

## 償還 運用報告書 (全体版)

第9期<償還日 2022年2月16日>

### 新光グローバル・ハイールド債券ファンド (年1回決算型)

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10月16日から2022年2月16日までです。	
運用方針	投資信託証券を主要投資対象として、安定した収益の確保と投資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	新光グローバル・ハイールド債券ファンド (年1回決算型)	投資信託証券。
	WAグローバル・ハイールド・ボンド (マルチ・カレンシー) ファンド-USDクラス	主として海外の高利回り社債に実質的な投資を行います。
	国内短期公社債マザーファンド	本邦通貨建ての公社債。
運用方法	WAグローバル・ハイールド・ボンド (マルチ・カレンシー) ファンド-USDクラスへの投資を通じて、主として海外の高利回り社債に実質的な投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。投資対象とする外国投資信託では、原則として投資対象資産の発行通貨を売り予約し、米ドルを買い予約する為替取引を行います。	
組入制限	新光グローバル・ハイールド債券ファンド (年1回決算型)	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	国内短期公社債マザーファンド	株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資は行いません。
分配方針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等の全額とします。分配金額は、基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには分配を行わないことがあります。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「新光グローバル・ハイールド債券ファンド (年1回決算型)」は、この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

http://www.am-one.co.jp/

## 新光グローバル・ハイイールド債券ファンド（年1回決算型）

### ■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分	込 金 期 騰 落	率 中 率			
5期 (2018年9月25日)	円 12,931	円 0	% 1.5	% 96.6	% -	百万円 107	
6期 (2019年9月25日)	13,308	0	2.9	98.1	0.1	54	
7期 (2020年9月25日)	13,366	0	0.4	95.6	0.1	47	
8期 (2021年9月27日)	14,938	0	11.8	96.6	-	41	
(償 還 日) 2022年2月16日	(償還価額) 15,026.31	0	0.6	-	-	37	

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注3) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

### ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 騰 落 率	価 額		投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	券 率
		騰 落 率	率			
(期 首) 2021年9月27日	円 14,938	% -	% 96.6	% -	% -	% -
9 月 末	15,055	0.8	96.7	-	-	-
10 月 末	15,182	1.6	96.2	-	-	-
11 月 末	15,061	0.8	95.8	-	-	-
12 月 末	15,414	3.2	96.6	-	-	-
2022年1月 末	15,049	0.7	97.1	-	-	-
(償還日) 2022年2月16日	(償還価額) 15,026.31	0.6	-	-	-	-

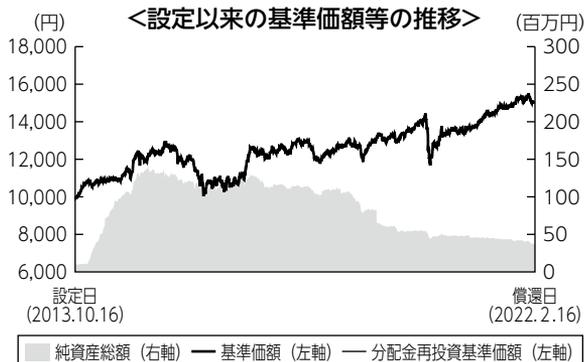
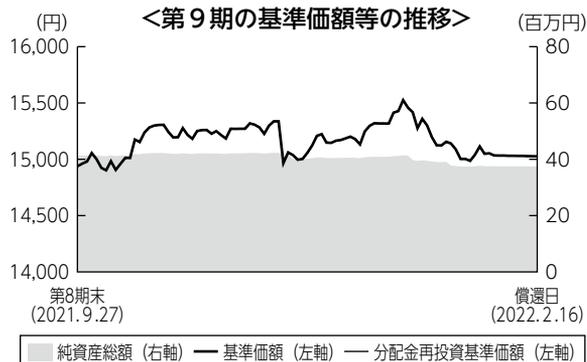
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

## ■設定以来の運用経過（2013年10月16日から2022年2月16日まで）

### 基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 「第9期の基準価額等の推移」の分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 「設定以来の基準価額等の推移」の基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。
- (注5) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

円建てのケイマン諸島籍外国投資信託である「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンドーUSDクラス」（以下、ハイイールド・ボンド・ファンドといいます。）を通じて、主として海外のハイイールド債券に実質的に投資を行いました。また、国内短期公社債マザーファンドへの投資を行いました。

