

## ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信／海外／株式	
信託期間	2020年3月30日から2025年3月28日まで	
運用方針	<p>①主に中国の上海証券取引所および深セン証券取引所に上場する人民元建て株式（中国A株）に投資し、信託財産の成長を目指します。</p> <p>②実質的な運用は、中国の総合金融会社である中国平安保険グループ傘下の平安ファンド・マネジメント・カンパニー・リミテッドが行います。</p> <p>③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>	
主要投資対象	東洋・中国A株ファンド「創新」2020-03	「United China A-Shares Innovation Fund」および「マネー・ポートフォリオ・マザーファンド」
	United China A-Shares Innovation Fund	上海・深セン証券取引所に上場されている中国A株
主な組入制限	東洋・中国A株ファンド「創新」2020-03	<p>①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>③デリバティブの直接利用は行いません。</p> <p>④株式への直接投資は行いません。</p>
	United China A-Shares Innovation Fund	<p>①有価証券の空売りは行いません。</p> <p>②流動性に欠ける資産への投資は行いません。</p> <p>③純資産総額の10%を超える借入れを行いません。</p> <p>④為替ヘッジは行いません。</p>
	マネー・ポートフォリオ・マザーファンド	<p>①株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p>
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、元本超過額、または経費控除後の配当等収益のいずれが多い額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>	

# 東洋・中国A株ファンド 「創新」2020-03

第3期（決算日 2022年7月25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、「東洋・中国A株ファンド「創新」2020-03」は、このたび第3期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



<https://www.sompo-am.co.jp/>

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			騰落率	受利益 回	債組入比	債券 率	投資信託 組入比	元残存 本率
		税金 分	込 配	み 金						
(設定日)	円									
2020年3月30日	10,000									100.0
1期(2020年7月27日)	13,984		0		3,984	39.8	121.2	—	95.8	97.3
2期(2021年7月26日)	20,575		0		6,591	47.1	79.7	—	94.8	53.8
3期(2022年7月25日)	18,792		0		△1,783	△8.7	37.8	—	96.4	19.7

(注1) 基準価額の騰落額及び騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万口当たり(以下同じ)。

(注3) 受益者利回りは、基準価額(分配金込み)の当初元本(10,000円)に対する騰落率を年率換算したものです。

(注4) 債券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注5) 投資信託証券組入比率はUnited China A-Shares Innovation Fundの組入比率。

(注6) 当ファンドは、United China A-Shares Innovation Fundの投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債組入比	債券 率	投資信託 組入比	信託 証券 率
(期首)	円	%		%		%
2021年7月26日	20,575	—		—		94.8
7月末	19,844	△3.6		—		95.2
8月末	19,143	△7.0		—		95.7
9月末	18,747	△8.9		—		78.9
10月末	19,980	△2.9		—		95.5
11月末	20,089	△2.4		—		95.9
12月末	19,225	△6.6		—		95.2
2022年1月末	17,713	△13.9		—		89.9
2月末	17,794	△13.5		—		95.8
3月末	17,461	△15.1		—		89.3
4月末	16,415	△20.2		—		95.1
5月末	16,672	△19.0		—		96.0
6月末	19,542	△5.0		—		95.1
(期末)						
2022年7月25日	18,792	△8.7		—		96.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

