

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／債券
設定日	2011年11月30日
信託期間	2011年11月30日～2021年11月19日（約10年）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、本邦通貨建ての公社債および短期金融商品等に実質的に投資を行い、利息等収入の確保を図ります。
主要運用対象	グローバルCBオープン（マネープールファンド） ・キャッシュ・マネジメント・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 キャッシュ・マネジメント・マザーファンド ・本邦通貨建て公社債および短期金融商品等を主要投資対象とします。
投資制限	グローバルCBオープン（マネープールファンド） ・株式への実質投資は行いません。 ・外貨建資産への実質投資は行いません。 キャッシュ・マネジメント・マザーファンド ・株式への投資は行いません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・デリバティブ取引（有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引をいいます。）の利用はヘッジ目的に限定しません。
分配方針	毎年5月、11月の19日（休業日の場合は、翌営業日）の決算日に、分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含まれます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。 * 分配金自動再投資型の場合、分配金は税金を差し引いた後自動的に無手数料で再投資されます。

- 口座残高など、お取引状況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。
- 運用報告書についてのお問い合わせ
コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

運用報告書（全体版）

第18期

決算日 2020年11月19日

グローバルCBオープン （マネープールファンド）

受益者の皆様へ

毎々、格別のお引き立てにあずかり厚くお礼申し上げます。

さて「グローバルCBオープン（マネープールファンド）」は、去る2020年11月19日に第18期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

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DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

最近5期の運用実績

決算期	(分配落)	基準価額		公社債組入比率	純資産額
		税込 分配金	期騰 落率		
	円	円	%	%	百万円
第14期（2018年11月19日）	9,996	0	△ 0.0	75.9	5
第15期（2019年5月20日）	9,991	0	△ 0.1	70.5	2
第16期（2019年11月19日）	9,988	0	△ 0.0	74.6	2
第17期（2020年5月19日）	9,984	0	△ 0.0	79.2	2
第18期（2020年11月19日）	9,982	0	△ 0.0	61.4	2

*当ファンドは、安定した収益の確保を図ることを目的とした運用を行っているため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、公社債組入比率は実質組入比率を記載しています。

当期中の基準価額等の推移

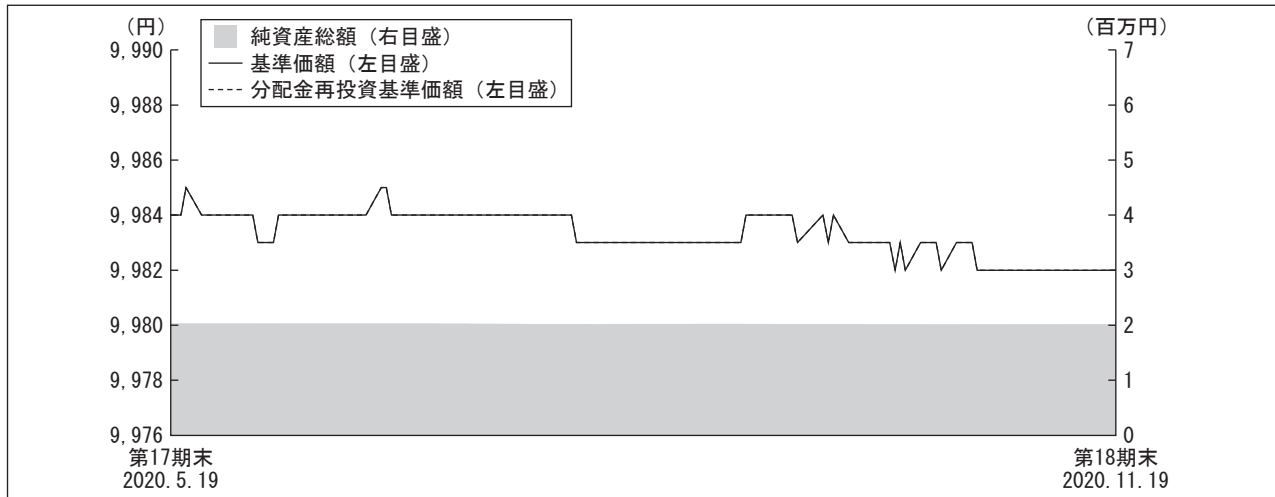
年月日	基準 価額	騰落 率	公社債 組入比 率
(期首) 2020年5月19日	9,984	—	79.2
5月末	9,984	0.0	74.2
6月末	9,985	0.0	87.1
7月末	9,984	0.0	85.8
8月末	9,983	△ 0.0	79.1
9月末	9,983	△ 0.0	82.8
10月末	9,982	△ 0.0	67.8
(期末) 2020年11月19日	9,982	△ 0.0	61.4

