

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 | 2014年9月4日 |
| 信託期間 | 2014年9月4日～2024年9月2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、残存期間が最長10年程度までの英国国債に投資し、原則として、各残存期間毎の投資金額がほぼ同額程度となるような運用を行い、信託財産の成長を目指します。英国国債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行います。 |
| 主要運用対象 | 英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり） ・英国国債ギルト10・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 英国国債ギルト10・マザーファンド ・英国国債を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり） ・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。 英国国債ギルト10・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3月、9月の2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。 * 分配金再投資コースの場合、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。 |

- 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
フリーダイヤル 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

運用報告書（全体版）

第10期

決算日 2019年9月2日

英国国債ファンドーギルト10ー （為替ヘッジあり）

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「英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）」は、去る2019年9月2日に第10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。



三井住友DSアセットマネジメント

（旧：大和住銀投信投資顧問）
〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<https://www.smd-am.co.jp>

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 英国5年国債 利回り (参考指数) | 公社債 組入比率 | 債券先物 組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------------------|-------------|-------------------------|-------------|--------------|------|
| | (分配落) | 税 配 分 金 | 騰 落 率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 第6期(2017年9月4日) | 10,028 | 70 | 0.3 | 0.4540 | 97.9 | — | 291 |
| 第7期(2018年3月2日) | 9,700 | 70 | △ 2.6 | 1.1280 | 95.0 | — | 282 |
| 第8期(2018年9月3日) | 9,651 | 70 | 0.2 | 1.0390 | 95.5 | — | 280 |
| 第9期(2019年3月4日) | 9,594 | 70 | 0.1 | 1.0000 | 101.4 | — | 279 |
| 第10期(2019年9月2日) | 9,789 | 70 | 2.8 | 0.3330 | 92.0 | — | 284 |

* 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。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 英国5年国債 利回り (参考指数) | 公社債 組入比率 | 債券先物 組入比率 |
|---------------|-------------|-------------|-------------------------|-------------|--------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| (期首)2019年3月4日 | 円 | % | % | % | % |
| 3月末 | 9,594 | — | 1.0000 | 101.4 | — |
| 4月末 | 9,705 | 1.2 | 0.7740 | 99.0 | — |
| 5月末 | 9,650 | 0.6 | 0.8740 | 98.3 | — |
| 6月末 | 9,729 | 1.4 | 0.6580 | 94.0 | — |
| 7月末 | 9,746 | 1.6 | 0.6170 | 97.3 | — |
| 8月末 | 9,811 | 2.3 | 0.4130 | 94.1 | — |
| 8月末 | 9,874 | 2.9 | 0.2910 | 91.9 | — |
| (期末)2019年9月2日 | 9,859 | 2.8 | 0.3330 | 92.0 | — |

