

三井住友・ ヨーロッパ国債ファンド

【運用報告書(全体版)】

第43作成期 (2024年2月21日から2024年8月20日まで)

第 252 期 / 第 253 期 / 第 254 期
決算日2024年3月21日 決算日2024年4月22日 決算日2024年5月20日

第 255 期 / 第 256 期 / 第 257 期
決算日2024年6月20日 決算日2024年7月22日 決算日2024年8月20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／債券
信託期間	無期限 (設定日：2003年2月27日)
運用方針	EU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	EU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債
当ファンドの運用方法	<ul style="list-style-type: none">■ EU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定的な利息収入の確保を目指します。■ FTSE 欧州世界国債インデックス (円換算ベース) をベンチマークとして運用します。■ 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ません。
組入制限	<ul style="list-style-type: none">■ 株式への投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の5%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	<ul style="list-style-type: none">■ 毎月20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。■ 分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益 (評価益を含みません) 等の全額とします。■ 分配金額は、委託会社が基準価額水準・市況動向を勘案して決定します。 <p>※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。</p>

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EU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保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・ヨーロッパ国債ファンド

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 準 価 額			(ベンチマーク) FTSE 欧州世界 国債インデックス		公 社 債 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 中 率	(円換算ベース)	期 騰 落 中 率		
228期 (2022年 3月22日)	円 5,838	円 15	% △1.0	202.11	% △0.7	% 96.2	百万円 4,886
229期 (2022年 4月20日)	5,930	15	1.8	206.34	2.1	96.5	4,939
230期 (2022年 5月20日)	5,695	15	△3.7	197.96	△4.1	98.0	4,702
231期 (2022年 6月20日)	5,626	15	△0.9	195.79	△1.1	98.0	4,631
232期 (2022年 7月20日)	5,771	15	2.8	200.75	2.5	97.8	4,743
233期 (2022年 8月22日)	5,606	15	△2.6	195.18	△2.8	97.4	4,580
234期 (2022年 9月20日)	5,606	15	0.3	194.97	△0.1	97.2	4,567
235期 (2022年10月20日)	5,456	15	△2.4	190.23	△2.4	97.2	4,435
236期 (2022年11月21日)	5,529	15	1.6	195.61	2.8	98.0	4,464
237期 (2022年12月20日)	5,361	15	△2.8	189.23	△3.3	97.3	4,318
238期 (2023年 1月20日)	5,291	15	△1.0	188.29	△0.5	96.4	4,249
239期 (2023年 2月20日)	5,277	15	0.0	188.03	△0.1	96.8	4,224
240期 (2023年 3月20日)	5,297	15	0.7	190.20	1.2	97.2	4,225
241期 (2023年 4月20日)	5,377	15	1.8	193.14	1.5	96.7	4,246
242期 (2023年 5月22日)	5,430	15	1.3	195.34	1.1	97.3	4,266
243期 (2023年 6月20日)	5,626	10	3.8	203.62	4.2	97.8	4,398
244期 (2023年 7月20日)	5,721	10	1.9	207.53	1.9	97.6	4,437
245期 (2023年 8月21日)	5,686	10	△0.4	206.26	△0.6	97.0	4,211
246期 (2023年 9月20日)	5,630	10	△0.8	205.17	△0.5	97.5	4,148
247期 (2023年10月20日)	5,568	10	△0.9	202.68	△1.2	96.3	4,082
248期 (2023年11月20日)	5,893	10	6.0	216.11	6.6	97.0	4,296
249期 (2023年12月20日)	5,943	10	1.0	219.09	1.4	96.4	4,282
250期 (2024年 1月22日)	5,944	10	0.2	219.86	0.4	97.0	4,252
251期 (2024年 2月20日)	5,923	10	△0.2	219.84	△0.0	96.9	4,215
252期 (2024年 3月21日)	6,025	10	1.9	225.38	2.5	96.3	4,210
253期 (2024年 4月22日)	5,974	10	△0.7	223.79	△0.7	97.0	4,344
254期 (2024年 5月20日)	6,142	10	3.0	231.45	3.4	97.6	4,440
255期 (2024年 6月20日)	6,137	10	0.1	232.78	0.6	97.6	4,413
256期 (2024年 7月22日)	6,211	10	1.4	236.34	1.5	97.3	4,433
257期 (2024年 8月20日)	5,958	10	△3.9	226.62	△4.1	96.9	4,225

