

スマート・ラップ・グローバル・インカム (毎月分配型)

追加型投信／内外／資産複合

償還 交付運用報告書

第92期 (決算日2022年 8月22日) 第93期 (決算日2022年 9月20日)
第94期 (決算日2022年10月20日) 第95期 (償還日2022年11月21日)

作成対象期間 (2022年 7月21日～2022年11月21日)

| 第95期末 (2022年11月21日) | |
|---------------------|-----------|
| 償還価額 (税込み) | 8,347円03銭 |
| 純資産総額 | 185百万円 |
| 第92期 ～ 第95期 | |
| 騰落率 | △2.3% |
| 分配金 (税込み) 合計 | 60円 |

(注) 騰落率は分配金 (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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

○交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書 (全体版) に記載しております。

○当ファンドは、投資信託約款において運用報告書 (全体版) に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書 (全体版) は、下記の手順にて閲覧・ダウンロードいただけます。

<運用報告書 (全体版) の閲覧・ダウンロード方法>

右記URLにアクセス ⇒ ファンド検索機能を利用して該当ファンドのページを表示 ⇒ 運用報告書タブを選択 ⇒ 該当する運用報告書をクリックしてPDFファイルを表示

○運用報告書 (全体版) は、受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、「スマート・ラップ・グローバル・インカム (毎月分配型)」は、2022年11月21日に償還いたしました。

当ファンドは、主として、日本を含む世界の債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券 (MLPなどを含みます。) などに投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なってまいりました。

ここに、信託期間中の運用経過等についてご報告申し上げます。

これまでのみなさまのご愛顧に対しまして、心より厚くお礼申し上げますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

<642695>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

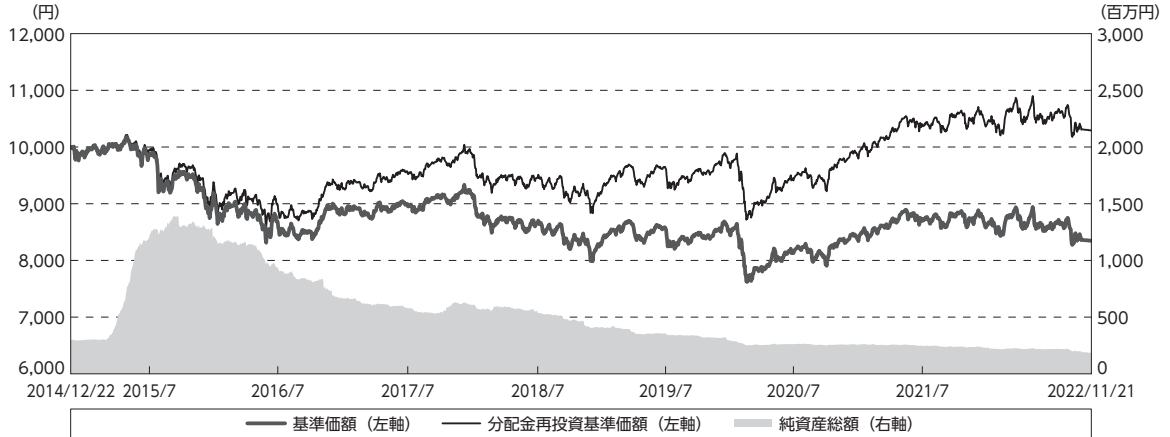
コールセンター 電話番号: 0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

運用経過

設定以来の基準価額等の推移

(2014年12月22日～2022年11月21日)



設 定 日：10,000円
 第95期末（償還日）：8,347円03銭（既払分配金（税込み）：1,820円）
 騰 落 率：2.9%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、日本を含む世界の債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券などに投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっておりまいた。信託期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・米国でトランプ政権が誕生し、積極的な景気刺激策による経済成長の加速期待が高まり、株価が上昇したこと。
- ・米中通商協議が進展したことや、欧州中央銀行（ECB）が金融緩和を決定したことで欧州の景気懸念が後退し、株価の上昇と債券利回りの低下（債券価格は上昇）が続いたこと。
- ・コロナ禍からの回復期待や歴史的な低金利環境を好感し、株価が大きく反発したこと。

