

## 第9期【償還】

# 運用報告書(全体版)

## 米国好配当リバランスオープン (年2回決算型)(為替ヘッジあり)

【2021年10月8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「米国好配当リバランスオープン(年2回決算型)(為替ヘッジあり)」は、2021年10月8日をもって信託約款の規定に基づき、繰上償還となりました。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	2017年6月28日から2021年10月8日(当初2027年5月21日)までです。	
運用方針	米国好配当リバランスマザーファンド(以下、「マザーファンド」といいます。)を通じて、主として米国の取引所に上場している株式に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長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、為替変動リスクの低減を図ります。	
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。
	米国好配当リバランスマザーファンド	米国の取引所上場株式(これに準ずるものを含みます。)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。
	米国好配当リバランスマザーファンド	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。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5月21日および11月21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、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、委託会社が分配対象収益の中から主として配当等収益を勘案して決定します。また、基準価額が当初元本を上回っている場合は、配当等収益または元本超過分の概ね、いずれか多い額を分配金額とします。ただし、市場環境や資金動向等によっては、分配金額が元本超過分とならない場合があります。 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			MSCI USA指数 (米ドル建て)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配先)	税金	み騰落中率	(参考指数)	騰落中率			
(設定日)	円 銭	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
2017年6月28日	10,000	—	—	2,304.86	—	—	—	57
1期(2017年11月21日)	10,007	350	3.6	2,460.17	6.7	87.5	—	189
2期(2018年5月21日)	10,008	80	0.8	2,586.59	5.1	89.5	—	64
3期(2018年11月21日)	9,724	130	△ 1.5	2,510.50	△ 2.9	90.5	—	52
4期(2019年5月21日)	9,868	150	3.0	2,706.41	7.8	93.1	—	44
5期(2019年11月21日)	10,005	170	3.1	2,962.40	9.5	87.1	—	35
6期(2020年5月21日)	7,878	130	△20.0	2,846.24	△ 3.9	92.6	—	18
7期(2020年11月24日)	9,861	180	27.5	3,477.81	22.2	90.9	—	20
8期(2021年5月21日)	10,000	2,470	26.5	4,028.38	15.8	85.9	—	16
(償還時)	(償還価額)							
9期(2021年10月8日)	9,799.64	—	△ 2.0	4,275.13	6.1	—	—	17

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万口当たり、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) MSCI USA指数(米ドル建て)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。

MSCI USA指数(米ドル建て)は当該日前営業日の現地終値です。

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

(注) 株式先物比率=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		MSCI USA指数 (米ドル建て)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	(参考指数)	騰落率		
(期首)	円 銭	%	ポイント	%	%	%
2021年5月21日	10,000	—	4,028.38	—	85.9	—
5月末	9,977	△0.2	4,074.95	1.2	92.8	—
6月末	9,811	△1.9	4,181.75	3.8	92.3	—
7月末	9,801	△2.0	4,303.58	6.8	91.5	—
8月末	9,898	△1.0	4,407.37	9.4	93.1	—
9月末	9,805	△2.0	4,232.45	5.1	—	—
(償還時)	(償還価額)					
2021年10月8日	9,799.64	△2.0	4,275.13	6.1	—	—

