

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 | 信託期間は2012年11月30日から2026年10月5日までです。 |
| 運用方針 | 配当収入の確保と投資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 | フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社が運用を行う「フランクリン・テンプレトン・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用)」を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブの直接利用は行いません。 |
| 分配方針 | 毎月決算を行い、収益分配を目指します。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 分配金額については、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があります。 |

ブラジル高配当株オープン (毎月決算型)

運用報告書(全体版)

第118期(決算日 2022年11月7日) 第121期(決算日 2023年2月6日)
第119期(決算日 2022年12月5日) 第122期(決算日 2023年3月6日)
第120期(決算日 2023年1月5日) 第123期(決算日 2023年4月5日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容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
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時~午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- 基準価額および税込分配金は1万円当たりで表記しています。
- 原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 | | | 債 組 入 比 | 券 率 | 投資信託証券 組入比率 | 純 資 産 額 |
|-----|-------------------|-------|-------------|------------------|------------------|--------|----------------|------------------|
| | | (分配落) | 税 分 配 | 込 金 騰 落 | | | | |
| | | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 | |
| 第17 | 第94期(2020年11月5日) | 2,465 | 20 | 2.0 | — | 98.3 | 6,081 | |
| | 第95期(2020年12月7日) | 3,059 | 20 | 24.9 | — | 98.6 | 7,475 | |
| | 第96期(2021年1月5日) | 3,057 | 20 | 0.6 | — | 97.5 | 7,390 | |
| | 第97期(2021年2月5日) | 3,018 | 20 | △0.6 | — | 97.8 | 7,248 | |
| | 第98期(2021年3月5日) | 2,698 | 20 | △9.9 | — | 97.6 | 6,473 | |
| | 第99期(2021年4月5日) | 2,800 | 20 | 4.5 | — | 97.7 | 6,695 | |
| 第18 | 第100期(2021年5月6日) | 3,038 | 20 | 9.2 | — | 97.7 | 7,259 | |
| | 第101期(2021年6月7日) | 3,390 | 20 | 12.2 | — | 97.9 | 7,933 | |
| | 第102期(2021年7月5日) | 3,318 | 20 | △1.5 | — | 98.3 | 7,447 | |
| | 第103期(2021年8月5日) | 3,073 | 20 | △6.8 | — | 97.5 | 6,763 | |
| | 第104期(2021年9月6日) | 2,908 | 20 | △4.7 | — | 96.6 | 6,277 | |
| | 第105期(2021年10月5日) | 2,633 | 20 | △8.8 | — | 98.3 | 5,598 | |
| 第19 | 第106期(2021年11月5日) | 2,542 | 20 | △2.7 | — | 97.4 | 5,330 | |
| | 第107期(2021年12月6日) | 2,516 | 20 | △0.2 | — | 97.7 | 5,186 | |
| | 第108期(2022年1月5日) | 2,486 | 20 | △0.4 | — | 97.6 | 4,992 | |
| | 第109期(2022年2月7日) | 2,837 | 20 | 14.9 | — | 98.3 | 5,485 | |
| | 第110期(2022年3月7日) | 2,975 | 20 | 5.6 | — | 99.2 | 5,494 | |
| | 第111期(2022年4月5日) | 3,705 | 20 | 25.2 | — | 98.9 | 6,407 | |
| 第20 | 第112期(2022年5月6日) | 3,262 | 20 | △11.4 | — | 97.2 | 5,606 | |
| | 第113期(2022年6月6日) | 3,566 | 10 | 9.6 | — | 96.2 | 6,375 | |
| | 第114期(2022年7月5日) | 2,988 | 10 | △15.9 | — | 97.7 | 5,076 | |
| | 第115期(2022年8月5日) | 3,137 | 10 | 5.3 | — | 98.9 | 5,176 | |
| | 第116期(2022年9月5日) | 3,410 | 10 | 9.0 | — | 97.7 | 5,413 | |
| | 第117期(2022年10月5日) | 3,625 | 10 | 6.6 | — | 97.6 | 5,500 | |
| 第21 | 第118期(2022年11月7日) | 3,919 | 10 | 8.4 | — | 98.1 | 5,402 | |
| | 第119期(2022年12月5日) | 3,237 | 10 | △17.1 | — | 96.9 | 4,372 | |
| | 第120期(2023年1月5日) | 2,928 | 10 | △9.2 | — | 96.9 | 3,901 | |
| | 第121期(2023年2月6日) | 3,178 | 10 | 8.9 | — | 97.7 | 4,200 | |
| | 第122期(2023年3月6日) | 3,072 | 10 | △3.0 | — | 97.1 | 4,038 | |
| | 第123期(2023年4月5日) | 3,028 | 10 | △1.1 | — | 97.1 | 3,964 | |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定していません。

