

■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／内外／資産複合	
信託期間	2016年4月8日から2020年2月19日まで	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。	
主要運用対象	ベビーファンド	ドイチェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)を主要投資対象とします。
組入制限	ベビーファンド	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	マザーファンド	①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②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	<p>毎決算時(原則として毎年4月12日及び10月12日。ただし、当該日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準及び市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>③留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>	

ドイチェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・ファンド 2016-04 (為替ヘッジあり／限定追加型) (愛称:ザ・大企業16-04)

償還運用報告書(全体版)

信託終了日 2020年2月19日

■投資者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「ドイチェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・ファンド 2016-04 (為替ヘッジあり／限定追加型) (愛称:ザ・大企業16-04)」は、2020年2月19日をもちまして満期償還を迎えました。ここに謹んで運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

長い間ご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
東京都千代田区永田町2-11-1 山王パークタワー

〈お問い合わせ先〉

電話番号: 03-5156-5108

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時

<https://funds.dws.com/jp/>

*お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落		債組入比率	純資産額
		税金 分	配 分		
	円 銭		金	%	百万円
4期(2018年4月12日)	10,514		30	0.1	97.3
5期(2018年10月12日)	10,444		30	△0.4	96.9
6期(2019年4月12日)	10,417		30	0.0	96.9
7期(2019年10月15日)	10,347		30	△0.4	93.8
(償還時)	(償還価額)				
8期(2020年2月19日)	10,294.99		—	△0.5	—

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは、ドイチェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・マザーファンドへの投資を通じて、主に世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行うことを基本としております。そのため、ファンドの収益率を測る適切なインデックスが存在せず、ベンチマーク及び参考指数を設けておりません。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率は実質比率を記載しております。

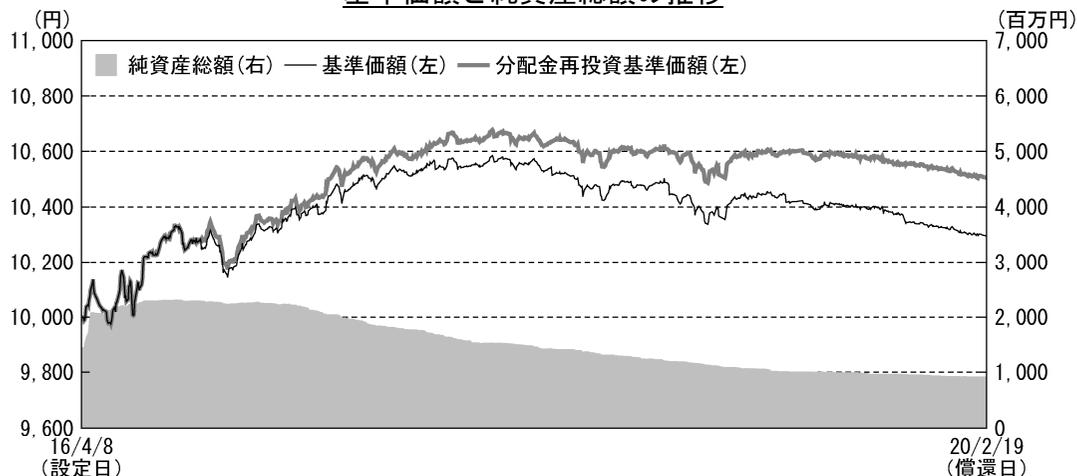
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額	騰落率		債組入比率
		騰	落	
(期首)	円 銭		%	%
2019年10月15日	10,347		—	93.8
10月末	10,341		△0.1	94.7
11月末	10,330		△0.2	97.4
12月末	10,320		△0.3	95.3
2020年1月末	10,303		△0.4	85.0
(償還時)	(償還価額)			
2020年2月19日	10,294.99		△0.5	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率は実質比率を記載しております。

基準価額と純資産総額の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(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、ファンド運用の本質的なパフォーマンスを示すものです。ただし、設定以来の分配金が0円のファンドにつきましては基準価額と重なって表示されております。

(注2) 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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

◆基準価額

当ファンドの基準価額は設定時の10,000円から償還時は10,294円99銭となり、分配金込みでは設定時比5.0%上昇しました。当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行いました。主要中央銀行の緩和的な政策姿勢等を背景に、高利回り債券への旺盛な需要を受けて、ハイブリッド証券市場全体は上昇基調となりました。世界的にリスク選好の回復基調が続き、主要国株式市場が堅調に推移したことなども、ハイブリッド証券市場の上昇に寄与しました。

