

世界M&A戦略株ファンド (愛称：目利き力)

運用報告書（全体版） 第1期

(決算日 2021年6月1日)

(作成対象期間 2020年12月15日～2021年6月1日)

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し上げます。

当ファンドは、日本を含む世界のM&A関連企業の株式等に投資し、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/>

★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／内外／株式	
信託期間	約5年間(2020年12月15日～2025年12月1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「グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド(ヘッジなし・クラス)」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーアセット・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、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、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		公社債 組入比率	投資信託 受益組入 証券比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
1期末(2021年6月1日)	円 11,036	円 750	% 17.9	11,995	% 20.0	% -	% 97.7	百万円 12,694

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World 指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

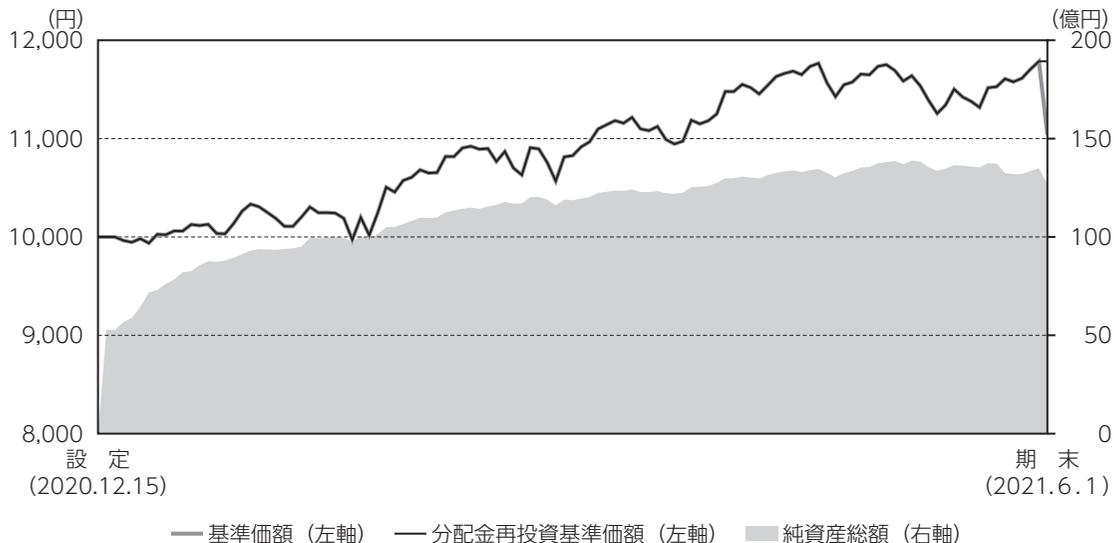
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。



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：11,036円（分配金750円）

騰落率：17.9%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

グローバル株式市況が上昇したことや米ドルが対円で上昇（円安）したことなどがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

世界M&A戦略株ファンド

年 月 日	基 準 価 額		MSCI AC World指数 (配当込み、円換算)		公 社 債 組 入 比	投 資 信 託 受 組 証 券	入 益 証 比 入 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首) 2020年12月15日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -	% -
12月末	10,116	1.2	10,164	1.6	-	-	95.5
2021年 1 月末	10,199	2.0	10,452	4.5	-	-	97.9
2 月末	10,702	7.0	10,849	8.5	-	-	97.4
3 月末	11,182	11.8	11,420	14.2	-	-	98.5
4 月末	11,752	17.5	11,856	18.6	-	-	98.2
5 月末	11,786	17.9	12,028	20.3	-	-	92.0
(期末) 2021年 6 月 1 日	11,786	17.9	11,995	20.0	-	-	97.7

(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

(2020.12.15~2021.6.1)