当作成期中の基準価額の推移

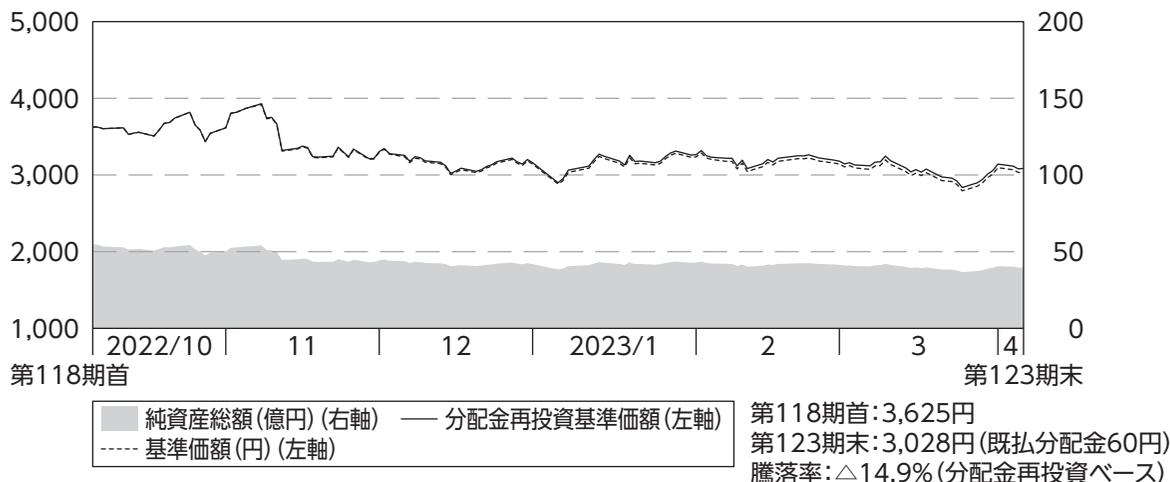
| 決算期 | 年 月 日 | 基準 価 額 | | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|-------|-----------------|------------|--------|----------------|------------------------|
| | | 騰 落 率 | 率 | | |
| 第118期 | (期 首)2022年10月5日 | 円 3,625 | % — | — | % 97.6 |
| | (期 末)2022年11月7日 | 3,929 | 8.4 | — | 98.1 |
| 第119期 | (期 首)2022年11月7日 | 3,919 | — | — | 98.1 |
| | (期 末)2022年12月5日 | 3,247 | △17.1 | — | 96.9 |
| 第120期 | (期 首)2022年12月5日 | 3,237 | — | — | 96.9 |
| | (期 末)2023年 1月5日 | 2,938 | △9.2 | — | 96.9 |
| 第121期 | (期 首)2023年 1月5日 | 2,928 | — | — | 96.9 |
| | (期 末)2023年 2月6日 | 3,188 | 8.9 | — | 97.7 |
| 第122期 | (期 首)2023年 2月6日 | 3,178 | — | — | 97.7 |
| | (期 末)2023年 3月6日 | 3,082 | △3.0 | — | 97.1 |
| 第123期 | (期 首)2023年 3月6日 | 3,072 | — | — | 97.1 |
| | (期 末)2023年 4月5日 | 3,038 | △1.1 | — | 97.1 |

(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) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 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ものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (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、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2022年10月5日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

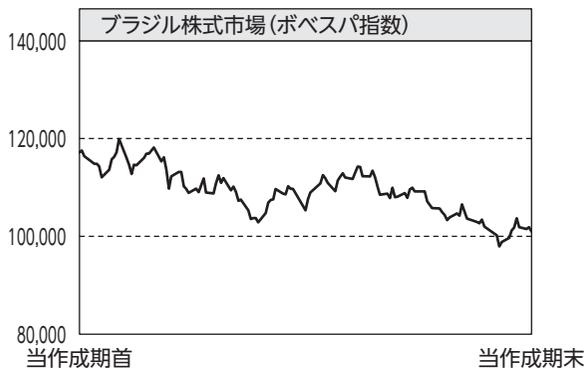
基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「フランクリン・templton・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用)」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額も下落しました。

| 組入ファンド | 投資資産 | 当作成対象 期間末組入比率 | 騰落率 |
|---|-------------|------------------|--------|
| フランクリン・templton・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用) | ブラジルの株式 | 97.1% | △14.6% |
| 短期金融資産 マザーファンド | わが国の短期金融資産等 | 0.3% | △0.0% |

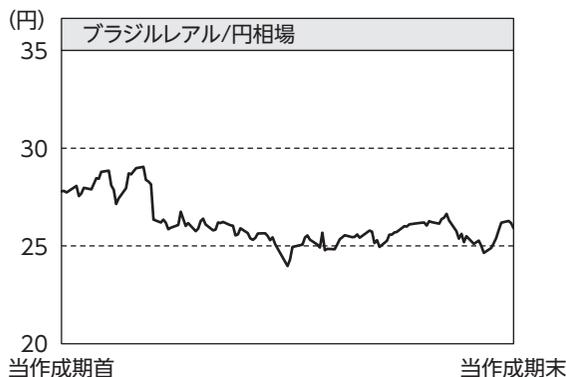
(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

投資環境



ブラジル株式市場は下落しました。当学期初より2022年末にかけては、ルラ新政権下では財政規律が緩んで財政赤字が拡大するとの懸念が強まったこと、BCB(ブラジル中央銀行)が利上げ再開に含みを持たせたことなどから、ブラジル株式市場は下落基調となりました。2023年入り後は、中国の景気回復期待や米国の利上げペース減速見通しなどから、ブラジル株式市場は上昇に転じました。しかし、2月以降はBCBが政策金利を長期間据え置く可能性を示唆し、早期の利下げ期待が後退したことや、米銀の経営破綻をきっかけに投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、ブラジル株式市場は再び下落基調となりました。

外国為替市場では、ブラジルの財政悪化が懸念されたことや、欧米の金融システム不安を背景にリスク回避姿勢が強まったことなどから、ブラジルレアルは円に対して下落しました。



当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

「フランクリン・テンプレートン・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用)」の組入比率を高位に保つ運用を行いました。

・フランクリン・テンプレートン・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用)