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※ベンチマークは、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。

※FTSE欧州世界国債インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。同社は、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、同社は、当該データの正確性および完全性を保証せず、データの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。また、同社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

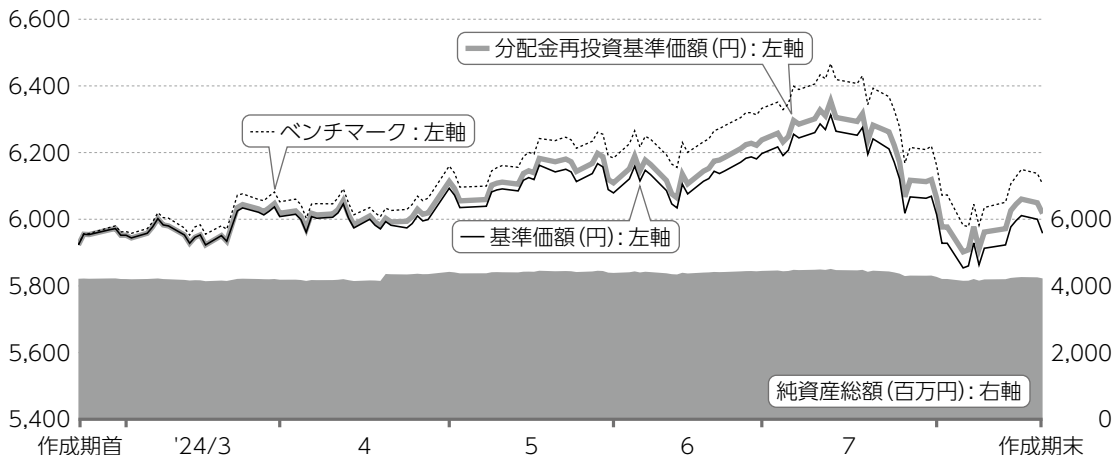
決算期	年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E 欧 州 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス		公 社 組 入 比 率
		円	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率	
第252期	(期 首) 2024年2月20日	5,923	—	219.84	—	96.9
	2月末	5,952	0.5	221.33	0.7	96.7
	(期 末) 2024年3月21日	6,035	1.9	225.38	2.5	96.3
第253期	(期 首) 2024年3月21日	6,025	—	225.38	—	96.3
	3月末	6,008	△0.3	224.64	△0.3	96.6
	(期 末) 2024年4月22日	5,984	△0.7	223.79	△0.7	97.0
第254期	(期 首) 2024年4月22日	5,974	—	223.79	—	97.0
	4月末	6,093	2.0	228.63	2.2	97.2
	(期 末) 2024年5月20日	6,152	3.0	231.45	3.4	97.6
第255期	(期 首) 2024年5月20日	6,142	—	231.45	—	97.6
	5月末	6,079	△1.0	229.51	△0.8	97.1
	(期 末) 2024年6月20日	6,147	0.1	232.78	0.6	97.6
第256期	(期 首) 2024年6月20日	6,137	—	232.78	—	97.6
	6月末	6,197	1.0	235.04	1.0	97.7
	(期 末) 2024年7月22日	6,221	1.4	236.34	1.5	97.3
第257期	(期 首) 2024年7月22日	6,211	—	236.34	—	97.3
	7月末	6,014	△3.2	228.68	△3.2	97.8
	(期 末) 2024年8月20日	5,968	△3.9	226.62	△4.1	96.9

