

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／不動産投信（リート）	
信託期間	2014年5月30日から2024年5月1日まで	
運用方針	NB／MYAM米国リート・インカム・ファンドおよび明治安田マネーブル・マザーファンドへの投資を通じて安定した収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	明治安田米国リート・インカム・プレミアム・ファンド（毎月決算型）	NB／MYAM米国リート・インカム・ファンドおよび明治安田マネーブル・マザーファンドを主要投資対象とします。
	明治安田マネーブル・マザーファンド	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
組入制限	明治安田米国リート・インカム・プレミアム・ファンド（毎月決算型）	株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	明治安田マネーブル・マザーファンド	株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎月1日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として以下の方針に基づいて、収益の分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

明治安田米国リート・インカム・プレミアム・ファンド(毎月決算型)

愛称:スリーピース

運用報告書（全体版）

第105期（決算日	2023年3月1日）
第106期（決算日	2023年4月3日）
第107期（決算日	2023年5月1日）
第108期（決算日	2023年6月1日）
第109期（決算日	2023年7月3日）
第110期（決算日	2023年8月1日）

受益者のみなさまへ

平素は「明治安田米国リート・インカム・プレミアム・ファンド（毎月決算型）」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

さて、当ファンドは、第105期から第110期までの決算を行いましたので、当期間の運用状況につきましてご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

MYAM 明治安田アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目3番2号
ホームページ <https://www.myam.co.jp/>

〈運用報告書のお問い合わせ先〉
サポートデスク 0120-565787
(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

○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 組 入 比	純 資 産 額
		(分配落)	税 分 配 金	み 騰 落	期 中 率				
		円	円	%	%	%	百万円		
第15作成期	81期(2021年3月1日)	2,985	30	1.4	0.4	98.5	5,363		
	82期(2021年4月1日)	3,127	30	5.8	0.5	98.4	5,446		
	83期(2021年5月6日)	3,219	30	3.9	0.5	98.8	5,509		
	84期(2021年6月1日)	3,238	30	1.5	0.5	98.7	5,522		
	85期(2021年7月1日)	3,267	30	1.8	0.5	98.5	5,307		
	86期(2021年8月2日)	3,343	30	3.2	0.5	98.5	5,170		
第16作成期	87期(2021年9月1日)	3,379	30	2.0	0.5	98.7	4,962		
	88期(2021年10月1日)	3,179	30	△ 5.0	0.6	97.7	4,599		
	89期(2021年11月1日)	3,637	30	15.4	0.5	97.4	5,022		
	90期(2021年12月1日)	3,586	30	△ 0.6	0.6	98.4	4,784		
	91期(2022年1月4日)	3,849	30	8.2	0.5	98.8	5,045		
	92期(2022年2月1日)	3,652	30	△ 4.3	0.6	97.5	4,776		
第17作成期	93期(2022年3月1日)	3,488	30	△ 3.7	0.6	98.9	4,492		
	94期(2022年4月1日)	3,742	30	8.1	0.5	98.0	4,812		
	95期(2022年5月2日)	3,888	30	4.7	0.5	98.9	4,933		
	96期(2022年6月1日)	3,543	30	△ 8.1	0.4	98.4	4,447		
	97期(2022年7月1日)	3,384	30	△ 3.6	0.4	97.8	4,218		
	98期(2022年8月1日)	3,506	30	4.5	0.4	97.1	4,351		
第18作成期	99期(2022年9月1日)	3,400	30	△ 2.2	0.5	97.1	4,194		
	100期(2022年10月3日)	3,096	30	△ 8.1	0.5	97.6	3,785		
	101期(2022年11月1日)	3,218	30	4.9	0.6	97.4	3,942		
	102期(2022年12月1日)	3,129	30	△ 1.8	0.7	97.3	3,831		
	103期(2023年1月4日)	2,860	30	△ 7.6	0.7	98.0	3,462		
	104期(2023年2月1日)	2,947	30	4.1	0.5	97.6	3,735		
第19作成期	105期(2023年3月1日)	2,891	30	△ 0.9	0.6	98.3	3,632		
	106期(2023年4月3日)	2,775	30	△ 3.0	0.5	97.6	3,473		
	107期(2023年5月1日)	2,794	30	1.8	0.5	98.1	3,470		
	108期(2023年6月1日)	2,764	30	0.0	0.7	98.4	3,415		
	109期(2023年7月3日)	2,907	30	6.3	0.5	98.6	3,585		
	110期(2023年8月1日)	2,874	30	△ 0.1	0.5	97.9	3,521		

(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。

(注3) 当ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式により、米国の不動産投資信託(リート)の中でも相対的に高い配当利回りを有するリートに投資するとともに、国内短期金融資産に投資を行います。特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、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	騰 落 率		債 組 入 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	託 券 率
第105期	(期 首) 2023年2月1日	円 2,947		% —		% 0.5		% 97.6
	2月末	2,922		△0.8		0.6		97.2
	(期 末) 2023年3月1日	2,921		△0.9		0.6		98.3
第106期	(期 首) 2023年3月1日	2,891		—		0.6		98.3
	3月末	2,751		△4.8		0.5		96.4
	(期 末) 2023年4月3日	2,805		△3.0		0.5		97.6
第107期	(期 首) 2023年4月3日	2,775		—		0.5		97.6
	4月末	2,775		0.0		0.5		97.3
	(期 末) 2023年5月1日	2,824		1.8		0.5		98.1
第108期	(期 首) 2023年5月1日	2,794		—		0.5		98.1
	5月末	2,773		△0.8		0.6		97.4
	(期 末) 2023年6月1日	2,794		0.0		0.7		98.4
第109期	(期 首) 2023年6月1日	2,764		—		0.7		98.4
	6月末	2,928		5.9		0.5		97.5
	(期 末) 2023年7月3日	2,937		6.3		0.5		98.6
第110期	(期 首) 2023年7月3日	2,907		—		0.5		98.6
	7月末	2,866		△1.4		0.5		97.1
	(期 末) 2023年8月1日	2,904		△0.1		0.5		97.9

