

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111期（決算日	2023年9月1日）
第112期（決算日	2023年10月2日）
第113期（決算日	2023年11月1日）
第114期（決算日	2023年12月1日）
第115期（決算日	2024年1月4日）
第116期（決算日	2024年2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111期から第116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	期 騰 落 率				
		円	円	%	%	%	百万円	
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	
第20作成期	111期(2023年9月1日)	2,810	30	△ 1.2	0.4	98.1	3,366	
	112期(2023年10月2日)	2,675	30	△ 3.7	0.5	98.6	3,180	
	113期(2023年11月1日)	2,648	30	0.1	0.3	96.9	3,197	
	114期(2023年12月1日)	2,773	30	5.9	0.2	97.3	3,288	
	115期(2024年1月4日)	2,755	30	0.4	0.2	98.9	3,207	
	116期(2024年2月1日)	2,712	30	△ 0.5	0.2	99.1	3,116	

(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 証 組 入 比	託 券 率
第111期	(期 首) 2023年8月1日	円 2,874	% —			% 0.5		% 97.9
	8月末	2,855	△0.7			0.4		97.0
	(期 末) 2023年9月1日	2,840	△1.2			0.4		98.1
第112期	(期 首) 2023年9月1日	2,810	—			0.4		98.1
	9月末	2,703	△3.8			0.5		97.5
	(期 末) 2023年10月2日	2,705	△3.7			0.5		98.6
第113期	(期 首) 2023年10月2日	2,675	—			0.5		98.6
	10月末	2,601	△2.8			0.3		96.4
	(期 末) 2023年11月1日	2,678	0.1			0.3		96.9
第114期	(期 首) 2023年11月1日	2,648	—			0.3		96.9
	11月末	2,777	4.9			0.2		96.5
	(期 末) 2023年12月1日	2,803	5.9			0.2		97.3
第115期	(期 首) 2023年12月1日	2,773	—			0.2		97.3
	12月末	2,803	1.1			0.2		97.9
	(期 末) 2024年1月4日	2,785	0.4			0.2		98.9
第116期	(期 首) 2024年1月4日	2,755	—			0.2		98.9
	1月末	2,779	0.9			0.2		97.8
	(期 末) 2024年2月1日	2,742	△0.5			0.2		99.1

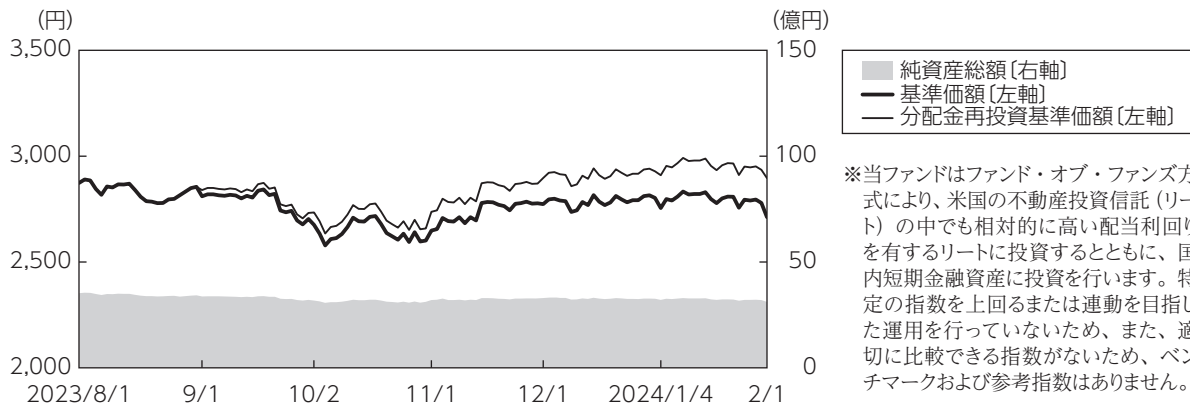
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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。

(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111期首(2023年8月1日):2,874円

第116期末(2024年2月1日):2,712円(既払分配金180円)