※期末基準価額は分配金込み、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(2024年2月21日から2024年8月20日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、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	5,923円
作成期末 (当作成期既払分配金60円(税引前))	5,958円
騰落率	+1.6% (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)

※当ファンドのベンチマークは、FTSE 欧州世界国債インデックス(円換算ベース)です。

※FTSE 欧州世界国債インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。同社は、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、同社は、当該データの正確性および完全性を保証せず、データの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。また、同社は当ファンドの取引および運用

成果等に関して一切責任を負いません。

基準価額の主な変動要因(2024年2月21日から2024年8月20日まで)

当ファンドは、EU(欧州連合)加盟国の高格付けの国債を主要投資対象として運用しました。なお、外貨建資産については、為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ドイツやベルギーなどの長期金利(10年国債利回り)が低下(債券価格は上昇)したこと

下落要因

- フランスの長期金利が上昇したこと

投資環境について(2024年2月21日から2024年8月20日まで)

ドイツやベルギーなどの長期金利は低下し、フランスの長期金利は上昇しました。為替市場では、ユーロなどの投資通貨は円に対して一進一退となりました。

債券市場

期間の初めは、欧州の景況感の改善やECB(欧州中央銀行)高官のタカ派(インフレ抑制を重視する立場)的な発言を背景に、金利は上昇しました。その後はECBが政策金利の引き下げを決定しましたが、フランス発の政治不安が意識される中、ドイツなどの金利は低下した一方、フランスなど一部の国ではリスク回避の動きから金利は上昇しました。期末にかけては、フランス発の政治不安が後退したことや、欧州の景況

感の悪化が意識されたこと、米国で利下げ観測が高まったことなどを背景に、金利は低下する動きとなりました。

為替市場

為替市場では、日銀の緩和スタンス継続による円安の進行からユーロ高・円安となりましたが、期末にかけては、米国での利下げ観測による米ドル/円の下落の影響や、日銀による利上げの実施などから、ユーロ安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2024年2月21日から2024年8月20日まで)

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)

期間を通じて、デュレーションはベンチマークに対して概ね中立からやや短めを基本とし、金融市場の動向に応じて機動的に調整を行いました。

国別配分

ユーロ圏内では、引き続きフランス、ベルギー、ドイツを中心に組入れを行いました。経済・市場動向や格付け水準等を勘案し、引き続きイタリア、スペインを非保有としました。また、ポーランドについては、ウクライナ情勢の影響と地理的な近接性を勘案し、非保有を維持しました。EU非加

三井住友・ヨーロッパ国債ファンド

盟国である英国、ノルウェーについては投資を行いませんでした。

は投資を行わないことから、大部分をユーロで保有し、他にデンマーククローネ、スウェーデンクローナを保有しました。また、ウクライナ情勢悪化の影響と地理的な近接性を勘案し、ポーランドズロチの非保有を継続しました。

