

大和住銀／コロンビア米国株 リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)／ Bコース(ダイワ投資一任専用)

追加型投信／海外／株式

日経新聞掲載名：Fコロ米株A／Fコロ米株B

2022年6月16日から2023年6月15日まで

第 7 期 決算日：2023年6月15日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

各ファンドは外国投資信託証券への投資を通じて、米国株式へ投資することで、信託財産の中長期的な成長を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

当期の状況

	Aコース (ダイワ投資一任専用)	Bコース (ダイワ投資一任専用)
基準価額(期末)	17,430円	26,811円
純資産総額(期末)	1,993百万円	3,009百万円
騰落率(当期)	+12.7%	+21.1%
分配金合計(当期)	0円	0円

※騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したものです。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

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旨を定めており、次の手順でご覧いただけます。なお、印刷した「運用報告書(全体版)」はご請求により交付させていただきますので、販売会社までお問い合わせください。

【閲覧方法】<https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/>にアクセス→ファンド名を入力→検索結果からファンドを選択

1 運用経過

基準価額等の推移について(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

基準価額等の推移

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)



※分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	15,466円
期末	17,430円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+12.7% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

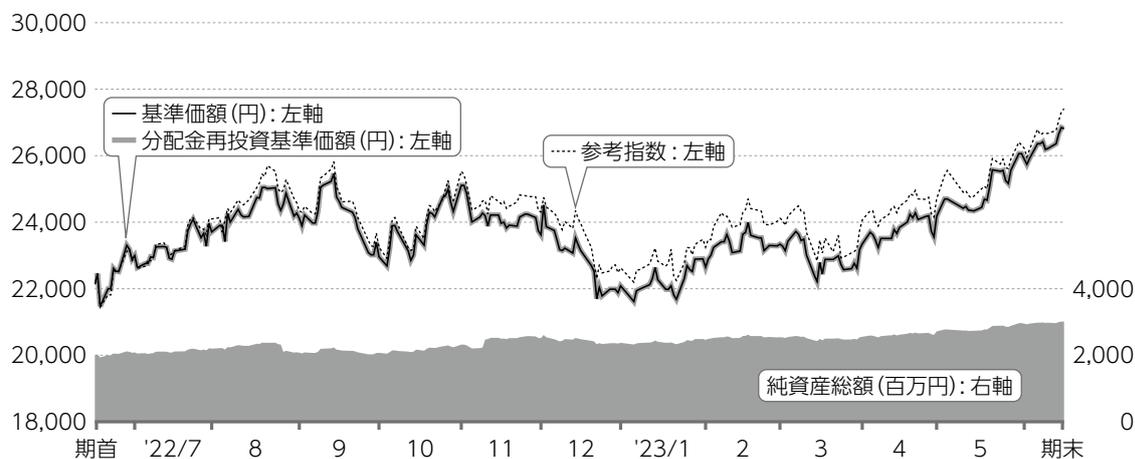
分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの参考指数は、S & P 500インデックス(配当込み)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)



※分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	22,137円
期末	26,811円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+21.1% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの参考指数は、S & P 500インデックス(配当込み、円換算ベース)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)

当ファンドは、外国投資信託証券への投資を通じて、米国株式へ投資しました。

上昇要因

- インフレ見通しやF R B (米連邦準備制度理事会)の金融政策に対する思惑、企業業績動向などで上下したものの、期間を通じてみると米国株が上昇したこと

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)

当ファンドは、外国投資信託証券への投資を通じて、米国株式へ投資しました。

上昇要因

- インフレ見通しやF R Bの金融政策に対する思惑、企業業績動向などで上下したものの、期間を通じてみると米国株が上昇したこと
- 期間を通じてみれば、米ドル高・円安となったこと

1万口当たりの費用明細(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	84円	0.522%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は16,030円です。
(投信会社)	(62)	(0.385)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(18)	(0.110)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(4)	(0.027)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	2	0.011	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(－)	(－)	保管費用: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)	(0.010)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	86	0.533	