■グローバル株式市況

グローバル株式市況は上昇しました。

グローバル株式市況は、当作成期首より上昇基調で推移しました。米国で民主党が大統領選挙と上下両院を制する「トリプルブルー」となり、バイデン新政権の経済政策が進めやすくなるとの期待が高まったことや、新型コロナウイルスワクチンの接種が着実に進展したことなどが上昇要因となりました。2021年2月下旬から3月上旬にかけては、金利上昇に伴い軟調な展開となる場面も散見されたものの、経済活動の正常化期待から持ち直し、その後は堅調に推移しました。

■為替相場

米ドルは対円で上昇しました。

米ドルの対円為替相場は、当作成期首から2021年1月下旬にかけて、おおむね横ばいで推移しました。その後は、新型コロナウイルスワクチンの接種の進展や経済活動の正常化期待などから市場のリスク選好姿勢が強まり、円安米ドル高となりました。

ポートフォリオについて

(2020.12.15~2021.6.1)

■当ファンド

当ファンドは、グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）への投資割合は、信託財産の純資産総額の95%程度以上とすることをめざしました。

■グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）

有望企業を発掘する「インキュベーター」、優良事業を有利な条件で取り込む「コングロマリット」、事業統合で成長を加速させる「オペレーター」といった3タイプの「M&A買収側企業」に注目し、卓越した目利き力でM&A（合併・買収）を成功に導く「M&A巧者」を厳選しました。銘柄別では、TモバイルUS（コミュニケーション・サービス）、LVMHモエヘネシー・ルイヴィトン（一般消費財・サービス）、アンフェノール（情報技術）などを組み入れました。

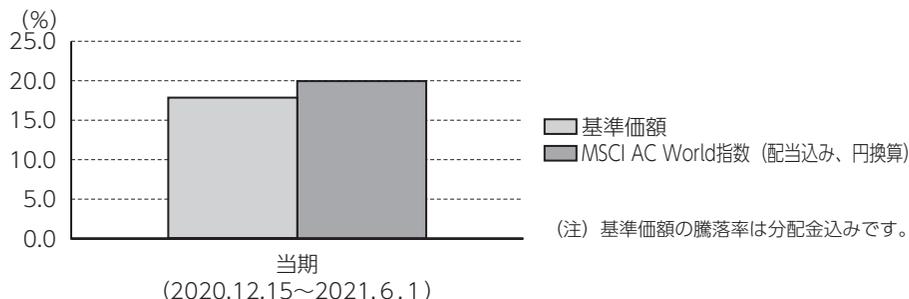
■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

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を設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金(税込み)は下記「分配原資の内訳(1万口当り)」の「当期分配金(税込み)」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程(1万口当り)」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期	
	2020年12月15日 ～2021年6月1日	
当期分配金(税込み)	(円)	750
対基準価額比率	(%)	6.36
当期の収益	(円)	750
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	1,035

(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。

■収益分配金の計算過程(1万口当り)

項目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益		0.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	1,452.69
(c) 収益調整金		333.11
(d) 分配準備積立金		0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		1,785.81
(f) 分配金		750.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		1,035.81

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

今後も、グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資します。また、グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

■グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）

企業の成長戦略として積極的にM&A（合併・買収）を活用する企業は、変化する社会経済情勢に素早く適応し、成長力を高めることができると考えます。卓越した目利き力でM&Aを成功に導く「M&A巧者」を厳選しつつ、バリュエーションにも注意を払った運用を継続し、長期的に優れたリターン獲得を追求します。

■ダイワ・マネーアセット・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 (2020.12.15~2021.6.1)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	57円	0.522%	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10,895円です。
(投 信 会 社)	(17)	(0.153)	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)	(39)	(0.356)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(0.013)	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	57	0.526	

