

■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／株式
信託期間	2013年11月25日から2023年11月13日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、米国の小型株へ実質的に投資するとともに、「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、インカムゲインと高水準のオプションプレミアム確保の確保、ならびに信託財産の中長期的な成長を目指します。
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。 USスモール・キャップ・エクイティ・プレミアム・ファンド 担保付スワップ取引を通じて、実質的に米国の小型株市場へ投資するとともに米国小型株市場全体にかかるオプション取引、通貨オプション取引を行います。 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	■米国の小型株へ実質的に投資することで、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ■「USスモール・キャップ・エクイティ・プレミアム・ファンド」においては、主として担保付スワップ取引を通じて、米国小型株指数（原則としてラッセル2000指数とします。）を対象としたETFへ実質的に投資します。 ■実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ■株式への実質的な投資に加えて、ツインα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12日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、分配を行います。 ■分配対象額は、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。

米国小型株ツインα （毎月分配型）

【償還 運用報告書（全体版）】

第20作成期（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

第 115 期 / 第 116 期 / 第 117 期
決算日2023年6月12日 決算日2023年7月12日 決算日2023年8月14日

第 118 期 / 第 119 期 / 第 120 期
決算日2023年9月12日 決算日2023年10月12日 償還日2023年11月13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、米国の小型株へ実質的に投資するとともに、「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、インカムゲインと高水準のオプションプレミアムの確保、ならびに信託財産の中長期的な成長を目指しました。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）

米国小型株ツインα（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 価 額			公 社 債 組 入 比 率	投資信託証券 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	%	%	%	百万円
91期 (2021年6月14日)	3,740	10	5.6	0.0	97.4	6,929
92期 (2021年7月12日)	3,703	10	△ 0.7	0.0	97.2	6,636
93期 (2021年8月12日)	3,693	10	0.0	0.0	97.1	6,473
94期 (2021年9月13日)	3,679	10	△ 0.1	0.0	97.7	6,137
95期 (2021年10月12日)	3,752	10	2.3	0.0	97.9	6,157
96期 (2021年11月12日)	3,964	10	5.9	0.0	98.1	6,234
97期 (2021年12月13日)	3,711	10	△ 6.1	0.0	97.6	5,715
98期 (2022年1月12日)	3,751	10	1.3	0.0	97.4	5,597
99期 (2022年2月14日)	3,531	10	△ 5.6	0.0	98.1	5,138
100期 (2022年3月14日)	3,528	10	0.2	0.0	98.0	5,028
101期 (2022年4月12日)	3,694	10	5.0	0.0	98.0	5,170
102期 (2022年5月12日)	3,343	10	△ 9.2	0.0	97.6	4,546
103期 (2022年6月13日)	3,565	10	6.9	0.0	97.6	4,766
104期 (2022年7月12日)	3,539	10	△ 0.4	0.0	97.5	4,637
105期 (2022年8月12日)	3,739	10	5.9	0.0	97.5	4,837
106期 (2022年9月12日)	3,775	10	1.2	0.0	97.4	4,769
107期 (2022年10月12日)	3,491	10	△ 7.3	0.0	97.1	4,338
108期 (2022年11月14日)	3,650	10	4.8	0.0	97.1	4,444
109期 (2022年12月12日)	3,448	10	△ 5.3	0.0	97.0	4,152
110期 (2023年1月12日)	3,475	10	1.1	0.0	97.3	4,119
111期 (2023年2月13日)	3,551	10	2.5	0.0	97.2	4,135
112期 (2023年3月13日)	3,351	10	△ 5.4	0.0	97.1	3,862
113期 (2023年4月12日)	3,387	10	1.4	0.0	97.2	3,860
114期 (2023年5月12日)	3,371	10	△ 0.2	0.0	97.1	3,759
115期 (2023年6月12日)	3,605	10	7.2	0.0	97.1	3,938
116期 (2023年7月12日)	3,691	10	2.7	0.0	97.2	3,921
117期 (2023年8月14日)	3,814	10	3.6	0.0	97.3	3,990
118期 (2023年9月12日)	3,738	10	△ 1.7	0.0	97.2	3,857
119期 (2023年10月12日)	3,645	10	△ 2.2	0.0	97.3	3,703
(償 還 日)	(償還価額)					
120期 (2023年11月13日)	3,569.11	0	△ 2.1	—	—	3,565

