

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	2020年3月13日まで（2010年4月16日設定）	
運用方針	ファンド・オブ・ファンズ方式により、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	世界投資適格債オープン（通貨選択型）豪ドルコース（毎月決算型）	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス） 受益証券およびマネー・プール マザーファンド受益証券
	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）	日本を除く世界の投資適格格付け（BBB格相当以上）を有する社債*とソブリン債券 *社債にはCoCosを含みます。
	マネー・プールマザーファンド	わが国の公社債
運用方法	<ul style="list-style-type: none"> ・米ドルやユーロなど複数通貨（以下、「原資産通貨」ということがあります。）建の日本を除く世界の投資適格格付けを有する社債とソブリン債券に投資し、安定したインカムゲインの確保と、債券の値上がり益および為替差益の獲得を目指します。 ・実質的な外貨建資産に対して原資産通貨売り／豪ドル買いの為替取引を行います。 	
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・投資信託証券、短期社債等およびコマニシャル・ペーパー以外の有価証券への投資は行いません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 	
分配方針	毎月15日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して、分配金額を決定します。（ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わない場合もあります。）	

※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）

世界投資適格債オープン（通貨選択型） 豪ドルコース（毎月決算型）



第70期（決算日：2016年4月15日）
 第71期（決算日：2016年5月16日）
 第72期（決算日：2016年6月15日）
 第73期（決算日：2016年7月15日）
 第74期（決算日：2016年8月15日）
 第75期（決算日：2016年9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「世界投資適格債オープン（通貨選択型）豪ドルコース（毎月決算型）」は、去る9月15日に第75期の決算を行いましたので、法令に基づいて第70期～第75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
 URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
 (9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)
 お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

世界投資適格債オープン（通貨選択型）豪ドルコース（毎月決算型）のご報告

◇最近30期の運用実績	1
◇当作成期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	8
◇1万口当たりの費用明細	9
◇売買及び取引の状況	9
◇利害関係人との取引状況等	10
◇組入資産の明細	10
◇投資信託財産の構成	10
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	11
◇損益の状況	12
◇分配金のお知らせ	13
◇お知らせ	13

投資対象ファンドのご報告

◇ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）	15
◇マネー・プール マザーファンド	35

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 準 価 額 (分配落)	税 込 金 騰 落 中 率			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		分 配	み 金	期 騰 落				
	円	円	円	%	%	%	%	百万円
46期(2014年4月15日)	11,356		60	5.6	0.2	—	97.4	1,014
47期(2014年5月15日)	11,379		60	0.7	0.1	—	97.9	1,007
48期(2014年6月16日)	11,379		60	0.5	0.1	—	97.9	953
49期(2014年7月15日)	11,324		60	0.0	0.1	—	97.9	925
50期(2014年8月15日)	11,380		60	1.0	0.1	—	97.9	921
51期(2014年9月16日)	11,463		60	1.3	0.1	—	97.9	883
52期(2014年10月15日)	11,147		60	△2.2	0.1	—	97.9	808
53期(2014年11月17日)	12,066		60	8.8	0.1	—	97.9	908
54期(2014年12月15日)	11,700		60	△2.5	0.1	—	97.9	875
55期(2015年1月15日)	11,557		60	△0.7	0.1	—	97.9	883
56期(2015年2月16日)	11,111		60	△3.3	0.1	—	97.9	837
57期(2015年3月16日)	11,121		60	0.6	0.1	—	97.9	829
58期(2015年4月15日)	11,007		60	△0.5	0.1	—	97.9	828
59期(2015年5月15日)	11,247		60	2.7	0.1	—	97.9	852
60期(2015年6月15日)	10,977		60	△1.9	0.1	—	97.9	887
61期(2015年7月15日)	10,486		60	△3.9	0.1	—	97.9	841
62期(2015年8月17日)	10,528		60	1.0	0.1	—	97.9	843
63期(2015年9月15日)	9,795		60	△6.4	0.1	—	97.9	789
64期(2015年10月15日)	9,943		60	2.1	0.1	—	97.9	850
65期(2015年11月16日)	9,902		60	0.2	0.1	—	97.9	796
66期(2015年12月15日)	9,876		60	0.3	0.1	—	97.9	796
67期(2016年1月15日)	9,276		60	△5.5	0.1	—	97.9	729
68期(2016年2月15日)	9,006		60	△2.3	0.1	—	97.9	704
69期(2016年3月15日)	9,623		60	7.5	0.1	—	97.9	755
70期(2016年4月15日)	9,572		60	0.1	0.1	—	97.9	766
71期(2016年5月16日)	9,010		60	△5.2	0.1	—	97.8	725
72期(2016年6月15日)	8,925		60	△0.3	0.1	—	97.9	709
73期(2016年7月15日)	9,298		60	4.9	0.1	—	97.9	753
74期(2016年8月15日)	8,997		40	△2.8	0.1	—	97.6	730
75期(2016年9月15日)	8,749		40	△2.3	0.1	—	97.9	706

