

第9期【償還】

運用報告書(全体版)

米国優先リート17-07 (為替ヘッジあり)

【2021年12月15日償還】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

皆様の「米国優先リート17-07(為替ヘッジあり)」は、2021年12月15日をもちまして信託約款の規定に基づき、償還となりました。ここに設定以来の運用経過及び償還内容のご報告をいたしますとともに、皆様のご愛顧に対し改めてお礼申し上げます。

今後とも、弊社ファンドに対しまして、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社営業部 セールスサポートグループへ
フリーダイヤル ☎ 0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

[ホームページ]

<https://www.okasan-am.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信/海外/不動産投信	
信託期間	2017年7月31日から2021年12月15日までです。	
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主として米国の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託または不動産投資法人が発行する優先証券に実質的に投資します。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。	
主要投資対象	当ファンド	NB・OAM優先リートファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)および日本マネー・マザーファンドを主要投資対象とします。
	NB・OAM優先リートファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	NB・OAM優先リート・マザーファンドへの投資を通じて、米国の金融商品取引所等(これに準じるものを含みます。)に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託および不動産投資法人が発行する優先リートを主要投資対象とします。また、普通リートにも投資することがあります。
	日本マネー・マザーファンド	わが国の公社債および短期金融商品为主要投資対象とします。
投資制限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎年1月15日および7月15日(それぞれ休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。分配対象収益の範囲は、元本超過額または経費控除後の利子・配当等収益のいずれが多い金額とします。経費控除後の利子・配当等収益には、マザーファンドの利子・配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき利子・配当等収益を含むものとします。分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。	

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受益者 利回り	ICE BofA REIT Preferred Securities Index		債券組 入率	投資信託 証券組 入比率	元本 残存率
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落額	期中 騰落率		(参考指数)	期中 騰落率			
(設定日) 2017年7月31日	円 銭 10,000	円 -	円 -	% -	% -	ポイント 431.070	% -	% -	% -	% 100.0
1期(2018年1月15日)	9,735	90	△ 175	△ 1.8	△ 3.8	436.150	1.2	0.1	98.1	99.5
2期(2018年7月17日)	9,595	70	△ 70	△ 0.7	△ 2.5	444.432	1.9	0.1	98.2	96.9
3期(2019年1月15日)	8,910	50	△ 635	△ 6.6	△ 6.0	426.646	△ 4.0	0.1	97.5	94.5
4期(2019年7月16日)	9,418	100	608	6.8	△ 1.4	476.078	11.6	0.1	96.4	92.9
5期(2020年1月15日)	9,518	90	190	2.0	△ 0.3	501.629	5.4	0.2	98.4	90.5
6期(2020年7月15日)	7,879	100	△ 1,539	△ 16.2	△ 5.5	493.890	△ 1.5	0.2	98.0	89.1
7期(2021年1月15日)	8,801	90	1,012	12.8	△ 1.8	517.547	4.8	0.2	98.6	82.9
8期(2021年7月15日)	9,129	110	438	5.0	△ 0.4	539.756	4.3	0.1	98.5	81.3
(償還時) 9期(2021年12月15日)	(償還価額) 8,974.41	-	△ 154.59	△ 1.7	△ 0.7	528.602	△ 2.1	-	-	76.3

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万口当たり、基準価額の騰落額および騰落率は分配金(税引前)込み。

(注) 設定日の基準価額は当初設定元本。

(注) 受益者利回りは、設定以来の年率換算利回りです。

(注) ICE BofA REIT Preferred Securities Indexは当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。ICE BofA REIT Preferred Securities Indexは当該日前営業日の現地終値です。

(注) 当ファンドはマザーファンド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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		ICE BofA REIT Preferred Securities Index		債券組 入率	投資信託 証券組 入比率
	騰落率	騰落率	(参考指数)	騰落率		
(期首) 2021年7月15日	円 銭 9,129	% -	ポイント 539.756	% -	% 0.1	% 98.5
7月末	9,126	△ 0.0	539.200	△ 0.1	0.1	98.7
8月末	9,183	0.6	540.684	0.2	0.1	99.3
9月末	9,091	△ 0.4	540.443	0.1	0.2	98.8
10月末	9,140	0.1	537.345	△ 0.4	0.2	98.9
11月末	8,965	△ 1.8	525.947	△ 2.6	0.2	98.9
(償還時) 2021年12月15日	(償還価額) 8,974.41	△ 1.7	528.602	△ 2.1	-	-

