



BNY MELLON

●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／内外／その他資産（通貨）／特殊型（絶対収益追求型）
信託期間	2006年5月8日から2016年2月26日まで
運用方針	投資信託証券を主要投資対象とし、中長期的に絶対収益を追求することを目標とします。
主要運用対象	主として、以下の投資信託の受益証券に投資し、日本円短期金利を上回る投資成果を目指します。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ケイマン籍の円建ての外国投資信託である「メロン・オブショア・ファンズー日興グローバル・カレンシー・ファンド（円建てファンド・オブ・ファンズ専用クラス）」（ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。）</li> <li>・国内の証券投資信託である「BNYメロン・マネーポートフォリオ・ファンド（適格機関投資家専用）」</li> </ul>
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ファンド・オブ・ファンズにのみ取得されることを目的とするもの以外の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。</li> <li>・株式への直接投資は、行いません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブの直接利用は行いません。</li> </ul>
分配方針	毎決算時（毎年4月20日。ただし、休業日の場合は翌営業日）に、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、長期的に信託財産の成長を追求する観点から、分配を行わないことがあります。

## 日興メロン・グローバル・カレンシー・オープン

追加型投信／内外／その他資産（通貨）／特殊型（絶対収益追求型）

### 償還運用報告書（全体版）

第10期（償還日：2016年2月26日）

#### 受益者のみなさまへ

平素は、格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「日興メロン・グローバル・カレンシー・オープン」は、2016年2月26日に繰上償還となりました。

謹んで運用状況と償還内容をご報告いたしますとともに、みなさまのご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

#### BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社

東京都千代田区丸の内1丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

ドキュメンテーション部

電話番号：03-6756-4600（代表）

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページ <http://www.bnymellonam.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		投資信託 組入比	純資産 総額
	(分配落)	税分 込配	み 金 騰 落 中 率	(3ヵ月円LIBOR)	騰 落 中 率		
	円 銭	円	%		%	%	百万円
6期(2012年4月20日)	7,750	0	△3.9	10,298.79	0.2	98.7	131
7期(2013年4月22日)	7,365	0	△5.0	10,318.03	0.2	97.8	108
8期(2014年4月21日)	6,819	0	△7.4	10,333.45	0.1	97.7	82
9期(2015年4月20日)	7,354	0	7.8	10,345.65	0.1	96.8	77
(償還時)	(償還価額)						
10期(2016年2月26日)	6,998.55	—	△4.8	10,352.93	0.1	—	22

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 3ヵ月円LIBORは2006年5月8日を10,000として指数化しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		参考指数		投資信託 組入比	託券率
	騰 落 率	騰 落 率	(3ヵ月円LIBOR)	騰 落 率		
(期首)	円 銭	%		%	%	
2015年4月20日	7,354	—	10,345.65	—	96.8	
4月末	7,301	△0.7	10,345.92	0.0	96.8	
5月末	7,107	△3.4	10,346.75	0.0	97.2	
6月末	6,934	△5.7	10,347.64	0.0	98.5	
7月末	6,922	△5.9	10,348.51	0.0	96.6	
8月末	6,859	△6.7	10,349.26	0.0	93.1	
9月末	6,867	△6.6	10,350.06	0.0	96.1	
10月末	6,869	△6.6	10,350.75	0.0	96.0	
11月末	7,019	△4.6	10,351.43	0.1	95.5	
12月末	6,955	△5.4	10,352.10	0.1	96.2	
2016年1月末	7,017	△4.6	10,352.79	0.1	95.5	
(償還時)	(償還価額)					
2016年2月26日	6,998.55	△4.8	10,352.93	0.1	—	

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 3ヵ月円LIBORは2006年5月8日を10,000として指数化しております。

## ■市場概況

### 第1期（2006年5月8日～2007年4月20日）

2007年2月の世界的な株安などを受けて短期的に円高が進行する場面があったものの、海外と日本の金利格差に注目したキャリートレードの活発化などにより、ニュージーランドドルを始め、先進国主要通貨が対円で上昇しました。