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○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		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	投 資 信 託 券 率
			騰 落 率	率						
第70期	(期 首)	円		%	%	%	%	%		%
	2016年3月15日	9,623	—	—	0.1	—	—	—	—	97.9
	3月末	9,818	2.0	—	0.1	—	—	—	—	97.9
第71期	(期 末)									
	2016年4月15日	9,572	—	—	0.1	—	—	—	—	97.9
	4月末	9,631	0.6	—	0.1	—	—	—	—	97.8
第72期	(期 首)									
	2016年5月16日	9,070	△5.2	—	0.1	—	—	—	—	97.8
	5月末	9,010	—	—	0.1	—	—	—	—	97.8
第73期	(期 末)									
	2016年6月15日	8,985	△0.3	—	0.1	—	—	—	—	97.9
	6月末	8,925	—	—	0.1	—	—	—	—	97.9
第74期	(期 首)									
	2016年7月15日	9,298	—	—	0.1	—	—	—	—	97.9
	7月末	8,806	△1.3	—	0.1	—	—	—	—	97.9
第75期	(期 末)									
	2016年8月15日	9,358	4.9	—	0.1	—	—	—	—	97.9
	8月末	9,172	△1.4	—	0.1	—	—	—	—	97.9
第76期	(期 首)									
	2016年9月15日	8,789	△2.3	—	0.1	—	—	—	—	97.6
	8月末	8,997	—	—	0.1	—	—	—	—	97.6
第77期	(期 末)									
	2016年9月15日	8,789	△2.3	—	0.1	—	—	—	—	97.9
	8月末	8,989	△0.1	—	0.1	—	—	—	—	97.9

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

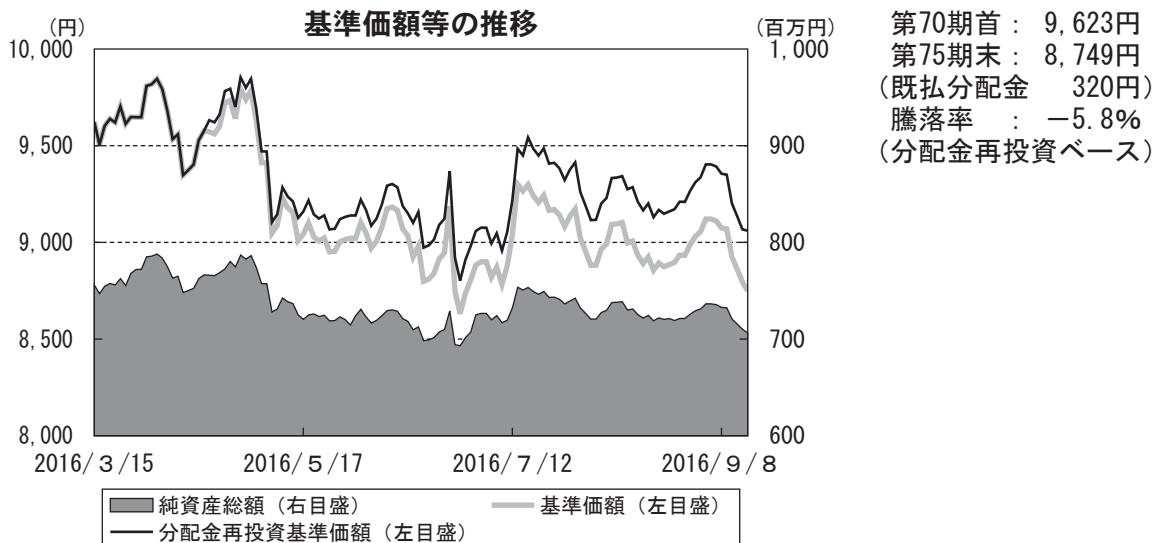
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について（第70期～第75期：2016/3/16～2016/9/15）

