

◎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 | 2011年6月28日～2015年11月10日 (当初、2021年6月21日) | |
| 運用方針 | 当ファンド(「ベビーファンド」)は、HSBC 中国人民元マザーファンド(「マザーファンド」) 受益証券への投資を通じて、人民元建債券等で運用する投資信託証券をはじめ複数の投資信託証券に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指します。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | マザーファンド | 米ドル建てのケイマン籍外国投資信託「HSBC グローバル・インベストメント・トラスト- HSBC RMBボンド・ファンド- クラスI USD」(「HSBC RMBボンド・ファンド」) に投資し、また、ETF (上場投資信託) にも投資します。 |
| 組入制限 | ベビーファンド | 投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。投資信託証券(マザーファンドを含みます。)および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。また、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 | 投資信託証券への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 年1回の決算時(毎年6月20日、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、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額水準・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等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 | |

償還金のお知らせ

| | |
|-------------------|------------|
| 1万口当たり 償還金(税込) | 14,923円42銭 |
|-------------------|------------|

◇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。

(個人の受益者に対する課税)

※償還金が個別元本を上回る場合、上回る部分に20.315%(所得税及び復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%)の税率が適用されます。

HSBC 中国人民元ファンド

償還運用報告書(全体版)

(償還日 2015年11月10日)

◎受益者の皆さまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、「HSBC 中国人民元ファンド」は、信託約款の規定に基づき、2015年11月10日をもちまして信託を終了し、繰上償還いたしました。

ここに運用経過と償還内容をご報告いたしますとともに、これまでのご愛顧に対し厚くお礼申し上げます。

HSBC投信株式会社

東京都中央区日本橋3-11-1 HSBCビルディング
お問い合わせ先(クライアントサービス本部)
電話番号: 03-3548-5690(営業日の午前9時～午後5時)
ホームページ: www.assetmanagement.hsbc.com/jp



◎設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 (分 配 落) | 税 込 配 金 | 期 騰 落 中 率 | 投資信託証券 組入比率 | 純 資 産 額 |
|------------------------------|---------------------|---------|-----------|----------------|---------|
| | | | | | |
| (設 定 日) 2011年6月28日 | 10,000 | — | — | — | 470 |
| 第1期 (2012年6月20日) | 9,756 | 0 | △ 2.4 | 96.8 | 412 |
| 第2期 (2013年6月20日) | 12,536 | 300 | 31.6 | 97.2 | 334 |
| 第3期 (2014年6月20日) | 12,947 | 300 | 5.7 | 97.0 | 243 |
| 第4期 (2015年6月22日) | 15,615 | 300 | 22.9 | 97.7 | 187 |
| (償 還 時) 第5期 (2015年11月10日) | (償還価額) 14,923.42 | — | △ 4.4 | — | 118 |

(注1) 基準価額の期中騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは、特定のベンチマークを設定し運用を行うものではありません。したがって、ベンチマークを設けておりません。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は、実質比率を記載しております。

(注4) 設定日の基準価額は1万円当たりの当初設定元本、設定日の純資産総額は当初設定元本です。

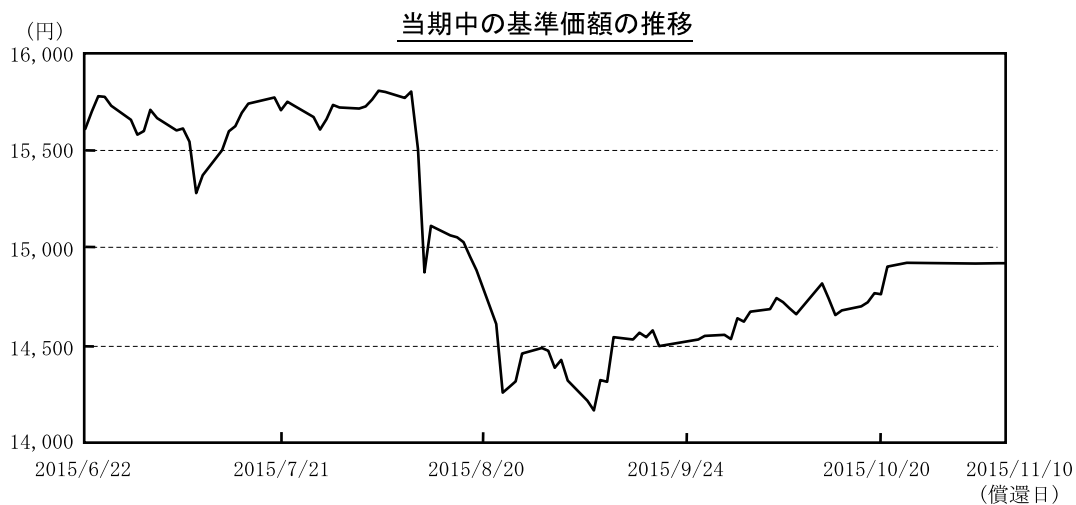
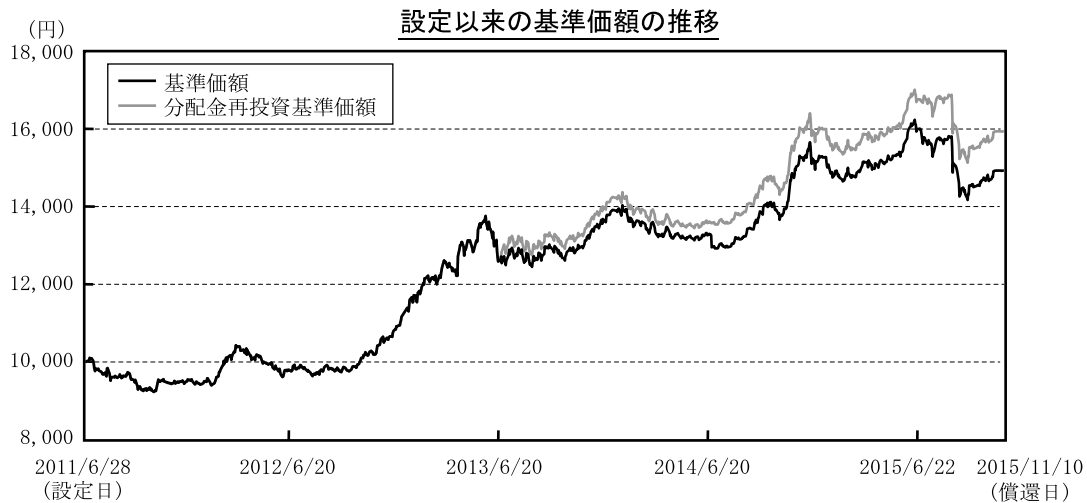
◎当期中の基準価額等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | 投資信託証券 組入比率 |
|------------------------|---------------------|-------|----------------|
| | | | |
| (期 首) 2015年 6月22日 | 15,615 | — | 97.7 |
| 6月末 | 15,586 | △0.2 | 96.6 |
| 7月末 | 15,726 | 0.7 | 96.7 |
| 8月末 | 14,487 | △7.2 | 96.2 |
| 9月末 | 14,640 | △6.2 | 96.3 |
| 10月末 | 14,924 | △4.4 | — |
| (償 還 時) 2015年11月10日 | (償還価額) 14,923.42 | △4.4 | — |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は、実質比率を記載しております。

