

三井住友・バンクローン・ ファンド (為替ヘッジあり) 毎月決算型

【繰上償還 運用報告書(全体版)】

第21作成期(2023年10月27日から2024年3月12日まで)

第 121 期 / 第 122 期 / 第 123 期
決算日 2023年11月27日 決算日 2023年12月26日 決算日 2024年1月26日

第 124 期 / 第 125 期
決算日 2024年2月26日 償還日 2024年3月12日

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、主として米国企業向けの貸付債権(バンクローン)等に投資し、安定的なインカム収益の確保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。

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)

■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/その他資産(バンクローン) |
| 信託期間 | 2013年10月30日から2024年3月12日まで |
| 運用方針 | 投資信託証券への投資を通じて、主として米国企業向けの貸付債権(バンクローン)等に投資し、安定的なインカム収益の確保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。 ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ(JPY) I マンスリー・ディストリビューティング・クラス 米国企業向けバンクローン マネー・アカウント・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、米国の投資適格未滿(BB格以下)企業向けの貸付債権(バンクローン)に投資することにより、安定的なインカム収益の確保を目指して運用を行います。 ■外貨建資産に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。 ■実質的な運用は、バンクローンの運用に強みを持つ「ニューバーガー・バーマン・グループ」が行います。 |
| 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26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。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ■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、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。 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）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 準 価 額 (分配落) | 税 配 込 期 騰 落 中 率 | | | 公 社 債 率 組 入 比 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|------------------|-----------------|------|-----|------------------|---------------------|---------|
| | | 分 配 | 金 | 騰 落 | | | |
| | 円 | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 96期(2021年10月26日) | 8,621 | 20 | 0.1 | 0.2 | 97.5 | 57 | |
| 97期(2021年11月26日) | 8,595 | 20 | △0.1 | 0.2 | 97.6 | 53 | |
| 98期(2021年12月27日) | 8,579 | 20 | 0.0 | 0.2 | 89.7 | 53 | |
| 99期(2022年1月26日) | 8,593 | 20 | 0.4 | 0.2 | 97.7 | 53 | |
| 100期(2022年2月28日) | 8,495 | 20 | △0.9 | 0.2 | 97.6 | 52 | |
| 101期(2022年3月28日) | 8,411 | 20 | △0.8 | 0.2 | 97.6 | 51 | |
| 102期(2022年4月26日) | 8,444 | 20 | 0.6 | 0.2 | 97.5 | 52 | |
| 103期(2022年5月26日) | 8,097 | 20 | △3.9 | 0.2 | 97.4 | 50 | |
| 104期(2022年6月27日) | 8,020 | 20 | △0.7 | 0.3 | 97.6 | 48 | |
| 105期(2022年7月26日) | 7,992 | 20 | △0.1 | 0.3 | 97.5 | 48 | |
| 106期(2022年8月26日) | 8,129 | 20 | 2.0 | 0.3 | 97.5 | 49 | |
| 107期(2022年9月26日) | 7,955 | 20 | △1.9 | 0.3 | 97.4 | 48 | |
| 108期(2022年10月26日) | 7,838 | 20 | △1.2 | 0.3 | 97.5 | 45 | |
| 109期(2022年11月26日) | 7,885 | 20 | 0.9 | 0.3 | 97.1 | 46 | |
| 110期(2022年12月26日) | 7,854 | 20 | △0.1 | 0.3 | 97.4 | 45 | |
| 111期(2023年1月26日) | 7,981 | 20 | 1.9 | 0.3 | 97.4 | 46 | |
| 112期(2023年2月27日) | 7,978 | 20 | 0.2 | 0.3 | 97.4 | 46 | |
| 113期(2023年3月27日) | 7,860 | 20 | △1.2 | 0.3 | 97.3 | 45 | |
| 114期(2023年4月26日) | 7,907 | 20 | 0.9 | 0.3 | 97.5 | 45 | |
| 115期(2023年5月26日) | 7,820 | 20 | △0.8 | 0.3 | 97.5 | 45 | |
| 116期(2023年6月26日) | 7,886 | 20 | 1.1 | 0.3 | 97.6 | 45 | |
| 117期(2023年7月26日) | 7,957 | 20 | 1.2 | 0.2 | 97.6 | 45 | |
| 118期(2023年8月28日) | 7,966 | 20 | 0.4 | 0.3 | 97.6 | 44 | |
| 119期(2023年9月26日) | 8,018 | 20 | 0.9 | 0.2 | 97.6 | 44 | |
| 120期(2023年10月26日) | 7,941 | 20 | △0.7 | 0.3 | 97.0 | 44 | |
| 121期(2023年11月27日) | 7,959 | 20 | 0.5 | 0.3 | 97.0 | 44 | |
| 122期(2023年12月26日) | 7,985 | 20 | 0.6 | 0.2 | 97.0 | 44 | |
| 123期(2024年1月26日) | 7,989 | 20 | 0.3 | 0.2 | 97.5 | 42 | |
| 124期(2024年2月26日) | 7,984 | 20 | 0.2 | 0.3 | 96.7 | 36 | |
| (償還日) | (償還価額) | | | | | | |
| 125期(2024年3月12日) | 7,986.91 | 0 | 0.0 | — | — | 36 | |

※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

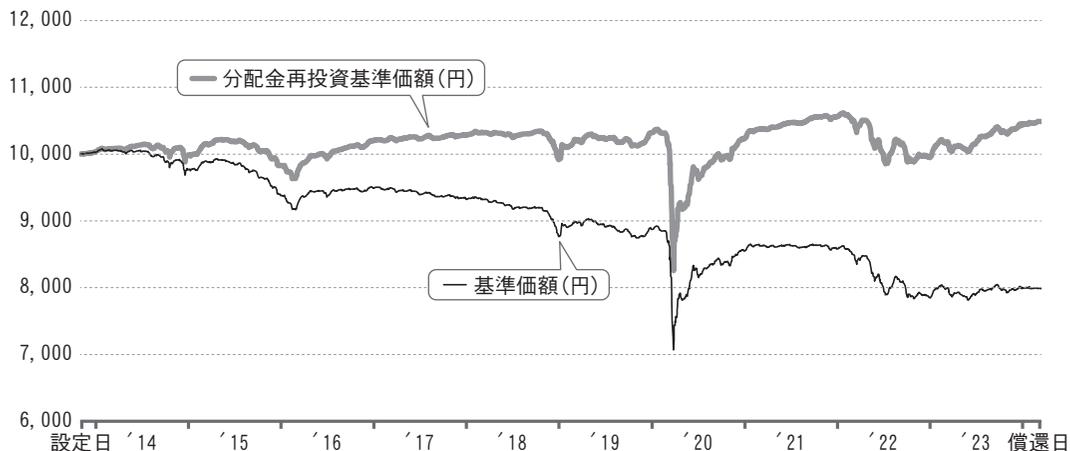
| 決算期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 公 社 債 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|-------|----------------------|--------------------|--------|-------|----------|---------------------|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| 第121期 | (期 首) 2023年10月26日 | 円 7,941 | % — | | % 0.3 | % 97.0 |
| | 10月末 | 7,931 | △0.1 | | 0.3 | 97.0 |
| | (期 末) 2023年11月27日 | 7,979 | 0.5 | | 0.3 | 97.0 |
| 第122期 | (期 首) 2023年11月27日 | 7,959 | — | | 0.3 | 97.0 |
| | 11月末 | 7,967 | 0.1 | | 0.3 | 97.0 |
| | (期 末) 2023年12月26日 | 8,005 | 0.6 | | 0.2 | 97.0 |
| 第123期 | (期 首) 2023年12月26日 | 7,985 | — | | 0.2 | 97.0 |
| | 12月末 | 7,995 | 0.1 | | 0.2 | 97.0 |
| | (期 末) 2024年1月26日 | 8,009 | 0.3 | | 0.2 | 97.5 |
| 第124期 | (期 首) 2024年1月26日 | 7,989 | — | | 0.2 | 97.5 |
| | 1月末 | 7,989 | 0.0 | | 0.2 | 97.5 |
| | (期 末) 2024年2月26日 | 8,004 | 0.2 | | 0.3 | 96.7 |
| 第125期 | (期 首) 2024年2月26日 | 7,984 | — | | 0.3 | 96.7 |
| | 2月末 | 7,990 | 0.1 | | — | — |
| | (償還日) 2024年3月12日 | (償還価額) 7,986.91 | 0.0 | | — | — |

※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（2013年10月30日）から償還日（2024年3月12日）まで）

設定以来の基準価額の推移



前作成期までの運用の概略（設定日（2013年10月30日）から第20作成期末（2023年10月26日）まで）

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて米国企業向けの貸付債権（バンクローン）等へ投資を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

上昇要因

- ・ 2015年1月～2015年5月、米国経済が回復基調にあるとの市場の見方を背景に、バンクローン市場は堅調に推移したこと
- ・ 2016年3月～2018年2月、世界経済に対する懸念の後退や、米国の良好な雇用統計を受けて投資家心理が改善したこと
- ・ 2020年4月～2021年12月、緩和的な金融政策や積極的な財政政策が実施されたことなどにより、バンクローン市場が上昇したこと

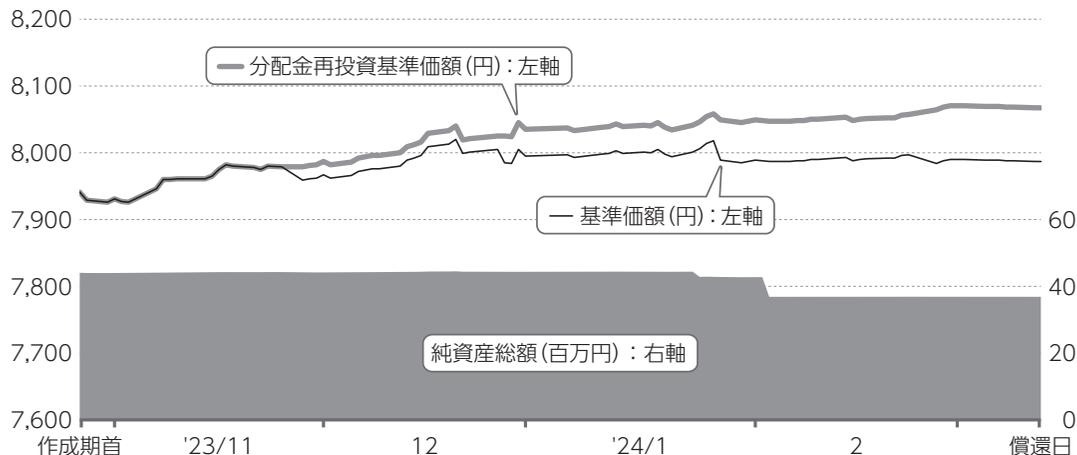
下落要因

- ・ 2015年7月～2016年2月、原油安と世界景気の減速懸念により世界的にリスク回避的な動きが広がったこと
- ・ 2020年1月～2020年3月、新型コロナウイルスの感染拡大により投資家心理が大きく悪化したこと
- ・ 2022年1月～2022年7月、ロシアがウクライナへの軍事侵攻に踏み切り、対ロシアへの制裁強化を含めた地政学リスクが高まったこと

