

■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4月26日から2026年4月17日まで
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、カナダの高配当株式への投資に加え、「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、高水準のインカムゲインとオプションプレミアム確保の確保、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。 プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス カナダの株式等 キャッシュ・マネジメント・マザーファンド 本邦通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	<p>■カナダ株式を実質的な投資対象とし、主に配当利回りに着目した銘柄選定により信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>■「プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス」においては、カナダ株式の配当利回り水準に着目し、相対的に配当利回りの高い銘柄の中から、個々の企業のファンダメンタルズを勘案して銘柄を選定します。外国投資信託証券における株式の運用は、プリンシパル・グローバル・インベスターズLLCが行います。</p> <p>■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。</p> <p>■株式への投資に加え、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。</p>
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	<p>■毎月17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。</p> <p>■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。</p> <p>■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。</p> <p>※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。</p>

カナダ高配当株ツインα (毎月分配型)

【運用報告書(全体版)】

第19作成期(2022年4月19日から2022年10月17日まで)

第107期 / 第108期 / 第109期
決算日2022年5月17日 決算日2022年6月17日 決算日2022年7月19日

第110期 / 第111期 / 第112期
決算日2022年8月17日 決算日2022年9月20日 決算日2022年10月17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、カナダの高配当株式への投資に加え、「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、高水準の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)

カナダ高配当株ツイン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 (分配落)	標準価額		公社債 組入比率	債券 投資比率	信託 組入率	純資産額
		税金配込	騰落率				
83期 (2020年5月18日)	円 1,329	円 10	% 4.7	% 0.3	% 97.0	百万円 20,296	
84期 (2020年6月17日)	1,411	10	6.9	0.3	97.0	21,205	
85期 (2020年7月17日)	1,471	10	5.0	0.3	97.0	21,697	
86期 (2020年8月17日)	1,516	10	3.7	0.3	97.0	22,098	
87期 (2020年9月17日)	1,485	10	△1.4	0.3	97.3	21,306	
88期 (2020年10月19日)	1,509	10	2.3	0.3	97.2	21,276	
89期 (2020年11月17日)	1,538	10	2.6	0.2	97.6	21,196	
90期 (2020年12月17日)	1,589	10	4.0	0.2	97.5	21,273	
91期 (2021年1月18日)	1,617	10	2.4	0.2	97.3	21,178	
92期 (2021年2月17日)	1,687	10	4.9	0.2	97.3	21,603	
93期 (2021年3月17日)	1,741	10	3.8	0.2	97.3	21,815	
94期 (2021年4月19日)	1,758	10	1.6	0.2	97.9	21,481	
95期 (2021年5月17日)	1,800	10	3.0	0.2	97.9	21,572	
96期 (2021年6月17日)	1,844	10	3.0	0.2	97.8	21,474	
97期 (2021年7月19日)	1,779	10	△3.0	0.2	97.5	20,095	
98期 (2021年8月17日)	1,799	10	1.7	0.2	97.4	19,938	
99期 (2021年9月17日)	1,801	10	0.7	0.0	97.3	19,510	
100期 (2021年10月18日)	1,884	10	5.2	0.0	97.8	19,995	
101期 (2021年11月17日)	1,906	10	1.7	0.0	97.8	19,572	
102期 (2021年12月17日)	1,790	10	△5.6	0.0	97.5	18,069	
103期 (2022年1月17日)	1,845	10	3.6	0.0	97.4	18,166	
104期 (2022年2月17日)	1,846	10	0.6	0.0	97.3	17,736	
105期 (2022年3月17日)	1,867	10	1.7	0.0	97.8	17,687	
106期 (2022年4月18日)	1,948	10	4.9	0.0	98.1	17,767	
107期 (2022年5月17日)	1,834	10	△5.3	0.0	97.6	16,243	
108期 (2022年6月17日)	1,767	10	△3.1	0.0	97.3	15,249	
109期 (2022年7月19日)	1,798	10	2.3	0.0	97.3	15,209	
110期 (2022年8月17日)	1,885	10	5.4	0.0	97.3	15,794	
111期 (2022年9月20日)	1,880	10	0.3	0.0	97.3	15,563	
112期 (2022年10月17日)	1,759	10	△5.9	0.0	97.0	14,390	