* 騰落率は期首比です。

* 期末基準価額は分配金込み

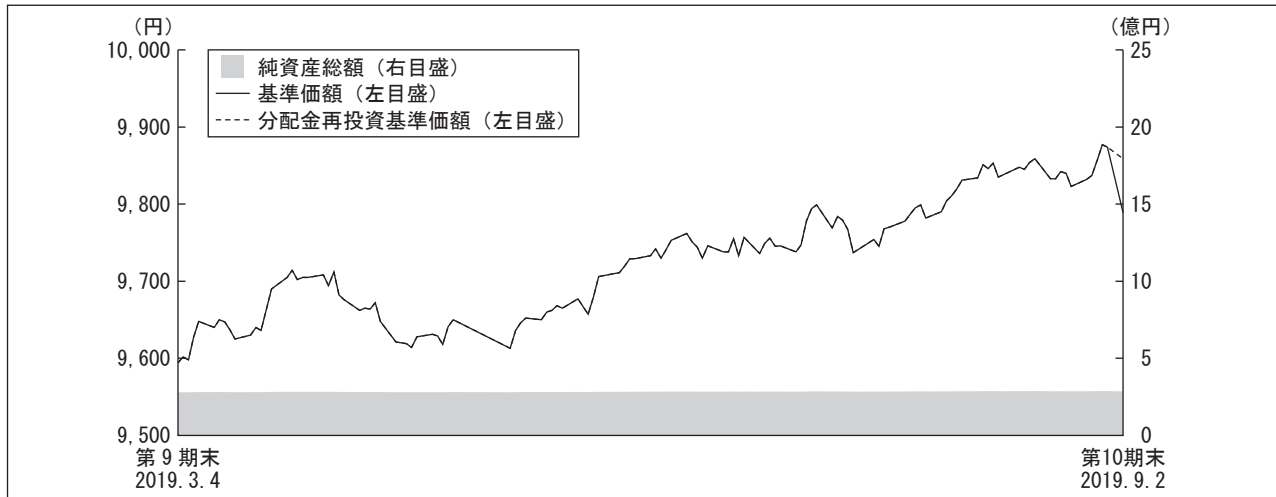
* 先物組入比率は、買建比率－売建比率

* 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。

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

運用経過

【基準価額等の推移】



*当ファンドにはベンチマークはありません。

*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。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10期首： 9,594円

第10期末： 9,789円（既払分配金 70円）

騰落率： +2.8%（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、英国国債ギルト10・マザーファンドへの投資を通じて、主として、残存期間が最長10年程度までの英国国債に投資し、原則として、各残存期間毎の投資金額がほぼ同額程度となるような運用を行いました。

（上昇要因）

債券のインカムゲインやキャピタルゲインが主な上昇要因となりました。

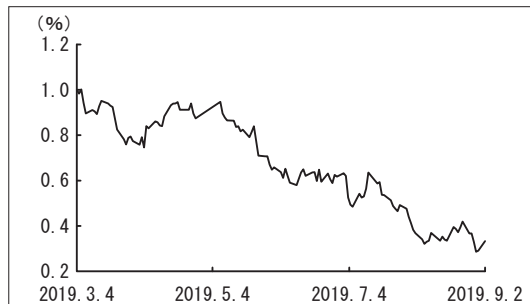
英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

【投資環境】

英国債券相場は上昇し金利は低下しました。期を通じて英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感が金利低下要因となるなか、離脱期限の延期などを受けて金利が一時的に上昇する場面も見られました。一方、メイ英首相の辞任やECB（欧州中央銀行）の金融政策に対する慎重なスタンスなどが金利低下要因になったほか、米中貿易摩擦の深刻化なども材料となり、金利は低下基調をたどりました。また、期末にかけてはジョンソン新首相が誕生し議会閉鎖の方針を示したことなどから、合意なきEU離脱の可能性が意識される展開となりました。

英ポンド円相場は下落しました。英国のEU離脱問題や欧州を中心とした軟調な経済指標を背景とするグローバルな景気減速懸念などを背景に、英ポンド円は下落する展開となりました。

英国5年国債利回りの推移



【ポートフォリオ】

■英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

主要投資対象である英国国債ギルト10・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92.0%としました。

為替ヘッジについては、想定元本を外貨建ての純資産総額と概ね同等として為替ヘッジを行い、為替変動リスクのフルヘッジを目指しました。

■英国国債ギルト10・マザーファンド

当期の騰落率は、 $\Delta 9.7\%$ となりました。

残存期間が最長10年程度までの英国国債に投資するとともに、各残存期間1年毎の投資金額がほぼ同額程度となるように維持しました。

【ベンチマークとの差異】

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。英国5年国債利回りを参考指数としているため、当ファンドの基準価額の騰落率との対比をしておりません。

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

【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70円（税込み）とさせて頂きました。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10期 | |
|--------------------|-------------------------|------------|
| | 2019年3月5日 ～2019年9月2日 | |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | (円) (%) | 70 0.71 |
| 当期の収益 | (円) | 70 |
| 当期の収益以外 | (円) | — |
| 翌期繰越分配対象額 | (円) | 355 |

※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

■英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

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、主として残存期間が10年程度までの英国国債に投資し、各残存期間毎の投資金額がほぼ同額程度となるようなポートフォリオ運営を行う方針です。また、為替ヘッジを行い、フルヘッジを基本とする方針です。

■英国国債ギルト10・マザーファンド

英国のEU離脱問題については先行き不透明感が残り、英国債券利回りの上昇圧力は抑制されるものと見ています。

当ファンドは、残存期間が異なる債券をバランスよく保有することで金利変動リスクを抑制しつつ、償還を迎える債券は残存年数10年程度までの国債に再投資をし、各残存期間の投資金額がほぼ同額程度となるようなポートフォリオを維持する方針です。

