

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、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジなし） ・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（為替ヘッジなし） ・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。

運用報告書（全体版）

第12期

決算日 2020年9月2日

英国国債ファンドーギルト10ー （為替ヘッジなし）

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（為替ヘッジなし）」は、去る2020年9月2日に第12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>

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジなし）

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)	税金 分配	騰落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
第8期(2018年9月3日)	8,504	60	△ 1.3	1.0390	97.9	—	85
第9期(2019年3月4日)	8,789	60	4.1	1.0000	98.2	—	87
第10期(2019年9月2日)	7,855	60	△ 9.9	0.3330	98.1	—	78
第11期(2020年3月2日)	8,354	60	7.1	0.3290	98.3	—	83
第12期(2020年9月2日)	8,623	60	3.9	-0.0360	98.0	—	86

* 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				
(期首)2020年3月2日	円	%	%	%	%
3月末	8,354	—	0.3290	98.3	—
4月末	8,142	△ 2.5	0.2010	98.7	—
5月末	8,121	△ 2.8	0.1500	98.6	—
6月末	8,136	△ 2.6	0.0130	98.5	—
7月末	8,148	△ 2.5	-0.0500	98.3	—
8月末	8,454	1.2	-0.1320	98.2	—
8月末	8,603	3.0	-0.0080	97.3	—
(期末)2020年9月2日	8,683	3.9	-0.0360	98.0	—

* 騰落率は期首比です。

* 期末基準価額は分配金込み

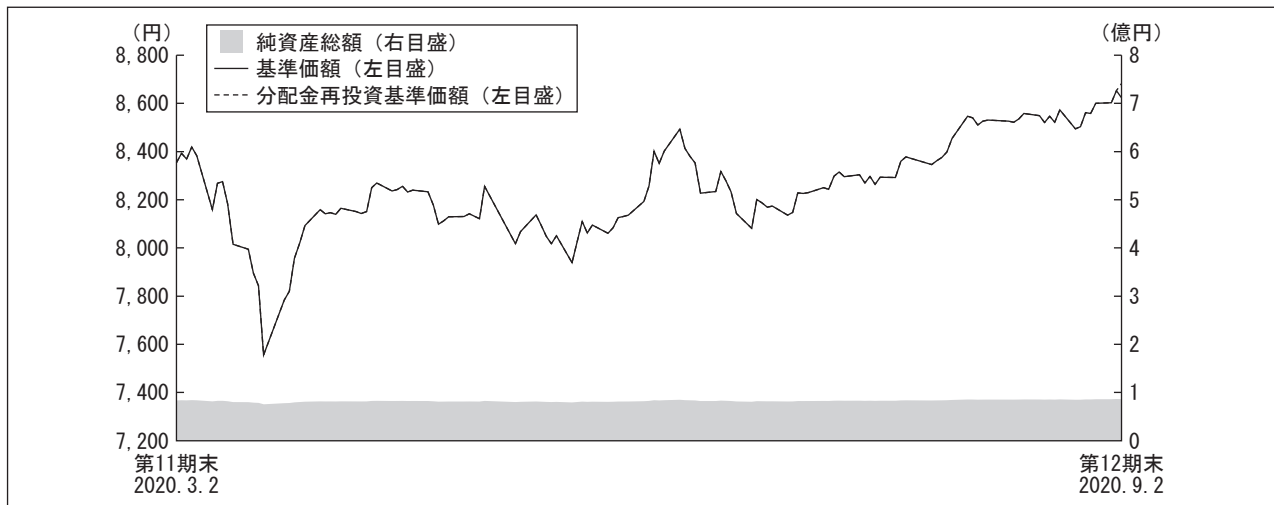
* 先物組入比率は、買建比率-売建比率

* 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（為替ヘッジなし）

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12期首：8,354円

第12期末：8,623円（既払分配金 60円）

騰落率：+3.9%（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）

保有する債券のインカムゲインや英ポンド円の上昇などが、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（為替ヘッジなし）

【投資環境】

英国債券相場では、金利は概ね横ばいとなりました。新型コロナウイルス感染症の世界的な感染拡大を背景に金利は低下して始まりましたが、3月中旬には資産の現金化の動きが強まったことで、一時、金利は急上昇しました。その後金利は低下基調となり、新型コロナウイルスによる経済的な悪影響が意識されたことや、BOE（イングランド銀行：中央銀行）の緩和的なスタンス、EU（欧州連合）離脱を巡る通商交渉に対する懸念などを背景に、金利の低下基調が続きました。しかしながら8月に入ると、BOEによるマイナス金利採用観測が後退したことや、リスクセンチメントの改善から金利は上昇する展開となりました。

