

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／不動産投信	
信託期間	2022年12月14日まで（2013年2月18日設定）	
運用方針	マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の不動産投資信託証券に実質的な投資を行い、値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 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為替変動リスクの低減をはかります。 マザーファンドの不動産投資信託証券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーファンド	マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	米国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。
Macquarie Bank Limited（以下「MBL」といいます）を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社は何れも1959年銀行法（オーストラリア連邦）上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。

償還報告書（全体版）

[満期償還]

三菱UFJ／マッコーリー 米国ハイインカムリートファンド ＜為替ヘッジあり＞（毎月決算型）

愛称：アスリート



第113期（決算日：2022年7月14日）

第114期（決算日：2022年8月15日）

第115期（決算日：2022年9月14日）

第116期（決算日：2022年10月14日）

第117期（決算日：2022年11月14日）

信託終了日：2022年12月14日



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、「三菱UFJ／マッコーリー 米国ハイインカムリートファンド＜為替ヘッジあり＞（毎月決算型）」は、この度、信託期間を満了し、償還の運びとなりました。ここに謹んで運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。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。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額			投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
		税 分 込 配	み 金 期 騰 落	中 率		
	円 銭		円	%	%	百万円
89期(2020年7月14日)	6,897		30	△ 2.9	96.5	414
90期(2020年8月14日)	7,247		30	5.5	97.4	436
91期(2020年9月14日)	7,133		30	△ 1.2	96.8	429
92期(2020年10月14日)	7,335		30	3.3	95.7	438
93期(2020年11月16日)	7,517		30	2.9	98.2	440
94期(2020年12月14日)	7,406		30	△ 1.1	96.4	425
95期(2021年1月14日)	7,397		30	0.3	95.2	423
96期(2021年2月15日)	7,879		30	6.9	96.8	434
97期(2021年3月15日)	8,035		30	2.4	96.8	425
98期(2021年4月14日)	8,273		30	3.3	95.4	436
99期(2021年5月14日)	8,386		30	1.7	97.7	437
100期(2021年6月14日)	9,128		30	9.2	95.7	445
101期(2021年7月14日)	9,087		30	△ 0.1	96.4	441
102期(2021年8月16日)	9,287		30	2.5	96.3	442
103期(2021年9月14日)	9,242		30	△ 0.2	96.5	417
104期(2021年10月14日)	9,331		30	1.3	97.1	400
105期(2021年11月15日)	9,673		30	4.0	96.9	395
106期(2021年12月14日)	9,825		30	1.9	97.0	392
107期(2022年1月14日)	9,851		30	0.6	95.1	393
108期(2022年2月14日)	9,212		30	△ 6.2	96.0	349
109期(2022年3月14日)	9,279		30	1.1	96.2	339
110期(2022年4月14日)	9,644		30	4.3	95.6	340
111期(2022年5月16日)	8,456		30	△12.0	96.5	299
112期(2022年6月14日)	7,599		30	△ 9.8	95.8	269
113期(2022年7月14日)	7,808		30	3.1	96.8	276
114期(2022年8月15日)	8,563		30	10.1	95.7	304
115期(2022年9月14日)	7,850		30	△ 8.0	96.5	277
116期(2022年10月14日)	6,751		30	△13.6	96.3	228
117期(2022年11月14日)	7,337		30	9.1	92.9	234
(償還時)	(償還価額)					
118期(2022年12月14日)	7,281.81		—	△ 0.8	—	230

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

○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		投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	率	
第113期	(期首) 2022年6月14日	円 銭		%	%
	6月末	7,599		—	95.8
	(期末) 2022年7月14日	7,918		4.2	96.4
第114期	(期首) 2022年7月14日	7,838		3.1	96.8
	7月末	7,808		—	96.8
	(期末) 2022年8月15日	8,376		7.3	95.5
第115期	(期首) 2022年8月15日	8,593		10.1	95.7
	8月末	8,563		—	95.7
	(期末) 2022年9月14日	7,905		△ 7.7	96.5
第116期	(期首) 2022年9月14日	7,880		△ 8.0	96.5
	9月末	7,850		—	96.5
	(期末) 2022年10月14日	6,889		△12.2	94.9
第117期	(期首) 2022年10月14日	6,781		△13.6	96.3
	10月末	6,751		—	96.3
	(期末) 2022年11月14日	7,074		4.8	96.7
第118期	(期首) 2022年11月14日	7,367		9.1	92.9
	11月末	7,337		—	92.9
	(償還時) 2022年12月14日	7,296	(償還価額)	△ 0.6	—
		7,281.81		△ 0.8	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