### 第2期（2007年4月21日～2008年4月21日）

為替市場は、対円での通貨毎のパフォーマンスに差が出る結果となりました。米ドル・円相場は、2007年7月のバーナンキ米連邦準備制度理事会（FRB）議長の発言を契機にサブプライムローン問題が顕在化したことなどを受けて、期を通じて下落基調で推移しました。また、原油価格が上昇したことなどを背景に、ノルウェークローネなどは底堅い動きとなりました。

### 第3期（2008年4月22日～2009年4月20日）

米国のサブプライムローン問題が未曾有の金融危機に発展し、「質への逃避」による動きから、円全面高の展開となりました。また、景気の急激な悪化などを背景に各国中央銀行が大幅な利下げを実施したことや原油価格の急落に伴いインフレ懸念が弱まったことなども主要通貨が円に対して下落する要因となりました。

### 第4期（2009年4月21日～2010年4月20日）

為替市場は、対円での通貨毎のパフォーマンスに差が出る結果となりました。期初から2009年11月までの米ドル・円相場は、米国の経済指標の悪化やドバイ政府系企業の資金繰り問題などを受けて円高が進行しましたが、その後は、2009年8月に就任した藤井財務相の円高牽制発言を契機に持ち直す動きとなりました。その他の通貨については、米国の金融危機の落ち着きや市場環境の回復などを背景に、高金利通貨買い低金利通貨売りのキャリートレードが復活し、豪ドルやニュージーランドドルなどが対円で上昇しました。

### 第5期（2010年4月21日～2011年4月20日）

為替市場は、対円での通貨毎のパフォーマンスに差が出る結果となりました。期初から2010年10月までの米ドル・円相場は、米国景気の減速感が強まる中で、米国の金融当局による追加量的金融緩和（所謂QE2）実施の可能性が高まり、下落基調で推移しました。その後は、2011年3月の東日本大震災直後に円が一時的に最高値となる76円台に上昇する場面もありましたが、80-85円のレンジで方向感の乏しい展開が続きました。ユーロ・円相場は、欧州周縁国の債務問題などを受けて下落しました。

### 第6期（2011年4月21日～2012年4月20日）

欧州債務問題に対する懸念などを背景に投資家のリスク回避姿勢が高まり、ニュージーランドドル以外の主要先進国通貨は対円で下落しました。期初から2012年2月前半までのドル・円相場は、米国の債務上限問題や米国の景気動向に対する不透明感の強まりなどを背景に下落基調が続きました。しかしながら、その後は、日銀の物価目標の設定などを受けて、日本の金融緩和姿勢の長期化観測が強まり、円安が進行しました。

#### 第7期（2012年4月21日～2013年4月22日）

ニュージーランドドルやスウェーデンクローナなどを筆頭に、主要先進国通貨が対円で大きく上昇しました。米ドル・円相場は、期初より80円付近でもみ合う展開が続いていましたが、11月以降は、日本でデフレ脱却を掲げる安倍政権発足や日銀による金融緩和実施の期待が高まったことなどを受けて円安が進行しました。2013年4月には、日銀が事前予想を大幅に上回る大規模金融緩和を決定したことなどから、円は下落幅を拡大しました。

#### 第8期（2013年4月23日～2014年4月21日）

英ポンド、ユーロ、スイスフランなどが大きく上昇しました。米ドルは99円台後半からスタートしましたが、6月以降、複数のFRB高官の発言や強弱入り乱れる米国の経済指標の発表などを受けて米国の金融緩和の縮小開始時期を見極めようとする動きとなり、11月前半までもみ合う展開が続きました。2014年1月は、中国の製造業景況感指数の低下などを契機に新興国景気に対して慎重な見方が強まったことから円が買い戻されましたが、2月以降は方向感の乏しい展開となり、結局、102円台半ばで期末を迎えました。

#### 第9期（2014年4月22日～2015年4月20日）

米ドル、スイスフランなどが上昇しました。期初102円台半ばからスタートした米ドル・円相場は、2014年8月中旬までほぼ横ばいでの推移が続きましたが、その後は事前予想を上回る米国の経済指標の発表が相次いだことなどから米国の利上げ観測が高まり、米ドル高・円安が進行しました。10月上旬に上値が重くなる場面が見られましたが、12月上旬には2007年8月以来の高値となる121円台後半まで円安が進行しました。