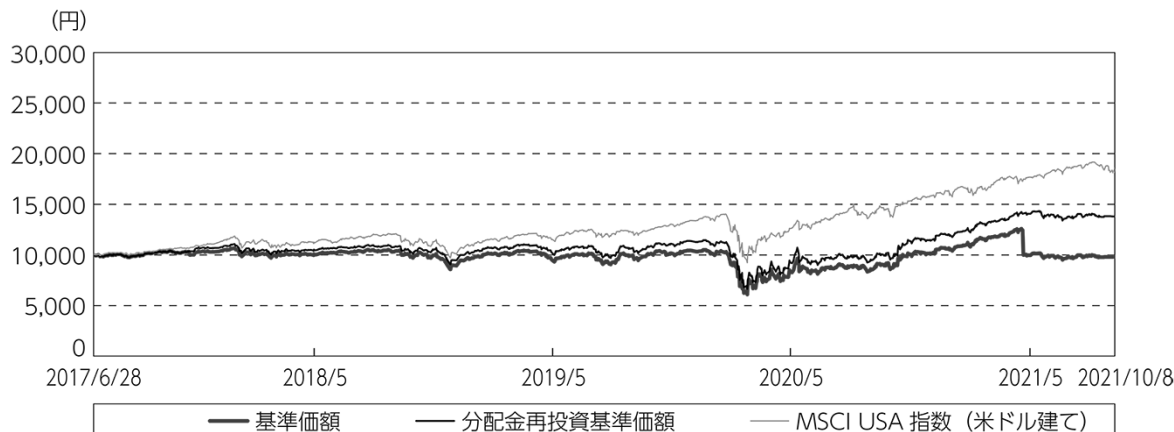
(注) 騰落率は期首比。

MSCI USA指数はMSCI Inc. が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

## 設定以来の運用経過

### 設定以来の基準価額等の推移

（2017年6月28日～2021年10月8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、MSCI USA指数（米ドル建て）です。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、設定日（2017年6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。

### 設定以来の投資環境

（2017年6月28日～2021年10月8日）

米国株式市場は、トランプ政権の法人減税を柱とする税制改革法案への期待などを背景に、2017年は堅調に推移しました。2018年から2019年にかけては、通商問題をはじめとする米中間の対立激化や、米連邦準備制度理事会（FRB）の金融引き締め姿勢が嫌気され、株価が下落する場面がありましたが、好調な米企業業績が支えとなり、上昇基調が続きました。2020年に入ってから、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）へ発展したことを受けて大きく下落しましたが、相次いで大規模な経済対策やFRBによる金融支援が打ち出されたことで、その後、株価は急速に持ち直す動きとなりました。2021年も、新型コロナウイルスのワクチン接種進展による経済活動の正常化や、バイデン新政権のインフラ投資など経済政策への期待を背景に株価は上昇基調を維持し、主要な株価指数は過去最高値を更新する展開となりました。

**設定以来の当ファンドのポートフォリオ**

（2017年6月28日～2021年10月8日）

**<米国好配当リバランスオープン（年2回決算型）（為替ヘッジあり）>**

「米国好配当リバランスマザーファンド」を通じて、米国の取引所に上場している株式を組み入れ、実質株式組入比率は、資金変動や決算対応で一時的に低下した時期を除き、概ね80%台後半から90%台半ばの範囲で推移させました。また、実質組入外貨建資産については、運用の基本方針に則り為替ヘッジを行い、高位のヘッジ比率を維持しました。

○米国好配当リバランスマザーファンド

米国の取引所に上場している株式の組入比率を概ね高位に維持しました。運用の基本方針に則り、MSCI USA指数採用銘柄（REITを除く）の中から、原則として予想配当利回りの高い上位70銘柄を選定し、各銘柄への資産配分が概ね等金額になるよう組入銘柄の入替と組入比率の調整（リバランス）を行いました。リバランスについては、毎月1回の頻度で行いました。その後、2021年9月中旬に繰上償還が決定したことを受けて、組入株式を売却し、短期金融市場で資金を運用しました。

**設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異**

（2017年6月28日～2021年10月8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、設定以来の分配金も考慮した当ファンドの基準価額の騰落率は、参考指数としているMSCI USA指数（米ドル建て）の騰落率を下回りました。

## ○ 1万口当たりの費用明細

（2021年5月22日～2021年10月8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 ）	(21)	(0.211)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(17)	(0.169)	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 ）	( 2)	(0.021)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	13	0.131	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(13)	(0.131)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	( 0)	(0.001)	有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用	27	0.274	(d) 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 ）	(23)	(0.233)	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)	(0.005)	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 ）	( 4)	(0.037)	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	80	0.807	
期中の平均基準価額は、9,858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。

