

三井住友・公益債券投信 (毎月決算型) 【運用報告書(全体版)】

第22作成期 (2021年7月16日から2022年1月17日まで)

第 127 期 / 第 128 期 / 第 129 期
決算日2021年8月16日 決算日2021年9月15日 決算日2021年10月15日

第 130 期 / 第 131 期 / 第 132 期
決算日2021年11月15日 決算日2021年12月15日 決算日2022年1月17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／内外／債券
信託期間	2011年1月28日から2028年1月17日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資することにより、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。 DWS 世界公益債券ファンド (適格機関投資家専用) 世界各国の公益企業・公社が発行する債券 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	■主として世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資します。 ■対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクを低減します。
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15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および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、将来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への投資を通じて、世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資することにより、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。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

 三井住友DSアセットマネジメント
〒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)

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

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 (分配落)	準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 証 券 率 組 入 比	純 資 産 額
		税 分 配	込 金 騰 落 中 率			
103期 (2019年 8月15日)	円 9,566	円 30	% 2.9	% 0.1	% 97.9	百万円 8,004
104期 (2019年 9月17日)	9,396	30	△1.5	0.1	98.0	7,672
105期 (2019年10月15日)	9,399	30	0.4	0.1	96.6	7,692
106期 (2019年11月15日)	9,360	30	△0.1	0.1	96.4	7,625
107期 (2019年12月16日)	9,386	30	0.6	0.1	97.9	7,542
108期 (2020年 1月15日)	9,371	30	0.2	0.1	96.3	7,550
109期 (2020年 2月17日)	9,499	30	1.7	0.1	96.4	7,620
110期 (2020年 3月16日)	8,949	30	△5.5	0.0	98.1	7,084
111期 (2020年 4月15日)	9,011	30	1.0	0.1	96.2	7,053
112期 (2020年 5月15日)	9,045	30	0.7	0.1	96.6	7,066
113期 (2020年 6月15日)	9,268	30	2.8	0.1	96.7	7,217
114期 (2020年 7月15日)	9,413	30	1.9	0.1	98.0	7,337
115期 (2020年 8月17日)	9,424	30	0.4	0.1	98.2	7,193
116期 (2020年 9月15日)	9,391	30	△0.0	0.1	97.3	7,158
117期 (2020年10月15日)	9,372	30	0.1	0.1	96.6	7,083
118期 (2020年11月16日)	9,371	30	0.3	0.1	96.9	7,060
119期 (2020年12月15日)	9,477	30	1.5	0.1	97.6	7,010
120期 (2021年 1月15日)	9,407	30	△0.4	0.1	97.7	6,744
121期 (2021年 2月15日)	9,324	30	△0.6	0.1	96.2	6,623
122期 (2021年 3月15日)	9,066	30	△2.4	0.1	97.9	6,372
123期 (2021年 4月15日)	9,146	30	1.2	0.1	97.2	6,433
124期 (2021年 5月17日)	9,105	30	△0.1	0.1	96.8	6,432
125期 (2021年 6月15日)	9,172	30	1.1	0.1	97.7	6,464
126期 (2021年 7月15日)	9,236	30	1.0	0.1	96.7	6,470
127期 (2021年 8月16日)	9,238	30	0.3	0.1	97.7	6,434
128期 (2021年 9月15日)	9,217	30	0.1	0.1	97.2	6,337
129期 (2021年10月15日)	9,073	30	△1.2	0.1	96.9	6,232
130期 (2021年11月15日)	9,034	30	△0.1	0.0	96.5	6,175
131期 (2021年12月15日)	8,963	30	△0.5	0.1	98.3	6,005
132期 (2022年 1月17日)	8,783	30	△1.7	0.1	96.3	5,920

※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	債券 比率	投資信託 組入比率	証券 比率
			騰	落率				
第127期	(期首) 2021年7月15日	円	9,236	% —	0.1		96.7	%
	7月末		9,282	0.5	0.1		98.2	
	(期末) 2021年8月16日		9,268	0.3	0.1		97.7	
第128期	(期首) 2021年8月16日		9,238	—	0.1		97.7	
	8月末		9,227	△0.1	0.1		98.2	
	(期末) 2021年9月15日		9,247	0.1	0.1		97.2	
第129期	(期首) 2021年9月15日		9,217	—	0.1		97.2	
	9月末		9,123	△1.0	0.1		96.7	
	(期末) 2021年10月15日		9,103	△1.2	0.1		96.9	
第130期	(期首) 2021年10月15日		9,073	—	0.1		96.9	
	10月末		9,065	△0.1	0.1		98.0	
	(期末) 2021年11月15日		9,064	△0.1	0.0		96.5	
第131期	(期首) 2021年11月15日		9,034	—	0.0		96.5	
	11月末		8,972	△0.7	0.1		97.3	
	(期末) 2021年12月15日		8,993	△0.5	0.1		98.3	
第132期	(期首) 2021年12月15日		8,963	—	0.1		98.3	
	12月末		8,906	△0.6	0.0		96.0	
	(期末) 2022年1月17日		8,813	△1.7	0.1		96.3	

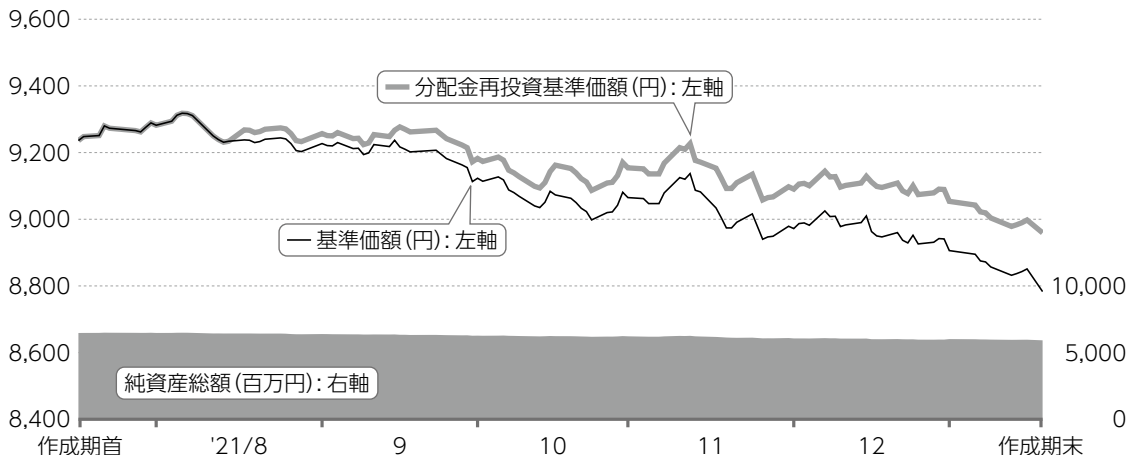
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

※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。

1 運用経過

基準価額等の推移について（2021年7月16日から2022年1月17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	9,236円
作成期末	8,783円 (当作成期既払分配金180円(税引前))
騰落率	-3.0% (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(2021年7月16日から2022年1月17日まで)

当ファンドは投資信託証券への投資を通じて、世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資しました。また、外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行いました。

下落要因

- 米国での早期利上げ観測等を受け、欧米の長期金利(10年国債利回り)が上昇(価格は下落)したこと
- 変異ウイルス(オミクロン型)に対する警戒感が広がり、スプレッド(国債に対する上乗せ金利)が拡大したことで公益債券の利回りが上昇したこと

投資環境について（2021年7月16日から2022年1月17日まで）

長期金利（10年国債利回り）は米国、欧州（ドイツ）ともに上昇しました。公益債券市場も下落しました。

主要先進国の長期金利は、米国、欧州ともに上昇しました。インフレ高進の継続や、FRB（米連邦準備制度理事会）が早期利上げを示唆するなどタカ派（インフレ抑制を重視する立場）色を強めたことから、長期金利は上昇しました。

社債市場においては、変異ウイルスに対する警戒感が広がり、スプレッドが拡大し

ました。世界の投資適格社債の代表的な指数であるブルームバーグ・グローバル総合（除く日本）・社債インデックスのスプレッドは、前期末比で拡大し、円ヘッジベースでのリターンはマイナスとなりました。セクター別のパフォーマンスは、マイナス幅の大きい方から、公益、産業、金融の順となりました。

ポートフォリオについて（2021年7月16日から2022年1月17日まで）

当ファンド

「DWS 世界公益債券ファンド（適格機関投資家専用）」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、「DWS 世界公益債券ファンド（適格機関投資家専用）」の高位組入れを維持しました。

DWS 世界公益債券ファンド（適格機関投資家専用）

当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲイン（利金収入）の獲得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。

国別では、米国、欧州を中心とした配分を継続しました。投資行動としましては、公益企業が発行したグリーンbond（環境分野への取り組みに特化した資金を調達するために発行される債券）等を購入し、一方で割高感の出てきた銘柄を売却する等しました。

金利戦略につきましては、保有債券の年限が長めであることや金融政策の正常化観測を踏まえ、米国国債先物および、ドイツ国債先物の売建てを継続しました。

なお、外貨建資産については対円での為替ヘッジを行っています。

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、流動性の確保など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(2021年7月16日から2022年1月17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(2021年7月16日から2022年1月17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。