*騰落率は期首比です。

*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、公社債組入比率は実質組入比率を記載しています。

運用経過

【基準価額等の推移】



*当ファンドは、安定した収益の確保を図ることを目的とした運用を行っているため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

*分配金再投資基準価額は、期首の基準価額を基準に算出しております。

*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はありません。

*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、ファンドの購入価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。

第18期首：9,984円

第18期末：9,982円（既払分配金 0円）

騰落率：△0.0%（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

当ファンドは、キャッシュ・マネジメント・マザーファンドへの投資を通じて、本邦通貨建ての公社債および短期金融商品等を実質的に投資を行いました。

（下落要因）

マイナス金利政策導入を背景とした無担保コールレートのマイナス化が要因となりました。

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

【投資環境】

国内短期金融市場では、期首-0.13%近辺でスタートした国庫短期証券3ヵ月物の利回りは、大量発行に伴う需給悪化懸念を受けて、一時-0.06%近辺まで上昇しました。その後、日本銀行が短期の国債買い入れオペを増額したことを受けて需給悪化懸念が後退し、-0.10%近辺で期末を迎えました。

【ポートフォリオ】

■グローバルCBオープン（マネープールファンド）

主要投資対象であるキャッシュ・マネジメント・マザーファンドを期を通じて高位に組み入れ、期末の実質的な公社債組入比率は61.4%としました

■キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

安全性と流動性を考慮し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行いました。年限に関しては、残存6ヵ月以内の短期の国債・政府保証債を中心とした運用を継続しました。

【ベンチマークとの差異】

当ファンドは、安定した収益の確保を図ることを目的とした運用を行っているため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

【分配金】

分配金につきましては、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、見送りとさせていただきます。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳

（1万口当り・税引前）

項目	第18期	
	2020年5月20日	2020年11月19日
当期分配金 (円)	0	
(対基準価額比率) (%)	0.00	
当期の収益 (円)	-	
当期の収益以外 (円)	-	
翌期繰越分配対象額 (円)	437	

※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。

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

今後の運用方針

■グローバルCBオープン（マネープールファンド）

引き続き、運用の基本方針に従い、マザーファンドへの投資を通じて、本邦通貨建ての公社債および短期金融商品等に実質的に投資を行い、利息等収入の確保を図ります。

■キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

新型コロナウイルスの感染拡大への懸念に伴う金融情勢を踏まえて、日本銀行は2020年4月の金融政策決定会合において金融緩和の強化を行ったものの、政策金利の引き下げは見送りました。しかし、世界の主要中央銀行が相次いで緊急利下げや量的緩和政策の導入に踏み切ったことや、日本銀行も国債のさらなる積極的な買い入れを明示したことから、市場利回りは当分の間低い水準での推移を予想します。引き続き、安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行っていきます。ファンドの平均残存年限については、2~4ヵ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年5月20日~2020年11月19日		
	金額	比率	
信託報酬	－円	－%	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9,984円です。
（投信会社）	（－）	（－）	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	（－）	（－）	購入後の情報提供、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等の対価
（受託会社）	（－）	（－）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
その他費用	0	0.000	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	（0）	（0.000）	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.000	