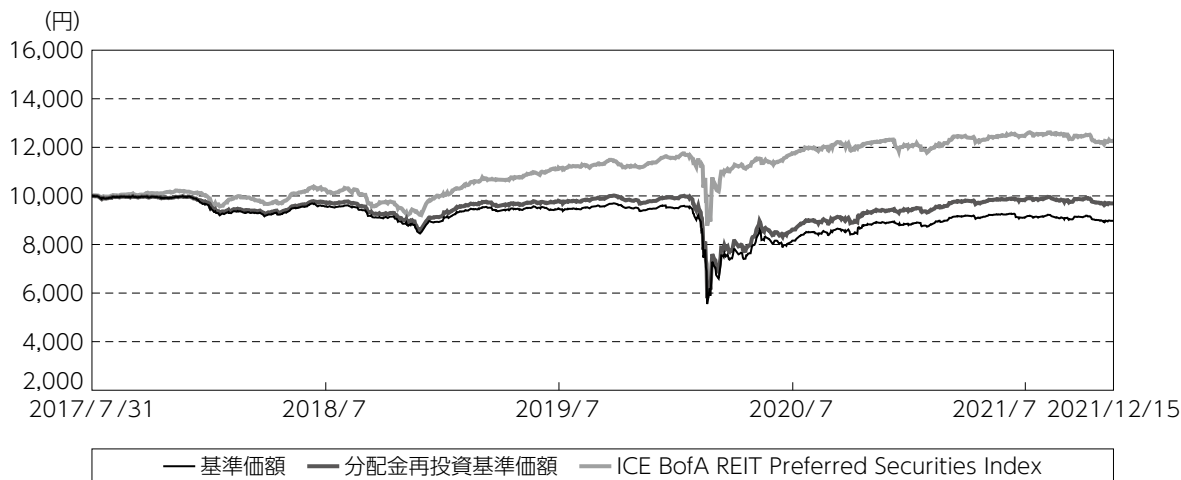
(注) 騰落率は期首比。

ICE BofA REIT Preferred Securities Indexは、ICE Data Indices, LLC、その関係会社（「ICE Data」）及び/又はその第三者サブライヤーの財産であり、岡三アセットマネジメント株式会社による使用のためにライセンスされています。ICE Data及びその第三者サブライヤーは、その使用に関して一切の責任を負いません。

設定以来の運用経過

設定以来の基準価額等の推移

（2017年7月31日～2021年12月15日）



(注) 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) 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、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。なお、当ファンドは単位型投信であり、実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。

(注) 参考指数は、ICE BofA REIT Preferred Securities Indexです。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、設定日（2017年7月31日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

設定以来の投資環境

（2017年7月31日～2021年12月15日）

米国優先リート市場は、設定当初より発行体であるリートの業績が好調に推移し、配当の安全性が高いと見られたことなどから、底堅く推移しました。2018年は、米連邦準備制度理事会（F R B）が段階的に政策金利を引き上げる中、長期金利の上昇が嫌気されたほか、景気減速懸念が強まったことなどが投資家心理の悪化に繋がり、年後半にかけて軟調な展開となりました。2019年に入り、F R Bが利上げを休止し、その後、8月に利下げに転じたことを受けて、長期金利が低下して米国優先リートの利回り面での投資魅力が高まったことなどから、上昇する展開となりました。しかし、2020年2月に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、経済活動の停滞によるリートの事業環境悪化への懸念が強まり、3月下旬にかけて急落しました。その後は、政府の大規模な経済対策やF R Bの金融緩和策を追い風に反発する展開となりました。2021年7月中旬以降は、同ウイルスの変異株（デルタ株）の感染拡大や金融緩和策の縮小に対する警戒感が強まった一方、優先リートの利回りに着目したと見られる買いが入ったことなどから、一進一退の展開となりました。11月に入ると、量的緩和の縮小（テーパリング）開始が決定され、その後、複数のF R B高官の発言などでテーパリングの前倒し観測が広がったほか、月末にかけては、同ウイルスの新たな変異株（オミクロン株）が確認されたことなどを受けて、投資家心理が悪化し、下落しました。12月に入ってからは、オミクロン株について重症化しにくい可能性があることが報じられたことなどから、オミクロン株に対する過度な警戒感が後退し、持ち直す動きとなりました。

設定以来の当ファンドのポートフォリオ

（2017年7月31日～2021年12月15日）

<米国優先リート17-07（為替ヘッジあり）>

「NB・OAM優先リートファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）」を概ね98%前後で組入れ、「日本マネー・マザーファンド」とあわせ、高位の組入れを維持しました。