運用経過

第1期～第118期：2013年2月18日～2022年12月14日

▶ 設定来の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第1期首 10,000円

第118期末 7,281.81円

既払分配金 4,800円

騰落率 22.1%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみな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により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ22.1% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

保有銘柄 (PROLOGIS INCなど) が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

第1期～第118期：2013年2月18日～2022年12月14日

投資環境について

▶ 米国リート市況

米国リート市況は、設定時に比べ上昇しました。

設定時から2015年末にかけては、米金融当局による低金利政策の継続などを受けて上昇しました。その後も、政策金利の引き上げを嫌気する局面があったものの、米国の好調な経済指標の発表や2017年12月に大型の税制改革法案が成立したことなどをを受けて底堅く推移し上昇しました。2020年2月中旬から3月下旬にかけては、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、世界経済の減速懸念が

高まり、金融市場への不透明感が強まる中、景気感応度の高いホテル・リゾートや店舗用のリートを中心に大きく下落し、米国リート市況は下落したものの、その後は、新型コロナウイルスのワクチン開発やワクチンの世界的普及などに加え、各国金融当局による金融緩和などを好感し上昇しました。2022年以降はウクライナ情勢の緊迫化やインフレ懸念の高まりなどを背景とした米金融当局による急速な金融引き締めを受けて、米国リート市況は下落しましたが、設定来でみると上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ／マッコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり>（毎月決算型）

マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド受益証券への投資を通じて、米国の不動産投資信託証券を高位に組み入れるとともに、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。

最終作成期（2022年6月15日～信託終了日）は、前記の運用を維持し、信託終了日にかけてマザーファンドの償還金を受領しました。

▶ マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド

信託期間を通じて、米国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指し、運用を行ってまいりました。

配当利回りに着目した上で、財務の健全性、配当の安定性および成長性、キャッシュフローの成長性などに基づいて組入銘柄を選定しました。

リーートの組入比率については、設定時から高位を維持しました。

最終作成期（2022年6月15日～信託終了日）は、前記の運用を維持し、2022年11月下旬に保有資産の売却を開始し、安定運用に切り替えました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、信託期間中、累計で4,800円の分配を行わせていただきました。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第113期 2022年6月15日～ 2022年7月14日	第114期 2022年7月15日～ 2022年8月15日	第115期 2022年8月16日～ 2022年9月14日	第116期 2022年9月15日～ 2022年10月14日	第117期 2022年10月15日～ 2022年11月14日
当期分配金 （対基準価額比率）	30 (0.383%)	30 (0.349%)	30 (0.381%)	30 (0.442%)	30 (0.407%)
当期の収益	30	30	0	30	5
当期の収益以外	—	—	29	—	24
翌期繰越分配対象額	1,561	1,565	1,535	1,543	1,519

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

償還価額

三菱UFJ／マッコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり>（毎月決算型）

償還価額は、7,281円81銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

2022年6月15日～2022年12月14日

1万口当たりの費用明細

項目	第113期～第118期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	65	0.855	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(36)	(0.480)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(25)	(0.331)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.044)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	3	0.042	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(投資信託証券)	(3)	(0.042)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(c) 有価証券取引税 = 作成期中の有価証券取引税 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.002)	
(d) その他費用	7	0.086	(d) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(6)	(0.081)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	75	0.985	