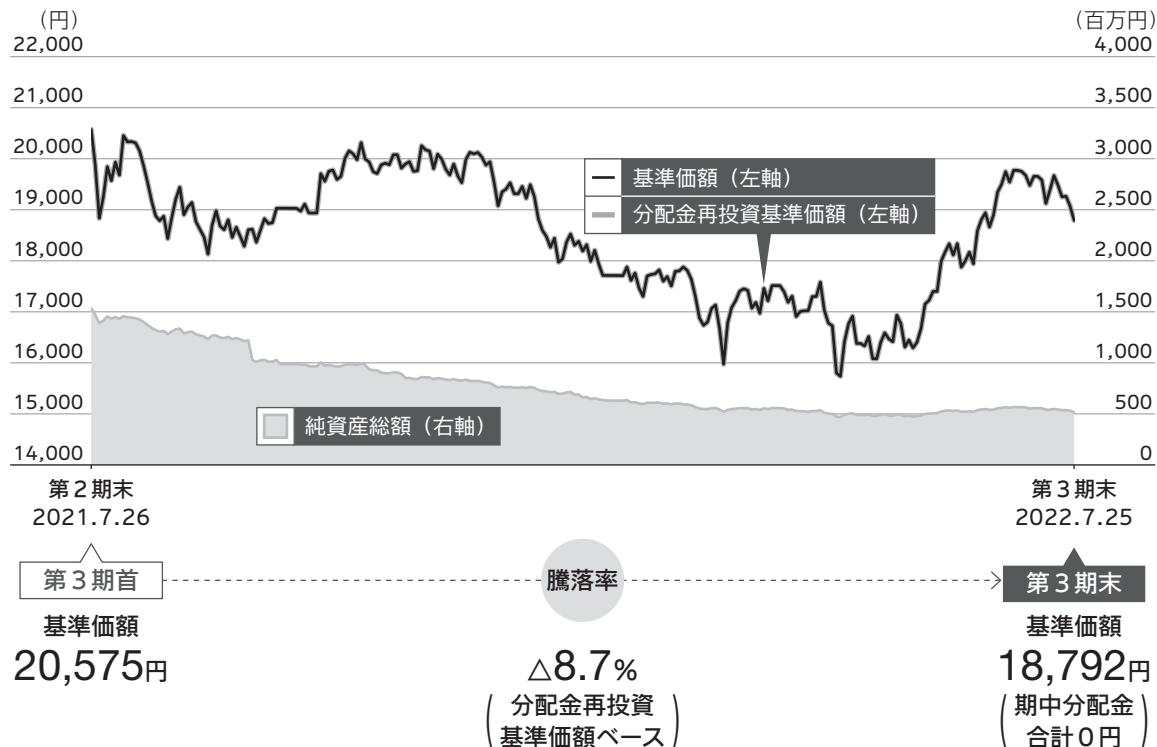
(注2) 債券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 投資信託証券組入比率はUnited China A-Shares Innovation Fundの組入比率。

(注4) 当ファンドは、United China A-Shares Innovation Fundの投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## 運用経過

## ● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、2021年7月26日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金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。
- 単位型投資信託は実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。
- 当ファンドは、United China A-Shares Innovation Fundの投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 東洋・中国A株ファンド「創新」2020-03

当期は、主要投資対象であるUnited China A-Shares Innovation Fundが下落したことから、当ファンドの基準価額は下落しました。

- 本報告書では、ベビーファンド、マザーファンド及びマザーファンド以外のファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド    マザーファンド    マザーファンド以外のファンド

## ● 投資環境

### ○中国株式市場

中国株式市場は下落しました。

期初から2021年の年末にかけては、中央銀行である中国人民銀行による1年2カ月ぶりの預金準備率引き下げが好感された一方、不動産大手の中国恒大集団の経営危機や、新型コロナウイルスの変異株の世界的な流行などが嫌気され、方向感の定まらない動きになりました。

2022年の年明け以降は物価上昇を受け、各国で利上げの動きが強まったことや、2月にはロシアがウクライナに侵攻し、先行き不透明感から下落しました。

3月は、中国国内の新型コロナウイルスの新規感染者数が再び増加し、ゼロコロナ政策のもと北京や上海で都市封鎖が行われ、景気減速懸念から大きく下落しました。

5月以降は、都市封鎖の解除や政府による景気刺激策への期待に加え、中国人民銀行が緩和的な金融政策を維持していることなどが好感され、下落幅をやや取り戻して期末を迎えました。

### ○為替市場

円に対して、中国人民元は大きく上昇しました。

#### 主要株式指数の推移



#### 為替レートの推移



注. 為替レートは対顧客電信売買相場の仲値を使用しております。

## ● 当該投資信託のポートフォリオ

当ファンドは、「United China A-Shares Innovation Fund」および「マネー・ポートフォリオ・マザーファンド」を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指して運用を行います。

原則として、United China A-Shares Innovation Fundの組入比率を高位に維持しました。

### United China A-Shares Innovation Fund

当ファンドは、中国の上海証券取引所および深セン証券取引所に上場する人民元建て株式（中国A株）の中から技術革新を生み出す企業や生活の質の向上につながる商品や技術を扱う銘柄を厳選して、投資を行いました。リチウム乾電池メーカーのEVE Energyや、コンピューターや通信機器等の部品を製造するLuxshare Precision Industry等の保有がマイナスに寄与しました。

### マネー・ポートフォリオ・マザーファンド

コール・ローン等の短期金融資産による運用を行いました。

## ● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、United China A-Shares Innovation Fundの投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券のコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、当期は分配を行いませんでした。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

## ● 今後の運用方針

### 東洋・中国A株ファンド「創新」2020-03

主として「United China A-Shares Innovation Fund」および「マネー・ポートフォリオ・マザーファンド」の投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目指します。