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

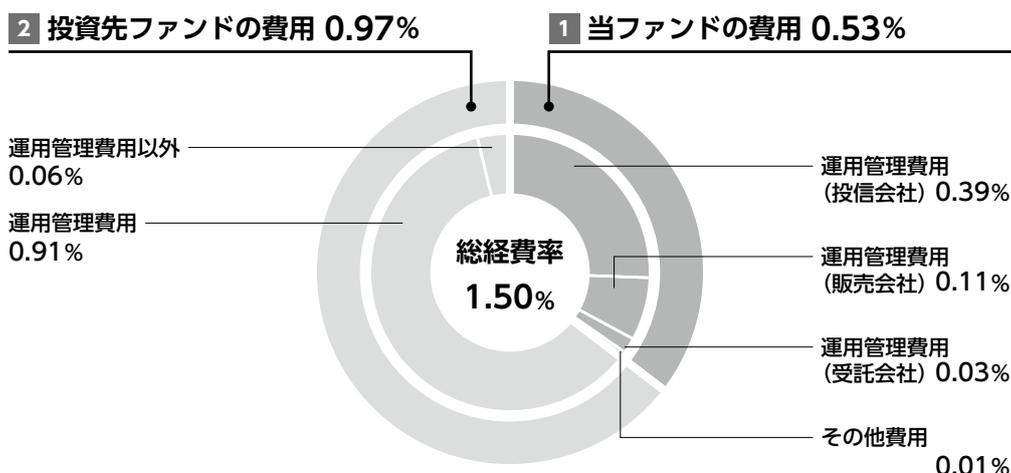
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。



参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(1+2)	1.50%
1 当ファンドの費用の比率	0.53%
2 投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.91%
投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

※**1**の各費用は、前掲「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、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※**2**の投資先ファンド(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))の費用は、シェアクラスの経費率です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※**1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・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。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.50%です。

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	124円	0.522%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は23,726円です。
(投信会社)	(91)	(0.385)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(26)	(0.110)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(7)	(0.027)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(株式)	(-)	(-)	売買委託手数料: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)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(株式)	(-)	(-)	有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	3	0.011	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(-)	(-)	保管費用: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付金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(2)	(0.010)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	127	0.534	

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

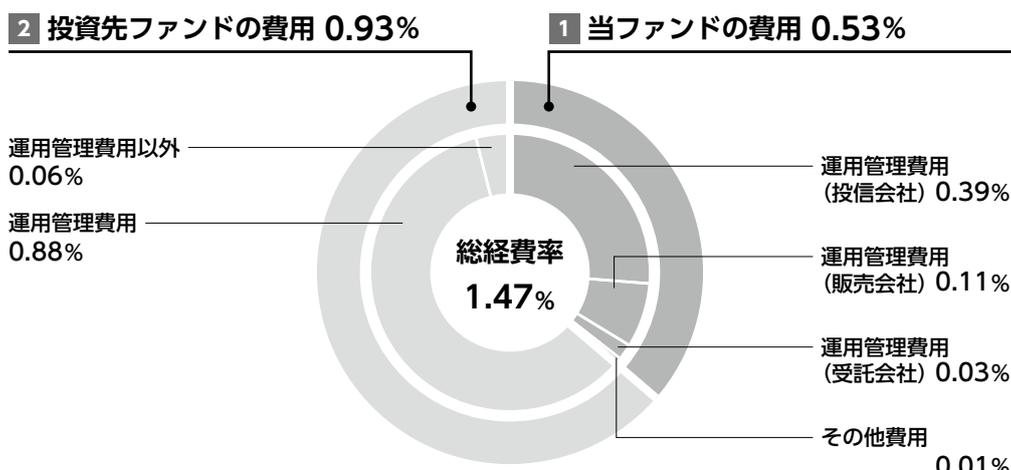
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。



参考情報 総経費率(年率換算)



項目	比率
総経費率 (1 + 2)	1.47%
1 当ファンドの費用の比率	0.53%
2 投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.88%
投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

※**1**の各費用は、前掲「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、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※**2**の投資先ファンド(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))の費用は、シェアクラスの経費率です。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※**1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