なお、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す。

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第127期	第128期	第129期	第130期	第131期	第132期
当期分配金	30	30	30	30	30	30
(対基準価額比率)	(0.32%)	(0.32%)	(0.33%)	(0.33%)	(0.33%)	(0.34%)
当期の収益	14	13	13	13	13	12
当期の収益以外	16	16	16	16	16	17
翌期繰越分配対象額	527	510	494	477	461	443

※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

当ファンド

「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」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、「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」を高位に組み入れることで、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う方針です。

DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)

引き続き、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得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。

国債市場では、F R Bが今後利上げや量的引き締めを実施するとの観測もあり、長期金利は上昇する可能性が見込まれます。

社債市場については、企業業績の改善や、利回りを求める需要が支えになる見通しです。運用方針としましては、魅力的な水準で取引されている債券の組み入れを検討し、金利戦略につきましては、ポートフォリオの金利リスクを中長期的にある程度抑えるためデュレーション(投資資金の平均回収期間)を調整していく方針です。

なお、外貨建資産については対円での為替ヘッジを行います。

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に投資し、安定した収益の確保を目指します。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

1万口当たりの費用明細（2021年7月16日から2022年1月17日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	32円	0.349%	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9,093円です。
（投信会社）	(10)	(0.112)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(20)	(0.224)	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)	(0.014)	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 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
（株式）	(－)	(－)	
（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 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
（株式）	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.003	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）	(0)	(0.003)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	32	0.352	

※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。

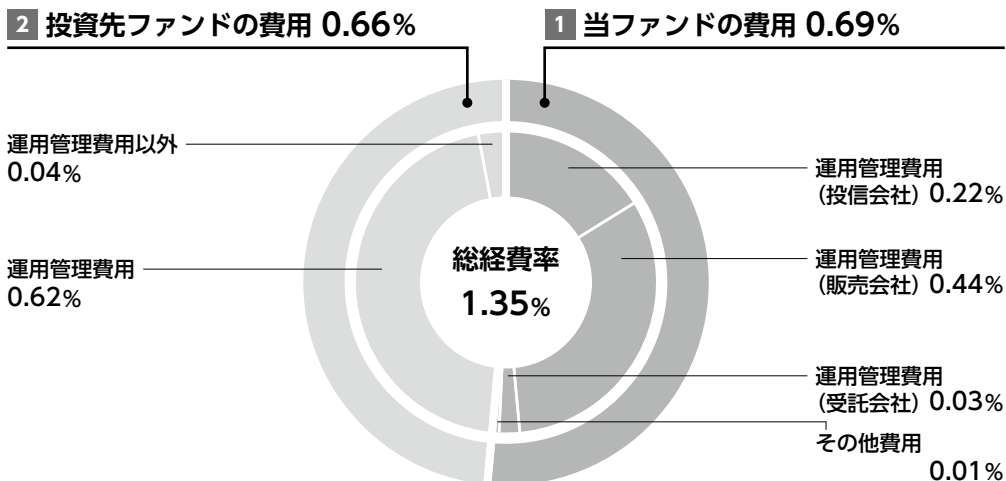
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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)	1.35%
1 当ファンドの費用の比率	0.69%
2 投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.62%
投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.04%

※1の各費用は、前掲「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、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。「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。

※2の各費用は、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「1万口当たりの費用明細」をもとに、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1.35%です。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2021年7月16日から2022年1月17日まで）

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	DWS世界公益債券ファンド（適格機関投資家専用）	138,640,428	千円 132,000	475,194,272	千円 451,000

※金額は受渡し代金。

※国内には、円建ての外国籍投資信託証券を含みます。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等（2021年7月16日から2022年1月17日まで）

利害関係人との取引状況

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

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。

マネープール・マザーファンド

区 分	当 作 成 期			当 作 成 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
公 社 債	百万円 148,004	百万円 49,054	% 33.1	百万円 -	百万円 -	% -

※平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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、当作成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

（2021年7月16日から2022年1月17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（2022年1月17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
DWS世界公益債券ファンド（適格機関投資家専用）	6,534,113,374	6,197,559,530	千円 5,698,655	% 96.3
合 計	6,534,113,374	6,197,559,530	5,698,655	96.3

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

(2) 親投資信託残高

種 類	作 成 期 首		作 成 期 末	
	口	数	口	数
マネープール・マザーファンド		千口 8,874		千口 8,874
				千円 8,876

※マネープール・マザーファンドの作成期末の受益権総口数は335,637,638,595口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年1月17日現在)

項 目	作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	5,698,655	95.8
マネープール・マザーファンド	8,876	0.1
コール・ローン等、その他	240,689	4.0
投資信託財産総額	5,948,222	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年8月16日) (2021年9月15日) (2021年10月15日) (2021年11月15日) (2021年12月15日) (2022年1月17日)

項 目	第127期末	第128期末	第129期末	第130期末	第131期末	第132期末
(A) 資 産	6,462,645,101円	6,380,985,430円	6,267,722,679円	6,215,925,061円	6,061,241,768円	5,948,222,605円
コール・ローン等	169,769,883	213,549,770	219,790,999	168,992,904	148,624,360	240,689,646
投資信託受益証券(評価額)	6,283,994,696	6,158,556,026	6,039,052,046	5,956,053,410	5,903,739,549	5,698,655,987
マネープール・マザーファンド(評価額)	8,880,522	8,879,634	8,879,634	8,878,747	8,877,859	8,876,972
未 収 入 金	—	—	—	82,000,000	—	—
(B) 負 債	28,463,286	43,074,975	34,892,729	40,881,898	55,781,089	27,666,470
未払収益分配金	20,894,262	20,629,596	20,609,075	20,505,257	20,100,213	20,223,221
未払解約金	3,635,044	18,805,657	10,704,583	16,718,482	32,215,751	3,691,529
未払信託報酬	3,901,610	3,610,064	3,550,422	3,628,788	3,437,396	3,721,496
未 払 利 息	317	129	—	—	—	—
その他未払費用	32,053	29,529	28,649	29,371	27,729	30,224
(C) 純資産総額(A-B)	6,434,181,815	6,337,910,455	6,232,829,950	6,175,043,163	6,005,460,679	5,920,556,135
元 本	6,964,754,304	6,876,532,308	6,869,691,684	6,835,085,905	6,700,071,262	6,741,073,828
次期繰越損益金	△ 530,572,489	△ 538,621,853	△ 636,861,734	△ 660,042,742	△ 694,610,583	△ 820,517,693
(D) 受益権総口数	6,964,754,304口	6,876,532,308口	6,869,691,684口	6,835,085,905口	6,700,071,262口	6,741,073,828口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,238円	9,217円	9,073円	9,034円	8,963円	8,783円

※当作成期における作成期首元本額7,005,701,121円、作成期中追加設定元本額250,768,841円、作成期中一部解約元本額515,396,134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。

三井住友・公益債券投信（毎月決算型）

■ 損益の状況

	〔自2021年7月16日〕 〔至2021年8月16日〕	〔自2021年8月17日〕 〔至2021年9月15日〕	〔自2021年9月16日〕 〔至2021年10月15日〕	〔自2021年10月16日〕 〔至2021年11月15日〕	〔自2021年11月16日〕 〔至2021年12月15日〕	〔自2021年12月16日〕 〔至2022年1月17日〕
項 目	第 127 期	第 128 期	第 129 期	第 130 期	第 131 期	第 132 期
(A) 配 当 等 収 益	13,078,803円	12,805,422円	12,740,360円	12,770,199円	12,540,291円	12,381,653円
受 取 配 当 金	13,089,959	12,813,291	12,747,480	12,778,370	12,548,908	12,388,770
受 取 利 息	—	—	103	57	274	308
支 払 利 息	△ 11,156	△ 7,869	△ 7,223	△ 8,228	△ 8,891	△ 7,425
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,034,896	△ 3,295,314	△ 87,012,278	△ 15,023,911	△ 36,543,875	△ 109,800,580
売 買 益	13,280,867	139,849	486,460	61,156	751,625	265,362
売 買 損	△ 245,971	△ 3,435,163	△ 87,498,738	△ 15,085,067	△ 37,295,500	△ 110,065,942
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,933,728	△ 3,642,217	△ 3,582,350	△ 3,658,344	△ 3,465,560	△ 3,751,860
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	22,179,971	5,867,891	△ 77,854,268	△ 5,912,056	△ 27,469,144	△ 101,170,787
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 435,844,630	△ 417,388,716	△ 419,575,619	△ 503,222,598	△ 507,253,917	△ 537,082,740
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 96,013,568	△ 106,471,432	△ 118,822,772	△ 130,402,831	△ 139,787,309	△ 162,040,945
(配当等相当額)	(374,460,058)	(358,720,819)	(348,766,533)	(337,834,838)	(319,993,845)	(310,860,483)
(売買損益相当額)	(△470,473,626)	(△465,192,251)	(△467,589,305)	(△468,237,669)	(△459,781,154)	(△472,901,428)
(G) 合 計 (D + E + F)	△ 509,678,227	△ 517,992,257	△ 616,252,659	△ 639,537,485	△ 674,510,370	△ 800,294,472
(H) 収 益 分 配 金	△ 20,894,262	△ 20,629,596	△ 20,609,075	△ 20,505,257	△ 20,100,213	△ 20,223,221
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 530,572,489	△ 538,621,853	△ 636,861,734	△ 660,042,742	△ 694,610,583	△ 820,517,693
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 107,157,174	△ 116,098,577	△ 128,051,733	△ 141,795,584	△ 150,812,080	△ 173,633,703
(配当等相当額)	(363,316,452)	(349,093,674)	(339,537,572)	(326,442,086)	(308,969,074)	(299,267,729)
(売買損益相当額)	(△470,473,626)	(△465,192,251)	(△467,589,305)	(△468,237,670)	(△459,781,154)	(△472,901,432)
分 配 準 備 積 立 金	4,134,378	2,237,003	—	—	—	—
繰 越 損 益 金	△ 427,549,693	△ 424,760,279	△ 508,810,001	△ 518,247,158	△ 543,798,503	△ 646,883,990

