

三井住友・公益債券投信 (毎月決算型) 【運用報告書(全体版)】

第25作成期 (2023年1月17日から2023年7月18日まで)

第 145 期 / 第 146 期 / 第 147 期
決算日2023年2月15日 決算日2023年3月15日 決算日2023年4月17日

第 148 期 / 第 149 期 / 第 150 期
決算日2023年5月15日 決算日2023年6月15日 決算日2023年7月18日

■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／内外／債券 |
| 信託期間 | 2011年1月28日から2028年1月17日まで |
| 運用方針 | 投資信託証券への投資を通じて、世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資することにより、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 DWS 世界公益債券ファンド (適格機関投資家専用) 世界各国の公益企業・公社が発行する債券 マネープール・マザーファンド 円貨建ての短期公社債および短期金融商品 |
| 当ファンドの運用方法 | ■主として世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資します。 ■対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減します。 |
| 組入制限 | ■外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | ■毎月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 |

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資することにより、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほど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>

■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。

■当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)

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近30期の運用実績

| 決 算 期 | 基 (分配落) | 準 価 額 | | 公 社 債 率 組 入 比 | 投 資 信 託 証 券 率 組 入 比 | 純 資 産 額 |
|--------------------|------------|---------|-------------|------------------|------------------------|--------------|
| | | 税 分 配 | 込 金 騰 落 中 率 | | | |
| 121期 (2021年 2月15日) | 円 9,324 | 円 30 | % △0.6 | % 0.1 | % 96.2 | 百万円 6,623 |
| 122期 (2021年 3月15日) | 9,066 | 30 | △2.4 | 0.1 | 97.9 | 6,372 |
| 123期 (2021年 4月15日) | 9,146 | 30 | 1.2 | 0.1 | 97.2 | 6,433 |
| 124期 (2021年 5月17日) | 9,105 | 30 | △0.1 | 0.1 | 96.8 | 6,432 |
| 125期 (2021年 6月15日) | 9,172 | 30 | 1.1 | 0.1 | 97.7 | 6,464 |
| 126期 (2021年 7月15日) | 9,236 | 30 | 1.0 | 0.1 | 96.7 | 6,470 |
| 127期 (2021年 8月16日) | 9,238 | 30 | 0.3 | 0.1 | 97.7 | 6,434 |
| 128期 (2021年 9月15日) | 9,217 | 30 | 0.1 | 0.1 | 97.2 | 6,337 |
| 129期 (2021年10月15日) | 9,073 | 30 | △1.2 | 0.1 | 96.9 | 6,232 |
| 130期 (2021年11月15日) | 9,034 | 30 | △0.1 | 0.0 | 96.5 | 6,175 |
| 131期 (2021年12月15日) | 8,963 | 30 | △0.5 | 0.1 | 98.3 | 6,005 |
| 132期 (2022年 1月17日) | 8,783 | 30 | △1.7 | 0.1 | 96.3 | 5,920 |
| 133期 (2022年 2月15日) | 8,471 | 30 | △3.2 | 0.1 | 97.6 | 5,674 |
| 134期 (2022年 3月15日) | 8,105 | 30 | △4.0 | 0.2 | 97.6 | 5,376 |
| 135期 (2022年 4月15日) | 7,962 | 30 | △1.4 | 0.1 | 98.1 | 5,264 |
| 136期 (2022年 5月16日) | 7,682 | 20 | △3.3 | 0.2 | 97.8 | 5,001 |
| 137期 (2022年 6月15日) | 7,451 | 20 | △2.7 | 0.1 | 96.5 | 4,806 |
| 138期 (2022年 7月15日) | 7,475 | 20 | 0.6 | 0.2 | 97.5 | 4,777 |
| 139期 (2022年 8月15日) | 7,624 | 20 | 2.3 | 0.2 | 97.6 | 4,827 |
| 140期 (2022年 9月15日) | 7,298 | 20 | △4.0 | 0.2 | 97.1 | 4,561 |
| 141期 (2022年10月17日) | 6,838 | 20 | △6.0 | 0.2 | 97.1 | 4,245 |
| 142期 (2022年11月15日) | 6,995 | 20 | 2.6 | 0.1 | 96.6 | 4,314 |
| 143期 (2022年12月15日) | 7,228 | 20 | 3.6 | 0.2 | 96.9 | 4,450 |
| 144期 (2023年 1月16日) | 7,252 | 20 | 0.6 | 0.2 | 96.8 | 4,457 |
| 145期 (2023年 2月15日) | 7,159 | 20 | △1.0 | 0.2 | 97.7 | 4,384 |
| 146期 (2023年 3月15日) | 7,050 | 20 | △1.2 | 0.2 | 98.1 | 4,282 |
| 147期 (2023年 4月17日) | 7,133 | 20 | 1.5 | 0.2 | 97.0 | 4,321 |
| 148期 (2023年 5月15日) | 7,078 | 20 | △0.5 | 0.2 | 94.7 | 4,328 |
| 149期 (2023年 6月15日) | 6,941 | 20 | △1.7 | 0.2 | 94.5 | 4,243 |
| 150期 (2023年 7月18日) | 6,922 | 20 | 0.0 | 0.2 | 97.1 | 4,175 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年月日 | 基準 | 価額 | | 公 社 債 率 | 投資信託証券 組入比率 |
|-------|--------------------|----|-------|--------|----------|----------------|
| | | | 騰 落 率 | 率 | | |
| 第145期 | (期首) 2023年1月16日 | 円 | 7,252 | % — | % 0.2 | % 96.8 |
| | 1月末 | | 7,255 | 0.0 | 0.2 | 97.1 |
| | (期末) 2023年2月15日 | | 7,179 | △1.0 | 0.2 | 97.7 |
| 第146期 | (期首) 2023年2月15日 | | 7,159 | — | 0.2 | 97.7 |
| | 2月末 | | 7,038 | △1.7 | 0.2 | 94.7 |
| | (期末) 2023年3月15日 | | 7,070 | △1.2 | 0.2 | 98.1 |
| 第147期 | (期首) 2023年3月15日 | | 7,050 | — | 0.2 | 98.1 |
| | 3月末 | | 7,106 | 0.8 | 0.0 | 98.3 |
| | (期末) 2023年4月17日 | | 7,153 | 1.5 | 0.2 | 97.0 |
| 第148期 | (期首) 2023年4月17日 | | 7,133 | — | 0.2 | 97.0 |
| | 4月末 | | 7,119 | △0.2 | 0.0 | 94.9 |
| | (期末) 2023年5月15日 | | 7,098 | △0.5 | 0.2 | 94.7 |
| 第149期 | (期首) 2023年5月15日 | | 7,078 | — | 0.2 | 94.7 |
| | 5月末 | | 6,970 | △1.5 | 0.0 | 94.8 |
| | (期末) 2023年6月15日 | | 6,961 | △1.7 | 0.2 | 94.5 |
| 第150期 | (期首) 2023年6月15日 | | 6,941 | — | 0.2 | 94.5 |
| | 6月末 | | 6,911 | △0.4 | 0.2 | 97.7 |
| | (期末) 2023年7月18日 | | 6,942 | 0.0 | 0.2 | 97.1 |

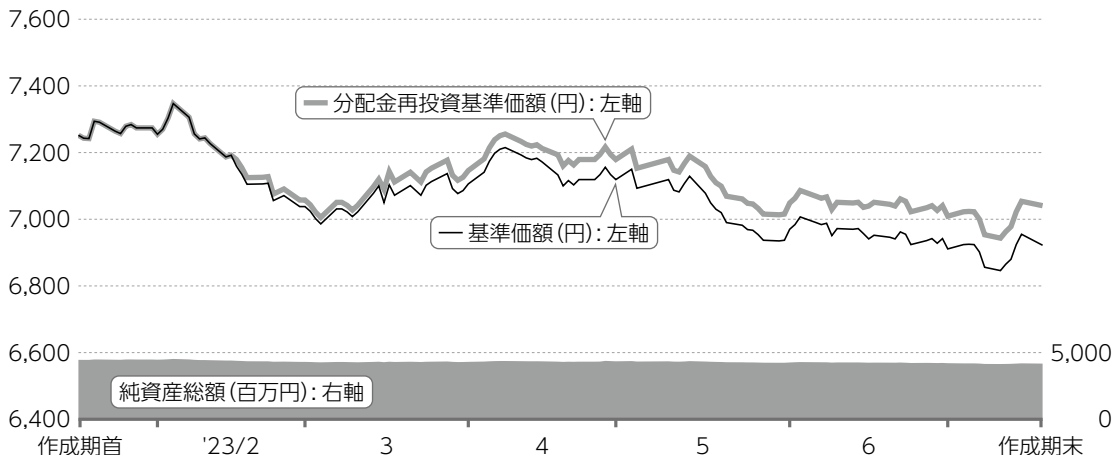
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

| | |
|------|--------------------------------|
| 作成期首 | 7,252円 |
| 作成期末 | 6,922円 (当作成期既払分配金120円(税引前)) |
| 騰落率 | -2.9% (分配金再投資ベース) |

分配金再投資基準価額について

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と仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

基準価額の主な変動要因（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資しました。また、外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行いました。

上昇要因

- 公益債券のスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと

下落要因

- 欧米中銀の利上げ継続を背景に、米国や欧州（ドイツ）の長期金利（10年国債利回り）が上昇（価格は下落）したこと
- 日本と海外との短期金利差に伴うヘッジコスト

投資環境について（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

長期金利は米国および欧州(ドイツ)で上昇しました。公益債券のスプレッドは縮小しました。

欧米中銀による利上げ長期化への警戒感から、長期金利は上昇しました。

公益債券市場においては、景気減速懸念は変動要因となったものの、利回り水準の高さが見直されて資金が流入し、世界の投資適格社債の代表的な指数であるブルーム

バーグ・グローバル総合(除く日本)・社債インデックスの公益セクターのスプレッドは前期末比で縮小しました。しかしながら、長期金利上昇の影響から円ヘッジベースでのリターンはマイナスとなりました。

ポートフォリオについて（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

当ファンド

「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」および「マネープール・マザーファンド」を主要投資対象とし、「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」の高位組入れを維持しました。

DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)

当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲイン(利金収入)の獲得と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。国別では、米国、欧州を中心とした配分を維持しました。投資行動で

は、魅力的な利回り水準で発行された新発債を購入、一方で割安感の乏しい銘柄を売却する等しました。金利戦略につきましては、保有債券の年限が長めであることや、利上げ継続観測を踏まえ、米国国債先物および、ドイツ国債先物の売建てを継続しました。

なお、外貨建資産については対円での為替ヘッジを行っています。

マネープール・マザーファンド

主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、流動性の確保などを目指した運用を行いました。

ベンチマークとの差異について（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

分配金について（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

期間の1万口当たりの分配金（税引前）は、基準価額水準等を勘案し、以下の通りといたしました。

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いたします。

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第145期 | 第146期 | 第147期 | 第148期 | 第149期 | 第150期 |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 当期分配金 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| （対基準価額比率） | (0.28%) | (0.28%) | (0.28%) | (0.28%) | (0.29%) | (0.29%) |
| 当期の収益 | 14 | 14 | 17 | 14 | 13 | 13 |
| 当期の収益以外 | 5 | 5 | 2 | 5 | 6 | 6 |
| 翌期繰越分配対象額 | 354 | 348 | 346 | 340 | 334 | 327 |

