

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／内外／その他資産（ハイブリッド証券）
設定日	2015年12月29日
信託期間	2015年12月29日～2019年6月25日（約3年半）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の企業が実質的に発行するハイブリッド証券を中心に投資することにより、高水準の利息収益の確保と信託財産の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、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主要運用対象	世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり） ・世界ハイブリッド証券マザーファンド201512の受益証券を主要投資対象とします。 世界ハイブリッド証券マザーファンド201512 ・主に世界の企業が発行するハイブリッド証券を主要投資対象とします。
投資制限	世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり） ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 世界ハイブリッド証券マザーファンド201512 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ・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6月、12月の25日（休業日の場合は、翌営業日）の決算日に、原則として以下の方針に基づいて分配を行います。 分配対象額の範囲は、元本超過額または経費控除後の利子・配当収益のいずれか多い金額とします。分配金額は、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。

- 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） 満期償還

第7期

償還日 2019年6月25日

世界ハイブリッド証券ファンド201512 （ヘッジあり） （愛称） ゆうせん君プラス201512

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。

このたび「世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）（愛称：ゆうせん君プラス201512）」は、信託約款の規定に基づき、2019年6月25日をもちまして信託を終了し、満期償還いたしました。

ここに、設定以来の運用状況と償還内容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>

世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201512」

設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受利益者 回率	ハイブリッド証券 組入比率	元残存 本率	
	(分配落)	税分 配	込金 込	期騰 落				中額 率
(設定日) 2015年12月29日	円 10,000		円 —		円 —	% —	% 100.0	
第1期(2016年6月27日)	9,915		40	△45	△0.5	△0.9	83.8	99.7
第2期(2016年12月26日)	10,015		40	140	1.4	1.0	87.3	98.5
第3期(2017年6月26日)	10,345		40	370	3.7	3.1	88.2	90.8
第4期(2017年12月25日)	10,449		40	144	1.4	3.1	85.0	74.7
第5期(2018年6月25日)	10,180		40	△229	△2.2	1.5	87.9	66.2
第6期(2018年12月25日)	9,960		0	△220	△2.2	0.5	82.2	53.7
(償還日) 第7期(2019年6月25日)	(償還価額) 10,059.47円			99.47	1.0	0.7	—	43.1

*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。

*設定日の基準価額は、設定価額を記載しています。

*基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み

*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、ハイブリッド証券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

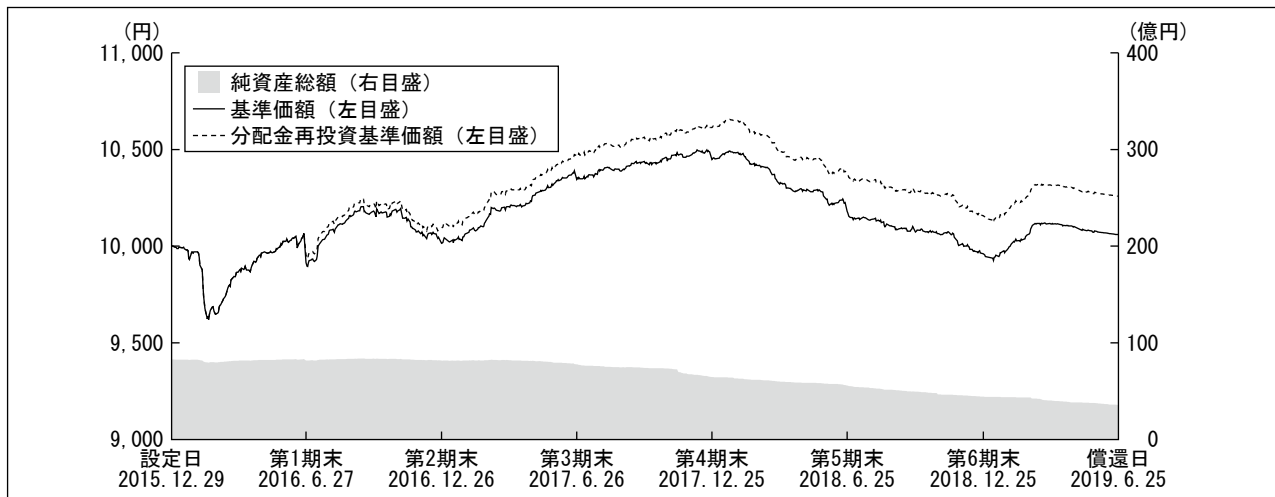
年月日	基準価額		ハイブリッド証券 組入比率
	騰	落率	
(期首) 2018年12月25日	円 9,960	% —	% 82.2
12月末	9,946	△0.1	83.1
2019年1月末	10,007	0.5	81.5
2月末	10,096	1.4	80.0
3月末	10,115	1.6	63.8
4月末	10,102	1.4	18.7
5月末	10,072	1.1	—
(償還日) 2019年6月25日	(償還価額) 10,059.47円	1.0	—

