

■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
信託期間	2017年11月7日から2027年9月13日まで
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。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンド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
当ファンドの運用方法	■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。 ■当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。
組入制限	当ファンド ■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	■年2回（原則として毎年3月および9月の11日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みません。）等の範囲内とします。 ■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。 ※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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</div>

米国中期債運用戦略ファンド (ダイワ投資一任専用) 【運用報告書(全体版)】

(2023年3月14日から2023年9月11日まで)

第 **12** 期

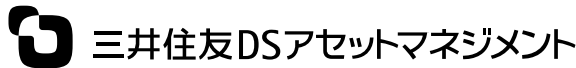
決算日 2023年9月11日

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。当期についても、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)

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

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 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率		
8 期 (2021年 9 月13日)	円 10,951	円 0	% 1.6	% 99.3	百万円 1,066
9 期 (2022年 3 月11日)	10,867	0	△0.8	99.2	4,505
10期 (2022年 9 月12日)	11,441	0	5.3	101.5	6,678
11期 (2023年 3 月13日)	11,087	0	△3.1	99.7	9,024
12期 (2023年 9 月11日)	11,155	0	0.6	100.1	8,217

※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。

■ 当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	騰 落 率	
(期 首) 2023年 3 月13日	円 11,087	% —	% 99.7
3 月末	11,186	0.9	99.5
4 月末	11,281	1.7	99.4
5 月末	11,477	3.5	98.9
6 月末	11,420	3.0	99.7
7 月末	11,220	1.2	100.3
8 月末	11,209	1.1	98.4
(期 末) 2023年 9 月11日	11,155	0.6	100.1

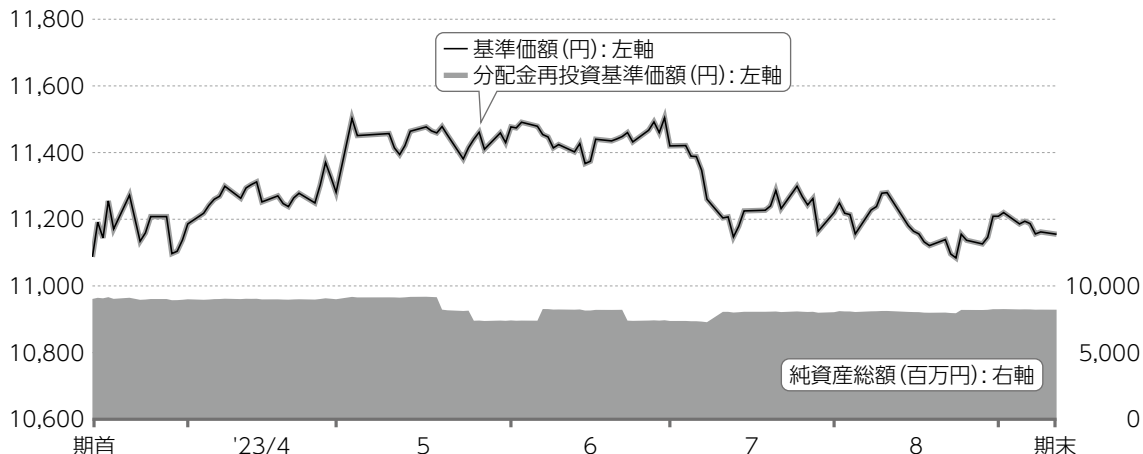
※騰落率は期首比です。

※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（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、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。

期首	11,087円
期末	11,155円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	+0.6% (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(2023年3月14日から2023年9月11日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として残存期間が5～7年程度の米国債に投資を行いました。

実質的に保有する債券の利回り上昇は下落要因でしたが、米ドル円相場の上昇や実質的に保有する債券の利息収入が上昇要因となり、基準価額は上昇しました。

投資環境について（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

米国債券市場は下落しました。為替市場では、米ドル円が前期末と比較して円安に振れました。

米国債券市場

米国5～7年の中期ゾーンの国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。期初から5月は、米シリコンバレー銀行などの破綻やスイスのクレディ・スイス・グループをめぐる経営危機などを背景に、利回り低下の動きとなりました。その後、6月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で、年内に0.25%の利上げが2回ある可能性が示されたことや、FRB（米連邦準備制度理事会）議長やECB（欧州中央銀行）総裁から追加利上げが必要との発言があったこと、米国の雇用統計や小売売上高などの結果から米国経済の堅調さが示されたことなどを受け、利回りは上昇しました。