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ5.8%（分配金再投資ベース）の下落となりました。



- ・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、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客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。

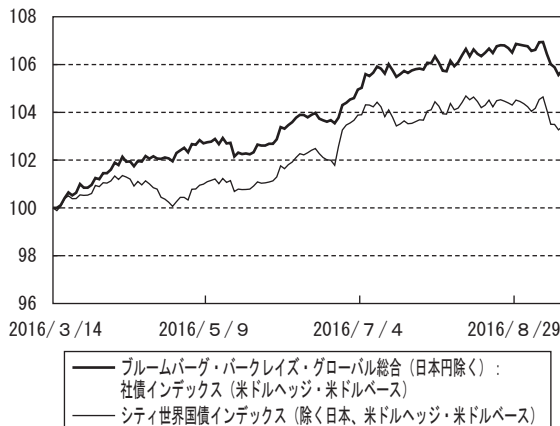
基準価額の主な変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・保有する債券からの利息収入の積み上げが、基準価額の上昇要因となりました。 ・主要国の国債利回りの低下や社債のスプレッド（国債との利回り格差）縮小を受けて、保有する債券の価格が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。 ・原資産通貨*について、原資産通貨売り／豪ドル買いの為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）を得られたことが、基準価額の上昇要因となりました。 <p>*原資産通貨とは、当ファンドが実質的に投資している社債やソブリン債券の発行通貨（米ドルやユーロなど）をいいます。</p>
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・豪ドルが円に対して下落したことが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

（第70期～第75期：2016/3/16～2016/9/15）

投資適格債券市場の推移 （当作成期首を100として指数化）



（注）グラフの数値は、ファンドの基準価額との関連を考慮して、前営業日の値を使用しています。

（注）※ブルームバーク・パークレイズ・グローバル総合（日本円除く）：社債インデックス

ブルームバーク（BLOOMBERG）は、ブルームバーク・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）の商標およびサービスマークです。パークレイズ（BARCLAYS）は、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシー（Barclays Bank Plc）の商標およびサービスマークです。ブルームバーク・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーク」と総称します。）またはブルームバークのライセンサーは、ブルームバーク・パークレイズ・インデックス（BLOOMBERG BARCLAYS INDICES）に対する一切の独占的権利を有しています。

※シティ世界国債インデックス（除く日本）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

◎投資適格債券市況

- ・当作成期の投資適格債券市場は、ソブリン債券、社債ともに上昇しました。
- ・世界国債市場は、米国やユーロ圏など多くの国で利回りが低下（債券価格は上昇）しました。当作成期首から2016年4月上旬にかけては、3月の米連邦公開市場委員会（FOMC）や米連邦準備制度理事会（FRB）議長の講演を受け、世界経済の減速などを背景に米国における利上げのペースが緩やかなものに留まるとの観測が高まったことなどを受け、利回りは低下しました。4月上旬から7月上旬にかけては、5月に発表された4月のFOMC議事録の内容などを受け、米国での早期利上げ観測が高まったことから、利回りが上昇（債券価格は下落）する局面はあったものの、英国における欧州連合（EU）離脱問題を背景に安全資産としての国債に対する需要が高まったことなどから、利回りは低下しましたが、9月に入ると、欧州中央銀行（ECB）の金融政策決定会合で追加の金融緩和策が示されなかったことなどを受けて利回りは上昇しました。
- ・投資適格社債市場は、主要国の国債利回りが低下したことに加えて、スプレッドが縮小したことから上昇しました。

