

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2017年3月9日から2021年10月14日（繰上償還決定前は2027年8月25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	ヌビーン・アセット・マネジメント・エルエルシーが運用する、ケイマン籍円建外国投資信託証券「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」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、毎年8月25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。

NMS 米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)

償還報告書(全体版)

第6期（償還日 2021年10月14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/>

償還金のお知らせ

1万口当たり償還金

11,128円16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			参考指数		債券組入比率	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		期中 騰落率			
設定日(2017年 3月 9日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	百万円 0.5
第1期(2017年 8月25日)	10,310	0	3.1	10,366	3.7	—	98.1	245
第2期(2018年 8月27日)	10,148	0	△1.6	10,255	△1.1	—	98.2	171
第3期(2019年 8月26日)	10,803	0	6.5	11,189	9.1	—	98.1	185
第4期(2020年 8月25日)	11,026	0	2.1	11,700	4.6	—	98.1	65
第5期(2021年 8月25日)	11,259	0	2.1	12,003	2.6	—	98.2	62
(償還日) 第6期(2021年10月14日)	(償還価額) 11,128.16	—	△1.2	11,817	△1.6	—	—	58

(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。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		参考指数		債券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率		
(当期首) 2021年 8月25日	円 11,259	% —	12,003	% —	% —	% 98.2
8月末	11,251	△0.1	12,023	0.2	—	98.0
9月末	11,132	△1.1	11,818	△1.5	—	98.8
(償還日) 2021年10月14日	(償還価額) 11,128.16	△1.2	11,817	△1.6	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

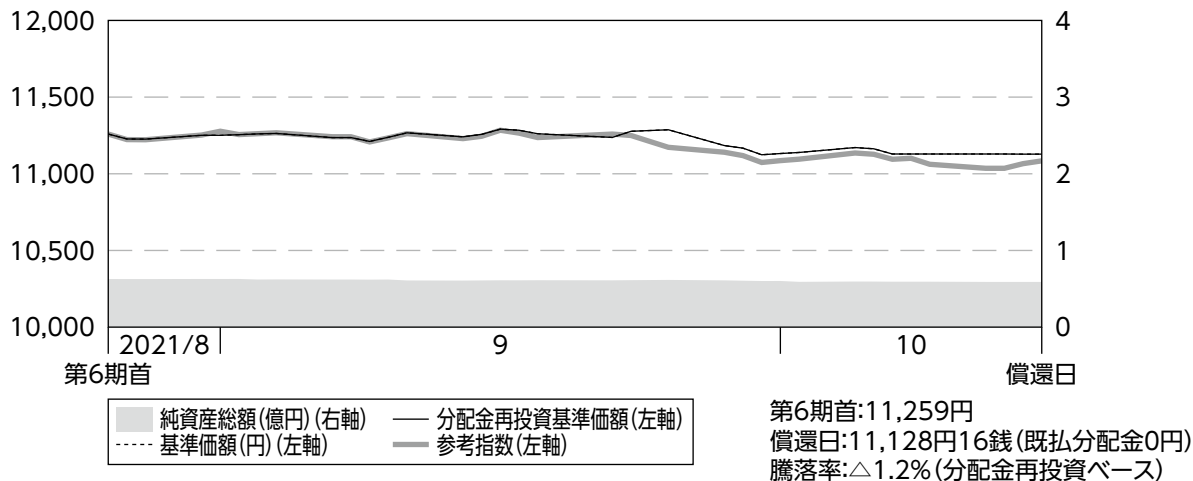
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

参考指数は、S&P Long Intermediate Term Taxable Municipal Bond Index(円ヘッジベース)です。

S&P Long Intermediate Term Taxable Municipal Bond Indexとは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、米ドル建中長期(5年以上15年未満)の課税投資適格地方債市場の投資パフォーマンスを表します。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。同指数の所有権及びその他一切の権利は、S&P Globalの一部門であるSPDJIが有しています。SPDJIは、同指数等の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

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。

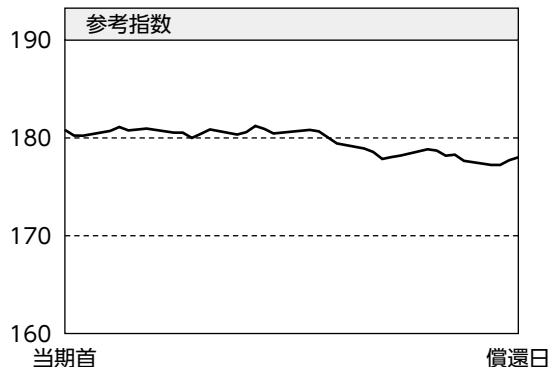
(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額及び参考指数は、2021年8月25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

