

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／債券
設定日	2017年11月7日
信託期間	2017年11月7日～2022年9月12日
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、主として米国債に実質的に投資することで、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。残存期間が5年～7年程度の米国債に投資し、原則として、各残存期間毎の投資金額がほぼ同額程度となるような運用（ラダー型運用）を目指します。米国債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。実質組入外貨建資産については、「守る為替ヘッジ戦略」と「攻める為替ヘッジ戦略」の組合せにより、最適な為替ヘッジ戦略を目指します。
主要運用対象	米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用） ・米国中期債運用戦略マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。 米国中期債運用戦略マザーファンド ・米国債を主要投資対象とします。
投資制限	米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用） ・株式への実質投資は行いません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 米国中期債運用戦略マザーファンド ・株式への投資は行いません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎年3月、9月の11日（休業日の場合は、翌営業日）の決算日に、収益分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。

運用報告書（全体版）

第1期

決算日 2018年3月12日

米国中期債運用戦略ファンド （ダイワ投資一任専用）

受益者の皆様へ

毎々、格別のお引き立てにあずかり厚くお礼申し上げます。

さて「米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）」は、去る2018年3月12日に第1期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

ホームページアドレス

<http://www.daiwasbi.co.jp/>

お問い合わせ先

受付窓口：（電話番号）0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで（土、日、祝日除く。）

※お客様のお取引内容につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。



資産運用のベストパートナー、だいわすみぎん

大和住銀投信投資顧問

Daiwa SB Investments

東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 分配	期中 騰落率			
(設定日) 2017年11月7日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 3,245
第1期 (2018年3月12日)	9,603	0	△4.0	97.8	—	3,610

*当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

*設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
		騰落率		
(設定日) 2017年11月7日	円 10,000	% —	% —	% —
11月末	9,909	△0.9	98.3	—
12月末	9,875	△1.3	99.2	—
2018年1月末	9,625	△3.8	96.5	—
2月末	9,599	△4.0	97.3	—
(期末) 2018年3月12日	9,603	△4.0	97.8	—

*設定日の基準価額は、設定価額を記載しています。

*騰落率は設定日比です。

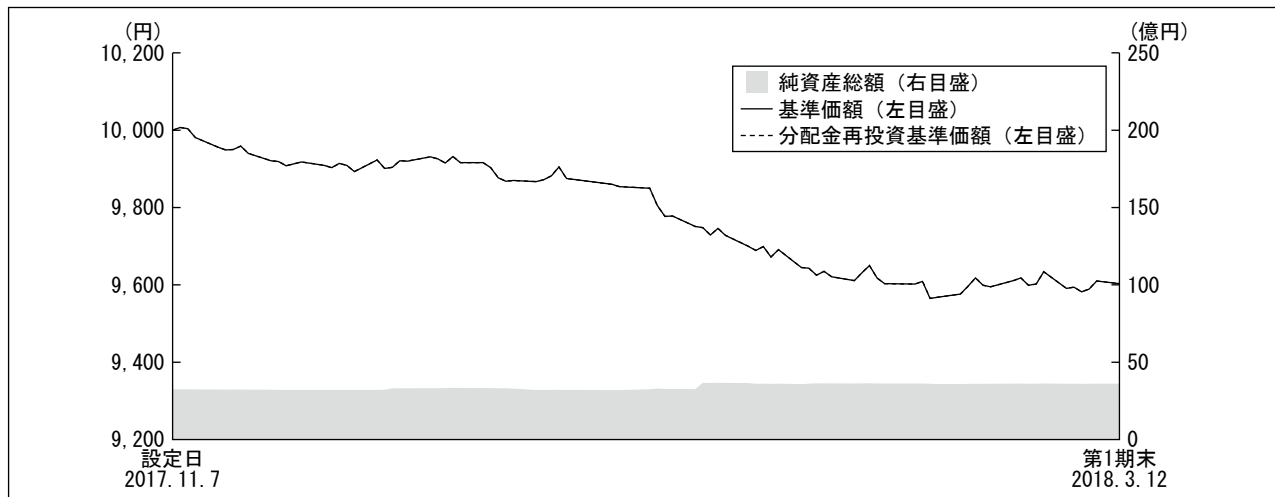
*先物組入比率は、買建比率－売建比率

*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

運用経過

【基準価額等の推移】



* 設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を表示しております。

* 当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

* 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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はありません。

