

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 | 信託期間は2013年12月25日から2023年10月16日までです。 |
| 運用方針 | 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 | パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー(PIMCO)が運用するパミュダ籍円建投資信託証券「PIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)」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。外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。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。 |

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)
(愛称:ハイイールドプラス/年1(トルコ・リラコース))

償還報告書(全体版)

第10期(償還日 2023年10月16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、信託期間を満了し、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

7,107円53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 | | | 債券組入率 | 債券先比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|-------------------|-------------|--------|--------|--------|--------|------------|------------|
| | (分配落) | 税込分配金 | 期中騰落率 | | | | |
| 設定日(2013年12月25日) | 円 10,000 | 円 — | % — | % — | % — | % — | 百万円 0.5 |
| 第1期(2014年10月16日) | 10,001 | 0 | 0.0 | 0.3 | — | 98.2 | 3 |
| 第2期(2015年10月16日) | 9,847 | 0 | △1.5 | 0.0 | — | 98.3 | 4 |
| 第3期(2016年10月17日) | 9,584 | 0 | △2.7 | — | — | 98.0 | 2 |
| 第4期(2017年10月16日) | 10,069 | 0 | 5.1 | — | — | 97.6 | 2 |
| 第5期(2018年10月16日) | 7,154 | 0 | △29.0 | — | — | 98.2 | 5 |
| 第6期(2019年10月16日) | 8,977 | 0 | 25.5 | — | — | 98.3 | 5 |
| 第7期(2020年10月16日) | 7,491 | 0 | △16.6 | — | — | 97.9 | 1 |
| 第8期(2021年10月18日) | 8,603 | 0 | 14.8 | — | — | 95.5 | 1 |
| 第9期(2022年10月17日) | 7,020 | 0 | △18.4 | — | — | 96.1 | 1 |
| (償還日) | (償還価額) | | | | | | |
| 第10期(2023年10月16日) | 7,107.53 | — | 1.2 | — | — | — | 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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 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 | 債券先比率 | 投資信託証券組入比率 |
|-------------|----------|------|-------|-------|------------|
| | | 騰落率 | | | |
| (当期首) | 円 | % | % | % | % |
| 2022年10月17日 | 7,020 | — | — | — | 96.1 |
| 10月末 | 7,220 | 2.8 | — | — | 95.9 |
| 11月末 | 7,045 | 0.4 | — | — | 94.4 |
| 12月末 | 6,821 | △2.8 | — | — | 96.1 |
| 2023年1月末 | 6,972 | △0.7 | — | — | 96.7 |
| 2月末 | 7,253 | 3.3 | — | — | 93.0 |
| 3月末 | 7,120 | 1.4 | — | — | 97.4 |
| 4月末 | 7,428 | 5.8 | — | — | 97.9 |
| 5月末 | 7,779 | 10.8 | — | — | 98.0 |
| 6月末 | 6,952 | △1.0 | — | — | 95.1 |
| 7月末 | 6,743 | △3.9 | — | — | 95.8 |
| 8月末 | 7,193 | 2.5 | — | — | 97.0 |
| 9月末 | 7,207 | 2.7 | — | — | 97.1 |
| (償還日) | (償還価額) | | | | |
| 2023年10月16日 | 7,107.53 | 1.2 | — | — | — |

(注1) 騰落率は期首比です。

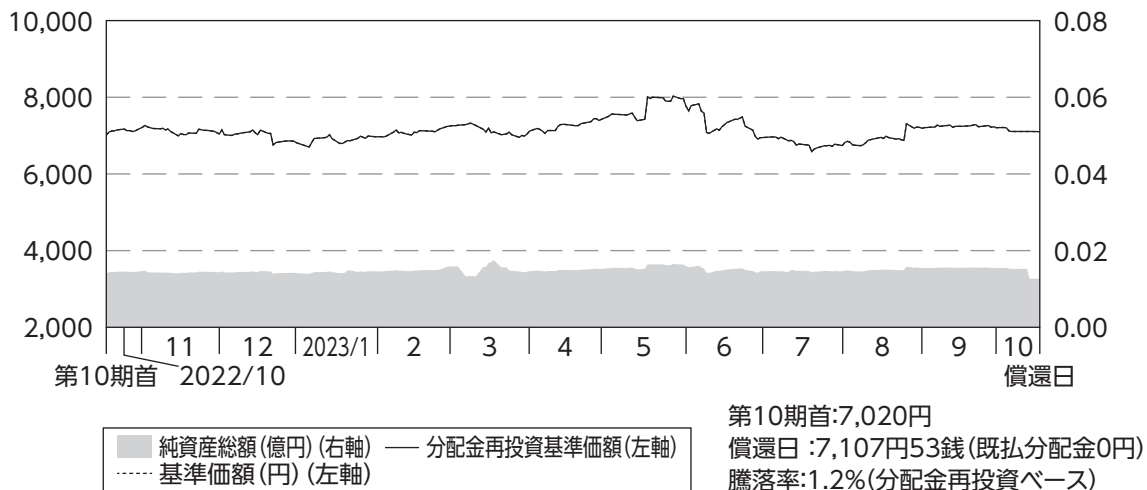
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 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

