

# メキシコ債券ファンド (毎月分配型)

## 【愛称:ラ・バンバ】

### 【償還 運用報告書(全体版)】

第20作成期 (2022年8月27日から2023年2月27日まで)

第 115 期 / 第 116 期 / 第 117 期  
決算日2022年9月26日 決算日2022年10月26日 決算日2022年11月28日

第 118 期 / 第 119 期 / 第 120 期  
決算日2022年12月26日 決算日2023年1月26日 償還日2023年2月27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、主としてメキシコの債券等に投資し、安定的な金利収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いました。ここに当作成期の運用状況等をご報告いたします。

皆さまのご愛顧ありがとうございました。

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券
信託期間	2013年3月8日から2023年2月27日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、主としてメキシコの債券等に投資し、安定的な金利収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	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。 メキシコ・ボンド・ファンド (ディストリビューションクラス) メキシコの債券等 マネー・オープン・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、メキシコの債券等に投資することにより、安定的な金利収益の確保と信託財産の成長を目指します。 ■原則として対円での為替ヘッジは行いません。 ■実質的な運用は、現地の債券運用に強みを持つブラックロック・メキシコが行います。
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(評価損益を含みません)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)

## メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

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

### ■ 最近30期の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	投資信託 証券組入 比	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
91期(2020年9月28日)	5,081	25	△1.9	0.7	87.8	1,160
92期(2020年10月26日)	5,274	25	4.3	0.7	87.8	1,169
93期(2020年11月26日)	5,532	25	5.4	0.7	87.9	1,123
94期(2020年12月28日)	5,628	25	2.2	0.7	89.5	1,099
95期(2021年1月26日)	5,520	25	△1.5	0.7	88.2	1,066
96期(2021年2月26日)	5,324	25	△3.1	0.8	92.9	1,002
97期(2021年3月26日)	5,285	25	△0.3	0.8	88.6	970
98期(2021年4月26日)	5,462	25	3.8	0.8	93.4	985
99期(2021年5月26日)	5,481	25	0.8	0.7	88.3	983
100期(2021年6月28日)	5,512	25	1.0	0.8	87.8	970
101期(2021年7月26日)	5,418	25	△1.3	0.8	92.9	949
102期(2021年8月26日)	5,328	25	△1.2	0.9	92.5	922
103期(2021年9月27日)	5,344	25	0.8	0.8	88.0	911
104期(2021年10月26日)	5,366	25	0.9	0.9	94.0	899
105期(2021年11月26日)	5,069	25	△5.1	0.9	93.2	842
106期(2021年12月27日)	5,248	25	4.0	0.9	93.7	847
107期(2022年1月26日)	5,231	25	0.2	0.9	83.2	836
108期(2022年2月28日)	5,293	25	1.7	0.9	92.8	816
109期(2022年3月28日)	5,528	25	4.9	1.0	93.3	844
110期(2022年4月26日)	5,585	25	1.5	1.0	86.0	843
111期(2022年5月26日)	5,756	25	3.5	1.0	88.8	856
112期(2022年6月27日)	5,968	25	4.1	1.0	88.8	869
113期(2022年7月26日)	5,915	25	△0.5	1.0	87.2	854
114期(2022年8月26日)	6,086	25	3.3	1.1	93.4	808
115期(2022年9月26日)	6,123	25	1.0	1.0	93.1	805
116期(2022年10月26日)	6,281	25	3.0	1.1	93.6	738
117期(2022年11月28日)	6,293	25	0.6	1.1	89.1	729
118期(2022年12月26日)	6,012	25	△4.1	1.2	86.0	665
119期(2023年1月26日)	6,154	25	2.8	1.1	85.4	675
(償還日)	(償還価額)					
120期(2023年2月27日)	6,162.64	0	0.1	—	—	659

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組入比率	投資信託 証券組入 比 率
		円	騰 落 率		
第115期	(期 首) 2022年 8月26日	6,086	—	1.1	93.4
	8月末	6,064	△0.4	1.1	93.4
	(期 末) 2022年 9月26日	6,148	1.0	1.0	93.1
第116期	(期 首) 2022年 9月26日	6,123	—	1.0	93.1
	9月末	6,105	△0.3	1.0	93.3
	(期 末) 2022年10月26日	6,306	3.0	1.1	93.6
第117期	(期 首) 2022年10月26日	6,281	—	1.1	93.6
	10月末	6,323	0.7	1.1	93.8
	(期 末) 2022年11月28日	6,318	0.6	1.1	89.1
第118期	(期 首) 2022年11月28日	6,293	—	1.1	89.1
	11月末	6,255	△0.6	1.2	93.3
	(期 末) 2022年12月26日	6,037	△4.1	1.2	86.0
第119期	(期 首) 2022年12月26日	6,012	—	1.2	86.0
	12月末	6,072	1.0	1.1	86.1
	(期 末) 2023年 1月26日	6,179	2.8	1.1	85.4
第120期	(期 首) 2023年 1月26日	6,154	—	1.1	85.4
	1月末	6,177	0.4	1.1	93.2
	(償 還 日) 2023年 2月27日	(償還価額) 6,162.64	0.1	—	—