作成期中の平均基準価額は、7,590円です。

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してありません。

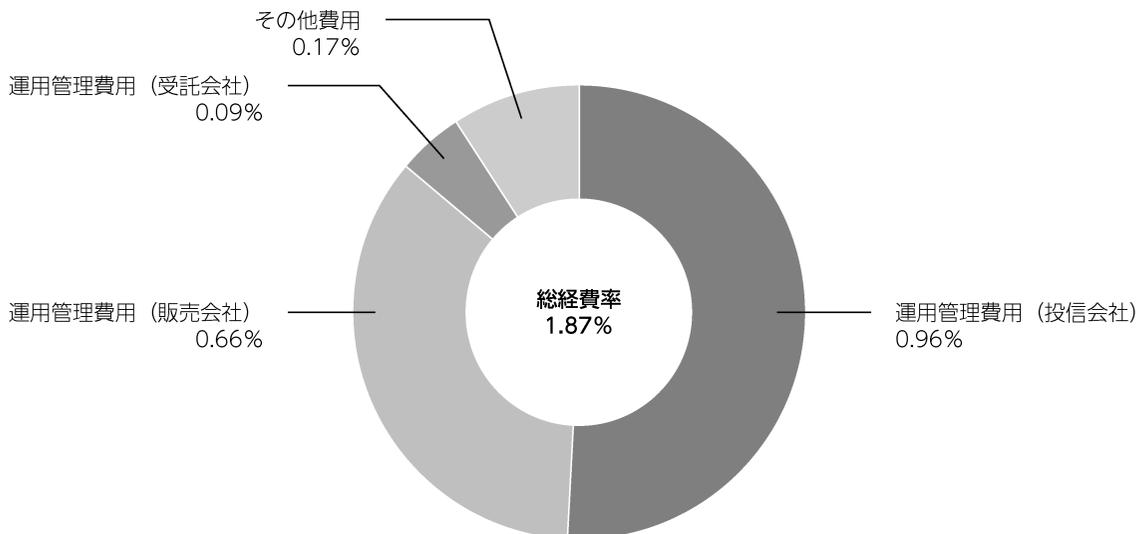
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.87%**です。



(注) 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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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は異なります。

○売買及び取引の状況

（2022年6月15日～2022年12月14日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第113期～第118期			
		設		定	
		口	数	金	額
		口	数	金	額
		千口		千円	
マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド		14,537		35,100	
				口	数
				千口	
				128,853	
				金	額
				千円	
				305,201	

○利害関係人との取引状況等

（2022年6月15日～2022年12月14日）

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ／マッコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり>（毎月決算型）>

区	分	第113期～第118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	$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引		2,162	300	13.9	1,890	53	2.8

<マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド>

区	分	第113期～第118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	$\frac{D}{C}$
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引		16	3	18.8	646	597	92.4

平均保有割合 41.8%

※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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

（2022年12月14日現在）

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	第112期末	
		口	数
マコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド			千口 114,315

○投資信託財産の構成

(2022年12月14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 230,710	% 100.0
投資信託財産総額		230,710	100.0

○資産、負債、元本及び基準(償還)価額の状況

項	目	第113期末	第114期末	第115期末	第116期末	第117期末	償 還 時
		2022年7月14日現在	2022年8月15日現在	2022年9月14日現在	2022年10月14日現在	2022年11月14日現在	2022年12月14日現在
		円	円	円	円	円	円
(A) 資産		549,735,183	596,141,328	547,058,113	448,409,286	452,589,069	230,710,466
	コール・ローン等	11,001,529	9,712,719	18,006,963	8,766,737	3,042,606	230,710,466
	マコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド(詳細)	272,921,416	295,487,791	272,660,686	224,436,287	220,683,418	—
	未収入金	265,812,238	290,940,818	256,390,464	215,206,262	228,863,045	—
(B) 負債		272,844,271	292,077,318	269,116,360	219,609,960	217,917,258	324,553
	未払金	271,389,829	290,578,433	267,645,087	218,243,272	216,630,160	—
	未払収益分配金	1,063,904	1,065,265	1,062,215	1,016,784	959,513	—
	未払解約金	36	38	4,103	10	10	—
	未払信託報酬	389,607	432,584	404,010	349,080	326,819	323,271
	未払利息	1	2	19	13	6	539
	その他未払費用	894	996	926	801	750	743
(C) 純資産総額(A-B)		276,890,912	304,064,010	277,941,753	228,799,326	234,671,811	230,385,913
	元本	354,634,808	355,088,469	354,071,784	338,928,266	319,837,709	316,385,401
	次期繰越損益金	△ 77,743,896	△ 51,024,459	△ 76,130,031	△ 110,128,940	△ 85,165,898	—
	償還差損金	—	—	—	—	—	△ 85,999,488
(D) 受益権総口数		354,634,808口	355,088,469口	354,071,784口	338,928,266口	319,837,709口	316,385,401口
	1万口当たり基準価額(C/D)	7,808円	8,563円	7,850円	6,751円	7,337円	—
	1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	7,281円81銭

