

日本企業外貨建て債券ファンド2016-03 (為替ヘッジあり)

愛称：ボンドジャパン

償還運用報告書(全体版)

第9期(償還日2020年9月9日)

作成対象期間(2020年3月10日～2020年9月9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。

このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行い、償還価額が決定いたしました。

ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信/内外/債券	
信託期間	2016年3月18日から2020年9月9日までです。	
運用方針	日本企業外貨建て債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券、わが国の政府、政府機関、地方公共団体および企業(国内外の連結子会社および持分法適用関連会社を含みます。)が発行する先進国通貨建て(日本円を除きます。)の公社債(劣後債等を含みます。以下「先進国通貨建て公社債」といいます。)ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等(以下「日本を含む先進国の国債等」といいます。)を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。投資にあたっては、マザーファンド受益証券を高位に組入れることを基本としますが、為替ヘッジコスト、信用力、利回り水準、流動性や当ファンドの残存信託期間等を勘案し、先進国通貨建て公社債および日本を含む先進国の国債等に高位に直接投資を行う場合があります。直接投資にあたっては、投資対象銘柄は取得時においてBBB格相当以上の格付けを有するものとします。当初ポートフォリオ構築完了時の実質組入銘柄の発行体と同一の発行体が発行する先進国通貨建て公社債、および日本を含む先進国の国債等についてはこの限りではありません。 実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。	
主な投資対象	日本企業外貨建て債券ファンド 2016-03(為替ヘッジあり)	マザーファンド受益証券、先進国通貨建て公社債ならびに日本を含む先進国の国債等を主要投資対象とします。
	マザーファンド	先進国通貨建て公社債ならびに日本を含む先進国の国債等を主要投資対象とします。
主な投資制限	日本企業外貨建て債券ファンド 2016-03(為替ヘッジあり)	外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したもの等に限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
	マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したもの等に限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)から、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			期中騰落率	受利益者	債組入比率	債券先物比率	元残存本率
		税金配分	み配金	期中騰落					
(設定日) 2016年3月18日	円 銭 10,000		円 -	円 銭 -	% -	% -	% -	% -	% 100.0
1期(2016年9月9日)	10,153		30	183	1.8	3.8	93.5	-	99.7
2期(2017年3月9日)	9,897		5	△251	△2.5	△0.7	97.5	-	94.6
3期(2017年9月11日)	10,087		5	195	2.0	0.9	95.6	-	84.2
4期(2018年3月9日)	9,903		5	△179	△1.8	△0.3	94.0	-	70.3
5期(2018年9月10日)	9,837		0	△66	△0.7	△0.5	97.6	-	47.2
6期(2019年3月11日)	9,894		0	57	0.6	△0.2	96.1	-	42.3
7期(2019年9月9日)	10,208		0	314	3.2	0.7	95.5	-	38.6
8期(2020年3月9日)	10,249		0	41	0.4	0.7	69.5	-	32.6
(償還時) 9期(2020年9月9日)	(償還価額) 10,385.57		-	136.57	1.3	1.0	-	-	26.0

* 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

* 当ファンドでは、マザーファンドを通じ、主としてわが国の企業が発行する先進国通貨建て（除く円）の社債（劣後債を含む）ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等に投資しておりますが、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額	標準価額		債組入比率	債券先物比率	債券先物比率
		騰落	騰落率			
(期首) 2020年3月9日	円 銭 10,249		% -	% 69.5	% -	% -
3月末	9,963		△2.8	48.6	-	-
4月末	10,177		△0.7	48.9	-	-
5月末	10,248		△0.0	44.5	-	-
6月末	10,294		0.4	45.3	-	-
7月末	10,349		1.0	45.7	-	-
8月末	10,386		1.3	-	-	-
(償還時) 2020年9月9日	(償還価額) 10,385.57		1.3	-	-	-