※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。

カナダ高配当株ツイン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		公 組 入 比	債 率	投 証 比	資 券 信 組	託 入 率
		騰 落 率	率					
第107期	(期 首) 2022年4月18日	円	%		%			%
	4月末	1,948	—		0.0			98.1
	(期 末) 2022年5月17日	1,874	△3.8		0.0			97.8
第108期	(期 首) 2022年5月17日	1,844	△5.3		0.0			97.6
	5月末	1,834	—		0.0			97.6
	(期 末) 2022年6月17日	1,902	3.7		0.0			97.8
第109期	(期 首) 2022年6月17日	1,777	△3.1		0.0			97.3
	6月末	1,767	—		0.0			97.3
	(期 末) 2022年7月19日	1,824	3.2		0.0			97.4
第110期	(期 首) 2022年7月19日	1,808	2.3		0.0			97.3
	7月末	1,798	—		0.0			97.3
	(期 末) 2022年8月17日	1,842	2.4		0.0			97.3
第111期	(期 首) 2022年8月17日	1,895	5.4		0.0			97.3
	8月末	1,885	—		0.0			97.3
	(期 末) 2022年9月20日	1,863	△1.2		0.0			97.3
第112期	(期 首) 2022年9月20日	1,890	0.3		0.0			97.3
	9月末	1,880	—		0.0			97.3
	(期 末) 2022年10月17日	1,751	△6.9		0.0			97.1
		1,769	△5.9		0.0			97.0

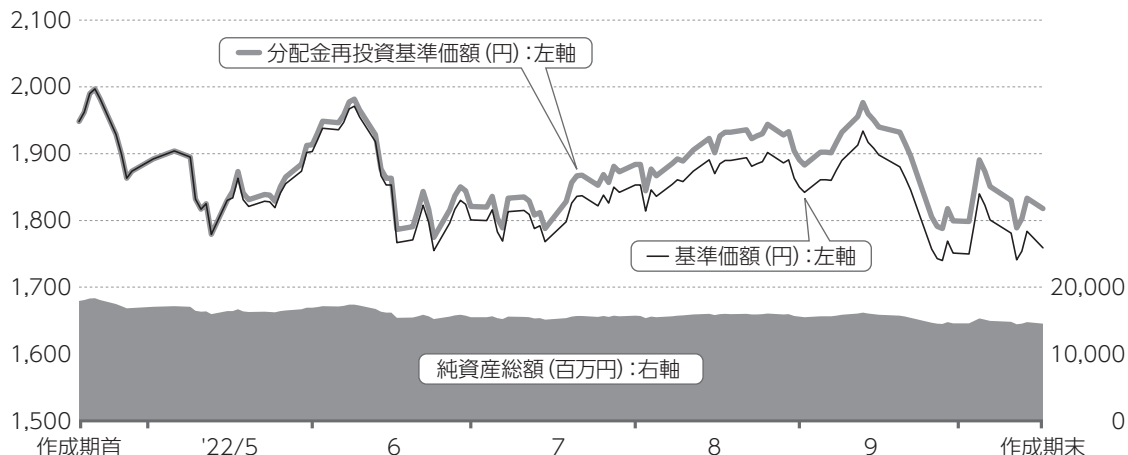
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

1 運用経過

基準価額等の推移について（2022年4月19日から2022年10月17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	1,948円
作成期末	1,759円 (当作成期既払分配金60円(税引前))
騰落率	-6.7% (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4月19日から2022年10月17日まで）

当ファンドは、プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラスへの投資を通じて、カナダの高配当株式への投資に加え、「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

- 個別銘柄では、原油価格および天然ガス価格など引き続き高値圏で推移していることを背景に、原油や天然ガスの生産などを手掛けるトルマリン・オイルが上昇したこと、また、企業間ソフトウェア・メーカーのデカルト・システムズ・グループや運送・物流会社のTFIインターナショナルが上昇したこと
- 「株式カバードコール戦略」がプラスとなったこと

下落要因

- 現物株のポートフォリオがマイナスとなったこと
- セクター別では、金融、素材、不動産など中心にすべてのセクターが下落したこと
- 個別銘柄では、オルタナティブ運用会社のブルックフィールド・アセット・マネジメントが、不動産セクターが弱含む中で不動産投資が嫌気されて下落したこと、また、通信サービス会社のビーシーイー・インクや総合金融サービスのロイヤル・バンク・オブ・カナダが下落したこと
- 「通貨カバードコール戦略」がマイナスとなったこと

投資環境について（2022年4月19日から2022年10月17日まで）

期間におけるカナダ株式市場は下落しました。また、カナダドルは対円で上昇しました。

カナダ株式市場

期間のカナダ株式市場は下落しました。インフレの高止まりが引き続き懸念されているほか、FRB（米連邦準備制度理事会）やカナダ銀行（中央銀行）をはじめとする主要中央銀行による金融引き締めの加速が世界経済や企業収益を押し下げるとの警戒感が高まったことから、カナダ株式市場を含む世界の株式市場は大幅に下落しました。原油価格は、EU（欧州連合）がロシア産原油の輸入禁止で合意したことや、堅調な米国の経済指標などを背景とした需給逼迫の懸念から大幅に上昇した局面もありましたが、中国での新型コロナウイルスの感染再拡大や、主要中央銀行による金融引き締めが世界景気を冷やし原油需要が細るとの見方から下落基調に転じ、大幅に下落しました。なお、カナダ国債利回りは中短期ゾーンを中心に総じて上昇し、逆イールド（長短金利の逆転）が発生しました。