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

1万口当りの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|--------|---------------------|---------|---|
| | 2019年3月5日～2019年9月2日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 23円 | 0.231% | 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9,753円です。 |
| （投信会社） | (10) | (0.107) | ファンドの運用等の対価 |
| （販売会社） | (10) | (0.107) | 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 | 3 | 0.027 | 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) | (0.014) | 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） | (1) | (0.007) | 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 | 25 | 0.257 | |

* 「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。

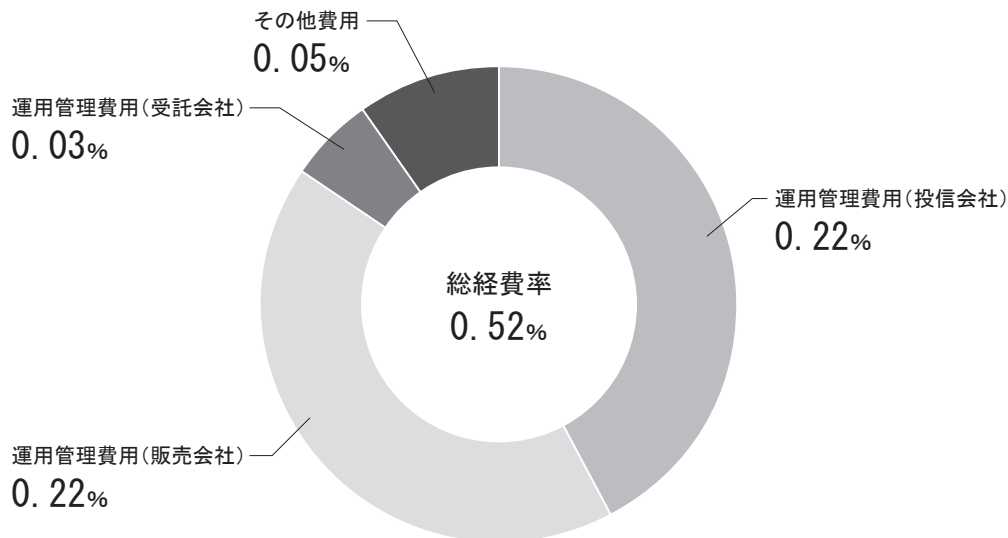
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

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。

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

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0.52%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2019年3月5日から2019年9月2日まで）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------|--------------|--------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 英国国債ギルト10・マザーファンド | 千口 12,258 | 千円 11,159 | 千口 4,103 | 千円 3,927 |

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

利害関係人との取引状況等

（2019年3月5日から2019年9月2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

2019年9月2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 |
| 英国国債ギルト10・マザーファンド | 千口 302,638 | 千口 310,793 | | 千円 269,706 |

*英国国債ギルト10・マザーファンド全体の受益権口数は、402,223千口です。

投資信託財産の構成

2019年9月2日現在

| 項 | 当 | | 末 |
|-------------------|---|---------------|-----------|
| | 評 | 価 | 比 |
| 目 | 額 | 額 | 率 |
| 英国国債ギルト10・マザーファンド | | 千円 269,706 | % 93.8 |
| コール・ローン等、その他 | | 17,772 | 6.2 |
| 投資信託財産総額 | | 287,479 | 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 イギリス・ポンド=128.89円

*英国国債ギルト10・マザーファンド

当期末における外貨建資産（342,670千円）の投資信託財産総額（349,037千円）に対する比率 98.2%

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジあり）

資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2019年9月2日）現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 551,065,300円 |
| 英国国債ギルト10・マザーファンド(評価額) | 269,706,378 |
| 未 収 入 金 | 281,358,922 |
| (B) 負 債 | 266,290,829 |
| 未 払 金 | 263,586,180 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 2,036,310 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 653,252 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 15,087 |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 284,774,471 |
| 元 本 | 290,901,490 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 6,127,019 |
| (D) 受益権総口数 | 290,901,490口 |
| 1万口当り基準価額 (C / D) | 9,789円 |

*元本状況

| | |
|-----------|--------------|
| 期首元本額 | 290,901,490円 |
| 期中追加設定元本額 | 0円 |
| 期中一部解約元本額 | 0円 |

