

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136期(決算日 2024年5月7日) 第139期(決算日 2024年 8月5日)
第137期(決算日 2024年6月5日) 第140期(決算日 2024年 9月5日)
第138期(決算日 2024年7月5日) 第141期(決算日 2024年10月7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、金額の表記未満は切捨て、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 | | | 債組入比率 | 債券組入比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|-----|--------------------|-------|----|-------|-------|--------|------------|------|
| | | (分配落) | 税分 | 込金騰落 | | | | |
| | | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 | |
| 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22 | 第123期(2023年 4月 5日) | 3,028 | 10 | △1.1 | — | 97.1 | 3,964 | |
| | 第124期(2023年 5月 8日) | 3,255 | 10 | 7.8 | — | 97.0 | 4,260 | |
| | 第125期(2023年 6月 5日) | 3,521 | 10 | 8.5 | — | 97.6 | 4,264 | |
| | 第126期(2023年 7月 5日) | 3,907 | 10 | 11.2 | — | 98.6 | 4,422 | |
| | 第127期(2023年 8月 7日) | 3,803 | 10 | △2.4 | — | 97.9 | 4,048 | |
| | 第128期(2023年 9月 5日) | 3,756 | 10 | △1.0 | — | 96.8 | 4,333 | |
| 第23 | 第129期(2023年10月 5日) | 3,538 | 10 | △5.5 | — | 95.8 | 4,179 | |
| | 第130期(2023年11月 6日) | 3,817 | 10 | 8.2 | — | 97.5 | 4,471 | |
| | 第131期(2023年12月 5日) | 3,973 | 10 | 4.3 | — | 95.9 | 4,629 | |
| | 第132期(2024年 1月 5日) | 4,026 | 10 | 1.6 | — | 97.1 | 4,621 | |
| | 第133期(2024年 2月 5日) | 3,965 | 10 | △1.3 | — | 98.1 | 4,495 | |
| | 第134期(2024年 3月 5日) | 4,086 | 10 | 3.3 | — | 97.8 | 4,472 | |
| 第24 | 第135期(2024年 4月 5日) | 4,052 | 10 | △0.6 | 0.1 | 99.0 | 4,300 | |
| | 第136期(2024年 5月 7日) | 4,075 | 10 | 0.8 | 0.1 | 96.7 | 4,247 | |
| | 第137期(2024年 6月 5日) | 3,745 | 10 | △7.9 | 0.2 | 97.6 | 3,802 | |
| | 第138期(2024年 7月 5日) | 3,903 | 10 | 4.5 | 0.1 | 98.5 | 3,918 | |
| | 第139期(2024年 8月 5日) | 3,360 | 10 | △13.7 | 0.2 | 97.7 | 3,313 | |
| | 第140期(2024年 9月 5日) | 3,609 | 10 | 7.7 | 0.2 | 98.5 | 3,528 | |
| | 第141期(2024年10月 7日) | 3,754 | 10 | 4.3 | 0.1 | 98.2 | 3,528 | |

(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おりません。

当作成期中の基準価額の推移

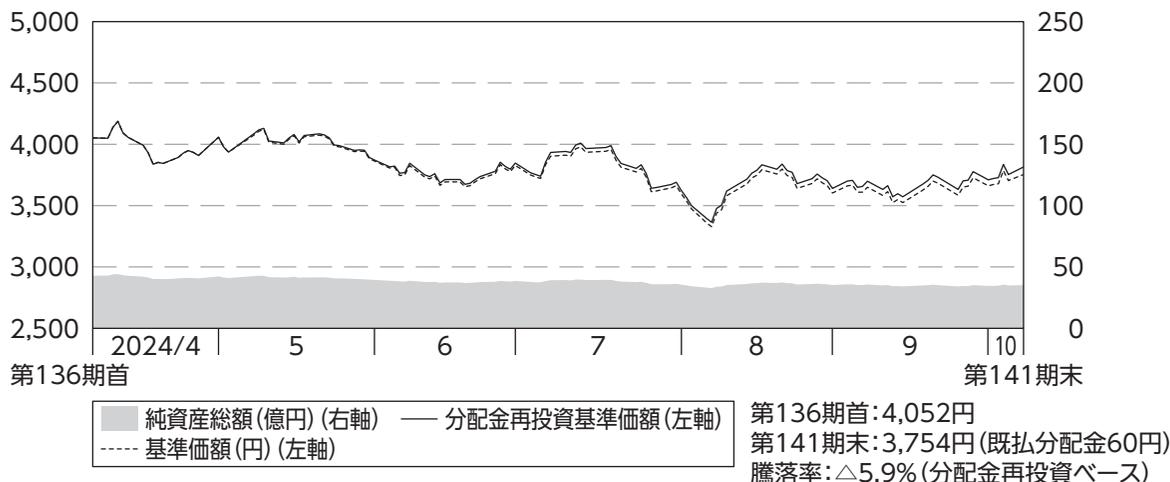
| 決算期 | 年 月 日 | 基準 価 額 | | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|-------|----------------|--------|-------|-------------|---------------------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| 第136期 | (期首)2024年 4月5日 | 円 | % | % | % |
| | (期末)2024年 5月7日 | 4,052 | — | 0.1 | 99.0 |
| 第137期 | (期首)2024年 5月7日 | 4,085 | 0.8 | 0.1 | 96.7 |
| | (期末)2024年 6月5日 | 4,075 | — | 0.1 | 96.7 |
| 第138期 | (期首)2024年 6月5日 | 3,755 | △7.9 | 0.2 | 97.6 |
| | (期末)2024年 7月5日 | 3,745 | — | 0.2 | 97.6 |
| 第139期 | (期首)2024年 7月5日 | 3,913 | 4.5 | 0.1 | 98.5 |
| | (期末)2024年 8月5日 | 3,903 | — | 0.1 | 98.5 |
| 第140期 | (期首)2024年 8月5日 | 3,370 | △13.7 | 0.2 | 97.7 |
| | (期末)2024年 9月5日 | 3,360 | — | 0.2 | 97.7 |
| 第141期 | (期首)2024年 9月5日 | 3,619 | 7.7 | 0.2 | 98.5 |
| | (期末)2024年10月7日 | 3,609 | — | 0.2 | 98.5 |
| | | 3,764 | 4.3 | 0.1 | 98.2 |