◆投資環境

主要な指標となる米国やドイツの10年国債利回り(長期金利*)は低下しました(価格は上昇)。各国中央銀行が緩和的な政策姿勢を維持する中、利回り狙いの資金流入等を背景に、長期金利は低下しました。世界景気に対する不透明感の強まりや、米中貿易交渉の難航、新型肺炎の感染拡大等を背景にリスク回避的な動きが顕著となった局面でも、安全資産としての国債需要から金利は低下傾向となりました。

コーポレート・ハイブリッド証券市場では、主要中央銀行による低金利環境の継続を背景に、相対的に高い利回りに対する旺盛な資金需要等を受けて、上昇基調となりました。

◆運用状況

(当ファンド)

当ファンドでは当初の運用方針通り、マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

(ドイチェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・マザーファンド)

当ファンドでは当初の運用方針通り、主に世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

ポートフォリオについては、期を通して通貨別ではユーロの配分を多めとし、国別では、欧州主要国やアメリカ等への配分を高めとしました。

◆収益分配金

基準価額水準等を勘案して、各期とも30円(税引前)といたしました。なお、留保された収益金につきましては、当ファンドの運用の基本方針に基づき運用させていただきました。

当ファンドをご愛顧いただきましたことをここに厚く御礼申し上げます。

*金利：債券価格は金利変動の影響を受けます。一般的に金利が低下した場合には債券価格は上昇し、逆に金利が上昇した場合には債券価格は下落する傾向があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年10月16日～2020年2月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 50	% 0.489	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(26)	(0.248)	委託した資金の運用等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(24)	(0.229)	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)	(0.011)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	4	0.039	(b) 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)	(0.007)	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 ・ 印 刷 費 用 等 ）	(4)	(0.032)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用や運用報告書の作成に 係る費用等
合 計	54	0.528	
期中の平均基準価額は、10,323円です。			

(注1) 期中において発生した費用(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。なお、その他費用は、当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、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

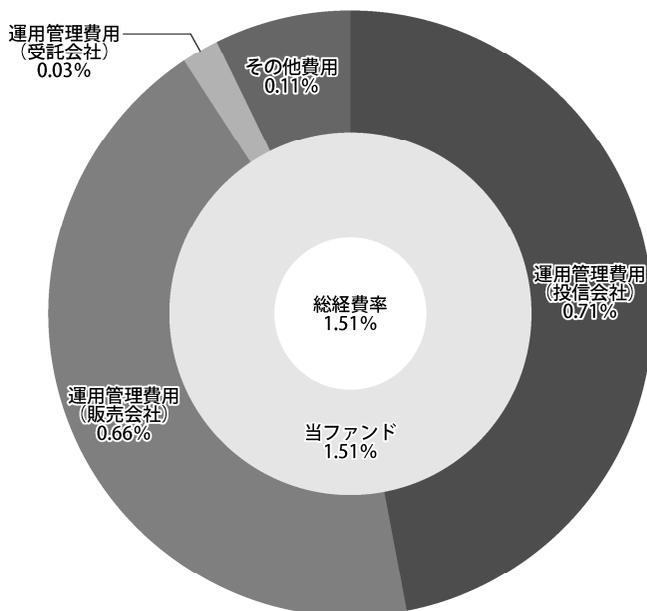
(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 監査費用・印刷費用等にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

(参考情報)

○総経費率

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口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.51%です。



(注1) 当ファンドの費用は1万口当た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す。

(注2) 各費用は、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。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注5) 上記の前提条件で算出したものです。このため、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。

○売買及び取引の状況

(2019年10月16日～2020年2月19日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ドイツ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・マザーファンド	千口 8,825	千円 9,716	千口 908,513	千円 1,000,320

(注)単位未満は切捨て。

○マザーファンドにおける主要な売買銘柄

(2019年10月16日～2020年2月19日)

