

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／債券
設定日	2017年8月31日
信託期間	2017年8月31日～2027年8月3日（約10年）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、主として米国のメジャー企業が発行する米ドル建ての社債等に投資を行うことにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。「メジャー企業」とは、財務基盤、収益性、企業価値等を総合的に判断し、広く市場で認知されていると大和住銀投信投資顧問が判断する企業を指します。一部、米国以外の企業が発行する債券にも投資する場合があります。また、米国国債に投資する場合があります。投資する債券の格付けは、原則として、取得時においてA格相当以上とします。実質組入外貨建資産については対円での為替ヘッジを行い、為替ヘッジ比率は原則として80%程度とします。市場環境によっては大和住銀投信投資顧問独自の判断で、為替ヘッジ比率を100%程度まで引き上げる場合があります。
主要運用対象	米国メジャー企業債ファンド ・米国メジャー企業債マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。 米国メジャー企業債マザーファンド ・優良企業の発行する米ドル建ての社債を主要投資対象とします。
投資制限	米国メジャー企業債ファンド ・株式への実質投資は行いません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 米国メジャー企業債マザーファンド ・株式への投資は行いません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎年2月、8月の3日（休業日の場合は、翌営業日）の決算日に、収益分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含まれます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。 *分配金自動再投資型の場合、分配金は税金を差し引いた後自動的に無手数料で再投資されます。

ホームページアドレス

<https://www.daiwasbi.co.jp/>

お問い合わせ先

受付窓口：（電話番号）0120-286104

受付時間：午前9時から午後5時まで（土、日、祝日除く。）

※お客様のお取引内容につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。



運用報告書（全体版）

第3期

決算日 2019年2月4日

米国メジャー企業債ファンド (愛称) 米国メジャー

受益者の皆様へ

毎々、格別のお引き立てにあずかり厚くお礼申し上げます。

さて「米国メジャー企業債ファンド（愛称：米国メジャー）」は、去る2019年2月4日に第3期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

大和住銀投信投資顧問株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年4月1日に三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社となる予定です。

資産運用のベストパートナー、だいわすみぎん



大和住銀投信投資顧問

Daiwa SB Investments

東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 込金	騰落 中率			
(設定日) 2017年8月31日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 250
第1期(2018年2月5日)	9,647	15	△3.4	95.4	—	245
第2期(2018年8月3日)	9,517	15	△1.2	98.9	—	248
第3期(2019年2月4日)	9,632	15	1.4	95.7	—	252

*当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

*設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

*基準価額の騰落率は分配金込み

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
	騰落率	騰落率		
(期首) 2018年8月3日	円 9,517	% —	% 98.9	% —
8月末	9,554	0.4	98.4	—
9月末	9,527	0.1	100.0	—
10月末	9,420	△1.0	99.8	—
11月末	9,410	△1.1	98.0	—
12月末	9,487	△0.3	96.4	—
2019年1月末	9,616	1.0	95.1	—
(期末) 2019年2月4日	9,647	1.4	95.7	—

*騰落率は期首比です。

*期末基準価額は分配金込み

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

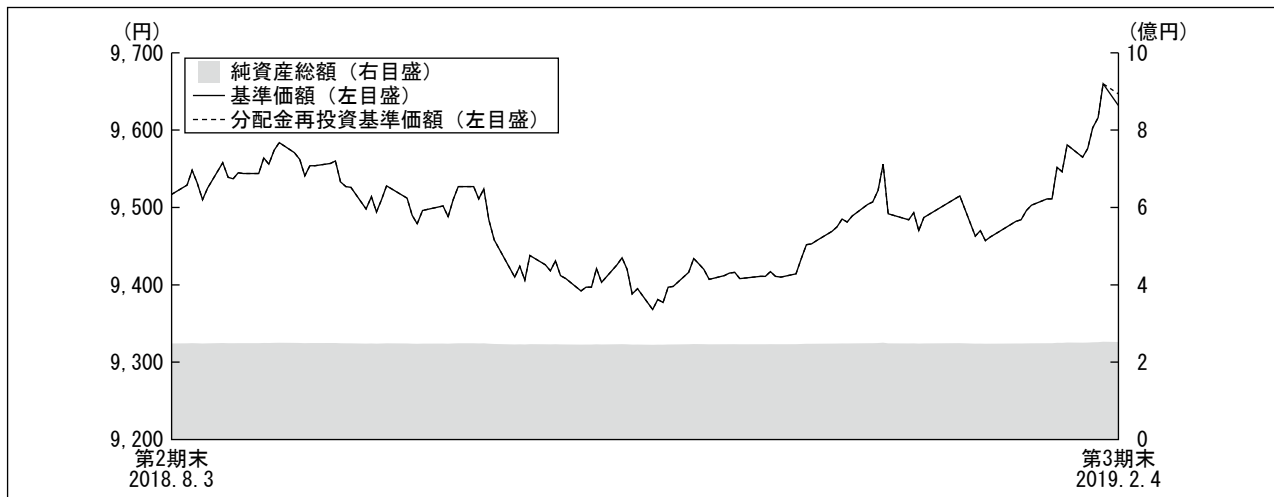
*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