為替市場

米ドル円相場は円安に振れました。期初から6月は、米国で利上げが行われた一方で、日銀総裁が物価目標達成に慎重な見方を示したことなどを受け、円安が進行しました。7月上旬に一旦円高の動きとなりましたが、その後、米国経済の堅調さを示す経済指標の発表や、FOMC議事要旨での物価上昇を警戒する記載、日本政府・日銀による為替介入はすぐには行われなかったといった思惑などを背景に、円安の動きとなりました。日本では、7月下旬に金融政策の柔軟化が発表されましたが、日銀は今後も金融緩和を継続するとの見方などから、強い円高材料にはなりませんでした。

ポートフォリオについて（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

当ファンド

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ました。

米国中期債運用戦略マザーファンド

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%台から90%台の範囲で調整しました。期初から6月前半にかけては主に20%台から50%台、6月後半は70%台としました。7月は上旬から中旬に40%台から50%台とし、その後は60%台から90%台としました。「守る為替ヘッジ戦略」は、主に30%台から60%台としました。「攻める為替ヘッジ戦略」は、3月下旬や7月中旬に円高に振れた場面で円安判定、6月後半や7月下旬から9月の月初付近に円高判定とし、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を25%程度増減する調整を行いました。

ベンチマークとの差異について（2023年3月14日から2023年9月11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（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項目	第12期
当期分配金	0
（対基準価額比率）	（0.00%）
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,792

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りいたしました。

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、「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。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

1万口当たりの費用明細（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	26円	0.230%	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11,297円です。
（投信会社）	(19)	(0.164)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(6)	(0.055)	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）	(1)	(0.011)	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 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
（株式）	(－)	(－)	
（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 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
（株式）	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(d) 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)	(0.007)	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）	(1)	(0.005)	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	27	0.242	

※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。

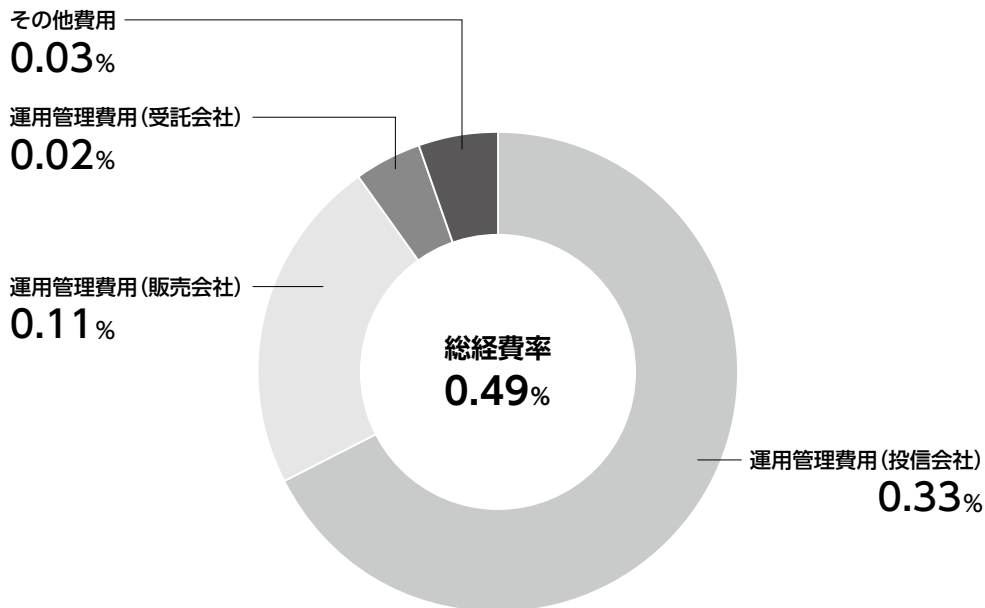
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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。



参考情報 総経費率（年率換算）



※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、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。

※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。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総経費率(年率換算)は0.49%です。

米国中期債運用戦略ファンド（ダイワ投資一任専用）

■ 当期中の売買及び取引の状況（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	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 1,744,388	千円 2,034,652	千口 2,516,267	千円 2,952,320

■ 利害関係人との取引状況等（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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。

■ 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 （2023年3月14日から2023年9月11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。

■ 組入れ資産の明細（2023年9月11日現在）

親投資信託残高

種 類	期 首(前期末)		期 末	
	口 数	口 数	評 価	額
米国中期債運用戦略マザーファンド	千口 7,928,449	千口 7,156,570	千円 8,217,174	

※米国中期債運用戦略マザーファンドの期末の受益権総口数は7,156,570,503口です。

■ 投資信託財産の構成

（2023年9月11日現在）

項 目	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 8,217,174	% 99.8
コール・ローン等、その他	19,775	0.2
投資信託財産総額	8,236,949	100.0

※米国中期債運用戦略マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（8,238,503千円）の投資信託財産総額（8,278,050千円）に対する比率は99.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.97円です。

