

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） <ul style="list-style-type: none"><li>・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。</li></ul> 米国中期債運用戦略マザーファンド <ul style="list-style-type: none"><li>・米国債を主要投資対象とします。</li></ul>
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） <ul style="list-style-type: none"><li>・株式への実質投資は行いません。</li><li>・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li></ul> 米国中期債運用戦略マザーファンド <ul style="list-style-type: none"><li>・株式への投資は行いません。</li><li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>
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、分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含まれます。）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6期

決算日 2020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2020年9月11日に第6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。

- 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。
- 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）



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>

# 米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

## 最近5期の運用実績

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 込金	騰落 率			
第2期（2018年9月11日）	円 9,579	円 0	% △0.2	% 98.1	% —	百万円 2,131
第3期（2019年3月11日）	9,790	0	2.2	99.7	—	2,357
第4期（2019年9月11日）	10,088	0	3.0	99.1	—	6,102
第5期（2020年3月11日）	10,497	0	4.1	95.1	—	3,084
第6期（2020年9月11日）	10,972	0	4.5	99.6	—	2,551

\*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。

\*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) 2020年3月11日	円 10,497	% —	% 95.1	% —
3月末	10,985	4.6	98.8	—
4月末	10,952	4.3	98.7	—
5月末	10,966	4.5	98.2	—
6月末	11,019	5.0	98.9	—
7月末	10,982	4.6	97.3	—
8月末	10,922	4.0	98.2	—
(期末) 2020年9月11日	10,972	4.5	99.6	—

\*騰落率は期首比です。

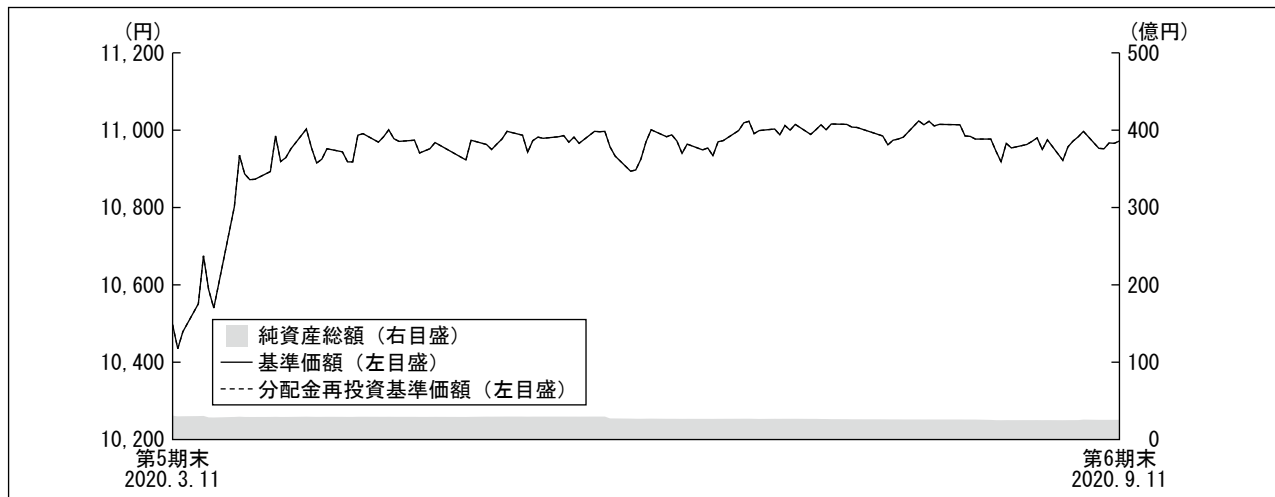
\*先物組入比率は、買建比率－売建比率

\*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、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。

第6期首：10,497円

第6期末：10,972円（既払分配金 0円）

騰落率：+4.5%（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、円安を享受したことによって、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年～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。3月中旬は、経済情勢の先行き不透明感が高まる中、多くの金融資産が現金化される動きなどの影響で、利回りは上昇しました。3月下旬は、FRB（米連邦準備制度理事会）が量的緩和策を強化したことなどから、利回りは低下に転じました。その後、4月中旬や6月上旬などに、FRBによる投資不適格級の社債購入を可能とする資金供給策などを背景に景気は下支えされるとの見方や、米国の雇用統計で予想外に失業率や雇用者数が改善したことなどが材料となり、利回りが上昇する場面がありました。しかし、米国で新型コロナウイルスの感染者数が増加したことや、FRB議長が雇用情勢や景気の回復に時間を要するとの考えを示したことなどから、利回り低下が優勢となりました。