英ポンド円相場は上昇しました。EUによる復興基金への期待や、リスクセンチメントの改善などを背景に、英ポンド円は上昇しました。

【ポートフォリオ】

■英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジなし）

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98.0%としました。

■英国国債ギルト10・マザーファンド

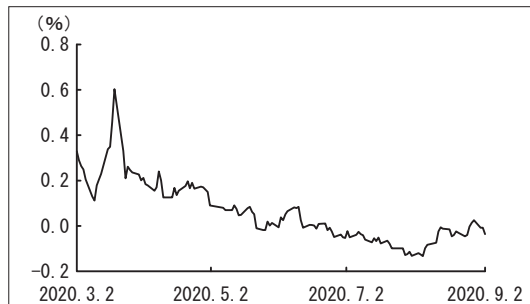
当期の騰落率は、+4.2%となりました。

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5年国債利回りの推移



英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジなし）

【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60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12期	
	2020年3月3日 ～2020年9月2日	
当期分配金 (対基準価額比率)	(円) (%)	60 0.69
当期の収益	(円)	60
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	1,023

※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（為替ヘッジなし）

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。

■英国国債ギルト10・マザーファンド

足元では、新型コロナウイルス感染症の感染状況の悪化に一巡感が見られ、市場のリスクセンチメントに改善が見られていますが、BOEや主要国の中央銀行は緩和的な姿勢を維持する可能性が高く、英国における金利低下圧力は継続するものと考えています。

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年程度へ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（為替ヘッジなし）

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年3月3日～2020年9月2日		
	金額	比率	
信託報酬	20円	0.238%	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8,267円です。
（投信会社）	（9）	（0.111）	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	（9）	（0.111）	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）	（1）	（0.017）	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	0.029	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）	（2）	（0.022）	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）	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	（0）	（0.002）	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	22	0.267	

* 「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。

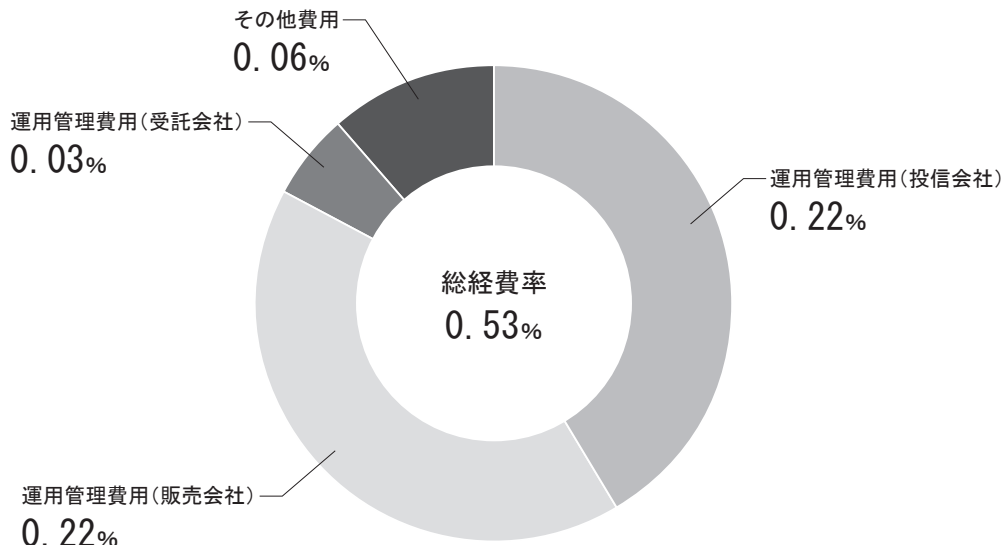
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

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（為替ヘッジなし）

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0.53%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2020年3月3日から2020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 —	千円 —	千口 1,742	千円 1,653

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジなし）

利害関係人との取引状況等

（2020年3月3日から2020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

2020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 90,510	千口 88,768		千円 86,176

*英国国債ギルト10・マザーファンド全体の受益権口数は、393,954千口です。

投資信託財産の構成

2020年9月2日現在

項	目	当	期	末		
		評	価	額	比	率
			千円			%
	英国国債ギルト10・マザーファンド		86,176			99.0
	コール・ローン等、その他		851			1.0
	投資信託財産総額		87,027			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=141.88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（379,080千円）の投資信託財産総額（385,997千円）に対する比率 98.2%