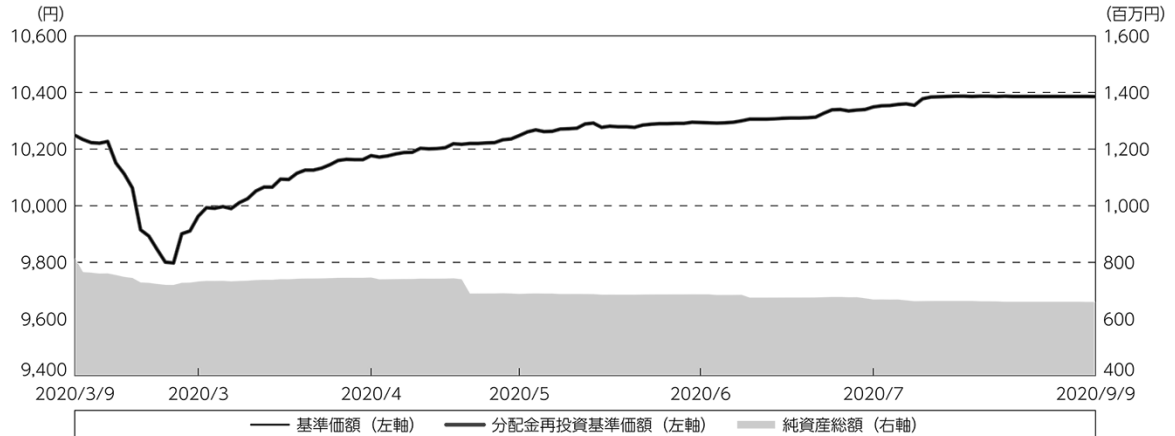
* 騰落率は期首比です。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首： 10,249円

期末(償還日)：10,385円57銭 (既払分配金(税込み)：－円)

騰 落 率： 1.3% (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。作成期首(2020年3月9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。なお、当ファンドは単利型投信であり、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。

(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。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は以下の要因により変動しました。

(上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン(利子収入)

(上 昇) 保有債券の利回り低下に伴うキャピタルゲイン(値上がり益)

○投資環境

海外クレジット市場では、償還時のスプレッド（国債との利回り格差）は当作成期首比で縮小しました。当作成期首から3月下旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界的な景気減速懸念を背景にスプレッドは拡大しました。その後はFRB（米連邦準備制度理事会）が社債の買入れや、中小企業の支援向け融資を表明するなど、緩和的な金融政策を実施する中でスプレッドは縮小に転じ、償還時にかけても新型コロナウイルスのワクチン開発や経済活動再開への期待が高まる中、縮小基調で推移しました。

日本国内発行体の外貨建て社債に関しても、海外クレジット市場に連動してクレジットスプレッドは当作成期首比で縮小しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[日本企業外貨建て債券ファンド2016-03（為替ヘッジあり）]

親投資信託である日本企業外貨建て債券マザーファンド受益証券の組み入れを高位に維持しました。実質組み入れ外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りました。

[日本企業外貨建て債券マザーファンド]

わが国の政府、政府機関、地方公共団体および企業が発行する先進国通貨建て（日本円を除く）の公社債（劣後債等を含む）ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないました。

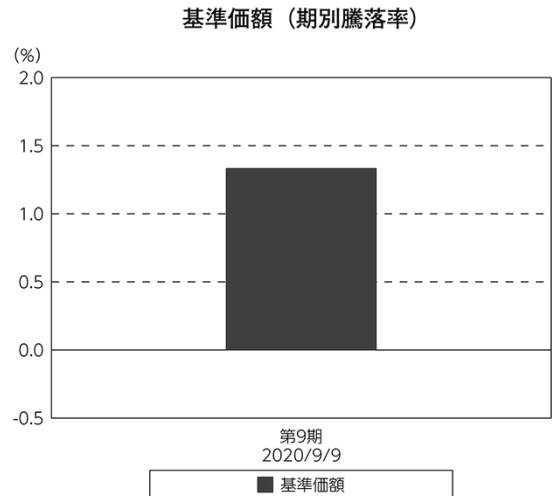
<当作成期中の主な動き>

償還に向けて、債券組入比率をゼロとしました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、マザーファンドを通じ、主としてわが国の企業が発行する先進国通貨建て（除く円）の社債（劣後債を含む）ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等に投資しておりますが、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎分配金

