

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。

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。



運用報告書（全体版）

第3期

決算日 2019年3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2019年3月11日に第3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。

大和住銀投信投資顧問株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年4月1日に三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友DSアセットマネジメント株式会社となる予定です。

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

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	純資産額
	(分配落)	税金 分配金	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
第3期(2019年3月11日)	9,790	0	2.2	99.7	—	2,357

*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9月11日	円 9,579	% —	% 98.1	% —
9月末	9,599	0.2	100.0	—
10月末	9,613	0.4	99.7	—
11月末	9,699	1.3	99.6	—
12月末	9,724	1.5	98.8	—
2019年1月末	9,669	0.9	98.9	—
2月末	9,739	1.7	98.8	—
(期末) 2019年3月11日	9,790	2.2	99.7	—

*騰落率は期首比です。

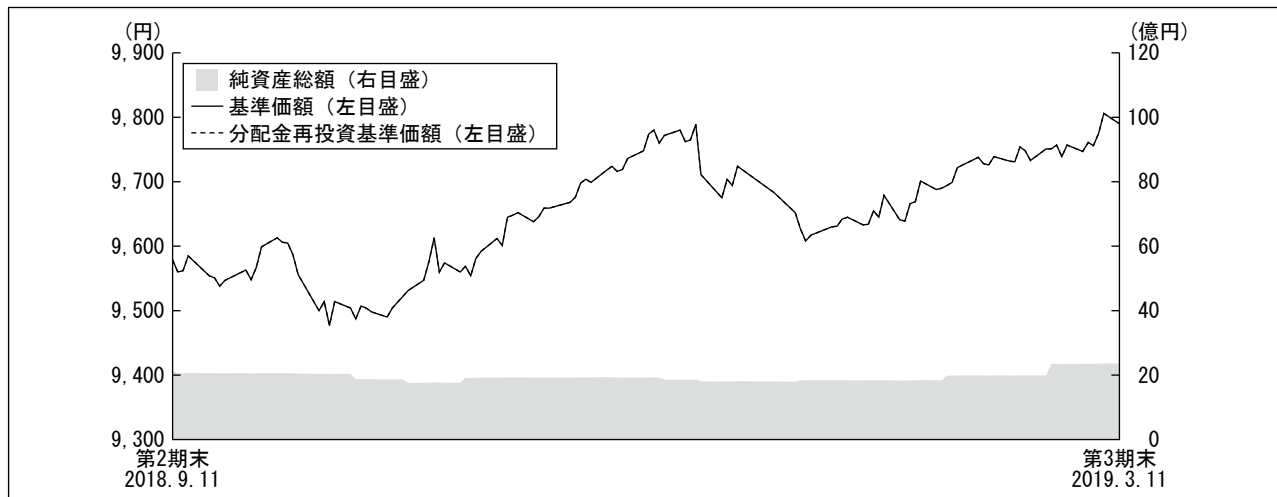
*先物組入比率は、買建比率－売建比率

*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3期首：9,579円

第3期末：9,790円（既払分配金 0円）

騰落率：+2.2%（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。

保有する債券の価格上昇や利息収入が主因となり、基準価額は上昇しました。

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5～7年の中期ゾーンの国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。期初から2018年11月上旬にかけて、米中貿易摩擦が激化すると懸念が和らいだことや、米国で利上げ継続の方針が示されたことなどを背景に、利回りは上昇しました。その後、米国中間選挙の結果、追加の減税政策の法制化は困難との観測が高まったことや、世界的な株式市場の下落を受けリスク回避姿勢が強まったこと、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が政策を変更する考えを示したことなどが材料となり、利回りは低下しました。

米ドル円相場は小幅円高に振れました。期初から2018年12月半ばにかけては、英国やイタリアの政情不安が高まったことなどは円高材料となった一方、米中対立の緩和期待や、雇用統計など米国での強い経済指標の発表を受け、円安が優勢となりました。12月半ばから2019年の年初にかけては、米国で景気減速が意識される中、当面利上げが継続される方針が示されたことなどが影響し、円高の動きとなりました。その後、米国の金融当局がハト派寄りの方針に転じたことなどが好感され、米ドルは買い戻される展開となりました。

【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99.7%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、+2.4%となりました。