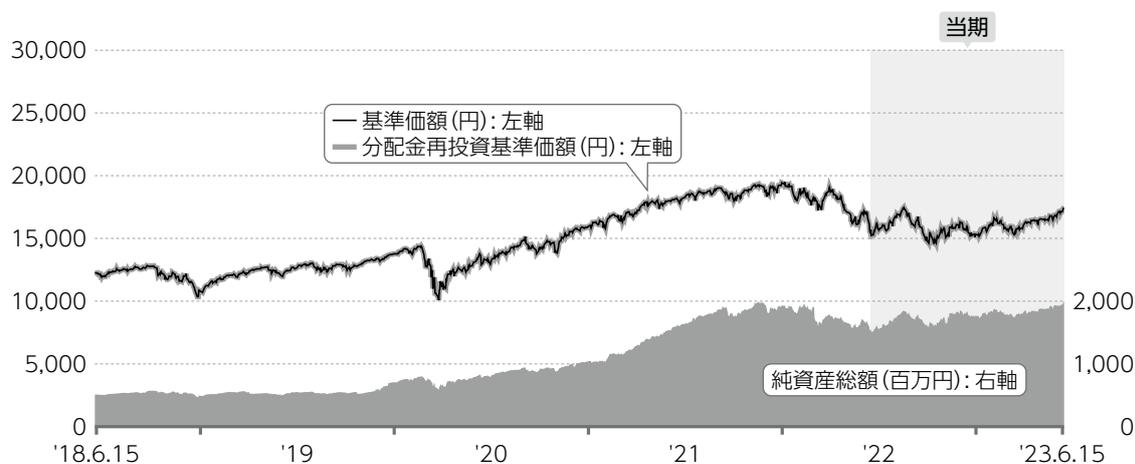
※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当期中の運用・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。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.47%です。

最近5年間の基準価額等の推移について(2018年6月15日から2023年6月15日まで)

最近5年間の推移

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)



※分配金再投資基準価額は、2018年6月15日の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

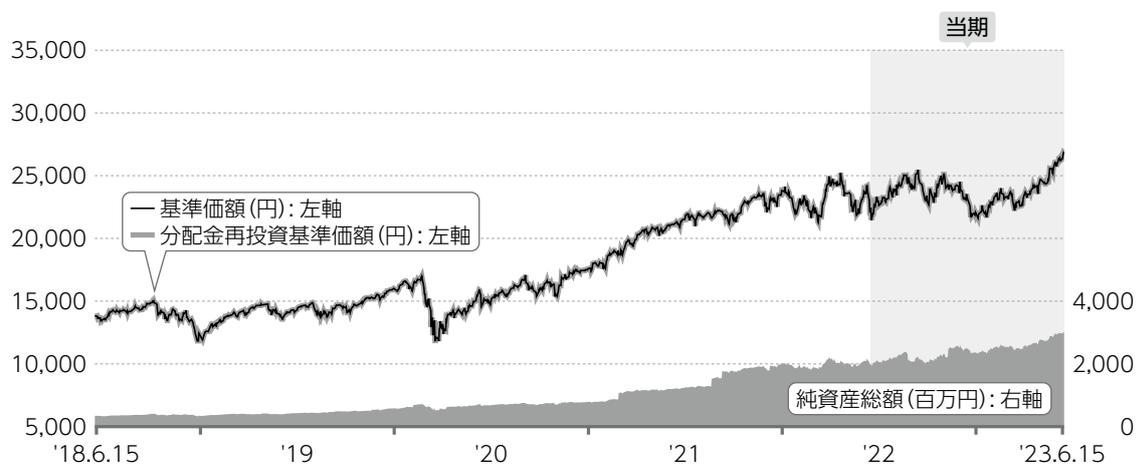
		2018.6.15 決算日	2019.6.17 決算日	2020.6.15 決算日	2021.6.15 決算日	2022.6.15 決算日	2023.6.15 決算日
基準価額	(円)	12,266	12,427	13,035	18,196	15,466	17,430
期間分配金合計(税引前)	(円)	—	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額騰落率	(%)	—	1.3	4.9	39.6	-15.0	12.7
参考指数騰落率	(%)	—	5.9	7.4	42.1	-10.9	19.1
純資産総額	(百万円)	512	532	786	1,599	1,530	1,993