1 運用経過

基準価額等の推移について（2023年10月27日から2024年3月12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 | 7,941円 |
| 償還日 | 7,986円91銭 (当作成期既払分配金80円(税引前)) |
| 騰落率 | +1.6% (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（2023年10月27日から2024年3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米国企業向けの貸付債権（バンクローン）等へ投資を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

上昇要因

- 金利上昇に伴い、変動利付である同資産、及び同資産を裏付資産とするCLO（ローン担保証券）に対して堅調な需要が見られたこと
- インフレ率の伸び鈍化を背景に、中央銀行の利上げ幅縮小への期待から、景気後退の懸念が和らいだこと

下落要因

- 需要の回復や地政学リスクの上昇などにより高進したインフレに対処するため、中央銀行が積極的に金融政策の引き締めを行ったことで、景気後退懸念が高まったこと
- 継続中のロシアによるウクライナ侵攻に加え中東情勢の不安定化により、地政学リスクが高まったことなどを受けて、投資家がリスク回避姿勢を強めたこと

投資環境について（2023年10月27日から2024年3月12日まで）

バンクローン市場は上昇しました。

期初より2023年末にかけて、FRB（米連邦準備制度理事会）による早期利下げ期待が高まって長期金利（10年国債利回り）が低下し、投資家がリスク選好的となったことなどから、バンクローン市場は上昇しました。

2024年に入り期末にかけては、雇用統計

が強く出たことやインフレ率が再加速したことなどを受け、投資家が利下げの織り込み度合いを見直したことなどから金利が上昇に転じ、バンクローン市場では価格上昇が頭打ちになりました。

ポートフォリオについて（2023年10月27日から2024年3月12日まで）

当ファンド

期初より「ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ（JPY | マンスリー・ディストリビューティング・クラス）」を高位に組み入れました。ただし、償還手続きにより資金化しました。

ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ（JPY | マンスリー・ディストリビューティング・クラス）

●組入比率

期を通じてクーポンが変動金利に連動するバンクローンの組入比率を高い水準で維

持し、ポートフォリオの大部分をバンクローンに投資しました。

●業種

セクター別では、複数のセクターに分散したポートフォリオを維持しました。

●格付け

格付け別では、B格以上の銘柄を中心とするポートフォリオとしました。

●市場配分

通貨別では、引き続き米ドル建てのバンクローンをポートフォリオの中心に据えた運用を行いました。

マネー・アカウント・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（2023年10月27日から2024年3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。

分配金について（2023年10月27日から2024年3月12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125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121期 | 第122期 | 第123期 | 第124期 |
|-----------|---------|---------|---------|---------|
| 当期分配金 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| （対基準価額比率） | (0.25%) | (0.25%) | (0.25%) | (0.25%) |
| 当期の収益 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 545 | 551 | 555 | 560 |

※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。

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

1万口当たりの費用明細（2023年10月27日から2024年3月12日まで）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|------|---------|--|
| (a) 信託報酬 | 32円 | 0.405% | 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7,984円です。 |
| （投信会社） | (12) | (0.145) | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (20) | (0.249) | 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) | (0.012) | 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 | 0.001 | 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) | (0.001) | 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 | 0.407 | |

※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。

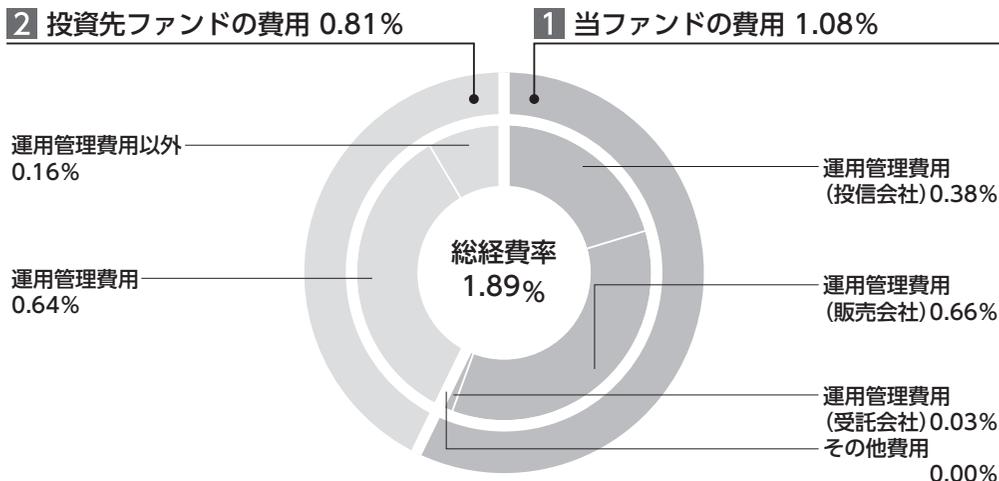
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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) | 1.89% |
| 1 当ファンドの費用の比率 | 1.08% |
| 2 投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.64% |
| 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.16% |

- ※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、シェアクラスの経費率です。運用管理費用と運用管理費用以外の費用を、目論見書に記載している料率にもとづき区別しています。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1.89%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2023年10月27日から2024年3月12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 | ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・ フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ (JPY マンスリー・ディストリビューティング・クラス) | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | - | - | 5,569 | 42,953 | |

※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。

(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・アカウント・マザーファンド | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | |
| | - | - | 159 | 159 | |

■ 利害関係人との取引状況等（2023年10月27日から2024年3月12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

(2023年10月27日から2024年3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。

■ 組入れ資産の明細（2024年3月12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 |
| ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・ フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ (JPY マンスリー・ディストリビューティング・クラス) | 口 | 口 | 千円 | % |
| | 5,569.41 | - | - | - |
| 合 計 | 5,569.41 | - | - | - |

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）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 | 千口 | 口 数 | 千口 |
| マネー・アカウント・マザーファンド | 159 | | — | |
| | | 千円 | | 千円 |
| | | — | | — |

■ 投資信託財産の構成

(2024年3月12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 36,879 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 36,879 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額または償還価額の状況

(2023年11月27日現在) (2023年12月26日現在) (2024年1月26日現在) (2024年2月26日現在) (2024年3月12日現在)

| 項 目 | 第121期末 | 第122期末 | 第123期末 | 第124期末 | 償還時 |
|-------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| (A) 資 産 | 44,312,490円 | 44,450,896円 | 42,903,066円 | 36,975,894円 | 36,879,262円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,313,456 | 1,327,815 | 1,076,399 | 1,194,706 | 36,879,262 |
| 投 資 証 券 (評 価 額) | 42,839,678 | 42,963,709 | 41,667,295 | 35,621,848 | — |
| マネー・アカウント・マザーファンド(評価額) | 159,356 | 159,372 | 159,372 | 159,340 | — |
| (B) 負 債 | 152,719 | 148,961 | 147,572 | 127,309 | 17,472 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 110,969 | 110,969 | 107,038 | 92,305 | — |
| 未 払 信 託 報 酬 | 41,590 | 37,832 | 40,366 | 34,873 | 17,366 |
| 未 払 利 息 | — | — | — | — | 106 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 160 | 160 | 168 | 131 | — |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 44,159,771 | 44,301,935 | 42,755,494 | 36,848,585 | 36,861,790 |
| 元 本 | 55,484,706 | 55,484,801 | 53,519,319 | 46,152,640 | 46,152,732 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △11,324,935 | △11,182,866 | △10,763,825 | △ 9,304,055 | — |
| 償 還 差 損 益 金 | — | — | — | — | △ 9,290,942 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 55,484,706口 | 55,484,801口 | 53,519,319口 | 46,152,640口 | 46,152,732口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,959円 | 7,985円 | 7,989円 | 7,984円 | — |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | — | — | — | — | 7,986円91銭 |

※当作成期における作成期首元本額55,484,611円、作成期中追加設定元本額468円、作成期中一部解約元本額9,332,347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。

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

■ 損益の状況

| | 自2023年10月27日 至2023年11月27日 | 自2023年11月28日 至2023年12月26日 | 自2023年12月27日 至2024年1月26日 | 自2024年1月27日 至2024年2月26日 | 自2024年2月27日 至2024年3月12日 |
|-----------------------------|------------------------------|------------------------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 項 目 | 第121期 | 第122期 | 第123期 | 第124期 | 第125期 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 166,986円 | 167,003円 | 162,534円 | 138,598円 | △ 1,293円 |
| 受 取 配 当 金 | 167,082 | 167,082 | 162,633 | 138,694 | — |
| 受 取 利 息 | — | — | — | 2 | — |
| 支 払 利 息 | △ 96 | △ 79 | △ 99 | △ 98 | △ 1,293 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 87,328 | 124,047 | 5,007 | △ 44,804 | 31,792 |
| 売 買 損 益 | 87,328 | 124,047 | 6,193 | 739 | 31,808 |
| 売 買 損 益 | — | — | △ 1,186 | △ 45,543 | △ 16 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 41,750 | △ 37,992 | △ 40,534 | △ 35,004 | △ 17,366 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 212,564 | 253,058 | 127,007 | 58,790 | 13,133 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △10,231,210 | △10,129,615 | △ 9,630,780 | △ 8,276,210 | △8,309,725 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 1,195,320 | △ 1,195,340 | △ 1,153,014 | △ 994,330 | △ 994,350 |
| (配 当 等 相 当 額) | (757,297) | (757,302) | (730,479) | (629,939) | (629,944) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 1,952,617) | (△ 1,952,642) | (△ 1,883,493) | (△ 1,624,269) | (△1,624,294) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | △11,213,966 | △11,071,897 | △10,656,787 | △ 9,211,750 | △9,290,942 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 110,969 | △ 110,969 | △ 107,038 | △ 92,305 | — |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | △11,324,935 | △11,182,866 | △10,763,825 | △ 9,304,055 | — |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 1,195,320 | △ 1,195,340 | △ 1,153,014 | △ 994,330 | — |
| (配 当 等 相 当 額) | (757,297) | (757,302) | (730,479) | (629,939) | (—) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 1,952,617) | (△ 1,952,642) | (△ 1,883,493) | (△ 1,624,269) | (—) |
| 償 還 差 損 益 金 | — | — | — | — | △9,290,942 |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 2,269,651 | 2,303,924 | 2,241,443 | 1,956,014 | — |
| 繰 越 損 益 金 | △12,399,266 | △12,291,450 | △11,852,254 | △10,265,739 | — |

※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121期 | 第122期 | 第123期 | 第124期 |
|----------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 139,617円 | 145,242円 | 123,243円 | 103,631円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 757,297 | 757,302 | 730,479 | 629,939 |
| (d) 分配準備積立金 | 2,241,003 | 2,269,651 | 2,225,238 | 1,944,688 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 3,137,917 | 3,172,195 | 3,078,960 | 2,678,258 |
| 1万口当たり当期分配対象額 | 565.55 | 571.72 | 575.30 | 580.30 |
| (f) 分配金 | 110,969 | 110,969 | 107,038 | 92,305 |
| 1万口当たり分配金 | 20 | 20 | 20 | 20 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

