

■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	2013年4月26日から2023年4月17日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、カナダの高配当株式への投資に加え、「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで、高水準のインカムゲインとオプションプレミアム確保の確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス カナダの株式等 キャッシュ・マネジメント・マザーファンド 本邦通貨建て公社債および短期金融商品等
当ファンドの運用方法	<p>■カナダ株式を実質的な投資対象とし、主に配当利回りに着目した銘柄選定により信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>■「プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス」においては、カナダ株式の配当利回り水準に着目し、相対的に配当利回りの高い銘柄の中から、個々の企業のファンダメンタルズを勘案して銘柄を選定します。外国投資信託証券における株式の運用は、プリンシパル・グローバル・インベスターズLLCが行います。</p> <p>■実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>■株式への投資に加え、ツインα戦略を行うことで、オプションプレミアムの確保を目指します。</p>
組入制限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	<p>■毎月17日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、分配を行います。</p> <p>■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>

# カナダ高配当株ツインα (毎月分配型)

【運用報告書(全体版)】

第18作成期(2021年10月19日から2022年4月18日まで)

第101期 / 第102期 / 第103期  
決算日2021年11月17日 決算日2021年12月17日 決算日2022年1月17日

第104期 / 第105期 / 第106期  
決算日2022年2月17日 決算日2022年3月17日 決算日2022年4月18日

## 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、カナダの高配当株式への投資に加え、「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで、高水準のインカムゲインとオプションプレミアム確保の確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指します。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



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>

■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。

■当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)

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

### ■ 最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準額		公社債比率	投資信託比率	純資産額
		税金配込	騰落率			
77期（2019年11月18日）	円 1,800	円 20	% 2.7	% 0.2	% 97.4	百万円 32,145
78期（2019年12月17日）	1,806	20	1.4	0.1	97.0	30,213
79期（2020年1月17日）	1,838	20	2.9	0.1	97.2	29,958
80期（2020年2月17日）	1,822	20	0.2	0.2	97.1	29,112
81期（2020年3月17日）	1,166	20	△34.9	0.3	95.2	18,353
82期（2020年4月17日）	1,279	10	10.5	0.3	97.0	19,770
83期（2020年5月18日）	1,329	10	4.7	0.3	97.0	20,296
84期（2020年6月17日）	1,411	10	6.9	0.3	97.0	21,205
85期（2020年7月17日）	1,471	10	5.0	0.3	97.0	21,697
86期（2020年8月17日）	1,516	10	3.7	0.3	97.0	22,098
87期（2020年9月17日）	1,485	10	△1.4	0.3	97.3	21,306
88期（2020年10月19日）	1,509	10	2.3	0.3	97.2	21,276
89期（2020年11月17日）	1,538	10	2.6	0.2	97.6	21,196
90期（2020年12月17日）	1,589	10	4.0	0.2	97.5	21,273
91期（2021年1月18日）	1,617	10	2.4	0.2	97.3	21,178
92期（2021年2月17日）	1,687	10	4.9	0.2	97.3	21,603
93期（2021年3月17日）	1,741	10	3.8	0.2	97.3	21,815
94期（2021年4月19日）	1,758	10	1.6	0.2	97.9	21,481
95期（2021年5月17日）	1,800	10	3.0	0.2	97.9	21,572
96期（2021年6月17日）	1,844	10	3.0	0.2	97.8	21,474
97期（2021年7月19日）	1,779	10	△3.0	0.2	97.5	20,095
98期（2021年8月17日）	1,799	10	1.7	0.2	97.4	19,938
99期（2021年9月17日）	1,801	10	0.7	0.0	97.3	19,510
100期（2021年10月18日）	1,884	10	5.2	0.0	97.8	19,995
101期（2021年11月17日）	1,906	10	1.7	0.0	97.8	19,572
102期（2021年12月17日）	1,790	10	△5.6	0.0	97.5	18,069
103期（2022年1月17日）	1,845	10	3.6	0.0	97.4	18,166
104期（2022年2月17日）	1,846	10	0.6	0.0	97.3	17,736
105期（2022年3月17日）	1,867	10	1.7	0.0	97.8	17,687
106期（2022年4月18日）	1,948	10	4.9	0.0	98.1	17,767