償還のため分配は行ないませんでした。

◎設定来の運用経過

＜設定来の基準価額の推移＞



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時の10,000円が償還時10,385.57円となりました。設定来お支払いした分配金は1万口当たり45円となりました。

第1期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン（利子収入）
- (上 昇) 保有の日本国内発行体の外貨建て社債利回りの低下（債券価格の上昇）によるキャピタルゲイン（値上がり益）

第2期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (下 落) 保有の日本国内発行体の外貨建て社債利回りの上昇（債券価格の下落）によるキャピタルロス（値下がり損）

第3期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (上 昇) 保有の日本国内発行体の外貨建て社債利回りの低下によるキャピタルゲイン

第4期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (下 落) 保有する日本国内発行体の外貨建て社債利回りの上昇によるキャピタルロス

第5期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (下 落) 保有する日本国内発行体の外貨建て社債利回りの上昇によるキャピタルロス

第6期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (上 昇) 保有する日本国内発行体の外貨建て社債利回りの低下によるキャピタルゲイン

第7期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (上 昇) 保有する日本国内発行体の外貨建て社債利回りの低下によるキャピタルゲイン

第8期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン

第9期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (上 昇) 保有債券の利回り低下に伴うキャピタルゲイン

ご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2020年3月10日～2020年9月9日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(1)	(0.006)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(1)	(0.006)	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および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.006)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	1	0.013	(b)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)	(0.010)	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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	3	0.030	
期中の平均基準価額は、10,236円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、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。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

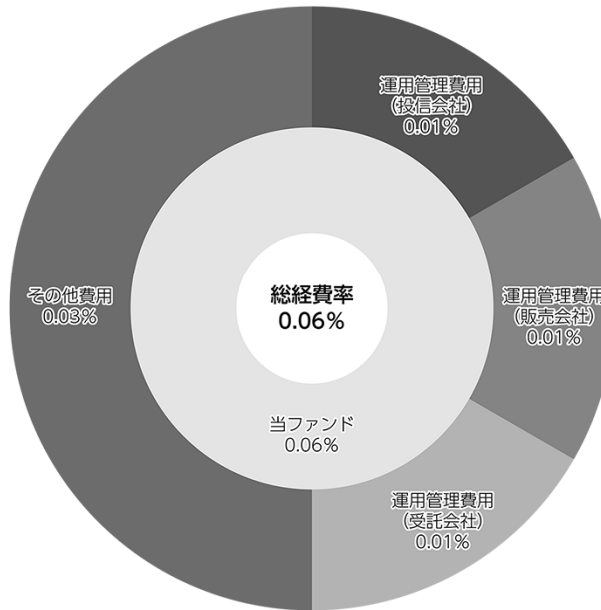
* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.06%です。



(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、売買委託手数料及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) 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ます。

(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。

○売買及び取引の状況

(2020年3月10日～2020年9月9日)

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
日本企業外貨建て債券マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 722,432	千円 798,159

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年3月10日～2020年9月9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

(2020年9月9日現在)

2020年9月9日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	
	口数	金額
日本企業外貨建て債券マザーファンド	千口 722,432	

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年9月9日現在)

項目	償還時	
	評価額	比率
コール・ローン等、その他	千円 660,933	% 100.0
投資信託財産総額	660,933	100.0

*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 (2020年9月9日現在)

項 目	償 還 時	円
(A) 資産	660,933,433	
コール・ローン等	660,933,433	
(B) 負債	629,201	
未払解約金	512,515	
未払信託報酬	108,112	
未払利息	870	
その他未払費用	7,704	
(C) 純資産総額(A-B)	660,304,232	
元本	635,789,797	
償還差益金	24,514,435	
(D) 受益権総口数	635,789,797口	
1万口当たり償還価額(C/D)	10,385円57銭	

(注) 設定年月日2016年3月18日、設定元本額は2,441,184,783円、期首元本額は797,648,636円、期末における元本残存率は26.0%、1口当たり純資産額は1.038557円です。

