

日興グラビティ・ ヨーロピアン・ファンド

【愛称:ユーロビート】
【繰上償還 運用報告書(全体版)】

(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

第 9 期

償還日 2023年1月19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／海外／株式
信託期間	2014年3月7日から2023年1月19日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、欧州および欧州周辺国の上場株式に投資することにより、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。 グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド 欧州および欧州周辺国（東欧、ロシア、トルコおよびアフリカ等）の上場株式 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、欧州の上場株式に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 ■投資対象とする外国投資信託の運用は、欧州株式への投資に精通したエドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（フランス）が行います。 ■外貨建資産に対しては、原則として円での為替ヘッジを行いません。
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	■年1回（原則として毎年2月26日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みません。）等の範囲内とします。 ■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。 ※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、欧州および欧州周辺国の上場株式に投資することにより、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。ここに当期の運用状況等をご報告いたします。

皆さまのご愛顧ありがとうございました。

 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）

日興グラビティ・ヨーロッパン・ファンド【愛称：ユーロビート】

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			(参考指数) MSCIオールカントリー・ ヨーロッパインデックス		公社債 組入比率	投資信託 証券組入 率	純資産額
	(分配)	税込 分配金	期中 騰落率	(円ベース)	期中 騰落率			
5期(2019年2月26日)	円 9,313	円 0	% △ 8.4	円 113.86	% △ 2.9	% 0.5	% 97.0	百万円 1,938
6期(2020年2月26日)	9,663	0	3.8	121.05	6.3	0.5	96.8	1,448
7期(2021年2月26日)	9,419	0	△ 2.5	135.27	11.8	0.8	96.8	1,171
8期(2022年2月28日)	9,745	0	3.5	153.32	13.3	1.1	93.8	815
(償還日) 9期(2023年1月19日)	(償還価額) 10,276.43	0	5.5	168.88	10.1	—	—	657

※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。

※参考指数は、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

※参考指数は市場の動きを示す目的で記載しており、当ファンドが当該参考指数を意識して運用しているわけではありません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(参考指数) MSCIオールカントリー・ ヨーロッパインデックス		公社債 組入比率	投資信託 証券組入 率
	騰落率	(円ベース)	騰落率			
(期首) 2022年2月28日	円 9,745	% —	円 153.32	% —	% 1.1	% 93.8
3月末	10,491	7.7	161.06	5.0	0.8	94.9
4月末	10,349	6.2	155.11	1.2	0.7	96.1
5月末	10,687	9.7	160.51	4.7	1.1	97.6
6月末	10,356	6.3	155.66	1.5	0.5	97.3
7月末	10,067	3.3	155.23	1.3	0.4	97.7
8月末	10,026	2.9	153.65	0.2	1.1	96.7
9月末	9,269	△ 4.9	143.12	△ 6.6	1.3	96.3
10月末	10,209	4.8	159.43	4.0	1.2	97.0
11月末	10,592	8.7	165.93	8.2	0.4	96.7
12月末	10,240	5.1	162.12	5.7	1.3	49.1
(償還日) 2023年1月19日	(償還価額) 10,276.43	5.5	168.88	10.1	—	—

※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。

設定以来の運用状況 (設定日 (2014年3月7日) から償還日 (2023年1月19日) まで)

設定以来の基準価額の推移



前期までの概略 (設定日 (2014年3月7日) から第8期末 (2022年2月28日) まで)

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として、欧州の上場株式に投資しました。実質外貨建資産については、対円ででの為替ヘッジを行いません。

上昇要因

- ・ 2016年11月から2018年1月にかけて、米国大統領選挙の結果を受けた政策期待や、同国を中心とした世界的な好景気を背景に、欧州株式市場が上昇したこと
- ・ 2020年5月以降、新型コロナウイルスの感染拡大ペース鈍化やワクチン接種の進展、各国における経済活動制限措置の緩和を背景に、世界景気の回復期待が高まったこと