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※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。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率	投 資 信 託 入 率
			騰 落 率	率		
第101期	(期 首) 2021年10月18日	円		%	%	%
	10月末	1,884	—	0.0	0.0	97.8
	(期 末) 2021年11月17日	1,895	0.6	0.0	0.0	97.8
第102期	(期 首) 2021年11月17日	1,916		1.7	0.0	97.8
	11月末	1,906	—	0.0	0.0	97.8
	(期 末) 2021年12月17日	1,828	△4.1	0.0	0.0	97.7
第103期	(期 首) 2021年12月17日	1,800		△5.6	0.0	97.5
	12月末	1,790	—	0.0	0.0	97.5
	(期 末) 2022年1月17日	1,832	2.3	0.0	0.0	97.6
第104期	(期 首) 2022年1月17日	1,855		3.6	0.0	97.4
	1月末	1,845	—	0.0	0.0	97.4
	(期 末) 2022年2月17日	1,796	△2.7	0.0	0.0	97.4
第105期	(期 首) 2022年2月17日	1,856		0.6	0.0	97.3
	2月末	1,846	—	0.0	0.0	97.3
	(期 末) 2022年3月17日	1,833	△0.7	0.0	0.0	97.9
第106期	(期 首) 2022年3月17日	1,877		1.7	0.0	97.8
	3月末	1,867	—	0.0	0.0	97.8
	(期 末) 2022年4月18日	1,953	4.6	0.0	0.0	98.2
		1,958	4.9	0.0	0.0	98.1

※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

作成期首	1,884円
作成期末	1,948円 (当作成期既払分配金60円(税引前))
騰落率	+6.8% (分配金再投資ベース)

## 分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さまが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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※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。

### 基準価額の主な変動要因（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

当ファンドは、プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラスへの投資を通じて、カナダの高配当株式への投資に加え、「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせ運用を行いました。

### 上昇要因

- 現物株のポートフォリオがプラスとなったこと
- セクター別では、エネルギー、素材、金融などが上昇したこと
- 個別銘柄では、原油価格の上昇などを背景に石油などの生産・開発を手掛けるカナディアン・ナチュラルリソースズが上昇したこと。肥料メーカーのニュートリエンや、トロント・ドミニオン銀行が上昇したこと

### 下落要因

- セクター別では、情報技術などが下落したこと
- 個別銘柄では、オンライン取引プラットフォームのショッピングファイ、運送・物流会社のTFIインターナショナル、ソフトウェア・メーカーのデカルト・システムズ・グループが下落したこと
- 「株式カバードコール戦略」がマイナスとなったこと
- 「通貨カバードコール戦略」がマイナスとなったこと

投資環境について（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

期間におけるカナダ株式市場は上昇しました。また、カナダドルは対円で上昇しました。

### カナダ株式市場

期間のカナダ株式市場は上昇しました。新型コロナウイルスの変異ウイルス「オミクロン型」の感染拡大や、インフレの高止まりとそれに伴う各国中央銀行による早期の金融引き締め観測、ウクライナ情勢の緊迫化などが世界の株式市場の重石となりました。一方で、原油などの資源価格全般が上昇したことなどは、カナダ株式市場を押し上げました。原油価格は、石油の主要消費国による協調した石油備蓄の放出や、新型コロナウイルスの感染再拡大によって需給が緩むとの観測で一時的に下落する局面がありました。しかし、経済活動の正常化などを背景として原油需要が堅調になると見込まれた中で、中東やウクライナを巡る地政学リスクの高まり、欧米による対ロシア制裁に伴う供給不安などが重なり、需給逼迫が強く意識されたことで大きく上昇しました。なお、カナダ国債利回りは、中短期ゾーンを中心に総じて上昇しました。

### 為替市場

期間のカナダドルは対円で上昇しました。海外において、金融引き締めやインフレ圧力に対する懸念から長期金利が大きく上昇し、内外金利差の拡大などを要因として急速に円安が進行しました。また、資源価格の上昇もカナダドル高材料となりました。

ポートフォリオについて（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

## 当ファンド

主要投資対象であるプリンシパル／CSカナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラスを期間を通じて高位に組み入れました。

## プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス

持続的に高い配当の支払いを行うことが可能な銘柄を中心に、事業ファンダメンタルズ（基礎的条件）とバリュエーション（投資価値評価）が魅力的な銘柄を多く組み入れました。

原油価格の上昇によってファンダメンタルズの改善が見込まれたエネルギー銘柄などを購入しました。一方、半導体不足と原材料価格の高騰による影響が大きい自動車関連銘柄、供給網の混乱が売上に影響することが懸念される電子商取引事業を展開する情報技術銘柄などを売却しました。

また、株式への投資に加え、カナダ株価指数のコールオプションの売りを行う「株式カバードコール戦略」および円に対するカナダドルのコールオプションの売りを行う「通貨カバードコール戦略」を活用し、運用を行いました。

## キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

安全性と流動性を考慮し、短期の政府保証債を中心とした運用を行いました。年限に関しては、残存6ヵ月以内の短期の政府保証債を中心とした運用を継続しました。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### ベンチマークとの差異について（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

### 分配金について（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

期間の1万口当たりの分配金（税引前）は、基準価額水準等を勘案し、以下の通りといたしました。

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いたします。

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期
当期分配金	10	10	10	10	10	10
（対基準価額比率）	(0.52%)	(0.56%)	(0.54%)	(0.54%)	(0.53%)	(0.51%)
当期の収益	－	－	－	－	－	－
当期の収益以外	10	10	10	10	10	10
翌期繰越分配対象額	702	692	682	672	662	652

