

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／不動産投信 | |
|--------|--|--|
| 信託期間 | 2022年12月14日まで（2013年2月18日設定） | |
| 運用方針 | AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の不動産投資信託証券に実質的な投資を行い、値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。マザーファンドの不動産投資信託証券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | AMP 米国ハイインカムリート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 | 米国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビーファンド | 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 |
| | マザーファンド | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |
| 分配方針 | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 | |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ／AMP 米国ハイインカムリートファンド ＜為替ヘッジあり＞（毎月決算型）

愛称：アスリート



第83期（決算日：2020年1月14日）
 第84期（決算日：2020年2月14日）
 第85期（決算日：2020年3月16日）
 第86期（決算日：2020年4月14日）
 第87期（決算日：2020年5月14日）
 第88期（決算日：2020年6月15日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「三菱UFJ／AMP 米国ハイインカムリートファンド＜為替ヘッジあり＞（毎月決算型）」は、去る6月15日に第88期の決算を行いましたので、法令に基づいて第83期～第88期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、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ので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

| 決 算 期 | 基 (分配落) | 準 価 額 | | | 投 資 信 託 券 率 組 入 比 | 純 資 産 額 | |
|------------------|------------|-------|-----|-----------------|----------------------|---------|-------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 期 金 騰 落 | | | 中 率 |
| | 円 | | 円 | | % | 百万円 | |
| 59期(2018年1月15日) | 9,013 | | 50 | △ | 3.7 | 92.8 | 1,063 |
| 60期(2018年2月14日) | 8,481 | | 50 | △ | 5.3 | 92.4 | 919 |
| 61期(2018年3月14日) | 8,555 | | 50 | | 1.5 | 94.9 | 854 |
| 62期(2018年4月16日) | 8,474 | | 50 | △ | 0.4 | 94.6 | 815 |
| 63期(2018年5月14日) | 8,800 | | 50 | | 4.4 | 94.9 | 834 |
| 64期(2018年6月14日) | 9,038 | | 50 | | 3.3 | 91.6 | 810 |
| 65期(2018年7月17日) | 9,200 | | 50 | | 2.3 | 90.4 | 789 |
| 66期(2018年8月14日) | 9,108 | | 50 | △ | 0.5 | 93.7 | 758 |
| 67期(2018年9月14日) | 9,258 | | 50 | | 2.2 | 95.8 | 732 |
| 68期(2018年10月15日) | 8,541 | | 50 | △ | 7.2 | 95.0 | 658 |
| 69期(2018年11月14日) | 8,818 | | 50 | | 3.8 | 93.9 | 665 |
| 70期(2018年12月14日) | 8,555 | | 50 | △ | 2.4 | 95.4 | 624 |
| 71期(2019年1月15日) | 8,244 | | 50 | △ | 3.1 | 94.3 | 602 |
| 72期(2019年2月14日) | 8,822 | | 50 | | 7.6 | 95.2 | 635 |
| 73期(2019年3月14日) | 8,874 | | 50 | | 1.2 | 94.2 | 621 |
| 74期(2019年4月15日) | 9,012 | | 50 | | 2.1 | 94.5 | 600 |
| 75期(2019年5月14日) | 8,961 | | 50 | △ | 0.0 | 94.6 | 582 |
| 76期(2019年6月14日) | 8,978 | | 50 | | 0.7 | 94.9 | 583 |
| 77期(2019年7月16日) | 8,904 | | 50 | △ | 0.3 | 95.8 | 565 |
| 78期(2019年8月14日) | 8,932 | | 30 | | 0.7 | 94.6 | 566 |
| 79期(2019年9月17日) | 9,107 | | 30 | | 2.3 | 97.2 | 571 |
| 80期(2019年10月15日) | 9,178 | | 30 | | 1.1 | 95.9 | 581 |
| 81期(2019年11月14日) | 9,165 | | 30 | | 0.2 | 96.8 | 581 |
| 82期(2019年12月16日) | 8,927 | | 30 | △ | 2.3 | 96.8 | 556 |
| 83期(2020年1月14日) | 9,035 | | 30 | | 1.5 | 97.7 | 562 |
| 84期(2020年2月14日) | 9,053 | | 30 | | 0.5 | 97.0 | 547 |
| 85期(2020年3月16日) | 6,981 | | 30 | △ | 22.6 | 90.9 | 418 |
| 86期(2020年4月14日) | 6,701 | | 30 | △ | 3.6 | 91.1 | 402 |
| 87期(2020年5月14日) | 6,242 | | 30 | △ | 6.4 | 91.5 | 375 |
| 88期(2020年6月15日) | 7,134 | | 30 | | 14.8 | 95.8 | 428 |