■ 投資信託財産運用総括表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2013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3月12日 | | 資産総額 | 36,879,262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 | 17,472円 |
| | | | | 純資産総額 | 36,861,790円 |
| 受益権口数 | 22,098,402口 | 46,152,732口 | 24,054,330口 | 受益権口数 | 46,152,732口 |
| 元本額 | 22,098,402円 | 46,152,732円 | 24,054,330円 | 1万口当たり償還金 | 7,986円91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 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第4期 | 93,034,464 | 93,495,108 | 10,050 | 10 | 0.10 |
| 第5期 | 92,840,649 | 93,295,748 | 10,049 | 10 | 0.10 |
| 第6期 | 85,375,791 | 85,407,132 | 10,004 | 20 | 0.20 |
| 第7期 | 85,375,791 | 85,674,818 | 10,035 | 20 | 0.20 |
| 第8期 | 85,375,791 | 85,686,935 | 10,036 | 20 | 0.20 |
| 第9期 | 85,375,791 | 85,533,693 | 10,018 | 20 | 0.20 |
| 第10期 | 240,477,670 | 239,902,490 | 9,976 | 20 | 0.20 |
| 第11期 | 835,970,602 | 828,212,506 | 9,907 | 20 | 0.20 |
| 第12期 | 1,007,603,737 | 993,202,426 | 9,857 | 20 | 0.20 |
| 第13期 | 1,008,308,752 | 998,258,417 | 9,900 | 20 | 0.20 |
| 第14期 | 1,004,624,082 | 980,964,027 | 9,764 | 20 | 0.20 |
| 第15期 | 1,007,686,738 | 983,912,962 | 9,764 | 20 | 0.20 |
| 第16期 | 1,003,510,499 | 990,184,125 | 9,867 | 20 | 0.20 |
| 第17期 | 948,212,912 | 935,971,386 | 9,871 | 20 | 0.20 |
| 第18期 | 845,268,901 | 837,720,579 | 9,911 | 20 | 0.20 |
| 第19期 | 792,971,421 | 784,207,735 | 9,889 | 20 | 0.20 |
| 第20期 | 772,018,692 | 760,853,810 | 9,855 | 20 | 0.20 |
| 第21期 | 867,332,977 | 852,569,455 | 9,830 | 20 | 0.20 |
| 第22期 | 745,816,936 | 725,178,983 | 9,723 | 20 | 0.20 |
| 第23期 | 645,843,717 | 626,549,393 | 9,701 | 20 | 0.20 |
| 第24期 | 579,774,705 | 558,155,361 | 9,627 | 20 | 0.20 |
| 第25期 | 511,863,540 | 485,922,408 | 9,493 | 20 | 0.20 |
| 第26期 | 490,603,352 | 460,202,458 | 9,380 | 20 | 0.20 |
| 第27期 | 473,243,548 | 438,699,579 | 9,270 | 20 | 0.20 |
| 第28期 | 441,053,859 | 404,229,121 | 9,165 | 20 | 0.20 |
| 第29期 | 433,950,157 | 405,963,897 | 9,355 | 20 | 0.20 |
| 第30期 | 417,514,819 | 394,028,459 | 9,437 | 20 | 0.20 |
| 第31期 | 400,051,997 | 377,677,228 | 9,441 | 20 | 0.20 |
| 第32期 | 395,027,761 | 370,224,039 | 9,372 | 20 | 0.20 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 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 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第33期 | 349,254,051 | 329,987,148 | 9,448 | 20 | 0.20 |
| 第34期 | 334,759,488 | 316,425,414 | 9,452 | 20 | 0.20 |
| 第35期 | 329,634,125 | 312,107,615 | 9,468 | 20 | 0.20 |
| 第36期 | 325,635,195 | 308,460,377 | 9,473 | 20 | 0.20 |
| 第37期 | 324,201,426 | 306,145,135 | 9,443 | 20 | 0.20 |
| 第38期 | 322,132,215 | 305,702,935 | 9,490 | 20 | 0.20 |
| 第39期 | 326,251,518 | 309,291,819 | 9,480 | 20 | 0.20 |
| 第40期 | 341,458,457 | 323,477,340 | 9,473 | 20 | 0.20 |
| 第41期 | 365,375,809 | 344,671,991 | 9,433 | 20 | 0.20 |
| 第42期 | 389,360,937 | 367,765,045 | 9,445 | 20 | 0.20 |
| 第43期 | 386,389,772 | 364,833,847 | 9,442 | 20 | 0.20 |
| 第44期 | 386,627,708 | 363,204,239 | 9,394 | 20 | 0.20 |
| 第45期 | 376,507,184 | 354,429,519 | 9,414 | 20 | 0.20 |
| 第46期 | 376,747,939 | 352,819,335 | 9,365 | 20 | 0.20 |
| 第47期 | 366,800,425 | 343,288,375 | 9,359 | 20 | 0.20 |
| 第48期 | 350,942,305 | 328,858,009 | 9,371 | 20 | 0.20 |
| 第49期 | 336,760,827 | 314,449,536 | 9,337 | 20 | 0.20 |
| 第50期 | 332,012,166 | 309,817,119 | 9,331 | 20 | 0.20 |
| 第51期 | 332,258,900 | 310,282,555 | 9,339 | 20 | 0.20 |
| 第52期 | 201,836,579 | 188,089,629 | 9,319 | 20 | 0.20 |
| 第53期 | 201,857,301 | 187,542,366 | 9,291 | 20 | 0.20 |
| 第54期 | 192,824,176 | 178,893,692 | 9,278 | 20 | 0.20 |
| 第55期 | 174,529,870 | 161,230,974 | 9,238 | 20 | 0.20 |
| 第56期 | 163,837,107 | 150,759,735 | 9,202 | 20 | 0.20 |
| 第57期 | 158,663,824 | 145,817,989 | 9,190 | 20 | 0.20 |
| 第58期 | 136,649,021 | 125,514,454 | 9,185 | 20 | 0.20 |
| 第59期 | 136,660,262 | 125,625,601 | 9,193 | 20 | 0.20 |
| 第60期 | 136,669,889 | 125,238,241 | 9,164 | 20 | 0.20 |
| 第61期 | 135,679,899 | 122,861,957 | 9,055 | 20 | 0.20 |
| 第62期 | 130,581,555 | 114,673,054 | 8,782 | 20 | 0.20 |
| 第63期 | 124,730,301 | 111,077,660 | 8,905 | 20 | 0.20 |
| 第64期 | 124,242,069 | 111,395,975 | 8,966 | 20 | 0.20 |
| 第65期 | 124,253,782 | 110,956,287 | 8,930 | 20 | 0.20 |
| 第66期 | 122,294,686 | 110,238,169 | 9,014 | 20 | 0.20 |
| 第67期 | 122,306,390 | 109,638,479 | 8,964 | 20 | 0.20 |
| 第68期 | 120,840,739 | 107,831,819 | 8,923 | 20 | 0.20 |
| 第69期 | 120,852,615 | 107,624,261 | 8,905 | 20 | 0.20 |
| 第70期 | 115,564,893 | 102,064,464 | 8,832 | 20 | 0.20 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 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 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第71期 | 115,075,318 | 101,851,502 | 8,851 | 20 | 0.20 |
| 第72期 | 115,082,324 | 100,716,511 | 8,752 | 20 | 0.20 |
| 第73期 | 111,220,156 | 97,458,380 | 8,763 | 20 | 0.20 |
| 第74期 | 103,064,714 | 91,497,977 | 8,878 | 20 | 0.20 |
| 第75期 | 103,071,746 | 91,584,828 | 8,886 | 20 | 0.20 |
| 第76期 | 92,994,238 | 81,825,447 | 8,799 | 20 | 0.20 |
| 第77期 | 92,000,363 | 66,389,051 | 7,216 | 20 | 0.20 |
| 第78期 | 79,712,852 | 62,275,956 | 7,813 | 20 | 0.20 |
| 第79期 | 79,720,916 | 63,654,044 | 7,985 | 20 | 0.20 |
| 第80期 | 79,728,827 | 65,453,534 | 8,210 | 20 | 0.20 |
| 第81期 | 75,585,354 | 62,654,846 | 8,289 | 20 | 0.20 |
| 第82期 | 75,585,409 | 63,045,603 | 8,341 | 20 | 0.20 |
| 第83期 | 75,596,936 | 63,029,963 | 8,338 | 20 | 0.20 |
| 第84期 | 75,597,018 | 63,330,095 | 8,377 | 20 | 0.20 |
| 第85期 | 75,597,101 | 64,146,682 | 8,485 | 20 | 0.20 |
| 第86期 | 74,238,326 | 63,441,641 | 8,546 | 20 | 0.20 |
| 第87期 | 74,238,403 | 64,048,673 | 8,627 | 20 | 0.20 |
| 第88期 | 74,238,480 | 64,035,152 | 8,626 | 20 | 0.20 |
| 第89期 | 74,238,557 | 63,865,904 | 8,603 | 20 | 0.20 |
| 第90期 | 74,238,634 | 63,909,047 | 8,609 | 20 | 0.20 |
| 第91期 | 73,234,191 | 63,136,781 | 8,621 | 20 | 0.20 |
| 第92期 | 73,234,268 | 63,182,959 | 8,628 | 20 | 0.20 |
| 第93期 | 72,243,298 | 62,171,936 | 8,606 | 20 | 0.20 |
| 第94期 | 67,955,912 | 58,440,342 | 8,600 | 20 | 0.20 |
| 第95期 | 66,966,246 | 57,799,584 | 8,631 | 20 | 0.20 |
| 第96期 | 66,966,325 | 57,728,745 | 8,621 | 20 | 0.20 |
| 第97期 | 61,966,404 | 53,259,421 | 8,595 | 20 | 0.20 |
| 第98期 | 61,966,483 | 53,161,058 | 8,579 | 20 | 0.20 |
| 第99期 | 61,768,352 | 53,080,100 | 8,593 | 20 | 0.20 |
| 第100期 | 61,768,431 | 52,473,876 | 8,495 | 20 | 0.20 |
| 第101期 | 61,758,872 | 51,948,009 | 8,411 | 20 | 0.20 |
| 第102期 | 62,758,952 | 52,993,731 | 8,444 | 20 | 0.20 |
| 第103期 | 62,759,032 | 50,815,850 | 8,097 | 20 | 0.20 |
| 第104期 | 60,750,586 | 48,724,740 | 8,020 | 20 | 0.20 |
| 第105期 | 60,750,676 | 48,552,936 | 7,992 | 20 | 0.20 |
| 第106期 | 60,750,768 | 49,381,375 | 8,129 | 20 | 0.20 |
| 第107期 | 60,750,858 | 48,329,873 | 7,955 | 20 | 0.20 |
| 第108期 | 58,689,794 | 45,998,845 | 7,838 | 20 | 0.20 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 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 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | % |
| 第109期 | 58,417,416 | 46,063,231 | 7,885 | 20 | 0.20 |
| 第110期 | 58,209,387 | 45,717,470 | 7,854 | 20 | 0.20 |
| 第111期 | 58,209,480 | 46,455,809 | 7,981 | 20 | 0.20 |
| 第112期 | 58,209,573 | 46,441,224 | 7,978 | 20 | 0.20 |
| 第113期 | 58,209,666 | 45,752,641 | 7,860 | 20 | 0.20 |
| 第114期 | 57,657,286 | 45,592,313 | 7,907 | 20 | 0.20 |
| 第115期 | 57,657,380 | 45,086,924 | 7,820 | 20 | 0.20 |
| 第116期 | 57,561,221 | 45,395,305 | 7,886 | 20 | 0.20 |
| 第117期 | 57,561,316 | 45,802,249 | 7,957 | 20 | 0.20 |
| 第118期 | 55,484,422 | 44,198,210 | 7,966 | 20 | 0.20 |
| 第119期 | 55,484,516 | 44,485,020 | 8,018 | 20 | 0.20 |
| 第120期 | 55,484,611 | 44,058,101 | 7,941 | 20 | 0.20 |
| 第121期 | 55,484,706 | 44,159,771 | 7,959 | 20 | 0.20 |
| 第122期 | 55,484,801 | 44,301,935 | 7,985 | 20 | 0.20 |
| 第123期 | 53,519,319 | 42,755,494 | 7,989 | 20 | 0.20 |
| 第124期 | 46,152,640 | 36,848,585 | 7,984 | 20 | 0.20 |