配当収入の確保と信託財産の中長期的成長を目指して運用に努め、予想配当利回りが高い銘柄に選別投資し、ポートフォリオを構築しました。当学期においては、基準価額(分配金再投資ベース)は下落しました。ブラジル株式市場の下落を受けて株式要因はマイナスとなりました。また、ブラジルレアルが円に対して下落したことから、為替要因はマイナスとなりました。

<投資対象ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

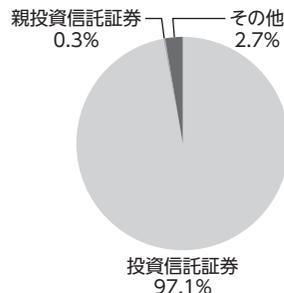
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

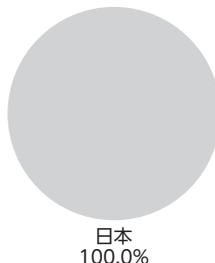
| | 当作成期末 |
|--|-----------|
| | 2023年4月5日 |
| フランクリン・テンプレートン・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用) | 97.1% |
| 短期金融資産 マザーファンド | 0.3% |
| その他 | 2.7% |
| 組入ファンド数 | 2 |

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

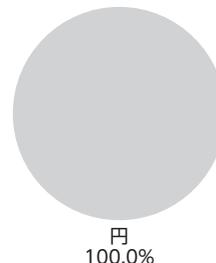
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第118期 | 第119期 | 第120期 | 第121期 | 第122期 | 第123期 |
|---------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2022年10月6日～ 2022年11月7日 | 2022年11月8日～ 2022年12月5日 | 2022年12月6日～ 2023年1月5日 | 2023年1月6日～ 2023年2月6日 | 2023年2月7日～ 2023年3月6日 | 2023年3月7日～ 2023年4月5日 |
| 当期分配金 (円) | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| (対基準価額比率) (%) | (0.255) | (0.308) | (0.340) | (0.314) | (0.324) | (0.329) |
| 当期の収益 (円) | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| 当期の収益以外 (円) | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | 2,421 | 2,431 | 2,441 | 2,454 | 2,464 | 2,474 |

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の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3)－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

○当ファンド

フランクリン・templton・ジャパン株式会社が運用を行う「フランクリン・templton・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、主としてサンパウロ証券取引所に上場している株式に投資します。

・フランクリン・templton・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用)

フランクリン・templton・ブラジル高配当株マザーファンドを主要投資対象とし、配当収入の確保と信託財産の中長期的な成長を目指します。

・短期金融資産 マザーファンド

わが国の短期金融資産等を中心に投資を行い、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果をめざします。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当作成期 | | 項目の概要 |
|------------------|------------------------|---------|---|
| | (2022年10月6日~2023年4月5日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 22円 | 0.664% | (a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は3,253円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付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、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (投信会社) | (6) | (0.181) | |
| (販売会社) | (15) | (0.466) | |
| (受託会社) | (1) | (0.016) | |
| (b) 売買委託手数料 | — | — | |
| (株式) | (—) | (—) | |
| (新株予約権証券) | (—) | (—) | |
| (オプション証券等) | (—) | (—) | |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (—) | (—) | |
| (投資信託証券) | (—) | (—) | |
| (商品) | (—) | (—) | |
| (先物・オプション) | (—) | (—) | |
| (c) 有価証券取引税 | — | — | (c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (—) | (—) | |
| (新株予約権証券) | (—) | (—) | |
| (オプション証券等) | (—) | (—) | |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (—) | (—) | |
| (公社債) | (—) | (—) | |
| (投資信託証券) | (—) | (—) | |
| (d) その他費用 | 0 | 0.003 | (d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保管費用) | (—) | (—) | |
| (監査費用) | (0) | (0.003) | |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| 合計 | 22 | 0.667 | |

(注1) 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た結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

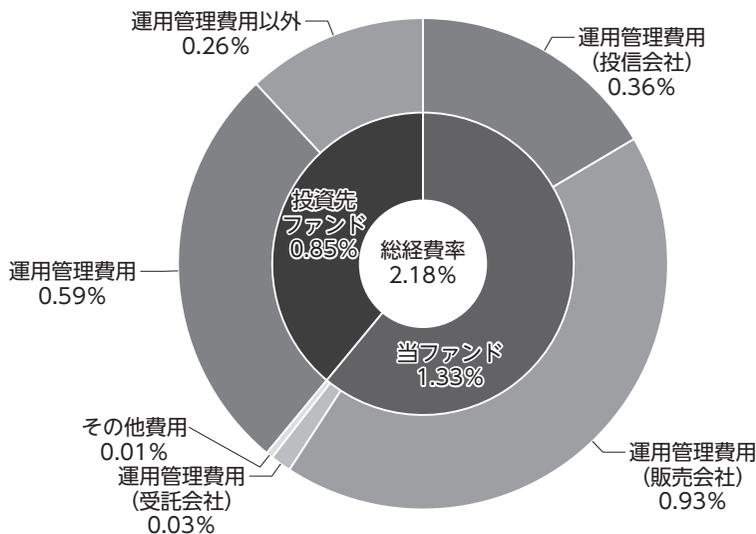
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 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(マザーファンドを除く)。

<参考情報>

総経費率

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、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は2.18%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③) | 2.18% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.33% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.59% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.26% |

(注1)当ファンドの費用は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す。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、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。)です。

