

日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・ グローバルCBファンド (為替ヘッジあり)

【運用報告書(全体版)】

(2021年10月27日から2022年10月26日まで)

第 **7** 期
決算日 2022年10月26日

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、主として、世界の企業が発行する転換社債等に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。当期についても、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。

■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 | 2015年10月30日から2025年10月27日まで |
| 運用方針 | 投資信託証券への投資を通じて、主として、世界の企業が発行する転換社債等に投資し、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。 グローバルCBファンド(円ヘッジクラス) 世界の企業が発行する転換社債等 マネー・マーケット・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、世界の企業が発行する転換社債(以下、「CB」ということがあります。)等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証券の実質的な運用は、CBの運用に強みを持つエドモン・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。 ■実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。 |
| 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10月26日。休業日の場合は翌営業日)決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価益を含みます。)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。 |

 **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)

日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド（為替ヘッジあり）

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) リフィニティブ・グローバル・ フォーカス・ヘッジド C B インデックス | | 公 社 債 組入比率 | 投資信託証券 組入比率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|------------|--------------|--------------|---|--------------|---------------|----------------|--------------|
| | (分配落) | 税 込 分 配 金 | 期 中 騰 落 率 | (円ベース) | 期 中 騰 落 率 | | | |
| 3 期 (2018年10月26日) | 円 9,482 | 円 0 | % △ 7.4 | 100.85 | % △ 4.3 | % 0.0 | % 97.8 | 百万円 1,991 |
| 4 期 (2019年10月28日) | 9,435 | 0 | △ 0.5 | 105.92 | 5.0 | 0.0 | 98.4 | 1,682 |
| 5 期 (2020年10月26日) | 10,321 | 310 | 12.7 | 124.48 | 17.5 | 0.0 | 98.0 | 1,581 |
| 6 期 (2021年10月26日) | 10,813 | 230 | 7.0 | 137.06 | 10.1 | 0.0 | 97.6 | 1,567 |
| 7 期 (2022年10月26日) | 8,709 | 0 | △19.5 | 106.90 | △22.0 | 0.0 | 97.7 | 1,251 |

※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) リフィニティブ・グローバル・ フォーカス・ヘッジド C B インデックス | | 公 社 債 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|----------------------|---------|------------|---|------------|------------------|------------------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | (円ベース) | 騰 落 率 % | | |
| (期 首) 2021年10月26日 | 10,813 | — | 137.06 | — | 0.0 | 97.6 |
| 10月末 | 10,761 | △ 0.5 | 136.91 | △ 0.1 | 0.0 | 96.2 |
| 11月末 | 10,639 | △ 1.6 | 133.95 | △ 2.3 | 0.0 | 97.8 |
| 12月末 | 10,556 | △ 2.4 | 131.84 | △ 3.8 | 0.0 | 97.3 |
| 2022年 1 月末 | 9,885 | △ 8.6 | 125.17 | △ 8.7 | 0.0 | 97.7 |
| 2 月末 | 9,854 | △ 8.9 | 124.03 | △ 9.5 | 0.0 | 97.7 |
| 3 月末 | 9,993 | △ 7.6 | 123.93 | △ 9.6 | 0.0 | 97.9 |
| 4 月末 | 9,522 | △11.9 | 118.58 | △13.5 | 0.0 | 97.2 |
| 5 月末 | 9,138 | △15.5 | 114.22 | △16.7 | 0.0 | 97.2 |
| 6 月末 | 8,823 | △18.4 | 108.91 | △20.5 | 0.0 | 97.2 |
| 7 月末 | 9,047 | △16.3 | 111.94 | △18.3 | 0.0 | 97.3 |
| 8 月末 | 9,130 | △15.6 | 111.78 | △18.4 | 0.0 | 97.4 |
| 9 月末 | 8,695 | △19.6 | 105.76 | △22.8 | 0.0 | 97.6 |
| (期 末) 2022年10月26日 | 8,709 | △19.5 | 106.90 | △22.0 | 0.0 | 97.7 |

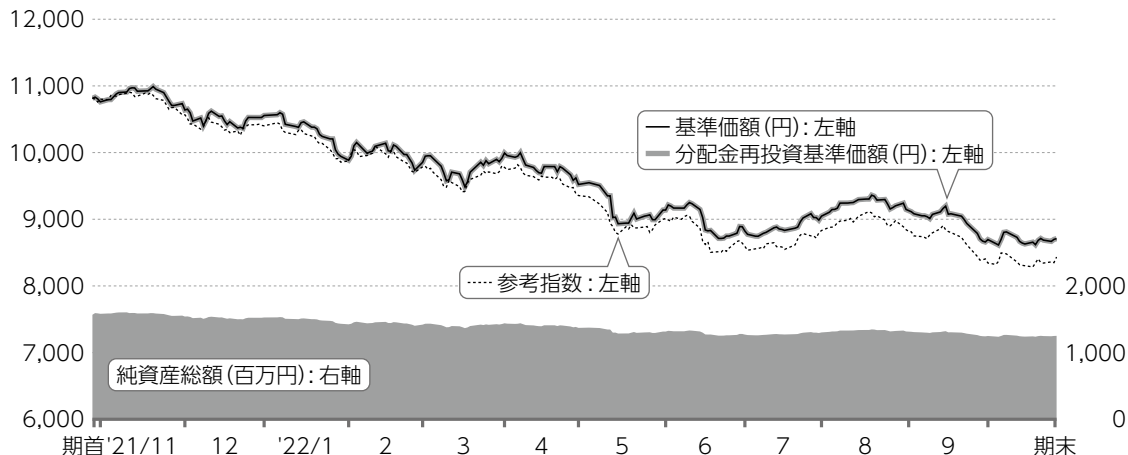
※騰落率は期首比です。

※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（2021年10月27日から2022年10月26日まで）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額および参考指数は、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。

| | |
|-----|--------------------------|
| 期首 | 10,813円 |
| 期末 | 8,709円 (既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | -19.5% (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)