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。

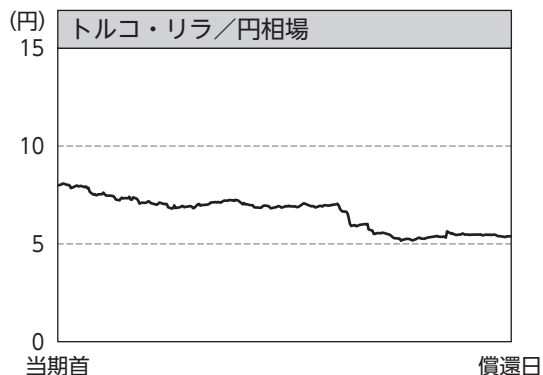
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2022年10月17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

当ファンドの主要投資対象であるPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)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



<米国ハイイールド債券市場>

当期中、FRB(米連邦準備理事会)による金融引き締めの継続などを受けて、米国債利回りは上昇しました。一方、米インフレ率の上昇が落ち着いたことや株式市場の上昇などが好感されスプレッドは縮小しました。米国債利回りの上昇はマイナス要因となったもののスプレッドの縮小などがプラス要因となり、米国ハイイールド債券市場は上昇しました。

<外国為替市場>

低金利政策を継続してきたエルドアン大統領が再選を果たしたことなどがマイナス要因となり、トルコ・リラ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

主要投資対象であるPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)への投資を高位に保つ運用を行いました。償還対応として、2023年10月上旬に投資対象ファンドを全て売却しました。

・PIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)

景気後退の可能性も意識される中、慎重姿勢を維持しながらファンダメンタルズの健全性などを見極め、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行いました。具体的には、新型コロナウイルス後の航空需要の回復の恩恵を受ける航空などへの投資比率を多めとした一方、Eコマース市場の拡大が加速する中、対面販売への依存度が高い一部の小売などへの投資比率を少なめとしました。また、米ドル建資産に対し、原則として米ドル売りトルコ・リラ買いの為替取引を行いました。

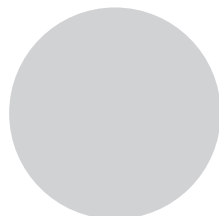
<投資対象ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

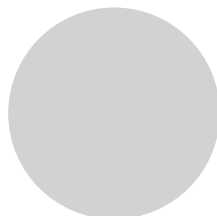
償還時における該当事項はありません。

○資産別配分



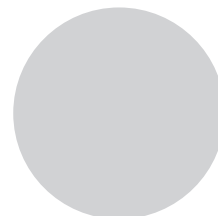
短期金融資産等
100.0%

○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

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)への投資を高位に保つ運用を行いました。償還対応として、2023年10月上旬に投資対象ファンドを全て売却しました。

【基準価額の主な変動要因】

<第1期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額は上昇しましたが、当ファンドの純資産総額に対する多額の設定・解約が影響したことで当期の基準価額(分配金再投資ベース)は横ばいとなりました。

<第2期～第3期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が下落したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は下落しました。

<第4期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が上昇したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

<第5期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が下落したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は下落しました。

<第6期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が上昇したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

<第7期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が下落したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は下落しました。

<第8期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が上昇したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

<第9期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が下落したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は下落しました。

<第10期>

主要投資対象ファンドのPIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ファンドⅡークラスY(TRY)の基準価額が上昇したことから、当期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|------------------|---------------------------|---------|---|
| | (2022年10月18日～2023年10月16日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 125円 | 1.755% | (a) 信託報酬 = $\frac{\text{期中の平均基準価額}}{\text{期中の平均基準価額}} \times \text{信託報酬率}$ 期中の平均基準価額は7,144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。 |
| (投信会社) | (74) | (1.031) | 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 |
| (販売会社) | (49) | (0.680) | |
| (受託会社) | (3) | (0.044) | |
| | | | |
| (b) 売買委託手数料 | — | — | (b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ |
| (株式) | (—) | (—) | 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 |
| (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 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$ |
| (株式) | (—) | (—) | 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 |
| (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 | 0.000 | (d) 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) | (—) | (—) | 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 |
| (監査費用) | (0) | (0.000) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 125 | 1.755 | |

