

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三井住友DSアセットマネジメント株式会社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三井住友DSアセットマネジメント株式会社独自の判断で、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、分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）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。

# 運用報告書（全体版）

第5期

決算日 2020年2月3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2020年2月3日に第5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。

- 口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 運用報告書についてのお問い合わせ  
フリーダイヤル 0120-88-2976  
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1

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

# 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
第4期 (2019年8月5日)	10,088	15	4.9	92.3	—	275
第5期 (2020年2月3日)	10,315	15	2.4	97.9	—	279

\*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		
(期首) 2019年8月5日	円 10,088	% —	% 92.3	% —
8月末	10,258	1.7	94.9	—
9月末	10,160	0.7	97.0	—
10月末	10,147	0.6	99.4	—
11月末	10,204	1.1	98.3	—
12月末	10,188	1.0	98.7	—
2020年1月末	10,325	2.3	98.5	—
(期末) 2020年2月3日	10,330	2.4	97.9	—

\*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

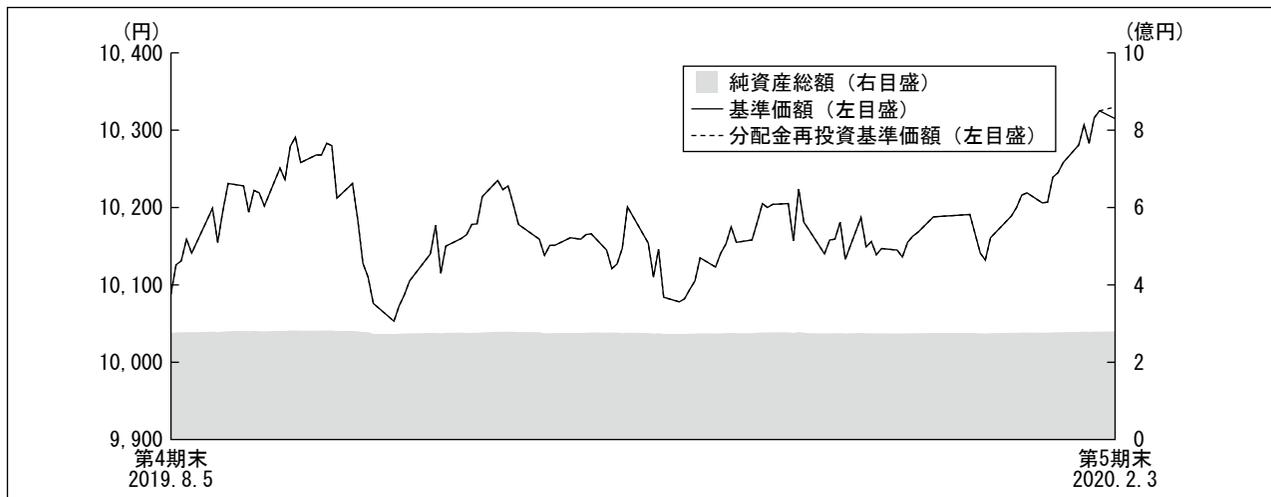
\*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

# 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、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はありません。

\*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5期首：10,088円

第5期末：10,315円（既払分配金 15円）

騰落率：+2.4%（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およびキャピタルゲインと、米ドルの対円での上昇が要因になりました。

# 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 спреッドは縮小し、ベース金利に相当する米国債利回りは低下した結果、社債利回りは低下（価格は上昇）となりました。また、米ドルは対円で上昇しました。

社債市場は期初、米中貿易協議が難航していたことからリスクオフ相場となり、社債スプレッドは拡大傾向となった一方、米国債利回りは低下したことから社債の利回りは横ばい圏で推移しました。その後、2019年9月から年末にかけては、米中が貿易協議の部分的な合意に向け交渉を再開したことを背景にリスクオン相場となり、社債スプレッドは縮小した一方、米国債利回りは上昇基調となった結果、社債利回りは横ばい圏となりました。年明け以降は、中国の新型コロナウイルスの景気への影響が懸念されたことで社債スプレッドは小幅に上昇したものの、米国債利回りが大幅に低下したことで、社債利回りは低下しました。

### 【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97.9%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、+5.8%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通信セクターへの配分を高位に維持しました。