参考指数について

※外国の指数は基準価額への反映を考慮した日付の値を使用しています。

※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います。

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)



※分配金再投資基準価額は、2018年6月15日の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

		2018.6.15 決算日	2019.6.17 決算日	2020.6.15 決算日	2021.6.15 決算日	2022.6.15 決算日	2023.6.15 決算日
基準価額	(円)	13,805	14,091	14,824	21,330	22,137	26,811
期間分配金合計(税引前)	(円)	—	0	0	0	0	0
分配金再投資基準価額騰落率	(%)	—	2.1	5.2	43.9	3.8	21.1
参考指数騰落率	(%)	—	3.9	6.0	45.9	9.2	23.8
純資産総額	(百万円)	345	416	669	1,221	1,983	3,009

参考指数について

※外国の指数は基準価額への反映を考慮した日付の値を使用しています。

※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います。

投資環境について(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

期間における米国株式市場は上昇しました。また、為替市場は米ドル高・円安となりました。

米国株式市場

米国株式市場は上昇しました。期間の初めから8月中旬にかけては、長期金利(10年国債利回り)が低下基調で推移したことや、7月末のFOMC(米連邦公開市場委員会)での利上げ幅が市場予想通りとなり、パウエルFRB議長が今後の利上げペースを緩める可能性に言及したことなどから、米国株式市場は上昇しました。しかしながら、8月中旬以降は一部の半導体企業の軟調な業績見通しの発表や、FRBのタカ派(インフレ抑制を重視する立場)的な姿勢を嫌気して株式市場は再び調整し、10月中旬まで下落しました。その後は、インフレ見通しと金融政策への思惑、景気見通しと業績発表などに左右され上下に振れましたが、上昇基調が継続しました。3月には地方銀行の破綻などで一時的に金融不安が強まりましたが、迅速な対応で株式市場全体への影響は大きくありませんでした。また、AI技術に関わる成長期待から、半導体関連銘柄を中心にテクノロジー銘柄が大きく上昇しました。

為替市場

米ドル・円相場は期間の初めから2022年10月中旬にかけては、FRBがタカ派色を強めることで、日米における金融政策の方向性の違いや金利差拡大を背景に米ドル高・円安となりました。その後、米国の利上げペースの緩和期待が強まったことなどから、米ドル・円相場は反転し、1月中旬にかけて米ドル安・円高が進行しました。1月下旬から期末にかけては、3月に米地銀の破綻などで米ドル安となる局面もあったものの、緩やかな米ドル高・円安基調となりました。

ポートフォリオについて(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

**大和住銀／コロンビア米国株リバーサル
戦略ファンド Aコース
(ダイワ投資一任専用)**

主要投資対象である「コロンビア・US
コントラリアン・ファンド ヘッジド・クラ
ス」を期間を通じて高位に組み入れました。

**コロンビア・USコントラリアン・
ファンド ヘッジド・クラス**

当ファンドの運用戦略であるリバーサル
戦略(ファンダメンタルズ分析および株価水
準を考慮した逆張り投資)に基づき、株式
ポートフォリオを運用しました。

期間における主な売買としては、
Medtronic Plc、The Procter & Gamble
Company、Parker-Hannifin Corporation
などを購入する一方、CVS Health
Corporation、State Street Corporation、
Southwest Airlines Co.などを売却しまし
た。

また、対円で為替ヘッジを行い、為替変
動リスクの低減を目指しました。

**大和住銀／コロンビア米国株リバーサル
戦略ファンド Bコース
(ダイワ投資一任専用)**

主要投資対象である「コロンビア・US
コントラリアン・ファンド アンヘッジド・
クラス」を期間を通じて高位に組み入れまし
た。

**コロンビア・USコントラリアン・
ファンド アンヘッジド・クラス**

当ファンドの運用戦略であるリバーサル
戦略(ファンダメンタルズ分析および株価水
準を考慮した逆張り投資)に基づき、株式
ポートフォリオを運用しました。

期間における主な売買としては、
Medtronic Plc、The Procter & Gamble
Company、Parker-Hannifin Corporation
などを購入する一方、CVS Health
Corporation、State Street Corporation、
Southwest Airlines Co.などを売却しまし
た。

