

SMBC・日興 ニューワールド債券ファンド (南アランド)

【償還 運用報告書(全体版)】

第30作成期 (2024年4月13日から2024年10月15日まで)

第 175 期 / 第 176 期 / 第 177 期
決算日2024年5月13日 決算日2024年6月12日 決算日2024年7月12日

第 178 期 / 第 179 期 / 第 180 期
決算日2024年8月13日 決算日2024年9月12日 償還日2024年10月15日

■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／債券
信託期間	2009年10月30日から2024年10月15日まで
運用方針	投資信託証券に投資することにより、実質的に海外の債券に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	当ファンドは以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト (南アフリカランドクラス) エマージング諸国の企業や政府・政府関係機関等が発行する債券等 マネープール・マザーファンド 円貨建ての短期公社債および短期金融商品
当ファンドの運用方法	■世界的な経済構造の変化から恩恵を受ける企業や国が発行する債券に投資し、金利収入と値上がり益を追求します。 ■原則として米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行います。
組入制限	■外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	■毎月12日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。 ■分配金額は、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。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、今後の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは投資信託証券に投資することにより、実質的に海外の債券に投資し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。ここに当作成期の運用状況等をご報告いたします。

皆さまのご愛顧ありがとうございました。



〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1
<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況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

コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

S M B C ・ 日 興 ニ ュ ー ワ ー ル ド 債 券 フ ァ ン ド (南 ア ラ ン ド)

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組入比率	投資信託 証券組入 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分配金	期 中 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
151期 (2022年5月12日)	4,616	15	△9.1	0.6	96.9	327
152期 (2022年6月13日)	4,769	15	3.6	0.9	95.9	338
153期 (2022年7月12日)	4,321	15	△9.1	0.5	95.3	302
154期 (2022年8月12日)	4,609	15	7.0	1.0	95.4	320
155期 (2022年9月12日)	4,527	15	△1.5	1.0	95.7	312
156期 (2022年10月12日)	4,143	15	△8.2	1.2	95.9	281
157期 (2022年11月14日)	4,244	15	2.8	1.1	95.7	287
158期 (2022年12月12日)	4,380	15	3.6	1.1	95.4	291
159期 (2023年1月12日)	4,385	15	0.5	1.1	96.0	286
160期 (2023年2月13日)	4,119	15	△5.7	1.2	94.8	268
161期 (2023年3月13日)	4,091	15	△0.3	1.1	94.7	266
162期 (2023年4月12日)	4,057	15	△0.5	0.7	95.3	263
163期 (2023年5月12日)	3,924	15	△2.9	1.2	94.7	255
164期 (2023年6月12日)	4,145	15	6.0	1.1	96.8	269
165期 (2023年7月12日)	4,239	15	2.6	1.1	95.2	273
166期 (2023年8月14日)	4,345	15	2.9	1.1	95.1	279
167期 (2023年9月12日)	4,369	15	0.9	1.1	95.5	270
168期 (2023年10月12日)	4,370	15	0.4	0.3	95.0	269
169期 (2023年11月13日)	4,534	15	4.1	0.2	95.6	274
170期 (2023年12月12日)	4,448	15	△1.6	0.2	95.4	265
171期 (2024年1月12日)	4,614	15	4.1	1.0	95.7	274
172期 (2024年2月13日)	4,669	15	1.5	0.2	95.8	274
173期 (2024年3月12日)	4,741	15	1.9	0.2	96.3	276
174期 (2024年4月12日)	4,887	15	3.4	0.8	95.5	282
175期 (2024年5月13日)	5,079	15	4.2	0.8	95.2	284
176期 (2024年6月12日)	5,066	15	0.0	0.8	95.0	280
177期 (2024年7月12日)	5,373	15	6.4	0.7	96.0	292
178期 (2024年8月13日)	5,004	15	△6.6	0.5	96.5	267
179期 (2024年9月12日)	4,930	15	△1.2	0.5	97.0	262
(償 還 日)	(償還価額)					
180期 (2024年10月15日)	5,230.26	0	6.1	—	—	275

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※当ファンドの運用方針に対し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		公 社 債 組入比率	投資信託 証券組入 比 率
		円	騰 落 率		
第175期	(期 首) 2024年4月12日	4,887	—	0.8	95.5
	4月末	5,028	2.9	0.1	96.4
	(期 末) 2024年5月13日	5,094	4.2	0.8	95.2
第176期	(期 首) 2024年5月13日	5,079	—	0.8	95.2
	5月末	5,056	△0.5	0.8	96.5
	(期 末) 2024年6月12日	5,081	0.0	0.8	95.0
第177期	(期 首) 2024年6月12日	5,066	—	0.8	95.0
	6月末	5,262	3.9	0.2	97.0
	(期 末) 2024年7月12日	5,388	6.4	0.7	96.0
第178期	(期 首) 2024年7月12日	5,373	—	0.7	96.0
	7月末	5,166	△3.9	0.2	96.0
	(期 末) 2024年8月13日	5,019	△6.6	0.5	96.5
第179期	(期 首) 2024年8月13日	5,004	—	0.5	96.5
	8月末	5,128	2.5	0.5	96.6
	(期 末) 2024年9月12日	4,945	△1.2	0.5	97.0
第180期	(期 首) 2024年9月12日	4,930	—	0.5	97.0
	9月末	5,192	5.3	0.5	89.5
	(償 還 日) 2024年10月15日	(償還価額) 5,230.26	6.1	—	—

※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

設定以来の運用状況（設定日（2009年10月30日）から償還日（2024年10月15日）まで）

設定以来の基準価額の推移



前作成期までの概略（設定日（2009年10月30日）から第29作成期末（2024年4月12日）まで）

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じてエマージング諸国の企業や政府、政府関係機関等が発行する米ドル建て債券およびエマージング諸国の成長から恩恵を受けると考えられる先進国の企業や政府、政府関係機関等が発行する債券に投資しました。

組み入れている投資信託証券では原則として米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行いました。

上昇要因

- ・リーマンショック以降実施されていた先進国の金融緩和策
- ・コロナウイルスの感染拡大を背景とした経済危機を受けて、世界的に財政出動や金融緩和が実施されたこと