＜値下がり要因＞

- ・設定当初に、欧米諸国で金利引き上げ懸念が広がり債券利回りが上昇（債券価格は下落）したこと。
- ・米国の金利上昇や米中貿易摩擦による景気への影響が懸念され、株価が下落したこと。
- ・新型コロナウイルスが世界中に感染拡大し、経済活動が大きく制限され、株価が大きく下落したこと。
- ・ロシアによるウクライナ侵攻やインフレなどによる景気低迷懸念が広がり、株価の下落と債券利回りの上昇が続いたこと。

1 万口当たりの費用明細

（2022年7月21日～2022年11月21日）

| 項 目 | 第92期～第95期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-----------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信託報酬 | 円 35 | % 0.411 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (10) | (0.116) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (24) | (0.280) | 運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価 |
| （受託会社） | (1) | (0.015) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 5 | 0.054 | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 |
| （株式） | (0) | (0.003) | 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （投資信託証券） | (4) | (0.051) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.002 | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 |
| （株式） | (0) | (0.001) | 有価証券取引税は、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) | (0.001) | |
| (d) その他費用 | 14 | 0.165 | (d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （保管費用） | (11) | (0.129) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （監査費用） | (0) | (0.001) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （印刷費用） | (3) | (0.033) | 印刷費用は、法定開示資料の印刷に係る費用 |
| （その他） | (0) | (0.002) | その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 54 | 0.632 | |
| 作成期間の平均基準価額は、8,483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す。

(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。

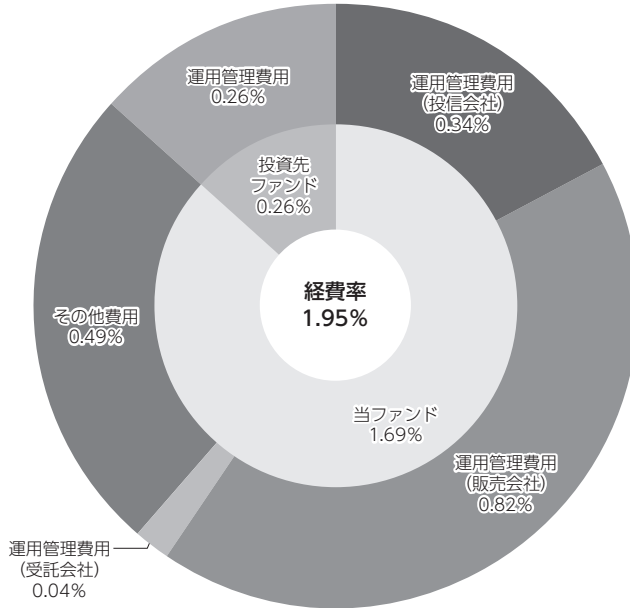
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注) この他にファンドが投資対象とする投資先においても信託報酬等が発生する場合があります。

(参考情報)

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.95%です。



(単位: %)

| | |
|--------------------|-------------|
| 経費率 (①+②) | 1.95 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.69 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.26 |

(注) 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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託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) 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) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注) 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。

最近5年間の基準価額等の推移

（2017年11月20日～2022年11月21日）



- (注) 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、2017年11月20日の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

| | 2017年11月20日 決算日 | 2018年11月20日 決算日 | 2019年11月20日 決算日 | 2020年11月20日 決算日 | 2021年11月22日 決算日 | 2022年11月21日 償還日 |
|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 基準価額 (円) | 9,007 | 8,328 | 8,410 | 8,219 | 8,780 | 8,347.03 |
| 期間分配金合計 (税込み) (円) | — | 240 | 240 | 240 | 240 | 220 |
| 分配金再投資基準価額騰落率 (%) | — | △ 4.9 | 3.9 | 0.6 | 9.8 | △ 2.5 |
| 純資産総額 (百万円) | 582 | 463 | 321 | 254 | 238 | 185 |

- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。
- (注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。
- (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