※当ファンドの参考指数は、リフィニティブ・グローバル・フォーカス・ヘッジドCB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(2021年10月27日から2022年10月26日まで)

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として世界の企業が発行するC B（転換社債）に投資しました。実質組入外貨建資産については、主として主要国通貨を対象とした運用を実施し、対円での為替ヘッジを行いました。

下落要因

- インフレと債券利回りの上昇などから、主要株式市場やクレジット市場が軟調に推移し、C B市場も下落したこと

投資環境について（2021年10月27日から2022年10月26日まで）

C B市場は、期を通じてみれば下落しました。

米国のインフレ上昇懸念から米国債の金利が上昇（債券価格は下落）し、主要株式市場やクレジット市場が軟調に推移しました。ロシアによるウクライナ侵攻で、投資家のリスク回避姿勢が強まったこともC B市場の下落につながりました。

期の後半には、F R B（米連邦準備制度理

事会）の大幅利上げの影響もあり、景気後退懸念が浮上しました。C Bの新規発行市場を見ると、軟調な市場環境を受けて発行体の資金調達意欲は盛り上がりせず、発行量は減少しました。市場全体では様々な業種と地域で、発行体の分散化が維持されています。

ポートフォリオについて（2021年10月27日から2022年10月26日まで）

当ファンド

「グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）」および「マネー・マーケット・マザーファンド」に投資し、期を通じて「グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）」を高位に組み入れました。

グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス）

企業収益に悪影響を及ぼすインフレのマイナス影響を緩和できるように、ポジションを構築しました。経済環境の悪化に対して相対的に強いヘルスケア、公益、情報技術といった業種から、大手企業が発行する

銘柄を優先して組入れました。また、経済再開から恩恵を受けられる空運、小売り、クルーズ船といった銘柄群の組入れがプラスに寄与しました。一方で、地政学リスクを懸念してロシア銘柄はウクライナ侵攻前に非保有としました。

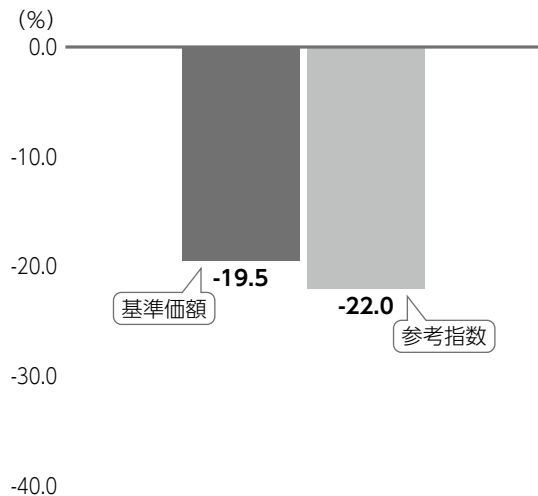
外貨建ての現物資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

マネー・マーケット・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（2021年10月27日から2022年10月26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、参考指数としてリフィニティブ・グローバル・フォーカス・ヘッジドC B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（2021年10月27日から2022年10月26日まで）

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第7期 |
|-----------|---------|
| 当期分配金 | 0 |
| (対基準価額比率) | (0.00%) |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 775 |

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、左記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

引き続き、「グローバルC Bファンド(円ヘッジクラス)」を高位に組み入れて運用を行います。

グローバルC Bファンド(円ヘッジクラス)

●C B市場

経済成長とインフレ環境をめぐる不透明感を勘案して、短期的には慎重なポジションを継続する方針です。ディフェンシブ(景気変動の影響を受けにくい)な業種の堅固な企業ファンダメンタルズ(業績、財務内容などの基礎的諸条件)を持つ発行体を選好していきます。現状は高めの現金比率を維持し

ており、発行市場で良い投資機会が浮上すれば、積極的に購入していく考えです。ただし今の市場環境を考えれば、新規ポジションの構築には厳選して実行していきま

●為替ヘッジ

外貨建ての現物資産については、対円での為替ヘッジを行います。

マネー・マーケット・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、流動性の確保を目指した運用を行います。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルC B ファンド（為替ヘッジあり）

1万口当たりの費用明細（2021年10月27日から2022年10月26日まで）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|--|
| (a) 信託報酬 | 106円 | 1.100% | 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9,614円です。 |
| （投信会社） | (29) | (0.297) | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (74) | (0.770) | 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) | (0.033) | 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 | 1 | 0.006 | 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） | (1) | (0.006) | 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) | (0.001) | その他:信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 106 | 1.106 | |

