

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2期

決算日 2018年9月11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9月11日に第2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

<https://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

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 込金	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
第2期 (2018年9月11日)	9,579	0	△0.2	98.1	—	2,131

*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		
(期首) 2018年3月12日	円 9,603	% —	% 97.8	% —
3月末	9,655	0.5	100.1	—
4月末	9,513	△0.9	100.8	—
5月末	9,590	△0.1	97.4	—
6月末	9,585	△0.2	99.5	—
7月末	9,539	△0.7	98.6	—
8月末	9,597	△0.1	97.1	—
(期末) 2018年9月11日	9,579	△0.2	98.1	—

*騰落率は期首比です。

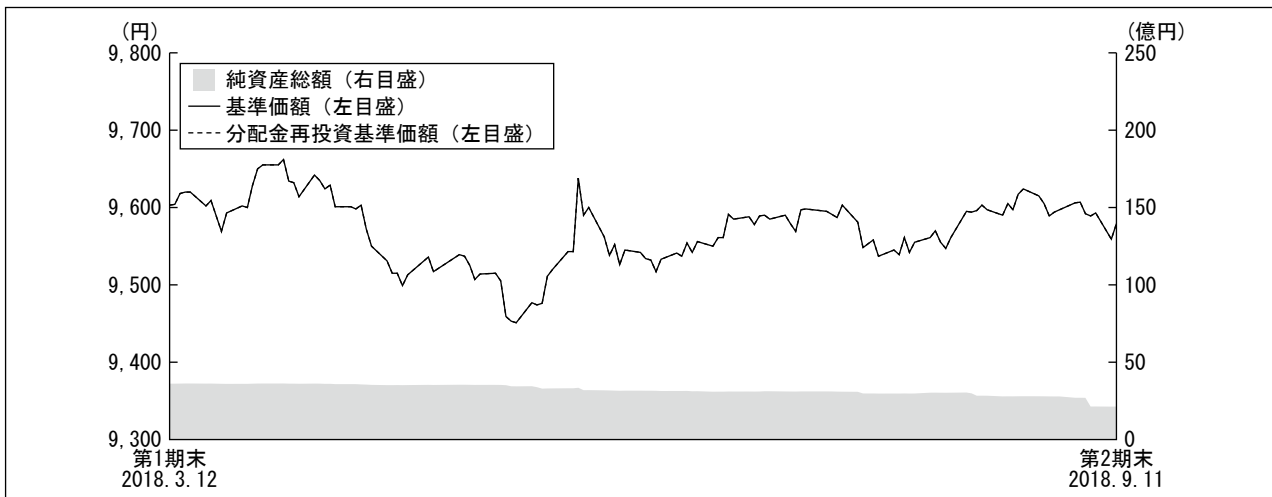
*先物組入比率は、買建比率－売建比率

*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】



*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、期首の基準価額を基準に算出しております。

*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す。

*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。

第2期首：9,603円

第2期末：9,579円（既払分配金 0円）

騰落率：△0.2%（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。

債券からの利息収入と米ドル円相場が円安に振れたことは上昇要因となりましたが、米国債の価格が下落したことや為替ヘッジを行ったことによるコストが下落要因となり、基準価額は下落しました。

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。3月は、米中の貿易摩擦懸念が高まったことなどを受け、利回りは低下しました。5月中旬に、米7年国債利回りは7年ぶりの水準まで上昇しました。主な背景は、4月以降に米中間で緊張緩和の動きが見られたことや、商品市況が上昇したためインフレ懸念が高まったことです。その後、南欧の政情不安や米国の通商問題は利回り低下の材料となった一方、米国の良好な経済情勢や政策金利の引き上げは利回りが上昇する材料となりました。

米ドル円相場は円安に振れました。4月から5月中旬にかけて、米中貿易摩擦懸念の後退や、小売売上高など米国の良好な経済指標の発表を受け、円安の動きとなりました。5月下旬に、南欧の政情不安定化などの影響で投資家のリスク回避姿勢が強まり、一旦円高に振れましたが、米国の利上げや米朝首脳会談が無難に通過したことなどを背景に、7月中旬に113円台まで円安が進行しました。その後、日本銀行が政策を修正するとの観測報道や米中の貿易摩擦激化への警戒感を受け、期末は111円台半ばで取引を終えました。