為替市況の推移
（当作成期首を100として指数化）



◎為替市況

- ・豪ドルは、英国のEU離脱問題を背景とするリスク回避の動きや2016年7月に発表された日銀による追加の金融緩和が上場投資信託（ETF）買い入れ額の増額などに留まったことなどを受けて、対円で下落しました。

（注）グラフの数値は、ファンドの基準価額との関連を考慮して、前営業日の値を使用しています。

◎国内短期金融市場

＜無担保コール翌日物金利の推移＞

- ・日銀による金融緩和政策の影響を受けて、無担保コール翌日物金利はおおむね0%を下回る水準で推移しました。日銀のマイナス金利の適用開始を受けて、足元ではマイナス0.06%程度で推移しました。

＜国庫短期証券（3ヵ月物）の利回りの推移＞

- ・日銀による短期国債の買入れや短期国債の需給の引き締めなどから、国庫短期証券（3ヵ月物）の利回りはおおむねマイナス0.1%を下回る水準で推移しました。当作成期首から2016年4月初旬にかけての国庫短期証券（3ヵ月物）の利回りはマイナス0.1%前後で推移していましたが、4月下旬にかけて急低下となり、一時的にマイナス0.3%を下回りました。その後、マイナス0.25%前後で推移していたものの、7月初旬に再度マイナス0.3%を下回りました。8月初旬にかけては、7月末の日銀金融政策決定会合でマイナス金利幅の拡大などが見送られたことや9月の金融政策決定会合で金融政策の総括的な検証を行うとの決定が追加緩和の限界を連想させたことなどからマイナス0.23%程度まで上昇しました。その後、9月の日銀金融政策決定会合でマイナス金利幅を拡大するとの報道などを受けて低下傾向となり、足元ではマイナス0.33%程度で推移しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<世界投資適格債オープン（通貨選択型）豪ドルコース（毎月決算型）>

- ・ 当作成期を通じて、円建の外国投資信託であるワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）受益証券を高位に組み入れ、マネー・プールマザーファンド受益証券にも一部投資を行いました。
- ・ その結果、基準価額（分配金再投資ベース）は当作成期首に比べ、下落しました。

<ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）>

- ・ 米ドルやユーロなど、複数通貨建の日本を除く世界の投資適格格付けを有する社債とソブリン債券を中心に投資を行いました。
- ・ 社債とソブリン債券の投資比率は、当作成期を通じ、概ね社債の投資比率を基本投資比率と比べて低めとし、ソブリン債券の投資比率を高めとしました（基本投資比率は、社債75%程度、ソブリン債券25%程度です。投資環境、流動性などを勘案し、±25%程度の範囲で投資比率の変更を行うことがあります）。ただし、デレージションを加味した実質的な投資比率では、当作成期を通じて、社債のウェイトを高めとしました。
- ・ ソブリン債券については、利回り水準が相対的に高い米国を継続して高位の組み入れとしました。
- ・ 社債については、国別では、底堅い経済成長が見込まれる米国を高位の組み入れとしました。セクター別では、銀行や消費財（非市況）セクターなどを組み入れの中心としました。また、新発債についてもスプレッド水準が魅力的であると判断したものを選別的に組み入れました。
- ・ その結果、主要国の国債利回りの低下や社債のスプレッド縮小による保有債券の価格上昇などが、基準価額にプラスに寄与しました。
- ・ 米ドル以外の通貨建の資産に関しては、実質的に米ドル建となるように為替取引を行いました。米ドル建資産および為替取引を行った実質米ドル建資産に対して、米ドル売り／豪ドル買いの為替取引を行いました。その結果、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）は基準価額にプラスに寄与しました。一方、豪ドルが対円で下落したことが基準価額にマイナスに作用しました。

（注）当記載は、ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンドの資料を基に、三菱UFJ国際投信が作成したものです。

<マネー・プール マザーファンド>

- ・ わが国の国債や短期国債（国庫短期証券）現先取引、コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保や常時適正な流動性の保持を目指した運用を行いました。運用資金に対するマイナス金利適用などから、基準価額は当作成期首と比べて下落しました。