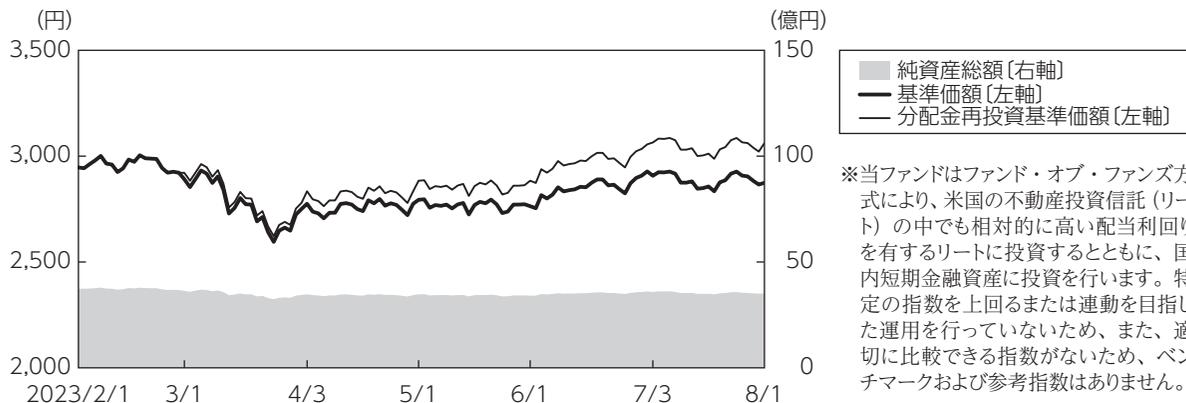
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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。

(注3) 当ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式により、米国の不動産投資信託(リート)の中でも相対的に高い配当利回りを有するリートに投資するとともに、国内短期金融資産に投資を行います。特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、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。

運用経過の説明

■ 基準価額等の推移



※当ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式により、米国の不動産投資信託(リート)の中でも相対的に高い配当利回りを有するリートに投資するとともに、国内短期金融資産に投資を行います。特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、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。

第105期首(2023年2月1日):2,947円

第110期末(2023年8月1日):2,874円(既払分配金180円)

騰落率:3.9%(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、税引前の分配金を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。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客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により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に従い、NB/MY AM米国リート・インカム・ファンド(以下、外国投資信託証券とすることがあります。)への投資を通じて、米国を中心とする金融商品取引所に上場または店頭登録されている不動産投資信託(リート)等へ投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

組み入れている外国投資信託証券の基準価額(分配金再投資ベース)が上昇したことにより、当ファンドの基準価額は上昇しました。

■ 投資環境

米国リート

当作成期の米国リート相場は下落しました。米国で預金流出が加速した中堅銀行が破綻するなど、欧米で金融システム不安が強まる中、FOMC（米連邦公開市場委員会）では利上げが継続されたことから下落しました。その後作成期末にかけては、米国債務上限問題を巡る与野党合意形成や主要企業の底堅い4～6月期決算などが投資家心理の改善につながり、下落幅は縮小しました。セクター別では、株式相場でハイテク株が堅調となり、関連するデータ・センターが好調に推移しました。一方で、通信タワー等を運営するインフラ関連が相対的に軟調に推移しました。顧客である大手通信企業が、有毒な鉛で覆われたケーブルを全米に展開しているとの報道などが重石となりました。

外国為替

当作成期の米ドルは円に対して上昇しました。作成期首より、米国CPI（消費者物価指数）が高止まる中、米国長期金利の上昇を背景に米ドルは上昇基調で始まりました。2023年3月には米国中堅銀行やスイス大手投資銀行を巡る信用リスクの高まりから安全資産選好が強まり円が買われ、米ドルは下落する展開となりました。しかし、その後は米国景気が堅調なことから金融引き締め継続観測が広がり、7月にかけては上昇基調となりました。7月末近くには日銀のイールドカーブ・コントロールの運用柔軟化により日本の金利が上昇したことから下落する場面もありましたが、下げ幅は限定的でした。

■ 当該投資信託のポートフォリオ

明治安田米国リート・インカム・プレミアム・ファンド（毎月決算型）

作成期首の運用方針に基づき、外国投資信託証券への投資比率を高位に保ちました。また、明治安田マネープール・マザーファンドを組み入れた運用を行いました。

外国投資信託証券

外国投資信託証券の当作成期末（8月1日〔現地日付：7月31日〕）時点でのポートフォリオについて、投資顧問会社であるニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシーおよびクレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッドより提供された情報等を基に明治安田アセットマネジメントが作成しています。

