

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2023年4月27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	Credit Suisse Asset Management, LLCが運用する円建外国投資信託証券「HYFI Loan Fund—JPY-EUR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）に決算を行い、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 (ユーロコース)(SMA専用)

償還報告書(全体版)

第10期（償還日 2023年4月27日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。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上げます。今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

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/>

償還金のお知らせ

1万口当たり償還金

12,969円38銭

- 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。)

【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。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			債組入比率	券率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税金配込	騰落率				
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)	10,745	0	7.5	0.9	98.5	1	
第2期(2015年7月10日)	10,653	0	△0.9	0.1	99.0	10	
第3期(2016年7月11日)	8,878	0	△16.7	-	99.4	8	
第4期(2017年7月10日)	10,731	0	20.9	-	99.6	10	
第5期(2018年7月10日)	10,743	0	0.1	-	99.1	9	
第6期(2019年7月10日)	10,438	0	△2.8	-	98.6	1	
第7期(2020年7月10日)	10,185	0	△2.4	-	98.8	1	
第8期(2021年7月12日)	11,511	0	13.0	-	98.5	1	
第9期(2022年7月11日)	11,692	0	1.6	-	99.6	3	
(償還日) 第10期(2023年4月27日)	(償還価額) 12,969.38	-	10.9	-	-	1	

(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	券率	投資信託証券組入比率
	騰落率	騰落率			
(当期首) 2022年7月11日	円 11,692	% -	%	%	% 99.6
7月末	11,772	0.7	-	-	99.6
8月末	12,083	3.3	-	-	99.7
9月末	12,034	2.9	-	-	99.8
10月末	12,645	8.2	-	-	99.9
11月末	12,477	6.7	-	-	99.9
12月末	12,409	6.1	-	-	99.3
2023年1月末	12,572	7.5	-	-	98.7
2月末	12,783	9.3	-	-	98.8
3月末	12,819	9.6	-	-	98.8
(償還日) 2023年4月27日	(償還価額) 12,969.38	10.9	-	-	-