*元本の欠損 6,127,019円

損益の状況

自2019年3月5日
至2019年9月2日

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------|---------------|
| (A) 有価証券売買損益 | 8,407,750円 |
| 売 買 益 | 38,074,907 |
| 売 買 損 | △ 29,667,157 |
| (B) 信託報酬等 | △ 679,139 |
| (C) 当期損益金 (A + B) | 7,728,611 |
| (D) 前期繰越損益金 | △ 10,237,471 |
| (E) 追加信託差損益金 | △ 1,581,849 |
| (配当等相当額) | (7,169,818) |
| (売買損益相当額) | (△ 8,751,667) |
| (F) 計 (C + D + E) | △ 4,090,709 |
| (G) 収益分配金 | △ 2,036,310 |
| 次期繰越損益金 (F + G) | △ 6,127,019 |
| 追加信託差損益金 | △ 1,581,849 |
| (配当等相当額) | (7,169,818) |
| (売買損益相当額) | (△ 8,751,667) |
| 分配準備積立金 | 3,157,564 |
| 繰越損益金 | △ 7,702,734 |

*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) | 2,872,638円 |
| (B) 有価証券売買等損益(費用控除後、繰越欠損金補填後) | 0 |
| (C) 収益調整金 | 7,169,818 |
| (D) 分配準備積立金 | 2,321,236 |
| 分配可能額 (A + B + C + D) | 12,363,692 |
| (1万口当り分配可能額) | (425.01) |
| 収益分配金 | 2,036,310 |
| (1万口当り収益分配金) | (70) |

分配金のお知らせ

| | |
|---------------|-----|
| 1万口当り分配金（税込み） | 70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営業日までに開始いたします。

■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。

※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

大和住銀投信投資顧問株式会社は、2019年4月1日に三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友DSアセットマネジメント株式会社となりました。

委託会社の合併に伴い、ファンドの委託者の商号ならびに公告の方法を変更することに伴う所要の約款変更を行いました。（2019年4月1日付）

| |
|--------------------------------------|
| ※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。 |
|--------------------------------------|

英国国債ギルト10・マザーファンド

運用報告書

決算日：2019年9月2日

(第10期：2019年3月5日～2019年9月2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 | 主として、残存期間が最長10年程度までの英国国債に投資し、原則として、各残存期間毎の投資金額がほぼ同額程度となるような運用を行い、信託財産の成長を目指します。 |
| 主要運用対象 | 英国国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

(旧：大和住銀投信投資顧問)
〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<https://www.smd-am.co.jp>

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 英国5年 国債利回り (参考指数) | 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6期(2017年9月4日) | 9,224 | 2.5 | 0.4540 | 96.9 | — | 547 |
| 第7期(2018年3月2日) | 9,320 | 1.0 | 1.1280 | 96.7 | — | 364 |
| 第8期(2018年9月3日) | 9,217 | △ 1.1 | 1.0390 | 97.0 | — | 362 |
| 第9期(2019年3月4日) | 9,613 | 4.3 | 1.0000 | 97.3 | — | 379 |
| 第10期(2019年9月2日) | 8,678 | △ 9.7 | 0.3330 | 97.1 | — | 349 |

*先物組入比率は、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 | | 英国5年 国債利回り (参考指数) | 公社債 組入比率 | 債券先物 組入比率 |
|---------------|-------|-------|-------------------------|-------------|--------------|
| | 円 | 騰落率 | | | |
| (期首)2019年3月4日 | 9,613 | — | 1.0000 | 97.3 | — |
| 3月末 | 9,517 | △ 1.0 | 0.7740 | 98.4 | — |
| 4月末 | 9,420 | △ 2.0 | 0.8740 | 98.2 | — |
| 5月末 | 9,105 | △ 5.3 | 0.6580 | 97.9 | — |
| 6月末 | 9,046 | △ 5.9 | 0.6170 | 98.1 | — |
| 7月末 | 8,823 | △ 8.2 | 0.4130 | 97.9 | — |
| 8月末 | 8,742 | △ 9.1 | 0.2910 | 97.1 | — |
| (期末)2019年9月2日 | 8,678 | △ 9.7 | 0.3330 | 97.1 | — |

*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

運用経過

【基準価額等の推移】

期首：9,613円

期末：8,678円

騰落率：△9.7%

【基準価額の主な変動要因】

(上昇要因)

保有する債券のインカムゲインやキャピタルゲインが主な上昇要因となりました。

(下落要因)

