

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	2016年2月29日
信託期間	2016年2月29日～2019年8月26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201602（ヘッジあり） ・世界ハイブリッド証券マザーファンド201602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201602 ・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201602（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201602 ・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2月、8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・配当収益のいずれが多い金額とします。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8月26日

世界ハイブリッド証券ファンド201602 （ヘッジあり） （愛称） ゆうせん君プラス201602

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201602（ヘッジあり）（愛称：ゆうせん君プラス201602）」は、信託約款の規定に基づき、2019年8月26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201602（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201602」

設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受利益者	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	期騰落中額			
(設定日) 2016年2月29日	円 10,000	円 —	円 —	円 —	% —	% —	% 100.0
第1期(2016年8月25日)	10,519	80	599	6.0	12.2	89.3	93.6
第2期(2017年2月27日)	10,444	80	5	0.0	6.0	88.9	63.2
第3期(2017年8月25日)	10,817	80	453	4.3	7.1	88.6	48.7
第4期(2018年2月26日)	10,772	80	35	0.3	5.5	72.2	41.6
第5期(2018年8月27日)	10,328	60	△ 384	△3.6	2.8	81.1	29.0
第6期(2019年2月25日)	10,297	30	△ 1	△0.0	2.4	79.8	22.8
(償還日) 第7期(2019年8月26日)	(償還価額) 10,446.78円		149.78	1.5	2.5	—	19.4

*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) 2019年2月25日	円 10,297	% —	% 79.8
2月末	10,326	0.3	80.1
3月末	10,358	0.6	78.2
4月末	10,418	1.2	80.7
5月末	10,417	1.2	60.1
6月末	10,470	1.7	61.2
7月末	10,461	1.6	—
(償還日) 2019年8月26日	(償還価額) 10,446.78円	1.5	—

*騰落率は期首比です。

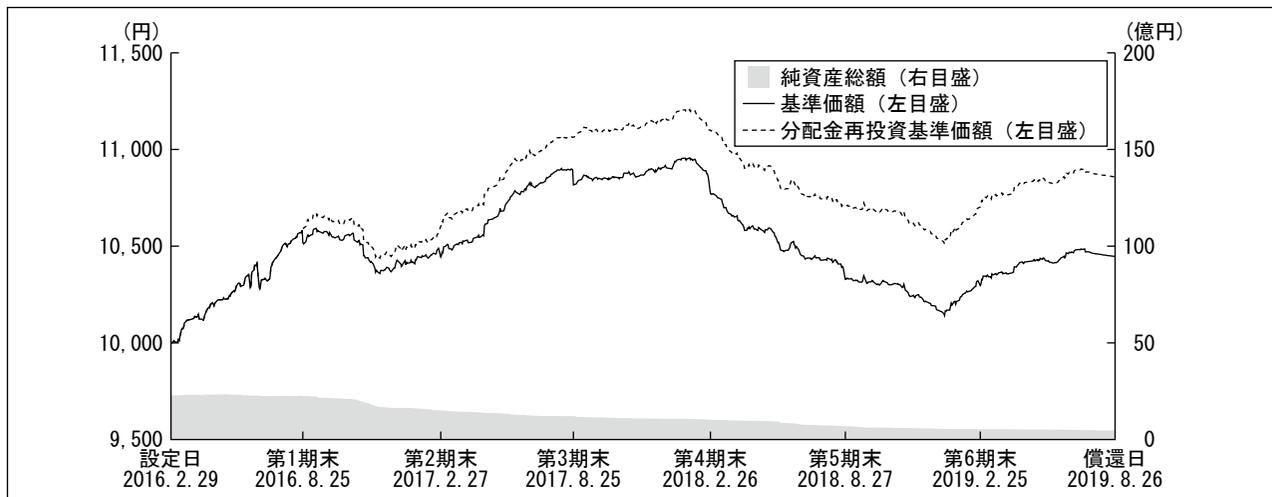
*当ファンドは親投資信託を組み入れますので、ハイブリッド証券組入比率は実質組入比率を記載しています。

世界ハイブリッド証券ファンド201602（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201602」

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。

* 単位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：10,446円78銭（既払分配金 410円）

騰落率：+8.6%（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、世界ハイブリッド証券マザーファンド201602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、設定後の優先証券相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。

（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。

世界ハイブリッド証券ファンド201602（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201602」

【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201602（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201602を運用期間を通じて組み入れました。その後、2019年8月の償還に向けてマザーファンドを売却し、2019年8月26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201602

設定来の騰落率は、+17.5%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8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8月23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4期の各期において80円、第5期60円、第6期30円とさせて頂きました。（1万円当り税込み）

世界ハイブリッド証券ファンド201602（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201602」

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2019年2月26日～2019年8月26日		
	金額	比率	
信託報酬	86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10,408円です。
（投信会社）	(45)	(0.431)	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	(39)	(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
その他費用	5	0.051	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）	(5)	(0.046)	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）	(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	91	0.875	

