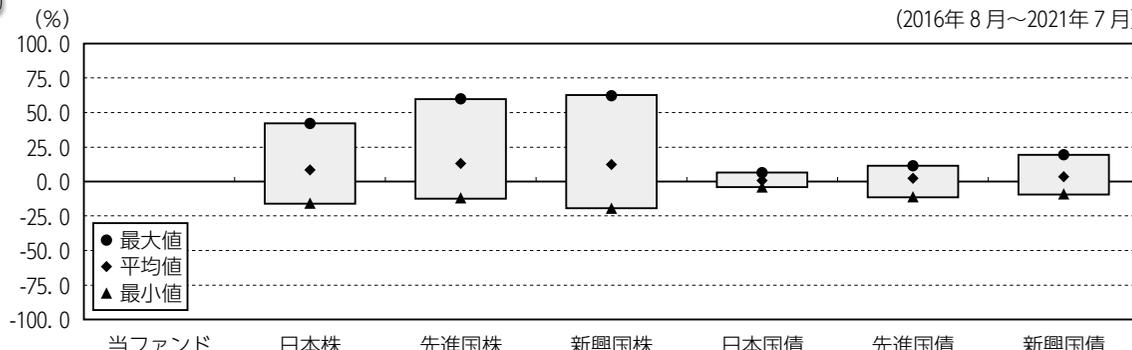
"NYSE® FANG+™" is a service/trade mark of ICE Data Indices, LLC or its affiliates ("ICE Data") and has been licensed along with the NYSE® FANG+™ Index and NYSE® FANG+™ Index (JPY) ("Indexes") for use by DAIWA ASSET MANAGEMENT in connection with FANG+ BULL BEAR FUND (the "Fund"). Neither DAIWA ASSET MANAGEMENT nor the Fund, as applicable, are sponsored, endorsed, sold or promoted by ICE Data. ICE Data makes no representations or warranties regarding the advisability of investing in securities generally, in the Fund particularly or the ability of the Indexes to track general stock market performance.

ICE DATA AND ITS RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS MAKE NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND HEREBY EXPRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE WITH RESPECT TO THE INDEXES, INDEX VALUES OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. IN NO EVENT SHALL ICE DATA HAVE ANY LIABILITY FOR ANY SPECIAL, PUNITIVE, DIRECT, INDIRECT, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES (INCLUDING LOST PROFITS), EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.



代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2016年8月～2021年7月)



	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	—	42.1	59.8	62.7	6.5	11.4	19.3
平均値	—	8.3	13.0	12.3	0.5	2.3	3.5
最小値	—	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 11.4	△ 9.4

上記の図表は、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。

②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※上記の騰落率は直近月末から60カ月さかのぼった算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

※資産クラスについて

日本株……………東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

先進国株……………MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、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（配当込み、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……………JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCI コクサイ・インデックスおよびMSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE 世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLC が有しています。●JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morgan からの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved. (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。



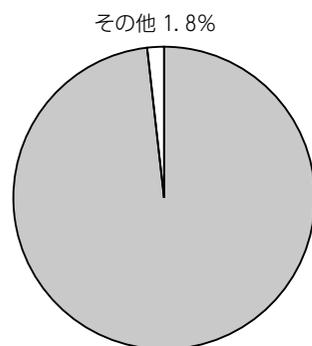
ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入上位銘柄

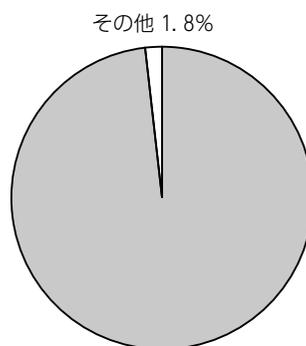
銘柄名	通貨	比率
Star Helios Plc 0.0% 2023/8/18	日本・円	98.2%
組入銘柄数	1銘柄	

資産別配分



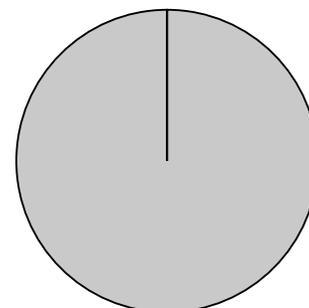
外国債券 98.2%

国別配分



アイルランド 98.2%

通貨別配分



日本・円 100.0%

(注1) 上記データは2021年8月18日現在のものです。

(注2) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 国別配分において、キャッシュ部分については「その他」に含めています。