為替市場

期間のカナダドルは対円で上昇しました。海外において、金融引き締めやインフレ圧力に対する懸念から金利が大きく上昇し、内外金利差の拡大などを要因として円安が進行しました。

ポートフォリオについて（2022年4月19日から2022年10月17日まで）

当ファンド

主要投資対象であるプリンシパル／CSカナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラスを期間を通じて高位に組み入れました。

プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス

持続的に高い配当の支払いを行うことが可能な銘柄を中心に、事業ファンダメンタルズ（基礎的条件）とバリュエーション（投資価値評価）が魅力的な銘柄を多く組み入れました。生活費の高騰を背景としてより安価な商品が求められるとの予想からプライベート・ブランドに強みを持つ食品流通会社を購入したほか、カナダ政府による環境や再生可能エネルギーへの取り組みの恩恵を受けると考えられる電力会社などを購入しました。一方、これまでのエネルギー価格の上昇を受けて年初来で好調だった業績がエネルギー価格に連動する傾向を有する銘柄などを、売却しました。また、株式への投資に加え、カナダ株価指数のコールオプションの売りを行う「株式カバードコール戦略」および円に対するカナダドルのコールオプションの売りを行う「通貨カバードコール戦略」を活用し、運用を行いました。

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

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ヵ月以内の政府保証債を中心とした運用を継続しました。

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

ベンチマークとの差異について（2022年4月19日から2022年10月17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4月19日から2022年10月17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107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期
当期分配金	10	10	10	10	10	10
（対基準価額比率）	(0.54%)	(0.56%)	(0.55%)	(0.53%)	(0.53%)	(0.57%)
当期の収益	－	－	－	－	－	－
当期の収益以外	10	10	10	10	10	10
翌期繰越分配対象額	642	632	622	612	602	592

※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、主として円建て外国投資信託証券への投資を通じて、カナダの高配当株式への投資に加え、「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、高水準の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。

プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインα クラス

様々な問題や株式市場に対する不透明感が続くことが予想される一方、それらが今後解消される中で、再び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）が市場を牽引する可能性が高くなってきていると考えます。また、商品価格が引き続き高値圏で推移していることは、カナダ経済の成長の原動力が輸出やエネルギーおよび素材関連事業であることから、カナダ企業の業績改善要因になるとみています。引き続き、個別企業の分析に基づくボトムアップの銘柄選択により、高配当銘柄の中でも、事業ファンダメンタルズの改善や投資家の期待上昇が想定さ

れる銘柄への投資を通じて、安定的なリターンを獲得に努める方針です。一方で、先物などによる材料コスト上昇に対するヘッジ効果の剥落を含む、インフレが企業収益に及ぼす影響を注視しています。

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

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カ月程度を目安に短めを基本とする方針です。

3 お知らせ

約款変更について

- 信託期間の延長に伴う約款変更を行いました。（適用日：2022年7月15日）

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

1万口当たりの費用明細（2022年4月19日から2022年10月17日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	13円	0.685%	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1,847円です。
（投信会社）	(4)	(0.235)	投信会社：ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(8)	(0.438)	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)	(0.012)	受託会社：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
（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	0.003	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（保管費用）	(-)	(-)	保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.003)	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	13	0.689	

※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。

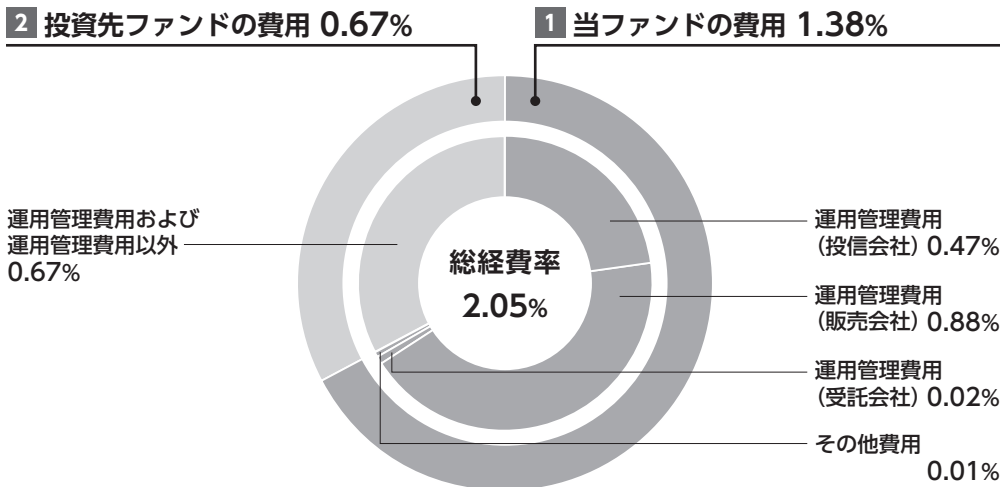
※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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)	2.05%
1 当ファンドの費用の比率	1.38%
2 投資先ファンドの費用の比率	0.67%