*騰落率は期首比です。

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

運用経過

【基準価額等の推移】



* 設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を表示しております。

* 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、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。

* 単体型投資信託は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。

設定日：10,000円

償還日：10,059円47銭（既払分配金 200円）

騰落率：+2.6%（分配金再投資ベース）

【基準価額の変動要因】

当ファンドは、世界ハイブリッド証券マザーファンド201512への投資を通じて、主に世界の企業（金融機関のほか、事業会社も含まれます。）が実質的に発行するハイブリッド証券を中心に投資を行いました。

（上昇要因）

ファンド設定時の市場環境と適切な銘柄選択が奏功し、設定後の優先証券市場全体の上昇分を取り込むことができました。また、設定当初から2016年10月頃まで上昇した上場銘柄を一部組み入れていたことに加え、組入比率の高い店頭市場の従来型優先証券が大きく上昇したこともプラスに寄与しました。さらに、多くの組入銘柄においてコール（期限前償還）またはテnder（買入消却）が実施されたことも奏功しました。

世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201512」

（下落要因）

2016年初め頃は、コールまでの期間の短い一部の米保険銘柄がコールのスキップなどのリスクを嫌気され下落したことが一時的にマイナスに作用しました。また、2016年11月の米国大統領選挙の結果を受け、米国債利回りが急上昇したことを背景に一時的に大きく下落した上場銘柄を一部保有していたことが一時的にマイナスに作用しました。2018年に入ってから、金利上昇に加え、テnder期待銘柄が額面でコールされるとの懸念の高まりや欧州銀行株の下落を受けた投資家のリスクオフの動きを背景に、欧州の銀行が発行するデュレーション*の長い従来型優先証券が下落したことも下落要因となりました。

*デュレーションとは、「投資元本の平均的な回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い（大きい）ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

【投資環境】

設定来、優先証券市場は上昇しました。2016年は、新型ティア1証券の利払い懸念、Brexit（英国のEUからの離脱）、ドイツ銀行のモーゲージ担保証券の不正販売に絡む和解金問題などに加え、一部の従来型優先証券のコール見送りや米国大統領選挙の結果を受けた米国債利回りの急上昇を背景に市場が弱含む局面も見られましたが、市場は上昇しました。2017年は、金利が上昇する中、利回りへの高い需要や投資家の強気のセンチメントが継続したことから上昇しましたが、2018年は、米国における金利上昇、欧州における地政学リスクの高まり、貿易戦争への懸念などを背景に、リスク回避の動きがクレジット市場全体に波及し、優先証券市場は下落しました。2019年は、主要中央銀行からのハト派的な金融政策見通しによる国債利回りの低下と、投資家心理の改善によって市場は上昇しました。

【ポートフォリオ】

■世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）

主要投資対象である世界ハイブリッド証券マザーファンド201512を運用期間を通じて組み入れました。その後、2019年6月の償還に向けてマザーファンドを売却し、2019年6月25日に満期償還いたしました。

■世界ハイブリッド証券マザーファンド201512

設定来の騰落率は、+3.0%となりました。

償還までの期間にコールまたはテnderが実施される可能性の高い銘柄を組み入れるという当ファンドのコンセプトに沿ったポートフォリオを構築した結果、設定来のリターンはプラスとなりました。ティア1優先証券に対するコール期待の高まりや上場銘柄の上昇がパフォーマンスを押し上げ、店頭市場と上場市場がともに設定時と比較して上昇する中で償還日を迎えました。

為替要因では米ドルが対円で下落したことが円ベースのパフォーマンスにマイナスに作用しました。

2019年6月の償還に向けて組入ハイブリッド証券を全売却し、2019年6月24日に繰上償還いたしました。

【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。

【分配金】

分配金につきましては、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、第1期～第5期の各期において40円、第6期は見送りとさせていただきます。（1万口当り税込）