通貨別配分

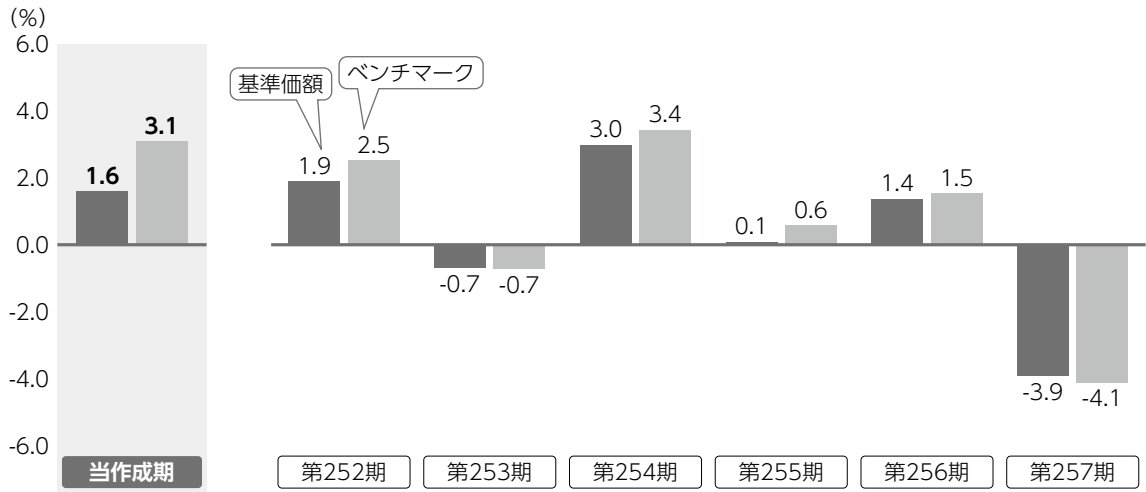
E U非加盟国である英国やノルウェーに

ベンチマークとの差異について(2024年2月21日から2024年8月20日まで)

当ファンドは、F T S E 欧州世界国債インデックス(円換算ベース)をベンチマークとしています。

記載のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

基準価額とベンチマークの騰落率対比



※当作成期の基準価額は分配金再投資ベース、各期は分配金(税引前)込み。

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は+1.6% (分配金再投資ベース) となり、ベンチマークの騰落率+3.1%を1.5%下回りました。

マイナス要因

- ベンチマークに含まれる英国国債 (EU非加盟国のため当ファンドでは非保有) がユーロ圏の国債をアウトパフォーマンスしたこと

分配金について (2024年2月21日から2024年8月20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252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期
当期分配金	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	(0.17%)	(0.17%)	(0.16%)	(0.16%)	(0.16%)	(0.17%)
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	141	142	147	148	155	155

※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

欧州では、当面金利は一進一退の展開を予想します。先行きは、ECBが利下げを継続すると想定されることから、金利は緩やかに低下していくと予想します。

デュレーションや残存構成は景気情勢や金融政策、需給環境等を踏まえて機動的に対応します。ユーロ圏内の国別配分では、格付け水準等を勘案し、イタリアを非保有とする一方で、フランス、ベルギー、ドイツの組入れを厚めとします。スペインについては、今後の経済状況や格付け動向等を注視しつつ、今後の組入れも検討します。

ポーランドの組入れについては、ウクライナ情勢の緊張緩和を待って実施する方針です。

為替市場では、当面ユーロは値動きの荒い展開が予想されるものの、その後は、ECBによる利下げ継続や日銀による追加利上げが想定されることから、緩やかなユーロ安・円高の展開を予想します。

通貨配分は、大部分をユーロとしたポジションを維持する方針です。EU非加盟国である英国、ノルウェーについては投資を行いません。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友・ヨーロッパ国債ファンド

1万口当たりの費用明細(2024年2月21日から2024年8月20日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	28円	0.464%	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6,061円です。
(投信会社)	(13)	(0.219)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(13)	(0.219)	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)	(2)	(0.027)	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	1	0.021	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)	(0.019)	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)	(0.002)	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	29	0.485	

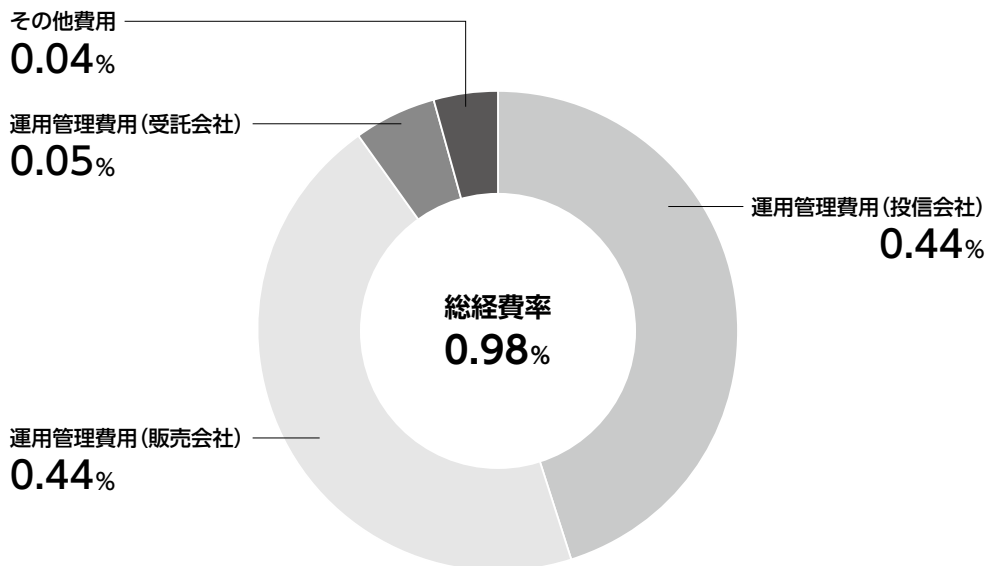
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