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 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。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決 算 期 | 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|-------|----------------------|-------|-------|-------|-----------------|
| | | | 騰 落 率 | 率 | |
| 第83期 | (期 首) 2019年12月16日 | 円 | | % | % |
| | | 8,927 | | — | 96.8 |
| | 12月末 | 9,013 | | 1.0 | 96.9 |
| 第84期 | (期 末) 2020年1月14日 | 9,065 | | 1.5 | 97.7 |
| | (期 首) 2020年1月14日 | 9,035 | | — | 97.7 |
| | 1月末 | 9,021 | | △ 0.2 | 96.4 |
| 第85期 | (期 末) 2020年2月14日 | 9,083 | | 0.5 | 97.0 |
| | (期 首) 2020年2月14日 | 9,053 | | — | 97.0 |
| | 2月末 | 8,250 | | △ 8.9 | 93.4 |
| 第86期 | (期 末) 2020年3月16日 | 7,011 | | △22.6 | 90.9 |
| | (期 首) 2020年3月16日 | 6,981 | | — | 90.9 |
| | 3月末 | 6,425 | | △ 8.0 | 95.6 |
| 第87期 | (期 末) 2020年4月14日 | 6,731 | | △ 3.6 | 91.1 |
| | (期 首) 2020年4月14日 | 6,701 | | — | 91.1 |
| | 4月末 | 6,880 | | 2.7 | 91.3 |
| 第88期 | (期 末) 2020年5月14日 | 6,272 | | △ 6.4 | 91.5 |
| | (期 首) 2020年5月14日 | 6,242 | | — | 91.5 |
| | 5月末 | 6,920 | | 10.9 | 96.0 |
| | (期 末) 2020年6月15日 | 7,164 | | 14.8 | 95.8 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 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。

運用経過

第83期～第88期：2019年12月17日～2020年6月15日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------------|--------|
| 第83期首 | 8,927円 |
| 第88期末 | 7,134円 |
| 既払分配金 | 180円 |
| 騰落率 | -18.1% |
| (分配金再投資ベース) | |

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
 ※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさま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、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ18.1% (分配金再投資ベース) の下落となりました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

保有銘柄 (SIMON PROPERTY GROUP INCなど) が下落したことなどが、基準価額の下落要因となりました。

第83期～第88期：2019年12月17日～2020年6月15日

投資環境について

▶ 米国リート市況

米国リート市況は、当作成期を通してみると下落しました。

当作成期首から2020年2月中旬までは、持続する低金利が経済活動をサポートするとの思惑などから上昇しましたが、2月後半から3月中旬にかけては、新型肺炎の感染拡大を受けた投資家心理の悪化

などから大きく下落しました。その後は、米連邦準備制度理事会（FRB）による金融緩和策や米政府による巨額の財政政策に加え、新型肺炎の感染拡大にピークアウトの兆しが見えたことを受けて、経済活動の一部正常化の動きなどが好感されて上昇しましたが、当作成期を通してみると下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ／AMP 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり>（毎月決算型）

AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド受益証券への投資を通じて、米国の不動産投資信託証券を高位に組み入れるとともに、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。

▶ AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド

配当利回りに着目した上で、財務の健全性、配当の安定性および成長性、キャッシュフローの成長性などに基づいて組入銘柄を選定しました。リートの組入比率については、当作成期を通じて高位を維持しました。足元の投資環境を踏まえ、

より分散されたポートフォリオの構築をめざして銘柄入替を行い、優先リートの比率を引き下げました。

組入銘柄数については、当作成期中において銘柄入替を実施し当作成期首は30銘柄程度としておりましたが、当作成期末には35銘柄程度としました。銘柄入替については、今後の業績が懸念される銘柄などを売却し、配当利回りや割安性においてより魅力的な銘柄や、新型肺炎の影響が相対的に小さいとみられる銘柄などを買い付けました。

パフォーマンスに寄与・影響した銘柄は以下の通りです。

上昇銘柄

EQUINIX INC（アメリカ）：米国でデータセンターなどを手掛ける。第5世代移

動通信システム（5G）の本格商用化や、
新型肺炎の感染拡大による在宅勤務や在
宅学習の普及に伴うクラウド需要の増加
などを背景に上昇しました。

下落銘柄

SIMON PROPERTY GROUP INC（アメ
リカ）：米国で店舗用不動産などを手掛
ける。新型肺炎の感染拡大に伴う売上減
少、賃料回収率の低下懸念などから下落
しました。

