

日本株アルファ・カルテット (毎月分配型)

【運用報告書(全体版)】

■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／国内／株式 |
| 信託期間 | 2014年4月4日から2029年3月5日まで |
| 運用方針 | 投資信託証券への投資を通じて、わが国の株式への投資に加え、「高金利通貨戦略」と「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで、インカムゲインとオプションプレミアムの確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指します。 |
| 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。 ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA 日本の株式 マネー・マネジメント・マザーファンド 本邦貨建て公社債および短期金融商品等 |
| 当ファンドの運用方法 | ■わが国の株式を実質的な投資対象とし、ファンダメンタルズおよびバリュエーション等を勘案し魅力的な銘柄に投資することで、中長期的な信託財産の成長を目指します。 ■「高金利通貨戦略」では、相対的に金利水準の高い通貨の為替取引を実質的に行います。 ■「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を行うことで、オプションプレミアムの確保を目指します。 |
| 組入制限 | ■外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | ■毎月4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。 |

第19作成期 (2023年3月7日から2023年9月4日まで)

第108期 / 第109期 / 第110期
決算日2023年4月4日 決算日2023年5月8日 決算日2023年6月5日

第111期 / 第112期 / 第113期
決算日2023年7月4日 決算日2023年8月4日 決算日2023年9月4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、わが国の株式への投資に加え、「高金利通貨戦略」と「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで、インカムゲインとオプションプレミアムの確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指します。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

 三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

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 (分配落) | 価 額 | | | 公 社 債 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|--------------|-------|-------|-----------|------------------|------------------------|---------|
| | | 税 分 配 | 込 金 | 期 騰 落 中 率 | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 | |
| 84期 (2021年4月5日) | 1,392 | 10 | 7.4 | 0.0 | 97.4 | 48,034 | |
| 85期 (2021年5月6日) | 1,406 | 10 | 1.7 | 0.0 | 97.9 | 46,337 | |
| 86期 (2021年6月4日) | 1,512 | 10 | 8.3 | 0.0 | 98.1 | 47,358 | |
| 87期 (2021年7月5日) | 1,532 | 10 | 2.0 | 0.0 | 97.8 | 46,553 | |
| 88期 (2021年8月4日) | 1,467 | 10 | △ 3.6 | 0.0 | 97.6 | 43,495 | |
| 89期 (2021年9月6日) | 1,542 | 10 | 5.8 | 0.0 | 97.5 | 44,691 | |
| 90期 (2021年10月4日) | 1,490 | 10 | △ 2.7 | 0.0 | 97.3 | 41,782 | |
| 91期 (2021年11月4日) | 1,514 | 10 | 2.3 | 0.0 | 97.4 | 41,534 | |
| 92期 (2021年12月6日) | 1,465 | 10 | △ 2.6 | 0.0 | 97.5 | 39,023 | |
| 93期 (2022年1月4日) | 1,540 | 10 | 5.8 | 0.0 | 97.4 | 39,653 | |
| 94期 (2022年2月4日) | 1,589 | 10 | 3.8 | 0.0 | 97.3 | 39,500 | |
| 95期 (2022年3月4日) | 1,621 | 10 | 2.6 | 0.0 | 97.2 | 39,558 | |
| 96期 (2022年4月4日) | 1,802 | 10 | 11.8 | 0.0 | 98.0 | 42,423 | |
| 97期 (2022年5月6日) | 1,778 | 10 | △ 0.8 | 0.0 | 97.6 | 39,687 | |
| 98期 (2022年6月6日) | 1,903 | 10 | 7.6 | 0.0 | 97.6 | 41,427 | |
| 99期 (2022年7月4日) | 1,749 | 10 | △ 7.6 | 0.0 | 97.4 | 37,042 | |
| 100期 (2022年8月4日) | 1,789 | 10 | 2.9 | 0.0 | 97.3 | 37,131 | |
| 101期 (2022年9月5日) | 1,897 | 10 | 6.6 | 0.0 | 97.3 | 38,451 | |
| 102期 (2022年10月4日) | 1,895 | 10 | 0.4 | 0.0 | 97.1 | 37,591 | |
| 103期 (2022年11月4日) | 2,041 | 10 | 8.2 | 0.0 | 97.3 | 39,733 | |
| 104期 (2022年12月5日) | 1,867 | 10 | △ 8.0 | 0.0 | 96.9 | 35,811 | |
| 105期 (2023年1月4日) | 1,817 | 10 | △ 2.1 | 0.0 | 96.9 | 34,335 | |
| 106期 (2023年2月6日) | 1,875 | 10 | 3.7 | 0.0 | 97.3 | 34,891 | |
| 107期 (2023年3月6日) | 1,961 | 10 | 5.1 | 0.0 | 97.3 | 35,986 | |
| 108期 (2023年4月4日) | 1,992 | 10 | 2.1 | 0.0 | 97.4 | 35,944 | |
| 109期 (2023年5月8日) | 2,093 | 10 | 5.6 | 0.0 | 97.4 | 36,997 | |
| 110期 (2023年6月5日) | 2,233 | 10 | 7.2 | 0.0 | 97.4 | 38,042 | |
| 111期 (2023年7月4日) | 2,462 | 10 | 10.7 | 0.0 | 97.4 | 40,927 | |
| 112期 (2023年8月4日) | 2,434 | 10 | △ 0.7 | 0.0 | 97.2 | 39,732 | |
| 113期 (2023年9月4日) | 2,569 | 10 | 6.0 | 0.0 | 97.3 | 41,301 | |