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注8)上記の前提条件で算出したものです。このため、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。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券>

| | | 当 作 成 期 | | | |
|-----|--|---------|---------|-----------------|---------------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | フランクリン・テンプレトンプラジール高配当株ファンド (適格機関投資家専用) | 千口 — | 千円 — | 千口 2,136,621 | 千円 646,108 |

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人*との取引状況等

■利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 作 成 期 | | | | | |
|---------------|----------|---------------------|---------------|------------|---------------------|---------------|
| | 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 | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託受益証券 | 百万円 — | 百万円 — | % — | 百万円 646 | 百万円 646 | % 100.0 |
| 金 銭 信 託 | 0.012187 | 0.012187 | 100.0 | 0.012187 | 0.012187 | 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 14,764 | 1,296 | 8.8 | 14,821 | 1,299 | 8.8 |

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<短期金融資産 マザーファンド>

| 区 分 | 当 作 成 期 | | | | | |
|---------------|-----------------|---------------------|---------------|-----------------|---------------------|---------------|
| | 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 | $\frac{D}{C}$ |
| 金 銭 信 託 | 百万円 0.716259 | 百万円 0.716259 | % 100.0 | 百万円 0.716259 | 百万円 0.716259 | % 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 1,185,195 | 106,500 | 9.0 | 1,186,337 | 106,306 | 9.0 |

<平均保有割合 0.1%>

(注1)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ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

* 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。

組入資産の明細

＜当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細＞

| フ ァ ン ド 名 | 当 作 成 期 末 | | |
|--|------------|-------------|--------|
| | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式ファンド | 千口 | 千円 | % |
| フランクリン・テンブルトン・ブラジル高配当株ファンド (適格機関投資家専用) | 15,358,647 | 3,848,877 | 97.1 |

(注) 比率は純資産総額に対する評価額の比率です。

＜親投資信託残高＞

| | 前作成期末 | 当 作 成 期 末 | |
|----------------|--------|-----------|-------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 短期金融資産 マザーファンド | 9,880 | 9,880 | 9,993 |

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、9,816,070千口です。

投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 作 成 期 末 | |
|----------------|-------------|--------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 | % |
| 短期金融資産 マザーファンド | 9,993 | 0.3 |
| コール・ローン等、その他 | 127,698 | 3.2 |
| 投資信託財産総額 | 3,986,568 | 100.0 |

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目 | 第118期末 | 第119期末 | 第120期末 | 第121期末 | 第122期末 | 第123期末 |
|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 2022年11月7日現在 | 2022年12月5日現在 | 2023年1月5日現在 | 2023年2月6日現在 | 2023年3月6日現在 | 2023年4月5日現在 |
| (A) 資 産 | 5,445,731,200円 | 4,406,435,617円 | 3,932,146,223円 | 4,225,183,799円 | 4,060,983,413円 | 3,986,568,298円 |
| コール・ローン等 | 136,386,510 | 161,399,653 | 141,841,014 | 113,150,054 | 129,927,498 | 127,698,027 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 5,299,349,508 | 4,235,041,770 | 3,780,311,869 | 4,102,040,539 | 3,921,062,709 | 3,848,877,065 |
| 短期金融資産 マザーファンド(評価額) | 9,995,182 | 9,994,194 | 9,993,206 | 9,993,206 | 9,993,206 | 9,993,206 |
| 未 収 利 息 | — | — | 134 | — | — | — |
| (B) 負 債 | 42,813,471 | 34,275,370 | 31,052,725 | 24,455,542 | 22,069,843 | 22,075,145 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 13,785,865 | 13,505,819 | 13,325,278 | 13,216,774 | 13,147,290 | 13,094,730 |
| 未 払 解 約 金 | 22,726,725 | 16,130,508 | 12,975,453 | 6,303,571 | 4,671,141 | 4,658,815 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 6,274,681 | 4,619,513 | 4,732,450 | 4,914,815 | 4,233,877 | 4,303,805 |
| 未 払 利 息 | 280 | 452 | — | 83 | 48 | 22 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 25,920 | 19,078 | 19,544 | 20,299 | 17,487 | 17,773 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 5,402,917,729 | 4,372,160,247 | 3,901,093,498 | 4,200,728,257 | 4,038,913,570 | 3,964,493,153 |
| 元 本 | 13,785,865,010 | 13,505,819,987 | 13,325,278,366 | 13,216,774,399 | 13,147,290,685 | 13,094,730,585 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △8,382,947,281 | △9,133,659,740 | △9,424,184,868 | △9,016,046,142 | △9,108,377,115 | △9,130,237,432 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 13,785,865,010口 | 13,505,819,987口 | 13,325,278,366口 | 13,216,774,399口 | 13,147,290,685口 | 13,094,730,585口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 3,919円 | 3,237円 | 2,928円 | 3,178円 | 3,072円 | 3,028円 |