当該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、残存信託期間等を勘案し、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70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期
	2016年3月16日～ 2016年4月15日	2016年4月16日～ 2016年5月16日	2016年5月17日～ 2016年6月15日	2016年6月16日～ 2016年7月15日	2016年7月16日～ 2016年8月15日	2016年8月16日～ 2016年9月15日
当期分配金	60	60	60	60	40	40
（対基準価額比率）	0.623%	0.662%	0.668%	0.641%	0.443%	0.455%
当期の収益	26	22	21	26	19	18
当期の収益以外	33	37	38	33	20	21
翌期繰越分配対象額	3,721	3,684	3,646	3,612	3,591	3,570

（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

<世界投資適格債オープン（通貨選択型）豪ドルコース（毎月決算型）>

◎今後の運用方針

- ・引き続き、当ファンドが主要投資対象とする円建の外国投資信託であるワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）受益証券に投資を行います。また、マネー・プール マザーファンド受益証券への投資も行います。

<ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）>

◎運用環境の見通し

- ・ECBや日銀による金融緩和姿勢は当面続くと見込まれるほか、今後は英国経済に対する見通しの悪化などを受けイングランド銀行（BOE）が追加の金融緩和を行うことも想定され、これらは債券市場全体の下支え要因になることが期待されます。
- ・米国の社債市場については、米国経済の底堅い成長が見込まれることや、先進国の中でも相対的に高い利回り水準を有し、投資家からの需要が期待されることなどから、堅調に推移するとみています。
- ・欧州の社債市場については、ECBによる金融緩和策のひとつである社債の買い入れにより、ボラティリティ（変動性）の低下や同市場への資金流入が見込まれます。

◎今後の運用方針

- ・引き続き、米ドルやユーロなど、複数通貨建の日本を除く世界の投資適格格付けを有する社債とソブリン債券を中心に投資を行うとともに、米ドル以外の通貨建の資産に関しては、実質的に米ドル建となるように為替取引を行います。また、米ドル建資産および為替取引を行った実質米ドル建資産に対しては、原則として米ドル売り／豪ドル買いの為替取引を行います。
- ・組み入れにあたっては、引き続き社債に投資妙味があると考えており、当面はデュレーションを加味した実質的な投資比率では社債のウェイトを高めとする方針を継続します。
- ・社債については、国別では米国を中心に英国やユーロ圏など、幅広く投資を行う方針です。セクター別では、安定的な収益が見込まれる公益セクターなどをポジティブにみています。一方、中国からの需要の動向に不透明感が残る素材やコモディティ関連企業などからの受注低迷が懸念される資本財セクターへは慎重な投資スタンスとしています。

（注）当記載は、ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンドの資料を基に、三菱UFJ国際投信が作成したものです。

<マネー・プール マザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・中国経済の減速などから原油価格が下落したことや為替が円高に推移した結果、物価の伸びは日銀の目標を大幅に下回っています。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・引き続き、わが国の国債や短期国債（国庫短期証券）現先取引、コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保や常時適正な流動性の保持を目指した運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年3月16日～2016年9月15日)

項 目	第70期～第75期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(20)	(0.216)	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)	(0.271)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.016)	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) そ の 他 費 用	0	0.002	(b)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
(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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	46	0.505	
作成期中の平均基準価額は、9,239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) 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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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。

○売買及び取引の状況

(2016年3月16日～2016年9月15日)

投資信託証券

銘 柄		第70期～第75期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）	千口	千円	千口	千円
		100,514	81,131	93,137	74,900

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月16日～2016年9月15日)

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

(2016年9月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第69期末		第75期末			
		口	数	口	数	評 価 額	比 率
			千口		千口	千円	%
ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド (AUDクラス)			879,901		887,279	691,279	97.9
合	計		879,901		887,279	691,279	97.9

(注) 比率は世界投資適格債オープン（通貨選択型）豪ドルコース（毎月決算型）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘	柄	第69期末		第75期末		
		口	数	口	数	評 価 額
			千口		千口	千円
マネー・プール	マザーファンド		995		995	999

○投資信託財産の構成

(2016年9月15日現在)