当投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。
従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

| 項目 | 第83期 2019年12月17日～ 2020年1月14日 | 第84期 2020年1月15日～ 2020年2月14日 | 第85期 2020年2月15日～ 2020年3月16日 | 第86期 2020年3月17日～ 2020年4月14日 | 第87期 2020年4月15日～ 2020年5月14日 | 第88期 2020年5月15日～ 2020年6月15日 |
|--------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 当期分配金 （対基準価額比率） | 30 (0.331%) | 30 (0.330%) | 30 (0.428%) | 30 (0.446%) | 30 (0.478%) | 30 (0.419%) |
| 当期の収益 | 30 | 15 | 30 | 25 | — | 20 |
| 当期の収益以外 | — | 14 | — | 4 | 30 | 10 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,241 | 1,227 | 1,236 | 1,232 | 1,202 | 1,192 |

（注）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）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針（作成対象期間末での見解です。）

▶三菱UFJ／AMP 米国ハイインカムリートファンド＜為替ヘッジあり＞（毎月決算型）

マザーファンドへの投資を通じて、米国の不動産投資信託証券を高位に組み入れ、値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざすほか、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行います。

▶AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド

新型コロナウイルスの感染拡大が経済に及ぼす影響により、短期的には値動きの大きい展開が継続すると考えており、新型コロナウイルスの影響を直接的に受けるセクターの組入比率

を抑え、市況動向に左右されにくい銘柄を選別して投資を行います。より短期的には、新型コロナウイルスの影響によりテナント誘致には時間を要すると考えられるため、開発案件が少なく、流動資金を確保している銘柄を選好します。ポートフォリオについては内部成長が期待できるREITや買収や開発を通じて外部成長が期待できるREIT、優れた経営陣を擁するREITに注目してまいります。

当ファンドの運用につきましては、バランスがとれ、分散されたポートフォリオの構築、維持を通し、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を行っていく方針です。

2019年12月17日～2020年6月15日

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第83期～第88期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 65 | 0.854 | (a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数) |
| （投信会社） | (37) | (0.479) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 |
| （販売会社） | (25) | (0.330) | 交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (3) | (0.044) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 14 | 0.178 | (b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| （投資信託証券） | (14) | (0.178) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税 = 作成期中の有価証券取引税 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （投資信託証券） | (0) | (0.001) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.027 | (d) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数 |
| （保管費用） | (2) | (0.025) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| （監査費用） | (0) | (0.002) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| 合計 | 81 | 1.060 | |

作成期中の平均基準価額は、7,646円です。

(注) 作成期間の費用（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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

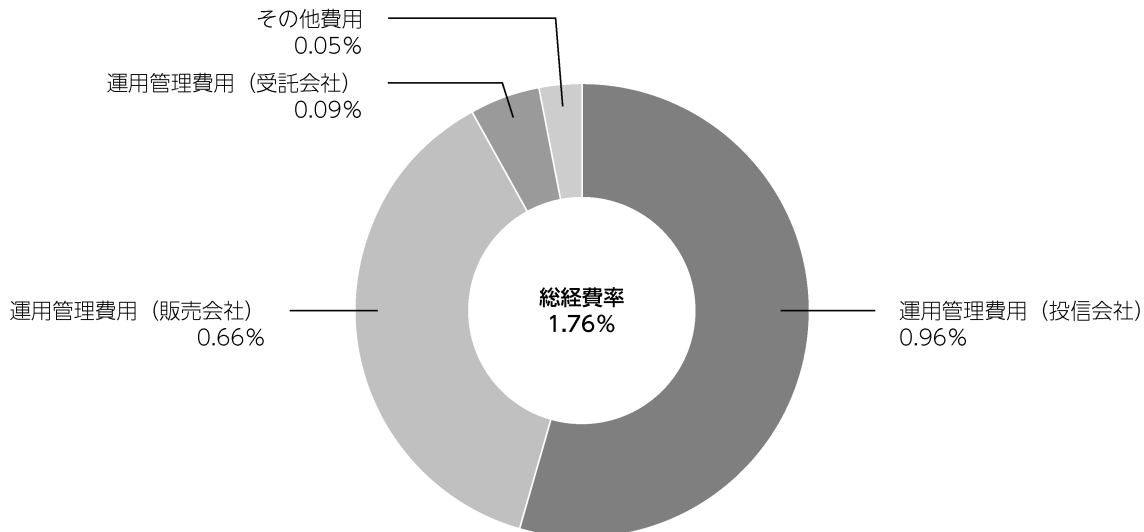
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は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）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・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。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.76%**です。