■損益の状況

| 項 目 | 第118期 | 第119期 | 第120期 | 第121期 | 第122期 | 第123期 |
|-----------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| | 自 2022年10月6日 至 2022年11月7日 | 自 2022年11月8日 至 2022年12月5日 | 自 2022年12月6日 至 2023年1月5日 | 自 2023年1月6日 至 2023年2月6日 | 自 2023年2月7日 至 2023年3月6日 | 自 2023年3月7日 至 2023年4月5日 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 31,929,634円 | 30,996,251円 | 30,839,781円 | 30,810,809円 | 30,596,035円 | 30,599,558円 |
| 受 取 配 当 金 | 31,936,522 | 31,004,306 | 30,847,698 | 30,813,039 | 30,597,711 | 30,601,984 |
| 受 取 利 息 | — | — | 134 | 77 | 27 | 74 |
| 支 払 利 息 | △6,888 | △8,055 | △8,051 | △2,307 | △1,703 | △2,500 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 393,639,559 | △920,719,857 | △424,599,997 | 318,493,996 | △152,666,457 | △70,914,223 |
| 売 買 益 | 398,852,808 | 15,527,894 | 3,559,631 | 321,721,892 | 592,830 | 1,298,720 |
| 売 買 損 | △5,213,249 | △936,247,751 | △428,159,628 | △3,227,896 | △153,259,287 | △72,212,943 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △6,300,601 | △4,638,591 | △4,751,994 | △4,935,114 | △4,251,364 | △4,321,578 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | 419,268,592 | △894,362,197 | △398,512,210 | 344,369,691 | △126,321,786 | △44,636,243 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △595,059,501 | △182,634,230 | △1,071,833,087 | △1,469,941,859 | △1,127,366,495 | △1,257,542,632 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △8,193,370,507 | △8,043,157,494 | △7,940,514,293 | △7,877,257,200 | △7,841,541,544 | △7,814,963,827 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,904,947,609) | (2,853,293,596) | (2,816,775,146) | (2,794,324,866) | (2,781,795,330) | (2,772,263,189) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△11,098,318,116) | (△10,896,451,090) | (△10,757,289,439) | (△10,671,582,066) | (△10,623,336,874) | (△10,587,227,016) |
| (G) 計 (D+E+F) | △8,369,161,416 | △9,120,153,921 | △9,410,859,590 | △9,002,829,368 | △9,095,229,825 | △9,117,142,702 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △13,785,865 | △13,505,819 | △13,325,278 | △13,216,774 | △13,147,290 | △13,094,730 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △8,382,947,281 | △9,133,659,740 | △9,424,184,868 | △9,016,046,142 | △9,108,377,115 | △9,130,237,432 |
| 追加信託差損益金 | △8,193,370,507 | △8,043,157,494 | △7,940,514,293 | △7,877,257,200 | △7,841,541,544 | △7,814,963,827 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,904,947,607) | (2,853,293,591) | (2,816,775,144) | (2,794,324,866) | (2,781,795,330) | (2,772,263,189) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△11,098,318,114) | (△10,896,451,085) | (△10,757,289,437) | (△10,671,582,066) | (△10,623,336,874) | (△10,587,227,016) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 433,666,985 | 430,636,702 | 436,026,151 | 449,150,072 | 457,842,159 | 467,666,671 |
| 繰 越 損 益 金 | △623,243,759 | △1,521,138,948 | △1,919,696,726 | △1,587,939,014 | △1,724,677,730 | △1,782,940,276 |

(注1) (B) 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。

(注2) (C) 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3) (F) 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。

〈注記事項〉

※当ファンドの第118期首元本額は15,171,456,180円、第118～123期中追加設定元本額は468,521,319円、第118～123期中一部解約元本額は2,545,246,914円です。

※分配金の計算過程

| 項目 | 第118期 | 第119期 | 第120期 | 第121期 | 第122期 | 第123期 |
|-------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| (A) 配当等収益額(費用控除後) | 31,456,537円 | 26,356,975円 | 26,087,137円 | 30,375,340円 | 26,344,507円 | 26,277,769円 |
| (B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後) | -円 | -円 | -円 | -円 | -円 | -円 |
| (C) 収益調整金額 | 2,904,947,607円 | 2,853,293,591円 | 2,816,775,144円 | 2,794,324,866円 | 2,781,795,330円 | 2,772,263,189円 |
| (D) 分配準備積立金額 | 415,996,313円 | 417,785,546円 | 423,264,292円 | 431,991,506円 | 444,644,942円 | 454,483,632円 |
| (E) 分配対象収益額(A+B+C+D) | 3,352,400,457円 | 3,297,436,112円 | 3,266,126,573円 | 3,256,691,712円 | 3,252,784,779円 | 3,253,024,590円 |
| (F) 期末残存口数 | 13,785,865,010口 | 13,505,819,987口 | 13,325,278,366口 | 13,216,774,399口 | 13,147,290,685口 | 13,094,730,585口 |
| (G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000) | 2,431円 | 2,441円 | 2,451円 | 2,464円 | 2,474円 | 2,484円 |
| (H) 分配金額(1万口当たり) | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |
| (I) 収益分配金金額(F×H/10,000) | 13,785,865円 | 13,505,819円 | 13,325,278円 | 13,216,774円 | 13,147,290円 | 13,094,730円 |

分配金のお知らせ

| | 第118期 | 第119期 | 第120期 | 第121期 | 第122期 | 第123期 |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万口当たり分配金 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

【分配金の課税上の取扱いについて】

- ・収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

お知らせ

投資対象ファンドの名称変更に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2022年10月26日)

組入投資信託証券の内容

■フランクリン・テンプルトン・ブラジル高配当株ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

| | |
|--------|--|
| 運用会社 | フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社 |
| 運用方針 | フランクリン・テンプルトン・ブラジル高配当株マザーファンドを主要投資対象とし、配当収入の確保と信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 主要運用対象 | 「フランクリン・テンプルトン・ブラジル高配当株マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 |