### 【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】

分配金は、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、1万口当り15円（税込み）とさせていただきます。  
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

（1万口当り・税引前）

項目	第5期	
	2019年8月6日 ～2020年2月3日	
当期分配金 (円)		15
(対基準価額比率) (%)		0.15
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)		465

※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2020年初以降、中国の新型肺炎への懸念や、米ドル建ての社債発行が続いたことによる需給の悪化で小幅にワイド化しています。今後については、徐々に新型肺炎の景気への影響が確認されるにつれ、不透明感の後退が意識されることや、起債が増える時期を終えることによる需給の改善から、底堅く推移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
	2019年8月6日～2020年2月3日		
	金額	比率	
信託報酬	38円	0.375%	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10,214円です。
(投信会社)	(18)	(0.179)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(18)	(0.179)	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	1	0.014	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)	(0.009)	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	40	0.389	

\* 「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。

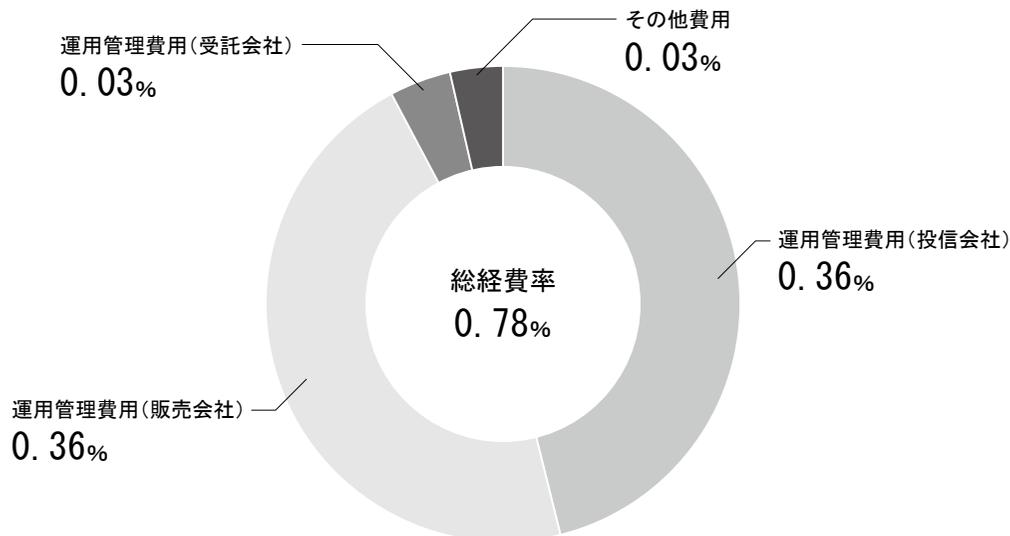
なお、その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託受益証券が支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

\* 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

# 米国メジャー企業債ファンド

愛称：「米国メジャー」

## 参考情報 総経費率（年率換算）



\*各費用は、前掲「1万口当りの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。

\*各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。

\*上記の前提条件で算出しているため、「1万口当りの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.78%です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2019年8月6日から2020年2月3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ザーファンド	千口 19,740	千円 21,004	千口 25,244	千円 26,943

# 米国メジャー企業債ファンド

## 愛称：「米国メジャー」

### 利害関係人との取引状況等

(2019年8月6日から2020年2月3日まで)

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。

### 自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年8月6日から2020年2月3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

2020年2月3日現在

#### ■親投資信託残高

	期首(前期末)	当期		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 261,754	千口 256,250	千円 281,593	千円 281,593

\*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、256,250千口です。

### 投資信託財産の構成

2020年2月3日現在

項目	当期	末
	評価額	比率
米国メジャー企業債マザーファンド	千円 281,593	% 100.0
コール・ローン等、その他	4	0.0
投資信託財産総額	281,598	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=108.52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(278,837千円)の投資信託財産総額(281,605千円)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

(2020年2月3日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	503,903,614円
米国メジャー企業債マザーファンド(評価額)	281,593,775
未 収 入 金	222,309,839
(B) 負 債	224,107,261
未 払 金	222,643,338
未 払 収 益 分 配 金	406,889
未 払 解 約 金	4,233
未 払 信 託 報 酬	1,037,851
そ の 他 未 払 費 用	14,950
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	279,796,353
元 本	271,259,599
次 期 繰 越 損 益 金	8,536,754
(D) 受 益 権 総 口 数	271,259,599口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	10,315円