○損益の状況

項 目	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期
	2022年6月15日～ 2022年7月14日	2022年7月15日～ 2022年8月15日	2022年8月16日～ 2022年9月14日	2022年9月15日～ 2022年10月14日	2022年10月15日～ 2022年11月14日	2022年11月15日～ 2022年12月14日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 381	△ 80	△ 334	△ 620	△ 479	△ 809
受取利息	4	—	—	1	—	—
支払利息	△ 385	△ 80	△ 334	△ 621	△ 479	△ 809
(B) 有価証券売買損益	8,845,760	28,323,190	△23,783,493	△ 35,887,383	20,047,740	△ 1,427,991
売買益	29,688,550	29,165,355	339,141	12,066,895	26,547,033	15,982,862
売買損	△20,842,790	△ 842,165	△24,122,634	△ 47,954,278	△ 6,499,293	△17,410,853
(C) 信託報酬等	△ 390,501	△ 439,520	△ 404,936	△ 349,881	△ 327,569	△ 324,014
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,454,878	27,883,590	△24,188,763	△ 36,237,884	19,719,692	△ 1,752,814
(E) 前期繰越損益金	△59,737,431	△52,346,028	△25,430,076	△ 48,452,382	△80,756,376	△61,238,054
(F) 追加信託差損益金	△25,397,439	△25,496,756	△25,448,977	△ 24,421,890	△23,169,701	△23,008,620
(配当等相当額)	(37,846,065)	(37,919,773)	(37,828,897)	(36,231,094)	(34,215,385)	(33,866,770)
(売買損益相当額)	(△63,243,504)	(△63,416,529)	(△63,277,874)	(△ 60,652,984)	(△57,385,086)	(△56,875,390)
(G) 計(D+E+F)	△76,679,992	△49,959,194	△75,067,816	△109,112,156	△84,206,385	—
(H) 収益分配金	△ 1,063,904	△ 1,065,265	△ 1,062,215	△ 1,016,784	△ 959,513	—
次期繰越損益金(G+H)	△77,743,896	△51,024,459	△76,130,031	△110,128,940	△85,165,898	—
償還差損金(D+E+F+H)	—	—	—	—	—	△85,999,488
追加信託差損益金	△25,397,439	△25,496,756	△25,448,977	△ 24,421,890	△23,169,701	—
(配当等相当額)	(37,848,788)	(37,920,503)	(37,829,137)	(36,233,003)	(34,215,440)	(—)
(売買損益相当額)	(△63,246,227)	(△63,417,259)	(△63,278,114)	(△ 60,654,893)	(△57,385,141)	(—)
分配準備積立金	17,522,373	17,652,115	16,529,018	16,085,432	14,377,311	—
繰越損益金	△69,868,830	△43,179,818	△67,210,072	△101,792,482	△76,373,508	—

(注) (B) 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。

(注) (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) (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。

<注記事項>

- ①作成期首(前作成期末)元本額 354,300,235円
 作成期中追加設定元本額 2,814,768円
 作成期中一部解約元本額 40,729,602円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.728181円です。

- ②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は85,999,488円です。

- ③分配金の計算過程

項 目	2022年6月15日～ 2022年7月14日	2022年7月15日～ 2022年8月15日	2022年8月16日～ 2022年9月14日	2022年9月15日～ 2022年10月14日	2022年10月15日～ 2022年11月14日
費用控除後の配当等収益額	1,732,451円	1,195,150円	6,622円	1,300,052円	180,524円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	37,848,788円	37,920,503円	37,829,137円	36,233,003円	34,215,440円
分配準備積立金額	16,853,826円	17,522,230円	17,584,611円	15,802,164円	15,156,300円
当ファンドの分配対象収益額	56,435,065円	56,637,883円	55,420,370円	53,335,219円	49,552,264円
1万口当たり収益分配対象額	1,591円	1,595円	1,565円	1,573円	1,549円
1万口当たり分配金額	30円	30円	30円	30円	30円
収益分配金金額	1,063,904円	1,065,265円	1,062,215円	1,016,784円	959,513円