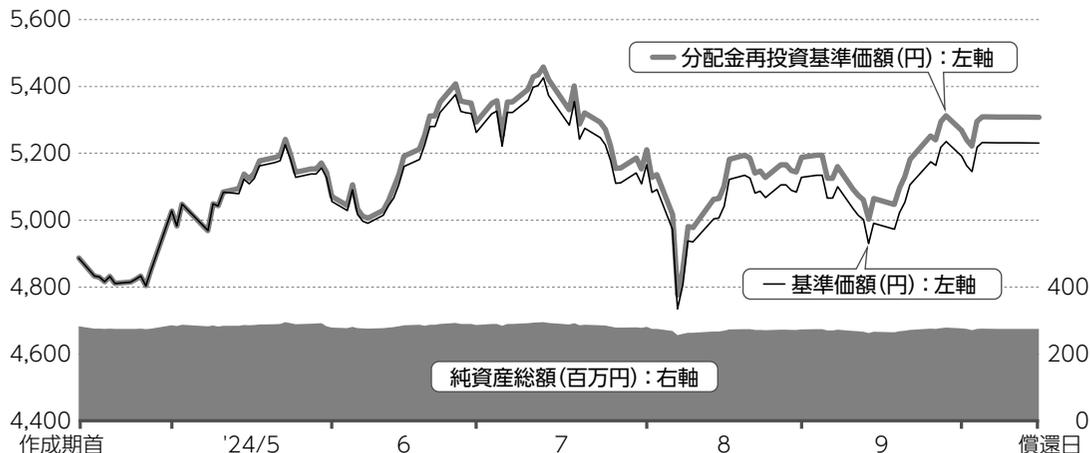
下落要因

- ・米国の利上げが進んだ局面に新興国通貨が全般的に下落した際などに、南アフリカランドが日本円に対しても下落したこと
- ・2013年のFRB（米連邦準備制度理事会）による金融緩和策の早期縮小懸念
- ・コロナウイルスの世界的大流行などを背景に世界経済の先行きへの懸念が高まったこと
- ・コロナ禍後の世界的なインフレの上昇や金融引き締め

1 運用経過

基準価額等の推移について（2024年4月13日から2024年10月15日まで）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

作成期首	4,887円
償還日	5,230円26銭 (当作成期既払分配金75円(税引前))
騰落率	+8.6% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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と仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの運用方針に対し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。

基準価額の主な変動要因（2024年4月13日から2024年10月15日まで）

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じてエマージング諸国の企業や政府、政府関係機関等が発行する米ドル建て債券およびエマージング諸国の成長から恩恵を受けると考えられる先進国の企業や政府、政府関係機関等が発行する債券に投資しました。

組み入れている投資信託証券では原則として米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行いました。

上昇要因

- 主に米国債の利回りが低下（価格は上昇）したことから、新興国国債市場が米ドルベースで上昇したこと
- 市場寄りの政策がとられるとの期待などから、南アフリカランドが円に対して上昇したこと

投資環境について（2024年4月13日から2024年10月15日まで）

新興国国債、新興国社債、先進国社債市場は上昇しました。為替市場では、南アフリカランドは円に対して上昇しました。

新興国国債

新興国国債市場は、スプレッド（米国債に対する上乗せ金利）が拡大したものの、米国債の金利が低下したことから、上昇しました。

スプレッドは、期の序盤は、5月に公表されたFOMC（米連邦公開市場委員会）の議事要旨がタカ派（インフレ抑制を重視する立場）寄りと市場で受け止められたことなどが嫌気され、拡大しました。期中中盤も、中国の4－6月期のGDP（国内総生産）などの経済指標が軟調だったこと、米国の景気後退懸念が高まったことなどを背景にスプレッドは拡大しました。期の終盤に入ると、米利下げ期待や中国当局による景気支援策などが好感され、スプレッドは縮小に転じました。期を通して見ると、スプレッドは前期末を上回る水準で期を終えました。

新興国社債

新興国社債市場は、上昇しました。地域別ではアフリカが相対的に堅調となりました。セクター別では、不動産が最も上昇しました。

先進国社債

先進国社債市場は、スプレッドは概ね横ばいだったものの、米国債の金利が低下したことから、上昇しました。

為替市場

南アフリカランドは対円で上昇しました。主要輸出品である金の価格上昇に加え、5月の総選挙で過半数割れとなった与党が市場寄りの政策を掲げる野党との連立で合意したことなどが、プラス材料となりました。

ポートフォリオについて（2024年4月13日から2024年10月15日まで）

当ファンド

期初より「エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト（南アフリカランドクラス）」および「マネープール・マザーファンド」を主要投資対象とし、「エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト（南アフリカランドクラス）」を高位に組み入れました。

ただし、償還に伴い10月に全て売却しました。

エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト（南アフリカランドクラス）

8月29日時点の組入比率については、新興国国債への組入比率を概ね42.1%、新興国社債への組入比率を概ね52.4%、先進国社債への組入比率を概ね0.1%、現金等への

組入比率を概ね4.5%としていました。

国別の要因分析については、ウクライナや南アフリカの国別選択や銘柄選択などがパフォーマンスにプラス寄与となった一方、スリランカやアンゴラの国別選択や銘柄選択などがパフォーマンスにマイナス寄与となりました。

ただし、期末にはファンドの償還に向けて組み入れ債券の売却を行いました。

また、期中は概ね100%の米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行いました。結果、南アフリカランドクラスは上昇しました。

マネープール・マザーファンド

主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

ベンチマークとの差異について（2024年4月13日から2024年10月15日まで）

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

分配金について（2024年4月13日から2024年10月15日まで）

期間の1万口当たりの分配金（税引前）は、基準価額水準等を勘案し、以下の通りといたしました。

留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたしました。

なお、第180期については、償還のため該当事項はございません。

（単位：円、1万口当たり、税引前）

項 目	第175期	第176期	第177期	第178期	第179期
当期分配金	15	15	15	15	15
（対基準価額比率）	(0.29%)	(0.30%)	(0.28%)	(0.30%)	(0.30%)
当期の収益	15	15	15	－	－
当期の収益以外	－	－	－	15	15
翌期繰越分配対象額	4,750	4,801	4,857	4,842	4,827