(注) 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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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12月17日～2020年6月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 | 柄 | 第83期～第88期 | | | |
|------------------------|---|-----------|--------|--------|--------|
| | | 設 定 | | 解 約 | |
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド | | 38,667 | 60,840 | 52,496 | 84,480 |

○利害関係人との取引状況等

(2019年12月17日～2020年6月15日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ/AMP 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり> (毎月決算型) >

| 区 分 | 第83期～第88期 | | | | | |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | 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 | $\frac{D}{C}$ |
| | | | | | | |
| 為替先物取引 | 4,000 | 85 | 2.1 | 3,884 | 124 | 3.2 |

<AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド>

| 区 分 | 第83期～第88期 | | | | | |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | 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 | $\frac{D}{C}$ |
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 32 | 3 | 9.4 | 218 | 106 | 48.6 |

平均保有割合 46.1%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2020年6月15日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 第82期末 | | 第88期末 | |
|------------------------|---------|----|---------|---------|
| | 口数 | 千口 | 口数 | 千口 |
| AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド | 290,039 | | 276,209 | 417,546 |

○投資信託財産の構成

(2020年6月15日現在)

| 項目 | 第88期末 | |
|------------------------|---------|--------|
| | 評価額 | 比率 |
| AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド | 417,546 | 96.6% |
| コール・ローン等、その他 | 14,734 | 3.4% |
| 投資信託財産総額 | 432,280 | 100.0% |

(注) AMP 米国ハイインカムリートマザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産(862,129千円)の投資信託財産総額(871,177千円)に対する比率は99.0%です。