主な投資対象である「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の基準価額(分配金再投資ベース)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



当期における米国地方債市場の利回りは上昇(価格は下落)しました。

当期の米10年国債利回りは、2021年9月下旬以降に上昇しました。パウエルFRB(米連邦準備理事会)議長がFOMC(米連邦公開市場委員会)後の会見で、11月にテーパリング(量的金融緩和の段階的縮小)の開始を決定することやテーパリングが2022年半ばまでに完了する可能性を示唆したことなどが、市場ではタカ派(金融引き締めの)と受け止められ、利回りは上昇しました。

当期の米国地方債の対米国債スプレッド(米国債に対する上乗せ金利)は概ね横ばい推移となり、米国地方債の利回りの上昇幅は米国債と同程度となりました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

主な投資対象である「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の組入比率を高位に保つ運用を行いました。繰上償還の決定を受けて、10月上旬に投資対象ファンドを全売却しました。

・Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class

当期においても相対的に利回りの高い長期ゾーンの債券を組み入れる一方で、デレションリスクを抑制するため短期ゾーンの債券も組み入れたポートフォリオで運用を行いました。税収入財源債、公益、輸送セクターといったキャッシュフローが強固なセクターのほか、投資機会が豊富なヘルスケアセクターを高位に維持しました。組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を目指しました。

<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



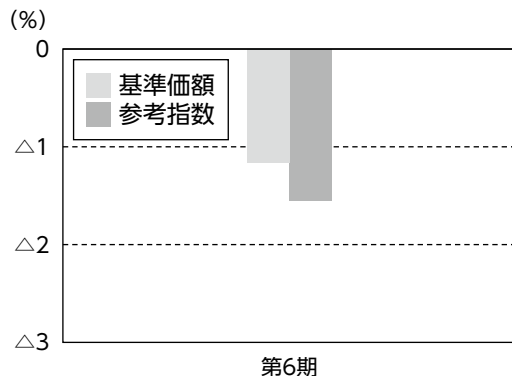
円
100.0%

(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

当ファンドは運用の目標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の騰落率の対比です。



分配金

該当事項はありません。

設定以来の運用経過

主な投資対象である「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の組入比率を高位に保つ運用を行いました。当ファンドの繰上償還の決定を受けて、2021年10月上旬に投資対象ファンドを全売却しました。

[基準価額の主な変動要因]

<第1期>

主な投資対象である「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の基準価額(分配金再投資ベース)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「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の基準価額(分配金再投資ベース)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「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の基準価額(分配金再投資ベース)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4期>

主な投資対象である「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の基準価額(分配金再投資ベース)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「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の基準価額(分配金再投資ベース)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「Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class」の基準価額(分配金再投資ベース)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
	(2021年8月26日~2021年10月14日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	5円	0.047%	(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11,191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)	(3)	(0.024)	
(販売会社)	(2)	(0.018)	
(受託会社)	(1)	(0.005)	
(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	0.001	(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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(—)	(—)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(—)	(—)	
合計	5	0.048	

(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。

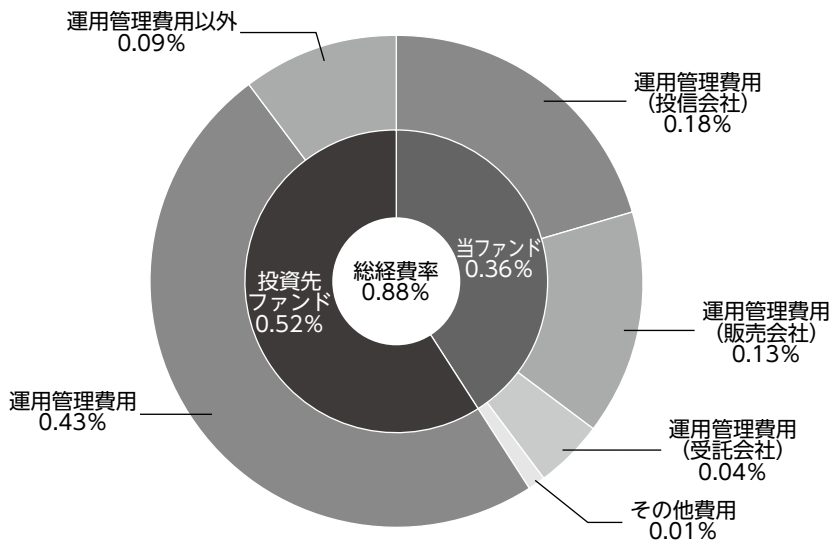
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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0.88%です。