※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。

米国小型株ツインα（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115期	(期 首) 2023年 5月12日	円 3,371	% —		% 0.0	% 97.1
	5月末	3,505	4.0		0.0	97.2
	(期 末) 2023年 6月12日	3,615	7.2		0.0	97.1
第116期	(期 首) 2023年 6月12日	3,605	—		0.0	97.1
	6月末	3,714	3.0		0.0	97.4
	(期 末) 2023年 7月12日	3,701	2.7		0.0	97.2
第117期	(期 首) 2023年 7月12日	3,691	—		0.0	97.2
	7月末	3,777	2.3		0.0	97.3
	(期 末) 2023年 8月14日	3,824	3.6		0.0	97.3
第118期	(期 首) 2023年 8月14日	3,814	—		0.0	97.3
	8月末	3,826	0.3		0.0	97.4
	(期 末) 2023年 9月12日	3,748	△ 1.7		0.0	97.2
第119期	(期 首) 2023年 9月12日	3,738	—		0.0	97.2
	9月末	3,691	△ 1.3		0.0	97.3
	(期 末) 2023年10月12日	3,655	△ 2.2		0.0	97.3
第120期	(期 首) 2023年10月12日	3,645	—		0.0	97.3
	10月末	3,429	△ 5.9		0.0	73.2
	(償 還 日) 2023年11月13日	(償還価額) 3,569.11	△ 2.1		—	—

※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。

米国小型株ツインα（毎月分配型）

設定以来の運用状況（設定日（2013年11月25日）から償還日（2023年11月13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11月25日）から第19作成期末（2023年5月12日）まで）

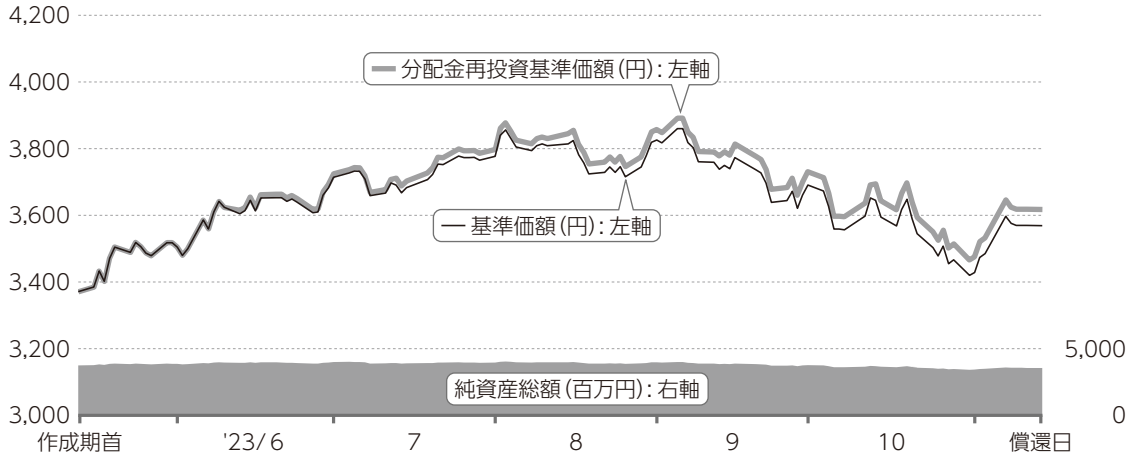
当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主に米国の小型株へ実質的に投資するとともに、「株式カバードコール戦略」および「通貨カバードコール戦略」を組み合わせることで運用を行いました。

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ ファンド設定から2020年2月にかけて、一時的な調整局面はあったものの、堅調に米国株式市場が上昇したこと ・ 2020年4月以降、2021年末にかけて、世界的に中央銀行による低金利政策が継続し、米国株式市場が上昇したこと ・ 2021年初から2022年10月にかけて、米ドル・円レートが急激に米ドル高・円安となり、期間を通じて米ドル高・円安となったこと
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・ 2020年3月に新型コロナウイルスの拡大懸念が急速に投資家心理を悪化させ、米国株式市場が急落したこと ・ 2022年初から第19作成期末にかけて、インフレの上昇とそれに対応する金融引き締めなどにより米国株式市場が下落したこと