(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。

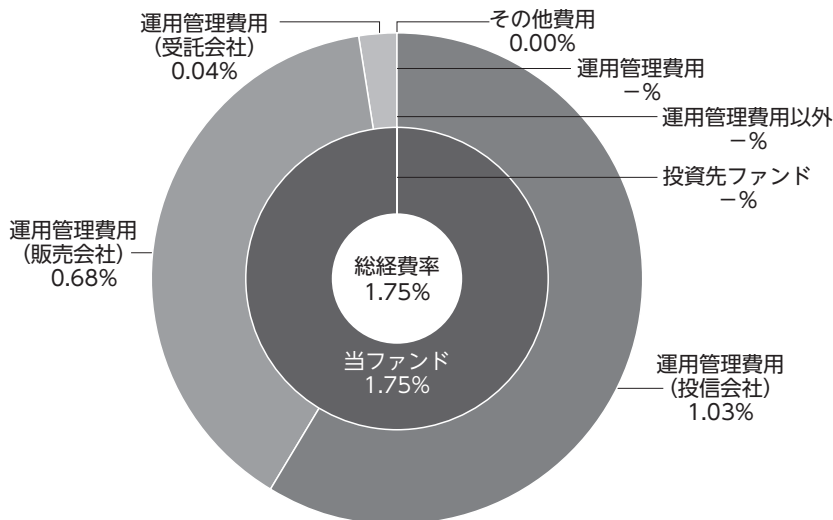
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.75%です。



| | |
|---------------------|-------|
| 総経費率(①+②) | 1.75% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.75% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用等の比率 | 0.00% |

(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等はありません。ただし、運用管理費用(投信会社)に当ファンドの信託財産の運用に係る権限の一部を委託するため要する費用を含みます。

(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 | PIMCO U.S. ハイイールド・ストラテジー・ ファンドⅡークラスY (TRY) | 千口 0.6039 | 千円 681 | 千口 1 | 千円 2,012 |

(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 0.018140 | 百万円 0.018140 | % 100.0 | 百万円 0.018140 | 百万円 0.018140 | % 100.0 |
| コール・ローン | 25 | 1 | 4.0 | 23 | 1 | 4.3 |

(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 | $\frac{D}{C}$ |
| 金 銭 信 託 | 百万円 2,771 | 百万円 2,771 | % 100.0 | 百万円 2,771 | 百万円 2,771 | % 100.0 |
| コール・ローン | 71,518,086 | 7,869,585 | 11.0 | 71,671,972 | 7,915,896 | 11.0 |

<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 元 | 当期解約 元 | 償還時残高 (元) | 取引の理由 |
|--------------|-----------|-----------|--------------|-------------|
| 千円 500 | 千円 - | 千円 - | 千円 500 | 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 1,538 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,538 | 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10月16日現在 |
|---------------------|------------------------|
| (A) 資 産 | 1,538,185円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,538,185 |
| (B) 負 債 | 272,878 |
| 未 払 解 約 金 | 259,569 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 13,307 |
| 未 払 利 息 | 1 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 1 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 1,265,307 |
| 元 本 | 1,780,234 |
| 償 還 差 損 金 | △514,927 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,780,234口 |
| 1万口当たり償還価額(G/D) | 7,107円53銭 |

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2022年10月18日 至 2023年10月16日 |
|-----------------------|---------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 64,034円 |
| 受 取 配 当 金 | 64,045 |
| 支 払 利 息 | △11 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △32,576 |
| 売 買 益 | 14,335 |
| 売 買 損 | △46,911 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △26,095 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | 5,363 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △49,857 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △470,433 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,418,156) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△2,888,589) |
| 償 還 差 損 金 (D+E+F) | △514,927 |

(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3) 当ファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託するために要する費用として、計算期間を通じて投資対象の投資信託受益証券の日々の時価総額に対して年10,000分の63(税抜)の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は2,023,870円、期中追加設定元本額は1,199,352円、期中一部解約元本額は1,442,988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12月25日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|----------|------------|-------------|------------|--------------|------------|
| | 投資信託契約終了日 | 2023年10月16日 | | 資産総額 | 1,538,185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 | 272,878円 |
| 受益権口数 | 500,000口 | 1,780,234口 | 1,280,234口 | 純資産総額 | 1,265,307円 |
| | | | | 受益権口数 | 1,780,234口 |
| 元本額 | 500,000円 | 1,780,234円 | 1,280,234円 | 1万口当たり償還金 | 7,107.53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 | 3,285,869円 | 3,286,326円 | 10,001円 | 0円 | 0.0000% |
| 第2期 | 4,212,893 | 4,148,228 | 9,847 | 0 | 0.0000 |
| 第3期 | 2,141,414 | 2,052,311 | 9,584 | 0 | 0.0000 |
| 第4期 | 2,473,170 | 2,490,357 | 10,069 | 0 | 0.0000 |
| 第5期 | 7,100,958 | 5,079,694 | 7,154 | 0 | 0.0000 |
| 第6期 | 6,479,796 | 5,817,217 | 8,977 | 0 | 0.0000 |
| 第7期 | 2,201,630 | 1,649,149 | 7,491 | 0 | 0.0000 |
| 第8期 | 1,614,443 | 1,388,907 | 8,603 | 0 | 0.0000 |
| 第9期 | 2,023,870 | 1,420,749 | 7,020 | 0 | 0.0000 |