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金」（税引前）の期末基準価額（分配金（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」および「マネープール・マザーファンド」を主要投資対象とし、「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」を高位に組み入れることで、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行う方針です。

DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)

引き続き、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

国債市場では欧米中銀の金融政策を巡る憶測や景気減速への警戒感から変動すると見込まれます。社債市場については、世界

景気の減速懸念等は変動要因となる一方、高い利回りを求める需要が支えになる見通しです。

運用方針としましては、魅力的な水準で取引されている債券の組み入れを検討し、金利戦略につきましては、ポートフォリオの金利リスクを中長期的にある程度抑えるためデュレーション(投資資金の平均回収期間：金利の変動による債券価格の感応度)を調整していく方針です。

なお、外貨建資産については対円での為替ヘッジを行います。

マネープール・マザーファンド

円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

1万口当たりの費用明細（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|------------|---------------|---|
| (a) 信託報酬 | 24円 | 0.343% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は7,077円です。 |
| （投信会社） | (8) | (0.110) | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (16) | (0.220) | 販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (1) | (0.013) | 受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | － | － | 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 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | (－) | (－) | |
| （先物・オプション） | (－) | (－) | |
| （投資信託証券） | (－) | (－) | |
| (c) 有価証券取引税 | － | － | 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 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | (－) | (－) | |
| （公社債） | (－) | (－) | |
| （投資信託証券） | (－) | (－) | |
| (d) その他費用 | 0 | 0.003 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| （保管費用） | (－) | (－) | 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 |
| （監査費用） | (0) | (0.003) | 監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用 |
| （その他） | (0) | (0.000) | その他:信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 24 | 0.345 | |

※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ています。

※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。

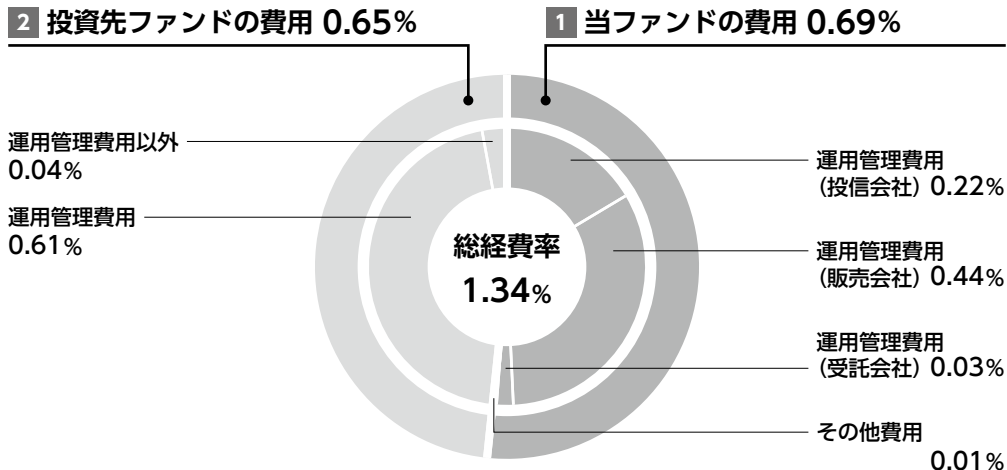
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



| | |
|----------------------------|--------------|
| 総経費率(1 + 2) | 1.34% |
| 1 当ファンドの費用の比率 | 0.69% |
| 2 投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.61% |
| 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.04% |

※**1**の各費用は、前掲「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、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。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※**2**の投資先ファンド(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))の費用は、「1万口当たりの費用明細」をもとに、投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※**1**と**2**の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.34%です。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

投資信託証券

| | | 当 作 成 期 | | | |
|----|--------------------------|-------------|---------|-------------|---------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 |
| 国内 | DWS世界公益債券ファンド（適格機関投資家専用） | 726,252,534 | 538,000 | 824,886,151 | 616,000 |

※金額は受渡し代金。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

■ 利害関係人との取引状況等（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

利害関係人との取引状況

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

マネープール・マザーファンド

| 区 分 | 当 作 成 期 | | | 成 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 20,682 | 百万円 3,141 | % 15.2 | 百万円 - | 百万円 - | % - |

※平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の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、投資信託およ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、当作成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。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

（2023年1月17日から2023年7月18日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細（2023年7月18日現在）

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 作 成 期 首 | 作 成 期 | | 末 |
|--------------------------|---------------|---------------|-----------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 組 入 比 率 |
| DWS世界公益債券ファンド（適格機関投資家専用） | 5,637,117,961 | 5,538,484,344 | 4,055,278 | 97.1 |
| 合 計 | 5,637,117,961 | 5,538,484,344 | 4,055,278 | 97.1 |

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

(2) 親投資信託残高

| 種 類 | 作 成 期 首 | | 作 成 期 末 | |
|----------------|---------|-------------|---------|-------------|
| | 口 | 数 | 口 | 数 |
| マネープール・マザーファンド | | 千口 8,874 | | 千口 8,874 |
| | | | | 千円 8,868 |

※マネープール・マザーファンドの作成期末の受益権総口数は268,832,188,153口です。

■ 投資信託財産の構成

(2023年7月18日現在)

| 項 目 | 作 成 期 末 | |
|----------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 4,055,278 | 96.6 |
| マネープール・マザーファンド | 8,868 | 0.2 |
| コール・ローン等、その他 | 134,498 | 3.2 |
| 投資信託財産総額 | 4,198,645 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年2月15日) (2023年3月15日) (2023年4月17日) (2023年5月15日) (2023年6月15日) (2023年7月18日)

| 項 目 | 第145期末 | 第146期末 | 第147期末 | 第148期末 | 第149期末 | 第150期末 |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 資 産 | 4,402,250,936円 | 4,305,852,903円 | 4,336,381,617円 | 4,346,108,807円 | 4,259,254,154円 | 4,198,645,831円 |
| コール・ローン等 | 109,186,737 | 98,117,237 | 135,552,545 | 236,401,508 | 239,256,978 | 134,498,610 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 4,284,192,552 | 4,198,864,906 | 4,191,958,312 | 4,100,837,427 | 4,011,127,304 | 4,055,278,236 |
| マネープール・マザーファンド(評価額) | 8,871,647 | 8,870,760 | 8,870,760 | 8,869,872 | 8,869,872 | 8,868,985 |
| (B) 負 債 | 17,262,814 | 23,655,962 | 14,821,608 | 17,113,308 | 16,167,816 | 23,338,447 |
| 未払収益分配金 | 12,250,808 | 12,147,691 | 12,117,528 | 12,232,995 | 12,226,007 | 12,063,743 |
| 未払解約金 | 2,466,566 | 9,216,384 | 14 | 2,581,480 | 1,434,898 | 8,647,030 |
| 未払信託報酬 | 2,525,056 | 2,273,546 | 2,682,450 | 2,280,303 | 2,486,871 | 2,606,518 |
| その他未払費用 | 20,384 | 18,341 | 21,616 | 18,530 | 20,040 | 21,156 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 4,384,988,122 | 4,282,196,941 | 4,321,560,009 | 4,328,995,499 | 4,243,086,338 | 4,175,307,384 |
| 元 本 | 6,125,404,208 | 6,073,845,883 | 6,058,764,464 | 6,116,497,581 | 6,113,003,542 | 6,031,871,892 |
| 次期繰越損益金 | △1,740,416,086 | △1,791,648,942 | △1,737,204,455 | △1,787,502,082 | △1,869,917,204 | △1,856,564,508 |
| (D) 受益権総口数 | 6,125,404,208口 | 6,073,845,883口 | 6,058,764,464口 | 6,116,497,581口 | 6,113,003,542口 | 6,031,871,892口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,159円 | 7,050円 | 7,133円 | 7,078円 | 6,941円 | 6,922円 |

※当作成期における作成期首元本額6,146,397,590円、作成期中追加設定元本額149,823,433円、作成期中一部解約元本額264,349,131円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

■ 損益の状況

| | 〔自2023年1月17日〕 〔至2023年2月15日〕 | 〔自2023年2月16日〕 〔至2023年3月15日〕 | 〔自2023年3月16日〕 〔至2023年4月17日〕 | 〔自2023年4月18日〕 〔至2023年5月15日〕 | 〔自2023年5月16日〕 〔至2023年6月15日〕 | 〔自2023年6月16日〕 〔至2023年7月18日〕 |
|---------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 項 目 | 第 145 期 | 第 146 期 | 第 147 期 | 第 148 期 | 第 149 期 | 第 150 期 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 11,329,512円 | 11,259,570円 | 10,836,299円 | 10,948,074円 | 10,920,995円 | 10,813,215円 |
| 受 取 配 当 金 | 11,331,813 | 11,261,353 | 10,837,851 | 10,956,516 | 10,931,094 | 10,821,516 |
| 受 取 利 息 | 111 | 53 | 67 | 7 | 16 | 316 |
| 支 払 利 息 | △ 2,412 | △ 1,836 | △ 1,619 | △ 8,449 | △ 10,115 | △ 8,617 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 53,445,817 | △ 62,694,963 | 53,956,665 | △ 30,089,494 | △ 79,464,020 | △ 7,578,950 |
| 売 買 益 | 30,791 | 619,081 | 54,093,405 | 66,372 | 241,384 | 297,304 |
| 売 買 損 | △ 53,476,608 | △ 63,314,044 | △ 136,740 | △ 30,155,866 | △ 79,705,404 | △ 7,876,254 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 2,545,637 | △ 2,292,083 | △ 2,704,172 | △ 2,298,954 | △ 2,507,172 | △ 2,627,875 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 44,661,942 | △ 53,727,476 | 62,088,792 | △ 21,440,374 | △ 71,050,197 | 606,390 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 1,448,509,925 | △ 1,488,278,940 | △ 1,545,676,234 | △ 1,485,892,906 | △ 1,510,497,122 | △ 1,566,132,747 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 234,993,411 | △ 237,494,835 | △ 241,499,485 | △ 267,935,807 | △ 276,143,878 | △ 278,974,408 |
| (配当等相当額) | (220,441,185) | (215,148,350) | (211,443,243) | (211,739,746) | (208,037,293) | (201,515,976) |
| (売買損益相当額) | (△ 455,434,596) | (△ 452,643,185) | (△ 452,942,728) | (△ 479,675,553) | (△ 484,181,171) | (△ 480,490,384) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | △ 1,728,165,278 | △ 1,779,501,251 | △ 1,725,086,927 | △ 1,775,269,087 | △ 1,857,691,197 | △ 1,844,500,765 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 12,250,808 | △ 12,147,691 | △ 12,117,528 | △ 12,232,995 | △ 12,226,007 | △ 12,063,743 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | △ 1,740,416,086 | △ 1,791,648,942 | △ 1,737,204,455 | △ 1,787,502,082 | △ 1,869,917,204 | △ 1,856,564,508 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 238,459,954 | △ 240,674,696 | △ 243,232,615 | △ 271,519,399 | △ 279,955,737 | △ 282,852,078 |
| (配当等相当額) | (216,974,642) | (211,968,489) | (209,710,113) | (208,156,155) | (204,225,434) | (197,638,306) |
| (売買損益相当額) | (△ 455,434,596) | (△ 452,643,185) | (△ 452,942,728) | (△ 479,675,554) | (△ 484,181,171) | (△ 480,490,384) |
| 繰 越 損 益 金 | △ 1,501,956,132 | △ 1,550,974,246 | △ 1,493,971,840 | △ 1,515,982,683 | △ 1,589,961,467 | △ 1,573,712,430 |