※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

## メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

設定以来の運用状況（設定日（2013年3月8日）から償還日（2023年2月27日）まで）

### 設定以来の基準価額の推移



前作成期までの概略（設定日（2013年3月8日）から第19作成期末（2022年8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、主として、メキシコの債券等に投資しました。また、対円での為替ヘッジは行いませんでした。

#### 上昇要因

- ・2018年12月から2021年1月にかけて、新型コロナウイルスの影響による景気後退に対応してメキシコの中央銀行が利下げを行い、メキシコ債券市場が上昇したこと
- ・2020年5月から2022年8月にかけて、メキシコと日本の金利差拡大によりメキシコペソが対円で上昇したこと

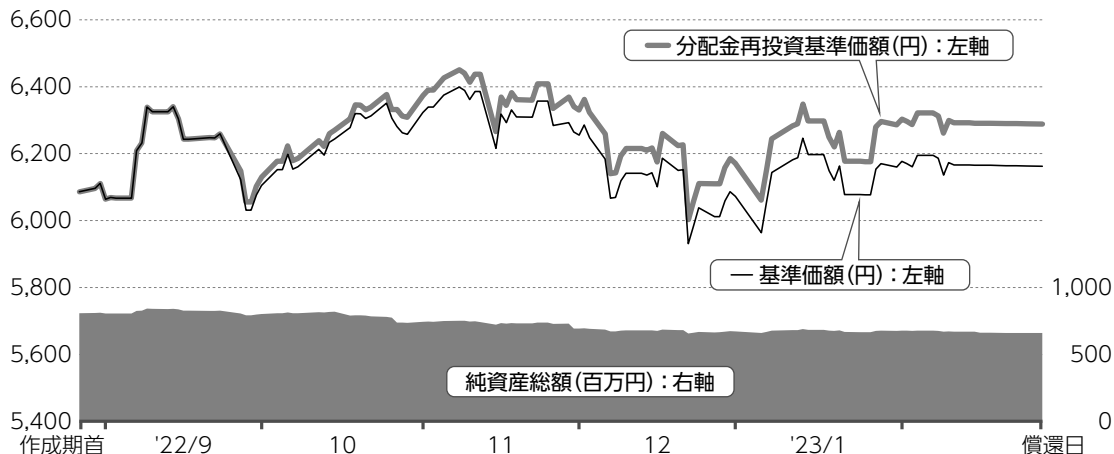
#### 下落要因

- ・2016年10月から2018年11月にかけてと、2021年2月から2022年8月にかけて、インフレ率上昇に対応してメキシコの中央銀行が利上げを行い、メキシコ債券市場が下落したこと
- ・2015年7月から2016年9月にかけて、中国の景気減速懸念や原油価格の下落から投資家のリスク回避姿勢が強まり、メキシコペソが対円で下落したこと

# 1 運用経過

基準価額等の推移について（2022年8月27日から2023年2月27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	6,086円
償還日	6,162円64銭 (当作成期既払分配金125円(税引前))
騰落率	+3.3% (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(2022年8月27日から2023年2月27日まで)**

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主として、メキシコの債券等に投資しました。また、対円での為替ヘッジは行いませんでした。

**上昇要因**

- メキシコペソが対円で上昇したこと

投資環境について（2022年8月27日から2023年2月27日まで）

メキシコ債券市場は概ね横ばいとなりました。為替市場ではメキシコペソは対円で上昇しました。

### 債券市場

メキシコの長期金利（10年国債利回り）は、メキシコ銀行（中央銀行）が利上げを継続しましたが、インフレ率が上昇傾向から上昇ペース鈍化に転じるなかで小幅な上昇にとどまりました。米国での利上げペース減速も、メキシコ金利の安定化要因となりました。

期初から期中には、高止まりするインフレをコントロールするための利上げが継続されるとの見方からメキシコ金利は上昇しました。償還日にかけては、主要国の景気減速が意識され、メキシコでもインフレ圧力が後退してきたことが好感されて、メキシコ金利は低下しました。

金利は中銀の利上げの進捗を受けて短期ゾーンでの金利上昇幅が大きく、イールドカーブ（利回り曲線）は逆イールド化しました。

### 為替市場

メキシコペソ・円の相場は、期初と比較してメキシコペソ高・円安となりました。メキシコ銀行の利上げ継続がメキシコペソ高要因となりました。一時的には日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことで、メキシコペソ安・円高となる場面もありましたが、メキシコ銀行の利上げ継続の影響が根強く、メキシコペソは対円で上昇しました。

ポートフォリオについて（2022年8月27日から2023年2月27日まで）

### 当ファンド

期初より、「メキシコ・ボンド・ファンド（ディストリビューションクラス）」を高位に組み入れることにより主としてメキシコの債券等に投資しました。また「マネー・オープン・マザーファンド」への投資を通じて安定