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「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（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

償還のため、該当事項はございません。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

S M B C ・ 日興ニューワールド債券ファンド（南アランド）

1万口当たりの費用明細（2024年4月13日から2024年10月15日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	28円	0.556%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 期中の平均基準価額は5,110円です。
（投信会社）	(8)	(0.151)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(20)	(0.392)	販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.013)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	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
（株式）	(-)	(-)	売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(-)	(-)	
（投資信託証券）	(-)	(-)	
(c) 有価証券取引税	-	-	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
（株式）	(-)	(-)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（公社債）	(-)	(-)	
（投資信託証券）	(-)	(-)	
(d) その他費用	-	-	その他費用＝期中のその他費用/期中の平均受益権口数
（保管費用）	(-)	(-)	保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(-)	(-)	監査費用：監査法人に支払うファンドの監査費用
（その他）	(-)	(-)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	28	0.556	

※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ています。

※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。

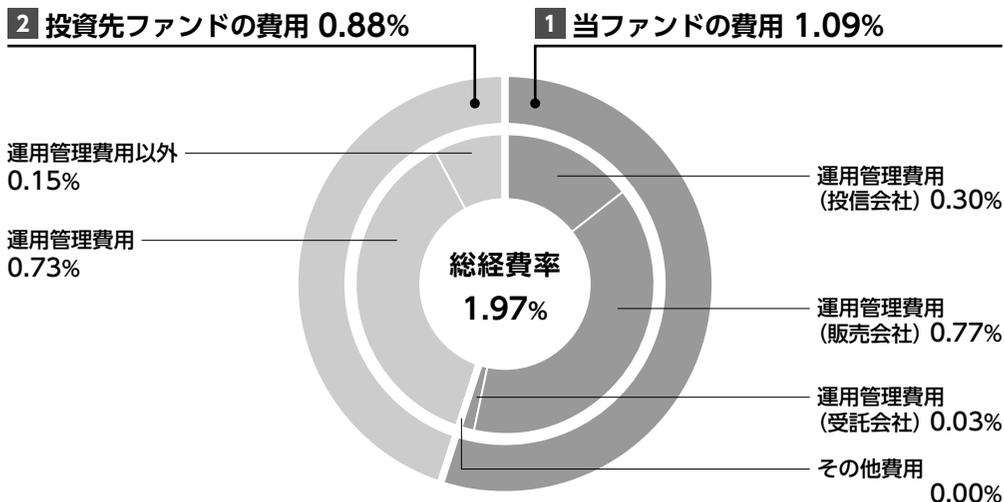
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



総経費率(1 + 2)	1.97%
1 当ファンドの費用の比率	1.09%
2 投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.73%
投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.15%

※ **1**の各費用は、前掲「1万円当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。「1万円当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※ **2**の投資先ファンド(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))の費用は、入手可能なファンド全体のデータをもとに委託会社が計算した経費率です。そのため、実際に投資しているシェアクラスの経費率とは大きく異なる場合があります。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※ **1**と**2**の費用は、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。また、計上された期間が異なる場合があります。

※上記の前提条件で算出している参考値であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

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比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.97%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2024年4月13日から2024年10月15日まで)

(1) 投資信託証券

		当 作 成 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト（南アフリカランドクラス）	口 4,271 (-)	千円 10,200 (-)	口 20,805 (101,487)	千円 48,000 (245,238)

※金額は受渡し代金。

※()内は分割・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。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

(2) 親投資信託受益証券の設定、解約状況

		当 作 成 期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
マネープール・マザーファンド	千口 -	千円 -	千口 3,474	千円 3,473	

■ 利害関係人との取引状況等 (2024年4月13日から2024年10月15日まで)

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2024年4月13日から2024年10月15日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2024年10月15日現在)

(1) 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

ファンド名	作成期首	作 成 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	組 入 比 率
エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト（南アフリカランドクラス）	口 118,021.961	口 -	千円 -	% -
合 計	118,021.961	-	-	-

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

SMBC・日興ニューワールド債券ファンド（南アランド）

(2)親投資信託残高

種 類	作成期首		作成 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
マネープール・マザーファンド	千口 3,474	千口 -	千口 -	千円 -

■ 投資信託財産の構成

(2024年10月15日現在)

項 目	作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 275,578	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	275,578	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額または償還価額の状況

(2024年5月13日)(2024年6月12日)(2024年7月12日)(2024年8月13日)(2024年9月12日)(2024年10月15日)

項 目	第175期末	第176期末	第177期末	第178期末	第179期末	償還時
(A) 資 産	290,902,899円	281,719,997円	293,684,198円	271,547,713円	264,343,448円	275,578,084円
コール・ローン等	16,875,194	11,514,488	9,284,462	10,349,072	6,075,733	275,576,401
投資信託受益証券(評価額)	270,556,347	266,734,151	280,928,031	257,726,588	254,795,315	-
マネープール・マザーファンド(評価額)	3,471,358	3,471,358	3,471,705	3,472,053	3,472,400	-
未 収 利 息	-	-	-	-	-	1,683
(B) 負 債	6,713,904	1,088,718	1,080,563	4,416,197	1,782,214	278,405
未払収益分配金	839,379	830,857	816,873	800,701	798,923	-
未払解約金	5,613,943	2,000	4,032	3,348,368	738,913	16
未払信託報酬	260,582	255,861	259,658	267,128	244,378	278,389
(C) 純資産総額(A-B)	284,188,995	280,631,279	292,603,635	267,131,516	262,561,234	275,299,679
元 本	559,586,605	553,905,075	544,582,276	533,800,800	532,615,991	526,358,961
次期繰越損益金	△275,397,610	△273,273,796	△251,978,641	△266,669,284	△270,054,757	-
償還差損益金	-	-	-	-	-	△251,059,282
(D) 受 益 権 総 口 数	559,586,605口	553,905,075口	544,582,276口	533,800,800口	532,615,991口	526,358,961口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,079円	5,066円	5,373円	5,004円	4,930円	-
1万口当たり償還価額(C/D)	-	-	-	-	-	5,230円26銭