※**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2.05%です。

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2022年4月19日から2022年10月17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
		口	千円	口	千円
国内	プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス	80,314,987	22,394	9,011,758,969	2,480,835

※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（2022年4月19日から2022年10月17日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 （2022年4月19日から2022年10月17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。

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

■ 組入れ資産の明細（2022年10月17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
プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス	61,089,996,171	52,158,552,189	13,962,844	97.0
合計	61,089,996,171	52,158,552,189	13,962,844	97.0

※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	評価額
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	千口 433	千口 433		千円 439

※キャッシュ・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4,290,083,734口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年10月17日現在)

項目	作成期		末
	評価額	比率	比率
投資信託受益証券	13,962,844		96.1
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド	439		0.0
コール・ローン等、その他	560,791		3.9
投資信託財産総額	14,524,075		100.0

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年5月17日) (2022年6月17日) (2022年7月19日) (2022年8月17日) (2022年9月20日) (2022年10月17日)

項 目	第107期末	第108期末	第109期末	第110期末	第111期末	第112期末
(A) 資 産	16,403,056,190円	15,387,636,379円	15,353,862,442円	15,935,957,905円	15,685,490,555円	14,524,075,996円
コール・ローン等	496,819,791	524,133,522	549,455,306	547,358,787	537,078,227	530,220,647
投資信託受益証券(評価額)	15,860,763,591	14,835,477,319	14,795,770,036	15,372,115,398	15,135,911,936	13,962,844,420
キャッシュ・マネジメント・マザーファンド(評価額)	439,802	439,845	439,845	439,802	439,802	439,758
未 収 入 金	45,033,006	27,585,693	8,197,255	16,043,918	12,060,590	30,571,171
(B) 負 債	159,793,398	138,466,541	144,179,261	141,923,345	121,861,547	133,902,581
未払収益分配金	88,586,571	86,306,126	84,573,860	83,776,793	82,785,559	81,826,558
未払解約金	52,512,070	32,521,991	40,748,739	40,681,519	18,306,456	36,319,286
未払信託報酬	18,582,014	19,407,408	18,509,705	17,011,726	20,190,769	15,082,213
その他未払費用	112,743	231,016	346,957	453,307	578,763	674,524
(C) 純資産総額(A-B)	16,243,262,792	15,249,169,838	15,209,683,181	15,794,034,560	15,563,629,008	14,390,173,415
元 本	88,586,571,194	86,306,126,516	84,573,860,443	83,776,793,741	82,785,559,802	81,826,558,323
次期繰越損益金	△72,343,308,402	△71,056,956,678	△69,364,177,262	△67,982,759,181	△67,221,930,794	△67,436,384,908
(D) 受益権総口数	88,586,571,194口	86,306,126,516口	84,573,860,443口	83,776,793,741口	82,785,559,802口	81,826,558,323口
1万口当たり基準価額(C/D)	1,834円	1,767円	1,798円	1,885円	1,880円	1,759円

※当作成期における作成期首元本額91,208,126,801円、作成期中追加設定元本額1,152,492,224円、作成期中一部解約元本額10,534,060,702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。

