

★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 | |
| 信託期間 | 4年10カ月間（2015年11月16日～2020年9月15日） | |
| 運用方針 | 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。 | |
| 主要投資対象 | ベビーファンド | 外貨建てニッポン社債マザーファンド≪2020-09≫の受益証券 |
| | 外貨建てニッポン社債マザーファンド≪2020-09≫ | 米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等 |
| ベビーファンドの運用方法 | <p>①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、日系企業が発行する外貨建ての社債等に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。</p> <p>※日系企業とは、日本企業もしくはその子会社をいいます。</p> <p>※社債等には、日本の政府機関、地方公共団体等が発行する債券を含みます。</p> <p>②マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。</p> <p>③保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。</p> <p>※保有実質外貨建資産とは、当ファンドが保有する外貨建資産およびマザーファンドが保有する外貨建資産のうち当ファンドに属するとみなした外貨建資産をいいます。</p> | |
| マザーファンドの運用方法 | <p>①運用にあたっては、以下の点に留意します。</p> <p>イ. 投資対象は、主として日系企業が発行する米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等とします。</p> <p>※必ずしも、上記通貨のすべてが組み入れられるわけではありません。</p> <p>ロ. 流動性の確保およびポートフォリオのデュレーションの調整のため、米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての海外の国債やコマーシャル・ペーパー等に投資することがあります。</p> <p>ハ. 債券の格付けは、取得時においてB B B格相当以上（R & I、J C R、S & P、フィッチのいずれかでB B B-以上またはムーディーズでB a a 3以上）とします。</p> <p>ニ. ポートフォリオのデュレーションは、当ファンドの残存年数+0.3（年）以内とすることをめざします。</p> <p>②為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> | |
| 組入制限 | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 | 無制限 |
| | マザーファンドの株式組入上限比率 | 純資産総額の10%以下 |
| 分配方針 | <p>分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、経費控除後の配当等収益等の中から分配することをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。</p> | |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

東京TYFG・外貨建て ニッポン社債ファンド201510 （愛称：東京TY201510）

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2016年11月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「東京TYFG・外貨建てニッポン社債ファンド201510（愛称：東京TY201510）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

<3268>

設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 公社債 組入比率 | 債券先物 比率 | 純資産 総額 |
|--------------------|--------|--------|--------|-------------|------------|-----------|
| | (分配落) | 税 分 | 込 配 | | | |
| | 円 | | 円 | % | | 百万円 |
| 1 期末 (2016年 5月16日) | 10,260 | | 30 | 2.9 | 91.8 | 7,022 |
| 2 期末 (2016年11月15日) | 10,173 | | 30 | △ 0.6 | 101.7 | 6,218 |

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注 2) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

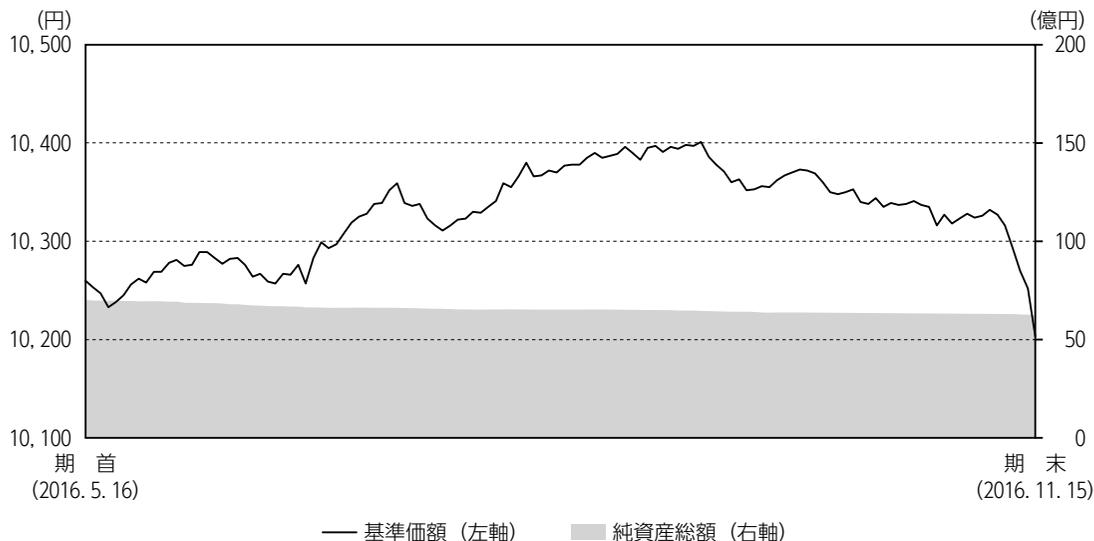
(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注 5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《運用経過》

