

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／資産複合
信託期間	信託期間は2013年10月1日から2024年12月3日（繰上償還決定前は2028年7月10日）までです。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	UBS Asset Management (Americas) LLCが運用する円建外国投資信託証券「HYFI Loan Fund—JPY-AUDクラス」を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	原則として7月10日（休業日の場合は翌営業日）に清算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、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。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。

バンクローン・オープン (豪ドルコース)(SMA専用)

償還報告書（全体版）

第12期（償還日 2024年12月3日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。さて、当ファンドはこのたび、投資信託約款の規定に基づき、繰上償還いたしました。ここに謹んで設定以来の運用状況と償還内容をご報告いたしますとともに、受益者のみなさまのご愛顧に対しまして厚くお礼申しあげます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容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。
- 当償還報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

償還金のお知らせ

1万口当たり償還金

15,993円23銭

【本償還報告書の記載について】

- ・基準(償還)価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他的一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			債組入比率	投資信託組入比率	純 資 産 額
	(分配落)	税分配	込 金			
設定日(2013年10月 1日)	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 1
第1期(2014年 7月10日)	10,864	0	8.6	0.0	99.2	58
第2期(2015年 7月10日)	10,683	0	△1.7	0.0	98.5	173
第3期(2016年 7月11日)	9,315	0	△12.8	—	99.3	165
第4期(2017年 7月10日)	11,214	0	20.4	—	98.7	126
第5期(2018年 7月10日)	10,950	0	△2.4	—	99.1	103
第6期(2019年 7月10日)	10,211	0	△6.7	—	99.0	95
第7期(2020年 7月10日)	10,177	0	△0.3	—	99.1	65
第8期(2021年 7月12日)	11,783	0	15.8	—	99.0	22
第9期(2022年 7月11日)	12,698	0	7.8	—	99.8	23
第10期(2023年 7月10日)	13,965	0	10.0	—	99.3	45
第11期(2024年 7月10日)	16,947	0	21.4	0.0	99.6	55
(償還日) 第12期(2024年12月 3日)	(償還価額) 15,993.23	—	△5.6	—	—	52

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債組入比率	投資信託組入比率	債券率
	騰 落 率	率			
(当期首) 2024年 7月10日	円 16,947	% —	% 0.0	% 99.6	
7月末	15,832	△6.6	0.0	99.6	
8月末	15,522	△8.4	0.0	99.7	
9月末	15,610	△7.9	0.0	99.7	
10月末	15,983	△5.7	0.0	99.8	
11月末	15,994	△5.6	—	—	—
(償還日) 2024年12月 3日	(償還価額) 15,993.23	△5.6	—	—	—

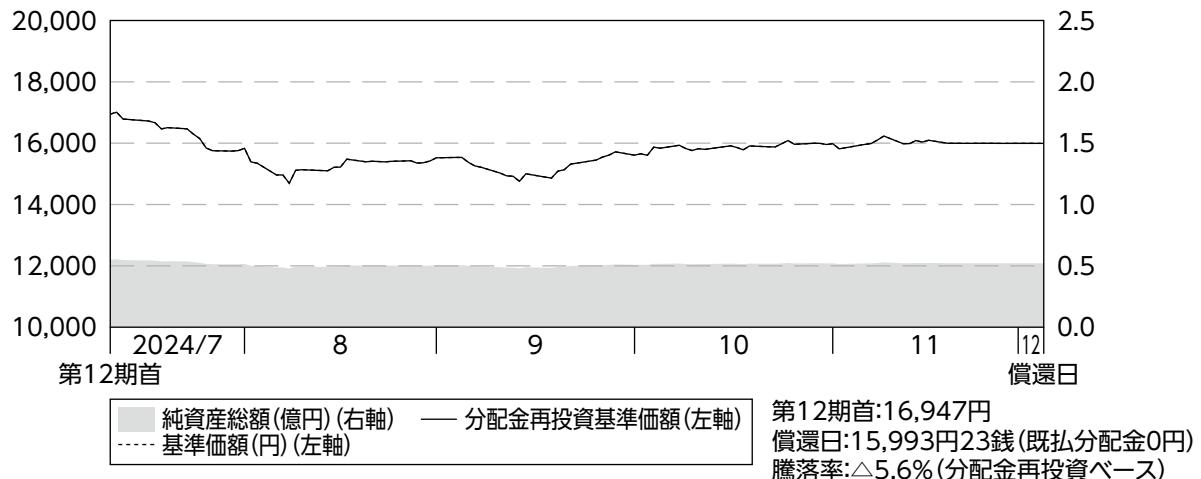
(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過