英ポンド円下落による為替差損が主な下落要因となりました。

【投資環境】

英国債券相場は上昇し金利は低下しました。期を通じて英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感が金利低下要因となるなか、離脱期限の延期などを受けて金利が一時的に上昇する場面も見られました。一方、メイ英首相の辞任やECB（欧州中央銀行）の金融政策に対する慎重なスタンスなどが金利低下要因になったほか、米中貿易摩擦の深刻化なども材料となり、金利は低下基調をたどりました。また、期末にかけてはジョンソン新首相が誕生し議会閉鎖の方針を示したことなどから、合意なきEU離脱の可能性が意識される展開となりました。

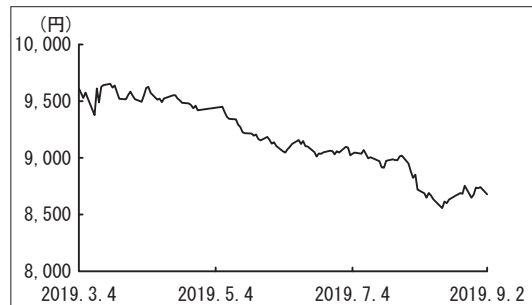
英ポンド円相場は下落しました。英国のEU離脱問題や欧州を中心とした軟調な経済指標を背景とするグローバルな景気減速懸念などを背景に、英ポンド円は下落する展開となりました。

【ポートフォリオ】

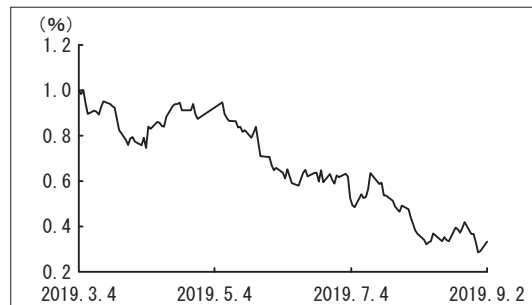
当期の騰落率は、△9.7%となりました。

残存期間が最長10年程度までの英国国債に投資するとともに、各残存期間1年毎の投資金額がほぼ同額程度となるように維持しました。

基準価額の推移



英国5年国債利回りの推移



今後の運用方針

英国のEU離脱問題については先行き不透明感が残り、英国債券利回りの上昇圧力は抑制されるものと見ています。

当ファンドは、残存期間が異なる債券をバランスよく保有することで金利変動リスクを抑制しつつ、償還を迎える債券は残存年数10年程度までの国債に再投資をし、各残存期間の投資金額がほぼ同額程度となるようなポートフォリオを維持する方針です。

1万口当りの費用明細

| 項目 | 当 期 | | 項目の概要 |
|---------------------|---------------------|-------------------|--|
| | 2019年3月5日～2019年9月2日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| その他費用 (保管費用) | 2円 (1) | 0.018% (0.015) | 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) | (0) | (0.003) | |
| 合計 | 2 | 0.018 | |
| 期中の平均基準価額は9,109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

(2019年3月5日から2019年9月2日まで)

■公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|----|------|------|-----------------|-----------------|
| 外国 | イギリス | 国債証券 | 千イギリス・ポンド 89 | 千イギリス・ポンド 16 |

* 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

英国国債ギルト10・マザーファンド

主要な売買銘柄

(2019年3月5日から2019年9月2日まで)

■公社債

| 当 | | | 期 | | |
|------------------------|----|-------|------------------------|----|-----|
| 買 | 付 | 金額 | 売 | 付 | 金額 |
| 銘柄 | 銘柄 | 金額 | 銘柄 | 銘柄 | 金額 |
| | | 千円 | | | 千円 |
| UK GILT 3.75 09/07/19 | | 2,062 | UK GILT 2.75 09/07/24 | | 723 |
| UK GILT 2.75 09/07/24 | | 1,516 | UK GILT 1.625 10/22/28 | | 711 |
| UK GILT 3.75 09/07/21 | | 1,463 | UK GILT 1.25 07/22/27 | | 688 |
| UK GILT 2.25 09/07/23 | | 1,461 | | | |
| UK GILT 1.75 09/07/22 | | 1,419 | | | |
| UK GILT 3.75 09/07/20 | | 1,417 | | | |
| UK GILT 2 09/07/25 | | 740 | | | |
| UK GILT 1.625 10/22/28 | | 731 | | | |
| UK GILT 1.5 07/22/26 | | 722 | | | |
| UK GILT 1.25 07/22/27 | | 709 | | | |