※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。

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

■ 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108期 | (期 首) 2023年 3 月 6 日 | 円 1,961 | % — | | % 0.0 | % 97.3 |
| | 3 月末 | 1,960 | △ 0.1 | | 0.0 | 96.9 |
| | (期 末) 2023年 4 月 4 日 | 2,002 | 2.1 | | 0.0 | 97.4 |
| 第109期 | (期 首) 2023年 4 月 4 日 | 1,992 | — | | 0.0 | 97.4 |
| | 4 月末 | 2,051 | 3.0 | | 0.0 | 97.5 |
| | (期 末) 2023年 5 月 8 日 | 2,103 | 5.6 | | 0.0 | 97.4 |
| 第110期 | (期 首) 2023年 5 月 8 日 | 2,093 | — | | 0.0 | 97.4 |
| | 5 月末 | 2,201 | 5.2 | | 0.0 | 97.4 |
| | (期 末) 2023年 6 月 5 日 | 2,243 | 7.2 | | 0.0 | 97.4 |
| 第111期 | (期 首) 2023年 6 月 5 日 | 2,233 | — | | 0.0 | 97.4 |
| | 6 月末 | 2,424 | 8.6 | | 0.0 | 97.0 |
| | (期 末) 2023年 7 月 4 日 | 2,472 | 10.7 | | 0.0 | 97.4 |
| 第112期 | (期 首) 2023年 7 月 4 日 | 2,462 | — | | 0.0 | 97.4 |
| | 7 月末 | 2,478 | 0.6 | | 0.0 | 97.4 |
| | (期 末) 2023年 8 月 4 日 | 2,444 | △ 0.7 | | 0.0 | 97.2 |
| 第113期 | (期 首) 2023年 8 月 4 日 | 2,434 | — | | 0.0 | 97.2 |
| | 8 月末 | 2,566 | 5.4 | | 0.0 | 97.0 |
| | (期 末) 2023年 9 月 4 日 | 2,579 | 6.0 | | 0.0 | 97.3 |

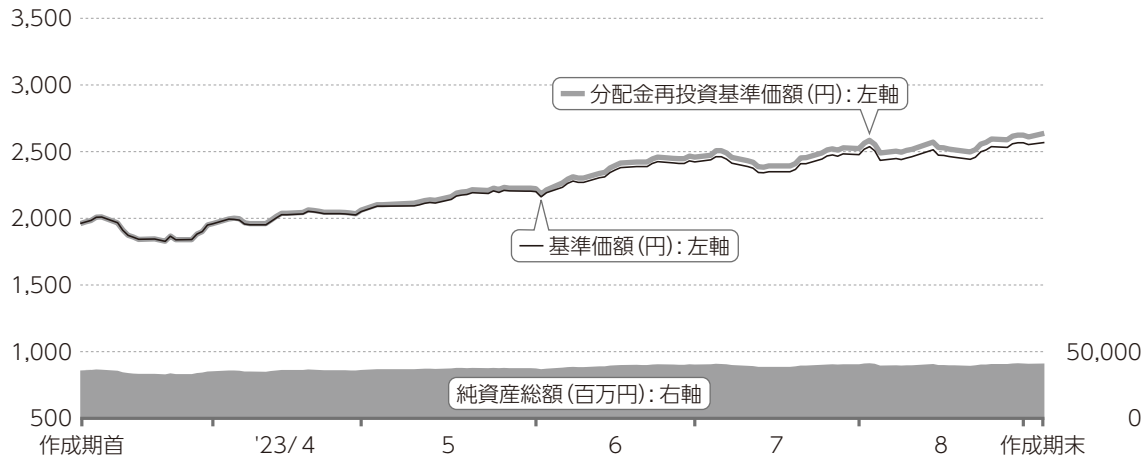
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

1 運用経過

基準価額等の推移について（2023年3月7日から2023年9月4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 | 1,961円 |
| 作成期末 (当作成期既払分配金60円(税引前)) | 2,569円 |
| 騰落率 (分配金再投資ベース) | +34.5% |

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3月7日から2023年9月4日まで）

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、わが国の株式への投資に加え、「高金利通貨戦略」と「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を行いました。

上昇要因

- 日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感されたこと
- 「高金利通貨戦略」および「株式カバードコール戦略」のパフォーマンスがプラスに寄与したこと