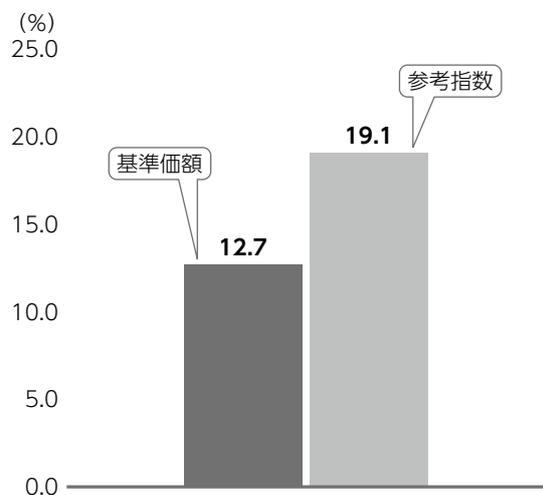
マネー・マネジメント・マザーファンド

安全性と流動性を考慮し、短期の政府保
証債を中心とした運用を行いました。年限
に関しては、残存6ヵ月以内の短期の政府
保証債を中心とした運用を継続しました。

ベンチマークとの差異について(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)

基準価額と参考指数の騰落率対比



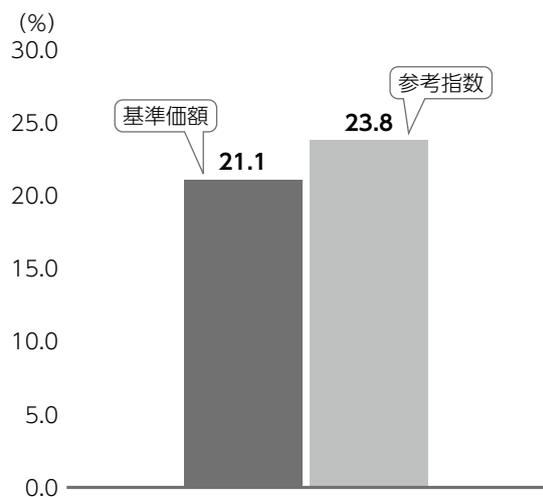
※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてS & P 500インデックス(配当込み)を設けています。

記載のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)

基準価額と参考指数の騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてS & P 500インデックス(配当込み、円換算ベース)を設けています。

記載のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

分配金について(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)
／Bコース(ダイワ投資一任専用)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項 目	第7期	
	Aコース (ダイワ投資一任専用)	Bコース (ダイワ投資一任専用)
当期分配金	0	0
(対基準価額比率)	(0.00%)	(0.00%)
当期の収益	-	-
当期の収益以外	-	-
翌期繰越分配対象額	7,630	16,811

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りとした。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース (ダイワ投資一任専用)

引き続き、運用の基本方針に従い、「コロンビア・USコントラリアン・ファンド ヘッジド・クラス」への投資を通じて、米国株式へ投資することで、信託財産の中長期的な成長を目指します。

コロンビア・USコントラリアン・ファンド ヘッジド・クラス

ポートフォリオの長期的価値を創造する可能性のある投資候補を選択する上での出発点として、市場に広がる悲観論に着目しており、それらの悲観論により株価が下落している銘柄を調査対象として、逆張りの投資プロセスを忠実に守っています。非常にボラティリティ(価格変動性)が高く、流動的な市場環境の中でリスクに留意しつつ、長期にわたり上手く機能してきた逆張りプロセスを進める方針です。

また、対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を目指します。

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース (ダイワ投資一任専用)

引き続き、運用の基本方針に従い、「コロンビア・USコントラリアン・ファンド アンヘッジド・クラス」への投資を通じて、米国株式へ投資することで、信託財産の中長期的な成長を目指します。

