

# デジタル情報通信革命 愛称 〈0101(ゼロイチゼロイチ)〉

## 運用報告書（全体版） 第21期

（決算日 2020年8月20日）  
（作成対象期間 2019年8月21日～2020年8月20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、わが国の株式に投資し、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。

### ★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／国内／株式
信託期間	約25年間（1999年9月1日～2024年8月20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	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限
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。

## 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/>

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		T O P I X		株式 組入比率	株式 先物比率	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
17期末(2016年8月22日)	円 5,059	円 0	% △17.4	1,303.68	% △19.7	% 93.5	% -	百万円 16,880
18期末(2017年8月21日)	6,053	0	19.6	1,595.19	22.4	98.7	-	17,724
19期末(2018年8月20日)	6,485	0	7.1	1,692.15	6.1	97.4	-	16,657
20期末(2019年8月20日)	5,614	0	△13.4	1,506.77	△11.0	96.2	-	13,111
21期末(2020年8月20日)	6,739	0	20.0	1,599.20	6.1	92.5	-	14,333

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

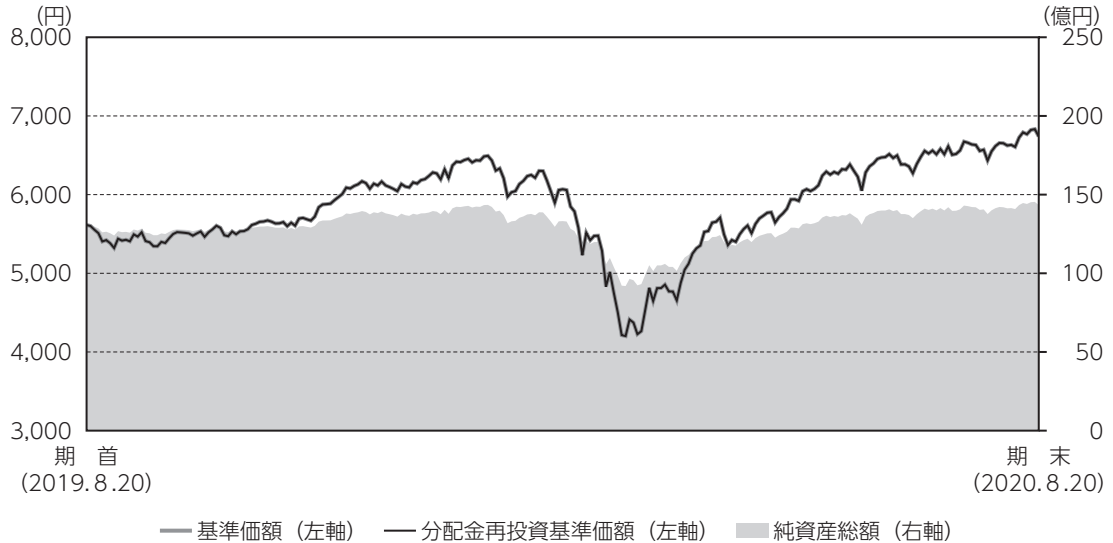
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



## 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

期首：5,614円

期末：6,739円（分配金0円）

騰落率：20.0%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

当作成期の国内株式市況は、米国の利下げや米中通商問題の進展等を受けて上昇したものの、2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落しました。その後、世界的な金融緩和や新型コロナウイルスワクチンの実用化の期待などを受けて、当作成期首を上回って当作成期末を迎えました。これを受けて基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2019年 8月20日	円 5,614	% -	1,506.77	% -	% 96.2	% -
8月末	5,440	△ 3.1	1,511.86	0.3	96.7	-
9月末	5,478	△ 2.4	1,587.80	5.4	97.0	-
10月末	5,633	0.3	1,667.01	10.6	97.9	-
11月末	6,110	8.8	1,699.36	12.8	98.4	-
12月末	6,269	11.7	1,721.36	14.2	99.0	-
2020年 1月末	6,030	7.4	1,684.44	11.8	96.9	-
2月末	5,230	△ 6.8	1,510.87	0.3	97.5	-
3月末	4,856	△13.5	1,403.04	△ 6.9	97.2	-
4月末	5,607	△ 0.1	1,464.03	△ 2.8	93.3	-
5月末	6,118	9.0	1,563.67	3.8	94.0	-
6月末	6,385	13.7	1,558.77	3.5	94.6	-
7月末	6,434	14.6	1,496.06	△ 0.7	91.5	-
(期末) 2020年 8月20日	6,739	20.0	1,599.20	6.1	92.5	-

