

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／海外／債券	
信託期間	2016年7月28日から2020年12月21日までです。	
運用方針	外貨建て日系債券マザーファンド16-07（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券への投資を通じて、本邦の企業およびその子会社等（海外子会社等を含みます。）または政府系機関・地方自治体等の発行する、主に米ドルを中心とした先進国通貨建ての債券に投資を行い、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要投資対象	当ファンド	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	外貨建て日系債券マザーファンド16-07	取得時においてBBB格相当以上の外貨建債券を主要投資対象とします。
投資制限	当ファンド	マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
	外貨建て日系債券マザーファンド16-07	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	年4回、3月、6月、9月および12月の各月の21日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、元本超過額または経費控除後の利子・配当等収益のいずれが多い金額とします。経費控除後の利子・配当等収益には、マザーファンドの利子・配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき利子・配当等収益を含むものとします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象収益が少額の場合には、収益分配を行わないことがあります。	

運用報告書（全体版）

外貨建て日系債券ファンド16-07 （為替ヘッジなし） （愛称 花めぐり（為替ヘッジなし））

第1期（決算日 2016年12月21日）

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「外貨建て日系債券ファンド16-07（為替ヘッジなし）（愛称 花めぐり（為替ヘッジなし）」は、2016年12月21日に第1期決算を迎えましたので、設定以来（第1期）の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。

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。

 **岡三アセットマネジメント**

〒104-0028 東京都中央区八重洲2-8-1

お問い合わせは弊社カスタマーサービス部へ
フリーダイヤル ☎0120-048-214（営業日の9:00～17:00）

【ホームページ】

<http://www.okasan-am.jp>

※アクセスにかかる通信料はおお客様のご負担となります。
※機種により本サービスをご利用いただけない場合があります。



○設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受益者 利回り	Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPY (参考指数)	期中 騰落率	債券 組入比率	債券 先物比率	元本 残存率
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 額	期 中 騰 落 率						
(設定日)	円	円	円	%	%	ポイント	%	%	%	%
2016年7月28日	10,000	—	—	—	—	241.8105	—	—	—	100.0
1期(2016年12月21日)	10,982	20	1,002	10.0	24.9	261.5119	8.1	97.7	—	69.2

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万口当たり、設定日の基準価額は、1万口当たりの当初設定元本額です。

(注) 基準価額の期中騰落額と期中騰落率、および受益者利回りは、分配金(税引前)込みです。

(注) 受益者利回りは、設定以来の年率換算利回りです。

(注) Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYは当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。

Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYは、当該日前営業日の指数値です。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、債券組入比率および債券先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

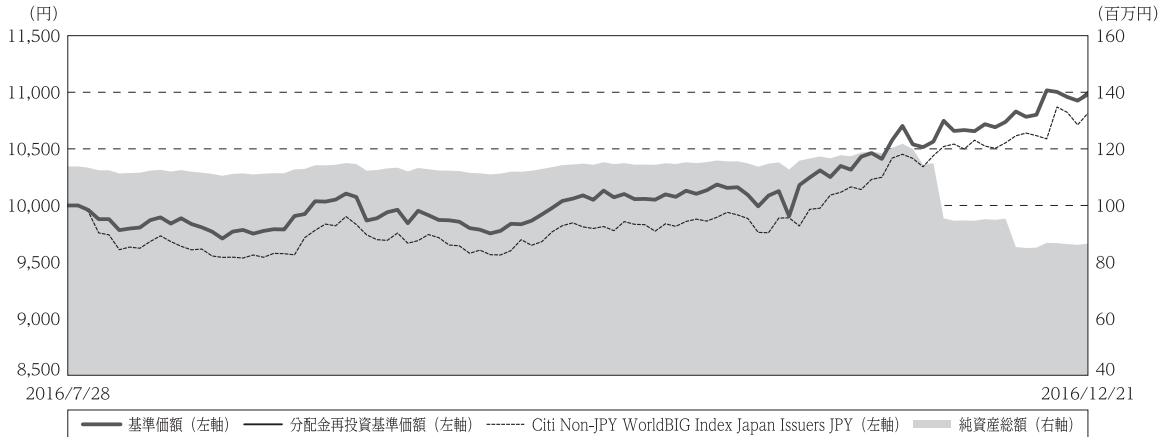
決算期	年 月 日	基準価額		Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPY (参考指数)		債券 組入比率	債券 先物比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
第1期	(設定日)	円	%	ポイント	%	%	%
	2016年7月28日	10,000	—	241.8105	—	—	—
	7月末	9,960	△ 0.4	240.4762	△0.6	47.1	—
	8月末	10,037	0.4	236.4981	△2.2	94.3	—
	9月末	9,834	△ 1.7	234.5065	△3.0	95.6	—
	10月末	10,155	1.6	240.3469	△0.6	95.4	—
	11月末	10,564	5.6	252.4431	4.4	95.2	—
(期 末)							
2016年12月21日	11,002	10.0	261.5119	8.1	97.7	—	