基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

期首：10,260円

期末：10,173円 (分配金30円)

騰落率：△0.6% (分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

「外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>>」の受益証券を通じて、主として日系企業が発行する外貨建ての社債に投資し、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行なった結果、債券の利息収入はプラスに寄与しましたが、社債金利の上昇（債券価格の下落）などを反映し、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

東京TYFG・外貨建てニッポン社債ファンド201510

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 公 社 債 率 組 入 比 | 債 券 先 物 率 比 |
|--------------------|---------|------------|------------------|----------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | | |
| (期 首) 2016年 5 月16日 | 10,260 | — | 91.8 | — |
| 5 月末 | 10,278 | 0.2 | 96.9 | — |
| 6 月末 | 10,297 | 0.4 | 94.2 | — |
| 7 月末 | 10,335 | 0.7 | 96.7 | — |
| 8 月末 | 10,397 | 1.3 | 94.7 | — |
| 9 月末 | 10,372 | 1.1 | 94.2 | — |
| 10 月末 | 10,323 | 0.6 | 98.5 | — |
| (期 末) 2016年11月15日 | 10,203 | △ 0.6 | 101.7 | — |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

○海外債券市況

主要国では、英国のEU（欧州連合）離脱に対する警戒感などから、当初は国債金利が低下（債券価格は上昇）しました。その後は、欧米の景況感の改善を示す経済指標や原油価格の回復に伴うインフレ期待の上昇などを背景に、米国の年内利上げ観測やECB（欧州中央銀行）による量的金融緩和の減額への懸念が広がりました。また、米国大統領選挙の結果を受けて財政拡大による景気浮揚が意識されたこともあり、国債金利は期末に向けて上昇基調となりました。

こうした環境下、米ドルなど外貨建ての社債は、金利が上昇しました。ただし、発行体信用力に目立った悪化は見られず、相対的に高い利回りを求める投資需要に支援され、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は縮小しました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

「外貨建てニッポン社債マザーファンド<2020-09>」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。

○外貨建てニッポン社債マザーファンド<2020-09>

今後も、主として日系企業の米ドル建て債券に投資し、高利回りの金融セクターを中心に投資を行なうことにより高いポートフォリオ利回りを維持し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行なってまいります。

ポートフォリオについて

○当ファンド

「外貨建てニッポン社債マザーファンド<2020-09>」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないました。

○外貨建てニッポン社債マザーファンド<2020-09>

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、流動性や利回り面で投資妙味のある金融セクターを中心としたポートフォリオを維持しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は30円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目 | 当期 | |
|---------------|------------|--------------|
| | 2016年5月17日 | ~2016年11月15日 |
| 当期分配金（税込み）（円） | | 30 |
| 対基準価額比率（％） | | 0.29 |
| 当期の収益（円） | | 30 |
| 当期の収益以外（円） | | — |
| 翌期繰越分配対象額（円） | | 365 |

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

| 項 目 | 当期 |
|-----------------------------|---------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 132.01円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 |
| (c) 収益調整金 | 1.68 |
| (d) 分配準備積立金 | 261.58 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 395.28 |
| (f) 分配金 | 30.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 365.28 |

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

《今後の運用方針》

○当ファンド

「外貨建てニッポン社債マザーファンド<2020-09>」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。