米ドル円相場は円安に振れました。期初から3月下旬にかけては、世界景気の先行き不透明感の高まりを受け、企業や金融機関から基軸通貨である米ドルに需要が高まったことなどから、一時111円台後半まで円安が進行しました。その後は、FRBによる資金供給策や、新型コロナウイルスの治療薬開発への期待、欧米での経済活動再開への動きなどを受け、先行き不透明感が和らぎ、米ドルへの需要が後退し過剰感が高まりました。こうしたことを背景に、米ドルはユーロなど広範な通貨に対して下落したことが影響し、円高の動きが優勢となりました。また、米国と中国が互いに在外公館を閉鎖するなど両国の緊張が高まったことや、米国議会での追加経済対策をめぐる与野党協議の行き詰まりなども円高材料となりました。

### 【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99.6%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、+4.8%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。為替ヘッジ比率は、20%台から90%台の範囲で調整しました。大部分の期間は50%台から80%台とし、期初と6月半ばは20%台、3月半ばと8月後半は40%台、6月前半は90%台としました。「守る為替ヘッジ戦略」は、大部分の期間は40%台から50%台とし、6月前半と期末付近は60%台から70%程度としました。「攻める為替ヘッジ戦略」は、3月下旬から8月半ばの大部分の期間は円高判定、期初と6月半ばに円安判定とし、「守る為替ヘッジ戦略」を基準に為替ヘッジ比率を25%程度増減する調整を行いました。3月の中旬、4月月初、6月下旬、8月半ばから期末にかけては適用しませんでした。

### 【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】

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6期	
	2020年3月12日 ～2020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)		1,153

※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」を基準に為替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
	2020年3月12日～2020年9月11日		
	金額	比率	
信託報酬	26円	0.233%	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10,971円です。
（投信会社）	(18)	(0.166)	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	(6)	(0.055)	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	2	0.016	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)	(0.010)	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)	(0.006)	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	27	0.249	

\* 「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。

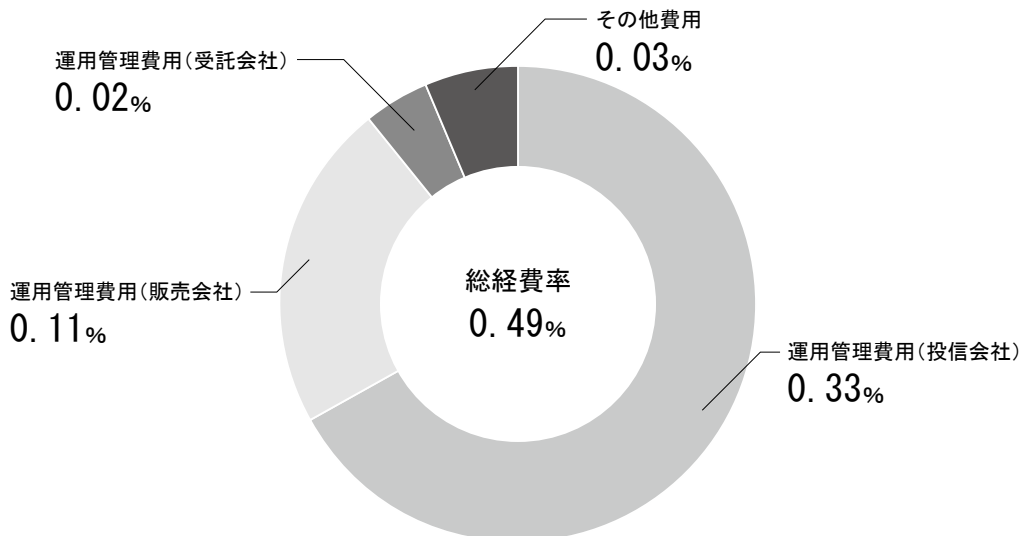
\* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

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。

## 米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

### 参考情報 総経費率（年率換算）



\*各費用は、前掲「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、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

\*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。

\*上記の前提条件で算出しているため、「1万口当りの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、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、売買委託手数料及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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.49%です。

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2020年3月12日から2020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 ヅ ー フ ェ ン ド	千口 135,336	千円 150,421	千口 758,784	千円 832,273

# 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等

(2020年3月12日から2020年9月11日まで)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## 組入資産の明細

2020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	額
米国中期債運用戦略マザーファンド	千口 2,919,714	千口 2,296,265	千円	千円 2,551,840