基準価額等の推移



(注1)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。

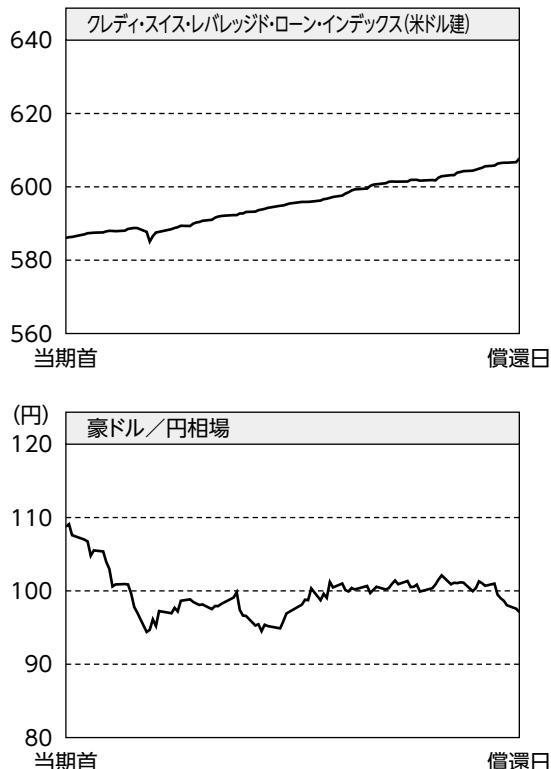
(注2)分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3)分配金再投資基準価額は、2024年7月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も下落しました。

投資環境



○バンクローン市場

当期の米国バンクローン市場は上昇しました。米国では8月初旬に景気悪化懸念が台頭したことによって株式市場を中心にボラティリティが高まる局面がありました。しかし、バンクローン市場への影響は限定的でした。

また9月から政策金利の引き下げが行われるという見通しにより、機関投資家や個人投資家が変動金利であるバンクローンから、固定金利の債券に資金を振り向ける動きがみられましたが、長期金利が上昇したことなどを背景にバンクローン市場に資金が回帰する動きも見られました。

○為替市場

当期の豪ドル／円相場は、豪ドル安・円高となりました。オーストラリアの国内経済が鈍化したことや、米国の経済成長が減速していること、世界のその他の国・地域で経済成長が停滞していること、同国との交易関係が強い中国の景気減速などがマイナス要因となり、豪ドルは対円で下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」への投資を高位に保つ運用を行いました。なお、2024年11月中旬には当ファンドの繰上償還に向けて、保有受益証券を全て売却しました。

・HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス

金融、情報技術、サービスの組入比率を相対的に高く保ち、格付ではBB格とB格を中心に組み入れました。投資対象資産(米ドル建)については、米ドル売り／豪ドル買いの為替取引を行いました。

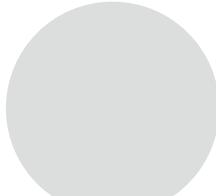
<投資対象ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

償還時における該当事項はありません。

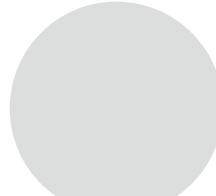
○資産別配分



短期金融資産等
100.0%



日本
100.0%



円
100.0%

(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

該当事項はありません。

設定以来の運用経過

当ファンドの運用につきましては、主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」への投資を高位に保つ運用を行いました。なお、2024年11月中旬には当ファンドの繰上償還に向けて、保有受益証券を全て売却しました。

