

トレンド・キャッチ 戦略ファンド (愛称:クラッシュハンター)

運用報告書(全体版) 第1期

(決算日 2021年6月14日)
(作成対象期間 2020年12月14日～2021年6月14日)

★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／株式		
信 託 期 間	約 5 年間（2020年12月14日～2025年12月12日）		
運 用 方 針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	当 フ ァ ン ド	イ、ケイマン籍の外国投資信託 「米国株式イントラデイ・ モメンタム・ファンド（円建 て・クラスA）」の受益証券 ロ、ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド の受益証券	
	ダイワ・マネー ポートフォリオ・ マザーファンド	円建ての債券	
組 入 制 限	当 フ ァ ン ド の 投資信託証券組入上限比率	無制限	
	マ ザ ー フ ァ ン ド の 株 式 組 入 上 限 比 率	純資産総額の10% 以下	
分 配 方 針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 （評価益を含みます。）等とし、原則として、信 託財産の成長に資することを目的に、基準価額の 水準等を勘案して分配金額を決定します。ただ し、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわ ないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申
上げます。

当ファンドは、米国の株価指数先物取引の
売買により信託財産の成長をめざしておりま
す。当作成期につきましてもそれに沿った運
用を行ないました。ここに、運用状況をご報
告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、
お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先(コールセンター)
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

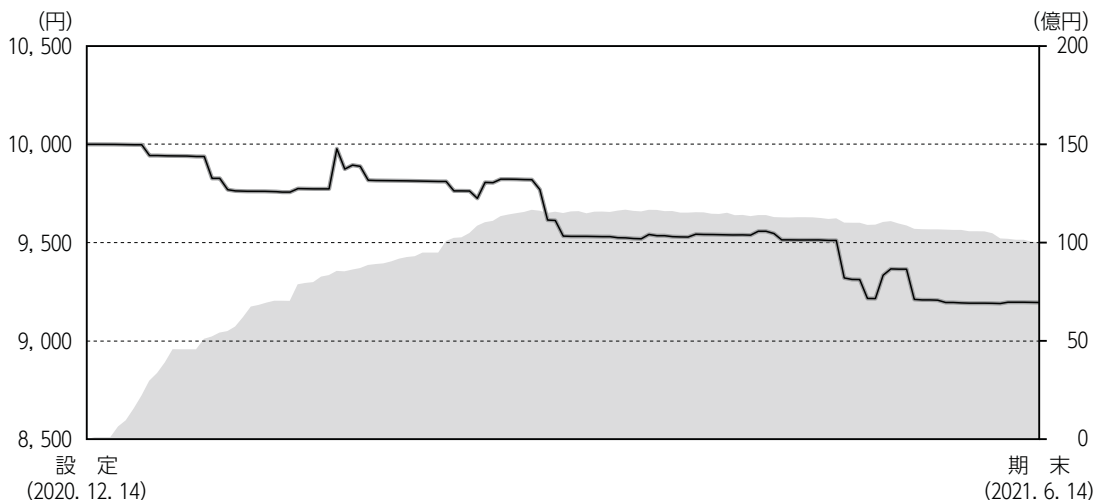
決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額
	(分 配 落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率			
1 期末 (2021年 6 月14日)	円 9,195	円 0	% △ 8.1	% —	% 99.3	百万円 10,014

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
(注 4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



* 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す。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：9,195円（分配金0円）

騰落率：△8.1%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

「モメンタム・ファンド」の受益証券へ投資し、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざした結果、当作成期の市場動向が比較的落ち着いていたことから、大きく変動したときにリターンを獲得する当戦略が奏功せず、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

※モメンタム・ファンド：米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド（円建て・クラスA）

トレンド・キャッチ戦略ファンド

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 率
		騰 落 率		
(期 首) 2020年12月14日	円 10,000	% —	% —	% —
12月末	9,940	△ 0.6	—	73.7
2021年 1 月末	9,977	△ 0.2	—	98.1
2 月末	9,725	△ 2.8	—	94.3
3 月末	9,535	△ 4.7	—	99.2
4 月末	9,513	△ 4.9	—	99.5
5 月末	9,193	△ 8.1	—	99.6
(期 末) 2021年 6 月14日	9,195	△ 8.1	—	99.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2020. 12. 14 ~ 2021. 6. 14)