- ④「マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の44以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○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2月18日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年12月14日		資産総額	230,710,466円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	324,553円
				純資産総額	230,385,913円
受益権口数	490,000,000口	316,385,401口	△173,614,599口	受益権口数	316,385,401口
元本額	490,000,000円	316,385,401円	△173,614,599円	1万円当たり償還金	7,281円81銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	490,000,000円	504,247,122円	10,291円	0円	0.0%
第2期	490,000,000	530,995,508	10,837	0	0.0
第3期	490,000,000	551,767,894	11,261	0	0.0
第4期	490,000,000	510,324,066	10,415	0	0.0
第5期	490,000,000	519,832,556	10,609	0	0.0
第6期	537,350,758	541,557,140	10,078	50	0.5
第7期	604,745,960	596,112,912	9,857	50	0.5
第8期	618,563,787	616,421,848	9,965	50	0.5
第9期	619,084,813	610,053,202	9,854	50	0.5
第10期	660,508,779	627,394,271	9,499	50	0.5
第11期	608,862,763	585,736,614	9,620	50	0.5
第12期	609,145,519	605,570,930	9,941	50	0.5
第13期	608,784,429	611,526,832	10,045	50	0.5
第14期	595,845,344	602,013,443	10,104	50	0.5
第15期	592,890,778	616,817,214	10,404	50	0.5
第16期	589,814,535	617,514,605	10,470	50	0.5
第17期	590,094,353	625,617,474	10,602	50	0.5
第18期	606,981,347	640,590,221	10,554	50	0.5
第19期	612,078,262	624,709,060	10,206	50	0.5
第20期	625,674,873	635,068,392	10,150	50	0.5
第21期	618,583,084	654,325,279	10,578	50	0.5
第22期	655,633,594	698,608,814	10,655	50	0.5
第23期	633,407,994	708,997,844	11,193	50	0.5
第24期	629,339,945	695,660,319	11,054	50	0.5
第25期	622,332,515	665,282,875	10,690	50	0.5
第26期	615,667,689	658,763,251	10,700	50	0.5
第27期	609,158,042	627,345,293	10,299	50	0.5
第28期	592,664,073	603,264,561	10,179	50	0.5
第29期	594,802,522	604,924,139	10,170	50	0.5
第30期	592,933,757	601,580,264	10,146	50	0.5
第31期	583,092,294	556,278,353	9,540	50	0.5

三菱UFJマコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり> (毎月決算型)

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
第32期	583,355,723円	577,733,411円	9,904円	50円	0.5%
第33期	586,383,425	561,713,732	9,579	50	0.5
第34期	578,820,802	556,848,717	9,620	50	0.5
第35期	580,260,090	545,871,110	9,407	50	0.5
第36期	556,205,662	506,982,535	9,115	50	0.5
第37期	563,803,157	560,670,530	9,944	50	0.5
第38期	689,836,950	703,780,331	10,202	50	0.5
第39期	760,804,169	780,266,478	10,256	50	0.5
第40期	816,396,427	844,162,211	10,340	50	0.5
第41期	952,603,842	1,042,262,203	10,941	50	0.5
第42期	1,684,571,953	1,865,567,533	11,074	50	0.5
第43期	2,073,399,986	2,182,342,572	10,525	50	0.5
第44期	2,110,754,916	2,195,210,218	10,400	50	0.5
第45期	1,957,812,030	1,905,149,504	9,731	50	0.5
第46期	2,088,428,188	2,132,917,067	10,213	50	0.5
第47期	2,199,065,960	2,249,595,806	10,230	50	0.5
第48期	2,111,698,843	2,159,061,594	10,224	50	0.5
第49期	1,746,353,729	1,710,350,243	9,794	50	0.5
第50期	1,653,344,854	1,680,968,237	10,167	50	0.5
第51期	1,375,962,139	1,313,983,282	9,550	50	0.5
第52期	1,850,531,202	1,807,485,973	9,767	50	0.5
第53期	1,492,834,499	1,437,607,774	9,630	50	0.5
第54期	1,439,638,325	1,364,871,891	9,481	50	0.5
第55期	1,298,054,622	1,259,159,459	9,700	50	0.5
第56期	1,314,025,779	1,271,386,619	9,676	50	0.5
第57期	1,342,007,697	1,271,978,173	9,478	50	0.5
第58期	1,199,073,432	1,128,809,579	9,414	50	0.5
第59期	1,180,081,891	1,063,584,891	9,013	50	0.5
第60期	1,083,903,612	919,258,105	8,481	50	0.5
第61期	998,940,787	854,570,138	8,555	50	0.5
第62期	962,219,261	815,403,179	8,474	50	0.5
第63期	947,957,024	834,188,142	8,800	50	0.5
第64期	896,446,116	810,182,111	9,038	50	0.5
第65期	857,632,306	789,043,613	9,200	50	0.5
第66期	832,541,069	758,293,078	9,108	50	0.5
第67期	791,239,377	732,497,601	9,258	50	0.5
第68期	770,803,740	658,370,388	8,541	50	0.5
第69期	754,839,235	665,613,887	8,818	50	0.5
第70期	730,529,424	624,991,455	8,555	50	0.5
第71期	730,678,193	602,348,492	8,244	50	0.5