原則として、「United China A-Shares Innovation Fund」への投資比率を高位に保ちます。

### United China A-Shares Innovation Fund

主として、中国の上海証券取引所および深セン証券取引所に上場する人民元建て株式（中国A株）の中から、技術革新を生み出す企業や生活の質の向上につながる商品や技術を扱う銘柄を厳選して投資していきます。

### マネー・ポートフォリオ・マザーファンド

安全性、流動性の高いコール・ローン等短期金融資産による運用を行う方針です。

## ● 1万口当たりの費用明細

項目	第3期 2021.7.27~2022.7.25		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	220円	1.185%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は18,552円です。
( 投信会社 )	( 71 )	( 0.384 )	ファンドの運用の対価
( 販売会社 )	( 142 )	( 0.768 )	購入後の情報提供、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 )	( 6 )	( 0.033 )	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	3	0.019	(b) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
( 監査費用 )	( 3 )	( 0.018 )	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
( その他 )	( 0 )	( 0.000 )	信託事務の処理にかかるその他の費用等
<b>合計</b>	<b>223</b>	<b>1.204</b>	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

注2. 金額欄は各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。

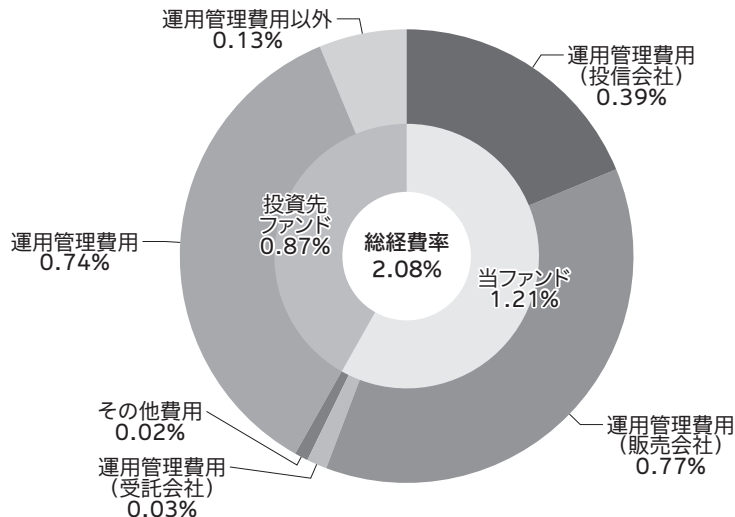
注4. 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。



## (参考情報)

## ○総経費率

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**総経費率（年率）は2.08%**です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	2.08
①当ファンドの費用の比率	1.21
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.74
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.13

注1. 当ファンドの費用は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、当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. 当ファンドの費用は、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. 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、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は異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2021年7月27日～2022年7月25日)

## 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	United China A-Shares Innovation Fund	12,884	313,870	47,046	1,150,260

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	マネー・ポートフォリオ・マザーファンド	1,483	1,480	11,754	11,730

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年7月27日～2022年7月25日)

該当事項はございません。

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。

## ○組入資産の明細

(2022年7月25日現在)

## 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

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
	United China A-Shares Innovation Fund	54,130	19,968	496,920	96.4%
	合計	54,130	19,968	496,920	96.4%

(注) 単位未満は切捨て。

## 親投資信託残高

銘柄		期首(前期末)	当期末	
		口数	口数	評価額
	マネー・ポートフォリオ・マザーファンド	15,566	5,295	5,281

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

## ○投資信託財産の構成

(2022年7月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	496,920	94.3
マネー・ポートフォリオ・マザーファンド	5,281	1.0
コール・ローン等、その他	24,972	4.7
投資信託財産総額	527,173	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ○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	当 期 末
	円
(A) 資産	527,173,750
コール・ローン等	24,972,140
投資信託受益証券(評価額)	496,920,159
マネー・ポートフォリオ・マザーファンド(評価額)	5,281,451
(B) 負債	11,474,837
未払解約金	8,536,770
未払信託報酬	2,886,731
未払利息	75
その他未払費用	51,261
(C) 純資産総額(A-B)	515,698,913
元本	274,430,000
次期繰越損益金	241,268,913
(D) 受益権総口数	274,430,000口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,792円

(注1) 2020年3月30日設定、設定当初元本額1,386,670,000円、当期首元本額746,300,000円、元本残存率(期末元本額の設定当初元本額に対する割合)19.7%