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

(2023年9月11日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	8,236,949,658円
コール・ローン等	151,384
米国中期債運用戦略 マザーファンド(評価額)	8,217,174,251
未 収 入 金	19,624,023
(B) 負 債	19,601,829
未 払 信 託 報 酬	19,146,061
そ の 他 未 払 費 用	455,768
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	8,217,347,829
元 本	7,366,478,285
次 期 繰 越 損 益 金	850,869,544
(D) 受 益 権 総 口 数	7,366,478,285口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C / D)	11,155円

※当期における期首元本額8,139,508,949円、期中追加設定元本額1,798,789,456円、期中一部解約元本額2,571,820,120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。

■ 損益の状況

(自2023年3月14日 至2023年9月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 58円
受 取 利 息	4
支 払 利 息	△ 62
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	28,479,162
売 買 損 益	102,667,350
売 買 損 益	△ 74,188,188
(C) 信 託 報 酬 等	△ 19,601,829
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	8,877,275
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	28,656,592
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	813,335,677
(配 当 等 相 当 額)	(1,014,769,481)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 201,433,804)
(G) 合 計(D + E + F)	850,869,544
次 期 繰 越 損 益 金(G)	850,869,544
追 加 信 託 差 損 益 金	813,335,677
(配 当 等 相 当 額)	(1,019,383,503)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 206,047,826)
分 配 準 備 積 立 金	301,288,387
繰 越 損 益 金	△ 263,754,520

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資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。

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	90,719,174円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,019,383,503
(d) 分配準備積立金	210,569,213
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,320,671,890
1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	1,792.81
(f) 分配金	0
1 万 口 当 たり 分 配 金	0

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 たり 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	0円

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。

米国中期債運用戦略マザーファンド

第12期（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

信託期間	無期限（設定日：2017年11月7日）
運用方針	<ul style="list-style-type: none">■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目指します。■組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。為替ヘッジ比率については、主に米国の金利と米ドル／円の為替の相関等を勘案して、効率的なヘッジ比率を決定します。■大和証券株式会社から運用にかかる助言を受けます。

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5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		公 組 入 社 比 債 率	純 総 資 産 額
		期 騰 落	中 率		
8期（2021年9月13日）	円		%	%	百万円
9期（2022年3月11日）	11,150		1.9	99.3	1,066
10期（2022年9月12日）	11,089		△0.5	99.2	4,505
11期（2023年3月13日）	11,718		5.7	101.5	6,678
12期（2023年9月11日）	11,382		△2.9	99.7	9,024
	11,482		0.9	100.1	8,217

※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。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

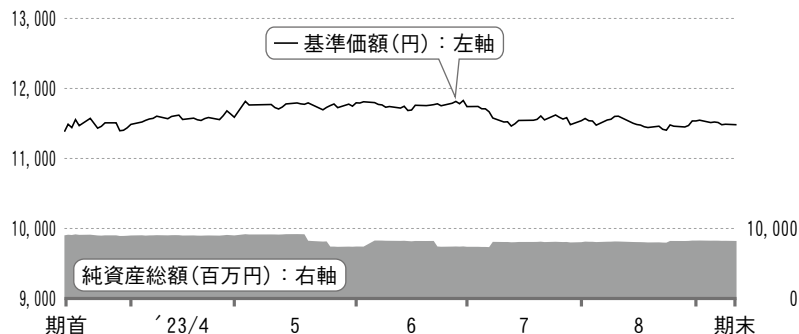
年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率
		騰 落 率	率	
(期 首) 2023年 3月13日	円		%	%
	11,382		—	99.7
3月末	11,487		0.9	99.4
4月末	11,589		1.8	99.3
5月末	11,795		3.6	98.8
6月末	11,741		3.2	99.5
7月末	11,540		1.4	100.1
8月末	11,536		1.4	98.2
(期 末) 2023年 9月11日		11,482	0.9	100.1

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

基準価額等の推移



期首	11,382円
期末	11,482円
騰落率	+0.9%

▶ 基準価額の主な変動要因（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

当ファンドは、残存期間が5～7年程度の米国債を主要投資対象とし、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ました。

保有する債券の利回り上昇は下落要因でしたが、米ドル円相場の上昇や保有する債券の利息収入が上昇要因となり、基準価額は上昇しました。

▶投資環境について（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

米国債券市場は下落しました。為替市場では、米ドル円が前期末と比較して円安に振れました。

米国債券市場

米国5～7年の中期ゾーンの国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。期初から5月は、米シリコンバレー銀行などの破綻やスイスのクレディ・スイス・グループをめぐる経営危機などを背景に、利回り低下の動きとなりました。その後、6月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で、年内に0.25%の利上げが2回ある可能性が示されたことや、FRB（米連邦準備制度理事会）議長やECB（欧州中央銀行）総裁から追加利上げが必要との発言があったこと、米国の雇用統計や小売売上高などの結果から米国経済の堅調さが示されたことなどを受け、利回りは上昇しました。