【基準価額(分配金再投資ベース)の主な変動要因】

＜第1期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も上昇しました。

＜第2期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も下落しました。

＜第3期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も下落しました。

＜第4期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も上昇しました。

＜第5期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も下落しました。

＜第6期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も下落しました。

＜第7期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が概ね横ばいとなったことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も概ね横ばいとなりました。

＜第8期＞

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も上昇しました。

<第9期>

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も上昇しました。

<第10期>

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も上昇しました。

<第11期>

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も上昇しました。

<第12期>

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-AUDクラス」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も下落しました。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要	
	(2024年7月11日~2024年12月3日)			
	金額	比率		
(a) 信託報酬	35円	0.220%	(a)信託報酬=[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は15,788円です。 信託報酬に係る消費税は(当作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価	
(投信会社)	(21)	(0.132)		
(販売会社)	(10)	(0.066)		
(受託会社)	(3)	(0.022)		
(b) 売買委託手数料	—	—	(b)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]×10,000 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)	(—)	(—)		
(新株予約権証券)	(—)	(—)		
(オプション証券等)	(—)	(—)		
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)		
(投資信託証券)	(—)	(—)		
(商品)	(—)	(—)		
(先物・オプション)	(—)	(—)		
(c) 有価証券取引税	—	—	(c)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]×10,000 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	
(株式)	(—)	(—)		
(新株予約権証券)	(—)	(—)		
(オプション証券等)	(—)	(—)		
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)		
(公社債)	(—)	(—)		
(投資信託証券)	(—)	(—)		
(d) その他費用	0	0.002	(d)その他費用=[期中のその他費用] [期中の平均受益権口数]×10,000	
(保管費用)	(—)	(—)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保 管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用	
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用	
(その他)	(—)	(—)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用	
合計	35	0.222		

(注1)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た結果です。
なわ、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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。

(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

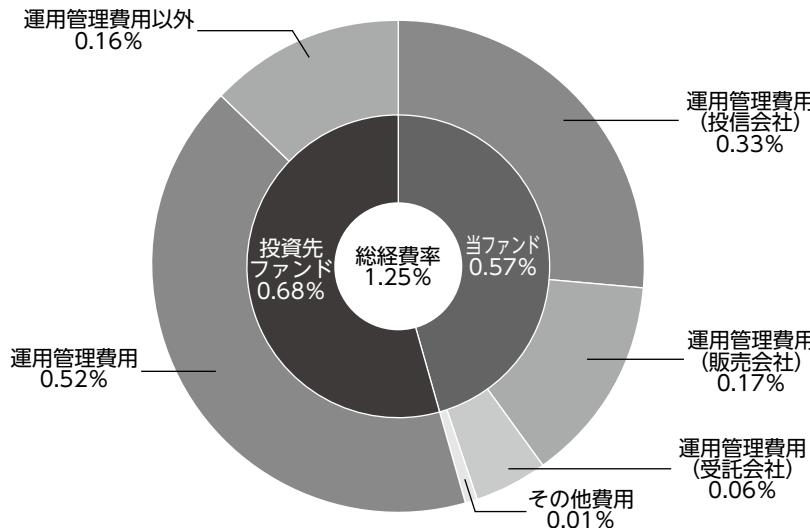
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4)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(マザーファンドを除く)。

<参考情報>

総経費率

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、売買委託手数料及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)は1.25%です。



総経費率 (①+②+③)	1.25%
①当ファンドの費用の比率	0.57%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.68%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.16%

(注1)当ファンドの費用は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す。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及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、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。)です。

(注5)当ファンドの費用は、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)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注9)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は異なります。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	HYFI Loan Fund—JPY-AUDクラス	千口 —	千円 —	千口 30	千円 51,994

(注)金額は受渡代金です。

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当 期				
	設 定		解 約		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
マネープールマザーファンド	千口 —	千円 —	千口 9	千円 9	