した収益の確保を目指した運用を行いました。ただし、償還前には現金化しております。

### メキシコ・ボンド・ファンド（ディストリビューションクラス）

ポートフォリオのデュレーション（投資資金の平均回収期間）：金利の変動による債券価

## メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

格の感応度)は、期初から期中までは短期化していましたが、12月からインフレ圧力の後退を勘案し長期化し、1月には中立化しました。

また、メキシコの国債と社債に投資しましたが、社債については流動性と収益追求の観点からクオリティの高い銘柄中心に保有し、1月には期初対比でやや組入れを減らしまし

た。

### マネー・オープン・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(2022年8月27日から2023年2月27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(2022年8月27日から2023年2月27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120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115期	第116期	第117期	第118期	第119期
当期分配金	25	25	25	25	25
(対基準価額比率)	(0.41%)	(0.40%)	(0.40%)	(0.41%)	(0.40%)
当期の収益	25	25	25	25	25
当期の収益以外	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	4,808	4,910	5,003	5,107	5,206

※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。

## メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

### 1万口当たりの費用明細（2022年8月27日から2023年2月27日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	34円	0.556%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) <span style="border: 1px solid black; padding: 2px;">期中の平均基準価額は6,193円です。</span>
（投信会社）	(9)	(0.150)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(24)	(0.390)	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)	(0.016)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
（株式）	(－)	(－)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(d) その他費用	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）	(－)	(－)	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)	(0.001)	その他：信託事務の処理等に要するその他費用
<b>合計</b>	<b>35</b>	<b>0.557</b>	

※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。

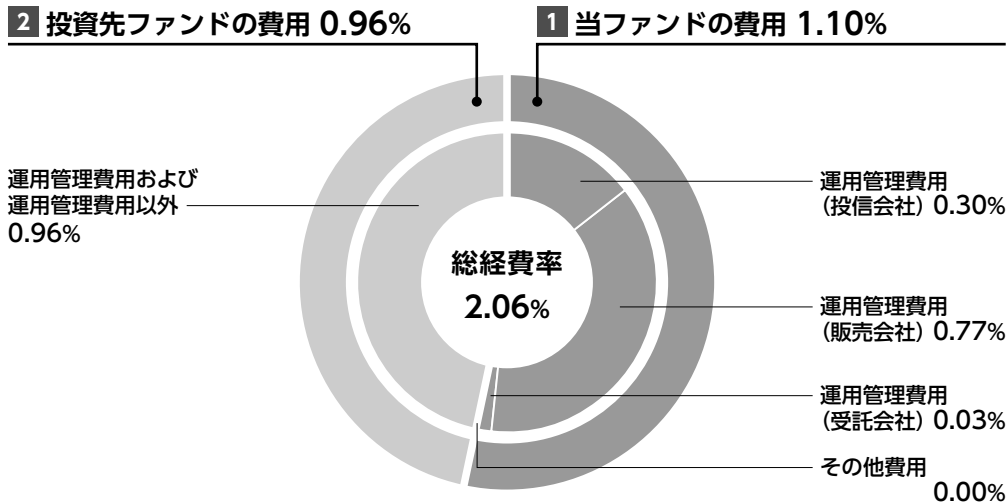
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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)

2.06%

1 当ファンドの費用の比率

1.10%

2 投資先ファンドの費用の比率

0.96%

※ 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、実際に投資しているシェアクラスのデータが入手できない場合は、入手可能なファンド全体のデータをもとに委託会社が計算したものです。運用管理費用と運用管理費用以外の費用を明確に区別できない場合は、まとめて表示しています。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2.06%です。

## メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

### ■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2022年8月27日から2023年2月27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	メキシコ・ボンド・ファンド（ディストリビューションクラス）	□ 424,231,976	千円 119,000	□ 3,052,019,973	千円 829,424

※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・オープン・マザーファンド		千口 -	千円 -	千口 9,994	千円 9,970

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2022年8月27日から2023年2月27日まで)

#### 利害関係人との取引状況

#### メキシコ債券ファンド（毎月分配型）

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・オープン・マザーファンド

区 分	当 作 成 期					
	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 18	百万円 -	%	百万円 12	百万円 10	%

※平均保有割合 20.1%

※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、当作成期中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  
(2022年8月27日から2023年2月27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2月27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
メキシコ・ボンド・ファンド（ディストリビューションクラス）	2,627,787,997	—	—	—
合計	2,627,787,997	—	—	—

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 親投資信託残高

種類	作成期首	作成期末	
	口数	口数	評価額
マネー・オープン・マザーファンド	9,994	—	—

■ 投資信託財産の構成

(2023年2月27日現在)

項目	作成期末	
	評価額	比率
コール・ローン等、その他	661,449	100.0
投資信託財産総額	661,449	100.0

メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

■ 資産、負債、元本及び基準価額または償還価額の状況

(2022年9月26日) (2022年10月26日) (2022年11月28日) (2022年12月26日) (2023年1月26日) (2023年2月27日)

