

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ません。 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。

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 ＜為替ヘッジなし＞（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＜為替ヘッジなし＞（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 純 資 産 額	
		税 分 込 配	み 期 騰 落	中 率		
	円 銭		円	%	%	百万円
89期(2020年7月14日)	6,907		70	△ 2.9	98.4	411
90期(2020年8月14日)	7,212		70	5.4	98.6	422
91期(2020年9月14日)	7,006		70	△ 1.9	98.8	409
92期(2020年10月14日)	7,122		70	2.7	98.1	417
93期(2020年11月16日)	7,208		70	2.2	98.5	408
94期(2020年12月14日)	7,019		70	△ 1.7	98.0	395
95期(2021年1月14日)	6,970		70	0.3	97.4	383
96期(2021年2月15日)	7,492		50	8.2	98.3	408
97期(2021年3月15日)	7,907		50	6.2	98.4	427
98期(2021年4月14日)	8,113		50	3.2	98.0	433
99期(2021年5月14日)	8,268		50	2.5	98.6	442
100期(2021年6月14日)	9,013		50	9.6	97.3	476
101期(2021年7月14日)	9,025		50	0.7	98.3	446
102期(2021年8月16日)	9,117		50	1.6	98.2	431
103期(2021年9月14日)	9,099		50	0.4	98.4	408
104期(2021年10月14日)	9,441		50	4.3	98.6	423
105期(2021年11月15日)	9,828		50	4.6	98.8	423
106期(2021年12月14日)	9,933		50	1.6	98.7	417
107期(2022年1月14日)	9,985		50	1.0	97.5	420
108期(2022年2月14日)	9,414		50	△ 5.2	97.4	395
109期(2022年3月14日)	9,641		50	2.9	96.9	392
110期(2022年4月14日)	10,685		50	11.3	97.4	431
111期(2022年5月16日)	9,640		50	△ 9.3	98.9	380
112期(2022年6月14日)	8,937		50	△ 6.8	97.8	352
113期(2022年7月14日)	9,449		50	6.3	98.0	373
114期(2022年8月15日)	10,028		50	6.7	98.0	392
115期(2022年9月14日)	9,972		50	△ 0.1	97.9	378
116期(2022年10月14日)	8,731		50	△ 11.9	97.9	316
117期(2022年11月14日)	9,053		50	4.3	98.3	329
(償還時)	(償還価額)					
118期(2022年12月14日)	8,829.71		—	△ 2.5	—	321

(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	8,937		—	97.8
	(期 末) 2022年7月14日	9,498		6.3	97.7
第114期	(期 首) 2022年7月14日	9,499		6.3	98.0
	7 月 末	9,449		—	98.0
	(期 末) 2022年8月15日	9,925		5.0	98.0
第115期	(期 首) 2022年8月15日	10,078		6.7	98.0
	8 月 末	10,028		—	98.0
	(期 末) 2022年9月14日	9,647		△ 3.8	98.5
第116期	(期 首) 2022年9月14日	10,022		△ 0.1	97.9
	9 月 末	9,972		—	97.9
	(期 末) 2022年10月14日	8,758		△12.2	96.8
第117期	(期 首) 2022年10月14日	8,781		△11.9	97.9
	10 月 末	8,731		—	97.9
	(期 末) 2022年11月14日	9,232		5.7	97.2
第118期	(期 首) 2022年11月14日	9,103		4.3	98.3
	11 月 末	9,053		—	98.3
	(償還時) 2022年12月14日	8,964	(償還価額)	△ 1.0	—
		8,829.71		△ 2.5	—

(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	8,829.71円
既払分配金	8,300円
騰落率	100.9%
	(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100.9% (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

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。

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。

▶ 為替市況

為替市況は設定時に比べ、44.4%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

▶ 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）

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8,300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）	50 (0.526%)	50 (0.496%)	50 (0.499%)	50 (0.569%)	50 (0.549%)
当期の収益	50	40	0	49	7
当期の収益以外	—	9	49	0	42
翌期繰越分配対象額	3,575	3,566	3,516	3,516	3,473