総経費率(①+②+③)	0.88%
①当ファンドの費用の比率	0.36%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.43%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.09%

(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	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY-H Dividend Retail Class	千口 0.0656	千円 600	千口 6	千円 61,332

(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 0.996	千円 0.997

利害関係人[※]との取引状況等

当期中における利害関係人との取引等はありません。

組入資産の明細

償還時における該当事項はありません。

※ 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。

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 59,276	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	59,276	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 2021年10月14日現在
(A)資 産	59,276,920円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	59,276,920
(B)負 債	309,935
未 払 解 約 金	280,327
未 払 信 託 報 酬	29,019
未 払 利 息	137
そ の 他 未 払 費 用	452
(C)純 資 産 総 額(A-B)	58,966,985
元 本	52,988,969
償 還 差 益 金	5,978,016
(D)受 益 権 総 口 数	52,988,969口
1万口当たり償還価額(C/D)	11,128円16銭

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年 8月26日 至 2021年10月14日
(A)配 当 等 収 益	188,131円
受 取 配 当 金	188,677
受 取 利 息	2
支 払 利 息	△548
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△851,055
売 買 益	26,788
売 買 損	△877,843
(C)信 託 報 酬 等	△29,471
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△692,395
(E)前 期 繰 越 損 益 金	4,897,790
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,772,621
(配 当 等 相 当 額)	(3,345,346)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,572,725)
償 還 差 益 金(D+E+F)	5,978,016

(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55,710,545円、期中追加設定元本額は1,105,353円、期中一部解約元本額は3,826,929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	2017年 3月 9日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年10月14日		資 産 総 額	59,276,920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	309,935円
受益権口数	500,000口	52,988,969口	52,488,969口	純 資 産 総 額	58,966,985円
元 本 額	500,000円	52,988,969円	52,488,969円	受 益 権 口 数	52,988,969口
毎計算期末の状況				1万口当たり償還金	11,128.16円
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	238,556,523円	245,959,026円	10,310円	0円	0.0000%
第 2 期	168,541,326	171,029,029	10,148	0	0.0000
第 3 期	171,978,244	185,789,709	10,803	0	0.0000
第 4 期	59,436,075	65,532,966	11,026	0	0.0000
第 5 期	55,710,545	62,726,378	11,259	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11期（決算日 2020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 総
	期 騰 落	中 率			
第 7 期 (2016年11月21日)	円	%	%	%	百万円 111
第 8 期 (2017年11月20日)	10,046	△0.0	—	—	239,473
第 9 期 (2018年11月20日)	10,040	△0.1	—	—	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11期 (2020年11月20日)	10,019	△0.0	—	—	486,701

(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) 2019年11月20日	円	%	%	%
11月末	10,024	—	—	—
12月末	10,024	0.0	—	—
2020年 1月末	10,023	△0.0	—	—
2月末	10,023	△0.0	—	—
3月末	10,022	△0.0	—	—
4月末	10,022	△0.0	—	—
5月末	10,022	△0.0	—	—
6月末	10,021	△0.0	—	—
7月末	10,021	△0.0	—	—
8月末	10,020	△0.0	—	—
9月末	10,020	△0.0	—	—
10月末	10,020	△0.0	—	—
(当 期 末) 2020年11月20日	10,019	△0.0	—	—