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 第 145 期 | 第 146 期 | 第 147 期 | 第 148 期 | 第 149 期 | 第 150 期 |
|----------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 8,784,265円 | 8,967,830円 | 10,384,398円 | 8,649,403円 | 8,414,148円 | 8,186,073円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 220,441,185 | 215,148,350 | 211,443,243 | 211,739,747 | 208,037,293 | 201,515,976 |
| (d) 分配準備積立金 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 229,225,450 | 224,116,180 | 221,827,641 | 220,389,150 | 216,451,441 | 209,702,049 |
| 1万口当たり当期分配対象額 | 374.22 | 368.99 | 366.13 | 360.32 | 354.08 | 347.66 |
| (f) 分配金 | 12,250,808 | 12,147,691 | 12,117,528 | 12,232,995 | 12,226,007 | 12,063,743 |
| 1万口当たり分配金 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |

■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金（税引前） | 第145期 | 第146期 | 第147期 | 第148期 | 第149期 | 第150期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 |

※分配金は、分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額「普通分配金」となり課税されます。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は下回る部分が「元本払戻金（特別分配金）」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

DWS 世界公益債券ファンド (適格機関投資家専用)

■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／内外／債券 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | インカム・ゲインの獲得と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 | 世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎決算時(原則として毎月10日。ただし、当該日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた利子・配当収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②収益分配金額は、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もあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき元本部分と同一の運用を行います。 |

運用報告書(全体版)

第143期(決算日:2022年12月12日)

第144期(決算日:2023年1月10日)

第145期(決算日:2023年2月10日)

第146期(決算日:2023年3月10日)

第147期(決算日:2023年4月10日)

第148期(決算日:2023年5月10日)

■投資者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」は、2023年5月10日に第148期の決算を行いました。ここに第143期から第148期の運用状況と収益分配金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。

ドイツ・アセット・マネジメント株式会社
東京都千代田区永田町2-11-1 山王パークタワー

〈お問い合わせ先〉

電話番号:03-5156-5108

受付時間:営業日の午前9時~午後5時

<https://funds.dws.com/ja-jp/>

*お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 準 備 額 | | 債 券 率 組 入 比 | 債 券 率 先 物 比 | 純 資 産 額 | |
|-------------------|---------------|-------|-----|----------------|----------------|---------|-------|
| | | 税 分 | 達 配 | | | | み 金 |
| | 円 | | 円 | % | % | 百万円 | |
| 119期(2020年12月10日) | 9,683 | | 20 | 1.7 | 95.7 | △ 5.9 | 7,484 |
| 120期(2021年1月12日) | 9,605 | | 20 | △0.6 | 97.6 | △ 7.5 | 7,209 |
| 121期(2021年2月10日) | 9,598 | | 20 | 0.1 | 98.2 | △11.7 | 7,000 |
| 122期(2021年3月10日) | 9,367 | | 20 | △2.2 | 99.8 | △13.0 | 6,877 |
| 123期(2021年4月12日) | 9,416 | | 20 | 0.7 | 94.7 | △13.0 | 6,863 |
| 124期(2021年5月10日) | 9,452 | | 20 | 0.6 | 93.4 | △12.9 | 6,972 |
| 125期(2021年6月10日) | 9,486 | | 20 | 0.6 | 96.1 | △13.1 | 6,934 |
| 126期(2021年7月12日) | 9,564 | | 20 | 1.0 | 95.7 | △13.6 | 6,849 |
| 127期(2021年8月10日) | 9,576 | | 20 | 0.3 | 95.1 | △13.6 | 6,892 |
| 128期(2021年9月10日) | 9,567 | | 20 | 0.1 | 96.7 | △13.8 | 6,734 |
| 129期(2021年10月11日) | 9,387 | | 20 | △1.7 | 96.8 | △13.9 | 6,602 |
| 130期(2021年11月10日) | 9,508 | | 20 | 1.5 | 97.0 | △14.2 | 6,707 |
| 131期(2021年12月10日) | 9,360 | | 20 | △1.3 | 94.7 | △16.7 | 6,410 |
| 132期(2022年1月11日) | 9,215 | | 20 | △1.3 | 95.5 | △17.0 | 6,196 |
| 133期(2022年2月10日) | 8,959 | | 20 | △2.6 | 95.4 | △17.0 | 6,112 |
| 134期(2022年3月10日) | 8,618 | | 20 | △3.6 | 95.2 | △10.7 | 5,824 |
| 135期(2022年4月11日) | 8,463 | | 20 | △1.6 | 96.3 | △13.1 | 5,694 |
| 136期(2022年5月10日) | 8,036 | | 20 | △4.8 | 97.4 | △16.3 | 5,317 |
| 137期(2022年6月10日) | 8,043 | | 20 | 0.3 | 99.0 | △14.2 | 5,179 |
| 138期(2022年7月11日) | 7,821 | | 20 | △2.5 | 96.8 | △11.0 | 5,056 |
| 139期(2022年8月10日) | 8,010 | | 20 | 2.7 | 91.8 | △ 4.2 | 5,166 |
| 140期(2022年9月12日) | 7,704 | | 20 | △3.6 | 96.8 | △ 4.4 | 4,827 |
| 141期(2022年10月11日) | 7,296 | | 20 | △5.0 | 97.1 | △10.3 | 4,551 |
| 142期(2022年11月10日) | 7,218 | | 20 | △0.8 | 97.7 | △10.8 | 4,520 |
| 143期(2022年12月12日) | 7,587 | | 20 | 5.4 | 91.6 | △ 8.6 | 4,695 |
| 144期(2023年1月10日) | 7,583 | | 20 | 0.2 | 87.8 | △ 8.3 | 4,656 |
| 145期(2023年2月10日) | 7,609 | | 20 | 0.6 | 94.9 | △ 8.1 | 4,714 |
| 146期(2023年3月10日) | 7,391 | | 20 | △2.6 | 95.5 | △ 8.0 | 4,559 |
| 147期(2023年4月10日) | 7,580 | | 20 | 2.8 | 97.9 | △ 8.4 | 4,495 |
| 148期(2023年5月10日) | 7,464 | | 20 | △1.3 | 99.4 | △ 8.5 | 4,474 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは、主に世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本としております。そのため、ファンドの収益率を測る適切なインデックスが存在せず、ベンチマーク及び参考指数を設けておりません。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決 算 期 | 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|-------|----------------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| 第143期 | (期 首) 2022年11月10日 | 円 | % | — | % | % |
| | 11月末 | 7,218 | — | 97.7 | △10.8 | |
| | (期 末) 2022年12月12日 | 7,492 | 3.8 | 91.8 | △ 8.7 | |
| 第144期 | (期 首) 2022年12月12日 | 7,607 | 5.4 | 91.6 | △ 8.6 | |
| | 12月末 | 7,587 | — | 91.6 | △ 8.6 | |
| | (期 末) 2023年 1月10日 | 7,485 | △1.3 | 87.5 | △ 8.2 | |
| 第145期 | (期 首) 2023年 1月10日 | 7,603 | 0.2 | 87.8 | △ 8.3 | |
| | 1月末 | 7,583 | — | 87.8 | △ 8.3 | |
| | (期 末) 2023年 2月10日 | 7,658 | 1.0 | 90.2 | △ 8.1 | |
| 第146期 | (期 首) 2023年 2月10日 | 7,629 | 0.6 | 94.9 | △ 8.1 | |
| | 2月末 | 7,609 | — | 94.9 | △ 8.1 | |
| | (期 末) 2023年 3月10日 | 7,427 | △2.4 | 97.3 | △ 8.3 | |
| 第147期 | (期 首) 2023年 3月10日 | 7,411 | △2.6 | 95.5 | △ 8.0 | |
| | 3月末 | 7,391 | — | 95.5 | △ 8.0 | |
| | (期 末) 2023年 4月10日 | 7,506 | 1.6 | 93.7 | △ 8.1 | |
| 第148期 | (期 首) 2023年 4月10日 | 7,600 | 2.8 | 97.9 | △ 8.4 | |
| | 4月末 | 7,580 | — | 97.9 | △ 8.4 | |
| | (期 末) 2023年 5月10日 | 7,523 | △0.8 | 99.0 | △ 8.4 | |
| | | 7,484 | △1.3 | 99.4 | △ 8.5 | |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、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。



(注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(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、ファンド運用の本質的なパフォーマンスを示すものです。ただし、上記対象期間中の分配金が0円のファンドにつきましては基準価額と重なって表示されております。

(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、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

◆ 基準価額

当ファンドの基準価額は作成期末において7,464円(分配落後)となり、分配金込みでは前作成期末比5.1%上昇しました。当ファンドでは当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。米国金利*が低下(価格は上昇)したことや、社債市場でスプレッド*が縮小したことは、基準価額の上昇要因となりました。一方で、日本と海外との短期金利差等に伴うヘッジコスト等はマイナス材料となりました。

◆ 投資環境

主要国債市場において、長期金利は米国では低下、欧州(ドイツ)では上昇しました。欧米の利上げ継続は金利上昇要因となりましたが、金融セクター不安は低下要因となりました。社債市場では、利回りを求める需要を背景に、世界の投資適格社債の代表的な指数であるブルームバーグ・グローバル総合(除く日本)・社債インデックスのスプレッドは縮小し、円ヘッジベースのリターンはプラスとなりました。

*金利：債券価格は金利変動の影響を受けます。一般的に金利が低下した場合には債券価格は上昇し、逆に金利が上昇した場合には債券価格は下落する傾向があります。

*スプレッド：主に主要国債(先進国債など)利回りとの利回り格差のことで、発行体の信用力や流動性等の影響を受けます。一般的に、信用力が高まればスプレッドは縮小(価格の上昇要因)し、信用力が低下すればスプレッドは拡大(価格の下落要因)する傾向があります。

◆運用状況

当ファンドでは当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。

国別では、米国の配分を高めとしました。金利戦略については、保有債券のデュレーション*が長めであることや、欧米の利上げに伴い金利が上昇するリスクを勘案して、米国国債先物およびドイツ国債先物の売り建てを継続しました。