純資産等

項目	当期末
	2021年8月18日
純資産総額	86,280,437円
受益権総口数	194,379,379口
1万口当り基準価額	4,439円

* 当期中における追加設定元本額は583,185,991円、同解約元本額は588,806,612円です。

* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。

FANG+ブルベア・マネーポートフォリオ

<3422>

追加型投信/国内/債券

第1期 2021年8月18日決算

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、円建ての債券に投資することにより、安定した収益の確保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。

第1期末	基準価額	9,992円
	純資産総額	0百万円
第1期	騰落率	△0.1%
	分配金	0円

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/>

運用報告書に関するお問い合わせ先



コールセンター 受付時間 9:00~17:00(営業日のみ)
0120-106212

お客様の口座内容に関するご照会は、
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。

■当ファンドは、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ことを定めており、以下の手順で閲覧、ダウンロードいただけます。「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、販売会社へお問い合わせください。



見やすく読みまちがえにくい
ユニバーサルデザインフォント
を採用しています。

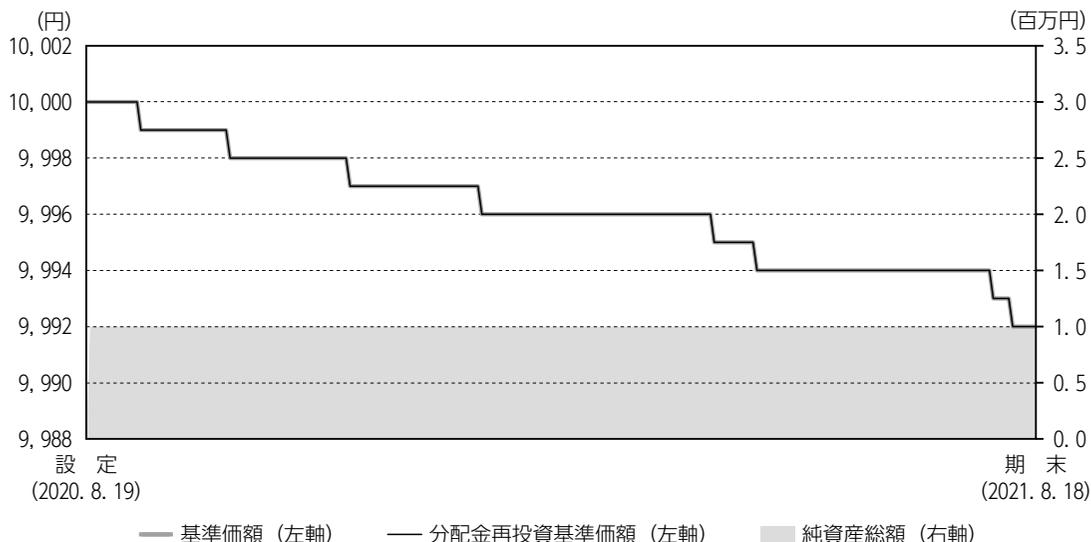
「運用報告書(全体版)」の閲覧・ダウンロード方法

上記のURLにアクセス → ファンド検索欄にファンド名を入力 → リストから当ファンドを選択 → 運用報告書(全体版)を選択



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

期末：9,992円（分配金0円）

騰落率：△0.1%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券を通じて投資したコール・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。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 8. 19~2021. 8. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—	—	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9,996円です。
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	0.037	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 ）	(4)	(0.036)	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	4	0.037	

(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。

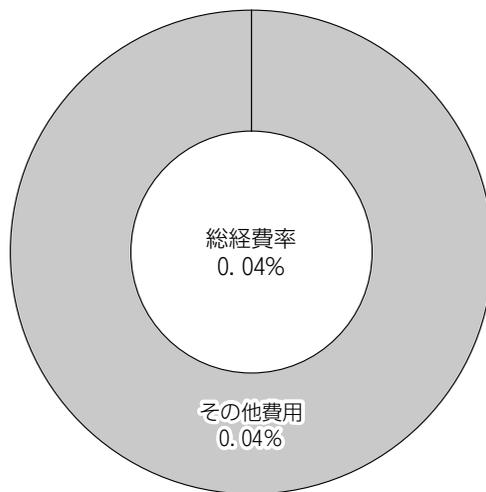
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.04%です。