(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。

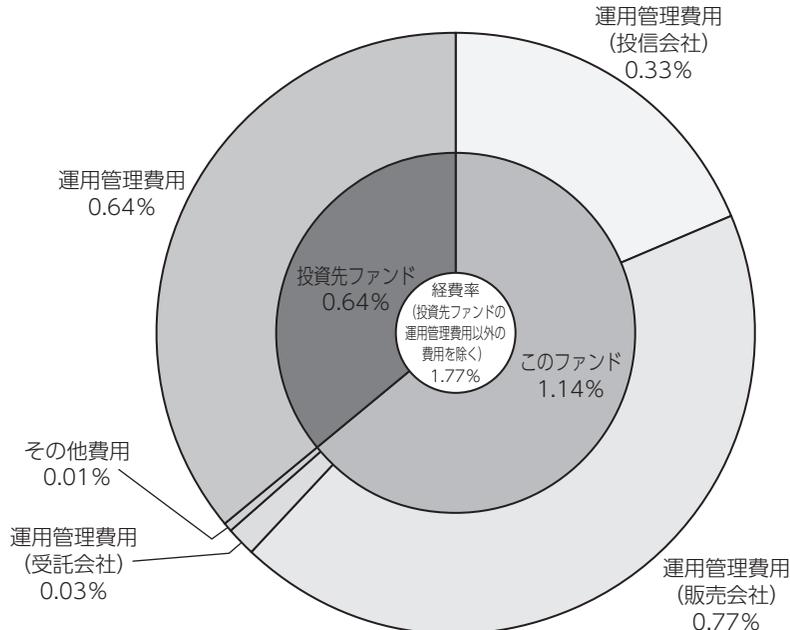
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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口当り）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.77%です。



経費率 (①+②)	1.77%
①このファンドの費用の比率	1.14%
②投資先ファンドの運用管理費用	0.64%

(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) 投資先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15日から2021年6月1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)	1,164.47834	11,908,000	123.11908	1,439,000

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月15日から2021年6月1日まで)

	設定		解約	
	□数	金額	□数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,001	1,000	-	-

(注) 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15日から2021年6月1日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	□数	金額	平均単価	円	銘柄	□数	金額	平均単価	円
INCOME INVESTMENT TRUST GLOBAL CAPITAL ALLOCATORS FUND JPY UNHEDGED CLASS (ケイマン諸島)	1,164.47834	11,908,000	10,226	円	INCOME INVESTMENT TRUST GLOBAL CAPITAL ALLOCATORS FUND JPY UNHEDGED CLASS (ケイマン諸島)	123.11908	1,439,000	11,687	円

(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。

■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
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) INCOME INVESTMENT TRUST GLOBAL CAPITAL ALLOCATORS FUND JPY UNHEDGED CLASS	1,041.35926	12,406,754	97.7

(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。

■投資信託財産の構成

2021年6月1日現在

項目	当 期 末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	12,406,754	90.9
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	999	0.0
コール・ローン等、その他	1,237,415	9.1
投資信託財産総額	13,645,169	100.0

(注) 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
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,001	999

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年6月1日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	13,645,169,479円
コール・ローン等	1,237,415,456
投資信託受益証券(評価額)	12,406,754,223
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド(評価額)	999,800
(B) 負債	950,971,507
未払収益分配金	862,710,013
未払解約金	28,565,365
未払信託報酬	59,262,585
その他未払費用	433,544
(C) 純資産総額(A - B)	12,694,197,972
元本	11,502,800,178
次期繰越損益金	1,191,397,794
(D) 受益権総口数	11,502,800,178口
1万口当り基準価額(C/D)	11,036円

*設定時における元本額は5,277,049,269円、当作成期間中における追加設定元本額は8,044,439,735円、同解約元本額は1,818,688,826円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,036円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月15日 至2021年6月1日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 58,257円
受取利息	8,221
支払利息	△ 66,478
(B) 有価証券売買損益	1,730,708,579
売買益	1,936,607,285
売買損	△ 205,898,706
(C) 信託報酬等	△ 59,697,118
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,670,953,204
(E) 追加信託差損益金	383,154,603
(配当等相当額)	(△ 16,890)
(売買損益相当額)	(383,171,493)
(F) 合計(D + E)	2,054,107,807
(G) 収益分配金	△ 862,710,013
次期繰越損益金(F + G)	1,191,397,794
追加信託差損益金	383,154,603
(配当等相当額)	(△ 16,890)
(売買損益相当額)	(383,171,493)
分配準備積立金	808,301,448
繰越損益金	△ 58,257