○外貨建てニッポン社債マザーファンド<2020-09>

主として日系企業が発行する米ドル建て債券に投資し、金融セクターを中心としたポートフォリオを維持することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------|----------------------------|---------|--|
| | (2016. 5. 17~2016. 11. 15) | | |
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信託報酬 | 57円 | 0.555% | 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10,328円です。 |
| (投信会社) | (28) | (0.271) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価 |
| (販売会社) | (28) | (0.271) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託銀行) | (1) | (0.013) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| 売買委託手数料 | — | — | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、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 | — | — | 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 有価証券取引税は、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 | 1 | 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 |
| (保管費用) | (0) | (0.005) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (監査費用) | (0) | (0.004) | 監査費用は、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) | (0.000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 58 | 0.564 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンド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まず。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年5月17日から2016年11月15日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|------------------------------|--------|--------|---------|---------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>> | 77,577 | 67,500 | 275,359 | 244,700 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | | 当 期 末 | | |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-------|-----|-------|
| | 口 数 | 金 額 | 評 価 額 | 口 数 | 金 額 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千円 | 千円 | 千口 | 千円 | 千円 |
| 外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>> | 7,262,719 | 7,064,937 | 6,538,599 | | | |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>> | 6,538,599 | 97.3 |
| コール・ローン等、その他 | 180,658 | 2.7 |
| 投資信託財産総額 | 6,719,257 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.89円です。

(注3) 外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>>において、当期末における外貨建純資産(12,226,842千円)の投資信託財産総額(12,271,076千円)に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------------|-----------------|
| (A) 資産 | 12,831,878,476円 |
| コール・ローン等 | 180,658,117 |
| 外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>>(評価額) | 6,538,599,223 |
| 未収入金 | 6,112,621,136 |
| (B) 負債 | 6,612,971,433 |
| 未払金 | 6,558,035,770 |
| 未払収益分配金 | 18,338,742 |
| 未払信託報酬 | 36,331,177 |
| その他未払費用 | 265,744 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 6,218,907,043 |
| 元本 | 6,112,914,175 |
| 次期繰越損益金 | 105,992,868 |
| (D) 受益権総口数 | 6,112,914,175口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 10,173円 |

* 期首における元本額は6,844,495,966円、当期中における追加設定元本額は93,217円、同解約元本額は731,675,008円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,173円です。

■損益の状況

当期 自2016年5月17日 至2016年11月15日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| (A) 配当等収益 | △ 39,068円 |
| 受取利息 | 1,722 |
| 支払利息 | △ 40,790 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,980,215 |
| 売買益 | 462,792,826 |
| 売買損 | △ 460,812,611 |
| (C) 信託報酬等 | △ 36,607,721 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 34,666,574 |
| (E) 前期繰越損益金 | 159,902,337 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 904,153 |
| (配当等相当額) | (1,031,740) |
| (売買損益相当額) | (△ 1,935,893) |
| (G) 合計(D+E+F) | 124,331,610 |
| (H) 収益分配金 | △ 18,338,742 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 105,992,868 |
| 追加信託差損益金 | △ 904,153 |
| (配当等相当額) | (1,031,740) |
| (売買損益相当額) | (△ 1,935,893) |
| 分配準備積立金 | 222,262,498 |
| 繰越損益金 | △ 115,365,477 |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は9ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 80,698,903円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 1,031,740 |
| (d) 分配準備積立金 | 159,902,337 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 241,632,980 |
| (f) 分配金 | 18,338,742 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e-f) | 223,294,238 |
| (h) 受益権総口数 | 6,112,914,175口 |

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

30円

- <分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、11月15日現在の基準価額（1万口当り10,173円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、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）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、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です。
- ・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。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）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、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>>

運用報告書 第2期 (決算日 2016年11月15日)

(計算期間 2016年5月17日～2016年11月15日)

外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>>の第2期にかかる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。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等 |
| 運用方法 | <p>①主として、日系企業が発行する外貨建ての社債等に投資することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。 ※日系企業とは、日本企業もしくはその子会社をいいます。 ※社債等には、日本の政府機関、地方公共団体等が発行する債券を含みます。</p> <p>②運用にあたっては、以下の点に留意します。 イ. 投資対象は、主として日系企業が発行する米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債等とします。 ※必ずしも、上記通貨のすべてが組み入れられるわけではありません。 ロ. 流動性の確保およびポートフォリオのデュレーションの調整のため、米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての海外の国債やコマーシャル・ペーパー等に投資することがあります。 ハ. 債券の格付けは、取得時においてBBB格相当以上(R&I、JCR、S&P、フィッチのいずれかでBBB-以上またはムーディーズでBaa3以上)とします。 ニ. ポートフォリオのデュレーションは、当ファンドの残存年数+0.3(年)以内とすることをめざします。</p> <p>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下 |