【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98.1%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、 $\Delta 0.0\%$ 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。期初から3月末にかけて、「守る為替ヘッジ戦略」のみ適用し、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、80%台としました。4月初旬から7月の月末付近は、「攻める為替ヘッジ戦略」で円高局面と判定し、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を増やす調整を行い、80%台から100%程度としました。その後、9月中旬まで「守る為替ヘッジ戦略」のみ適用し70%から80%台とし、期末付近に「攻める為替ヘッジ戦略」で円安局面と判定し、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2期	
	2018年3月13日 ～2018年9月11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)	111

※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。「守る為替ヘッジ戦略」は常時適応し、債券価格とドル円レートが逆方向に変動する動きを捉え、安定した収益確保を図ります。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、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を増減する調整を行います。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2018年3月13日～2018年9月11日		
	金額	比率	
信託報酬	22円	0.227%	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9,580円です。
（投信会社）	(16)	(0.162)	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	(5)	(0.054)	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)	(0.011)	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	0.012	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）	(1)	(0.007)	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）	(1)	(0.005)	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	23	0.240	

* 「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

(2018年3月13日から2018年9月11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 104,095	千円 99,813	千口 1,638,612	千円 1,574,158

利害関係人との取引状況等

(2018年3月13日から2018年9月11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9月11日現在

■親投資信託残高

	期首（前期末）	当期		期末
	口数	口数	評価額	評価額
	千口	千口	千円	千円
米国中期債運用戦略マザーファンド	3,758,953	2,224,436	2,139,240	2,139,240

* 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、4,238,518千口です。

投資信託財産の構成

2018年9月11日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	比率
	千円		%
米国中期債運用戦略マザーファンド	2,139,240	100.0	100.0
投資信託財産総額	2,139,240	100.0	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=111.45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（4,047,992千円）の投資信託財産総額（4,085,205千円）に対する比率 99.1%

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9月11日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,139,240,382円
米国中期債運用戦略マザーファンド(評価額)	2,139,240,382
(B) 負 債	7,501,352
未 払 信 託 報 酬	7,326,993
そ の 他 未 払 費 用	174,359
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,131,739,030
元 本	2,225,476,392
次 期 繰 越 損 益 金	△ 93,737,362
(D) 受 益 権 総 口 数	2,225,476,392口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	9,579円

* 元本状況

期首元本額	3,759,382,237円
期中追加設定元本額	104,441,878円
期中一部解約元本額	1,638,347,723円

* 元本の欠損

93,737,362円

損益の状況

自2018年3月13日
至2018年9月11日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,326,381円
売 買 益	5,224,631
売 買 損	△ 2,898,250
(B) 信 託 報 酬 等	△ 7,501,352
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	△ 5,174,971
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 75,961,510
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 12,600,881
(配 当 等 相 当 額)	(877,294)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 13,478,175)
(F) 計 (C + D + E)	△ 93,737,362
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	△ 93,737,362
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 12,600,881
(配 当 等 相 当 額)	(1,053,612)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 13,654,493)
分 配 準 備 積 立 金	23,694,753
繰 越 損 益 金	△ 104,831,234

* 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 取 益 (費用控除後)	15,799,829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) 收 益 調 整 金	1,053,612
(D) 分 配 準 備 積 立 金	7,894,924
分 配 可 能 額 (A + B + C + D)	24,748,365
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(111.2)
收 益 分 配 金	0
(1 万 口 当 り 收 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9月11日

(第2期：2018年3月13日～2018年9月11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

<https://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 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率			
(設定日) 2017年11月7日	10,000	% —	% —	% —	百万円 3,245
第1期 (2018年3月12日)	9,619	△3.8	97.6	—	5,559
第2期 (2018年9月11日)	9,617	△0.0	97.7	—	4,075

*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 組入比率
	円	騰落率		
(期首) 2018年3月12日	9,619	% —	% 97.6	% —
3月末	9,673	0.6	100.1	—
4月末	9,534	△0.9	100.7	—
5月末	9,616	△0.0	97.1	—
6月末	9,614	△0.1	99.3	—
7月末	9,572	△0.5	98.4	—
8月末	9,634	0.2	96.8	—
(期末) 2018年9月11日	9,617	△0.0	97.7	—