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金」（税引前）の期末基準価額（分配金（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。



## 2 今後の運用方針

### 当ファンド

引き続き、運用の基本方針に従い、主として円建て外国投資信託証券への投資を通じて、カナダの高配当株式への投資に加え、「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで、高水準のインカムゲインとオプションプレミアムの確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス

ウクライナ情勢、各国中央銀行による金融引き締め、長引く供給制約、インフレの高止まりなどが市場で注目されています。しかし、これらの地政学的およびマクロ経済レベルのリスクが一巡した後は、再び企業のファンダメンタルズが市場のパフォーマンスを牽引するとみています。さらに、資源価格の上昇は、カナダ経済の成長の原動力が輸出やエネルギー関連事業であることから、カナダ企業の業績改善要因になるとみています。

引き続き、個別企業の分析に基づくボトムアップの銘柄選択により、高配当銘柄の中でも、事業ファンダメンタルズの改善や投資家の期待上昇が想定される銘柄への投資を通じて、安定的なリターンの獲得に努める方針です。

### キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

引き続き、安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行っていきます。ファンドの平均残存年限については、2～4カ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

## 3 お知らせ

### 約款変更について

該当事項はございません。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### 1万口当たりの費用明細（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	13円	0.684%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数） 期中の平均基準価額は1,859円です。
（投信会社）	(4)	(0.234)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(8)	(0.437)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(0)	(0.012)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.003	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）	(－)	(－)	保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.003)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	13	0.687	

※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、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当た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。

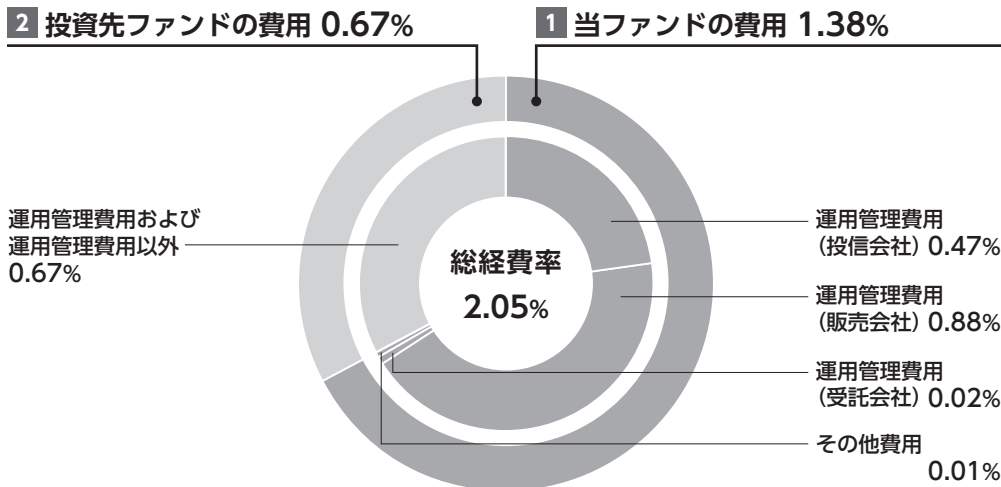
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

※各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。



## 参考情報 総経費率（年率換算）



### 総経費率 (1+2)

2.05%

**1 当ファンドの費用の比率**

1.38%

**2 投資先ファンドの費用の比率**

0.67%

※**1**の各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※**2**の投資先ファンド（当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））の費用は、実際に投資しているシェアクラスのデータが入手できない場合は、入手可能なファンド全体のデータをもとに委託会社が計算したものです。運用管理費用と運用管理費用以外の費用を明確に区別できない場合は、まとめて表示しています。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※**1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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口当たり）を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率（年率）は2.05%です。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

#### 投資信託証券

		当 作 成 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス	687,693,013	185,209 千円	13,424,903,192	3,578,496 千円

※金額は受渡し代金。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

### ■ 利害関係人との取引状況等（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

#### 利害関係人との取引状況

#### カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

#### キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

区 分	当 作 成 期					
	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	C	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
公 社 債	百万円 3,350	百万円 1,006	% 30.0	百万円 -	百万円 -	% -

※平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託およ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あり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C 日興証券株式会社です。

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2021年10月19日から2022年4月18日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■ 組入れ資産の明細（2022年4月18日現在）

(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	作成期首	作成期		末
	口数	口数	評価額	組入比率
プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス	73,827,206,350	61,089,996,171	17,422,866	98.1
合計	73,827,206,350	61,089,996,171	17,422,866	98.1

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 親投資信託残高

種類	作成期首	作成期		末
	口数	口数	評価額	評価額
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	433	433		439

※キャッシュ・マネジメント・マザーファンドの作成期末の受益権総口数は4,635,634,276口です。

### ■ 投資信託財産の構成

(2022年4月18日現在)