◎投資環境と運用状況



1. 基準価額等の推移について（当期）

<基準価額の動き>

基準価額は、期首（2015年6月22日）の15,615円から償還時（2015年11月10日）は14,923円42銭となり、分配金再投資ベースの基準価額は期首に比べ、4.4%の下落となりました。

2. 基準価額の主な変動要因（当期）

<下落要因>

- ・ オフショア人民元の対円での下落。
- ・ オフショア人民元債券の利回り上昇（債券価格の下落）。

3. 投資環境について

【債券・為替市況】

<第1期>

オフショア人民元債券市場は、米国の大手格付会社S & Pによる米国債の格付引き下げや欧州債務危機を巡る不透明感などの悪材料及び中国人民銀行（中央銀行）による預金準備率の引き下げなどの好材料が拮抗し、期を通じてほぼ横ばいの動きとなりました。為替市場では、米国債の格下げや欧州債務問題から円が堅調となり、オフショア人民元は対円で小幅下落しました。

<第2期>

中央銀行が追加利下げを行ったことや米連邦準備制度理事会（FRB）が量的緩和を実施したことなどを受け、オフショア人民元債券市場は堅調な推移となりました。また、為替市場では、日本銀行が大幅な金融緩和策を打ち出したことから円安が進み、オフショア人民元は対円で大幅上昇となりました。

<第3期>

上海での自由貿易試験区の設定、人民元の兌換（だかん）性の向上、中国の金利自由化に進展があり、また一段の金利自由化への期待も加わり、オフショア人民元債券市場は堅調な推移となりました。また、為替市場では、米国が量的緩和の規模の縮小を表明したことから米ドル高が進み、米ドルに連動する形でオフショア人民元は対円で底堅い動きとなりました。

<第4期>

中国の景気減速を背景に、中央銀行は政策金利の引き下げや預金準備率の引下げなどを実施しました。オフショア人民元債券市場はこれらを好感し、堅調な展開となりました。為替市場では、米ドル高が進んだことからオフショア人民元は米ドルに連動する形で対円で大幅高となりました。

<第5期>

中央銀行は、人民元の対米ドル基準値の算出方法を変更し人民元を切り下げました。これを受け、市場では人民元の先行きに対する不透明感や中国景気に対する懸念が広がり、オフショア人民元債券市場は軟調となりました。また為替市場ではオフショア人民元は対円で下落しました。

4. ポートフォリオについて

<HSBC 中国人民元ファンド> (当ファンド)

第1期から第5期の間、「HSBC 中国人民元マザーファンド」への投資を通じて、主に中国本土以外の市場で発行される人民元建ての債券に投資しました。

<HSBC 中国人民元マザーファンド>

第1期から第4期の2015年3月までの間、米ドル建てのケイマン籍外国投資信託「HSBCグローバル・インベストメント・トラスト-HSBC RMBボンド・ファンド-クラスI USD」（以下、「HSBC RMBボンド・ファンド」）への投資比率を高位に維持しました。また投資資金の一部を国内外の公社債を主要投資対象とするわが国の証券投資信託「HSBCマネープールファンド（適格機関投資家専用）」に投資し、キャッシュ比率は2～6%程度としました。

2015年3月から第5期の2015年10月までは「HSBC RMBボンド・ファンド」への投資比率を高位に維持するとともに、「HSBCマネープールファンド（適格機関投資家専用）」に替えてオフショア人民元建債券の上場投資信託（ETF）への少額の投資を行いました。2015年10月には、11月の当ファンドの償還に向けてこれら投資対象ファンドを売却し、キャッシュによる安定運用に切り替えました。

「HSBC RMBボンド・ファンド」への期間中、同ファンドにおいては、高い信用力を持ち、割安で、残存期間が比較的短いオフショア人民元建銘柄を中心とした組入れを行いました。