騰落率:0.8%(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小幅に上昇しました。作成期首から2023年10月にかけては、金融引き締め長期化観測が強まったことや中国景気への不安、9月の原油価格上昇やその後の中東情勢の緊迫化などから、下落基調となりました。しかし、11月には雇用統計や物価指標の落ち着きなどを受けてインフレ懸念が後退し長期金利が低下に転じたことがリート相場の追い風となり、反発しました。12月には2024年の複数回の利下げ実施観測を受けて長期金利が急低下したことから、リート相場は続伸しました。年明け以降は、年内利下げ回数の修正観測もあり、長期金利が上昇したことで下げる展開となりました。セクター別では、利回りが高く割安感が注目された地域モール関連が相対的に好調に推移しました。一方、一部地域での供給過剰が懸念された集合住宅関連が軟調に推移しました。

外国為替

当作成期の米ドルは円に対して上昇しました。2023年9月の原油価格上昇によるインフレ懸念、日銀の金融緩和政策維持を受けた日米の金利差拡大などを背景に、作成期首から10月頃まで米ドルは上昇基調となりました。しかし、FOMC（米連邦公開市場委員会）における連続での利上げ見送り、米国CPI（消費者物価指数）の落ち着き、FRB（米連邦準備制度理事会）理事による利下げ前倒しへの言及などを受けて米ドルは年末にかけて下落しました。年明け後は、米国の利下げ開始時期を巡る観測や思惑などから長期金利が上昇に転じ、米ドルも円に対して上昇基調となりました。

■ 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（2月1日〔現地日付：1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、ハイウッズ・プロパティーズ、VICI プロパティーズを購入し、オメガ・ヘルスケア・インベスターズなどを一部売却、アースタット・ビドル・プロパティーズ クラス A 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)

- ・米国リート相場が小幅に上昇したこと
- ・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)

- ・米国リート相場の上昇や円安ドル高が進んだことでカバードコール戦略（米国リート戦略、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	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%

※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	アメリカン・タワー	7.6%
2	クラウン・キャッスル	7.5%
3	サイモン・プロパティ・グループ	7.4%
4	プロロジス	6.1%
5	エクストラ・スペース・ストレージ	5.0%
6	リアルティ・インカム	4.7%
7	パブリック・ストレージ	4.7%
8	デジタル・リアルティ・トラスト	4.5%
9	VICIプロパティーズ	4.3%
10	アパートメント・インカム・リート	4.0%

【用途別組入状況】

作成期首

	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%

作成期末

	用途名	組入比率
1	電気通信	15.1%
2	産業施設	9.8%
3	個人用倉庫	9.7%
4	集合住宅	9.5%
5	医療関連施設	8.0%
6	モール型商業施設	7.4%
7	ショッピング・センター	6.0%
8	ゲーミング	5.7%
9	データ・センター	5.7%
10	その他	21.1%

※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：1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	13.7%	5.9%
カバー率※2	51.9%	51.9%

※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めざ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111期	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
	2023年8月2日～ 2023年9月1日	2023年9月2日～ 2023年10月2日	2023年10月3日～ 2023年11月1日	2023年11月2日～ 2023年12月1日	2023年12月2日～ 2024年1月4日	2024年1月5日～ 2024年2月1日
当期分配金	30	30	30	30	30	30
(対基準価額比率)	1.056	1.109	1.120	1.070	1.077	1.094
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	1,773	1,778	1,783	1,791	1,796	1,802

(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^①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めざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 8 月 2 日～2024年 2 月 1 日)

項 目	第111期～第116期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	16	0.570	(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)	(0.221)	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)	(0.332)	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)	(0.017)	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)	(0.000)	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	0.573	
作成期間の平均基準価額は、2,753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。

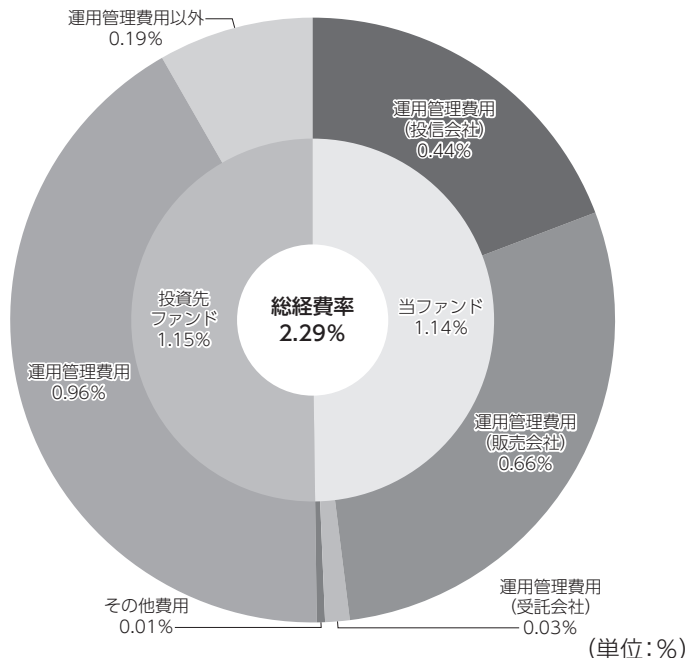
(注4) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)が支払った費用を含みません。