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

■ 損益の状況

項 目	〔自2022年4月19日 至2022年5月17日〕		〔自2022年5月18日 至2022年6月17日〕		〔自2022年6月18日 至2022年7月19日〕		〔自2022年7月20日 至2022年8月17日〕		〔自2022年8月18日 至2022年9月20日〕		〔自2022年9月21日 至2022年10月17日〕	
	第107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期						
(A) 配 当 等 収 益	△ 7,442円	△ 14,107円	△ 13,148円	△ 5,035円	△ 19,225円	△ 18,621円						
受 取 利 息	67	443	1,007	301	92	627						
支 払 利 息	△ 7,509	△ 14,550	△ 14,155	△ 5,336	△ 19,317	△ 19,248						
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 906,255,926	△ 470,059,441	369,870,340	825,178,516	59,579,673	△ 896,064,379						
売 買 益	11,797,413	18,848,243	376,212,266	830,680,539	61,252,795	7,694,034						
売 買 損	△ 918,053,339	△ 488,907,684	△ 6,341,926	△ 5,502,023	△ 1,673,122	△ 903,758,413						
(C) 信 託 報 酬 等	△ 18,695,093	△ 19,526,822	△ 18,626,817	△ 17,119,020	△ 20,317,667	△ 15,179,358						
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 924,958,461	△ 489,600,370	351,230,375	808,054,461	39,242,781	△ 911,262,358						
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 30,327,548,777	△ 30,408,921,238	△ 30,238,251,455	△ 29,380,094,002	△ 28,201,444,187	△ 27,807,067,852						
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 41,002,214,593	△ 40,072,128,944	△ 39,392,582,322	△ 39,326,942,847	△ 38,976,943,829	△ 38,636,228,140						
(配 当 等 相 当 額)	(5,781,129,856)	(5,546,013,814)	(5,350,134,422)	(5,215,934,652)	(5,071,432,621)	(4,930,857,473)						
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 46,783,344,449)	(△ 45,618,142,758)	(△ 44,742,716,744)	(△ 44,542,877,499)	(△ 44,048,376,450)	(△ 43,567,085,613)						
(G) 合 計 (D + E + F)	△ 72,254,721,831	△ 70,970,650,552	△ 69,279,603,402	△ 67,898,982,388	△ 67,139,145,235	△ 67,354,558,350						
(H) 収 益 分 配 金	△ 88,586,571	△ 86,306,126	△ 84,573,860	△ 83,776,793	△ 82,785,559	△ 81,826,558						
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 72,343,308,402	△ 71,056,956,678	△ 69,364,177,262	△ 67,982,759,181	△ 67,221,930,794	△ 67,436,384,908						
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 41,090,801,164	△ 40,158,435,070	△ 39,477,156,182	△ 39,410,719,640	△ 39,059,729,388	△ 38,718,054,698						
(配 当 等 相 当 額)	(5,692,543,285)	(5,459,707,688)	(5,265,560,562)	(5,132,157,859)	(4,988,647,062)	(4,849,030,915)						
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 46,783,344,449)	(△ 45,618,142,758)	(△ 44,742,716,744)	(△ 44,542,877,499)	(△ 44,048,376,450)	(△ 43,567,085,613)						
繰 越 損 益 金	△ 31,252,507,238	△ 30,898,521,608	△ 29,887,021,080	△ 28,572,039,541	△ 28,162,201,406	△ 28,718,330,210						

※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107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円	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	0
(c) 収益調整金	5,781,129,856	5,546,013,814	5,350,134,422	5,215,934,652	5,071,432,621	4,930,857,473
(d) 分配準備積立金	0	0	0	0	0	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	5,781,129,856	5,546,013,814	5,350,134,422	5,215,934,652	5,071,432,621	4,930,857,473
1万口当たり当期分配対象額	652.60	642.60	632.60	622.60	612.60	602.60
(f) 分配金	88,586,571	86,306,126	84,573,860	83,776,793	82,785,559	81,826,558
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107期	第108期	第109期	第110期	第111期	第112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。

カナダ高配当株ツイン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	プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインα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	カナダの株式等を主要投資対象とします。また、スワップ取引を通じて、株価指数オプション取引、通貨オプション取引を活用します。
投資方針	<p>1. 主としてカナダの株式等に投資しつつ、株価指数と通貨のカバードコール戦略を組み合わせることで、高水準の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。</p> <p><高配当株式投資戦略></p> <ul style="list-style-type: none"> ・株式等への投資に当たっては、配当利回り水準に着目し、相対的に配当利回りの高い銘柄を中心に投資します。 ・銘柄の選定に当たっては、個々の企業のファンダメンタルズ分析等も勘案します。 ・株式等の運用は、プリンシパル・グローバル・インベスターズLLCが行います。 <p><株式カバードコール戦略></p> <ul style="list-style-type: none"> ・株式カバードコール戦略は、カナダ株価指数（原則S&Pトロント60指数）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す戦略です。 ・株式カバードコール戦略は、原則として保有するカナダドル建て資産の評価額の50%程度のコールオプションの売りを行います。 <p><通貨カバードコール戦略></p> <ul style="list-style-type: none"> ・通貨カバードコール戦略は、円に対するカナダ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す戦略です。 ・通貨カバードコール戦略は、原則として保有するカナダドル建て資産の評価額の50%程度のコールオプションの売りを行います。 ※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。 ※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>2. 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"> ・株式等への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の株式等への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・同一セクターへの投資割合は、原則として取得時におい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。
収益の分配	原則、毎月行います。
管理報酬 その他費用	<p>管理報酬等：年0.615%</p> <p>上記の他、信託財産にかかる租税、組入有価証券の売買時にかかる費用、受託会社の費用、管理事務費用、名義書換事務代行費用、組入有価証券等の保管に関する費用等はファンドの信託財産から負担されます。上記の報酬等は将来変更される場合があります。</p>
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
副投資顧問会社	プリンシパル・グローバル・インベスターズLLC