5. ベンチマークとの差異について

当ファンドは、特定のベンチマークを設定し運用を行うものではありません。このためベンチマークはありません。

◎1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第5期 | | 項目の概要 |
|-------------|----------------------|---------|--|
| | 2015/6/23～2015/11/10 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 65円 | 0.429% | (a) 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15,072円です。 |
| （投信会社） | (31) | (0.208) | ファンドの運用等の対価 |
| （販売会社） | (31) | (0.208) | 分配金・換金代金の支払い、運用報告書等の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| （受託会社） | (2) | (0.012) | 運用財産の管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.003 | (b) 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 |
| （投資信託証券） | (0) | (0.003) | 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 |
| (c) その他費用 | 12 | 0.080 | (c) 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) | (0.002) | 海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡費用 |
| （監査費用） | (3) | (0.018) | 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （その他） | (9) | (0.060) | 振替制度に係る費用、印刷業者に支払う法定書類に係る費用等 |
| 合計 | 77 | 0.512 | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加設定・一部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、売買委託手数料およびその他費用は、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まず。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各項目の費用は、マザーファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(注4) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注5) 「投信会社」は、以下、「委託者」、「委託会社」という場合があります。

◎親投資信託受益証券の設定、解約状況（2015年6月23日から2015年11月10日まで）

| | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------|-------------|-------------|---------------|---------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| HSBC 中国人民元マザーファンド | 千口 2,825 | 千円 4,816 | 千口 114,530 | 千円 189,227 |

(注) 単位未満は切捨て。

◎利害関係人との取引状況（2015年6月23日から2015年11月10日まで）

当期における利害関係人との取引はありません。

*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をいいます。

◎組入資産の明細

信託終了日における有価証券の組み入れはありません。

以下は前期末（2015年6月22日）の状況です。

親投資信託残高

| 種 類 | 当 期 首（前 期 末） | |
|--------------------|---------------|---------------|
| | 口 数 | 評 価 額 |
| H S B C 中国元マザーファンド | 千口 111,704 | 千円 192,801 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

◎投資信託財産の構成

2015年11月10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 129,385 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 129,385 | 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

2015年11月10日現在

| 項 目 | 償 還 時 |
|-----------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 129,385,723円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 129,385,688 |
| 未 取 利 息 | 35 |
| (B) 負 債 | 10,446,876 |
| 未 払 解 約 金 | 9,603,508 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 714,883 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 128,485 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 118,938,847 |
| 元 本 | 79,699,473 |
| 償 還 差 益 金 | 39,239,374 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 79,699,473口 |
| 1万口当たり償還価額 (C / D) | 14,923円42銭 |

◎損益の状況

自2015年6月23日 至2015年11月10日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 35円 |
| 受 取 利 息 | 35 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △4,860,377 |
| 売 買 益 | 2,666,796 |
| 売 買 損 | △7,527,173 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 843,368 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △5,703,710 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 29,426,856 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 15,516,228 |
| (配 当 等 相 当 額) | (8,508,297) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (7,007,931) |
| 償 還 差 益 金 (D + E + F) | 39,239,374 |

<注記事項（当運用報告書作成時点では監査未了です。）>

(注1) 当ファンドの期首元本額は120,290,344円、期中追加設定元本額は3,133,922円、期中一部解約元本額は43,724,793円です。

(注2) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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おります。

(注4) 損益の状況の中で(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 | 2011年 6月28日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
| | 投資信託契約終了日 | 2015年11月10日 | | 資産総額 | 129,385,723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 | 10,446,876円 |
| | | | | 純資産総額 | 118,938,847円 |
| 受益権口数 | 470,822,700口 | 79,699,473口 | △391,123,227口 | 受益権口数 | 79,699,473口 |
| 元本額 | 470,822,700円 | 79,699,473円 | △391,123,227円 | 1万円当たり償還金 | 14,923.42円 |
| 毎計算期末の状況 | | | | | |
| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1万円当たり分配金 | |
| | | | | 金額 | 分配率 |
| 第1期 | 422,611,693円 | 412,304,031円 | 9,756円 | 0円 | 0.0000% |
| 第2期 | 266,575,761 | 334,185,741 | 12,536 | 300 | 3.0000 |
| 第3期 | 188,016,360 | 243,433,134 | 12,947 | 300 | 3.0000 |
| 第4期 | 120,290,344 | 187,827,505 | 15,615 | 300 | 3.0000 |

◆親投資信託「HSBC 中国人民元マザーファンド」の運用状況
償還日（2015年11月9日）
第5期（2015年6月23日～2015年11月9日）

◎設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | 騰 落 中 率 | | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|----------------------------|---------------------|---------|--------|------------------------|------------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (設 定 日) 2011年6月28日 | 円 10,000 | | % — | % — | 百万円 470 |
| 第1期（2012年6月20日） | 9,821 | △ | 1.8 | 96.2 | 414 |
| 第2期（2013年6月20日） | 13,039 | | 32.8 | 94.3 | 344 |
| 第3期（2014年6月20日） | 13,920 | | 6.8 | 94.1 | 250 |
| 第4期（2015年6月22日） | 17,260 | | 24.0 | 95.2 | 192 |
| (償 還 時) 第5期（2015年11月9日） | (償還価額) 16,544.72 | | △ 4.1 | — | 120 |

(注1) 当ファンドは、特定のベンチマークを設定し運用を行うものではありません。したがって、ベンチマークを設けておりません。

(注2) 設定日の基準価額は1万円当たりの当初設定元本、設定日の純資産総額は当初設定元本です。

◎当期中の基準価額等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|-----------------------|---------------------|-------|--------|------------------------|
| | | 騰 | 落 | |
| (期 首) 2015年 6月22日 | 円 17,260 | | % — | % 95.2 |
| 6月末 | 17,234 | △ | 0.2 | 96.6 |
| 7月末 | 17,405 | | 0.8 | 96.5 |
| 8月末 | 16,051 | △ | 7.0 | 95.9 |
| 9月末 | 16,235 | △ | 5.9 | 96.0 |
| 10月末 | 16,546 | △ | 4.1 | — |
| (償 還 時) 2015年11月9日 | (償還価額) 16,544.72 | | △ 4.1 | — |