#### 第10期（2015年4月21日～2016年2月26日）

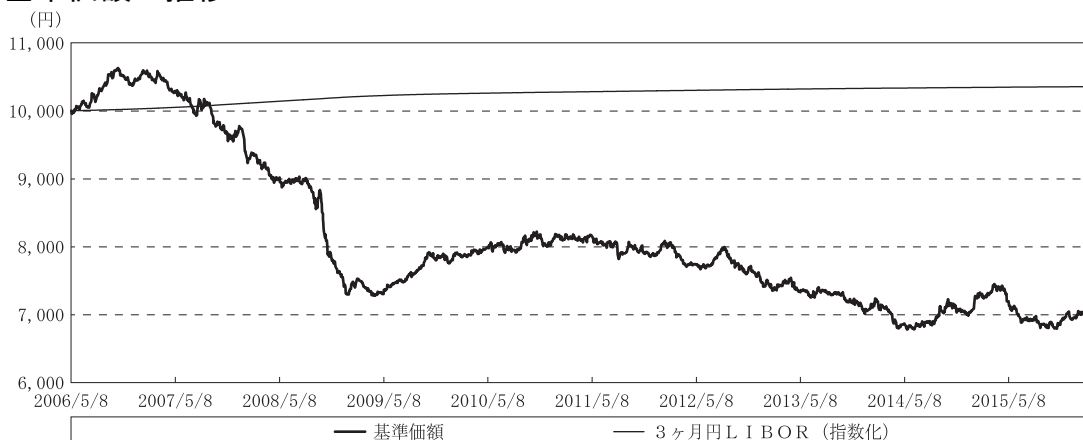
投資対象の全通貨が対円で下落しました。原油価格の下落などを背景にコモディティ通貨が総じて弱含む展開となったことに加え、グローバル景気動向に対する不透明感の強まり、世界的な株安進行、地政学リスクの増大などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、円が投資対象通貨すべてに対して上昇しました。

### ■運用概況

当ファンドでは、「メロン・オフショア・ファンズー日興グローバル・カレンシー・ファンド（円建てファンド・オブ・ファンズ専用クラス）」及び「BNYメロン・マネーポートフォリオ・ファンド（適格機関投資家専用）」を主要投資対象として運用を行いました。

「メロン・オフショア・ファンズー日興グローバル・カレンシー・ファンド（円建てファンド・オブ・ファンズ専用クラス）」では、メロン・キャピタル・マネジメント・コーポレーションが、定量モデルを用いた運用を継続し、高格付けの米ドル建て債券などに対する投資に加え、通貨ロングショート戦略による運用を行いました。通貨ロングショート戦略においては、相対的な各通貨の魅力度やリスクを加味して、機動的にポジションを取ってまいりました。