* 「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。

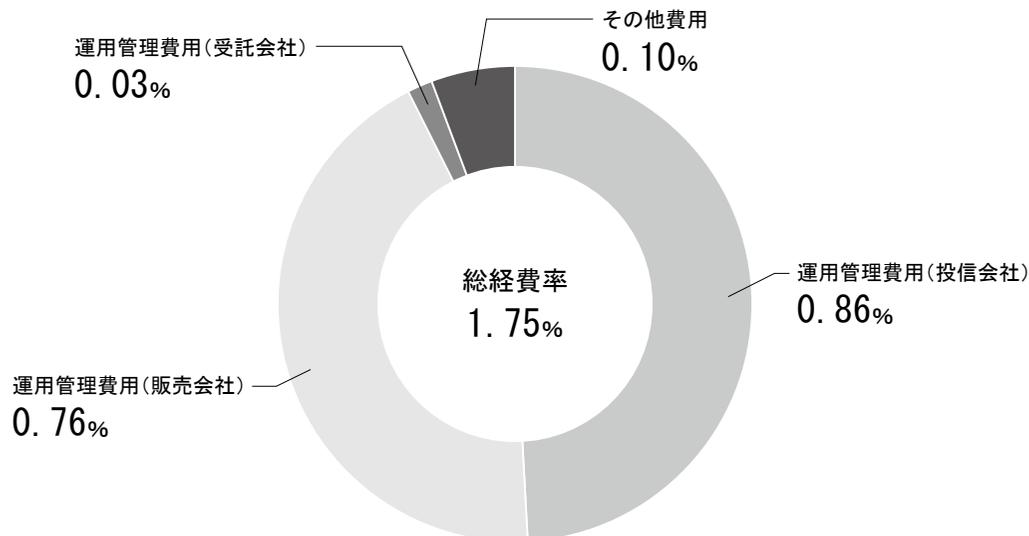
なお、その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託受益証券が支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

* 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201602（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201602」

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1.75%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2019年2月26日から2019年8月26日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
世界ハイブリッド証券マザーファンド201602	千口 12,047	千円 14,125	千口 480,567	千円 565,509

利害関係人との取引状況等

（2019年2月26日から2019年8月26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201602（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201602」

組入資産の明細

2019年8月26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	口数	評価額
世界ハイブリッド証券マザーファンド201602	千口 468,519	千口 —	千口 —	千円 —

投資信託財産の構成

2019年8月26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 480,412	% 100.0
投資信託財産総額	480,412	100.0

資産、負債、元本及び償還価額の状況

損益の状況

(2019年8月26日) 現在

自2019年2月26日
至2019年8月26日

項目	償還時
(A) 資産	480,412,003円
コール・ローン等	480,412,003
(B) 負債	15,171,842
未払解約金	11,250,884
未払信託報酬	3,920,015
未払利息	943
(C) 純資産総額(A-B)	465,240,161
元本	445,343,215
償還差損益金	19,896,946
(D) 受益権総口数	445,343,215口
1万口当り償還価額(C/D)	10,446.78円

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 13,723円
支払利息	△ 13,723
(B) 有価証券売買損益	79,494,451
売買益	90,430,730
売買損	△10,936,279
(C) 有価証券評価差損益	△67,577,290
(D) 信託報酬等	△ 4,222,251
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	7,681,187
(F) 前期繰越損益金	15,492,532
(G) 解約差損益金	△ 3,276,773
(H) 計(E+F+G)	19,896,946
償還差損益金(H)	19,896,946

*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	2016年2月29日
設定元本額	2,284,119,075円
期首元本額	521,186,749円
元本残存率	19.4%

*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906,833円です。

世界ハイブリッド証券ファンド201602（ヘッジあり）

愛称：「ゆうせん君プラス201602」

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2016年2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8月26日			資産総額	480,412,003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	15,171,842円
					純資産総額	465,240,161円
受益権口数	2,284,119,075口	445,343,215口	△1,838,775,860口		受益権口数	445,343,215口
元本額	2,284,119,075円	445,343,215円	△1,838,775,860円		1万口当り償還金	10,446.78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 2,139,032,498	円 2,250,048,547	円 10,519	円 80	% 0.80
第2期	1,443,619,141	1,507,675,632	10,444	80	0.80
第3期	1,112,665,254	1,203,613,110	10,817	80	0.80
第4期	952,211,699	1,025,687,063	10,772	80	0.80
第5期	664,472,176	686,280,441	10,328	60	0.60
第6期	521,186,749	536,679,281	10,297	30	0.30
信託期間中1万口当り総収益金及び年平均収益率				856.78円	2.4527%

償還金のお知らせ

1万口当り償還金（税込み）	10,446円78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201602

運用報告書

繰上償還

償還日：2019年8月23日

(第7期：2019年2月26日～2019年8月23日)

当ファンドは、信託約款の規定に基づき、2019年8月23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	2016年2月29日から2019年8月23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201602