項 目	第115期末	第116期末	第117期末	第118期末	第119期末	償還時
<b>(A) 資 産</b>	<b>825,806,339円</b>	<b>791,470,821円</b>	<b>752,396,721円</b>	<b>669,164,230円</b>	<b>679,464,387円</b>	<b>661,449,230円</b>
コール・ローン等	49,172,685	48,016,709	91,979,162	87,333,554	92,661,880	661,449,230
投資信託受益証券(評価額)	749,799,799	691,782,095	650,446,542	571,861,658	576,832,489	-
マネー・オープン・マザーファンド(評価額)	9,974,015	9,972,017	9,971,017	9,969,018	9,970,018	-
未 収 入 金	-	41,700,000	-	-	-	-
未 収 配 当 金	16,859,840	-	-	-	-	-
<b>(B) 負 債</b>	<b>20,331,714</b>	<b>52,587,922</b>	<b>22,537,964</b>	<b>4,022,129</b>	<b>4,073,528</b>	<b>1,500,730</b>
未 払 金	10,500,000	-	18,900,000	-	-	-
未払収益分配金	3,288,546	2,940,975	2,899,667	2,765,755	2,743,533	-
未払解約金	5,773,558	48,921,777	3,010	679,462	699,068	829,449
未払信託報酬	768,799	724,521	734,552	575,298	629,787	665,811
未 払 利 息	-	-	-	-	-	807
その他未払費用	811	649	735	1,614	1,140	4,663
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>805,474,625</b>	<b>738,882,899</b>	<b>729,858,757</b>	<b>665,142,101</b>	<b>675,390,859</b>	<b>659,948,500</b>
元 本	1,315,418,684	1,176,390,339	1,159,867,151	1,106,302,325	1,097,413,558	1,070,885,225
次期繰越損益金	△ 509,944,059	△ 437,507,440	△ 430,008,394	△ 441,160,224	△ 422,022,699	-
償還差損益金	-	-	-	-	-	△ 410,936,725
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1,315,418,684口</b>	<b>1,176,390,339口</b>	<b>1,159,867,151口</b>	<b>1,106,302,325口</b>	<b>1,097,413,558口</b>	<b>1,070,885,225口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	6,123円	6,281円	6,293円	6,012円	6,154円	-
1万口当たり償還価額(C/D)	-	-	-	-	-	6,162円64銭

※当作成期における作成期首元本額1,328,317,161円、作成期中追加設定元本額5,187,707円、作成期中一部解約元本額262,619,643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。

## メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

### ■ 損益の状況

(自2022年8月27日 至2022年9月26日) (自2022年9月27日 至2022年10月26日) (自2022年10月27日 至2022年11月26日) (自2022年11月27日 至2022年12月26日) (自2022年12月27日 至2023年1月26日) (自2023年1月27日 至2023年2月27日)

項 目	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>16,792,560円</b>	<b>15,338,405円</b>	<b>14,471,451円</b>	<b>14,891,302円</b>	<b>13,975,319円</b>	<b>△ 5,728円</b>
受 取 配 当 金	16,795,484	15,340,671	14,474,498	14,893,500	13,978,293	-
受 取 利 息	9	201	53	-	201	100
支 払 利 息	△ 2,933	△ 2,467	△ 3,100	△ 2,198	△ 3,175	△ 5,828
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 7,860,994</b>	<b>6,867,642</b>	<b>△ 9,482,961</b>	<b>△ 42,559,322</b>	<b>4,989,920</b>	<b>1,560,853</b>
売 買 益	861,794	7,824,480	1,867,587	26,528	4,998,984	1,576,695
売 買 損	△ 8,722,788	△ 956,838	△ 11,350,548	△ 42,585,850	△ 9,064	△ 15,842
<b>(C) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 769,722</b>	<b>△ 725,247</b>	<b>△ 735,379</b>	<b>△ 577,342</b>	<b>△ 631,062</b>	<b>△ 670,702</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)</b>	<b>8,161,844</b>	<b>21,480,800</b>	<b>4,253,111</b>	<b>△ 28,245,362</b>	<b>18,334,177</b>	<b>884,423</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>△349,872,497</b>	<b>△308,269,001</b>	<b>△285,430,505</b>	<b>△270,803,399</b>	<b>△299,176,681</b>	<b>△276,580,635</b>
<b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>△164,944,860</b>	<b>△147,778,264</b>	<b>△145,931,333</b>	<b>△139,345,708</b>	<b>△138,436,662</b>	<b>△135,240,513</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 111,482,347)	( 100,104,600)	( 99,077,934)	( 94,762,583)	( 94,333,224)	( 92,305,681)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△276,427,207)	(△247,882,864)	(△245,009,267)	(△234,108,291)	(△232,769,886)	(△227,546,194)
<b>(G) 合 計 ( D + E + F )</b>	<b>△506,655,513</b>	<b>△434,566,465</b>	<b>△427,108,727</b>	<b>△438,394,469</b>	<b>△419,279,166</b>	<b>△410,936,725</b>
<b>(H) 収 益 分 配 金</b>	<b>△ 3,288,546</b>	<b>△ 2,940,975</b>	<b>△ 2,899,667</b>	<b>△ 2,765,755</b>	<b>△ 2,743,533</b>	<b>-</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)</b>	<b>△509,944,059</b>	<b>△437,507,440</b>	<b>△430,008,394</b>	<b>△441,160,224</b>	<b>△422,022,699</b>	<b>-</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	△164,944,860	△147,778,264	△145,931,333	△139,345,708	△138,436,662	-
( 配 当 等 相 当 額 )	( 111,482,347)	( 100,104,600)	( 99,077,934)	( 94,762,583)	( 94,333,224)	( - )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△276,427,207)	(△247,882,864)	(△245,009,267)	(△234,108,291)	(△232,769,886)	( - )
償 還 差 損 益 金	-	-	-	-	-	△410,936,725
分 配 準 備 積 立 金	521,079,971	477,504,293	481,261,272	470,326,739	476,987,048	-
繰 越 損 益 金	△866,079,170	△767,233,469	△765,338,333	△772,141,255	△760,573,085	-