* 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

設定日 : 10,000円

第1期末 : 9,603円（既払分配金 0円）

騰落率 : $\Delta 4.0\%$ （分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

当ファンドは、米国中期債運用戦略マザーファンドへの投資を通じて、主として米国債に実質的に投資を行いました。

（下落要因）

米国債の価格とドル円レートがいずれも下落する「金利上昇と円高」の市場変動の影響を受けたことが下落要因となりました。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

【投資環境】

米国の5～7年の中期ゾーンの国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。主な背景は、設定当初から米国景気が回復基調であったことに加え、トランプ政権の税制改革によって経済成長が加速するとの見方や賃金と物価の上昇率が高くなった動きを受け、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めが積極化すると観測が広がったことです。2018年2月に米国株式市場の乱高下を受け、米国債利回りの上昇の動きは一服しました。しかし、米国債の増発や歳出拡大の影響で債券市場の需給悪化への懸念が根強く、利回り低下の動きは限定的でした。

米ドル円相場は円高が進行しました。この動きは、主に次の点を背景とし、2018年の年明け以降に目立ちました。1月は、日本銀行の国債購入額減額をきっかけに日本の金融政策の正常化が進むとの思惑が広がりました。2月は、米国市場で金利上昇による景気減速が懸念され株価が乱高下し、市場のリスク回避姿勢が強まりました。また、米国は2月から3月に緊急輸入制限発動や輸入関税導入を発表したため、同国の通商政策の保護主義化が警戒されました。

【ポートフォリオ】

■米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

主要投資対象である米国中期債運用戦略マザーファンドを期を通じて高位に組み入れ、期末の実質的な公社債組入比率は97.8%としました。

■米国中期債運用戦略マザーファンド

当期の騰落率は、△3.8%となりました。

債券ポートフォリオは、5～7年までの残存期間毎の米国債の組入比率がほぼ均等となるように構築し、残存期間の分散を図りました。

為替ヘッジ取引の判断にあたっては、大和証券株式会社からの投資助言を受けて以下の運用を行いました。為替ヘッジ比率は、50%台から100%程度の範囲で調整しました。「守る為替ヘッジ戦略」では、債券価格と為替レートが逆方向に動く傾向を分析した結果、期を通じて60%台から80%台のヘッジ比率でした。次の4つの時期においては、「攻める為替ヘッジ戦略」を適用し、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を25%程度増減する調整を行いました。2月中旬は米ドル円相場が108円台から106円台に下落した場面で円高局面と判定し、ヘッジ比率を100%程度に高めました。また、1月中旬、1月の月末付近から2月の月初付近、2月下旬は円安局面と判定し、ヘッジ比率を50%台に下げました。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

【ベンチマークとの差異】

当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

【分配金】

収益分配金につきましては、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、見送りとさせていただきます。
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を行います。

■分配原資の内訳

（1万口当り・税引前）

項目	第1期	
	2017年11月7日 ～2018年3月12日	
当期分配金	(円)	0
(対基準価額比率)	(%)	0.00
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	39

※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

■米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

引き続き、運用の基本方針に従い、マザーファンドへの投資を通じて、主として米国債に実質的に投資することで、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