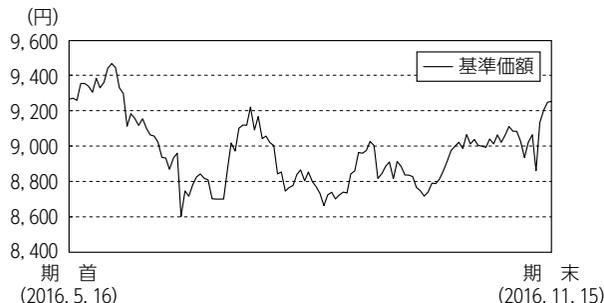
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額の推移



| 年月日 | 基準価額 | | 公社債 組入比率 | 債券先物 比率 |
|------------------|-------|-------|-------------|------------|
| | 円 | 騰落率 | | |
| (期首) 2016年5月16日 | 9,268 | — | 95.8 | — |
| 5月末 | 9,470 | 2.2 | 97.6 | — |
| 6月末 | 8,826 | △ 4.8 | 98.2 | — |
| 7月末 | 9,004 | △ 2.8 | 97.6 | — |
| 8月末 | 8,965 | △ 3.3 | 94.6 | — |
| 9月末 | 8,788 | △ 5.2 | 95.5 | — |
| 10月末 | 9,086 | △ 2.0 | 95.7 | — |
| (期末) 2016年11月15日 | 9,255 | △ 0.1 | 96.8 | — |

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。
 (注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。
 (注4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：9,268円 期末：9,255円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

主として日系企業が発行する外貨建ての社債に投資した結果、債券の利息収入はプラスに寄与しましたが、社債金利の上昇(債券価格の下落)や円高米ドル安などを反映し、基準価額は小幅に下落しました。

◆投資環境について

○海外債券市場

主要国では、英国のEU(欧州連合)離脱に対する警戒感などから、当初は国債金利が低下(債券価格は上昇)しました。その後は、欧米の景況感の改善を示す経済指標や原油価格の回復に伴うインフレ期待の上昇などを背景に、米国の年内利上げ観測やECB(欧州中央銀行)による量的金融緩和の減額への懸念が広がりました。また、米大統領選挙の結果を受けて財政拡大による景気浮揚が意識されたこともあり、国債金利は期末に向けて上昇基調となりました。

こうした環境下、米ドルなど外貨建ての社債は、金利が上昇しました。ただし、発行体信用力に目立った悪化は見られず、相対的に高い利回りを求める投資需要に支援され、スプレッド(国債に対する

の上乗せ金利)は縮小しました。

○為替相場

期の初めは、英国のEU離脱に対する警戒感から円高傾向となりました。しかし、米国の年内利上げ観測が広がったほか、米大統領選挙の結果を受け、財政拡大による景気浮揚が意識されたこともあり、米ドルは期末にかけて対円での下落幅を縮めました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後も、主として日系企業の米ドル建て債券に投資し、高利回りの金融セクターを中心に投資を行なうことにより高いポートフォリオ利回りを維持し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行なってまいります。

◆ポートフォリオについて

主として日系企業が発行する米ドル建ての債券に投資し、流動性や利回り面で投資妙味のある金融セクターを中心としたポートフォリオを維持しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

主として日系企業が発行する米ドル建て債券に投資し、金融セクターを中心としたポートフォリオを維持することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

■1万口当りの費用の明細

| 項目 | 当期 |
|-----------------|----------|
| 売買委託手数料 | —円 |
| 有価証券取引税 | — |
| その他費用 (保管費用) | 0 (0) |
| 合計 | 0 |

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
 (注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公社債