(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、2024年4月5日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

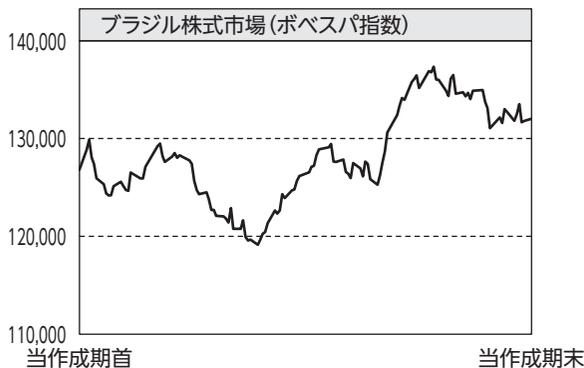
基準価額の主な変動要因

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 | 98.2% | △5.4% |
| 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% |

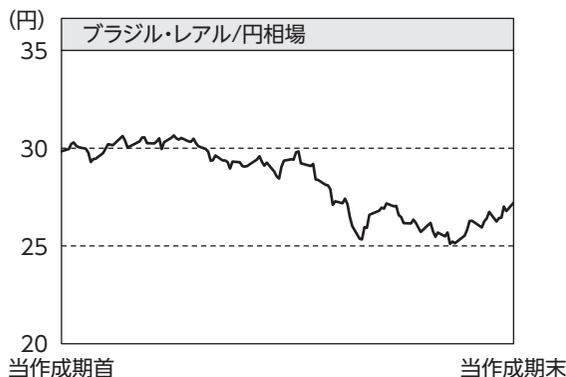
(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

投資環境



ブラジル株式市場は上昇しました。当作成期の前半は、BCB(ブラジル中央銀行)が利下げ幅をこれまでの0.50%から0.25%へと縮小したことが嫌気され、ブラジル株式市場は下落しました。その後、配当政策を巡る経営陣とルラ政権との対立により低迷していた国営石油会社ペトロブラスの株価が上昇に転じたことをきっかけにしてブラジル株式市場は上昇に向かいました。当作成期の後半には、BCBによる約2年ぶりの利上げを受けて下落する局面もありましたが、景気減速懸念が和らいだ米国の株式市場が上昇したことから、ブラジル株式市場も持ち直しの動きを見せました。

外国為替市場では、ブラジルの財政政策への懸念が再燃したことや日銀の追加利上げを背景に、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。当作成期においては、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上昇を受けて株式要因はプラスとなりました。一方、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。>

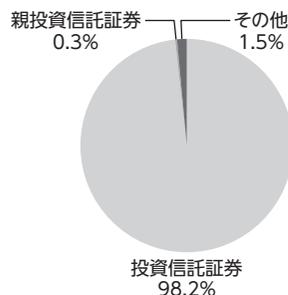
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

| | 当作成期末 |
|---|------------|
| | 2024年10月7日 |
| 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) | 98.2% |
| 短期金融資産 マザーファンド | 0.3% |
| その他 | 1.5% |
| 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。

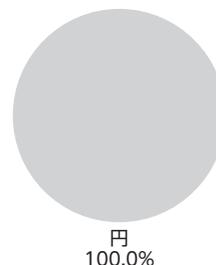
○資産別配分



○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136期 | 第137期 | 第138期 | 第139期 | 第140期 | 第141期 |
|---------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| | 2024年4月6日～ 2024年5月7日 | 2024年5月8日～ 2024年6月5日 | 2024年6月6日～ 2024年7月5日 | 2024年7月6日～ 2024年8月5日 | 2024年8月6日～ 2024年9月5日 | 2024年9月6日～ 2024年10月7日 |
| 当期分配金 (円) | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| (対基準価額比率) (%) | (0.245) | (0.266) | (0.256) | (0.297) | (0.276) | (0.266) |
| 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) | 2,624 | 2,634 | 2,648 | 2,658 | 2,672 | 2,686 |