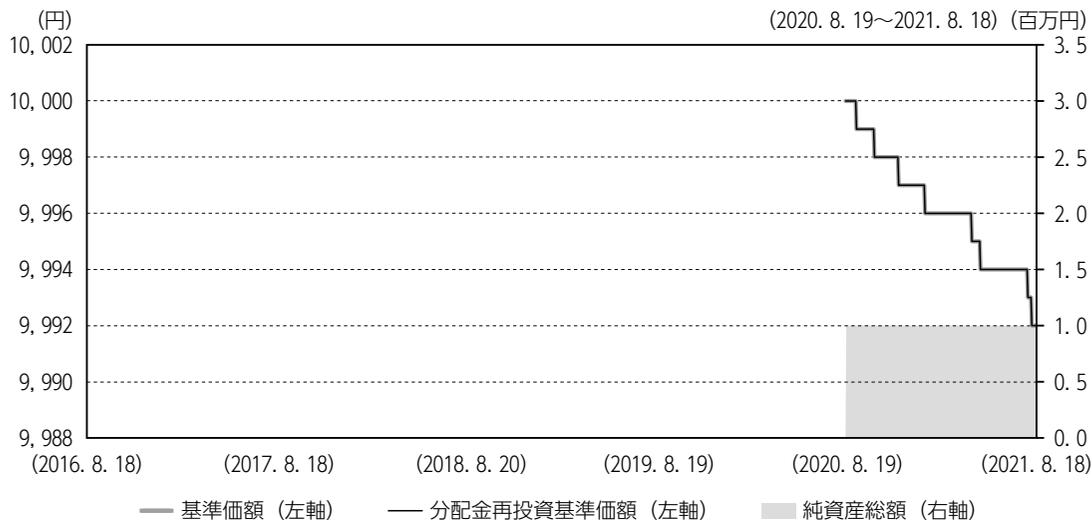


(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

最近5年間の基準価額等の推移について



		2020年8月19日	2021年8月18日
		設定	決算日
基準価額	(円)	10,000	9,992
分配金 (税込み)	(円)	—	0
分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	△0.1
純資産総額	(百万円)	1	0

(注1) 比率は小数点第1位未満を四捨五入してあります。

(注2) 当ファンドは、「FANG+ブルベアファンド」を構成するファンドのスイッチング資金を一時滞留させる受け皿としての役割を持ったファンドであり、わが国の債券を中心に安定運用を行います。そのため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

投資環境について

(2020.8.19～2021.8.18)

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。

ポートフォリオについて

(2020.8.19～2021.8.18)

当ファンド

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

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（1万口当り）

項 目	当期	
	2020年8月19日 ～2021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)	—

- (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。



今後の運用方針

当ファンド

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

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・ローン等による運用を行う方針です。

今後も現在の低金利環境が継続した場合は、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落することが予想されます。投資家のみなさまにおかれましては、ご留意くださいますようお願い申し上げます。



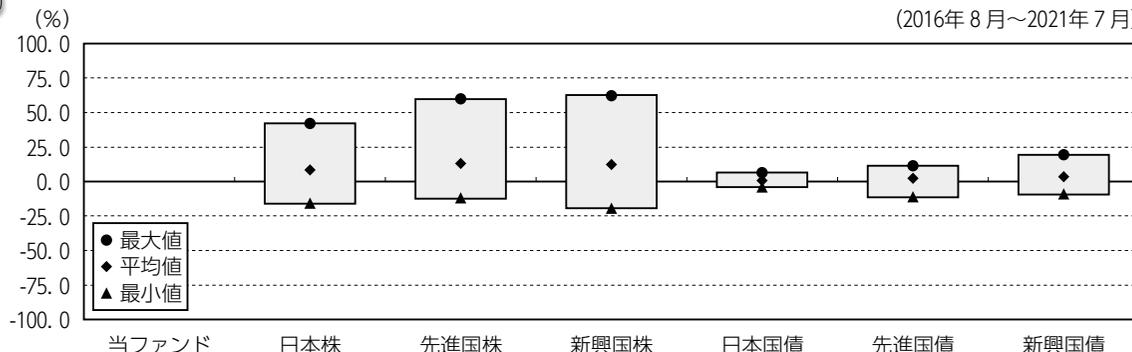
当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／国内／債券	
信託期間	3年間（2020年8月19日～2023年8月18日）	
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	ベビーファンド	イ. ダイワ・マネーポートフォリオ・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 ロ. 円建ての債券
	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
ベビーファンドの運用方法	①主として、マザーファンドの受益証券および円建ての債券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ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。	
マザーファンドの運用方法	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。	
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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等の額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	



