

## 第20期【償還】

# 運用報告書(全体版)

## 米国中小型株オープン

【2021年5月17日償還】

### 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「米国中小型株オープン」は、2021年5月17日をもって信託約款の規定に基づき、償還となりました。ここに設定以来の運用経過及び償還内容のご報告をいたしますとともに、皆様のご愛顧に対し改めてお礼申し上げます。

今後とも、弊社ファンドに対しまして、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社営業部 セールスサポートグループへ  
フリーダイヤル ☎ 0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

[ホームページ]

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

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

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/株式	
信託期間	2011年5月31日から2021年5月17日までです。	
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、実質的に米国の中小型株式(DR(預託証券))を含みます。)およびわが国の公社債、短期金融商品に投資し、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 実質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	米国成長株ファンドF(適格機関投資家専用)および日本マネー・マザーファンドを主要投資対象とします。
	米国成長株ファンドF(適格機関投資家専用)	GIM米国成長株マザーファンド(適格機関投資家専用)の受益証券を主要投資対象とします。マザーファンドの主要投資対象は米国の中小型株式に該当すると判断されるものとします。
	日本マネー・マザーファンド	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式および外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎年5月17日および11月17日(それぞれ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繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 繰越分を含めた配当等収益には、日本マネー・マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき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、基準価額水準等を勘案して決定します。分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。	

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ラッセル2000種指数 (円換算後)		債券 組入比率	投資信託 組入比率	米国成長株 ファンドF (適格機関 投資家専用) 組入比率	日本マネー マザー ファンド 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率					
(設定日) 2011年5月31日	円 銭 10,000	円 —	% —	ポイント 67,636.71	% —	%	%	% —	% —	百万円 3,058
1期 (2011年11月17日)	8,393	0	△16.1	56,250.31	△16.8			92.4	0.5	2,797
2期 (2012年5月17日)	9,216	0	9.8	61,992.71	10.2			93.8	2.0	738
3期 (2012年11月19日)	9,444	0	2.5	63,228.01	2.0			93.0	3.1	480
4期 (2013年5月17日)	13,818	600	52.7	100,790.43	59.4			87.9	0.7	451
5期 (2013年11月18日)	14,980	500	12.0	111,943.70	11.1			99.8	0.2	5,408
6期 (2014年5月19日)	14,476	400	△0.7	112,033.09	0.1			95.0	0.3	7,712
7期 (2014年11月17日)	17,056	600	22.0	136,677.85	22.0			85.1	0.9	2,532
8期 (2015年5月18日)	17,887	600	8.4	148,825.94	8.9	1.0	93.7			2,158
9期 (2015年11月17日)	16,728	600	△3.1	142,464.11	△4.3	0.8	95.5			1,607
10期 (2016年5月17日)	13,742	400	△15.5	121,622.46	△14.6	0.2	92.9			1,258
11期 (2016年11月17日)	15,533	400	15.9	141,601.23	16.4	0.1	97.6			1,116
12期 (2017年5月17日)	15,919	500	5.7	157,041.31	10.9	0.1	93.7			1,653
13期 (2017年11月17日)	16,203	400	4.3	167,972.95	7.0	0.2	94.3			1,645
14期 (2018年5月17日)	16,406	700	5.6	178,333.77	6.2	0.2	95.0			1,625
15期 (2018年11月19日)	15,152	500	△4.6	172,198.80	△3.4	0.2	96.2			1,516
16期 (2019年5月17日)	14,261	400	△3.2	171,296.29	△0.5	0.3	96.0			1,247
17期 (2019年11月18日)	14,315	400	3.2	173,726.12	1.4	0.3	91.8			1,223
18期 (2020年5月18日)	11,219	100	△20.9	134,736.97	△22.4	0.3	91.5			1,428
19期 (2020年11月17日)	15,051	500	38.6	186,531.91	38.4	0.2	97.1			2,215
(償還時) 20期 (2021年5月17日)	(償還価額) 19,561.22	—	30.0	243,485.75	30.5	—	—			1,508