※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 127 期	第 128 期	第 129 期	第 130 期	第 131 期	第 132 期
(a) 経費控除後の配当等収益	11,109,013円	9,163,922円	9,158,716円	9,112,504円	9,075,442円	8,630,463円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	374,460,058	358,720,819	348,766,533	337,834,839	319,993,845	310,860,487
(d) 分配準備積立金	2,776,021	4,075,532	2,221,398	0	0	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	388,345,092	371,960,273	360,146,647	346,947,343	329,069,287	319,490,950
1万口当たり当期分配対象額	557.58	540.89	524.25	507.60	491.14	473.95
(f) 分配金	20,894,262	20,629,596	20,609,075	20,505,257	20,100,213	20,223,221
1万口当たり分配金	30	30	30	30	30	30

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税引前）	第127期	第128期	第129期	第130期	第131期	第132期
	30円	30円	30円	30円	30円	30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。

DWS 世界公益債券ファンド (適格機関投資家専用)

■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／内外／債券
信託期間	無期限
運用方針	インカム・ゲインの獲得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。
主要運用対象	世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時(原則として毎月10日。ただし、当該日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた利子・配当収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき元本部分と同一の運用を行います。

運用報告書(全体版)

第125期(決算日:2021年6月10日)
 第126期(決算日:2021年7月12日)
 第127期(決算日:2021年8月10日)
 第128期(決算日:2021年9月10日)
 第129期(決算日:2021年10月11日)
 第130期(決算日:2021年11月10日)

■投資者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「DWS 世界公益債券ファンド(適格機関投資家専用)」は、2021年11月10日に第130期の決算を行いました。ここに第125期から第130期の運用状況と収益分配金を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。

ドイチュ・アセット・マネジメント株式会社
 東京都千代田区永田町2-11-1 山王パークタワー

〈お問い合わせ先〉

電話番号:03-5156-5108

受付時間:営業日の午前9時~午後5時

<https://funds.dws.com/jp/>

*お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税分		達配		期騰落	債券比率	債券先物比率	純資産額
		分	配	分	配				
	円	円	円	円	円	%	%	%	百万円
101期(2019年6月10日)	9,121	20	20	20	20	1.1	95.6	△5.9	8,304
102期(2019年7月10日)	9,266	20	20	20	20	1.8	96.5	△1.4	8,327
103期(2019年8月13日)	9,486	20	20	20	20	2.6	93.0	△1.4	8,516
104期(2019年9月10日)	9,471	20	20	20	20	0.1	96.8	△1.5	8,299
105期(2019年10月10日)	9,439	20	20	20	20	△0.1	97.3	△9.6	8,139
106期(2019年11月11日)	9,306	20	20	20	20	△1.2	99.0	△9.5	8,033
107期(2019年12月10日)	9,370	20	20	20	20	0.9	96.0	△7.4	8,027
108期(2020年1月10日)	9,374	20	20	20	20	0.3	97.3	△8.7	7,883
109期(2020年2月10日)	9,532	20	20	20	20	1.9	97.2	△8.6	8,139
110期(2020年3月10日)	9,481	20	20	20	20	△0.3	91.1	△3.0	8,041
111期(2020年4月10日)	8,958	20	20	20	20	△5.3	94.7	△7.9	7,463
112期(2020年5月11日)	9,129	20	20	20	20	2.1	93.1	△7.8	7,460
113期(2020年6月10日)	9,409	20	20	20	20	3.3	95.2	△6.1	7,689
114期(2020年7月10日)	9,531	20	20	20	20	1.5	95.5	△6.1	7,810
115期(2020年8月11日)	9,705	20	20	20	20	2.0	96.4	△6.1	7,843
116期(2020年9月10日)	9,538	20	20	20	20	△1.5	96.1	△6.3	7,496
117期(2020年10月12日)	9,501	20	20	20	20	△0.2	95.6	△6.2	7,562
118期(2020年11月10日)	9,541	20	20	20	20	0.6	96.0	△6.0	7,575
119期(2020年12月10日)	9,683	20	20	20	20	1.7	95.7	△5.9	7,484
120期(2021年1月12日)	9,605	20	20	20	20	△0.6	97.6	△7.5	7,209
121期(2021年2月10日)	9,598	20	20	20	20	0.1	98.2	△11.7	7,000
122期(2021年3月10日)	9,367	20	20	20	20	△2.2	99.8	△13.0	6,877
123期(2021年4月12日)	9,416	20	20	20	20	0.7	94.7	△13.0	6,863
124期(2021年5月10日)	9,452	20	20	20	20	0.6	93.4	△12.9	6,972
125期(2021年6月10日)	9,486	20	20	20	20	0.6	96.1	△13.1	6,934
126期(2021年7月12日)	9,564	20	20	20	20	1.0	95.7	△13.6	6,849
127期(2021年8月10日)	9,576	20	20	20	20	0.3	95.1	△13.6	6,892
128期(2021年9月10日)	9,567	20	20	20	20	0.1	96.7	△13.8	6,734
129期(2021年10月11日)	9,387	20	20	20	20	△1.7	96.8	△13.9	6,602
130期(2021年11月10日)	9,508	20	20	20	20	1.5	97.0	△14.2	6,707

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは、主に世界各国の公益企業・公社が発行する債券に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本としております。そのため、ファンドの収益率を測る適切なインデックスが存在せず、ベンチマーク及び参考指数を設けておりません。

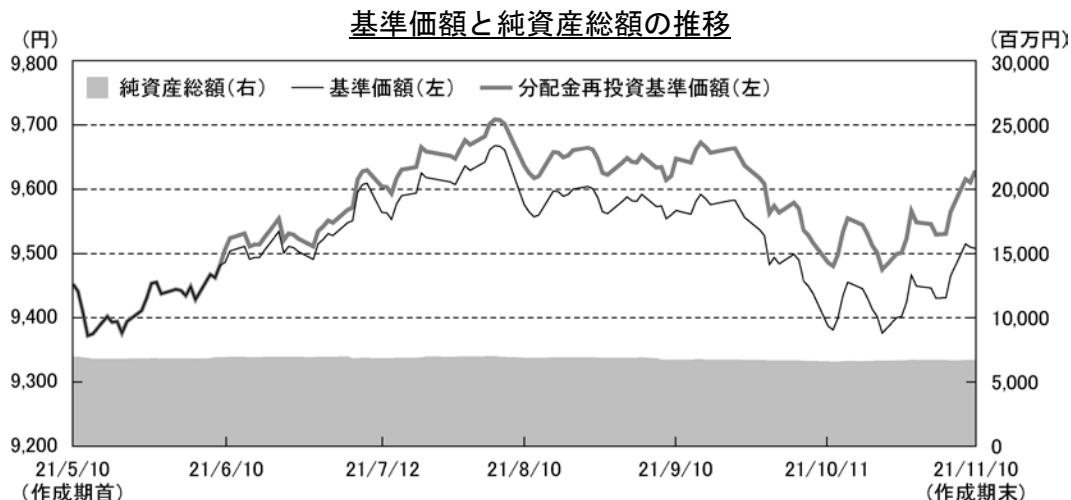
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

○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 率	債 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
第125期	(期 首) 2021年5月10日	円 9,452	% —		% 93.4	% △12.9
	5月末	9,444	△0.1		96.8	△13.1
	(期 末) 2021年6月10日	9,506	0.6		96.1	△13.1
第126期	(期 首) 2021年6月10日	9,486	—		96.1	△13.1
	6月末	9,522	0.4		96.8	△13.2
	(期 末) 2021年7月12日	9,584	1.0		95.7	△13.6
第127期	(期 首) 2021年7月12日	9,564	—		95.7	△13.6
	7月末	9,629	0.7		93.8	△13.4
	(期 末) 2021年8月10日	9,596	0.3		95.1	△13.6
第128期	(期 首) 2021年8月10日	9,576	—		95.1	△13.6
	8月末	9,588	0.1		95.4	△13.5
	(期 末) 2021年9月10日	9,587	0.1		96.7	△13.8
第129期	(期 首) 2021年9月10日	9,567	—		96.7	△13.8
	9月末	9,494	△0.8		97.0	△13.8
	(期 末) 2021年10月11日	9,407	△1.7		96.8	△13.9
第130期	(期 首) 2021年10月11日	9,387	—		96.8	△13.9
	10月末	9,449	0.7		97.4	△14.0
	(期 末) 2021年11月10日	9,528	1.5		97.0	△14.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。