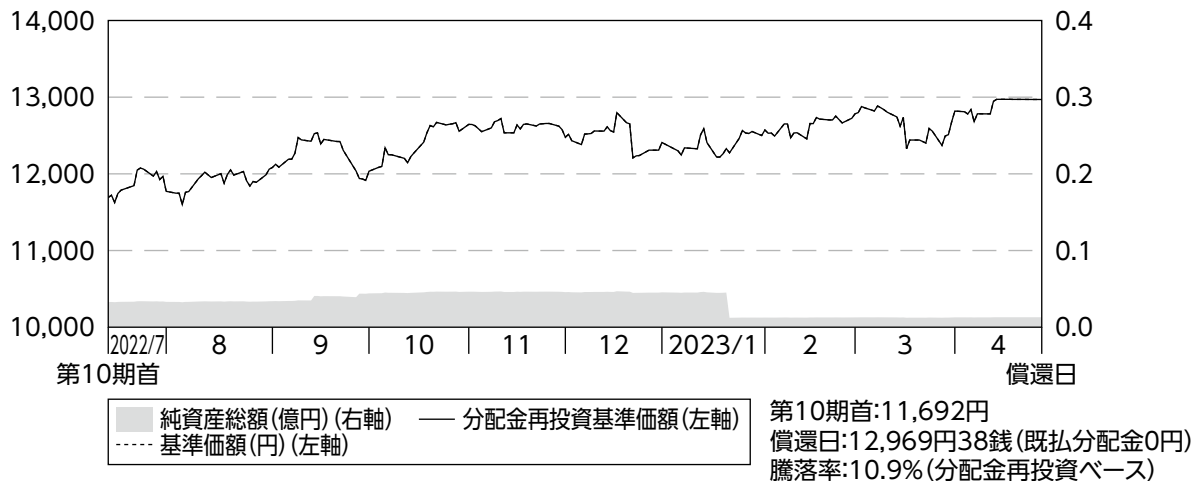
(注1) 騰落率は期首比です。

(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

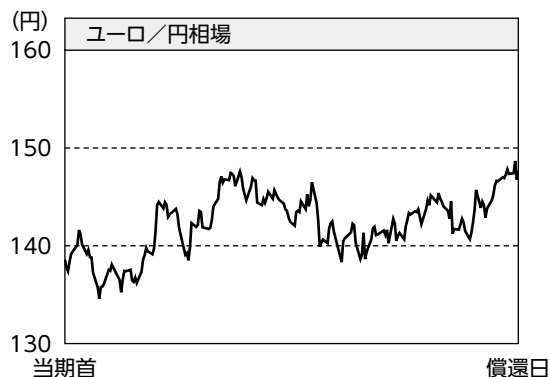
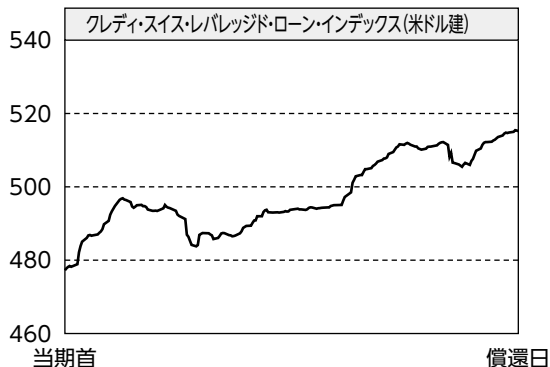


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2022年7月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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-EUR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。

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。米国バンクローン市場は7月以降、堅調に推移しましたが、9月にはFRB(米連邦準備理事会)パウエル議長がインフレ抑制に強くコミットした発言をしたことで、大幅な金融引き締めが継続するとの観測が広まり、リスク資産が全般的に月末にかけて全面安となりました。10月以降の市場は反発し、2023年2月まで5カ月連続でプラスのリターンとなりました。3月以降は金融システム不安等が重石となりました。

○為替市場

当期のユーロ/円相場は、ユーロ高・円安となりました。7月はロシアから欧州への天然ガス供給削減への不安やイタリアの政局不安などから、円高・ユーロ安の展開となりましたが、8月以降はECB(欧州中央銀行)の大幅な利上げ継続やユーロ圏の景況感指標の改善、日銀による政策修正観測の弱まりなどを背景に円安・ユーロ高が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

「HYFI Loan Fund-JPY-EURクラス」への投資を高位に保つ運用を行いました。なお、2023年4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-EURクラス

電機、ヘルスケア/教育、金融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/ユーロ買いの為替取引を行いました。

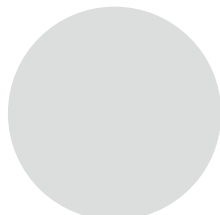
<投資対象ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

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



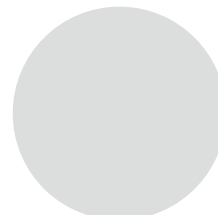
短期金融資産等
100.0%

○国別配分



日本
100.0%

○通貨別配分



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いません。

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-EURクラス」への投資を高位に保つ運用を行いました。なお、2023年4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。

【基準価額の主な変動要因】

<第1期>

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-EUR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-EUR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-EUR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-EUR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-EUR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6期>

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-EUR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-EUR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8期>

主な投資対象である「HYFI Loan Fund-JPY-EUR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-EUR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-EUR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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年7月12日~2023年4月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	54円	0.437%	(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12,399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)	(33)	(0.262)	
(販売会社)	(16)	(0.131)	
(受託会社)	(5)	(0.044)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(b) 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)	(—)	(—)	
(c) 有価証券取引税	—	—	(c) 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)	(—)	(—)	
(d) その他費用	0	0.002	(d) 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(—)	(—)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	54	0.439	

(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。
なお、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あります。

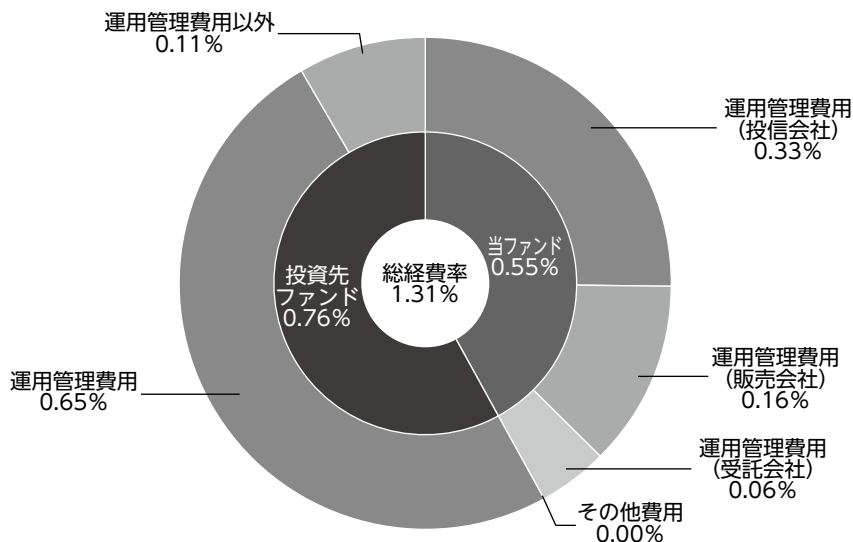
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.31%です。