■ 分配金のお知らせ

| 1 万口当たり分配金（税引前） | 第121期 | 第122期 | 第123期 | 第124期 |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|
| | | 20円 | 20円 | 20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 | ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ（JPY I マンスリー・ディストリビューティング・クラス） |
| 形態 | アイルランド籍会社型投資信託（円建て） |
| 主要投資対象 | 米国企業向けバンクローン |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として、米国企業向け優先担保付バンクローンに投資し、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指した運用を行います。 ・外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行います。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・同一業種のバンクローンへの投資割合は、純資産総額の20%以内とします。 ・有価証券の空売りは行いません。 ・純資産総額の10%を超える借入れは行いません。 ・同一発行体のバンクローンへの投資割合は、純資産総額の5%以内とします。 |
| 配分方針 | 毎月10日（休業日の場合は前営業日）に分配を行う方針です。ただし、分配を行わないことがあります。 |
| 運用管理費用 | <p>純資産総額に対して 運用報酬 年0.75%程度</p> <p>※上記のほか、管理および保管に要する費用などがかかりますが、運用状況等により変動するものであり、事前に料率等を示すことができません。</p> <p>また、年間最低報酬額や取引ごとにかかる費用等が定められている場合があるため、純資産総額の規模や取引頻度等によっては、上記の料率を上回ることがあります。</p> |
| その他の費用 | <p>ファンドの設立費用、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 | ニューバーガー・バーマン・アセットマネジメント・アイルランド・リミテッド |
| 副投資顧問会社 | ニューバーガー・バーマン・ヨーロッパ・リミテッド ニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズ・エル・エル・シー |
| 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、「ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ（JPY I マンスリー・ディストリビューティング・クラス）」をシェアクラスとして含む「ニューバーガー・バーマン・グローバル・シニア・フローティング・レート・インカム・ファンドⅡ」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。

■ 損益計算書（2022年1月1日から2022年12月31日までの期間）

(米ドル)

| | |
|-----------------------------------|--------------|
| 収益 | |
| 受取利息 | 4,868,686 |
| 受取配当金 | - |
| その他収益 | 48,888 |
| 損益を通じて公正価値で測定される金融資産および金融負債に係る純損益 | (15,512,066) |
| | <hr/> |
| | (10,594,492) |
| 費用 | |
| 管理報酬 | 354,817 |
| 販売報酬 | 41,567 |
| 管理事務代行報酬 | 76,018 |
| コミットメント・フィー | 126,629 |
| カストディー・フィー | 13,330 |
| 保管報酬 | 3,903 |
| 専門家報酬 | 58,968 |
| 役員報酬 | 11,851 |
| 取引費用 | 4,672 |
| 監査報酬 | 2,093 |
| VAT還付金 | (7,957) |
| その他費用 | 84,106 |
| 権利放棄費用 | (1,242) |
| 費用合計 | <hr/> |
| | 768,755 |
| 金融費用 | |
| 当座借越費用 | 885 |
| 支払分配金 | 2,196,608 |
| | <hr/> |
| | 2,197,493 |
| 源泉徴収税 | 2,141 |
| 償還可能参加型持分の保有者に帰属する運用による損益 | (13,562,881) |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