世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201512」

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2018年12月26日～2019年6月25日		
	金額	比率	
信託報酬	83円	0.824%	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10,056円です。
（投信会社）	(43)	(0.431)	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	(38)	(0.377)	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
売買委託手数料 （ハイブリッド証券）	0 (0)	0.000 (0.000)	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 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税 （ハイブリッド証券）	0 (0)	0.000 (0.000)	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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 （保管費用） （その他）	2 (1) (1)	0.020 (0.011) (0.009)	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
合計	85	0.844	

* 「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、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。

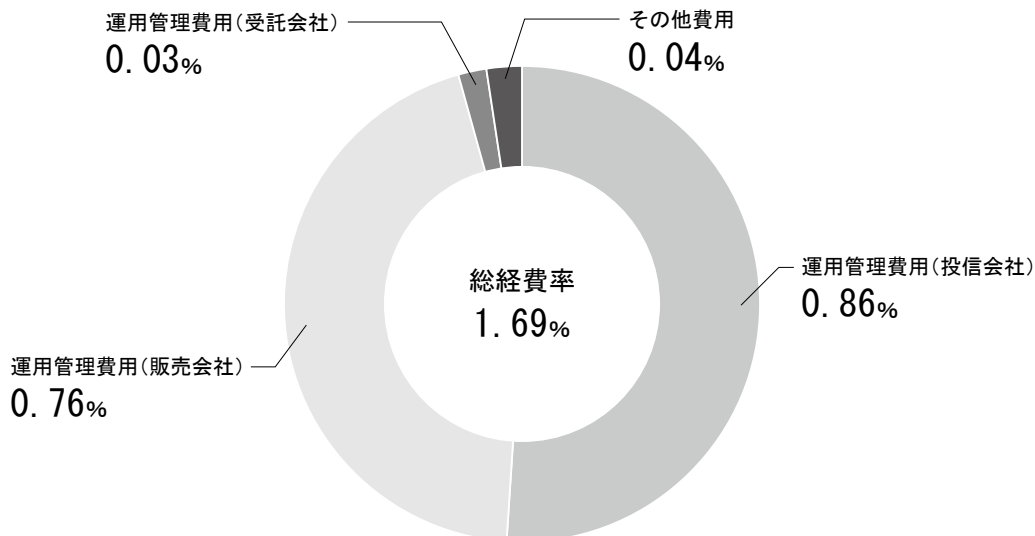
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託受益証券が支払った金額のうち、このファンドに
対応するものを含みます。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201512」

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1.69%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2018年12月26日から2019年6月25日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
世界ハイブリッド証券マザーファンド201512	168,382	172,120	4,456,459	4,655,634

利害関係人との取引状況等

（2018年12月26日から2019年6月25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。

世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201512」

組入資産の明細

2019年6月25日現在

償還日現在、有価証券等の組み入れはありません。

■親投資信託残高

	期首（前期末）	償 還 時	
	口 数	口 数	評 価 額
世界ハイブリッド証券マザーファンド201512	千口 4,288,077	千口 —	千円 —

投資信託財産の構成

2019年6月25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 3,635,133	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,635,133	100.0

資産、負債、元本及び償還価額の状況

損益の状況

(2019年6月25日) 現在

自2018年12月26日
至2019年6月25日

項 目	償 還 時
(A) 資 産	3,635,133,884円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,635,133,884
(B) 負 債	42,569,026
未 払 解 約 金	12,802,665
未 払 信 託 報 酬	29,756,743
未 払 利 息	9,618
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	3,592,564,858
元 本	3,571,326,259
償 還 差 損 益 金	21,238,599
(D) 受 益 権 総 口 数	3,571,326,259口
1 万 口 当 り 償 還 価 額 (C/D)	10,059.47円

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 219,689円
支 払 利 息	△ 219,689
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	214,928,501
売 買 益	519,364,792
売 買 損	△304,436,291
(C) 有 価 証 券 評 価 差 損 益	△134,773,900
(D) 信 託 報 酬 等	△ 33,494,901
(E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	46,440,011
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 17,981,076
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 7,220,336
(H) 計 (E+F+G)	21,238,599
償 還 差 損 益 金 (H)	21,238,599