※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、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。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

当作成期中の運用・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総経費率(年率換算)は0.98%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2024年2月21日から2024年8月20日まで)

公社債

			当 作 成 期	
			買 付 額	売 付 額
外	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ -	千スウェーデン・クローナ 317
	ユ	ー	口	千ユーロ
国	ベルギー	国債証券	1,757	1,032
	フランス	国債証券	-	541
	ドイツ	国債証券	326	561

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

■ 利害関係人との取引状況等 (2024年2月21日から2024年8月20日まで)

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。

※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 (2024年2月21日から2024年8月20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 (2024年8月20日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	額 面 金 額	作 成 期		組 入 比 率	うちBBB格以下 組 入 比 率	末		
		評 価 額				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
デンマーク	千デンマーク・クローネ 2,100	千デンマーク・クローネ 2,490	千円 54,171	% 1.3	% -	% 1.0	% 0.2	% -
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 3,060	千スウェーデン・クローナ 3,165	45,009	1.1	-	0.4	0.7	-
ユ	千ユーロ	千ユーロ						
オランダ	680	681	110,609	2.6	-	2.6	-	-
ベルギー	7,300	7,928	1,286,838	30.5	-	18.2	12.3	-
フランス	10,430	10,164	1,649,858	39.0	-	29.7	9.4	-
ドイツ	6,350	5,829	946,200	22.4	-	18.0	4.4	-
合 計	-	-	4,092,687	96.9	-	69.9	26.9	-

※邦貨換算金額は、作成期末の時価を日本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。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

三井住友・ヨーロッパ国債ファンド

B 個別銘柄開示 外国（外貨建）公社債

区 分	銘 柄	種 類	作 成 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	
デンマーク	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 1,600	千デンマーク・クローネ 2,016	千円 43,856	2039/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5000	500	474	10,315	2027/11/15
	小 計		-	2,100	2,490	54,171	-
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローナ 1,000	千スウェーデン・クローナ 1,180	16,785	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT	国債証券	0.7500	2,060	1,984	28,223	2028/05/12
小 計			-	3,060	3,165	45,009	-
ユ ー ロ				千ユーロ	千ユーロ		
オランダ	NETHERLANDS GOVERNMENT	国債証券	2.5000	680	681	110,609	2033/01/15
ベルギー	BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5000	2,900	3,198	519,110	2028/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0000	2,700	2,944	477,976	2032/03/28
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.7500	800	858	139,317	2045/06/22
	BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.4500	900	926	150,433	2043/06/22
フランス	FRANCE O. A. T.	国債証券	5.5000	2,080	2,334	378,947	2029/04/25
	FRANCE OAT.	国債証券	4.0000	2,550	2,789	452,771	2038/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.7500	100	100	16,291	2027/10/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.5000	900	891	144,710	2030/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	2.0000	1,900	1,477	239,806	2048/05/25
	FRANCE OAT.	国債証券	0.0000	1,900	1,560	253,295	2031/11/25
	FRANCE OAT.	国債証券	3.0000	1,000	1,010	164,035	2033/05/25
ドイツ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	5.5000	1,490	1,780	289,071	2031/01/04
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.5000	1,200	1,133	183,925	2028/02/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	0.0000	1,560	833	135,342	2050/08/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	1.0000	400	333	54,162	2038/05/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.1000	200	199	32,333	2029/11/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	2.6000	1,500	1,548	251,365	2033/08/15
小 計			-	24,760	24,604	3,993,506	-
合 計			-	-	-	4,092,687	-