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万円当たり、基準価額の騰落率は分配金(税引前)込み。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) ラッセル2000種指数(円換算後)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。

ラッセル2000種指数(円換算後)は、当該日前営業日の現地終値を為替レート(対顧客電信売買相場の当日(東京)の仲値)を乗じて  
岡三アセットマネジメントが算出しています。

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

(注) 第8期より、組入比率の記載について、ファンド別の記載から、資産別の記載に変更しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

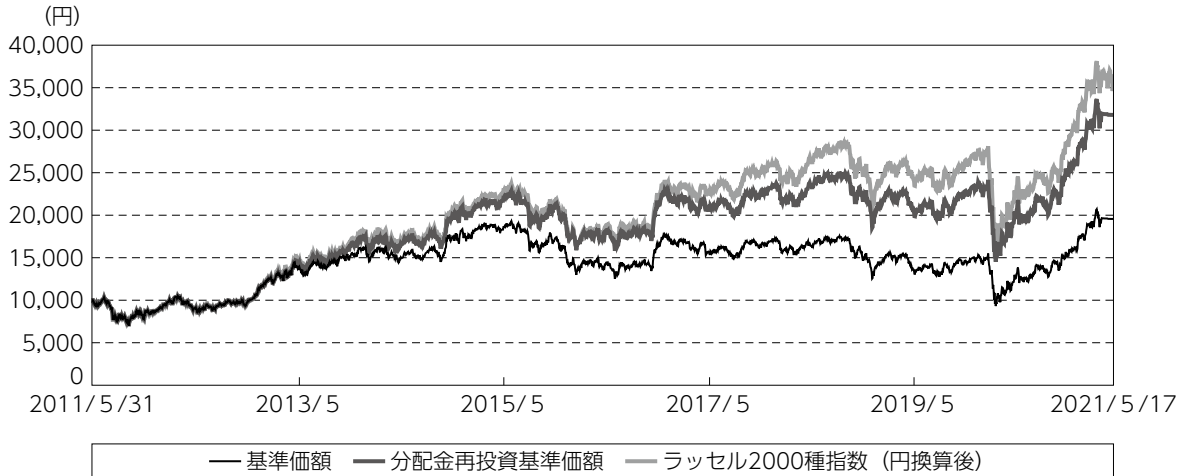
年 月 日	基 準 価 額		ラ ッ セ ル 2000 種 指 数 (円 換 算 指 数 後) (参考指数)		債 組 入 比	券 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	円 銭	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率			
(期 首) 2020年11月17日	15,051	—	186,531.91	—	0.2	%	97.1
11月末	15,472	2.8	192,744.00	3.3	0.2	%	97.6
12月末	15,918	5.8	202,794.07	8.7	0.2	%	98.4
2021年1月末	17,357	15.3	220,098.51	18.0	0.2	%	96.5
2月末	18,622	23.7	233,768.28	25.3	0.1	%	97.4
3月末	19,531	29.8	243,096.58	30.3	0.2	%	94.1
4月末	19,568	30.0	250,044.02	34.0	0.2	%	—
(償還時) 2021年5月17日	(償還価額) 19,561.22	30.0	243,485.75	30.5	—	%	—

(注) 騰落率は期首比。

## 設定以来の運用経過

### 設定以来の基準価額等の推移

(2011年5月31日～2021年5月17日)



- (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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、ラッセル2000種指数(円換算後)です。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、設定日(2011年5月31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。

### 設定以来の投資環境

(2011年5月31日～2021年5月17日)