利害関係人※との取引状況等

■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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000270	百万円 0.000270	% 100.0	百万円 0.000270	百万円 0.000270	% 100.0
コ ー ル・ロ ー ン	487	102	20.9	435	91	20.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜マネープールマザーファンド＞

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
預 金	百万円 70	百万円 70	% 100.0	百万円 70	百万円 70	% 100.0
金 銭 信 託	116	116	100.0	116	116	100.0
コ ー ル・ロ ー ン	8,201,222	1,754,424	21.4	8,199,319	1,753,953	21.4

〈平均保有割合 0.0%〉

(注1)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ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当期首残高 (元 千円 1,000)	当期設定 元 千円 一	当期解約 元 千円 一	償還時残高 (元 千円 1,000)	取引の理由
				当初設定時における取得

組入資産の明細

償還時における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項目	償還時	
	評価額	比率
コール・ローン等、その他	千円 52,203	% 100.0
投資信託財産総額	52,203	100.0

資産、負債、元本および償還価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および償還価額の状況

項目	償還時 2024年12月3日現在
(A) 資産	52,203,494円
コール・ローン等	52,203,116
未 収 利 息	378
(B) 負債	114,524
未 払 信 託 報 酬	113,448
そ の 他 未 払 費 用	1,076
(C) 純資産総額(A-B)	52,088,970
元 本	32,569,378
債還差益金	19,519,592
(D) 受益権総口数	32,569,378口
1万口当たり償還価額(C/D)	15,993円23銭

■損益の状況

項目	当期 自2024年7月11日 至2024年12月3日
(A)配当等収益 受取利息	4,188円 4,188
(B)有価証券売買損益 売買益 売買損	△2,995,728 3 △2,995,731
(C)信託報酬等	△114,524
(D)当期損益金(A+B+C)	△3,106,064
(E)前期繰越損益金	15,697,163
(F)追加信託差損益金 (配当等相当額) (売買損益相当額)	6,928,493 (3,568,916) (3,359,577)
償還差益金(D+E+F)	19,519,592

(注1) (C)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います。

(注2) (F)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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は32,569,378円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は0円です。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2013年10月1日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年12月3日		資産総額	52,203,494円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	114,524円
受益権口数	1,000,000口	32,569,378口	31,569,378口	純資産総額	52,088,970円
元本額	1,000,000円	32,569,378円	31,569,378円	受益権口数	32,569,378口
				1万口当たり償還金	15,993.23円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	54,205,833円	58,891,622円	10,864円	0円	0.0000%
第2期	162,112,548	173,184,707	10,683	0	0.0000
第3期	177,501,897	165,345,324	9,315	0	0.0000
第4期	112,878,691	126,579,731	11,214	0	0.0000
第5期	94,930,656	103,953,237	10,950	0	0.0000
第6期	93,036,897	95,003,155	10,211	0	0.0000
第7期	64,472,918	65,612,518	10,177	0	0.0000
第8期	19,284,868	22,723,021	11,783	0	0.0000
第9期	18,444,338	23,421,236	12,698	0	0.0000
第10期	32,569,378	45,483,867	13,965	0	0.0000
第11期	32,569,378	55,195,034	16,947	0	0.0000

お知らせ

主要投資対象ファンドの運用会社の商号変更に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。
ファンドにおける資金の借入について、要件の緩和を行うため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2024年10月11日)

マネーポールマザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2024年11月20日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2010年2月26日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等にも投資します。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	債券組入率		債券先物率		純資産額
		期騰	中落率	比	比	
第11期(2020年11月20日)	円 10,019		% △0.0	% —	% —	百万円 486,701
第12期(2021年11月22日)	10,015		△0.0	—	—	358,814
第13期(2022年11月21日)	10,011		△0.0	—	—	371,933
第14期(2023年11月20日)	10,006		△0.0	—	—	236,294
第15期(2024年11月20日)	10,012		0.1	53.1	—	178,757