項目	作成期		末
	評価額	比率	比率
投資信託受益証券	17,422,866		97.2
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	439		0.0
コール・ローン等、その他	500,915		2.8
投資信託財産総額	17,924,221		100.0

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月17日) (2021年12月17日) (2022年1月17日) (2022年2月17日) (2022年3月17日) (2022年4月18日)

項 目	第101期末	第102期末	第103期末	第104期末	第105期末	第106期末
<b>(A) 資 産</b>	<b>19,772,066,783円</b>	<b>18,237,746,518円</b>	<b>18,351,013,355円</b>	<b>17,894,327,302円</b>	<b>17,844,987,836円</b>	<b>17,924,221,851円</b>
コール・ローン等	565,802,073	581,068,771	587,002,320	607,300,938	516,616,995	477,700,338
投資信託受益証券(評価額)	19,137,749,624	17,625,207,179	17,700,419,437	17,254,631,348	17,293,791,333	17,422,866,907
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド(評価額)	439,888	439,888	439,845	439,802	439,802	439,845
未 収 入 金	68,075,198	31,030,680	63,151,753	31,955,214	34,139,706	23,214,761
<b>(B) 負 債</b>	<b>200,028,866</b>	<b>168,344,895</b>	<b>184,856,715</b>	<b>158,138,331</b>	<b>157,715,606</b>	<b>156,588,718</b>
未払収益分配金	102,708,027	100,969,059	98,471,233	96,060,905	94,741,795	91,208,126
未払解約金	74,710,212	45,869,076	64,692,708	40,677,999	43,803,915	42,861,851
未払信託報酬	22,480,491	21,253,782	21,314,285	20,897,144	18,557,397	21,777,582
その他未払費用	130,136	252,978	378,489	502,283	612,499	741,159
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>19,572,037,917</b>	<b>18,069,401,623</b>	<b>18,166,156,640</b>	<b>17,736,188,971</b>	<b>17,687,272,230</b>	<b>17,767,633,133</b>
元 本	102,708,027,446	100,969,059,195	98,471,233,341	96,060,905,518	94,741,795,500	91,208,126,801
次期繰越損益金	△ 83,135,989,529	△ 82,899,657,572	△ 80,305,076,701	△ 78,324,716,547	△ 77,054,523,270	△ 73,440,493,668
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>102,708,027,446口</b>	<b>100,969,059,195口</b>	<b>98,471,233,341口</b>	<b>96,060,905,518口</b>	<b>94,741,795,500口</b>	<b>91,208,126,801口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>1,906円</b>	<b>1,790円</b>	<b>1,845円</b>	<b>1,846円</b>	<b>1,867円</b>	<b>1,948円</b>

※当作成期における作成期首元本額106,148,882,985円、作成期中追加設定元本額748,633,450円、作成期中一部解約元本額15,689,389,634円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■ 損益の状況

自2021年10月19日  
至2021年11月17日
自2021年11月18日  
至2021年12月17日
自2021年12月18日  
至2022年1月17日
自2022年1月18日  
至2022年2月17日
自2022年2月18日  
至2022年3月17日
自2022年3月18日  
至2022年4月18日

項 目	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期
(A) 配 当 等 収 益	△ 25,369円	△ 21,841円	△ 17,850円	△ 18,340円	△ 7,817円	△ 3,435円
受 取 利 息	460	793	756	1,428	518	115
支 払 利 息	△ 25,829	△ 22,634	△ 18,606	△ 19,768	△ 8,335	△ 3,550
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	349,338,558	△ 1,048,750,913	663,663,319	131,871,658	308,199,846	852,995,895
売 買 益	352,760,107	12,958,560	671,092,945	141,299,834	309,632,677	877,744,541
売 買 損	△ 3,421,549	△ 1,061,709,473	△ 7,429,626	△ 9,428,176	△ 1,432,831	△ 24,748,646
(C) 信 託 報 酬 等	△ 22,611,077	△ 21,379,166	△ 21,441,107	△ 21,022,474	△ 18,668,951	△ 21,907,106
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	326,702,112	△ 1,070,151,920	642,204,362	110,830,844	289,523,078	831,085,354
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 36,709,044,383	△ 35,725,063,035	△ 35,835,812,044	△ 34,288,527,980	△ 33,666,097,148	△ 32,090,957,183
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 46,650,939,231	△ 46,003,473,558	△ 45,012,997,786	△ 44,050,958,506	△ 43,583,207,405	△ 42,089,413,713
(配 当 等 相 当 額)	( 7,318,909,936)	( 7,094,028,276)	( 6,820,063,691)	( 6,557,070,387)	( 6,372,294,965)	( 6,043,411,951)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 53,969,849,167)	(△ 53,097,501,834)	(△ 51,833,061,477)	(△ 50,608,028,893)	(△ 49,955,502,370)	(△ 48,132,825,664)
(G) 合 計 (D+E+F)	△ 83,033,281,502	△ 82,798,688,513	△ 80,206,605,468	△ 78,228,655,642	△ 76,959,781,475	△ 73,349,285,542
(H) 収 益 分 配 金	△ 102,708,027	△ 100,969,059	△ 98,471,233	△ 96,060,905	△ 94,741,795	△ 91,208,126
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 83,135,989,529	△ 82,899,657,572	△ 80,305,076,701	△ 78,324,716,547	△ 77,054,523,270	△ 73,440,493,668
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 46,753,647,258	△ 46,104,442,617	△ 45,111,469,019	△ 44,147,019,411	△ 43,677,949,200	△ 42,180,621,839
(配 当 等 相 当 額)	( 7,216,201,909)	( 6,993,059,217)	( 6,721,592,458)	( 6,461,009,482)	( 6,277,553,170)	( 5,952,203,825)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 53,969,849,167)	(△ 53,097,501,834)	(△ 51,833,061,477)	(△ 50,608,028,893)	(△ 49,955,502,370)	(△ 48,132,825,664)
繰 越 損 益 金	△ 36,382,342,271	△ 36,795,214,955	△ 35,193,607,682	△ 34,177,697,136	△ 33,376,574,070	△ 31,259,871,829