※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115期	第116期	第117期	第118期	第119期
(a) 経費控除後の配当等収益	16,027,797円	14,841,853円	13,741,295円	14,318,421円	13,514,453円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	111,482,347	100,104,600	99,077,934	94,762,583	94,333,224
(d) 分配準備積立金	508,340,720	465,603,415	470,419,644	458,774,073	466,216,128
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	635,850,864	580,549,868	583,238,873	567,855,077	574,063,805
1万口当たり当期分配対象額	4,833.83	4,935.01	5,028.50	5,132.91	5,231.06
(f) 分配金	3,288,546	2,940,975	2,899,667	2,765,755	2,743,533
1万口当たり分配金	25	25	25	25	25

メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

■ 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3月8日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年2月27日		資産総額	661,449,230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	1,500,730円
受益権口数	10,904,491,720口	1,070,885,225口	△9,833,606,495口	純資産総額	659,948,500円
元本額	10,904,491,720円	1,070,885,225円	△9,833,606,495円	受益権口数	1,070,885,225口
				1万円当たり 償還金	6,162円64銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第1期	13,444,180,917	13,402,481,151	9,969	0	0.00
第2期	17,360,533,237	19,144,962,921	11,028	50	0.50
第3期	20,287,516,412	21,432,664,093	10,564	50	0.50
第4期	23,039,194,254	20,353,713,522	8,834	50	0.50
第5期	24,030,633,526	23,161,448,096	9,638	50	0.50
第6期	24,376,818,620	22,244,201,392	9,125	50	0.50
第7期	24,451,505,805	22,679,951,818	9,275	50	0.50
第8期	24,540,214,837	22,856,709,223	9,314	50	0.50
第9期	24,440,780,480	22,408,919,409	9,169	50	0.50
第10期	24,295,830,982	22,984,244,199	9,460	50	0.50
第11期	24,318,367,367	21,511,816,409	8,846	50	0.50
第12期	24,001,881,840	21,911,169,622	9,129	50	0.50
第13期	22,680,778,274	20,981,823,938	9,251	50	0.50
第14期	20,897,992,590	19,251,669,498	9,212	50	0.50
第15期	20,342,238,063	19,299,293,252	9,487	50	0.50
第16期	18,912,234,566	17,923,137,825	9,477	50	0.50
第17期	18,238,161,530	17,433,658,055	9,559	50	0.50
第18期	17,493,934,345	16,664,344,693	9,526	50	0.50
第19期	16,614,787,108	16,022,844,962	9,644	50	0.50
第20期	15,922,710,023	15,163,491,555	9,523	50	0.50
第21期	14,524,250,627	14,909,226,553	10,265	50	0.50
第22期	13,878,518,786	13,542,602,031	9,758	50	0.50
第23期	13,294,977,609	13,013,950,026	9,789	50	0.50
第24期	12,568,351,644	11,961,384,393	9,517	50	0.50
第25期	11,905,139,627	11,249,086,886	9,449	50	0.50
第26期	11,361,698,136	10,387,384,888	9,142	50	0.50
第27期	11,106,892,563	10,302,892,515	9,276	50	0.50
第28期	10,436,318,128	9,673,600,624	9,269	50	0.50
第29期	10,056,669,790	8,873,165,291	8,823	50	0.50
第30期	9,509,040,024	7,810,665,981	8,214	50	0.50
第31期	9,148,225,023	7,378,453,002	8,065	50	0.50



メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

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 32 期	8,749,839,248	7,475,347,751	8,543	50	0.50
第 33 期	8,316,712,348	7,108,887,278	8,548	50	0.50
第 34 期	7,704,897,046	6,147,231,616	7,978	50	0.50
第 35 期	7,377,588,863	5,418,968,404	7,345	50	0.50
第 36 期	7,145,656,718	5,098,850,024	7,136	50	0.50
第 37 期	6,935,712,488	5,113,386,803	7,373	50	0.50
第 38 期	6,765,776,071	4,913,853,720	7,263	50	0.50
第 39 期	6,663,326,026	4,511,732,806	6,771	50	0.50
第 40 期	6,421,509,353	4,011,552,299	6,247	50	0.50
第 41 期	6,260,064,565	4,071,625,626	6,504	50	0.50
第 42 期	6,047,033,751	3,806,141,233	6,294	50	0.50
第 43 期	5,932,780,129	3,448,283,511	5,812	50	0.50
第 44 期	5,785,747,168	3,660,606,130	6,327	50	0.50
第 45 期	5,734,525,205	3,320,023,871	5,790	50	0.50
第 46 期	5,533,611,263	3,340,744,615	6,037	50	0.50
第 47 期	5,743,054,983	3,175,333,727	5,529	50	0.50
第 48 期	5,674,444,792	3,366,465,120	5,933	50	0.50
第 49 期	5,732,966,837	3,551,467,600	6,195	50	0.50
第 50 期	5,558,540,613	3,384,059,342	6,088	50	0.50
第 51 期	5,358,808,418	3,360,852,823	6,272	35	0.35
第 52 期	5,188,553,451	3,417,714,826	6,587	35	0.35
第 53 期	5,010,354,991	3,297,385,914	6,581	35	0.35
第 54 期	4,951,465,854	3,235,793,347	6,535	35	0.35
第 55 期	4,887,021,149	3,222,052,719	6,593	35	0.35
第 56 期	4,942,735,467	3,048,773,786	6,168	35	0.35
第 57 期	4,875,421,745	3,027,110,871	6,209	35	0.35
第 58 期	4,648,733,134	2,750,332,456	5,916	35	0.35
第 59 期	4,503,411,603	2,704,698,610	6,006	35	0.35
第 60 期	4,423,020,568	2,574,926,222	5,822	35	0.35
第 61 期	4,275,684,729	2,458,356,766	5,750	35	0.35
第 62 期	4,120,129,829	2,390,087,102	5,801	35	0.35
第 63 期	3,916,704,703	2,175,550,974	5,555	35	0.35
第 64 期	3,851,936,340	2,111,016,349	5,480	35	0.35
第 65 期	3,797,885,067	2,229,433,895	5,870	35	0.35
第 66 期	3,741,608,753	2,187,706,935	5,847	35	0.35
第 67 期	3,703,578,351	2,148,387,661	5,801	35	0.35
第 68 期	3,677,327,750	2,048,089,390	5,570	35	0.35
第 69 期	3,579,945,592	1,837,398,430	5,132	35	0.35
第 70 期	3,474,509,495	1,847,783,058	5,318	25	0.25
第 71 期	3,392,038,473	1,882,247,362	5,549	25	0.25
第 72 期	3,328,418,339	1,859,665,086	5,587	25	0.25

メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

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 73 期	3,276,546,880	1,856,830,575	5,667	25	0.25
第 74 期	3,172,686,299	1,790,393,477	5,643	25	0.25
第 75 期	3,127,730,841	1,755,242,305	5,612	25	0.25
第 76 期	2,993,979,902	1,657,240,258	5,535	25	0.25
第 77 期	3,059,823,687	1,744,814,697	5,702	25	0.25
第 78 期	3,045,895,023	1,672,924,167	5,492	25	0.25
第 79 期	3,021,134,122	1,712,855,600	5,670	25	0.25
第 80 期	2,938,318,165	1,720,225,978	5,854	25	0.25
第 81 期	2,536,600,485	1,450,517,337	5,718	25	0.25
第 82 期	2,445,453,772	1,443,327,440	5,902	25	0.25
第 83 期	2,402,621,789	1,436,925,433	5,981	25	0.25
第 84 期	2,341,606,870	1,408,422,127	6,015	25	0.25
第 85 期	2,340,288,912	1,070,572,027	4,575	25	0.25
第 86 期	2,341,401,756	1,057,464,557	4,516	25	0.25
第 87 期	2,321,619,713	1,178,512,184	5,076	25	0.25
第 88 期	2,318,921,114	1,168,954,647	5,041	25	0.25
第 89 期	2,294,112,796	1,174,367,032	5,119	25	0.25
第 90 期	2,282,626,706	1,188,263,191	5,206	25	0.25
第 91 期	2,283,382,794	1,160,156,042	5,081	25	0.25
第 92 期	2,216,876,418	1,169,109,786	5,274	25	0.25
第 93 期	2,031,211,285	1,123,589,933	5,532	25	0.25
第 94 期	1,954,218,063	1,099,930,492	5,628	25	0.25
第 95 期	1,931,586,787	1,066,285,236	5,520	25	0.25
第 96 期	1,882,432,158	1,002,188,669	5,324	25	0.25
第 97 期	1,835,784,723	970,209,698	5,285	25	0.25
第 98 期	1,804,138,532	985,401,987	5,462	25	0.25
第 99 期	1,793,876,935	983,198,233	5,481	25	0.25
第 100 期	1,760,127,747	970,103,783	5,512	25	0.25
第 101 期	1,751,686,484	949,056,609	5,418	25	0.25
第 102 期	1,731,085,129	922,240,737	5,328	25	0.25
第 103 期	1,705,376,758	911,299,621	5,344	25	0.25
第 104 期	1,676,259,956	899,416,960	5,366	25	0.25
第 105 期	1,662,871,066	842,891,076	5,069	25	0.25
第 106 期	1,615,683,234	847,921,461	5,248	25	0.25
第 107 期	1,599,645,325	836,835,430	5,231	25	0.25
第 108 期	1,541,962,083	816,196,463	5,293	25	0.25
第 109 期	1,528,210,327	844,720,881	5,528	25	0.25
第 110 期	1,509,929,863	843,319,451	5,585	25	0.25
第 111 期	1,487,857,954	856,465,852	5,756	25	0.25
第 112 期	1,457,569,386	869,819,971	5,968	25	0.25
第 113 期	1,445,356,981	854,933,861	5,915	25	0.25