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額	債券組入率		債券先物率	
		騰	落率	比	率
(当期首) 2023年11月20日	円 10,006		% —	% —	% —
11月末	10,006		0.0	—	—
12月末	10,006		0.0	—	—
2024年1月末	10,006		0.0	—	—
2月末	10,006		0.0	—	—
3月末	10,005		△0.0	31.9	—
4月末	10,005		△0.0	54.1	—
5月末	10,005		△0.0	53.1	—
6月末	10,008		0.0	56.4	—
7月末	10,004		△0.0	53.8	—
8月末	10,008		0.0	55.1	—
9月末	10,011		0.0	53.5	—
10月末	10,013		0.1	53.1	—
(当期末) 2024年11月20日	10,012		0.1	53.1	—

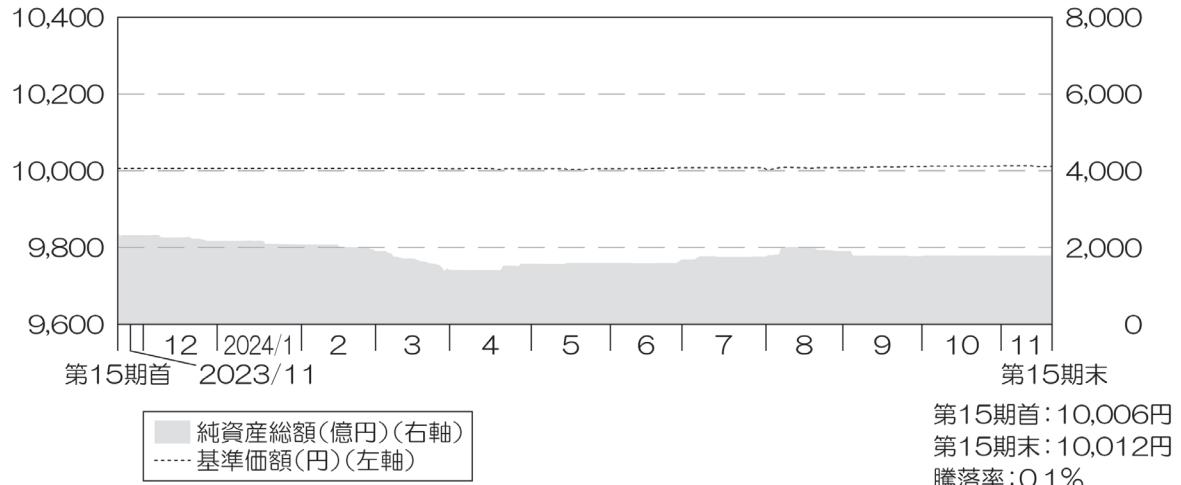
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

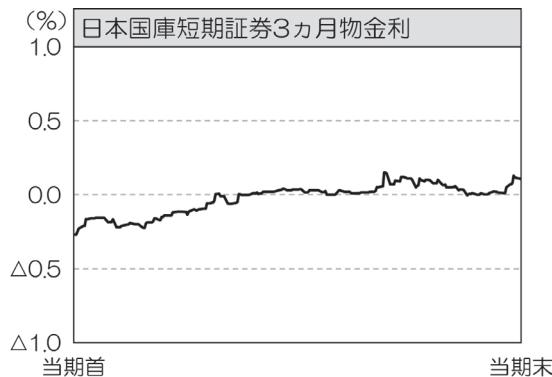
基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

日銀は、2024年3月中旬にかけて「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を継続しましたが、3月19日の金融政策決定会合で、マイナス金利を解除して今後は無担保コール翌日物レートを0～0.1%程度で推移するよう金融調節を行う方針等を決定しました。その後7月末には、無担保コール翌日物レートの誘導目標を0.25%程度へ引き上げました。3ヵ月国債利回りは、2024年3月中旬までマイナス利回りでの推移が続いた後、3月下旬に0.00%近辺に上昇(債券価格は下落)し、7月末には一段と上昇しましたが、8月以降10月下旬にかけては低下(債券価格は上昇)推移となりました。11月以降は、再び上昇しました。無担保コール翌日物金利は、2024年3月中旬にかけて概ね△0.09～0.00%のレンジで推移し、その後期末にかけては概ね0.07～0.25%のレンジ推移となりました。このような中、当ファンドは3月中旬までコール等での運用を続けましたが、3月下旬にプラス利回りの残存1年未満の短期国債への投資を再開しました。再開後期末にかけては、純資産総額で30～60%のプラス利回りの短期国債と残りはコール等にて運用を行った結果、基準価額は前期末比で若干の上昇となりました。