●損益の状況

| 項目 | 第130期 | 第131期 | 第132期 | 第133期 | 第134期 | 第135期 |
|------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年7月26日 至 2022年8月23日 | 自 2022年8月24日 至 2022年9月26日 | 自 2022年 9月27日 至 2022年10月24日 | 自 2022年10月25日 至 2022年11月24日 | 自 2022年11月25日 至 2022年12月23日 | 自 2022年12月24日 至 2023年 1月23日 |
| (A) 配当等収益 | -円 | 42,118円 | -円 | -円 | -円 | -円 |
| その他収益金 | - | 42,118 | - | - | - | - |
| (B) 有価証券売買損益 | 702,356,195 | 275,920,443 | 464,387,699 | △764,672,253 | △81,130,034 | △12,274,062 |
| 売 買 益 | 724,233,199 | 282,577,089 | 481,420,349 | 12,508,218 | 1,092,421 | - |
| 売 買 損 | △21,877,004 | △6,656,646 | △17,032,650 | △777,180,471 | △82,222,455 | △12,274,062 |
| (C) 信託報酬等 | △2,607,698 | △3,153,603 | △2,493,111 | △2,543,535 | △2,089,325 | △2,177,322 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 699,748,497 | 272,808,958 | 461,894,588 | △767,215,788 | △83,219,359 | △14,451,384 |
| (E) 前期繰越損益金 | △1,461,108,568 | △761,460,979 | △469,413,292 | △8,169,158 | △784,987,502 | △887,225,902 |
| (F) 追加信託差損益金 | △12,577,652,581 | △12,079,893,044 | △11,140,781,008 | △10,554,258,263 | △10,501,174,801 | △10,513,091,209 |
| (配当等相当額) | (922,344,756) | (880,220,573) | (797,133,310) | (722,941,758) | (701,953,300) | (690,036,892) |
| (売買損益相当額) | (△13,499,997,337) | (△12,960,113,617) | (△11,937,914,318) | (△11,277,200,021) | (△11,203,128,101) | (△11,203,128,101) |
| (G) 計(D+E+F) | △13,339,012,652 | △12,568,545,065 | △11,148,299,712 | △11,329,643,209 | △11,369,381,662 | △11,414,768,495 |
| (H) 収益分配金 | △37,277,883 | △35,787,087 | △32,964,547 | △31,140,013 | △30,935,449 | △30,935,449 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △13,376,290,535 | △12,604,332,152 | △11,181,264,259 | △11,360,783,222 | △11,400,317,111 | △11,445,703,944 |
| 追加信託差損益金 | △12,583,109,126 | △12,094,724,741 | △11,172,616,482 | △10,570,605,604 | △10,513,091,209 | △10,530,386,949 |
| (配当等相当額) | (916,888,211) | (865,388,876) | (765,297,836) | (706,594,417) | (690,036,892) | (672,741,152) |
| (売買損益相当額) | (△13,499,997,337) | (△12,960,113,617) | (△11,937,914,318) | (△11,277,200,021) | (△11,203,128,101) | (△11,203,128,101) |
| 繰越損益金 | △793,181,409 | △509,607,411 | △8,647,777 | △790,177,618 | △887,225,902 | △915,316,995 |

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

| | 第129期末 | | 第135期末 | |
|-------------------------------|-----------|--|-----------|--|
| | 口数 | | 口数 | |
| | 千口 | | 千口 | |
| フランクリン・テンプレトン・ブラジル高配当株マザーファンド | 4,702,566 | | 3,610,018 | |
| | | | 千円 | |
| | | | 4,055,133 | |

下記は、フランクリン・テンプレトン・ブラジル高配当株マザーファンド全体の内容です。

<外国株式>

| 銘柄 | 第129期末 | | 第135期末 | | 業種 | |
|------------------------------|--------|--------|----------|---------|------------------------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千ブラジルレアル | 千円 | | |
| VALE SA | 2,982 | 2,192 | 20,604 | 511,564 | 素材 | |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR | 2,935 | 3,207 | 13,144 | 326,349 | 公益事業 | |
| CIA DE TRANSMISSAO DE ENE-PF | 4,420 | — | — | — | 公益事業 | |
| ITAUSA SA | 28,040 | 23,604 | 20,252 | 502,822 | 銀行 | |
| GERDAU SA-PREF | 3,175 | 2,600 | 8,634 | 214,382 | 素材 | |
| SANTOS BRASIL PARTICIPACOES | 7,093 | 9,749 | 7,955 | 197,523 | 運輸 | |
| BANCO BRADESCO SA-PREF | 12,874 | 3,575 | 5,244 | 130,212 | 銀行 | |
| RANDON PARTICIPACOES SA-PREF | 5,221 | — | — | — | 資本財 | |
| BRADESCO SA-PREF | — | 1,825 | 5,847 | 145,176 | 素材 | |
| CPFL ENERGIA SA | 4,416 | 3,872 | 12,620 | 313,326 | 公益事業 | |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | — | 2,975 | 7,765 | 192,790 | 銀行 | |
| PORTO SEGURO SA | 5,939 | 4,668 | 10,910 | 270,880 | 保険 | |
| LOJAS RENNER S.A. | — | 1,864 | 3,830 | 95,102 | 小売 | |
| COSAN SA | 6,497 | — | — | — | エネルギー | |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 4,298 | 1,884 | 5,085 | 126,257 | 公益事業 | |
| SLC AGRICOLA SA | 864 | 815 | 3,978 | 98,785 | 食品・飲料・タバコ | |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PFR | — | 4,539 | 5,161 | 128,156 | 公益事業 | |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS | — | 2,242 | 4,986 | 123,791 | 不動産 | |
| MINERVA SA | — | 3,003 | 4,658 | 115,662 | 食品・飲料・タバコ | |
| HYPERA SA | 3,063 | 2,494 | 11,076 | 274,994 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ENERGISA SA-UNITS | 1,421 | 1,204 | 4,970 | 123,400 | 公益事業 | |
| TELEFONICA BRASIL S.A. | 2,545 | 2,158 | 8,519 | 211,529 | 電気通信サービス | |
| ALUPAR INVESTIMENTO SA-UNIT | 2,529 | 2,809 | 8,029 | 199,358 | 公益事業 | |
| ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 2,799 | 3,053 | 11,651 | 289,278 | 公益事業 | |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 5,262 | 5,076 | 6,482 | 160,934 | 各種金融 | |
| AMBEV SA | 5,553 | 4,379 | 5,925 | 147,125 | 食品・飲料・タバコ | |
| KLABIN SA - UNIT | 4,822 | — | — | — | 素材 | |
| CURY CONSTRUTORA E INCORPORA | 11,025 | 8,665 | 10,485 | 260,329 | 耐久消費財・アパレル | |
| COMPANHIA BRASILEIRA DE ALUM | 2,408 | — | — | — | 素材 | |
| 3R PETROLEUM OLEO E GAS SA | 1,382 | 1,157 | 5,643 | 140,102 | エネルギー | |
| AUREN ENERGIA SA - ON | 3,534 | 2,034 | 3,009 | 74,709 | 公益事業 | |
| TIM SA | 7,831 | 5,955 | 6,914 | 171,680 | 電気通信サービス | |
| VIBRA ENERGIA SA | 6,389 | 5,778 | 8,737 | 216,924 | 小売 | |
| PETRO RIO SA | — | 1,266 | 5,203 | 129,190 | エネルギー | |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 4,630 | 3,392 | 7,225 | 179,401 | 各種金融 | |
| 合計 | 株数 | 金額 | 153,959 | 122,048 | 244,556 | 6,071,745 |
| 銘柄数<比率> | 28 | 30 | — | <91.0%> | | |