為替市場

米ドル円相場は円安に振れました。期初から6月は、米国で利上げが行われた一方で、日銀総裁が物価目標達成に慎重な見方を示したことなどを受け、円安が進行しました。7月上旬に一旦円高の動きとなりましたが、その後、米国経済の堅調さを示す経済指標の発表や、FOMC議事要旨での物価上昇を警戒する記載、日本政府・日銀による為替介入はすぐには行われまいといった思惑などを背景に、円安の動きとなりました。日本では、7月下旬に金融政策の柔軟化が発表されましたが、日銀は今後も金融緩和を継続するとの見方などから、強い円高材料にはなりません。

▶ポートフォリオについて（2023年3月14日から2023年9月11日まで）

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%台から90%台の範囲で調整しました。期初から6月前半にかけては主に20%台から50%台、6月後半は70%台としました。7月は上旬から中旬に40%台から50%台とし、その後は60%台から90%台としました。「守る為替ヘッジ戦略」は、主に30%台から60%台としました。「攻める為替ヘッジ戦略」は、3月下旬や7月中旬に円高に振れた場面で円安判定、6月後半や7月下旬から9月の月初付近に円高判定とし、「守る為替ヘッジ戦略」を基準にヘッジ比率を25%程度増減する調整を行いました。

▶ **ベンチマークとの差異について（2023年3月14日から2023年9月11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。

2 今後の運用方針

引き続き、債券ポートフォリオは、米国債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。

■ 1万口当たりの費用明細 (2023年3月14日から2023年9月11日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) そ の 他 費 用	1円	0.007%	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：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 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
（保 管 費 用）	(1)	(0.007)	
（そ の 他）	(0)	(0.000)	
合 計	1	0.007	

期中の平均基準価額は11,613円です。

※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。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年3月14日から2023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 28,932	千アメリカ・ドル 39,021

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年3月14日から2023年9月11日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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。

■ 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
(2023年3月14日から2023年9月11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。

米国中期債運用戦略マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2023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	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		
		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 59,429	千アメリカ・ドル 55,993	千円 8,229,298	% 100.1	% -	% 100.1	% -	% -
合 計	-	-	8,229,298	100.1	-	100.1	-	-

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

B 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

区 分	銘 柄	種 類	期				末	
			利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
ア メ リ カ	US TREASURY N/B	国 債 証 券	% 1.8750	千アメリカ・ドル 15,947	千アメリカ・ドル 13,998	千円 2,057,397	2029/02/28	
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	3.1250	14,993	13,999	2,057,559	2029/08/31	
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4.0000	14,299	13,995	2,056,866	2030/02/28	
	US TREASURY N/B	国 債 証 券	4.1250	14,190	13,999	2,057,475	2030/08/31	
	小 計		-	59,429	55,993	8,229,298	-	
	合 計		-	-	-	8,229,298	-	

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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

(2023年9月11日現在)

項 目	期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 8,229,298	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	48,751	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	8,278,050	100.0

※期末における外貨建資産（8,238,503千円）の投資信託財産総額（8,278,050千円）に対する比率は99.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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。なお、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=146.97円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年9月11日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	18,674,047,241円
コール・ローン等	23,463,906
公社債(評価額)	8,229,298,755
未収入金	10,412,753,762
未収利息	6,579,512
前払費用	1,951,306
(B) 負 債	10,456,534,427
未払金	10,436,910,246
未払解約金	19,624,023
その他未払費用	158
(C) 純資産総額(A-B)	8,217,512,814
元 本	7,156,570,503
次期繰越損益金	1,060,942,311
(D) 受益権総口数	7,156,570,503口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,482円

※当期における期首元本額7,928,449,640円、期中追加設定元本額1,744,388,751円、期中一部解約元本額2,516,267,888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。

※期末における元本の内訳は、米国中期債運用戦略ファンド(ダイワ投資一任専用)7,156,570,503円です。

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2023年3月14日 至2023年9月11日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	114,384,763円
受 取 利 息	114,408,281
支 払 利 息	△ 23,518
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,759,551
売 買 益	1,018,506,842
売 買 損	△1,021,266,393
(C) そ の 他 費 用 等	△ 596,241
(D) 当期損益金(A+B+C)	111,028,971
(E) 前期繰越損益金	1,095,702,515
(F) 解約差損益金	△ 436,052,521
(G) 追加信託差損益金	290,263,346
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,060,942,311
次期繰越損益金(H)	1,060,942,311

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※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。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。