1 運用経過

基準価額等の推移について（2023年5月13日から2023年11月13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	3,371円
償還日	3,569円11銭 (当作成期既払分配金50円(税引前))
騰落率	+7.3% (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（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、主に米国の小型株へ実質的に投資するとともに、「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」を組み合わせ運用を行いました。

上昇要因

- 期間の初めから7月末にかけて、インフレの収束期待や生成AIに対する期待などから米国株式市場が上昇したこと
- 7月に米ドル安・円高に振れる局面もあったものの、期間を通じては米ドル高・円安となったこと

下落要因

- 8月の初めから10月末にかけて、インフレの高止まりなどからタカ派（インフレ抑制を重視する立場）的な金融政策が継続し、長期金利も上昇傾向となったことで米国株式市場が下落したこと

投資環境について（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

期間における米国株式市場は上下に振れたものの、期間を通じては上昇しました。一方で、米国小型株は下落しました。為替市場では、米ドルは円に対して上昇しました。

米国株式市場

米国株式市場は上昇しました。期間の初めからインフレの低下や利上げの終了に対する思惑などから、米国株式市場は上昇しました。7月下旬のFOMC（米連邦公開市場委員会）で再利上げが行われ、FRB（米連邦準備制度理事会）のタカ派的な金融政策の長期化懸念が強まると、10月下旬にかけて米国株式市場は下落基調となりました。その後、期間末にかけては利上げ終了期待が高まり、米国株式市場は反発しましたが、8月～10月の下落幅が大きく、期間で見ると下落しました。

為替市場

期間末の米ドル・円は、期間の初めと比較して米ドル高・円安となりました。米ドル・円の動きを見ると、7月前半に一時的に米ドル安・円高となった局面はあったものの、期間を通じて米国の長期金利の上昇やFRBのタカ派的な金融政策の長期化懸念などから、米ドル高・円安基調となりました。

ポートフォリオについて（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

当ファンド

主要投資対象である「U S スモール・キャップ・エクイティ・プレミアム・ファンド」を高位に組み入れました。ただし、償還に備え、11月に入り現金化を行いました。

マネー・マネジメント・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。

U S スモール・キャップ・エクイティ・プレミアム・ファンド

担保付スワップ取引を通じて、米国小型株指数を対象としたE T F（上場投資信託）を高位に組み入れました。

ベンチマークとの差異について（2023年5月13日から2023年11月13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。

米国小型株ツインα（毎月分配型）

分配金について（2023年5月13日から2023年11月13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	10	10	10	10	10
（対基準価額比率）	(0.28%)	(0.27%)	(0.26%)	(0.27%)	(0.27%)
当期の収益	—	—	—	—	—
当期の収益以外	10	10	10	10	10
翌期繰越分配対象額	3,413	3,403	3,393	3,383	3,374

※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。

米国小型株ツインα（毎月分配型）

1万口当たりの費用明細（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	28円	0.762%	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3,655円です。
（投信会社）	(12)	(0.333)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(15)	(0.416)	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 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	0.000	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）	(－)	(－)	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	28	0.762	

※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。

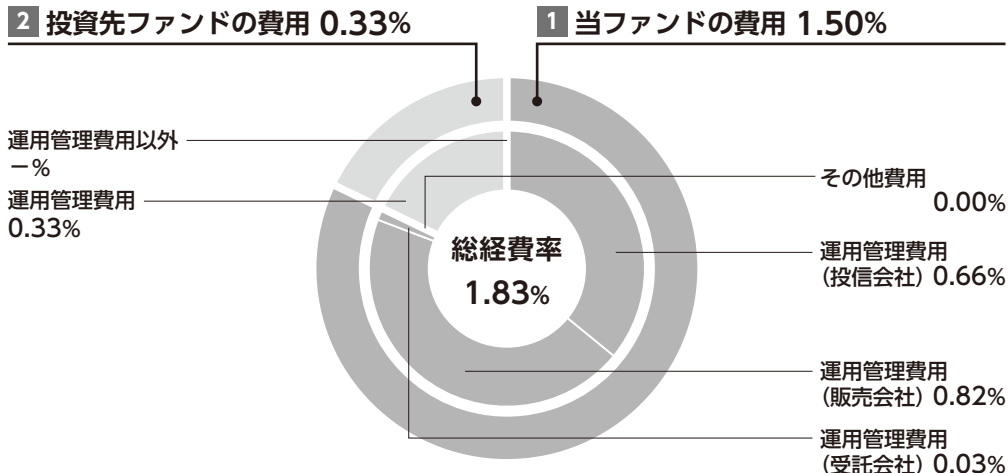
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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)	1.83%
1 当ファンドの費用の比率	1.50%
2 投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.33%
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、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1.83%です。