（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＜為替ヘッジなし＞ （毎月決算型）

償還価額は、8,829円71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	80	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)	(45)	(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)	(31)	(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)	(4)	(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	4	0.044	(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)	(4)	(0.044)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(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)	(0.003)	
(d) その他費用	8	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)	(8)	(0.083)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	92	0.988	

作成期中の平均基準価額は、9,332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。

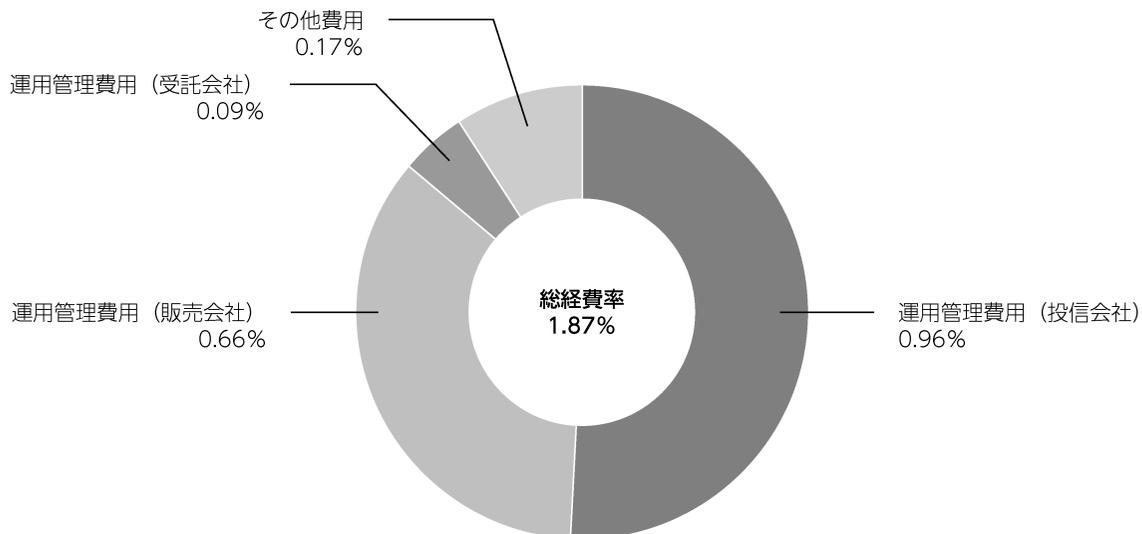
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	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		3,490	8,210	156,554	369,380

○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<為替ヘッジなし>（毎月決算型）>

該当事項はございません。

<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 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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	%	
為替直物取引	16	3	18.8	646	597	92.4

平均保有割合 58.2%

※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
			千口
マッコーリー 米国ハイインカムリートマザーファンド			153,063