運用経過

【基準価額等の推移】



*当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

*分配金再投資基準価額は、期首の基準価額を基準に算出しております。

*分配金再投資基準価額は、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様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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

第3期首：9,517円

第3期末：9,632円（既払分配金 15円）

騰落率：+1.4%（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

当ファンドは、米国メジャー企業債マザーファンドへの投資を通じて、主として米国のメジャー企業が発行する米ドル建ての社債等に投資を行いました。

（上昇要因）

社債のインカムゲインが要因となりました。

（下落要因）

米ドルの対円での下落が要因となりました。

米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

【投資環境】

米ドル建て社債のスプレッドは拡大した一方、ベース金利に相当する米国債利回りは低下した結果、社債利回り（社債価格）は横ばい圏となりました。また、米ドルは対円で下落しました。

社債スプレッドは期初、堅調な米国の経済指標を背景に、低位で落ち着いた推移となりました。しかし、2018年10月以降、米企業の決算発表で米中貿易摩擦などを背景に先行き不透明感が示されたことや、米経済指標が鈍化の兆しが見られたことを背景に株式市場が下落し、社債市場でもスプレッドがワイド化傾向となりました。その後、年末にかけてスプレッド拡大が加速したものの、2019年1月初めにパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げ継続に柔軟な姿勢を示したことで期末にかけて社債スプレッドは縮小方向に転じました。

【ポートフォリオ】

■米国メジャー企業債ファンド

主要投資対象である米国メジャー企業債マザーファンドを期を通じて高位に組み入れ、期末の実質的な公社債組入比率は95.7%としました。

■米国メジャー企業債マザーファンド

当期の騰落率は、+1.3%となりました。

米国の優良企業が発行する米ドル建て社債に投資を行い、安定したインカムゲインの確保を目指しました。セクターアロケーションにおいては、特に安定したキャッシュフローの創出が期待できる生活必需品セクターやヘルスケアセクターへの配分を高位に維持しました。個別銘柄では、スプレッドの拡大を警戒し2018年11月にイーライリリーの社債を売却することで、社債のエクスポージャーを引き下げました。

【ベンチマークとの差異】

当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

【分配金】

収益分配金は、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、1万口当たり15円（税込み）とさせて頂きました。なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳

（1万口当たり・税引前）

項目	第3期	
	2018年8月4日 ～2019年2月4日	
当期分配金 (円)		15
(対基準価額比率) (%)		0.16
当期の収益 (円)		15
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		249

※円未満を切り捨てしているため、「当期分配金」は「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計額と一致しない場合があります。

※当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針

■米国メジャー企業債ファンド

引き続き、運用の基本方針に従い、マザーファンドへの投資を通じて、主として米国のメジャー企業が発行する米ドル建ての社債等に投資を行うことにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

■米国メジャー企業債マザーファンド

社債スプレッドは2018年後半の急拡大後、2019年1月以降はFRBのハト派化と株式市場の反発を背景に、急速に縮小しています。しかし、経済指標からは中国の経済成長の鈍化が示され、米国も税制改革の景気浮揚効果が剥がれることで、2018年半ばまでの好調さに陰りが見えている状況です。米中貿易摩擦問題や、米国の一部政府機関の閉鎖問題など政治的なリスクも残ることから、2019年後半にはスプレッドのワイド化が再開すると予想しています。当ファンドでは、引き続き、キャッシュフローの安定している発行体の社債を中心に投資を行っていく方針です。