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円	0円	0円	0円	0円	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	7,318,909,936	7,094,028,276	6,820,063,691	6,557,070,387	6,372,294,965	6,043,411,951
(d) 分配準備積立金	0	0	0	0	0	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	7,318,909,936	7,094,028,276	6,820,063,691	6,557,070,387	6,372,294,965	6,043,411,951
1万口当たり当期分配対象額	712.59	702.59	692.59	682.60	672.60	662.60
(f) 分配金	102,708,027	100,969,059	98,471,233	96,060,905	94,741,795	91,208,126
1万口当たり分配金	10	10	10	10	10	10

## ■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税引前）	第101期	第102期	第103期	第104期	第105期	第106期
	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配金は、分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額「普通分配金」となり課税されます。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は下回る部分が「元本払戻金（特別分配金）」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。



## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### ■ 組入れ投資信託証券の内容

#### 投資信託証券の概要

ファンド名	プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス
基本的性格	ケイマン籍／外国投資信託受益証券／円建て
主要投資対象	カナダの株式等を主要投資対象とします。また、スワップ取引を通じて、株価指数オプション取引、通貨オプション取引を活用します。
投資方針	<p>1. 主としてカナダの株式等に投資しつつ、株価指数と通貨のカバードコール戦略を組み合わせることで、高水準のインカムゲインとオプションプレミアムの確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指します。</p> <p>&lt;高配当株式投資戦略&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式等への投資に当たっては、配当利回り水準に着目し、相対的に配当利回りの高い銘柄を中心に投資します。</li> <li>・銘柄の選定に当たっては、個々の企業のファンダメンタルズ分析等も勘案します。</li> <li>・株式等の運用は、プリンシパル・グローバル・インベスターズLLCが行います。</li> </ul> <p>&lt;株式カバードコール戦略&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式カバードコール戦略は、カナダ株価指数（原則S&amp;Pトロント60指数）のコールオプションの売りを行うことでオプションプレミアムの確保を目指す戦略です。</li> <li>・株式カバードコール戦略は、原則として保有するカナダドル建て資産の評価額の50%程度のコールオプションの売りを行います。</li> </ul> <p>&lt;通貨カバードコール戦略&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・通貨カバードコール戦略は、円に対するカナダドルのコールオプションの売りを行うことでオプションプレミアムの確保を目指す戦略です。</li> <li>・通貨カバードコール戦略は、原則として保有するカナダドル建て資産の評価額の50%程度のコールオプションの売りを行います。</li> <li>※カバードコール戦略では、原則として、権利行使が満期日のみに限定されているオプションを利用することを基本とします。</li> <li>※カバードコール戦略については、クレディ・スイス・インターナショナルを相手方とするスワップ取引を通じて当該戦略を行った場合の投資成果を享受します。</li> </ul> <p>2. 資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式等への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・同一銘柄の株式等への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・同一セクターへの投資割合は、原則として取得時において信託財産の純資産総額の50%以内とします。</li> <li>・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</li> </ul>
収益の分配	原則毎月行います。
申込手数料	ありません。
管理報酬 その他費用	<p>管理報酬等：年0.615%</p> <p>上記の他、信託財産にかかる租税、組入有価証券の売買時にかかる費用、受託会社の費用、管理事務費用、名義書換事務代行費用、組入有価証券等の保管に関する費用等はファンドの信託財産から負担されます。上記の報酬等は将来変更される場合があります。</p>
管理会社	クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッド
副投資顧問会社	プリンシパル・グローバル・インベスターズLLC

※上記の内容は、今後変更になる場合があります。

以下には、「プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス」をシェアクラスとして含む「プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド」の情報を委託会社において抜粋、要約して翻訳したものを記載しています。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### 包括利益計算書

