

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6期

決算日 2020年8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8月3日に第6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
コールセンター 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

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<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」

最近5期の運用実績

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)	税込 分配金	期中 騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
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
第6期 (2020年8月3日)	10,999	15	6.8	96.0	—	292

*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。

*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	騰落率		
	円	%	%	%
(期首) 2020年2月3日	10,315	—	97.9	—
2月末	10,423	1.0	96.5	—
3月末	10,356	0.4	96.7	—
4月末	10,624	3.0	94.2	—
5月末	10,701	3.7	96.8	—
6月末	10,794	4.6	97.9	—
7月末	10,976	6.4	94.8	—
(期末) 2020年8月3日	11,014	6.8	96.0	—

*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

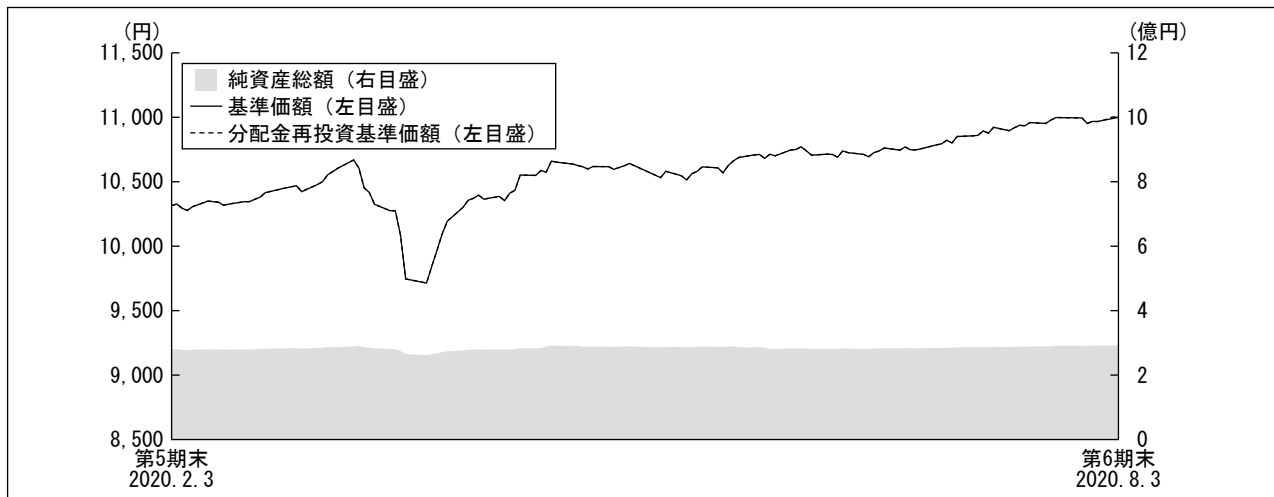
*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

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6期首：10,315円

第6期末：10,999円（既払分配金 15円）

騰落率：+6.8%（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が要因となりました。

（下落要因）

米ドルの対円での下落が要因となりました。

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】

当期の社債スプレッドは新型コロナウイルスの感染拡大を背景とするリスクオフ相場で拡大したものの、米国債利回りが大幅に低下したことから社債利回りは低下となりました。米ドル円相場は下落しました。

期初は、米中貿易交渉が第一段階で合意に至ったことなどを背景に、社債スプレッドは縮小傾向となりました。3月には新型コロナウイルスの感染者数が世界的に急増し、各国が都市封鎖や移動制限などを行ったことで景気への悪影響が懸念され、大規模なリスクオフ相場となりました。社債相場は下落し、社債スプレッドは急拡大しました。その後、新規感染者数の抑制や、各国の景気対策、各国中央銀行の強力な金融緩和を受けて社債スプレッドは縮小に転じ、3月後半以降期末まで、社債相場は堅調に推移しました。米ドル円は3月にリスクオフ相場となったことや、米国の強力な金融緩和による米国債利回りの低下などを背景に下落しました。