(注) 期末基準価額は1万口当たり分配金(税引前)込み、騰落率は設定日に対する率です。

運用経過

作成期間中の基準価額等の推移

(2016年7月28日～2016年12月21日)



設定日：10,000円

第1期末：10,982円 (既払分配金(税引前):20円)

騰落率：10.0% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
なお、当ファンドは単位型投信であり、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) 参考指数は、Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYです。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、設定日(2016年7月28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。
- (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) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。(以下同じ。)

○基準価額の主な変動要因

主要投資対象である「外貨建て日系債券マザーファンド16-07」における主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・保有債券からの利息収入がプラスに寄与しました。
- ・米ドルの対円での上昇がプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・保有債券の利回り上昇による価格下落がマイナスに寄与しました。

投資環境

(2016年7月28日～2016年12月21日)

米国の債券市場は、利回りが大幅に上昇しました。経済指標の改善や原油価格の上昇等を背景にインフレ期待が高まる中、拡張的な財政政策方針を掲げるトランプ候補が次期大統領に選出されたことから、景気拡大を期待した株式への買いが膨らむ一方、債券への売りが加速する展開となりました。

スプレッド (社債と国債の利回り格差) については、全般に拡大しました。欧米主要国の債券市場のボラティリティ (変動率) の高まり等を背景に、投資家の利回り選好の動きが弱まる展開となりました。

為替市場については、米ドルが対円で大幅に上昇しました。米国の金利先高観の高まりや日米の株価上昇等を背景に、米ドルを対円で買う動きが強まりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2016年7月28日～2016年12月21日)

「外貨建て日系債券マザーファンド16-07」の受益証券の組入比率を高位に保ちました。

実質組入外貨建資産につきましては、運用の基本方針通り為替ヘッジは行いませんでした。

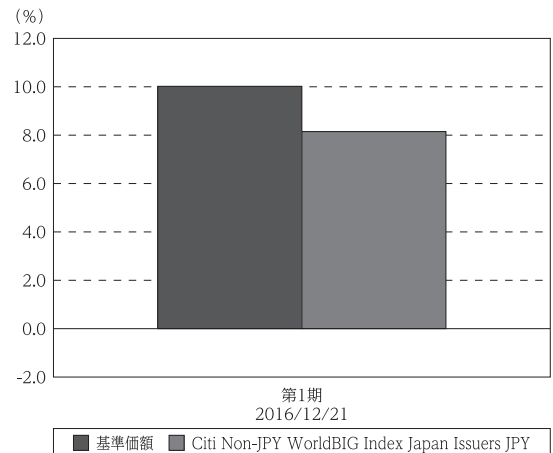
「外貨建て日系債券マザーファンド16-07」においては、本邦の企業等が発行する米ドル建ての債券に投資を行いました。ポートフォリオのデュレーションは、当ファンドの残存信託期間+0.5年程度とすることを目指しました。投資する銘柄の選択にあたっては、流動性、信用リスクに留意しつつ、利回り、業績、財務面等の魅力が高いと判断される債券に着目しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2016年7月28日～2016年12月21日)