※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。

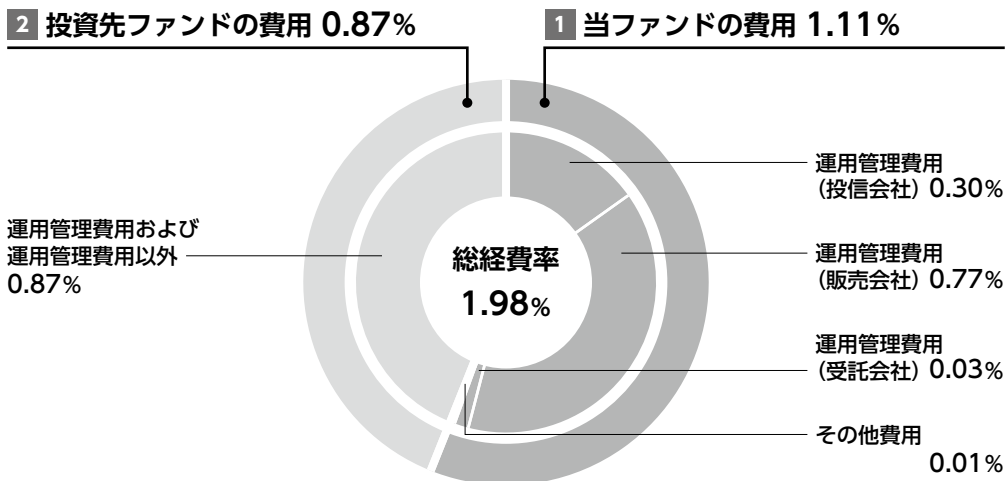
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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) | 1.98% |
| 1 当ファンドの費用の比率 | 1.11% |
| 2 投資先ファンドの費用の比率 | 0.87% |

※**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1.98%です。

日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド（為替ヘッジあり）

■ 当期中の売買及び取引の状況（2021年10月27日から2022年10月26日まで）

投資信託証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|-----------------------|--------|---------|------------|--------------|
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 |
| 国内 | グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス） | 口 - | 千円 - | 口 1,730 | 千円 20,000 |

※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（2021年10月27日から2022年10月26日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■ 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27日から2022年10月26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（2022年10月26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 |
| グローバルC Bファンド（円ヘッジクラス） | 口 122,395.07 | 口 120,664.545 | 千円 1,222,331 | % 97.7 |
| 合 計 | 122,395.07 | 120,664.545 | 1,222,331 | 97.7 |

※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 | 評 価 額 |
| マネー・マーケット・マザーファンド | 千口 289 | 千口 289 | 千円 289 | 千円 289 |

※マネー・マーケット・マザーファンドの期末の受益権総口数は76,632,575口です。

■ 投資信託財産の構成

（2022年10月26日現在）

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 千円 1,222,331 | % 97.1 |
| マネー・マーケット・マザーファンド | 289 | 0.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 35,782 | 2.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,258,403 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2022年10月26日現在）

| 項 目 | 期 末 |
|------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,258,403,702円 |
| コール・ローン等 | 35,782,742 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 1,222,331,840 |
| マネー・マーケット・マザーファンド(評価額) | 289,120 |
| (B) 負 債 | 7,193,204 |
| 未払信託報酬 | 7,156,981 |
| その他未払費用 | 36,223 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,251,210,498 |
| 元 本 | 1,436,672,130 |
| 次期繰越損益金 | △ 185,461,632 |
| (D) 受益権総口数 | 1,436,672,130口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8,709円 |

※当期における期首元本額1,449,592,725円、期中追加設定元本額20,694,079円、期中一部解約元本額33,614,674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27日 至2022年10月26日）

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △ 16,491円 |
| 受 取 利 息 | 720 |
| 支 払 利 息 | △ 17,211 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △287,009,313 |
| 売 買 損 益 | 1,001,628 |
| 売 買 損 益 | △288,010,941 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 15,370,090 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △302,395,894 |
| (E) 前期繰越損益金 | 108,645,051 |
| (F) 追加信託差損益金 | 8,289,211 |
| (配当等相当額) | (2,741,079) |
| (売買損益相当額) | (5,548,132) |
| (G) 合 計(D+E+F) | △185,461,632 |
| 次期繰越損益金(G) | △185,461,632 |
| 追加信託差損益金 | 8,289,211 |
| (配当等相当額) | (2,741,079) |
| (売買損益相当額) | (5,548,132) |
| 分配準備積立金 | 108,680,602 |
| 繰越損益金 | △302,431,445 |

※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。

※株式投資の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投資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。

| | 当 期 |
|----------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 2,741,079 |
| (d) 分配準備積立金 | 108,680,602 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 111,421,681 |
| 1万口当たり当期分配対象額 | 775.55 |
| (f) 分配金 | 0 |
| 1万口当たり分配金 | 0 |

■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金（税引前） | 当 期 |
|----------------|-----|
| | 0円 |