設定来、ハイイールド債券市場と通貨がともに上昇したことから基準価額（分配金再投資ベース）は上昇となりました。

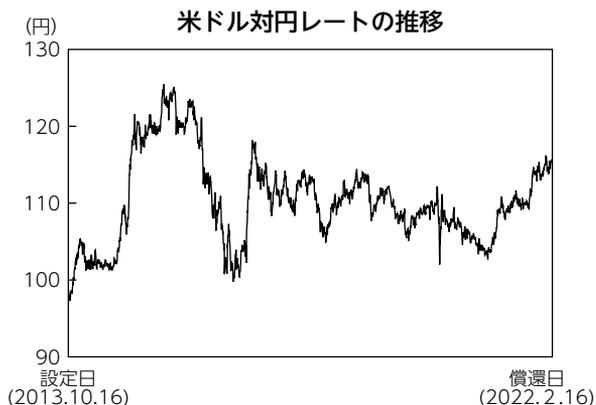
当期は、ハイイールド債券市場は下落したものの、通貨が上昇したことから基準価額（分配金再投資ベース）は上昇となりました。

## 設定来の投資環境

設定来、原油価格下落による米国エネルギー関連銘柄のデフォルト率上昇、米連邦準備制度理事会（F R B）の金融緩和縮小と利上げ実施、米中貿易摩擦など、相場の調整局面はありましたが、ハイイールド債券市場は概ね堅調に推移しました。2020年に入り、新型コロナウイルスの感染拡大と世界的な都市封鎖により、市場は乱高下しましたが、主要国の大規模な金融緩和策やワクチン開発及び接種の進展により、市場のリスク回避姿勢が改善し、上昇しました。

国内短期金融市場では、日本銀行の大規模な金融緩和政策の影響で、3ヵ月国庫短期証券利回りは2013年から0.10%以下の水準で推移しました。その後、2016年にはマイナス金利政策が導入されたことにより、同金利はマイナス金利で推移することになりました。

設定来、日米金利差が拡大傾向であったことから米ドルは対円で上昇しました。しかし、2016年に入り市場のリスク回避姿勢が高まったことで下落する局面もありました。2020年に新型コロナウイルスの感染拡大を受けて変動幅が拡大する局面もありました。2021年以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発及び接種の進展やF R Bの金融政策の正常化などを受けて、上昇して償還日を迎えました。



## 設定来のポートフォリオについて

### ●当ファンド

ハイイールド・ボンド・ファンドを高位に組み入れました。また、国内短期公社債マザーファンドの組み入れを継続しました。

### ●WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンド－USDクラス

2022年2月16日時点でのポートフォリオの状況は、キャッシュを除くベースで保有銘柄数は104銘柄、地域別では米国を選好しました。信用格付け別では、B格やBB格の銘柄を中心の組み入れを継続しました。また、セクター別では消費者関連、通信、エネルギーなどを中心とし、市場動向等に合わせで銘柄選択を行いました。



※基準価額は、当作成期間における分配金を再投資したものとみなして計算しています。

### ●国内短期公社債マザーファンド

残存期間の短い国債や地方債などで運用を行いました。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	(2021年9月28日 ～2022年2月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	70円	0.462%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は15,166円です。
(投信会社)	(23)	(0.150)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(45)	(0.300)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	( 2)	(0.013)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
合計	70	0.462	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

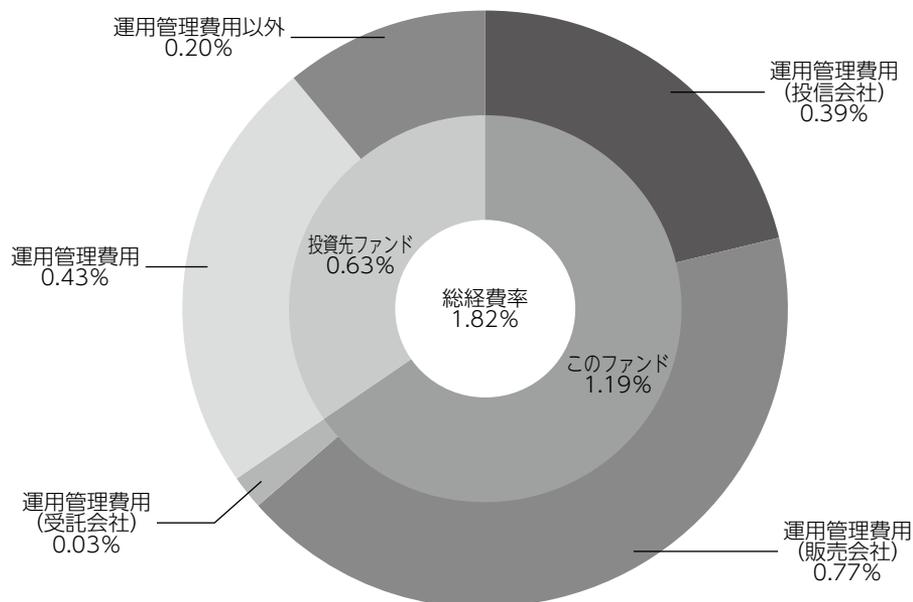
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額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総経費率（年率）は1.82%です。