米国小型株ツインα（毎月分配型）

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2023年5月13日から2023年11月13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	USスモール・キャップ・エクイティ・プレミアム・ファンド	口 54,151,410	千円 10,883	口 19,834,139,194	千円 3,971,587

※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・マネジメント・マザーファンド	千口 -	千円 -	千口 552	千円 550	

■ 利害関係人との取引状況等（2023年5月13日から2023年11月13日まで）

利害関係人との取引状況

米国小型株ツインα（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	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 5	百万円 4	% 80.0	百万円 1	百万円 -	% -

※平均保有割合 7.9%

※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。

米国小型株ツインα（毎月分配型）

■ 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5月13日から2023年11月13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11月13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		期末
	口数	口数	評価額	組入比率
USスモール・キャップ・エクイティ・プレミアム・ファンド	19,779,987,784	—	—	—
合計	19,779,987,784	—	—	—

※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		期末
	口数	口数	評価額	評価額
マネー・マネジメント・マザーファンド	552	—	—	—

米国小型株ツインα（毎月分配型）

■ 投資信託財産の構成

(2023年11月13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 3,578,342	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,578,342	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6月12日) (2023年7月12日) (2023年8月14日) (2023年9月12日) (2023年10月12日) (2023年11月13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
(A) 資 産	3,970,009,420円	3,941,507,608円	4,005,885,992円	3,873,942,240円	3,720,543,691円	3,578,342,993円
コール・ローン等	132,517,582	124,719,847	108,114,037	121,840,229	117,388,106	3,578,342,993
投資信託受益証券(評価額)	3,824,790,666	3,813,379,389	3,883,263,706	3,749,812,331	3,602,605,115	-
マネー・マネジメント・マザーファンド(評価額)	550,525	550,470	550,470	550,415	550,470	-
未 収 入 金	12,150,647	2,857,902	13,957,779	1,739,265	-	-
(B) 負 債	31,613,329	20,037,564	15,871,707	16,775,553	17,069,189	13,227,708
未払収益分配金	10,924,510	10,625,740	10,461,198	10,317,848	10,159,877	-
未払解約金	15,734,198	4,506,454	-	1,746,160	2,252,829	8,359,564
未払信託報酬	4,951,929	4,902,276	5,404,656	4,705,734	4,652,719	4,849,566
未 払 利 息	-	-	-	-	-	3,407
その他未払費用	2,692	3,094	5,853	5,811	3,764	15,171
(C) 純資産総額(A-B)	3,938,396,091	3,921,470,044	3,990,014,285	3,857,166,687	3,703,474,502	3,565,115,285
元 本	10,924,510,352	10,625,740,556	10,461,198,120	10,317,848,813	10,159,877,285	9,988,800,266
次期繰越損益金	△ 6,986,114,261	△ 6,704,270,512	△ 6,471,183,835	△ 6,460,682,126	△ 6,456,402,783	-
償 還 差 損 益 金	-	-	-	-	-	△ 6,423,684,981
(D) 受 益 権 総 口 数	10,924,510,352口	10,625,740,556口	10,461,198,120口	10,317,848,813口	10,159,877,285口	9,988,800,266口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,605円	3,691円	3,814円	3,738円	3,645円	-
1万口当たり償還価額(C/D)	-	-	-	-	-	3,569円11銭

※当作成期における作成期首元本額11,153,500,507円、作成期中追加設定元本額14,355,130円、作成期中一部解約元本額1,179,055,371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。

米国小型株ツインα（毎月分配型）

■ 損益の状況

〔自2023年5月13日〕
〔至2023年6月12日〕
〔自2023年6月13日〕
〔至2023年7月12日〕
〔自2023年7月13日〕
〔至2023年8月14日〕
〔自2023年8月15日〕
〔至2023年9月12日〕
〔自2023年9月13日〕
〔至2023年10月12日〕
〔自2023年10月13日〕
〔至2023年11月13日〕