## ■ 基準価額の推移



### 第1期 (2006年5月8日～2007年4月20日)

設定日、10,000円で運用をスタートし、期末には10,316円となりました。基準価額は316円上昇し、期中騰落率は3.16%となりました。

### 第2期 (2007年4月21日～2008年4月21日)

基準価額は、期初の10,316円から期末には9,009円となりました。基準価額は前期末比1,307円下落し、期中騰落率は△12.67%となりました。

### 第3期 (2008年4月22日～2009年4月20日)

基準価額は、期初の9,009円から期末には7,314円となりました。基準価額は前期末比1,695円下落し、期中騰落率は△18.81%となりました。

### 第4期 (2009年4月21日～2010年4月20日)

基準価額は、期初の7,314円から期末には7,951円となりました。基準価額は前期末比637円上昇し、期中騰落率は8.71%となりました。

### 第5期 (2010年4月21日～2011年4月20日)

基準価額は、期初の7,951円から期末には8,063円となりました。基準価額は前期末比112円上昇し、期中騰落率は1.41%となりました。

### 第6期 (2011年4月21日～2012年4月20日)

基準価額は、期初の8,063円から期末には7,750円となりました。基準価額は前期末比313円下落し、期中騰落率は△3.88%となりました。

### 第7期 (2012年4月21日～2013年4月22日)

基準価額は、期初の7,750円から期末には7,365円となりました。基準価額は前期末比385円下落し、期中騰落率は△4.97%となりました。

### 第8期 (2013年4月23日～2014年4月21日)

基準価額は、期初の7,365円から期末には6,819円となりました。基準価額は前期末比546円下落し、期中騰落率は△7.41%となりました。

第9期（2014年4月22日～2015年4月20日）

基準価額は、期初の6,819円から期末には7,354円となりました。基準価額は前期末比535円上昇し、期中騰落率は7.85%となりました。

第10期（2015年4月21日～2016年2月26日）

基準価額は、期初の7,354円から繰上償還日には6,998円55銭となりました。前期末から繰上償還日にかけて基準価額は355円45銭下落し、期中騰落率は△4.83%となりました。

## ■基準価額の主な変動要因

第1期（2006年5月8日～2007年4月20日）

上昇要因

・対外貨で円をショートとしていたポジションが奏功したこと。

下落要因

・大きくショートしていた豪ドルが対円で上昇したこと。

第2期（2007年4月21日～2008年4月21日）

下落要因

・ロングとしていた英ポンドが対円で下落したこと。

・ショートとしていたノルウェークローネが上昇したこと。

第3期（2008年4月22日～2009年4月20日）

下落要因

・ロングとしていたスウェーデンクローナ及びユーロが対円で下落したこと。

第4期（2009年4月21日～2010年4月20日）

上昇要因

・対円で大きく上昇した豪ドルをロングとしていたこと。

・ユーロ、米ドル、英ポンドなどのショートを維持したこと。

第5期（2010年4月21日～2011年4月20日）

上昇要因

・ショートとしていた米ドルや英ポンドが対円で下落したこと。

第6期（2011年4月21日～2012年4月20日）

上昇要因

・最大のショートとしていたユーロが対円で大きく下落したこと。

下落要因

・2011年5月、ユーロをロングとしていたが、欧州中央銀行による追加利上げ期待の後退を背景に対円で大きく下落したこと。

#### 第7期（2012年4月21日～2013年4月22日）

##### 上昇要因

- ・2012年7月、最大のショートとしていたユーロが大きく下落したこと。
- ・ロングとしていた豪ドル及びカナダドルが上昇したこと。

##### 下落要因

- ・2012年8月から2013年1月にかけて、ショートとしていたユーロが、欧州債務問題に対する懸念後退や日銀による金融緩和期待などを背景に上昇したこと。

#### 第8期（2013年4月23日～2014年4月21日）

##### 上昇要因

- ・最大のロングとしていた英ポンドが対円で上昇したこと。
- ・投資家のリスク回避姿勢が強まり円高が進行する中、カナダドルおよびスイスフランをショートとしていたこと。

##### 下落要因

- ・対円で上昇したニュージーランドドルなどをショートとしていたこと。

#### 第9期（2014年4月22日～2015年4月20日）

##### 上昇要因

- ・米ドルが対円で上昇基調となる中、ロングとしていたこと。
- ・対主要通貨でユーロが下落する中、ユーロをショートとしていたこと。

##### 下落要因

- ・英ポンドが対円で上昇する中、英ポンドをショートとしていたこと。

#### 第10期（2015年4月21日～2016年2月26日）

##### 上昇要因

- ・豪州中央銀行が早期利下げ実施の可能性について否定的な発言をしたことなどを背景に、豪ドルが対円で上昇する中、豪ドルをロングとしていたこと。

##### 下落要因

- ・原油などの商品価格が下落する局面で、カナダドルやニュージーランドドルなどのコモディティ通貨をロングとしていたこと。

以上の運用の結果、償還価額は6,998円55銭となりました。

当ファンドは2016年2月26日に繰上償還となりました。みなさまのご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年4月21日～2016年2月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 58	% 0.829	(a)信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(16)	(0.230)	委託した資金の運用の対価
( 販 売 会 社 )	(39)	(0.552)	交付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、購入後の 情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	( 3)	(0.046)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.003	(b)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	( 0)	(0.003)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	58	0.832	
期中の平均基準価額は、6,985円です。			