●ドイツ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・マザーファンド

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
BTF 0 02/12/20(ユーロ・フランス)	168,474	BTF 0 02/12/20(ユーロ・フランス)	166,196
SRGIM 3.5% 02/13/20(ユーロ・イタリア)	156,952	SRGIM 3.5% 02/13/20(ユーロ・イタリア)	154,338
BUBILL 0 02/12/20(ユーロ・ドイツ)	156,455	BUBILL 0 02/12/20(ユーロ・ドイツ)	154,325
EXPNLN 4.75% 02/04/20(ユーロ・その他)	144,725	MCK 0 02/12/20(ユーロ・その他)	118,711
OMVAV 4.375% 02/10/20(ユーロ・オーストリア)	132,749	AMXLM FRN 09/06/73(イギリス)	117,301
MCK 0 02/12/20(ユーロ・その他)	120,316	TELIAS 4.25% 02/18/20(ユーロ・その他)	83,168
VW 2% 01/14/20(ユーロ・オランダ)	96,756	BAYNGR FRN 07/01/75(ユーロ・ドイツ)	71,236
ENIIM 4.25% 02/03/20(ユーロ・イタリア)	48,646	VLVY FRN 06/10/75(ユーロ・その他)	24,053
		TELEFO FRN PERPETUAL(イギリス)	14,945
		ENELIM FRN 01/15/75(ユーロ・イタリア)	12,317

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2019年10月16日～2020年2月19日)

利害関係人との取引状況

<ドイツェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・ファンド 2016-04 (為替ヘッジあり/限定追加型)>

該当事項はございません。

<ドイツェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 1,025	百万円 169	% 16.5	百万円 941	百万円 -	% -

平均保有割合 53.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、DEUTSCHE BANK AG、ドイツ証券です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況 (2019年10月16日～2020年2月19日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年10月16日～2020年2月19日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年2月19日現在)

2020年2月19日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
ドイツェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・マザーファンド			千口 899,688

(注)単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年2月19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 926,547	% 100.0
投資信託財産総額	926,547	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2020年2月19日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	926,547,728
コール・ローン等	926,547,728
(B) 負債	4,845,245
未払信託報酬	4,615,418
未払利息	2,538
その他未払費用	227,289
(C) 純資産総額(A-B)	921,702,483
元本	895,292,165
償還差益金	26,410,318
(D) 受益権総口数	895,292,165口
1万口当たり償還価額(C/D)	10,294円99銭

<注記事項>

期首元本額	927,900,517円
期中追加設定元本額	579,980円
期中一部解約元本額	33,188,332円

○損益の状況 (2019年10月16日～2020年2月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,538
支払利息	△ 2,538
(B) 有価証券売買損益	46,658
売買益	27,634,877
売買損	△27,588,219
(C) 信託報酬等	△ 4,842,707
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,798,587
(E) 前期繰越損益金	29,995,662
(F) 追加信託差損益金	1,213,243
(配当等相当額)	(1,193,588)
(売買損益相当額)	(19,655)
償還差益金(D+E+F)	26,410,318

(注1) (A) 配当等収益—支払利息にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

(注2) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注3) (C) 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います。

(注4) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○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4月8日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2020年2月19日		資産総額	926,547,728円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	4,845,245円
受益権口数	1,459,955,582口	895,292,165口	△564,663,417口	純資産総額	921,702,483円
元本額	1,459,955,582円	895,292,165円	△564,663,417円	受益権口数	895,292,165口
				1万円当たり償還金	10,294円99銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	2,235,424,681円	2,291,519,575円	10,251円	30円	0.3%
第2期	2,030,248,026	2,106,213,793	10,374	30	0.3
第3期	1,606,010,793	1,691,933,294	10,535	30	0.3
第4期	1,358,715,359	1,428,565,916	10,514	30	0.3
第5期	1,139,992,103	1,190,569,774	10,444	30	0.3
第6期	970,309,199	1,010,784,104	10,417	30	0.3
第7期	927,900,517	960,124,561	10,347	30	0.3

○償還金のお知らせ

1万円当たり償還金（税込み）	10,294円99銭
----------------	------------

償還時の個別元本超過額については、原則として20.315%（所得税及び復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）の税率で源泉徴収されます。（法人受益者の場合は税制が異なります。）

<お知らせ>

- ・該当事項はございません。

ドイツ・グローバル・コーポレート・ ハイブリッド・ボンド・マザーファンド

運用報告書

《満期償還》

償還日：2020年2月18日

(計算期間：2019年10月16日～2020年2月18日)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)を主要投資対象とします。
組入制限	①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○設定以来の運用実績