当作成期間における当ファンドの分配金も考慮した基準価額の騰落率は、参考指数であるCiti Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYの騰落率を1.9%上回る結果となりました。

基準価額と参考指数の対比 (騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金 (税引前) 込みです。

(注) 参考指数は、Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYです。

分配金

（2016年7月28日～2016年12月21日）

当ファンドの分配対象収益の範囲は、元本超過額または経費控除後の利子・配当等収益のいずれか多い金額とします。当作成期間につきましては、20円（税引前）の分配を行いました。なお、留保益の運用につきましては、元本部分と同一の運用を行ってまいります。

今後の運用方針

米国の債券市場は、徐々に利回りの上昇圧力が弱まる展開を想定します。一般の選挙結果に対する市場の反応はやや行き過ぎと見られ、トランプ次期大統領が掲げる政策が実現する可能性や実効性を考慮すれば、足元の市場は将来の利上げやインフレを過剰に織り込んでいると考えられます。

スプレッドについては、全般に縮小方向への動きとなることを予想します。当面は債券市場のボラティリティの上昇を警戒し、不安定な展開となることが想定されますが、米国の金利上昇圧力が弱まるに連れて、徐々に投資家の利回り選好の動きが回復すると見込んでいます。また、全般に発行体の財務状況は健全と見られ、主要国の金融システムが安定していることも、社債市場を下支えすると考えています。

為替市場は、徐々に米ドルの対円での上値が重くなる展開を想定します。足元の米国の景気拡大観測や金利先高観の高まりは、トランプ新政権への期待が先行したものと思われ、今後は市場参加者が実体経済に目を向けて先行きを見極めようとするが見込まれるため、米ドルの対円での買いが弱まると考えています。

このような状況下、当ファンドの運用においては、主要な投資対象である「外貨建て日系債券マザーファンド16-07」の受益証券の組入れを高位に維持して運用する方針です。

○1万口当たりの費用明細

（2016年7月28日～2016年12月21日）

項 目	第1期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a)信託報酬＝作成期間中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(9)	(0.087)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(9)	(0.087)	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 ）	(1)	(0.011)	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	2	0.016	(b)その他費用＝作成期間中のその他費用÷作成期間中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.009)	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 ）	(1)	(0.005)	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)	(0.003)	その他は、金融商品取引を行う為の識別番号取得費用等
合 計	21	0.201	
作成期間中の平均基準価額は、10,110円です。			

(注) 作成期間中の費用（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。

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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、この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

（2016年7月28日～2016年12月21日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第1期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外貨建て日系債券マザーファンド16-07	千口 114,236	千円 113,000	千口 35,387	千円 37,200

(注) 口数・金額の単位未満は切捨てです。

○利害関係人との取引状況等

（2016年7月28日～2016年12月21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12月21日現在）

親投資信託残高

銘	柄	第1期末	
		口数	評価額
外貨建て日系債券マザーファンド16-07		千口 78,848	千円 85,929

（注）口数・評価額の単位未満は切捨てです。

○投資信託財産の構成

（2016年12月21日現在）

項目	第1期末	
	評価額	比率
外貨建て日系債券マザーファンド16-07	千円 85,929	% 99.0
コール・ローン等、その他	905	1.0
投資信託財産総額	86,834	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨てです。

（注）外貨建て日系債券マザーファンド16-07において、第1期末における外貨建純資産（819,765千円）の投資信託財産総額（824,380千円）に対する比率は99.4%です。

（注）外貨建て日系債券マザーファンド16-07における外貨建資産は、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。なお、第1期末における邦貨換算レートは1米ドル=117.94円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月21日現在)

項 目	第1期末
	円
(A) 資産	86,834,392
コール・ローン等	905,164
外貨建て日系債券マザーファンド16-07(評価額)	85,929,228
(B) 負債	310,487
未払収益分配金	157,576
未払信託報酬	147,187
その他未払費用	5,724
(C) 純資産総額(A-B)	86,523,905
元本	78,788,418
次期繰越損益金	7,735,487
(D) 受益権総口数	78,788,418口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,982円