米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2018年8月4日～2019年2月4日		
	金額	比率	
信託報酬	36円	0.378%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,502円です。
(投信会社)	(17)	(0.181)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(17)	(0.181)	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)	(2)	(0.016)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
その他費用	2	0.016	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.011)	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)	(1)	(0.005)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	37	0.394	

* 「比率」欄は1万口当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。

* 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。

なお、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受益証券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まず。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2018年8月4日から2019年2月4日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
米 国 メ ジャ ー 企 業 債 マ ジ ー フ ァ ン ド	千口 1,303	千円 1,292	千口 12,265	千円 12,142

利害関係人との取引状況等

(2018年8月4日から2019年2月4日まで)

<米国メジャー企業債ファンド>

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

<米国メジャー企業債マザーファンド>

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

米国メジャー企業債ファンド
愛称：「米国メジャー」

自社による当ファンドの設定・解約状況

(2018年8月4日から2019年2月4日まで)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 250	百万円 —	百万円 —	百万円 250	当初設定時における取得

組入資産の明細

2019年2月4日現在

■親投資信託残高

	期首(前期末)	当期		期末
	口数	口数	評価額	評価額
米国メジャー企業債マザーファンド	千口 258,977	千口 248,015	千円 247,668	千円 247,668

*米国メジャー企業債マザーファンド全体の受益権口数は、248,015千口です。

投資信託財産の構成

2019年2月4日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	比率
米国メジャー企業債マザーファンド	千円 247,668		% 97.7
コール・ローン等、その他	5,913		2.3
投資信託財産総額	253,581		100.0

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1 アメリカ・ドル=109.53円

*米国メジャー企業債マザーファンド

当期末における外貨建資産(245,203千円)の投資信託財産総額(247,680千円)に対する比率 99.0%

米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年2月4日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	457,100,917円
米国メジャー企業債マザーファンド(評価額)	247,668,065
未 収 入 金	209,432,852
(B) 負 債	205,025,995
未 払 金	203,683,680
未 払 収 益 分 配 金	392,555
未 払 解 約 金	19
未 払 信 託 報 酬	936,277
そ の 他 未 払 費 用	13,464
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	252,074,922
元 本	261,703,997
次 期 繰 越 損 益 金	△ 9,629,075
(D) 受 益 権 総 口 数	261,703,997口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	9,632円

*元本状況

期首元本額 260,913,368円

期中追加設定元本額 1,366,717円

期中一部解約元本額 576,088円

*元本の欠損 9,629,075円

損益の状況

自2018年8月4日
至2019年2月4日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,368,653円
売 買 益	14,905,603
売 買 損	△10,536,950
(B) 信 託 報 酬 等	△ 949,741
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	3,418,912
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△12,240,003
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 415,429
(配 当 等 相 当 額)	(83,923)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 499,352)
(F) 計 (C + D + E)	△ 9,236,520
(G) 収 益 分 配 金	△ 392,555
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	△ 9,629,075
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 415,429
(配 当 等 相 当 額)	(87,012)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 502,441)
分 配 準 備 積 立 金	6,442,035
繰 越 損 益 金	△15,655,681

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*信託報酬等には、消費税等相当額を含めて表示しております。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

<分配金の計算過程>

信託約款に基づき計算した収益分配可能額及び収益分配金の計算過程は以下のとおりです。

(A) 配 当 等 収 益 (費用控除後)	2,856,840円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収 益 調 整 金	87,012
(D) 分 配 準 備 積 立 金	3,977,750
分 配 可 能 額 (A + B + C + D)	6,921,602
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(264.48)
収 益 分 配 金	392,555
(1 万 口 当 り 収 益 分 配 金)	(15)

米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

分配金のお知らせ

1万口当り分配金(税込み)

15円

■分配金のお支払いについて

分配金のお支払いは決算日から起算して5営業日までに開始いたします。

■課税上のお取扱いについて

- ・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は、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、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、分配金発生時における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。
- ・普通分配金は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、申告分離課税または総合課税を選択することもできます。

※法人の受益者の場合、税率が異なります。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※課税上のお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。

お知らせ

該当事項はございません。

※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。

米国メジャー企業債マザーファンド

運用報告書

決算日：2019年2月4日

(第3期：2018年8月4日～2019年2月4日)