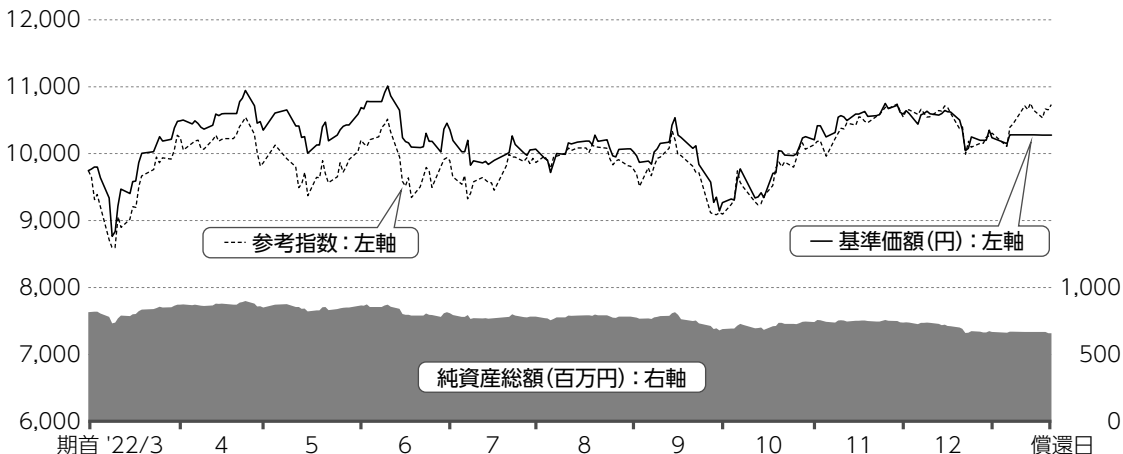
下落要因

- ・ 2015年8月から2016年1月にかけて、中国景気の減速から世界経済への減速懸念が強まり、欧州株式市場が下落したこと
- ・ 2020年2月中旬から2020年3月中旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を受けた世界的な景気減速懸念から欧州株式市場が下落したこと

1 運用経過

基準価額等の推移について(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

基準価額等の推移



期首	9,745円
償還日	10,276円43銭
騰落率	+5.5%

※当ファンドの参考指数は、MSCIオールカンントリー・ヨーロッパインデックス(円ベース)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として、欧州の上場株式に投資しました。実質外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いません。

上昇要因

- 10月以降、エネルギー供給懸念の緩和やインフレピークアウト観測の高まり、中国のゼロコロナ政策撤回による経済回復期待などから、株式市場が上昇したこと
- 期を通じてみるとユーロが円に対して上昇したこと

下落要因

- 9月下旬にかけて、域内景気の減速懸念や、ECB(欧州中央銀行)及び周辺国による利上げの実施、英国の政策的な不透明感などを背景に、株式市場が下落したこと

投資環境について(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

期間における欧州株式市場は上昇しました。為替市場では、ユーロに対して円安となりました。

欧州株式市場

期初は、ウクライナ情勢やエネルギー価格の高止まり、ECBによる利上げ前倒し観測などを背景に、株式市場は下落基調で推移しました。その後も域内景気の減速懸念や、ECB及び周辺国による利上げの実施、英国の政策的な不透明感などを背景に、株式市場の軟調地合いが続きました。しかし10月以降は、暖冬予報などを受けたエネルギー供給懸念の緩和や、インフレピークアウト観測の高まり、中国のゼロコロナ政策撤回による経済回復期待などから、株式市場は期末にかけて上昇しました。

一方で、欧州周辺国市場は下落しました。国内投資家によるインフレヘッジ目的の株式買いが続いたことなどからトルコは上昇しましたが、原油価格の下落や経済制裁の強化などからロシアは下落しました。

為替市場

期末のユーロ・円は、期初と比較してユーロ高・円安となりました。

期初から、ECBによる早期利上げ観測などを背景に、円安が進みました。その後もECBが利上げを継続するとの見方から、日欧の金融政策の方向性の違いが意識され、円安が進みました。しかし11月以降は、ECBの利上げペース鈍化観測や日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことを背景に、円高が進みました。