コロンビア・USコントラリアン・ファンド アンヘッジド・クラス

ポートフォリオの長期的価値を創造する可能性のある投資候補を選択する上での出発点として、市場に広がる悲観論に着目しており、それらの悲観論により株価が下落している銘柄を調査対象として、逆張りの投資プロセスを忠実に守っています。非常にボラティリティが高く、流動的な市場環境の中でリスクに留意しつつ、長期にわたり上手く機能してきた逆張りプロセスを進める方針です。

マネー・マネジメント・マザーファンド

当ファンドでは引き続き、安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行っていきます。ファンドの平均残存年限については、2～4ヵ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

3 お知らせ

約款変更について

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)／Bコース(ダイワ投資一任専用)

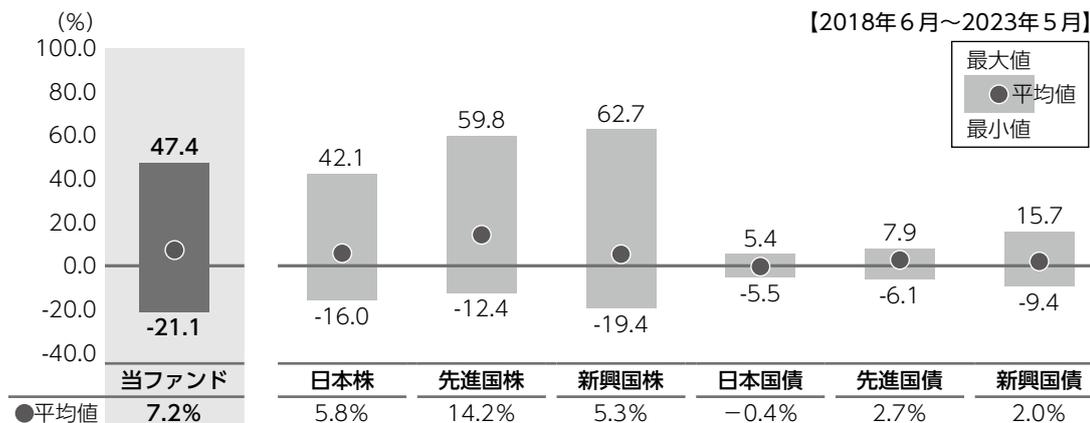
該当事項はございません。

4 当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式
信 託 期 間	無期限(設定日：2016年9月26日)
運 用 方 針	外国投資信託証券への投資を通じて、米国株式へ投資することで、信託財産の中長期的な成長を目指します。 大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)は以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 コロンビア・USコントラリアン・ファンド ヘッジド・クラス 米国の株式等 原則として組入資産に対して対円で為替ヘッジを行います。
主 要 投 資 対 象	マネー・マネジメント・マザーファンド 本邦貨建て公社債および短期金融商品等 大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)は以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 コロンビア・USコントラリアン・ファンド アンヘッジド・クラス 米国の株式等 原則として為替ヘッジは行いません。 マネー・マネジメント・マザーファンド 本邦貨建て公社債および短期金融商品等
当 ファ ン ド の 運 用 方 法	<ul style="list-style-type: none"> ■当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。 ■米国株式を実質的な投資対象とし、コロンビア社の米国株リバーサル戦略により信託財産の中長期的な成長を目指します。 ■「コロンビア・USコントラリアン・ファンド」における株式の銘柄選択にあたっては、個別企業のファンダメンタルズを勘案したリバーサル(逆張り)戦略により行います。外国投資信託証券における株式の運用は、コロンビア・マネジメント・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシーが行います。
組 入 制 限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分 配 方 針	<ul style="list-style-type: none"> ■毎年6月15日(休業日の場合翌営業日)に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配金額を決定します。 ■分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ■分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額な場合等には分配を行わないことがあります。 <p>※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</p> </div>

5 代表的な資産クラスとの騰落率の比較

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)