*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

(2019年3月5日から2019年9月2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

2019年9月2日現在

■公社債

A 債券種類別開示 外国（外貨建）公社債

| 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 |
| イギリス | 千イギリス・ポンド 2,458 | 千イギリス・ポンド 2,629 | 千円 338,914 | % 97.1 | % — | % 48.9 | % 29.1 | % 19.1 |
| 合計 | — | — | 338,914 | 97.1 | — | 48.9 | 29.1 | 19.1 |

*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。

英国国債ギルト10・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 | | | | | |
|-----------------|------|--------|-----------|-----------|---------|------------|
| | 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 | |
| (イギリス・ポンド…イギリス) | | % | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| UK GILT | 国債証券 | 3.7500 | 261 | 261 | 33,660 | 2019/09/07 |
| UK GILT | 国債証券 | 3.7500 | 249 | 257 | 33,151 | 2020/09/07 |
| UK GILT | 国債証券 | 3.7500 | 242 | 258 | 33,296 | 2021/09/07 |
| UK GILT | 国債証券 | 1.7500 | 254 | 264 | 34,112 | 2022/09/07 |
| UK GILT | 国債証券 | 2.2500 | 246 | 264 | 34,129 | 2023/09/07 |
| UK GILT | 国債証券 | 2.7500 | 233 | 261 | 33,666 | 2024/09/07 |
| UK GILT | 国債証券 | 2.0000 | 240 | 264 | 34,138 | 2025/09/07 |
| UK GILT | 国債証券 | 1.5000 | 247 | 267 | 34,454 | 2026/07/22 |
| UK GILT | 国債証券 | 1.2500 | 247 | 264 | 34,106 | 2027/07/22 |
| UK GILT | 国債証券 | 1.6250 | 239 | 265 | 34,198 | 2028/10/22 |
| 合計 | — | — | 2,458 | 2,629 | 338,914 | — |

* 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。

投資信託財産の構成

2019年9月2日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|---------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 公社債 | 千円 338,914 | % 97.1 |
| コール・ローン等、その他 | 10,122 | 2.9 |
| 投資信託財産総額 | 349,037 | 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 イギリス・ポンド=128.89円

* 当期末における外貨建資産（342,670千円）の投資信託財産総額（349,037千円）に対する比率 98.2%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年9月2日)現在

| 項目 | 当期末 |
|----------------|--------------|
| (A) 資産 | 349,037,242円 |
| コール・ローン等 | 6,718,513 |
| 公社債(評価額) | 338,914,868 |
| 未収利息 | 3,329,963 |
| 前払費用 | 73,898 |
| (B) 純資産総額(A) | 349,037,242 |
| 元本 | 402,223,094 |
| 次期繰越損益金 | △ 53,185,852 |
| (C) 受益権総口数 | 402,223,094口 |
| 1万口当り基準価額(B/C) | 8,678円 |

*元本状況

| | |
|-----------|--------------|
| 期首元本額 | 394,903,780円 |
| 期中追加設定元本額 | 12,258,191円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,938,877円 |

*元本の内訳

| | |
|--------------------------|--------------|
| 英国国債ファンドーギルト10ー(為替ヘッジあり) | 310,793,246円 |
| 英国国債ファンドーギルト10ー(為替ヘッジなし) | 91,429,848円 |

| | |
|--------|-------------|
| *元本の欠損 | 53,185,852円 |
|--------|-------------|

損益の状況

自2019年3月5日
至2019年9月2日

| 項目 | 当期 |
|------------------|--------------|
| (A) 配当等収益 | 3,822,887円 |
| 受取利息 | 3,824,468 |
| 支払利息 | △ 1,581 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 40,790,503 |
| 売買益 | 9,403,197 |
| 売買損 | △ 50,193,700 |
| (C) その他費用 | △ 64,226 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 37,031,842 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 15,263,855 |
| (F) 解約差損益金 | 208,179 |
| (G) 追加信託差損益金 | △ 1,098,334 |
| (H) 計(D+E+F+G) | △ 53,185,852 |
| 次期繰越損益金(H) | △ 53,185,852 |

*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

委託会社の合併に伴い、ファンドの委託者の商号ならびに公告の方法を変更することに伴う所要の約款変更を行いました。(2019年4月1日付)

※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。