【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96.0%としました。

また、運用方針に基づき、平時は約80%としている為替ヘッジ比率を一時的に約100%に引き上げた場面があり、パフォーマンスにはプラスに寄与しました。

■米国メジャー企業債マザーファンド

当期の騰落率は、+5.7%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。具体的な投資行動としては、償還が近くなった銘柄を売却し、残存年限が長い銘柄へ入れ替えを行いました。

【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6期	
	2020年2月4日 ～2020年8月3日	
当期分配金 (円)		15
(対基準価額比率) (%)		0.14
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)		1,030

※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

社債市場は、3月に売られたあと、足元の8月まで買い戻しが続いています。今後についても、各国の強力な金融緩和や、段階的な経済活動再開を背景に、社債市場は堅調な推移を予想しています。また、金融緩和策に伴い国債利回りが低位で推移していることから、利回りを求める投資家の社債需要が強い環境が続くと考えています。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
	2020年2月4日～2020年8月3日		
	金額	比率	
信託報酬	40円	0.377%	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10,646円です。
(投信会社)	(19)	(0.181)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(19)	(0.181)	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	2	0.018	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)	(0.008)	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)	(0.004)	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	42	0.395	

* 「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。

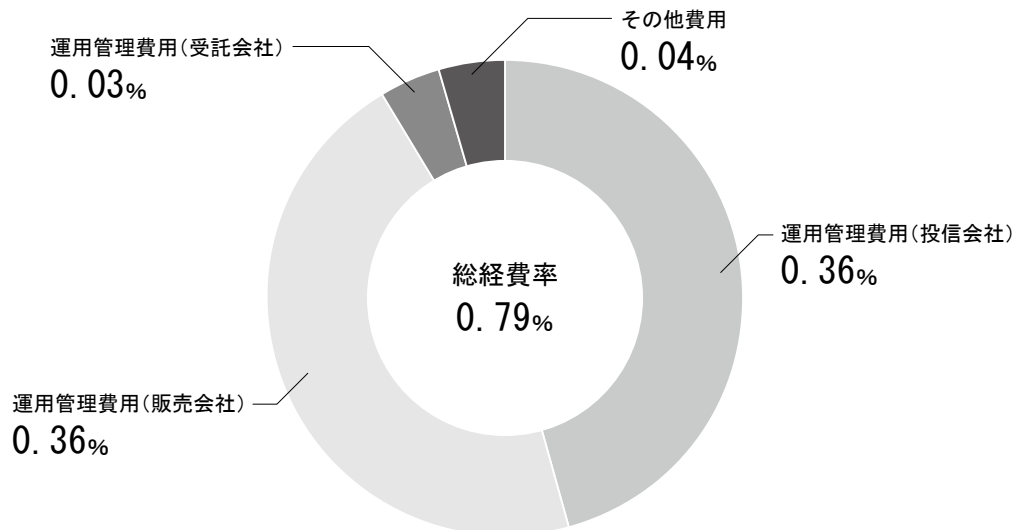
なお、その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託受益証券が支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

* 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0.79%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2020年2月4日から2020年8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 19,421	千円 21,698	千口 24,630	千円 27,422

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

(2020年2月4日から2020年8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

(2020年2月4日から2020年8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8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 256,250	千口 251,040	千円 291,609	千円 291,609

*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、251,040千口です。

投資信託財産の構成

2020年8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 291,609	% 99.2
コール・ローン等、その他	2,287	0.8
投資信託財産総額	293,896	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=106.13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(284,627千円)の投資信託財産総額(291,601千円)に対する比率 97.6%

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8月3日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	522,457,083円
米国メジャー企業債マザーファンド(評価額)	291,609,121
未 収 入 金	230,847,962
(B) 負 債	230,135,614
未 払 金	228,650,428
未 払 収 益 分 配 金	398,656
未 払 信 託 報 酬	1,071,100
そ の 他 未 払 費 用	15,430
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	292,321,469
元 本	265,770,751
次 期 繰 越 損 益 金	26,550,718
(D) 受 益 権 総 口 数	265,770,751口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	10,999円