(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 |
|------------------|------------------------|---------|---|
| | (2024年4月6日~2024年10月7日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 25円 | 0.675% | (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3,767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) | (7) | (0.184) | (b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (販売会社) | (18) | (0.474) | |
| (受託会社) | (1) | (0.017) | |
| | | | |
| (b) 売買委託手数料 | — | — | (b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (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) | (—) | (—) | |
| 合計 | 25 | 0.678 | |

(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。

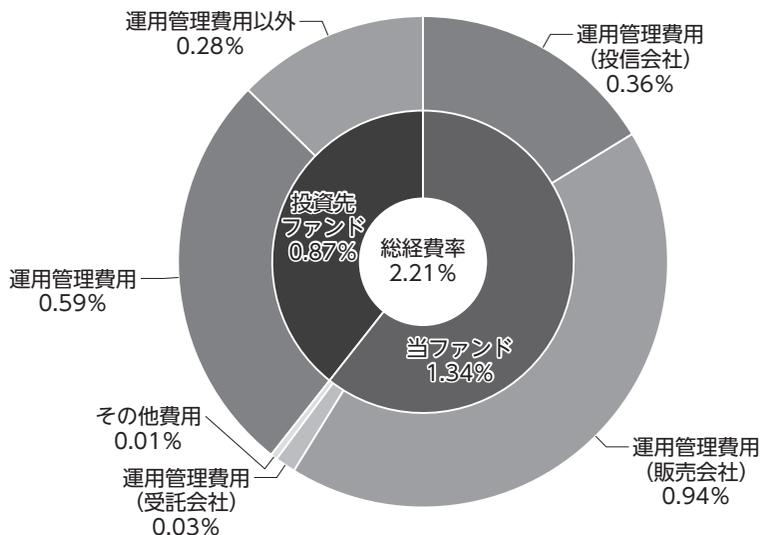
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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2.21%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率(①+②+③) | 2.21% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.34% |
| 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 | 0.28% |

(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) 投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8) 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9) 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ル高配当株ファンド (適格機関投資家専用) | 千口 — | 千円 — | 千口 1,352,113 | 千円 416,824 |

(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 416 | 百万円 416 | % 100.0 |
| 金 銭 信 託 | 0.010871 | 0.010871 | 100.0 | 0.010871 | 0.010871 | 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 10,147 | 2,145 | 21.1 | 10,172 | 2,150 | 21.1 |

(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 0.700892 | 百万円 0.700892 | % 100.0 | 百万円 0.700892 | 百万円 0.700892 | % 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 529,385 | 112,400 | 21.2 | 528,810 | 112,243 | 21.2 |

<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) | 11,628,691 | 3,466,513 | 98.2 |

(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>

| 種 類 | 前作成期末 | 当 作 成 期 末 | |
|----------------|-------|-----------|-------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 短期金融資産 マザーファンド | 千口 | 千口 | 千円 |
| | 9,880 | 9,880 | 9,994 |

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、10,183,993千口です。

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 | % |
| | 3,466,513 | 97.6 |
| 短期金融資産 マザーファンド | 9,994 | 0.3 |
| コール・ローン等、その他 | 76,273 | 2.1 |
| 投資信託財産総額 | 3,552,780 | 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136期末 2024年5月7日現在 | 第137期末 2024年6月5日現在 | 第138期末 2024年7月5日現在 | 第139期末 2024年8月5日現在 | 第140期末 2024年9月5日現在 | 第141期末 2024年10月7日現在 |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|
| (A) 資 産 | 4,265,011,052円 | 3,829,228,847円 | 3,949,965,528円 | 3,337,159,278円 | 3,543,882,944円 | 3,552,780,117円 |
| コール・ローン等 | 146,669,839 | 108,141,924 | 80,924,923 | 88,474,283 | 59,193,630 | 76,272,460 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 4,108,352,679 | 3,711,098,457 | 3,859,049,226 | 3,238,694,229 | 3,474,697,732 | 3,466,513,012 |
| 短期金融資産 マザーファンド(評価額) | 9,988,266 | 9,988,266 | 9,991,230 | 9,990,242 | 9,991,230 | 9,994,194 |
| 未 収 利 息 | 268 | 200 | 149 | 524 | 352 | 451 |
| (B) 負 債 | 18,002,189 | 26,589,707 | 31,283,596 | 23,497,407 | 15,184,626 | 24,506,190 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 10,423,234 | 10,153,232 | 10,039,571 | 9,863,007 | 9,776,586 | 9,399,201 |
| 未 払 解 約 金 | 2,703,387 | 12,093,565 | 17,080,476 | 9,365,022 | 1,350,469 | 11,017,025 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 4,855,512 | 4,325,049 | 4,146,425 | 4,251,818 | 4,040,882 | 4,073,142 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 20,056 | 17,861 | 17,124 | 17,560 | 16,689 | 16,822 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 4,247,008,863 | 3,802,639,140 | 3,918,681,932 | 3,313,661,871 | 3,528,698,318 | 3,528,273,927 |
| 元 本 | 10,423,234,119 | 10,153,232,724 | 10,039,571,958 | 9,863,007,124 | 9,776,586,932 | 9,399,201,636 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △6,176,225,256 | △6,350,593,584 | △6,120,890,026 | △6,549,345,253 | △6,247,888,614 | △5,870,927,709 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 10,423,234,119口 | 10,153,232,724口 | 10,039,571,958口 | 9,863,007,124口 | 9,776,586,932口 | 9,399,201,636口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 4.075円 | 3.745円 | 3.903円 | 3.360円 | 3.609円 | 3.754円 |