■米国中期債運用戦略マザーファンド

引き続き、債券ポートフォリオは、米国債5～7年のラダー型とします。

為替ヘッジ取引の判断にあたっては、引き続き、大和証券株式会社からの投資助言を受けて運用を行います。なお、投資助言者の運用方針は以下の通りです。為替ヘッジは「攻・守」合わせた戦略を適用します。債券価格とドル円レートには、逆方向に変動する傾向があります。「守る為替ヘッジ戦略」は常時適用し、こうした動きを捉え安定した収益の確保を図ります。さらに、ドル円の市場データを分析した結果、追加収益獲得の機会と捉えた際は「攻める為替ヘッジ戦略」を機動的に適用します。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2017年11月7日～2018年3月12日		
	金額	比率	
信託報酬	15円	0.157%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,752円です。
（投信会社）	(11)	(0.112)	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	(4)	(0.037)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
（受託会社）	(1)	(0.007)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
その他費用	1	0.006	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）	(0)	(0.002)	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)	(0.004)	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)	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	16	0.163	

* 「比率」欄は1万口当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。

* 期中の費用（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。

なお、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受益証券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。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年11月7日から2018年3月12日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
米 国 中 期 債 運 用 戦 略 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 4,019,788	千円 4,003,256	千口 260,835	千円 255,345

利害関係人との取引状況等

(2017年11月7日から2018年3月12日まで)

<米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）>

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

<米国中期債運用戦略マザーファンド>

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

組入資産の明細

2018年3月12日現在

■親投資信託残高

	当 期 末	
	口 数	評 価 額
米 国 中 期 債 運 用 戦 略 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 3,758,953	千円 3,615,737

*米国中期債運用戦略マザーファンド全体の受益権口数は、5,779,464千口です。

投資信託財産の構成

2018年3月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
米 国 中 期 債 運 用 戦 略 マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 3,615,737	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,615,737	100.0

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1 アメリカ・ドル=106.95円

*米国中期債運用戦略マザーファンド

当期末における外貨建資産（5,433,942千円）の投資信託財産総額（5,560,363千円）に対する比率 97.7%

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年3月12日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,615,737,127円
米国中期債運用戦略マザーファンド(評価額)	3,615,737,127
(B) 負 債	5,424,237
未 払 信 託 報 酬	5,298,156
そ の 他 未 払 費 用	126,081
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3,610,312,890
元 本	3,759,382,237
次 期 繰 越 損 益 金	△ 149,069,347
(D) 受 益 権 総 口 数	3,759,382,237口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	9,603円

*元本状況

当初設定元本額	3,245,396,306円
期中追加設定元本額	774,985,931円
期中一部解約元本額	261,000,000円

*元本の欠損

149,069,347円

損益の状況

自2017年11月7日
至2018年3月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 118円
受 取 利 息	6
支 払 利 息	△ 124
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△126,986,453
売 買 益	4,909,242
売 買 損	△131,895,695
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5,424,237
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△132,410,808
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 16,658,539
(配 当 等 相 当 額)	(△ 19)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 16,658,520)
(F) 次 期 繰 越 損 益 金 (D + E)	△149,069,347
追 加 信 託 差 損 益 金 (F)	△149,069,347
(配 当 等 相 当 額)	(16,658,539)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,056,701)
分 配 準 備 積 立 金	(△ 17,715,240)
繰 越 損 益 金	13,761,881
繰 越 損 益 金	△146,172,689

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*信託報酬等には、消費税等相当額を含めて表示しております。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

<分配金の計算過程>

信託約款に基づき計算した収益分配可能額及び収益分配金の計算過程は以下のとおりです。

(A) 配 当 等 収 益 (費用控除後)	13,761,881円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収 益 調 整 金	1,056,701
(D) 分 配 準 備 積 立 金	0
分 配 可 能 額 (A + B + C + D)	14,818,582
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(39.42)
収 益 分 配 金	0
(1 万 口 当 り 収 益 分 配 金)	(0)

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。

米国中期債運用戦略マザーファンド

運用報告書

決算日：2018年3月12日

(第1期：2017年11月7日～2018年3月12日)