ポートフォリオについて(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

当ファンド

期初より、「グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド」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、「グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド」を高位に組み入れました。ただし、繰上償還決定後、同ファンドを売却しました。

グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド

主として欧州の取引所に上場している株式で、バランスシートが強固なハイクオリティ株式やディフェンシブ(景気変動の影響を受けにくい)株式に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指しました。加えて、欧州周辺国(東欧、ロシア、トルコ、アフリカ等)の株式で、欧州の景気拡大により

高い成長が期待される銘柄を組み入れ、リターンの獲得を目指しました。

●個別銘柄

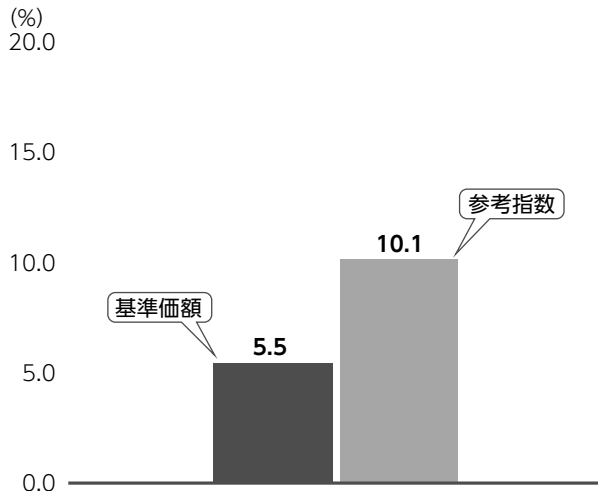
金利上昇による業績改善期待などから金融サービス大手のミュンヘン再保険が上昇した一方、中国のゼロコロナ政策を受けた需要減退懸念などからスポーツ用品大手のアディダスが下落しました。欧州周辺国の銘柄では、トルコの飲料大手コカコーラ・アイスセックが上昇した一方、ポーランドの銀行大手PKOバンク・ポルスキが下落しました。

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、安定した収益の確保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(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

基準価額と参考指数の騰落率対比



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてMSCIオールカントリー・ヨーロッパインデックス(円ベース)を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

※基準価額は分配金再投資ベース

分配金について(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

償還のため、該当事項はございません。

2 今後の運用方針

償還のため、該当事項はございません。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

日興グラビティ・ヨーロッパ・ファンド【愛称：ユーロビート】

1万口当たりの費用明細(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	110円	1.077%	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10,192円です。
(投 信 会 社)	(27)	(0.264)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
(販 売 会 社)	(80)	(0.784)	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)	(3)	(0.029)	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
(株 式)	(-)	(-)	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
(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
(株 式)	(-)	(-)	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
(公 社 債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	0	0.004	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)	(0.004)	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	110	1.081	

※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。

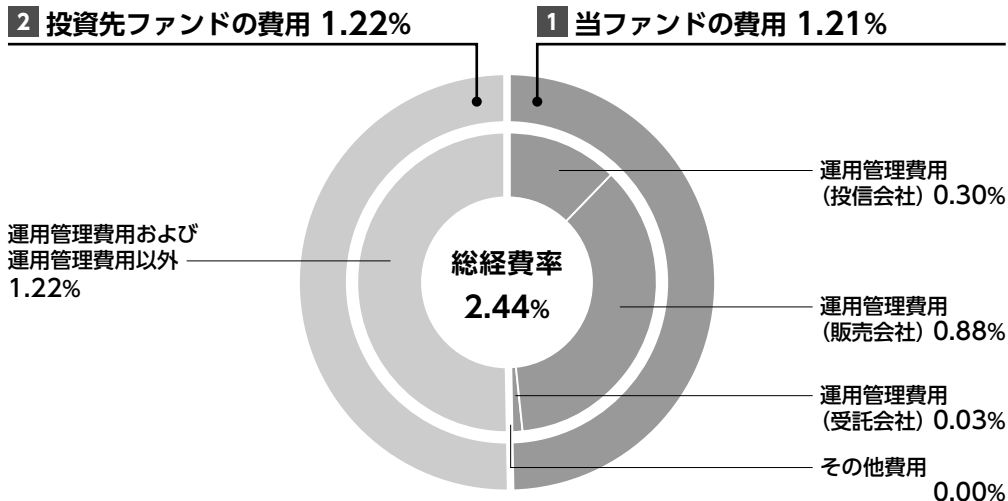
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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)	2.44%
1 当ファンドの費用の比率	1.21%
2 投資先ファンドの費用の比率	1.22%