(注) 外貨建資産は、作成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。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | |
|-----------------|--|--|
| 1アメリカドル=107.24円 | | |
|-----------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項目 | 第83期末 | 第84期末 | 第85期末 | 第86期末 | 第87期末 | 第88期末 |
|----------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 2020年1月14日現在 | 2020年2月14日現在 | 2020年3月16日現在 | 2020年4月14日現在 | 2020年5月14日現在 | 2020年6月15日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 1,111,606,848 | 1,077,565,679 | 820,032,289 | 787,640,725 | 739,250,220 | 841,465,031 |
| コール・ローン等 | 16,157,160 | 19,382,383 | 20,533,151 | 14,892,560 | 13,708,466 | 14,485,655 |
| AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド(詳細) | 557,480,872 | 537,149,720 | 413,518,896 | 388,345,898 | 366,492,404 | 417,546,492 |
| 未収入金 | 537,968,816 | 521,033,576 | 385,980,242 | 384,402,267 | 359,049,350 | 409,432,884 |
| (B) 負債 | 549,046,276 | 529,915,913 | 401,524,909 | 385,407,802 | 364,064,491 | 413,130,072 |
| 未払金 | 546,419,670 | 523,251,839 | 398,992,947 | 383,109,551 | 361,701,055 | 410,713,760 |
| 未払収益分配金 | 1,867,871 | 1,814,713 | 1,798,572 | 1,800,779 | 1,803,330 | 1,801,156 |
| 未払解約金 | - | 4,042,825 | 6,137 | - | - | 50 |
| 未払信託報酬 | 756,975 | 804,672 | 725,535 | 496,324 | 558,809 | 613,684 |
| 未払利息 | 10 | 5 | 43 | 4 | 8 | 8 |
| その他未払費用 | 1,750 | 1,859 | 1,675 | 1,144 | 1,289 | 1,414 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 562,560,572 | 547,649,766 | 418,507,380 | 402,232,923 | 375,185,729 | 428,334,959 |
| 元本 | 622,623,775 | 604,904,423 | 599,524,064 | 600,259,963 | 601,110,215 | 600,385,355 |
| 次期繰越損益金 | △ 60,063,203 | △ 57,254,657 | △181,016,684 | △198,027,040 | △225,924,486 | △172,050,396 |
| (D) 受益権総口数 | 622,623,775口 | 604,904,423口 | 599,524,064口 | 600,259,963口 | 601,110,215口 | 600,385,355口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,035円 | 9,053円 | 6,981円 | 6,701円 | 6,242円 | 7,134円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第83期 | 第84期 | 第85期 | 第86期 | 第87期 | 第88期 |
|-------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2019年12月17日～ 2020年1月14日 | 2020年1月15日～ 2020年2月14日 | 2020年2月15日～ 2020年3月16日 | 2020年3月17日～ 2020年4月14日 | 2020年4月15日～ 2020年5月14日 | 2020年5月15日～ 2020年6月15日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 651 | △ 223 | △ 387 | △ 527 | △ 246 | △ 600 |
| 受取利息 | — | 7 | — | 49 | 4 | 4 |
| 支払利息 | △ 651 | △ 230 | △ 387 | △ 576 | △ 250 | △ 604 |
| (B) 有価証券売買損益 | 9,371,896 | 3,715,218 | △121,744,493 | △ 14,386,198 | △ 25,253,465 | 56,017,532 |
| 売買益 | 17,828,866 | 11,747,222 | 34,025,835 | 19,549,766 | 6,170,743 | 64,847,536 |
| 売買損 | △ 8,456,970 | △ 8,032,004 | △155,770,328 | △ 33,935,964 | △ 31,424,208 | △ 8,830,004 |
| (C) 信託報酬等 | △ 758,725 | △ 806,531 | △ 727,210 | △ 497,468 | △ 560,098 | △ 615,098 |
| (D) 当期損益金 (A+B+C) | 8,612,520 | 2,908,464 | △122,472,090 | △ 14,884,193 | △ 25,813,809 | 55,401,834 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 35,207,631 | △ 27,582,822 | △ 26,233,681 | △150,137,571 | △166,822,543 | △193,954,878 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 31,600,221 | △ 30,765,586 | △ 30,512,341 | △ 31,204,497 | △ 31,484,804 | △ 31,696,196 |
| (配当等相当額) | (74,803,960) | (72,681,569) | (72,038,008) | (72,135,506) | (72,247,489) | (72,160,700) |
| (売買損益相当額) | (△106,404,181) | (△103,447,155) | (△102,550,349) | (△103,340,003) | (△103,732,293) | (△103,856,896) |
| (G) 計 (D+E+F) | △ 58,195,332 | △ 55,439,944 | △179,218,112 | △196,226,261 | △224,121,156 | △170,249,240 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,867,871 | △ 1,814,713 | △ 1,798,572 | △ 1,800,779 | △ 1,803,330 | △ 1,801,156 |
| 次期繰越損益金 (G+H) | △ 60,063,203 | △ 57,254,657 | △181,016,684 | △198,027,040 | △225,924,486 | △172,050,396 |
| 追加信託差損益金 | △ 31,600,221 | △ 30,765,586 | △ 30,512,341 | △ 31,204,497 | △ 31,484,804 | △ 32,296,582 |
| (配当等相当額) | (74,804,233) | (72,683,289) | (72,039,311) | (72,142,732) | (72,247,802) | (71,561,011) |
| (売買損益相当額) | (△106,404,454) | (△103,448,875) | (△102,551,652) | (△103,347,229) | (△103,732,606) | (△103,857,593) |
| 分配準備積立金 | 2,523,969 | 1,594,920 | 2,115,859 | 1,816,870 | 13,540 | 41,920 |
| 繰越損益金 | △ 30,986,951 | △ 28,083,991 | △152,620,202 | △168,639,413 | △194,453,222 | △139,795,734 |

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (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) (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。

<注記事項>

- ①作成期首 (前作成期末) 元本額 623,647,898円
 作成期中追加設定元本額 6,295,502円
 作成期中一部解約元本額 29,558,045円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7134円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は172,050,396円です。

③分配金の計算過程

| 項 目 | 2019年12月17日～ 2020年1月14日 | 2020年1月15日～ 2020年2月14日 | 2020年2月15日～ 2020年3月16日 | 2020年3月17日～ 2020年4月14日 | 2020年4月15日～ 2020年5月14日 | 2020年5月15日～ 2020年6月15日 |
|---------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 2,756,958円 | 963,712円 | 2,334,888円 | 1,506,946円 | —円 | 1,229,184円 |
| 費用控除後・繰越大損金補填後の有価証券売買等損益額 | —円 | —円 | —円 | —円 | —円 | —円 |
| 収益調整金額 | 74,804,233円 | 72,683,289円 | 72,039,311円 | 72,142,732円 | 72,247,802円 | 72,161,397円 |
| 分配準備積立金額 | 1,634,882円 | 2,445,921円 | 1,579,543円 | 2,110,703円 | 1,816,870円 | 13,506円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 79,196,073円 | 76,092,922円 | 75,953,742円 | 75,760,381円 | 74,064,672円 | 73,404,087円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 1,271円 | 1,257円 | 1,266円 | 1,262円 | 1,232円 | 1,222円 |
| 1万口当たり分配金額 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |
| 収益分配金金額 | 1,867,871円 | 1,814,713円 | 1,798,572円 | 1,800,779円 | 1,803,330円 | 1,801,156円 |