項 目	第 115 期	第 116 期	第 117 期	第 118 期	第 119 期	第 120 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 5,431円	△ 5,526円	△ 5,011円	△ 5,570円	△ 5,337円	△ 30,590円
受 取 利 息	53	354	153	163	272	1,137
支 払 利 息	△ 5,484	△ 5,880	△ 5,164	△ 5,733	△ 5,609	△ 31,727
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	271,449,759	106,134,435	145,017,465	△ 63,255,501	△ 79,924,772	△ 71,220,659
売 買 益	274,605,353	108,296,797	146,081,197	422,227	1,223,854	1,321,014
売 買 損	△ 3,155,594	△ 2,162,362	△ 1,063,732	△ 63,677,728	△ 81,148,626	△ 72,541,673
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,953,741	△ 4,904,684	△ 5,409,089	△ 4,708,201	△ 4,655,188	△ 4,863,528
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	266,490,587	101,224,225	139,603,365	△ 67,969,272	△ 84,585,297	△ 76,114,777
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 2,018,028,604	△ 1,713,658,872	△ 1,597,434,297	△ 1,447,754,731	△ 1,502,240,840	△ 1,569,657,808
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,223,651,734	△ 5,081,210,125	△ 5,002,891,705	△ 4,934,640,275	△ 4,859,416,769	△ 4,777,912,396
(配 当 等 相 当 額)	(2,539,710,071)	(2,470,536,193)	(2,432,542,715)	(2,399,440,965)	(2,362,935,328)	(2,323,357,907)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 7,763,361,805)	(△ 7,551,746,318)	(△ 7,435,434,420)	(△ 7,334,081,240)	(△ 7,222,352,097)	(△ 7,101,270,303)
(G) 合 計 (D + E + F)	△ 6,975,189,751	△ 6,693,644,772	△ 6,460,722,637	△ 6,450,364,278	△ 6,446,242,906	△ 6,423,684,981
(H) 収 益 分 配 金	△ 10,924,510	△ 10,625,740	△ 10,461,198	△ 10,317,848	△ 10,159,877	-
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 6,986,114,261	△ 6,704,270,512	△ 6,471,183,835	△ 6,460,682,126	△ 6,456,402,783	-
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,223,651,734	△ 5,081,210,125	△ 5,002,891,705	△ 4,934,640,275	△ 4,859,416,769	-
(配 当 等 相 当 額)	(2,539,710,071)	(2,470,536,193)	(2,432,542,715)	(2,399,440,965)	(2,362,935,328)	(-)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 7,763,361,805)	(△ 7,551,746,318)	(△ 7,435,434,420)	(△ 7,334,081,240)	(△ 7,222,352,097)	(-)
債 還 差 損 益 金	-	-	-	-	-	△ 6,423,684,981
分 配 準 備 積 立 金	1,189,404,389	1,146,170,176	1,117,815,279	1,092,057,444	1,065,056,658	-
繰 越 損 益 金	△ 2,951,866,916	△ 2,769,230,563	△ 2,586,107,409	△ 2,618,099,295	△ 2,662,042,672	-

※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	0円	0円	0円	0円	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	2,539,710,071	2,470,536,193	2,432,542,715	2,399,440,965	2,362,935,328
(d) 分配準備積立金	1,200,328,899	1,156,795,916	1,128,276,477	1,102,375,292	1,075,216,535
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,740,038,970	3,627,332,109	3,560,819,192	3,501,816,257	3,438,151,863
1万口当たり当期分配対象額	3,423.53	3,413.72	3,403.83	3,393.94	3,384.05
(f) 分配金	10,924,510	10,625,740	10,461,198	10,317,848	10,159,877
1万口当たり分配金	10	10	10	10	10