◆収益分配金

基準価額水準等を勘案して、各期とも20円(税引前)といたしました。なお、留保された収益金につきましては、当ファンドの運用の基本方針に基づき運用させていただきます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第143期 | 第144期 | 第145期 | 第146期 | 第147期 | 第148期 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2022年11月11日～ 2022年12月12日 | 2022年12月13日～ 2023年1月10日 | 2023年1月11日～ 2023年2月10日 | 2023年2月11日～ 2023年3月10日 | 2023年3月11日～ 2023年4月10日 | 2023年4月11日～ 2023年5月10日 |
| 当期分配金 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| (対基準価額比率) | 0.263% | 0.263% | 0.262% | 0.270% | 0.263% | 0.267% |
| 当期の収益 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 819 | 821 | 825 | 828 | 837 | 841 |

(注1) 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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金(税込み)と一致しない場合があります。

◆今後の運用方針

当ファンドでは引き続き当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。国債市場は、追加利上げを巡る憶測が変動要因と見えています。社債市場では、金融セクターへの不安はあるものの、利回りを求める需要が支えになると見えています。運用方針としましては、魅力的な水準で取引されている債券の組み入れを検討し、金利リスクを中長期的にある程度抑えるためデュレーションを調整していく方針です。

*デュレーション：金利変動に対する債券価格の変動性を示します。一般的にデュレーションが長いほど金利変動に対する価格の変動が大きくなります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年11月11日～2023年5月10日)

| 項 目 | 第143期～第148期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-------------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 24 | 0.314 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| (投 信 会 社) | (23) | (0.300) | 委託した資金の運用等の対価 |
| (販 売 会 社) | (0) | (0.003) | 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) | (1) | (0.011) | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.001 | (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 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (0) | (0.001) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 1 | 0.019 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (1) | (0.007) | 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 ・ 印 刷 費 用 等) | (1) | (0.012) | 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用や運用報告書の作成に係る費用等 |
| 合 計 | 25 | 0.334 | |
| 期中の平均基準価額は、7,515円です。 | | | |

(注1) 期中において発生した費用(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) 各比率は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) 監査費用・印刷費用等にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

〇売買及び取引の状況

(2022年11月11日～2023年5月10日)

公社債

| | | 第143期～第148期 | | | |
|--|------|-------------|--------------|-----------|------|
| | | 買付額 | 売付額 | | |
| 外 国 | アメリカ | 特殊債券 | 千米ドル 198 | 千米ドル - | |
| | | 社債券 | 2,664 | 3,519 | |
| | ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | | ドイツ | 社債券 | 209 | - |
| | | | イタリア | 地方債証券 | 100 |
| | | 特殊債券 | | 109 | - |
| | | フランス | 社債券 | 438 | 244 |
| | | | 特殊債券 | 197 | 103 |
| | | オランダ | 社債券 | 200 | - |
| | | | 特殊債券 | - | 390 |
| | | スペイン | 社債券 | 575 | 141 |
| | | | 特殊債券 | 497 | - |
| | | ベルギー | 社債券 | 99 | - |
| | | | 特殊債券 | - | 97 |
| | | アイルランド | 特殊債券 | 245 | - |
| 社債券 | | | 99 | 404 | |
| その他 | 特殊債券 | 119 | 468 | | |
| | 社債券 | - | - | | |
| イギリス | 特殊債券 | 千英ポンド - | 千英ポンド 397 | | |
| | 社債券 | 100 | - | | |

(注1)金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2)単位未満は切捨て。

先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | | 第143期～第148期 | | | |
|-----|--------|-------------|----------|------------|------------|
| | | 買建 | | 売建 | |
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 外国 | 債券先物取引 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 765 | 百万円 872 |

(注1)単位未満は切捨て。

(注2)取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○主要な売買銘柄

(2022年11月11日～2023年5月10日)

公社債

| 第143期～第148期 | | | |
|-----------------------------------|--------|------------------------------|--------|
| 買 付 | | 売 付 | |
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 |
| | 千円 | | 千円 |
| PCG 6.15% 01/15/33(アメリカ) | 54,101 | DTE 3.65% 03/15/24(アメリカ) | 93,740 |
| EXC 3.35% 03/15/32(アメリカ) | 47,553 | EVRG 5.3% 10/01/41(アメリカ) | 80,955 |
| ESBIRE 3.75% 01/25/43(ユーロ・アイルランド) | 34,696 | ORSTED 4.875% 01/12/32(イギリス) | 65,317 |
| WEC 4.75% 01/15/28(アメリカ) | 33,129 | TENN FRN PERPETUAL(ユーロ・オランダ) | 56,932 |
| NEE 4.9% 02/28/28(アメリカ) | 32,859 | PCG 6.15% 01/15/33(アメリカ) | 54,320 |
| ANESM 3.75% 04/25/30(ユーロ・スペイン) | 29,393 | AEE 3.9% 09/15/42(アメリカ) | 53,010 |
| EDF FRN PERPETUAL(ユーロ・フランス) | 28,752 | SO 3.75% 03/01/45(アメリカ) | 42,624 |
| ENELIM FRN PERPETUAL(ユーロ・イタリア) | 28,374 | AEP 3.3% 06/01/27(アメリカ) | 37,570 |
| IBESM FRN PERPETUAL(ユーロ・スペイン) | 28,244 | ORSTED FRN 11/24/17(ユーロ・その他) | 28,511 |
| EDF 4.625% 01/25/43(ユーロ・フランス) | 27,936 | DTE 3.7% 03/15/45(アメリカ) | 27,455 |

(注1)金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2)単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月11日～2023年5月10日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 第143期～第148期 | |
|-----|-------------|------------|
| | 買 付 | 額 |
| 公社債 | | 百万円 121 |

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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、DEUTSCHE BANK AG、ドイツ証券です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年11月11日～2023年5月10日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年11月11日～2023年5月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年5月10日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第148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 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| アメリカ | 千米ドル 24,560 | 千米ドル 24,042 | 千円 3,249,341 | % 72.6 | % — | % 55.2 | % 13.1 | % 4.3 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 610 | 549 | 81,468 | 1.8 | — | 1.5 | 0.3 | — |
| イタリア | 950 | 976 | 144,774 | 3.2 | — | 2.2 | 1.1 | — |
| フランス | 800 | 736 | 109,161 | 2.4 | — | 2.4 | — | — |
| オランダ | 1,450 | 1,393 | 206,533 | 4.6 | — | 4.2 | 0.4 | — |
| スペイン | 1,100 | 980 | 145,292 | 3.2 | — | 3.2 | — | — |
| ベルギー | 100 | 100 | 14,846 | 0.3 | — | 0.3 | — | — |
| ルクセンブルグ | 150 | 128 | 19,082 | 0.4 | — | — | 0.4 | — |
| フィンランド | 270 | 235 | 34,867 | 0.8 | — | 0.8 | — | — |
| アイルランド | 250 | 235 | 34,965 | 0.8 | — | 0.8 | — | — |
| その他 | 1,300 | 1,122 | 166,358 | 3.7 | — | 3.3 | 0.4 | — |
| イギリス | 千英ポンド 1,520 | 千英ポンド 1,425 | 243,202 | 5.4 | — | 4.3 | — | 1.2 |
| 合 計 | — | — | 4,449,896 | 99.4 | — | 78.3 | 15.7 | 5.5 |

(注1) 邦貨換算金額は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(注4) —印は組入れなし。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | 第148期末 | | | | | |
|------|-------|------------------------|-------|-------|--------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| アメリカ | 特殊債券 | CFELEC 3.875% 07/26/33 | 3.875 | 380 | 292 | 39,565 | 2033/7/26 |
| | | TAQAUH 4.375% 01/24/29 | 4.375 | 200 | 201 | 27,250 | 2029/1/24 |
| | 普通社債券 | BRKHEC 3.5% 02/01/25 | 3.5 | 1,000 | 979 | 132,340 | 2025/2/1 |
| | | BRKHEC 6.25% 10/15/37 | 6.25 | 1,200 | 1,340 | 181,208 | 2037/10/15 |
| | | CHINLP 3.125% 05/06/25 | 3.125 | 200 | 193 | 26,210 | 2025/5/6 |
| | | CNP 4.95% 04/01/33 | 4.95 | 180 | 182 | 24,627 | 2033/4/1 |
| | | D 3.15% 01/15/26 | 3.15 | 450 | 436 | 59,045 | 2026/1/15 |
| | | D 5.375% 11/15/32 | 5.375 | 180 | 181 | 24,584 | 2032/11/15 |
| | | D 7% 06/15/38 | 7.0 | 900 | 1,022 | 138,160 | 2038/6/15 |
| | | D FRN 10/01/54 | 5.75 | 100 | 94 | 12,838 | 2054/10/1 |
| | | DUK 3.25% 08/15/25 | 3.25 | 450 | 438 | 59,202 | 2025/8/15 |
| | | DUK 4.8% 12/15/45 | 4.8 | 400 | 362 | 48,979 | 2045/12/15 |
| | | DUK 6.4% 06/15/38 | 6.4 | 950 | 1,076 | 145,541 | 2038/6/15 |
| | | ED 3.35% 04/01/30 | 3.35 | 200 | 183 | 24,834 | 2030/4/1 |
| | | ED 4.45% 03/15/44 | 4.45 | 1,300 | 1,153 | 155,895 | 2044/3/15 |
| | | EDPPL 1.71% 01/24/28 | 1.71 | 300 | 262 | 35,420 | 2028/1/24 |
| | | ENBCN 1.6% 10/04/26 | 1.6 | 110 | 99 | 13,502 | 2026/10/4 |
| | | ENBCN 5.7% 03/08/33 | 5.7 | 60 | 61 | 8,292 | 2033/3/8 |
| | | ENELIM 6.8% 09/15/37 | 6.8 | 300 | 318 | 43,094 | 2037/9/15 |
| | | EOANGR 6.65% 04/30/38 | 6.65 | 750 | 814 | 110,092 | 2038/4/30 |
| | | EPD 4.85% 03/15/44 | 4.85 | 400 | 363 | 49,173 | 2044/3/15 |
| | | EPD 5.95% 02/01/41 | 5.95 | 550 | 566 | 76,567 | 2041/2/1 |
| | | ETP 6.5% 02/01/42 | 6.5 | 750 | 759 | 102,610 | 2042/2/1 |
| | | ETR 2.4% 06/15/31 | 2.4 | 340 | 281 | 37,989 | 2031/6/15 |
| | | EXC 3.35% 03/15/32 | 3.35 | 400 | 355 | 48,006 | 2032/3/15 |
| | | EXC 3.7% 08/15/28 | 3.7 | 500 | 483 | 65,383 | 2028/8/15 |
| | | EXC 3.7% 09/15/47 | 3.7 | 300 | 238 | 32,183 | 2047/9/15 |
| | | EXC 5.4% 06/01/53 | 5.4 | 70 | 70 | 9,493 | 2053/6/1 |
| | | EXC 7.6% 04/01/32 | 7.6 | 400 | 467 | 63,162 | 2032/4/1 |
| | | FE 2.65% 01/15/32 | 2.65 | 250 | 210 | 28,414 | 2032/1/15 |
| | | ISRELE 5% 11/12/24 | 5.0 | 260 | 258 | 34,870 | 2024/11/12 |
| | | KMI 4.3% 03/01/28 | 4.3 | 200 | 196 | 26,519 | 2028/3/1 |
| | | KMI 5.2% 06/01/33 | 5.2 | 110 | 107 | 14,504 | 2033/6/1 |
| | | KMI 6.95% 01/15/38 | 6.95 | 600 | 664 | 89,753 | 2038/1/15 |
| | | MPLX 4.125% 03/01/27 | 4.125 | 280 | 273 | 36,938 | 2027/3/1 |
| | | MPLX 4.7% 04/15/48 | 4.7 | 160 | 128 | 17,410 | 2048/4/15 |
| | | MPLX 5% 03/01/33 | 5.0 | 90 | 86 | 11,740 | 2033/3/1 |
| | | NEE 1.9% 06/15/28 | 1.9 | 170 | 149 | 20,200 | 2028/6/15 |
| | | NEE 2.25% 06/01/30 | 2.25 | 200 | 167 | 22,695 | 2030/6/1 |
| | | NEE 4.125% 02/01/42 | 4.125 | 250 | 220 | 29,740 | 2042/2/1 |
| | | NEE 4.9% 02/28/28 | 4.9 | 250 | 252 | 34,077 | 2028/2/28 |
| | | NEE 5% 07/15/32 | 5.0 | 180 | 179 | 24,258 | 2032/7/15 |
| | | NEE FRN 12/01/77 | 4.8 | 300 | 261 | 35,284 | 2077/12/1 |
| | | NGGLN 2.742% 08/15/26 | 2.742 | 645 | 595 | 80,496 | 2026/8/15 |
| | | NRUC 2.4% 03/15/30 | 2.4 | 155 | 134 | 18,120 | 2030/3/15 |