*元本状況

期首元本額	271,259,599円
期中追加設定元本額	16,782,068円
期中一部解約元本額	22,270,916円

損益の状況

自2020年2月4日
至2020年8月3日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	19,174,767円
売 買 益	23,006,674
売 買 損	△ 3,831,907
(B) 信 託 報 酬 等	△ 1,092,470
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	18,082,297
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	8,028,848
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	838,229
(配 当 等 相 当 額)	(1,627,144)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 788,915)
(F) 計 (C + D + E)	26,949,374
(G) 収 益 分 配 金	△ 398,656
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	26,550,718
追 加 信 託 差 損 益 金	838,229
(配 当 等 相 当 額)	(1,666,137)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 827,908)
分 配 準 備 積 立 金	25,712,489

*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)	3,504,773円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	11,863,796
(C) 収 益 調 整 金	1,666,137
(D) 分 配 準 備 積 立 金	10,742,576
分 配 可 能 額 (A + B + C + D)	27,777,282
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(1,045.16)
収 益 分 配 金	398,656
(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8月3日

(第6期：2020年2月4日～2020年8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">・ 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。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

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

米国メジャー企業債マザーファンド

最近5期の運用実績

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 総額
	円	騰落率			
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
第6期 (2020年8月3日)	11,616	5.7	96.3	—	291

*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。

*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		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
	円	騰落率		
(期首) 2020年2月3日	10,989	—	97.3	—
2月末	11,204	2.0	96.5	—
3月末	11,101	1.0	96.8	—
4月末	11,228	2.2	95.7	—
5月末	11,373	3.5	96.4	—
6月末	11,502	4.7	97.3	—
7月末	11,450	4.2	96.2	—
(期末) 2020年8月3日	11,616	5.7	96.3	—

*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

米国メジャー企業債マザーファンド

運用経過

【基準価額等の推移】

期 首：10,989円

期 末：11,616円

騰落率：+5.7%

【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が要因となりました。

(下落要因)

米ドルの対円での下落が要因となりました。

基準価額の推移



【投資環境】

当期の社債スプレッドは新型コロナウイルスの感染拡大を背景とするリスクオフ相場で拡大したものの、米国債利回りが大幅に低下したことから社債利回りは低下となりました。米ドル円相場は下落しました。

期初は、米中貿易交渉が第一段階で合意に至ったことなどを背景に、社債スプレッドは縮小傾向となりました。3月には新型コロナウイルスの感染者数が世界的に急増し、各国が都市封鎖や移動制限などを行ったことで景気への悪影響が懸念され、大規模なリスクオフ相場となりました。社債相場は下落し、社債スプレッドは急拡大しました。その後、新規感染者数の抑制や、各国の景気対策、各国中央銀行の強力な金融緩和を受けて社債スプレッドは縮小に転じ、3月後半以降、社債相場は堅調に推移しました。米ドル円は3月にリスクオフ相場となったことや、米国の強力な金融緩和による米国債利回りの低下などを背景に下落しました。

【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、+5.7%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。具体的な投資行動としては、償還が近くなった銘柄を売却し、残存年限が長い銘柄へ入れ替えを行いました。

米国メジャー企業債マザーファンド

今後の運用方針

社債市場は、3月に売られたあと、足元の8月まで買い戻しが続いています。今後についても、各国の強力な金融緩和や、段階的な経済活動再開を背景に、社債市場は堅調な推移を予想しています。また、金融緩和策に伴い国債利回りが低位で推移していることから、利回りを求める投資家の社債需要が強い環境が続くと考えています。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
	2020年2月4日～2020年8月3日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	1円	0.010%	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)	(0.002)	
合計	1	0.010	
期中の平均基準価額は11,310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

(2020年2月4日から2020年8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 57	千アメリカ・ドル -
		社債証券	140	244