■ 投資明細表（2022年12月31日現在）

損益を通じて公正価値評価される金融資産

| 株数 | 内訳 | | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) | |
|--|--|--------|------------------|--------------|--------------|
| 普通株0.61% (2021年12月31日付: 0.61%) | | | | | |
| 米ドル | | | | | |
| 12,575 | Brock Holdings III Inc | | 113,174 | 0.17 | |
| 16,817 | Covia Holdings Corp | | 232,640 | 0.35 | |
| 9,326 | iHeartMedia Inc Class A | | 57,168 | 0.09 | |
| 1,014 | Riverbed Technology Inc | | 766 | 0.00 | |
| 普通株合計 | | | 403,748 | 0.61 | |
| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
| 資産担保証券2.06% (2021年12月31日付: 3.30%) | | | | | |
| ユーロ | | | | | |
| 104,964 | Carlyle Euro CLO 2022-3 DAC Series 2022-3X Class D | 8.19% | 13/01/2035 | 100,461 | 0.15 |
| 116,627 | Palmer Square European Loan Funding Series 2021-1X Class E | 7.33% | 15/04/2031 | 107,954 | 0.17 |
| 75,808 | Palmer Square European Loan Funding Series 2021-1X Class F | 9.83% | 15/04/2031 | 65,317 | 0.10 |
| ユーロ合計 | | | 273,732 | 0.42 | |
| 米ドル | | | | | |
| 174,941 | 522 Funding CLO Ltd Series 2020-6X Class ER | 10.83% | 23/10/2034 | 142,866 | 0.22 |
| 58,314 | AIMCO CDO Series 2020-12X Class ER | 9.96% | 17/01/2032 | 53,262 | 0.08 |
| 116,627 | AIMCO CLO Series 2017-AX Class E | 10.49% | 20/04/2034 | 103,155 | 0.15 |
| 349,881 | Betony CLO 2 Ltd 2018-1X Class D | 10.06% | 30/04/2031 | 298,347 | 0.45 |
| 174,941 | Canyon CLO Ltd Series 2018-1X Class E | 9.83% | 15/07/2031 | 136,705 | 0.21 |
| 145,784 | Invesco CLO Ltd Series 2021-1X Class E | 10.54% | 15/04/2034 | 132,349 | 0.20 |
| 85,721 | RR 12 Ltd Series 2020-12X Class DR2 | 10.80% | 15/01/2036 | 78,481 | 0.12 |
| 69,976 | Symphony CLO XXIV Ltd Series 2020-24X Class E | 11.32% | 23/01/2032 | 63,091 | 0.09 |
| 87,470 | Symphony CLO XXV Ltd Series 2021-25X Class E | 10.73% | 19/04/2034 | 76,854 | 0.12 |
| 米ドル合計 | | | 1,085,110 | 1.64 | |
| 資産担保証券合計 | | | 1,358,842 | 2.06 | |
| 事業債4.74% (2021年12月31日付: 2.84%) | | | | | |
| ユーロ | | | | | |
| 135,171 | United Group BV | 6.52% | 01/02/2029 | 125,377 | 0.19 |
| ユーロ合計 | | | 125,377 | 0.19 | |
| 英ポンド | | | | | |
| 84,088 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl | 4.88% | 01/06/2028 | 80,205 | 0.12 |
| 英ポンド合計 | | | 80,205 | 0.12 | |
| 米ドル | | | | | |
| 226,840 | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy | 4.88% | 04/02/2028 | 184,634 | 0.28 |
| 144,618 | Altice Financing SA | 5.00% | 15/01/2028 | 116,728 | 0.18 |
| 186,603 | Altice France SA | 5.50% | 15/01/2028 | 146,534 | 0.22 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---|--|--------|------------|------------------|--------------|
| 事業債4.74% (2021年12月31日付: 2.84%) (続き) | | | | | |
| 米ドル(続き) | | | | | |
| 131,789 | APX Group Inc | 6.75% | 15/02/2027 | 127,057 | 0.19 |
| 195,350 | Banjay Entertainment SASU | 5.38% | 01/03/2025 | 184,915 | 0.28 |
| 144,618 | Bank of America Corp | 6.13% | 29/12/2049 | 142,268 | 0.22 |
| 296,542 | Brock Holdings III Inc | 15.00% | 24/04/2024 | 296,542 | 0.45 |
| 109,046 | Consolidated Communications Inc | 5.00% | 01/10/2028 | 80,560 | 0.12 |
| 87,004 | Cumulus Media New Holdings Inc | 6.75% | 01/07/2026 | 73,221 | 0.11 |
| 102,632 | eG Global Finance Plc | 8.50% | 30/10/2025 | 95,776 | 0.14 |
| 261,046 | Global Aircraft Leasing Co Ltd | 6.50% | 15/09/2024 | 222,451 | 0.34 |
| 165,027 | JPMorgan Chase & Co | 4.60% | 29/12/2049 | 145,843 | 0.22 |
| 197,683 | Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc | 5.00% | 01/02/2026 | 176,185 | 0.27 |
| 90,969 | Mauser Packaging Solutions Holding Co | 5.50% | 15/04/2024 | 88,631 | 0.13 |
| 152,782 | NCL Corp Ltd | 5.88% | 15/02/2027 | 132,531 | 0.20 |
| 94,468 | Scientific Games International Inc | 7.00% | 15/05/2028 | 90,284 | 0.14 |
| 123,042 | Six Flags Entertainment Corp | 4.88% | 31/07/2024 | 118,658 | 0.18 |
| 243,751 | Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp | 8.50% | 15/10/2026 | 231,680 | 0.35 |
| 193,018 | Trivium Packaging Finance BV | 5.50% | 15/08/2026 | 177,314 | 0.27 |
| 95,051 | XHR LP | 6.38% | 15/08/2025 | 91,538 | 0.14 |
| 米ドル合計 | | | | 2,923,350 | 4.43 |
| 事業債合計 | | | | 3,128,932 | 4.74 |
| タームローン 82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) | | | | | |
| ユーロ | | | | | |
| 77,745 | Aernnova Aerospace SAU | 5.44% | 26/02/2027 | 75,174 | 0.11 |
| 19,935 | Aernnova Aerospace SAU | 5.63% | 26/02/2027 | 19,275 | 0.03 |
| 154,997 | BCP V Modular Services Holdings IV Ltd | 6.70% | 15/12/2028 | 154,746 | 0.24 |
| 196,867 | EG Group Ltd | 9.75% | 30/04/2027 | 180,101 | 0.27 |
| 229,283 | Entain Plc | 0.00% | 30/06/2028 | 241,644 | 0.37 |
| 93,521 | GTT Communications BV | 0.00% | 31/05/2025 | 51,402 | 0.08 |
| 233,254 | GVC Holdings Plc | 4.40% | 29/03/2024 | 246,980 | 0.37 |
| 184,685 | Iris BidCo GmbH | 6.61% | 29/06/2028 | 170,919 | 0.26 |
| ユーロ合計 | | | | 1,140,241 | 1.73 |
| 英ポンド | | | | | |
| 302,997 | CD&R Firefly Bidco Ltd | 6.54% | 23/06/2025 | 335,722 | 0.51 |
| 181,355 | Constellation Automotive Group Ltd | 9.19% | 27/07/2029 | 90,144 | 0.13 |
| 105,079 | EG Group Ltd | 8.45% | 07/02/2025 | 114,369 | 0.17 |
| 182,553 | WSH Services Holding Ltd | 7.96% | 16/03/2026 | 196,718 | 0.30 |
| 英ポンド合計 | | | | 736,953 | 1.11 |
| 米ドル | | | | | |
| 206,430 | AAAdvantage Loyalty IP Ltd | 8.99% | 20/04/2028 | 205,882 | 0.31 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---------|--|--------|------------|-------------|--------------|
| | タームローン 82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) (続き) | | | | |
| | 米ドル (続き) | | | | |
| 251,858 | Adient US LLC | 7.63% | 10/04/2028 | 249,616 | 0.38 |
| 295,169 | AEA International Holdings (Luxembourg) Sarl | 8.50% | 07/09/2028 | 292,955 | 0.44 |
| 232,910 | AG Group Holdings Inc | 8.14% | 29/12/2028 | 223,012 | 0.34 |
| 290,066 | Ahead DB Holdings LLC | 8.48% | 18/10/2027 | 280,820 | 0.43 |
| 230,153 | AI Convoy (Luxembourg) Sarl | 8.17% | 18/01/2027 | 227,420 | 0.34 |
| 422,298 | Air Canada | 8.13% | 11/08/2028 | 418,668 | 0.63 |
| 244,735 | Alliant Holdings Intermediate LLC | 7.85% | 05/11/2027 | 239,534 | 0.36 |
| 235,162 | Allied Universal Holdco LLC | 8.17% | 12/05/2028 | 223,875 | 0.34 |
| 245,497 | Alterra Mountain Co | 7.88% | 17/08/2028 | 243,119 | 0.37 |
| 325,209 | Altice France SA | 8.65% | 14/08/2026 | 303,394 | 0.46 |
| 355,987 | Amentum Government Services Holdings LLC | 8.12% | 15/02/2029 | 347,755 | 0.53 |
| 184,156 | American Airlines Inc | 6.14% | 27/06/2025 | 177,509 | 0.27 |
| 239,333 | Anchor Packaging LLC | 8.38% | 18/07/2026 | 229,461 | 0.35 |
| 133,357 | Apex Group Treasury Ltd | 8.26% | 27/07/2028 | 127,690 | 0.19 |
| 174,646 | Apex Tool Group LLC | 9.67% | 08/02/2029 | 150,823 | 0.23 |
| 102,049 | Apex Tool Group LLC | 14.42% | 08/02/2030 | 80,958 | 0.12 |
| 167,360 | AppLovin Corp | 0.00% | 15/08/2025 | 161,589 | 0.24 |
| 148,525 | APX Group Inc | 6.73% | 10/07/2028 | 147,202 | 0.22 |
| 341,761 | Artera Services LLC | 8.23% | 06/03/2025 | 281,100 | 0.43 |
| 149,165 | Ascend Learning LLC | 7.88% | 11/12/2028 | 141,406 | 0.21 |
| 196,517 | Ascend Learning LLC | 10.13% | 10/12/2029 | 170,068 | 0.26 |
| 245,433 | ASP Dream Acquisition Co LLC | 8.67% | 15/12/2028 | 237,456 | 0.36 |
| 543,482 | Asurion LLC | 9.63% | 20/01/2029 | 425,664 | 0.64 |
| 18,698 | athenahealth Group Inc | 4.58% | 15/02/2029 | 16,929 | 0.03 |
| 439,075 | athenahealth Group Inc | 7.82% | 15/02/2029 | 397,521 | 0.60 |
| 242,172 | Auris Luxembourg III Sarl | 8.68% | 27/02/2026 | 217,350 | 0.33 |
| 11,904 | Aveanna Healthcare LLC | 0.00% | 17/07/2028 | 9,220 | 0.01 |
| 169,952 | Aveanna Healthcare LLC | 8.14% | 17/07/2028 | 131,628 | 0.20 |
| 244,917 | Aveanna Healthcare LLC | 11.39% | 10/12/2029 | 146,950 | 0.22 |
| 320,055 | Avis Budget Car Rental LLC | 7.92% | 16/03/2029 | 316,056 | 0.48 |
| 127,741 | AZZ Inc | 8.67% | 13/05/2029 | 127,881 | 0.19 |
| 184,640 | BCP Renaissance Parent LLC | 7.82% | 02/11/2026 | 183,222 | 0.28 |
| 274,859 | BCPE Empire Holdings Inc | 8.38% | 11/06/2026 | 268,503 | 0.41 |
| 187,089 | Bella Holding Co LLC | 0.00% | 10/05/2028 | 177,080 | 0.27 |
| 340,673 | Blackstone Mortgage Trust Inc | 7.82% | 09/05/2029 | 334,712 | 0.51 |
| 8,625 | Bright Bidco BV | 0.00% | 28/02/2023 | 7,576 | 0.01 |
| 119,370 | Bright Bidco BV | 0.00% | 30/06/2024 | 40,437 | 0.06 |
| 170,432 | Brown Group Holdings LLC | 7.91% | 02/07/2029 | 170,152 | 0.26 |
| 130,471 | Carnival Corp | 7.63% | 18/10/2028 | 122,512 | 0.19 |
| 125,169 | Cast & Crew LLC | 8.07% | 29/12/2028 | 123,698 | 0.19 |
| 285,736 | Central Parent Inc | 9.08% | 06/07/2029 | 283,642 | 0.43 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---------|--|--------|------------|-------------|--------------|
| | タームローン 82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) (続き) | | | | |
| | 米ドル (続き) | | | | |
| 265,704 | Chariot Buyer LLC | 7.63% | 03/11/2028 | 251,090 | 0.38 |
| 253,081 | Chart Industries Inc | 0.00% | 07/12/2029 | 250,868 | 0.38 |
| 311,367 | Charter Next Generation Inc | 8.13% | 01/12/2027 | 303,023 | 0.46 |
| 230,883 | Circor International Inc | 9.88% | 20/12/2028 | 224,100 | 0.34 |
| 377,872 | Citco Funding LLC | 7.55% | 27/04/2028 | 375,982 | 0.57 |
| 162,504 | Cloudera Inc | 8.13% | 08/10/2028 | 153,745 | 0.23 |
| 149,283 | Cloudera Inc | 10.38% | 08/10/2029 | 125,211 | 0.19 |
| 136,096 | CNT Holdings I Corp | 7.24% | 08/11/2027 | 132,073 | 0.20 |
| 141,119 | CNT Holdings I Corp | 10.49% | 06/11/2028 | 133,828 | 0.20 |
| 145,101 | Coherent Corp | 7.13% | 02/07/2029 | 143,940 | 0.22 |
| 173,461 | Commscope Inc | 7.63% | 06/04/2026 | 163,964 | 0.25 |
| 146,963 | Connect Finco Sarl | 7.89% | 11/12/2026 | 145,570 | 0.22 |
| 241,354 | ConnectWise LLC | 7.88% | 29/09/2028 | 229,889 | 0.35 |
| 193,388 | Consolidated Communications Inc | 0.00% | 02/10/2027 | 171,390 | 0.26 |
| 277,748 | Constant Contact Inc | 7.91% | 10/02/2028 | 246,154 | 0.37 |
| 393,465 | ConvergeOne Holdings Corp | 9.38% | 04/01/2026 | 230,580 | 0.35 |
| 132,955 | ConvergeOne Holdings Corp | 12.88% | 04/01/2027 | 59,830 | 0.09 |
| 203,310 | Covia Holdings LLC | 7.75% | 31/07/2026 | 196,851 | 0.30 |
| 267,181 | CQP Holdco LP | 8.48% | 05/06/2028 | 266,346 | 0.40 |
| 157,019 | Crosby US Acquisition Corp | 9.50% | 26/06/2026 | 150,444 | 0.23 |
| 222,746 | CSC Holdings LLC | 6.57% | 17/07/2025 | 211,274 | 0.32 |
| 104,381 | CSC Holdings LLC | 6.82% | 15/04/2027 | 93,552 | 0.14 |
| 229,187 | Curium BidCo Sarl | 8.98% | 02/12/2027 | 224,030 | 0.34 |
| 200,417 | Cytera DC Holdings Inc | 7.36% | 01/05/2024 | 171,795 | 0.26 |
| 108,366 | Deerfield Dakota Holding LLC | 8.07% | 09/04/2027 | 101,475 | 0.15 |
| 147,129 | Diamond Sports Group LLC | 7.57% | 24/08/2026 | 18,882 | 0.03 |
| 321,898 | Dispatch Acquisition Holdings LLC | 8.98% | 27/03/2028 | 273,613 | 0.41 |
| 243,028 | Eastern Power LLC | 8.48% | 02/10/2025 | 217,493 | 0.33 |
| 216,926 | Edelman Financial Center LLC | 11.13% | 20/07/2026 | 196,144 | 0.30 |
| 148,999 | Edelman Financial Engines Center LLC | 7.88% | 07/04/2028 | 139,426 | 0.21 |
| 51,180 | Edgewater Generation LLC | 8.13% | 13/12/2025 | 48,724 | 0.07 |
| 246,654 | EFS Cogen Holdings I LLC | 8.24% | 01/10/2027 | 237,800 | 0.36 |
| 245,355 | Eisner Advisory Group LLC | 9.69% | 28/07/2028 | 233,087 | 0.35 |
| 82,498 | Element Materials Technology Group US Holdings Inc | 0.00% | 22/06/2029 | 80,814 | 0.12 |
| 178,746 | Element Materials Technology Group US Holdings Inc | 8.93% | 22/06/2029 | 175,097 | 0.27 |
| 188,264 | Emerald Expositions Holding Inc | 6.88% | 22/05/2024 | 184,498 | 0.28 |
| 269,084 | Endurance International Group Holdings Inc | 7.72% | 10/02/2028 | 242,848 | 0.37 |
| 213,566 | Engineered Components and Systems LLC | 10.29% | 02/08/2028 | 189,540 | 0.29 |
| 84,935 | Engineered Machinery Holdings Inc | 8.48% | 19/05/2028 | 82,374 | 0.12 |
| 196,517 | Engineered Machinery Holdings Inc | 11.23% | 21/05/2029 | 179,485 | 0.27 |
| 437,976 | Envision Healthcare Corp | 0.00% | 31/03/2027 | 153,292 | 0.23 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---------|--|--------|------------|-------------|--------------|
| | タームローン 82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) (続き) | | | | |
| | 米ドル(続き) | | | | |
| 373,766 | Envision Healthcare Corp | 8.33% | 31/03/2027 | 99,670 | 0.15 |
| 97,647 | Envision Healthcare Corp | 12.61% | 31/03/2027 | 87,455 | 0.13 |
| 321,814 | Epicor Software Corp | 7.63% | 30/07/2027 | 309,727 | 0.47 |
| 157,430 | FCG Acquisitions Inc | 8.48% | 31/03/2028 | 150,100 | 0.23 |
| 93,885 | FCG Acquisitions Inc | 11.48% | 30/03/2029 | 88,721 | 0.13 |
| 145,508 | FINThrive Software Intermediate Holdings Inc | 8.38% | 18/12/2028 | 123,803 | 0.19 |
| 143,451 | FINThrive Software Intermediate Holdings Inc | 11.13% | 17/12/2029 | 110,323 | 0.17 |