投資環境

（2014年12月22日～2022年11月21日）

（債券市況）

期間の初めは、米国による早期の利上げ観測や、欧州でのデフレ観測後退により、総じて債券利回りは上昇しましたが、その後、2015年下半年から2016年の半ば頃までは、原油安の進行や世界経済の減速懸念を受けた投資家による安全資産への逃避需要の強まり、ECBなど中央銀行による追加金融緩和観測が広がり、各国の債券利回りは低下しました。2017年から2018年にかけては、景気の持ち直しにより、原油高、株高が続き、米国をはじめとして、債券利回りは上昇しました。しかし、2018年末頃には、原油価格や主要国の株式市場の軟調な推移から投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて、利回りは低下しました。その後も、米国において暫定予算が成立せず政府機関の一部が閉鎖されたことや、景気減速懸念が高まったことなどを受けて、利回りは低下しました。2019年の後半には、米中間の通商交渉や英国の欧州連合（EU）離脱を巡り、楽観的な見方が広がったことや、米国経済の底堅さが確認されたことなどにより、一旦利回りは上昇しました。しかし、2020年には、新型コロナウイルスの感染拡大、オーストラリアの大規模な森林火災の長期化などが世界経済に与える悪影響が懸念され、投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、米国連邦準備制度理事会（FRB）の緊急利下げやECBによる金融緩和政策の長期化観測などを背景に、各国の債券利回りは総じて低下しました。2020年の後半には、歴史的な低金利状態の終了が意識されたことや、景気回復に伴う需要急増によるインフレ懸念が台頭し、債券利回りは大幅な上昇となりました。

（株式市況）

期間の初めは、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念や、中国の株式市場の急落に端を発した世界同時株安、ドイツ自動車メーカーによる排ガス規制に対する不正の発覚など悪材料が相つぎ、総じて大幅に下落しましたが、2016年には、原油価格の底打ちや世界的に政策当局などによる追加経済対策への期待が高まったこと、米国経済に対する楽観的な見方が強まったことなどから株価は上昇しました。その後も、米国大統領選挙後に米国次期政権の減税や財政支出拡大による景気刺激策が経済成長を加速させるとの期待が広がったことや石油輸出国機構（OPEC）とOPEC非加盟国が減産で合意し、今後の原油価格の安定が期待されたこと、ECBによる景気支援策などが好感されたことを背景に株価は上昇が続きました。2018年の後半には、地政学的リスクや米国の保護主義政策、利上げによる景気減速への警戒感が広がり、株価は調整しましたが、2019年には、年初に米中通商協議が合意に達したことや、ECBの金融緩和決定による景気懸念後退などが株価の支援材料となりました。2020年には、新型コロナウイルスの感染拡大、オーストラリアの大規模な森林火災の長期化などが世界経済に与える悪影響が懸念され、投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、FRBの緊急利下げやECBによる金融緩和政策の長期化観測などを背景に、各国の株式は急激な下落に見舞われましたが、歴史的な金融緩和や景気支援策などを背景に株価は急速に反発しました。期間末には、歴史的な低金利状態の終了が意識されたことや、景気回復による需要急増、ロシアによるウクライナ侵攻、および中国のゼロコロナ政策などによるサプライチェーン（供給網）の混乱が続いたことから、インフレ懸念が台頭し、各国中央銀行が金融引き締めを加速させたことから、株価は再び下落しました。