\*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、2,296,265千口です。

## 投資信託財産の構成

2020年9月11日現在

項目	当期		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 2,551,840		% 99.7
コール・ローン等、その他	6,710		0.3
投資信託財産総額	2,558,550		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=106.16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（2,542,747千円）の投資信託財産総額（2,559,881千円）に対する比率 99.3%



# 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

(2020年9月11日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,558,550,200円
コール・ローン等	99,996
米国中期債運用戦略マザーファンド(評価額)	2,551,840,053
未 収 入 金	6,610,151
(B) 負 債	6,606,934
未 払 信 託 報 酬	6,453,376
そ の 他 未 払 費 用	153,558
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	2,551,943,266
元 本	2,325,808,288
次 期 繰 越 損 益 金	226,134,978
(D) 受 益 権 総 口 数	2,325,808,288口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,972円

\*元本状況

期首元本額	2,938,620,203円
期中追加設定元本額	137,624,805円
期中一部解約元本額	750,436,720円

## 損益の状況

自2020年3月12日  
至2020年9月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 4円
支 払 利 息	△ 4
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	111,053,527
売 買 益	137,230,778
売 買 損	△ 26,177,251
(C) 信 託 報 酬 等	△ 6,606,934
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	104,446,589
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	115,449,335
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,239,054
(配 当 等 相 当 額)	( 48,146,276)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 41,907,222)
(G) 計 (D+E+F)	226,134,978
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	226,134,978
追 加 信 託 差 損 益 金	6,239,054
(配 当 等 相 当 額)	( 48,298,021)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 42,058,967)
分 配 準 備 積 立 金	219,895,924

\*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)	20,963,137円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	83,483,452
(C) 収 益 調 整 金	48,298,021
(D) 分 配 準 備 積 立 金	115,449,335
分 配 可 能 額 (A+B+C+D)	268,193,945
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	( 1,153.12)
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：2020年9月11日

(第6期：2020年3月12日～2020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	<ul style="list-style-type: none"><li>・ 株式への投資は行いません。</li><li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>



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>

# 米国中期債運用戦略マザーファンド

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	公社債率 組入比	債券先物率 組入比	純資産額
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
第4期 (2019年9月11日)	10,174	3.3	98.9	—	6,112
第5期 (2020年3月11日)	10,601	4.2	94.8	—	3,095
第6期 (2020年9月11日)	11,113	4.8	99.6	—	2,551

\*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。

\*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
(期首) 2020年3月11日	10,601	—	94.8	—
3月末	11,098	4.7	98.4	—
4月末	11,069	4.4	98.7	—
5月末	11,087	4.6	98.1	—
6月末	11,149	5.2	98.8	—
7月末	11,116	4.9	96.8	—
8月末	11,060	4.3	97.9	—
(期末) 2020年9月11日	11,113	4.8	99.6	—

\*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：10,601円

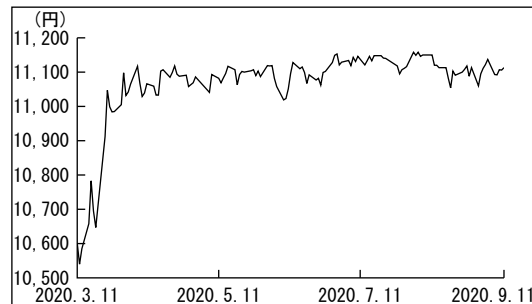
期末：11,113円

騰落率：+4.8%

### 【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、円安を享受したことによって、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年～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。3月中旬は、経済情勢の先行き不透明感が高まる中、多くの金融資産が現金化される動きなどの影響で、利回りは上昇しました。3月下旬は、FRB（米連邦準備制度理事会）が量的緩和策を強化したことなどから、利回りは低下に転じました。その後、4月中旬や6月上旬などに、FRBによる投資不適格級の社債購入を可能とする資金供給策などを背景に景気は下支えされるとの見方や、米国の雇用統計で予想外に失業率や雇用者数が改善したことなどが材料となり、利回りが上昇する場面がありました。しかし、米国で新型コロナウイルスの感染者数が増加したことや、FRB議長が雇用情勢や景気の回復に時間を要するとの考えを示したことなどから、利回り低下が優勢となりました。