| 264,974 | First Brands Group LLC | 8.37% | 30/03/2027 | 252,123 | 0.38 |
| 194,572 | First Brands Group LLC | 11.87% | 30/03/2028 | 176,412 | 0.27 |
| 273,713 | Flexera Software LLC | 8.14% | 03/03/2028 | 263,364 | 0.40 |
| 252,396 | FloWorks International LLC | 10.04% | 27/12/2028 | 234,728 | 0.36 |
| 213,428 | Flutter Entertainment Plc | 8.09% | 22/07/2028 | 212,805 | 0.32 |
| 332,720 | Focus Financial Partners LLC | 7.57% | 30/06/2028 | 329,462 | 0.50 |
| 328,305 | Formula One Management Ltd | 7.57% | 15/01/2030 | 328,552 | 0.50 |
| 177,756 | Foundational Education Group Inc | 8.59% | 31/08/2028 | 159,980 | 0.24 |
| 98,550 | Foundational Education Group Inc | 11.34% | 31/08/2029 | 78,840 | 0.12 |
| 229,755 | Four Seasons Holdings Inc | 0.00% | 30/11/2029 | 230,083 | 0.35 |
| 264,153 | Freeport LNG Investments LLLP | 7.74% | 21/12/2028 | 251,790 | 0.38 |
| 296,684 | Frontier Communications Corp | 8.50% | 01/05/2028 | 284,102 | 0.43 |
| 385,363 | Gainwell Acquisition Corp | 8.73% | 01/10/2027 | 362,723 | 0.55 |
| 260,078 | Galaxy US Opco Inc | 9.07% | 29/04/2029 | 236,021 | 0.36 |
| 328,154 | Garda World Security Corp | 8.93% | 30/10/2026 | 320,115 | 0.48 |
| 293,747 | Gates Global LLC | 7.82% | 16/11/2029 | 292,187 | 0.44 |
| 114,280 | Genesys Cloud Services Holdings I LLC | 8.38% | 01/12/2027 | 109,971 | 0.17 |
| 413,238 | Granite Generation LLC | 8.13% | 09/11/2026 | 402,390 | 0.61 |
| 283,053 | Great Outdoors Group LLC | 8.13% | 06/03/2028 | 272,615 | 0.41 |
| 342,629 | Groupe Solmax Inc | 9.48% | 29/05/2028 | 286,095 | 0.43 |
| 272,131 | GTT Communications Inc | 0.00% | 31/05/2025 | 126,541 | 0.19 |
| 223,924 | Guggenheim Partners Investment Management Holdings LLC | 7.57% | 12/12/2029 | 221,686 | 0.34 |
| 137,276 | Hayward Industries Inc | 7.67% | 30/05/2028 | 132,643 | 0.20 |
| 172,787 | Hercules Achievement Inc | 7.88% | 16/12/2024 | 167,021 | 0.25 |
| 256,827 | Herschend Entertainment Co LLC | 8.19% | 27/08/2028 | 254,901 | 0.39 |
| 123,801 | Hertz Corp B Term Loan | 7.63% | 30/06/2028 | 121,600 | 0.18 |
| 23,687 | Hertz Corp C Term Loan | 7.63% | 30/06/2028 | 23,266 | 0.04 |
| 95,205 | Hoffmaster Group, Inc | 8.73% | 21/11/2023 | 86,923 | 0.13 |
| 291,208 | Hub International Ltd | 7.53% | 25/04/2025 | 288,991 | 0.44 |
| 98,935 | Hyland Software Inc | 10.63% | 07/07/2025 | 94,087 | 0.14 |
| 92,478 | Icebox Holdco III Inc | 8.23% | 22/12/2028 | 85,658 | 0.13 |
| 181,938 | Icebox Holdco III Inc | 11.48% | 21/12/2029 | 161,925 | 0.25 |
| 166,464 | IGT Holding IV AB | 8.13% | 31/03/2028 | 163,551 | 0.25 |
| 149,866 | iHeartCommunications Inc | 7.38% | 01/05/2026 | 137,830 | 0.21 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---------|--|--------|------------|-------------|--------------|
| | タームローン 82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) (続き) | | | | |
| | 米ドル (続き) | | | | |
| 183,105 | Impala Bidco 0 Ltd | 0.00% | 08/06/2028 | 169,372 | 0.26 |
| 199,313 | Imprivata Inc | 8.13% | 01/12/2027 | 192,287 | 0.29 |
| 233,454 | Ineos US Finance LLC | 0.00% | 08/11/2027 | 230,244 | 0.35 |
| 360,704 | Ingram Micro Inc | 8.23% | 30/06/2028 | 356,196 | 0.54 |
| 209,221 | Intrado Corp | 8.41% | 10/10/2024 | 193,297 | 0.29 |
| 171,879 | Ivanti Software Inc | 8.73% | 01/12/2027 | 136,108 | 0.21 |
| 160,614 | Ivanti Software Inc | 9.01% | 01/12/2027 | 127,906 | 0.19 |
| 178,843 | Kenan Advantage Group Inc | 8.13% | 24/03/2026 | 174,787 | 0.26 |
| 99,133 | Kenan Advantage Group Inc | 11.63% | 01/09/2027 | 92,029 | 0.14 |
| 110,942 | Kestrel Acquisition LLC | 8.64% | 02/06/2025 | 108,100 | 0.16 |
| 77,557 | KKR Apple Bidco LLC | 10.13% | 21/09/2029 | 75,230 | 0.11 |
| 244,735 | LaserShip Inc | 9.23% | 07/05/2028 | 177,330 | 0.27 |
| 96,217 | LaserShip Inc | 12.23% | 07/05/2029 | 58,693 | 0.09 |
| 259,838 | Learning Care Group (US) No 2 Inc | 7.64% | 13/03/2025 | 242,397 | 0.37 |
| 178,093 | Lids Holdings Inc | 10.11% | 14/12/2026 | 167,408 | 0.25 |
| 121,292 | LifePoint Health Inc | 8.16% | 16/11/2025 | 114,636 | 0.17 |
| 276,773 | Lightstone Holdco LLC B Term Loan | 10.07% | 01/02/2027 | 254,631 | 0.39 |
| 16,668 | Lightstone Holdco LLC C Term Loan | 10.07% | 01/02/2027 | 15,335 | 0.02 |
| 191,492 | Lonestar II Generation Holdings LLC B Term Loan | 9.38% | 20/04/2026 | 187,064 | 0.28 |
| 31,710 | Lonestar II Generation Holdings LLC C Term Loan | 9.38% | 20/04/2026 | 30,977 | 0.05 |
| 321,987 | LS Group Opco Acquisition LLC | 6.58% | 02/11/2027 | 318,365 | 0.48 |
| 227,423 | M6 ETX Holdings II Midco LLC | 9.16% | 19/09/2029 | 227,672 | 0.34 |
| 196,779 | Mandolin Technology Intermediate Holdings Inc | 8.16% | 31/07/2028 | 184,480 | 0.28 |
| 99,133 | Mandolin Technology Intermediate Holdings Inc | 10.91% | 30/07/2029 | 89,715 | 0.14 |
| 236,488 | Marnix SAS | 6.79% | 04/08/2028 | 225,404 | 0.34 |
| 236,925 | Mauser Packaging Solutions Holding Co | 7.37% | 03/04/2024 | 231,792 | 0.35 |
| 243,060 | Maverick Bidco Inc | 8.16% | 18/05/2028 | 231,008 | 0.35 |
| 435,497 | McAfee Corp | 7.97% | 01/03/2029 | 406,567 | 0.62 |
| 267,884 | McGraw-Hill Education Inc | 8.32% | 28/07/2028 | 252,898 | 0.38 |
| 293,271 | Medallion Midland Acquisition LLC | 8.59% | 18/10/2028 | 291,116 | 0.44 |
| 201,416 | Mercury Borrower Inc | 8.25% | 02/08/2028 | 192,941 | 0.29 |
| 156,391 | MHI Holdings LLC | 9.38% | 21/09/2026 | 155,316 | 0.24 |
| 224,411 | MI Windows and Doors LLC | 7.92% | 18/12/2027 | 222,540 | 0.34 |
| 232,026 | Misys Ltd | 6.87% | 13/06/2024 | 205,826 | 0.31 |
| 196,443 | Motion Acquisition Ltd B1 Term Loan | 7.98% | 12/11/2026 | 187,869 | 0.28 |
| 25,672 | Motion Acquisition Ltd B2 Term Loan | 7.98% | 12/11/2026 | 24,551 | 0.04 |
| 383,219 | MPH Acquisition Holdings LLC | 8.98% | 01/09/2028 | 329,090 | 0.50 |
| 88,803 | National Mentor Holdings Inc | 8.33% | 02/03/2028 | 62,557 | 0.09 |
| 3,138 | National Mentor Holdings Inc | 8.48% | 02/03/2028 | 2,211 | 0.00 |
| 188,936 | National Mentor Holdings Inc | 11.98% | 02/03/2029 | 125,879 | 0.19 |
| 270,212 | Nautilus Power LLC | 8.63% | 16/05/2024 | 207,874 | 0.31 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---|--|--------|------------|-------------|--------------|
| タームローン82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) (続き) | | | | | |
| 米ドル (続き) | | | | | |
| 253,933 | Netsmart Inc | 8.38% | 01/10/2027 | 245,204 | 0.37 |
| 326,556 | Nomad Foods Ltd | 8.23% | 12/11/2029 | 326,182 | 0.49 |
| 292,431 | Oceankey (US) II Corp | 7.88% | 15/12/2028 | 268,525 | 0.41 |
| 199,837 | OCM System One Buyer CTB LLC | 8.73% | 02/03/2028 | 192,844 | 0.29 |
| 246,083 | OEG Borrower LLC | 9.60% | 18/06/2029 | 240,546 | 0.36 |
| 316,208 | Olympus Water US Holding Corp | 8.50% | 09/11/2028 | 304,394 | 0.46 |
| 303,408 | Optiv Inc | 7.42% | 01/02/2024 | 290,956 | 0.44 |
| 155,697 | Optiv Inc | 11.42% | 31/01/2025 | 145,285 | 0.22 |
| 257,174 | Orion Advisor Solutions Inc | 8.16% | 24/09/2027 | 234,993 | 0.36 |
| 307,312 | Oscar Acquisition Co LLC | 9.18% | 29/04/2029 | 291,756 | 0.44 |
| 264,101 | Ozark Holdings LLC | 8.13% | 16/12/2027 | 243,303 | 0.37 |
| 252,558 | Packaging Coordinators Midco Inc | 8.23% | 30/11/2027 | 240,157 | 0.36 |
| 294,438 | Pactiv Evergreen Inc | 7.63% | 24/09/2028 | 291,024 | 0.44 |
| 251,681 | PAI Holdco Inc | 8.16% | 28/10/2027 | 223,211 | 0.34 |
| 101,982 | Paradocs Holding Sarl | 8.06% | 17/02/2028 | 99,368 | 0.15 |
| 19,242 | Parkway Generation LLC | 0.00% | 18/02/2029 | 19,041 | 0.03 |
| 148,118 | Parkway Generation LLC | 9.07% | 18/02/2029 | 146,008 | 0.22 |
| 253,556 | Pearls (Netherlands) Bidco BV | 7.84% | 26/02/2029 | 246,900 | 0.37 |
| 174,295 | PECF USS Intermediate Holding III Corp | 8.63% | 15/12/2028 | 145,984 | 0.22 |
| 449,860 | Peraton Corp | 8.13% | 01/02/2028 | 440,114 | 0.67 |
| 139,264 | Peraton Corp | 12.09% | 01/02/2029 | 133,101 | 0.20 |
| 232,041 | Petco Health and Wellness Co Inc | 7.83% | 03/03/2028 | 225,588 | 0.34 |
| 324,202 | PetSmart LLC | 8.13% | 11/02/2028 | 318,223 | 0.48 |
| 273,721 | PetVet Care Centers LLC | 7.88% | 14/02/2025 | 258,092 | 0.39 |
| 92,354 | PetVet Care Centers LLC | 10.63% | 13/02/2026 | 85,312 | 0.13 |
| 269,307 | Phoenix Newco Inc | 7.63% | 15/11/2028 | 259,956 | 0.39 |
| 193,601 | Playtika Holding Corp | 0.00% | 13/03/2028 | 185,252 | 0.28 |
| 239,070 | PMHC II Inc | 8.49% | 23/04/2029 | 203,271 | 0.31 |
| 338,767 | Polaris Newco LLC | 8.73% | 02/06/2028 | 309,972 | 0.47 |
| 186,130 | Potters Industries LLC | 8.73% | 14/12/2027 | 182,873 | 0.28 |
| 403,342 | Prairie ECI Acquiror LP | 9.13% | 11/03/2026 | 393,146 | 0.60 |
| 171,277 | Pro Mach Group Inc | 8.38% | 31/08/2028 | 166,974 | 0.25 |
| 257,970 | Project Ruby Ultimate Parent Corp | 7.63% | 10/03/2028 | 244,495 | 0.37 |
| 146,950 | Proofpoint Inc | 10.98% | 31/08/2029 | 141,869 | 0.21 |
| 226,883 | Quantum Health Inc | 8.88% | 22/12/2027 | 196,254 | 0.30 |
| 148,534 | QUIKRETE Holdings Inc | 7.38% | 11/06/2028 | 147,571 | 0.22 |
| 122,972 | Radiate Holdco LLC | 7.63% | 25/09/2026 | 100,459 | 0.15 |
| 145,784 | RealPage Inc | 10.88% | 23/04/2029 | 140,955 | 0.21 |
| 253,943 | Redstone HoldCo 2 LP | 9.11% | 27/04/2028 | 177,034 | 0.27 |
| 194,184 | Redstone HoldCo 2 LP | 12.11% | 27/04/2029 | 98,428 | 0.15 |
| 92,719 | Renaissance Holding Corp | 11.38% | 29/05/2026 | 86,769 | 0.13 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---|---|--------|------------|-------------|--------------|
| タームローン82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) (続き) | | | | | |
| 米ドル (続き) | | | | | |
| 230,442 | Ring Container Technologies Group LLC | 7.88% | 12/08/2028 | 227,851 | 0.34 |
| 116,987 | Riverbed Technology LLC | 10.54% | 07/12/2026 | 50,568 | 0.08 |
| 212,166 | S&S Holdings LLC | 9.29% | 11/03/2028 | 193,956 | 0.29 |
| 93,885 | S&S Holdings LLC | 13.04% | 09/03/2029 | 85,435 | 0.13 |
| 54,678 | Sabre GLBL Inc | 9.42% | 30/06/2028 | 50,680 | 0.08 |
| 122,964 | Safe Fleet Holdings LLC | 8.17% | 23/02/2029 | 119,198 | 0.18 |
| 92,501 | Safe Fleet Holdings LLC | 11.14% | 02/02/2026 | 84,609 | 0.13 |
| 248,999 | Scientific Games Holdings LP | 7.10% | 04/04/2029 | 238,067 | 0.36 |
| 239,597 | SCIH Salt Holdings Inc | 8.41% | 16/03/2027 | 233,521 | 0.35 |
| 179,995 | Seren BidCo AB | 8.23% | 16/11/2028 | 174,145 | 0.26 |
| 8 | Service Logic Acquisition Inc | 8.41% | 29/10/2027 | 8 | 0.00 |
| 247,174 | Sharp Midco LLC | 8.73% | 31/12/2028 | 235,433 | 0.36 |
| 237,613 | Sophia LP | 8.23% | 07/10/2027 | 229,892 | 0.35 |
| 92,719 | Sound Inpatient Physicians Inc | 11.13% | 26/06/2026 | 73,306 | 0.11 |
| 133,689 | Southern Veterinary Partners LLC | 8.38% | 05/10/2027 | 128,397 | 0.19 |
| 247,500 | Sovos Brands Intermediate Inc | 7.91% | 08/06/2028 | 241,726 | 0.37 |
| 264,334 | Sparta US Holdco LLC | 7.39% | 02/08/2028 | 257,946 | 0.39 |
| 150,047 | SPX Flow Inc | 8.92% | 05/04/2029 | 140,536 | 0.21 |
| 363,807 | SRS Distribution Inc | 7.88% | 02/06/2028 | 348,704 | 0.53 |
| 150,999 | Star US Bidco LLC | 8.98% | 17/03/2027 | 144,204 | 0.22 |
| 326,556 | Starwood Property Mortgage LLC | 7.57% | 18/11/2027 | 322,474 | 0.49 |
| 244,735 | Summer (BC) Bidco B LLC | 9.23% | 04/12/2026 | 227,808 | 0.34 |
| 166,189 | Summit Behavioral Healthcare LLC | 9.45% | 24/11/2028 | 157,049 | 0.24 |
| 97,967 | Summit Behavioral Healthcare LLC | 12.45% | 26/11/2029 | 87,190 | 0.13 |
| 230,243 | Sunshine Luxembourg VII Sarl | 8.48% | 01/10/2026 | 221,066 | 0.33 |
| 245,974 | Superannuation and Investments Finco Pty Ltd | 8.13% | 01/12/2028 | 242,668 | 0.37 |
| 455,890 | Team Health Holdings Inc | 9.57% | 02/03/2027 | 344,910 | 0.52 |
| 292,048 | TEAM Services Group LLC | 9.93% | 20/12/2027 | 278,906 | 0.42 |
| 47,817 | TEAM Services Group LLC | 13.93% | 18/12/2028 | 45,426 | 0.07 |
| 174,472 | Tecta America Corp | 8.69% | 10/04/2028 | 167,929 | 0.25 |
| 96,801 | Tecta America Corp | 12.94% | 09/04/2029 | 92,686 | 0.14 |
| 71,143 | Telesat Canada | 7.17% | 07/12/2026 | 33,564 | 0.05 |
| 166,777 | Token Buyer Inc | 10.73% | 31/05/2029 | 154,685 | 0.23 |
| 299,732 | TransDigm Inc | 7.83% | 22/02/2027 | 299,077 | 0.45 |
| 169,150 | TransMontaigne Operating Co LP | 7.87% | 17/11/2028 | 166,243 | 0.25 |
| 42,928 | Trident TPI Holdings Inc Tranche B-3 Delayed Draw Term Loan | 0.00% | 15/09/2028 | 41,326 | 0.06 |
| 301,331 | Trident TPI Holdings Inc Tranche B-3 Initial Term Loan | 0.00% | 15/09/2028 | 290,086 | 0.44 |
| 145,660 | UFC Holdings LLC | 7.11% | 29/04/2026 | 144,021 | 0.22 |
| 74,266 | UKG Inc | 7.00% | 04/05/2026 | 70,831 | 0.11 |
| 295,067 | UKG Inc | 9.00% | 03/05/2027 | 272,273 | 0.41 |
| 388,935 | United AirLines Inc | 8.11% | 21/04/2028 | 385,128 | 0.58 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