安定的なキャッシュ・フロー創出能力を有し相対的に高い利回りが期待される銘柄に着目し、銘柄選択を行いました。期中の主要な売買としては、ヘルスピーク・プロパティーズ、ハイウッズ・プロパティーズを購入し、アースタット・ビドル・プロパティーズなどを一部売却、ボルネード・リアルティ・トラストを全売却しました。

また、カバードコール戦略においては組入外貨建資産に対して米国リート戦略および通貨戦略ともに概ね50%のコールオプションを売却しています。

以上の運用を行った結果、外国投資信託証券の基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。主な変動要因は以下の通りです。

(上昇要因)

- ・米ドルが円に対して上昇したこと
- ・オプション取引を組み合わせたカバードコール戦略(米国リート戦略、通貨戦略)においてオプションプレミアム収益を獲得できたこと

(下落要因)

- ・米国リート相場が下落したこと
- ・米ドルが円に対して上昇したことでカバードコール戦略(通貨戦略)による損失が発生したこと

【組入上位10銘柄】

作成期首

	銘柄名	組入比率
1	クラウン・キャッスル	9.0%
2	アメリカン・タワー	7.6%
3	プロロジス	5.9%
4	サイモン・プロパティ・グループ	5.5%
5	エクストラ・スペース・ストレージ	4.8%
6	デジタル・リアルティ・トラスト	4.0%
7	アパートメント・インカム・リート	3.6%
8	エクイティ・レジデンシャル	3.5%
9	オメガ・ヘルスケア・インベスターズ	3.3%
10	VICIプロパティーズ	3.3%

※組入比率は米国リート資産（現金等を含む）に対する割合。

作成期末

	銘柄名	組入比率
1	クラウン・キャッスル	7.4%
2	アメリカン・タワー	7.3%
3	サイモン・プロパティ・グループ	7.2%
4	プロロジス	6.4%
5	デジタル・リアルティ・トラスト	4.9%
6	エクストラ・スペース・ストレージ	4.8%
7	オメガ・ヘルスケア・インベスターズ	4.5%
8	アパートメント・インカム・リート	4.1%
9	エクイティ・レジデンシャル	4.1%
10	アイアンマウンテン	3.7%

【用途別組入状況】

作成期首

	用途名	組入比率
1	インフラ	16.5%
2	集合住宅	9.8%
3	医療関連施設	9.7%
4	産業施設	9.1%
5	個人用倉庫	8.0%
6	ショッピング・センター	7.7%
7	データ・センター	6.3%
8	特殊用途設備	6.3%
9	モール型商業施設	5.5%
10	その他	18.1%

作成期末

	用途名	組入比率
1	インフラ	14.6%
2	集合住宅	11.5%
3	医療関連施設	10.8%
4	産業施設	10.1%
5	個人用倉庫	8.1%
6	モール型商業施設	7.2%
7	データ・センター	6.6%
8	その他商業施設	6.0%
9	ショッピング・センター	5.6%
10	その他	17.4%

※組入比率は米国リート資産（現金等を含む）に対する割合のため合計値が100%になりません。

※用途名はF T S Eと全米不動産投資信託協会（NAREIT）の分類によるものです。

【コールオプションのポートフォリオ概況】(現地日付：7月31日)

対象資産	米国リート	通貨
オプション・プレミアム※1	11.7%	6.0%
カバー率※2	50.6%	50.6%

※原則として、約定基準でのカバー率は50%、権利行使価格は対象資産に対して100%の水準でオプションを構築しています。

※1 オプション・プレミアム(約定基準)は当該時点のカバー率を適用した年率調整後のプレミアム収入です。

※2 カバー率は、当該時点の組入れ外貨建て資産に対するオプションのポジションです。

明治安田マネープール・マザーファンド

作成期首の運用方針に基づき、安定した収益の確保を目指して残存期間が比較的短い政府保証債を組み入れた運用を行いました。

■ 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式により、米国の不動産投資信託(リート)の中でも相対的に高い配当利回りを有するリートに投資するとともに、国内短期金融資産に投資を行います。特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、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。

■ 分配金

- ・ 収益分配については、分配対象額の水準、基準価額水準等を勘案し、次表の通りといたしました。
- ・ 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり、税引前)

項目	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期
	2023年2月2日～ 2023年3月1日	2023年3月2日～ 2023年4月3日	2023年4月4日～ 2023年5月1日	2023年5月2日～ 2023年6月1日	2023年6月2日～ 2023年7月3日	2023年7月4日～ 2023年8月1日
当期分配金	30	30	30	30	30	30
(対基準価額比率)	1.027	1.070	1.062	1.074	1.021	1.033
当期の収益	30	30	30	30	30	30
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,740	1,745	1,750	1,755	1,762	1,767

(注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)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2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

明治安田米国リート・インカム・プレミアム・ファンド (毎月決算型)

引き続き、外国投資信託証券および明治安田マネープール・マザーファンドに投資します。外国投資信託証券への投資比率を高位に保つ方針です。

外国投資信託証券

①米国リート戦略においては、引き続き、米国の不動産投資信託（リート）の中でも相対的に高い配当利回りを有するリートに実質的に投資する予定です。経営陣の質や、市場における競争力、財務体質の健全性などを分析して銘柄選定することで、中長期的に魅力ある運用成果の実現が可能と考えます。その中でも特に、持続可能なキャッシュ・フローおよび強力で柔軟な財務体質を持つ銘柄に着目し、魅力的なトータルリターンの獲得を目指します。