(注) 騰落率は期首比です。

◎ 1万口当たりの費用明細 (2015年6月23日から2015年11月9日まで)

| 項 目 | 金 額 | 比 率 |
|---|---------------------|-----------------------------|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) | 0円 (0) | 0.003% (0.003) |
| (b) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 2 (2) (ー) | 0.010 (0.010) (0.000) |
| 合 計 | 2 | 0.013 |

- ・1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの最終の決算期のものです。
- ・期中のマザーファンドの平均基準価額は16,694円です。
- ・各項目の費用は、マザーファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。
- ・各項目ごとに円未満は四捨五入しております。なお、費用項目の概要については、5ページをご参照ください。
- ・「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

◎ 当期中の売買及び取引の状況 (2015年6月23日から2015年11月9日まで)

投資信託証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|-----|-----|------|---------|-------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国 | 米 国 | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| | | ー | ー | 124,297 | 1,446 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

◎ 当期中の主要な売買銘柄 (2015年6月23日から2015年11月9日まで)

投資信託証券

| 当 | | | 期 | | |
|-----|-----|-----|----------------------------------|---------|---------|
| 買 付 | | 売 付 | | | |
| 銘 柄 | 口 数 | 金 額 | 銘 柄 | 口 数 | 金 額 |
| | 口 | 千円 | (米国) | 口 | 千円 |
| | | | HGIT HSBC RMB BF CLASS I USD | 122,297 | 169,293 |
| | | | POWERSHARES CHINESE YUAN DIM ETF | 2,000 | 5,703 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

◎利害関係人との取引状況（2015年6月23日から2015年11月9日まで）

当期における利害関係人との取引はありません。

*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をいいます。

◎組入資産の明細（2015年11月9日現在）

信託終了日における有価証券の組み入れはありません。

◎投資信託財産の構成

2015年11月9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 129,949 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 129,949 | 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

2015年11月9日現在

| 項 目 | 償 還 時 |
|-----------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 129,949,255円 |
| コー ル ・ ロ ー ン 等 | 129,949,220 |
| 未 収 利 息 | 35 |
| (B) 負 債 | 9,688,738 |
| 未 払 解 約 金 | 9,688,738 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 120,260,517 |
| 元 本 | 72,688,154 |
| 償 還 差 益 金 | 47,572,363 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 72,688,154口 |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 16,544円72銭 |

《注記事項》

※期首元本額 111,704,383円
 期中追加設定元本額 2,825,932円
 期中一部解約元本額 41,842,161円

※期末における元本の内訳
 H S B C 中国人民幣ファンド 72,688,154円

◎損益の状況

自2015年6月23日 至2015年11月9日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|-------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 53,630円 |
| 受 取 配 当 金 | 52,997 |
| 受 取 利 息 | 633 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 8,427,896 |
| 売 買 益 | 49,031 |
| 売 買 損 | △ 8,476,927 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 15,921 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 8,390,187 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 81,096,924 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,990,856 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △27,125,230 |
| 償還差益金(D + E + F + G) | 47,572,363 |

(注1) 損益の状況の中で(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2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には保管費用等が含まれます。

(注3) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

◎参考情報

HSBC 中国人民元マザーファンドが主として投資している（償還時には組み入れておりません。）投資信託証券に関し、投資対象とする投資信託証券の概要等を参考資料として記載しております。

投資対象とする投資信託証券の概要

| | |
|-----------|---|
| ファンド名 | HSBC グローバル・インベストメント・トラスト－HSBC RMB ボンド・ファンドークラス I USD (HSBC RMBボンド・ファンド) |
| 形態 | ケイマン籍外国投資信託（米ドル建） |
| 運用の基本方針 | 人民元建債券等を投資対象とし、人民元ベースでの中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本とします。 |
| 主な投資対象 | <ul style="list-style-type: none"> 主として中国本土以外の市場で発行される人民元建ての国債、政府機関債、国際機関債、社債、転換社債等に投資します。 人民元以外の通貨で決済される債券等に投資する場合があります。 ヘッジ目的でデリバティブ取引を行う場合があります。 人民元建ての短期金融商品（短期運用の有価証券、預金を含む）を活用する場合があります。 <p>(注) 人民元建債券市場において需給関係が著しく逼迫している場合等には、投資の全部または一部を人民元建預金で行う可能性があります。</p> |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> 原則として、同一発行体への投資割合は、純資産額の10%以内とします。ただし、政府やその他公的機関が発行体である場合には、純資産額の100%までそのような同一発行体へ投資を行うことができますが、少なくとも6銘柄以上に投資するものとし、かつ同一銘柄への投資割合は純資産額の30%以内とします。 流動性に欠ける資産に投資する場合については、価格の透明性を確保する方法がとられているものに投資します。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資は行いません。 金融派生商品（為替先渡取引や直物為替先渡取引に限定します。）の利用は、ヘッジ目的に限るものとします。 純資産額の10%を超える借入は行いません。 |
| 決算日 | 年1回（毎年7月31日） |
| 分配方針 | 分配を行わない予定です。ただし、管理会社の判断により分配を行う場合があります。 |
| マネジメントフィー | 年0.30% |
| その他費用 | 有価証券の売買に係る手数料、租税、カスタディーフィー、登録・名義書換事務代行会社報酬、監査報酬、法律顧問費用、法的書類に要する費用等 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 償還条項 | すべてのクラスの純資産額の合計が50百万米ドルを下回った場合等には、償還する場合があります。 |
| 投資顧問会社 | HSBCグローバル・アセット・マネジメント（香港）リミテッド |

※ケイマン籍外国投資信託については、日々の純流入額が前営業日のファンドの純資産額の一定割合を超える場合、ファンドの買付価格・解約価格の調整が行われることがあります。また、人民元建債券等の取引市場において海外からの投資に対し課税や課徴金などが導入される場合、ファンドの純資産価格から想定される費用を課金として控除するなどの調整を行う場合があります。