米ドル円相場は円安に振れました。期初から3月下旬にかけては、世界景気の先行き不透明感の高まりを受け、企業や金融機関から基軸通貨である米ドルに需要が高まったことなどから、一時111円台後半まで円安が進行しました。その後は、FRBによる資金供給策や、新型コロナウイルスの治療薬開発への期待、欧米での経済活動再開への動きなどを受け、先行き不透明感が和らぎ、米ドルへの需要が後退し過剰感が高まりました。こうしたことを背景に、米ドルはユーロなど広範な通貨に対して下落したことが影響し、円高の動きが優勢となりました。また、米国と中国が互いに在外公館を閉鎖するなど両国の緊張が高まったことや、米国議会での追加経済対策をめぐる与野党協議の行き詰まりなども円高材料となりました。

# 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、+4.8%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。為替ヘッジ比率は、20%台から90%台の範囲で調整しました。大部分の期間は50%台から80%台とし、期初と6月半ばは20%台、3月半ばと8月後半は40%台、6月前半は90%台としました。「守る為替ヘッジ戦略」は、大部分の期間は40%台から50%台とし、6月前半と期末付近は60%台から70%程度としました。「攻める為替ヘッジ戦略」は、3月下旬から8月半ばの大部分の期間は円高判定、期初と6月半ばに円安判定とし、「守る為替ヘッジ戦略」を基準に為替ヘッジ比率を25%程度増減する調整を行いました。3月の中旬、4月月初、6月下旬、8月半ばから期末にかけては適用しませんでした。

## 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」を基準に為替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
	2020年3月12日～2020年9月11日		
	金額	比率	
その他費用	1円	0.010%	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)	(0.010)	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	0.010	
期中の平均基準価額は11,097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

## 売買及び取引の状況

(2020年3月12日から2020年9月11日まで)

### ■公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 7,394	千アメリカ・ドル 11,818

\*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

## 主要な売買銘柄

(2020年3月12日から2020年9月11日まで)

### ■公社債

当		期	
買	付	売	付
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
US TREASURY N/B 0.5 08/31/27	640,701	US TREASURY N/B 2.75 08/31/25	806,699
US TREASURY N/B 2.5 02/28/26	58,925	US TREASURY N/B 2.5 02/28/26	196,795
US TREASURY N/B 1.125 02/28/27	48,852	US TREASURY N/B 1.375 08/31/26	153,587
US TREASURY N/B 2.75 08/31/25	37,147	US TREASURY N/B 1.125 02/28/27	104,457

\*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

## 利害関係人との取引状況等

(2020年3月12日から2020年9月11日まで)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

# 米国中期債運用戦略マザーファンド

## 組入資産の明細

2020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 22,705	千アメリカ・ドル 23,942	千円 2,541,768	% 99.6	% —	% 99.6	% —	% —
合 計	—	—	2,541,768	99.6	—	99.6	—	—

\*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	2.5000	5,375	6,008	637,879	2026/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	1.3750	5,535	5,862	622,387	2026/08/31	
US TREASURY N/B	国債証券	1.1250	5,780	6,040	641,309	2027/02/28	
US TREASURY N/B	国債証券	0.5000	6,015	6,030	640,193	2027/08/31	
合 計	—	—	22,705	23,942	2,541,768	—	

\*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

2020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 2,541,768	% 99.3	千円 2,541,768	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,112	0.7	18,112	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	2,559,881	100.0	2,559,881	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=106.16円

\*当期末における外貨建資産（2,542,747千円）の投資信託財産総額（2,559,881千円）に対する比率 99.3%

# 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

(2020年9月11日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,355,145,183円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	13,084,986
公 社 債(評価額)	2,541,768,885
未 収 入 金	1,799,312,939
未 収 利 息	889,222
前 払 費 用	89,151
(B) 負 債	1,803,391,105
未 払 金	1,796,780,900
未 払 解 約 金	6,610,151
そ の 他 未 払 費 用	54
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,551,754,078
元 本	2,296,265,683
次 期 繰 越 損 益 金	255,488,395
(D) 受 益 権 総 口 数	2,296,265,683口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	11,113円

\*元本状況

期首元本額	2,919,714,431円
期中追加設定元本額	135,336,016円
期中一部解約元本額	758,784,764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)	2,296,265,683円
--------------------------	----------------

## 損益の状況

自2020年3月12日  
至2020年9月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	23,808,721円
受 取 利 息	23,821,955
支 払 利 息	△ 13,234
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	114,762,797
売 買 益	219,062,235
売 買 損	△104,299,438
(C) そ の 他 費 用	△ 283,576
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	138,287,942
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	175,603,944
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 73,489,018
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,085,527
(H) 計 (D+E+F+G)	255,488,395
次 期 繰 越 損 益 金(H)	255,488,395

\*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。