米国小型株ツインα（毎月分配型）

■ 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11月25日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2023年11月13日		資産総額	3,578,342,993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	13,227,708円
				純資産総額	3,565,115,285円
受益権口数	552,901,717口	9,988,800,266口	9,435,898,549口	受益権口数	9,988,800,266口
元本額	552,901,717円	9,988,800,266円	9,435,898,549円	1万口当たり償還金	3,569円11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1期	1,050,080,704	1,035,124,514	9,858	0	0.00
第2期	1,694,707,211	1,704,893,362	10,060	150	1.50
第3期	4,732,624,577	4,599,214,241	9,718	150	1.50
第4期	13,075,380,191	12,932,527,836	9,891	150	1.50
第5期	20,642,676,144	18,884,267,472	9,148	150	1.50
第6期	25,376,922,353	23,000,642,818	9,064	150	1.50
第7期	30,425,477,168	28,332,531,692	9,312	150	1.50
第8期	32,161,280,535	29,363,936,520	9,130	150	1.50
第9期	34,610,740,775	31,048,956,296	8,971	150	1.50
第10期	33,825,552,249	31,346,713,579	9,267	150	1.50
第11期	32,303,088,893	27,015,332,558	8,363	150	1.50
第12期	30,737,584,025	28,045,451,500	9,124	150	1.50
第13期	26,205,097,696	23,948,349,511	9,139	150	1.50
第14期	24,253,510,803	22,125,777,505	9,123	150	1.50
第15期	23,365,431,239	21,704,955,693	9,289	150	1.50
第16期	21,813,662,928	20,410,594,565	9,357	150	1.50
第17期	20,974,936,415	19,714,088,975	9,399	150	1.50
第18期	20,156,012,202	18,349,956,323	9,104	150	1.50
第19期	19,075,285,866	17,844,447,368	9,355	150	1.50
第20期	19,027,288,886	17,339,427,019	9,113	150	1.50
第21期	19,062,567,044	16,937,811,782	8,885	150	1.50
第22期	18,359,799,032	15,015,570,082	8,179	150	1.50
第23期	17,812,431,257	14,508,746,111	8,145	150	1.50
第24期	16,929,920,640	13,973,902,752	8,254	150	1.50
第25期	16,223,749,327	12,447,891,828	7,673	150	1.50
第26期	16,126,346,525	11,072,917,824	6,866	150	1.50
第27期	16,030,189,125	9,644,686,455	6,017	150	1.50

米国小型株ツインα（毎月分配型）

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 28 期	15,961,562,006	10,409,573,207	6,522	150	1.50
第 29 期	15,903,982,475	9,782,387,357	6,151	150	1.50
第 30 期	15,721,837,276	9,664,551,488	6,147	150	1.50
第 31 期	15,212,887,018	9,328,149,875	6,132	150	1.50
第 32 期	14,898,412,939	8,766,813,714	5,884	150	1.50
第 33 期	15,168,923,011	8,890,482,994	5,861	150	1.50
第 34 期	15,055,655,259	8,697,863,442	5,777	150	1.50
第 35 期	14,869,970,650	8,547,485,408	5,748	150	1.50
第 36 期	14,827,003,177	8,639,555,793	5,827	150	1.50
第 37 期	15,167,092,072	9,590,364,441	6,323	150	1.50
第 38 期	18,935,926,118	11,831,808,568	6,248	150	1.50
第 39 期	22,070,929,426	13,406,406,031	6,074	150	1.50
第 40 期	24,592,677,214	14,628,389,761	5,948	150	1.50
第 41 期	28,508,596,376	16,098,290,266	5,647	150	1.50
第 42 期	31,827,174,916	18,154,057,010	5,704	150	1.50
第 43 期	33,842,821,114	18,722,086,410	5,532	150	1.50
第 44 期	35,227,764,572	19,292,792,877	5,477	150	1.50
第 45 期	37,145,276,201	18,607,943,963	5,010	150	1.50
第 46 期	38,420,717,535	19,118,994,295	4,976	150	1.50
第 47 期	39,823,076,791	20,344,152,146	5,109	150	1.50
第 48 期	41,326,634,736	20,369,507,958	4,929	150	1.50
第 49 期	43,751,322,466	21,458,472,000	4,905	150	1.50
第 50 期	45,223,123,093	21,882,612,833	4,839	150	1.50
第 51 期	45,800,163,632	20,262,744,747	4,424	100	1.00
第 52 期	44,908,473,522	20,070,143,170	4,469	100	1.00
第 53 期	44,996,300,010	19,120,634,060	4,249	100	1.00
第 54 期	44,615,899,508	19,335,310,241	4,334	100	1.00
第 55 期	43,632,951,089	19,080,011,082	4,373	100	1.00
第 56 期	43,754,533,282	18,972,454,249	4,336	100	1.00
第 57 期	43,832,283,799	18,654,285,232	4,256	100	1.00
第 58 期	44,890,722,873	19,103,248,464	4,256	100	1.00
第 59 期	46,481,848,391	17,604,651,839	3,787	100	1.00
第 60 期	48,157,234,331	18,168,019,519	3,773	100	1.00
第 61 期	50,162,522,851	17,559,374,918	3,500	50	0.50
第 62 期	48,540,777,868	16,218,598,047	3,341	50	0.50