\*元本状況

期首元本額	273,416,482円
期中追加設定元本額	12,878,824円
期中一部解約元本額	15,035,707円

### 損益の状況

自2019年8月6日  
至2020年2月3日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 68円
受 取 利 息	2
支 払 利 息	△ 70
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,476,099
売 買 益	24,355,858
売 買 損	△16,879,759
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,052,801
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	6,423,230
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,704,976
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 184,563
(配 当 等 相 当 額)	( 928,655)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,113,218)
(G) 計 (D+E+F)	8,943,643
(H) 収 益 分 配 金	△ 406,889
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	8,536,754
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 184,563
(配 当 等 相 当 額)	( 956,091)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,140,654)
分 配 準 備 積 立 金	11,669,102
繰 越 損 益 金	△ 2,947,785

\*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)	3,274,359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	956,091
(D) 分 配 準 備 積 立 金	8,801,632
分 配 可 能 額 (A+B+C+D)	13,032,082
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	( 480.43)
収 益 分 配 金	406,889
(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。

※外国税額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。

※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：2020年2月3日

(第5期：2019年8月6日～2020年2月3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"><li>・ 株式への投資は行いません。</li><li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1

<https://www.smd-am.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		公社債率	債券先物率	純資産額
		期騰	落中率			
(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
第4期 (2019年8月5日)	10,389		4.0	93.6	—	271
第5期 (2020年2月3日)	10,989		5.8	97.3	—	281

\*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		公社債率	債券先物率
		騰	落率		
(期首) 2019年8月5日	円 10,389		% —	% 93.6	% —
8月末	10,598		2.0	93.9	—
9月末	10,663		2.6	94.4	—
10月末	10,747		3.4	95.0	—
11月末	10,881		4.7	97.6	—
12月末	10,891		4.8	97.8	—
2020年1月末	11,024		6.1	97.6	—
(期末) 2020年2月3日	10,989		5.8	97.3	—

\*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：10,389円

期末：10,989円

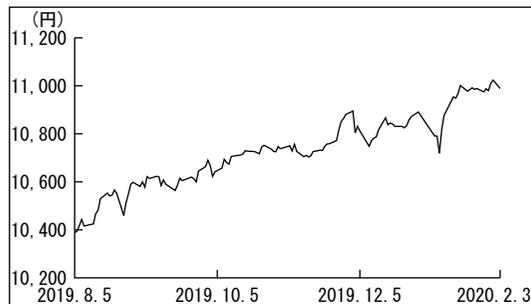
騰落率：+5.8%

### 【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およびキャピタルゲインと、米ドルの対円での上昇が要因になりました。

基準価額の推移



### 【投資環境】

米ドル建て社債のспレッドは縮小し、ベース金利に相当する米国債利回りは低下した結果、社債利回りは低下（価格は上昇）となりました。また、米ドルは対円で上昇しました。

社債市場は期初、米中貿易協議が難航していたことからリスクオフ相場となり、社債спレッドは拡大傾向となった一方、米国債利回りは低下したことから社債の利回りは横ばい圏で推移しました。その後、2019年9月から年末にかけては、米中が貿易協議の部分的な合意に向け交渉を再開したことを背景にリスクオン相場となり、社債спレッドは縮小した一方、米国債利回りは上昇基調となった結果、社債利回りは横ばい圏となりました。年明け以降は、中国の新型コロナウイルスの景気への影響が懸念されたことで社債спレッドは小幅に上昇したものの、米国債利回りが大幅に低下したことで、社債利回りは低下しました。

### 【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、+5.8%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通信セクターへの配分を高位に維持しました。

# 米国メジャー企業債マザーファンド

## 今後の運用方針

社債スプレッドは2020年初以降、中国の新型肺炎への懸念や、米ドル建ての社債発行が続いたことによる需給の悪化で小幅にワイド化しています。今後については、徐々に新型肺炎の景気への影響が確認されるにつれ、不透明感の後退が意識されることや、起債が増える時期を終えることによる需給の改善から、底堅く推移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
	2019年8月6日～2020年2月3日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	1円	0.008%	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
(その他)	(1)	(0.008)	
合計	(0)	(0.000)	
合計	1	0.008	
期中の平均基準価額は10,801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。