米国の中小型株式市場は、設定当初は欧州の債務問題に対する先行き不透明感などから下落しましたが、2011年10月以降は、米国の経済指標が概ね好調であったことや、欧州中央銀行(ECB)による金融機関向けの支援策により、債務問題に対する先行き不透明感が後退し、堅調に推移しました。2013年は、バーナンキ米連邦準備制度理事会(FRB)議長が、量的金融緩和政策の早期縮小の可能性を示唆したことを受けて、下げる場面もありましたが、その後のFRB議長の議会証言などを受けて、早期縮小観測が後退し、上昇に転じました。2014年から2015年にかけては、これまでの上昇を受けて、やや過熱感が台頭して、利益確定の売りが優勢となり、上値が抑えられました。その後は、2016年11月に、トランプ氏が大統領選に勝利し、同氏が打ち出す政策への期待感から上昇しました。2018年に入っても、好調な米国経済を受けて上昇基調が続きましたが、米中の貿易摩擦に対する懸念が広がったことを受けて、下落に転じました。その後は、もみ合いで推移しましたが、2020年に入ると、新型コロナウイルスの新規感染者が急増し、世界的な大流行(パンデミック)に対する懸念が高まったことから、急落しました。しかし、3月に政府が大規模な経済対策を相次いで打ち出したことや、FRBが無制限で量的緩和を行うと表明したことを好感し、急反発しました。その後も、新型コロナウイルスのワクチン開発や、バイデン政権の経済政策に対する期待感から、上昇基調が継続しました。

**設定以来の当ファンドのポートフォリオ**

(2011年5月31日～2021年5月17日)

**<米国中小型株オープン>**

「米国成長株ファンドF（適格機関投資家専用）」と「日本マネー・マザーファンド」への投資を通じて、実質的に米国の中小型株式およびわが国の公社債、短期金融商品に投資を行いました。また「米国成長株ファンドF（適格機関投資家専用）」の組入比率につきましては、概ね高位を維持しました。

なお、2021年4月中旬以降は、償還に向けて、「米国成長株ファンドF（適格機関投資家専用）」と「日本マネー・マザーファンド」を売却し、短期金融市場で資金を運用しました。

○米国成長株ファンドF（適格機関投資家専用）

「G I M米国成長株マザーファンド（適格機関投資家専用）」（当初の「J P M米国成長株マザーファンド（適格機関投資家専用）」から名称変更）への投資を通じて、米国の中小型株式に該当すると判断する有価証券に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行いました。

なお、償還に向けて、「G I M米国成長株マザーファンド（適格機関投資家専用）」への投資を通じて保有する全ての米国の中小型株式を売却し、短期金融市場で資金を運用しました。

○日本マネー・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行いました。主に、政府保証債の組み入れを行いました。

**設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異**

(2011年5月31日～2021年5月17日)

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、分配金も考慮した設定以来の基準価額の騰落率は、参考指数としているラッセル2000種指数（円換算後）の騰落率を下回りました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年11月18日～2021年5月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	100 ( 39) ( 58) ( 3)	0.565 (0.218) (0.327) (0.019)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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 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 (監 査 費 用) (そ の 他)	1 ( 1) ( 0)	0.007 (0.007) (0.001)	(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 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	101	0.572	
期中の平均基準価額は、17,744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) その他費用は、当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。

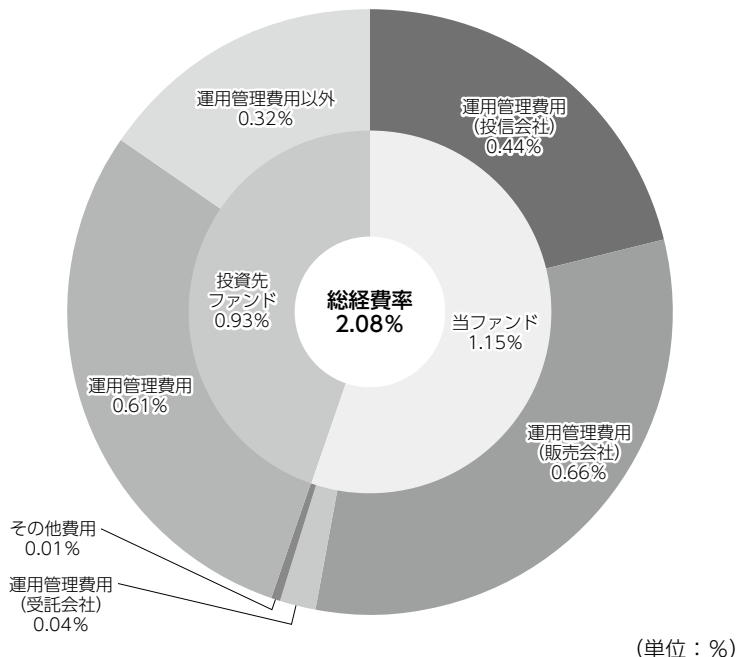
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