※当作成期における作成期首元本額578,909,234円、作成期中追加設定元本額16,224,387円、作成期中一部解約元本額68,774,660円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金および償還差損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
 ※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額または償還価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2024年4月13日 至2024年5月13日) (自2024年5月14日 至2024年6月12日) (自2024年6月13日 至2024年7月12日) (自2024年7月13日 至2024年8月13日) (自2024年8月14日 至2024年9月12日) (自2024年9月13日 至2024年10月15日)

項 目	第175期	第176期	第177期	第178期	第179期	第180期
(A) 配 当 等 収 益	3,759,336円	3,894,473円	3,897,212円	974円	1,180円	16,947円
受 取 配 当 金	3,758,834	3,893,903	3,896,767	—	—	—
受 取 利 息	502	570	445	974	1,180	16,947
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,048,156	△ 3,543,907	13,867,869	△ 18,607,460	△ 2,935,935	16,084,157
売 買 益	8,135,314	109,929	13,992,779	483,449	346	16,204,756
売 買 損	△ 87,158	△ 3,653,836	△ 124,910	△ 19,090,909	△ 2,936,281	△ 120,599
(C) 信 託 報 酬 等	△ 260,582	△ 255,861	△ 259,658	△ 267,128	△ 244,378	△ 278,389
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	11,546,910	94,705	17,505,423	△ 18,873,614	△ 3,179,133	15,822,715
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 84,664,038	△ 71,787,616	△ 71,189,712	△ 53,349,366	△ 72,763,258	△ 75,754,000
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△201,441,103	△200,750,028	△197,477,479	△193,645,603	△193,313,443	△191,127,997
(配 当 等 相 当 額)	(70,714,650)	(73,745,130)	(72,804,233)	(71,618,974)	(71,711,623)	(71,076,222)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△272,155,753)	(△274,495,158)	(△270,281,712)	(△265,264,577)	(△265,025,066)	(△262,204,219)
(G) 合 計 (D + E + F)	△274,558,231	△272,442,939	△251,161,768	△265,868,583	△269,255,834	△251,059,282
(H) 収 益 分 配 金	△ 839,379	△ 830,857	△ 816,873	△ 800,701	△ 798,923	—
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△275,397,610	△273,273,796	△251,978,641	△266,669,284	△270,054,757	—
追 加 信 託 差 損 益 金	△201,441,103	△200,750,028	△197,477,479	△193,645,603	△193,313,443	—
(配 当 等 相 当 額)	(70,714,650)	(73,745,132)	(72,804,233)	(71,618,974)	(71,711,623)	(—)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△272,155,753)	(△274,495,160)	(△270,281,712)	(△265,264,577)	(△265,025,066)	(—)
償 還 差 損 益 金	—	—	—	—	—	△251,059,282
分 配 準 備 積 立 金	195,143,359	192,228,487	191,716,107	186,863,774	185,398,443	—
繰 越 損 益 金	△269,099,866	△264,752,255	△246,217,269	△259,887,455	△262,139,757	—

※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。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第175期	第176期	第177期	第178期	第179期
(a) 経費控除後の配当等収益	3,676,650円	3,638,879円	3,840,481円	0円	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	70,714,650	73,745,132	72,804,233	71,618,974	71,711,623
(d) 分配準備積立金	192,306,088	189,420,465	188,692,499	187,664,475	186,197,366
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	266,697,388	266,804,476	265,337,213	259,283,449	257,908,989
1万口当たり当期分配対象額	4,765.97	4,816.79	4,872.31	4,857.31	4,842.31
(f) 分配金	839,379	830,857	816,873	800,701	798,923
1万口当たり分配金	15	15	15	15	15

S M B C ・ 日 興 ニ ュ ー ワ ー ル ド 債 券 フ ァ ン ド (南 ア ラ ン ド)

■ 投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2009年10月30日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年10月15日		資産総額	275,578,084円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	278,405円
受益権口数	10,238,697,468口	526,358,961口	△9,712,338,507口	純資産総額	275,299,679円
元本額	10,238,697,468円	526,358,961円	△9,712,338,507円	受益権口数	526,358,961口
				1万円当たり償還金	5,230円26銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第60期	3,335,332,669	2,217,183,037	6,648	70	0.70
第61期	3,344,924,972	2,323,576,819	6,947	70	0.70
第62期	3,342,649,232	2,268,791,241	6,787	70	0.70
第63期	3,411,485,177	2,306,616,197	6,761	70	0.70
第64期	3,352,431,014	2,234,821,900	6,666	70	0.70
第65期	3,264,984,137	2,113,405,670	6,473	70	0.70
第66期	3,229,625,012	2,160,097,397	6,688	70	0.70
第67期	3,227,928,069	2,126,141,680	6,587	70	0.70
第68期	3,080,819,926	1,985,879,910	6,446	70	0.70
第69期	2,890,626,672	1,833,328,389	6,342	70	0.70
第70期	2,810,727,804	1,740,523,314	6,192	70	0.70
第71期	2,684,751,648	1,504,187,506	5,603	50	0.50
第72期	2,622,379,721	1,502,847,858	5,731	50	0.50
第73期	2,505,687,546	1,366,623,706	5,454	50	0.50
第74期	2,186,485,194	1,029,223,747	4,707	50	0.50
第75期	2,102,526,201	916,629,043	4,360	50	0.50
第76期	2,035,115,615	890,927,797	4,378	50	0.50
第77期	1,987,330,199	937,487,172	4,717	40	0.40
第78期	1,959,167,633	921,159,223	4,702	40	0.40
第79期	1,923,131,745	901,983,806	4,690	40	0.40
第80期	1,907,233,532	888,104,653	4,657	40	0.40
第81期	1,862,198,456	892,155,198	4,791	40	0.40
第82期	1,856,174,895	960,222,090	5,173	40	0.40
第83期	1,857,563,264	903,935,136	4,866	40	0.40
第84期	1,822,771,005	892,313,283	4,895	40	0.40
第85期	1,790,918,287	894,420,593	4,994	40	0.40
第86期	1,777,634,840	965,216,064	5,430	40	0.40
第87期	1,706,320,377	939,506,026	5,506	40	0.40
第88期	1,623,488,268	915,424,766	5,639	40	0.40
第89期	1,616,371,147	930,723,309	5,758	40	0.40
第90期	1,601,821,520	848,978,793	5,300	40	0.40