※上記の内容は、今後変更になる場合があります。

以下には、「プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・ファンド ツインαクラス」をシェアクラスとして含む「プリンシパル／CS カナディアン・エクイティ・インカム・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。

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

包括利益計算書

	2021年3月31日に 終了した年度 (日本円)	2020年3月31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 ¹		
受取配当金	729,719,964	1,112,064,217
スワップ費用	(2,089,289,412)	(473,816,628)
有価証券に係る（損）益	10,607,636,273	(5,776,675,119)
	9,248,066,825	(5,138,427,530)
受取利息 ²	496	2,407,331
外国為替取引に係る（損）益 ³	33,332,344	(1,905,495)
収益合計	9,281,399,665	(5,137,925,694)
費用		
助言料	82,828,540	128,567,363
仲介手数料	44,487,405	69,067,352
取引費用	26,106,854	22,817,001
保管管理費用	12,782,046	14,235,943
弁護士費用及び専門家報酬	9,443	114,894
その他費用（受託会社及び名義書換代理人報酬）	4,346,062	4,523,262
費用合計	170,560,350	239,325,815
運用に伴う（損）益（税引前）	9,110,839,315	(5,377,251,509)
源泉徴収税	(167,605,636)	(245,317,801)
分配前の受益者に帰属する純資産の変動額	8,943,233,679	(5,622,569,310)
受益者に対する分配金	—	—
分配後の受益者に帰属する純資産の変動額	8,943,233,679	(5,622,569,310)

1. 損益を通じて公正価値で測定される金融商品の収益は、公正価値で測定する金融資産及び金融負債に係る実現及び未実現損益（有価証券に係る収益/損失）、受取配当金及びスワップ費用/収益を含む。
2. 償却原価で測定される金融資産に実効金利法を適用して算出した受取利息。
3. 外国為替に係る実現及び未実現損益。

カナダ高配当株ツインα（毎月分配型）

組入上位銘柄

（基準日：2021年3月31日）

	銘柄名	業種名	比率
1	トロント・ドミニオン銀行	金融	8.9%
2	カナダロイヤル銀行	金融	7.8%
3	ショッピファイ	情報技術	6.3%
4	カナディアン・インベリアル・バンク・オブ・コマース	金融	4.5%
5	カナディアン・パシフィック鉄道	資本財サービス	3.9%
6	ビーシーイー・インク	コミュニケーション・サービス	3.4%
7	エンブリッジ	エネルギー	2.9%
8	ブルックフィールド・アセット・マネジメント	金融	2.8%
9	マニユライフ・ファイナンシャル	金融	2.7%
10	バンク・オブ・ノバスコシア	金融	2.6%
	全銘柄数	68銘柄	

※比率は組入株式等の時価評価額合計に対する割合

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

第16期（2021年7月27日から2022年7月25日まで）

信託期間	無期限（設定日：2007年2月20日）
運用方針	■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
		期 騰 落	中 率			
12期（2018年7月25日）	円	10,172	△0.0		69.2	百万円 4,478
13期（2019年7月25日）		10,167	△0.0		72.9	3,760
14期（2020年7月27日）		10,160	△0.1		86.2	4,668
15期（2021年7月26日）		10,154	△0.1		62.8	5,851
16期（2022年7月25日）		10,152	△0.0		75.3	4,586

※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) 2021年7月26日	円	10,154	—		62.8
7月末		10,154	0.0		61.0
8月末		10,154	0.0		72.4
9月末		10,154	0.0		59.0
10月末		10,154	0.0		65.7
11月末		10,153	△0.0		65.3
12月末		10,152	△0.0		58.4
2022年1月末		10,152	△0.0		62.5
2月末		10,151	△0.0		67.5
3月末		10,151	△0.0		71.2
4月末		10,151	△0.0		81.8
5月末		10,151	△0.0		76.3
6月末		10,152	△0.0		73.0
(期 末) 2022年7月25日		10,152	△0.0		75.3

※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7月27日から2022年7月25日まで）

基準価額等の推移



期首	10,154円
期末	10,152円
騰落率	-0.0%

▶ 基準価額の主な変動要因（2021年7月27日から2022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。