(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8月2日～2024年2月1日)

投資信託証券

銘 柄		第111期～第116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 601,375,871	千円 130,000

(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111期～第116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 10,006	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8月2日～2024年2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

(2024年2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19作成期末	第20作成期末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
	NB/MYAM US REIT Income Fund	口 15,252,886,939	口 14,651,511,068	千円 3,088,538	% 99.1
	合 計	15,252,886,939	14,651,511,068	3,088,538	99.1

(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19作成期末	第20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 19,884	千口 9,878	千円 9,871

(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

(2024年2月1日現在)

項 目	第20作成期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 3,088,538	% 97.7
明治安田マネープール・マザーファンド	9,871	0.3
コール・ローン等、その他	64,229	2.0
投資信託財産総額	3,162,638	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111期末	第112期末	第113期末	第114期末	第115期末	第116期末
	2023年9月1日現在	2023年10月2日現在	2023年11月1日現在	2023年12月1日現在	2024年1月4日現在	2024年2月1日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	3,405,902,068	3,220,721,833	3,237,914,037	3,327,618,954	3,254,841,497	3,162,638,441
コール・ローン等	84,846,880	65,926,227	120,563,835	117,380,796	71,223,765	64,228,561
投資信託受益証券(評価額)	3,301,186,830	3,134,929,236	3,097,483,832	3,200,366,811	3,173,746,385	3,088,538,533
明治安田マネーボール・マザーファンド(評価額)	19,868,358	19,866,370	19,866,370	9,871,347	9,871,347	9,871,347
(B) 負債	39,263,215	40,158,615	40,736,478	38,899,069	47,140,564	46,270,104
未払収益分配金	35,941,544	35,666,125	36,223,696	35,579,774	34,928,146	34,470,128
未払解約金	15	1,288,730	1,584,219	293,808	8,755,065	8,977,370
未払信託報酬	3,305,374	3,188,007	2,914,029	3,010,564	3,440,464	2,808,799
未払利息	246	196	343	319	198	182
その他未払費用	16,036	15,557	14,191	14,604	16,691	13,625
(C) 純資産総額(A-B)	3,366,638,853	3,180,563,218	3,197,177,559	3,288,719,885	3,207,700,933	3,116,368,337
元本	11,980,514,883	11,888,708,603	12,074,565,412	11,859,924,762	11,642,715,408	11,490,042,702
次期繰越損益金	△ 8,613,876,030	△ 8,708,145,385	△ 8,877,387,853	△ 8,571,204,877	△ 8,435,014,475	△ 8,373,674,365
(D) 受益権総口数	11,980,514,883口	11,888,708,603口	12,074,565,412口	11,859,924,762口	11,642,715,408口	11,490,042,702口
1万円当たり基準価額(C/D)	2,810円	2,675円	2,648円	2,773円	2,755円	2,712円

(注1) 当ファンドの第111期首元本額は12,253,498,931円、第111～116期中追加設定元本額は689,434,545円、第111～116期中一部解約元本額は1,452,890,774円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第111期0.2810円、第112期0.2675円、第113期0.2648円、第114期0.2773円、第115期0.2755円、第116期0.2712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111期8,613,876,030円、第112期8,708,145,385円、第113期8,877,387,853円、第114期8,571,204,877円、第115期8,435,014,475円、第116期8,373,674,365円です。