代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2016年8月～2021年7月)



	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	—	42.1	59.8	62.7	6.5	11.4	19.3
平均値	—	8.3	13.0	12.3	0.5	2.3	3.5
最小値	—	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 11.4	△ 9.4

上記の図表は、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※上記の騰落率は直近月末から60カ月さかのぼった算出結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。

※資産クラスについて

日本株……………東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

先進国株……………MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、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（配当込み、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……………JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCI コクサイ・インデックスおよびMSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI 国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE 世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLC が有しています。●JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morgan からの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved. (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。



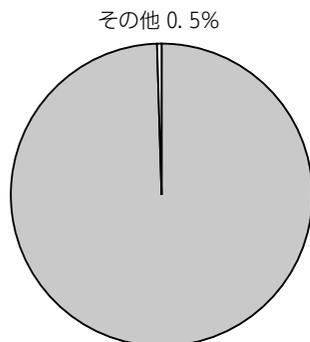
ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入ファンド等

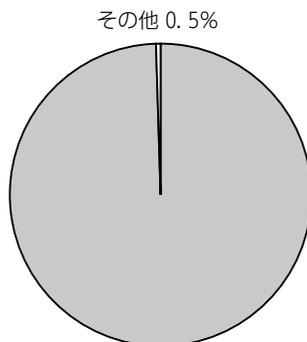
	比 率
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	99.5%
その他	0.5

資産別配分



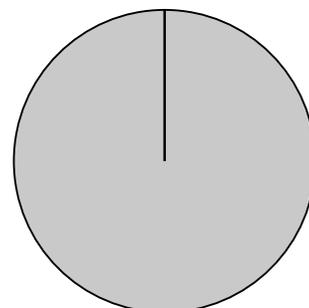
マザーファンド 99.5%

国別配分



日本 99.5%

通貨別配分



日本・円 100.0%

(注1) 上記データは2021年8月18日現在のものです。

(注2) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 国別配分において、キャッシュ部分については「その他」に含めています。

※当ファンドは、上記組入ファンドを通じて実質的な運用を行っています。次ページの「組入上位ファンドの概要」には、組入上位3ファンドまでのファンドの内容を掲載しています。

純資産等

項 目	当期末
	2021年8月18日
純資産総額	999,239円
受益権総口数	1,000,000口
1万円当り基準価額	9,992円

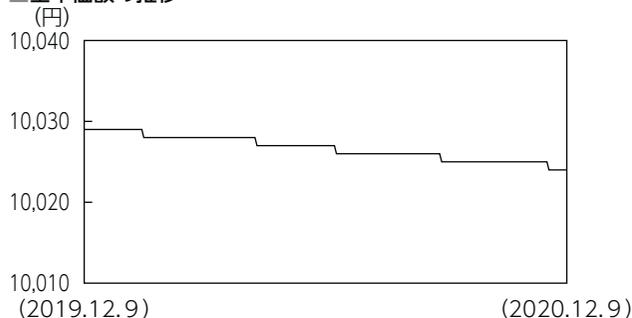
* 当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。

組入上位ファンドの概要

◆ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（作成対象期間 2019年12月10日～2020年12月9日）

■基準価額の推移



■1万口当りの費用の明細

項	目	
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

■組入資産

2020年12月9日現在、有価証券等の組み入れはありません。

(注1) 基準価額の推移、1万口当りの費用の明細は組入ファンドの直近の作成対象期間のものです。

(注2) 1万口当りの費用の明細における費用（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、簡便法により算出した結果です。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。また、円未満を四捨五入してあります。

* 組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）をご覧ください。