※上記の内容は償還日現在のものです。今後変更される場合があります。また、投資対象ファンドは、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

【HSBC グローバル・インベストメント・トラスト - HSBC RMBボンド・ファンド - クラス I USDの状況】

「HSBC グローバル・インベストメント・トラスト - HSBC RMBボンド・ファンド - クラス I USD」は、「HSBC 中国人民元マザーファンド」が投資対象とする投資信託受益証券です。

当該投資対象ファンドは米ドル建てのケイマン籍外国投資信託であり、2014年7月31日に会計年度を終了しております。当財務諸表は、香港の会計基準に基づき作成されており、独立の監査法人による監査は受けております。以下の参考情報は、HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limitedより入手した資料を一部抜粋・翻訳したものであり、「HSBC グローバル・インベストメント・トラスト - HSBC RMBボンド・ファンド - クラス I USD」を含めた全てのクラスを合算して表示しております。

純資産計算書 (2014年7月31日現在)

| 科目 | 金額 (人民元) |
|-----------------------------|----------------------|
| 資産 | |
| 現金および現金同等物 | 295,574,665 |
| 有価証券 | 5,023,142,462 |
| 未収利息 | 49,381,631 |
| 追加設定に係る未収入金 | 41,949,596 |
| その他未収入金 | |
| 資産計 | 5,410,048,354 |
| 負債 | |
| 解約未払金 | 92,184,534 |
| 有価証券売却に係る未払金 | 6,138,726 |
| 分配金未払金 | 49,430,804 |
| その他未払金 | 4,170,553 |
| 負債計 | 151,924,617 |
| 純資産額 | 5,258,123,737 |
| | |
| 科目 | 金額 (米ドル) |
| 2014年7月31日現在の口数 (クラス I USD) | 346,320 |
| 一口当たり純資産額 (クラス I USD) | 11.577 |

費用の内訳

2013年8月1日から2014年7月31日まで

| | 金額 (人民元) |
|----------|-------------------|
| 運用報酬 | 32,688,800 |
| 受託者報酬 | 3,792,324 |
| 監査費用 | 164,671 |
| 運用管理費用 | 5,097 |
| 管理費用 | 731,288 |
| 雑費 | 777,614 |
| 計 | 38,159,794 |

以下の有価証券明細表は、HSBC Investment Funds (Hong Kong) Limitedから入手した資料に記載の分類をそのまま採用しております。また、投資比率とはファンドの純資産額に対する当該資産の時価比率をいいます。

有価証券明細表 (2014年7月31日現在)

外国債券

| 種類 | 銘柄名/利率/償還日 | 額面金額 | 評価額 (人民元) | 投資比率 (%) | |
|---|------------|--|--------------|-------------|------|
| 債券 | 上場銘柄 | AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD 6.5% (28 FEBRUARY 2017) | 65,000,000 | 65,046,150 | 1.24 |
| | | AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 3.08% (16 JANUARY 2016) | 55,000,000 | 55,026,950 | 1.05 |
| | | AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 3.2% (22 JUNE 2015) | 28,000,000 | 28,047,320 | 0.53 |
| | | AIR LIQUIDE FRANCE 3% (19 SEPTEMBER 2016) | 66,000,000 | 66,241,560 | 1.26 |
| | | AIR LIQUIDE FINANCE 3.95% (19 SEPTEMBER 2018) | 5,150,000 | 5,257,635 | 0.10 |
| | | AMERICA MOVIL SAB DE C.V. 3.5% (8 FEBRUARY 2015) | 65,000,000 | 65,167,700 | 1.24 |
| | | ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.85% (21 OCTOBER 2020) | 55,000,000 | 53,704,750 | 1.02 |
| | | AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP 2.9% (14 AUGUST 2015) | 43,700,000 | 44,028,624 | 0.84 |
| | | AVIC INTERNATIONAL FINANCE & INVESTMENT LTD 4.8% (9 JULY 2015) | 57,000,000 | 57,429,780 | 1.09 |
| | | AVIC INTERNATIONAL FINANCE & INVESTMENT LTD 4.8% (10 APRIL 2017) | 18,760,000 | 19,059,035 | 0.36 |
| | | BANK OF CHINA/LONDON 3.45% (16 JANUARY 2017) | 32,900,000 | 32,901,645 | 0.63 |
| | | BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD 3.3% (20 MARCH 2016) | 20,000,000 | 20,006,000 | 0.38 |