| 銘柄 | | | 第148期末 | | | | |
|------|-------|------------------------|---------|------|-------|-----------|------------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 普通社債券 | NRUC 3.4% 02/07/28 | 3.4 | 390 | 372 | 50,386 | 2028/2/7 |
| | | NRUC FRN 04/30/43 | 8.20914 | 190 | 183 | 24,828 | 2043/4/30 |
| | | OKE 3.4% 09/01/29 | 3.4 | 400 | 359 | 48,561 | 2029/9/1 |
| | | OKE 6.1% 11/15/32 | 6.1 | 200 | 206 | 27,876 | 2032/11/15 |
| | | OKE 6.85% 10/15/37 | 6.85 | 300 | 316 | 42,789 | 2037/10/15 |
| | | ONCRTX 4.3% 05/15/28 | 4.3 | 80 | 79 | 10,797 | 2028/5/15 |
| | | ONCRTX 4.55 09/15/32 | 4.55 | 170 | 167 | 22,700 | 2032/9/15 |
| | | ONCRTX 5.25% 09/30/40 | 5.25 | 850 | 857 | 115,890 | 2040/9/30 |
| | | PEG 1.6% 08/15/30 | 1.6 | 350 | 281 | 37,993 | 2030/8/15 |
| | | PEG 3.95% 05/01/42 | 3.95 | 700 | 599 | 81,026 | 2042/5/1 |
| | | SGSPAA 3.25% 07/29/26 | 3.25 | 400 | 380 | 51,405 | 2026/7/29 |
| | | SO 0.9% 01/15/26 | 0.9 | 200 | 181 | 24,590 | 2026/1/15 |
| | | SO 4.3% 03/15/42 | 4.3 | 500 | 432 | 58,492 | 2042/3/15 |
| | | SRE 1.7% 10/01/30 | 1.7 | 230 | 187 | 25,385 | 2030/10/1 |
| | | SRE 5.35% 04/01/53 | 5.35 | 200 | 199 | 26,999 | 2053/4/1 |
| | | TRPCN 7.625% 01/15/39 | 7.625 | 700 | 819 | 110,716 | 2039/1/15 |
| | | TRPCN FRN 03/15/77 | 5.3 | 180 | 155 | 20,996 | 2077/3/15 |
| | | WEC 4.75% 01/15/28 | 4.75 | 250 | 250 | 33,876 | 2028/1/15 |
| | | WMB 3.75% 06/15/27 | 3.75 | 350 | 337 | 45,624 | 2027/6/15 |
| | | WMB 4% 09/15/25 | 4.0 | 250 | 245 | 33,112 | 2025/9/15 |
| | | WMB 6.3% 04/15/40 | 6.3 | 250 | 258 | 35,002 | 2040/4/15 |
| 小計 | | | | | | 3,249,341 | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ドイツ | 普通社債券 | AMPRIO 3.45% 09/22/27 | 3.45 | 100 | 99 | 14,708 | 2027/9/22 |
| | | AMPRIO 3.971% 09/22/32 | 3.971 | 100 | 100 | 14,939 | 2032/9/22 |
| | | ENBW FRN 08/31/81 | 2.125 | 200 | 139 | 20,655 | 2081/8/31 |
| | | EUROGR 3.722% 04/27/30 | 3.722 | 100 | 100 | 14,933 | 2030/4/27 |
| | | RWE 3.625% 02/13/29 | 3.625 | 110 | 109 | 16,231 | 2029/2/13 |
| イタリア | 特殊債券 | ACEIM 3.875% 01/24/31 | 3.875 | 210 | 207 | 30,818 | 2031/1/24 |
| | 普通社債券 | AEMSPA 4.375% 02/03/34 | 4.375 | 110 | 109 | 16,240 | 2034/2/3 |
| | | ENELIM 5.625% 06/21/27 | 5.625 | 300 | 327 | 48,488 | 2027/6/21 |
| | | ENELIM FRN PERPETUAL | 6.375 | 200 | 202 | 29,983 | — |
| | | HERIM 4.25% 04/20/33 | 4.25 | 130 | 129 | 19,242 | 2033/4/20 |
| フランス | 特殊債券 | EDF 4.625% 01/25/43 | 4.625 | 200 | 184 | 27,339 | 2043/1/25 |
| | | EDF 4.75% 10/12/34 | 4.75 | 100 | 100 | 14,867 | 2034/10/12 |
| | 普通社債券 | EDF FRN PERPETUAL | 7.5 | 200 | 195 | 29,021 | — |
| | | ENGIFP 3.5% 09/27/29 | 3.5 | 100 | 99 | 14,820 | 2029/9/27 |
| | | ENGIFP FRN PERPETUAL | 1.5 | 100 | 81 | 12,034 | — |
| | | ENGIFP FRN PERPETUAL | 1.875 | 100 | 74 | 11,078 | — |
| オランダ | 特殊債券 | TENN 1.625% 11/17/26 | 1.625 | 140 | 133 | 19,850 | 2026/11/17 |
| | | TENN 2.75% 05/17/42 | 2.75 | 190 | 162 | 24,099 | 2042/5/17 |
| | | TENN FRN PERPETUAL | 2.995 | 230 | 223 | 33,120 | — |
| | 普通社債券 | ALLRNV FRN PERPETUAL | 1.625 | 350 | 320 | 47,439 | — |
| | | ENBW 4% 01/24/35 | 4.0 | 150 | 146 | 21,753 | 2035/1/24 |
| | | ENBW 4.049% 11/22/29 | 4.049 | 130 | 133 | 19,772 | 2029/11/22 |
| | | ENBW 6.125% 07/07/39 | 6.125 | 100 | 118 | 17,565 | 2039/7/7 |
| | | ENELIM 4.5% 02/20/43 | 4.5 | 160 | 154 | 22,931 | 2043/2/20 |

| 銘 柄 | | | 第148期末 | | | | |
|---------|---------------------|------------------------|--------|-------|---------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 普通社債券 | ANESM 1.375% 01/26/32 | 1.375 | 200 | 165 | 24,471 | 2032/1/26 |
| | | ANESM 3.75% 04/25/30 | 3.75 | 200 | 199 | 29,520 | 2030/4/25 |
| | | IBESM 3.125% 11/22/28 | 3.125 | 100 | 99 | 14,802 | 2028/11/22 |
| | | IBESM FRN PERPETUAL | 1.575 | 200 | 166 | 24,704 | — |
| | | IBESM FRN PERPETUAL | 4.875 | 200 | 192 | 28,460 | — |
| | | NATUEN 0.905% 01/22/31 | 0.905 | 200 | 157 | 23,334 | 2031/1/22 |
| ベルギー | 普通社債券 | ELIASO FRN PERPETUAL | 5.85 | 100 | 100 | 14,846 | — |
| ルクセンブルグ | 普通社債券 | CZGRID 1% 07/16/27 | 1.0 | 150 | 128 | 19,082 | 2027/7/16 |
| フィンランド | 普通社債券 | TVOYFH 1.375% 06/23/28 | 1.375 | 270 | 235 | 34,867 | 2028/6/23 |
| アイルランド | 特殊債券 | ESBIRE 3.75% 01/25/43 | 3.75 | 250 | 235 | 34,965 | 2043/1/25 |
| その他 | 特殊債券 | ORSTED 2.875% 06/14/33 | 2.875 | 140 | 128 | 19,110 | 2033/6/14 |
| | | ORSTED 3.75% 03/01/30 | 3.75 | 100 | 100 | 14,921 | 2030/3/1 |
| | | SPPDIS 1% 06/09/31 | 1.0 | 160 | 109 | 16,288 | 2031/6/9 |
| | | VATFAL 0.125% 02/12/29 | 0.125 | 100 | 83 | 12,408 | 2029/2/12 |
| | | VATFAL 3.75% 10/18/26 | 3.75 | 110 | 111 | 16,489 | 2026/10/18 |
| | 普通社債券 | ANVAU 0.625% 08/25/30 | 0.625 | 110 | 86 | 12,880 | 2030/8/25 |
| | | ANVAU FRN 03/11/81 | 1.625 | 110 | 92 | 13,637 | 2081/3/11 |
| | | NGTRAN 4.25% 04/05/30 | 4.25 | 120 | 121 | 17,962 | 2030/4/5 |
| | | SO FRN 09/15/81 | 1.875 | 250 | 196 | 29,162 | 2081/9/15 |
| | | VATFAL FRN 03/19/77 | 3.0 | 100 | 91 | 13,496 | 2077/3/19 |
| 小 計 | | | | | 957,352 | | |
| イギリス | | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | |
| | 特殊債券 | ORSTED FRN 02/18/21 | 2.5 | 200 | 138 | 23,624 | 3021/2/18 |
| | 普通社債券 | APAAU 3.125% 07/18/31 | 3.125 | 220 | 180 | 30,880 | 2031/7/18 |
| | | ENELIM 5.75% 09/14/40 | 5.75 | 300 | 304 | 51,906 | 2040/9/14 |
| | | EOANGR 6.375% 06/07/32 | 6.375 | 300 | 316 | 54,082 | 2032/6/7 |
| | | IBESM 7.375% 01/29/24 | 7.375 | 300 | 303 | 51,814 | 2024/1/29 |
| | | VATFAL FRN 06/29/83 | 2.5 | 100 | 81 | 13,828 | 2083/6/29 |
| | VATFAL FRN 08/17/83 | 6.875 | 100 | 100 | 17,065 | 2083/8/17 | |
| 小 計 | | | | | | 243,202 | |
| 合 計 | | | | | | 4,449,896 | |