当ファンドは、上記の通り決算を行いました。ここに、期中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。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	主に米ドル建ての社債に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	優良企業の発行する米ドル建ての社債を主要投資対象とします。
投資制限	<ul style="list-style-type: none">・ 株式への投資は行いません。・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

資産運用のベストパートナー、だいわすみぎん



大和住銀投信投資顧問

Daiwa SB Investments

東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

<https://www.daiwasbi.co.jp/>

米国メジャー企業債マザーファンド

設定以来の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産 総額
		騰落	率			
(設定日) 2017年8月31日	円 10,000	% —		% —	% —	百万円 250
第1期 (2018年2月5日)	9,716	△2.8		97.0	—	241
第2期 (2018年8月3日)	9,853	1.4		96.3	—	255
第3期 (2019年2月4日)	9,986	1.3		97.4	—	247

*当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

*設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額	騰落率		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
		騰落	率		
(期首) 2018年8月3日	円 9,853	% —		% 96.3	% —
8月末	9,858	0.1		98.1	—
9月末	10,022	1.7		97.8	—
10月末	9,920	0.7		97.5	—
11月末	9,949	1.0		97.8	—
12月末	9,887	0.3		97.6	—
2019年1月末	9,909	0.6		97.4	—
(期末) 2019年2月4日	9,986	1.3		97.4	—

*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

運用経過

【基準価額等の推移】

期首：9,853円

期末：9,986円

騰落率：+1.3%

【基準価額の主な変動要因】

(上昇要因)

社債のインカムゲインが要因となりました。

(下落要因)

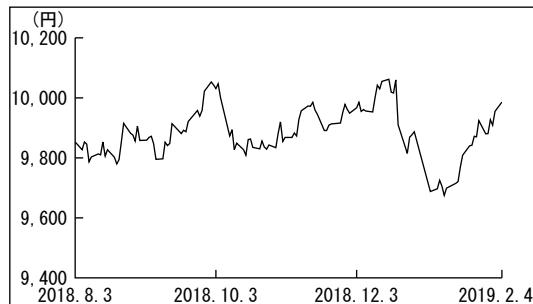
米ドルの対円での下落が要因となりました。

【投資環境】

米ドル建て社債のスプレッドは拡大した一方、ベース金利に相当する米国債利回りは低下した結果、社債利回り（社債価格）は横ばい圏となりました。また、米ドルは対円で下落しました。

社債スプレッドは期初、堅調な米国の経済指標を背景に、低位で落ち着いた推移となりました。しかし、2018年10月以降、米企業の決算発表で米中貿易摩擦などを背景に先行き不透明感が示されたことや、米経済指標が鈍化の兆しが見られたことを背景に株式市場が下落し、社債市場でもスプレッドがワイド化傾向となりました。その後、年末にかけてスプレッド拡大が加速したものの、2019年1月初めにパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げ継続に柔軟な姿勢を示したことで期末にかけて社債スプレッドは縮小方向に転じました。

基準価額の推移



米国メジャー企業債マザーファンド

【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、+1.3%となりました。

米国の優良企業が発行する米ドル建て社債に投資を行い、安定したインカムゲインの確保を目指しました。セクターアロケーションにおいては、特に安定したキャッシュフローの創出が期待できる生活必需品セクターやヘルスケアセクターへの配分を高位に維持しました。個別銘柄では、スプレッドの拡大を警戒し2018年11月にイーライリリーの社債を売却することで、社債のエクスポージャーを引き下げました。

今後の運用方針

社債スプレッドは2018年後半の急拡大後、2019年1月以降はFRBのハト派化と株式市場の反発を背景に、急速に縮小しています。しかし、経済指標からは中国の経済成長の鈍化が示され、米国も税制改革の景気浮揚効果が剥がれることで、2018年半ばまでの好調さに陰りが見えている状況です。米中貿易摩擦問題や、米国の一部政府機関の閉鎖問題など政治的なリスクも残ることから、2019年後半にはスプレッドのワイド化が再開すると予想しています。当ファンドでは、引き続き、キャッシュフローの安定している発行体の社債を中心に投資を行っていく方針です。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2018年8月4日～2019年2月4日		
	金額	比率	
その他費用	1円	0.011%	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.011)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	1	0.011	
期中の平均基準価額は9,924円です。			

* 「比率」欄は1万口当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。

* 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。

* 円未満は四捨五入しています。

米国メジャー企業債マザーファンド

売買及び取引の状況

(2018年8月4日から2019年2月4日まで)