三菱UFJマコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり> (毎月決算型)

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
第72期	719,959,704円	635,147,004円	8,822円	50円	0.5%
第73期	700,413,578	621,520,417	8,874	50	0.5
第74期	666,593,759	600,712,250	9,012	50	0.5
第75期	649,972,747	582,416,935	8,961	50	0.5
第76期	649,697,119	583,270,240	8,978	50	0.5
第77期	635,195,778	565,581,198	8,904	50	0.5
第78期	633,729,667	566,076,875	8,932	30	0.3
第79期	627,736,718	571,665,807	9,107	30	0.3
第80期	633,640,374	581,527,745	9,178	30	0.3
第81期	634,005,607	581,073,840	9,165	30	0.3
第82期	623,647,898	556,730,010	8,927	30	0.3
第83期	622,623,775	562,560,572	9,035	30	0.3
第84期	604,904,423	547,649,766	9,053	30	0.3
第85期	599,524,064	418,507,380	6,981	30	0.3
第86期	600,259,963	402,232,923	6,701	30	0.3
第87期	601,110,215	375,185,729	6,242	30	0.3
第88期	600,385,355	428,334,959	7,134	30	0.3
第89期	601,162,201	414,604,736	6,897	30	0.3
第90期	601,851,223	436,132,342	7,247	30	0.3
第91期	602,536,929	429,785,887	7,133	30	0.3
第92期	597,418,895	438,198,101	7,335	30	0.3
第93期	586,249,858	440,685,403	7,517	30	0.3
第94期	575,120,100	425,913,373	7,406	30	0.3
第95期	571,972,216	423,062,354	7,397	30	0.3
第96期	551,944,281	434,867,332	7,879	30	0.3
第97期	529,127,841	425,147,059	8,035	30	0.3
第98期	527,265,266	436,209,332	8,273	30	0.3
第99期	521,721,313	437,521,560	8,386	30	0.3
第100期	487,663,004	445,132,237	9,128	30	0.3
第101期	486,256,658	441,843,341	9,087	30	0.3
第102期	476,580,340	442,605,322	9,287	30	0.3
第103期	451,898,074	417,644,481	9,242	30	0.3
第104期	429,190,357	400,477,901	9,331	30	0.3
第105期	408,717,012	395,336,260	9,673	30	0.3
第106期	399,865,335	392,860,294	9,825	30	0.3
第107期	399,469,316	393,503,673	9,851	30	0.3
第108期	379,588,241	349,681,026	9,212	30	0.3
第109期	365,867,882	339,481,393	9,279	30	0.3
第110期	353,036,189	340,461,455	9,644	30	0.3
第111期	353,931,201	299,270,427	8,456	30	0.3

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112期	354,300,235円	269,244,360円	7,599円	30円	0.3%
第113期	354,634,808	276,890,912	7,808	30	0.3
第114期	355,088,469	304,064,010	8,563	30	0.3
第115期	354,071,784	277,941,753	7,850	30	0.3
第116期	338,928,266	228,799,326	6,751	30	0.3
第117期	319,837,709	234,671,811	7,337	30	0.3

○分配金のお知らせ

	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
1 万口当たり分配金（税込み）	30円	30円	30円	30円	30円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・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、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税込み）	7,281円81銭
-----------------	-----------

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド (旧ファンド名称「AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド」)

《繰上償還(第10期)》信託終了日2022年12月13日

[計算期間：2021年12月15日～2022年12月13日]

「マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド」は、この度、約款の規定に基づき、12月13日に繰り上げて償還させていただきました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	米国の不動産投資信託証券に投資を行い、値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざします。 不動産投資信託証券への投資にあたっては、人口動態分析、マクロ経済分析等のトップダウン・アプローチと、個別銘柄の割安度や保有資産・業績の分析および資本構造や経営の質等の分析によるボトムアップ・アプローチを併用し、銘柄選定を行います。 不動産投資信託証券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	米国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。
Macquarie Bank Limited (以下「MBL」といいます)を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社はどれも1959年銀行法(オーストラリア連邦)上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準 円 銭	価 額		投資 組 入	信 託 比 率	純 資 産 総 額
		期 騰 落	中 率			
6期(2018年12月14日)	16,812		1.9		97.8	百万円 1,476
7期(2019年12月16日)	18,757		11.6		99.0	1,268
8期(2020年12月14日)	15,795		△15.8		98.5	810
9期(2021年12月14日)	24,520		55.2		99.2	799
(償還時) 10期(2022年12月13日)	(償還価額) 23,457.05		△ 4.3		—	545