総経費率 (①+②+③)	1.82%
①このファンドの費用の比率	1.19%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.43%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.20%

(注1) ①の費用は、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す。

(注2) 各費用は、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。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

## ■売買及び取引の状況 (2021年9月28日から2022年2月16日まで)

投資信託受益証券

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国邦貨建	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド (マルチ・カレンシー) ファンド-USDクラス	千□ -	千円 -	千□ 34,434.61	千円 39,412

(注) 金額は受渡代金です。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2021年9月28日から2022年2月16日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
国内短期公社債マザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 99	千円 99

## ■利害関係人との取引状況等 (2021年9月28日から2022年2月16日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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。

## ■組入資産の明細

償還時における有価証券の組入れはありません。前期末の組入れは以下の通りでした。

### (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	期 首(前期末)	
	□	数
WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド (マルチ・カレンシー) ファンド-USDクラス		千□ 34,434.61
合 計		34,434.61

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

### (2) 親投資信託残高

	期 首 (前期末)	
	□	数
国内短期公社債マザーファンド		千□ 99

## ■投資信託財産の構成

2022年2月16日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 37,674	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	37,674	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月16日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	37,674,588円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	37,674,588
(B) 負 債	188,402
未 払 信 託 報 酬	188,384
未 払 利 息	18
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	37,486,186
元 本	24,947,036
償 還 差 損 益 金	12,539,150
(D) 受 益 権 総 口 数	24,947,036口
1 万 口 当 た り 償 還 価 額(C/D)	15,026円31銭

(注) 期首における元本額は27,588,006円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は2,640,970円です。

## ■損益の状況

当期 自 2021年9月28日 至 2022年2月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	827,125円
受 取 配 当 金	827,294
支 払 利 息	△169
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△419,080
売 買 益	39,343
売 買 損	△458,423
(C) 信 託 報 酬 等	△188,384
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	219,661
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,251,900
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,067,589
(配 当 等 相 当 額)	(2,330,887)
(売 買 損 益 相 当 額)	(736,702)
(G) 合 計(D+E+F)	12,539,150
償 還 差 損 益 金(G)	12,539,150

(注1) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注2) (F)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。

## ■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16日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年2月16日		資産総額	37,674,588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	188,402円
				純資産総額	37,486,186円
受益権口数	10,000,000口	24,947,036口	14,947,036口	受益権口数	24,947,036口
元本額	10,000,000円	24,947,036円	14,947,036円	1万口当たり償還金	15,026円31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
第1期	93,148,371円	106,784,706円	11,464円	0円	0.00%
第2期	101,096,987	118,933,711	11,764	0	0.00
第3期	115,819,159	124,114,482	10,716	0	0.00
第4期	89,618,607	114,197,228	12,743	0	0.00
第5期	82,913,896	107,213,175	12,931	0	0.00
第6期	41,068,347	54,652,167	13,308	0	0.00
第7期	35,507,028	47,456,983	13,366	0	0.00
第8期	27,588,006	41,211,689	14,938	0	0.00

## 償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税引前）	15,026円31銭
----------------	------------

### 償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置の適用を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは販売会社までお問い合わせ下さい。

# WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド (マルチ・カレンシー) ファンドーUSDクラス

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形態	ケイマン諸島籍外国投資信託／円建受益証券
運用方針	主として世界各国の高利回り社債に分散投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。また、効率的な運用を目的として、市場金利や企業の信用状態に関連するデリバティブ取引を行う場合があります。 米ドル以外の通貨建債券へ投資した場合、原則として債券の発行通貨売り／米ドル買いの為替取引を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・原則として、信用格付けがBB+/Ba1格相当以下の証券に純資産総額の80%以上を投資します。</li> <li>・同一発行体の証券への投資割合は、原則として純資産総額の5%以内とします。</li> <li>・有価証券の空売りは行いません。</li> <li>・純資産総額の10%を超える借入れは行わないこととします。</li> <li>・流動性に欠ける資産への投資は、純資産総額の15%以内とします。</li> <li>・他のファンドへの投資は、純資産総額の5%以内とします。</li> <li>・通常の状態において、日本において有価証券に属する証券に純資産総額の50%以上を投資します。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年3月31日
信託報酬等	純資産総額に対し年率0.50%程度 上記料率には、管理会社、投資顧問会社、副投資顧問会社、受託会社、保管受託銀行ならびに管理事務代行会社への報酬が含まれます。ただし、これら報酬の中には取引頻度に応じた額や最低支払額が設定されているものがあるため、取引頻度や資産規模などにより上記料率を上回る場合があります。
主な関係法人	<p>管理会社：ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド 投資顧問会社：ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー 副投資顧問会社：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>ウエスタン・アセット・マネジメント株式会社（東京）</li> <li>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティイー・リミテッド（シンガポール）</li> <li>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティワイ・リミテッド（メルボルン）</li> <li>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・DTVMM・リミターダ（サンパウロ）</li> </ul> <p>受託会社兼管理事務代行会社：BNYメロン・ファンド・マネジメント（ケイマン）リミテッド 副管理事務代行会社：ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン 保管受託銀行：ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン</p>

「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンドーJPYクラス」、 「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンドーUSDクラス」、 「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンドーAUDクラス」、 「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンドーBRLクラス」は、「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンド」を構成する個別クラスとなっております。

「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンド」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

## WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンドの内容

### (1) 損益計算書

2021年3月31日終了年度

（日本円表示）

#### 投資収益

利息	295,739,069円
配当金	1,084,772円
投資収益合計	296,823,841円

#### 費用

管理会社報酬	29,733,717円
保管	11,132,135円
専門家	3,900,390円
管理事務代行、会計代行および名義書換代理人	2,080,403円
受託会社報酬	660,760円
その他	634,369円
費用合計	48,141,774円
投資純利益	248,682,067円

#### 投資、外貨換算／取引およびデリバティブ取引に係る実現・未実現純利益（損失）

実現純利益（損失）	
投資	(396,784,505円)
外貨取引	1,368,227円
為替予約	(733,134,866円)
実現純利益（損失）	(1,128,551,144円)

#### 未実現純利益（損失）の純変動額

投資	1,416,046,941円
外貨換算	10,304,525円
為替予約	585,996,404円
未実現純利益（損失）の純変動額	2,012,347,870円

投資、外貨換算／取引およびデリバティブ取引に係る実現・未実現純利益（損失）	883,796,726円
営業による純資産の純増加額	1,132,478,793円

(2) 組入上位10銘柄  
2021年3月31日現在

銘柄名	通貨	比率
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS	アメリカ・ドル	4.9%
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	アメリカ・ドル	4.3
NEWELL BRANDS INC	アメリカ・ドル	3.7
KRAFT HEINZ FOODS CO	アメリカ・ドル	3.6
SPRINT CORP	アメリカ・ドル	3.5
VERIZON COMMUNICATIONS	アメリカ・ドル	3.4
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	アメリカ・ドル	2.5
INEOS QUATTRO FINANCE 1 REGS	ユーロ	2.5
DELTA AIR LINES INC	アメリカ・ドル	2.4
BNP PARIBAS	アメリカ・ドル	2.0
組入銘柄数	119銘柄	

(注1) 比率は、WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンドの組入公社債に対する評価額の割合です。

(注2) ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシーのデータをもとにアセットマネジメントOneが作成したものです。

# 国内短期公社債マザーファンド 運用報告書

第13期（決算日 2021年11月1日）

（計算期間 2020年11月3日～2021年11月1日）

国内短期公社債マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限です。
運用方針	主として本邦通貨建ての公社債に投資することにより、安定した収益の確保を目指した運用を行います。
主要投資対象	本邦通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。

## ■最近3期の運用実績

決算期	基準価額	期騰落中率		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰	落中率			
11期(2019年10月31日)	円 10,069	% △0.1	% 68.3	% -	百万円 147	
12期(2020年11月2日)	10,069	0.0	69.7	-	77	
13期(2021年11月1日)	10,068	△0.0	-	-	77	