■損益の状況

| 項 目 | 第136期 自 2024年4月6日 至 2024年5月7日 | 第137期 自 2024年5月8日 至 2024年6月5日 | 第138期 自 2024年6月6日 至 2024年7月5日 | 第139期 自 2024年7月6日 至 2024年8月5日 | 第140期 自 2024年8月6日 至 2024年9月5日 | 第141期 自 2024年 9月6日 至 2024年10月7日 |
|--------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 25,461,185円 | 24,555,645円 | 24,549,075円 | 23,972,974円 | 24,122,146円 | 23,460,259円 |
| 受 取 配 当 金 | 25,455,156 | 24,549,626 | 24,544,463 | 23,966,344 | 24,110,423 | 23,448,509 |
| 受 取 利 息 | 6,029 | 6,019 | 4,612 | 6,630 | 11,723 | 11,750 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 13,463,680 | △344,311,028 | 148,257,535 | △545,822,329 | 233,655,223 | 125,780,792 |
| 売 買 損 益 | 16,476,559 | 2,296,434 | 148,284,351 | 3,891,980 | 236,012,975 | 129,095,264 |
| 売 買 損 益 | △3,012,879 | △346,607,462 | △26,816 | △549,714,309 | △2,357,752 | △3,314,472 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △4,875,568 | △4,342,910 | △4,163,549 | △4,269,378 | △4,057,571 | △4,089,964 |
| (D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C) | 34,049,297 | △324,098,293 | 168,643,061 | △526,118,733 | 253,719,798 | 145,151,087 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 102,204,476 | 122,456,369 | △209,222,912 | △49,676,580 | △580,190,074 | △323,037,374 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △6,302,055,795 | △6,138,798,428 | △6,070,270,604 | △5,963,686,933 | △5,911,641,752 | △5,683,642,221 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,321,272,274) | (2,261,531,050) | (2,236,616,256) | (2,197,725,567) | (2,178,719,437) | (2,094,930,516) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△8,623,328,069) | (△8,400,329,478) | (△8,306,886,860) | (△8,161,412,500) | (△8,090,361,189) | (△7,778,572,737) |
| (G) 計 (D+E+F) | △6,165,802,022 | △6,340,440,352 | △6,110,850,455 | △6,539,482,246 | △6,238,112,028 | △5,861,528,508 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △10,423,234 | △10,153,232 | △10,039,571 | △9,863,007 | △9,776,586 | △9,399,201 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H) | △6,176,225,256 | △6,350,593,584 | △6,120,890,026 | △6,549,345,253 | △6,247,888,614 | △5,870,927,709 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △6,302,055,795 | △6,138,798,428 | △6,070,270,604 | △5,963,686,933 | △5,911,641,752 | △5,683,642,221 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,321,272,274) | (2,261,531,050) | (2,236,616,256) | (2,197,725,567) | (2,178,719,437) | (2,094,930,516) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△8,623,328,069) | (△8,400,329,478) | (△8,306,886,860) | (△8,161,412,500) | (△8,090,361,189) | (△7,778,572,737) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 414,065,103 | 413,021,597 | 421,923,552 | 423,905,724 | 433,914,246 | 430,286,886 |
| 繰 越 損 益 金 | △288,234,564 | △624,816,753 | △472,542,974 | △1,009,564,044 | △770,161,108 | △617,572,374 |

(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136期首元本額は10,614,202,545円、第136～141期中追加設定元本額は46,230,321円、第136～141期中一部解約元本額は1,261,231,230円です。

※分配金の計算過程

| 項目 | 第136期 | 第137期 | 第138期 | 第139期 | 第140期 | 第141期 |
|-------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 配当等収益額(費用控除後) | 22,272,329円 | 20,212,962円 | 23,957,664円 | 19,703,911円 | 23,743,087円 | 22,818,195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 | 2,321,272,274円 | 2,261,531,050円 | 2,236,616,256円 | 2,197,725,567円 | 2,178,719,437円 | 2,094,930,516円 |
| (D) 分配準備積立金額 | 402,216,008円 | 402,961,867円 | 408,005,459円 | 414,064,820円 | 419,947,745円 | 416,867,892円 |
| (E) 分配対象収益額(A+B+C+D) | 2,745,760,611円 | 2,684,705,879円 | 2,668,579,379円 | 2,631,494,298円 | 2,622,410,269円 | 2,534,616,603円 |
| (F) 期末残存口数 | 10,423,234,119口 | 10,153,232,724口 | 10,039,571,958口 | 9,863,007,124口 | 9,776,586,932口 | 9,399,201,636口 |
| (G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000) | 2,634円 | 2,644円 | 2,658円 | 2,668円 | 2,682円 | 2,696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) | 10,423,234円 | 10,153,232円 | 10,039,571円 | 9,863,007円 | 9,776,586円 | 9,399,201円 |