* 投資信託財産に係る設定年月日、期首元本額及び元本残存率

設定年月日	2015年12月29日
設定元本額	8,276,946,241円
期首元本額	4,451,388,334円
元本残存率	43.1%

* 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。

* 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。

* 当期中において、親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託報酬の中から支弁している額は6,818,226円です。

世界ハイブリッド証券ファンド201512（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201512」

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2015年12月29日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2019年6月25日			資産総額	3,635,133,884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	又は追加信託	負債総額	42,569,026円
					純資産総額	3,592,564,858円
受益権口数	8,276,946,241口	3,571,326,259口	△4,705,619,982口		受益権口数	3,571,326,259口
元本額	8,276,946,241円	3,571,326,259円	△4,705,619,982円		1万口当り償還金	10,059.47円

■毎計算期末の状況

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当り分配金	
				金額	分配率
第1期	円 8,259,805,673	円 8,189,197,211	円 9,915	円 40	% 0.40
第2期	8,154,327,185	8,166,475,188	10,015	40	0.40
第3期	7,519,015,602	7,778,732,024	10,345	40	0.40
第4期	6,190,769,448	6,468,470,956	10,449	40	0.40
第5期	5,479,777,829	5,578,420,584	10,180	40	0.40
第6期	4,451,388,334	4,433,407,258	9,960	0	0.00
信託期間中1万口当り総収益金及び年平均収益率				259.47円	0.7428%

償還金のお知らせ

1万口当り償還金（税込み）	10,059円47銭
---------------	------------

■償還金のお支払いについて

償還金のお支払いは償還日から起算して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

償還時の元本超過額について、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収されます。

※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。

世界ハイブリッド証券マザーファンド201512

運用報告書

繰上償還

償還日：2019年6月24日

(第7期：2018年12月26日～2019年6月24日)

当ファンドは、信託約款の規定に基づき、2019年6月24日をもちまして繰上償還いたしました。ここに、設定以来の運用状況と償還内容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	2015年12月29日から2019年6月24日（当初、無期限）までです。
運用方針	主に世界の企業が発行するハイブリッド証券を中心に投資することにより、高水準の利息収益の確保と信託財産の成長を目指します。
主要運用対象	主に世界の企業が発行するハイブリッド証券を主要投資対象とします。
投資制限	<ul style="list-style-type: none">・ 株式への投資割合には、制限を設けません。・ 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。・ 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>

世界ハイブリッド証券マザーファンド201512

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		ハイブリッド証券 組 入 比 率	純 資 産 額
		期 騰	落 中 率		
(設 定 日) 2015年12月29日	円 10,000		% —	% —	百万円 8,276
第1期 (2016年6月27日)	8,506	△14.9		89.9	7,641
第2期 (2016年12月26日)	9,976	17.3		87.2	8,182
第3期 (2017年6月26日)	10,030	0.5		87.4	7,850
第4期 (2017年12月25日)	10,546	5.1		83.3	6,598
第5期 (2018年6月25日)	10,174	△ 3.5		87.8	5,584
第6期 (2018年12月25日)	10,154	△ 0.2		83.7	4,353
(償 還 日) 第7期 (2019年6月24日)	(償還価額) 10,299.86円		1.4	—	10

*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。

*設定日の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準	価 額		ハイブリッド証券 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首) 2018年12月25日	円 10,154		% —	% 83.7
12月末	10,226		0.7	84.7
2019年1月末	10,191		0.4	80.6
2月末	10,508		3.5	77.1
3月末	10,550		3.9	63.9
4月末	10,645		4.8	18.6
5月末	10,438		2.8	—
(償還日) 2019年6月24日	(償還価額) 10,299.86円		1.4	—

*騰落率は期首比です。

運用経過

【基準価額等の推移】

設定日：10,000円

償還日：10,299円86銭

騰落率：+3.0%

【基準価額の主な変動要因】

(上昇要因)

ファンド設定時の市場環境と適切な銘柄選択が奏功し、設定後の優先証券市場全体の上昇分を取り込むことができました。また、設定当初から2016年10月頃まで上昇した上場銘柄を一部組み入れていたことに加え、組入比率の高い店頭市場の従来型優先証券が大きく上昇したこともプラスに寄与しました。さらに、多くの組入銘柄においてコール