(2016年5月17日から2016年11月15日まで)

| 外国 | 買付額 | 売付額 |
|------|-------|-----|
| | | |
| アメリカ | 4,445 | — |
| 社債券 | () | () |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。
 (注2) ()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。
 (注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。
 (注4) 単位未満は四捨五入。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年5月17日から2016年11月15日まで)

| 当 期 | | 期 | |
|--|---------|-----|-----|
| 買 付 | | 売 付 | |
| 銘 柄 | 金 額 | 銘 柄 | 金 額 |
| | 千円 | | 千円 |
| Fukoku Mutual Life Insurance Co (日本) 6.5% 9999/12/31 | 128,801 | | |
| Nomura Holdings Inc (日本) 6.7% 2020/3/4 | 128,414 | | |
| Meiji Yasuda Life Insurance Co (日本) 5.2% 2045/10/20 | 122,810 | | |
| Nissan Motor Acceptance Corp (アメリカ) 2.55% 2021/3/8 | 113,136 | | |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国(外貨建) 公社債(通貨別)

| 区 分 | 額 面 金 額 | 当 期 | | 組入比率 | う ち B B 格 以 下 組 入 比 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
|------|----------|-----------|-------------|------|---------------------------|-------------------|---------|---------|
| | | 評 価 額 | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | | | |
| | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 103,701 | 110,065 | 11,874,936 | 96.8 | — | 40.2 | 49.8 | 6.8 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国(外貨建) 公社債(銘柄別)

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|------|-------------------------------------|-----|--------|----------|-----------|-------------|------------|
| | | | | | 額 | | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| アメリカ | Mizuho Bank Ltd | 社債券 | 2.4000 | 5,400 | 5,396 | 582,215 | 2020/03/26 |
| | Mizuho Bank Ltd | 社債券 | 2.7000 | 800 | 803 | 86,646 | 2020/10/20 |
| | Sumitomo Mitsui Banking Corp | 社債券 | 3.9500 | 2,000 | 2,117 | 228,498 | 2022/01/12 |
| | Sumitomo Mitsui Banking Corp | 社債券 | 2.4500 | 1,000 | 1,002 | 108,156 | 2020/01/16 |
| | Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp | 社債券 | 2.4500 | 3,992 | 4,024 | 434,159 | 2019/10/16 |
| | Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp | 社債券 | 2.6500 | 2,677 | 2,689 | 290,170 | 2020/10/19 |
| | Chiba Bank Ltd/The | 社債券 | 2.5500 | 1,500 | 1,513 | 163,331 | 2019/10/30 |
| | Suntory Holdings Ltd | 社債券 | 2.5500 | 1,500 | 1,515 | 163,539 | 2019/09/29 |
| | Toyota Motor Credit Corp | 社債券 | 4.5000 | 1,000 | 1,084 | 116,976 | 2020/06/17 |
| | Nissan Motor Acceptance Corp | 社債券 | 2.3500 | 2,500 | 2,523 | 272,228 | 2019/03/04 |
| | Nissan Motor Acceptance Corp | 社債券 | 2.1250 | 3,500 | 3,486 | 376,142 | 2020/03/03 |
| | Nissan Motor Acceptance Corp | 社債券 | 2.5500 | 1,000 | 1,006 | 108,581 | 2021/03/08 |
| | Meiji Yasuda Life Insurance Co | 社債券 | 5.2000 | 7,000 | 7,673 | 827,920 | 2045/10/20 |
| | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd | 社債券 | 1.8000 | 2,550 | 2,545 | 274,594 | 2018/03/28 |
| | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd | 社債券 | 2.9500 | 1,250 | 1,270 | 137,103 | 2018/09/14 |
| | Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd | 社債券 | 7.0000 | 5,850 | 6,910 | 745,553 | 2072/03/15 |
| | Sumitomo Life Insurance Co | 社債券 | 6.5000 | 4,500 | 5,242 | 565,613 | 2073/09/20 |
| | Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The | 社債券 | 7.2500 | 5,900 | 6,943 | 749,169 | 9999/12/31 |
| | Nippon Life Insurance Co | 社債券 | 5.0000 | 5,500 | 5,832 | 629,230 | 2042/10/18 |