(注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の本質的なパフォーマンスを示すものです。ただし、上記対象期間中の分配金が0円のファンドにつきましては基準価額と重なって表示されております。
 (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入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。

◆ 基準価額

当ファンドの基準価額は作成期末において9,508円(分配落後)となり、分配金込みでは前作成期末比1.9%上昇しました。当ファンドでは当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得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。保有する公益債券の利金収入に加え、米国や欧州(ドイツ)の10年国債利回り(長期金利*)の小幅低下(価格は上昇)等は、基準価額の上昇要因となりました。一方、日本と海外との短期金利差に伴うヘッジコスト等はマイナス要因となりました。

◆ 投資環境

米国、欧州の長期金利は新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う景気回復や、金融政策正常化観測等から変動し、前期比で小幅低下しました。

社債市場では、企業業績回復等が支えとなり、世界の投資適格社債の代表的な指数ブルームバーグ・グローバル総合(除く日本)・社債インデックスのスプレッド*はほぼ変わらず、円ヘッジベースのリターンは1.63%となりました。セクター別では公益2.30%、産業2.08%、金融0.82%となりました。

*金利：債券価格は金利変動の影響を受けます。一般的に金利が低下した場合には債券価格は上昇し、逆に金利が上昇した場合には債券価格は下落する傾向があります。

*スプレッド：主に主要国債(先進国国債など)利回りとの利回り格差のことで、発行体の信用力や流動性等の影響を受けます。一般的に、信用力が高まればスプレッドは縮小(価格の上昇要因)し、信用力が低下すればスプレッドは拡大(価格の下落要因)する傾向があります。

◆運用状況

当ファンドでは当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得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。

幅広い地域や銘柄を組み入れ、国別では、強めの景気回復が見込まれ、市場規模の大きい米国の配分を高め維持しました。また、地政学リスクによる影響、財政や経済動向などを勘案した投資を行いました。金利戦略につきましては、保有債券のデュレーション*が長めであることや、景気回復や金融政策正常化に伴い金利が上昇するリスクを勘案して、米国国債先物およびドイツ国債先物の売り建てを継続しました。

◆収益分配金

基準価額水準等を勘案して、各期とも20円(税引前)といたしました。なお、留保された収益金につきましては、当ファンドの運用の基本方針に基づき運用させていただきます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
	2021年5月11日～ 2021年6月10日	2021年6月11日～ 2021年7月12日	2021年7月13日～ 2021年8月10日	2021年8月11日～ 2021年9月10日	2021年9月11日～ 2021年10月11日	2021年10月12日～ 2021年11月10日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	0.210%	0.209%	0.208%	0.209%	0.213%	0.210%
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	747	754	755	757	758	764

(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四捨五入で算出しているため合計が当期分配金(税込み)と一致しない場合があります。

◆今後の運用方針

当ファンドでは引き続き当初の運用方針通り、世界各国の公益企業・公社が発行する債券を主要投資対象とし、インカム・ゲインの獲得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。

国債市場では、金融政策の正常化観測等を背景に、緩やかな金利上昇が見込まれます。社債市場では、利回りへの底堅い需要が支えになると見えています。運用方針としては、企業価値や価格水準などを勘案した銘柄選択を行う予定としています。金利戦略につきましては、保有債券のデュレーションが長めであることや、金融政策の正常化予想等を考慮し、金利リスクをある程度抑えるためデュレーションを調整していく方針です。

*デュレーション：金利変動に対する債券価格の変動性を示します。一般的にデュレーションが長いほど金利変動に対する価格の変動が大きくなります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年5月11日～2021年11月10日)

項 目	第125期～第130期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	30	0.319	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(29)	(0.305)	委託した資金の運用等の対価
(販 売 会 社)	(0)	(0.003)	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)	(1)	(0.011)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(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 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)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	2	0.021	(c) 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)	(1)	(0.008)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用 ・ 印 刷 費 用 等)	(1)	(0.012)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用や運用報告書の作成に係る費用等
合 計	32	0.341	
期中の平均基準価額は、9,521円です。			

(注1) 期中において発生した費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注4) 監査費用・印刷費用等にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

○売買及び取引の状況

(2021年5月11日～2021年11月10日)

公社債

			第125期～第130期		
			買付額	売付額	
外 国	アメリカ	特殊債券	千米ドル 380	千米ドル 752	
		社債券	674	1,852	
	ユーロ			千ユーロ	千ユーロ
		ドイツ	社債券	596	745
		イタリア	社債券	—	698
		フランス	特殊債券	215	—
			社債券	595	415
		オランダ	特殊債券	447	258
			社債券	873	706
		スペイン	社債券	197	—
		オーストリア	特殊債券	—	196
		ルクセンブルグ	社債券	—	243
	フィンランド	社債券	269	259	
		特殊債券	159	—	
	その他	社債券	398	—	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド	
	特殊債券	—	262		
	社債券	100	518		

(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)単位未満は切捨て。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		第125期～第130期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債券先物取引	百万円 —	百万円 —	百万円 1,821	百万円 1,837

(注1)単位未満は切捨て。

(注2)取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○主要な売買銘柄

(2021年5月11日～2021年11月10日)

公社債

第125期～第130期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
ENGIFP FRN PERPETUAL (ユーロ・フランス)	52,276	DTE 6.375% 04/15/33 (アメリカ)	74,394
ENELIM 2.875% 07/12/41 (アメリカ)	43,525	ENBW FRN 04/05/77 (ユーロ・ドイツ)	52,980
CFELEC 3.875% 07/26/33 (アメリカ)	41,606	ENGIFP 2.875% 10/10/22 (アメリカ)	45,913
TVOYFH 1.375% 06/23/28 (ユーロ・フィンランド)	35,418	EOANGR 6.375% 06/07/32 (イギリス)	43,537
ENELIM 0.875% 06/17/36 (ユーロ・オランダ)	34,034	SECO 2.413% 09/17/30 (アメリカ)	43,238
ENELIM 0.875% 09/28/34 (ユーロ・オランダ)	33,598	TRNIM 1% 10/11/28 (ユーロ・イタリア)	40,984
TENN 1.125% 06/09/41 (ユーロ・オランダ)	33,280	EDF 1% 10/13/26 (ユーロ・フランス)	40,902
SO FRN 09/15/81 (ユーロ・その他)	32,465	EPD 3.35% 03/15/23 (アメリカ)	40,576
EDF 2% 12/09/49 (ユーロ・フランス)	28,036	ORSTED 4.875% 01/12/32 (イギリス)	40,224
RWE 0.625% 06/11/31 (ユーロ・ドイツ)	26,620	SECO 5.06% 04/08/43 (アメリカ)	39,268

(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)単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月11日～2021年11月10日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第125期～第130期	
	買 付	額
公社債		百万円 278

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あり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、DEUTSCHE BANK AG、ドイツ証券です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年5月11日～2021年11月10日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年5月11日～2021年11月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年11月10日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第130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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 34,292	千米ドル 41,646	千円 4,700,256	% 70.1	% —	% 56.3	% 12.0	% 1.7
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	700	695	91,053	1.4	—	1.4	—	—
イタリア	1,380	1,535	200,871	3.0	—	3.0	—	—
フランス	1,200	1,250	163,668	2.4	—	2.4	—	—
オランダ	2,490	2,743	358,962	5.4	—	4.4	0.9	—
スペイン	400	400	52,434	0.8	—	0.8	—	—
ルクセンブルグ	300	306	40,162	0.6	—	0.6	—	—
フィンランド	270	270	35,331	0.5	—	0.5	—	—
アイルランド	400	446	58,444	0.9	—	0.9	—	—
その他	2,593	2,676	350,106	5.2	—	4.8	0.4	—
イギリス	千英ポンド 2,320	千英ポンド 2,980	455,862	6.8	—	6.0	0.8	—
合 計	—	—	6,507,153	97.0	—	81.1	14.1	1.7