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（2021年7月27日から2022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。

国内短期金融市場

国内短期金融市場では、期間の初め-0.11%近辺でスタートした国庫短期証券3ヵ月物の利回りは、-0.08%~-0.20%の狭いレンジで推移し、-0.15%近辺で期間末を迎えました。

▶ ポートフォリオについて (2021年7月27日から2022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 (2021年7月27日から2022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

日本銀行は2021年3月の金融政策決定会合において、より効果的で持続的な金融緩和を実施していくための点検を行いました。現時点で日本銀行によるマイナス金利の深掘りの可能性は低いものの、現行の強力な金融緩和政策を継続することから、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まいります。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 (2021年7月27日から2022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)	0円 (0)	0.001% (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 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	0	0.001	

期中の平均基準価額は10,152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7月27日から2022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	2,864,455	(3,066,000)
	社債	1,806,994	(1,800,000)

※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。

※社債券には新株予約権付社債（転換社債）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7月27日から2022年7月25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	4,671	1,308	28.0	—	—	—

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、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
(2021年7月27日から2022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 (2022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BBB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特 殊 債 券 (除く金融債券)	2,346,000 (2,346,000)	2,352,252 (2,352,252)	51.3 (51.3)	— (—)	— (—)	— (—)	51.3 (51.3)
普 通 社 債 券	1,100,000 (1,100,000)	1,102,492 (1,102,492)	24.0 (24.0)	— (—)	— (—)	— (—)	24.0 (24.0)
合 計	3,446,000 (3,446,000)	3,454,745 (3,454,745)	75.3 (75.3)	— (—)	— (—)	— (—)	75.3 (75.3)

※()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。

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

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
特 殊 債 券 (除く金融債券)	39政保地方公共団	0.8010	115,000	115,059	2022/08/15
	1 政保新関西空港	0.8010	445,000	445,366	2022/08/29
	51 政保関西空港	2.1000	100,000	100,230	2022/08/31
	40政保地方公共団	0.8190	170,000	170,223	2022/09/16
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	100,161	2022/09/30
	218 政保預金保険	0.1000	100,000	100,047	2022/10/14
	175 政保道路機構	0.7910	135,000	135,313	2022/10/31
	42政保地方公共団	0.8050	281,000	281,764	2022/11/14
	23 政保日本政策	0.7340	200,000	200,646	2022/12/16
	182 政保道路機構	0.8340	400,000	401,928	2023/01/31
	18 政保中部空港	0.6680	300,000	301,510	2023/03/22
小 計	—	2,346,000	2,352,252	—	
普 通 社 債 券	372 中国電力	1.2040	100,000	100,099	2022/08/25
	7 日本電産	0.1140	100,000	100,008	2022/08/30
	46 三井不動産	0.9640	100,000	100,091	2022/08/30
	11 ダイセル	0.1400	200,000	200,017	2022/09/15
	87東日本旅客鉄道	0.8690	100,000	100,151	2022/09/27
	94 丸紅	1.1700	100,000	100,240	2022/10/12
	3 東燃ゼネラル石油	1.2220	100,000	100,430	2022/12/05
	19 ダイキン工業	1.2040	100,000	100,460	2022/12/12
	11 LIXILグループ	0.0100	100,000	99,936	2023/07/18
6 JXホールディングス	1.1190	100,000	101,056	2023/07/19	
小 計	—	1,100,000	1,102,492	—	
合 計	—	3,446,000	3,454,745	—	

※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7月25日現在)

項 目	期		末
	評 価 額	比 率	
公 社 債	千円		%
公 社 債	3,454,745		75.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,134,253		24.7
投 資 信 託 財 産 総 額	4,588,998		100.0

キャッシュ・マネジメント・マザーファンド

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年7月25日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	4,588,998,699円
コーポレート債等	1,128,939,961
公社債(評価額)	3,454,745,014
未収利息	4,924,447
前払費用	389,277
(B) 負 債	2,010,298
未払解約金	2,007,896
その他未払費用	2,402
(C) 純資産総額(A-B)	4,586,988,401
元 本	4,518,439,727
次期繰越損益金	68,548,674
(D) 受益権総口数	4,518,439,727口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,152円

※当期における期首元本額5,763,082,023円、期中追加設定元本額2,653,267,074円、期中一部解約元本額3,897,909,370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。