下落要因

- 中国の景気減速懸念や欧米の金融引き締めが警戒されたこと
- 「通貨カバードコール戦略」のパフォーマンスがマイナスに作用したこと

投資環境について（2023年3月7日から2023年9月4日まで）

期間における日本株式市場は上昇しました。また、為替市場ではブラジルレアルが対円で上昇しました。

日本株式市場

期間において、日本株式市場は上昇しました。

期初は、米国の銀行破綻に欧州大手金融機関の経営不安の報道が重なったことで金融不安が広がり、リスク回避の動きから急落して始まりました。しかし、各国金融当局が不安解消に向けて対応策を迅速に打ち出したことで株価の下落は一時的にとどまり、急速に持ち直しました。

年度が変わると、日銀の金融緩和方針維持による円安進展や海外投資家による日本株買いが好感され、上値を切り上げて推移しました。根強い中国景気減速懸念や欧米の金融引き締めへの警戒感が上値を抑える場面もありましたが、日銀による長短金利操作の運用柔軟化の決定を無難に消化すると、米ドル高・円安が一段進行する中、TOPIXは好業績銘柄が牽引する形でバブル後の高値を更新する展開となりました。

為替市場

期間においてブラジルレアルは対円で上昇しました。

ブラジルの新たな財政枠組みを巡る不透明感や、ブラジル中央銀行が政策金利を0.5%引き下げたことなどがブラジルレアルの下落材料となりました。しかし、米国CPI（消費者物価指数）の伸びが鈍化したことなどを受けFRB（米連邦準備制度理事会）による引き締めサイクルが終わりに近いとの見方が強まったこと、日銀が金融政策決定会合において金融政策の現状維持を決定したこと、ブラジルで新しい財政枠組み案が下院を通過したことなどを背景に、ブラジルレアルは対円で上昇しました。

ポートフォリオについて（2023年3月7日から2023年9月4日まで）

当ファンド

主要投資対象である「ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA」を高位に組み入れました。

ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA

日本株式の運用については、財務の安定性、収益成長性などの個々の企業におけるファンダメンタルズ（業績、財務内容などの基礎的諸条件）配当利回り、その他のバリュエーション（投資価値評価）等を勘案して銘柄選定を行いました。

また、日本株式への投資に加え、「高金利通貨戦略」と「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで、インカムゲインとオプションプレミアムの確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指しました。

●株式組入比率

実質株式組入比率を概ね9割以上に保ちました。

●業種配分

期間末の業種配分比率については、電気・

ガス業、銀行業、輸送用機器などを市場対比で高くしています。一方、サービス業、化学、電気機器などを市場対比で低くしています。

●個別銘柄

トヨタ自動車、三菱UFJフィナンシャル・グループ、パナソニックホールディングスなどを高い比率で保有しています。

●ポートフォリオの特性

配当利回り、その他のバリュエーションを重視していることにより、高配当で割安なポートフォリオ特性となっています。

●通貨別配分

「高金利通貨戦略」において高金利通貨（ブラジルリアル）の買いと円の売りの為替取引を行いました。また、「通貨カバードコール戦略」において、円に対する高金利通貨（ブラジルリアル）のコールオプションの売りを行うことでオプションプレミアムの確保を目指しました。

ブラジルリアルは対円で上昇し「高金利通貨戦略」はプラス、一方でオプションプレミアムが加算されたものの「通貨カバードコール戦略」はマイナスに作用しました。

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

マネー・マネジメント・マザーファンド

主として、円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3月7日から2023年9月4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3月7日から2023年9月4日まで）

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

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第108期 | 第109期 | 第110期 | 第111期 | 第112期 | 第113期 |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 当期分配金 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| (対基準価額比率) | (0.50%) | (0.48%) | (0.45%) | (0.40%) | (0.41%) | (0.39%) |
| 当期の収益 | 10 | 10 | 10 | 10 | 9 | 10 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | 0 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 915 | 917 | 919 | 921 | 921 | 923 |

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

※「対基準価額比率」は、「当期分配金」（税引前）の期末基準価額（分配金（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、運用の基本方針に従い、主として「ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA」への投資を通じて、わが国の株式への投資に加え、「高金利通貨戦略」と「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで、インカムゲインとオプションプレミアムの確保、ならびに中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA

日本株式の運用方針としては、引き続き、わが国の株式の中から、財務の安定性、収益の成長性など個々の企業のファンダメンタルズ（業績、財務内容などの基礎的諸条件）、配当利回り、その他のバリュエーショ

ン等を考慮して魅力的な銘柄を選定し、ポートフォリオを構築します。また同一セクター内でも業績格差が拡大する傾向が続くとみていることから、業績見通しを精査し、堅調な業績が見込める企業への選別投資を進めていく方針です。こうした運用方針を基に、中長期的な信託財産の成長を目指します。

「高金利通貨戦略」では、相対的に金利水準の高い通貨の為替取引を実質的に行いません。また、「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を行うことで、オプションプレミアムの確保を目指します。

マネー・マネジメント・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に投資し、安定した収益の確保を目指します。