※上記期間の月末ごとに、それぞれ直近1年間の騰落率を算出し、最大・平均・最小を表示しています。よって、決算日に対応した数値とは異なります。

※当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したものです。

※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。

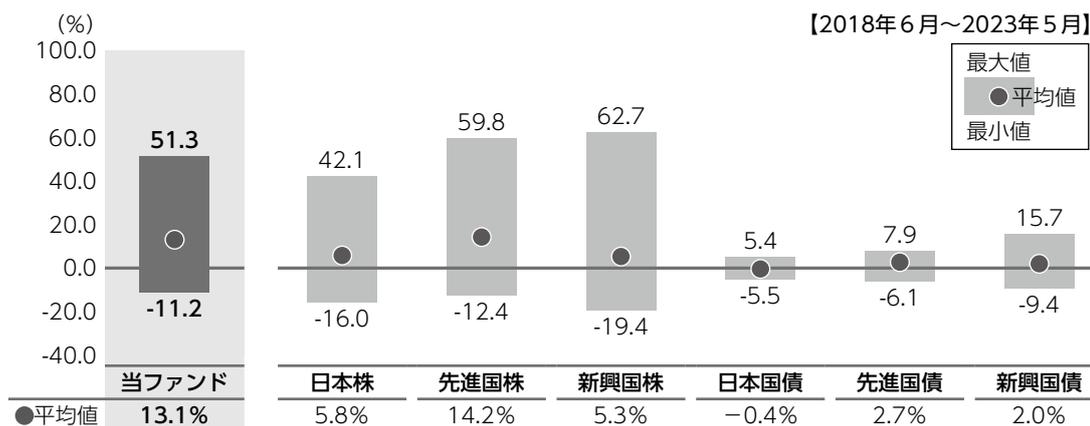
各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・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) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)



※上記期間の月末ごとに、それぞれ直近1年間の騰落率を算出し、最大・平均・最小を表示しています。よって、決算日に対応した数値とは異なります。

※当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定して計算したものです。

※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。

各資産クラスの指数

日本株	<p>TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。</p>
先進国株	<p>MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。</p>
新興国株	<p>MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。</p>
日本国債	<p>NOMURA-BPI(国債) 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。</p>
先進国債	<p>FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。</p>
新興国債	<p>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) J.P. Morganが開発した指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。</p>

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

6 当ファンドのデータ

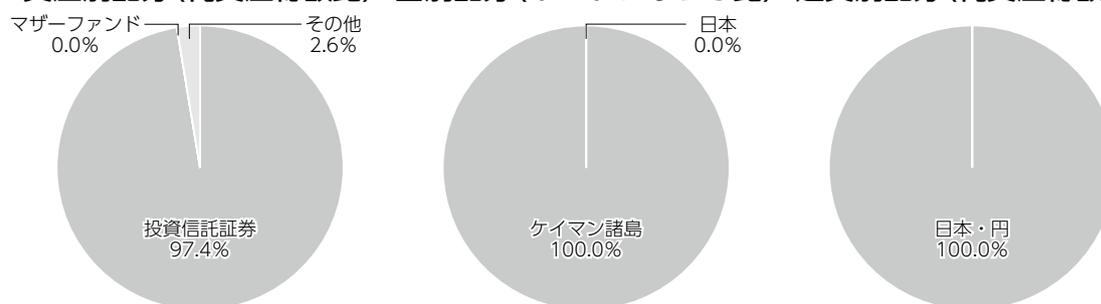
当ファンドの組入資産の内容(2023年6月15日)

大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)
組入れファンド等

銘柄名	組入比率
コロンビア・USコントラリアン・ファンド ヘッジド・クラス	97.4%
マネー・マネジメント・マザーファンド	0.0%
コールローン等、その他	2.6%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

資産別配分(純資産総額比) 国別配分(ポートフォリオ比) 通貨別配分(純資産総額比)



※未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

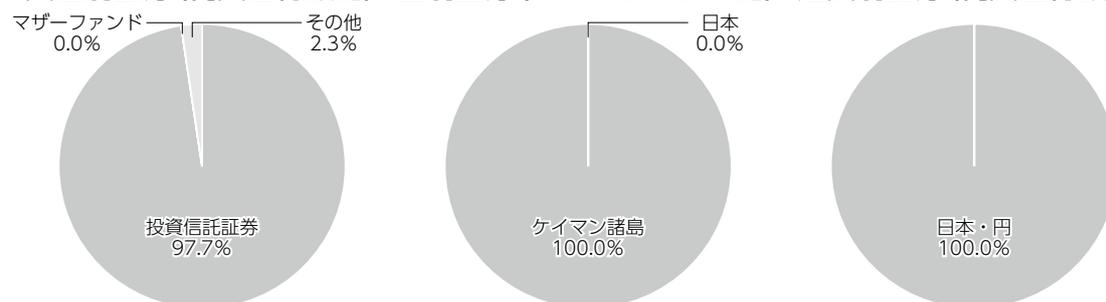
大和住銀／コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)