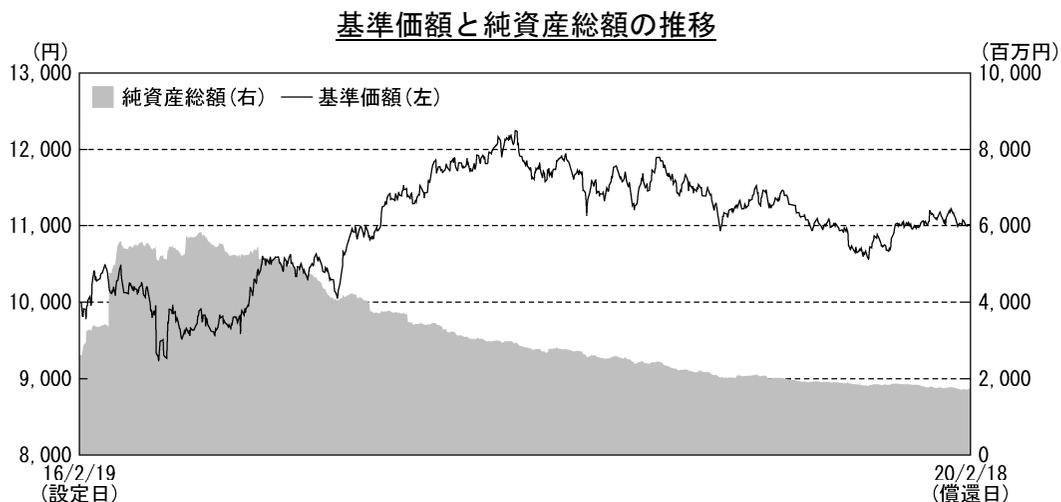
決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率		
(設定日)	円 銭		%		百万円
2016年2月19日	10,000		—	—	2,615
1期(2016年10月12日)	9,713	△	2.9	96.2	5,451
2期(2017年10月12日)	11,812		21.6	92.5	3,281
3期(2018年10月12日)	11,680	△	1.1	96.6	2,314
4期(2019年10月15日)	10,896	△	6.7	91.9	1,870
(償還時)	(償還価額)				
5期(2020年2月18日)	11,014.13		1.1	—	1,729

(注)当ファンドは、主に世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本としております。そのため、ファンドの収益率を測る適切なインデックスが存在せず、ベンチマーク及び参考指数を設けておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	券 率
		騰 落	率		
(期 首)	円 銭		%		%
2019年10月15日	10,896		—		91.9
10月末	11,065		1.6		92.5
11月末	11,041		1.3		96.6
12月末	11,189		2.7		93.4
2020年1月末	11,031		1.2		85.3
(償還時)	(償還価額)				
2020年2月18日	11,014.13		1.1		—

(注)騰落率は期首比です。



◆基準価額

当ファンドの基準価額は設定時の10,000円から償還時は11,014円13銭となり、設定時比10.1%上昇しました。

当ファンドは、主に世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行いました。主要中央銀行の緩和的な政策姿勢等を背景に、高利回り債券への旺盛な需要を受けて、ハイブリッド証券市場全体は上昇基調が継続しました。主要国株式市場が堅調に推移し、世界的にリスク選好の回復基調が続いたことなども、基準価額の上昇要因となりました。2018年に強まった主要中央銀行の金融正常化観測や、混迷の続いた米中貿易摩擦問題等は市場の下落要因となり、基準価額にはマイナスに影響しました。また、ユーロが対円で下落したことなども、基準価額の下落要因となりました。

◆投資環境

主要な指標となる米国やドイツの10年国債利回り(長期金利*)は低下しました(価格は上昇)。各国中央銀行が緩和的な政策姿勢を維持する中、利回り狙いの資金流入等を背景に、長期金利は低下しました。世界景気に対する不透明感の強まりや、米中貿易交渉の難航、新型肺炎の感染拡大等を背景にリスク回避的な動きが顕著となった局面でも、安全資産としての国債需要から金利は低下傾向となりました。

コーポレート・ハイブリッド証券市場では、主要中央銀行による低金利環境の継続を背景に、相対的に高い利回りに対する旺盛な資金需要等を受けて、上昇基調となりました。

為替市場では、欧州中央銀行(ECB)による強力な金融緩和策の維持や、米中貿易交渉の継続、英国の欧州連合(EU)離脱動向の難航に加えて、世界景気の不透明感の強まり等が材料となり、ユーロに対して円買いが優勢となったことから、ユーロは対円で下落しました。

◆運用状況

当ファンドでは当初の運用方針通り、主に世界各国の企業が発行するハイブリッド証券(劣後債及び優先証券等)に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行いました。

ポートフォリオについては、期を通して通貨別ではユーロの配分を多めとし、国別では、欧州主要国やアメリカ等への配分を高めとしました。

*金利：債券価格は金利変動の影響を受けます。一般的に金利が低下した場合には債券価格は上昇し、逆に金利が上昇した場合には債券価格は下落する傾向があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年10月16日～2020年 2月18日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	円 3 (3) (0)	% 0.027 (0.027) (0.000)	(a)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 証券投資信託管理事務等に係る費用
合 計	3	0.027	
期中の平均基準価額は、11,081円です。			