3 お知らせ

約款変更について

- 信託期間の延長に伴い、信託約款に所要の変更を行いました。

（適用日：2023年6月2日）

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

1万口当たりの費用明細（2023年3月7日から2023年9月4日まで）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|-------------|-----|---------|--|
| (a) 信託報酬 | 12円 | 0.556% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は2,236円です。 |
| （投信会社） | (5) | (0.217) | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (7) | (0.326) | 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） | (0) | (0.013) | 受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | － | － | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 |
| （株式） | (－) | (－) | 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （先物・オプション） | (－) | (－) | |
| （投資信託証券） | (－) | (－) | |
| (c) 有価証券取引税 | － | － | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 |
| （株式） | (－) | (－) | 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （公社債） | (－) | (－) | |
| （投資信託証券） | (－) | (－) | |
| (d) その他費用 | 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 | 12 | 0.558 | |

※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。

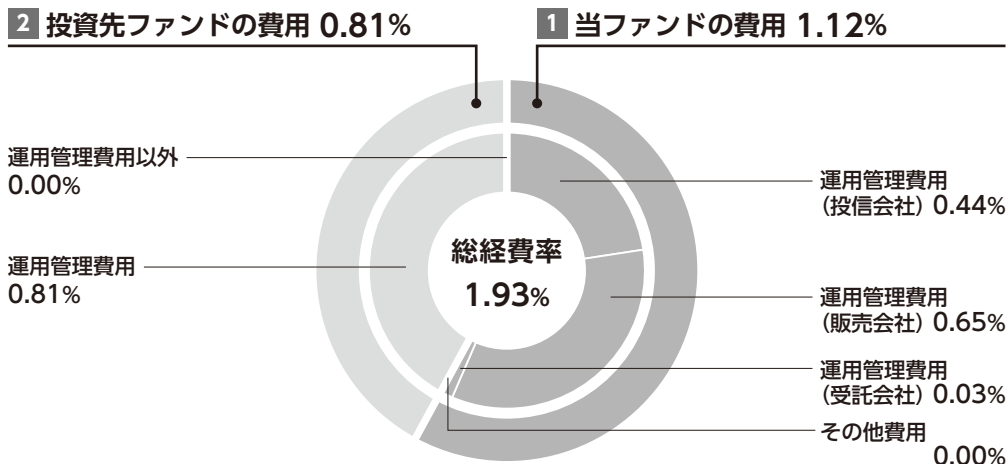
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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) | 1.93% |
| 1 当ファンドの費用の比率 | 1.12% |
| 2 投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.81% |
| 投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.00% |

※**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、入手可能なファンド全体の経費率です。そのため、実際に投資しているシェアクラスの経費率とは大きく異なる場合があります。投資先ファンドへの平均投資比率を勘案して、実質的な費用を計算しています。

※**1**と**2**の費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。また、計上された期間が異なる場合があります。

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

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した比率に、投資先ファンドの経費率を加えた総経費率(年率)は1.93%です。

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2023年3月7日から2023年9月4日まで）

投資信託証券

| | | 当 作 成 期 | | | |
|---|---------------------------|---------------|-----------|----------------|-----------|
| | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | 口 数 | 買 付 額 | 口 数 | 売 付 額 |
| 国 | 内 | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| | ジャパン・イクイティ・プレミアム・ファンドクラスA | 7,331,605,312 | 1,296,812 | 35,883,572,035 | 6,458,929 |

※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。

■ 利害関係人との取引状況等（2023年3月7日から2023年9月4日まで）

利害関係人との取引状況

日本株アルファ・カルテット（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・マネジメント・マザーファンド

| 区 分 | 当 作 成 期 | | | | | |
|-------|---------|----------------|------|------|----------------|-----|
| | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
| | A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| 公 社 債 | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| | 4 | 3 | 75.0 | 4 | — | — |

※平均保有割合 27.6%

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

利害関係人とは、投資信託および投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

（2023年3月7日から2023年9月4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。

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

■ 組入れ資産の明細（2023年9月4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 |
| ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA | 口 220,827,483,558 | 口 192,275,516,835 | 千円 40,204,810 |
| 合計 | 220,827,483,558 | 192,275,516,835 | 40,204,810 |
| | | | 組入比率 97.3% |

※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・マネジメント・マザーファンド | 千口 1,998 | 千口 1,998 | 千円 1,990 |

※マネー・マネジメント・マザーファンドの作成期末の受益権総口数は7,080,698口です。

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

■ 投資信託財産の構成

(2023年9月4日現在)

| 項 目 | 作 成 期 末 | |
|-------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 千円 40,204,810 | % 96.6 |
| マネー・マネジメント・マザーファンド | 1,990 | 0.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,409,118 | 3.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 41,615,919 | 100.0 |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年4月4日) (2023年5月8日) (2023年6月5日) (2023年7月4日) (2023年8月4日) (2023年9月4日)