| | | BANK OF EAST ASIA CHINA LTD 3.65% (11 MAY 2015) | 30,700,000 | 30,781,662 | 0.59 |
| | | BAOSTEEL GROUP CORP LTD 3.5% (01 DECEMBER 2014) | 31,000,000 | 31,053,320 | 0.59 |
| | | BAOSTEEL GROUP CORP LTD 3.675% (1 MARCH 2015) | 14,300,000 | 14,332,890 | 0.27 |
| | | BAOSTEEL GROUP CORP LTD 4.15% (1 MARCH 2017) | 1,000,000 | 1,015,360 | 0.02 |
| | | BAOSTEEL GROUP CORP LTD 4.375% (1 DECEMBER 2016) | 39,000,000 | 39,862,290 | 0.76 |
| | | BEIJING CAPITAL HONG KONG LTD 4.7% (20 JUNE 2017) | 40,830,000 | 41,005,161 | 0.78 |
| | | BESTGAIN REAL ESTATE LYRA LTD 4.05% (16 DECEMBER 2016) | 23,600,000 | 23,725,788 | 0.45 |
| | | BESTGAIN REAL ESTATE LYRA LTD 4.5% (4 DECEMBER 2018) | 40,000,000 | 40,284,800 | 0.77 |
| | | BITRONIC LTD 4% (12 DECEMBER 2015) | 28,000,000 | 28,062,440 | 0.53 |
| | | BP CAPITAL MARKETS PLC 3.65% (28 FEBRUARY 2019) | 19,000,000 | 19,298,300 | 0.37 |
| | | BP CAPITAL MARKETS PLC 3.95% (8 OCTOBER 2018) | 58,500,000 | 60,195,915 | 1.14 |
| | | BSH BOSCH UND SIEMENS HA 3.375% (28 SEPTEMBER 2016) | 10,000,000 | 10,114,200 | 0.19 |
| | | BSH BOSCH UND SIEMENS HA 3.8% (24 JULY 2017) | 10,000,000 | 10,225,600 | 0.19 |
| | | BSH BOSCH UND SIEMENS HA 4% (28 SEPTEMBER 2018) | 50,000,000 | 51,253,000 | 0.98 |
| | | CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 2.95% (3 MARCH 2016) | 11,000,000 | 11,045,210 | 0.21 |
| | | CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 3.25% (26 JUNE 2015) | 75,000,000 | 75,395,250 | 1.43 |
| | | CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT LTD 7.6% (29 NOVEMBER 2015) | 27,500,000 | 28,584,050 | 0.54 |
| | | CHINA CITIC BANK 4.125% (27 FEBRUARY 2017) | 60,000,000 | 60,804,600 | 1.16 |
| | | CHINA CITY CONSTRUCTION INTERNATIONAL 5.35% (3 JULY 2017) | 60,000,000 | 60,312,000 | 1.15 |
| | | CHINA CONSTRUCTION BANK ASIA CORP LTD 3.25% (13 MARCH 2016) | 15,000,000 | 15,003,450 | 0.29 |
| | | CHINA DATANG CORP 3.6% (25 APRIL 2016) | 65,000,000 | 64,463,750 | 1.23 |
| | | CHINA DEVELOPMENT BANK 3.1% (16 JANUARY 2015) | 10,000,000 | 10,007,400 | 0.19 |
| | | CHINA ELECTRONICS CORP HOLDINGS CO LTD 4.7% (16 JANUARY 2017) | 28,000,000 | 28,168,840 | 0.54 |
| | | CHINA GENERAL NUCLEAR 3.75% (1 NOVEMBER 2015) | 67,000,000 | 67,198,990 | 1.28 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 1.94% (18 AUGUST 2018) | 6,000,000 | 5,815,020 | 0.11 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 2.56% (29 JUNE 2017) | 10,000,000 | 10,025,200 | 0.19 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 3.09% (22 NOVEMBER 2018) | 10,000,000 | 10,091,500 | 0.19 |
| | | CHINA MERCHANTS BANK 4.1% (10 APRIL 2017) | 55,000,000 | 55,705,650 | 1.06 |
| CHINA MINMETALS CORP 3.65% (28 MARCH 2016) | 35,000,000 | 34,786,500 | 0.66 | | |
| CHINA POWER CONSTRUCTION 4.2% (15 MAY 2017) | 63,060,000 | 63,106,665 | 1.20 | | |