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.8792円

## ○損益の状況 (2021年7月27日～2022年7月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 41,279
支払利息	△ 41,279
(B) 有価証券売買損益	405,174,568
売買益	405,184,154
売買損	△ 9,586
(C) 有価証券評価差損益	△526,814,896
(D) 信託報酬等	△ 9,412,584
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△131,094,191
(F) 前期繰越損益金	789,209,018
(G) 解約差損益金	△416,845,914
(H) 計(E+F+G)	241,268,913
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	241,268,913

(注1) 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) 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。

(注3) 計算期間末における元本超過額は241,268,913円、分配可能額は△6,218,396円ですが、当期に分配した金額はありません。

## <参考情報>組入れ投資信託証券の内容

### ■主要投資対象の投資信託証券の概要

名称	United China A-Shares Innovation Fund (ユナイテッド チャイナ エーシェアーズ イノベーション ファンド)
形態	シンガポール籍外国投資信託 (円建て)
運用の基本方針	①上海・深セン証券取引所に上場されている中国A株を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指します。
主な投資制限	①有価証券の空売りは行いません。 ②流動性に欠ける資産への投資は行いません。 ③純資産総額の10%を超える借入れを行いません。 ④為替ヘッジは行いません。 <有価証券の発行者等に関するエクスポージャー> 1発行体10%以内 <取引の相手方に対するエクスポージャー> 評価益ベースで10%以内
決算日	毎年12月31日
信託報酬等	純資産総額に対して年率0.80% ※年間最低報酬額等がかかる場合は、純資産総額等により年率換算で上記の信託報酬率を上回ることがあります。 ※上記のほか、投資信託証券の設立・開示に関する費用等（監査費用、弁護士費用等）、売買委託手数料、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に関する租税等がかかります。
申込・解約手数料	ありません。
投資顧問会社	UOB Asset Management Ltd. (UOBアセットマネジメント・リミテッド)
副投資顧問会社	Ping An Fund Management Company Limited (平安ファンド・マネジメント・カンパニー・リミテッド)

※当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

## ■ 損益計算書

期間：2021年1月1日から2021年12月31日

### 収益

受取配当金	5,458,303
利息収入	247,878
収益合計	<u>5,706,181</u>

### 費用

管理報酬	6,086,781
信託報酬	260,832
監査報酬	16,053
名義書換費用	24,966
評価費用	1,571,147
保管費用	673,941
取引費用	2,340,701
その他費用	154,863
費用合計	<u>11,129,284</u>

### 純利益/（損失）

-5,423,103

### 投資およびデリバティブの純利益/（損失）

投資純利益/（損失）	-2,899,067
デリバティブ純利益/（損失）	-1,511,802
為替差益/（差損）	4,550,240
	<u>139,371</u>

### 税引前当期純利益/（損失）

-5,283,732

税金	-592,950
----	----------

税引後当期純利益/（損失）	<u>-5,876,682</u>
---------------	-------------------

## ■ポートフォリオ明細

2021年12月31日時点  
United China A-Shares Innovation Fund

	保有数量	公正価格 (\$)	純資産比率 (%)
業種別			
株式			
<b>一般消費財・サービス</b>			
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	357,488	15,445,216	2.17
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	860,200	8,577,475	1.20
HAIER SMART HOME CO LTD	809,249	5,116,565	0.72
<b>一般消費財・サービス合計</b>		<b>29,139,256</b>	<b>4.09</b>
<b>生活必需品</b>			
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	935,700	14,508,117	2.04
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	108,656	47,117,042	6.62
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	296,100	3,342,140	0.47
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	287,398	19,197,241	2.70
TONGWEI CO LTD	1,039,700	9,887,917	1.39
TSINGTAO BREWERY CO LTD	437,349	9,158,699	1.28
<b>生活必需品合計</b>		<b>103,211,156</b>	<b>14.50</b>
<b>金融</b>			
BANK OF NINGBO CO LTD	3,156,321	25,557,804	3.59
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	1,397,300	14,397,207	2.02
<b>金融合計</b>		<b>39,955,011</b>	<b>5.61</b>
<b>ヘルスケア</b>			
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	802,442	7,176,606	1.01
SHANDONG PHARMACEUTICAL GLASS CO LTD	573,700	5,327,455	0.75
SHENZHEN MINDRAY BIO MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	328,400	26,452,732	3.72
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL LTD	47,100	4,355,338	0.61
<b>ヘルスケア合計</b>		<b>43,312,131</b>	<b>6.09</b>