※ **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、実際に投資しているシェアクラスのデータが入手できない場合は、入手可能なファンド全体のデータをもとに委託会社が計算したものです。運用管理費用と運用管理費用以外の費用を明確に区別できない場合は、まとめて表示しています。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2.44%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

(1) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド	口 -	千円 -	口 70,902	千円 819,782

※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。

(2) 親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マネープール・マザーファンド	千口 -	千円 -	千口 9,958	千円 9,955

■ 利害関係人との取引状況等(2022年3月1日から2023年1月19日まで)

利害関係人との取引状況

日興グラビティ・ヨーロピアン・ファンド

当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	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 153,338	百万円 12,310	% 8.0	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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、S M B 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
(2022年3月1日から2023年1月19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 1月19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	期首(前期末)	期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド	70,902.47	—	—	—
合 計	70,902.47	—	—	—

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネープール・マザーファンド	9,958	—	—

■ 投資信託財産の構成

(2023年 1月19日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	671,801	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	671,801	100.0

■ 資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2023年1月19日現在)

項 目	償 還 時
(A) 資 産	671,801,279円
コール・ローン等	671,801,279
(B) 負 債	14,140,859
未払解約金	10,735,548
未払信託報酬	3,404,315
未払利息	263
その他未払費用	733
(C) 純資産総額(A-B)	657,660,420
元 本	639,969,871
償還差損益金	17,690,549
(D) 受益権総口数	639,969,871口
1万口当たり償還価額(C/D)	10,276円43銭

※当期における期首元本額836,628,255円、期中追加設定元本額1,915,146円、期中一部解約元本額198,573,530円です。

※上記表中の償還差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1万口当たり償還価額が、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。

■ 損益の状況

(自2022年3月1日 至2023年1月19日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 12,584円
受 取 利 息	1,680
支 払 利 息	△ 14,264
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	42,381,310
売 買 損 益	54,644,625
売 買 損 益	△12,263,315
(C) 信 託 報 酬 等	△ 8,441,182
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	33,927,544
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△15,319,646
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 917,349
(配 当 等 相 当 額)	(5,628,153)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 6,545,502)
(G) 合 計 (D+E+F)	17,690,549
償 還 差 損 益 金 (G)	17,690,549

※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。

■ 投資信託財産運用総括表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2014年3月7日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年1月19日		資 産 総 額	671,801,279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	14,140,859円
受益権口数	28,686,629,739口	639,969,871口	△28,046,659,868口	純資産総額	657,660,420円
元 本 額	28,686,629,739円	639,969,871円	△28,046,659,868円	受益権口数	639,969,871口
				1万口当たり償還金	10,276円43銭
毎計算期末の状況					
計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第1期	43,900,806,992	46,593,967,488	10,613	0	0.00
第2期	8,704,063,587	7,366,306,857	8,463	0	0.00
第3期	4,739,240,403	4,250,413,420	8,969	0	0.00
第4期	2,855,832,111	2,903,574,763	10,167	60	0.60
第5期	2,081,716,502	1,938,708,188	9,313	0	0.00
第6期	1,499,104,156	1,448,614,408	9,663	0	0.00
第7期	1,244,328,289	1,171,991,705	9,419	0	0.00
第8期	836,628,255	815,325,709	9,745	0	0.00