(注1) 邦貨換算金額は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(注4) —印は組入れなし。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄		第130期末				
		利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
特殊債券	CFELEC 3.875% 07/26/33	3.875	380	373	42,166	2033/7/26
	CHGRID 3.125% 05/22/23	3.125	500	517	58,381	2023/5/22
	EDF FRN PERPETUAL	5.625	350	372	42,029	—
	KOHNPW 3% 09/19/22	3.0	500	510	57,599	2022/9/19
	POWFIN 3.95% 04/23/30	3.95	250	257	29,054	2030/4/23
	TAQAUH 4.375% 04/23/25	4.375	810	892	100,720	2025/4/23
普通社債券	ADTIN 4% 08/03/26	4.0	207	219	24,718	2026/8/3
	AEE 3.9% 09/15/42	3.9	480	561	63,382	2042/9/15
	AEP 3.3% 06/01/27	3.3	300	324	36,651	2027/6/1
	BRKHEC 3.5% 02/01/25	3.5	1,000	1,068	120,621	2025/2/1
	BRKHEC 3.75% 11/15/23	3.75	400	421	47,612	2023/11/15
	BRKHEC 6.25% 10/15/37	6.25	1,200	1,717	193,832	2037/10/15
	CHINLP 3.125% 05/06/25	3.125	400	420	47,447	2025/5/6
	COLBUN 3.95% 10/11/27	3.95	200	213	24,134	2027/10/11
	D 3.15% 01/15/26	3.15	450	482	54,498	2026/1/15
	D 7% 06/15/38	7.0	1,100	1,641	185,299	2038/6/15
	D FRN 10/01/54	5.75	300	327	36,985	2054/10/1
	DTE 3.65% 03/15/24	3.65	700	741	83,708	2024/3/15
	DTE 3.7% 03/15/45	3.7	250	293	33,088	2045/3/15
	DUK 3.25% 08/15/25	3.25	450	483	54,560	2025/8/15
	DUK 4.8% 12/15/45	4.8	600	764	86,328	2045/12/15
	DUK 6.4% 06/15/38	6.4	1,400	2,070	233,670	2038/6/15
	ED 3.35% 04/01/30	3.35	200	219	24,762	2030/4/1
	ED 4.45% 03/15/44	4.45	1,300	1,578	178,203	2044/3/15
	EDPPL 1.71% 01/24/28	1.71	600	591	66,725	2028/1/24
	ENBCN 1.6% 10/04/26	1.6	110	109	12,386	2026/10/4
	ENELIM 2.875% 07/12/41	2.875	400	399	45,074	2041/7/12
	ENELIM 6.8% 09/15/37	6.8	400	592	66,849	2037/9/15
	EOANGR 6.65% 04/30/38	6.65	850	1,245	140,516	2038/4/30
	EPD 4.85% 03/15/44	4.85	400	493	55,707	2044/3/15
	EPD 5.95% 02/01/41	5.95	700	970	109,563	2041/2/1
	ETP 6.5% 02/01/42	6.5	850	1,124	126,855	2042/2/1
	ETR 2.4% 06/15/31	2.4	340	338	38,166	2031/6/15
	EVRG 5.3% 10/01/41	5.3	600	817	92,281	2041/10/1
	EXC 3.7% 08/15/28	3.7	500	561	63,334	2028/8/15
	EXC 3.7% 09/15/47	3.7	600	708	79,969	2047/9/15
	EXC 7.6% 04/01/32	7.6	400	572	64,612	2032/4/1
	FE 5.4% 12/15/43	5.4	500	666	75,243	2043/12/15
	ISRELE 5% 11/12/24	5.0	260	286	32,317	2024/11/12
	KMI 3.6% 02/15/51	3.6	365	381	43,002	2051/2/15
KMI 4.3% 03/01/28	4.3	200	226	25,537	2028/3/1	
KMI 6.95% 01/15/38	6.95	1,300	1,864	210,459	2038/1/15	
MPLX 4.125% 03/01/27	4.125	280	310	35,082	2027/3/1	
MPLX 4.7% 04/15/48	4.7	320	383	43,238	2048/4/15	
NEE 1.9% 06/15/28	1.9	170	169	19,155	2028/6/15	

銘 柄			第130期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	普通社債券	NEE 2.25% 06/01/30	2.25	200	201	22,755	2030/6/1
		NEE 4.125% 02/01/42	4.125	250	306	34,627	2042/2/1
		NEE FRN 12/01/77	4.8	300	337	38,093	2077/12/1
		NGGLN 2.742% 08/15/26	2.742	645	668	75,445	2026/8/15
		NRUC 2.4% 03/15/30	2.4	305	312	35,271	2030/3/15
		NRUC 3.4% 02/07/28	3.4	390	426	48,141	2028/2/7
		NRUC FRN 04/30/43	4.75	300	310	35,061	2043/4/30
		OKE 3.4% 09/01/29	3.4	400	424	47,937	2029/9/1
		OKE 6.85% 10/15/37	6.85	300	415	46,919	2037/10/15
		ONCRTX 5.25% 09/30/40	5.25	850	1,176	132,780	2040/9/30
		PEG 1.6% 08/15/30	1.6	350	331	37,365	2030/8/15
		PEG 3.95% 05/01/42	3.95	700	836	94,371	2042/5/1
		POWFIN 3.9% 09/16/29	3.9	270	277	31,351	2029/9/16
		PPL 5.125% 11/01/40	5.125	800	1,050	118,529	2040/11/1
		SGSPAA 3.25% 07/29/26	3.25	400	425	48,006	2026/7/29
		SO 0.9% 01/15/26	0.9	200	195	22,033	2026/1/15
		SO 3.75% 03/01/45	3.75	390	450	50,799	2045/3/1
		SO 4.15% 12/01/25	4.15	160	176	19,892	2025/12/1
		SO 4.3% 03/15/42	4.3	500	585	66,102	2042/3/15
		SRE 1.7% 10/01/30	1.7	230	222	25,128	2030/10/1
		TRPCN 7.625% 01/15/39	7.625	900	1,422	160,537	2039/1/15
		TRPCN FRN 03/15/77	5.3	180	189	21,430	2077/3/15
		VLP 4.375% 12/15/26	4.375	300	336	37,945	2026/12/15
		WMB 3.75% 06/15/27	3.75	350	383	43,297	2027/6/15
		WMB 4% 09/15/25	4.0	500	545	61,526	2025/9/15
		WMB 6.3% 04/15/40	6.3	250	348	39,365	2040/4/15
小	計					4,700,256	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	普通社債券	AMPRIO 0.625% 09/23/33	0.625	200	196	25,676	2033/9/23
		ENBW FRN 08/31/81	2.125	200	196	25,773	2081/8/31
		EUROGR 0.741% 04/21/33	0.741	100	100	13,202	2033/4/21
		RWE 0.625% 06/11/31	0.625	200	201	26,401	2031/6/11
イタリア	特殊債券	ACEIM 1.75% 05/23/28	1.75	140	152	19,963	2028/5/23
	普通社債券	ENELIM 5.625% 06/21/27	5.625	400	520	68,068	2027/6/21
		ENELIM FRN PERPETUAL	2.5	300	311	40,773	—
		ENELIM FRN PERPETUAL	2.25	160	166	21,828	—
		ENELIM FRN PERPETUAL	1.875	160	157	20,653	—
		IGIM 0.875% 04/24/30	0.875	220	226	29,584	2030/4/24
フランス	特殊債券	EDF 2% 12/09/49	2.0	200	225	29,557	2049/12/9
		EDF FRN PERPETUAL	5.375	200	222	29,101	—
		EDF FRN PERPETUAL	2.625	200	200	26,294	—
	普通社債券	ENGIFP FRN PERPETUAL	1.5	200	200	26,189	—
		ENGIFP FRN PERPETUAL	1.875	400	401	52,525	—
オランダ	特殊債券	TENN 0.5% 06/09/31	0.5	200	201	26,375	2031/6/9
		TENN FRN PERPETUAL	2.995	630	660	86,478	—
	普通社債券	ALLRNV FRN PERPETUAL	1.625	350	362	47,485	—
		ENBW 0.25% 10/19/30	0.25	140	138	18,089	2030/10/19

銘		柄		第130期末				
				利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	普通社債券	ENBW 6.125% 07/07/39	6.125	200	371	48,598	2039/7/7	
		ENELIM 0% 05/28/26	—	160	159	20,849	2026/5/28	
		ENELIM 0.375% 05/28/29	0.375	200	199	26,048	2029/5/28	
		IBESM FRN PERPETUAL	1.825	100	100	13,120	—	
		REDEXS 1.875% 05/28/25	1.875	300	317	41,482	2025/5/28	
		TENN 1.5% 06/03/39	1.5	210	232	30,436	2039/6/3	
スペイン	普通社債券	NATUEN 0.905% 01/22/31	0.905	200	198	26,032	2031/1/22	
		REESM 0.5% 05/24/33	0.5	200	201	26,401	2033/5/24	
ルクセンブルグ	普通社債券	CZGRID 0.875% 03/31/31	0.875	150	150	19,754	2031/3/31	
		CZGRID 1% 07/16/27	1.0	150	155	20,408	2027/7/16	
フィンランド	普通社債券	TVOYFH 1.375% 06/23/28	1.375	270	270	35,331	2028/6/23	
アイルランド	普通社債券	ESBIRE 1.875% 06/14/31	1.875	200	225	29,438	2031/6/14	
		ESBIRE 2.125% 06/08/27	2.125	200	221	29,006	2027/6/8	
その他	特殊債券	ORSTED FRN 06/26/13	6.25	83	90	11,898	3013/6/26	
		ORSTED FRN 11/24/17	2.25	210	219	28,727	3017/11/24	
		ORSTED FRN 12/09/19	1.75	100	102	13,384	3019/12/9	
		SPPDIS 1% 06/09/31	1.0	160	161	21,160	2031/6/9	
		SPPEUS 1.625% 06/25/27	1.625	300	316	41,460	2027/6/25	
		VATFAL 0.125% 02/12/29	0.125	210	207	27,136	2029/2/12	
	普通社債券	ANVAU 0.625% 08/25/30	0.625	110	110	14,408	2030/8/25	
		ANVAU FRN 03/11/81	1.625	110	110	14,489	2081/3/11	
		APAAU 2% 07/15/30	2.0	260	282	36,905	2030/7/15	
		ENAPHO 1.659% 04/26/24	1.659	210	216	28,354	2024/4/26	
		ENAPHO 1.816% 03/02/31	1.816	140	144	18,928	2031/3/2	
		ENAPHO 2.045% 10/09/28	2.045	200	211	27,673	2028/10/9	
		NGGLN 0.75% 09/01/33	0.75	150	148	19,483	2033/9/1	
		SO FRN 09/15/81	1.875	250	245	32,125	2081/9/15	
		VATFAL FRN 03/19/77	3.0	100	106	13,968	2077/3/19	
小 計						1,351,034		
イギリス					千英ポンド	千英ポンド		
特殊債券	ORSTED 4.875% 01/12/32	4.875	400	524	80,284	2032/1/12		
	ORSTED FRN 02/18/21	2.5	200	197	30,232	3021/2/18		
普通社債券	APAAU 3.125% 07/18/31	3.125	220	237	36,367	2031/7/18		
	CNALN 7% 09/19/33	7.0	200	303	46,380	2033/9/19		
	ENELIM 5.75% 09/14/40	5.75	300	463	70,924	2040/9/14		
	EOANGR 6.375% 06/07/32	6.375	300	424	64,862	2032/6/7		
	IBESM 7.375% 01/29/24	7.375	300	342	52,340	2024/1/29		
	IGYGY 4.75% 01/31/34	4.75	300	388	59,355	2034/1/31		
	VATFAL FRN 06/29/83	2.5	100	98	15,113	2083/6/29		
小 計						455,862		
合 計						6,507,153		