(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

(2019.8.21~2020.8.20)

### 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、トランプ米国大統領が中国に対して追加関税の対象を拡大する方針を示したことが嫌気され下落したものの、その後は米中交渉の継続により妥協点を見いだすことへの期待やドイツが経済対策を行うとの観測から、横ばい圏で推移しました。2019年9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大懸念、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。また、新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感され上昇しましたが、6月ごろより、国内外の感染拡大が再び懸念され、株価は弱含んで推移しました。8月に入ると、新型コロナウイルスワクチンの実用化の期待や米国の景気改善期待が高まったことなどを受け上昇しました。

### 前作成期末における「今後の運用方針」

世界的な景気や企業業績の減速懸念、各国通商政策の不透明感などから、国内株式市場を取り巻く投資環境は楽観を許さない状況にあると考えています。一方で、バリュエーション指標などから見て国内株式市場はこのような投資環境の不透明感を相応に織り込んでいると考えています。また、日本・米国・欧州における緩和的な金融政策や中国の景気対策の推進などが世界経済や金融市場の下支え要因になるとみており、国内株式市場は一進一退の展開を想定しています。国内外の経済指標や企業業績、各国の政策動向などを注視しながら、投資環境の方向性を見極めていく方針です。

銘柄選択にあたりましては、当ファンドの投資対象である、情報通信機器、情報関連サービス、情報ソフト、通信・放送等に関連する事業を営む企業およびこれらを利用することによって経営の効率化が図られると期待される企業の中から、市場に評価される企業を発掘、選別し投資を行います。また、中長期的な業績成長に重点をおき、テーマ性や株価位置などを勘案した銘柄選別を行う所存です。

個別銘柄では、バリュエーション面で割安感の出た銘柄、中長期的な業績拡大が期待される銘柄、DX（デジタルトランスフォーメーション）関連やクラウド関連などのテーマ性のある銘柄、マーケットの注目を浴びやすい新規上場銘柄の中で業績の拡大が期待できる銘柄などに投資してまいります。

## ポートフォリオについて

(2019.8.21~2020.8.20)

株式組入比率は、90%程度以上の高位を維持しました。

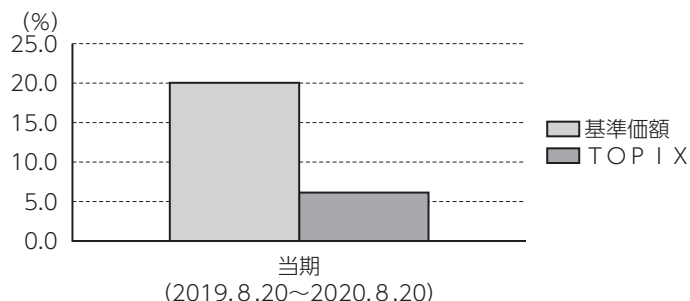
業種構成は、売買や株価変動などにより、化学や電気機器などの比率が上昇し、卸売業や情報・通信業などの比率が低下しました。

個別銘柄では、業績見通しやバリュエーション指標などを考慮し、ソニーを買い増し、また東京エレクトロンや信越化学工業などを新たに買い付けました。一方で、ブレインパッドやフィックスターズなどの売却を行いました。

## 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（TOPIX）との騰落率の対比です。当ファンドは運用スキーム上、参考指数と比較して銀行業の組入比率が低いという特徴があります。参考指数は国内株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。  
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（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2019年8月21日 ～2020年8月20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）	424

(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

国内株式市場は一進一退の展開を想定しています。景気や企業業績の先行きに対する不透明感に加え、新型コロナウイルスの感染第2波や米中関係の悪化に対する懸念もあり、国内株式市場を取り巻く投資環境は依然として楽観視できない状況と考えます。一方で、主要中央銀行や各国政府による金融・財政政策が景気や金融市場の下支え要因になるとみています。国内外の景気や企業業績、金融・財政政策の動向、新型コロナウイルスの感染状況、経済活動再開に向けた動きなどを注視しながら、今後の投資環境の方向性を冷静に見極めていく方針です。