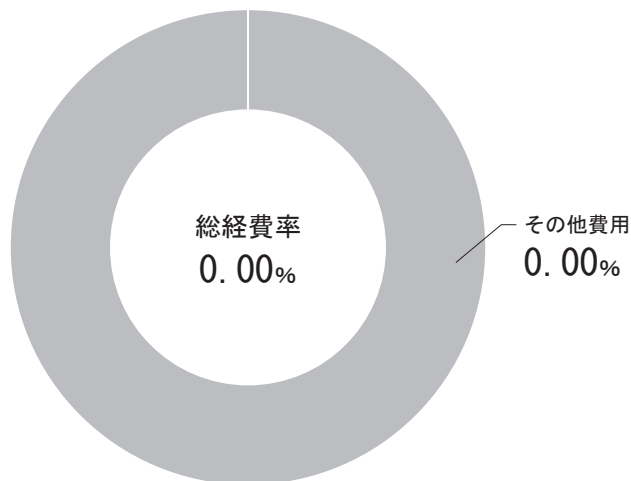
* 「比率」欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により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、その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託受益証券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。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

参考情報 総経費率（年率換算）



*各費用は、前掲「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、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。

*各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。

*上記の前提条件で算出しているため、「1万口当りの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.00%です。

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2020年5月20日から2020年11月19日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	千口 10	千円 10	千口 71	千円 72

利害関係人との取引状況等

（2020年5月20日から2020年11月19日まで）

■利害関係人との取引状況

<グローバルCBオープン（マネープールファンド）>

当期における利害関係人との取引はありません。

<キャッシュ・マネジメント・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
公 社 債	百万円 2,539	百万円 1,307	% 51.5	百万円 -	百万円 -	% -

*平均保有割合0.0%

*平均保有割合とは親投資信託残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合

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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

自社による当ファンドの設定・解約状況

（2020年5月20日から2020年11月19日まで）

期首残高（元本）	当期設定元本	当期解約元本	期末残高（元本）	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

組入資産の明細

2020年11月19日現在

■親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	千円 2,002	千円 1,941	千円 1,971

<補足情報>

キャッシュ・マネジメント・マザーファンドにおける組入資産の明細

下記は、キャッシュ・マネジメント・マザーファンド全体（5,680,313千円）の内容です。

■公社債

A 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2020年11月19日現在						
	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
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	200,000 (200,000)	200,345 (200,345)	3.5 (3.5)	— (—)	— (—)	— (—)	3.5 (3.5)
特殊債券 (除く金融債券)	2,420,000 (2,420,000)	2,428,929 (2,428,929)	42.1 (42.1)	— (—)	— (—)	— (—)	42.1 (42.1)
普通社債券	1,000,000 (1,000,000)	1,000,491 (1,000,491)	17.3 (17.3)	— (—)	— (—)	— (—)	17.3 (17.3)
合 計	3,620,000 (3,620,000)	3,629,766 (3,629,766)	62.9 (62.9)	— (—)	— (—)	— (—)	62.9 (62.9)

*（ ）内は、非上場債で内書き

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

B 個別銘柄開示 国内（邦貨建）公社債

銘柄	2020年11月19日現在			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
(地方債証券)				
27-1 仙台市5年	0.1010	100,000	100,009	2021/01/27
347 大阪府公債	1.3200	100,000	100,335	2021/02/25
小計	—	200,000	200,345	—
(特殊債券（除く金融債券）)				
25 政保政策投資C	0.1470	600,000	600,000	2020/11/25
122 政保道路機構	0.9000	95,000	95,017	2020/11/30
19 政保地方公共団	1.2000	500,000	500,384	2020/12/14
129 政保道路機構	1.2000	200,000	200,611	2021/02/26
22 国際協力銀行	1.8900	100,000	100,623	2021/03/22
9 政保道路機構	1.9000	500,000	503,266	2021/03/26
135 政保道路機構	1.1000	130,000	130,747	2021/05/31
137 政保道路機構	1.2000	95,000	95,696	2021/06/30
14 政保政策投資B	2.1000	100,000	101,719	2021/09/13
145 政保道路機構	1.0000	100,000	100,863	2021/09/30
小計	—	2,420,000	2,428,929	—
(普通社債券)				
2 コカ・コーライースト	0.2760	100,000	100,009	2020/12/14
25 中日本高速道	1.2800	100,000	100,096	2020/12/18
3 大日本印刷	1.3580	100,000	100,096	2020/12/18
5 日本梱包運輸	0.6140	100,000	100,029	2020/12/18
2 ファーストリテイリング	0.2910	100,000	100,009	2020/12/18
379 中国電力	0.6190	100,000	100,098	2021/01/25
57 クレディセゾン	0.4200	100,000	100,048	2021/01/29
185 オリックス	0.4150	100,000	100,068	2021/02/19
27 三菱UFJリース	0.5080	100,000	100,098	2021/02/24
23 リコーリース	0.0500	100,000	99,936	2021/09/24
小計	—	1,000,000	1,000,491	—
合計	—	3,620,000	3,629,766	—