(注) 期中の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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) 各項目の費用は、この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。）が支払った費用を含みません。

(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、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2015年4月21日～2016年2月26日)

### 投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	メロン・オフショア・ファンズ-日興グローバル・カレンシー・ファンド	—	—	90,261,065	71,079
国内	BNYメロン・マネーポートフォリオ・ファンド (適格機関投資家専用)	—	—	1,001,299	1,002
合 計		—	—	91,262,364	72,082

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 単位未満は切り捨て。



## ○利害関係人との取引状況等

(2015年4月21日～2016年2月26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

(2016年2月26日現在)

2016年2月26日現在、有価証券等の組入れはございません。

### 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)	
		口	数
メロン・オブショア・ファンズー日興グローバル・カレンシー・ファンド			口
			90,261,065
BNYメロン・マネーポートフォリオ・ファンド(適格機関投資家専用)			1,001,299
合	計		91,262,364

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## ○投資信託財産の構成

(2016年2月26日現在)

項	目	償		還		時	
		評	価	額	比	率	
				千円			%
	コール・ローン等、その他			22,610			100.0
	投資信託財産総額			22,610			100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2016年2月26日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	22,610,831
コール・ローン等	22,610,831
(B) 負債	187,697
未払信託報酬	187,697
(C) 純資産総額(A-B)	22,423,134
元本	32,039,677
償還差損金	△ 9,616,543
(D) 受益権総口数	32,039,677口
1万口当たり償還価額(C/D)	6,998円55銭

(注) 当ファンドの期首元本額は105,907,642円、期中追加設定元本額は9,052,837円、期中一部解約元本額は82,920,802円です。

(注) 1口当たり純資産額は0.6998円です。

○損益の状況 (2015年4月21日～2016年2月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	168
受取利息	168
(B) 有価証券売買損益	△ 519,255
売買益	345,492
売買損	△ 864,747
(C) 信託報酬等	△ 520,419
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,039,506
(E) 前期繰越損益金	△ 5,497,711
(F) 追加信託差損益金	△ 3,079,326
(配当等相当額)	( 130,502)
(売買損益相当額)	(△ 3,209,828)
償還差損金(D+E+F)	△ 9,616,543

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2006年5月8日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年2月26日		資 産 総 額	22,610,831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	187,697円
				純 資 産 総 額	22,423,134円
受益権口数	10,000,000口	32,039,677口	22,039,677口	受 益 権 口 数	32,039,677口
元 本 額	10,000,000円	32,039,677円	22,039,677円	1万口当たり償還金	6,998円55銭
毎計算期末の状況					
計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第1期	2,008,948,712円	2,072,472,090円	10,316円	0円	0%
第2期	1,304,434,757	1,175,225,878	9,009	0	0
第3期	602,714,091	440,850,612	7,314	0	0
第4期	291,798,789	232,013,769	7,951	0	0
第5期	209,198,362	168,668,075	8,063	0	0
第6期	169,392,719	131,283,005	7,750	0	0
第7期	147,735,282	108,799,750	7,365	0	0
第8期	121,042,631	82,537,359	6,819	0	0
第9期	105,907,642	77,880,752	7,354	0	0

## ○償還金のお知らせ

---

1 万口当たり償還金 (税込み)	6,998円55銭
------------------	-----------

## ○お知らせ

---

当ファンドは、繰上償還（信託終了）に関して、2015年11月4日から2015年12月4日までの期間をもって異議申立ての受付を行いました。

その結果、異議を申立てられた受益者の受益権の合計口数が2015年11月4日現在の受益権総口数の2分の1を超えなかったため、2016年2月26日をもって償還することとなりました。