④「AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド」の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、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の44以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○分配金のお知らせ

| | 第83期 | 第84期 | 第85期 | 第86期 | 第87期 | 第88期 |
|-----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 | 30円 |

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・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には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、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。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・2020年1月1日以降の分配時において、外国税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。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の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。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

* 三菱UFJ国際投信では本資料のほか、当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド

《第7期》決算日2019年12月16日

[計算期間：2018年12月15日～2019年12月16日]

「AMP 米国ハイインカムリートマザーファンド」は、12月16日に第7期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第7期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 米国の不動産投資信託証券に投資を行い、値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざします。 不動産投資信託証券への投資にあたっては、人口動態分析、マクロ経済分析等のトップダウン・アプローチと、個別銘柄の割安度や保有資産・業績の分析および資本構造や経営の質等の分析によるボトムアップ・アプローチを併用し、銘柄選定を行います。 不動産投資信託証券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主要運用対象 | 米国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準 | 価額 | | 投資信託証券比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-----|------|----------|-------|
| | | 期騰落 | 中率 | | |
| | 円 | | % | % | 百万円 |
| 3期(2015年12月14日) | 15,014 | △ | 0.4 | 96.4 | 1,977 |
| 4期(2016年12月14日) | 16,578 | | 10.4 | 97.9 | 3,355 |
| 5期(2017年12月14日) | 16,492 | △ | 0.5 | 92.4 | 2,063 |
| 6期(2018年12月14日) | 16,812 | | 1.9 | 97.8 | 1,476 |
| 7期(2019年12月16日) | 18,757 | | 11.6 | 99.0 | 1,268 |

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 | 月 | 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 投 資 信 託 券 率 |
|---|-------------|---|---------|-------|---|-------------|
| | | | | 騰 | 落 | |
| | (期 首) | | 円 | % | | % |
| | 2018年12月14日 | | 16,812 | — | | 97.8 |
| | 12月末 | | 15,087 | △10.3 | | 96.3 |
| | 2019年1月末 | | 16,601 | △ 1.3 | | 96.9 |
| | 2月末 | | 17,392 | 3.4 | | 97.5 |
| | 3月末 | | 17,964 | 6.9 | | 94.5 |
| | 4月末 | | 17,775 | 5.7 | | 97.3 |
| | 5月末 | | 17,576 | 4.5 | | 97.4 |
| | 6月末 | | 17,481 | 4.0 | | 97.8 |
| | 7月末 | | 18,154 | 8.0 | | 97.7 |
| | 8月末 | | 17,952 | 6.8 | | 96.7 |
| | 9月末 | | 18,788 | 11.8 | | 98.2 |
| | 10月末 | | 19,458 | 15.7 | | 98.7 |
| | 11月末 | | 19,532 | 16.2 | | 98.9 |
| | (期 末) | | | | | |
| | 2019年12月16日 | | 18,757 | 11.6 | | 99.0 |

(注) 騰落率は期首比。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ11.6%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の変動要因

(上昇要因)

保有銘柄 (SUN COMMUNITIES INCなど) が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

◎米国リート市況

・米国リート市況は、当期を通してみると上昇しました。

世界経済への過度な警戒感が後退したことや、米連邦準備制度理事会 (FRB) による緩和的な金融政策が継続するとの期待などから長期金利が低下し、利回り資産に対する買い需要が高まったこと、決算内容や業界再編の動きが好感されたことなどを背景に上昇しました。

◎為替市況

・為替市況は、期首に比べ3.7%の円高・米ドル安となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・配当利回りに着目した上で、財務の健全性、配当の安定性および成長性、キャッシュフローの成長性などに基づいて組入銘柄を選定しました。リートの組入比率については、期を通じて高位を維持し、普通リートと優先リートの投資割合については、概ね70：30程度の割合で推移させました。
- ・組入銘柄数については、期中において銘柄入替を実施し期首は29銘柄程度としておりましたが、期末には30銘柄程度としました。銘柄入替については、今後の業績が懸念される銘柄や、価格上昇により割安性が薄まった銘柄を売却し、配当利回りや割安性においてより魅力的な銘柄を買い付けました。
- ・パフォーマンスに寄与・影響した銘柄は以下の通りです。

(上昇銘柄)