項	目	第75期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
投資信託受益証券		691,279	97.3
マネー・プール	マザーファンド	999	0.1
コール・ローン等、その他		18,207	2.6
投資信託財産総額		710,485	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第70期末	第71期末	第72期末	第73期末	第74期末	第75期末
	2016年4月15日現在	2016年5月16日現在	2016年6月15日現在	2016年7月15日現在	2016年8月15日現在	2016年9月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	771,532,347	730,599,976	715,213,685	758,983,854	733,984,938	710,485,428
コール・ローン等	20,350,328	20,152,124	19,822,657	19,928,938	20,048,053	18,206,518
投資信託受益証券(評価額)	749,881,783	709,347,616	694,390,792	737,554,879	712,836,848	691,279,072
マネー・ブール マザーファンド(評価額)	1,000,236	1,000,236	1,000,236	1,000,037	1,000,037	999,838
未収入金	300,000	100,000	—	500,000	100,000	—
(B) 負債	5,457,376	5,580,676	5,570,251	5,555,993	3,879,205	4,051,570
未払金	—	100,000	200,000	100,000	—	200,000
未払収益分配金	4,802,119	4,828,051	4,770,970	4,861,841	3,245,842	3,229,795
未払解約金	96	—	—	—	—	—
未払信託報酬	652,366	649,784	596,695	591,595	630,637	619,093
未払利息	—	37	31	24	24	28
その他未払費用	2,795	2,804	2,555	2,533	2,702	2,654
(C) 純資産総額(A-B)	766,074,971	725,019,300	709,643,434	753,427,861	730,105,733	706,433,858
元本	800,353,251	804,675,243	795,161,811	810,306,851	811,460,672	807,448,840
次期繰越損益金	△ 34,278,280	△ 79,655,943	△ 85,518,377	△ 56,878,990	△ 81,354,939	△ 101,014,982
(D) 受益権総口数	800,353,251口	804,675,243口	795,161,811口	810,306,851口	811,460,672口	807,448,840口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,572円	9,010円	8,925円	9,298円	8,997円	8,749円

○損益の状況

項 目	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期
	2016年3月16日～ 2016年4月15日	2016年4月16日～ 2016年5月16日	2016年5月17日～ 2016年6月15日	2016年6月16日～ 2016年7月15日	2016年7月16日～ 2016年8月15日	2016年8月16日～ 2016年9月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	2,742,916	2,473,468	2,328,455	2,159,416	2,200,527	2,100,943
受取配当金	2,742,916	2,474,550	2,329,216	2,160,222	2,201,137	2,101,568
受取利息	—	—	24	16	8	—
支払利息	—	△ 1,082	△ 785	△ 822	△ 618	△ 625
(B) 有価証券売買損益	△ 1,386,994	△ 42,326,550	△ 3,896,477	33,886,393	△ 22,677,905	△ 18,311,478
売買益	17,424,302	146,020	7,345,929	58,828,646	40,781	18,162
売買損	△ 18,811,296	△ 42,472,570	△ 11,242,406	△ 24,942,253	△ 22,718,686	△ 18,329,640
(C) 信託報酬等	△ 655,161	△ 652,588	△ 599,250	△ 594,128	△ 633,339	△ 621,747
(D) 当期損益金(A+B+C)	700,761	△ 40,505,670	△ 2,167,272	35,451,681	△ 21,110,717	△ 16,832,282
(E) 前期繰越損益金	△ 18,270,530	△ 22,205,890	△ 64,683,857	△ 70,914,759	△ 40,229,492	△ 64,238,064
(F) 追加信託差損益金	△ 11,906,392	△ 12,116,332	△ 13,896,278	△ 16,554,071	△ 16,768,888	△ 16,714,841
(配当等相当額)	(192,582,564)	(194,972,661)	(195,759,812)	(202,212,293)	(202,843,332)	(201,879,817)
(売買損益相当額)	(△204,488,956)	(△207,088,993)	(△209,656,090)	(△218,766,364)	(△219,612,220)	(△218,594,658)
(G) 計(D+E+F)	△ 29,476,161	△ 74,827,892	△ 80,747,407	△ 52,017,149	△ 78,109,097	△ 97,785,187
(H) 収益分配金	△ 4,802,119	△ 4,828,051	△ 4,770,970	△ 4,861,841	△ 3,245,842	△ 3,229,795
次期繰越損益金(G+H)	△ 34,278,280	△ 79,655,943	△ 85,518,377	△ 56,878,990	△ 81,354,939	△101,014,982
追加信託差損益金	△ 11,906,392	△ 12,116,332	△ 13,896,278	△ 16,554,071	△ 16,768,888	△ 16,714,841
(配当等相当額)	(192,582,565)	(194,972,662)	(195,759,814)	(202,212,298)	(202,843,333)	(201,879,817)
(売買損益相当額)	(△204,488,957)	(△207,088,994)	(△209,656,092)	(△218,766,369)	(△219,612,221)	(△218,594,658)
分配準備積立金	105,308,053	101,520,296	94,186,914	90,519,569	88,627,612	86,400,395
繰越損益金	△127,679,941	△169,059,907	△165,809,013	△130,844,488	△153,213,663	△170,700,536