■ 米国株式市況

米国株式市場は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスに関してワクチンの接種が着実に進展していることで強含みました。2021年2月中旬から3月中旬にかけては、高値警戒感や米国金利の上昇への警戒感から上値が重い展開となりましたが、追加経済対策が議会を通過したことや大規模なインフラ（社会基盤）投資計画への期待もあり、株価は底堅く推移しました。当作成期の後半は、雇用統計や各種景況感指数など好調な経済指標の発表が続き、米国経済の力強さが好感されたこともあり、株価は上昇基調で推移しました。

■ 国内短期金融市況

日銀のマイナス金利政策の影響により、短期の国債利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

(2020. 12. 14 ~ 2021. 6. 14)

■当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、ケイマン籍の外国投資信託「モメンタム・ファンド」の受益証券を高位で組み入れ、信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

■モメンタム・ファンド

円建て短期公社債等へ投資を行うとともに、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざしました。

トレンド・キャッチ戦略では、米国株式市場の取引時間内における S & P 500 株価指数先物価格のトレンドを捉えることをめざしました。S & P 500 株価指数先物価格が日中に前日比で一定率以上上昇した場合には株価指数先物取引を買建て、一定率以上下落した場合には株価指数先物取引を売建てました。株価指数先物取引はすべて当該取引日の取引終了までに反対売買を行って損益を確定しました。

当作成期においては、インフレ懸念から金利上昇リスクが意識され散発的に下落する局面があったものの、本格的なショックへとつながる局面は訪れませんでした。そのような環境下においては、リーマン・ショックやコロナショックなどの大きな下落局面とは異なり、日中に一度発生した下落トレンドが消失、反転する場面が度々みられ、トレンド・キャッチ戦略にとっては逆風の環境となりました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当作成期は、分配対象額を計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月14日	～2021年 6月14日
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	—

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- （注3）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

■当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、引き続き、ケイマン籍の外国投資信託「モメンタム・ファンド」の受益証券を高位で組み入れ、信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

■モメンタム・ファンド

円建て短期公社債等へ投資を行うとともに、トレンド・キャッチ戦略に基づく米国の株価指数先物取引の売買により収益の獲得をめざします。

トレンド・キャッチ戦略では、米国株式市場の取引時間内におけるS & P 500株価指数先物価格のトレンドを捉えることをめざします。S & P 500株価指数先物価格が日中に前日比で一定率以上上昇した場合には株価指数先物取引を買建て、一定率以上下落した場合には株価指数先物取引を売建てます。株価指数先物取引はすべて当該取引日の取引終了までに反対売買を行って損益を確定します。株価指数先物取引の買建または売建のポジション総額は、見込み純資産総額の3倍程度を上限とします。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 12. 14～2021. 6. 14)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	60円	0. 620%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9, 619円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0. 193)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(40)	(0. 414)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0. 014)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0. 004	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 004)	監査費用は、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)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	60	0. 624	

(注 1) 当作成期中の費用（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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

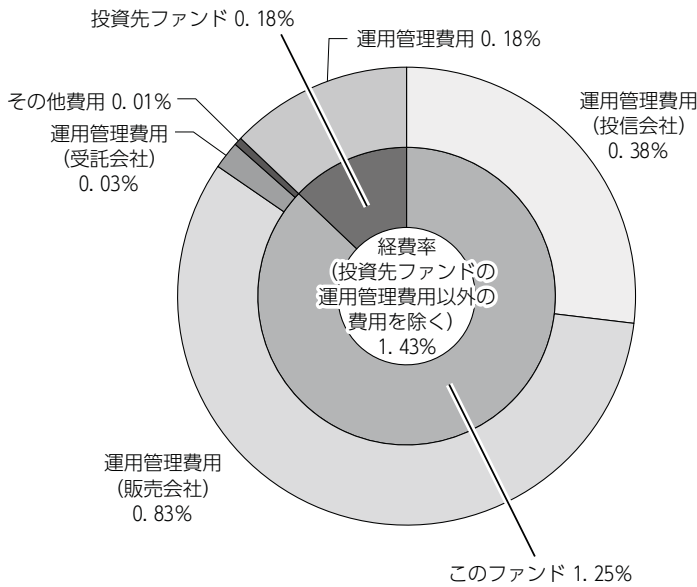
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンド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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、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経費率（年率）は1.43%です。