	保有数量	公正価格 ( \$ )	純資産比率 ( % )
業種別			
株式			
<b>資本財・サービス</b>			
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	974,500	7,385,826	1.04
BEIJING SIFANG AUTOMATION CO LTD	926,000	4,093,810	0.58
CENTRE TESTING INTERNATIONAL GROUP CO LTD	1,220,000	6,934,225	0.97
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	313,146	38,948,850	5.47
EVE ENERGY CO LTD	757,367	18,933,060	2.66
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	578,582	7,895,187	1.11
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	1,245,701	18,076,252	2.54
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	1,048,400	9,349,708	1.31
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CO	462,830	2,476,923	0.35
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	1,059,100	3,830,924	0.54
<b>資本財・サービス合計</b>		<b>117,924,765</b>	<b>16.57</b>
<b>情報技術</b>			
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	693,200	6,221,599	0.87
GOERTEK INC	881,500	10,087,651	1.42
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	1,024,498	13,468,607	1.89
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	1,634,229	29,798,241	4.19
LONGSHINE TECHNOLOGY GROUP	2,789,630	21,850,972	3.07
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	1,954,300	20,338,868	2.86
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	290,794	21,345,700	3.00
SG MICRO CORP	56,100	3,666,839	0.52
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG CO LTD	387,400	11,343,026	1.59
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	3,422,300	9,613,612	1.35
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	381,406	18,749,690	2.63
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	115,900	1,647,001	0.23
<b>情報技術合計</b>		<b>168,131,806</b>	<b>23.62</b>
<b>素材</b>			
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	1,086,150	12,103,362	1.70
GANFENG LITHIUM CO LTD	433,000	13,083,941	1.84
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	1,079,082	26,169,713	3.68

	保有数量	公正価格 (\$)	純資産比率 (%)
業種別			
株式			
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	251,900	6,990,890	0.98
<b>素材合計</b>		<b>58,347,906</b>	<b>8.20</b>
不動産			
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	3,724,800	10,510,642	1.48
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	6,250,402	20,665,094	2.90
<b>不動産合計</b>		<b>31,175,736</b>	<b>4.38</b>
公共事業			
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	12,521,600	14,170,463	1.99
HUANENG POWER INTL INC	6,581,900	13,491,042	1.90
<b>公共事業合計</b>		<b>27,661,505</b>	<b>3.89</b>
<b>株式合計</b>		<b>618,859,272</b>	<b>86.95</b>
<b>投資銘柄合計</b>		<b>618,859,272</b>	<b>86.95</b>
<b>その他純資産 / (負債)</b>		<b>92,919,217</b>	<b>13.05</b>
<b>投資家に帰属する純資産</b>		<b>711,778,489</b>	<b>100.00</b>

(注1) UOBアセットマネジメント・リミテッドからのデータ提供を受けて作成しております。

(注2) 作成時点において、入手可能な直近計算期間の財務諸表を用いております。



# マネー・ポートフォリオ・マザーファンド

## 運用報告書

第3期（決算日 2022年7月25日）

＜計算期間 2021年7月27日～2022年7月25日＞

マネー・ポートフォリオ・マザーファンドの第3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	無期限
運用方針	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債等
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限り、投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。

### ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
(設定日)	円		%		%	百万円
2019年7月31日	10,000		—		—	35
1期(2020年7月27日)	9,991		△0.1		—	291
2期(2021年7月26日)	9,982		△0.1		—	212
3期(2022年7月25日)	9,973		△0.1		—	83

(注1) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

(注2) 当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	日	基 準	価 額		債 組 入 比	券 率
				騰 落	率		
	(期 首)		円		%		%
	2021年	7月26日	9,982		—		—
	7月末		9,982		0.0		—
	8月末		9,981		△0.0		—
	9月末		9,981		△0.0		—
	10月末		9,980		△0.0		—
	11月末		9,979		△0.0		—
	12月末		9,978		△0.0		—
	2022年	1月末	9,977		△0.1		—
	2月末		9,977		△0.1		—
	3月末		9,976		△0.1		—
	4月末		9,975		△0.1		—
	5月末		9,974		△0.1		—
	6月末		9,973		△0.1		—
	(期 末)						
	2022年	7月25日	9,973		△0.1		—