(注) 計算期間末における1口当たり純資産額は、第1期1,0982円です。

(注) 当ファンドの設定元本額は113,788,418円、当作成期末における元本残存率は69.2%です。

○損益の状況 (2016年7月28日～2016年12月21日)

項 目	第1期
	円
(A) 配当等収益	△ 466
支払利息	△ 466
(B) 有価証券売買損益	2,189,173
売買益	2,189,173
(C) 有価証券評価差損益	7,940,055
(D) 信託報酬等	△ 209,199
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	9,919,563
(F) 解約差損益金	△2,026,500
(G) 計(E+F)	7,893,063
(H) 収益分配金	△ 157,576
次期繰越損益金(G+H)	7,735,487

(注) 損益の状況の中で、(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額、監査費用を含めて表示しています。(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。

(注) 収益分配金

(第1期)

計算期間末における元本超過額7,893,063円と費用控除後の配当等収益1,510,008円のうち、多い金額7,893,063円を分配対象金額として157,576円(10,000口当たり20円)を分配金額としております。

○分配金のお知らせ

	第1期
1万口当たり分配金(税引前)	20円
支払開始日	決算日から起算して5営業日までの間に支払いを開始します。
お支払場所	取得申込みを取扱った販売会社の本支店

<お知らせ>

該当事項はございません。

外貨建て日系債券マザーファンド16-07

マザーファンドの運用報告書につきましては、ベビーファンドの運用報告書と作成対象期間が異なる場合には、データ・コメント等に不一致が生じることがありますのでご了承ください。

外貨建て日系債券マザーファンド16-07

第1期 運用状況のご報告

決算日：2016年12月21日

「外貨建て日系債券マザーファンド16-07」は、2016年12月21日に第1期の決算を行いましたので、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。

運用方針	本邦の企業およびその子会社等（海外子会社等を含みます。）または政府系機関・地方自治体等の発行する、主に米ドルを中心とした先進国通貨建ての債券に投資を行い、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	取得時においてBBB格相当以上の外貨建債券を主要投資対象とします。
投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPY (参考指数)		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	騰落	率	騰落	率			
(設定日) 2016年7月28日	円	—	ポイント 241.8105	% —	% —	% —	百万円 800
1期(2016年12月21日)	10,898	9.0	261.5119	8.1	98.4	—	824

(注) 基準価額は1万円当たりです。

(注) 設定日の基準価額は1万円当たりの当初設定元本額です。設定日の純資産総額は当初設定元本総額です。

(注) Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYは当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。

Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYは、当該日前営業日の指数値です。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

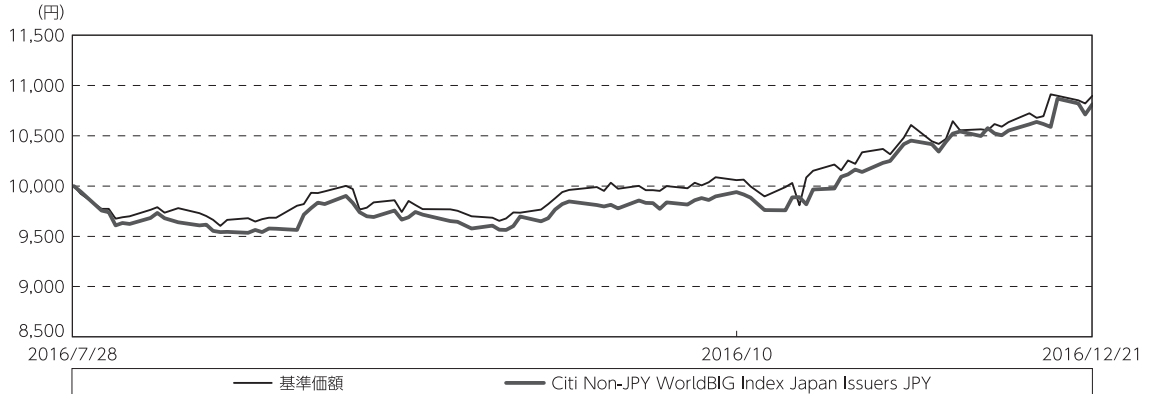
年月日	基準価額		Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPY (参考指数)		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(設定日) 2016年7月28日	円	—	ポイント 241.8105	% —	% —	% —
7月末	9,924	△0.8	240.4762	△0.6	89.6	—
8月末	9,933	△0.7	236.4981	△2.2	94.9	—
9月末	9,735	△2.7	234.5065	△3.0	96.2	—
10月末	10,058	0.6	240.3469	△0.6	96.0	—
11月末	10,468	4.7	252.4431	4.4	95.6	—
(期末) 2016年12月21日	10,898	9.0	261.5119	8.1	98.4	—