| 項 目 | 第108期末 | 第109期末 | 第110期末 | 第111期末 | 第112期末 | 第113期末 |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産 | 36,193,043,163円 | 37,282,843,494円 | 38,361,702,467円 | 41,297,964,330円 | 40,014,622,874円 | 41,615,919,892円 |
| コール・ローン等 | 1,157,094,962 | 1,186,980,409 | 1,268,953,664 | 1,334,092,818 | 1,332,185,290 | 1,352,434,564 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 35,017,876,390 | 36,033,063,666 | 37,036,050,299 | 39,864,841,157 | 38,629,810,822 | 40,204,810,570 |
| マネー・マネジメント・マザーファンド(評価額) | 1,991,205 | 1,991,205 | 1,991,005 | 1,991,005 | 1,990,805 | 1,990,805 |
| 未 収 入 金 | 16,080,606 | 60,808,214 | 54,707,499 | 97,039,350 | 50,635,957 | 56,683,953 |
| (B) 負 債 | 248,510,274 | 285,528,408 | 319,376,188 | 370,962,023 | 282,243,705 | 314,091,613 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 180,412,437 | 176,800,996 | 170,345,374 | 166,201,958 | 163,258,420 | 160,771,687 |
| 未 払 解 約 金 | 36,936,041 | 70,415,110 | 116,130,589 | 168,532,115 | 79,988,086 | 113,740,195 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 30,986,864 | 37,949,298 | 32,381,447 | 35,538,433 | 38,128,277 | 38,504,330 |
| その他未払費用 | 174,932 | 363,004 | 518,778 | 689,517 | 868,922 | 1,075,401 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 35,944,532,889 | 36,997,315,086 | 38,042,326,279 | 40,927,002,307 | 39,732,379,169 | 41,301,828,279 |
| 元 本 | 180,412,437,148 | 176,800,996,793 | 170,345,374,135 | 166,201,958,324 | 163,258,420,566 | 160,771,687,733 |
| 次期繰越損益金 | △144,467,904,259 | △139,803,681,707 | △132,303,047,856 | △125,274,956,017 | △123,526,041,397 | △119,469,859,454 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 180,412,437,148口 | 176,800,996,793口 | 170,345,374,135口 | 166,201,958,324口 | 163,258,420,566口 | 160,771,687,733口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 1,992円 | 2,093円 | 2,233円 | 2,462円 | 2,434円 | 2,569円 |

※当作成期における作成期首元本額183,487,529,152円、作成期中追加設定元本額2,688,516,617円、作成期中一部解約元本額25,404,358,036円です。

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

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

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

■ 損益の状況

〔自2023年3月7日〕〔自2023年4月5日〕〔自2023年5月9日〕〔自2023年6月6日〕〔自2023年7月5日〕〔自2023年8月5日〕
〔至2023年4月4日〕〔至2023年5月8日〕〔至2023年6月5日〕〔至2023年7月4日〕〔至2023年8月4日〕〔至2023年9月4日〕

| 項 目 | 第 108 期 | 第 109 期 | 第 110 期 | 第 111 期 | 第 112 期 | 第 113 期 |
|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 217,034,072円 | 213,148,389円 | 205,071,950円 | 199,502,578円 | 195,518,380円 | 192,540,401円 |
| 受 取 配 当 金 | 217,067,530 | 213,185,303 | 205,119,274 | 199,564,762 | 195,570,472 | 192,588,039 |
| 受 取 利 息 | 95 | 2,478 | 337 | 351 | 4,668 | 35 |
| 支 払 利 息 | △ 33,553 | △ 39,392 | △ 47,661 | △ 62,535 | △ 56,760 | △ 47,673 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 555,014,354 | 1,771,846,660 | 2,387,720,197 | 3,805,188,584 | △ 465,492,276 | 2,177,422,393 |
| 売 買 益 | 573,944,182 | 1,787,090,696 | 2,433,663,008 | 3,862,044,040 | 20,982,060 | 2,190,159,167 |
| 売 買 損 | △ 18,929,828 | △ 15,244,036 | △ 45,942,811 | △ 56,855,456 | △ 486,474,336 | △ 12,736,774 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 31,158,571 | △ 38,154,691 | △ 32,552,951 | △ 35,728,351 | △ 38,323,923 | △ 38,737,162 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 740,889,855 | 1,946,840,358 | 2,560,239,196 | 3,968,962,811 | △ 308,297,819 | 2,331,225,632 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 29,391,708,566 | △ 28,201,456,879 | △ 25,396,166,672 | △ 22,372,286,159 | △ 18,180,616,961 | △ 18,308,148,556 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △115,636,673,111 | △113,372,264,190 | △109,296,775,006 | △106,705,430,711 | △104,873,868,197 | △103,332,164,843 |
| (配当等相当額) | (11,232,496,487) | (11,016,971,982) | (10,627,907,492) | (10,385,334,823) | (10,216,922,656) | (10,076,465,292) |
| (売買損益相当額) | (△126,869,169,598) | (△124,389,236,172) | (△119,924,682,498) | (△117,090,765,534) | (△115,090,790,853) | (△113,408,630,135) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | △144,287,491,822 | △139,626,880,711 | △132,132,702,482 | △125,108,754,059 | △123,362,782,977 | △119,309,087,767 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 180,412,437 | △ 176,800,996 | △ 170,345,374 | △ 166,201,958 | △ 163,258,420 | △ 160,771,687 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | △144,467,904,259 | △139,803,681,707 | △132,303,047,856 | △125,274,956,017 | △123,526,041,397 | △119,469,859,454 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △115,636,673,111 | △113,372,264,190 | △109,296,775,006 | △106,705,430,711 | △104,873,868,197 | △103,332,164,843 |
| (配当等相当額) | (11,232,496,487) | (11,016,971,982) | (10,627,907,492) | (10,385,334,823) | (10,216,922,656) | (10,076,465,292) |
| (売買損益相当額) | (△126,869,169,598) | (△124,389,236,172) | (△119,924,682,498) | (△117,090,765,534) | (△115,090,790,853) | (△113,408,630,135) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 5,284,940,884 | 5,204,198,914 | 5,036,878,284 | 4,932,398,280 | 4,826,018,609 | 4,767,977,057 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 34,116,172,032 | △ 31,635,616,431 | △ 28,043,151,134 | △ 23,501,923,586 | △ 23,478,191,809 | △ 20,905,671,668 |