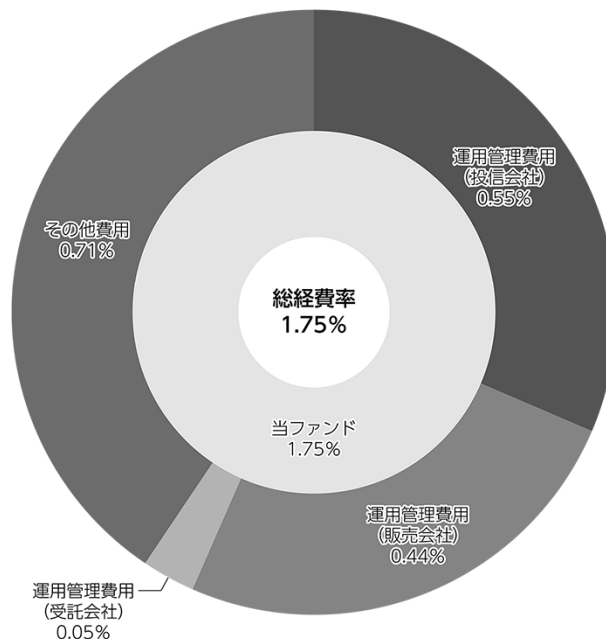
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.75%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) 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

（2021年5月22日～2021年10月8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。

### 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
米国好配当リバランスマザーファンド	千口 1,943	千円 2,940	千口 12,022	千円 18,014

（注）単位未満は切捨て。

## ○株式売買比率

（2021年5月22日～2021年10月8日）

### 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	米国好配当リバランスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	359,856千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	223,811千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.60

（注）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

## ○利害関係人との取引状況等

（2021年5月22日～2021年10月8日）

### 利害関係人との取引状況

<米国好配当リバランスオープン（年2回決算型）（為替ヘッジあり）>  
該当事項はございません。

<米国好配当リバランスマザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 17	% 23.9	百万円 288	百万円 6	% 2.1	

平均保有割合 7.4%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

米国好配当リバランスオープン（年2回決算型）（為替ヘッジあり）

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	23千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	5.2%

(注) 売買委託手数料総額は、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です。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とはOKASAN SECURITIES TOKYO/JAPANです。

○組入資産の明細

(2021年10月8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
米国好配当リバランスマザーファンド		千口 10,078

(注) 口数の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年10月8日現在)

項 目	債 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 17,836	% 100.0
投資信託財産総額	17,836	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10月8日現在）

項 目	償 還 時	円
(A) 資産	17,836,040	
コール・ローン等	17,836,040	
(B) 負債	71,349	
未払信託報酬	70,456	
未払利息	21	
その他未払費用	872	
(C) 純資産総額(A-B)	17,764,691	
元本	18,127,899	
償還差損金	△ 363,208	
(D) 受益権総口数	18,127,899口	
1万口当たり償還価額(C/D)	9,799円64銭	

(注) 純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は363,208円です。

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、0.979964円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は16,844,927円、期中追加設定元本額は3,768,604円、期中一部解約元本額は2,485,632円です。

○損益の状況（2021年5月22日～2021年10月8日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	△ 40	
支払利息	△ 40	
(B) 有価証券売買損益	△246,170	
売買益	150,168	
売買損	△396,338	
(C) 信託報酬等	△ 77,274	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△323,484	
(E) 追加信託差損益金	△ 39,724	
(配当等相当額)	(△ 1)	
(売買損益相当額)	(△ 39,723)	
償還差損金(D+E)	△363,208	

(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(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	2017年6月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年10月8日		資 産 総 額	17,836,040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	71,349円
受益権口数	57,800,000口	18,127,899口	△39,672,101口	純 資 産 総 額	17,764,691円
元 本 額	57,800,000円	18,127,899円	△39,672,101円	受 益 権 口 数	18,127,899口
				1万口当たり償還金	9,799円64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	189,179,672円	189,307,114円	10,007円	350円	3.5%
第2期	64,786,415	64,838,056	10,008	80	0.8
第3期	54,150,447	52,655,266	9,724	130	1.3
第4期	45,057,568	44,460,878	9,868	150	1.5
第5期	35,923,068	35,940,084	10,005	170	1.7
第6期	23,078,460	18,181,490	7,878	130	1.3
第7期	21,018,499	20,726,392	9,861	180	1.8
第8期	16,844,927	16,845,428	10,000	2,470	24.7