(注1) 邦貨換算金額は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | 第148期末 | |
|-----|--------|--------------|--------|-------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 | 債券先物取引 | | 百万円 | 百万円 |
| | | EURO-BUND FU | — | 240 |
| | | US LONG BOND | — | 140 |

(注1)金額は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2)単位未満は切捨て。

(注3)一印は組入れなし。

○投資信託財産の構成

(2023年5月10日現在)

| 項 目 | 第148期末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 4,449,896 | 93.9 |
| コール・ローン等、その他 | 289,929 | 6.1 |
| 投資信託財産総額 | 4,739,825 | 100.0 |

(注1)評価額の単位未満は切捨て。

(注2)作成期末における外貨建純資産(4,668,508千円)の投資信託財産総額(4,739,825千円)に対する比率は98.5%です。

(注3)外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年5月10日における邦貨換算レートは、1米ドル=135.15円、1ユーロ=148.23円、1英ポンド=170.65円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第143期末 | 第144期末 | 第145期末 | 第146期末 | 第147期末 | 第148期末 |
|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2022年12月12日現在 | 2023年1月10日現在 | 2023年2月10日現在 | 2023年3月10日現在 | 2023年4月10日現在 | 2023年5月10日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 9,264,834,638 | 9,166,213,866 | 9,695,761,351 | 10,102,072,937 | 9,623,249,675 | 10,017,620,811 |
| コール・ローン等 | 99,885,308 | 135,230,457 | 152,081,527 | 229,218,369 | 181,737,662 | 142,224,220 |
| 公社債(評価額) | 4,300,463,362 | 4,090,845,804 | 4,475,897,429 | 4,355,715,829 | 4,402,467,527 | 4,449,896,196 |
| 未収入金 | 4,660,197,544 | 4,738,881,452 | 4,877,178,577 | 5,296,972,429 | 4,824,910,840 | 5,286,536,450 |
| 未収利息 | 63,411,873 | 64,588,628 | 52,065,067 | 58,023,943 | 55,233,688 | 57,392,015 |
| 前払費用 | 18,311 | 17,653 | 1,489,131 | 1,735,425 | 720,515 | 734,525 |
| その他未収収益 | 1,913,370 | 2,127,281 | 2,313,818 | 2,533,310 | 2,726,325 | 2,947,190 |
| 差入委託証拠金 | 138,944,870 | 134,522,591 | 134,735,802 | 157,873,632 | 155,453,118 | 77,890,215 |
| (B) 負債 | 4,569,235,355 | 4,509,242,579 | 4,981,425,170 | 5,542,645,905 | 5,127,555,169 | 5,542,802,585 |
| 未払金 | 4,554,187,026 | 4,494,429,844 | 4,966,196,031 | 5,527,704,098 | 4,923,532,237 | 5,527,907,345 |
| 未払収益分配金 | 12,377,367 | 12,282,864 | 12,391,627 | 12,337,025 | 11,861,489 | 11,989,913 |
| 未払解約金 | — | — | — | — | 189,199,998 | — |
| 未払信託報酬 | 2,569,389 | 2,335,976 | 2,543,111 | 2,222,542 | 2,481,145 | 2,348,700 |
| 未払利息 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |
| その他未払費用 | 101,546 | 193,868 | 294,374 | 382,213 | 480,273 | 556,600 |
| (C) 純資産総額(A－B) | 4,695,599,283 | 4,656,971,287 | 4,714,336,181 | 4,559,427,032 | 4,495,694,506 | 4,474,818,226 |
| 元本 | 6,188,683,707 | 6,141,432,277 | 6,195,813,803 | 6,168,512,866 | 5,930,744,893 | 5,994,956,935 |
| 次期繰越損益金 | △1,493,084,424 | △1,484,460,990 | △1,481,477,622 | △1,609,085,834 | △1,435,050,387 | △1,520,138,709 |
| (D) 受益権総口数 | 6,188,683,707口 | 6,141,432,277口 | 6,195,813,803口 | 6,168,512,866口 | 5,930,744,893口 | 5,994,956,935口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,587円 | 7,583円 | 7,609円 | 7,391円 | 7,580円 | 7,464円 |

(注)第143期首元本額は6,263,177,790円、第143～148期中追加設定元本額は436,018,818円、第143～148期中一部解約元本額は704,239,673円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第143期 | 第144期 | 第145期 | 第146期 | 第147期 | 第148期 |
|--------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2022年11月11日～ 2022年12月12日 | 2022年12月13日～ 2023年1月10日 | 2023年1月11日～ 2023年2月10日 | 2023年2月11日～ 2023年3月10日 | 2023年3月11日～ 2023年4月10日 | 2023年4月11日～ 2023年5月10日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 17,803,067 | 15,418,514 | 16,715,982 | 16,216,765 | 17,416,893 | 17,140,066 |
| 受取利息 | 17,279,199 | 14,905,985 | 16,156,706 | 15,769,804 | 17,106,420 | 16,712,448 |
| その他収益金 | 524,781 | 513,229 | 560,234 | 447,755 | 310,014 | 428,473 |
| 支払利息 | △ 913 | △ 700 | △ 958 | △ 914 | 459 | △ 855 |
| (B) 有価証券売買損益 | 246,177,917 | △ 9,404,163 | 11,031,636 | △ 143,252,040 | 126,429,059 | △ 78,873,450 |
| 売買益 | 595,469,244 | 152,927,354 | 318,490,354 | 144,834,276 | 366,501,728 | 111,843,427 |
| 売買損 | △ 349,291,327 | △ 162,331,517 | △ 307,458,718 | △ 288,086,316 | △ 240,072,669 | △ 190,716,877 |
| (C) 先物取引等取引損益 | △ 20,841,682 | 5,920,994 | 3,035,239 | 10,742,702 | △ 17,429,125 | 7,062,482 |
| 取引益 | 1,394,472 | 5,920,994 | 3,035,239 | 12,278,239 | — | 7,062,482 |
| 取引損 | △ 22,236,154 | — | — | △ 1,535,537 | △ 17,429,125 | — |
| (D) 信託報酬等 | △ 2,724,881 | △ 2,428,298 | △ 2,752,553 | △ 2,310,381 | △ 2,649,673 | △ 2,507,377 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 240,414,421 | 9,507,047 | 28,030,304 | △ 118,603,014 | 123,767,154 | △ 57,178,279 |
| (F) 前期繰越損益金 | △ 1,350,174,598 | △ 1,113,570,361 | △ 1,115,657,269 | △ 1,063,949,675 | △ 1,146,898,636 | △ 1,017,524,515 |
| (G) 追加信託差損益金 | △ 370,946,880 | △ 368,114,812 | △ 381,459,030 | △ 414,196,120 | △ 400,057,416 | △ 433,446,002 |
| (配当等相当額) | (113,022,233) | (112,159,342) | (116,919,195) | (127,860,652) | (123,560,527) | (135,290,058) |
| (売買損益相当額) | (△ 483,969,113) | (△ 480,274,154) | (△ 498,378,225) | (△ 542,056,772) | (△ 523,617,943) | (△ 568,736,060) |
| (H) 計(E+F+G) | △ 1,480,707,057 | △ 1,472,178,126 | △ 1,469,085,995 | △ 1,596,748,809 | △ 1,423,188,998 | △ 1,508,148,796 |
| (I) 収益分配金 | △ 12,377,367 | △ 12,282,864 | △ 12,391,627 | △ 12,337,025 | △ 11,861,489 | △ 11,989,913 |
| 次期繰越損益金(H+I) | △ 1,493,084,424 | △ 1,484,460,990 | △ 1,481,477,622 | △ 1,609,085,834 | △ 1,435,050,387 | △ 1,520,138,709 |
| 追加信託差損益金 | △ 370,946,880 | △ 368,114,812 | △ 381,459,030 | △ 414,196,120 | △ 400,057,416 | △ 433,446,002 |
| (配当等相当額) | (113,022,233) | (112,159,342) | (116,919,195) | (127,860,652) | (123,560,527) | (135,290,058) |
| (売買損益相当額) | (△ 483,969,113) | (△ 480,274,154) | (△ 498,378,225) | (△ 542,056,772) | (△ 523,617,943) | (△ 568,736,060) |
| 分配準備積立金 | 394,423,313 | 392,119,361 | 394,707,100 | 383,334,202 | 373,128,398 | 369,473,569 |
| 繰越損益金 | △ 1,516,560,857 | △ 1,508,465,539 | △ 1,494,725,692 | △ 1,578,223,916 | △ 1,408,121,369 | △ 1,456,166,276 |

(注1) (A) 配当等収益一支払利息にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

(注2) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注3) (D) 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4) (G) 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。

○分配金の計算過程

| 項 目 | 第143期 | 第144期 | 第145期 | 第146期 | 第147期 | 第148期 |
|----------------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2022年11月11日～ 2022年12月12日 | 2022年12月13日～ 2023年1月10日 | 2023年1月11日～ 2023年2月10日 | 2023年2月11日～ 2023年3月10日 | 2023年3月11日～ 2023年4月10日 | 2023年4月11日～ 2023年5月10日 |
| a. 配当等収益(費用控除後) | 17,603,606円 | 12,990,216円 | 15,221,346円 | 13,906,324円 | 17,051,768円 | 14,632,689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 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 113,022,233 | 112,159,342 | 116,919,195 | 127,860,652 | 123,560,527 | 135,290,058 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 389,197,074 | 391,412,009 | 391,877,381 | 381,764,903 | 367,938,119 | 366,830,793 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 519,822,913 | 516,561,567 | 524,017,922 | 523,531,879 | 508,550,414 | 516,753,540 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 839 | 841 | 845 | 848 | 857 | 861 |
| g. 分配金 | 12,377,367 | 12,282,864 | 12,391,627 | 12,337,025 | 11,861,489 | 11,989,913 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |

○分配金のお知らせ

| | 第143期 | 第144期 | 第145期 | 第146期 | 第147期 | 第148期 |
|------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 |

(注1) 分配金をお支払いする場合

分配金のお支払いは、原則として決算日から起算して5営業日までに開始いたします。

(注2) 分配金を再投資する場合

お手持り分配金は、税引後みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

* 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

<お知らせ>

- ・ 該当事項はございません。

マネープール・マザーファンド

第13期 (2021年10月13日から2022年10月12日まで)

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限 (設定日: 2009年10月30日) |
| 運用方針 | 主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。 |

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 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 総額 |
|-------------------|--------|-----------|-------------|-----------|
| | | 期中 騰落率 | | |
| | 円 | % | % | 百万円 |
| 9期 (2018年10月12日) | 10,032 | △0.1 | 16.6 | 440,044 |
| 10期 (2019年10月15日) | 10,023 | △0.1 | 96.1 | 411,156 |
| 11期 (2020年10月12日) | 10,014 | △0.1 | 93.4 | 354,336 |
| 12期 (2021年10月12日) | 10,006 | △0.1 | 92.9 | 340,127 |
| 13期 (2022年10月12日) | 9,999 | △0.1 | 93.8 | 279,322 |