外貨建てニッポン社債マザーファンド<<2020-09>>

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|-----|--------------------------------------|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|
| | | | | | 当 期 末 | | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| | Fukoku Mutual Life Insurance Co | 社債券 | 6.5000 | 3,000 | 3,494 | 376,994 | 9999/12/31 |
| | Fukoku Mutual Life Insurance Co | 社債券 | 5.0000 | 200 | 213 | 22,991 | 9999/12/31 |
| | ORIX Corp | 社債券 | 2.9500 | 4,135 | 4,183 | 451,326 | 2020/07/23 |
| | ORIX Corp | 社債券 | 2.6500 | 3,000 | 3,011 | 324,925 | 2021/04/13 |
| | SoftBank Corp | 社債券 | 4.5000 | 4,000 | 4,051 | 437,088 | 2020/04/15 |
| | Sompo Japan Insurance Inc | 社債券 | 5.3250 | 5,200 | 5,713 | 616,429 | 2073/03/28 |
| | AMERICAN HONDA FINANCE | 社債券 | 2.2500 | 2,111 | 2,142 | 231,128 | 2019/08/15 |
| | Sumitomo Mitsui Banking Corp | 社債券 | 2.5000 | 3,398 | 3,435 | 370,686 | 2018/07/19 |
| | Sumitomo Mitsui Banking Corp | 社債券 | 2.4500 | 1,500 | 1,512 | 163,162 | 2019/01/10 |
| | Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd/The | 社債券 | 2.8500 | 2,000 | 2,015 | 217,463 | 2021/09/08 |
| | Nomura Holdings Inc | 社債券 | 6.7000 | 6,649 | 7,514 | 810,768 | 2020/03/04 |
| | Mitsubishi UFJ Lease&Finance Co Ltd | 社債券 | 2.5000 | 3,500 | 3,494 | 377,029 | 2020/03/09 |
| | Mitsubishi UFJ Lease&Finance Co Ltd | 社債券 | 2.7500 | 3,618 | 3,688 | 397,926 | 2020/10/21 |
| | Mitsubishi Corp | 社債券 | 2.8750 | 471 | 480 | 51,820 | 2018/07/18 |
| | Mitsubishi Corp | 社債券 | 3.3750 | 1,500 | 1,532 | 165,363 | 2024/07/23 |
| 合 計 | 銘柄数 | 34銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | 103,701 | 110,065 | 11,874,936 | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 11,874,936 千円 | 96.8 % |
| コール・ローン等、その他 | 396,139 | 3.2 |
| 投資信託財産総額 | 12,271,076 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝107.89円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(12,226,842千円)の投資信託財産総額(12,271,076千円)に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月15日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------|-----------------|
| (A) 資産 | 12,271,076,088円 |
| コール・ローン等 | 314,752,602 |
| 公社債（評価額） | 11,874,936,970 |
| 未収利息 | 81,386,516 |
| (B) 負債 | — |
| (C) 純資産総額（A－B） | 12,271,076,088 |
| 元本 | 13,258,654,024 |
| 次期繰越損益金 | △ 987,577,936 |
| (D) 受益権総口数 | 13,258,654,024口 |
| 1万口当り基準価額（C/D） | 9,255円 |

* 期首における元本額は13,097,921,146円、当期中における追加設定元本額は723,787,828円、同解約元本額は563,054,950円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、東京TYFG・外貨建てニッポン社債ファンド201510 7,064,937,032円、東京TYFG・外貨建てニッポン社債ファンド201604 6,193,716,992円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,255円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は987,577,936円です。

■損益の状況

当期 自2016年5月17日 至2016年11月15日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| (A) 配当等収益 | 233,497,156円 |
| 受取利息 | 233,546,148 |
| 支払利息 | △ 48,992 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 240,245,945 |
| 売買益 | 5,694,320 |
| 売買損 | △ 245,940,265 |
| (C) その他費用 | △ 556,720 |
| (D) 当期損益金（A＋B＋C） | △ 7,305,509 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 959,139,549 |
| (F) 解約差損益金 | 56,854,950 |
| (G) 追加信託差損益金 | △ 77,987,828 |
| (H) 合計（D＋E＋F＋G） | △ 987,577,936 |
| 次期繰越損益金（H） | △ 987,577,936 |

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。