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、売買委託手数料およ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2.08%です。



(単位：%)

総経費率 (①+②+③)	2.08
①当ファンドの費用の比率	1.15
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.61
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.32

(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、売買委託手数料およ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) 投資先ファンドとは、当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。）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、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(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11月18日～2021年5月17日)

○売買及び取引の状況とは、ファンドが購入・売却した有価証券の数量および金額です。

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	米国成長株ファンドF (適格機関投資家専用)	33,742,620	112,000	811,563,665 (4,704,758)	2,893,000 (11,891)

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ( )内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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
日本マネー・マザーファンド		千口 -	千円 -	千口 4,940	千円 5,023

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年11月18日～2021年5月17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

(2021年5月17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
米国成長株ファンドF (適格機関投資家専用)			口 782,525,803
合 計			782,525,803

(注) 口数の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘	柄	期	首(前期末)
		口	数
日本マネー・マザーファンド			千口 4,940

(注) 口数の単位未満は切捨て。



○投資信託財産の構成

(2021年5月17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 1,563,498	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	1,563,498	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2021年5月17日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	1,563,498,322
コール・ローン等	1,563,498,322
(B) 負債	55,246,277
未払解約金	42,174,010
未払信託報酬	12,914,214
未払利息	774
その他未払費用	157,279
(C) 純資産総額(A-B)	1,508,252,045
元本	771,041,822
償還差益金	737,210,223
(D) 受益権総口数	771,041,822口
1万口当たり償還価額(C/D)	19,561円22銭

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.956122円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は1,471,914,663円、期中追加設定元本額は177,547,286円、期中一部解約元本額は878,420,127円です。

○損益の状況 (2020年11月18日～2021年5月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 21,635
受取利息	148
支払利息	△ 21,783
(B) 有価証券売買損益	337,592,681
売買益	427,382,066
売買損	△ 89,789,385
(C) 信託報酬等	△ 13,079,820
(D) 当期損益金(A+B+C)	324,491,226
(E) 前期繰越損益金	47,776,412
(F) 追加信託差損益金	364,942,585
(配当等相当額)	( 166,786,701)
(売買損益相当額)	( 198,155,884)
償還差益金(D+E+F)	737,210,223

(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	2011年5月31日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年5月17日		資産総額	1,563,498,322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	55,246,277円
				純資産総額	1,508,252,045円
受益権口数	3,058,040,000口	771,041,822口	△2,286,998,178口	受益権口数	771,041,822口
元本額	3,058,040,000円	771,041,822円	△2,286,998,178円	1万口当たり償還金	19,561円22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	3,332,680,000円	2,797,215,473円	8,393円	0円	0.0000%
第2期	800,925,980	738,135,265	9,216	0	0.0000
第3期	508,476,387	480,206,855	9,444	0	0.0000
第4期	326,956,473	451,772,285	13,818	600	6.0000
第5期	3,610,722,207	5,408,767,935	14,980	500	5.0000
第6期	5,327,793,968	7,712,701,354	14,476	400	4.0000
第7期	1,484,994,357	2,532,849,244	17,056	600	6.0000
第8期	1,206,858,524	2,158,698,463	17,887	600	6.0000
第9期	961,193,931	1,607,914,211	16,728	600	6.0000
第10期	915,994,754	1,258,764,738	13,742	400	4.0000
第11期	718,619,474	1,116,238,645	15,533	400	4.0000
第12期	1,038,645,045	1,653,437,652	15,919	500	5.0000
第13期	1,015,679,185	1,645,664,572	16,203	400	4.0000
第14期	990,872,262	1,625,673,917	16,406	700	7.0000
第15期	1,001,037,177	1,516,786,457	15,152	500	5.0000
第16期	874,493,272	1,247,099,950	14,261	400	4.0000
第17期	854,635,364	1,223,380,509	14,315	400	4.0000
第18期	1,272,930,122	1,428,064,345	11,219	100	1.0000
第19期	1,471,914,663	2,215,315,358	15,051	500	5.0000