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 | グローバルC B ファンド（円ヘッジクラス） | | | | | | | | | | |
| 形態 | ケイマン籍契約型投資信託（円建て） | | | | | | | | | | |
| 主要投資対象 | 世界の企業が発行する転換社債 | | | | | | | | | | |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として、世界の企業が発行する転換社債等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。 ・原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。 | | | | | | | | | | |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・転換社債等への投資割合は、純資産総額の75%以上とします。 ・新興国への投資割合は、純資産総額の20%以内とします。 ・同一発行体に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーは、原則として、それぞれ純資産総額の10%以内、合計で純資産総額の20%以内とします。 ・現物有価証券の空売りは行いません。 | | | | | | | | | | |
| 分配方針 | 毎年10月15日（休業日の場合は翌営業日）に分配を行う方針。ただし、分配を行わないことがあります。 | | | | | | | | | | |
| 運用管理費用 | <p>純資産総額に対して</p> <table> <tr> <td>運用報酬</td> <td>年0.5%程度</td> </tr> <tr> <td>受託会社報酬</td> <td>年0.01%程度（最低年15,000米ドル）</td> </tr> <tr> <td>管理費用</td> <td>年0.03%程度</td> </tr> <tr> <td>保管費用</td> <td>年0.04%程度</td> </tr> <tr> <td>事務代行費用</td> <td>年0.0625%程度</td> </tr> </table> <p>※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。</p> | 運用報酬 | 年0.5%程度 | 受託会社報酬 | 年0.01%程度（最低年15,000米ドル） | 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 |
| 運用報酬 | 年0.5%程度 | | | | | | | | | | |
| 受託会社報酬 | 年0.01%程度（最低年15,000米ドル） | | | | | | | | | | |
| 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 | | | | | | | | | | |
| その他の費用 | <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | | | | | | |
| 申込手数料 | ありません。 | | | | | | | | | | |
| 信託財産留保額 | 一部解約時に0.3% | | | | | | | | | | |
| 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、「グローバルC B ファンド（円ヘッジクラス）」をシェアクラスとして含む「グローバルC B 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（2021年3月1日から2022年2月28日まで）

（表示通貨：日本円）

| | |
|-------------------|----------------------|
| 収益 | |
| 利息（債券） | 9,915,181 |
| その他収益 | 1,053,776 |
| 収益合計 | <u>10,968,957</u> |
| 費用 | |
| 投資運用報酬 | 13,827,860 |
| 印刷および広告費 | 2,140,070 |
| 専門家費用 | 1,840,402 |
| 管理事務代行報酬 | 1,725,372 |
| 受託会社報酬 | 1,707,992 |
| 保管報酬 | 1,105,097 |
| 管理報酬 | 829,391 |
| 取引費用 | 655,094 |
| 弁護士費用 | 516,026 |
| 保護預り手数料 | 279,103 |
| 銀行利息 | 40,209 |
| 登録手数料 | 9,976 |
| その他費用 | 360,258 |
| 費用合計 | <u>25,036,850</u> |
| 投資純損失 | <u>(14,067,893)</u> |
| 実現純損益： | |
| 投資有価証券 | 220,976,341 |
| オプション取引 | 12,821,464 |
| 外国為替取引 | 11,362,512 |
| 為替先渡契約 | (129,902,936) |
| 投資純損失および実現純利益（当期） | <u>101,189,488</u> |
| 未実現損益の純変動： | |
| 為替先渡契約 | 27,424,214 |
| オプション取引 | (3,632,880) |
| 投資有価証券 | (283,960,923) |
| 運用の結果による純資産の純減少 | <u>(158,980,101)</u> |
| 資本の変動 | |
| 受益証券追加信託 | — |
| 受益証券買取 | (319,959,824) |
| 資本の純変動 | <u>(319,959,824)</u> |
| 期首純資産額 | <u>2,959,664,408</u> |
| 期末純資産額 | <u>2,480,724,483</u> |