| 種類 | | 銘柄名/利率/償還日 | 額面金額 | 評価額 (人民元) | 投資比率 (%) |
|---|------------|--|------------|--------------|-------------|
| 債券 | 上場銘柄 | CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT LTD 4.5% (9 MAY 2017) | 30,000,000 | 30,119,700 | 0.57 |
| | | CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD 3.75% (12 NOVEMBER 2015) | 39,500,000 | 39,727,520 | 0.76 |
| | | CHINA UNICOM HONG KONG LTD 4% (16 APRIL 2017) | 80,000,000 | 80,098,400 | 1.52 |
| | | DBS BANK LTD 2.5% (7 JUNE 2016) | 40,000,000 | 39,858,675 | 0.76 |
| | | DORSETT HOSPITALITY INTERNATIONAL 6% (3 APRIL 2018) | 27,500,000 | 27,335,000 | 0.52 |
| | | EASTERN AIR OVERSEAS HONG KONG CORP LTD 4% (8 AUGUST 2014) | 56,400,000 | 56,400,157 | 1.07 |
| | | EASTERN AIR OVERSEAS HONG KONG CORP LTD 4.8% (13 MARCH 2017) | 25,000,000 | 25,181,000 | 0.48 |
| | | EASTERN CREATION II INVESTMENT HOLDINGS LTD 3.75% (27 JUNE 2017) | 45,200,000 | 45,271,868 | 0.86 |
| | | ESUN INTERNATONAL FINANCE LTD 8.375% (24 JUNE 2018) | 27,430,000 | 27,911,122 | 0.53 |
| | | EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25% (27 JULY 2015) | 65,000,000 | 65,365,300 | 1.24 |
| | | EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.625% (27 JANUARY 2019) | 34,800,000 | 34,998,360 | 0.67 |
| | | FAR EAST HORIZON LTD 4.5% (22 MARCH 2016) | 7,000,000 | 7,034,116 | 0.13 |
| | | FONTERRA COOPERATIVE GROUP 3.6% (29 JANUARY 2019) | 64,000,000 | 64,080,000 | 1.22 |
| | | GAZPROMBANK (GPB FINANCE) 4.25% (30 JANUARY 2017) | 36,300,000 | 34,065,009 | 0.65 |
| | | GEMDALE ASIA HOLDINGS LTD 5.625% (21 MARCH 2018) | 39,000,000 | 38,309,700 | 0.73 |
| | | GEMDALE INTERNATIONAL HOLDING LTD 9.15% (26 JULY 2015) | 25,000,000 | 26,124,250 | 0.50 |
| | | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD 3.375% (11 MAY 2016) | 68,000,000 | 67,983,000 | 1.29 |
| | | GREENLAND HONG KONG HOLDINGS LTD 5.5% (23 JANUARY 2018) | 49,200,000 | 48,787,704 | 0.93 |
| | | GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD 5.625% (13 MAY 2016) | 48,000,000 | 47,545,920 | 0.90 |
| | | HKCG FINANCE LTD 1.4% (11 APRIL 2016) | 65,000,000 | 63,132,550 | 1.20 |
| | | HUANENG POWER INTERNATIONAL INC 3.85% (5 FEBRUARY 2016) | 49,300,000 | 49,290,140 | 0.94 |
| | | ICBC ASIA LTD 6% (4 NOVEMBER 2021) | 20,000,000 | 20,998,800 | 0.40 |
| | | ICBC LTD 3.75% (19 NOVEMBER 2018) | 33,300,000 | 33,604,362 | 0.64 |
| | | ICICI BANK LTD 4% (25 JUNE 2016) | 32,500,000 | 32,727,500 | 0.62 |
| | | ICICI BANK LTD SINGAPORE 4.9% (21 SEPTEMBER 2015) | 28,300,000 | 28,765,818 | 0.55 |
| | | JINCHUAN GROUP CO LTD 4.75% (17 JULY 2017) | 65,000,000 | 64,556,700 | 1.23 |
| | | KAISIA GROUP HOLDINGS LTD 6.875% (22 APRIL 2016) | 46,600,000 | 47,191,820 | 0.90 |
| | | KOREA DEVELOPMENT BANK 3.3% (21 JUNE 2015) | 60,500,000 | 60,902,325 | 1.16 |
| | | LAFARGE SHUI ON CEMENT LTD 9% (14 NOVEMBER 2014) | 55,600,000 | 56,511,284 | 1.08 |
| | | LAI FUNG HOLDINGS LTD 6.875% (25 APRIL 2018) | 52,050,000 | 50,604,572 | 0.96 |
| | | LANDESKREDITBANK BADENWUERTEMBERG- FOERDERBANK 3.25% (28 SEPTEMBER 2018) | 30,000,000 | 29,962,500 | 0.57 |
| | | LONGFOR PROPERTIES CO LTD 6.75% (28 MAY 2018) | 68,000,000 | 69,464,040 | 1.32 |
| | | LOTTE SHOPPING BUSINESS MANAGEMENT HONG KONG LTD 4% (9 FEBRUARY 2015) | 61,600,000 | 61,916,008 | 1.18 |
| | | MAIKUN INVESTMENT CO LTD 4.5% (6 JUNE 2017) | 66,960,000 | 66,850,186 | 1.27 |
| | | MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE CO LTD 3.28% (27 FEBRUARY 2017) | 59,000,000 | 59,258,420 | 1.13 |
| | | MITSUI & CO LTD 4.25% (1 MARCH 2017) | 30,640,000 | 31,529,479 | 0.60 |
| | | MODERN LAND CHINA CO LTD 11% (22 JANUARY 2017) | 23,000,000 | 22,111,510 | 0.42 |
| | | NATIONAL AUSTRALIA BANK 2.4% (18 JUNE 2015) | 44,200,000 | 44,246,815 | 0.84 |
| | | NEW WORLD CHINA LAND LTD 5.5% (6 FEBRUARY 2018) | 41,000,000 | 41,905,690 | 0.80 |
| | | NEW WORLD CHINA LAND LTD 8.5% (11 APRIL 2015) | 23,000,000 | 23,770,040 | 0.45 |
| NOBLE GROUP LTD 4% (30 JANUARY 2016) | 67,000,000 | 67,495,130 | 1.28 | | |
| PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA 2.25% (13 NOVEMBER 2014) | 31,800,000 | 31,811,448 | 0.60 | | |
| RAINBOW DAYS LTD 3% (30 JUNE 2016) | 44,600,000 | 43,925,202 | 0.84 | | |
| RENAULT S. A. 5.625% (10 OCTOBER 2014) | 45,000,000 | 45,179,100 | 0.86 | | |
| RKI FINANCE (2013) LTD 6% (3 DECEMBER 2016) | 48,000,000 | 48,182,400 | 0.92 | | |
| SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK 4.08% (22 MAY 2017) | 39,200,000 | 39,566,520 | 0.75 | | |
| SHINHAN BANK 3.5% (19 SEPTEMBER 2014) | 28,000,000 | 27,999,924 | 0.53 | | |
| SHUI ON DEVELOPMENT HOLDING LTD 6.875% (26 FEBRUARY 2017) | 22,500,000 | 22,521,600 | 0.43 | | |