(注1) 邦貨換算金額は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			第130期末	
			買 建 額	売 建 額
外国	債券先物取引		百万円	百万円
		EURO-BUND FU	—	156
		US LONG BOND	—	794

(注1)金額は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2)単位未満は切捨て。

(注3)一印は組入れなし。

○投資信託財産の構成

(2021年11月10日現在)

項 目	第130期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	6,507,153	94.4
コール・ローン等、その他	383,109	5.6
投資信託財産総額	6,890,262	100.0

(注1)評価額の単位未満は切捨て。

(注2)作成期末における外貨建純資産(6,851,434千円)の投資信託財産総額(6,890,262千円)に対する比率は99.4%です。

(注3)外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年11月10日における邦貨換算レートは、1米ドル=112.86円、1ユーロ=130.83円、1英ポンド=152.97円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第125期末	第126期末	第127期末	第128期末	第129期末	第130期末
	2021年6月10日現在	2021年7月12日現在	2021年8月10日現在	2021年9月10日現在	2021年10月11日現在	2021年11月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	14,000,632,179	14,166,632,582	13,971,914,673	14,252,256,332	13,592,959,452	13,819,318,833
コール・ローン等	194,284,954	193,184,334	203,163,060	60,762,306	177,518,684	232,278,455
公社債(評価額)	6,663,745,248	6,556,979,610	6,556,795,991	6,510,915,581	6,394,374,910	6,507,153,791
未収入金	6,948,700,001	7,226,473,674	7,028,009,671	7,526,022,092	6,874,060,702	6,932,372,742
未収利息	71,508,000	67,405,934	61,157,524	72,551,365	62,945,990	62,713,502
前払費用	13,706	13,771	—	—	400,329	402,884
その他未収収益	621,656	942,957	1,277,696	1,579,607	1,904,400	2,221,542
差入委託証拠金	121,758,614	121,632,302	121,510,731	80,425,381	81,754,437	82,175,917
(B) 負債	7,066,433,278	7,316,920,000	7,079,323,995	7,517,878,749	6,990,528,163	7,112,155,428
未払金	7,048,047,462	7,298,570,141	7,061,175,908	7,499,755,583	6,972,424,719	7,094,023,794
未払収益分配金	14,620,365	14,324,596	14,395,405	14,078,842	14,066,736	14,108,677
未払信託報酬	3,678,156	3,846,697	3,491,423	3,695,439	3,602,403	3,466,281
未払利息	77	79	27	27	207	76
その他未払費用	87,218	178,439	261,232	348,858	434,278	556,600
(C) 純資産総額(A-B)	6,934,198,901	6,849,712,582	6,892,590,678	6,734,377,583	6,602,431,289	6,707,163,405
元本	7,310,182,684	7,162,298,311	7,197,702,621	7,039,421,260	7,033,368,329	7,054,338,999
次期繰越損益金	△ 375,983,783	△ 312,585,729	△ 305,111,943	△ 305,043,677	△ 430,937,040	△ 347,175,594
(D) 受益権総口数	7,310,182,684口	7,162,298,311口	7,197,702,621口	7,039,421,260口	7,033,368,329口	7,054,338,999口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,486円	9,564円	9,576円	9,567円	9,387円	9,508円

(注)第125期首元本額は7,376,266,017円、第125～130期中追加設定元本額は287,547,082円、第125～130期中一部解約元本額は609,474,100円です。

○損益の状況

項 目	第125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
	2021年5月11日～ 2021年6月10日	2021年6月11日～ 2021年7月12日	2021年7月13日～ 2021年8月10日	2021年8月11日～ 2021年9月10日	2021年9月11日～ 2021年10月11日	2021年10月12日～ 2021年11月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	19,836,469	20,052,709	18,029,230	18,801,725	19,161,936	18,542,485
受取利息	19,589,832	19,958,683	17,773,519	18,780,885	18,850,944	18,316,090
その他収益金	247,972	94,413	257,111	21,000	311,901	227,250
支払利息	△ 1,335	△ 387	△ 1,400	△ 160	△ 909	△ 855
(B) 有価証券売買損益	34,922,154	73,548,193	16,066,403	△ 1,929,562	△158,252,049	114,903,764
売買益	157,946,834	144,200,680	149,373,705	51,748,884	160,011,043	155,597,718
売買損	△123,024,680	△ 70,652,487	△133,307,302	△ 53,678,446	△318,263,092	△ 40,693,954
(C) 先物取引等取引損益	△ 11,845,650	△ 19,436,127	△ 7,417,653	△ 5,513,760	△ 30,852,581	△ 30,825,318
取引益	1,774,449	-	-	1,231,313	30,852,581	-
取引損	△ 13,620,099	△ 19,436,127	△ 7,417,653	△ 6,745,073	-	△ 30,825,318
(D) 信託報酬等	△ 3,892,791	△ 4,048,367	△ 3,695,203	△ 3,920,686	△ 3,834,243	△ 3,808,544
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	39,020,182	70,116,408	22,982,777	7,437,717	△112,071,775	98,812,387
(F) 前期繰越損益金	△ 4,717,052	28,527,828	83,658,417	90,217,312	83,146,077	△ 42,528,901
(G) 追加信託差損益金	△405,100,652	△396,905,369	△397,357,732	△388,619,864	△387,944,606	△389,350,403
(配当等相当額)	(95,637,277)	(93,702,512)	(99,915,498)	(97,718,363)	(99,507,718)	(105,842,639)
(売買損益相当額)	(△500,737,929)	(△490,607,881)	(△497,273,230)	(△486,338,227)	(△487,452,324)	(△495,193,042)
(H) 計(E+F+G)	△361,363,418	△298,261,133	△290,716,538	△290,964,835	△416,870,304	△333,066,917
(I) 収益分配金	△ 14,620,365	△ 14,324,596	△ 14,395,405	△ 14,078,842	△ 14,066,736	△ 14,108,677
次期繰越損益金(H+I)	△375,983,783	△312,585,729	△305,111,943	△305,043,677	△430,937,040	△347,175,594
追加信託差損益金	△405,100,652	△396,905,369	△397,357,732	△388,619,864	△387,944,606	△389,350,403
(配当等相当額)	(95,637,277)	(93,702,512)	(99,915,498)	(97,718,363)	(99,507,718)	(105,842,639)
(売買損益相当額)	(△500,737,929)	(△490,607,881)	(△497,273,230)	(△486,338,227)	(△487,452,324)	(△495,193,042)
分配準備積立金	451,049,711	446,558,302	444,193,061	435,227,485	434,248,622	433,312,270
繰越損益金	△421,932,842	△362,238,662	△351,947,272	△351,651,298	△477,241,056	△391,137,461

(注1) (A) 配当等収益—支払利息にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

(注2) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注3) (D) 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4) (G) 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

項 目	第125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
	2021年5月11日～ 2021年6月10日	2021年6月11日～ 2021年7月12日	2021年7月13日～ 2021年8月10日	2021年8月11日～ 2021年9月10日	2021年9月11日～ 2021年10月11日	2021年10月12日～ 2021年11月10日
a. 配当等収益(費用控除後)	18,037,221円	18,958,031円	15,532,012円	14,881,039円	15,327,693円	17,854,281円
b. 有価証券売買等損益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	0	0	0	0	0	0
c. 信託約款に定める収益調整金	95,637,277	93,702,512	99,915,498	97,718,363	99,507,718	105,842,639
d. 信託約款に定める分配準備積立金	447,632,855	441,924,867	443,056,454	434,425,288	432,987,665	429,566,666
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	561,307,353	554,585,410	558,503,964	547,024,690	547,823,076	553,263,586
f. 分配対象収益(1万口当たり)	767	774	775	777	778	784
g. 分配金	14,620,365	14,324,596	14,395,405	14,078,842	14,066,736	14,108,677
h. 分配金(1万口当たり)	20	20	20	20	20	20

○分配金のお知らせ

	第125期	第126期	第127期	第128期	第129期	第130期
1 万口当たり分配金 (税込み)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