銘柄選択にあたっては、情報通信機器、情報関連サービス、情報ソフト、通信・放送等に関連する事業を営む企業およびこれらを利用することによって経営の効率化が図られると期待される企業の中から、成長性および株価バリュエーションなどを分析し、アナリストと議論し判断します。引き続き、当ファンドにおいては、アナリストの専門的知見を活用し、成長が期待できる企業に投資し、基準価額の上昇に努めてまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2019.8.21~2020.8.20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	98円	1.663%	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5,864円です。
(投 信 会 社)	(53)	(0.897)	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)	(38)	(0.656)	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)	(6)	(0.109)	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	11	0.189	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
(株 式)	(11)	(0.189)	
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	0.005	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)	(0.005)	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	109	1.858	

(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。

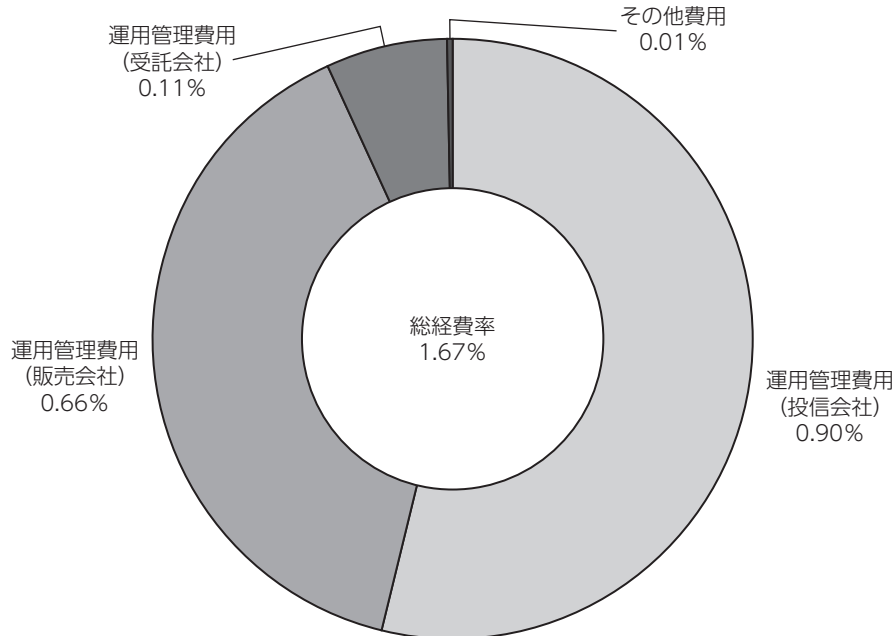
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 参考情報

## ■ 総経費率

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総経費率（年率）は1.67%です。



(注1) 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。

■売買および取引の状況

株式

(2019年8月21日から2020年8月20日まで)

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
	千株	千円	千株	千円
国内	6,485.5 (796.275)	14,833,451 (-)	9,109.875	16,749,035

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2019年8月21日から2020年8月20日まで)

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	31,582,487千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,367,637千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.55

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株式

(2019年8月21日から2020年8月20日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ソニー	72.5	505,540	6,972	AMAZIA	112.9	527,058	4,668
日本電信電話	169.9	431,367	2,538	SHIFT	77.9	511,425	6,565
東京エレクトロン	16.9	361,574	21,394	サーバーワークス	29.6	401,975	13,580
野村総合研究所	124.8	323,992	2,596	ブレインパッド	62	339,699	5,479
信越化学	26.8	313,397	11,693	ラクス	152.7	312,337	2,045
SMC	5.6	284,133	50,738	ホロン	58	299,071	5,156
ディスコ	11.3	274,491	24,291	スクウェア・エニックス・HD	52	267,314	5,140
コムシスホールディングス	90.6	261,122	2,882	メドレー	80.8	254,438	3,148
サイバーエージェント	60.1	258,491	4,301	コムチュア	110	250,272	2,275
スクウェア・エニックス・HD	53.5	242,961	4,541	フィックスターズ	195.6	250,187	1,279

(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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

(2019年8月21日から2020年8月20日まで)

決算期	当					
	買付額等		うち利害関係人との取引状況B	売付額等		うち利害関係人との取引状況D
区分	A	B/A		C	D/C	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	14,833	3,217	21.7	16,749	3,431	20.5
コール・ローン	128,610	-	-	-	-	-

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2019年8月21日から2020年8月20日まで)

種類	当期	
	買	付額
株式		百万円 310

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への  
支払比率

(2019年8月21日から2020年8月20日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	24,681千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9,270千円
(B)/(A)	37.6%