	2021年3月31日に 終了した年度 (日本円)	2020年3月31日に 終了した年度 (日本円)
<b>収益</b>		
損益を通じて公正価値で測定される金融商品の（損）益 <sup>1</sup>		
受取配当金	729,719,964	1,112,064,217
スワップ費用	(2,089,289,412)	(473,816,628)
有価証券に係る（損）益	10,607,636,273	(5,776,675,119)
	9,248,066,825	(5,138,427,530)
受取利息 <sup>2</sup>	496	2,407,331
外国為替取引に係る（損）益 <sup>3</sup>	33,332,344	(1,905,495)
<b>収益合計</b>	9,281,399,665	(5,137,925,694)
<b>費用</b>		
助言料	82,828,540	128,567,363
仲介手数料	44,487,405	69,067,352
取引費用	26,106,854	22,817,001
保管管理費用	12,782,046	14,235,943
弁護士費用及び専門家報酬	9,443	114,894
その他費用（受託会社及び名義書換代理人報酬）	4,346,062	4,523,262
<b>費用合計</b>	170,560,350	239,325,815
<b>運用に伴う（損）益（税引前）</b>	9,110,839,315	(5,377,251,509)
源泉徴収税	(167,605,636)	(245,317,801)
<b>分配前の受益者に帰属する純資産の変動額</b>	8,943,233,679	(5,622,569,310)
<b>受益者に対する分配金</b>	—	—
<b>分配後の受益者に帰属する純資産の変動額</b>	8,943,233,679	(5,622,569,310)

1. 損益を通じて公正価値で測定される金融商品の収益は、公正価値で測定する金融資産及び金融負債に係る実現及び未実現損益（有価証券に係る収益/損失）、受取配当金及びスワップ費用/収益を含む。
2. 償却原価で測定される金融資産に実効金利法を適用して算出した受取利息。
3. 外国為替に係る実現及び未実現損益。

## カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

### 組入上位銘柄

（基準日：2021年3月31日）

	銘柄名	業種名	比率
1	トロント・ドミニオン銀行	金融	8.9%
2	カナダロイヤル銀行	金融	7.8%
3	ショッピファイ	情報技術	6.3%
4	カナディアン・インベリアル・バンク・オブ・コマース	金融	4.5%
5	カナディアン・パシフィック鉄道	資本財サービス	3.9%
6	ビーシーイー・インク	コミュニケーション・サービス	3.4%
7	エンブリッジ	エネルギー	2.9%
8	ブルックフィールド・アセット・マネジメント	金融	2.8%
9	マニユライフ・ファイナンシャル	金融	2.7%
10	バンク・オブ・ノバスコシア	金融	2.6%
	全銘柄数	68銘柄	

※比率は組入株式等の時価評価額合計に対する割合

# キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

## 運用報告書

決算日：2021年7月26日

(第15期：2020年7月28日～2021年7月26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	安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。
主要運用対象	本邦通貨建て公社債および短期金融商品等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は行いません。</li><li>・ デリバティブ取引（有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引をいいます。）の利用はヘッジ目的に限定しません。</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>

# キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

## 最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		公社債 組入比率	純資産 総額
		期騰	落中率		
第11期 (2017年7月25日)	円		%	%	百万円
	10,177		△0.1	58.8	3,841
第12期 (2018年7月25日)	10,172		△0.0	69.2	4,478
第13期 (2019年7月25日)	10,167		△0.0	72.9	3,760
第14期 (2020年7月27日)	10,160		△0.1	86.2	4,668
第15期 (2021年7月26日)	10,154		△0.1	62.8	5,851

\*当ファンドは、安定した収益の確保を図ることを目的とした運用を行っているため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

## 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 率
		騰	落率		
(期首) 2020年7月27日	円		%		%
	10,160		—		86.2
7月末	10,160		0.0		85.8
8月末	10,159		△0.0		81.1
9月末	10,159		△0.0		84.9
10月末	10,158		△0.0		69.6
11月末	10,157		△0.0		79.3
12月末	10,157		△0.0		64.7
2021年1月末	10,157		△0.0		61.3
2月末	10,157		△0.0		63.8
3月末	10,156		△0.0		54.4
4月末	10,154		△0.1		61.7
5月末	10,154		△0.1		58.9
6月末	10,154		△0.1		62.1
(期末) 2021年7月26日	10,154		△0.1		62.8

\*騰落率は期首比です。

## 運用経過

### 【基準価額等の推移】

期首：10,160円

期末：10,154円

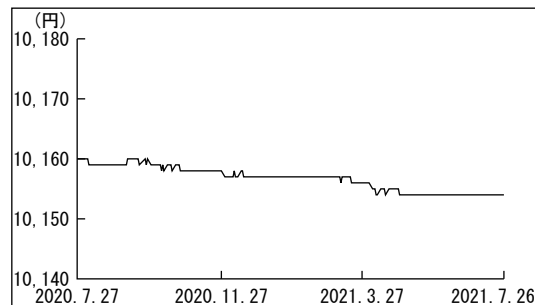
騰落率：△0.1%

### 【基準価額の主な変動要因】

(下落要因)