S M B C ・ 日 興 ニ ュ ー ワ ー ル ド 債 券 フ ァ ン ド (南 ア ラ ン ド)

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 91 期	1,572,014,825	896,810,907	5,705	40	0.40
第 92 期	1,482,259,834	861,360,362	5,811	40	0.40
第 93 期	1,466,824,817	832,588,954	5,676	40	0.40
第 94 期	1,463,509,259	805,041,344	5,501	40	0.40
第 95 期	1,403,410,195	810,611,327	5,776	40	0.40
第 96 期	1,396,028,348	788,507,623	5,648	40	0.40
第 97 期	1,386,701,008	742,259,488	5,353	40	0.40
第 98 期	1,370,689,256	774,481,811	5,650	40	0.40
第 99 期	1,323,390,882	802,842,905	6,067	40	0.40
第 100 期	1,281,649,913	773,359,276	6,034	40	0.40
第 101 期	1,291,397,304	773,082,488	5,986	40	0.40
第 102 期	1,277,211,163	752,289,966	5,890	40	0.40
第 103 期	1,239,554,933	719,207,337	5,802	40	0.40
第 104 期	1,219,235,188	658,086,671	5,398	40	0.40
第 105 期	1,219,199,946	650,602,322	5,336	40	0.40
第 106 期	1,224,726,545	620,952,955	5,070	40	0.40
第 107 期	1,221,038,803	568,337,224	4,655	40	0.40
第 108 期	1,181,037,142	573,486,287	4,856	40	0.40
第 109 期	1,169,988,649	583,779,270	4,990	40	0.40
第 110 期	1,154,284,391	567,581,239	4,917	40	0.40
第 111 期	1,153,330,943	573,243,128	4,970	40	0.40
第 112 期	1,196,764,025	614,992,892	5,139	40	0.40
第 113 期	1,198,754,484	601,042,058	5,014	40	0.40
第 114 期	1,172,667,818	609,938,630	5,201	40	0.40
第 115 期	1,169,723,717	586,975,099	5,018	40	0.40
第 116 期	1,168,089,959	567,368,452	4,857	40	0.40
第 117 期	1,171,153,405	605,207,167	5,168	40	0.40
第 118 期	1,174,202,674	536,982,647	4,573	40	0.40
第 119 期	1,180,659,855	574,648,918	4,867	30	0.30
第 120 期	1,174,782,439	570,035,812	4,852	30	0.30
第 121 期	1,174,022,314	572,391,774	4,875	30	0.30
第 122 期	1,158,535,543	565,313,375	4,880	30	0.30
第 123 期	1,137,887,393	581,083,720	5,107	30	0.30
第 124 期	1,132,220,000	567,990,166	5,017	30	0.30
第 125 期	1,115,088,416	460,801,770	4,132	30	0.30
第 126 期	1,014,939,961	351,906,547	3,467	30	0.30
第 127 期	1,018,017,952	351,071,113	3,449	30	0.30
第 128 期	1,019,139,857	396,511,192	3,891	15	0.15
第 129 期	1,007,873,173	403,755,079	4,006	15	0.15
第 130 期	1,008,364,243	399,178,212	3,959	15	0.15
第 131 期	1,003,941,772	415,902,522	4,143	15	0.15
第 132 期	1,003,956,658	417,622,346	4,160	15	0.15

S M B C ・ 日興ニューワールド債券ファンド（南アランド）

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 133 期	990,036,326	434,666,799	4,390	15	0.15
第 134 期	973,393,978	446,744,355	4,590	15	0.15
第 135 期	972,028,324	436,448,713	4,490	15	0.15
第 136 期	963,763,579	463,824,203	4,813	15	0.15
第 137 期	952,775,575	453,703,038	4,762	15	0.15
第 138 期	925,346,061	454,141,079	4,908	15	0.15
第 139 期	908,810,019	465,725,425	5,125	15	0.15
第 140 期	892,627,267	479,951,462	5,377	15	0.15
第 141 期	892,907,176	463,096,934	5,186	15	0.15
第 142 期	888,041,772	448,217,291	5,047	15	0.15
第 143 期	872,287,341	460,296,771	5,277	15	0.15
第 144 期	818,742,657	409,463,440	5,001	15	0.15
第 145 期	793,774,265	394,004,530	4,964	15	0.15
第 146 期	783,580,556	368,193,024	4,699	15	0.15
第 147 期	757,417,797	367,344,286	4,850	15	0.15
第 148 期	757,706,436	371,915,448	4,908	15	0.15
第 149 期	734,176,684	339,055,952	4,618	15	0.15
第 150 期	733,191,588	373,314,204	5,092	15	0.15
第 151 期	708,966,304	327,239,967	4,616	15	0.15
第 152 期	709,971,947	338,602,505	4,769	15	0.15
第 153 期	699,193,962	302,093,613	4,321	15	0.15
第 154 期	695,575,053	320,612,646	4,609	15	0.15
第 155 期	691,051,631	312,824,982	4,527	15	0.15
第 156 期	679,465,392	281,478,118	4,143	15	0.15
第 157 期	677,907,287	287,677,423	4,244	15	0.15
第 158 期	665,437,518	291,486,395	4,380	15	0.15
第 159 期	654,016,819	286,785,865	4,385	15	0.15
第 160 期	652,684,087	268,817,952	4,119	15	0.15
第 161 期	651,306,604	266,424,595	4,091	15	0.15
第 162 期	649,682,556	263,576,199	4,057	15	0.15
第 163 期	650,590,537	255,305,831	3,924	15	0.15
第 164 期	649,704,650	269,322,090	4,145	15	0.15
第 165 期	646,176,934	273,938,969	4,239	15	0.15
第 166 期	644,094,747	279,831,899	4,345	15	0.15
第 167 期	620,018,895	270,916,363	4,369	15	0.15
第 168 期	616,573,634	269,415,666	4,370	15	0.15
第 169 期	605,694,539	274,646,595	4,534	15	0.15
第 170 期	597,819,172	265,900,618	4,448	15	0.15
第 171 期	595,947,507	274,987,287	4,614	15	0.15
第 172 期	588,493,020	274,788,836	4,669	15	0.15
第 173 期	582,550,734	276,179,102	4,741	15	0.15
第 174 期	578,909,234	282,897,539	4,887	15	0.15