■ 投資明細表 (2022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 債券 | | | | | |
| 200,000 | ADIDAS AG 0.05 CV 12SEP23 SER ADS | ユーロ | 33,214,630 | 26,602,054 | 1.07 |
| 458,000 | AIRBNB INC 0 CV 15MAR26 | 米ドル | 50,011,121 | 50,097,061 | 2.02 |
| 143,000 | AKAMAI TECHNOLOGI 0.125 CV 01MAY25 | 米ドル | 15,847,315 | 19,986,784 | 0.81 |
| 137,000 | AKAMAI TECHNOLOGI 0.375 CV 01SEP27 | 米ドル | 14,977,285 | 17,157,570 | 0.69 |
| 200,000 | AMERICA MOVIL BV 0.00 CV 02MAR24 | ユーロ | 28,191,097 | 27,365,309 | 1.10 |
| 210,000 | AMERICAN AIR GROUP CV 6.5 01JUL25 | 米ドル | 36,683,986 | 32,988,120 | 1.33 |
| 120,000 | AMYRIS INC CV 1.50 15NOV26 | 米ドル | 13,577,402 | 10,190,332 | 0.41 |
| 70,000 | AVALARA INC CV 0.25 01AUG26 | 米ドル | 8,333,533 | 6,977,395 | 0.28 |
| 160,000 | BARCLAYS BANK PLC 0 18FEB25 F0TR | 米ドル | 18,321,455 | 20,672,628 | 0.83 |
| 210,000 | BENTLEY SYST INC 0.125 CV 15JAN26 | 米ドル | 27,206,023 | 22,727,096 | 0.92 |
| 2,000,000 | BEST PATH GLOBAL 0 CV 01JUN22 | 香港ドル | 28,573,685 | 28,937,540 | 1.17 |
| 113,000 | BOOKING HOLDING INC 0.75 CV 01MAY25 | 米ドル | 17,320,866 | 18,679,756 | 0.75 |
| 250,000 | BRENTAG FIN BV CV 1.875 02DEC22 | 米ドル | 33,149,406 | 31,766,494 | 1.28 |
| 200,000 | CELLNEX TELECOM 0.5 CV 05JUL28 CLNX | ユーロ | 30,390,261 | 30,656,815 | 1.24 |
| 260,000 | COINBASE GLOBAL INC CV 0.5 1JUN26 | 米ドル | 35,835,217 | 27,230,593 | 1.10 |
| 180,000 | COUPA SOFTWARE INC 0.125 CV 15JUN25 | 米ドル | 23,587,725 | 21,845,728 | 0.88 |
| 200,000 | CP FOODS CAPITAL 0.5 CV 18JUN25 | 米ドル | 23,109,328 | 23,635,344 | 0.95 |
| 10,000,000 | CYBERAGENT INC 0 CV 19FEB25 | 日本円 | 11,955,000 | 11,695,500 | 0.47 |
| 100,000 | DEUTSCHE POST AG 0.05 CV 30JUN25 | ユーロ | 16,297,962 | 13,984,313 | 0.56 |
| 423,000 | DEXCOM INC 0.25 CV 15NOV25 | 米ドル | 44,128,888 | 51,051,980 | 2.06 |
| 230,000 | DISH NETWORK CORP 0.00 CV 15DEC25 | 米ドル | 28,904,812 | 26,419,928 | 1.07 |
| 30,000 | EDF SA 0 CV 14SEP24 SER EDF | ユーロ | 44,940,396 | 46,070,488 | 1.86 |
| 120,000 | ENPHASE ENERGY INC 0.00 CV 01MAR26 | 米ドル | 12,737,403 | 13,007,852 | 0.52 |
| 153,000 | ETSY INC 0.125 CV 01SEP27 | 米ドル | 18,070,645 | 19,100,019 | 0.77 |
| 297,000 | EXACT SCIENCES COR 0.375 CV 15MAR27 | 米ドル | 37,792,134 | 34,454,934 | 1.39 |
| 189,000 | EXPEDIA GROUP INC 0.00 CV 15FEB26 | 米ドル | 21,716,254 | 26,788,938 | 1.08 |
| 140,000 | FIVE9 INC 0.5 CV 01JUN25 | 米ドル | 19,621,149 | 17,338,649 | 0.70 |
| 556,000 | FORD MOTOR CO 0 CV 15MAR26 | 米ドル | 62,110,071 | 79,078,824 | 3.19 |
| 100,000 | GN STORE NORD 0 CV 21MAY24 | ユーロ | 14,482,550 | 13,395,465 | 0.54 |
| 290,000 | GUARDANT HEALTH INC 0.00 CV 15NOV27 | 米ドル | 33,153,793 | 27,915,685 | 1.13 |
| 200,000 | HON HAI PRECISION 0.00 CV 06NOV22 | 米ドル | 22,961,651 | 25,018,194 | 1.01 |
| 200,000 | IBERDROLA INTL B.V 0 CV 11NOV22 IBE | ユーロ | 28,309,634 | 31,693,695 | 1.28 |
| 175,000 | INSULET CORP 0.375 CV 01SEP26 | 米ドル | 24,363,516 | 26,717,346 | 1.08 |

日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド (為替ヘッジあり)