○損益の状況

項 目	第111期	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
	2023年8月2日～ 2023年9月1日	2023年9月2日～ 2023年10月2日	2023年10月3日～ 2023年11月1日	2023年11月2日～ 2023年12月1日	2023年12月2日～ 2024年1月4日	2024年1月5日～ 2024年2月1日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	45,050,956	44,756,756	44,892,256	44,912,924	43,944,427	43,560,952
受取配当金	45,055,588	44,760,762	44,895,457	44,916,723	43,950,780	43,563,707
受取利息	199	107	71	—	130	—
支払利息	△ 4,831	△ 4,113	△ 3,272	△ 3,799	△ 6,483	△ 2,755
(B) 有価証券売買損益	△ 82,069,753	△ 165,848,855	△ 37,140,470	140,609,879	△ 26,675,282	△ 55,821,188
売買益	8,384,795	431,370	380,470	242,544,018	231,177	11,719,724
売買損	△ 90,454,548	△ 166,280,225	△ 37,520,940	△ 101,934,139	△ 26,906,999	△ 67,540,912
(C) 信託報酬等	△ 3,321,410	△ 3,203,564	△ 2,928,184	△ 3,025,168	△ 3,457,155	△ 2,822,424
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	△ 40,340,207	△ 124,295,663	4,823,602	182,497,635	13,811,990	△ 15,082,660
(E) 前期繰越損益金	△4,269,245,380	△4,285,474,484	△4,412,355,745	△4,317,014,833	△4,066,974,247	△4,010,801,378
(F) 追加信託差損益金	△4,268,348,899	△4,262,709,113	△4,433,632,014	△4,401,107,905	△4,346,924,072	△4,313,320,199
(配当等相当額)	(1,293,315,506)	(1,288,629,659)	(1,328,635,656)	(1,314,170,698)	(1,295,392,187)	(1,283,117,754)
(売買損益相当額)	(△5,561,664,405)	(△5,551,338,772)	(△5,762,267,670)	(△5,715,278,603)	(△5,642,316,259)	(△5,596,437,953)
(G) 計 (D+E+F)	△8,577,934,486	△8,672,477,260	△8,841,164,157	△8,535,625,103	△8,400,086,329	△8,339,204,237
(H) 収益分配金	△ 35,941,544	△ 35,666,125	△ 36,223,696	△ 35,579,774	△ 34,928,146	△ 34,470,128
次期繰越損益金 (G+H)	△8,613,876,030	△8,708,145,385	△8,877,387,853	△8,571,204,877	△8,435,014,475	△8,373,674,365
追加信託差損益金	△4,268,348,899	△4,262,709,113	△4,433,632,014	△4,401,107,905	△4,346,924,072	△4,313,320,199
(配当等相当額)	(1,293,315,531)	(1,288,629,680)	(1,328,635,711)	(1,314,170,706)	(1,295,392,192)	(1,283,117,759)
(売買損益相当額)	(△5,561,664,430)	(△5,551,338,793)	(△5,762,267,725)	(△5,715,278,611)	(△5,642,316,264)	(△5,596,437,958)
分配準備積立金	830,986,804	825,552,108	825,232,711	810,590,348	796,375,016	787,777,310
繰越損益金	△5,176,513,935	△5,270,988,380	△5,268,988,550	△4,980,687,320	△4,884,465,419	△4,848,131,476

- (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111期計算期間末における費用控除後の配当等収益(41,739,211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(1,293,315,531円)および分配準備積立金(825,189,137円)より分配対象収益は2,160,243,879円(10,000口当たり1,803円)であり、うち35,941,544円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注5) 第112期計算期間末における費用控除後の配当等収益(41,561,213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(1,288,629,680円)および分配準備積立金(819,657,020円)より分配対象収益は2,149,847,913円(10,000口当たり1,808円)であり、うち35,666,125円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注6) 第113期計算期間末における費用控除後の配当等収益(41,972,343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(1,328,635,711円)および分配準備積立金(819,484,064円)より分配対象収益は2,190,092,118円(10,000口当たり1,813円)であり、うち36,223,696円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注7) 第114期計算期間末における費用控除後の配当等収益(44,183,260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(1,314,170,706円)および分配準備積立金(801,986,862円)より分配対象収益は2,160,340,828円(10,000口当たり1,821円)であり、うち35,579,774円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注8) 第115期計算期間末における費用控除後の配当等収益(40,490,868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(1,295,392,192円)および分配準備積立金(790,812,294円)より分配対象収益は2,126,695,354円(10,000口当たり1,826円)であり、うち34,928,146円(10,000口当たり30円)を分配金額としております。
- (注9) 第116期計算期間末における費用控除後の配当等収益(40,741,030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(1,283,117,759円)および分配準備積立金(781,506,408円)より分配対象収益は2,105,563,197円(10,000口当たり1,832円)であり、うち34,470,128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111期	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
1万口当たり分配金(税込み)	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