S M B C ・ 日 興 ニ ュ ー ワ ー ル ド 債 券 フ ァ ン ド (南 ア ラ ン ド)

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 175 期	559,586,605	284,188,995	5,079	15	0.15
第 176 期	553,905,075	280,631,279	5,066	15	0.15
第 177 期	544,582,276	292,603,635	5,373	15	0.15
第 178 期	533,800,800	267,131,516	5,004	15	0.15
第 179 期	532,615,991	262,561,234	4,930	15	0.15

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	第175期	第176期	第177期	第178期	第179期
		15円	15円	15円	15円

※分配金は、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」となり課税されます。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が「元本払戻金（特別分配金）」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

■ 組入れ投資信託証券の内容

投資信託証券の概要

ファンド名	エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト（南アフリカランドクラス）						
形態	ケイマン籍契約型投資信託（円建て）						
主要投資対象	エマージング諸国の企業や政府・政府関係機関等が発行する債券等						
運用の基本方針	主にエマージング諸国の企業や政府・政府関係機関等が発行する米ドル建て債券等への分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行うことを目的とします。 原則、保有する債券の平均格付けはBBB-格以上を維持することに努めます。ただし、市場環境によってはBBB-格を下回ることがあります。						
為替取引等	原則として米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行います。						
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ●現地通貨建て債券への投資割合は、純資産総額の10%以内とします。ただし、先進国の企業や政府・政府関係機関等が発行する債券はこの限りではありません。米ドル建て以外の債券へ投資した場合は、原則、当該債券通貨売り、米ドル買いの為替取引を行います。 ●同一発行体の証券への投資割合は、純資産総額の10%以内とします。ただし、政府・政府関係機関等が発行する証券はこの限りではありません。 ●マネー・マーケット・ファンドや類似ファンドへの投資は、純資産総額の5%以内とします。 ●有価証券の空売りは行わないものとします。 ●純資産総額の10%を超える借入れは行わないものとします。 ●流動性の乏しい証券への投資割合は、取得時において純資産総額の10%以内とします。 ●通常の状況において、日本において有価証券に属する証券に純資産総額の50%以上を投資します。 						
配分方針	原則として、毎月4日に分配を行う方針。						
運用管理費用	<p>運用報酬：</p> <table style="width: 100%; border: none;"> <tr> <td style="width: 50%;">純資産総額5億米ドルまで</td> <td style="width: 50%;">年0.65%程度*</td> </tr> <tr> <td>同5億米ドル超10億米ドルまで</td> <td>年0.66%程度*</td> </tr> <tr> <td>同10億米ドル超</td> <td>年0.67%程度*</td> </tr> </table> <p>*年間最低報酬額等が定められている場合があるため、純資産総額によっては、上記の料率を上回ることがあります。</p> <p>※上記のほか、管理事務および保管報酬、受託報酬等がかかります。これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>	純資産総額5億米ドルまで	年0.65%程度*	同5億米ドル超10億米ドルまで	年0.66%程度*	同10億米ドル超	年0.67%程度*
純資産総額5億米ドルまで	年0.65%程度*						
同5億米ドル超10億米ドルまで	年0.66%程度*						
同10億米ドル超	年0.67%程度*						
その他の費用	<p>ファンドの取引関連費用、法的費用、会計・監査および税務上の費用ならびにその他の費用を負担します。</p> <p>これらは、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。</p>						
申込手数料	ありません。						
スイング・プライス	ファンドの買付け、売却がポートフォリオに重要な影響を与えると考えられる場合、予想される取引スプレッド、コスト、その他の要因を考慮して、その売買価格が調整されることがあります。						
投資顧問会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー						
副投資顧問会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル						
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。						

以下には、「エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト（南アフリカランドクラス）」をシェアクラスとして含む「エマージング・マーケット・ボンド・プラス・サブ・トラスト」の情報を委託会社において抜粋、要約して翻訳したものを記載しています。

■ 包括利益計算書 (2023年3月31日で終了する年度)

(単位：米ドル)

利益	
受取利息	217,966
損益を通じて公正価値評価する金融資産からの利息	10,845,476
配当収入	181,603
損益を通じて公正価値評価する金融資産および金融負債による実現純損益	
投資有価証券	(15,241,565)
先物契約	(3,743,116)
売建てオプション	(10,549)
外貨	(4,907,192)
スワップ契約	2,110,825
損益を通じて公正価値評価する金融資産および金融負債による未実現損益の純変動	
投資有価証券	(8,664,643)
先物契約	1,033,551
外貨	(5,535,209)
スワップ契約	(1,077,905)
純損益	<u>(24,790,758)</u>
営業費用	
支払利息	8,924
運用報酬	1,179,691
管理事務代行報酬	77,192
監査報酬	78,067
受託会社報酬	18,149
保管サービス報酬	177,247
株主サービス報酬	20,000
その他手数料	219,242
営業費用合計	<u>1,778,512</u>
営業による純損益	<u>(26,569,270)</u>
金融費用	
参加型受益証券保有者に対する配当	35,026,316
源泉税控除前損益	(61,595,586)
営業による償還可能参加型受益証券保有者に帰属する純資産の変動	<u>(61,595,586)</u>
包括損益 合計	<u>—</u>