※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 108 期 | 第 109 期 | 第 110 期 | 第 111 期 | 第 112 期 | 第 113 期 |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 208,276,319円 | 209,051,649円 | 202,497,887円 | 197,724,207円 | 157,195,470円 | 189,395,642円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 11,232,496,487 | 11,016,971,982 | 10,627,907,492 | 10,385,334,823 | 10,216,922,656 | 10,076,465,292 |
| (d) 分配準備積立金 | 5,257,077,002 | 5,171,948,261 | 5,004,725,771 | 4,900,876,031 | 4,832,081,559 | 4,739,353,102 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 16,697,849,808 | 16,397,971,892 | 15,835,131,150 | 15,483,935,061 | 15,206,199,685 | 15,005,214,036 |
| 1万口当たり当期分配対象額 | 925.54 | 927.48 | 929.59 | 931.63 | 931.42 | 933.32 |
| (f) 分配金 | 180,412,437 | 176,800,996 | 170,345,374 | 166,201,958 | 163,258,420 | 160,771,687 |
| 1万口当たり分配金 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |

■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金（税引前） | 第108期 | 第109期 | 第110期 | 第111期 | 第112期 | 第113期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10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。

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

■ 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 | ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA |
| 形態 | ケイマン籍契約型投資信託（円建て） |
| 主要投資対象 | 日本の株式を主要投資対象とします。また、スワップ取引を通じて、為替取引、株価指数オプション取引ならびに通貨オプション取引を活用します。 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ●日本株投資戦略 <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資に当たっては、財務の安定性、収益の成長性などの個々の企業のファンダメンタルズ、配当利回りその他のバリュエーション等を考慮して投資魅力のある銘柄を中心に投資します。 ●高金利通貨戦略 <ul style="list-style-type: none"> ・高金利の通貨の買いと円の売りの為替取引を行います。 ・取引対象通貨は、ブラジルレアルとします。 ●株式カバードコール戦略 <ul style="list-style-type: none"> ・日本の株価指数にかかるコールオプションの売りを行うことでオプションプレミアムの確保を目指します。 ・原則としてファンドの純資産総額の50%程度のコールオプションの売りを行います。 ●通貨カバードコール戦略 <ul style="list-style-type: none"> ・円に対する高金利通貨（ブラジルレアル）のコールオプションの売りを行うことでオプションプレミアムの確保を目指します。 ・原則としてファンドの純資産総額の50%程度のコールオプションの売りを行います。 <p>※カバードコール戦略では、原則として、権利行使が満期日のみに限定されているオプションを利用することを基本とします。</p> <p>※高金利通貨戦略および株式・通貨のカバードコール戦略については、クレディ・スイス・インターナショナルを相手方とするスワップ取引を通じて当該戦略を行った場合の投資成果を享受します。</p> <p>●資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・同一発行体に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーは、原則として、それぞれ純資産総額の10%以内、合計で純資産総額の20%以内とします。 ・同一セクターへの投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の50%以内とします。 ・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 |
| 分配方針 | 原則毎月行います。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 運用管理費用 | <p>純資産総額に対して</p> <p>運用報酬 年0.55%程度</p> <p>管理事務代行費用 年0.245%程度*</p> <p>*当該費用には、事務代行費用として年40,000米ドル、管理費用として年5,000米ドルの最低報酬額が設定されています。</p> <p>※上記のほか、受託会社報酬（年10,000米ドル）および保管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、各費用には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場合があります。</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> |
| 管理会社 | クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッド |
| 副投資顧問会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 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、「ジャパン・エクイティ・プレミアム・ファンド クラスA」をシェアクラスとして含む「ジャパン・エクイティ・プレミアム・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す。