(2024年2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(3,858,672千口)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20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)	2,969,000	2,978,192	77.2	—	—	—	77.2
合 計	2,969,000	2,978,192	77.2	—	—	—	77.2

(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20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	100,449	2025/3/13
政府保証第30回日本政策投資銀行債券		0.425	200,000	201,106	2025/9/11
政府保証第52回日本政策投資銀行債券		0.001	200,000	199,952	2025/1/24
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	200,204	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	234,512	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	100,264	2024/6/28
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	117,471	2024/10/31
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	110,317	2025/1/31
政府保証第238回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.414	100,000	100,401	2025/2/28
政府保証第243回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.391	126,000	126,524	2025/4/30
政府保証第249回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	200,000	201,166	2025/6/30
政府保証第57回地方公共団体金融機構債券		0.66	239,000	239,064	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	100,077	2024/3/15
政府保証第65回地方公共団体金融機構債券		0.539	100,000	100,383	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	113,444	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	100,395	2024/12/13
政府保証第72回地方公共団体金融機構債券		0.509	200,000	201,170	2025/5/23
政府保証第77回地方公共団体金融機構債券		0.386	200,000	201,004	2025/10/15
政府保証第31回日本政策金融公庫債券		0.544	100,000	100,341	2024/9/13
政府保証第56回日本政策金融公庫債券		0.001	130,000	129,945	2025/2/21
合	計		2,969,000	2,978,192	

(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12期

(決算日 2023年10月16日)

「明治安田マネープール・マザーファンド」は、2023年10月16日に第12期決算を行いました。
以下、当マザーファンドの第12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	騰落率		債券組入比率	純資産総額
		期	中		
	円		%	%	百万円
(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
(第12期) 2023年10月16日	9,992	△0.0		95.2	5,011

(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
		騰	落	
	円		%	%
(期首) 2022年10月17日	9,994	—		73.4
10月末	9,993	△0.0		73.4
11月末	9,993	△0.0		91.5
12月末	9,988	△0.1		76.0
2023年 1月末	9,990	△0.0		68.6
2月末	9,991	△0.0		74.4
3月末	9,992	△0.0		58.5
4月末	9,992	△0.0		57.3
5月末	9,992	△0.0		66.1
6月末	9,992	△0.0		62.3
7月末	9,991	△0.0		85.6
8月末	9,992	△0.0		72.1
9月末	9,992	△0.0		78.8
(期末) 2023年10月16日	9,992	△0.0		95.2

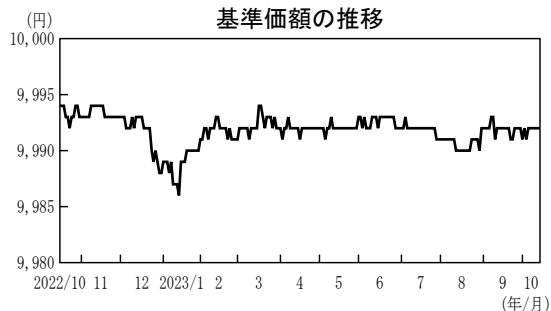
(注1)騰落率は期首比です。

(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(2022年10月18日～2023年10月16日)

1 基準価額

基準価額の推移と主な変動要因



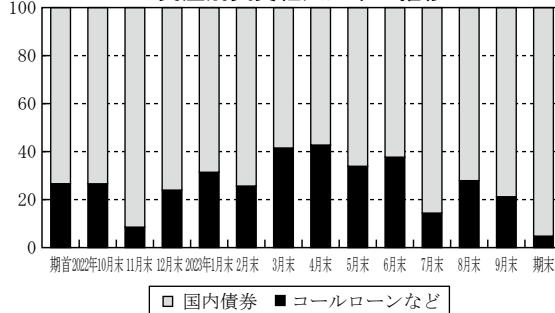
基準価額は期首9,994円で始まり、期末9,992円で終わりました。騰落率は△0.02%でした。この主な要因としては、組み入れていた政府保証債の金利相当分の収益が基準価額に対してプラスに寄与した一方、短期金利がマイナス圏で推移し時価が下落したことがマイナスに影響しました。