英国国債ファンドーギルト10ー（為替ヘッジなし）

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年9月2日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	87,027,598円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	50,000
英国国債ギルト10・マザーファンド(評価額)	86,176,473
未 収 入 金	801,125
(B) 負 債	801,018
未 払 収 益 分 配 金	600,000
未 払 信 託 報 酬	196,548
そ の 他 未 払 費 用	4,470
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	86,226,580
元 本	100,000,000
次 期 繰 越 損 益 金	△ 13,773,420
(D) 受 益 権 総 口 数	100,000,000口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	8,623円

* 元本状況

期首元本額	100,000,000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 13,773,420円

損益の状況

自2020年3月3日
至2020年9月2日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	3,483,653円
売 買 益	3,483,653
(B) 信託報酬等	△ 201,018
(C) 当期損益金(A+B)	3,282,635
(D) 前期繰越損益金	△ 24,814,985
(E) 追加信託差損益金	8,358,930
(配当等相当額)	(4,958,269)
(売買損益相当額)	(3,400,661)
(F) 計 (C+D+E)	△ 13,173,420
(G) 収益分配金	△ 600,000
次期繰越損益金 (F+G)	△ 13,773,420
追加信託差損益金	8,358,930
(配当等相当額)	(4,958,269)
(売買損益相当額)	(3,400,661)
分配準備積立金	1,880,501
繰越損益金	△ 24,012,851

* 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)	776,330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	8,358,930
(D) 分配準備積立金	1,704,171
分配可能額(A+B+C+D)	10,839,431
(1万口当り分配可能額)	(1,083.94)
収益分配金	600,000
(1万口当り収益分配金)	(60)

分配金のお知らせ

1万口当り分配金（税込み）	60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。

※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。

英国国債ギルト10・マザーファンド

運用報告書

決算日：2020年9月2日

(第12期：2020年3月3日～2020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

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<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8期(2018年9月3日)	9,217	△ 1.1	1.0390	97.0	—	百万円 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
第11期(2020年3月2日)	9,319	7.4	0.3290	97.3	—	359
第12期(2020年9月2日)	9,708	4.2	-0.0360	98.0	—	382

*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)2020年3月2日	9,319	—	0.3290	97.3	—
3月末	9,086	△ 2.5	0.2010	98.7	—
4月末	9,066	△ 2.7	0.1500	98.5	—
5月末	9,086	△ 2.5	0.0130	98.4	—
6月末	9,103	△ 2.3	-0.0500	98.2	—
7月末	9,448	1.4	-0.1320	98.0	—
8月末	9,619	3.2	-0.0080	97.1	—
(期末)2020年9月2日	9,708	4.2	-0.0360	98.0	—

*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：9,319円

期末：9,708円

騰落率：+4.2%

【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英ポンド円の上昇などが、主な上昇要因となりました。

【投資環境】

英国債券相場では、金利は概ね横ばいとなりました。新型コロナウイルス感染症の世界的な感染拡大を背景に金利は低下して始まりましたが、3月中旬には資産の現金化の動きが強まったことで、一時、金利は急上昇しました。その後金利は低下基調となり、新型肺炎による経済的な悪影響が意識されたことや、BOE（イングランド銀行：中央銀行）の緩和的なスタンス、EU（欧州連合）離脱を巡る通商交渉に対する懸念などを背景に、金利の低下基調が続きました。しかしながら8月に入ると、BOEによるマイナス金利採用観測が後退したことや、リスクセンチメントの改善から金利は上昇する展開となりました。

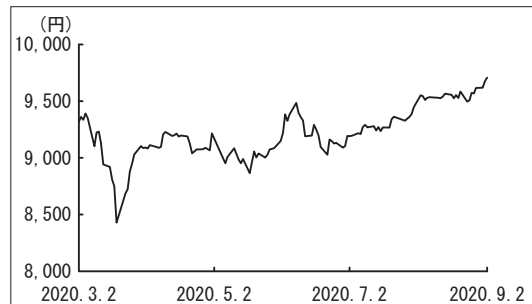
英ポンド円相場は上昇しました。EUによる復興基金への期待や、リスクセンチメントの改善などを背景に、英ポンド円は上昇しました。