債券ポートフォリオは、5年～7年までの残存期間毎の米国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。ヘッジ比率は、20%台前半から60%台前半の範囲で調整しました。「守る為替ヘッジ戦略」は、前期末から2018年10月上旬は80%程度とし、10月中旬から12月中旬にかけて、徐々に30%台後半まで下げました。その後、徐々に引き上げ、期末は60%台前半としました。次の2つの期間には、「攻める為替ヘッジ戦略」で円安局面と判定し、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を25%程度減らす調整を行いました。前期末から2018年10月中旬と、10月の月末付近から11月中旬の時期で、米ドル円レートは、それぞれ、111円台半ばから112円程度と、112円程度から114円程度に上昇しました。

【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。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

【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3期	
	2018年9月12日 ～2019年3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)		204

※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、債券価格と米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、米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9月12日～2019年3月11日		
	金額	比率	
信託報酬	22円	0.225%	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9,674円です。
（投信会社）	(16)	(0.161)	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	0.013	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)	(0.008)	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	0.238	

* 「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9月12日から2019年3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 716,248	千円 698,040	千口 543,040	千円 523,089

利害関係人との取引状況等

(2018年9月12日から2019年3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

2019年3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
米国中期債運用戦略マザーファンド	千口 2,224,436	千口 2,397,644	千円	千円 2,362,159

*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、4,398,712千口です。

投資信託財産の構成

2019年3月11日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	比率
米国中期債運用戦略マザーファンド	千円 2,362,159		% 100.0
投資信託財産総額	2,362,159		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=110.95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（4,314,460千円）の投資信託財産総額（4,334,529千円）に対する比率 99.5%

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

(2019年3月11日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,362,159,693円
米国中期債運用戦略マザーファンド(評価額)	2,362,159,693
(B) 負 債	4,482,624
未 払 信 託 報 酬	4,378,470
そ の 他 未 払 費 用	104,154
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,357,677,069
元 本	2,408,163,509
次 期 繰 越 損 益 金	△ 50,486,440
(D) 受 益 権 総 口 数	2,408,163,509口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	9,790円

* 元本状況

期首元本額	2,225,476,392円
期中追加設定元本額	720,361,532円
期中一部解約元本額	537,674,415円

* 元本の欠損

50,486,440円

損益の状況

自2018年9月12日
至2019年3月11日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	47,389,098円
売 買 益	51,713,226
売 買 損	△ 4,324,128
(B) 信 託 報 酬 等	△ 4,482,624
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	42,906,474
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 61,995,860
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 31,397,054
(配 当 等 相 当 額)	(8,674,912)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 40,071,966)
(F) 計 (C + D + E)	△ 50,486,440
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	△ 50,486,440
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 31,397,054
(配 当 等 相 当 額)	(9,917,021)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 41,314,075)
分 配 準 備 積 立 金	39,405,297
繰 越 損 益 金	△ 58,494,683

* 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)	21,300,290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	9,917,021
(D) 分 配 準 備 積 立 金	18,105,007
分 配 可 能 額 (A + B + C + D)	49,322,318
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(204.81)
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：2019年3月11日

(第3期：2018年9月12日～2019年3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	期 騰 落 中 率		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 組 入 比	純 資 産 額 総
		騰 落	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
第2期 (2018年9月11日)	9,617	△0.0		97.7	—	4,075
第3期 (2019年3月11日)	9,852	2.4		99.5	—	4,333

*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	騰 落 率		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 組 入 比
		騰 落	率		
(期 首) 2018年9月11日	円 9,617		% —	% 97.7	% —
9月末	9,639		0.2	100.0	—
10月末	9,658		0.4	99.6	—
11月末	9,748		1.4	99.5	—
12月末	9,776		1.7	98.6	—
2019年1月末	9,725		1.1	98.7	—
2月末	9,799		1.9	98.7	—
(期 末) 2019年3月11日	9,852		2.4	99.5	—