分配金のお知らせ

| | 第136期 | 第137期 | 第138期 | 第139期 | 第140期 | 第141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

ファンドにおける資金の借入について、要件の緩和を行うため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
(変更日：2024年7月6日)

組入投資信託証券の内容

■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)

●ファンドの概要

| | |
|-------------|--|
| 運用会社 | フランクリン・templton・ジャパン株式会社 |
| 主な投資対象・投資地域 | ブラジルの証券取引所に上場している株式 |
| 運用の基本方針等 | 当ファンドは、主に「フランクリン・templton・ブラジル高配当株マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主にブラジルの証券取引所に上場している株式に投資を行うことにより、配当収入の確保と信託財産の中長期的成長を目指します。 |

●損益の状況

| 項目 | 第148期 | 第149期 | 第150期 | 第151期 | 第152期 | 第153期 |
|----------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| | 自 2024年1月24日 至 2024年2月26日 | 自 2024年2月27日 至 2024年3月25日 | 自 2024年3月26日 至 2024年4月23日 | 自 2024年4月24日 至 2024年5月23日 | 自 2024年5月24日 至 2024年6月24日 | 自 2024年6月25日 至 2024年7月23日 |
| (A) 有価証券売買損益 | 167,785,383円 | 37,225,332円 | △162,362,848円 | 75,615,640円 | △213,338,044円 | 56,119,013円 |
| 売 | 170,700,485 | 38,051,101 | 692,435 | 78,119,891 | - | 59,573,159 |
| 買 | △2,915,102 | △825,769 | △163,055,283 | △2,504,251 | △213,338,044 | △3,454,146 |
| (B) 信託報酬等 | △2,610,759 | △2,110,596 | △2,105,502 | △2,090,922 | △2,082,155 | △1,901,841 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 165,174,624 | 35,114,736 | △164,468,350 | 73,524,718 | △215,420,199 | 54,217,172 |
| (D) 前期繰越損益金 | 74,656,367 | 206,289,169 | 211,405,093 | 20,773,564 | 69,639,821 | △167,308,232 |
| (E) 追加信託差損益金 | △9,192,854,040 | △8,902,300,448 | △8,735,478,994 | △8,455,426,310 | △8,455,426,310 | △8,300,117,716 |
| (配当等相当額) | (540,626,024) | (523,538,748) | (513,728,082) | (497,258,358) | (497,258,358) | (488,124,756) |
| (売買損益相当額) | (△9,733,480,064) | (△9,425,839,196) | (△9,249,207,076) | (△8,952,684,668) | (△8,952,684,668) | (△8,788,242,472) |
| (F) 計(C+D+E) | △8,953,023,049 | △8,660,896,543 | △8,688,542,251 | △8,361,128,028 | △8,601,206,688 | △8,413,208,776 |
| (G) 収益分配金 | △26,808,949 | △25,961,609 | △25,475,137 | △24,658,461 | △24,658,461 | △24,205,487 |
| 次期繰越損益金(F+G) | △8,979,831,998 | △8,686,858,152 | △8,714,017,388 | △8,385,786,489 | △8,625,865,149 | △8,437,414,263 |
| 追加信託差損益金 | △9,192,854,040 | △8,902,300,448 | △8,735,478,994 | △8,455,426,310 | △8,455,426,310 | △8,300,117,716 |
| (配当等相当額) | (540,626,024) | (523,538,748) | (513,728,082) | (497,258,358) | (497,258,358) | (488,124,756) |
| (売買損益相当額) | (△9,733,480,064) | (△9,425,839,196) | (△9,249,207,076) | (△8,952,684,668) | (△8,952,684,668) | (△8,788,242,472) |
| 分配準備積立金 | 213,022,042 | 215,442,296 | 196,447,433 | 213,713,342 | 202,557,854 | 183,432,091 |
| 繰越損益金 | - | - | △174,985,827 | △144,073,521 | △372,996,693 | △320,728,638 |

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

| 種 類 | 第147期末 | | 第153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 | 2,921,605 | | 2,481,137 | |
| | | | 千円 | |
| | | | 3,691,436 | |