お知らせ

該当事項はありません。

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 | % | % | % | 百万円 577,044 |
| 第10期 (2019年11月20日) | 10,032 | △0.1 | — | — | 544,455 |
| 第11期 (2020年11月20日) | 10,024 | △0.1 | — | — | 486,701 |
| 第12期 (2021年11月22日) | 10,019 | △0.0 | — | — | 358,814 |
| 第13期 (2022年11月21日) | 10,015 | △0.0 | — | — | 371,933 |

(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 比 | 債 券 先 物 率 比 |
|------------------------|---------|------|----------------|----------------|
| | 騰 落 | 率 | | |
| (当 期 首) 2021年11月22日 | 円 | % | % | % |
| 11月末 | 10,015 | — | — | — |
| 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 | — | — |

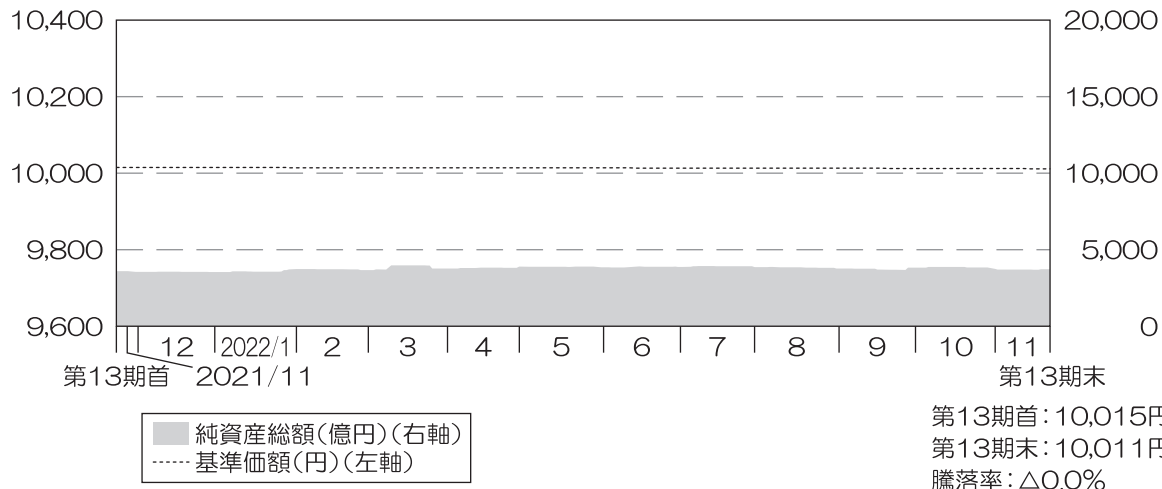
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－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

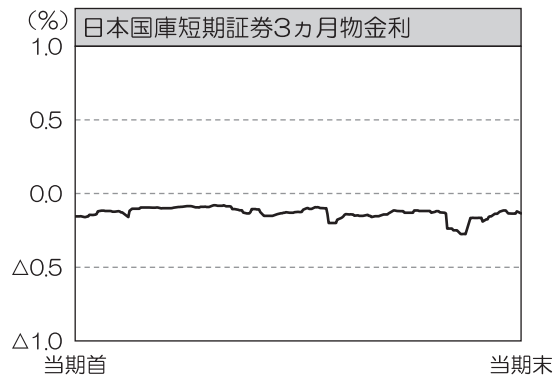
基準価額等の推移



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

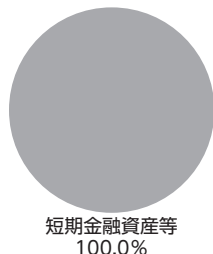
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コール等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

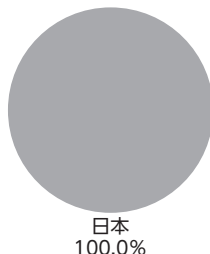
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

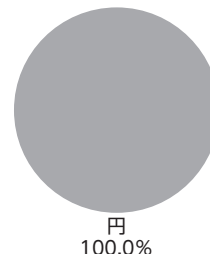
○資産別配分



○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 |
| 私募マネーブルファンド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 |
| NW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 |
| NW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 |
| NW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・リアルコース) | 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 |
| NW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。