| 数量 | 銘柄 | 通貨 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 比率* (%) |
|------------|-------------------------------------|-----|-------------|------------|------------|
| 200,000 | INTEGRA LIFESCIENCES 0.5 CV 15AUG25 | 米ドル | 22,163,879 | 25,142,773 | 1.01 |
| 200,000 | IQIYI INC 2.00 CV 01APR25 | 米ドル | 21,436,021 | 18,060,953 | 0.73 |
| 355,000 | JETBLUE AIRWAYS CORP 0.5 CV 01APR26 | 米ドル | 41,137,453 | 39,473,562 | 1.59 |
| 100,000 | JP MORGAN CHASE 0.00 CV 18FEB24 | ユーロ | 14,096,294 | 13,813,136 | 0.56 |
| 182,000 | JP MORGAN CHASE FIN 0.25 CV 01MAY23 | 米ドル | 19,884,415 | 23,564,332 | 0.95 |
| 100,000 | LEG IMMOBILIEN CV 0.875 01SEP25 LEG | ユーロ | 13,940,614 | 14,942,129 | 0.60 |
| 95,000 | LENDINGTREE INC 0.5 CV 15JUL25 | 米ドル | 9,712,523 | 9,069,260 | 0.37 |
| 260,000 | LI AUTO INC 0.25 CV 01MAY28 144A | 米ドル | 36,437,249 | 37,095,287 | 1.50 |
| 94,000 | LIVE NATION ENT CV 2.5 15MAR23 | 米ドル | 11,186,686 | 20,513,128 | 0.83 |
| 100,000 | LIVONGO HEALTH 0.875 CV 01JUN25 | 米ドル | 13,383,941 | 11,843,905 | 0.48 |
| 125,000 | LUMENTUM HDG INC 0.5 CV 15DEC26 | 米ドル | 14,945,974 | 17,399,604 | 0.70 |
| 125,000 | LYFT INC 1.5 CV 15MAY25 | 米ドル | 22,007,380 | 18,061,935 | 0.73 |
| 112,000 | MARRIOTT VACATION WORL 0 CV 15JAN26 | 米ドル | 14,456,416 | 14,435,246 | 0.58 |
| 200,000 | MEITUAN 0 CV 27APR27 | 米ドル | 23,088,685 | 19,676,089 | 0.79 |
| 30,000,000 | MERCARI INC 0 CV 14JUL26 | 日本円 | 31,875,000 | 28,543,800 | 1.15 |
| 40,000,000 | MITSUBISHI CHEMICAL 0 CV 29MAR24 | 日本円 | 41,262,223 | 40,608,800 | 1.64 |
| 30,000,000 | MITSUBISHI CHEMICAL 0 CV 30MAR22 | 日本円 | 30,853,334 | 29,962,500 | 1.21 |
| 45,000 | MONGODB INC 0.25 CV 15JAN26 | 米ドル | 14,083,922 | 9,782,047 | 0.39 |
| 100,000 | MP MATERIALS CORP CV 0.25 01APR26 | 米ドル | 10,936,576 | 14,661,032 | 0.59 |
| 103,000 | NEW RELIC INC 0.50 CV 01MAY23 | 米ドル | 13,000,133 | 11,981,156 | 0.48 |
| 200,000 | NEXI SPA 0.00 CV 24FEB28 | ユーロ | 24,463,903 | 21,810,651 | 0.88 |
| 100,000 | NICE LTD 0.00 CV 15SEP25 | 米ドル | 10,699,142 | 12,274,384 | 0.49 |
| 200,000 | NUVASIVE INC 0.375 CV 15MAR25 | 米ドル | 21,744,897 | 21,853,332 | 0.88 |
| 280,000 | OKTA INC CV 0.375 15JUN26 | 米ドル | 34,995,428 | 34,043,078 | 1.37 |
| 75,000 | ON SEMICONDUCTOR 1.625 CV 15OCT23 | 米ドル | 12,952,264 | 26,591,582 | 1.07 |
| 118,000 | PALO ALTO NETWORKS 0.75 CV 01JUL23 | 米ドル | 13,151,607 | 29,242,190 | 1.18 |
| 125,000 | PALO ALTO NETWORKS 0.375 CV 01JUN25 | 米ドル | 13,634,384 | 28,089,362 | 1.13 |
| 28,000 | PINDUODUO INC 0.00 CV 01OCT24 | 米ドル | 3,279,430 | 4,560,045 | 0.17 |
| 200,000 | QIAGEN NV 0.50 CV 13SEP23 | 米ドル | 21,865,812 | 29,444,794 | 1.19 |
| 100,000 | RAG-STIFTUNG 0 CV 02OCT24 EVK | ユーロ | 13,357,771 | 12,963,582 | 0.52 |
| 22,000 | REDFIN CORP CV 0.5 01APR27 | 米ドル | 2,392,611 | 1,731,925 | 0.06 |
| 210,000 | RINGCENTRAL INC 0.00 CV 01MAR25 | 米ドル | 23,208,886 | 21,121,483 | 0.85 |
| 30,000,000 | ROHM COMPANY LTD 0 CV 05DEC24 | 日本円 | 32,462,000 | 31,325,400 | 1.26 |
| 190,000 | ROYAL CARIB CRUI 4.25 CV 15JUN23 | 米ドル | 25,400,985 | 28,827,354 | 1.16 |
| 724 | SAFRAN SA 0 CV 01APR28 SER SAF | ユーロ | 18,072,536 | 16,401,685 | 0.66 |
| 1,043 | SAFRAN SA 0.875 CV 15MAY27 SER SAF | ユーロ | 19,217,051 | 18,348,671 | 0.74 |
| 30,000,000 | SBI HOLDINGS 0 CV 25JUL25 | 日本円 | 33,100,000 | 34,796,100 | 1.40 |

日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルC Bファンド (為替ヘッジあり)