- ・SUN COMMUNITIES INC (アメリカ)：米国で住宅用不動産などを手掛ける。良好な業績内容が好感されたことや、米長期金利が低下したことなどを背景に上昇しました。

(下落銘柄)

- ・PENN REAL ESTATE INVEST TST (アメリカ)：米国で店舗用不動産などを手掛ける。米小売店舗の閉鎖計画などを背景に事業環境への懸念が高まり、米モール・リートへの業績成長に対する不透明感が高まったことなどから下落しました。

○今後の運用方針

- ・貿易摩擦の深刻化、経済成長の減速に対する懸念はあるものの、今後の米国経済については、発表された経済指標が概ね底堅いことや、FRBが景気に配慮した慎重な金融政策運営方針を示していることから、引き続き良好な経済成長や不動産市況の改善が期待されます。セクターについては、相対的に配当利回りの高いヘルスケアやホテルなどに注目しています。ポートフォリオについては内部成長が期待できるリートや買収や開発を通じて外部成長が期待できるリート、優れた経営陣を擁するリートに注目してまいります。
- ・当ファンドの運用につきましては、引き続きセクター分散を考慮した上で、配当利回りの水準等に着目した銘柄選択を行い、普通リートに加えて優先リートへ投資をすることにより配当等収益を高めるとともに中長期的な信託財産の成長をめざした運用を行っていく方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年12月15日～2019年12月16日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|---------------------|-----------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) | 円 7 (7) | % 0.037 (0.037) | (a) 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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (b) 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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 5 (5) (0) | 0.029 (0.028) (0.001) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 12 | 0.067 | |
| 期中の平均基準価額は、17,830円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2018年12月15日～2019年12月16日)

投資信託証券

| 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|--------------------------------|--------------|----------------|-------|---------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| アメリカ | 千口 | 千アメリカドル | 千口 | 千アメリカドル |
| MACERICH CO/THE | 5 | 183 | — | — |
| PROLOGIS INC | 0.2 | 14 | 2 | 223 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | — | — | 0.882 | 91 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | — | — | 0.5 | 59 |
| EPR PROPERTIES | 0.4 | 29 | 1 | 103 |
| WELLTOWER INC | — | — | 1 | 123 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 2 | 20 | 17 | 177 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 0.6 | 22 | 3 | 153 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 25 | 160 | 8 | 55 |
| SUN COMMUNITIES INC | — | — | 1 | 239 |
| CUBESMART | 9 | 303 | 0.5 | 15 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | — | — | 5 | 408 |
| | (△ 51) | (—) | | |
| DOUGLAS EMMETT INC | — | — | 1 | 54 |
| RLJ LODGING TRUST | 6 | 109 | 3 | 66 |
| STAG INDUSTRIAL INC | — | — | 4 | 126 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 1 | 26 | 5 | 127 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 2 | 177 | — | — |
| VEREIT INC | — | — | 18 | 162 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 14 | 79 | 79 | 361 |
| STORE CAPITAL CORP | — | — | 5 | 186 |
| WASHINGTON PRIME GROUP PFD-H | — | — | 4 | 109 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 3 | 47 | 5 | 85 |
| PENN REAL ESTATE INVEST PFD-D | — | — | 2 | 61 |
| PUBLIC STORAGE PFD-G | — | — | 1 | 40 |
| SITE CENTERS CORP PFD-A | — | — | 5 | 138 |
| VICI PROPERTIES INC | 12 | 301 | — | — |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | — | — | 7 | 413 |
| MONMOUTH REIT PFD-C | — | — | 4 | 110 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL IN PFD-A | — | — | 7 | 177 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 0.5 | 81 | 0.2 | 36 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | — | — | 0.602 | 124 |
| 小計 | 84 (△ 51) | 1,557 (—) | 203 | 4,035 |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2018年12月15日～2019年12月16日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 105 | 百万円 31 | % 29.5 | 百万円 459 | 百万円 123 | % 26.8 |

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2019年12月16日現在)