マイナス金利政策導入を背景とした無担保コールレート  
のマイナス化が要因となりました。

基準価額の推移



### 【投資環境】

国内短期金融市場では、期首-0.09%近辺でスタートした国庫短期証券3ヵ月物の利回りは、-0.08%～-0.18%内での動きに終始し、-0.11%近辺で期末を迎えました。

### 【ポートフォリオ】

安全性と流動性を考慮し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行いました。年限に関しては、残存6ヵ月以内の短期の国債・政府保証債を中心とした運用を継続しました。

## 今後の運用方針

日本銀行は2021年3月の金融政策決定会合において、より効果的で持続的な金融緩和を実施していくための点検を行いました。現時点で日本銀行によるマイナス金利の深掘りの可能性は低いものの、現行の強力な金融緩和政策を継続することから、市場利回りは当分の間低い水準での推移を予想します。当ファンドでは引き続き、安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行っていきます。ファンドの平均残存年限については、2～4ヵ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

# キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

## 1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年7月28日～2021年7月26日		
	金額	比率	
その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	0	0.000	
期中の平均基準価額は10,157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。

## 売買及び取引の状況

(2020年7月28日から2021年7月26日まで)

### ■公社債

		買付額	売付額
国	内	千円 100,405	千円 — (400,000)
		4,289,998	— (4,410,000)
		1,604,517	— (1,500,000)

\*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

\*（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

\*社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれていません。

## 主要な売買銘柄

(2020年7月28日から2021年7月26日まで)

### ■公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
9 政保道路機構	1,006,840	—	—
1 政保地方公共8年	702,681		
31 政保地方公共団	504,075		
15 政保中部空港	460,318		
6 政保道路機構	401,960		
149 政保道路機構	262,644		
129 政保道路機構	200,706		
152 政保道路機構	155,906		
14 政保政策投資B	101,783		
145 政保道路機構	101,010		

\*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7月28日から2021年7月26日まで)

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 5,994	百万円 905	% 15.1	百万円 —	百万円 —	% —

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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

組入資産の明細

2021年7月26日現在

■公社債

A 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当		期		末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5年以上	2年以上	2年未満
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債 券)	千円 2,566,000 (2,566,000)	千円 2,573,856 (2,573,856)	% 44.0 (44.0)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 44.0 (44.0)
普 通 社 債 券	1,100,000 (1,100,000)	1,101,367 (1,101,367)	18.8 (18.8)	— (—)	— (—)	— (—)	18.8 (18.8)
合 計	3,666,000 (3,666,000)	3,675,224 (3,675,224)	62.8 (62.8)	— (—)	— (—)	— (—)	62.8 (62.8)

\* ( ) 内は、非上場債で内書き

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合



# キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

## B 個別銘柄開示 国内（邦貨建）公社債

銘柄	柄	当期			末
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券（除く金融債券）)		%	千円	千円	
14	政保政策投資B	2.1000	100,000	100,272	2021/09/13
11	政保政策投資C	1.0000	95,000	95,121	2021/09/14
1	政保地方公共8年	0.5760	700,000	700,587	2021/09/24
145	政保道路機構	1.0000	100,000	100,168	2021/09/30
149	政保道路機構	1.0000	260,000	260,876	2021/11/30
31	政保地方公共団	1.1000	500,000	502,078	2021/12/14
11	国際協力機構	1.1400	100,000	100,454	2021/12/20
152	政保道路機構	1.1000	155,000	155,706	2021/12/28
58	日本学生支援	0.0010	100,000	100,000	2022/02/18
15	政保中部空港	0.9000	456,000	458,590	2022/03/15
小	計	—	2,566,000	2,573,856	—
(普通社債券)					
20	ダイキン工業	0.3810	100,000	100,004	2021/07/30
32	西日本旅客鉄	1.1310	100,000	100,126	2021/09/09
68	新日本製鐵	1.1090	100,000	100,147	2021/09/17
19	豊田自動織機	1.1090	100,000	100,147	2021/09/17
34	東京瓦斯	1.0640	100,000	100,166	2021/09/22
23	リコーリース	0.0500	100,000	99,991	2021/09/24
43	三菱UFJリース	0.0600	100,000	100,000	2021/10/25
14	ZHD	0.2000	100,000	100,000	2021/12/10
25	リコーリース	0.1300	100,000	100,019	2022/02/23
9	ドンキホーテHD	0.8000	100,000	100,440	2022/03/11
13	パナソニック	0.5680	100,000	100,323	2022/03/18
小	計	—	1,100,000	1,101,367	—
合	計	—	3,666,000	3,675,224	—