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

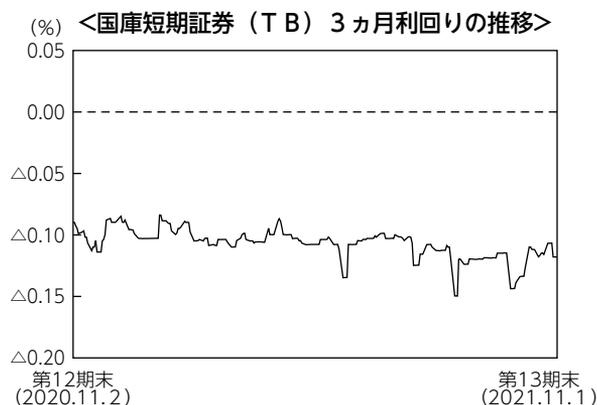
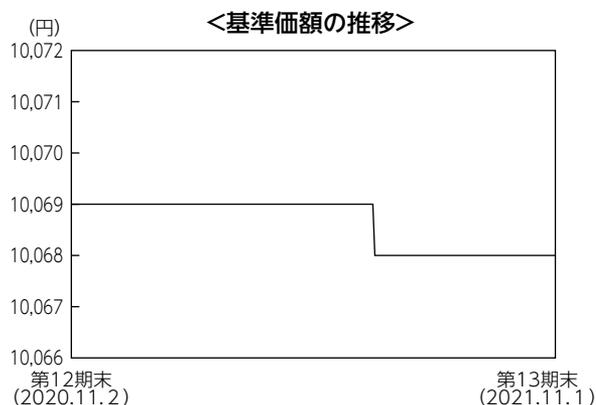
## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年11月2日	円 10,069	% -	% -	% 69.7	% -
11 月 末	10,069	0.0	69.6	-	
12 月 末	10,069	0.0	69.5	-	
2021年1 月 末	10,069	0.0	69.5	-	
2 月 末	10,069	0.0	69.4	-	
3 月 末	10,069	0.0	-	-	
4 月 末	10,069	0.0	-	-	
5 月 末	10,069	0.0	-	-	
6 月 末	10,068	△0.0	-	-	
7 月 末	10,068	△0.0	-	-	
8 月 末	10,068	△0.0	-	-	
9 月 末	10,068	△0.0	-	-	
10 月 末	10,068	△0.0	-	-	
(期 末) 2021年11月1日	10,068	△0.0	-	-	

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年11月3日から2021年11月1日まで）



※国庫短期証券（TB）3ヵ月利回りの低下は価格の上昇を示し、逆の場合は下落したことを示します。

### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は1万口あたり10,068円となり、前期末の同10,069円から0.01%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

基準価額の変動要因として、保有債券からの利息収入などのプラス要因はありましたが、マイナス金利による影響が大きく、前期末比で基準価額は下落しました。

### 投資環境

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力ががかかっていることが要因となりました。

### ポートフォリオについて

残存期間の短い地方債などで運用を行いました。

### 今後の運用方針

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。そのため、今後も安定的な運用を目指し、公社債などへの投資につとめます。

## ■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■ 売買及び取引の状況 (2020年11月3日から2021年11月1日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	内 地 方 債 証 券	—	— (54,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、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 (2020年11月3日から2021年11月1日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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。

## ■ 組入資産の明細

2021年11月1日現在、有価証券等の組入れはございません。

## ■ 投資信託財産の構成

2021年11月1日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 77,882	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	77,882	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年11月1日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	77,882,674円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	77,882,674
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	77,882,674
元 本	77,357,362
次 期 繰 越 損 益 金	525,312
(D) 受 益 権 総 口 数	77,357,362口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,068円

(注1) 期首元本額 77,357,362円  
 追加設定元本額 0円  
 一部解約元本額 0円

(注2) 期末における元本の内訳

ハイブリッド証券ファンド円コース	27,208,015円
ハイブリッド証券ファンド米ドルコース	3,391,713円
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース	4,489,701円
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース	16,175,679円
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース	2,324,574円
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース	2,228,133円
ハイブリッド証券ファンド中国元コース	1,130,574円
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース	236,700円
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース	8,032,854円
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース	1,090,474円
ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド	955,242円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド円コース	1,392,481円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース	99,759円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース	1,193,555円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース	6,365,626円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド	943,105円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド(年1回決算型)	99,177円
期末元本合計	77,357,362円

## ■損益の状況

当期 自2020年11月3日 至2021年11月1日

項 目	当 期
(A) 受 取 利 息 等 収 益	266,731円
受 取 利 息	276,116
支 払 利 息	△9,385
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△273,037
売 買 損	△273,037
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△6,306
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	531,618
(E) 合 計(C+D)	525,312
次 期 繰 越 損 益 金(E)	525,312

(注) (B)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。