SMBCファンドラップ・日本バリュー株	984,252円
SMBCファンドラップ・J-REIT	984,252円
SMBCファンドラップ・G-REIT	93,018,163円
SMBCファンドラップ・ヘッジファンド	311,216,889円
SMBCファンドラップ・米国株	984,543円
SMBCファンドラップ・欧州株	89,718,432円
SMBCファンドラップ・新興国株	61,111,034円
SMBCファンドラップ・コモディティ	30,882,058円
SMBCファンドラップ・米国債	136,874,567円
SMBCファンドラップ・欧州債	68,341,252円
SMBCファンドラップ・新興国債	54,958,024円
SMBCファンドラップ・日本グロース株	167,596,581円
SMBCファンドラップ・日本中小型株	27,029,827円
SMBCファンドラップ・日本債	964,891,078円
DC日本国債プラス	1,432,047,753円
エマージング・ボンド・ファンド・円コース(毎月分配型)	598,887円
エマージング・ボンド・ファンド・豪ドルコース(毎月分配型)	606,168円
エマージング・ボンド・ファンド・ニュージーランドドルコース(毎月分配型)	347,745円
エマージング・ボンド・ファンド・ブラジルリアルコース(毎月分配型)	619,829円
エマージング・ボンド・ファンド・南アフリカランドコース(毎月分配型)	468,047円
エマージング・ボンド・ファンド・トルコリラコース(毎月分配型)	886,592円
エマージング・ボンド・ファンド(マネーボールファンド)	172,728,849円
大和住銀 中国株式ファンド(マネー・ポートフォリオ)	26,108,158円

エマージング・ボンド・ファンド・中国元コース(毎月分配型)	354,941円
日本株厳選ファンド・円コース	270,889円
日本株厳選ファンド・ブラジルリアルコース	438,760円
日本株厳選ファンド・豪ドルコース	679,887円
日本株厳選ファンド・アジア3通貨コース	9,783円
日本株225・米ドルコース	49,237円
スマート・ストラテジー・ファンド(毎月決算型)	12,541,581円
スマート・ストラテジー・ファンド(年2回決算型)	4,566,053円
カナダ高配当株ツインα(毎月分配型)	433,260円
日本株厳選ファンド・米ドルコース	196,696円
日本株厳選ファンド・メキシコペソコース	196,696円
日本株厳選ファンド・トルコリラコース	196,696円
エマージング・ボンド・ファンド・カナダドルコース(毎月分配型)	25,219円
エマージング・ボンド・ファンド・メキシコペソコース(毎月分配型)	565,128円
グローバル創薬関連株式ファンド	984,834円
世界リアルアセット・バランス(毎月決算型)	466,767円
世界リアルアセット・バランス(資産成長型)	598,196円
米国分散投資戦略ファンド(1倍コース)	207,305,923円
米国分散投資戦略ファンド(3倍コース)	544,096,579円
米国分散投資戦略ファンド(5倍コース)	445,153円
グローバルDX関連株式ファンド(予想分配金提示型)	295,276円
グローバルDX関連株式ファンド(資産成長型)	1,968,504円
日興FWS・日本株クオリティ	19,697円
日興FWS・日本株市場型アクティブ	19,697円
日興FWS・先進国株クオリティ(為替ヘッジあり)	19,697円
日興FWS・先進国株クオリティ(為替ヘッジなし)	19,697円
日興FWS・先進国株市場型アクティブ(為替ヘッジあり)	19,697円
日興FWS・先進国株市場型アクティブ(為替ヘッジなし)	19,697円
日興FWS・新興国株アクティブ(為替ヘッジあり)	19,697円
日興FWS・新興国株アクティブ(為替ヘッジなし)	19,697円
日興FWS・日本債アクティブ	19,697円
日興FWS・先進国債アクティブ(為替ヘッジあり)	19,697円
日興FWS・先進国債アクティブ(為替ヘッジなし)	19,697円
日興FWS・新興国債アクティブ(為替ヘッジあり)	19,697円
日興FWS・新興国債アクティブ(為替ヘッジなし)	19,697円
日興FWS・Jリートアクティブ	19,697円
日興FWS・Gリートアクティブ(為替ヘッジあり)	19,697円
日興FWS・Gリートアクティブ(為替ヘッジなし)	19,697円
日興FWS・ヘッジファンドマルチ戦略	19,697円
日興FWS・ヘッジファンドアクティブ戦略	19,697円
大和住銀マルチ・ストラテジー・ファンド(ヘッジ付)(適格機関投資家限定)	98,396,143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2021年7月27日 至2022年7月25日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	24,828,178円
受 取 利 息	25,479,526
支 払 利 息	△ 651,348
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△25,929,128
売 買 益	8,500
売 買 損	△25,937,628
(C) そ の 他 費 用 等	△ 47,699
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 1,148,649
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	88,861,070
(F) 解 約 差 損 益 金	△59,645,514
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	40,481,767
(H) 合 計 (D + E + F + G)	68,548,674
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	68,548,674

※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。