（不動産投資信託市況）

期間の初めは、米国の景気指標の発表内容によって利上げ観測が一進一退となりましたが、米国のREIT価格もこの動きに影響を受ける展開が続きました。欧州は、ECBによる量的緩和政策実施への期待と国債利回りの低下などが下支えとなり、安定的に推移しました。2016年の半ばまでは、世界的な金利低下が追い風となり上昇が続きましたが、その後、米国の堅調な景気指標から追加利上げ観測が強まったことなどにより米国の長期金利が上昇し、REITの魅力が低下したことから下落しました。2017年から2018年にかけては、金利上昇が嫌気される局面もありましたが、概ね上昇基調を維持しました。2018年の後半には株価が調整したことから、同様に下落しましたが、2019年には米中通商協議の合意やECBの金融緩和決定による景気懸念後退などにより、株価が上昇し、REITも同様に上昇しました。2020年2月に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による懸念の高まりや経済活動の停止への影響によって下落しましたが、4月には各国政府による前例のない景気刺激策を受けて反発し、3月の下げ幅を部分的に取り戻し、2021年末まで続く息の長いラリーとなりました。2022年に入ると、歴史的な低金利状態の終了が意識されたことや、景気回復に伴う需要急増によるインフレ懸念が台頭し、ロシアによるウクライナ侵攻などの地政学的リスクの台頭などにより、再び下落しました。

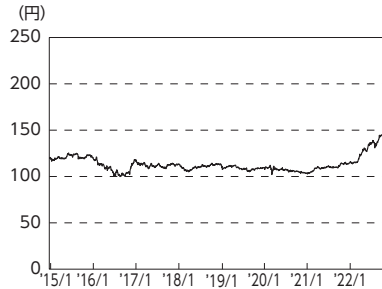
（商品（金）市況）

期間の初めは、米国の利上げ観測やその影響によるアメリカドル高などが嫌気され、金価格は軟調な展開となりましたが、2015年12月に利上げが実施され、金価格は材料出尽くしによるアメリカドル安や、持ち高調整などから上昇に転じました。2016年の後半には、再び米国の利上げ警戒感が強まったことや、アメリカドルの先高観を背景として金の価格は下落傾向となりました。同年10月に入ると米国の軟調な株式市場や米国大統領選挙に対する警戒感などから、安全資産として金を買戻す動きが見られ、2018年の前半まで、金市場へ資金が流入する状況が続き、金価格は上昇しました。その後、米中貿易問題や中東情勢の緊迫などの地政学的リスクが後退したことや、アメリカドル高などから安全資産への需要が低下し、金価格は下落基調が続きましたが、同年9月以降は株価下落や景気見通しへの懸念などを背景に安全資産への資金シフトが起こり、金価格は上昇に転じました。2019年から2020年の半ばまでは、FRBが引き締めから緩和に方針を転換したことにより、金に対する投資魅力が相対的に高まったことや、更に、2020年に発生した新型コロナウイルスの世界的な感染拡大、中国による香港国家安全法制定をめぐる米中関係の悪化に対する警戒感などから市場のリスク回避姿勢が強まったこと、世界の主要中央銀行による政策金利の引き下げや流動性供給策を受けて欧米主要国の長期金利が低下したこと、新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて世界経済の成長鈍化が懸念されたことなどから、金価格は急速に上昇しました。しかし、新型コロナウイルスの感染拡大の収束感の強まりやワクチン開発への期待、金利上昇懸念などによる利食い売りが広がり、2020年8月以降は下落に転じました。その後は一進一退の状況が続きましたが、2022年には各国中央銀行が金利引き上げを急いだことや、急速なアメリカドル上昇などが悪材料視され、金価格は下落しました。

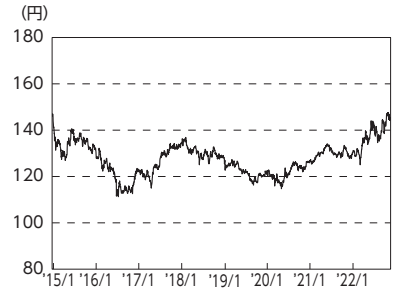
（為替市況）

信託期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。

円／アメリカドルの推移



円／ユーロの推移



当ファンドのポートフォリオ

（2014年12月22日～2022年11月21日）

（当ファンド）

主として、日本を含む世界の資産（債券、株式、不動産、商品（コモディティ）・その他）を実質的な投資対象としました。各資産への投資にあたっては、それぞれの資産を投資対象とする投資信託証券への投資を通じて行ないました。また、「日興アセットマネジメント アジア リミテッド」からの助言をもとに、市場環境の変化や各資産の基準価額変動への影響度合い、および市場見通しなどを勘案し、資産配分を行ないました。信託期間中における各資産への資産配分のポイントは以下の通りです。