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147期末 | | 第153期末 | | 業 種 等 |
|--|---------|--------|-----------|-------------|------------------------|
| | 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 | |
| CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP | — | 2,532 | 5,236 | 147,147 | 耐久消費財・アパレル |
| VALE SA | 2,637 | 2,389 | 14,587 | 409,926 | 素材 |
| COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA (PREF B) | 7,239 | 8,458 | 8,720 | 245,071 | 公益事業 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 2,252 | 1,961 | 7,423 | 208,610 | 公益事業 |
| BANCO DO BRASIL S. A. | 1,599 | 2,988 | 8,111 | 227,943 | 銀行 |
| CIA DE TRANSMISSAO DE ENE-PF | — | 2,585 | 6,376 | 179,189 | 公益事業 |
| ITAUSA SA | 15,573 | 13,672 | 14,205 | 399,212 | 銀行 |
| MARCOPOLO SA-PREF | — | 4,458 | 2,915 | 81,944 | 資本財 |
| GERDAU SA-PREF | 1,649 | 2,108 | 3,983 | 111,945 | 素材 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 2,723 | 2,804 | 10,634 | 298,845 | エネルギー |
| SANTOS BRASIL PARTICIPACOES | 6,607 | 5,658 | 8,210 | 230,724 | 運輸 |
| RANDON PARTICIPACOES SA-PREF | 3,715 | 4,161 | 4,923 | 138,354 | 資本財 |
| BRADSPAR SA -PREF | 2,946 | 2,159 | 4,082 | 114,717 | 素材 |
| CPFL ENERGIA SA | 2,846 | 2,651 | 8,815 | 247,732 | 公益事業 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 4,362 | 3,902 | 13,362 | 375,524 | 銀行 |
| PORTO SEGURO SA | 2,275 | 1,681 | 5,110 | 143,621 | 保険 |
| LOJAS RENNEN S. A. | 3,522 | 3,092 | 4,191 | 117,775 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| SAO MARTINHO SA | 1,866 | 1,684 | 5,289 | 148,656 | 食品・飲料・タバコ |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS | 2,367 | 2,413 | 6,181 | 173,703 | 不動産管理・開発 |
| HYPERA SA | 2,538 | 2,110 | 6,117 | 171,900 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DIRECIONAL ENGENHARIA SA | 3,171 | 1,672 | 4,831 | 135,770 | 耐久消費財・アパレル |
| TELEFONICA BRASIL S. A. | 1,304 | 1,802 | 8,936 | 251,135 | 電気通信サービス |
| ALUPAR INVESTIMENTO SA-UNIT | 2,113 | — | — | — | 公益事業 |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 2,620 | 2,452 | 8,450 | 237,472 | 保険 |
| ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 1,925 | 1,172 | 5,379 | 151,175 | 公益事業 |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 5,141 | 4,633 | 5,231 | 147,015 | 金融サービス |
| NATURA &CO HOLDING SA | 3,426 | 3,024 | 4,545 | 127,740 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CURY CONSTRUTORA E INCORPORA | 4,062 | 3,454 | 7,559 | 212,438 | 耐久消費財・アパレル |
| AUREN ENERGIA SA - ON | 4,106 | — | — | — | 公益事業 |
| TIM SA | 3,213 | 2,896 | 4,901 | 137,747 | 電気通信サービス |
| VIBRA ENERGIA SA | 2,234 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| PRIO SA | 1,627 | 1,442 | 6,448 | 181,208 | エネルギー |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 1,381 | 1,397 | 4,492 | 126,243 | 金融サービス |
| 合 計 | 株 数 | 株 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | 103,054 | 97,427 | 209,254 | 5,880,497 | |
| | 30 | 30 | — | <95.3%> | |

(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17期（決算日 2024年9月25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 |
|------------------|-------------|-----------|--------|-----------|----------------|-------------|--------------|
| | 期騰 | 中落率 | 期騰 | 中落率 | | | |
| 第13期(2020年9月25日) | 円 10,124 | % △0.0 | 10,096 | % △0.0 | % — | % — | 百万円 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 |
| 第16期(2023年9月25日) | 10,111 | △0.0 | 10,087 | △0.0 | — | — | 9,719 |
| 第17期(2024年9月25日) | 10,114 | 0.0 | 10,092 | 0.1 | 54.2 | — | 9,771 |

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

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 |
|----------------------|-------------|--------|--------|--------|----------------|-------------|
| | 騰 | 落率 | 騰 | 落率 | | |
| (当期首) 2023年 9月25日 | 円 10,111 | % — | 10,087 | % — | % — | % — |
| 9月末 | 10,110 | △0.0 | 10,087 | △0.0 | — | — |
| 10月末 | 10,110 | △0.0 | 10,086 | △0.0 | — | — |
| 11月末 | 10,110 | △0.0 | 10,086 | △0.0 | — | — |
| 12月末 | 10,110 | △0.0 | 10,086 | △0.0 | — | — |
| 2024年 1月末 | 10,110 | △0.0 | 10,086 | △0.0 | — | — |
| 2月末 | 10,110 | △0.0 | 10,086 | △0.0 | — | — |
| 3月末 | 10,110 | △0.0 | 10,086 | △0.0 | 55.2 | — |
| 4月末 | 10,108 | △0.0 | 10,087 | 0.0 | 58.6 | — |
| 5月末 | 10,109 | △0.0 | 10,087 | 0.0 | 58.5 | — |
| 6月末 | 10,112 | 0.0 | 10,088 | 0.0 | 61.0 | — |
| 7月末 | 10,107 | △0.0 | 10,089 | 0.0 | 60.5 | — |
| 8月末 | 10,111 | 0.0 | 10,091 | 0.0 | 59.1 | — |
| (当期末) 2024年 9月25日 | 10,114 | 0.0 | 10,092 | 0.1 | 54.2 | — |