## メキシコ債券ファンド（毎月分配型）【愛称：ラ・バンバ】

計 算 期	元 本 額	純 資 産 総 額	基 準 価 額	1 万 口 当 ち 分 配 金	
				金 額	分 配 率
	円	円	円	円	%
第 114 期	1,328,317,161	808,449,739	6,086	25	0.25
第 115 期	1,315,418,684	805,474,625	6,123	25	0.25
第 116 期	1,176,390,339	738,882,899	6,281	25	0.25
第 117 期	1,159,867,151	729,858,757	6,293	25	0.25
第 118 期	1,106,302,325	665,142,101	6,012	25	0.25
第 119 期	1,097,413,558	675,390,859	6,154	25	0.25

### ■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 ち 分 配 金 (税 引 前)	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
		25円	25円	25円	25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	メキシコ・ボンド・ファンド（ディストリビューションクラス）
形態	ケイマン籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	メキシコの債券等
運用の基本方針	主として、メキシコの債券等に投資し、安定的な金利収益の確保と信託財産の成長を目指します。メキシコペソ建て以外の債券等に投資する場合は、実質的にメキシコペソ建てとなるよう為替取引を行います。また、外貨建資産については、対円での為替ヘッジは行いません。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資信託証券への投資は純資産総額の5%以下とします。ただし、上場投資信託証券（ETF、REIT等）は除きます。</li> <li>非流動性資産への投資は、取得時において純資産総額の15%以下とします。</li> </ul>
決算日	原則として毎年10月31日
分配方針	毎月15日（休業日の場合は前営業日）に分配を行う方針。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</p> <p>運用報酬 年0.57%程度</p> <p>管理費用等 年0.07%程度*</p> <p>*事務代行費用、名義書換代行費用および保管費用を含みます。</p> <p>※上記の各料率には、年間最低報酬額等が定められている場合があるため、純資産総額によっては、上記の各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。
信託財産留保額	ありません。
投資顧問会社	シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッド
副投資顧問会社	ブラックロック・メキシコ（BlackRock México Operadora, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión）
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、「メキシコ・ボンド・ファンド（ディストリビューションクラス）」をシェアクラスとして含む「メキシコ・ボンド・ファンド」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せん。

■ 包括利益計算書(2020年11月1日から2021年10月31日まで)

	(千円)
損益を通じて公正価値評価される金融資産による受取利息	108,636
損益を通じて公正価値評価される金融商品にかかる純利益	79,971
純為替差益	2,526
利益合計	191,133
管理報酬	(8,756)
事務代行、名義書換代理人および保管報酬	(1,196)
監査報酬	(3,952)
専門家報酬	(2,077)
雑費	(120)
受託報酬	(1,215)
財務諸表作成費用	(440)
営業費用合計	(17,756)
税引前および金融費用控除前営業利益	173,377
受益証券保有者への分配金	(213,658)
税引前損失	(40,281)
源泉徴収税	(966)
営業による受益証券保有者に帰属する純資産の変動額および当期包括利益合計	(41,247)

■ 組入上位銘柄(基準日：2021年10月29日)

	銘柄名	利率	償還日	組入比率
1	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	8.500%	2029/5/31	11.0%
2	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	5.750%	2026/3/5	10.9%
3	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	8.500%	2038/11/18	9.8%
4	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	7.750%	2031/5/29	9.2%
5	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	10.000%	2024/12/5	9.0%
6	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	7.500%	2027/6/3	7.0%
7	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	8.000%	2024/9/5	7.0%
8	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	8.000%	2047/11/7	6.9%
9	SCOTIABANK INVERLAT SA	7.300%	2023/6/16	6.5%
10	MEXICAN FEDERAL GOVERNMENT DEPELOPMENT BOND	7.750%	2042/11/13	6.0%
	全銘柄数		19銘柄	

※比率は純資産総額に対する割合

# マネー・オープン・マザーファンド

第10期 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

信託期間	無期限 (設定日: 2012年7月27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
	円	期中 騰落率		
6期 (2018年3月1日)	10,009	△0.1	72.4	75
7期 (2019年3月1日)	10,002	△0.1	72.4	75
8期 (2020年3月2日)	9,996	△0.1	74.9	75
9期 (2021年3月1日)	9,987	△0.1	75.9	72
10期 (2022年3月1日)	9,979	△0.1	76.9	61