*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

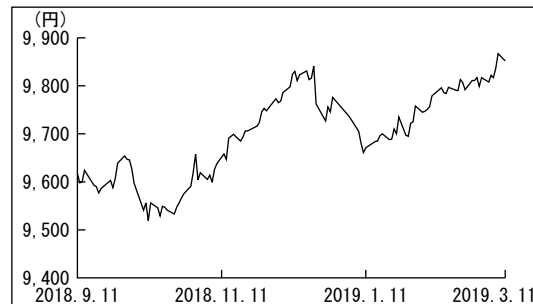
【基準価額等の推移】

期首：9,617円
期末：9,852円
騰落率：+2.4%

【基準価額の主な変動要因】

保有する債券の価格上昇や利息収入が主因となり、基準価額は上昇しました。

基準価額の推移



【投資環境】

米国5~7年の中期ゾーンの国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。期初から2018年11月上旬にかけて、米中貿易摩擦が激化するとの懸念が和らいだことや、米国で利上げ継続の方針が示されたことなどを背景に、利回りは上昇しました。その後、米国中間選挙の結果、追加の減税政策の法制化は困難との観測が高まったことや、世界的な株式市場の下落を受けリスク回避姿勢が強まったこと、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が政策を変更する考えを示したことなどが材料となり、利回りは低下しました。

米ドル円相場は小幅円高に振れました。期初から2018年12月半ばにかけては、英国やイタリアの政情不安が高まったことなどは円高材料となった一方、米中対立の緩和期待や、雇用統計など米国での強い経済指標の発表を受け、円安が優勢となりました。12月半ばから2019年の年初にかけては、米国で景気減速が意識される中、当面利上げが継続される方針が示されたことなどが影響し、円高の動きとなりました。その後、米国の金融当局がハト派寄りの方針に転じたことなどが好感され、米ドルは買い戻される展開となりました。

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、+2.4%となりました。

債券ポートフォリオは、5年～7年までの残存期間毎の米国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。ヘッジ比率は、20%台前半から60%台前半の範囲で調整しました。「守る為替ヘッジ戦略」は、前期末から2018年10月上旬は80%程度とし、10月中旬から12月中旬にかけて、徐々に30%台後半まで下げました。その後、徐々に引き上げ、期末は60%台前半としました。次の2つの期間には、「攻める為替ヘッジ戦略」で円安局面と判定し、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を25%程度減らす調整を行いました。前期末から2018年10月中旬と、10月の月末付近から11月中旬の時期で、米ドル円レートは、それぞれ、111円台半ばから112円程度と、112円程度から114円程度に上昇しました。

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、債券価格と米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、米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9月12日～2019年3月11日		
	金額	比率	
その他費用	1円	0.008%	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)	(0.008)	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	0.008	
期中の平均基準価額は9,724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

2019年3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 38,890	千アメリカ・ドル 38,857	千円 4,311,262	% 99.5	% —	% 99.5	% —	% —
合 計	—	—	4,311,262	99.5	—	99.5	—	—

*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	1.8750	9,940	9,640	1,069,581	2024/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	9,560	9,700	1,076,252	2025/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	2.7500	9,500	9,638	1,069,339	2025/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	2.5000	9,890	9,879	1,096,088	2026/02/28	
合 計	—	—	38,890	38,857	4,311,262	—	

*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

2019年3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 4,311,262	% 99.5	千円 4,311,262	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,266	0.5	23,266	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	4,334,529	100.0	4,334,529	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=110.95円

*当期末における外貨建資産（4,314,460千円）の投資信託財産総額（4,334,529千円）に対する比率 99.5%

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

(2019年3月11日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	7,173,490,856円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,274,246
公 社 債(評価額)	4,311,262,525
未 収 入 金	2,839,755,992
未 収 利 息	2,664,673
前 払 費 用	533,420
(B) 負 債	2,839,898,250
未 払 金	2,839,898,250
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,333,592,606
元 本	4,398,712,301
次 期 繰 越 損 益 金	△ 65,119,695
(D) 受 益 権 総 口 数	4,398,712,301口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	9,852円

* 元本状況

期首元本額	4,238,518,530円
期中追加設定元本額	716,248,784円
期中一部解約元本額	556,055,013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)	2,397,644,837円
米国中期債運用戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,001,067,464円

* 元本の欠損

65,119,695円

損益の状況

自2018年9月12日
至2019年3月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	46,552,245円
受 取 利 息	46,558,073
支 払 利 息	△ 5,828
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	48,920,705
売 買 益	166,790,001
売 買 損	△117,869,296
(C) そ の 他 費 用	△ 305,343
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	95,167,607
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△162,528,169
(F) 解 約 差 損 益 金	20,449,636
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 18,208,769
(H) 計 (D+E+F+G)	△ 65,119,695
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△ 65,119,695

* 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