| 種類 | | 銘柄名/利率/償還日 | 額面金額 | 評価額 (人民元) | 投資比率 (%) |
|--|--|--|--------------------|----------------------|-------------------|
| 債券 | 上場銘柄 | SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 3.55% (13 MAY 2017) | 70,000,000 | 69,862,100 | 1.33 |
| | | SK GLOBAL CHEMICAL INVESTMENT HONG KONG LTD 4.125% (26 SEPTEMBER 2016) | 63,000,000 | 63,681,660 | 1.21 |
| | | STANDARD CHARTERED PLC 2.625% (31 MAY 2016) | 62,500,000 | 62,265,000 | 1.18 |
| | | STARWAY ASSETS ENTERPRISES INC 4.1% (22 JANUARY 2017) | 67,300,000 | 67,474,307 | 1.28 |
| | | SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 4% (3 AUGUST 2015) | 20,000,000 | 20,194,000 | 0.38 |
| | | TIMES PROPERTY HOLDINGS LTD 10.375% (16 JULY 2017) | 16,330,000 | 16,404,302 | 0.31 |
| | | TOTAL CAPITAL SA 3.75% (24 SEPTEMBER 2018) | 63,000,000 | 64,811,250 | 1.23 |
| | | UNICAN LTD 5.8% (30 MAY 2017) | 30,000,000 | 30,403,800 | 0.58 |
| | | UNILEVER NV 2.95% (27 FEBRUARY 2017) | 6,000,000 | 6,046,860 | 0.12 |
| | | UNITED OVERSEAS BANK LTD 2.5% (24 JUNE 2016) | 59,500,000 | 59,376,835 | 1.13 |
| | | VALUE SUCCESS INTERNATIONAL LTD 4% (21 NOVEMBER 2016) | 15,000,000 | 15,099,750 | 0.29 |
| | | VALUE SUCCESS INTERNATIONAL LTD 4.75% (4 NOVEMBER 2018) | 10,000,000 | 10,218,500 | 0.19 |
| | | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 4.5% (28 JUNE 2017) | 15,000,000 | 15,468,000 | 0.29 |
| | | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 2.15% (23 MAY 2016) | 45,000,000 | 44,634,600 | 0.85 |
| | | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 3.5% (23 JANUARY 2019) | 30,000,000 | 30,429,600 | 0.58 |
| | | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 3.75% (30 NOVEMBER 2017) | 10,000,000 | 10,240,400 | 0.19 |
| | YANLORD LAND HONG KONG CO LTD 5.375% (23 MAY 2016) | 36,800,000 | 36,542,032 | 0.69 | |
| | 小計 | | | 4,228,973,630 | 80.43 |
| | 非上場銘柄 | CHINA CITIC BANK INTERNATIONAL LTD 3.65% (28 SEPTEMBER 2014) | 21,350,000 | 21,347,064 | 0.41 |
| | | CHINA CITIC BANK INTERNATIONAL LTD 3.7% (1 NOVEMBER 2014) | 5,000,000 | 5,000,861 | 0.09 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND 2.48% (1 DECEMBER 2020) | 40,000,000 | 38,001,600 | 0.72 |
| | | CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT LTD 3.2% (23 DECEMBER 2015) | 30,000,000 | 29,763,600 | 0.57 |
| | | EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3% (21 JANUARY 2016) | 57,000,000 | 57,014,250 | 1.08 |
| | | EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3.25% (21 JANUARY 2017) | 30,000,000 | 30,031,200 | 0.57 |
| | | HITACHI CAPITAL CORP 3.75% (22 MARCH 2015) | 2,970,000 | 2,995,340 | 0.06 |
| | | ICBC LTD 3.2% (24 APRIL 2016) | 30,000,000 | 29,974,200 | 0.57 |
| | | LANDESKREDITBANK BADENWUERTTEMBERG-FOERDERBANK 1.65% (23 MAY 2016) | 51,000,000 | 49,747,394 | 0.94 |
| | | MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE CO 3.6% (2 MARCH 2015) | 10,000,000 | 10,040,500 | 0.19 |
| RABOBANK NEDERLAND 3.25% (20 SEPTEMBER 2015) | | 55,000,000 | 55,764,500 | 1.06 | |
| WHARF FINANCE NO 1 LTD 4% (27 MARCH 2018) | | 63,620,000 | 64,503,046 | 1.23 | |
| 小計 | | | 394,183,555 | 7.49 | |
| 譲渡性 預金証書 | 上場銘柄 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/SYDNEY 3.25% (20 MAY 2016) | 30,000,000 | 29,965,560 | 0.57 |
| | | 小計 | | | 29,965,560 |
| | 非上場銘柄 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD HONG KONG 2.55% (20 NOVEMBER 2014) | 12,000,000 | 11,984,400 | 0.23 |
| | | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD HONG KONG 3.2% (22 AUGUST 2014) | 10,000,000 | 10,001,000 | 0.19 |
| | | BANK OF CHINA/HONG KONG 3% (30 SEPTEMBER 2014) | 20,000,000 | 19,993,626 | 0.38 |
| | | BANK OF CHINA/HONG KONG 3.1% (8 OCTOBER 2014) | 35,000,000 | 34,992,046 | 0.67 |
| | | BANK OF EAST ASIA 2.6% (4 NOVEMBER 2014) | 40,000,000 | 39,957,200 | 0.76 |
| | | CATHAY UNITED BANK CO LTD/HONG KONG 2.7% (18 MARCH 2015) | 20,000,000 | 19,990,909 | 0.38 |
| | | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/SINGAPORE 2.6% (9 JANUARY 2015) | 15,000,000 | 14,966,281 | 0.28 |
| | | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/SINGAPORE 2.8% (2 DECEMBER 2014) | 20,000,000 | 19,978,886 | 0.38 |
| | | CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 1.3% (25 AUGUST 2014) | 40,000,000 | 39,968,120 | 0.76 |
| | | CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.2% (23 SEPTEMBER 2021) | 20,000,000 | 18,470,094 | 0.35 |
| | | ICBC LUXEMBOURG 3% (9 DECEMBER 2015) | 30,000,000 | 29,953,129 | 0.57 |
| | | MALAYAN BANKING BHD/HONG KONG 2.5% (18 NOVEMBER 2014) | 20,000,000 | 19,958,863 | 0.38 |
| | | WING LUNG BANK LTD 2.75% (25 NOVEMBER 2014) | 20,000,000 | 19,969,911 | 0.38 |
| | | WING LUNG BANK LTD 2.8% (27 JANUARY 2015) | 15,000,000 | 14,981,806 | 0.29 |

| 種類 | | 銘柄名/利率/償還日 | 額面金額 | 評価額 (人民幣) | 投資比率 (%) |
|----------------|-------|---|------------|----------------------|--------------|
| 譲渡性 預金証書 | 非上場銘柄 | WING LUNG BANK LTD 2.8% (4 FEBRUARY 2015) | 10,000,000 | 9,983,067 | 0.19 |
| | | WING LUNG BANK LTD 2.8% (23 APRIL 2015) | 45,000,000 | 44,870,379 | 0.85 |
| | | 小計 | | 370,019,717 | 7.04 |
| 外国債券 合計 | | | | 5,023,142,462 | 95.53 |

◆お知らせ◆

<約款変更のお知らせ> ありません。

<その他のお知らせ> ありません。