②カバードコール戦略においては、カバー率*を原則50%程度とし、インカム収益とオプションプレミアムの獲得に加え、米国リーートの値上がり益と米ドル高（円安）による為替差益の享受も目指します。

*外国投資信託証券における保有資産（純資産総額）に対するコールオプションのポジションの割合。

③当該外国投資信託における米国リーートの運用は、ニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシーが行います。米国リートオプション取引および通貨オプション取引（カバードコール戦略）の運用は、クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッドが行います。

明治安田マネープール・マザーファンド

引き続き、運用の基本方針に基づき、安定した収益の確保を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 2 月 2 日～2023年 8 月 1 日)

項 目	第105期～第110期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 16	% 0.562	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×作成期末の信託報酬率
(投 信 会 社)	(6)	(0.218)	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
(販 売 会 社)	(9)	(0.327)	購入後の情報提供、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等の対価
(受 託 会 社)	(0)	(0.016)	ファンド財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.003	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合 計	16	0.565	
作成期間の平均基準価額は、2,835円です。			

(注1) 作成期間の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により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、その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

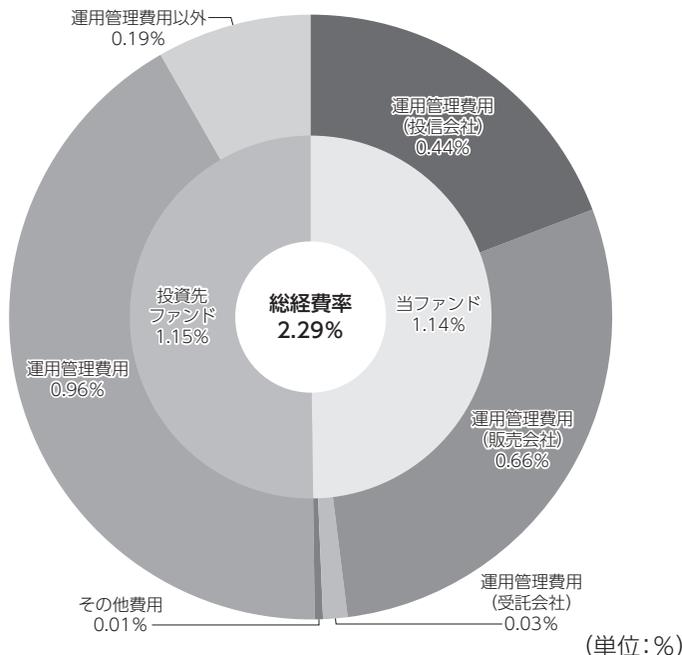
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)が支払った費用を含みません。

(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

作成期間の運用・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。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.29%です。



総経費率(①+②+③)	2.29
①当ファンドの費用の比率	1.14
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.96
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.19

(注) 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) 各費用は、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。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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) 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) 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) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年2月2日～2023年8月1日)

投資信託証券

銘 柄		第105期～第110期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	NB/MYAM US REIT Income Fund	口 —	千円 —	口 322,324,476	千円 70,000

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未满是切り捨て。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄		第105期～第110期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	明治安田マネープール・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 10,008	千円 10,000

(注) 単位未满是切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月2日～2023年8月1日)

該当事項はございません。

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。

○組入資産の明細

(2023年8月1日現在)

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

銘 柄		第18作成期末	第19作成期末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
	NB/MYAM US REIT Income Fund	口 15,575,211,415	口 15,252,886,939	千円 3,445,627	% 97.9
	合 計	15,575,211,415	15,252,886,939	3,445,627	97.9

(注1) 単位未满是切り捨て。

(注2) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

親投資信託残高

銘 柄	第18作成期末	第19作成期末	
	口 数	口 数	評 価 額
明治安田マネープール・マザーファンド	千口 29,892	千口 19,884	千円 19,866

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年8月1日現在)

項 目	第19作成期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 3,445,627	% 96.5
明治安田マネープール・マザーファンド	19,866	0.6
コール・ローン等、その他	106,488	2.9
投資信託財産総額	3,571,981	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第105期末	第106期末	第107期末	第108期末	第109期末	第110期末
	2023年3月1日現在	2023年4月3日現在	2023年5月1日現在	2023年6月1日現在	2023年7月3日現在	2023年8月1日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	3,684,474,020	3,515,843,612	3,512,362,132	3,459,217,030	3,633,205,614	3,571,981,704
コール・ローン等	84,770,195	97,608,390	77,154,217	67,209,346	69,931,009	106,488,175
投資信託受益証券(評価額)	3,569,838,456	3,388,366,863	3,405,339,556	3,362,136,336	3,533,406,246	3,445,627,159
明治安田マネーボール・マザーファンド(評価額)	29,865,369	29,868,359	29,868,359	29,871,348	29,868,359	19,866,370
(B) 負債	51,600,579	42,512,699	41,619,699	43,476,964	48,196,440	50,746,479
未払収益分配金	37,696,161	37,545,814	37,265,553	37,072,727	36,992,088	36,760,496
未払解約金	10,640,451	1,393,795	1,357,654	3,088,602	7,701,394	10,792,778
未払信託報酬	3,243,416	3,550,734	2,976,434	3,297,023	3,485,850	3,177,474
未払利息	—	—	—	196	198	316
その他未払費用	20,551	22,356	20,058	18,416	16,910	15,415
(C) 純資産総額(A－B)	3,632,873,441	3,473,330,913	3,470,742,433	3,415,740,066	3,585,009,174	3,521,235,225
元本	12,565,387,091	12,515,271,347	12,421,851,316	12,357,575,879	12,330,696,320	12,253,498,931
次期繰越損益金	△ 8,932,513,650	△ 9,041,940,434	△ 8,951,108,883	△ 8,941,835,813	△ 8,745,687,146	△ 8,732,263,706
(D) 受益権総口数	12,565,387,091口	12,515,271,347口	12,421,851,316口	12,357,575,879口	12,330,696,320口	12,253,498,931口
1万口当たり基準価額(C/D)	2,891円	2,775円	2,794円	2,764円	2,907円	2,874円