(注1) 期中において発生した費用(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。

(a) その他費用は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当た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。

(注4) (a) その他費用(その他)にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

○ 売買及び取引の状況

(2019年10月16日～2020年 2月18日)

公社債

		買 付 額	売 付 額	
外 国	アメリカ	社債券 千米ドル —	千米ドル — (3,400)	
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券	1,300	1,300
		社債券	—	590
	イタリア	社債券	1,708	1,400 (3,700)
		フランス	国債証券	1,400
	フランス	社債券	—	203 (2,040)
		オランダ	社債券	802
	ベルギー	社債券	—	— (400)
	オーストリア	社債券	1,103	— (1,100)
	アイルランド	社債券	—	— (1,000)
	その他	社債券	2,203	1,903 (1,500)
	イギリス	社債券	千英ポンド —	千英ポンド 925 (600)

(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。

(注3) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

○主要な売買銘柄

(2019年10月16日～2020年2月18日)

公社債

買		付		売		付	
銘柄	金額	銘柄	金額	銘柄	金額	銘柄	金額
BTF 0 02/12/20(ユーロ・フランス)	168,474	BTF 0 02/12/20(ユーロ・フランス)	166,532	SRGIM 3.5% 02/13/20(ユーロ・イタリア)	156,952	SRGIM 3.5% 02/13/20(ユーロ・イタリア)	154,650
BUBILL 0 02/12/20(ユーロ・ドイツ)	156,455	BUBILL 0 02/12/20(ユーロ・ドイツ)	154,637	EXPNLN 4.75% 02/04/20(ユーロ・その他)	144,725	MCK 0 02/12/20(ユーロ・その他)	118,951
OMVAV 4.375% 02/10/20(ユーロ・オーストリア)	132,749	AMXLM FRN 09/06/73(イギリス)	117,219	MCK 0 02/12/20(ユーロ・その他)	120,316	TELIAS 4.25% 02/18/20(ユーロ・その他)	83,336
VW 2% 01/14/20(ユーロ・オランダ)	96,756	BAYNGR FRN 07/01/75(ユーロ・ドイツ)	71,236	ENIIM 4.25% 02/03/20(ユーロ・イタリア)	48,646	VLVY FRN 06/10/75(ユーロ・その他)	24,101
		TELEFO FRN PERPETUAL(イギリス)	14,934			ENELIM FRN 01/15/75(ユーロ・イタリア)	12,317

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2019年10月16日～2020年2月18日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
		百万円	%		百万円	%
公社債	百万円 1,025	百万円 169	% 16.5	百万円 942	百万円 -	% -

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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、DEUTSCHE BANK AG、ドイツ証券です。

○組入資産の明細

(2020年2月18日現在)

2020年2月18日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2020年2月18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	1,729,560	100.0
投資信託財産総額	1,729,560	100.0

(注)評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2020年2月18日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	1,729,560,408
コール・ローン等	1,729,560,408
(B) 負債	4,738
未払利息	4,738
(C) 純資産総額(A-B)	1,729,555,670
元本	1,570,306,572
償還差益金	159,249,098
(D) 受益権総口数	1,570,306,572口
1万口当たり償還価額(C/D)	11,014円13銭

<注記事項>

- ①期首元本額 1,716,562,974円
 期中追加設定元本額 16,350,174円
 期中一部解約元本額 162,606,576円
- ②当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額
 ドイチェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・
 ファンド 2016-02 (為替ヘッジあり/限定追加型) 729,070,865円
 ドイチェ・グローバル・コーポレート・ハイブリッド・ボンド・
 ファンド 2016-04 (為替ヘッジあり/限定追加型) 841,235,707円

○損益の状況 (2019年10月16日～2020年2月18日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	20,029,459
受取利息	20,056,444
支払利息	△ 26,985
(B) 有価証券売買損益	122,385
売買益	16,840,335
売買損	△ 16,717,950
(C) 保管費用等	△ 473,225
(D) 当期損益金(A+B+C)	19,678,619
(E) 前期繰越損益金	153,749,694
(F) 追加信託差損益金	1,653,166
(G) 解約差損益金	△ 15,832,381
償還差益金(D+E+F+G)	159,249,098

(注1) (A) 配当等収益 - 支払利息にはマイナス金利に係る費用等を含みます。

(注2) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<お知らせ>

・該当事項はございません。