| 元本額 | 内訳 | クーポン | 満期日 | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
|--|---|--------|------------|-------------------|--------------|
| タームローン 82.08% (2021年12月31日付: 91.71%) (続き) | | | | | |
| 米ドル(続き) | | | | | |
| 207,191 | US Anesthesia Partners Inc | 8.37% | 01/10/2028 | 197,797 | 0.30 |
| 99,133 | US Anesthesia Partners Inc | 11.62% | 01/10/2029 | 92,194 | 0.14 |
| 299,852 | US Silica Co | 8.44% | 01/05/2025 | 297,603 | 0.45 |
| 145,904 | USIC Holdings Inc | 7.88% | 12/05/2028 | 139,586 | 0.21 |
| 97,967 | USIC Holdings Inc | 10.88% | 14/05/2029 | 92,252 | 0.14 |
| 233,238 | Vaco Holdings LLC | 9.73% | 21/01/2029 | 225,755 | 0.34 |
| 91,990 | Valcour Packaging LLC | 7.98% | 04/10/2028 | 77,042 | 0.12 |
| 148,700 | Valcour Packaging LLC | 11.23% | 04/10/2029 | 115,242 | 0.17 |
| 245,395 | Vector WP MidCo Inc | 9.38% | 12/10/2028 | 241,101 | 0.37 |
| 152,615 | Verscend Holding Corp | 8.38% | 27/08/2025 | 151,948 | 0.23 |
| 302,875 | ViaSat Inc | 8.94% | 02/03/2029 | 295,445 | 0.45 |
| 192,424 | Vision Solutions Inc | 8.36% | 24/04/2028 | 159,856 | 0.24 |
| 97,967 | Vision Solutions Inc | 11.61% | 23/04/2029 | 73,077 | 0.11 |
| 109,409 | Voyage Australia Pty Ltd | 7.74% | 20/07/2028 | 104,212 | 0.16 |
| 125,234 | W. R. Grace Holdings LLC | 8.50% | 22/09/2028 | 123,249 | 0.19 |
| 69,263 | Wand Newco 3 Inc | 7.38% | 05/02/2026 | 65,861 | 0.10 |
| 184,974 | WatchGuard Technologies Inc | 9.57% | 02/07/2029 | 177,297 | 0.27 |
| 236,699 | WaterBridge Midstream Operating LLC | 9.13% | 22/06/2026 | 228,156 | 0.35 |
| 157,899 | Waystar Technologies Inc | 8.38% | 22/10/2026 | 155,530 | 0.24 |
| 187,987 | Weber-Stephen Products LLC | 7.63% | 30/10/2027 | 159,684 | 0.24 |
| 179,602 | Weld North Education LLC | 8.13% | 21/12/2027 | 176,414 | 0.27 |
| 161,211 | West Deptford Energy Holdings LLC | 8.13% | 03/08/2026 | 118,202 | 0.18 |
| 220,167 | White Cap Supply Holdings LLC | 8.07% | 19/10/2027 | 213,287 | 0.32 |
| 309,473 | William Morris Endeavor Entertainment LLC | 7.14% | 18/05/2025 | 303,593 | 0.46 |
| 186,194 | Wilsonart LLC | 7.98% | 31/12/2026 | 177,653 | 0.27 |
| 270,996 | Woof Holdings Inc | 8.10% | 21/12/2027 | 256,430 | 0.39 |
| 219,549 | WWEX UNI TopCo Holdings LLC | 8.73% | 26/07/2028 | 201,635 | 0.31 |
| 99,133 | WWEX UNI TopCo Holdings LLC | 11.73% | 26/07/2029 | 83,086 | 0.13 |
| 92,719 | Zayo Group Holdings Inc | 7.38% | 09/03/2027 | 75,521 | 0.11 |
| 131,710 | Zayo Group Holdings Inc | 8.57% | 09/03/2027 | 109,936 | 0.17 |
| 米ドル合計 | | | | 52,356,205 | 79.24 |
| タームローン合計 | | | | 54,233,399 | 82.08 |
| 投資合計 | | | | 59,124,921 | 89.49 |