※邦貨換算金額は、作成期末の時価を日本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。

三井住友・ヨーロッパ国債ファンド

■ 投資信託財産の構成

(2024年8月20日現在)

項 目	作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 4,092,687	% 96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	145,569	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	4,238,257	100.0

※作成期末における外貨建資産（4,188,783千円）の投資信託財産総額（4,238,257千円）に対する比率は98.8%です。

※外貨建資産は、作成期末の時価を日本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、作成期末における邦貨換算レートは、1デンマーク・クローネ=21.75円、1スウェーデン・クローナ=14.22円、1ユーロ=162.31円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年3月21日) (2024年4月22日) (2024年5月20日) (2024年6月20日) (2024年7月22日) (2024年8月20日)

項 目	第 252 期 末	第 253 期 末	第 254 期 末	第 255 期 末	第 256 期 末	第 257 期 末
(A) 資 産	4,223,372,699円	4,676,969,653円	4,451,980,320円	4,428,011,027円	4,447,095,563円	4,238,257,191円
コール・ローン等	23,317,838	241,239,074	63,640,616	68,561,961	76,281,122	89,309,630
公社債(評価額)	4,055,598,187	4,212,892,185	4,332,258,422	4,306,393,513	4,315,295,333	4,092,687,448
未 収 入 金	45,838,110	162,675,105	—	—	—	—
未 収 利 息	87,956,050	48,213,938	40,404,082	39,836,520	51,039,381	55,042,999
前 払 費 用	7,431,499	8,436,993	11,861,060	12,635,723	3,585,930	—
その他未収収益	3,231,015	3,512,358	3,816,140	583,310	893,797	1,217,114
(B) 負 債	12,558,835	332,933,064	11,824,131	14,160,058	13,266,153	12,474,538
未 払 金	—	321,520,529	—	—	—	—
未 払 収 益 分 配 金	6,988,378	7,271,729	7,229,593	7,191,789	7,138,119	7,092,698
未 払 解 約 金	2,340,060	676,896	1,426,130	3,448,953	2,454,255	2,204,970
未 払 信 託 報 酬	3,213,364	3,445,686	3,151,734	3,500,795	3,654,450	3,160,155
その他未払費用	17,033	18,224	16,674	18,521	19,329	16,715
(C) 純資産総額(A-B)	4,210,813,864	4,344,036,589	4,440,156,189	4,413,850,969	4,433,829,410	4,225,782,653
元 本	6,988,378,878	7,271,729,546	7,229,593,248	7,191,789,025	7,138,119,034	7,092,698,028
次 期 繰 越 損 益 金	△2,777,565,014	△2,927,692,957	△2,789,437,059	△2,777,938,056	△2,704,289,624	△2,866,915,375
(D) 受 益 権 総 口 数	6,988,378,878口	7,271,729,546口	7,229,593,248口	7,191,789,025口	7,138,119,034口	7,092,698,028口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,025円	5,974円	6,142円	6,137円	6,211円	5,958円

※当作成期における作成期首元本額7,116,957,221円、作成期中追加設定元本額382,318,319円、作成期中一部解約元本額406,577,512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・ヨーロッパ国債ファンド

■ 損益の状況

自2024年2月21日
至2024年3月21日
自2024年3月22日
至2024年4月22日
自2024年4月23日
至2024年5月20日
自2024年5月21日
至2024年6月20日
自2024年6月21日
至2024年7月22日
自2024年7月23日
至2024年8月20日