| 数量 | 銘柄 | 通貨 | 取得原価 (円) | 時価 (円) | 比率* (%) |
|-----------------------------------|------------------------------------|--------|---------------|---------------|------------|
| 20,000,000 | SENKO GP HOLDINGS CO 0 CV 18MAR25 | 日本円 | 20,912,000 | 20,271,200 | 0.82 |
| 196,000 | SHOPIFY INC CV 0.125 01NOV25 | 米ドル | 22,082,083 | 21,817,863 | 0.88 |
| 120,000 | SIKA AG 0.15 CV 05JUN25 | スイスフラン | 14,175,135 | 24,221,720 | 0.98 |
| 200,000 | SINO BIOPHARMACEUT 0.00 CV 17FEB25 | ユーロ | 25,695,136 | 24,883,309 | 1.00 |
| 200,000 | SNAM SPA 0.00 CV 20MAR22 | ユーロ | 25,698,018 | 26,555,545 | 1.07 |
| 187,000 | SNAP INC 0 CV 01MAY27 | 米ドル | 21,128,844 | 18,758,905 | 0.76 |
| 240,000 | SOFI TECHN INC 0.00 CV 15OCT26 | 米ドル | 30,575,614 | 24,369,043 | 0.98 |
| 286,000 | SOUTHWEST AIRLINES 1.25 CV 01MAY25 | 米ドル | 43,550,327 | 45,040,375 | 1.82 |
| 385,000 | SPLUNK INC 0.50 CV 15SEP23 | 米ドル | 48,899,195 | 47,144,706 | 1.90 |
| 231,000 | SQUARE INC 0.00 CV 1MAY26 | 米ドル | 27,467,353 | 24,299,849 | 0.98 |
| 36,000 | SQUARE INC 0.5 CV 15MAY23 | 米ドル | 4,839,330 | 6,804,691 | 0.26 |
| 200,000 | STMICROELECTRONICS 0 CV 04AUG25 A | 米ドル | 22,350,226 | 27,519,944 | 1.11 |
| 200,000 | STMICROELECTRONICS 0 CV 04AUG27 B | 米ドル | 22,075,601 | 27,492,671 | 1.11 |
| 130,000 | TWITTER INC 0.25 CV 15JUN24 | 米ドル | 15,584,576 | 15,261,715 | 0.62 |
| 70,000 | TYLER TECHNOLOGIES CV 0.25 15MAR26 | 米ドル | 8,198,964 | 8,702,653 | 0.35 |
| 125,000 | UBER TECH INC 0.00 CV 15DEC25 | 米ドル | 13,861,445 | 13,035,726 | 0.53 |
| 2,000 | UBISOFT ENTERTNMNT 0.00 CV 24SEP24 | ユーロ | 28,953,077 | 28,949,180 | 1.17 |
| 100,000 | UMICORE SA 0 CV 23JUN25 | ユーロ | 14,107,280 | 12,597,586 | 0.51 |
| 180,000 | UNITY SOFTWARE 0.00 CV 15NOV26 | 米ドル | 20,442,074 | 17,290,366 | 0.70 |
| 190,000 | UPWORK INC CV 0.25 15AUG26 | 米ドル | 23,416,750 | 18,119,417 | 0.73 |
| 2,347 | VEOLIA ENVIRONNEMT SA 0 CV 01JAN25 | ユーロ | 9,360,720 | 10,927,356 | 0.44 |
| 120,000 | VROOM INC CV 0.75 01JUL26 | 米ドル | 13,368,700 | 7,588,457 | 0.31 |
| 130,000 | WAYFAIR INC 0.625 CV 01OCT25 | 米ドル | 13,908,047 | 12,802,378 | 0.52 |
| 4,319 | WORLDLINE SA FRANCE 0 CV 30JUL25 | ユーロ | 68,209,199 | 63,573,111 | 2.56 |
| 200,000 | XIAOMI BEST TIME INTL 0 CV 17DEC27 | 米ドル | 22,964,336 | 20,515,090 | 0.83 |
| 200,000 | ZALANDO SE 0.05 CV 06AUG25 A | ユーロ | 25,120,859 | 25,577,576 | 1.03 |
| 40,000 | ZSCALER INC 0.125 CV 1JUL25 | 米ドル | 7,054,502 | 7,447,375 | 0.30 |
| 220,000 | ZYNGA INC 0.25 CV 01JUN24 | 米ドル | 24,176,775 | 31,138,145 | 1.26 |
| 債券合計 | | | 2,261,939,784 | 2,306,010,673 | 92.96 |
| 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 | | | 2,261,939,784 | 2,306,010,673 | 92.96 |
| 投資有価証券合計 | | | 2,261,939,784 | 2,306,010,673 | 92.96 |

(*) 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・マーケット・マザーファンド

第11期 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

| | |
|------|--|
| 信託期間 | 無期限 (設定日: 2011年5月31日) |
| 運用方針 | 主として、円貨建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 |
|-----------------|--------|-------|---------|-------|
| | 円 | 期中騰落率 | | |
| 7期 (2018年3月1日) | 10,025 | △0.1 | 76.9 | 90 |
| 8期 (2019年3月1日) | 10,019 | △0.1 | 74.1 | 89 |
| 9期 (2020年3月2日) | 10,013 | △0.1 | 80.6 | 77 |
| 10期 (2021年3月1日) | 10,002 | △0.1 | 75.9 | 76 |
| 11期 (2022年3月1日) | 9,994 | △0.1 | 76.0 | 76 |

※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

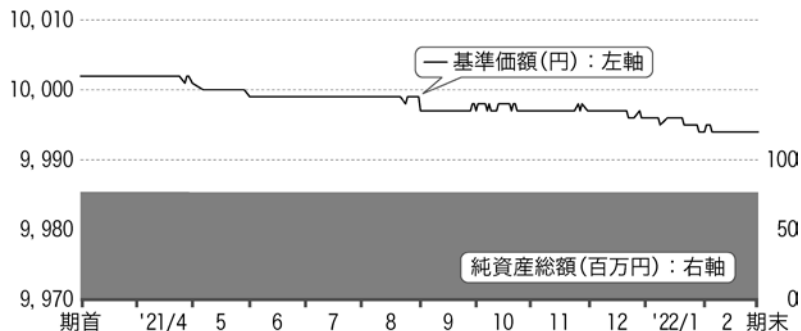
| 年月日 | 基準価額 | | 公社債組入比率 |
|-------------------|--------|------|---------|
| | 円 | 騰落率 | |
| (期首) 2021年3月1日 | 10,002 | — | 75.9 |
| 3月末 | 10,002 | 0.0 | 75.8 |
| 4月末 | 10,001 | △0.0 | 75.9 |
| 5月末 | 9,999 | △0.0 | 76.1 |
| 6月末 | 9,999 | △0.0 | 76.0 |
| 7月末 | 9,999 | △0.0 | 75.9 |
| 8月末 | 9,997 | △0.0 | 76.0 |
| 9月末 | 9,997 | △0.0 | 76.0 |
| 10月末 | 9,997 | △0.0 | 76.1 |
| 11月末 | 9,997 | △0.0 | 76.0 |
| 12月末 | 9,996 | △0.1 | 76.1 |
| 2022年1月末 | 9,994 | △0.1 | 76.0 |
| 2月末 | 9,994 | △0.1 | 76.0 |
| (期末) 2022年3月1日 | 9,994 | △0.1 | 76.0 |