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。

■ 組入れ投資信託証券の内容

投資信託証券の概要

ファンド名	グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド
形態	ケイマン籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	欧州および欧州周辺国（東欧、ロシア、トルコおよびアフリカ等）の上場株式
運用の基本方針	主として、欧州で活躍する企業を中心に投資を行います。また、欧州周辺国の経済成長の恩恵を受ける企業にも投資を行います。
主な投資制限	・純資産総額の10%を超える借入れは行いません。 ・非流動性資産への投資は、純資産総額の15%以下とします。
決算日	年1回決算（原則として、毎年2月28日）
分配方針	毎年2月15日（休業日の場合は前営業日）に分配を行う方針です。ただし、分配を行わないことがあります。
運用管理費用	純資産総額に対して 運用報酬 年0.569%程度 受託会社報酬 年0.01%程度 管理費用 年0.03%程度 保管費用 年0.04%程度 事務代行費用 年0.0625%程度 ※上記の各料率には、年間最低報酬額等が定められている場合があるため、純資産総額によっては、上記の各料率を上回ることがあります。
その他の費用	ファンドの取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。 これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資顧問会社	エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（フランス）
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

以下には、「グラビティ・ヨーロピアン・エクイティ・ファンド」の情報を委託会社において抜粋、要約して翻訳したものを記載しています。

■ 損益及び純資産変動計算書(2020年3月1日から2021年2月28日まで)

(表示通貨: 日本円)

収益	
受取配当金	30,132,158
収益合計	30,132,158
費用	
投資運用報酬	6,309,782
受託会社報酬	1,570,557
印刷および広告費	1,565,352
管理事務代行報酬	1,535,131
専門家費用	1,492,169
取引費用	1,486,233
保護預り手数料	1,073,485
弁護士費用	549,358
保管報酬	443,076
管理報酬	332,526
登録手数料	9,546
銀行利息	7,714
金融取引税	744
その他費用	1,052,059
費用合計	17,427,732
投資純利益	12,704,426
実現純損失:	
外国為替	(1,396,461)
投資有価証券	(80,622,634)
投資純利益および実現純損失(当期)	(69,314,669)
未実現利益の純変動:	
投資有価証券	122,570,831
運用の結果による純資産の純増加	53,256,162
資本の変動	
受益証券買取	(223,000,000)
資本の純変動	(223,000,000)
期首純資産額	1,277,445,227
期末純資産額	1,107,701,389

日興グラビティ・ヨーロッパン・ファンド【愛称：ユーロビート】

■ 投資明細表(2021年2月28日現在)