米国小型株ツインα（毎月分配型）

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 63 期	47,871,238,913	16,643,141,157	3,477	50	0.50
第 64 期	46,747,471,598	16,416,479,867	3,512	50	0.50
第 65 期	46,296,842,863	16,375,755,277	3,537	50	0.50
第 66 期	45,858,117,948	15,857,645,846	3,458	50	0.50
第 67 期	45,473,223,712	15,020,420,031	3,303	50	0.50
第 68 期	45,487,568,381	15,127,439,257	3,326	50	0.50
第 69 期	45,336,809,930	13,957,754,699	3,079	50	0.50
第 70 期	44,899,321,382	14,443,016,099	3,217	40	0.40
第 71 期	43,046,860,743	13,333,177,255	3,097	40	0.40
第 72 期	41,830,013,933	13,312,744,302	3,183	40	0.40
第 73 期	40,815,658,665	13,009,673,955	3,187	40	0.40
第 74 期	39,129,646,242	12,674,100,993	3,239	40	0.40
第 75 期	38,248,562,613	12,368,353,544	3,234	40	0.40
第 76 期	37,541,192,922	8,895,737,443	2,370	40	0.40
第 77 期	37,060,469,700	8,935,395,075	2,411	10	0.10
第 78 期	34,478,502,782	8,612,563,798	2,498	10	0.10
第 79 期	32,770,746,638	8,168,300,553	2,493	10	0.10
第 80 期	31,559,468,827	8,295,277,133	2,628	10	0.10
第 81 期	29,954,759,266	8,371,544,332	2,795	10	0.10
第 82 期	28,836,332,122	7,769,500,825	2,694	10	0.10
第 83 期	27,825,403,777	7,920,543,837	2,847	10	0.10
第 84 期	26,428,832,454	7,805,979,833	2,954	10	0.10
第 85 期	24,682,025,435	7,662,081,821	3,104	10	0.10
第 86 期	23,451,734,126	7,713,531,746	3,289	10	0.10
第 87 期	21,980,912,788	7,677,471,030	3,493	10	0.10
第 88 期	21,091,725,114	7,711,375,913	3,656	10	0.10
第 89 期	20,041,559,053	7,230,192,475	3,608	10	0.10
第 90 期	19,231,836,774	6,830,419,167	3,552	10	0.10
第 91 期	18,525,717,224	6,929,379,564	3,740	10	0.10
第 92 期	17,923,503,731	6,636,426,183	3,703	10	0.10
第 93 期	17,528,170,818	6,473,990,017	3,693	10	0.10
第 94 期	16,683,625,923	6,137,850,637	3,679	10	0.10
第 95 期	16,411,549,937	6,157,311,221	3,752	10	0.10
第 96 期	15,726,649,769	6,234,099,506	3,964	10	0.10
第 97 期	15,399,997,775	5,715,624,109	3,711	10	0.10

米国小型株ツインα（毎月分配型）

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 98 期	14,924,680,248	5,597,771,654	3,751	10	0.10
第 99 期	14,552,827,541	5,138,864,732	3,531	10	0.10
第100期	14,251,731,839	5,028,704,696	3,528	10	0.10
第101期	13,996,287,775	5,170,890,258	3,694	10	0.10
第102期	13,598,195,174	4,546,058,857	3,343	10	0.10
第103期	13,371,872,810	4,766,892,366	3,565	10	0.10
第104期	13,102,003,388	4,637,030,260	3,539	10	0.10
第105期	12,937,691,030	4,837,620,245	3,739	10	0.10
第106期	12,632,896,443	4,769,470,038	3,775	10	0.10
第107期	12,426,980,805	4,338,791,162	3,491	10	0.10
第108期	12,176,619,179	4,444,295,209	3,650	10	0.10
第109期	12,041,761,540	4,152,579,359	3,448	10	0.10
第110期	11,853,421,930	4,119,648,774	3,475	10	0.10
第111期	11,644,253,178	4,135,174,539	3,551	10	0.10
第112期	11,524,743,530	3,862,063,077	3,351	10	0.10
第113期	11,398,731,644	3,860,708,044	3,387	10	0.10
第114期	11,153,500,507	3,759,876,277	3,371	10	0.10
第115期	10,924,510,352	3,938,396,091	3,605	10	0.10
第116期	10,625,740,556	3,921,470,044	3,691	10	0.10
第117期	10,461,198,120	3,990,014,285	3,814	10	0.10
第118期	10,317,848,813	3,857,166,687	3,738	10	0.10
第119期	10,159,877,285	3,703,474,502	3,645	10	0.10