*騰落率は期首比です。

*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】

期首：9,619円

期末：9,617円

騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

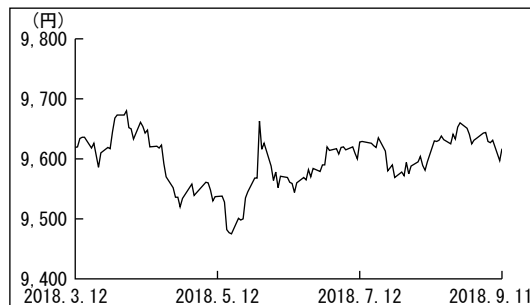
債券からの利息収入と米ドル円相場が円安に振れたことは上昇要因となりましたが、米国債の価格が下落したことや為替ヘッジを行ったことによるコストが下落要因となり、基準価額は下落しました。

【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。3月は、米中の貿易摩擦懸念が高まったことを受け、利回りは低下しました。5月中旬に、米7年国債利回りは7年ぶりの水準まで上昇しました。主な背景は、4月以降に米中間で緊張緩和の動きが見られたことや、商品市況が上昇したためインフレ懸念が高まったことです。その後、南欧の政情不安や米国の通商問題は利回り低下の材料となった一方、米国の良好な経済情勢や政策金利の引き上げは利回りが上昇する材料となりました。

米ドル円相場は円安に振れました。4月から5月中旬にかけて、米中貿易摩擦懸念の後退や、小売売上高など米国の良好な経済指標の発表を受け、円安の動きとなりました。5月下旬に、南欧の政情不安定化などの影響で投資家のリスク回避姿勢が強まり、一旦円高に振れましたが、米国の利上げや米朝首脳会談が無難に通過したことなどを背景に、7月中旬に113円台まで円安が進行しました。その後、日本銀行が政策を修正するとの観測報道や米中の貿易摩擦激化への警戒感を受け、期末は111円台半ばで取引を終えました。

基準価額の推移



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、△0.0%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。期初から3月末にかけて、「守る為替ヘッジ戦略」のみ適用し、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、80%台としました。4月初旬から7月の月末付近は、「攻める為替ヘッジ戦略」で円高局面と判定し、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を増やす調整を行い、80%台から100%程度としました。その後、9月中旬まで「守る為替ヘッジ戦略」のみ適用し70%から80%台とし、期末付近に「攻める為替ヘッジ戦略」で円安局面と判定し、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。「守る為替ヘッジ戦略」は常時適応し、債券価格とドル円レートが逆方向に変動する動きを捉え、安定した収益確保を図ります。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、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を増減する調整を行います。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2018年3月13日～2018年9月11日		
	金額	比率	
その他費用	1円	0.007%	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）	(1)	(0.007)	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
（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	1	0.007	
期中の平均基準価額は9,607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9月11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 36,731	千アメリカ・ドル 35,745	千円 3,983,818	% 97.7	% —	% 97.7	% —	% —
合 計	—	—	3,983,818	97.7	—	97.7	—	—

*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	2.1250	8,851	8,526	950,290	2024/02/29	
US TREASURY N/B	国債証券	1.8750	9,590	9,075	1,011,517	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	9,140	9,072	1,011,165	2025/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	9,150	9,069	1,010,844	2025/08/31	
合 計	—	—	36,731	35,745	3,983,818	—	

*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9月11日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 3,983,818	% 97.5	千円 3,983,818	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	101,386	2.5	101,386	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	4,085,205	100.0	4,085,205	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=111.45円

*当期末における外貨建資産（4,047,992千円）の投資信託財産総額（4,085,205千円）に対する比率 99.1%

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9月11日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	9,887,430,116円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	31,939,143
公 社 債(評価額)	3,983,818,739
未 収 入 金	5,868,702,071
未 収 利 息	2,427,883
前 払 費 用	542,280
(B) 負 債	5,811,439,755
未 払 金	5,811,439,647
そ の 他 未 払 費 用	108
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	4,075,990,361
元 本	4,238,518,530
次 期 繰 越 損 益 金	△ 162,528,169
(D) 受 益 権 総 口 数	4,238,518,530口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	9,617円

* 元本状況	
期首元本額	5,779,464,661円
期中追加設定元本額	104,095,507円
期中一部解約元本額	1,645,041,638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)	2,224,436,293円
米国中期債運用戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,014,082,237円
* 元本の欠損	162,528,169円

損益の状況

自2018年3月13日
至2018年9月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	54,816,713円
受 取 利 息	54,837,482
支 払 利 息	△ 20,769
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 57,184,252
売 買 益	431,891,543
売 買 損	△489,075,795
(C) そ の 他 費 用	△ 349,265
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 2,716,804
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△220,227,662
(F) 解 約 差 損 益 金	64,698,590
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 4,282,293
(H) 計 (D+E+F+G)	△162,528,169
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△162,528,169

*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