為替先渡契約 26.17% (2021年12月31日付:3.72%)

| 受取額 | 支払額 | 満期日 | 取引相手 | 契約数 | 未実現利益 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---------------------------|--------------|------------|----------------------|-----|--------------|--------------|
| € 233,254 | US\$ 231,379 | 18/01/2023 | Société Générale | 1 | 17,813 | 0.03 |
| £ 63,559 | US\$ 72,090 | 18/01/2023 | Westpac Banking Corp | 1 | 4,396 | 0.00 |
| <i>JPY Hedged Classes</i> | | | | | | |
| ¥ 46,442,769 | US\$ 338,199 | 18/01/2023 | UBS AG | 1 | 14,468 | 0.02 |

三井住友・バンクローン・ファンド（為替ヘッジあり）毎月決算型

為替先渡契約 26.17% (2021年12月31日付: 3.72%) (続き)

| 受取額 | 支払額 | 満期日 | 取引相手 | 契約数 | 未実現利益 米ドル | 純資産比率 (%) |
|---------------------------------------|------------------|------------|----------------------|-----|-------------------|---------------|
| <i>JPY Hedged Classes (continued)</i> | | | | | | |
| ¥ 28,787,651,593 | US\$ 201,343,716 | 18/01/2023 | Westpac Banking Corp | 5 | 17,258,130 | 26.12 |
| 為替先渡契約に係る未実現利益合計 | | | | | 17,294,807 | 26.17 |
| | | | | | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
| 損益を通じて公正価値評価される金融資産合計 | | | | | 76,419,728 | 115.66 |

損益を通じて公正価値評価される金融負債

為替先渡契約(20.60%) (2021年12月31日付: 4.67%)

| 受取額 | 支払額 | 満期日 | 取引相手 | 契約数 | 未実現損失 米ドル | 純資産比率 (%) |
|------------------------------|------------------|------------|----------------------|-----|---------------------|----------------|
| US\$ 2,256,175 | € 2,274,459 | 18/01/2023 | Société Générale | 1 | (173,697) | (0.26) |
| US\$ 732,781 | £ 651,452 | 18/01/2023 | Westpac Banking Corp | 1 | (51,162) | (0.08) |
| <i>JPY Hedged Classes</i> | | | | | | |
| US\$ 298,309 | ¥ 43,309,367 | 18/01/2023 | UBS AG | 1 | (30,565) | (0.05) |
| US\$ 155,996,521 | ¥ 22,301,612,178 | 18/01/2023 | Westpac Banking Corp | 12 | (13,352,950) | (20.21) |
| 為替先渡契約に係る未実現損失合計 | | | | | (13,608,374) | (20.60) |
| | | | | | 公正価値 米ドル | 純資産比率 (%) |
| 損益を通じて公正価値評価される金融負債合計 | | | | | (13,608,374) | (20.60) |
| 損益を通じて公正価値評価される純金融資産 | | | | | 62,811,354 | 95.06 |
| その他資産 | | | | | 3,264,581 | 4.94 |
| 償還可能参加型持分の保有者に帰属する純資産 | | | | | 66,075,935 | 100.00 |

マネー・アカウント・マザーファンド

第11期（2022年10月13日から2023年10月12日まで）

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2012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 | | 公社比 | 債率 | 純資産 | 産額 |
|------------------|-------|----|------|-----|------|-----|-----|
| | | 騰 | 落 | | | | |
| | 円 | | | | % | | 百万円 |
| 7期（2019年10月15日） | 9,996 | | △0.1 | | 74.9 | | 11 |
| 8期（2020年10月12日） | 9,986 | | △0.1 | | 83.5 | | 10 |
| 9期（2021年10月12日） | 9,980 | | △0.1 | | 56.1 | | 5 |
| 10期（2022年10月12日） | 9,976 | | △0.0 | | 75.7 | | 5 |
| 11期（2023年10月12日） | 9,970 | | △0.1 | | 69.7 | | 5 |

※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

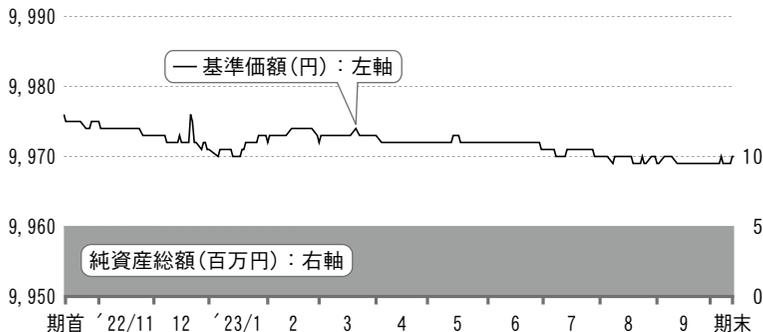
| 年月日 | 基準 | 価額 | | 公社比 | 債率 |
|---------------------|-------|----|------|-----|------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (期首) 2022年10月12日 | 円 | | | | % |
| | 9,976 | | — | | 75.7 |
| 10月末 | 9,975 | | △0.0 | | 75.7 |
| 11月末 | 9,973 | | △0.0 | | 75.7 |
| 12月末 | 9,971 | | △0.1 | | 75.7 |
| 2023年1月末 | 9,972 | | △0.0 | | 75.7 |
| 2月末 | 9,972 | | △0.0 | | 75.7 |
| 3月末 | 9,973 | | △0.0 | | 75.6 |
| 4月末 | 9,972 | | △0.0 | | 73.7 |
| 5月末 | 9,972 | | △0.0 | | 73.7 |
| 6月末 | 9,971 | | △0.1 | | 69.8 |
| 7月末 | 9,970 | | △0.1 | | 69.7 |
| 8月末 | 9,969 | | △0.1 | | 69.7 |
| 9月末 | 9,969 | | △0.1 | | 69.7 |
| (期末) 2023年10月12日 | 9,970 | | △0.1 | | 69.7 |

※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（2022年10月13日から2023年10月12日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|--------|
| 期首 | 9,976円 |
| 期末 | 9,970円 |
| 騰落率 | -0.1% |

▶ 基準価額の主な変動要因（2022年10月13日から2023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（2022年10月13日から2023年10月12日まで）

短期金利は、低下しました。

世界的にインフレが高止まりを続けたことや、欧米中央銀行による大幅な利上げの継続を背景に円安が進行したことから、国内でも物価上昇率が拡大し、CPIコア（生鮮食品除く消費者物価指数）は一時、前年比+4%台まで上昇しました。この間、日銀は市場機能への配慮や物価上昇リスクへの対応として、長期金利（10年国債利回り）の許容変動幅拡大や事実上の上限引き上げを行うなど、イールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の運用を柔軟化しました。しかし、日銀は賃金の上昇を伴う形での物価目標の達成を目指すために、イールドカーブ・コントロールの枠組みは維持し、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。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、欧米での金融不安の影響でリスク回避の動きが強まった3月や、年末越え運用ニーズが高まった9月末に、一時的に大きく低下する局面もありましたが、期を通じて概ねレンジ推移となりました。

▶ **ポートフォリオについて (2022年10月13日から2023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 (2022年10月13日から2023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

CPIコアの前年比伸び率は、政策効果によって+3%台に低下しており、先行きも輸入物価を起点とするコストプッシュ圧力の弱まりにより減速基調となる見通しです。日銀は賃金の上昇を伴う形での物価目標の達成に必要な時点までイールドカーブ・コントロールの枠組みを維持し、当面、マイナス金利政策を継続する見込みです。従って、短期国債利回りやコールローン（金融機関同士のごく短期の資金の貸借）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き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 (2022年10月13日から2023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9,972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 (2022年10月13日から2023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 | 1,911 | — |
| | 特殊債証券 | 1,611 | (3,800) |

※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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年10月13日から2023年10月12日まで)

当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
(2022年10月13日から2023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。

■ 組入れ資産の明細 (2023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BBB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 | 1,900 (-) | 1,906 (-) | 37.8 (-) | - (-) | - (-) | - (-) | 37.8 (-) |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 1,600 (1,600) | 1,607 (1,607) | 31.9 (31.9) | - (-) | - (-) | - (-) | 31.9 (31.9) |
| 合計 | 3,500 (1,600) | 3,513 (1,607) | 69.7 (31.9) | - (-) | - (-) | - (-) | 69.7 (31.9) |

※()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。

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 | 332 10年国債 | % 0.6000 | 千円 1,000 | 千円 1,001 | 2023/12/20 |
| | 335 10年国債 | 0.5000 | 900 | 904 | 2024/09/20 |
| 小 | 計 | - | 1,900 | 1,906 | - |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 215 政保道路機構 | 0.6690 | 800 | 803 | 2024/04/30 |
| | 3 政保新関西空港 | 0.6440 | 800 | 803 | 2024/06/26 |
| 小 | 計 | - | 1,600 | 1,607 | - |
| 合 | 計 | - | 3,500 | 3,513 | - |

■ 投資信託財産の構成

(2023年10月12日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 3,513千円 | 69.7% |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,525 | 30.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 5,038 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年10月12日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|--------------------|------------|
| (A) 資 産 | 5,038,972円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,521,226 |
| 公 社 債(評価額) | 3,513,373 |
| 未 収 利 息 | 4,226 |
| 前 払 費 用 | 147 |
| (B) 負 債 | 8 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 8 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 5,038,964 |
| 元 本 | 5,054,344 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 15,380 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 5,054,344口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,970円 |

※当期における期首元本額5,054,344円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額0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。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

| | |
|----------------------------------|----------|
| 三井住友・バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 毎月決算型 | 159,852円 |
| 三井住友・バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 年2回決算型 | 189,822円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-01 | 279,722円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-02 | 339,660円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-03 | 439,556円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-04 | 259,741円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-05 | 249,749円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-06 | 309,689円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-07 | 529,467円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-08 | 169,827円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-09 | 719,276円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-10 | 469,525円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-11 | 9,634円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 14-12 | 329,665円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 15-01 | 29,964円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 15-02 | 9,773円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 15-03 | 279,714円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 15-04 | 129,864円 |
| 日興・米国バンクローン・ファンド(為替ヘッジあり) 15-05 | 149,844円 |

※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2022年10月13日 至2023年10月12日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|---------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 24,979円 |
| 受 取 利 息 | 26,038 |
| 支 払 利 息 | △ 1,059 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △27,894 |
| 売 買 益 損 | 63 |
| 売 買 損 | △27,957 |
| (C) そ の 他 費 用 等 | △ 89 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △ 3,004 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △12,376 |
| (F) 合 計(D+E) | △15,380 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F) | △15,380 |

※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。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。