投資信託財産の構成

2020年11月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	千円 1,971	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等、 そ の 他	50	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,021	100.0

グローバルCBオープン（マネープールファンド）

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年11月19日) 現在

項目	当期末
(A) 資産	2,021,775円
コール・ローン等	50,000
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド（評価額）	1,971,775
(B) 純資産総額（A）	2,021,775
元本	2,025,332
次期繰越損益金	△ 3,557
(C) 受益権総口数	2,025,332口
1万口当り基準価額（B/C）	9,982円

*元本状況

期首元本額 2,037,846円

期中追加設定元本額 10,521円

期中一部解約元本額 23,035円

*元本の欠損 3,557円

損益の状況

自2020年5月20日
至2020年11月19日

項目	当期
(A) 有価証券売買損益	△ 382円
売	△ 382
買	△ 損
(B) 当期損益金（A）	△ 382
(C) 前期繰越損益金	△ 3,041
(D) 追加信託差損益金	△ 134
（配当等相当額）	（ 42,611）
（売買損益相当額）	（△ 42,745）
(E) 計（B+C+D）	△ 3,557
次期繰越損益金（E）	△ 3,557
追加信託差損益金	△ 134
（配当等相当額）	（ 42,611）
（売買損益相当額）	（△ 42,745）
分配準備積立金	45,952
繰越損益金	△ 49,375

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

<分配金の計算過程>

信託約款に基づき計算した収益分配可能額及び収益分配金の計算過程は以下のとおりです。

(A) 配当等収益（費用控除後）	6,889円
(B) 有価証券売買等損益（費用控除後、繰越欠損金補填後）	0
(C) 収益調整金	42,611
(D) 分配準備積立金	39,063
分配可能額（A+B+C+D）	88,563
（1万口当り分配可能額）	（ 437.28）
収益分配金	0
（1万口当り収益分配金）	（ 0）

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

運用報告書

決算日：2020年7月27日

(第14期：2019年7月26日～2020年7月27日)

当ファンドは、上記の通り決算を行いました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。
主要運用対象	本邦通貨建て公社債および短期金融商品等を主要投資対象とします。
投資制限	<ul style="list-style-type: none">・ 株式への投資は行いません。・ 外貨建資産への投資は行いません。・ デリバティブ取引（有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引をいいます。）の利用はヘッジ目的に限定しません。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		公社債 組入比率	純資産額
		騰落	率		
第10期 (2016年7月25日)	円		%	%	百万円
	10,186		0.1	81.1	4,928
第11期 (2017年7月25日)	10,177	△0.1		58.8	3,841
第12期 (2018年7月25日)	10,172	△0.0		69.2	4,478
第13期 (2019年7月25日)	10,167	△0.0		72.9	3,760
第14期 (2020年7月27日)	10,160	△0.1		86.2	4,668