○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 322,335	% 100.0
投資信託財産総額	322,335	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	376,841,642	395,242,002	384,423,161	319,270,391	332,111,714	322,335,888
コール・ローン等	4,068,457	4,230,391	4,188,867	3,470,491	3,871,093	322,335,888
マスコリー 種ハイインカムリートファンド(譲渡)	372,773,185	391,011,611	376,634,294	315,799,900	328,240,621	—
未収入金	—	—	3,600,000	—	—	—
(B) 負債	2,996,903	2,531,577	5,960,022	2,389,371	2,396,833	456,565
未払収益分配金	1,978,124	1,958,021	1,897,624	1,814,716	1,821,001	—
未払解約金	500,000	—	3,522,102	100,033	100,056	42
未払信託報酬	517,590	572,238	539,049	473,527	474,673	454,725
未払利息	—	1	4	5	8	754
その他未払費用	1,189	1,317	1,243	1,090	1,095	1,044
(C) 純資産総額(A-B)	373,844,739	392,710,425	378,463,139	316,881,020	329,714,881	321,879,323
元本	395,624,954	391,604,378	379,524,850	362,943,233	364,200,209	364,541,331
次期繰越損益金	△ 21,780,215	1,106,047	△ 1,061,711	△ 46,062,213	△ 34,485,328	—
償還差損金	—	—	—	—	—	△ 42,662,008
(D) 受益権総口数	395,624,954口	391,604,378口	379,524,850口	362,943,233口	364,200,209口	364,541,331口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,449円	10,028円	9,972円	8,731円	9,053円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	8,829円71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	△ 30	△ 9	△ 58	△ 90	△ 124	△ 858
受取利息	1	—	—	—	—	—
支払利息	△ 31	△ 9	△ 58	△ 90	△ 124	△ 858
(B) 有価証券売買損益	22,765,529	25,195,141	307,342	△ 42,729,487	13,738,188	△ 7,687,740
売買益	22,809,452	25,318,426	440,471	1,653,554	13,900,718	1,870
売買損	△ 43,923	△ 123,285	△ 133,129	△ 44,383,041	△ 162,530	△ 7,689,610
(C) 信託報酬等	△ 518,779	△ 573,555	△ 540,292	△ 474,617	△ 475,768	△ 455,769
(D) 当期損益金(A+B+C)	22,246,720	24,621,577	△ 233,008	△ 43,204,194	13,262,296	△ 8,144,367
(E) 前期繰越損益金	370,477	20,402,088	41,670,843	37,744,297	△ 7,116,103	4,323,860
(F) 追加信託差損益金	△ 42,419,288	△ 41,959,597	△ 40,601,922	△ 38,787,600	△ 38,810,520	△ 38,841,501
(配当等相当額)	(76,014,895)	(75,336,317)	(73,112,639)	(70,022,999)	(71,723,070)	(71,859,830)
(売買損益相当額)	(△118,434,183)	(△117,295,914)	(△113,714,561)	(△108,810,599)	(△110,533,590)	(△110,701,331)
(G) 計(D+E+F)	△ 19,802,091	3,064,068	835,913	△ 44,247,497	△ 32,664,327	—
(H) 収益分配金	△ 1,978,124	△ 1,958,021	△ 1,897,624	△ 1,814,716	△ 1,821,001	—
次期繰越損益金(G+H)	△ 21,780,215	1,106,047	△ 1,061,711	△ 46,062,213	△ 34,485,328	—
償還差損金(D+E+F+H)	—	—	—	—	—	△ 42,662,008
追加信託差損益金	△ 42,419,288	△ 41,959,597	△ 40,601,922	△ 38,787,600	△ 38,810,520	—
(配当等相当額)	(76,022,510)	(75,337,353)	(73,113,172)	(70,025,871)	(71,724,394)	(—)
(売買損益相当額)	(△118,441,798)	(△117,296,950)	(△113,715,094)	(△108,813,471)	(△110,534,914)	(—)
分配準備積立金	65,441,589	64,311,611	60,348,769	57,603,461	54,790,804	—
繰越損益金	△ 44,802,516	△ 21,245,967	△ 20,808,558	△ 64,878,074	△ 50,465,612	—