数量	銘柄	通貨	取得原価 (円)	時価 (円)	比率* (%)
公認の証券取引所あるいは他の規制市場で取引される譲渡可能な有価証券					
株式					
4,003	ACCOR SA	ユーロ	20,392,429	17,606,120	1.59
661	ADIDAS AG	ユーロ	17,424,584	24,708,480	2.23
1,462	AIR LIQUIDE SA	ユーロ	20,399,134	23,752,770	2.14
778	AIRBUS GROUP SE	ユーロ	9,117,134	9,704,698	0.88
769	ALLEGRO.EU SA	ポーランドズロチ	1,641,745	1,409,015	0.14
978	ALLIANZ SE -REG-	ユーロ	18,427,580	25,095,062	2.27
3,115	AMUNDI SA	ユーロ	18,151,053	25,525,247	2.30
876	ANGLO AMERICAN PLC(ZAR)	南アフリカランド	2,609,902	3,825,563	0.35
7,072	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	南アフリカランド	5,949,851	7,240,019	0.65
3,033	ASTRAZENECA PLC	英ポンド	22,543,934	31,425,993	2.84
5,674	AXA SA	ユーロ	14,623,930	15,283,546	1.38
43,558	BAE SYSTEMS PLC	英ポンド	37,301,563	31,716,814	2.86
35,238	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	ユーロ	18,724,320	20,873,659	1.88
4,420	BNP PARIBAS	ユーロ	26,311,383	28,168,602	2.54
6,545	BOUYGUES SA	ユーロ	23,436,857	28,533,245	2.58
11,260	CARREFOUR SA	ユーロ	34,681,074	21,154,087	1.91
3,300	COCA-COLA ICECEK AS	トルコリラ	2,787,873	3,303,377	0.30
659	COFINIMMO	ユーロ	9,898,805	10,961,537	0.99
19,607	CREDIT AGRICOLE SA	ユーロ	30,381,082	29,288,933	2.64
4,702	CRH PLC	ユーロ	16,761,945	22,087,072	1.99
2,646	DAIMLER AG -REG-	ユーロ	24,336,674	22,231,423	2.01
17,038	DEUTSCHE TELEKOM AG -REG-	ユーロ	32,135,147	32,778,101	2.96
349	DINO POLSKA SA	ポーランドズロチ	1,185,429	2,444,052	0.22
583	EIFFAGE	ユーロ	6,371,121	6,467,930	0.58
24,072	ENEL SPA	ユーロ	17,029,163	24,210,465	2.19
1,192	ERSTE GROUP BANK AG	ユーロ	4,756,782	4,229,811	0.38
4,199	ESSITY AKTIEBOLAG-B SHS	スウェーデンクローナ	10,420,400	13,786,315	1.24
31,710	FIRSTRAND LTD	南アフリカランド	15,192,780	11,348,562	1.02
13,578	GLAXOSMITHKLINE PLC	英ポンド	34,577,586	24,158,449	2.18
7,915	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	ユーロ	18,081,613	22,636,476	2.04
40,811	KONINKLIJKE KPN NV	ユーロ	13,558,140	14,334,438	1.29
2,039	LEGRAND SA	ユーロ	17,690,991	18,929,802	1.71
3,860	MAVI GIYIM SANAYI VE TICA - B	トルコリラ	3,598,944	2,746,205	0.25
12,504	MOBILE TELESYSTEMS PJSC(RUB)	ロシアルーブル	5,498,043	5,595,897	0.51
1,903	MR PRICE GROUP LTD - NEW -	南アフリカランド	2,615,380	2,340,988	0.22
910	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ユーロ	19,882,050	28,536,540	2.58
1,276	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカランド	21,418,060	31,516,009	2.85
1,266	NESTLE SA REG	スイスフラン	14,281,237	14,224,920	1.28
30,285	NOKIA OYJ	ユーロ	22,964,248	13,074,027	1.18