※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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表  
国内株式

銘 柄	期 首 当 期 末			銘 柄	期 首 当 期 末			銘 柄	期 首 当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
<b>建設業 (2.1%)</b>				<b>精密機器 (3.0%)</b>				エムケイシステム	27.4	-	-
コムシスホールディングス	-	90.6	284,031	島津製作所	45	51.2	162,304	デジタル・インフォメーション	53	-	-
<b>化学 (6.1%)</b>				インターアクション	40.5	-	-	ラクス	110	70.6	191,326
日産化学	-	35	187,950	HOYA	22	23.6	237,652	アカツキ	18	-	-
信越化学	-	26.8	342,772	<b>その他製品 (0.8%)</b>				チェンジ	-	14.6	184,690
日本化学工業	-	27	59,886	プシロード	3.4	-	-	UUUM	10	-	-
第一工業製薬	-	21	90,720	任天堂	-	2.1	111,930	ウォンテッドリー	23	-	-
富士フイルムHLDS	-	11.7	58,172	<b>情報・通信業 (42.1%)</b>				SKIYAKI	98.2	-	-
メック	19.8	-	-	システナ	-	44.9	80,236	アズジェント	57.3	-	-
有沢製作所	21.1	83.8	70,559	日鉄ソリューションズ	30	-	-	野村総合研究所	-	44.8	131,756
<b>機械 (8.2%)</b>				ソフトクリエイトHD	2.3	-	-	サイバネットシステム	150	-	-
ディスコ	-	11.3	280,240	T I S	57.3	90	198,900	CEホールディングス	97.9	-	-
オプトラ	36	53.6	119,045	電算システム	22	-	-	インフォコム	-	54.2	187,532
フリーユ	99	-	-	GMOペパボ	13.8	-	-	ラクスル	25.1	-	-
SMC	-	5.6	331,464	ブレインパッド	57	-	-	イーアイ	15.5	-	-
ワイエイシホールディングス	51.4	-	-	ネクソン	55	25	64,650	I P S	95.2	-	-
ローツェ	46.8	13	66,040	ソフトマックス	131.5	-	-	エクスマーショ	72	-	-
ダイキン工業	-	15.2	292,676	システム情報	122	-	-	イースル	120.9	-	-
<b>電気機器 (22.1%)</b>				ブイキューブ	-	30.2	49,558	AMAZIA	50	8	31,000
明電舎	-	66.8	112,090	フィックスターズ	195.6	-	-	Kudan	6.5	-	-
日本電産	-	35.5	310,731	オプティム	35	3.7	11,821	シノプス	81.8	-	-
日新電機	82.7	-	-	S H I F T	77.9	13	158,600	リックソフト	13	-	-
日東工業	9.2	-	-	日本ファルコム	95	-	-	サーバーワークス	12	1.8	27,720
電気興業	25.5	-	-	セック	-	39.1	113,390	カオナビ	7.5	-	-
アンリツ	75	80	184,160	テクマトリックス	60	-	-	WELBY	7.5	-	-
ソニー	17	89.5	747,683	GMOベイメントゲートウェイ	25	3.7	42,846	ヴィッツ	31.9	-	-
s a n t e c	70.7	-	-	ヴィンクス	82.1	142.4	163,617	トピラスシステムズ	20	-	-
メイコー	96.9	-	-	ULSグループ	8.5	-	-	バルテス	-	104.2	176,931
ヒロセ電機	-	10.6	129,638	システムインテグレータ	-	153.6	128,409	Sansan	-	32	159,360
アドバンテス	-	42.1	214,710	アドソル日進	57.6	-	-	ギフト	-	60	141,180
キーエンス	2	6	266,580	フリービット	100	-	-	HENNGE	-	6.3	34,650
山一電機	28.7	8.4	10,668	コムチュア	50	-	-	BASE	-	12.3	108,117
カシオ	-	50.8	80,924	NTTデータインテラマート	-	24.8	76,632	メドレー	-	8.5	37,145
太陽誘電	70	32.9	96,824	日本一ソフトウェア	34.7	-	-	JMDC	-	21.6	181,872
村田製作所	24	48	305,040	サイバーコム	27	-	-	J TOWER	-	28	164,920
東京エレクトロン	-	16.9	469,313	アステリア	8.6	-	-	フューチャー	9	-	-