なお、2021年12月に入ってから、償還に向けて、「NB・OAM優先リートファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）」と「日本マネー・マザーファンド」を売却し、短期金融市場で資金を運用しました。

○NB・OAM優先リートファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

NB・OAM優先リート・マザーファンドへの投資を通じて、主として米国の取引所に上場している不動産投資信託または不動産投資法人が発行する優先証券に投資し、安定的な収益と投資元本の保全を目指して運用を行いました。また、米国優先リートの組入れを高位で維持する一方、ポートフォリオの流動性と分散効果を考慮し、普通リートを一部組み入れました。

実質組入外貨建資産については、運用の基本方針に則り、為替ヘッジを行いました。

○日本マネー・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行い、政府保証債を組み入れました。

設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異

（2017年7月31日～2021年12月15日）

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、分配金も考慮した設定以来の基準価額の騰落率は、参考指数としているICE BofA REIT Preferred Securities Index（当初のThe BofA Merrill Lynch REIT Preferred Securities Indexから名称変更）の騰落率を下回りました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年7月16日～2021年12月15日)

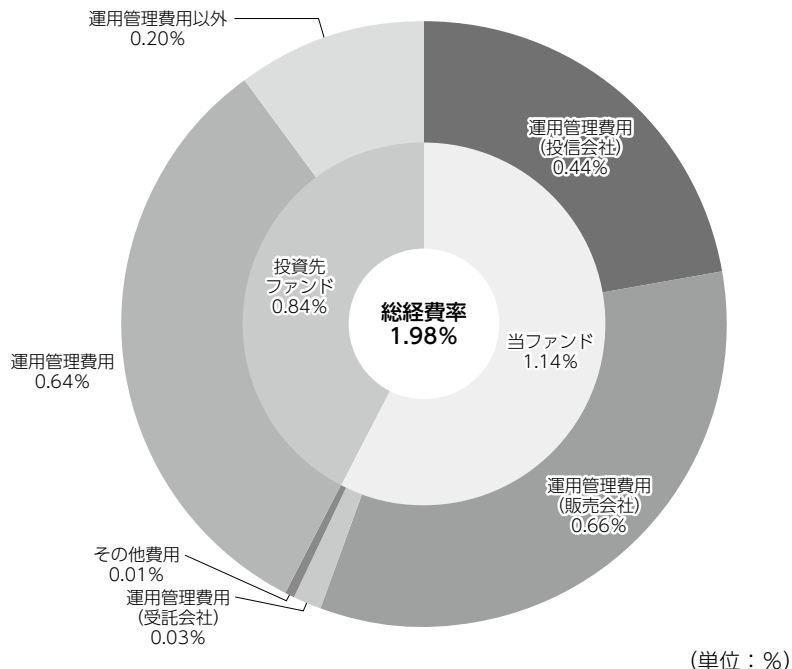
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	43 (17) (25) (1)	0.475 (0.184) (0.277) (0.014)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	－ (－)	－ (－)	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	－ (－)	－ (－)	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (そ の 他)	1 (1) (0)	0.006 (0.006) (0.000)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	44	0.481	
期中の平均基準価額は、9,101円です。			

- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注) 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) 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（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
(注) 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。

（参考情報）

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.98%です。



総経費率 (①+②+③)	1.98
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	0.64
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.20

(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

(2021年7月16日～2021年12月15日)

○売買及び取引の状況とは、ファンドが購入・売却した有価証券の数量および金額です。

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	NB・OAM優先リートファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	11,674,684	10,000 千円	1,014,579,638	850,834 千円

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	日本マネー・マザーファンド	千口 -	千円 -	千口 1,765	千円 1,794

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月16日～2021年12月15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

(2021年12月15日現在)

有価証券等の組入れはございません。

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	期	首(前期末)
		口	数
	NB・OAM優先リートファンド(為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)		口 1,002,904,954
	合 計		1,002,904,954

(注) 口数の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘	柄	期	首(前期末)
		口	数
	日本マネー・マザーファンド		千口 1,765

(注) 口数の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

（2021年12月15日現在）

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 817,479	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	817,479	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2021年12月15日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	817,479,106
コール・ローン等	817,479,106
(B) 負債	3,967,480
未払信託報酬	3,919,357
未払利息	835
その他未払費用	47,288
(C) 純資産総額(A－B)	813,511,626
元本	906,478,947
償還差損金	△ 92,967,321
(D) 受益権総口数	906,478,947口
1万口当たり償還価額(C／D)	8,974円41銭