みなさまのご愛顧に対し、厚く御礼申し上げます。

<メロン・オフショア・ファンズー日興グローバル・カレンシー・ファンド（円建てファンド・オブ・ファンズ専用クラス）の状況>

主要投資対象であるメロン・オフショア・ファンズー日興グローバル・カレンシー・ファンド（円建てファンド・オブ・ファンズ専用クラス）の本書作成時点で開示されている直近の会計年度末である2015年3月末時点の状況をご報告申し上げます。なお、これらの内容は、当該ファンドの全てのクラスを含んだ内容です。

■費用の明細（2014年4月1日から2015年3月31日まで）

運用計算書および純資産変動計算書（監査済）  
（2015年3月31日に終了した期間）

	米ドル
<b>収益</b>	
債券にかかる利息	1,035.62
<b>収益合計</b>	<b>1,035.62</b>
<b>費用</b>	
管理報酬	82,907.87
専門家費用	26,257.00
販売報酬	22,938.79
印刷および公告費	15,260.00
管理事務代行報酬	5,040.88
代行協会員報酬	3,819.70
保管報酬	3,358.47
保護預り費用	963.99
受託報酬	830.89
取引手数料	155.00
その他の費用	36,805.85
<b>費用合計</b>	<b>198,338.44</b>
<b>投資純損失</b>	<b>(197,302.82)</b>
<b>以下にかかる実現純損益</b>	
投資有価証券	20.03
外国為替	47,859.84
為替先渡契約	(753,211.94)
<b>当期実現純損失</b>	<b>(902,634.89)</b>
<b>以下にかかる未実現評価損益の純変動</b>	
投資有価証券	94.69
為替先渡契約	90,723.39
<b>運用による純資産の純減少</b>	<b>(811,816.81)</b>
<b>資本の変動</b>	
受益証券発行手取額	4,031,266.60
受益証券買戻支払額	(4,720,227.92)
<b>資本の変動、純額</b>	<b>(688,961.32)</b>
<b>期首現在純資産額</b>	<b>8,984,194.39</b>
<b>期末現在純資産額</b>	<b>7,483,416.26</b>

■組入有価証券明細（2015年3月末現在）

	銘柄	国	種類	償還期限	数量	評価価額 (米ドル)	投資比率 (%)
1	TREASURY BILL	米国	国債証券	2015/4/9	7,000,000	7,000,021.00	93.5
合計						7,000,021.00	93.5

(注) 上記には、「円建てファンド・オブ・ファンズ専用クラス」以外の資産クラスに帰属する投資資産も含まれます。

## ＜BNYメロン・マネーポートフォリオ・ファンド（適格機関投資家専用）の状況＞

主要投資対象であるBNYメロン・マネーポートフォリオ・ファンド（適格機関投資家専用）の決算は、年1回（毎年1月）です。以下は直近の決算期末である2016年1月18日現在の状況です。

### ○1万口当たりの費用明細

（2015年1月20日～2016年1月18日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 3	% 0.032	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(2)	(0.020)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(1)	(0.007)	口座内でのファンドの管理の対価
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.005)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
合 計	3	0.032	
期中の平均基準価額は、10,014円です。			

(注) 期中の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

### ○組入資産の明細

（2016年1月18日現在）

#### 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
BNYメロン・マネーポートフォリオ・マザーファンド	千口 231,200	千口 379,351	千円 380,944

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2016年1月18日現在)

<BNYメロン・マネーポートフォリオ・マザーファンド>

下記は、BNYメロン・マネーポートフォリオ・マザーファンド全体(379,351千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB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	%	%	%	%	%
国債証券	210,000 (210,000)	210,009 (210,009)	55.1 (55.1)	— (—)	— (—)	— (—)	55.1 (55.1)
合 計	210,000 (210,000)	210,009 (210,009)	55.1 (55.1)	— (—)	— (—)	— (—)	55.1 (55.1)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は組み入れなし。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 残存期間が1年以内の公社債は原則としてアキュムレーションまたはアモチゼーションにより評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第549回国庫短期証券	—	140,000	140,004	2016/2/10
第556回国庫短期証券	—	70,000	70,005	2016/3/10
合 計		210,000	210,009	

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。