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	日	基 準	価 額		投 資 信 託 券 率
				騰 落	率	
	(期 首)		円 銭		%	%
	2021年12月14日		24,520		—	99.2
	12月末		25,564		4.3	98.6
	2022年1月末		23,950	△	2.3	98.9
	2月末		23,874	△	2.6	99.0
	3月末		26,718		9.0	99.0
	4月末		27,176		10.8	99.0
	5月末		24,837		1.3	98.3
	6月末		24,393	△	0.5	98.2
	7月末		25,663		4.7	98.5
	8月末		25,111		2.4	98.9
	9月末		22,935	△	6.5	97.3
	10月末		24,345	△	0.7	97.7
	11月末		23,801	△	2.9	—
	(償還時)		(償還価額)			
	2022年12月13日		23,457.05	△	4.3	—

(注) 騰落率は期首比。

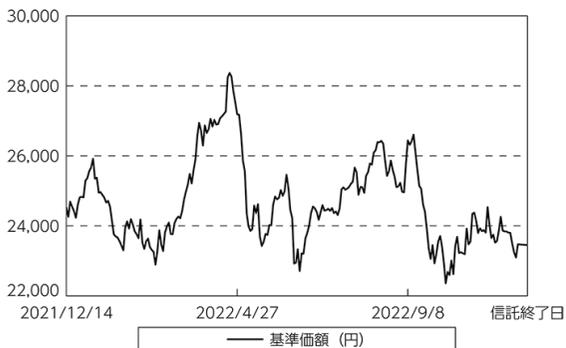
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

償還価額は期首に比べ4.3%の下落となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

米ドルが対円で上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

保有銘柄 (PROLOGIS INCなど) が下落したことなどが、基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎米国リート市況

- ・米国リート市況は、当期を通してみると下落しました。
- ・期首から2022年6月上旬にかけては、新型コロナウイルス変異株の感染拡大や米金融当局による金融引き締めを早期化、ウクライナ情勢の緊迫化などを受けて下落しました。その後、反発する局面もありましたが、インフレ懸念の高まりなどを背景に米金融当局が金融引き締めを加

速させたことなどを受けて10月中旬にかけて一段と下落しました。11月以降は、11月に公表された10月の米消費者物価指数（CPI）が市場予想を下回ったことや、11月の米連邦公開市場委員会（FOMC）議事録で参加者の多くが利上げペースの減速を支持したことなどを受けて上昇しましたが、期を通してみると米国リート市況は下落しました。

◎為替市況

- ・為替市況は、期首に比べ、21.2%の円安・米ドル高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・配当利回りに着目した上で、財務の健全性、配当の安定性および成長性、キャッシュフローの成長性などに基づいて組入銘柄を選定しました。リートの組入比率については、当期を通じて高位を維持しました。
- ・なお、2022年11月下旬に保有資産の売却を開始し、安定運用に切り替えました。

●償還価額

償還価額は、23,457円05銭となりました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年12月15日～2022年12月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 12 (12)	% 0.048 (0.048)	(a) 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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	1 (1)	0.002 (0.002)	(b) 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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	42 (41) (2)	0.172 (0.165) (0.007)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	55	0.222	
期中の平均基準価額は、24,632円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2021年12月15日～2022年12月13日)

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	—	6	184
	AGREE REALTY CORP	0.895	63	1	83
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	—	1	202
	PROLOGIS INC	—	—	3	453
	CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	0.925	113
	DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	1	211
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	—	0.478	115
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	1	132
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	—	—	1	88
	WELLTOWER INC	—	—	3	294
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	—	—	2	70
	KILROY REALTY CORP	—	—	1	88
	LXP INDUSTRIAL TRUST	1	14	10	111
	BOSTON PROPERTIES INC	—	—	1	159
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.162	25	0.862	161
	REALTY INCOME CORP	3	209	3	197
	SL GREEN REALTY CORP	—	—	1	64
		(0.006)	(3)		
	SUN COMMUNITIES INC	0.003	0.53861	0.985	147
	CUBESMART	—	—	3	129
	UDR INC	—	—	3	165
	DOUGLAS EMMETT INC	—	—	4	80
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	—	—	2	39
	STAG INDUSTRIAL INC	—	—	4	143
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	—	2	59
	WP CAREY INC	—	—	2	216
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	—	—	3	126
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2	91	2	73
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	—	—	3	71
	EQUINIX INC	0.031	22	0.443	295
	AMERICAN HOMES 4 RENT PFD-G	0.902	23	6	149
	RLJ LODGING TRUST PFD-A	2	62	2	55
	EQUITY RESIDENTIAL	—	—	3	246
	INVITATION HOMES INC	0.205	8	4	143
VICI PROPERTIES INC	0.714	20	8	268	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	2	55	2	65	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	—	—	3	77	
BROADSTONE NET LEASE INC	1	25	2	49	
PUBLIC STORAGE	0.106	44	0.965	301	