(注1) 当ファンドの第105期首元本額は12,675,362,478円、第105～110期中追加設定元本額は448,232,073円、第105～110期中一部解約元本額は870,095,620円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第105期0.2891円、第106期0.2775円、第107期0.2794円、第108期0.2764円、第109期0.2907円、第110期0.2874円です。

(注3) 純資産総額が元本額を下回っており、その額は第105期8,932,513,650円、第106期9,041,940,434円、第107期8,951,108,883円、第108期8,941,835,813円、第109期8,745,687,146円、第110期8,732,263,706円です。

○損益の状況

項 目	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期
	2023年2月2日～ 2023年3月1日	2023年3月2日～ 2023年4月3日	2023年4月4日～ 2023年5月1日	2023年5月2日～ 2023年6月1日	2023年6月2日～ 2023年7月3日	2023年7月4日～ 2023年8月1日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	46,600,155	46,617,402	46,083,210	46,136,970	46,185,609	45,948,831
受取配当金	46,600,155	46,617,402	46,083,210	46,139,283	46,188,887	45,951,787
受取利息	—	—	—	—	—	55
支払利息	—	—	—	△ 2,313	△ 3,278	△ 3,011
(B) 有価証券売買損益	△ 76,161,974	△ 149,802,875	17,404,581	△ 42,814,439	170,606,793	△ 47,161,818
売買益	239,164	1,429,478	17,409,091	382,871	171,279,583	90,453,184
売買損	△ 76,401,138	△ 151,232,353	△ 4,510	△ 43,197,310	△ 672,790	△ 137,615,002
(C) 信託報酬等	△ 3,263,967	△ 3,573,090	△ 2,995,898	△ 3,314,997	△ 3,502,760	△ 3,192,889
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	△ 32,825,786	△ 106,758,563	60,491,893	7,534	213,289,642	△ 4,405,876
(E) 前期繰越損益金	△4,563,642,053	△4,589,015,222	△4,668,623,006	△4,598,132,048	△4,602,255,794	△4,349,849,727
(F) 追加信託差損益金	△4,298,349,650	△4,308,620,835	△4,305,712,217	△4,306,638,572	△4,319,728,906	△4,341,247,607
(配当等相当額)	(1,322,151,785)	(1,321,944,163)	(1,317,546,377)	(1,315,078,895)	(1,316,505,229)	(1,317,979,713)
(売買損益相当額)	(△5,620,501,435)	(△5,630,564,998)	(△5,623,258,594)	(△5,621,717,467)	(△5,636,234,135)	(△5,659,227,320)
(G) 計 (D+E+F)	△8,894,817,489	△9,004,394,620	△8,913,843,330	△8,904,763,086	△8,708,695,058	△8,695,503,210
(H) 収益分配金	△ 37,696,161	△ 37,545,814	△ 37,265,553	△ 37,072,727	△ 36,992,088	△ 36,760,496
次期繰越損益金 (G+H)	△8,932,513,650	△9,041,940,434	△8,951,108,883	△8,941,835,813	△8,745,687,146	△8,732,263,706
追加信託差損益金	△4,298,349,650	△4,308,620,835	△4,305,712,217	△4,306,638,572	△4,319,728,906	△4,341,247,607
(配当等相当額)	(1,322,151,805)	(1,321,944,188)	(1,317,546,391)	(1,315,078,913)	(1,316,505,261)	(1,317,979,730)
(売買損益相当額)	(△5,620,501,455)	(△5,630,565,023)	(△5,623,258,608)	(△5,621,717,485)	(△5,636,234,167)	(△5,659,227,337)
分配準備積立金	865,116,921	862,308,903	857,331,475	854,484,130	856,945,420	848,405,619
繰越損益金	△5,499,280,921	△5,595,628,502	△5,502,728,141	△5,489,681,371	△5,282,903,660	△5,239,421,718