経費率（①＋②）	1.43%
①このファンドの費用の比率	1.25%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.18%

(注 1) ①の費用は、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す。

(注 2) 各費用は、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。

(注 3) 各比率は、年率換算した値です。

(注 4) 投資先ファンドとは、この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。）です。

(注 5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注 6) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注 7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、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異なります。

(注 8) 投資ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月14日から2021年 6月14日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国（邦貨建）	1,270.9457197	12,364,890	181.0221435	1,678,600

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託受益証券

(2020年12月14日から2021年 6月14日まで)

当 期							
買 付				売 付			
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
RED ARC GLOBAL INVESTMENTS TRUST US EQUITY INTRADAY MOMENTUM FUND JPY CLASS A（ケイマン諸島）	1,270.9457197	12,364,890	9,728	RED ARC GLOBAL INVESTMENTS TRUST US EQUITY INTRADAY MOMENTUM FUND JPY CLASS A（ケイマン諸島）	181.0221435	1,678,600	9,272

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設 定 時 保 有 額	当作成期中 設 定 額	当作成期中 解 約 額	当作成期末 保 有 額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
100	—	100	—	当初設定時における取得とその処分

(注 1) 金額は元本ベース。

(注 2) 単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年12月14日から2021年 6月14日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	9	10	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 （ケイマン諸島） RED ARC GLOBAL INVESTMENTS TRUST US EQUITY INTRADAY MOMENTUM FUND JPY CLASS A	1,089.9235762	9,942,282	99.3

(注 1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注 2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワ・マネーポート フォリオ・マザーファンド	9	9

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

項 目	2021年 6月14日現在 当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 9,942,282	% 97.5
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	9	0.0
コール・ローン等、その他	258,156	2.5
投資信託財産総額	10,200,449	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	2021年 6月14日現在 当 期 末
(A) 資産	10,255,149,650円
コール・ローン等	203,456,789
投資信託受益証券（評価額）	9,942,282,862
ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド（評価額）	9,999
未収入金	109,400,000
(B) 負債	240,566,949
未払金	54,700,000
未払解約金	128,193,111
未払信託報酬	57,291,973
その他未払費用	381,865
(C) 純資産総額（A－B）	10,014,582,701
元本	10,890,969,879
次期繰越損益金	△ 876,387,178
(D) 受益権総口数	10,890,969,879口
1万口当り基準価額（C／D）	9,195円

* 期首における元本額は100,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は13,325,685,217円、同解約元本額は2,534,715,338円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,195円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は876,387,178円です。

■損益の状況

項 目	当 期	当期 自2020年12月14日 至2021年 6月14日
(A) 配当等収益	△	49,601円
受取利息		11,879
支払利息	△	61,480
(B) 有価証券売買損益	△	644,227,747
売買益		86,943,421
売買損	△	731,171,168
(C) 信託報酬等	△	57,673,977
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△	701,951,325
(E) 追加信託差損益金	△	174,435,853
(配当等相当額)	(△	86,276)
(売買損益相当額)	(△	174,349,577)
(F) 合計（D＋E）	△	876,387,178
次期繰越損益金（F）	△	876,387,178
追加信託差損益金	△	174,435,853
(配当等相当額)	(△	86,276)
(売買損益相当額)	(△	174,349,577)
繰越損益金	△	701,951,325

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	0
(h) 受益権総口数	10,890,969,879口

米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド（円建て・クラスA）

当ファンド（トレンド・キャッチ戦略ファンド）の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資信託「米国株式イントラデイ・モメンタム・ファンド（円建て・クラスA）」は、2021年6月14日現在、第1期決算を迎えておりません。

<補足情報>

当ファンド（トレンド・キャッチ戦略ファンド）が投資対象としている「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の決算日（2020年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年6月14日）現在におけるダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの主要な売買銘柄

2020年12月14日～ 2021年6月14日における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

2021年6月14日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2020年12月9日）

（作成対象期間 2019年12月10日～2020年12月9日）

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド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。