## ○償還金のお知らせ

1 万口当たり 償還金	9,799円64銭
-------------	-----------

### 〈お知らせ〉

当ファンドは、受益権口数が投資信託約款の繰上償還に関する規定に定める5億口を下回る状態が継続しており、また残高の大幅な増加も見込みにくいと推測されたことから、投資信託契約を解約し、受益者の皆さまからお預かりした運用資産をお返しすることが受益者の皆さまにとって有利であると考え、信託終了（繰上償還）の手続きを行わせていただきました。

上記の内容につきまして、2021年8月20日現在の受益者の方を対象とし、2021年9月14日に書面決議を行いました。その結果、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の賛成があったことから、2021年10月8日をもちまして信託終了（繰上償還）することとなりました。

## 米国好配当リバランスマザーファンド

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。

### 米国好配当リバランスマザーファンド 第5期 運用状況のご報告 償還日：2021年10月7日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主として米国の取引所に上場している株式に投資を行い、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	米国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とします。
投資制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。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		MSCI USA 指数 (円換算後)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	期騰落	率	(参考指数)	期騰落			
(設定日) 2017年6月28日	円 銭	%	ポイント		%	%	百万円
	10,000	—	258,328.71	—	—	—	724
1期(2018年5月21日)	10,645	6.5	287,344.28	11.2	96.2	—	1,106
2期(2019年5月21日)	11,112	4.4	298,165.19	3.8	97.5	—	506
3期(2020年5月21日)	9,062	△18.4	306,682.36	2.9	95.3	—	218
4期(2021年5月21日)	15,102	66.7	438,690.58	43.0	95.1	—	230
(償還時)	(償還価額)						
5期(2021年10月7日)	14,964.21	△0.9	472,060.84	7.6	—	—	200

(注) 基準価額は1万円当たり。

(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) MSCI USA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。

MSCI USA指数（円換算後）は当該日前営業日の現地終値に為替レート（対顧客電信売買相場の当日（東京）の仲値）を乗じて算出しています。

(注) 株式先物比率＝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		M S C I U S A 指 数 ( 円 換 算 後 )		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円 銭	騰 落 率	( 参 考 指 数 )	騰 落 率		
(期 首) 2021年5月21日	15,102	—	ポイント 438,690.58	% —	% 95.1	% —
5月末	15,190	0.6	447,266.51	2.0	95.5	—
6月末	15,043	△0.4	462,417.92	5.4	95.5	—
7月末	14,910	△1.3	471,198.97	7.4	94.9	—
8月末	15,130	0.2	484,369.96	10.4	96.2	—
9月末	14,969	△0.9	473,695.80	8.0	—	—
(償還時) 2021年10月7日	(償還価額) 14,964.21	△0.9	472,060.84	7.6	—	—