投資環境



3ヶ月国債利回りは、2024年3月中旬までマイナス利回りが続いた後、3月下旬に0.00%近辺に上昇し、7月末の日銀による再利上げ時には一段と上昇しましたが、8月以降10月下旬にかけては、日銀による早期の追加利上げ観測が後退したことから低下しました。11月以降は、米金利上昇の影響を受け、再び上昇推移となりました。

無担保コール翌日物金利は、2024年3月中旬にかけて概ね△0.09～0.00%で推移し、その後期末にかけては概ね0.07～0.25%で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

2024年3月中旬にかけて、日銀の金融緩和継続により残存1年未満の短期国債のマイナス利回り推移が続いたことから、コール等にて運用を行いました。日銀によるマイナス金利解除などの金融政策変更後の3月下旬に、プラス利回りとなった短期国債への投資を再開しました。以降期末にかけて、債券組入比率は純資産総額の概ね30～60%程度、残りはコール等にて運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

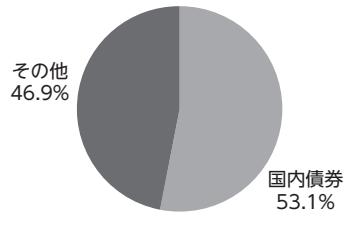
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第1220回国庫短期証券	日本	25.2%
2	第1226回国庫短期証券	日本	22.4%
3	第1238回国庫短期証券	日本	5.6%
4	—	—	—
5	—	—	—
6	—	—	—

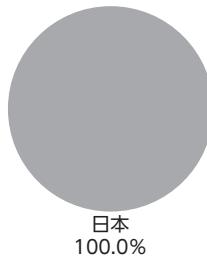
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	—	—	—
8	—	—	—
9	—	—	—
10	—	—	—

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

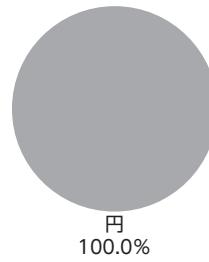
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、主としてわが国の公社債を投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。ポートフォリオにつきましては、金利動向やマーケット環境を踏まえながら、債券組入比率の向上を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要	
	(2023年11月21日～2024年11月20日)			
	金額	比率		
(a) 売買委託手数料	一円	-%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(-)	(-)		
(新株予約権証券)	(-)	(-)		
(オプション証券等)	(-)	(-)		
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)		
(投資信託証券)	(-)	(-)		
(商品)	(-)	(-)		
(先物・オプション)	(-)	(-)		
(b) 有価証券取引税	一	一	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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	
(株式)	(-)	(-)		
(新株予約権証券)	(-)	(-)		
(オプション証券等)	(-)	(-)		
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)		
(公社債)	(-)	(-)		
(投資信託証券)	(-)	(-)		
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$	
(保管費用)	(-)	(-)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用	
(監査費用)	(-)	(-)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用	
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用	
合計	0	0.000		

(注1) 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た結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 「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額(10,006円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当期	
		買付額	売付額
国内	国債証券	千円	千円
		104,878,725	9,986,170

(注)金額は受渡代金です。(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

■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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
預金	百万円 70	百万円 70	% 100.0	百万円 70	百万円 70	% 100.0
金銭信託	631	631	100.0	631	631	100.0
コール・ローン	30,631,766	2,935,346	9.6	30,784,226	2,917,410	9.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