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	MONMOUTH REIT PFD-C	—	—	0.409 (6)	10 (162)
	SPIRIT REALTY CAPITAL IN PFD-A	0.381	9	6	135
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.155	20	2	220
	KIMCO REALTY CORP	—	—	4	96
小 計		15 (0.006)	697 (3)	123 (6)	6,104 (162)

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、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

(2021年12月15日～2022年12月13日)

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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
		百万円	$\frac{B}{A}$ %		百万円	$\frac{D}{C}$ %
為替直物取引	28	3	10.7	805	660	82.0

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2022年12月13日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

外国投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
(アメリカ)			千口
HEALTHPEAK PROPERTIES INC			6
AGREE REALTY CORP		0.289	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT			1
PROLOGIS INC			3
CAMDEN PROPERTY TRUST		0.925	
DIGITAL REALTY TRUST INC			1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.478	
FEDERAL REALTY INVS TRUST			1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR			1
WELLTOWER INC			3
HIGHWOODS PROPERTIES INC			2
KILROY REALTY CORP			1
LXP INDUSTRIAL TRUST			8
BOSTON PROPERTIES INC			1
MID-AMERICA APARTMENT COMM		0.7	
SL GREEN REALTY CORP			1
SUN COMMUNITIES INC		0.982	
CUBESMART			3
UDR INC			3
DOUGLAS EMMETT INC			4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN			2
STAG INDUSTRIAL INC			4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC			2
WP CAREY INC			2
SPIRIT REALTY CAPITAL INC			3
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN			3
EQUINIX INC		0.412	
AMERICAN HOMES 4 RENT PFD-G			5
EQUITY RESIDENTIAL			3
INVITATION HOMES INC			3
VICI PROPERTIES INC			7
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY			3
BROADSTONE NET LEASE INC			1
PUBLIC STORAGE		0.859	
MONMOUTH REIT PFD-C			6
SPIRIT REALTY CAPITAL IN PFD-A			5
SIMON PROPERTY GROUP INC			1
KIMCO REALTY CORP			4
合 計		口	数
		銘	柄
			数
			114
			38

○投資信託財産の構成

(2022年12月13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 545,374	% 100.0
投資信託財産総額	545,374	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2022年12月13日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	545,374,030
コール・ローン等	545,374,030
(B) 負債	1,320
未払利息	1,320
(C) 純資産総額(A-B)	545,372,710
元本	232,498,402
償還差益金	312,874,308
(D) 受益権総口数	232,498,402口
1万口当たり償還価額(C/D)	23,457円05銭

<注記事項>

- ①期首元本額 325,914,489円
 期中追加設定元本額 27,360,927円
 期中一部解約元本額 120,777,014円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.345705円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ/マッコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	136,705,573円
三菱UFJ/マッコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	95,792,829円
合計	232,498,402円

【お知らせ】

- ①AMP キャピタル・インバスターズ・リミテッドのパブリック・マーケティング部門がマッコーリー・アセット・マネジメント・ホールディングス・ピーティワイ・リミテッドに売却されることに伴い、運用指図権限の委託先の変更およびファンド名称の変更等を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

ファンド名称の変更について

変更前：AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド

変更後：マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド

(2022年3月26日)

- ②当該投資信託を投資対象とする全ての投資信託が償還となるため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。

(2022年12月13日)

○損益の状況 (2021年12月15日～2022年12月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	25,731,534
受取配当金	25,577,044
受取利息	164,848
支払利息	△ 10,358
(B) 有価証券売買損益	△ 46,121,736
売買益	158,593,561
売買損	△204,715,297
(C) 保管費用等	△ 1,160,872
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 21,551,074
(E) 前期繰越損益金	473,229,295
(F) 追加信託差損益金	38,989,073
(G) 解約差損益金	△177,792,986
償還差益金(D+E+F+G)	312,874,308

- (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。
 (注) (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。
 (注) (G)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。