*当ファンドは、安定した収益の確保を図ることを目的とした運用を行っているため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準	価額		公社債 組入比率	債 率
		騰落	率		
(期首) 2019年7月25日	円		%		%
	10,167		—		72.9
7月末	10,167		0.0		58.2
8月末	10,168		0.0		60.3
9月末	10,168		0.0		71.5
10月末	10,165		△0.0		79.4
11月末	10,163		△0.0		60.1
12月末	10,163		△0.0		57.5
2020年1月末	10,163		△0.0		69.5
2月末	10,163		△0.0		63.1
3月末	10,160		△0.1		71.6
4月末	10,160		△0.1		79.9
5月末	10,160		△0.1		74.2
6月末	10,161		△0.1		87.1
(期末) 2020年7月27日	10,160		△0.1		86.2

*騰落率は期首比です。

運用経過

【基準価額等の推移】

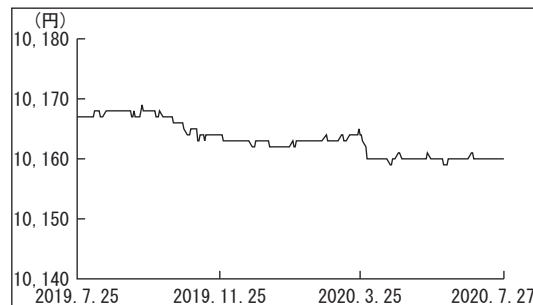
期首：10,167円
期末：10,160円
騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

(下落要因)

日本銀行のマイナス金利政策導入を背景とした無担保コールレートのマイナス化などが要因となりました。

基準価額の推移



【投資環境】

国内短期金融市場では、期初-0.13%近辺でスタートした国庫短期証券3ヵ月物の利回りは、2019年10月以降、海外投資家の短期の国債への需要の高まりを受けて、一時-0.4%近辺まで低下した後、-0.10%~-0.20%の狭いレンジで推移しました。2020年2月末以降は、年度越え要因に絡む海外投資家の短期の国債への需要の高まりや年度末を控えた担保需要の高まり等を受けて、-0.45%近辺まで低下しました。その後、期末にかけてマイナス幅を大きく縮小し、-0.09%近辺で期末を迎えました。

【ポートフォリオ】

安全性と流動性を考慮し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行いました。年限に関しては、残存6ヵ月以内の短期の国債・政府保証債を中心とした運用を継続しました。

今後の運用方針

新型コロナウイルス感染症への懸念拡大に伴う金融情勢を踏まえて、日本銀行は2020年4月の金融政策決定会合において金融緩和の強化を行ったものの、政策金利引き下げは見送りました。しかし世界の主要中央銀行は相次いで緊急利下げや量的緩和政策の導入に踏み切ったことや、日本銀行も国債のさらなる積極的な買い入れを明示したことから、市場利回りは当分の間低い水準での推移を予想します。当ファンドでは引き続き安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行っていきます。ファンドの平均残存年限については2~4ヵ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2019年7月26日～2020年7月27日		
	金額	比率	
その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は10,163円です。			

*「比率」欄は1万口当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。

*期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により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。

*円未満は四捨五入しています。

売買及び取引の状況

(2019年7月26日から2020年7月27日まで)

■公社債

		買	付	額	売	付	額
国	内			千円			千円
		地方債証券		402,133			(160,000)
		特殊債証券		4,172,461			(3,207,000)
		社債証券		2,708,532			(2,600,000)

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

*（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

*社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれていません。

主要な売買銘柄

(2019年7月26日から2020年7月27日まで)

■公社債

		当期					
		買	付	売	付		
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
			千円				千円
25	政保政策投資C	600,750		—		—	
18	政保地方公共団	598,798					
19	政保地方公共団	503,400					
120	政保道路機構	502,685					
11	政保地方公共団	403,904					
10	政保地方公共団	400,636					
12	政保地方公共団	200,456					
115	政保道路機構	195,904					
110	政保道路機構	195,815					
107	政保道路機構	140,973					

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

利害関係人との取引状況等

(2019年7月26日から2020年7月27日まで)

■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
公 社 債	百万円 7,283	百万円 1,204	% 16.5	百万円 —	百万円 —	% —