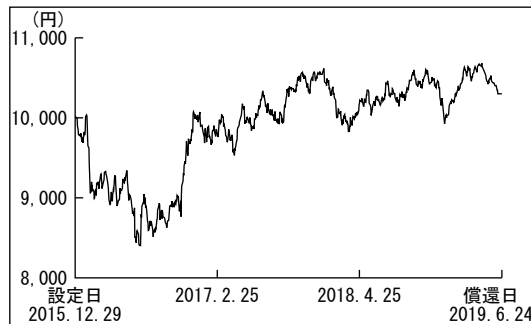
(期限前償還)またはテンダー(買入消却)が実施されたことも奏功しました。

(下落要因)

2016年初め頃は、コールまでの期間の短い一部の米保険銘柄がコールのスキップなどのリスクを嫌気され下落したことが一時的にマイナスに作用しました。また、2016年11月の米国大統領選挙の結果を受け、米国債利回りが急上昇したことを背景に一時的に大きく下落した上場銘柄を一部保有していたことが一時的にマイナスに作用しました。2018年に入ってから、金利上昇に加え、テンダー期待銘柄が額面でコールされる懸念の高まりや欧州銀行株の下落を受けた投資家のリスクオフの動きを背景に、欧州の銀行が発行するデュレーション*の長い従来型優先証券が下落したことも下落要因となりました。

米ドルが対円で下落したことも下落要因となりました。

基準価額の推移



*デュレーションとは、「投資元本の平均的な回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い(大きい)ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

【投資環境】

設定来、優先証券市場は上昇しました。2016年は、新型ティア1証券の利払い懸念、Brexit(英国のEUからの離脱)、ドイツ銀行のモーゲージ担保証券の不正販売に絡む和解問題などに加え、一部の従来型優先証券のコール見送りや米国大統領選挙の結果を受けた米国債利回りの急上昇を背景に市場が弱含む局面も見られましたが、市場は上昇しました。2017年は、金利が上昇する中、利回りへの高い需要や投資家の強気のセンチメントが継続したことから上昇しましたが、2018年は、米国における金利上昇、欧州における地政学リスクの高まり、貿易戦争への懸念などを背景に、リスク回避の動きがクレジット市場全体に波及し、優先証券市場は下落しました。2019年は、主要中央銀行からのハト派的な金融政策見通しによる国債利回りの低下と、投資家心理の改善によって市場は上昇しました。

世界ハイブリッド証券マザーファンド201512

【ポートフォリオ】

設定来の騰落率は、+3.0%となりました。

償還までの期間にコールまたはテNDERが実施される可能性の高い銘柄を組み入れるという当ファンドのコンセプトに沿ったポートフォリオを構築した結果、設定来のリターンはプラスとなりました。ティア1優先証券に対するコール期待の高まりや上場銘柄の上昇がパフォーマンスを押し上げ、店頭市場と上場市場がともに設定時と比較して上昇する中で償還日を迎えました。

為替要因では米ドルが対円で下落したことが円ベースのパフォーマンスにマイナスに作用しました。

2019年6月の償還に向けて組入ハイブリッド証券を全売却し、2019年6月24日に繰上償還いたしました。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2018年12月26日～2019年6月24日		
	金額	比率	
売買委託手数料 (ハイブリッド証券)	0円 (0)	0.000% (0.000)	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 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税 (ハイブリッド証券)	0 (0)	0.000 (0.000)	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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (保管費用) (その他)	2 (1) (1)	0.020 (0.011) (0.009)	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
合計	1	0.020	
期中の平均基準価額は10,426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。

*各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

売買及び取引の状況

(2018年12月26日から2019年6月24日まで)

■ハイブリッド証券

		買	付	額	売	付	額
外国	アメリカ			千アメリカ・ドル —			千アメリカ・ドル 29,050
	イギリス			千イギリス・ポンド —			千イギリス・ポンド 3,397

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

世界ハイブリッド証券マザーファンド201512

主要な売買銘柄

(2018年12月26日から2019年6月24日まで)