日本株アルファ・カルテット（毎月分配型）

■ 包括利益計算書（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

| | （単位：日本円） |
|----------------------------------|-----------------|
| 収益 | |
| 損益を通じて公正価値で測定される金融商品の純損益 | |
| 受取配当金 | 1,126,811,030 |
| 金融資産及び金融負債にかかる実現純損益 | 15,369,710,387 |
| 金融資産及び金融負債にかかる未実現損益の純変動額 | (1,154,405,619) |
| 外国為替取引にかかる実現純損益 | 1,005,537 |
| 外国為替取引にかかる未実現損益の純変動額 | (243,540) |
| 損益合計 | 15,342,877,795 |
| 費用 | |
| 投資顧問報酬 | 211,646,564 |
| 仲介手数料 | 76,962,393 |
| 取引費用 | 39,484,609 |
| カスタディーフィー | 15,847,573 |
| 管理事務代行費用 | 11,544,356 |
| 名義書換代理人報酬 | 3,613,683 |
| 受託者報酬 | 1,445,768 |
| 登録費用 | 93,021 |
| 費用合計 | 360,637,967 |
| 運用に伴う損益（金融費用控除前） | 14,982,239,828 |
| 金融費用 | |
| 支払利息 | (10,352,066) |
| 金融費用控除後及び税引前損益 | 14,971,887,762 |
| 源泉税 | (172,571,118) |
| 包括損益（運用による受益者に帰属する純資産の増減） | 14,799,316,644 |

■ 組入上位銘柄

（基準日：2022年11月30日）

| 銘柄名 | 業種 | 組入比率 | 銘柄名 | 業種 | 組入比率 |
|------------|--------|------|--------------------|------|------|
| 1 日本電信電話 | 情報・通信業 | 4.3% | 6 TDK | 電気機器 | 2.9% |
| 2 東京エレクトロン | 電気機器 | 3.6% | 7 東京海上ホールディングス | 保険業 | 2.8% |
| 3 トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3.4% | 8 伊藤忠商事 | 卸売業 | 2.7% |
| 4 ソニーグループ | 電気機器 | 3.0% | 9 武田薬品工業 | 医薬品 | 2.5% |
| 5 日立製作所 | 電気機器 | 2.9% | 10 パナソニック ホールディングス | 電気機器 | 2.5% |
| | | | 全銘柄数 | 90銘柄 | |

※比率は、株式現物の評価額に対する割合です。

マネー・マネジメント・マザーファンド

第10期（2022年7月26日から2023年7月25日まで）

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2013年6月3日） |
| 運用方針 | ■本邦通貨建て公社債および短期金融商品等に投資を行い、利息等収入の確保を図ります。 |

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 組 入 社 比 | 債 率 | 純 総 資 産 額 |
|-----------------|-------|-----|------|-----------|------|-----------|
| | | 騰 落 | 中 率 | | | |
| 6期（2019年7月25日） | 円 | | % | | % | 百万円 |
| | 9,988 | | △0.1 | | 86.0 | 37 |
| 7期（2020年7月27日） | 9,979 | | △0.1 | | 88.0 | 27 |
| 8期（2021年7月26日） | 9,972 | | △0.1 | | 62.4 | 27 |
| 9期（2022年7月25日） | 9,967 | | △0.1 | | 80.9 | 17 |
| 10期（2023年7月25日） | 9,960 | | △0.1 | | 70.9 | 7 |

※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

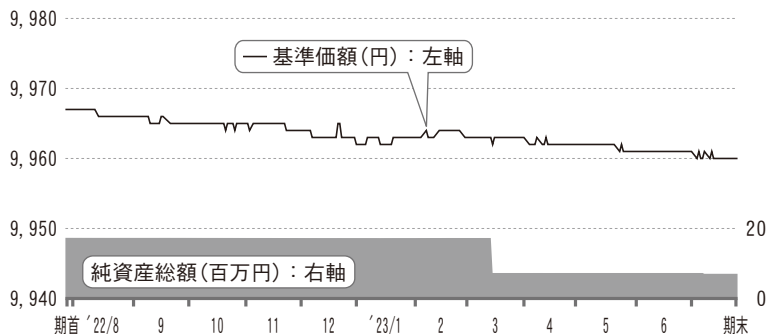
| 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 公 組 入 社 比 | 債 率 |
|---------------------|-------|-----|------|-----------|------|
| | | 騰 落 | 率 | | |
| (期 首) 2022年7月25日 | 円 | | % | | % |
| | 9,967 | | — | | 80.9 |
| 7月末 | 9,967 | | 0.0 | | 80.9 |
| 8月末 | 9,966 | | △0.0 | | 57.8 |
| 9月末 | 9,965 | | △0.0 | | 57.9 |
| 10月末 | 9,965 | | △0.0 | | 63.7 |
| 11月末 | 9,964 | | △0.0 | | 52.3 |
| 12月末 | 9,962 | | △0.1 | | 52.3 |
| 2023年1月末 | 9,963 | | △0.0 | | 69.7 |
| 2月末 | 9,963 | | △0.0 | | 52.2 |
| 3月末 | 9,963 | | △0.0 | | 68.9 |
| 4月末 | 9,962 | | △0.1 | | 68.8 |
| 5月末 | 9,961 | | △0.1 | | 68.7 |
| 6月末 | 9,961 | | △0.1 | | 68.7 |
| (期 末) 2023年7月25日 | 9,960 | | △0.1 | | 70.9 |