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--------------------------------|--------------|-----|---------|--------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % | |
| MACERICH CO/THE | — | 5 | 145 | 15,963 | 1.3 | |
| PROLOGIS INC | 7 | 4 | 395 | 43,299 | 3.4 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 2 | 2 | 220 | 24,140 | 1.9 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 2 | 2 | 250 | 27,375 | 2.2 | |
| EPR PROPERTIES | 7 | 6 | 443 | 48,577 | 3.8 | |
| WELLTOWER INC | 6 | 4 | 376 | 41,193 | 3.2 | |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 55 | 40 | 424 | 46,414 | 3.7 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 14 | 10 | 449 | 49,160 | 3.9 | |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 58 | 75 | 403 | 44,159 | 3.5 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 4 | 3 | 476 | 52,167 | 4.1 | |
| CUBESMART | — | 9 | 278 | 30,450 | 2.4 | |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 56 | — | — | — | — | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 6 | 5 | 213 | 23,383 | 1.8 | |
| RLJ LODGING TRUST | 24 | 26 | 465 | 50,917 | 4.0 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 17 | 13 | 406 | 44,454 | 3.5 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 24 | 19 | 410 | 44,909 | 3.5 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | — | 2 | 171 | 18,735 | 1.5 | |
| VEREIT INC | 67 | 49 | 450 | 49,349 | 3.9 | |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 65 | — | — | — | — | |
| STORE CAPITAL CORP | 16 | 11 | 421 | 46,111 | 3.6 | |
| WASHINGTON PRIME GROUP PFD-H | 41 | 36 | 790 | 86,509 | 6.8 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 28 | 26 | 410 | 44,897 | 3.5 | |
| PENN REAL ESTATE INVEST PFD-D | 26 | 23 | 471 | 51,563 | 4.1 | |
| PUBLIC STORAGE PFD-G | 25 | 23 | 616 | 67,495 | 5.3 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT PFD-G | 9 | 9 | 231 | 25,384 | 2.0 | |
| SITE CENTERS CORP PFD-A | 8 | 2 | 67 | 7,408 | 0.6 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS PFD-E | 9 | 9 | 238 | 26,091 | 2.1 | |
| VICI PROPERTIES INC | — | 12 | 299 | 32,771 | 2.6 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 7 | — | — | — | — | |
| MONMOUTH REIT PFD-C | 27 | 23 | 582 | 63,707 | 5.0 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL IN PFD-A | 27 | 19 | 512 | 56,076 | 4.4 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 2 | 2 | 398 | 43,629 | 3.4 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 2 | 2 | 452 | 49,498 | 3.9 | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 654 | 483 | 11,475 | 1,255,800 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 29 | 30 | — | < 99.0% > | |

(注) 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。

(注) 比率および合計欄の<>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12月16日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 1,255,800 | % 98.7 |
| コール・ローン等、その他 | 16,911 | 1.3 |
| 投資信託財産総額 | 1,272,711 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (1,269,962千円) の投資信託財産総額 (1,272,711千円) に対する比率は99.8%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | |
|------------------|--|--|
| 1 アメリカドル=109.43円 | | |
|------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年12月16日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産 | 1,276,868,989 円 |
| コール・ローン等 | 10,576,535 |
| 投資証券(評価額) | 1,255,800,273 |
| 未収入金 | 4,162,520 |
| 未収配当金 | 6,329,661 |
| (B) 負債 | 8,547,963 |
| 未払金 | 4,157,960 |
| 未払解約金 | 4,390,000 |
| 未払利息 | 3 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,268,321,026 |
| 元本 | 676,168,720 |
| 次期繰越損益金 | 592,152,306 |
| (D) 受益権総口数 | 676,168,720口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,757円 |

<注記事項>

| | |
|----------------------------|--------------|
| ①期首元本額 | 878,313,341円 |
| 期中追加設定元本額 | 137,521,601円 |
| 期中一部解約元本額 | 339,666,222円 |
| また、1口当たり純資産額は、期末1.8757円です。 | |

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

| | |
|---|--------------|
| 三菱UFJ/AMP 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型) | 386,129,717円 |
| 三菱UFJ/AMP 米国ハイインカムリートファンド<為替ヘッジあり>(毎月決算型) | 290,039,003円 |
| 合計 | 676,168,720円 |

○損益の状況

(2018年12月15日~2019年12月16日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------------|
| (A) 配当等収益 | 78,499,904 円 |
| 受取配当金 | 78,280,998 |
| 受取利息 | 229,112 |
| 支払利息 | △ 10,206 |
| (B) 有価証券売買損益 | 86,214,607 |
| 売買益 | 189,684,292 |
| 売買損 | △103,469,685 |
| (C) 保管費用等 | △ 398,330 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 164,316,181 |
| (E) 前期繰越損益金 | 598,331,504 |
| (F) 追加信託差損益金 | 101,928,399 |
| (G) 解約差損益金 | △272,423,778 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 592,152,306 |
| 次期繰越損益金(H) | 592,152,306 |

(注) (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) (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) (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。