(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	1,671,011,461
(c) 収益調整金	383,171,493
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	2,054,182,954
(f) 分配金	862,710,013
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,191,472,941
(h) 受益権総口数	11,502,800,178口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

750円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）

当ファンド（世界M&A戦略株ファンド）の主要投資対象であるケイマン籍の外国投資信託「グローバル・キャピタル・アロケーターズ・ファンド（ヘッジなし・クラス）」は、2021年6月1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（世界M&A戦略株ファンド）が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・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1日）現在におけるダイワ・マネーアセット・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・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄

2020年12月15日～2021年6月1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1日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第9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・マネーアセット・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。

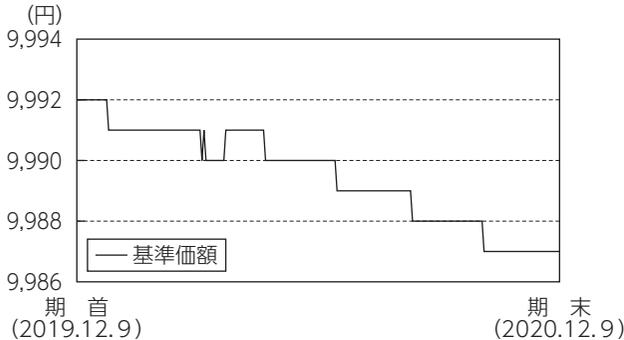
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2019年12月9日	円	%	%
	9,992	-	-
12月末	9,992	0.0	-
2020年1月1日	9,991	△0.0	-
2月末	9,991	△0.0	-
3月末	9,990	△0.0	-
4月末	9,991	△0.0	-
5月末	9,990	△0.0	-
6月末	9,989	△0.0	-
7月末	9,989	△0.0	-
8月末	9,988	△0.0	-
9月末	9,988	△0.0	-
10月末	9,987	△0.1	-
11月末	9,987	△0.1	-
(期末)2020年12月9日	9,987	△0.1	-

(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：9,992円 期末：9,987円 騰落率：△0.1%

【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前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
コール・ローン等、その他	千円 562,983	% 100.0
投資信託財産総額	562,983	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■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	562,983,783円
コール・ローン等	562,983,783
(B) 負債	-
(C) 純資産総額(A - B)	562,983,783
元本	563,730,093
次期繰越損益金	△ 746,310
(D) 受益権総口数	563,730,093口
1万口当り基準価額(C/D)	9,987円

*期首における元本額は7,329,994,437円、当作成期間中における追加設定元本額は128,103,486円、同解約元本額は6,894,367,830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、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)999円、ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αワトロプレミアム(毎月分配型)219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αワトロプレミアム(年2回決算型)24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(毎月分配型)848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム(年2回決算型)66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジあり)6,592,748円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジなし)10,288,683円、ダイワ/パリュール・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド10,000円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型)4,995円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型)4,995円、ダイワ・ブラジル・リアル債α(毎月分配型)ースーパー・ハインカムー α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・リアル債α(毎月分配型)ースーパー・ハインカムー α100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ15,828,234円、ダイワ円債セレクト・マネーコース490,006,140円、ダイワ・スイス高配当株ツインα(毎月分配型)2,996,106円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型)1,235円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし(毎月分配型)1,598円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース(毎月分配型)1,544円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース(毎月分配型)1,984円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,987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746,310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	△1,615,475円
受取利息	7,741
支払利息	△1,623,216
(B) その他費用	△ 23,537
(C) 当期損益金(A + B)	△1,639,012
(D) 前期繰越損益金	△5,937,566
(E) 解約差損益金	6,947,603
(F) 追加信託差損益金	△ 117,335
(G) 合計(C + D + E + F)	△ 746,310
次期繰越損益金(G)	△ 746,310

(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。