## 売買及び取引の状況

(2019年8月6日から2020年2月3日まで)

### ■ 公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 105	千アメリカ・ドル 33

\* 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

# 米国メジャー企業債マザーファンド

## 主要な売買銘柄

(2019年8月6日から2020年2月3日まで)

### ■公社債

当			期		
買		付	売		付
銘柄	金額		銘柄	金額	
US TREASURY N/B 2.875 05/15/49	千円 11,272		US TREASURY N/B 2.875 05/15/49	千円 3,621	

\*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

(2019年8月6日から2020年2月3日まで)

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

2020年2月3日現在

### ■公社債

#### A 債券種類別開示

##### 外国（外貨建）公社債

区分	額面金額	当		組入比率	入率	うち BB格以下 組入比率	末		
		評価額					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 2,340	千アメリカ・ドル 2,523	千円 273,896	% 97.3	% -	% 63.5	% 33.7	% -	
合計	-	-	273,896	97.3	-	63.5	33.7	-	

\*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。

# 米国メジャー企業債マザーファンド

## 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		
US TREASURY N/B	国債証券	2.8750	120	142	15,506	2049/05/15	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	社債券	2.4500	130	136	14,858	2026/11/03	
JOHNSON & JOHNSON	社債券	2.4500	130	134	14,639	2026/03/01	
WAL-MART STORES INC	社債券	2.5500	125	128	13,967	2023/04/11	
PFIZER INC	社債券	4.1250	100	121	13,150	2046/12/15	
HOME DEPOT INC	社債券	2.7000	100	103	11,207	2023/04/01	
MICROSOFT CORP	社債券	2.8750	130	136	14,798	2024/02/06	
JPMORGAN CHASE & CO	社債券	3.2000	140	149	16,176	2026/06/15	
MORGAN STANLEY	社債券	3.5910	110	119	12,931	2028/07/22	
CATERPILLAR FINANCIAL SE	社債券	3.3000	110	116	12,693	2024/06/09	
COMCAST CORP	社債券	4.1500	120	137	14,948	2028/10/15	
3M COMPANY	社債券	3.3750	100	108	11,824	2029/03/01	
COCA-COLA CO/THE	社債券	2.8750	140	148	16,133	2025/10/27	
ELI LILLY & CO	社債券	2.3500	55	55	6,060	2022/05/15	
APPLE INC	社債券	2.8500	130	136	14,772	2024/05/11	
VISA INC	社債券	2.1500	80	81	8,826	2022/09/15	
WALT DISNEY COMPANY/THE	社債券	3.1500	140	150	16,382	2025/09/17	
ALPHABET INC	社債券	1.9980	140	142	15,465	2026/08/15	
PHILIP MORRIS INTL INC	社債券	3.2500	110	116	12,626	2024/11/10	
EXXON MOBIL CORPORATION	社債券	4.1140	130	155	16,924	2046/03/01	
合 計	—	—	2,340	2,523	273,896	—	

\* 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

2020年2月3日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	273,896	97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,708	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	281,605	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=108.52円

\*当期末における外貨建資産(278,837千円)の投資信託財産総額(281,605千円)に対する比率 99.0%

## 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年2月3日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	281,605,532円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,484,356
公 社 債(評価額)	273,896,601
未 収 利 息	2,224,575
(B) 負 債	103
未 払 解 約 金	103
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	281,605,429
元 本	256,250,592
次 期 繰 越 損 益 金	25,354,837
(D) 受 益 権 総 口 数	256,250,592口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	10,989円

\*元本状況

期首元本額 261,754,548円

期中追加設定元本額 19,740,504円

期中一部解約元本額 25,244,460円

\*元本の内訳

米国メジャー企業債ファンド 256,250,592円

## 損益の状況

自2019年8月6日  
至2020年2月3日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,811,655円
受 取 利 息	3,813,965
支 払 利 息	△ 2,310
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,830,312
売 買 益	11,832,086
売 買 損	△ 1,774
(C) そ の 他 費 用	△ 23,890
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	15,618,077
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	10,171,987
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 1,699,082
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,263,855
(H) 計 (D+E+F+G)	25,354,837
次 期 繰 越 損 益 金(H)	25,354,837

\*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。