当ファンドは、上記の通り決算を行いました。ここに、期中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。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	残存期間が5～7年程度の米国債を主要投資対象とし、原則として、各残存期間毎の投資金額がほぼ同額程度となるような運用を行い、信託財産の成長を目指します。
主要運用対象	主に米国債を主要投資対象とします。
投資制限	・ 株式への投資は行いません。 ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

資産運用のベストパートナー、だいwasみぎん



大和住銀投信投資顧問

Daiwa SB Investments

東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

<http://www.daiwasbi.co.jp/>

米国中期債運用戦略マザーファンド

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		公社債 組入比率	債券先 物率	純資産 総額
	騰落率	中率			
(設定日) 2017年11月7日	円 10,000	% —	% —	% —	百万円 3,245
第1期 (2018年3月12日)	9,619	△3.8	97.6	—	5,559

*当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

*設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		公社債 組入比率	債券先 物率
	騰落率	率		
(設定日) 2017年11月7日	円 10,000	% —	% —	% —
11月末	9,912	△0.9	98.3	—
12月末	9,881	△1.2	99.2	—
2018年1月末	9,636	△3.6	96.4	—
2月末	9,613	△3.9	97.1	—
(期末) 2018年3月12日	9,619	△3.8	97.6	—

*設定日の基準価額は、設定価額を記載しています。

*騰落率は設定日比です。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

運用経過

【基準価額等の推移】

設定日：10,000円

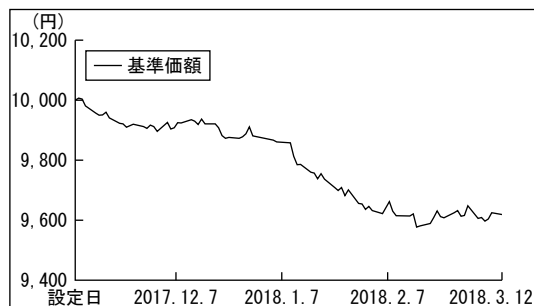
期 末：9,619円

騰落率：△3.8%

【基準価額の主な変動要因】

(下落要因)

米国債の価格とドル円レートがいずれも下落する「金利上昇と円高」の市場変動の影響を受けたことが下落要因となりました。



【投資環境】

米国の5～7年の中期ゾーンの国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。主な背景は、設定当初から米国景気が回復基調であったことに加え、トランプ政権の税制改革によって経済成長が加速するとの見方や賃金と物価の上昇率が高くなった動きを受け、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めが積極化するとの観測が広がったことです。2018年2月に米国株式市場の乱高下を受け、米国債利回りの上昇の動きは一服しました。しかし、米国債の増発や歳出拡大の影響で債券市場の需給悪化への懸念が根強く、利回り低下の動きは限定的でした。

米ドル円相場は円高が進行しました。この動きは、主に次の点を背景とし、2018年の年明け以降に目立ちました。1月は、日本銀行の国債購入額減額をきっかけに日本の金融政策の正常化が進むとの思惑が広がりました。2月は、米国市場で金利上昇による景気減速が懸念され株価が乱高下し、市場のリスク回避姿勢が強まりました。また、米国は2月から3月に緊急輸入制限発動や輸入関税導入を発表したため、同国の通商政策の保護主義化が警戒されました。

米国中期債運用戦略マザーファンド

【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、△3.8%となりました。

債券ポートフォリオは、5～7年までの残存期間毎の米国債の組入比率がほぼ均等となるように構築し、残存期間の分散を図りました。

為替ヘッジ取引の判断にあたっては、大和証券株式会社からの投資助言を受けて以下の運用を行いました。為替ヘッジ比率は、50%台から100%程度の範囲で調整しました。「守る為替ヘッジ戦略」では、債券価格と為替レートが逆方向に動く傾向を分析した結果、期を通じて60%台から80%台のヘッジ比率でした。次の4つの時期においては、「攻める為替ヘッジ戦略」を適用し、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を25%程度増減する調整を行いました。2月中旬は米ドル円相場が108円台から106円台に下落した場面で円高局面と判定し、ヘッジ比率を100%程度に高めました。また、1月中旬、1月の月末付近から2月の月初付近、2月下旬は円安局面と判定し、ヘッジ比率を50%台に下げました。