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金	19,561円22銭
-----------	------------

<お知らせ>

該当事項はございません。

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場合がありますのでご了承ください。

## 日本マナー・マザーファンド 第15期 運用状況のご報告 決算日：2020年10月12日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として安定運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
投資制限	株式および外貨建資産への投資は行いません。

### ○最近5期の運用実績

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
		騰	落			
11期 (2016年10月11日)	円 10,201	% 0.0		% 51.0	% —	百万円 752
12期 (2017年10月10日)	10,194	△0.1		72.4	—	761
13期 (2018年10月10日)	10,187	△0.1		86.0	—	778
14期 (2019年10月10日)	10,180	△0.1		97.5	—	680
15期 (2020年10月12日)	10,172	△0.1		88.9	—	429

(注) 基準価額は1万円当たり。

(注) 当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動する成果を目指した運用を行っていません。そのため、特定のベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

(注) 債券先物比率=買建比率-売建比率。

### ○当期中の基準価額と市況等の推移

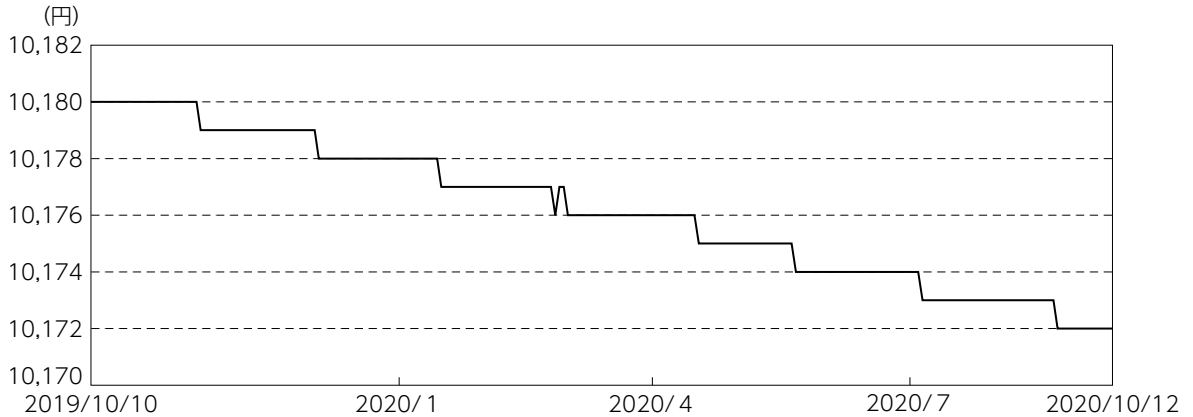
年月日	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰	落			
(期首) 2019年10月10日	円 10,180	% —		% 97.5	% —	% —
10月末	10,180	0.0		90.1	—	—
11月末	10,179	△0.0		84.2	—	—
12月末	10,178	△0.0		93.1	—	—
2020年1月末	10,178	△0.0		75.2	—	—
2月末	10,177	△0.0		84.1	—	—
3月末	10,177	△0.0		95.6	—	—
4月末	10,176	△0.0		72.3	—	—
5月末	10,175	△0.0		72.2	—	—
6月末	10,174	△0.1		74.7	—	—
7月末	10,174	△0.1		65.5	—	—
8月末	10,173	△0.1		65.5	—	—
9月末	10,172	△0.1		88.9	—	—
(期末) 2020年10月12日	10,172	△0.1		88.9	—	—

(注) 騰落率は期首比。

## 運用経過

## 期中の基準価額の推移

(2019年10月11日～2020年10月12日)



## ○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)

- ・特にありません。

## (主なマイナス要因)

- ・日銀のマイナス金利政策の影響により、保有債券の利回りがマイナス圏で推移したことが、マイナス要因となりました。

**投資環境**

(2019年10月11日～2020年10月12日)