（注）純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は92,967,321円です。

（注）計算期間末における1口当たりの純資産額は、0.897441円です。

（注）当ファンドの設定元本額は1,186,528,007円、期首元本額は965,452,646円、期末における元本残存率は76.3%です。

○損益の状況（2021年7月16日～2021年12月15日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	17,593,443
受取配当金	17,596,162
受取利息	41
支払利息	△ 2,760
(B) 有価証券売買損益	△ 27,682,008
売買益	157,820,060
売買損	△185,502,068
(C) 信託報酬等	△ 4,073,138
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 14,161,703
(E) 前期繰越損益金	△ 84,094,586
(F) 解約差損益金	5,288,968
償還差損金(D+E+F)	△ 92,967,321

（注）損益の状況の中で(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）損益の状況の中で(F)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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2017年7月31日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年12月15日		資産総額	817,479,106円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	3,967,480円
				純資産総額	813,511,626円
受益権口数	1,186,528,007口	906,478,947口	△280,049,060口	受益権口数	906,478,947口
元本額	1,186,528,007円	906,478,947円	△280,049,060円	1万口当たり償還金	8,974円41銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	1,181,038,578円	1,149,747,460円	9,735円	90円	0.9000%
第2期	1,150,277,103	1,103,680,393	9,595	70	0.7000
第3期	1,121,302,939	999,136,912	8,910	50	0.5000
第4期	1,102,853,913	1,038,693,513	9,418	100	1.0000
第5期	1,074,467,066	1,022,645,825	9,518	90	0.9000
第6期	1,058,315,929	833,843,156	7,879	100	1.0000
第7期	983,941,844	865,947,075	8,801	90	0.9000
第8期	965,452,646	881,358,060	9,129	110	1.1000
信託期間中1万口当たり総収益金及び年平均収益率				△325.59円	△0.7436%

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金	8,974円41銭
-----------	-----------

<お知らせ>

該当事項はございません。

マザーファンドの運用報告書につきましては、ベビーファンドの運用報告書と作成対象期間が異なる場合には、データ・コメント等に不一致が生じる場合がありますのでご了承ください。

日本マネー・マザーファンド 第16期 運用状況のご報告 決算日：2021年10月11日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として安定運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
投資制限	株式および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		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		騰	落			
12期 (2017年10月10日)	円 10,194		% △0.1	% 72.4	% —	百万円 761
13期 (2018年10月10日)	10,187		△0.1	86.0	—	778
14期 (2019年10月10日)	10,180		△0.1	97.5	—	680
15期 (2020年10月12日)	10,172		△0.1	88.9	—	429
16期 (2021年10月11日)	10,166		△0.1	92.3	—	445

(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動する成果を目指した運用を行っていません。そのため、特定のベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

(注) 債券先物比率=買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

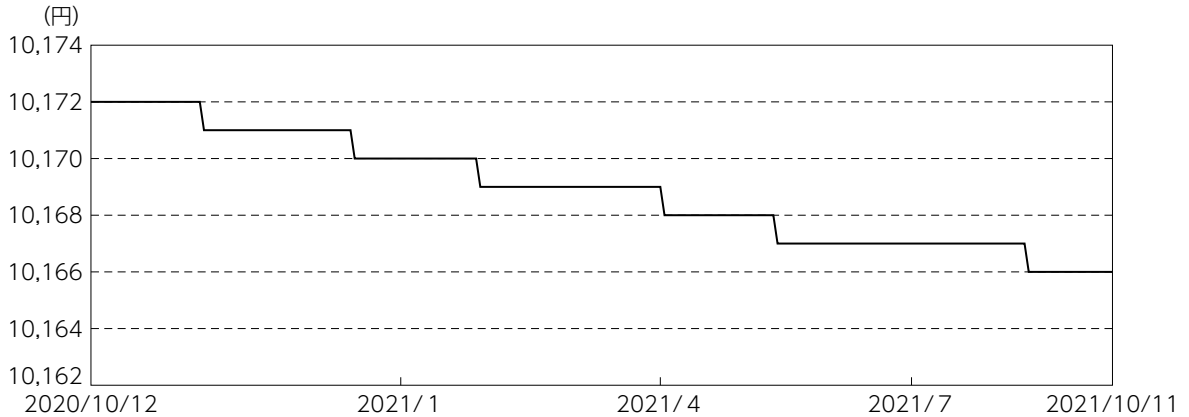
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰	落			
(期首) 2020年10月12日	円 10,172		% —	% 88.9	% —	% —
10月末	10,172		0.0	76.4	—	—
11月末	10,171		△0.0	76.1	—	—
12月末	10,171		△0.0	87.2	—	—
2021年1月末	10,170		△0.0	86.5	—	—
2月末	10,170		△0.0	63.3	—	—
3月末	10,169		△0.0	84.7	—	—
4月末	10,169		△0.0	82.5	—	—
5月末	10,168		△0.0	94.1	—	—
6月末	10,167		△0.0	67.4	—	—
7月末	10,167		△0.0	67.7	—	—
8月末	10,167		△0.0	67.6	—	—
9月末	10,166		△0.1	92.3	—	—
(期末) 2021年10月11日	10,166		△0.1	92.3	—	—