(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 394,893,341円
 作成期中追加設定元本額 13,022,800円
 作成期中一部解約元本額 43,374,810円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.882971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42,662,008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	2,406,654円	1,579,475円	17,691円	1,810,445円	263,449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	76,022,510円	75,337,353円	73,113,172円	70,025,871円	71,724,394円
分配準備積立金額	65,013,059円	64,690,157円	62,228,702円	57,607,732円	56,348,356円
当ファンドの分配対象収益額	143,442,223円	141,606,985円	135,359,565円	129,444,048円	128,336,199円
1万口当たり収益分配対象額	3,625円	3,616円	3,566円	3,566円	3,523円
1万口当たり分配金額	50円	50円	50円	50円	50円
収益分配金金額	1,978,124円	1,958,021円	1,897,624円	1,814,716円	1,821,001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	322,335,888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	456,565円
受益権口数	10,000,000口	364,541,331口	354,541,331口	純資産総額	321,879,323円
元本額	10,000,000円	364,541,331円	354,541,331円	受益権口数	364,541,331口
				1万円当たり償還金	8,829円71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	10,000,000円	10,517,029円	10,517円	0円	0.0%
第2期	10,000,000	11,381,232	11,381	0	0.0
第3期	10,000,000	12,163,977	12,164	0	0.0
第4期	10,000,000	10,477,301	10,477	0	0.0
第5期	10,000,000	11,285,215	11,285	0	0.0
第6期	368,646,314	390,003,061	10,579	70	0.7
第7期	1,020,659,464	1,068,383,738	10,468	70	0.7
第8期	1,351,705,909	1,418,927,490	10,497	70	0.7
第9期	1,454,700,783	1,519,397,394	10,445	70	0.7
第10期	1,525,497,436	1,591,508,841	10,433	70	0.7
第11期	1,511,911,587	1,597,027,327	10,563	70	0.7
第12期	1,544,581,020	1,667,153,368	10,794	70	0.7
第13期	1,351,467,069	1,465,443,066	10,843	70	0.7
第14期	1,104,334,758	1,198,433,433	10,852	70	0.7
第15期	1,096,204,884	1,232,538,372	11,244	70	0.7
第16期	1,021,792,386	1,152,477,819	11,279	70	0.7
第17期	1,065,922,680	1,208,567,523	11,338	70	0.7
第18期	1,092,630,965	1,245,802,560	11,402	70	0.7
第19期	1,119,326,088	1,288,784,397	11,514	70	0.7
第20期	1,311,747,923	1,499,524,323	11,431	70	0.7
第21期	1,306,726,691	1,685,071,411	12,895	70	0.7
第22期	1,781,658,539	2,360,510,032	13,249	70	0.7
第23期	1,826,839,803	2,522,688,871	13,809	70	0.7
第24期	1,895,267,517	2,605,656,587	13,748	70	0.7
第25期	1,846,810,597	2,513,221,999	13,608	70	0.7
第26期	1,694,064,144	2,278,421,838	13,449	70	0.7
第27期	1,666,251,047	2,146,278,634	12,881	70	0.7
第28期	1,589,942,705	2,094,987,944	13,176	70	0.7
第29期	1,538,718,775	2,029,508,212	13,190	70	0.7
第30期	1,479,313,626	1,957,849,635	13,235	70	0.7
第31期	1,310,594,697	1,579,090,800	12,049	70	0.7

三菱UFJマコーリー 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジなし> (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	1,254,501,518円	1,556,129,815円	12,404円	70円	0.7%
第33期	1,191,404,191	1,464,876,013	12,295	70	0.7
第34期	1,180,138,379	1,435,993,991	12,168	70	0.7
第35期	1,117,786,140	1,296,101,504	11,595	70	0.7
第36期	1,120,511,846	1,211,569,233	10,813	70	0.7
第37期	1,128,293,045	1,337,875,171	11,858	70	0.7
第38期	1,105,869,881	1,293,056,007	11,693	70	0.7
第39期	1,122,470,504	1,312,000,257	11,689	70	0.7
第40期	1,131,972,550	1,300,260,179	11,487	70	0.7
第41期	1,123,522,760	1,340,347,570	11,930	70	0.7
第42期	1,125,119,861	1,323,595,640	11,764	70	0.7
第43期	1,228,303,786	1,391,123,647	11,326	70	0.7
第44期	1,255,191,546	1,419,695,091	11,311	70	0.7
第45期	1,197,332,555	1,308,341,363	10,927	70	0.7
第46期	1,008,412,735	1,239,434,768	12,291	70	0.7
第47期	946,550,608	1,160,084,107	12,256	70	0.7
第48期	956,904,172	1,163,002,476	12,154	100	1.0
第49期	979,338,370	1,148,627,030	11,729	100	1.0
第50期	988,727,639	1,143,101,122	11,561	100	1.0
第51期	995,066,810	1,119,416,615	11,250	100	1.0
第52期	1,128,134,461	1,258,362,774	11,154	100	1.0
第53期	1,053,770,476	1,191,650,341	11,308	100	1.0
第54期	1,156,823,831	1,239,625,606	10,716	100	1.0
第55期	1,107,557,663	1,224,494,172	11,056	100	1.0
第56期	985,936,200	1,099,040,715	11,147	100	1.0
第57期	946,271,059	1,044,184,425	11,035	100	1.0
第58期	893,288,178	969,088,447	10,849	100	1.0
第59期	838,568,476	855,040,528	10,196	100	1.0
第60期	972,640,286	904,908,270	9,304	100	1.0
第61期	955,199,129	884,219,315	9,257	100	1.0
第62期	965,978,527	889,930,745	9,213	100	1.0
第63期	968,011,876	939,119,510	9,702	100	1.0
第64期	947,008,855	950,549,950	10,037	100	1.0
第65期	918,644,560	954,544,197	10,391	100	1.0
第66期	916,950,009	927,525,247	10,115	100	1.0
第67期	933,973,321	969,842,660	10,384	100	1.0
第68期	906,303,507	864,699,953	9,541	100	1.0
第69期	916,226,868	915,823,468	9,996	100	1.0
第70期	903,654,466	871,201,115	9,641	100	1.0
第71期	906,147,150	802,181,176	8,853	100	1.0