組入れファンド等

銘柄名	組入比率
コロンビア・USコントラリアン・ファンド アンヘッジド・クラス	97.7%
マネー・マネジメント・マザーファンド	0.0%
コールローン等、その他	2.3%

※比率は、純資産総額に対する割合です。

資産別配分(純資産総額比) 国別配分(ポートフォリオ比) 通貨別配分(純資産総額比)



※未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

純資産等

項目	第7期末 2023年6月15日		※Aコース(ダイワ投資一任専用)の当期における、追加設定元本額は345,295,005円、解約元本額は190,775,533円です。 ※Bコース(ダイワ投資一任専用)の当期における、追加設定元本額は486,367,211円、解約元本額は259,734,095円です。
	Aコース (ダイワ投資一任専用)	Bコース (ダイワ投資一任専用)	
純資産総額 (円)	1,993,691,509	3,009,913,430	
受益権総口数 (口)	1,143,811,175	1,122,626,974	
1万口当たり基準価額 (円)	17,430	26,811	

組入上位ファンドの概要

コロンビア・USコントラリアン・ファンド ヘッジド・クラス／アンヘッジド・クラス
(2021年10月1日～2022年9月30日)

基準価額の推移以外は投資ファンドを含むシェアクラスで構成された「コロンビア・USコントラリアン・ファンド」の情報で、コロンビア・マネジメント・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシーから提供されたデータに基づき作成しています。

基準価額(円建て)の推移
ヘッジド・クラス



※分配金再投資ベース

アンヘッジド・クラス



※分配金再投資ベース

1万口当たりの費用明細

単位当たり費用明細は入手できるデータがないため記載していません。

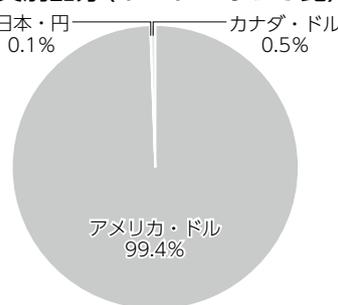
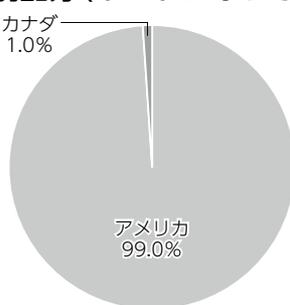
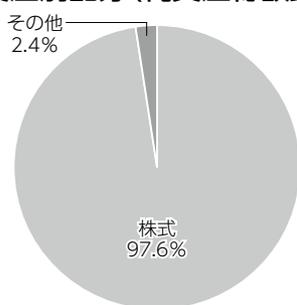
組入上位銘柄

(基準日：2022年9月30日)

順位	銘柄名	業種名	比率
1	Microsoft Corporation	情報技術	6.8%
2	Apple Inc.	情報技術	6.8%
3	Amazon.com, Inc.	一般消費財・サービス	4.6%
4	Johnson & Johnson	ヘルスケア	3.6%
5	Berkshire Hathaway Inc. Class B	金融	3.0%
6	Walmart Inc.	生活必需品	2.5%
7	Chevron Corporation	エネルギー	2.3%
8	Eli Lilly and Company	ヘルスケア	2.2%
9	Wells Fargo & Company	金融	2.1%
10	T-Mobile US, Inc.	コミュニケーション・サービス	1.9%
全銘柄数		75銘柄	

※比率はポートフォリオに対する割合

資産別配分(純資産総額比) 国別配分(ポートフォリオ比) 通貨別配分(ポートフォリオ比)



※国別配分は原則発行国もしくは投資国を表示しています。

※基準日は2022年9月30日です。