(注1) 分配金をお支払いする場合

分配金のお支払いは、原則として決算日から起算して5営業日までに開始いたします。

(注2) 分配金を再投資する場合

お手持り分配金は、税引後みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

* 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。

<お知らせ>

- ・ 該当事項はございません。

マネープール・マザーファンド

第12期（2020年10月13日から2021年10月12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
8期(2017年10月12日)	10,041	△0.1	95.9	470,433
9期(2018年10月12日)	10,032	△0.1	16.6	440,044
10期(2019年10月15日)	10,023	△0.1	96.1	411,156
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

※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

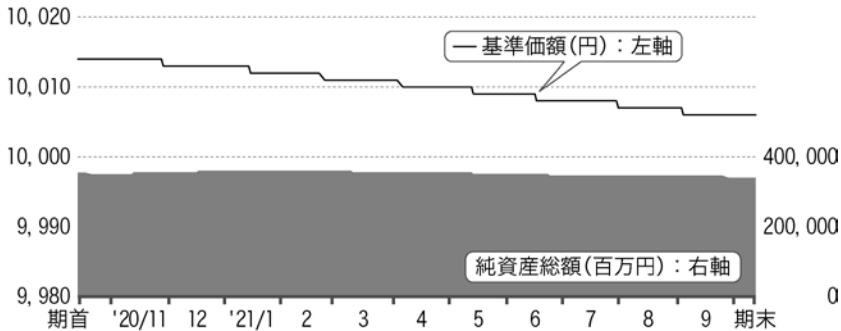
年月日	基準価額		公社債 組入比率
		騰落率	
(期首) 2020年10月12日	円 10,014	% -	% 93.4
10月末	10,014	0.0	94.8
11月末	10,013	△0.0	94.8
12月末	10,013	△0.0	92.2
2021年1月末	10,012	△0.0	94.3
2月末	10,011	△0.0	94.5
3月末	10,011	△0.0	50.2
4月末	10,010	△0.0	78.2
5月末	10,009	△0.0	65.8
6月末	10,008	△0.1	94.2
7月末	10,007	△0.1	93.8
8月末	10,007	△0.1	93.6
9月末	10,006	△0.1	37.6
(期末) 2021年10月12日	10,006	△0.1	92.9

※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 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

基準価額等の推移



期首	10,014円
期末	10,006円
騰落率	-0.1%

▶ 基準価額の変動要因 (2020年10月13日から2021年10月12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。

下落要因

・日銀によるマイナス金利政策が継続され、主要投資対象である短期公社債や短期金融商品におけるマイナス利回りが続いたこと

▶ 投資環境について (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

短期金利は低下しました。

物価の上昇率がマイナス圏で推移したことや、新型コロナウイルスの感染が再拡大したことから、日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を据え置き、日銀当座預金の一部へのマイナス金利付利を継続しました。

日銀が需給動向を勘案し短期国債の買入れ額を調整したことから、国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期初から7月まで横ばいで推移しました。しかし、7月中旬以降は短期国債の発行が大幅に減額され徐々に需給がひっ迫したことから、8月中旬に利回りは低下しました。

▶ ポートフォリオについて (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

短期金利は低位での推移が継続するとの見通しから、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 (2020年10月13日から2021年10月12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

2%の物価安定目標の達成が展望出来ない中、日銀によるマイナス金利政策が継続され、短期国債利回りやコールローン翌日物金利など、主要投資対象である短期公社債および短期金融商品の利回りは引続きマイナス圏での推移を想定します。

残存0年から1年3ヵ月までの公社債や短期金融商品で利回りのマイナス幅が小さい投資対象を選定し、マイナス利回りの影響を抑制することに配慮して運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細(2020年10月13日から2021年10月12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)	0.002% (0.002)	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	0.002	

期中の平均基準価額は10,010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(2020年10月13日から2021年10月12日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	3,587,875,790	3,073,046,314 (520,100,000)
	地方債証券	75,135,078	— (79,516,930)
	特殊債証券	10,336,755	— (14,836,800)

※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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 利害関係人との取引状況等(2020年10月13日から2021年10月12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 540,034	百万円 90,770	% 16.8	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
(2020年10月13日から2021年10月12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。

マネープール・マザーファンド

■ 組入れ資産の明細 (2021年10月12日現在)

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	229,640,000 (229,640,000)	229,782,056 (229,782,056)	67.6 (67.6)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	67.6 (67.6)
地 方 債 証 券	75,359,300 (75,359,300)	75,584,188 (75,584,188)	22.2 (22.2)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	22.2 (22.2)
特 殊 債 券 (除く金融債券)	10,577,100 (10,577,100)	10,622,181 (10,622,181)	3.1 (3.1)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	3.1 (3.1)
合 計	315,576,400 (315,576,400)	315,988,427 (315,988,427)	92.9 (92.9)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	92.9 (92.9)

※()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。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

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
		%	千円	千円	
国 債 証 券	1011国庫短期証券	—	10,000,000	10,000,320	2021/10/25
	1012国庫短期証券	—	990,000	990,058	2021/11/01
	1014国庫短期証券	—	10,000,000	10,000,810	2021/11/08
	1024国庫短期証券	—	8,650,000	8,651,868	2021/12/20
	1029国庫短期証券	—	100,000,000	100,028,000	2022/01/17
	1023国庫短期証券	—	100,000,000	100,111,000	2022/09/20
	小 計	—	229,640,000	229,782,056	—
地 方 債 証 券	24 名古屋市5年	0.0010	300,000	299,985	2021/10/13
	28-10 愛知県5年	0.0010	300,000	299,979	2021/10/14
	23-5 福岡県公債	1.0200	1,100,000	1,100,305	2021/10/25
	28-7 埼玉県5年	0.0010	700,000	699,934	2021/10/26
	23-6 埼玉県公債	1.0200	500,000	500,187	2021/10/27
	23-11 愛知県公債	1.0300	1,000,000	1,000,376	2021/10/28
	23-1 福井県公債	1.0000	200,000	200,075	2021/10/28
	23-4 横浜市公債	1.0450	450,000	450,348	2021/11/12
	23-9 静岡県公債	1.0450	100,000	100,117	2021/11/25
	23-5 千葉県公債	1.0600	600,000	600,704	2021/11/25
	23-14 愛知県公債	1.0060	300,000	300,382	2021/11/30
	28-5 大阪市5年	0.0010	600,000	599,941	2021/11/30
	23-1 岡山県公債	1.0200	300,000	300,382	2021/11/30
	45 横浜市5年	0.0010	400,000	399,960	2021/12/16
702 東京都公債	1.0400	700,000	701,311	2021/12/20	

マネープール・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	703 東京都公債	0.9900	2,800,000	2,804,967	2021/12/20
	704 東京都公債	0.9700	900,000	901,596	2021/12/20
	186 神奈川県公債	1.0400	1,717,600	1,720,817	2021/12/20
	477 名古屋市債	1.0340	400,000	400,749	2021/12/20
	4 川崎市公債15年	2.1100	700,000	702,760	2021/12/20
	23-8 福岡県公債	1.0400	1,300,000	1,302,563	2021/12/22
	23-4 京都市公債	1.0670	620,000	621,222	2021/12/22
	28-7 福岡県5年	0.0200	100,000	100,000	2022/01/20
	23-7 千葉県公債	0.9900	700,000	701,946	2022/01/25
	23-11 兵庫県公債	0.9500	200,000	200,536	2022/01/27
	23-9 埼玉県公債	0.9900	500,000	501,390	2022/01/27
	357 大阪府公債	0.9700	200,000	200,556	2022/01/28
	23-5 横浜市公債	1.0110	700,000	702,016	2022/01/28
	23-17 愛知県公債	0.9960	200,000	200,576	2022/01/31
	23-10 埼玉県公債	0.9900	650,000	652,332	2022/02/24
	23-19 愛知県公債	1.0060	100,000	100,368	2022/02/28
	23-10 福岡県公債	1.0300	100,000	100,378	2022/02/28
	23-9 京都市公債	1.0100	200,000	200,859	2022/03/16
	23-13 兵庫県公債	0.9800	100,000	100,409	2022/03/16
	705 東京都公債	1.0600	970,000	974,358	2022/03/18
	706 東京都公債	0.9600	802,000	805,286	2022/03/18
	707 東京都公債	0.8700	1,300,000	1,304,807	2022/03/18
	7 東京都7年	0.2490	100,000	100,101	2022/03/18
	189 神奈川県公債	0.8900	400,000	401,518	2022/03/18
	70 神奈川県5年	0.0100	4,220,000	4,219,666	2022/03/18
	71 神奈川県5年	0.0100	2,900,000	2,899,770	2022/03/18
	29-2 静岡県5年	0.0100	1,400,000	1,399,889	2022/03/18
	29-4 静岡県5年	0.0100	1,200,000	1,199,905	2022/03/18
	478 名古屋市債	1.0630	100,000	100,449	2022/03/18
	49 川崎市5年	0.0100	2,004,000	2,003,841	2022/03/18
	23-9 千葉県公債	1.0000	250,000	251,124	2022/03/25
	359 大阪府公債	0.9900	100,000	100,449	2022/03/29
	23-20 愛知県公債	1.0820	100,000	100,499	2022/03/29
	24-1 静岡県公債	1.0680	200,000	201,100	2022/04/20
	24-1 千葉県公債	1.0500	200,000	201,119	2022/04/25
	46 横浜市5年	0.0100	1,400,000	1,400,036	2022/04/25
	23-3 福井県公債	1.0300	100,000	100,540	2022/04/25
	24-1 埼玉県公債	1.0500	300,000	301,680	2022/04/26
	24-2 愛知県公債	0.9820	150,000	150,780	2022/04/27
	29-3 愛知県5年	0.0100	100,000	100,002	2022/05/16
	24-2 埼玉県公債	0.9100	200,000	201,082	2022/05/18
	24-3 静岡県公債	0.9060	200,000	201,081	2022/05/20
	24-1 広島県公債	0.9100	400,000	402,243	2022/05/25
	24-2 千葉県公債	0.9100	400,000	402,243	2022/05/25
	29-1 大阪市5年	0.0100	800,000	800,024	2022/05/25
	24-3 兵庫県公債	0.8770	100,000	100,541	2022/05/27
	360 大阪府公債	0.9000	500,000	502,803	2022/05/30
	24-3 愛知県公債	0.8910	300,000	301,682	2022/05/30
	708 東京都公債	0.8900	500,000	503,056	2022/06/20