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

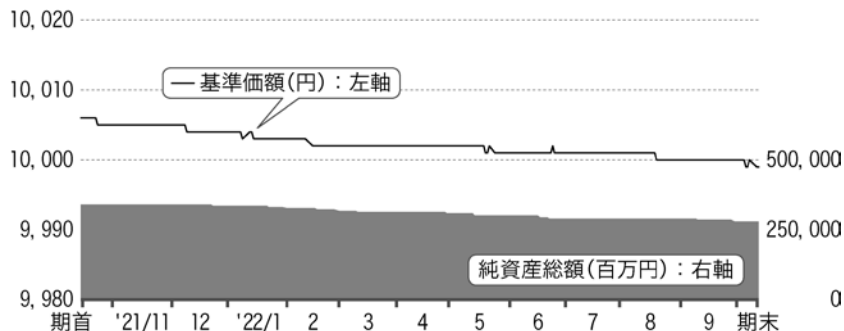
| 年月日 | 基準価額 | | 公社債 組入比率 |
|-------------|--------|------|-------------|
| | | 騰落率 | |
| (期首) | 円 | % | % |
| 2021年10月12日 | 10,006 | — | 92.9 |
| 10月末 | 10,005 | △0.0 | 91.7 |
| 11月末 | 10,005 | △0.0 | 91.8 |
| 12月末 | 10,004 | △0.0 | 30.8 |
| 2022年1月末 | 10,003 | △0.0 | 92.1 |
| 2月末 | 10,002 | △0.0 | 93.2 |
| 3月末 | 10,002 | △0.0 | 68.9 |
| 4月末 | 10,002 | △0.0 | 61.8 |
| 5月末 | 10,001 | △0.0 | 91.5 |
| 6月末 | 10,001 | △0.0 | 44.3 |
| 7月末 | 10,001 | △0.0 | 31.1 |
| 8月末 | 10,000 | △0.1 | 89.3 |
| 9月末 | 10,000 | △0.1 | 92.1 |
| (期末) | | | |
| 2022年10月12日 | 9,999 | △0.1 | 93.8 |

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2021年10月13日から2022年10月12日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 10,006円 |
| 期末 | 9,999円 |
| 騰落率 | -0.1% |

▶ 基準価額の主な変動要因 (2021年10月13日から2022年10月12日まで)

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

下落要因

- ・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2021年10月13日から2022年10月12日まで)

短期金利は低下しました。

2月のロシアによるウクライナ侵攻をきっかけに商品市況が高騰したことから、世界的にインフレ圧力が強まりました。また、インフレが高止まりを続けたことから、各国中央銀行が大幅な利上げを継続した結果、為替市場では円安が加速しました。これらの影響により国内でも物価上昇率が拡大し、CPIコア（生鮮食品除く消費者物価指数）は前年比+3%近辺まで上昇しました。しかし、日銀はコストプッシュ型の物価上昇は持続的でないとの見方から、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、日銀が金融政策を据え置いたことや、需給動向を勘案し短期国債の買入れ額を調整したことから、期初より概ね横ばいで推移しました。期末にかけては、年末越え運用ニーズが急速に強まったことから、一時的に大きく低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2021年10月13日から2022年10月12日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しの下、残存0年から1年3ヵ月までの円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを維持しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2021年10月13日から2022年10月12日まで)

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

② 今後の運用方針

商品市況の高騰や為替の円安を背景に、当面は物価上昇率の高止まりが続きますが、日銀はコストプッシュ型の物価上昇は持続的でないとの見方を維持し、マイナス金利政策を継続する見込みです。従って、短期国債利回りやコールローン（金融機関同士のごく短期の資金の貸借）翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引き続きマイナス圏での推移を想定します。

残存0年から1年3ヵ月までの公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

マネープール・マザーファンド

■ 1万口当たりの費用明細(2021年10月13日から2022年10月12日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用 (その他) | 0円 (0) | 0.001% (0.001) | 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：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 0 | 0.001 | |

期中の平均基準価額は10,002円です。

※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ています。

※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。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2021年10月13日から2022年10月12日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|-------|---------------|--------------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 8,301,986,878 | 8,113,423,306 (224,230,000) |
| | 地方債証券 | 63,444,582 | — (78,279,300) |
| | 特殊債証券 | 7,626,094 | — (10,577,100) |

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年10月13日から2022年10月12日まで)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 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 | $\frac{D}{C}$ |
|-----|----------------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | % | | | % |
| 公社債 | 百万円 279,547 | 百万円 65,519 | % 23.4 | 百万円 — | 百万円 — | % — |

利害関係人とは、投資信託およ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。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月13日から2022年10月12日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

マネープール・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2022年10月12日現在)

公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

| 区 分 | 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 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 193,830,000 (193,830,000) | 193,946,021 (193,946,021) | 69.4 (69.4) | — (—) | — (—) | — (—) | 69.4 (69.4) |
| 地 方 債 証 券 | 60,238,830 (60,238,830) | 60,396,645 (60,396,645) | 21.6 (21.6) | — (—) | — (—) | — (—) | 21.6 (21.6) |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 7,564,500 (7,564,500) | 7,582,469 (7,582,469) | 2.7 (2.7) | — (—) | — (—) | — (—) | 2.7 (2.7) |
| 合 計 | 261,633,330 (261,633,330) | 261,925,136 (261,925,136) | 93.8 (93.8) | — (—) | — (—) | — (—) | 93.8 (93.8) |

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

B 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----------|-------------|--------|-----------------|-----------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| 国 債 証 券 | 1101国庫短期証券 | — | 千円 3,830,000 | 千円 3,830,551 | 2022/11/14 |
| | 1104国庫短期証券 | — | 10,000,000 | 10,002,070 | 2022/11/28 |
| | 1110国庫短期証券 | — | 180,000,000 | 180,113,400 | 2023/01/06 |
| | 小 計 | — | 193,830,000 | 193,946,021 | — |
| 地 方 債 証 券 | 24-2 横浜市公債 | 0.8150 | 600,000 | 600,049 | 2022/10/17 |
| | 24-18 兵庫県公債 | 0.7700 | 600,000 | 600,052 | 2022/10/19 |
| | 24-6 京都府公債 | 0.8000 | 200,000 | 200,036 | 2022/10/21 |
| | 24-4 京都市公債 | 0.8010 | 300,000 | 300,054 | 2022/10/21 |
| | 24-10 神戸市公債 | 0.7960 | 100,000 | 100,018 | 2022/10/21 |
| | 24-6 福岡県公債 | 0.8000 | 200,000 | 200,055 | 2022/10/25 |
| | 24-6 埼玉県公債 | 0.8010 | 500,000 | 500,140 | 2022/10/26 |
| | 24-1 福井県公債 | 0.8000 | 300,000 | 300,084 | 2022/10/26 |
| | 29-7 埼玉県5年 | 0.0200 | 490,000 | 490,000 | 2022/10/27 |
| | 365 大阪府公債 | 0.7700 | 500,000 | 500,141 | 2022/10/28 |
| | 24-9 静岡県公債 | 0.8200 | 100,000 | 100,087 | 2022/11/22 |
| | 24-6 千葉県公債 | 0.8100 | 380,000 | 380,371 | 2022/11/25 |
| | 24-4 広島県公債 | 0.8100 | 100,000 | 100,097 | 2022/11/28 |
| | 366 大阪府公債 | 0.7900 | 342,000 | 342,334 | 2022/11/29 |

マネープール・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| | 24-13 愛知県公債 | 0.7720 | 100,000 | 100,098 | 2022/11/30 |
| | 24-8 京都府公債 | 0.7300 | 1,470,290 | 1,472,316 | 2022/12/19 |
| | 714 東京都公債 | 0.7400 | 100,000 | 100,138 | 2022/12/20 |
| | 715 東京都公債 | 0.7600 | 500,000 | 500,739 | 2022/12/20 |
| | 716 東京都公債 | 0.7700 | 550,000 | 550,812 | 2022/12/20 |
| | 193 神奈川県公債 | 0.7390 | 850,500 | 851,674 | 2022/12/20 |
| | 194 神奈川県公債 | 0.7910 | 600,000 | 600,888 | 2022/12/20 |
| | 481 名古屋市債 | 0.7440 | 1,433,000 | 1,434,978 | 2022/12/20 |
| | 25 名古屋市5年 | 0.0300 | 100,000 | 100,009 | 2022/12/20 |
| | 85 川崎市公債 | 0.7200 | 1,400,000 | 1,401,929 | 2022/12/20 |
| | 29-10 京都府5年 | 0.0300 | 100,000 | 100,009 | 2022/12/22 |
| | 24-7 千葉県公債 | 0.7400 | 600,000 | 600,886 | 2022/12/22 |
| | 24-3 横浜市公債 | 0.7290 | 500,000 | 500,739 | 2022/12/22 |
| | 24-9 福岡県公債 | 0.7100 | 500,000 | 500,739 | 2022/12/26 |
| | 24-2 北九州市債 | 0.7150 | 500,000 | 500,739 | 2022/12/26 |
| | 367 大阪府公債 | 0.7300 | 812,000 | 813,281 | 2022/12/27 |
| | 145 大阪府5年 | 0.0010 | 108,000 | 108,000 | 2022/12/27 |
| | 24-15 愛知県公債 | 0.7440 | 1,640,000 | 1,642,587 | 2022/12/27 |
| | 29-7 福岡県5年 | 0.0400 | 900,000 | 900,177 | 2023/01/23 |
| | 24-8 大阪市公債 | 0.8780 | 300,000 | 300,743 | 2023/01/23 |
| | 29-7 大阪市5年 | 0.0400 | 1,200,000 | 1,200,235 | 2023/01/24 |
| | 24-5 広島県公債 | 0.8400 | 500,000 | 501,237 | 2023/01/25 |
| | 24-8 千葉県公債 | 0.8400 | 600,000 | 601,484 | 2023/01/25 |
| | 47 横浜市5年 | 0.0400 | 600,000 | 600,117 | 2023/01/27 |
| | 368 大阪府公債 | 0.8300 | 300,000 | 300,771 | 2023/01/30 |
| | 24-9 埼玉県公債 | 0.8440 | 700,000 | 701,871 | 2023/01/31 |
| | 24-5 京都市公債 | 0.8540 | 100,000 | 100,267 | 2023/01/31 |
| | 24-1 岡山県公債 | 0.8400 | 100,000 | 100,257 | 2023/01/31 |
| | 24-4 横浜市公債 | 0.8100 | 350,000 | 351,041 | 2023/02/20 |
| | 29-6 広島県5年 | 0.0400 | 600,000 | 600,178 | 2023/02/23 |
| | 24-9 千葉県公債 | 0.8200 | 1,597,470 | 1,602,538 | 2023/02/24 |
| | 29-7 千葉県5年 | 0.0400 | 1,000,000 | 1,000,295 | 2023/02/24 |
| | 369 大阪府公債 | 0.8000 | 612,000 | 613,943 | 2023/02/27 |
| | 147 大阪府5年 | 0.0010 | 300,000 | 300,029 | 2023/02/27 |
| | 24-10 埼玉県公債 | 0.8250 | 800,000 | 802,619 | 2023/02/27 |
| | 24-11 福岡県公債 | 0.8000 | 300,000 | 300,952 | 2023/02/27 |
| | 29-12 京都府5年 | 0.0400 | 100,000 | 100,039 | 2023/03/16 |
| | 29-11 福岡市5年 | 0.0400 | 1,300,000 | 1,300,513 | 2023/03/16 |
| | 717 東京都公債 | 0.6300 | 300,000 | 300,894 | 2023/03/20 |
| | 718 東京都公債 | 0.6000 | 700,000 | 702,016 | 2023/03/20 |
| | 719 東京都公債 | 0.8600 | 510,000 | 512,026 | 2023/03/20 |
| | 195 神奈川県公債 | 0.5760 | 1,300,000 | 1,303,612 | 2023/03/20 |
| | 196 神奈川県公債 | 0.6780 | 700,000 | 702,223 | 2023/03/20 |
| | 74 神奈川県5年 | 0.0400 | 420,000 | 420,166 | 2023/03/20 |
| | 29-14 静岡県5年 | 0.0400 | 1,230,000 | 1,230,487 | 2023/03/20 |
| | 482 名古屋市債 | 0.6390 | 300,000 | 300,894 | 2023/03/20 |