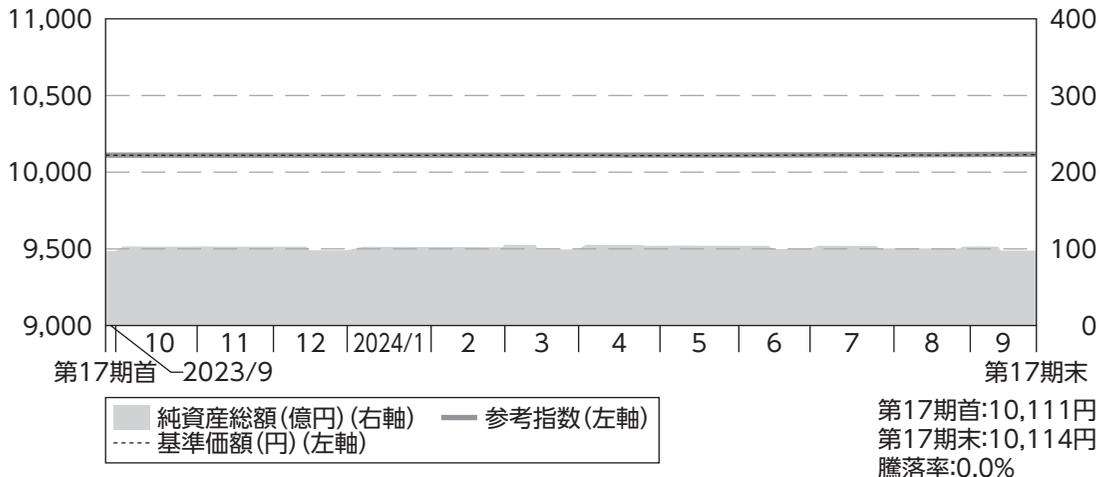
(注1) 騰落率は期首比です。

(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

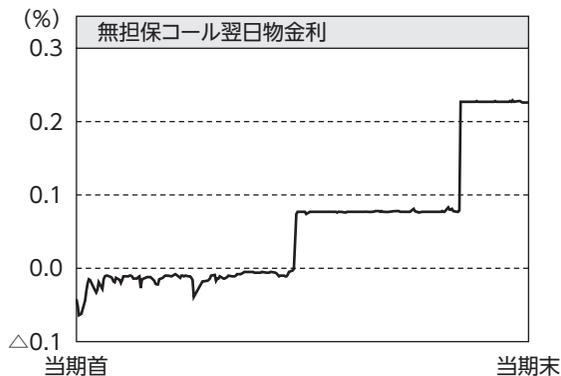


(注)参考指数は、2023年9月25日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀は、2024年3月中旬にかけて「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を継続しましたが、3月19日の金融政策決定会合で、マイナス金利を解除して今後は無担保コール翌日物レートを0~0.1%程度で推移するよう金融調節を行う方針と長短金利操作やリスク資産の買入れ終了を決定しました。その後7月末には政策金利を0.25%程度へ引き上げました。残存1年未満の短期国債利回りは、3月下旬に0.00%近辺に上昇(債券価格は下落)し、7月末の日銀による再利上げ時には一段と上昇する場面もありましたが、8月以降期末にかけては、プラス利回りを維持しながら概ねレンジ内での推移となりました。無担保コール翌日物金利は、3月中旬にかけて△0.09~0.00%で推移し、その後期末にかけては0.07~0.25%で推移しました。このような中、当ファンドは3月中旬までコールローン等での運用を続けましたが、3月下旬にプラス利回りの短期国債への投資を再開しました。再開後期末にかけて、債券組入比率を純資産総額の50~60%程度とし、残りはコールローン等にて運用を行った結果、基準価額は前期末比で概ね同水準となりました。

投資環境



残存1年未満の短期国債利回りは、2024年3月中旬にかけて、日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続されたことから、概ねマイナス圏で推移しました。3月下旬に、日銀のマイナス金利解除決定により利回りは0.00%近辺に上昇し、その後7月末の日銀による再利上げ時には一段と上昇する場面もありましたが、8月以降期末にかけては、プラス利回りを維持しながら概ねレンジ内での推移となりました。無担保コール翌日物金利は、3月中旬にかけて△0.09～0.00%で推移し、その後期末にかけては0.07～0.25%で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

2024年3月中旬にかけて、日銀の金融緩和継続により残存1年未満の短期国債のマイナス利回り推移が続いたことから、コールローン等にて運用を行いました。3月下旬にプラス利回りとなった短期国債への投資を再開し、以降期末にかけて債券組入比率を純資産総額の50～60%程度とし、残りは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

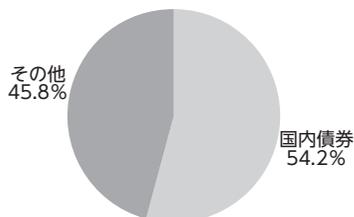
○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国・地域 | 組入比率 |
|----|--------------|------|-------|
| 1 | 第1220回国庫短期証券 | 日本 | 54.2% |
| 2 | ―― | ― | ― |
| 3 | ―― | ― | ― |
| 4 | ―― | ― | ― |
| 5 | ―― | ― | ― |
| 6 | ―― | ― | ― |