■ 分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税引前）	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
		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。

米国小型株ツインα（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	USスモール・キャップ・エクイティ・プレミアム・ファンド
形態	ケイマン籍契約型投資信託（円建て）
主要投資対象	担保付スワップ取引を通じて、実質的に米国の小型株市場へ投資するとともに米国小型株市場全体にかかるオプション取引、通貨オプション取引を行います。 ※担保付スワップ取引の相手方は、クレディ・スイス・インターナショナルです。
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●米国小型株戦略 <ul style="list-style-type: none"> ・主に米国小型株指数（原則としてラッセル2000指数とします。）を対象としたETFに投資することで、米団小型株市場全体の成長を捉えることを目指します。 ●株式カバードコール戦略 <ul style="list-style-type: none"> ・株式カバードコール戦略は、米国小型株市場全体（株価指数またはETF）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。 ・株式カバードコール戦略は、原則としてファンドが実質的に保有する米ドル建資産総額の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"> ・通貨カバードコール戦略は、円に対する米ド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。 ・通貨カバードコール戦略は、原則としてファンドが実質的に保有する米ドル建資産総額の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>●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	・純資産総額の10%を超える借入れを行いません。
分配方針	原則毎月行います。
運用管理費用	純資産総額に対して 管理報酬等：年0.35% ※上記の料率には、年間最低報酬額や取引ごとにかかる報酬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。
その他の費用	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。 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。
申込手数料	ありません。
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
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。
備考	<ul style="list-style-type: none"> ・担保付スワップ取引の相手方は、日々のオプションの評価および担保付スワップ取引の評価も行っており、当該評価に基づいて当ファンドの純資産価格は計算されます。 ・担保付スワップ取引の評価には、ETF等に投資する場合にかかる税金等が反映されます。

以下には、「USスモール・キャップ・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。

■ 包括利益計算書

2022年4月30日に
終了した年度
(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損益

手数料収入

担保付スワップ取引に係る純（損）益

20,443,645

173,164,764

193,608,409

収益合計

193,608,409

費用

費用合計

20,443,645

20,443,645

運用に伴う利益

173,164,764

受益者に帰属する純資産の変動額

173,164,764

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

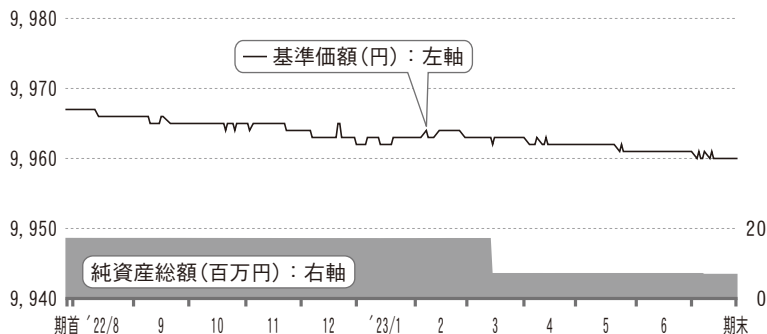
年 月 日	基 準	価 額		公 組 入 社 比	債 率
		騰 落	率		
(期 首) 2022年7月25日	円		%		%
	9,967		—		80.9
7月末	9,967		0.0		80.9
8月末	9,966		△0.0		57.8
9月末	9,965		△0.0		57.9
10月末	9,965		△0.0		63.7
11月末	9,964		△0.0		52.3
12月末	9,962		△0.1		52.3
2023年1月末	9,963		△0.0		69.7
2月末	9,963		△0.0		52.2
3月末	9,963		△0.0		68.9
4月末	9,962		△0.1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