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
国債証券	千円 95,000,000 (95,000,000)	千円 94,922,150 (94,922,150)	% 53.1 (53.1)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 53.1 (53.1)
合計	95,000,000 (95,000,000)	94,922,150 (94,922,150)	53.1 (53.1)	— (—)	— (—)	— (—)	53.1 (53.1)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2)()内は非上場債で内書きです。

(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

当 期 末				
銘柄	利 率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	% —	千円 45,000,000	千円 44,973,360	2025/3/21
第1220回国庫短期証券	—	40,000,000	39,965,240	2025/4/21
第1226回国庫短期証券	—	10,000,000	9,983,550	2025/6/20
第1238回国庫短期証券	—	95,000,000	94,922,150	
合計				

投資信託財産の構成

項目	当 期 末	
	評価額	比率
公社債	千円 94,922,150	% 53.1
コール・ローン等、その他	83,835,722	46.9
投資信託財産総額	178,757,872	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年11月20日現在
(A) 資産	178,757,872,272円
コール・ローン等	83,835,225,021
公社債(評価額)	94,922,150,000
未収入金	419
未収利息	496,832
(B) 負債	11,483
未払解約金	11,483
(C) 純資産総額(A-B)	178,757,860,789
元本	178,550,371,643
次期繰越損益金	207,489,146
(D) 受益権総口数	178,550,371,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,012円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年11月21日 至 2024年11月20日
(A) 配当等収益	66,057,226円
受取利息	77,607,772
その他の収益金	419
支払利息	△11,550,965
(B) 有価証券売買損益	29,595,000
売買益	29,595,000
(C) その他費用	△27
(D) 当期損益金(A+B+C)	95,652,199
(E) 前期繰越損益金	145,643,129
(F) 追加信託差損益金	53,312,061
(G) 解約差損益金	△87,118,243
(H) 計(D+E+F+G)	207,489,146
次期繰越損益金(H)	207,489,146

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換算によるものを含みます。

(注2) (F) 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。

(注3) (G) 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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は236,149,122,113円、期中追加設定元本額は80,679,511,032円、期中一部解約元本額は138,278,261,502円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

ダイナミック・マルチエクスボージャー・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	24,620,823,586円
TOPIXペアファンドF9 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	17,151,569,486円
TOPIXペアファンドF10 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	16,048,642,683円
TOPIXペアファンドF4 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	15,716,568,481円
ダイナミック・為替エクスボージャー・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	13,501,015,451円
TOPIXペアファンドF6 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	13,273,749,460円
TOPIXペアファンドF8 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,787,776,851円
TOPIXペアファンドF5 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,508,486,049円
TOPIXペアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,349,752,451円
TOPIXペアファンドF7 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	9,647,120,614円
TOPIXペアファンドF14 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,337,412,035円
TOPIXペアファンドF13 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,076,933,151円
TOPIXペアファンドF11 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	6,176,470,429円
TOPIXペアファンドF12 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	5,099,163,481円
リスクプレミア ^a ファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
ダイナミック・エクスボージャー・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	2,972,540,925円
私募マネーブールファンドAL (適格機関投資家専用)	261,376,364円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・レアルコース)	5,182,333円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・レアルコース)	4,087,676円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円

バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
SuMi TRUST マルチストラテジー／SMARS (SMA専用)	505,525円
米国国債ペアファンド (建玉比率非調整型Z) (適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXペアファンドF16 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,795円
TOPIXペアファンドF15 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,795円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210,100円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105,486円
PIMCO 米国ハイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99,941円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,791円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19,911円
スマート・コントロール 世界株式戦略ファンド	9,996円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,995円
オーストラリア公社債ファンド (奇数月決算型)	9,995円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型・奇数月決算型)	9,995円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,995円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,994円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,994円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (年2回決算型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (毎月決算型)	9,990円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9,970円
PIMCO 米国ハイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9,963円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9,961円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9,957円
債券コア・セレクション	9,956円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,951円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9,950円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4,985円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,990円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997円

お知らせ

該当事項はありません。