成長資産である株式をはじめ、利回りによる安定的なリターンが期待される債券やリートのほか、リスクオフの局面でのヘッジ効果が期待されるゴールドなど、幅広い資産に投資することによる分散効果が期待されるポートフォリオを維持しました。

当ファンドは2014年12月22日の設定以来、約7年11ヵ月にわたり運用してまいりました。このたび、約款の規定に基づき、信託終了日を2022年11月21日として償還いたしました。

これまでのみなさまのご愛顧に対しまして、心より厚くお礼申し上げますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2014年12月22日～2022年11月21日）

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

（2014年12月22日～2022年11月21日）

信託期間中における分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案して決定し、1万口当たりの累計は1,820円（税込み）となりました。また、第92期～第94期における分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりとしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたしました。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

| 項 目 | 第92期 | 第93期 | 第94期 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|
| | 2022年7月21日 ～2022年8月22日 | 2022年8月23日 ～2022年9月20日 | 2022年9月21日 ～2022年10月20日 |
| 当期分配金 | 20 | 20 | 20 |
| （対基準価額比率） | 0.230% | 0.233% | 0.237% |
| 当期の収益 | 20 | 18 | 19 |
| 当期の収益以外 | — | 1 | 0 |
| 翌期繰越分配対象額 | 579 | 578 | 577 |

（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。

お知らせ

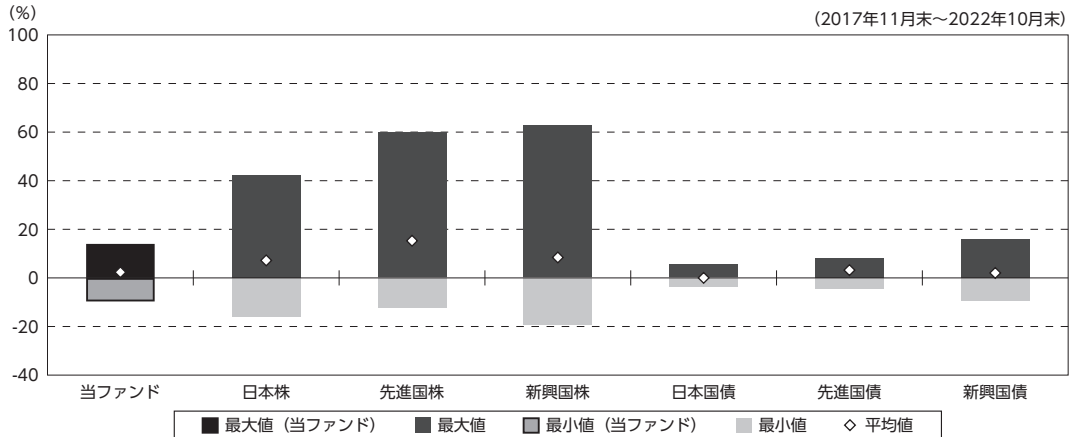
2022年7月21日から2022年11月21日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの概要

| | |
|--------|---|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合 |
| 信託期間 | 2014年12月22日から2022年11月21日までです。 |
| 運用方針 | 主として、日本を含む世界の債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券（MLPなどを含みます。）などに投資を行なう投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。）の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | 主として、日本を含む世界の債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券（MLPなどを含みます。）などに投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。市場環境の変化や各資産の基準価額変動への影響度合い、および市場見通しなどを勘案し、資産配分を調整します。 |
| 分配方針 | 第1計算期から第3計算期までは収益分配を行ないません。第4計算期以降、毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 |

(参考情報)

○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



| | 当ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|-----|-------|-------|-------|-------|------|------|------|
| 最大値 | 14.0 | 42.1 | 59.8 | 62.7 | 5.4 | 7.9 | 15.7 |
| 最小値 | △9.7 | △16.0 | △12.4 | △19.4 | △3.7 | △4.5 | △9.4 |
| 平均値 | 2.3 | 7.2 | 15.3 | 8.4 | 0.0 | 3.2 | 2.0 |