- (注1) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注3) 損益の状況の中で(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4) 第105期計算期間末における費用控除後の配当等収益(43,346,594円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,322,151,805円)および分配準備積立金(859,466,488円)より分配対象収益は2,224,964,887円(10,000口当たり1,770円)であり、うち37,696,161円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注5) 第106期計算期間末における費用控除後の配当等収益(43,053,997円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,321,944,188円)および分配準備積立金(856,800,720円)より分配対象収益は2,221,798,905円(10,000口当たり1,775円)であり、うち37,545,814円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注6) 第107期計算期間末における費用控除後の配当等収益(43,916,701円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,317,546,391円)および分配準備積立金(850,680,327円)より分配対象収益は2,212,143,419円(10,000口当たり1,780円)であり、うち37,265,553円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注7) 第108期計算期間末における費用控除後の配当等収益(42,831,169円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,315,078,913円)および分配準備積立金(848,725,688円)より分配対象収益は2,206,635,770円(10,000口当たり1,785円)であり、うち37,072,727円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注8) 第109期計算期間末における費用控除後の配当等収益(45,452,207円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,316,505,261円)および分配準備積立金(848,485,301円)より分配対象収益は2,210,442,769円(10,000口当たり1,792円)であり、うち36,992,088円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注9) 第110期計算期間末における費用控除後の配当等収益(42,764,015円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,317,979,730円)および分配準備積立金(842,402,100円)より分配対象収益は2,203,145,845円(10,000口当たり1,797円)であり、うち36,760,496円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。

○分配金のお知らせ

	第105期	第106期	第107期	第108期	第109期	第110期
1万口当たり分配金(税込)	30円	30円	30円	30円	30円	30円

※分配金をお支払する場合

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。

※分配金を再投資する場合

お手取り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいてみなさまの口座に繰入れて再投資いたしました。

課税上の取扱いについて
○分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、普通分配金と元本払戻金(特別分配金)に分かれます。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ます。また、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分が普通分配金となります。
○元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。
○課税上の取扱いの詳細については、税務署等にお問い合わせください。

○(参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2023年8月1日現在)

<明治安田マネープール・マザーファンド>

下記は、明治安田マネープール・マザーファンド全体(9,609,427千口)の内容です。

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第19作成期末							
	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)	8,187,000	8,219,843	85.6	—	—	—	85.6	
合 計	8,187,000	8,219,843	85.6	—	—	—	85.6	

(注1) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) 一印は組み入れなし。

(注4) 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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	第19作成期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
政府保証第28回日本政策投資銀行債券		0.45	100,000	100,612	2025/3/13
政府保証第52回日本政策投資銀行債券		0.001	200,000	199,838	2025/1/24
政府保証第197回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.835	136,000	136,092	2023/8/31
政府保証第200回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.801	400,000	400,520	2023/9/29
政府保証第202回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.699	115,000	115,202	2023/10/31
政府保証第207回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.693	192,000	192,541	2023/12/28
政府保証第213回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.645	200,000	200,850	2024/3/29
政府保証第218回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.66	234,000	235,425	2024/5/31
政府保証第220回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	100,000	100,572	2024/6/28
政府保証第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.601	361,000	363,133	2024/7/31
政府保証第225回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.556	500,000	502,920	2024/8/30
政府保証第227回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.544	379,000	381,330	2024/9/30
政府保証第229回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.539	117,000	117,749	2024/10/31
政府保証第231回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.495	300,000	301,830	2024/11/29
政府保証第236回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.32	110,000	110,436	2025/1/31
政府保証第241回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.45	200,000	201,244	2025/3/31
政府保証第51回地方公共団体金融機構債券		0.835	400,000	400,120	2023/8/14
政府保証第52回地方公共団体金融機構債券		0.801	400,000	400,392	2023/9/15
政府保証第53回地方公共団体金融機構債券		0.699	121,000	121,171	2023/10/13
政府保証第54回地方公共団体金融機構債券		0.669	105,000	105,208	2023/11/17
政府保証第55回地方公共団体金融機構債券		0.693	100,000	100,267	2023/12/18
政府保証第56回地方公共団体金融機構債券		0.747	100,000	100,358	2024/1/19
政府保証第57回地方公共団体金融機構債券		0.66	239,000	239,877	2024/2/16
政府保証第58回地方公共団体金融機構債券		0.645	100,000	100,424	2024/3/15
政府保証第59回地方公共団体金融機構債券		0.669	400,000	401,868	2024/4/12
政府保証第60回地方公共団体金融機構債券		0.66	241,000	242,279	2024/5/21
政府保証第63回地方公共団体金融機構債券		0.556	694,000	697,907	2024/8/16
政府保証第64回地方公共団体金融機構債券		0.544	600,000	603,546	2024/9/13
政府保証第65回地方公共団体金融機構債券		0.539	100,000	100,626	2024/10/16
政府保証第66回地方公共団体金融機構債券		0.495	113,000	113,681	2024/11/18
政府保証第67回地方公共団体金融機構債券		0.466	100,000	100,582	2024/12/13
政府保証第31回日本政策金融公庫債券		0.544	100,000	100,591	2024/9/13
政府保証第56回日本政策金融公庫債券		0.001	130,000	129,870	2025/2/21
政府保証第16回民間都市開発債券		0.699	500,000	500,775	2023/10/20
合	計		8,187,000	8,219,843	

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<組入れ投資信託証券の内容>

当ファンドの運用報告書作成時点において入手可能な直前計算期間の年次報告書等をもとに組入れ投資信託証券の組入資産明細表および包括利益計算書を作成、掲載しております。