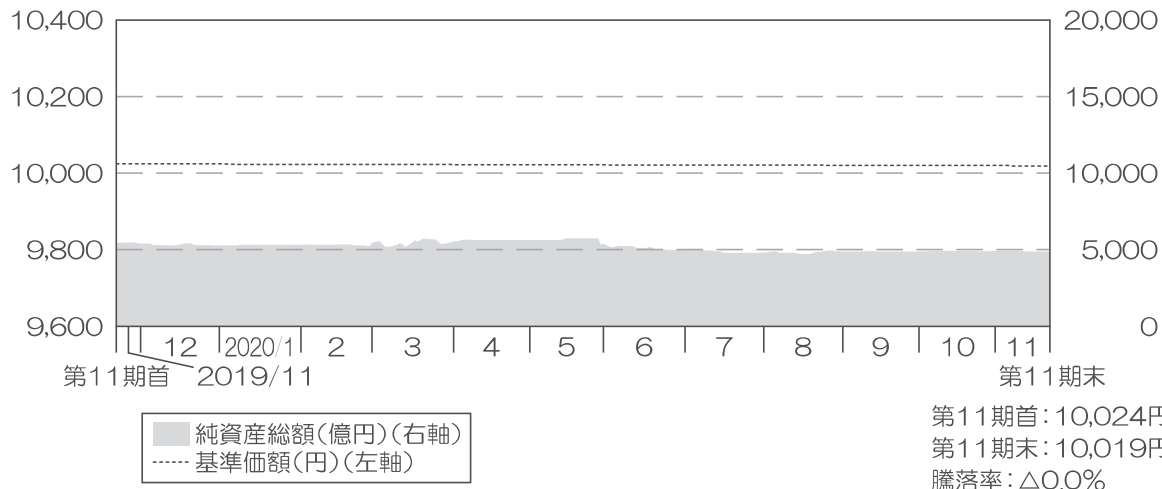
(注1) 騰落率は期首比です。

(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

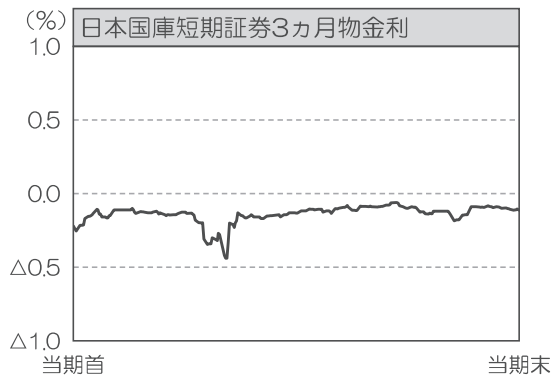
基準価額等の推移



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 $\Delta 0.1 \sim 0\%$ 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 $\Delta 0.1 \sim 0\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

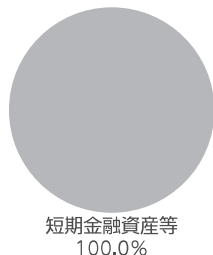
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コールおよび金銭信託等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

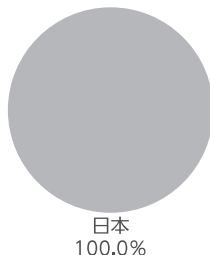
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

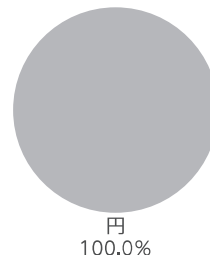
○資産別配分



○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
	(2019年11月21日～2020年11月20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(10,021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	101,823	101,823	100.0	101,823	101,823	100.0
コール・ローン	126,879,321	14,705,458	11.6	126,937,680	14,831,104	11.7

(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 486,702,869	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	486,702,869	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 2020年11月20日現在
(A) 資 産	486,702,869,504円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	486,702,869,504
(B) 負 債	1,715,563
未 払 解 約 金	1,070,182
未 払 利 息	645,381
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	486,701,153,941
元 本	485,765,055,436
次 期 繰 越 損 益 金	936,098,505
(D) 受 益 権 総 口 数	485,765,055,436口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,019円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年11月21日 至 2020年11月20日
(A) 配 当 等 収 益	△252,317,808円
受 取 利 息	2,247,512
支 払 利 息	△254,565,320
(B) そ の 他 費 用	△908,039
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△253,225,847
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	1,313,664,968
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	621,907,622
(F) 解 約 差 損 益 金	△746,248,238
(G) 計 (C+D+E+F)	936,098,505
次 期 繰 越 損 益 金(G)	936,098,505

(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543,142,104,633円、期中追加設定元本額は278,089,022,149円、期中一部解約元本額は335,466,071,346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)	131,695,710,569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)	120,992,929,824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)	93,158,917,044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)	38,964,677,216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)	31,297,357,632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)	23,615,935,088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)	17,187,450,587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)	13,180,772,188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)	5,544,129,457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)	3,393,223,554円
米回国債ベアファンド (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	1,693,023,732円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	1,390,191,638円
米国株式ベアファンド4 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	1,254,203,002円
ドイツ中期国債ベアファンド3 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	956,061,117円
日本債券ベアファンド4 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	760,935,151円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	677,915,273円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	46,604,436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F2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	299,044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
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
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
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 (豪ドルコース) (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
GARSファンド	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) (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) (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) (米ドルコース)	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) (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) (メキシコ・ペソコース)	9,960円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9,957円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	9,957円
債券コア・セクション	9,956円
欧州REIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,953円
国内株式SMTBセクション (SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセクション (SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセクション (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 為替ヘッジなし (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 (年2回決算型)	1,991円
欧州REIT・リサーチ・オープン (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
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
NMS 米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (SMA専用)	996円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	996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。