※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（2022年7月26日から2023年7月25日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|--------|
| 期首 | 9,967円 |
| 期末 | 9,960円 |
| 騰落率 | -0.1% |

▶ 基準価額の主な変動要因（2022年7月26日から2023年7月25日まで）

当ファンドは、本邦通貨建ての公社債および短期金融商品等を主要投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行いました。

上昇要因

- ・保有している公社債からスプレッド（国債に対する上乗せ金利）分のインカム収入を得たこと

下落要因

- ・マイナス金利政策導入を背景として無担保コールレートがマイナス化していること

▶ **投資環境について（2022年7月26日から2023年7月25日まで）**

期間における国内短期金融市場は、マイナス圏で推移しました。

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）は前年比+4%台まで上昇しました。しかし、日銀はコストプッシュ型の物価上昇は持続的でないとの見方から、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策を維持し、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るなど一時的に大きく低下する局面もありました。しかし、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、期間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7月26日から2023年7月25日まで）**

安全性と流動性を考慮し、短期の政府保証債を中心とした運用を行いました。年限に関しては、残存6ヵ月以内の短期の政府保証債を中心とした運用を継続しました。

▶ **ベンチマークとの差異について（2022年7月26日から2023年7月25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

植田新体制となった日本銀行は、内外経済や金融市場を巡る不確実性が高い中、物価安定の目標を実現するために、イールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の枠組みによる緩和政策を維持する姿勢を示しています。又、政策金利の引き上げに関してもかなりの距離があるというスタンスであり、市場利回りは当分の間低い水準での推移を予想します。当ファンドでは引き続き、安全性と流動性をもっとも重視したスタンスでの運用を継続し、短期の国債・政府保証債を中心とした運用を行っていきます。ファンドの平均残存年限については、2～4ヵ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

■ 1万口当たりの費用明細 (2022年7月26日から2023年7月25日まで)

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用 (その他) | 1円 (1) | 0.007% (0.007) | 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 | 1 | 0.007 | |

期中の平均基準価額は9,963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7月26日から2023年7月25日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|--------|-------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 特殊債券 | 15,056 | 4,005 (20,000) |

※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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年7月26日から2023年7月25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7月26日から2023年7月25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7月25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) | 5,000 (5,000) | 5,001 (5,001) | 70.9 (70.9) | — (—) | — (—) | — (—) | 70.9 (70.9) |
| 合 計 | 5,000 (5,000) | 5,001 (5,001) | 70.9 (70.9) | — (—) | — (—) | — (—) | 70.9 (70.9) |

※()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 |
| | | | % | 千円 | 千円 | |
| 特 殊 債 券 (除く金融債券) | 195 政保道路機構 | | 0.9110 | 3,000 | 3,000 | 2023/07/31 |
| | | 51政保地方公共団 | 0.8350 | 2,000 | 2,000 | 2023/08/14 |
| 合 | | 計 | — | 5,000 | 5,001 | — |

■ 投資信託財産の構成

(2023年7月25日現在)

| 項 目 | 期 | | 末 | |
|-------------------------|-------|-------|-------|-----|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % | | |
| 公 社 債 | 5,001 | 70.9 | | |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,055 | 29.1 | | |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 7,057 | 100.0 | | |

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年7月25日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------|------------|
| (A) 資 産 | 7,057,448円 |
| コール・ローン等 | 2,036,952 |
| 公社債(評価額) | 5,001,465 |
| 未収利息 | 18,807 |
| 前払費用 | 224 |
| (B) 負 債 | 1,033 |
| 未払解約金 | 999 |
| その他未払費用 | 34 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,056,415 |
| 元 本 | 7,084,714 |
| 次期繰越損益金 | △ 28,299 |
| (D) 受益権総口数 | 7,084,714口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,960円 |

※当期における期首元本額17,388,524円、期中追加設定元本額42,175円、期中一部解約元本額10,345,985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。

| | |
|--|------------|
| タフ・アメリカ(マネープールファンド) | 3,190,507円 |
| 米国小型株ツインα(毎月分配型) | 552,681円 |
| 日本株アルファ・カルテット(毎月分配型) | 1,998,801円 |
| 米国リバーサル戦略ツインαネオ(毎月分配型) | 1,312,751円 |
| 日本株アルファ・カルテット(年2回決算型) | 9,990円 |
| 大和住銀/コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用) | 9,992円 |
| 大和住銀/コロンビア米国株リバーサル戦略ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用) | 9,992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7月26日 至2023年7月25日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|---------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 63,940円 |
| 受 取 利 息 | 66,490 |
| 支 払 利 息 | △ 2,550 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △71,763 |
| 売 買 損 | △71,763 |
| (C) そ の 他 費 用 等 | △ 1,018 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △ 8,841 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △57,663 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | 38,373 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 168 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | △28,299 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | △28,299 |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。