◎組入資産明細表

組入上位10銘柄

2022年12月31日現在

	銘柄名	国	通貨	評価額 (米ドル建)	組入比率 (%)
1	Crown Castle Inc.	アメリカ	米ドル	2,332,194.16	9.0
2	American Tower Corporation	アメリカ	米ドル	2,047,203.18	7.9
3	Prologis, Inc.	アメリカ	米ドル	1,464,362.70	5.6
4	Simon Property Group, Inc.	アメリカ	米ドル	1,417,396.20	5.5
5	Extra Space Storage Inc.	アメリカ	米ドル	1,276,492.14	4.9
6	Digital Realty Trust, Inc.	アメリカ	米ドル	1,002,098.38	3.9
7	Apartment Income REIT Corp	アメリカ	米ドル	925,889.66	3.6
8	Equity Residential	アメリカ	米ドル	919,692.00	3.5
9	Omega Healthcare Investors, Inc.	アメリカ	米ドル	900,744.65	3.5
10	VICI Properties Inc	アメリカ	米ドル	889,444.80	3.4

※組入比率は米国リート資産（現金等を含む）に対する割合。

◎包括利益計算書

2022年12月31日に終了した年度

(単位：円)

収益

損益を公正価値で測定した金融商品による純益

受取配当金	169,828,037
コールオプション取引益 (損)	(255,447,801)
投資に対する純益 (損)	(634,355,683)
	<u>(719,975,447)</u>

受取利息

60,844,651

外貨建取引による純実現益 (損)

10,100,788

収益 (損失) 合計

(649,030,008)

費用

投資運用報酬

21,053,392

コールオプション取引に係わる費用

736,326

報酬代行会社報酬

8,469,623

その他費用

8,282,163

管理事務代行および保管報酬

12,222,962

費用合計

50,764,466

税引前運用利益 (損失)

(699,794,474)

源泉徴収税

(50,948,286)

運用による純資産の増減額

(750,742,760)

明治安田マネープール・マザーファンド

運用報告書

第11期

(決算日 2022年10月17日)

「明治安田マネープール・マザーファンド」は、2022年10月17日に第11期決算を行いました。
以下、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。

◎最近5期の運用実績

決算期	基準 価 額	期 中 騰 落 率		債券組入比率	純資産総額
		円	%		
(第7期) 2018年10月15日	10,021	△0.1	%	72.4	1,708
(第8期) 2019年10月15日	10,016	△0.0	%	74.6	1,707
(第9期) 2020年10月15日	10,009	△0.1	%	71.9	2,306
(第10期) 2021年10月15日	10,002	△0.1	%	84.8	2,279
(第11期) 2022年10月17日	9,994	△0.1	%	73.4	8,273

(注)当ファンドは、国内短期金融資産への投資を通じて安定的な収益の確保を目指して運用を行います。運用方針に対し適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準 価 額	騰 落 率		債券組入比率
		円	%	
(期首) 2021年10月15日	10,002	—	%	84.8
10月末	10,002	0.0	%	84.8
11月末	10,001	△0.0	%	96.4
12月末	10,001	△0.0	%	85.7
2022年 1月末	10,001	△0.0	%	89.4
2月末	10,001	△0.0	%	83.4
3月末	10,000	△0.0	%	82.9
4月末	10,000	△0.0	%	82.8
5月末	10,000	△0.0	%	65.0
6月末	9,999	△0.0	%	53.5
7月末	9,999	△0.0	%	56.1
8月末	9,997	△0.0	%	64.2
9月末	9,994	△0.1	%	94.5
(期末) 2022年10月17日	9,994	△0.1	%	73.4

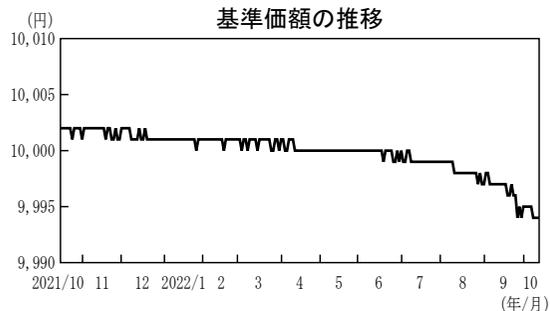
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)当ファンドは、国内短期金融資産への投資を通じて安定的な収益の確保を目指して運用を行います。運用方針に対し適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2021年10月16日～2022年10月17日)

1 基準価額

基準価額の推移と主な変動要因



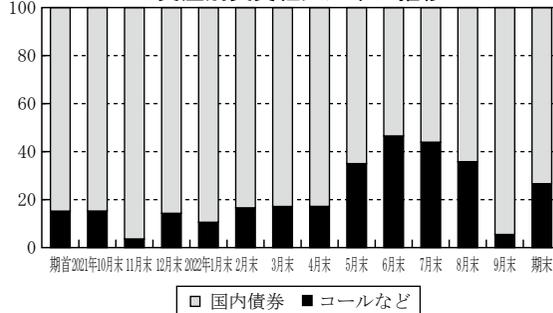
基準価額は期首10,002円で始まり、期末9,994円で終わりました。騰落率は△0.08%でした。この主な要因としては、組み入れていた政府保証債の金利相当分の収益が基準価額に対してプラスに寄与した一方、短期金利がマイナス圏で推移し時価が下落したことがマイナスに影響しました。

2 運用経過

運用概況

当マザーファンドは、国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融商品を主要投資対象としています。海外の主要中央銀行がインフレに対処するため金融引き締め政策を進める一方、日本銀行は、賃金の安定的な上昇を伴う形で物価安定目標の持続的・安定的な実現に向けて、緩和的な金融政策を続けました。こうした環境下で短期金利がマイナスで推移する中、期首の運用の基本方針に従い、政府保証債を組み入れた運用を行いました。