S M B C ・ 日 興 ニ ュ ー ワ ー ル ド 債 券 フ ァ ン ド (南 ア ラ ン ド)

■ 組入上位銘柄(基準日:2023年3月31日)

	銘柄	通貨	国・地域	クーポン	残存年数 (年)	格付け	比率
1	チリ国債	アメリカドル	チリ	2.750%	3.8	A	1.5%
2	トルコ国債	アメリカドル	トルコ	6.125%	5.6	B	1.2%
3	ボゴタ銀行社債	アメリカドル	コロンビア	6.250%	3.1	BB	1.1%
4	ペメックス(メキシコ国営石油公社)社債	ユーロ	メキシコ	3.750%	0.9	BBB	1.1%
5	エアロプエルト・ドミニカ社債	アメリカドル	ドミニカ共和国	6.750%	6.0	BB	1.1%
6	東部・南部アフリカ貿易開発銀行社債	アメリカドル	国際機関	4.875%	1.2	BBB	1.1%
7	ベネズエラ国営石油公社債	アメリカドル	ベネズエラ	6.000%	-0.4	格付なし	1.0%
8	サウジアラビア国債	アメリカドル	サウジアラビア	5.500%	9.6	A	1.0%
9	米国国債	アメリカドル	アメリカ	3.625%	7.0	AAA	0.9%
10	GACIファースト・インベストメント社債	アメリカドル	サウジアラビア	4.750%	6.9	A	0.9%
全銘柄数							408銘柄

※比率は純資産総額に対する割合

※キャッシュポジションの代替として保有している債券等を除外しています。

マネープール・マザーファンド

第15期（2023年10月13日から2024年10月15日まで）

信託期間	無期限（設定日：2009年10月30日）
運用方針	主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		公社債 組入比率	純資産 総額
		期中 騰落率		
	円	%	%	百万円
11期(2020年10月12日)	10,014	△0.1	93.4	354,336
12期(2021年10月12日)	10,006	△0.1	92.9	340,127
13期(2022年10月12日)	9,999	△0.1	93.8	279,322
14期(2023年10月12日)	9,992	△0.1	21.9	256,629
15期(2024年10月15日)	9,995	0.0	38.6	243,777

※当ファンドの運用方針に対し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。

■当期中の基準価額と市況等の推移

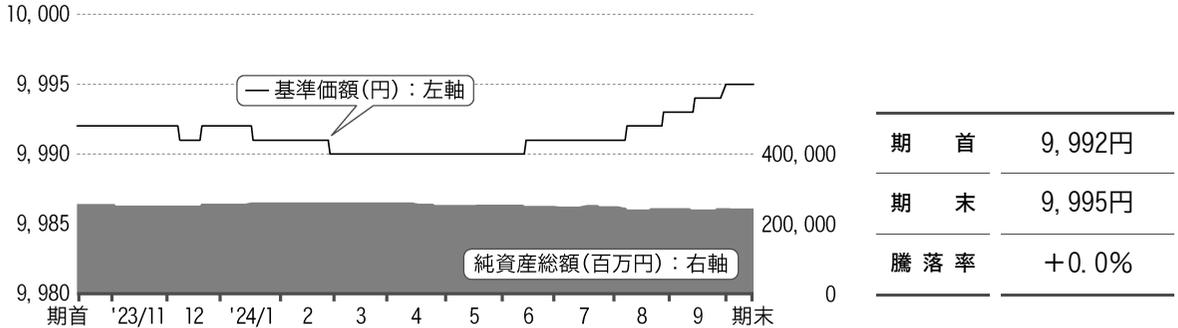
年月日	基準価額		公社債 組入比率
		騰落率	
(期首) 2023年10月12日	円 9,992	% -	% 21.9
10月末	9,992	0.0	17.4
11月末	9,992	0.0	84.4
12月末	9,992	0.0	83.1
2024年1月末	9,991	△0.0	12.9
2月末	9,990	△0.0	81.9
3月末	9,990	△0.0	78.4
4月末	9,990	△0.0	7.9
5月末	9,990	△0.0	61.9
6月末	9,991	△0.0	12.7
7月末	9,991	△0.0	12.3
8月末	9,993	0.0	40.6
9月末	9,995	0.0	38.6
(期末) 2024年10月15日	9,995	0.0	38.6

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2023年10月13日から2024年10月15日まで)

基準価額等の推移



▶ 基準価額の変動要因 (2023年10月13日から2024年10月15日まで)

当ファンドは、円建ての公社債および短期金融商品などへ投資しました。

上昇要因

・日銀が2024年3月にマイナス金利政策を解除し、7月に追加利上げを行ったことを受け、短期公社債や短期金融商品の利回りが上昇したこと

下落要因

・3月中旬まで日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期公社債や短期金融商品のマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2023年10月13日から2024年10月15日まで)

短期金利は、上昇しました。

円安進行などの影響から物価上昇率が高止まりし、CPIコア（生鮮食品除く消費者物価指数）は前年比+2%以上での推移となりました。日銀は物価目標の実現が見通せる状況に至ったと判断し、2024年3月に開催された金融政策決定会合で、日銀当座預金付利金利を0.1%に引き上げることで無担保コール（金融機関同士のごく短期の資金の貸借）翌日物金利を0~0.1%程度で推移するよう促すことを決定しました。さらに、7月の金融政策決定会合で追加利上げを決定し、無担保コール翌日物金利の誘導目標を0.25%程度としました。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期初から2024年1月中旬までは概ねレンジ推移となりました。1月に行われた金融政策決定会合後の植田日銀総裁の会見が、政策変更が近づいていることを意識させるタカ派（インフレ抑制を重視する立場）的な内容だったことから、利回りは上昇基調となりました。3月に、日銀がマイナス金利政策を解除したことから、利回りはプラス圏へ上昇し、7月の追加利上げ後にはさらに上昇しました。しかし、日銀の資金供給オペの担保として国庫短期証券へのニーズが強まる一方、発行額が段階的に減額されたことから、期末にかけて利回りの上昇幅は縮小しました。