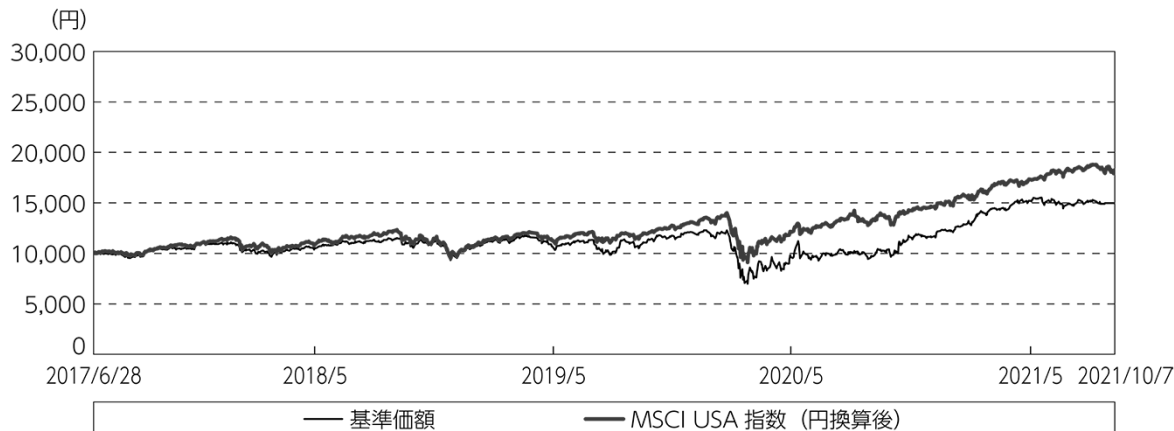
(注) 騰落率は期首比。

MSCI USA指数はMSCI Inc. が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

## 設定以来の運用経過

## 設定以来の基準価額等の推移

(2017年6月28日～2021年10月7日)



(注) 参考指数は、MSCI USA指数 (円換算後) です。

(注) 参考指数は、設定日 (2017年6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。

## 設定以来の投資環境

(2017年6月28日～2021年10月7日)

米国株式市場は、トランプ政権の法人減税を柱とする税制改革法案への期待などを背景に、2017年は堅調に推移しました。2018年から2019年にかけては、通商問題をはじめとする米中間の対立激化や、米連邦準備制度理事会 (F R B) の金融引き締め姿勢が嫌気され、株価が下落する場面がありましたが、好調な米企業業績が支えとなり、上昇基調が続きました。2020年に入ってから、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) へ発展したことを受けて大きく下落しましたが、相次いで大規模な経済対策やF R Bによる金融支援が打ち出されたことで、その後、株価は急速に持ち直す動きとなりました。2021年も、新型コロナウイルスのワクチン接種進展による経済活動の正常化や、バイデン新政権のインフラ投資など経済政策への期待を背景に株価は上昇基調を維持し、主要な株価指数は過去最高値を更新する展開となりました。

## 設定以来の当ファンドのポートフォリオ

(2017年6月28日～2021年10月7日)

米国の取引所に上場している株式を組み入れ、組入比率は資金変動や決算対応により一時的に低下した時期を除き、概ね90%台半ばの高位を維持しました。運用の基本方針に則り、MSCI USA指数採用銘柄（REITを除く）の中から、原則として予想配当利回りの高い上位70銘柄を選定し、各銘柄への資産配分が概ね等金額になるよう組入銘柄の入替えと組入比率の調整（リバランス）を行いました。リバランスについては、毎月1回の頻度で行いました。また、組入外貨建資産については、運用の基本方針に則り、為替ヘッジを行いませんでした。その後、2021年9月中旬に繰上償還が決定したことを受けて、組入株式を売却し、短期金融市場で資金を運用しました。

## 設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異

(2017年6月28日～2021年10月7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、設定以来の当ファンドの基準価額の騰落率は、参考指数としているMSCI USA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

(2021年5月22日～2021年10月7日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株 式)	円 19 (19)	% 0.129 (0.129)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株 式)	0 (0)	0.001 (0.001)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	39 (38) (0)	0.258 (0.255) (0.003)	(c) 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  その他は、金融商品取引を行う為の識別番号取得費用等
合計	58	0.388	
期中の平均基準価額は、15,048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

(2021年5月22日～2021年10月7日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 130 (1)	千米ドル 648 (6)	百株 587 (-)	千米ドル 2,589 (6)

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○株式売買比率

(2021年5月22日～2021年10月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	359,856千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	223,811千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.60

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月22日～2021年10月7日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 17	% 23.9	百万円 71	百万円 6	% 2.1	百万円 288

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	292千円
うち利害関係人への支払額 (B)	16千円
(B) / (A)	5.5%

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あり、当ファンドに係る利害関係人とはOKASAN SECURITIES TOKYO/JAPANです。