短期金融市場では、1年国債利回りが上昇しました。1年国債利回りは、米中通商協議の進展や日銀のマイナス金利の深掘り観測が後退したことにより、2020年1月上旬に-0.10%へ上昇しました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う景気減速懸念を背景に、3月上旬にかけて、1年国債利回りは-0.2%台後半へ急低下する場面がありましたが、日銀がマイナス金利の深掘りを見送ったことから、-0.1%台前半へ急上昇しました。ただ、4月以降、1年国債利回りは-0.1%台前半を中心にみ合う動きとなりました。

**当ファンドのポートフォリオ**

(2019年10月11日～2020年10月12日)

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行いました。当期間中は、政府保証債を組み入れました。

**当ファンドのベンチマークとの差異**

(2019年10月11日～2020年10月12日)

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

**今後の運用方針****(投資環境の見通し)**

国内短期金融市場は、日銀によるマイナス金利政策の継続が見込まれることから、主要な投資対象であるわが国の公社債および短期金融商品の利回りがマイナス圏での推移となり、今後も厳しい運用環境が続くと予想されます。

**(運用方針)**

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益確保を目的に運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2019年10月11日～2020年10月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	0	0.001	

期中の平均基準価額は、10,176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

(2019年10月11日～2020年10月12日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	特殊債券	千円 443,561	千円 — (720,000)

(注) 金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ( ) 内は償還等による増減分です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年10月11日～2020年10月12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10月12日現在)

## 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	%	%	%	%	%
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	380,000 (380,000)	382,046 (382,046)	88.9 (88.9)	— (—)	— (—)	— (—)	88.9 (88.9)
合 計	380,000 (380,000)	382,046 (382,046)	88.9 (88.9)	— (—)	— (—)	— (—)	88.9 (88.9)

(注) ( ) 内は非上場債券で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(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。

## (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
特殊債券（除く金融債）	%	千円	千円	
第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.11	100,000	100,067	2021/2/12
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	50,000	50,023	2020/10/30
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	70,000	70,517	2021/4/30
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	160,000	161,436	2021/6/30
小 計		380,000	382,046	
合 計		380,000	382,046	

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2020年10月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 382,046	% 88.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	47,740	11.1
投 資 信 託 財 産 総 額	429,786	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年10月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	429,786,436
コール・ローン等	46,855,126
公社債(評価額)	382,046,142
未収利息	691,196
前払費用	193,972
(B) 負債	538
未払利息	19
その他未払費用	519
(C) 純資産総額(A-B)	429,785,898
元本	422,513,077
次期繰越損益金	7,272,821
(D) 受益権総口数	422,513,077口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,172円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1,0172円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は668,362,483円、期中追加設定元本額は761,996円、期中一部解約元本額は246,611,402円です。

(注) 当親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。

アジア・オセアニア好配当成長株オープン (毎月分配型)	325,834,704円
米国短期ハイ・イールド債券オープン	49,037,879円
新興国連続増配成長株オープン	26,594,229円
米国中小型株オープン (3ヵ月決算型)	7,792,381円
米国中小型株オープン	4,940,794円
アジア・オセアニア好配当成長株オープン (1年決算型)	4,512,263円
インカム資産オープン (アジア・オセアニア)	2,035,255円
米国優先リート17-07 (為替ヘッジあり)	1,765,572円

## ○損益の状況 (2019年10月11日～2020年10月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,289,828
受取利息	4,335,682
支払利息	△ 45,854
(B) 有価証券売買損益	△ 4,687,171
売買損	△ 4,687,171
(C) その他費用等	△ 4,426
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 401,769
(E) 前期繰越損益金	12,049,531
(F) 追加信託差損益金	13,657
(G) 解約差損益金	△ 4,388,598
(H) 計(D+E+F+G)	7,272,821
次期繰越損益金(H)	7,272,821

(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(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)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。

## &lt;お知らせ&gt;

該当事項はございません。