■公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	社債券	千アメリカ・ドル —	千アメリカ・ドル 37

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

*社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれていません。

主要な売買銘柄

(2018年8月4日から2019年2月4日まで)

■公社債

当			期		
買付		金額	売付		金額
銘柄	柄	千円	銘柄	柄	千円
—	—	—	ELI LILLY & CO 2.35	05/15/22	4,282

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

利害関係人との取引状況等

(2018年8月4日から2019年2月4日まで)

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

米国メジャー企業債マザーファンド

組入資産の明細

2019年2月4日現在

■ 公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 率	う ち BB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 2,240	千アメリカ・ドル 2,202	千円 241,227	% 97.4	% —	% 76.8	% 20.6	% —
合 計	—	—	241,227	97.4	—	76.8	20.6	—

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

B 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

銘 柄	当 期				末		償 還 年 月 日
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ・ドル…アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	社債券	2.4500	130	123	13,523	2026/11/03	
JOHNSON & JOHNSON	社債券	2.4500	130	124	13,617	2026/03/01	
WAL-MART STORES INC	社債券	2.5500	125	124	13,621	2023/04/11	
PFIZER INC	社債券	4.1250	100	104	11,455	2046/12/15	
HOME DEPOT INC	社債券	2.7000	100	99	10,912	2023/04/01	
MICROSOFT CORP	社債券	2.8750	130	130	14,274	2024/02/06	
JPMORGAN CHASE & CO	社債券	3.2000	140	136	14,898	2026/06/15	
MORGAN STANLEY	社債券	3.5910	110	107	11,742	2028/07/22	
CATERPILLAR FINANCIAL SE	社債券	3.3000	110	110	12,075	2024/06/09	
COCA-COLA CO/THE	社債券	2.8750	140	137	15,058	2025/10/27	
ELI LILLY & CO	社債券	2.3500	55	54	5,914	2022/05/15	
PEPSICO INC	社債券	2.0000	110	108	11,920	2021/04/15	
APPLE INC	社債券	2.8500	130	129	14,170	2024/05/11	
VISA INC	社債券	2.1500	80	78	8,572	2022/09/15	
WALT DISNEY COMPANY/THE	社債券	3.1500	140	139	15,302	2025/09/17	
ALPHABET INC	社債券	1.9980	140	129	14,185	2026/08/15	
PHILIP MORRIS INTL INC	社債券	3.2500	110	107	11,811	2024/11/10	
BOEING CO	社債券	2.2500	130	120	13,237	2026/06/15	
EXXON MOBIL CORPORATION	社債券	4.1140	130	136	14,930	2046/03/01	
合 計	—	—	2,240	2,202	241,227	—	

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

米国メジャー企業債マザーファンド

投資信託財産の構成

2019年2月4日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	241,227	97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,452	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	247,680	100.0

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1 アメリカ・ドル=109.53円

*当期末における外貨建資産(245,203千円)の投資信託財産総額(247,680千円)に対する比率 99.0%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年2月4日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	247,680,096円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,476,401
公 社 債(評価額)	241,227,662
未 収 利 息	1,976,033
(B) 負 債	19
そ の 他 未 払 費 用	19
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	247,680,077
元 本	248,015,287
次 期 繰 越 損 益 金	△ 335,210
(D) 受 益 権 総 口 数	248,015,287口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	9,986円

*元本状況

期首元本額	258,977,142円
期中追加設定元本額	1,303,476円
期中一部解約元本額	12,265,331円

*元本の内訳

米国メジャー企業債ファンド	248,015,287円
---------------	--------------

*元本の欠損

335,210円

損益の状況

自2018年8月4日
至2019年2月4日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,577,923円
受 取 利 息	3,578,417
支 払 利 息	△ 494
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 185,036
売 買 益	4,972,465
売 買 損	△5,157,501
(C) そ の 他 費 用	△ 27,526
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	3,365,361
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△3,812,317
(F) 解 約 差 損 益 金	123,097
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 11,351
(H) 計 (D+E+F+G)	△ 335,210
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△ 335,210

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*解約差損益金とは、一部解約時の解約金額と元本の差額をいい、元本を下回る額は利益として、上回る額は損失として処理されます。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

お知らせ

該当事項はございません。

※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。