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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

組入資産の明細

2020年7月27日現在

■公社債

A 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

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
地 方 債 証 券	千円 300,000 (300,000)	千円 301,016 (301,016)	% 6.4 (6.4)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 6.4 (6.4)
特 殊 債 券 (除く金融債券)	2,715,000 (2,715,000)	2,723,367 (2,723,367)	58.3 (58.3)	— (—)	— (—)	— (—)	58.3 (58.3)
普 通 社 債 券	1,000,000 (1,000,000)	1,001,801 (1,001,801)	21.5 (21.5)	— (—)	— (—)	— (—)	21.5 (21.5)
合 計	4,015,000 (4,015,000)	4,026,186 (4,026,186)	86.2 (86.2)	— (—)	— (—)	— (—)	86.2 (86.2)

* () 内は、非上場債で内書き

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内（邦貨建）公社債

銘柄	柄	当期			末
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
（地方債証券）					
22-15	兵庫県公債	0.9600	100,000	100,216	2020/10/20
27-1	仙台市5年	0.1010	100,000	100,037	2021/01/27
347	大阪府公債	1.3200	100,000	100,761	2021/02/25
小	計	—	300,000	301,016	—
（特殊債券（除く金融債券））					
115	政保道路機構	1.0000	195,000	195,187	2020/08/31
120	政保道路機構	0.9000	500,000	501,184	2020/10/30
18	政保地方公共団	0.9000	595,000	596,648	2020/11/17
25	政保政策投資C	0.1470	600,000	600,280	2020/11/25
122	政保道路機構	0.9000	95,000	95,291	2020/11/30
19	政保地方公共団	1.2000	500,000	502,307	2020/12/14
22	国際協力銀行	1.8900	100,000	101,224	2021/03/22
135	政保道路機構	1.1000	130,000	131,244	2021/05/31
小	計	—	2,715,000	2,723,367	—
（普通社債券）					
75	三菱商事	1.2310	100,000	100,005	2020/07/29
15	東日本旅客鉄道	2.6500	100,000	100,204	2020/08/25
44	西日本高速道	0.0010	100,000	99,990	2020/09/18
298	北海道電力	1.8200	100,000	100,277	2020/09/25
369	中国電力	0.9760	100,000	100,226	2020/10/23
2	コカ・コーライースト	0.2760	100,000	100,085	2020/12/14
3	大日本印刷	1.3580	100,000	100,520	2020/12/18
5	日本梱包運輸	0.6140	100,000	100,162	2020/12/18
2	ファーストリテイリング	0.2910	100,000	100,095	2020/12/18
27	三菱UFJリース	0.5080	100,000	100,233	2021/02/24
小	計	—	1,000,000	1,001,801	—
合	計	—	4,015,000	4,026,186	—

投資信託財産の構成

2020年7月27日現在

項目	当期		末
	評価額	比率	率
公債	千円		%
社債	4,026,186		86.2
コーポレートローン等、その他	644,887		13.8
投資信託財産総額	4,671,073		100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年7月27日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,671,073,462円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	634,504,423
公 社 債 (評価額)	4,026,186,120
未 収 利 息	7,895,871
前 払 費 用	2,487,048
(B) 負 債	2,785,608
未 払 解 約 金	2,785,608
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	4,668,287,854
元 本	4,594,902,903
次 期 繰 越 損 益 金	73,384,951
(D) 受 益 権 総 口 数	4,594,902,903口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,160円