資産別実質組入比率の推移



※純資産総額に対する割合

3 今後の運用方針

引き続き、運用の基本方針に従い運用を行います。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2021年10月16日～2022年10月17日		
	金額	比率	
(a) その他費用	3円	0.028%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 ※期中の平均基準価額は9,999円です。
(その他)	(3)	(0.028)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合計	3	0.028	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

◎売買及び取引の状況(2021年10月16日～2022年10月17日)

○公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	特殊債券	5,374,699	— (1,221,000)

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は償還等による増減分です。

◎利害関係人との取引状況等(2021年10月16日～2022年10月17日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(注) 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。

◎組入資産明細表

○国内(邦貨建)公社債(種類別)

区 分	当		期		末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 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)	6,035,000	6,070,596	73.4	—	—	—	73.4
合 計	6,035,000	6,070,596	73.4	—	—	—	73.4

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2)単位未満は切り捨て。

(注3)－印は組み入れなし。

(注4)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。

○国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

銘 柄 名	当		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))						
政府保証第20回日本政策投資銀行債券	2.0	100,000	100,347	2022/12/19		
政府保証第19回日本政策投資銀行社債	0.668	100,000	100,280	2023/ 3/15		
政府保証第175回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	300,000	300,090	2022/10/31		
政府保証第180回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	100,000	100,148	2022/12/28		
政府保証第182回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	500,000	501,235	2023/ 1/31		
政府保証第189回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	600,000	601,776	2023/ 4/28		
政府保証第193回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	143,000	143,905	2023/ 6/30		
政府保証第197回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.835	136,000	137,011	2023/ 8/31		
政府保証第200回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	300,000	302,340	2023/ 9/29		
政府保証第218回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.66	234,000	236,438	2024/ 5/31		
政府保証第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	161,000	162,666	2024/ 7/31		
政府保証第227回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	266,000	268,660	2024/ 9/30		
政府保証第43回地方公共団体金融機構債券	0.734	400,000	400,492	2022/12/16		
政府保証第44回地方公共団体金融機構債券	0.834	100,000	100,221	2023/ 1/20		
政府保証第45回地方公共団体金融機構債券	0.815	400,000	401,124	2023/ 2/17		
政府保証第53回地方公共団体金融機構債券	0.699	121,000	121,859	2023/10/13		
政府保証第55回地方公共団体金融機構債券	0.693	100,000	100,834	2023/12/18		
政府保証第56回地方公共団体金融機構債券	0.747	100,000	100,964	2024/ 1/19		
政府保証第57回地方公共団体金融機構債券	0.66	239,000	241,151	2024/ 2/16		
政府保証第58回地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	100,922	2024/ 3/15		
政府保証第60回地方公共団体金融機構債券	0.66	241,000	243,489	2024/ 5/21		
政府保証第63回地方公共団体金融機構債券	0.556	694,000	700,724	2024/ 8/16		
政府保証第25回日本政策金融公庫債券	0.815	100,000	100,297	2023/ 2/24		
政府保証第16回民間都市開発債券	0.699	500,000	503,620	2023/10/20		
合 計		6,035,000	6,070,596			

(注)額面・評価額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	6,070,596	73.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,203,467	26.6
投 資 信 託 財 産 総 額	8,274,063	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,274,063,740円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,196,465,664
公 社 債(評価額)	6,070,596,150
未 収 利 息	3,839,358
前 払 費 用	3,162,568
(B) 負 債	187,672
未 払 解 約 金	80,000
そ の 他 未 払 費 用	107,672
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,273,876,068
元 本	8,278,638,535
次 期 繰 越 損 益 金	△ 4,762,467
(D) 受 益 権 総 口 数	8,278,638,535口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,994円

◎損益の状況

自 2021年10月16日
至 2022年10月17日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	13,769,370円
受 取 利 息	13,769,370
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△15,783,950
売 買 損	△15,783,950
(C) 信 託 報 酬 等	△ 623,859
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 2,638,439
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	441,409
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 2,466,126
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 99,311
(H) 計 (D+E+F+G)	△ 4,762,467
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△ 4,762,467

(注1) 当親ファンドの期首元本額は2,278,868,098円、期中追加設定元本額は6,601,171,126円、期中一部解約元本額は601,400,689円です。

(注2) 当親ファンドの当期末元本の内訳は、明治安田ダウンサイドリスク抑制型グローバル・バランスPファンド(適格機関投資家私募)8,074,482,348円、明治安田DC先進国コアファンド158,760,212円、明治安田米国リート・インカム・プレミアム・ファンド(毎月決算型)29,892,273円、明治安田Nextグローバル・リート(予想分配金提示型)5,000,000円、明治安田Nextグローバル・リート(資産成長型)5,000,000円、東洋ベトナム株式ファンド2021 4,998,501円、東洋ベトナム株式オープン500,201円、中国A株再生可能エネルギー関連プレミアムα5,000円です。

(注3) 1口当たり純資産額は0.9994円です。

(注4) 純資産総額が元本額を下回っており、その額は4,762,467円です。

(注5) 損益の状況の中で(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6) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注7) 損益の状況の中で(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8) 損益の状況の中で(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。