## 投資信託財産の構成

2021年7月26日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	率
公社債	千円		%
コーポレートローン等、その他	3,675,224		62.7
投資信託財産総額	2,183,693		37.3
	5,858,918		100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年7月26日) 現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	5,858,918,394円
	コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,175,671,520
	公 社 債 (評価額)	3,675,224,532
	未 収 利 息	7,215,793
	前 払 費 用	806,549
(B) 負	債	6,975,301
	未 払 解 約 金	6,975,301
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)		5,851,943,093
	元 本	5,763,082,023
	次 期 繰 越 損 益 金	88,861,070
(D) 受 益 権 総 口 数		5,763,082,023口
	1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,154円

\*元本状況

期首元本額	4,594,902,903円
期中追加設定元本額	5,942,517,345円
期中一部解約元本額	4,774,338,225円

\*元本の内訳

SMB Cファンドラップ・日本バリュー株	984,252円
SMB Cファンドラップ・J-REIT	984,252円
SMB Cファンドラップ・G-REIT	93,018,163円
SMB Cファンドラップ・ヘッジファンド	311,216,889円
SMB Cファンドラップ・米国株	984,543円
SMB Cファンドラップ・欧州株	89,718,432円
SMB Cファンドラップ・新興国株	61,111,034円
SMB Cファンドラップ・コモディティ	30,882,058円
SMB Cファンドラップ・米国債	136,874,567円
SMB Cファンドラップ・欧州債	68,341,252円
SMB Cファンドラップ・新興国債	54,958,024円
SMB Cファンドラップ・日本グロース株	167,596,581円
SMB Cファンドラップ・日本中小型株	27,029,827円
SMB Cファンドラップ・日本債	964,891,078円
DC日本国債プラス	1,377,745,844円
エマーシング・ボンド・ファンド・円コース (毎月分配型)	36,545,313円
エマーシング・ボンド・ファンド・豪ドルコース (毎月分配型)	130,604,200円
エマーシング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース (毎月分配型)	6,059,780円
エマーシング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース (毎月分配型)	146,670,647円
エマーシング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース (毎月分配型)	5,392,215円
エマーシング・ボンド・ファンド・トルコリラコース (毎月分配型)	47,173,770円
エマーシング・ボンド・ファンド (マネーボールファンド)	267,333,391円
大和住銀 中国株式ファンド (マネー・ポートフォリオ)	50,825,008円
エマーシング・ボンド・ファンド・中国元コース (毎月分配型)	1,339,775円
日本株厳選ファンド・円コース	270,889円
日本株厳選ファンド・ブラジルリアルコース	18,658,181円
日本株厳選ファンド・豪ドルコース	679,887円

日本株厳選ファンド・アジア3通貨コース	9,783円
日本株225・米ドルコース	49,237円
日本株225・ブラジルリアルコース	393,895円
日本株225・豪ドルコース	147,711円
日本株225・資源3通貨コース	49,237円
グローバルCBオープン・高金利通貨コース	598,533円
グローバルCBオープン・円コース	827,757円
グローバルCBオープン (マネーボールファンド)	1,943,569円
オーストラリア高配当株プレミアム (毎月分配型)	1,057,457円
スマート・ストラテジー・ファンド (毎月決算型)	12,541,581円
スマート・ストラテジー・ファンド (年2回決算型)	4,566,053円
カナダ高配当株ツインα (毎月分配型)	66,417,109円
日本株厳選ファンド・米ドルコース	196,696円
日本株厳選ファンド・メキシコペソコース	196,696円
日本株厳選ファンド・トルコリラコース	196,696円
エマーシング・ボンド・ファンド・カナダドルコース (毎月分配型)	320,670円
エマーシング・ボンド・ファンド・メキシコペソコース (毎月分配型)	2,042,379円
カナダ高配当株ファンド	984円
米国短期社債戦略ファンド2017-03 (為替ヘッジあり)	1,751,754円
世界リアルアセット・バランス (毎月決算型)	1,451,601円
世界リアルアセット・バランス (資産成長型)	2,567,864円
米国分散投資戦略ファンド (1倍コース)	404,915,211円
米国分散投資戦略ファンド (3倍コース)	1,061,844,622円
米国分散投資戦略ファンド (5倍コース)	445,153円
グローバルDX関連株式ファンド (予想分配金提示型)	295,276円
グローバルDX関連株式ファンド (資産成長型)	1,968,504円
大和住銀マルチ・ストラテジー・ファンド (ヘッジ付) (適格機関投資家限定)	98,396,143円

## 損益の状況

自2020年7月28日  
至2021年7月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	33,387,842円
受 取 利 息	33,978,612
支 払 利 息	△ 590,770
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△35,882,058
売 買 益	9,100
売 買 損	△35,891,158
(C) そ の 他 費 用	△ 720
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 2,494,936
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	73,384,951
(F) 解 約 差 損 益 金	△74,720,346
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	92,691,401
(H) 計 (D + E + F + G)	88,861,070
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	88,861,070

\*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。