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額の推移

(2020年10月13日～2021年10月11日)



○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・特にありません。

(主なマイナス要因)

- ・日銀のマイナス金利政策の影響により、保有債券の利回りがマイナス圏で推移したことが、マイナス要因となりました。

投資環境

(2020年10月13日～2021年10月11日)

短期金融市場では、日銀がマイナス金利政策を継続していることへの影響から、1年国債利回りが概ね-0.10%をやや下回る水準で推移する展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2020年10月13日～2021年10月11日)

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行いました。当期間中は、政府保証債を組み入れました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2020年10月13日～2021年10月11日)

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

今後の運用方針

(投資環境の見通し)

国内短期金融市場は、日銀によるマイナス金利政策の継続が見込まれることから、主要な投資対象であるわが国の公社債および短期金融商品の利回りがマイナス圏での推移となり、今後も厳しい運用環境が続くと予想されます。

(運用方針)

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益確保を目的に運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2020年10月13日～2021年10月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	0	0.001	

期中の平均基準価額は、10,168円です。

(注) 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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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

(2020年10月13日～2021年10月11日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	特殊債券	千円 412,077	千円 — (380,000)

(注) 金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) 単位未満は切捨て。

(注) () 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

(2020年10月13日～2021年10月11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

(2021年10月11日現在)

国内公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債 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	%	%	%	%	%
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	409,000 (409,000)	410,573 (410,573)	92.3 (92.3)	— (—)	— (—)	— (—)	92.3 (92.3)
合 計	409,000 (409,000)	410,573 (410,573)	92.3 (92.3)	— (—)	— (—)	— (—)	92.3 (92.3)

(注) () 内は非上場債券で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(注) 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	当 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	
第11回政府保証原子力損害賠償支援機構債	0.001	50,000	50,020	2022/5/20
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	50,000	50,072	2021/11/30
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	120,000	120,354	2022/1/31
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	80,000	80,297	2022/2/28
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	109,000	109,828	2022/8/31
合 計		409,000	410,573	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年10月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 410,573	% 92.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	34,491	7.7
投 資 信 託 財 産 総 額	445,064	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年10月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	445,064,140
コール・ローン等	33,769,356
公社債(評価額)	410,573,313
未収利息	554,014
前払費用	167,457
(B) 負債	1,018
未払利息	31
その他未払費用	987
(C) 純資産総額(A-B)	445,063,122
元本	437,805,475
次期繰越損益金	7,257,647
(D) 受益権総口数	437,805,475口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,166円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.0166円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は422,513,077円、期中追加設定元本額は30,060,828円、期中一部解約元本額は14,768,430円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。

アジア・オセアニア好配当成長株オープン (毎月分配型)	325,834,704円
米国短期ハイ・イールド債券オープン	49,037,879円
新興国連続増配成長株オープン	26,594,229円
PIMCOダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(資産成長型)	21,240,275円
PIMCOダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(年2回決算型)	8,820,553円
アジア・オセアニア好配当成長株オープン(1年決算型)	4,512,263円
米国優先リート17-07(為替ヘッジあり)	1,765,572円

○損益の状況 (2020年10月13日～2021年10月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,280,442
受取利息	3,306,015
支払利息	△ 25,573
(B) 有価証券売買損益	△3,550,429
売買損	△3,550,429
(C) その他費用等	△ 6,454
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 276,441
(E) 前期繰越損益金	7,272,821
(F) 追加信託差損益金	509,172
(G) 解約差損益金	△ 247,905
(H) 計(D+E+F+G)	7,257,647
次期繰越損益金(H)	7,257,647

(注) 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) 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、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 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>

該当事項はございません。