※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3月2日から2022年3月1日まで)

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 10,002円 |
| 期末 | 9,994円 |
| 騰落率 | -0.1% |

▶ 基準価額の変動要因 (2021年3月2日から2022年3月1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3月2日から2022年3月1日まで)

短期金利は小幅上昇しました。

物価の上昇率が低水準にとどまったことや、新型コロナウイルスの感染拡大が繰り返されたことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を据え置き、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、発行額の増減などにより上下に振れる局面もありましたが、日銀が需給動向を勘案し、短期国債の買入れ額を調整したことから、期を通じて概ねレンジ推移となりました。

▶ ポートフォリオについて (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、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3月2日から2022年3月1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

2%の物価安定目標の達成が展望出来ない中、日銀によるマイナス金利政策が継続され、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。

■ 1万口当たりの費用明細(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用 (その他) | 1円 (1) | 0.005% (0.005) | 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 | 1 | 0.005 | |

期中の平均基準価額は9,998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3月2日から2022年3月1日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|--------------|---------------------|
| 国内 | 特殊債券 | 千円 58,518 | 千円 － (58,000) |

※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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年3月2日から2022年3月1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 58 | 百万円 15 | % 25.9 | 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、SMBC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3月2日から2022年3月1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 (2022年3月1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 | % | % | % | % | % |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 58,000 (58,000) | 58,193 (58,193) | 76.0 (76.0) | — (—) | — (—) | — (—) | 76.0 (76.0) |
| 合 計 | 58,000 (58,000) | 58,193 (58,193) | 76.0 (76.0) | — (—) | — (—) | — (—) | 76.0 (76.0) |

※()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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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 | |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 159 政保道路機構 | 0.9000 | 14,000 | 14,005 | 2022/03/18 |
| | 163 政保道路機構 | 0.9010 | 15,000 | 15,033 | 2022/05/31 |
| | 40政保地方公共団 | 0.8190 | 15,000 | 15,068 | 2022/09/16 |
| | 180 政保道路機構 | 0.7340 | 14,000 | 14,085 | 2022/12/28 |
| | 小 計 | — | 58,000 | 58,193 | — |
| | 合 計 | — | 58,000 | 58,193 | — |

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 投資信託財産の構成

(2022年3月1日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|--------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 58,193 | 76.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 18,392 | 24.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 76,586 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年3月1日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------|-------------|
| (A) 資 産 | 76,586,115円 |
| コール・ローン等 | 18,301,901 |
| 公社債(評価額) | 58,193,302 |
| 未 収 利 息 | 90,912 |
| (B) 負 債 | 263 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 263 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 76,585,852 |
| 元 本 | 76,632,575 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 46,723 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 76,632,575口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,994円 |

※当期における期首元本額76,752,334円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額119,759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。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

| | |
|---|-------------|
| 高成長インド・中型株式ファンド | 17,711,132円 |
| アジア好利回りリート・ファンド | 99,971円 |
| 三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/年1回決算型) | 7,742,960円 |
| 三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/年1回決算型) | 1,337,053円 |
| 三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジあり/3カ月決算型) | 4,909,194円 |
| 三井住友・ビムコ・ストラテジック・インカムファンド(為替ヘッジなし/3カ月決算型) | 1,456,790円 |
| 日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし) | 14,208,735円 |
| 日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ) | 1,237,272円 |
| 三井住友・ニュー・アジア・ファンド | 369,177円 |
| アジア好利回りリート・ファンド(年1回決算型) | 997円 |
| 日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(為替ヘッジなし/年2回決算型) | 1,187,376円 |
| 日興ブラックロック・ハイ・クオリティ・アロケーション・ファンド(限定為替ヘッジ/年2回決算型) | 389,132円 |
| 日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド(為替ヘッジあり) | 289,352円 |
| 日興エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・グローバルCBファンド(為替ヘッジなし) | 419,066円 |
| グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジあり) | 4,140,881円 |
| グローバル自動運転関連株式ファンド(為替ヘッジなし) | 11,065,647円 |
| グローイング・フロンティア株式ファンド | 2,185,185円 |
| 高成長インド・中型株式ファンド(年1回決算型) | 7,882,655円 |

※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。

■ 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3月2日 至2022年3月1日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|----------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 542,668円 |
| 受 取 利 息 | 555,652 |
| 支 払 利 息 | △ 12,984 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △603,028 |
| 売 買 損 益 | △603,028 |
| (C) そ の 他 費 用 等 | △ 3,836 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | △ 64,196 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 17,437 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | 36 |
| (G) 合 計 (D+E+F) | △ 46,723 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | △ 46,723 |

※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。