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による金融引き締め政策の長期化が視野に入るとともに、国内においても日本銀行の政策修正に対する投資家の注目度は高まりました。日本銀行はイールドカーブ・コントロールを巡って、2022年12月には長期金利の許容変動幅を拡大し、総裁交代後の2023年7月には長期金利の変動幅に対する運用柔軟化を決定しましたが、マイナス金利政策については継続しました。こうした環境下で短期金利がマイナスで推移する中、当マザーファンドでは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
	2022年10月18日～2023年10月16日		
	金額	比率	
(a) その他費用	2円	0.020%	(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9,991円です。
(その他)	(2)	(0.020)	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	2	0.020	

(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(2022年10月18日～2023年10月16日)

○公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	特殊債券	7,781,174	2,696,353 (6,335,000)

(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、上段の数字には含まれておりません。

◎利害関係人との取引状況等(2022年10月18日～2023年10月16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	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
				う ち B B 格 以 下 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)	4,757,000	4,771,768	95.2	—	—	—	95.2
合 計	4,757,000	4,771,768	95.2	—	—	—	95.2

(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		償 還 年 月 日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額		
(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社債	0.45	100,000	100,547		2025/ 3/13
政府保証第52回日本政策投資銀行社債	0.001	200,000	199,886		2025/ 1/24
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	115,033		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	192,264		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	200,568		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	234,964		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	100,444		2024/ 6/28
政府保証第222回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	361,000	362,689		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	502,365		2024/ 8/30
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	117,625		2024/10/31
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	110,382		2025/ 1/31
政府保証第54回地方公共団体金融機構債券	0.669	105,000	105,060		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	100,119		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	100,194		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	239,525		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	100,265		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	241,944		2024/ 5/21
政府保証第64回地方公共団体金融機構債券	0.544	600,000	602,868		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	100,519		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	113,578		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	100,505		2024/12/13
政府保証第31回日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	100,478		2024/ 9/13
政府保証第56回日本政策金融公庫債券	0.001	130,000	129,905		2025/ 2/21
政府保証第16回民間都市開発債券	0.699	500,000	500,035		2023/10/20
合 計		4,757,000	4,771,768		

(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

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	4,771,768	95.2
コール・ローン等、その他	239,757	4.8
投資信託財産総額	5,011,525	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

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,011,525,782円
コール・ローン等	235,897,220
公 社 債(評価額)	4,771,768,700
未 収 利 息	3,859,862
(B) 負 債	1,489
未 払 利 息	694
そ の 他 未 払 費 用	795
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,011,524,293
元 本	5,015,411,715
次 期 繰 越 損 益 金	△ 3,887,422
(D) 受 益 権 総 口 数	5,015,411,715口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,992円

◎損益の状況

自 2022年10月18日
至 2023年10月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	49,237,024円
受 取 利 息	50,014,661
支 払 利 息	△ 777,637
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△48,649,060
売 買 益	70,200
売 買 損	△48,719,260
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,249,997
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 1,662,033
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 4,762,467
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△11,850,436
(G) 解 約 差 損 益 金	14,387,514
(H) 計 (D+E+F+G)	△ 3,887,422
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△ 3,887,422

(注1)当親ファンドの期首元本額は8,278,638,535円、期中追加設定元本額は14,615,400,436円、期中一部解約元本額は17,878,627,256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)2,649,626,414円、明治安田高配当サステナブルESG日本株時間分散型ファンド2023-6(適格機関投資家私募)950,610,329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)19,884,266円、明治安田NBグローバル好利回り社債ファンド2023-02(限定追加型)10,009,009円、明治安田NB世界好利回り事業債ファンド2023-07(限定追加型)10,009,009円、明治安田米国レベニュー債オープン(為替ヘッジなし)10,008,007円、明治安田NBコーポレート・ハイブリッド証券ファンド2022-12(限定追加型)10,007,005円、明治安田NBグローバル好利回り社債ファンド2023-06(限定追加型)10,007,005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0.9992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3,887,422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。

【お知らせ】

・デリバティブ取引について、投資態度を明確にするため、信託約款に所定の整備を行いました。(2023年7月15日)