○損益の状況 (2020年3月10日～2020年9月9日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	△ 1,471	
受取利息	229	
支払利息	△ 1,700	
(B) 有価証券売買損益	8,314,392	
売買益	90,321,348	
売買損	△82,006,956	
(C) 信託報酬等	△ 130,090	
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,182,831	
(E) 前期繰越損益金	19,831,756	
(F) 解約差損益金	△ 3,500,152	
償還差益金(D+E+F)	24,514,435	

*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。

*損益の状況の中で(F)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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2016年3月18日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2020年9月9日		資産総額	660,933,433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	629,201円
				純資産総額	660,304,232円
受益権口数	2,441,184,783口	635,789,797口	△1,805,394,986口	受益権口数	635,789,797口
元 本 額	2,441,184,783円	635,789,797円	△1,805,394,986円	1万口当たり償還金	10,385円57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	2,434,259,572円	2,471,445,493円	10,153円	30円	0.30%
第2期	2,310,460,164	2,286,647,269	9,897	5	0.05
第3期	2,055,886,562	2,073,845,161	10,087	5	0.05
第4期	1,716,713,248	1,700,057,010	9,903	5	0.05
第5期	1,154,412,535	1,135,540,169	9,837	0	0.00
第6期	1,033,152,434	1,022,152,375	9,894	0	0.00
第7期	944,256,424	963,864,414	10,208	0	0.00
第8期	797,648,636	817,480,392	10,249	0	0.00
信託期間中1万口当たり総収益金及び年平均収益率				430円57銭	0.9606%

○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税込み）	10,385円57銭
-----------------	------------

○お知らせ

該当事項はございません。

日本企業外貨建て債券マザーファンド

償還運用報告書

第5期（償還日2020年9月8日）

作成対象期間（2019年9月10日～2020年9月8日）

受益者のみなさまへ

日本企業外貨建て債券マザーファンドの設定日以降、償還までの運用状況をご報告申し上げます。
ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の政府、政府機関、地方公共団体および企業（国内外の連結子会社および持分法適用関連会社を含みます。）が発行する先進国通貨建て（日本円を除きます。）の公社債（劣後債等を含みます。以下「先進国通貨建て公社債」といいます。）ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等（以下「日本を含む先進国の国債等」といいます。）を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。 外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	先進国通貨建て公社債ならびに日本を含む先進国の国債等を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		期騰	落中率			
(設定日)	円 銭		%	%	%	百万円
2016年3月18日	10,000		—	—	—	2,563
1期(2016年9月9日)	9,407		△5.9	96.4	—	2,406
2期(2017年9月11日)	10,153		7.9	97.9	—	2,203
3期(2018年9月10日)	10,413		2.6	97.9	—	1,286
4期(2019年9月9日)	10,753		3.3	96.2	—	1,080
(償還時)	(償還価額)					
5期(2020年9月8日)	11,101.05		3.2	—	—	752

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドでは、主としてわが国の企業が発行する先進国通貨建て（除く円）の社債（劣後債を含む）ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等に投資しておりますが、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○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		債組入比率	債券先物比率
		騰	落率		
(期首)	円 銭		%	%	%
2019年9月9日	10,753		—	96.2	—
9月末	10,821		0.6	83.9	—
10月末	10,939		1.7	85.6	—
11月末	11,042		2.7	89.9	—
12月末	11,054		2.8	89.2	—
2020年1月末	11,068		2.9	87.2	—
2月末	11,145		3.6	84.2	—
3月末	10,732		△0.2	48.9	—
4月末	10,883		1.2	49.5	—
5月末	10,996		2.3	44.8	—
6月末	11,051		2.8	45.9	—
7月末	10,963		2.0	46.0	—
8月末	11,101		3.2	—	—
(償還時)	(償還価額)				
2020年9月8日	11,101.05		3.2	—	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は以下の要因により変動しました。

- (上昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン（利子収入）
- (上昇) 保有債券の利回り低下に伴うキャピタルゲイン（値上がり益）

○当ファンドのポートフォリオ

わが国の政府、政府機関、地方公共団体および企業が発行する先進国通貨建て（日本円を除く）の公社債（劣後債等を含む）ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないました。