(注) 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 2017年11月から2022年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

(注) 上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

《各資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数 (TOPIX、配当込)

先進国株：MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込、円ベース)

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債：JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ヘッジなし、円ベース)

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

指数について

●東証株価指数 (TOPIX、配当込) は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、株式会社 J P X総研又は株式会社 J P X総研の関連会社に帰属します。●MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース) は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。●MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込、円ベース) は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ヘッジなし、円ベース) は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

(2022年11月21日現在)

2022年11月21日現在、有価証券等の組入れはございません。

純資産等

| 項 目 | 第92期末 | 第93期末 | 第94期末 | 第95期末(償還日) |
|----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 2022年8月22日 | 2022年9月20日 | 2022年10月20日 | 2022年11月21日 |
| 純 資 産 総 額 | 219,809,340円 | 208,242,900円 | 199,246,364円 | 185,579,190円 |
| 受 益 権 総 口 数 | 253,346,574口 | 242,708,788口 | 236,793,999口 | 222,329,608口 |
| 1万口当たり基準(償還)価額 | 8,676円 | 8,580円 | 8,414円 | 8,347円03銭 |

(注) 当作成期間(第92期~第95期)中における追加設定元本額は115,486円、同解約元本額は31,107,384円です。

スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）

【貸借対照表】

（単位：円）

| | 前期 2022年7月20日現在 | 当期 2022年11月21日現在 |
|-----------------|--------------------|---------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 312,047 | — |
| コール・ローン | 17,147,429 | 187,206,099 |
| 投資信託受益証券 | 153,182,050 | — |
| 親投資信託受益証券 | 48,064,015 | — |
| 流動資産合計 | 218,705,541 | 187,206,099 |
| 資産合計 | 218,705,541 | 187,206,099 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 506,643 | — |
| 未払解約金 | 74 | 1,252,299 |
| 未払受託者報酬 | 7,863 | 7,311 |
| 未払委託者報酬 | 208,627 | 194,020 |
| 未払利息 | 6 | 354 |
| その他未払費用 | 105,763 | 172,925 |
| 流動負債合計 | 828,976 | 1,626,909 |
| 負債合計 | 828,976 | 1,626,909 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 253,321,506 | 222,329,608 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | △35,444,941 | △36,750,418 |
| （分配準備積立金） | 8,900,779 | — |
| 元本等合計 | 217,876,565 | 185,579,190 |
| 純資産合計 | 217,876,565 | 185,579,190 |
| 負債純資産合計 | 218,705,541 | 187,206,099 |

【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 前期 | | 当期 | |
|---|--------|--------------------------|--------|---------------------------|
| | 自 至 | 2022年1月21日 2022年7月20日 | 自 至 | 2022年7月21日 2022年11月21日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 4,347,938 | | 2,309,158 |
| 受取利息 | | 4 | | 2 |
| 有価証券売買等損益 | | △11,762,612 | | △10,128,503 |
| 為替差損益 | | 9,737,560 | | 4,396,013 |
| その他収益 | | 105 | | — |
| 営業収益合計 | | 2,322,995 | | △3,423,330 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 872 | | 9,785 |
| 受託者報酬 | | 48,283 | | 30,915 |
| 委託者報酬 | | 1,281,117 | | 820,375 |
| その他費用 | | 335,425 | | 329,702 |
| 営業費用合計 | | 1,665,697 | | 1,190,777 |
| 営業利益又は営業損失（△） | | 657,298 | | △4,614,107 |
| 経常利益又は経常損失（△） | | 657,298 | | △4,614,107 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | | 657,298 | | △4,614,107 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△） | | △41,490 | | △236,742 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | | △34,810,500 | | △35,444,941 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,761,067 | | 4,554,252 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 1,761,067 | | 4,554,252 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | — | | — |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 40,364 | | 16,667 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | — | | — |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 40,364 | | 16,667 |
| 分配金 | | 3,053,932 | | 1,465,697 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | | △35,444,941 | | △36,750,418 |