【ポートフォリオ】

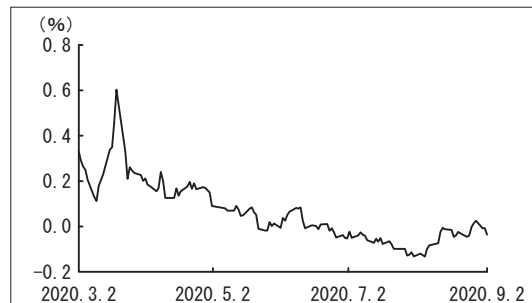
当期の騰落率は、+4.2%となりました。

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

足元では、新型コロナウイルス感染症の感染状況の悪化に一巡感が見られ、市場のリスクセンチメントに改善が見られていますが、BOEや主要国の中央銀行は緩和的な姿勢を維持する可能性が高く、英国における金利低下圧力は継続するものと考えています。

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年程度へ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
	2020年3月3日～2020年9月2日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	2円	0.023%	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)	(0.002)	
合計	2	0.023	
期中の平均基準価額は9,235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3月3日から2020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 155	千イギリス・ポンド 58

* 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

(2020年3月3日から2020年9月2日まで)

■ 公社債

当			期		
買	付	金額	売	付	金額
銘柄	柄	金額	銘柄	柄	金額
		千円			千円
UK GILT 3.75	09/07/20	2,994	UK GILT 1.5	07/22/26	1,484
UK GILT 3.75	09/07/21	2,819	UK GILT 1.25	07/22/27	1,473
UK GILT 2.25	09/07/23	2,597	UK GILT 1.625	10/22/28	786
UK GILT 2.75	09/07/24	2,400	UK GILT 0.875	10/22/29	743
UK GILT 1.75	09/07/22	2,374	UK GILT 2.75	09/07/24	738
UK GILT 2	09/07/25	2,077	UK GILT 2	09/07/25	731
UK GILT 1.5	07/22/26	1,911	UK GILT 2.25	09/07/23	710
UK GILT 1.25	07/22/27	1,898	UK GILT 3.75	09/07/21	415
UK GILT 1.625	10/22/28	897	UK GILT 1.75	09/07/22	412
UK GILT 0.875	10/22/29	847	UK GILT 3.75	09/07/20	400

*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3月3日から2020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

2020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 2,471	千イギリス・ポンド 2,642	千円 374,944	% 98.0	% —	% 48.6	% 29.7	% 19.7
合 計	—	—	374,944	98.0	—	48.6	29.7	19.7

*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	種類	利率	額面金額	期末		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	265	265	37,643	2020/09/07
UK GILT	国債証券	3.7500	255	264	37,577	2021/09/07
UK GILT	国債証券	1.7500	258	267	37,972	2022/09/07
UK GILT	国債証券	2.2500	250	267	37,982	2023/09/07
UK GILT	国債証券	2.7500	239	266	37,772	2024/09/07
UK GILT	国債証券	2.0000	241	265	37,711	2025/09/07
UK GILT	国債証券	1.5000	241	262	37,214	2026/07/22
UK GILT	国債証券	1.2500	243	262	37,232	2027/07/22
UK GILT	国債証券	1.6250	232	259	36,821	2028/10/22
UK GILT	国債証券	0.8750	247	260	37,014	2029/10/22
合計	—	—	2,471	2,642	374,944	—

* 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

2020年9月2日現在

項目	当	期	末		
	評	価	額	比	率
公債		千円	%		
コーポレートローン等、その他		11,053	2.9		
投資信託財産総額		385,997	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=141.88円

* 当期末における外貨建資産（379,080千円）の投資信託財産総額（385,997千円）に対する比率 98.2%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年9月2日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	385,997,129円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,783,914
公 社 債 (評価額)	374,944,027
未 収 利 息	3,225,177
前 払 費 用	44,011
(B) 負 債	3,529,499
未 払 解 約 金	3,529,499
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	382,467,630
元 本	393,954,517
次 期 繰 越 損 益 金	△ 11,486,887
(D) 受 益 権 総 口 数	393,954,517口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	9,708円

*元本状況

期首元本額	385,854,668円
期中追加設定元本額	21,076,865円
期中一部解約元本額	12,977,016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)	305,186,003円
英国国債ファンドーギルト10ー (為替ヘッジなし)	88,768,514円

*元本の欠損

11,486,887円

損益の状況

自2020年3月3日
至2020年9月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,830,065円
受 取 利 息	3,831,012
支 払 利 息	△ 947
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,962,039
売 買 益	13,059,740
売 買 損	△ 1,097,701
(C) そ の 他 費 用	△ 85,084
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	15,707,020
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 26,258,908
(F) 解 約 差 損 益 金	817,979
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,752,978
(H) 計 (D+E+F+G)	△ 11,486,887
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△ 11,486,887

*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。