○組入資産の明細

(2021年10月7日現在)

有価証券等の組入れはございません。

外国株式

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
(アメリカ)		百株
ALTRIA GROUP INC	5	
AT&T INC	8	
EXXON MOBIL CORP	4	
GENERAL MILLS INC	4	
PPL CORP	9	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1	
INTERNATIONAL PAPER CO	4	
JUNIPER NETWORKS INC	10	
KEYCORP	12	
KIMBERLY-CLARK CORP	2	
MERCK & CO. INC.	3	
NEWMONT CORP	4	
OMNICOM GROUP	3	
PFIZER INC	7	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2	
PHILLIPS 66	3	
PINNACLE WEST CAPITAL	3	
SOUTHERN CO/THE	4	
DEVON ENERGY CORP	11	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4	
FIRSTENERGY CORP	7	
ONEOK INC	5	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2	
SEMPRA ENERGY	2	
CARDINAL HEALTH INC	5	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	20	
NRG ENERGY INC	9	
CONSOLIDATED EDISON INC	3	
KELLOGG CO	4	
ENTERGY CORP	2	
FRANKLIN RESOURCES INC	8	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	8	
EVERGY INC	4	
DOMINION ENERGY INC	3	
NISOURCE INC	11	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4	
CHEVRON CORP	2	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	4	
CONOCOPHILLIPS	5	

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
(アメリカ)		百株
EDISON INTERNATIONAL	4	
MARATHON PETROLEUM CORP	4	
UGI CORP	6	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2	
VALERO ENERGY CORP	3	
WILLIAMS COS INC	11	
COCA-COLA CO/THE	5	
WESTERN UNION CO	11	
KINDER MORGAN INC	15	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2	
DUKE ENERGY CORP	2	
ABBVIE INC	2	
DOW INC	4	
AMCOR PLC	23	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	3	
TRUIST FINANCIAL CORP	4	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	6	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	17	
AMERICAN ELECTRIC POWER	3	
GILEAD SCIENCES INC	4	
NEWELL BRANDS INC	10	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	18	
EXELON CORP	6	
BROADCOM INC	0.66	
VIATRIS INC	17	
KRAFT HEINZ CO/THE	6	
合 計		455
銘柄数		70

(注) 株数の単位未満は切捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

○投資信託財産の構成

(2021年10月7日現在)

項 目	債 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 200,297	% 100.0
投資信託財産総額	200,297	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10月7日現在)

○損益の状況 (2021年5月22日～2021年10月7日)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	200,297,610
コール・ローン等	200,297,610
(B) 負債	1,237
未払利息	80
その他未払費用	1,157
(C) 純資産総額(A-B)	200,296,373
元本	133,850,269
償還差益金	66,446,104
(D) 受益権総口数	133,850,269口
1万口当たり償還価額(C/D)	14,964円21銭

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,064,270
受取配当金	3,114,826
受取利息	86
その他収益金	952,021
支払利息	△ 2,663
(B) 有価証券売買損益	△ 5,653,322
売買益	8,141,435
売買損	△13,794,757
(C) その他費用等	△ 587,728
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,176,780
(E) 前期繰越損益金	77,705,085
(F) 追加信託差損益金	10,411,962
(G) 解約差損益金	△19,494,163
償還差益金(D+E+F+G)	66,446,104

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1,496,421円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は152,298,068円、期中追加設定元本額は20,098,038円、期中一部解約元本額は38,545,837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。

米国好配当リバランスオープン(年2回決算型)(為替ヘッジなし)  
122,807,320円  
米国好配当リバランスオープン(年2回決算型)(為替ヘッジあり)  
11,042,949円

(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。

〈お知らせ〉

「米国好配当リバランスオープン(年2回決算型)(為替ヘッジあり)」「米国好配当リバランスオープン(年2回決算型)(為替ヘッジなし)」が償還となり、当ファンドを投資対象とする証券投資信託がなくなることから、投資信託約款の規定に基づき投資信託契約を解約し、2021年10月7日をもちまして繰上償還となりました。