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円		千株	千円		千株	千株	千円		千株	千円	
伊藤忠テクノソリューションズ	—	15	61,200	<b>卸売業 (0.9%)</b>			インソース	93.1	50	138,400				
大塚商会	—	47.1	253,869	イメージワン	151.4	—	ペイカレントコンサルティング	19	—	—				
インフォメーションクリエ	68	29.5	24,632	ダイワボウHD	25	—	RPAホールディングス	50	—	—				
サイボウズ	—	9	29,250	マクニカ・富士エレHLDGS	—	67.2	115,046	AND FACTORY	64.8	85.9	79,972			
日本ユニシス	64.7	50.3	153,918	東陽テクニカ	12.9	—	—	イーエムネットジャパン	18.2	—	—			
ビジョン	48	57.8	38,205	パリュエンスHLDGS	26.3	—	—	ブリッジインターナショナル	66	—	—			
日本電信電話	—	169.9	442,334	<b>その他金融業 (-)</b>			テクノスデータサイエンス	26.2	—	—				
光通信	10	12.4	312,356	日本モーゲージサービス	142.7	—	—	ギークス	52	60	74,820			
NTTドコモ	—	50.7	156,510	<b>サービス業 (14.7%)</b>			サイバー・バズ	—	18.3	64,599				
エムティーアイ	69.9	—	—	アイティメディア	145	115	309,005	NEXTONE	—	1.7	15,895			
ファイバーゲート	100	182.9	363,239	エス・エム・エス	50	66.3	195,253							
アルファボリス	51.9	—	—	ディップ	—	40	86,080	合計	株数、金額	5,515.4	千株	3,687.3	千円	13,259,726
KADOKAWA	22.7	—	—	ジャパンバストレスキューズ	60	—	—	銘柄数<比率>	103銘柄	81銘柄	<92.5%>			
スクウェア・エニックス・HD	65	66.5	461,510	バリューコマース	70	98.3	333,728	(注1)	銘柄欄の( )内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。					
シーイーシー	80	40.4	67,993	サイバーエージェント	—	50.1	294,588	(注2)	合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。					
クレオ	—	69	86,112	弁護士ドットコム	—	8.5	90,610	(注3)	評価額の単位未満は切捨て。					
S C S K	10	20	113,600	ジャパンマテリアル	70	80	119,120							
日本システムウエア	46	—	—	I B J	150.3	—	—							
ミロク情報サービス	35	—	—	シグマクス	70	102.9	142,413							
ソフトバンクグループ	—	26.3	164,795	ロゼッタ	34	—	—							

■投資信託財産の構成

2020年8月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	13,259,726	91.8
コール・ローン等、その他	1,188,754	8.2
投資信託財産総額	14,448,480	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8月20日現在

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>14,448,480,705円</b>
コール・ローン等	1,170,217,459
株式(評価額)	13,259,726,350
未収入金	12,581,346
未収配当金	5,955,550
<b>(B) 負債</b>	<b>114,599,554</b>
未払解約金	9,063,553
未払信託報酬	105,190,075
その他未払費用	345,926
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>14,333,881,151</b>
元本	21,269,684,819
次期繰越損益金	△ 6,935,803,668
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>21,269,684,819口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>6,739円</b>

\* 期首における元本額は23,355,950,796円、当作成期間中における追加設定元本額は197,026,560円、同解約元本額は2,283,292,537円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は6,739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6,935,803,668円です。

## ■損益の状況

当期 自2019年8月21日 至2020年8月20日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>117,337,450円</b>
受取配当金	117,535,220
受取利息	3,789
その他収益金	14,771
支払利息	△ 216,330
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>2,489,443,784</b>
売買益	4,970,205,069
売買損	△2,480,761,285
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 217,222,212</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>2,389,559,022</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△6,439,154,568</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△2,886,208,122</b>
(配当等相当額)	( 42,128,590)
(売買損益相当額)	(△2,928,336,712)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>△6,935,803,668</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>△6,935,803,668</b>
追加信託差損益金	△2,886,208,122
(配当等相当額)	( 42,128,590)
(売買損益相当額)	(△2,928,336,712)
分配準備積立金	861,276,694
繰越損益金	△4,910,872,240

- (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	107,562,450円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	42,128,590
(d) 分配準備積立金	753,714,244
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	903,405,284
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	903,405,284
(h) 受益権総口数	21,269,684,819口

## 《お知らせ》

## ■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。