* 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

* 社債券には新株予約権付社債（転換社債）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

(2020年2月4日から2020年8月3日まで)

■公社債

当			期		
買	付		売	付	
銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円
AMAZON.COM INC 2.5	06/03/50	15,096	HOME DEPOT INC 2.7	04/01/23	11,352
US TREASURY N/B 2	02/15/50	6,148	VISA INC 2.15	09/15/22	8,922
			ELI LILLY & CO 2.35	05/15/22	6,105

*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

(2020年2月4日から2020年8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8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		期		組 入 率	う ち BB格以下 組入比率	末		
		評 価 額		組 比	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 2,295	千アメリカ・ドル 2,644	千円 280,684	% 96.3	% —	% 72.3	% 23.9	% —		
合 計	—	—	280,684	96.3	—	72.3	23.9	—		

*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		償還年月日		
				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	169		18,021	2049/05/15	
US TREASURY N/B	国債証券	2.0000	50	60		6,378	2050/02/15	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	社債券	2.4500	130	144		15,328	2026/11/03	
JOHNSON & JOHNSON	社債券	2.4500	130	144		15,301	2026/03/01	
WAL-MART STORES INC	社債券	2.5500	125	131		13,962	2023/04/11	
PFIZER INC	社債券	4.1250	100	137		14,563	2046/12/15	
MICROSOFT CORP	社債券	2.8750	130	140		14,958	2024/02/06	
JPMORGAN CHASE & CO	社債券	3.2000	140	157		16,705	2026/06/15	
MORGAN STANLEY	社債券	3.5910	110	125		13,367	2028/07/22	
CATERPILLAR FINANCIAL SE	社債券	3.3000	110	122		12,950	2024/06/09	
COMCAST CORP	社債券	4.1500	120	147		15,664	2028/10/15	
3M COMPANY	社債券	3.3750	100	117		12,520	2029/03/01	
COCA-COLA CO/THE	社債券	2.8750	140	156		16,607	2025/10/27	
APPLE INC	社債券	2.8500	130	140		14,933	2024/05/11	
WALT DISNEY COMPANY/THE	社債券	3.1500	140	156		16,606	2025/09/17	
ALPHABET INC	社債券	1.9980	140	151		16,103	2026/08/15	
PHILIP MORRIS INTL INC	社債券	3.2500	110	122		12,969	2024/11/10	
EXXON MOBIL CORPORATION	社債券	4.1140	130	164		17,451	2046/03/01	
AMAZON.COM INC	社債券	2.5000	140	153		16,288	2050/06/03	
合計	—	—	2,295	2,644		280,684	—	

* 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8月3日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	280,684	96.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,916	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	291,601	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=106.13円

*当期末における外貨建資産(284,627千円)の投資信託財産総額(291,601千円)に対する比率 97.6%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年8月3日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	291,601,279円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,839,395
公 社 債(評価額)	280,684,303
未 収 利 息	2,047,236
前 払 費 用	30,345
(B) 純 資 産 総 額(A)	291,601,279
元 本	251,040,910
次 期 繰 越 損 益 金	40,560,369
(C) 受 益 権 総 口 数	251,040,910口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(B/C)	11,616円

*元本状況

期首元本額	256,250,592円
期中追加設定元本額	19,421,006円
期中一部解約元本額	24,630,688円

*元本の内訳

米国メジャー企業債ファンド	251,040,910円
---------------	--------------

損益の状況

自2020年2月4日
至2020年8月3日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,690,203円
受 取 利 息	3,692,333
支 払 利 息	△ 2,130
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	12,059,318
売 買 損 益	17,971,630
売 買 損	△ 5,912,312
(C) そ の 他 費 用	△ 29,149
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	15,720,372
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	25,354,837
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 2,792,194
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,277,354
(H) 計 (D+E+F+G)	40,560,369
次 期 繰 越 損 益 金(H)	40,560,369

*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。