今後の運用方針

引き続き、債券ポートフォリオは、米国債5～7年のラダー型とします。

為替ヘッジ取引の判断にあたっては、引き続き、大和証券株式会社からの投資助言を受けて運用を行います。なお、投資助言者の運用方針は以下の通りです。為替ヘッジは「攻・守」合わせた戦略を適用します。債券価格とドル円レートには、逆方向に変動する傾向があります。「守る為替ヘッジ戦略」は常時適用し、こうした動きを捉え安定した収益の確保を図ります。さらに、ドル円の市場データを分析した結果、追加収益獲得の機会と捉えた際は「攻める為替ヘッジ戦略」を機動的に適用します。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2017年11月7日～2018年3月12日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	0円	0.003%	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(0)	(0.002)	
合計	(0)	(0.000)	
合計	0	0.003	
期中の平均基準価額は9,761円です。			

*「比率」欄は1万口当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。

*期中の費用（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。

*円未満は四捨五入しています。

米国中期債運用戦略マザーファンド

組入資産の明細

2018年3月12日現在

■ 公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 率	う ち BB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 52,895	千アメリカ・ドル 50,757	千円 5,428,509	% 97.6	% —	% 97.6	% —	% —
合 計	—	—	5,428,509	97.6	—	97.6	—	—

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

B 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

銘 柄	当 期				末		償 還 年 月 日
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ・ドル…アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	13,640	12,723	1,360,781	2023/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.1250	13,120	12,664	1,354,507	2024/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	13,400	12,682	1,356,428	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	12,735	12,686	1,356,791	2025/02/28	
合 計	—	—	52,895	50,757	5,428,509	—	

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

投資信託財産の構成

2018年3月12日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 5,428,509	% 97.6	千円 5,428,509	% 97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	131,853	2.4	131,853	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	5,560,363	100.0	5,560,363	100.0

* 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1 アメリカ・ドル=106.95円

* 当期末における外貨建資産（5,433,942千円）の投資信託財産総額（5,560,363千円）に対する比率 97.7%

米国中期債運用戦略マザーファンド

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2018年3月12日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	14,983,789,233円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	70,635,404
公 社 債(評価額)	5,428,509,550
未 収 入 金	9,480,893,900
未 収 利 息	3,241,477
前 払 費 用	508,902
(B) 負 債	9,424,552,234
未 払 金	9,424,552,210
そ の 他 未 払 費 用	24
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	5,559,236,999
元 本	5,779,464,661
次 期 繰 越 損 益 金	△ 220,227,662
(D) 受 益 権 総 口 数	5,779,464,661口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	9,619円

* 元本状況

当初設定元本額	3,245,396,306円
期中追加設定元本額	2,794,904,105円
期中一部解約元本額	260,835,750円

* 元本の内訳

米国中期債運用戦略ファンド(ダイワ投資一任専用)	3,758,953,246円
米国中期債運用戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,020,511,415円

* 元本の欠損

220,227,662円

損益の状況

自2017年11月7日
至2018年3月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	27,467,539円
受 取 利 息	27,503,682
支 払 利 息	△ 36,143
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△216,015,482
売 買 益	281,967,465
売 買 損	△497,982,947
(C) そ の 他 費 用	△ 126,030
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△188,673,973
(E) 解 約 差 損 益 金	5,490,550
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 37,044,239
(G) 計 (D+E+F)	△220,227,662
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	△220,227,662

* 有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

* 解約差損益金とは、一部解約時の解約金額と元本の差額をいい、元本を下回る額は利益として、上回る額は損失として処理されます。

* 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。

資産運用のベストパートナー、だいわすみぎん



大和住銀投信投資顧問

Daiwa SB Investments