(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 785,545,923円

 作成期中追加設定元本額 78,326,724円

 作成期中一部解約元本額 56,423,807円

 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8749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101,014,982円です。

③分配金の計算過程

項 目	2016年3月16日～ 2016年4月15日	2016年4月16日～ 2016年5月16日	2016年5月17日～ 2016年6月15日	2016年6月16日～ 2016年7月15日	2016年7月16日～ 2016年8月15日	2016年8月16日～ 2016年9月15日
費用控除後の配当等収益額	2,088,560円	1,821,674円	1,730,134円	2,124,686円	1,568,094円	1,480,097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	192,582,565円	194,972,662円	195,759,814円	202,212,298円	202,843,333円	201,879,817円
分配準備積立金額	108,021,612円	104,526,673円	97,227,750円	93,256,724円	90,305,360円	88,150,093円
当ファンドの分配対象収益額	302,692,737円	301,321,009円	294,717,698円	297,593,708円	294,716,787円	291,510,007円
1万口当たり収益分配対象額	3,781円	3,744円	3,706円	3,672円	3,631円	3,610円
1万口当たり分配金額	60円	60円	60円	60円	40円	40円
収益分配金金額	4,802,119円	4,828,051円	4,770,970円	4,861,841円	3,245,842円	3,229,795円

○分配金のお知らせ

	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期
1万口当たり分配金（税込み）	60円	60円	60円	60円	40円	40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。

※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に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（<http://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。）の税率が適用されます。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年9月15日現在）

＜マネー・プール マザーファンド＞

下記は、マネー・プール マザーファンド全体(246,739千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第75期末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	150,000 (150,000)	150,031 (150,031)	60.5 (60.5)	— (—)	— (—)	— (—)	60.5 (60.5)
合 計	150,000 (150,000)	150,031 (150,031)	60.5 (60.5)	— (—)	— (—)	— (—)	60.5 (60.5)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	第75期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第282回利付国債（10年）	1.7	150,000	150,031	2016/9/20
合 計		150,000	150,031	

〈参考〉投資する投資信託証券およびその概要

当ファンドは、世界投資適格債オープン（通貨選択型）豪ドルコース（毎月決算型）が投資対象とする円建の外国投資信託証券です。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

投資信託証券	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（AUDクラス）
運用方針	<ol style="list-style-type: none"> 1. 日本を除く世界の投資適格格付け（BBB格相当以上）を有する社債とソブリン債券を中心に投資を行います。 2. 当ファンドにおいて、米ドルやユーロなど複数通貨建の資産に投資しますが、原則として以下の為替取引を行います。 <ol style="list-style-type: none"> （1）米ドル以外の通貨建の資産に関しては、実質的に米ドル建となるように為替取引を行います。 （2）米ドル建資産および（1）で為替取引を行った実質米ドル建資産に対して、原則として、外国為替予約取引および直物為替先渡取引（NDF）等を活用し、実質的に豪ドル建となるように為替取引を行います。 3. 投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等の場合をいいます。）の発生を含む市況動向や資金動向、残存信託期間等の事情によっては、前記のような運用ができない場合があります。
投資顧問会社	JPMorgan・アセット・マネジメント（UK）リミテッド*
信託期限	無期限
設定日	2010年4月16日
会計年度	毎年12月末
収益分配方針	原則として、毎月分配を行います。