▶ ポートフォリオについて (2023年10月13日から2024年10月15日まで)

残存0年から1年3ヵ月までの円建て公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを維持しました。また、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮しながら、短期公社債の組入れを行いました。

▶ ベンチマークとの差異について (2023年10月13日から2024年10月15日まで)

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

2 今後の運用方針

国内景気は、賃金上昇や経済対策の下で消費が回復しており、堅調な設備投資意欲や海外経済の底堅さも背景に、緩やかな成長軌道が続く見通しです。CPIコアの前年比伸び率は、賃金上昇に伴うサービス物価上昇により+2%程度の伸び率を維持できる見通しです。物価安定の目標達成が視野に入的过程中で日銀が追加利上げ姿勢を維持していることは金利の上昇要因ですが、短期市場での強い資金運用ニーズが金利上昇を抑制する見込みです。

引き続き、残存0年から1年3ヵ月までの円建ての公社債および短期金融商品で構築したポートフォリオを維持し、利子等の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10月13日から2024年10月15日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	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：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	0	0.000	

期中の平均基準価額は9,991円です。

※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ています。

※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。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2023年10月13日から2024年10月15日まで)

(1) 公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 7,214,985,491	千円 7,105,062,527 (40,420,000)
	地方債証券	7,274,173	— (36,938,800)
	特殊債証券	—	— (1,621,500)

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

※()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 2,169,496,005	千円 2,119,548,440

※金額は受渡し代金。

マネープール・マザーファンド

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年10月13日から2024年10月15日まで)

利害関係人との取引状況

区 分	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	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 27,272	百万円 3,264	% 12.0	百万円 -	百万円 -	% -

利害関係人とは、投資信託およ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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年10月13日から2024年10月15日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2024年10月15日現在)

(1) 公社債

A 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	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	90,000,000 (90,000,000)	89,913,530 (89,913,530)	36.9 (36.9)	- (-)	- (-)	- (-)	36.9 (36.9)
地 方 債 証 券	4,249,700 (4,249,700)	4,251,129 (4,251,129)	1.7 (1.7)	- (-)	- (-)	- (-)	1.7 (1.7)
合 計	94,249,700 (94,249,700)	94,164,659 (94,164,659)	38.6 (38.6)	- (-)	- (-)	- (-)	38.6 (38.6)

※()内は非上場債で内書きです。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

マネープール・マザーファンド

B 個別銘柄開示 国内(邦貨建)公社債

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国 債 証 券	1238国庫短期証券	—	千円 65,500,000	千円 65,441,705	2025/06/20
	1244国庫短期証券	—	24,500,000	24,471,825	2025/07/22
	小 計	—	90,000,000	89,913,530	—
地 方 債 証 券	30-2 宮城県公債	0.5300	400,000	400,029	2024/10/29
	1-5 大阪市5年	0.0010	600,000	599,886	2024/11/19
	26-5 横浜市公債	0.4710	200,000	200,090	2024/12/13
	51 横浜市5年	0.0010	100,000	99,970	2024/12/13
	1-11 京都府5年	0.0010	400,000	399,880	2024/12/18
	26-11 京都府公債	0.4760	129,700	129,758	2024/12/19
	738 東京都公債	0.4260	100,000	100,045	2024/12/20
	740 東京都公債	0.4630	100,000	100,045	2024/12/20
	211 神奈川県公債	0.4380	400,000	400,181	2024/12/20
	26-15 愛知県公債	0.4800	300,000	300,164	2024/12/20
	489 名古屋市債	0.4610	100,000	100,045	2024/12/20
	27 名古屋市5年	0.0010	300,000	299,881	2024/12/20
	1 京都市20年	2.1400	200,000	200,694	2024/12/20
	87 川崎市公債	0.4410	100,000	100,045	2024/12/20
	26-2 北九州市債	0.4510	200,000	200,090	2024/12/24
	391 大阪府公債	0.5130	210,000	210,134	2024/12/25
26-8 福岡県公債	0.4410	210,000	210,095	2024/12/25	
26-13 北海道公債	0.4610	200,000	200,090	2024/12/26	
	小 計	—	4,249,700	4,251,129	—
	合 計	—	94,249,700	94,164,659	—

(2)国内その他有価証券

	期 末	
	評 価 額	比 率
コ マ ー シ ャ ル ・ ペ ー パ ー	千円 49,967,691	% <20.5>

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

マネープール・マザーファンド

■ 投資信託財産の構成

(2024年10月15日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	4,251,129	1.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	239,526,079	98.3
投 資 信 託 財 産 総 額	243,777,209	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年10月15日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	243,777,209,408円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	99,639,613,075
公 社 債 (評 価 額)	4,251,129,714
現 先 取 引 (公 社 債)	89,913,530,000
現 先 取 引 (そ の 他 有 価 証 券)	49,967,691,103
未 収 利 息	5,245,516
(B) 純 資 産 総 額 (A)	243,777,209,408
元 本	243,887,039,224
次 期 繰 越 損 益 金	△ 109,829,816
(C) 受 益 権 総 口 数	243,887,039,224口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (B / C)	9,995円

※当期における期首元本額256,824,863,304円、期中追加設定元本額21,219,927,278円、期中一部解約元本額34,157,751,358円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

(自2023年10月13日 至2024年10月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	238,308,948円
受 取 利 息	302,692,714
支 払 利 息	△ 64,383,766
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△164,236,491
売 買 益	611,320
売 買 損	△164,847,811
(C) そ の 他 費 用 等	△ 973,870
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	73,098,587
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△195,826,590
(F) 解 約 差 損 益 金	30,604,465
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 17,706,278
(H) 合 計 (D + E + F + G)	△109,829,816
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△109,829,816

※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。

※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。

※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。

■ 期末における元本の内訳は以下の通りです。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）	8,874,310円	三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	24,275,879円
三井住友・公益債券投信（資産成長型）	941,890円	三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	16,035,046円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	11,904,991円	三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	3,266,846円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	729,463円	三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	1,959,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	49,416,809円	SMAM・アセットバランスファンドVA25L3<適格機関投資家限定>	243,769,634,288円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。