総経費率(①+②+③)	1.31%
①当ファンドの費用の比率	0.55%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.65%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11%

(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8)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-EURクラス	千口 0.8171	千円 1,050	千口 3	千円 4,582

(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 1	千円 1

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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.000001	百万円 0.000001	% 100.0	百万円 0.000001	百万円 0.000001	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	27	3	11.1	26	3	11.5

(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。

<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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 28	百万円 28	% 100.0	百万円 28	百万円 28	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	69,401,260	6,084,072	8.8	69,507,217	6,075,198	8.7

<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)	当期設定 本	当期解約 本	償還時残高 (元)	取引の理由
千円 1,000	千円 -	千円 -	千円 1,000	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 1,299	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,299	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 2023年4月27日現在
(A)資 産	1,299,395円
コール・ローン等	1,299,395
(B)負 債	2,457
未払信託報酬	2,453
未払利息	2
その他未払費用	2
(C)純資産総額(A-B)	1,296,938
元 本	1,000,000
償還差益金	296,938
(D)受益権総口数	1,000,000口
1万口当たり償還価額(C/D)	12,969円38銭

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年7月12日 至 2023年4月27日
(A)配 当 等 収 益	△10円
支 払 利 息	△10
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	128,748
売 買 益	168,141
売 買 損	△39,393
(C)信 託 報 酬 等	△13,812
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	114,926
(E)前 期 繰 越 損 益 金	19,093
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	162,919
(配 当 等 相 当 額)	(108,798)
(売 買 損 益 相 当 額)	(54,121)
償 還 差 益 金(D+E+F)	296,938

(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2,806,164円、期中追加設定元本額は857,465円、期中一部解約元本額は2,663,629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	2023年 4月27日		資 産 総 額	1,299,395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	2,457円
受益権口数	1,000,000口	1,000,000口	一口	純 資 産 総 額	1,296,938円
元 本 額	1,000,000円	1,000,000円	一口	受 益 権 口 数	1,000,000口
				1万口当たり償還金	12,969.38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	1,000,000円	1,074,465円	10,745円	0円	0.0000%
第 2 期	10,043,227	10,699,442	10,653	0	0.0000
第 3 期	10,043,227	8,916,864	8,878	0	0.0000
第 4 期	9,495,479	10,189,501	10,731	0	0.0000
第 5 期	8,482,475	9,112,474	10,743	0	0.0000
第 6 期	1,000,000	1,043,844	10,438	0	0.0000
第 7 期	1,000,000	1,018,524	10,185	0	0.0000
第 8 期	1,000,000	1,151,050	11,511	0	0.0000
第 9 期	2,806,164	3,280,983	11,692	0	0.0000

お知らせ

信託期間を2028年7月10日までに延長するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
(変更日:2022年10月12日)

マネープールマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2022年11月21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上げます。

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1万円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 比	債券先物率 比	純資産額
	期騰	落中率			
第9期(2018年11月20日)	円 10,032	% △0.1	% —	% —	百万円 577,044
第10期(2019年11月20日)	10,024	△0.1	—	—	544,455
第11期(2020年11月20日)	10,019	△0.0	—	—	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

(注)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比
	騰	落率		
(当期首) 2021年11月22日	円 10,015	% —	% —	% —
11月末	10,015	0.0	—	—
12月末	10,015	0.0	—	—
2022年 1月末	10,014	△0.0	—	—
2月末	10,014	△0.0	—	—
3月末	10,014	△0.0	—	—
4月末	10,014	△0.0	—	—
5月末	10,014	△0.0	—	—
6月末	10,013	△0.0	—	—
7月末	10,013	△0.0	—	—
8月末	10,013	△0.0	—	—
9月末	10,012	△0.0	—	—
10月末	10,012	△0.0	—	—
(当期末) 2022年11月21日	10,011	△0.0	—	—