マネープール・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|-----|-------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償還年月日 |
| | 24-10 京都府公債 | 0.6700 | 454,900 | 456,345 | 2023/03/22 |
| | 24-10 静岡県公債 | 0.6780 | 703,000 | 705,232 | 2023/03/22 |
| | 24-7 広島県公債 | 0.6700 | 100,000 | 100,328 | 2023/03/27 |
| | 370 大阪府公債 | 0.6500 | 100,000 | 100,318 | 2023/03/28 |
| | 24-19 愛知県公債 | 0.6390 | 600,000 | 601,909 | 2023/03/28 |
| | 29-5 京都市5年 | 0.0400 | 1,300,000 | 1,300,514 | 2023/03/28 |
| | 24-2 岡山県公債 | 0.6800 | 600,000 | 602,029 | 2023/03/29 |
| | 25-1 埼玉県公債 | 0.5860 | 250,000 | 250,823 | 2023/04/18 |
| | 25-1 静岡県公債 | 0.5810 | 600,000 | 601,914 | 2023/04/19 |
| | 25-1 千葉県公債 | 0.5800 | 150,000 | 150,494 | 2023/04/25 |
| | 25-2 大阪市公債 | 0.8330 | 200,000 | 201,060 | 2023/05/23 |
| | 25-1 広島県公債 | 0.6100 | 112,870 | 113,322 | 2023/05/24 |
| | 372 大阪府公債 | 0.6560 | 372,000 | 373,604 | 2023/05/30 |
| | 150 大阪府5年 | 0.0010 | 2,140,000 | 2,140,490 | 2023/05/30 |
| | 25-4 愛知県公債 | 0.8560 | 100,000 | 100,560 | 2023/05/30 |
| | 25-4 京都府公債 | 0.8800 | 100,000 | 100,631 | 2023/06/19 |
| | 722 東京都公債 | 0.8000 | 1,800,000 | 1,810,299 | 2023/06/20 |
| | 1 東京都20年 | 1.5400 | 100,000 | 101,090 | 2023/06/20 |
| | 197 神奈川県公債 | 0.8240 | 100,000 | 100,592 | 2023/06/20 |
| | 76 神奈川県5年 | 0.0300 | 1,500,000 | 1,500,660 | 2023/06/20 |
| | 1 横浜市20年 | 1.4700 | 400,000 | 404,160 | 2023/06/20 |
| | 25-3 千葉県公債 | 0.8900 | 100,000 | 100,641 | 2023/06/23 |
| | 25-3 埼玉県公債 | 0.8920 | 100,000 | 100,651 | 2023/06/26 |
| | 151 大阪府5年 | 0.0010 | 450,000 | 450,109 | 2023/06/28 |
| | 30-2 福岡県5年 | 0.0300 | 100,000 | 100,052 | 2023/07/20 |
| | 25-4 埼玉県公債 | 0.9210 | 300,000 | 302,221 | 2023/07/24 |
| | 25-4 千葉県公債 | 0.9200 | 200,000 | 201,500 | 2023/07/25 |
| | 14-1 宮城県5年 | 0.0300 | 100,000 | 100,052 | 2023/07/27 |
| | 374 大阪府公債 | 0.9380 | 400,000 | 403,041 | 2023/07/28 |
| | 25-2 京都市公債 | 0.8110 | 400,000 | 402,913 | 2023/08/28 |
| | 153 大阪府5年 | 0.0010 | 3,128,000 | 3,128,647 | 2023/08/30 |
| | 25-7 京都府公債 | 0.8000 | 300,000 | 302,302 | 2023/09/19 |
| | 724 東京都公債 | 0.7000 | 800,000 | 805,420 | 2023/09/20 |
| | 725 東京都公債 | 0.6600 | 1,550,000 | 1,559,876 | 2023/09/20 |
| | 200 神奈川県公債 | 0.8250 | 300,000 | 302,391 | 2023/09/20 |
| | 201 神奈川県公債 | 0.7040 | 500,000 | 503,388 | 2023/09/20 |
| | 25-7 静岡県公債 | 0.8010 | 100,000 | 100,766 | 2023/09/20 |
| | 30-3 大阪市5年 | 0.0300 | 30,000 | 30,014 | 2023/09/20 |
| | 25-3 広島県公債 | 0.8000 | 825,000 | 831,412 | 2023/09/25 |
| | 25-6 千葉県公債 | 0.8000 | 300,000 | 302,331 | 2023/09/25 |
| | 376 大阪府公債 | 0.8200 | 106,000 | 106,845 | 2023/09/27 |
| | 25-12 愛知県公債 | 0.7770 | 100,000 | 100,757 | 2023/09/27 |
| | 25-6 埼玉県公債 | 0.8060 | 148,000 | 149,165 | 2023/09/27 |
| | 25-9 京都府公債 | 0.6900 | 100,000 | 100,709 | 2023/10/13 |
| | 25-4 京都市公債 | 0.6890 | 100,000 | 100,709 | 2023/10/16 |
| | 25-8 静岡県公債 | 0.6990 | 159,800 | 160,964 | 2023/10/24 |

マネープール・マザーファンド

| 種 類 | 銘 柄 | 期 末 | | | |
|---------------------|-------------|---------|-------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | 29-1 宮城県公債 | 0.6800 | 600,000 | 604,318 | 2023/10/25 |
| | 25-15 愛知県公債 | 0.6990 | 300,000 | 302,218 | 2023/10/25 |
| | 25-6 福岡県公債 | 0.7090 | 100,000 | 100,749 | 2023/10/25 |
| | 25-7 千葉県公債 | 0.7000 | 400,000 | 402,957 | 2023/10/25 |
| | 30-7 埼玉県5年 | 0.0200 | 300,000 | 300,093 | 2023/10/26 |
| | 377 大阪府公債 | 0.7290 | 400,000 | 403,076 | 2023/10/30 |
| | 25-7 兵庫県公債 | 0.7000 | 600,000 | 604,439 | 2023/10/30 |
| | 25-6 大阪市公債 | 0.6940 | 100,000 | 100,772 | 2023/11/22 |
| | 25-8 千葉県公債 | 0.6700 | 120,000 | 120,903 | 2023/11/24 |
| | 378 大阪府公債 | 0.7000 | 144,000 | 145,142 | 2023/11/28 |
| | 25-16 愛知県公債 | 0.6650 | 100,000 | 100,752 | 2023/11/28 |
| | 25-1 栃木県公債 | 0.6500 | 300,000 | 302,226 | 2023/11/29 |
| | 小 計 | - | 60,238,830 | 60,396,645 | - |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 175 政保道路機構 | 0.7910 | 963,000 | 963,365 | 2022/10/31 |
| | 43政保地方公共団 | 0.7340 | 200,000 | 200,275 | 2022/12/16 |
| | 23 政保日本政策 | 0.7340 | 301,000 | 301,414 | 2022/12/16 |
| | 180 政保道路機構 | 0.7340 | 4,235,000 | 4,242,102 | 2022/12/28 |
| | 18 政保中部空港 | 0.6680 | 146,000 | 146,492 | 2023/03/22 |
| | 47政保地方公共団 | 0.5410 | 182,000 | 182,599 | 2023/04/21 |
| | 189 政保道路機構 | 0.5410 | 421,300 | 422,730 | 2023/04/28 |
| | 49政保地方公共団 | 0.8820 | 182,000 | 183,186 | 2023/06/16 |
| | 2 政保新関西空港 | 0.8820 | 72,100 | 72,591 | 2023/06/27 |
| | 4政保地方公共8年 | 0.3110 | 300,000 | 300,905 | 2023/07/28 |
| 200 政保道路機構 | 0.8010 | 562,100 | 566,804 | 2023/09/29 | |
| | 小 計 | - | 7,564,500 | 7,582,469 | - |
| | 合 計 | - | 261,633,330 | 261,925,136 | - |

■ 投資信託財産の構成

(2022年10月12日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 81,811,736 | 29.3 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 197,511,032 | 70.7 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 279,322,769 | 100.0 |

マネープール・マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年10月12日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------------|-------------------------|
| (A) 資 産 | 279,322,769,320円 |
| コール・ローン等 | 17,308,155,308 |
| 公社債(評価額) | 81,811,736,723 |
| 現先取引(公社債) | 180,113,400,000 |
| 未収利息 | 61,155,798 |
| 前払費用 | 28,321,491 |
| (B) 負 債 | 151,000 |
| その他未払費用 | 151,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 279,322,618,320 |
| 元 本 | 279,340,187,815 |
| 次期繰越損益金 | △ 17,569,495 |
| (D) 受益権総口数 | 279,340,187,815口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,999円 |

※当期における期首元本額339,935,919,283円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額60,595,731,468円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 当期末における、元本の内訳は以下の通りです。

| | | | |
|-------------------------------|--------------|------------------------------------|------------------|
| SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(ブラジルリアル) | 144,000,000円 | グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ノーヘッジ型) | 1,026,625円 |
| SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(南アランド) | 3,474,833円 | 三井住友・公益債券投信(資産成長型) | 941,890円 |
| SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(中国元) | 12,046,048円 | 日興グラビティ・ヨーロッパン・ファンド | 9,958,176円 |
| SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(豪ドル) | 50,000,000円 | 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 897,182円 |
| SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(円) | 11,000,000円 | 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 329,342円 |
| 三井住友・公益債券投信(毎月決算型) | 8,874,310円 | SMAM・アセットバランスファンドVA25L3<適格機関投資家限定> | 279,093,333,597円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジ型) | 4,305,812円 | | |

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2021年10月13日 至2022年10月12日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------------|---------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 302,013,016円 |
| 受 取 利 息 | 439,024,049 |
| 支 払 利 息 | △137,011,033 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △498,311,354 |
| 売 買 益 | 2,336,937 |
| 売 買 損 | △500,648,291 |
| (C) そ の 他 費 用 等 | △ 2,085,245 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △198,383,583 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 191,482,886 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △ 10,668,798 |
| (G) 合 計 (D + E + F) | △ 17,569,495 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | △ 17,569,495 |

※有価証券売買損益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。