(注) 騰落率は設定日に対する率です。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2016年7月28日～2016年12月21日)



(注) 参考指数は、Citi Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYです。

(注) 参考指数は、設定日（2016年7月28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。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・保有債券からの利息収入がプラスに寄与しました。
- ・米ドルの対円での上昇がプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・保有債券の利回り上昇による価格下落がマイナスに寄与しました。

投資環境

(2016年7月28日～2016年12月21日)

米国の債券市場は、利回りが大幅に上昇しました。経済指標の改善や原油価格の上昇等を背景にインフレ期待が高まる中、拡張的な財政政策方針を掲げるトランプ候補が次期大統領に選出されたことから、景気拡大を期待した株式への買いが膨らむ一方、債券への売りが加速する展開となりました。

スプレッド（社債と国債の利回り格差）については、全般に拡大しました。欧米主要国の債券市場のボラティリティ（変動率）の高まり等を背景に、投資家の利回り選好の動きが弱まる展開となりました。

為替市場については、米ドルが対円で大幅に上昇しました。米国の金利先高観の高まりや日米の株価上昇等を背景に、米ドルを対円で買う動きが強まりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2016年7月28日～2016年12月21日)

本邦の企業等が発行する米ドル建ての債券に投資を行いました。ポートフォリオのデュレーションは、当ファンドの残存信託期間+0.5年程度とすることを目指しました。投資する銘柄の選択にあたっては、流動性、信用リスクに留意しつつ、利回り、業績、財務面等の魅力が高いと判断される債券に着目しました。

組入外貨建資産につきましては、運用の基本方針通り為替ヘッジは行いませんでした。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2016年7月28日～2016年12月21日)

当期間における当ファンドの基準価額の騰落率は、参考指数であるCiti Non-JPY WorldBIG Index Japan Issuers JPYの騰落率を0.9%上回る結果となりました。

今後の運用方針

米国の債券市場は、徐々に利回りの上昇圧力が弱まる展開を想定します。今般の選挙結果に対する市場の反応はやや行き過ぎと見られ、トランプ次期大統領が掲げる政策が実現する可能性や実効性を考慮すれば、足元の市場は将来の利上げやインフレを過剰に織り込んでいると考えられます。

スプレッドについては、全般に縮小方向への動きとなることを予想します。当面は債券市場のボラティリティの上昇を警戒し、不安定な展開となることが想定されますが、米国の金利上昇圧力が弱まるに連れて、徐々に投資家の利回り選好の動きが回復すると見込んでいます。また、全般に発行体の財務状況は健全と見られ、主要国の金融システムが安定していることも、社債市場を下支えすると考えています。

為替市場は、徐々に米ドルの対円での上値が重くなる展開を想定します。足元の米国の景気拡大観測や金利先高観の高まりは、トランプ新政権への期待が先行したものと思われ、今後は市場参加者が実体経済に目を向けて先行きを見極めようとするが見込まれるため、米ドルの対円での買いが弱まると考えています。

このような状況下、当ファンドの運用においては、債券組入比率を高位に維持して運用する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年7月28日～2016年12月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(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)	1	0.012	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)	(1)	(0.009)	
	(0)	(0.003)	その他は、金融商品取引を行う為の識別番号取得費用等
合 計	1	0.012	
期中の平均基準価額は、10,023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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各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

(2016年7月28日～2016年12月21日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国		社債券（投資法人債券を含む）	千米ドル	千米ドル
	アメリカ		8,221	960