(注1) 邦貨換算金額は、当該日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) <>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

短期金融資産 マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2022年9月26日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 信託期間は2007年9月26日から無期限です。 |
| 運用方針 | わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。)を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。 |
| 主要運用対象 | わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | 外貨建資産への投資は行いません。 |

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 参考指数 | | 債券先物率 債組入比率 | 債券先物率 債比 | 純資産額 |
|------------------|----------|----------|---------------|----------|----------------|-------------|--------------|
| | 円 騰落率 | % 騰落率 | 10,000 騰落率 | % 騰落率 | | | |
| 第11期(2018年9月25日) | 10,138 | △0.1 | 10,106 | △0.1 | 3.7 | — | 百万円 8,170 |
| 第12期(2019年9月25日) | 10,129 | △0.1 | 10,100 | △0.1 | — | — | 8,839 |
| 第13期(2020年9月25日) | 10,124 | △0.0 | 10,096 | △0.0 | — | — | 9,348 |
| 第14期(2021年9月27日) | 10,120 | △0.0 | 10,093 | △0.0 | — | — | 10,085 |
| 第15期(2022年9月26日) | 10,116 | △0.0 | 10,091 | △0.0 | — | — | 9,151 |

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 参考指数 | | 債券先物率 債組入比率 | 債券先物率 債比 |
|----------------------|----------|----------|---------------|----------|----------------|-------------|
| | 円 騰落率 | % 騰落率 | 10,000 騰落率 | % 騰落率 | | |
| (当期首) 2021年 9月27日 | 10,120 | — | 10,093 | — | — | — |
| 9月末 | 10,120 | 0.0 | 10,093 | △0.0 | — | — |
| 10月末 | 10,120 | 0.0 | 10,093 | △0.0 | — | — |
| 11月末 | 10,119 | △0.0 | 10,093 | △0.0 | — | — |
| 12月末 | 10,119 | △0.0 | 10,093 | △0.0 | — | — |
| 2022年 1月末 | 10,118 | △0.0 | 10,092 | △0.0 | — | — |
| 2月末 | 10,118 | △0.0 | 10,092 | △0.0 | — | — |
| 3月末 | 10,118 | △0.0 | 10,092 | △0.0 | — | — |
| 4月末 | 10,118 | △0.0 | 10,092 | △0.0 | — | — |
| 5月末 | 10,118 | △0.0 | 10,092 | △0.0 | — | — |
| 6月末 | 10,117 | △0.0 | 10,092 | △0.0 | — | — |
| 7月末 | 10,117 | △0.0 | 10,092 | △0.0 | — | — |
| 8月末 | 10,117 | △0.0 | 10,091 | △0.0 | — | — |
| (当期末) 2022年 9月26日 | 10,116 | △0.0 | 10,091 | △0.0 | — | — |