*元本状況

期首元本額	3,698,685,821円
期中追加設定元本額	5,601,788,586円
期中一部解約元本額	4,705,571,504円

*元本の内訳

SMBCファンドラップ・日本バリュー株	984,252円
SMBCファンドラップ・J-REIT	984,252円
SMBCファンドラップ・G-REIT	93,018,163円
SMBCファンドラップ・ヘッジファンド	311,216,889円
SMBCファンドラップ・欧州株	89,718,432円
SMBCファンドラップ・新興国株	61,111,034円
SMBCファンドラップ・コモディティ	30,882,058円
SMBCファンドラップ・米国債	136,874,567円
SMBCファンドラップ・欧州債	68,341,252円
SMBCファンドラップ・新興国債	54,958,024円
SMBCファンドラップ・日本グロース株	167,596,581円
SMBCファンドラップ・日本中小型株	27,029,827円
SMBCファンドラップ・日本債	964,891,078円
エマーヅング・ボンド・ファンド・円コース (毎月分配型)	36,545,313円
エマーヅング・ボンド・ファンド・豪ドルコース (毎月分配型)	130,604,200円
エマーヅング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース (毎月分配型)	6,059,780円
エマーヅング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース (毎月分配型)	146,670,647円
エマーヅング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース (毎月分配型)	5,392,215円
エマーヅング・ボンド・ファンド・トルコリラコース (毎月分配型)	47,173,770円
エマーヅング・ボンド・ファンド (マネーボールファンド)	308,612,597円
大和住銀 中国株式ファンド (マネー・ポートフォリオ)	228,535,451円
エマーヅング好配当株オープン マネー・ポートフォリオ	2,041,063円
エマーヅング・ボンド・ファンド・中国元コース (毎月分配型)	1,339,775円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・アジア3通貨コース	8,842,389円
アジア・ハイ・インカム・ファンド・円コース	754,055円
アジア・ハイ・インカム・ファンド (マネーボールファンド)	1,006,475円
日本株厳選ファンド・円コース	270,889円

日本株厳選ファンド・ブラジルリアルコース	18,658,181円
日本株厳選ファンド・豪ドルコース	679,887円
日本株厳選ファンド・アジア3通貨コース	9,783円
日本株225・米ドルコース	49,237円
日本株225・ブラジルリアルコース	393,895円
日本株225・豪ドルコース	147,711円
日本株225・資源3通貨コース	49,237円
グローバルCBオープン・高金利通貨コース	598,533円
グローバルCBオープン・円コース	827,757円
グローバルCBオープン (マネーボールファンド)	1,994,744円
オーストラリア高配当株プレミアム (毎月分配型)	1,057,457円
スマート・ストラテジー・ファンド (毎月決算型)	12,541,581円
スマート・ストラテジー・ファンド (年2回決算型)	4,566,053円
カナダ高配当株ツインα (毎月分配型)	66,417,109円
日本株厳選ファンド・米ドルコース	196,696円
日本株厳選ファンド・メキシコペソコース	196,696円
日本株厳選ファンド・トルコリラコース	196,696円
エマーヅング・ボンド・ファンド・カナダドルコース (毎月分配型)	320,670円
エマーヅング・ボンド・ファンド・メキシコペソコース (毎月分配型)	2,042,379円
カナダ高配当株ファンド	984円
米国短期社債戦略ファンド2017-03 (為替ヘッジあり)	1,751,754円
世界リアルアセット・バランス (毎月決算型)	1,451,601円
世界リアルアセット・バランス (資産成長型)	2,567,864円
米国分散投資戦略ファンド (1倍コース)	251,575,286円
米国分散投資戦略ファンド (3倍コース)	1,196,314,788円
米国分散投資戦略ファンド (5倍コース)	445,153円
大和住銀マルチ・ストラテジー・ファンド (ヘッジ付) (適格機関投資家限定)	98,396,143円

損益の状況

自2019年7月26日
至2020年7月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	28,910,099円
受 取 利 息	29,808,510
支 払 利 息	△ 898,411
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△32,308,146
売 買 益	7,820
売 買 損	△32,315,966
(C) そ の 他 費 用	△ 2,891
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 3,400,938
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	61,807,847
(F) 解 約 差 損 益 金	△76,600,416
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	91,578,458
(H) 計 (D+E+F+G)	73,384,951
次 期 繰 越 損 益 金(H)	73,384,951

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*解約差損益金とは、一部解約時の解約金額と元本の差額をいい、元本を下回る額は利益として、上回る額は損失として処理されます。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。