※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

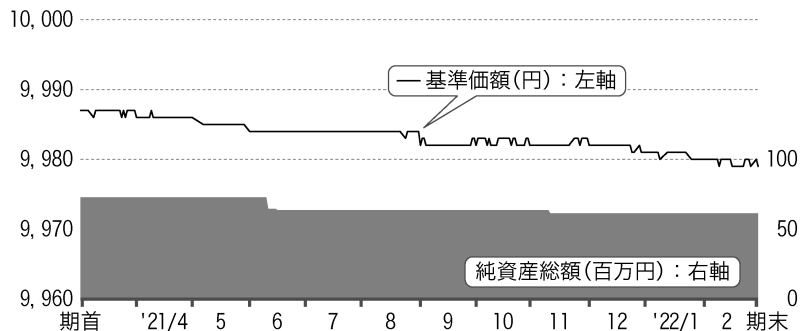
年月日	基準価額		公社債 組入比率
	円	騰落率	
(期首) 2021年3月1日	9,987	-	75.9
3月末	9,986	△0.0	75.9
4月末	9,986	△0.0	73.2
5月末	9,984	△0.0	70.5
6月末	9,984	△0.0	80.6
7月末	9,984	△0.0	80.6
8月末	9,982	△0.1	77.5
9月末	9,982	△0.1	77.5
10月末	9,982	△0.1	77.4
11月末	9,982	△0.1	80.2
12月末	9,981	△0.1	77.0
2022年1月末	9,980	△0.1	77.0
2月末	9,980	△0.1	76.9
(期末) 2022年3月1日	9,979	△0.1	76.9

※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 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

#### 基準価額等の推移



期 首	9,987円
期 末	9,979円
騰 落 率	-0.1%

### ▶ 基準価額の主な変動要因 (2021年3月2日から2022年3月1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 (2021年3月2日から2022年3月1日まで)

---

短期金利は小幅上昇しました。

物価の上昇率が低水準にとどまったことや、新型コロナウイルスの感染拡大が繰り返されたことから、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。

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、発行額の増減などにより上下に振れる局面もありましたが、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、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 (2021年3月2日から2022年3月1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 (2021年3月2日から2022年3月1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（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(2021年3月2日から2022年3月1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)	0.004% (0.004)	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	0.004	

期中の平均基準価額は9,983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(2021年3月2日から2022年3月1日まで)

公社債

		買付額	売付額
国内	特殊債券	千円 47,419	千円 — (55,000)

※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(2021年3月2日から2022年3月1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	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 47	百万円 12	% 25.5	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、S M B 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3月2日から2022年3月1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3月1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	%	%	%	%	%
特殊債券 (除く金融債券)	47,000 (47,000)	47,153 (47,153)	76.9 (76.9)	— (—)	— (—)	— (—)	76.9 (76.9)
合計	47,000 (47,000)	47,153 (47,153)	76.9 (76.9)	— (—)	— (—)	— (—)	76.9 (76.9)

※( )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	
特殊債券 (除く金融債券)	159 政保道路機構	0.9000	12,000	12,004	2022/03/18
	163 政保道路機構	0.9010	12,000	12,027	2022/05/31
	40政保地方公共団	0.8190	12,000	12,054	2022/09/16
	180 政保道路機構	0.7340	11,000	11,067	2022/12/28
	小 計	—	47,000	47,153	—
	合 計	—	47,000	47,153	—

※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

(2022年3月1日現在)

項目	期	末
	評価額	比率
	千円	%
公 社 債	47,153	76.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,132	23.1
投 資 信 託 財 産 総 額	61,286	100.0

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年3月1日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	61,286,544円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	14,059,462
公 社 債 ( 評 価 額 )	47,153,714
未 収 利 息	73,368
(B) 負 債	193
そ の 他 未 払 費 用	193
(C) 純 資 産 総 額 ( A - B )	61,286,351
元 本	61,414,707
次 期 繰 越 損 益 金	△ 128,356
(D) 受 益 権 総 口 数	61,414,707口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	9,979円

※当期における期首元本額72,873,889円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額11,459,182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。

メキシコ債券ファンド(毎月分配型)	9,994,004円
メキシコ債券ファンド(資産成長型)	4,997,002円
日興エドモンド・ドゥ・ロスチャイルド・ラグジュアリーファンド	29,982,011円
SMB C・日興資産成長ナビゲーション	2,798,587円
ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(為替ヘッジなし)	1,589,191円
ダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(限定為替ヘッジ)	269,851円
りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09(為替ヘッジあり)	5,797,087円
りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-09(為替ヘッジなし)	409,781円
りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-12(為替ヘッジあり)	5,027,477円
りそな・ストラテジック・インカムファンド2016-12(為替ヘッジなし)	549,716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。

## ■ 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2021年3月2日 至2022年3月1日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	477,409円
受 取 利 息	488,315
支 払 利 息	△ 10,906
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△527,036
売	△527,036
買	
(C) そ の 他 費 用 等	△ 2,569
(D) 当 期 損 益 金 ( A + B + C )	△ 52,196
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 94,955
(F) 解 約 差 損 益 金	18,795
(G) 合 計 ( D + E + F )	△128,356
次 期 繰 越 損 益 金 ( G )	△128,356

※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。