マネープール・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	709 東京都公債	0.7800	600,000	603,189	2022/06/20
	710 東京都公債	0.8100	200,000	201,102	2022/06/20
	190 神奈川県公債	0.8800	1,400,000	1,408,422	2022/06/20
	191 神奈川県公債	0.8300	1,002,000	1,007,725	2022/06/20
	24-2 京都府公債	0.9100	1,176,700	1,184,014	2022/06/20
	29-7 静岡県5年	0.0100	200,000	200,006	2022/06/20
	479 名古屋市債	0.8910	300,000	301,833	2022/06/20
	24-1 横浜市公債	0.9100	400,000	402,486	2022/06/20
	50 川崎市5年	0.0100	100,000	100,003	2022/06/20
	29-3 京都府5年	0.0100	100,000	100,003	2022/06/21
	24-1 福岡県公債	0.8800	100,000	100,611	2022/06/22
	361 大阪府公債	0.9200	1,076,000	1,083,007	2022/06/28
	24-5 愛知県公債	0.8860	700,000	704,420	2022/06/28
	139 大阪府5年	0.0010	160,000	159,990	2022/06/29
	29-2 福岡県5年	0.0100	100,000	100,003	2022/07/19
	24-5 静岡県公債	0.8490	500,000	503,260	2022/07/20
	24-2 広島県公債	0.8400	212,500	213,885	2022/07/25
	24-4 埼玉県公債	0.8400	800,000	805,214	2022/07/25
	24-7 愛知県公債	0.8010	100,000	100,632	2022/07/27
	13-1 宮城県5年	0.0100	100,000	100,003	2022/07/28
	140 大阪府5年	0.0010	6,564,000	6,563,632	2022/07/28
	362 大阪府公債	0.8300	200,000	201,304	2022/07/29
	24-15 兵庫県公債	0.7500	400,000	402,531	2022/08/16
	24-4 福岡県公債	0.8400	200,000	201,445	2022/08/24
	24-8 愛知県公債	0.8350	900,000	906,592	2022/08/29
	24-2 京都市公債	0.8490	122,500	123,409	2022/08/29
	363 大阪府公債	0.7700	942,000	948,339	2022/08/30
	141 大阪府5年	0.0010	3,464,000	3,463,816	2022/08/30
	711 東京都公債	0.8200	300,000	302,320	2022/09/20
	712 東京都公債	0.7700	3,400,000	3,424,568	2022/09/20
	713 東京都公債	0.7700	350,000	352,529	2022/09/20
	8 東京都7年	0.2380	100,000	100,224	2022/09/20
	192 神奈川県公債	0.8050	200,000	201,505	2022/09/20
	72 神奈川県5年	0.0200	100,000	100,015	2022/09/20
	73 神奈川県5年	0.0200	400,000	400,060	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	290,000	292,242	2022/09/20
	24-7 静岡県公債	0.8290	100,000	100,782	2022/09/20
	480 名古屋市債	0.8250	300,000	302,319	2022/09/20
	29-6 京都府5年	0.0200	200,000	200,000	2022/09/21
	24-5 千葉県公債	0.8200	300,000	302,319	2022/09/22
	24-3 広島県公債	0.8200	266,000	268,082	2022/09/26
	364 大阪府公債	0.7900	700,000	705,268	2022/09/27
	24-9 愛知県公債	0.8490	1,800,000	1,814,625	2022/09/28
	24-2 横浜市公債	0.8150	600,000	604,938	2022/10/17
	24-18 兵庫県公債	0.7700	600,000	604,702	2022/10/19
	24-6 京都府公債	0.8000	200,000	201,647	2022/10/21
	24-4 京都市公債	0.8010	300,000	302,471	2022/10/21
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	100,813	2022/10/21
	24-6 福岡県公債	0.8000	200,000	201,646	2022/10/25

マネープール・マザーファンド

種 類	銘 柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	24-6 埼玉県公債	0.8010	500,000	504,169	2022/10/26
	24-1 福井県公債	0.8000	300,000	302,501	2022/10/26
	24-6 千葉県公債	0.8100	100,000	100,904	2022/11/25
	24-4 広島県公債	0.8100	100,000	100,914	2022/11/28
	小 計	-	75,359,300	75,584,188	-
特 殊 債 券 (除く金融債券)	29政保地方公共団	1.0000	100,000	100,008	2021/10/18
	211 政保預金保険	0.1000	200,000	200,000	2021/10/19
	147 政保道路機構	1.0000	206,000	206,077	2021/10/29
	149 政保道路機構	1.0000	315,000	315,401	2021/11/30
	2政保地方公共8年	0.5020	100,000	100,098	2021/12/24
	152 政保道路機構	1.1000	409,600	410,570	2021/12/28
	155 政保道路機構	0.9000	711,000	712,976	2022/01/31
	157 政保道路機構	0.9000	2,967,000	2,977,345	2022/02/28
	34政保地方公共団	0.9000	100,000	100,389	2022/03/14
	159 政保道路機構	0.9000	594,300	596,671	2022/03/18
	59 政保関西空港	0.9000	100,000	100,419	2022/03/25
	35政保地方公共団	0.9770	2,200,000	2,211,653	2022/04/22
	36政保地方公共団	0.9010	200,000	201,120	2022/05/20
	228 政保預金保険	0.1000	800,000	800,578	2022/05/20
	163 政保道路機構	0.9010	269,200	270,789	2022/05/31
	37政保地方公共団	0.8950	100,000	100,630	2022/06/17
	168 政保道路機構	0.8390	135,000	135,933	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	200,000	201,403	2022/08/15
	1 政保新関西空港	0.8010	200,000	201,463	2022/08/29
	170 政保道路機構	0.8010	370,000	372,744	2022/08/31
	19 政保政策投資B	2.1000	300,000	305,904	2022/09/14
	小 計	-	10,577,100	10,622,181	-
	合 計	-	315,576,400	315,988,427	-

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

■ 投資信託財産の構成

(2021年10月12日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	115,849,427	33.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	226,190,525	66.1
投 資 信 託 財 産 総 額	342,039,952	100.0

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年10月12日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	342,039,952,117円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	25,934,501,870
公 社 債 (評 価 額)	115,849,427,112
現 先 取 引 (公 社 債)	200,139,000,000
未 収 利 息	95,706,349
前 払 費 用	21,316,786
(B) 負 債	1,912,549,948
未 払 金	1,911,915,000
そ の 他 未 払 費 用	634,948
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	340,127,402,169
元 本	339,935,919,283
次 期 繰 越 損 益 金	191,482,886
(D) 受 益 権 総 口 数	339,935,919,283口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,006円

※当期における期首元本額353,828,408,194円、期中追加設定元本額9,387,307,187円、期中一部解約元本額23,279,796,098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。

■ 当期末における、元本の内訳は以下の通りです。

SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(ブラジルリアル)	144,000,000円	三井住友・公益債券投信(資産成長型)	941,890円
SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(南アランド)	3,474,833円	日興グラビティ・ヨーロッパ・ファンド	9,958,176円
SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(中国元)	12,046,048円	BNPパリバ・グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)	1,485,087円
SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(豪ドル)	50,000,000円	米国優先リートファンド(為替ヘッジあり)	1,953,537円
SMBC・日興ニューワールド債券ファンド(円)	11,000,000円	米国優先リートファンド(為替ヘッジなし)	2,960,215円
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2050	897,182円
グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジ型)	4,305,812円	三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	329,342円
グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ノーヘッジ型)	1,026,625円	SMAM・アセットバランスファンドVA2.5L3<適格機関投資家限定>	339,682,666,226円

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2020年10月13日 至2021年10月12日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	235,628,659円
受 取 利 息	273,482,013
支 払 利 息	△ 37,853,354
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△536,576,287
売 買 損 益	178,000
売 買 損 益	△536,754,287
(C) そ の 他 費 用 等	△ 5,715,408
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△306,663,036
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	507,762,104
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 22,308,995
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	12,692,813
(H) 合 計 (D + E + F + G)	191,482,886
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	191,482,886

※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。

※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。

※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。