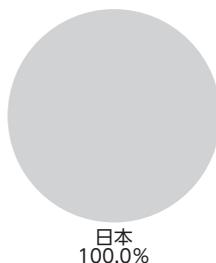
| 順位 | 銘柄名 | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|-----|------|------|
| 7 | ―― | ― | ― |
| 8 | ―― | ― | ― |
| 9 | ―― | ― | ― |
| 10 | ―― | ― | ― |
| 組入銘柄数 | | 1 | |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

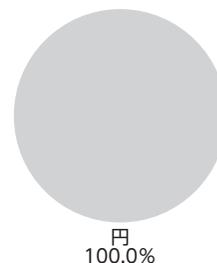
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

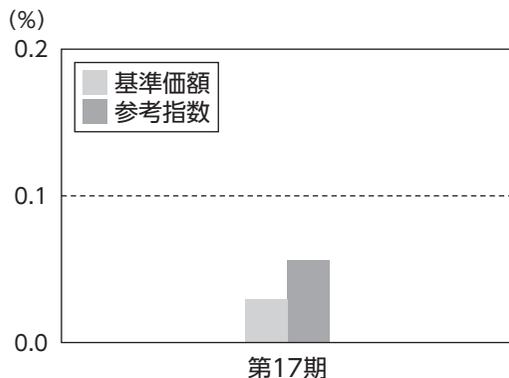


(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

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

| 項目 | 当期 (2023年9月26日~2024年9月25日) | | 項目の概要 |
|--|--|--|---|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 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) | -円 (-) (-) (-) (-) (-) (-) | -% (-) (-) (-) (-) (-) (-) | (a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) 有価証券取引税 (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) | - (-) (-) (-) (-) (-) | - (-) (-) (-) (-) (-) | (b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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 |
| (c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他) | 0 (-) (-) (0) | 0.000 (-) (-) (0.000) | (c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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 |
| 合計 | 0 | 0.000 | |

(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。

(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(10,109円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

| | | 当 期 | |
|----|---------|-----------------|---------------|
| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
| 国内 | 国 債 証 券 | 千円 6,094,511 | 千円 799,566 |

(注)金額は受渡代金です。(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

■ 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 | $\frac{D}{C}$ |
| 金 銭 信 託 | 百万円 146 | 百万円 146 | % 100.0 | 百万円 146 | 百万円 146 | % 100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 1,759,263 | 115,481 | 6.6 | 1,764,505 | 114,540 | 6.5 |

(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。

※ 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

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

| 区 分 | 当 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 | 5,300,000 (5,300,000) | 5,296,676 (5,296,676) | 54.2 (54.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 54.2 (54.2) |
| 合 計 | 5,300,000 (5,300,000) | 5,296,676 (5,296,676) | 54.2 (54.2) | — (—) | — (—) | — (—) | 54.2 (54.2) |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

| 銘 柄 名 | 当 期 | | 末 | | 償還年月日 |
|--------------|---------|--------------|------------|--------------|-----------|
| | 利 率 (%) | 額 面 金 額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 額 面 金 額 (千円) | |
| 国債証券 | | | | | |
| 第1220回国庫短期証券 | — | 5,300,000 | 5,296,676 | | 2025/3/21 |
| 合 計 | | 5,300,000 | 5,296,676 | | |

投資信託財産の構成

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公 社 債 | 5,296,676 | 54.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,477,787 | 45.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 9,774,463 | 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 2024年9月25日現在 |
|-------------------|-----------------------|
| (A)資 産 | 9,774,463,088円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 4,477,759,727 |
| 公 社 債(評価額) | 5,296,676,900 |
| 未 取 利 息 | 26,461 |
| (B)負 債 | 3,270,044 |
| 未 払 解 約 金 | 3,270,044 |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 9,771,193,044 |
| 元 本 | 9,661,226,525 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 109,966,519 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 9,661,226.525口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,114円 |

■損益の状況

| 項 目 | 当 期 自 2023年9月26日 至 2024年9月25日 |
|---------------------|-------------------------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 1,523,467円 |
| 受 取 利 息 | 2,547,412 |
| 支 払 利 息 | △1,023,945 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,731,800 |
| 売 買 益 | 1,731,800 |
| (C)そ の 他 費 用 | △366 |
| (D)当 期 損 益 金(A+B+C) | 3,254,901 |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金 | 106,254,087 |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金 | 31,556,696 |
| (G)解 約 差 損 益 金 | △31,099,165 |
| (H)計 (D+E+F+G) | 109,966,519 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 109,966,519 |

- (注1) (B) 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。
(注2) (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3) (G) 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9,613,014,242円、期中追加設定元本額は2,859,084,492円、期中一部解約元本額は2,810,872,209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) | 4,981,334,207円 |
| DCターゲット・イヤールファンド2025 | 4,441,116,325円 |
| DCターゲット・イヤールファンド2035 | 141,396,961円 |
| DCターゲット・イヤールファンド2045 | 79,487,615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・イヤールファンド2055 | 4,205,305円 |
| FOFs用 短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用) | 3,312,058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。