日興グラビティ・ヨーロッパ・ファンド【愛称：ユーロビート】

数量	銘柄	通貨	取得原価 (円)	時価 (円)	比率* (%)
3,546	NOVARTIS AG - REG SHS	スイスフラン	32,114,924	32,552,880	2.94
21,730	ORANGE	ユーロ	36,570,795	27,212,269	2.46
2,098	OTP BANK PLC	ハンガリーフォリント	9,343,636	9,966,283	0.90
9,294	PKO BANK POLSKI SA	ポーランドズロチ	7,906,319	7,985,655	0.72
644	PROSUS NV	ユーロ	4,973,661	8,112,912	0.73
397	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイスフラン	14,174,701	13,743,263	1.24
9,081	ROYAL DUTCH SHELL PLC -A-	ユーロ	29,469,223	20,104,826	1.82
3,056	SAMPO OYJ A	ユーロ	16,263,331	14,768,938	1.33
11,772	SANLAM LTD	南アフリカランド	7,350,525	5,103,846	0.46
2,985	SANOFI	ユーロ	28,503,822	28,905,509	2.61
881	SANTANDER BANK POLSKA SA	ポーランドズロチ	6,145,543	5,338,641	0.48
2,471	SAP SE	ユーロ	24,242,323	32,180,328	2.91
1,974	SASOL LTD	南アフリカランド	7,459,040	2,769,903	0.25
522	SIEMENS AG -REG-	ユーロ	8,791,884	8,693,504	0.78
8,956	SMITH AND NEPHEW PLC	英ポンド	15,743,475	18,503,591	1.67
22,803	SNAM SPA	ユーロ	11,356,667	12,760,805	1.15
16,950	SOK MARKETLER TICARET AS	トルコリラ	3,808,300	2,815,596	0.25
13,785	STANDARD BANK GROUP LTD	南アフリカランド	18,176,488	13,076,276	1.18
11,470	STORA ENSO OYJ-R	ユーロ	15,761,980	24,173,787	2.18
22,672	TERNA SPA	ユーロ	12,819,351	16,815,316	1.52
6,332	TOTAL SA	ユーロ	37,570,210	31,764,548	2.87
47,410	TURKIYE GARANTI BANKASI A. S.	トルコリラ	8,016,065	6,073,315	0.55
962	VINCI SA	ユーロ	6,912,428	10,771,873	0.97
1,357	YANDEX NV A	米ドル	5,048,258	9,385,673	0.85
株式合計			1,005,682,915	1,040,833,786	93.97
預託証券					
883	JUMIA TECHNOLOGIES AG - ADR	米ドル	1,043,359	4,239,563	0.38
1,391	LUKOIL PJSC -SPONS ADR-	米ドル	10,871,433	11,331,827	1.02
1,970	MAGNIT PJSC -SPONS GDR- REGS	米ドル	3,227,210	2,807,890	0.25
3,381	MMC NORILSK NICKEL PJSC -ADR-	米ドル	6,215,811	11,249,172	1.02
296	NOVATEK PJSC -SPONS GDR REG S	米ドル	6,006,571	5,431,560	0.49
10,095	SBERBANK PAO -SPONS ADR-	米ドル	13,327,865	15,668,957	1.41
1,525	X5 RETAIL GROUP NV -GDR- REGS	米ドル	4,572,688	5,383,069	0.49
預託証券合計			45,264,937	56,112,038	5.06
公認の証券取引所あるいは他の規制市場で取引される譲渡可能な有価証券合計			1,050,947,852	1,096,945,824	99.03
投資有価証券合計			1,050,947,852	1,096,945,824	99.03

(*)百分率で表示された純資産総額に対する時価の比率

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

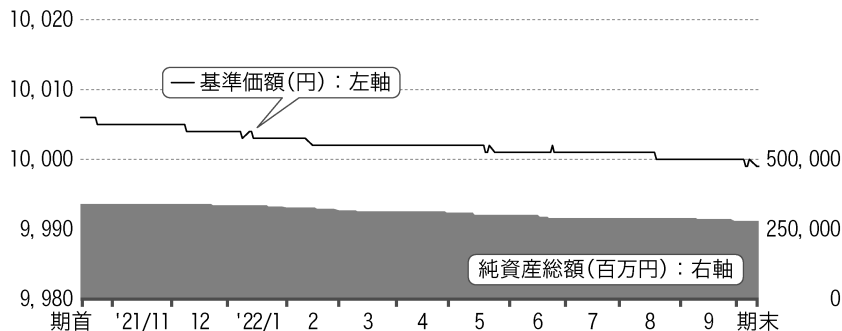
年月日	基準価額		公社債組入比率
		騰落率	
(期首) 2021年10月12日	円 10,006	% -	% 92.9
10月末	10,005	△0.0	91.7
11月末	10,005	△0.0	91.8
12月末	10,004	△0.0	30.8
2022年1月末	10,003	△0.0	92.1
2月末	10,002	△0.0	93.2
3月末	10,002	△0.0	68.9
4月末	10,002	△0.0	61.8
5月末	10,001	△0.0	91.5
6月末	10,001	△0.0	44.3
7月末	10,001	△0.0	31.1
8月末	10,000	△0.1	89.3
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
		%	千円	千円	
国 債 証 券	1101国庫短期証券	—	3,830,000	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。

■ 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。

■ 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DS・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DS・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。