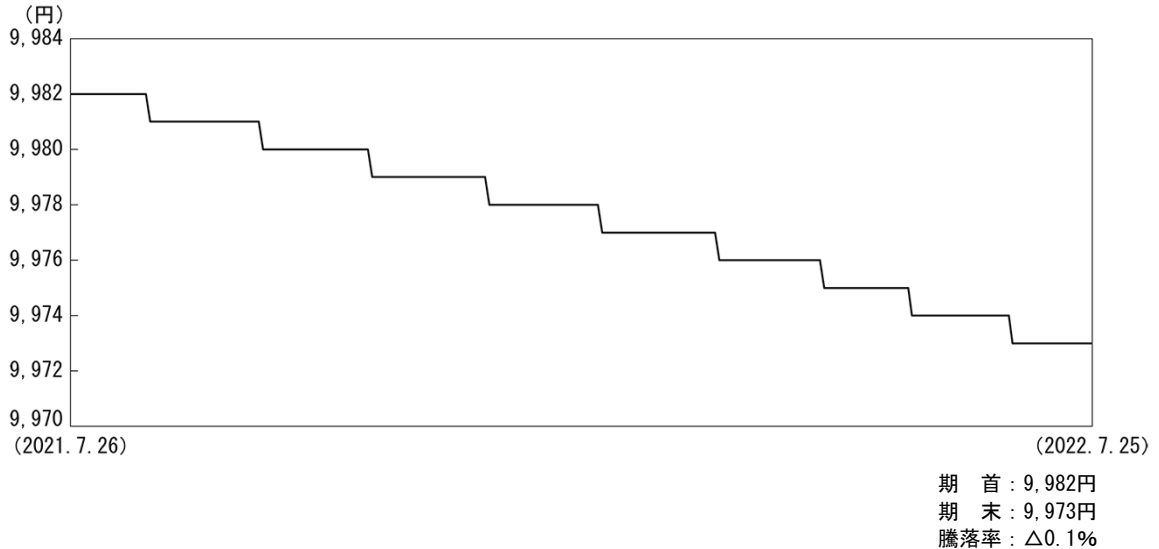
(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○運用経過

(2021年7月27日～2022年7月25日)

## ■基準価額の推移



## ■基準価額の主な変動要因

短期金融資産の利回りがマイナス圏で推移したことから、当期末の基準価額は期首の水準を小幅に下回りました。

## ■投資環境

日銀によるマイナス金利政策のもと、短期金融資産の利回りは期を通じてマイナス圏内で推移しました。

## ■当該投資信託のポートフォリオ

コール・ローン等の短期金融資産による運用を行いました。

## ■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ■今後の運用方針

安全性、流動性の高いコール・ローン等短期金融資産による運用を行う方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年7月27日～2022年7月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 0 (0)	% 0.003 (0.003)	(a)その他費用= $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 信託事務の処理にかかるその他の費用等
合 計	0	0.003	
期中の平均基準価額は9,977円です。			

(注1) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

## ○売買及び取引の状況

(2021年7月27日～2022年7月25日)

該当事項はございません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年7月27日～2022年7月25日)

該当事項はございません。

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。

## ○組入資産の明細

(2022年7月25日現在)

2022年7月25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

(2022年7月25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 83,969	% 100.0
投資信託財産総額	83,969	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ○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	当 期 末
	円
(A) 資産	83,969,091
コール・ローン等	83,969,091
(B) 負債	1,783
未払利息	253
その他未払費用	1,530
(C) 純資産総額(A-B)	83,967,308
元本	84,197,964
次期繰越損益金	△ 230,656
(D) 受益権総口数	84,197,964口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,973円

(注1) 信託財産に係る期首元本額212,868,937円、期中追加設定元本額27,172,967円、期中一部解約元本額155,843,940円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

東洋・中国A株ファンド「創新」	2019-07	13,026,712円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2019-08	5,332,641円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2019-09	11,626,472円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2019-10	7,329,868円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2019-11	7,872,987円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2019-12	10,527,380円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2020-01	13,254,849円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2020-02	9,831,064円
東洋・中国A株ファンド「創新」	2020-03	5,295,750円
SOMPOエイゴン・グローバル・サステナブル株式ファンド		100,241円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 0.9973円

(注4) 期末における元本の欠損金額 230,656円

## ○損益の状況 (2021年7月27日～2022年7月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△107,388
支払利息	△107,388
(B) 保管費用等	△ 3,893
(C) 当期損益金(A+B)	△111,281
(D) 前期繰越損益金	△380,348
(E) 追加信託差損益金	△ 62,967
(F) 解約差損益金	323,940
(G) 計(C+D+E+F)	△230,656
次期繰越損益金(G)	△230,656

(注1) 追加信託差損益金とは、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2) 解約差損益金とは、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。