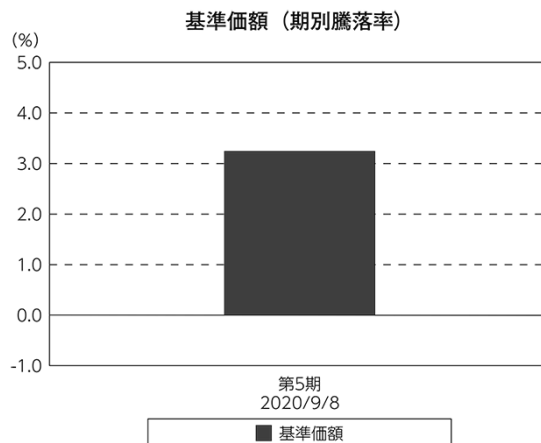
<当作成期中の主な動き>

償還に向けて、債券組入比率をゼロとしました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、主としてわが国の企業が発行する先進国通貨建て（除く円）の社債（劣後債を含む）ならびに日本を含む先進国の国債、政府保証債および地方債等に投資しておりますが、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎設定来の運用経過



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時の10,000円が償還時11,101.05円となりました。

第1期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン（利子収入）
- (上 昇) 保有の日本国内発行体の外貨建て社債利回りの低下（債券価格の上昇）によるキャピタルゲイン（値上がり益）
- (下 落) 円高進行に伴い、為替要因がマイナスとなったこと

第2期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (下 落) 保有の日本国内発行体の外貨建て社債利回りの上昇（債券価格の下落）によるキャピタルロス（値下がり損）
- (上 昇) 円安進行に伴い、為替要因がプラスとなったこと

第3期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (上 昇) 円安進行に伴う為替要因のプラス
- (下 落) 保有の日本国内発行体の外貨建て社債利回りの上昇によるキャピタルロス

第4期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (上 昇) 保有する日本国内発行体の外貨建て社債利回りの低下によるキャピタルゲイン
- (下 落) 円高ドル安に伴う為替要因のマイナス効果

第5期

- (上 昇) 日本国内発行体の外貨建て社債の保有による高水準のインカムゲイン
- (上 昇) 保有債券の利回り低下に伴うキャピタルゲイン

ご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2019年9月10日～2020年9月8日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.022	(a)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 ）	(2)	(0.021)	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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.022	
期中の平均基準価額は、10,982円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*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

(2019年9月10日～2020年9月8日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	特殊債券	千米ドル -	千米ドル 200 (600)
		社債券 (投資法人債券を含む)	801	5,140 (4,600)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

* () 内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券 (投資法人債券を含む) には新株予約権付社債 (転換社債) は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2019年9月10日～2020年9月8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

(2020年9月8日現在)

2020年9月8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

(2020年9月8日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 752,768	% 100.0
投資信託財産総額	752,768	100.0

*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 (2020年9月8日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	752,768,353
コール・ローン等	752,768,353
(B) 負債	965
未払利息	965
(C) 純資産総額(A-B)	752,767,388
元本	678,104,839
償還差益金	74,662,549
(D) 受益権総口数	678,104,839口
1万口当たり償還価額(C/D)	11,101円05銭

(注) 期首元本額は1,004,438,234円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は326,333,395円、1口当たり純資産額は1.110105円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額
 ・日本企業外貨建て債券ファンド2016-03 (為替ヘッジあり) 593,961,263円
 ・日本企業外貨建て債券ファンド2016-03 (為替ヘッジなし) 84,143,576円

○損益の状況 (2019年9月10日～2020年9月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	23,592,513
受取利息	23,690,824
支払利息	△ 98,311
(B) 有価証券売買損益	4,321,530
売買益	13,999,028
売買損	△ 9,677,498
(C) 保管費用等	△ 191,259
(D) 当期損益金(A+B+C)	27,722,784
(E) 前期繰越損益金	75,676,370
(F) 解約差損益金	△28,736,605
償還差益金(D+E+F)	74,662,549

*損益の状況の中で(F)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。

○お知らせ

該当事項はございません。