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) 2016年 2 月 29 日	円 10,000		% —	% —	百万円 2,284
第 1 期 (2016年 8 月 25 日)	9,521	△	4.8	92.8	2,166
第 2 期 (2017年 2 月 27 日)	10,811		13.5	88.8	1,509
第 3 期 (2017年 8 月 25 日)	11,215		3.7	88.9	1,198
第 4 期 (2018年 2 月 26 日)	11,157	△	0.5	73.5	1,007
第 5 期 (2018年 8 月 27 日)	11,406		2.2	79.0	705
第 6 期 (2019年 2 月 25 日)	11,634		2.0	78.6	545
(償 還 日) 第 7 期 (2019年 8 月 23 日)	(償還価額) 11,751.89円		1.0	—	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) 2019年 2 月 25 日	円 11,634		% —	% 78.6
2 月 末	11,678		0.4	79.6
3 月 末	11,768		1.2	78.4
4 月 末	11,965		2.8	80.3
5 月 末	11,754		1.0	59.9
6 月 末	11,686		0.4	60.6
7 月 末	11,769		1.2	—
(償還日) 2019年 8 月 23 日	(償還価額) 11,751.89円		1.0	—

*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：11,751円89銭
 騰落率：+17.5%

【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、設定後の優先証券相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。

(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。

*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】

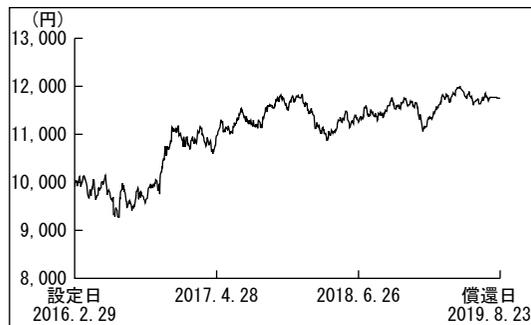
設定来の騰落率は、+17.5%となりました。

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8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8月23日に繰上償還いたしました。

基準価額の推移



世界ハイブリッド証券マザーファンド201602

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2019年2月26日～2019年8月23日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	6円 (5)	0.047% (0.045)	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	6	0.047	
期中の平均基準価額は11,770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2月26日から2019年8月23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 3,518 (400)

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

*（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

主要な売買銘柄

(2019年2月26日から2019年8月23日まで)

■ハイブリッド証券

当		期	
買付	金額	売付	金額
銘柄	柄	銘柄	柄
—	千円	RBS CAPITAL TRUST II FL PERPETUAL	55,164
		HSBC CAPITAL FUNDING LP FL PERPETUAL	49,973
		BARCLAYS BANK PLC 10.179 06/12/21	49,306
		STANDARD CHARTERED PLC FL PERPETUAL	47,298
		BNP PARIBAS FL PERPETUAL	47,258
		LLOYDS BANKING GROUP PLC FL PERPETUAL	46,117
		BPCE SA FL PERPETUAL	44,216
		CREDIT AGRICOLE SA FL PERPETUAL	43,912

*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2月26日から2019年8月23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8月23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 (2019年2月25日現在)

■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	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
	RBS CAPITAL TRUST II FL PERPETUAL	400	485	53,728
	CREDIT AGRICOLE SA FL PERPETUAL	400	412	45,641
	BPCE SA FL PERPETUAL	400	421	46,638
	BNP PARIBAS FL PERPETUAL	400	426	47,283
	COOPERATIEVE RABOBANK UA FL PERPETUAL	400	412	45,696
	BARCLAYS BANK PLC 10.179 06/12/21	400	452	50,110
	LLOYDS BANKING GROUP PLC FL PERPETUAL	400	399	44,256
	STANDARD CHARTERED PLC FL PERPETUAL	400	422	46,757
	HSBC CAPITAL FUNDING LP FL PERPETUAL	300	436	48,304
合計	額面金額	3,500	3,867	428,417
	銘柄数 <比率>	9銘柄	—	<78.6%>

*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8月23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	10,527	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	10,527	100.0

資産、負債、元本及び償還価額の状況

(2019年8月23日) 現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	10,527,964円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,527,964
(B) 負 債	69
未 払 利 息	69
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	10,527,895
元 本	8,958,471
償 還 差 損 益 金	1,569,424
(D) 受 益 権 総 口 数	8,958,471口
1 万 口 当 り 償 還 価 額 (C / D)	11,751.89円

*元本状況

期首元本額	468,519,459円
期中追加設定元本額	12,047,931円
期中一部解約元本額	471,608,919円

*元本の内訳

世界ハイブリッド証券ファンド201602 (ヘッジあり)	8,958,471円
------------------------------	------------

損益の状況

自2019年2月26日
至2019年8月23日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	12,452,065円
受 取 利 息	12,474,699
支 払 利 息	△ 22,634
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,916,497
売 買 益	9,503,883
売 買 損	△15,420,380
(C) そ の 他 費 用	△ 247,596
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	6,287,972
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	76,577,110
(F) 解 約 差 損 益 金	△83,373,134
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,077,476
(H) 計 (D + E + F + G)	1,569,424
償 還 差 損 益 金 (H)	1,569,424

*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。



三井住友DSアセットマネジメント