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は買建比率ー売建比率です。

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

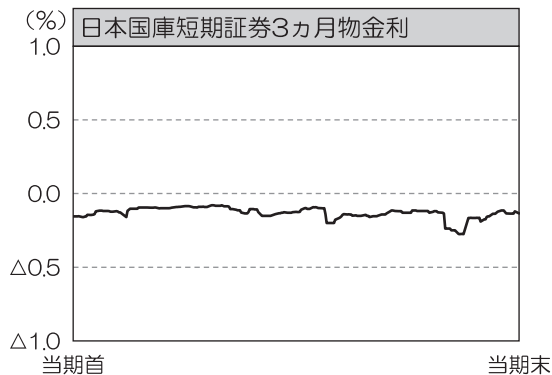
基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りは期を通じてマイナス圏で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09\sim 0\%$ 近辺で推移しました。このような状況の中、基準価額は小幅に下落しました。

投資環境



日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りはマイナス圏での推移となりました。また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09 \sim 0\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

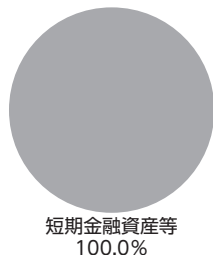
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コール等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

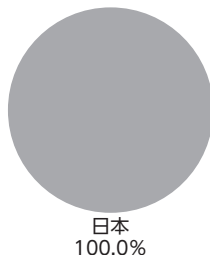
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

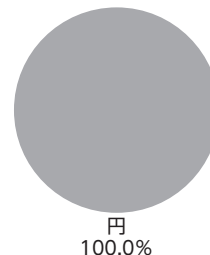
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(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。

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
	(2021年11月23日～2022年11月21日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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	－	－	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(－)	(－)	
(その他)	(0)	(0.000)	
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あります。

(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(10,013円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	28	28	100.0	28	28	100.0
コール・ローン	91,846,878	6,401,770	7.0	91,833,999	6,401,770	7.0

(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。

組入資産の明細

当期末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	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 371,934,952	% 100.0
投資信託財産総額	371,934,952	100.0

※ 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。

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 2022年11月21日現在
(A) 資産	371,934,952,946円
コール・ローン等	371,934,952,946
(B) 負債	1,497,555
未払解約金	544,709
未払利息	952,764
その他未払費用	82
(C) 純資産総額(A-B)	371,933,455,391
元本	371,514,353,891
次期繰越損益金	419,101,500
(D) 受益権総口数	371,514,353,891口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,011円

■損益の状況

項目	当期 自2021年11月23日 至2022年11月21日
(A) 配当等収益	△150,256,731円
受取利息	1,724,564
支払利息	△151,981,295
(B) その他費用	△82
(C) 当期損益金(A+B)	△150,256,813
(D) 前期繰越損益金	549,315,622
(E) 追加信託差損益金	155,678,449
(F) 解約差損益金	△135,635,758
(G) 計(C+D+E+F)	419,101,500
次期繰越損益金(G)	419,101,500

(注1) (E)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2) (F)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358,265,002,227円、期中追加設定元本額は114,656,558,826円、期中一部解約元本額は101,407,207,162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。

225ベアファンド7 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	103,275,806,469円
TOPIXベアファンドF (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	97,023,993,837円
TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	40,913,946,872円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	30,921,835,681円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	23,295,546,510円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	21,404,228,793円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	15,577,844,099円
ダイナミック・マルチエクスポート・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	4,267,283,000円
ダイナミック・為替エクスポート・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	4,138,099,571円
北米株配当戦略投信2018-11 (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)	3,905,313,624円
ダイナミック・エクスポート・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
225ベアファンド9 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	3,382,622,913円
リスクプレミアムαファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	2,616,273,059円
225ベアファンド6 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,331,276,690円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	1,057,375,332円
米国株価指数レバレッジ戦略ファンド (米国国債リスクコントロール型) (適格機関投資家専用)	99,396,417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・リアルコース)	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・リアルコース)	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
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS (SMA専用)	1,004,876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
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	299,461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
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9, 983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 (予想分配金提示型)	9, 983円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド (SMA専用)	9, 979円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9, 972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 為替ヘッジあり (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 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9, 970円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9, 963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9, 963円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 962円
GARSファンド	9, 961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
バンクローン・オープン (豪ドルコース) (SMA専用)	9, 961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	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
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (ブラジル・レアルコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (円コース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (メキシコ・ペソコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (トルコ・リラコース)	9, 960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (米ドルコース)	9, 960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 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9, 950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
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
バンクローン・オープン (ユーロコース) (SMA専用)	1, 993円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (毎月決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1, 991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (毎月決算型)	1, 991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
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
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 (為替ヘッジなし) (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 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (豪ドルコース)	988円

お知らせ

該当事項はありません。