三菱UFJマコーラー 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)

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	901,866,603円	873,344,459円	9,684円	100円	1.0%
第73期	902,009,135	879,006,323	9,745	100	1.0
第74期	840,334,491	835,559,378	9,943	100	1.0
第75期	837,338,232	807,745,533	9,647	100	1.0
第76期	828,676,291	792,040,485	9,558	100	1.0
第77期	823,714,969	775,858,026	9,419	100	1.0
第78期	880,226,165	818,013,650	9,293	70	0.7
第79期	872,919,746	839,819,160	9,621	70	0.7
第80期	870,292,022	843,907,624	9,697	70	0.7
第81期	828,630,852	803,777,670	9,700	70	0.7
第82期	768,103,697	727,865,119	9,476	70	0.7
第83期	760,980,666	733,496,677	9,639	70	0.7
第84期	709,527,670	681,990,460	9,612	70	0.7
第85期	633,250,406	450,535,091	7,115	70	0.7
第86期	628,991,885	430,443,958	6,843	70	0.7
第87期	631,151,599	397,279,162	6,295	70	0.7
第88期	633,365,565	455,062,860	7,185	70	0.7
第89期	595,377,518	411,254,962	6,907	70	0.7
第90期	586,445,748	422,950,216	7,212	70	0.7
第91期	584,811,836	409,691,185	7,006	70	0.7
第92期	585,854,135	417,237,188	7,122	70	0.7
第93期	566,287,829	408,176,408	7,208	70	0.7
第94期	563,737,217	395,710,207	7,019	70	0.7
第95期	549,766,151	383,172,631	6,970	70	0.7
第96期	545,685,954	408,839,300	7,492	50	0.5
第97期	540,990,333	427,749,901	7,907	50	0.5
第98期	534,444,463	433,583,570	8,113	50	0.5
第99期	535,092,172	442,436,992	8,268	50	0.5
第100期	528,924,642	476,707,099	9,013	50	0.5
第101期	494,477,696	446,242,049	9,025	50	0.5
第102期	473,769,610	431,928,321	9,117	50	0.5
第103期	449,292,399	408,833,127	9,099	50	0.5
第104期	449,010,999	423,895,208	9,441	50	0.5
第105期	430,751,614	423,337,700	9,828	50	0.5
第106期	420,000,731	417,199,058	9,933	50	0.5
第107期	421,044,780	420,420,079	9,985	50	0.5
第108期	420,168,671	395,552,160	9,414	50	0.5
第109期	406,702,208	392,085,602	9,641	50	0.5
第110期	403,982,462	431,657,775	10,685	50	0.5
第111期	394,897,002	380,667,261	9,640	50	0.5

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	394,893,341円	352,905,869円	8,937円	50円	0.5%
第113期	395,624,954	373,844,739	9,449	50	0.5
第114期	391,604,378	392,710,425	10,028	50	0.5
第115期	379,524,850	378,463,139	9,972	50	0.5
第116期	362,943,233	316,881,020	8,731	50	0.5
第117期	364,200,209	329,714,881	9,053	50	0.5

○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）	50円	50円	50円	50円	50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）	8,829円71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)	(償還価額)					
10期(2022年12月13日)	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	— (0.006)	— (3)	1	64
	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・ピーティーワイ・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。