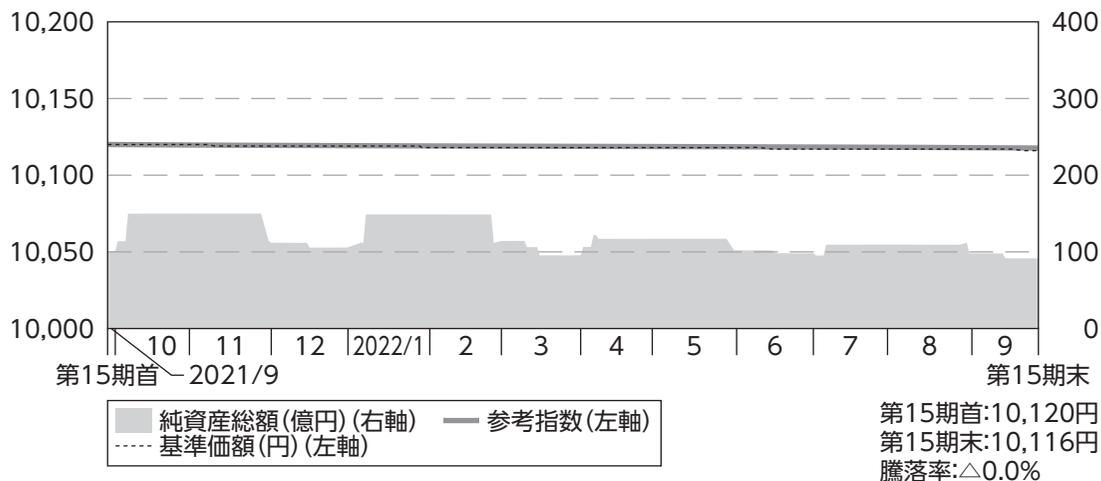
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

参考指数は、無担保コール翌日物金利の累積投資収益率で、設定日を10,000として指数化しております。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

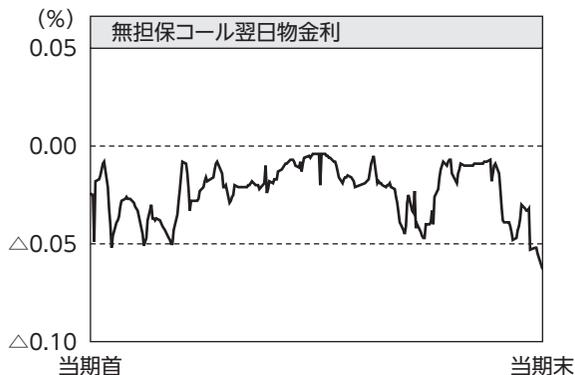


(注)参考指数は、2021年9月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りはマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08～0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等にて運用を行い、基準価額は横ばい推移となりました。

投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に $\Delta 0.1\%$ のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.08\sim 0.00\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

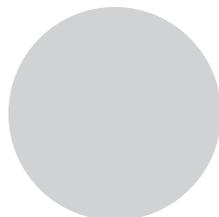
日銀の金融緩和継続により短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等にて運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

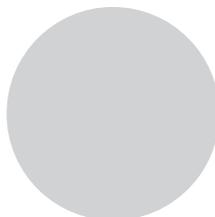
当期末における該当事項はありません。

○資産別配分



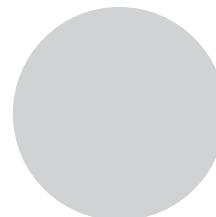
短期金融資産等
100.0%

○国別配分



日本
100.0%

○通貨別配分



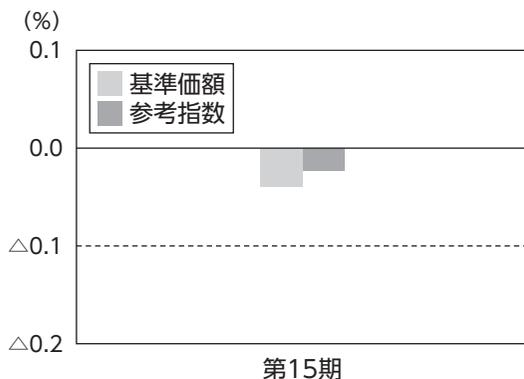
円
100.0%

(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



今後の運用方針

わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行い、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果をめざします。

1万口当たりの費用明細

当期中における該当事項はありません。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

| 区 分 | 当 | | | 期 | | |
|---------------|------------------|--------------------|---------------|------------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 百万円 2,928,178 | 百万円 136,215 | % 4.7 | 百万円 2,929,111 | 百万円 135,105 | % 4.6 |

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

※ 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。

投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|------------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 千円 9,152,935 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 9,152,935 | 100.0 |

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目 | 当 期 末 2022年9月26日現在 |
|-------------------|-----------------------|
| (A)資 産 | 9,152,935,950円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 9,152,935,950 |
| (B)負 債 | 1,523,169 |
| 未 払 解 約 金 | 1,502,802 |
| 未 払 利 息 | 20,367 |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 9,151,412,781 |
| 元 本 | 9,046,164,083 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 105,248,698 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 9,046,164,083口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,116円 |

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2021年9月28日 至 2022年9月26日 |
|--------------------|-------------------------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | △4,634,183円 |
| 受 取 利 息 | 55,856 |
| 支 払 利 息 | △4,690,039 |
| (B)当 期 損 益 金(A) | △4,634,183 |
| (C)前 期 繰 越 損 益 金 | 119,674,108 |
| (D)追 加 信 託 差 損 益 金 | 169,275,273 |
| (E)解 約 差 損 益 金 | △179,066,500 |
| (F) 計 (B+C+D+E) | 105,248,698 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F) | 105,248,698 |

(注1) (D)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。

(注2) (E)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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は9,965,821,749円、期中追加設定元本額は14,244,392,485円、期中一部解約元本額は15,164,050,151円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

| | |
|-----------------------------|----------------|
| バランスG(25)VA(適格機関投資家専用) | 5,278,040,765円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025 | 3,567,940,491円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035 | 114,624,285円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045 | 59,568,699円 |
| FOFs用 短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用) | 13,408,726円 |
| ブラジル高配当株オープン(毎月決算型) | 9,880,568円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 2,207,063円 |
| 米国成長株式ファンド | 493,486円 |

お知らせ

該当事項はありません。