項 目	第 252 期	第 253 期	第 254 期	第 255 期	第 256 期	第 257 期
(A) 配 当 等 収 益	10,833,741円	11,430,592円	10,810,085円	11,895,563円	12,408,404円	10,703,902円
受 取 利 息	10,561,466	11,150,852	10,507,991	11,617,239	12,100,146	10,381,862
そ の 他 収 益 金	272,582	279,740	302,094	278,324	308,258	322,040
支 払 利 息	△ 307	—	—	—	—	—
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	70,991,833	△ 36,310,756	120,912,524	△ 4,184,538	51,333,656	△ 180,128,753
売 買 益	76,899,451	4,671,773	124,221,565	23,394,478	57,424,346	56,831,932
売 買 損	△ 5,907,618	△ 40,982,529	△ 3,309,041	△ 27,579,016	△ 6,090,690	△ 236,960,685
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,365,774	△ 3,609,829	△ 3,295,468	△ 3,654,018	△ 3,813,386	△ 3,310,025
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	78,459,800	△ 28,489,993	128,427,141	4,057,007	59,928,674	△ 172,734,876
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 1,801,114,260	△ 1,711,497,161	△ 1,735,871,300	△ 1,604,749,419	△ 1,594,267,392	△ 1,530,500,516
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,047,922,176	△ 1,180,434,074	△ 1,174,763,307	△ 1,170,053,855	△ 1,162,812,787	△ 1,156,587,285
(配当等相当額)	(7,711,692)	(12,998,083)	(12,988,908)	(13,006,311)	(13,006,170)	(12,994,887)
(売買損益相当額)	(△1,055,633,868)	(△1,193,432,157)	(△1,187,752,215)	(△1,183,060,166)	(△1,175,818,957)	(△1,169,582,172)
(G) 合 計 (D+E+F)	△ 2,770,576,636	△ 2,920,421,228	△ 2,782,207,466	△ 2,770,746,267	△ 2,697,151,505	△ 2,859,822,677
(H) 収 益 分 配 金	△ 6,988,378	△ 7,271,729	△ 7,229,593	△ 7,191,789	△ 7,138,119	△ 7,092,698
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 2,777,565,014	△ 2,927,692,957	△ 2,789,437,059	△ 2,777,938,056	△ 2,704,289,624	△ 2,866,915,375
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,047,922,176	△ 1,180,434,074	△ 1,174,763,307	△ 1,170,053,855	△ 1,162,812,787	△ 1,156,587,285
(配当等相当額)	(7,711,692)	(12,998,083)	(12,988,908)	(13,006,311)	(13,006,170)	(12,994,887)
(売買損益相当額)	(△1,055,633,868)	(△1,193,432,157)	(△1,187,752,215)	(△1,183,060,166)	(△1,175,818,957)	(△1,169,582,172)
分 配 準 備 積 立 金	90,972,133	90,689,602	93,463,561	94,013,613	97,811,514	97,502,063
繰 越 損 益 金	△ 1,820,614,971	△ 1,837,948,485	△ 1,708,137,313	△ 1,701,897,814	△ 1,639,288,351	△ 1,807,830,153

※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 252 期	第 253 期	第 254 期	第 255 期	第 256 期	第 257 期
(a) 経費控除後の配当等収益	10,388,113円	7,820,763円	10,539,527円	8,241,545円	11,665,938円	7,393,877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	7,711,692	12,998,083	12,988,908	13,006,311	13,006,170	12,994,887
(d) 分配準備積立金	87,572,398	90,140,568	90,153,627	92,963,857	93,283,695	97,200,884
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	105,672,203	110,959,414	113,682,062	114,211,713	117,955,803	117,589,648
1万口当たり当期分配対象額	151.21	152.59	157.25	158.81	165.25	165.79
(f) 分配金	6,988,378	7,271,729	7,229,593	7,191,789	7,138,119	7,092,698
1万口当たり分配金	10	10	10	10	10	10

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	第252期	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期
	10円	10円	10円	10円	10円	10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。