■ハイブリッド証券

買		期	
銘	柄	金 額	付
—	—	千円	千円
			CREDIT AGRICOLE SA FL PERPETUAL
			400,478
			BARCLAYS BANK PLC FL PERPETUAL
			398,194
			BPCE SA FL PERPETUAL
			396,829
			BNP PARIBAS FL PERPETUAL
			338,905
			LLOYDS BANKING GROUP PLC FL PERPETUAL
			301,061
			ROYAL BK SCOTLND GRP PLC FL PERPETUAL
			283,539
			STANDARD CHARTERED PLC FL PERPETUAL
			225,115
			COOPERATIEVE RABOBANK UA FL PERPETUAL
			220,360
			BANCO SANTANDER SA FL PERPETUAL
			217,443
			HSBC CAPITAL FUNDING LP FL PERPETUAL
			205,620

*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

(2018年12月26日から2019年6月24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6月24日現在

償還日現在、有価証券等の組み入れはありません。

期首組入資産の明細（2018年12月25日現在）

■ハイブリッド証券25ドル額面

銘	柄	証 券 数	期 首 (前 期 末)	
			評 価	額
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ・ドル…アメリカ)		百証券	千アメリカ・ドル	千円
ING GROEP NV-ISF		15	37	4,145
合 計	証 券 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率>	15	37	4,145
		1銘柄	—	<0.1%>

*邦貨換算金額は、期首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。

*邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率

世界ハイブリッド証券マザーファンド201512

■ハイブリッド証券1,000ドル額面、その他

銘	柄	期首 (前期末)		
		額面金額	評価額	
			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
CREDIT AGRICOLE SA FL PERPETUAL		3,500	3,600	396,320
BPCE SA FL PERPETUAL		3,500	3,718	409,322
BNP PARIBAS FL PERPETUAL		700	719	79,167
BNP PARIBAS FL PERPETUAL		3,000	3,045	335,169
COOPERATIEVE RABOBANK UA FL PERPETUAL		2,000	2,078	228,780
COOPERATIEVE RABOBANK UA FL PERPETUAL		1,195	1,241	136,696
HBOS CAPITAL FUNDING LP 6.85 PERPETUAL		600	598	65,914
LLOYDS BANKING GROUP PLC FL PERPETUAL		2,665	2,611	287,469
LLOYDS BANKING GROUP PLC FL PERPETUAL		650	640	70,516
STANDARD CHARTERED PLC FL PERPETUAL		1,900	1,914	210,701
STANDARD CHARTERED PLC FL PERPETUAL		1,500	1,511	166,343
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC FL PERPETUAL		2,000	2,465	271,322
BANCO SANTANDER SA FL PERPETUAL		2,000	1,917	211,059
HSBC CAPITAL FUNDING LP FL PERPETUAL		1,256	1,805	198,731
HSBC CAPITAL FUNDING LP FL PERPETUAL		600	862	94,935
通貨小計	額面金額 銘柄数 <比率>	27,066 15銘柄	28,731 -	3,162,452 <72.6%>
(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
BARCLAYS BANK PLC FL PERPETUAL		2,700	2,832	395,619
HSBC BANK FUNDING STER FL PERPETUAL		500	597	83,483
通貨小計	額面金額 銘柄数 <比率>	3,200 2銘柄	3,430 -	479,103 <11.0%>
合計	額面金額 銘柄数 <比率>	- 17銘柄	- -	3,641,555 <83.6%>

* 邦貨換算金額は、期首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。

* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率

投資信託財産の構成

2019年6月24日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,637	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	10,637	100.0

資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2019年6月24日) 現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	10,637,745円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,637,745
(B) 負 債	26
未 払 利 息	26
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	10,637,719
元 本	10,328,018
償 還 差 損 益 金	309,701
(D) 受 益 権 総 口 数	10,328,018口
1 万 口 当 り 償 還 価 額 (C/D)	10,299.86円

*元本状況

期首元本額	4,288,077,273円
期中追加設定元本額	168,382,446円
期中一部解約元本額	4,446,131,701円

*元本の内訳

世界ハイブリッド証券ファンド201512 (ヘッジあり)	10,328,018円
------------------------------	-------------

損益の状況

自2018年12月26日
至2019年6月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	104,034,768円
受 取 配 当 金	66,159
受 取 利 息	104,039,209
支 払 利 息	△ 70,600
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	26,011,894
売 買 益 損	92,410,780
売 買 損 益	△ 66,398,886
(C) そ の 他 費 用	△ 467,074
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	129,579,588
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	65,857,368
(F) 解 約 差 損 益 金	△198,865,345
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,738,090
(H) 計 (D+E+F+G)	309,701
償 還 差 損 益 金 (H)	309,701

*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。