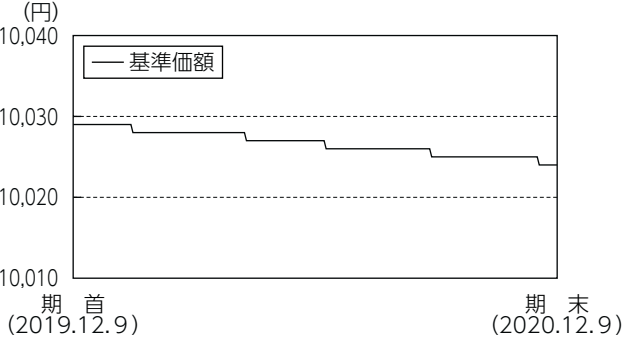
運 用 方 針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	円建ての債券
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率
	騰 落 率	組 入 比	
	円	%	%
(期首)2019年12月9日	10,029	—	—
12月末	10,029	0.0	—
2020年1月末	10,028	△0.0	—
2月末	10,028	△0.0	—
3月末	10,028	△0.0	—
4月末	10,027	△0.0	—
5月末	10,027	△0.0	—
6月末	10,026	△0.0	—
7月末	10,026	△0.0	—
8月末	10,026	△0.0	—
9月末	10,025	△0.0	—
10月末	10,025	△0.0	—
11月末	10,024	△0.0	—
(期末)2020年12月9日	10,024	△0.0	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,029円 期末：10,024円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆ 投資環境について

○ 国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

◆ ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

◆ ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については掲掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■ 主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■ 組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■ 投資信託財産の構成

2020年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	73,499,280	100.0
投資信託財産総額	73,499,280	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	73,499,280,005円
コール・ローン等	73,499,280,005
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A－B)	73,499,280,005
元本	73,320,433,569
次期繰越損益金	178,846,436
(D) 受益権総口数	73,320,433,569口
1万口当り基準価額(C／D)	10,024円

* 期首における元本額は38,285,006,118円、当作成期間中における追加設定元本額は92,065,519,457円、同解約元本額は57,030,092,006円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ米ドル・プルファンド（適格機関投資家専用）7,165,012,965円、ダイワ米ドル・ベアファンド（適格機関投資家専用）12,332,468,365円、ダイワ・マネーポートフォリオ（FOFs用）（適格機関投資家専用）1,089,639円、ダイワ・リートベア・ファンド（適格機関投資家専用）1,215,141,541円、ダイワ／パリュウ・パートナーズ チャイナ・ヘルスケア・フォーカス9,976円、通貨選択型 米国リート・αクワトロ（毎月分配型）159,141円、通貨選択型アメリカン・エクイティ・αクワトロ（毎月分配型）159,141円、オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）9,963円、オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定額分配コース）9,963円、オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定額分配コース）9,963円、オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）9,963円、N Y ダウ・トリプル・レバレッジ209,466,367円、世界セレクトティブ株式オープン（為替ヘッジあり／年1回決算型）998円、世界セレクトティブ株式オープン（為替ヘッジあり／年2回決算型）998円、FANG+プルベア・マネーポートフォリオ992,420円、AHLターゲットリスク・ライト戦略ファンド（適格機関投資家専用）6,417,784,873円、ダイワユーロベア・ファンド2（2倍、非リバランス型）（適格機関投資家専用）9,837,126,024円、ダイワユーロベア・ファンド（2倍、非リバランス型）（適格機関投資家専用）29,412,815,332円、ダイワ米ドルベア・ファンド（2倍、非リバランス型）（適格機関投資家専用）1,582,648,295円、ダイワ／ロジャーズ国際コモディティTM・ファンド2,417,017円、ダイワ／フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）日本円・コース（毎月分配型）998円、ダイワ／フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）ブラジル・レアル・コース（毎月分配型）998円、ダイワ／フィデリティ・アジア・ハイ・イールド債券ファンド（通貨選択型）アジア通貨・コース（毎月分配型）998円、ダイワTOP I Xベア・ファンド（適格機関投資家専用）5,141,916,506円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券α（毎月分配型）9,949円、ダイワ米国国債7－10年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ－U Sトリアングル－997,374円、ダイワ豪ドル建て高利回り証券ファンド－予想分配金提示型－173,802円で

す。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,024円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月10日 至2020年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 28,774,653円
受取利息	1,464,675
支払利息	△ 30,239,328
(B) その他費用	△ 1,598,733
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 30,373,386
(D) 前期繰越損益金	112,547,273
(E) 解約差損益金	△154,205,994
(F) 追加信託差損益金	250,878,543
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	178,846,436
次期繰越損益金(G)	178,846,436

（注1）解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

（注2）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。