(注) 金額は受渡代金です。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) 単位未満は切捨てです。

(注) 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

(2016年7月28日～2016年12月21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12月21日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	6,550	6,874	810,785	98.4	—	71.2	27.2	—
合 計	6,550	6,874	810,785	98.4	—	71.2	27.2	—

(注) 邦貨換算金額は、当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。

(注) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

(注) B B格以下組入比率は、S & P と Moody's の信用格付けのうち、高い方を採用しています。

(注) 一印は組み入れがありません。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末						
	利 率	額面金額	評 価 額		債還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
アメリカ	%	千米ドル	千米ドル	千円			
普通社債券 (含む投資法人債株)							
DAI-ICHI LIFE 7.25	7.25	550	620	73,211	—		
FUKOKU MUTUAL 6.5	6.5	400	438	51,723	—		
MEIJI YASUDA LIF 5.2	5.2	600	616	72,707	2045/10/20		
MITSUB UFJ FIN G	2.81067	200	207	24,414	2021/3/1		
MITSUB UFJ LEASE	1.65678	400	398	46,971	2019/7/23		
MITSUI SUMITOMO 7	7.0	500	565	66,660	2072/3/15		
MIZUHO FIN GROUP 4.6	4.6	600	624	73,699	2024/3/27		
NIPPON LIFE INS 5	5.0	600	618	72,924	2042/10/18		
NISSAN MOTOR ACC 2.125	2.125	400	393	46,455	2020/3/3		
NOMURA HOLDINGS 2.75	2.75	400	402	47,490	2019/3/19		
ORIX CORP 2.65	2.65	200	196	23,166	2021/4/13		
SOMPO JAPAN INS 5.325	5.325	600	630	74,384	2073/3/28		
SUMITOMO LIFE 6.5	6.5	400	446	52,629	2073/9/20		
SUMITOMO MITSUI	1.99111	100	100	11,846	2021/7/14		
SUMITOMO MITSUI 4.436	4.436	400	414	48,886	2024/4/2		
SUNTORY HOLDINGS 2.55	2.55	200	200	23,613	2019/9/29		
合 計				810,785			

(注) 邦貨換算金額は、当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。

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切捨てです。

(注) 変動利付債の利率は、期末における利率です。

(注) 債還年月日が「—」表示の銘柄は永久債です。

○投資信託財産の構成

(2016年12月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 810,785	% 98.4
コール・ローン等、その他	13,595	1.6
投資信託財産総額	824,380	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注) 当期末における外貨建純資産(819,765千円)の投資信託財産総額(824,380千円)に対する比率は99.4%です。

(注) 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。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=117.94円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	824,380,365 円
コール・ローン等	4,614,902
公社債(評価額)	810,785,724
未収利息	8,860,980
前払費用	118,759
(B) 負債	52
未払利息	3
その他未払費用	49
(C) 純資産総額(A-B)	824,380,313
元本	756,428,803
次期繰越損益金	67,951,510
(D) 受益権総口数	756,428,803口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,898円

(注) 計算期間末における1口当たり純資産額は1.0898円です。

(注) 当ファンドの当初設定元本額は800,000,000円、期中追加設定元本額は64,264,674円、期中一部解約元本額は107,835,871円です。

(注) 当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。

- ・外貨建て日系債券ファンド16-07(為替ヘッジあり) 677,580,181円
- ・外貨建て日系債券ファンド16-07(為替ヘッジなし) 78,848,622円

○損益の状況 (2016年7月28日～2016年12月21日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	14,714,065 円
受取利息	14,723,750
支払利息	△ 9,685
(B) 有価証券売買損益	60,464,737
売買益	106,277,725
売買損	△ 45,812,988
(C) その他費用等	△ 98,489
(D) 当期損益金(A+B+C)	75,080,313
(E) 追加信託差損益金	△ 1,264,674
(F) 解約差損益金	△ 5,864,129
(G) 計(D+E+F)	67,951,510
次期繰越損益金(G)	67,951,510

(注) 損益の状況の中で、(B)有価証券売買損益は期末の評価替えによるものを含みます。(E)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。(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。