※JPMorgan・アセット・マネジメント（UK）リミテッド（所在地：英国ロンドン）は、1974年2月に英国において設立された運用会社であり、JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー傘下の資産運用部門である「JPMorgan・アセット・マネジメント」グループに所属しています。

ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド

損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なFinancial Statementsから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

(2015年12月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

投資収益

受取利息(外国税額控除後)

投資収益合計

\$	8,044,513
	<u>8,044,513</u>

費用

投資顧問料

保管費用

会計処理および管理手数料

専門家報酬

名義書換事務代行手数料

受託者報酬

登録手数料

その他の費用

費用合計

1,325,244

355,900

326,633

68,107

53,435

8,100

5,964

621

2,144,004

投資純利益

5,900,509

実現および未実現損益：

実現損益：

投資有価証券

先物取引

外国通貨取引および為替予約取引

実現純損益

(5,785,616)

513,600

(2,947,515)

(8,219,531)

未実現評価損益の純変動：

投資有価証券

先物取引

外国通貨取引および為替予約取引

未実現評価損益の純変動

(13,927,311)

260,394

3,710,874

(9,956,043)

実現および未実現損益（純額）

(18,175,574)

営業活動による純資産の増減（純額）

\$ (12,275,065)

(注) () 内の金額は、マイナスの金額です。

2. 純資産変動計算書

(2015年12月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

運用による純資産の増減額:

投資純利益	\$	5,900,509
実現純損失		(8,219,531)
未実現評価損益の純変動		(9,956,043)
運用による純資産の増減額		(12,275,065)

分配額		(10,125,662)
ファンドユニットの取引による純資産の増減額		112,486,752
純資産の増減額		90,086,025

純資産

期首		210,297,327
期末	\$	300,383,352

	AUDクラス	BRLクラス	GNVクラス
ファンドユニット取引			
ユニット数			
発行	276,551,519	323,831,100	9,819,011
買戻し	38,968,955	337,178,655	5,811,669
償還	(318,873,298)	(1,045,110,175)	(43,755,514)
ユニット増減数	(3,352,824)	(384,100,420)	(28,124,834)
金額			
発行	\$ 2,023,387	\$ 1,763,741	\$ 107,664
買戻し	290,443	1,730,427	63,418
償還	(2,344,462)	(5,232,997)	(466,767)
ファンドユニット取引による増減額	\$ (30,632)	\$ (1,738,829)	\$ (295,685)

	IDRクラス	JPYクラス	USDクラス
ファンドユニット取引			
ユニット数			
発行	14,101,231	22,009,846,400	300,834,705
買戻し	101,274,354	758,734,917	19,919,314
償還	(346,623,699)	(10,261,041,997)	(236,224,820)
ユニット増減数	(231,248,114)	12,507,539,320	84,529,199
金額			
発行	\$ 103,188	\$ 160,064,836	\$ 3,030,275
買戻し	719,586	5,342,633	200,579
償還	(2,444,387)	(71,187,526)	(2,327,652)
ファンドユニット取引による増減額	\$ (1,621,613)	\$ 94,219,943	\$ 903,202

USD-hedged (F) クラス

ファンドユニット取引	
ユニット数	
発行	4,217,201,969
買戻し	191,100,992
償還	(2,140,263,828)
ユニット増減数	2,268,039,133
金額	
発行	\$ 38,701,461
買戻し	1,778,576
償還	(19,429,671)
ファンドユニット取引による増減額	\$ 21,050,366

3. 投資明細表

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%)		
		AUSTRALIA (1.6%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (1.1%)		
USD	165,000	BHP Billiton Finance USA, Ltd. 5.00% due 09/30/43	\$	149,520
USD	235,000	Rio Tinto Finance USA, Ltd. 3.75% due 06/15/25		213,489
EUR	1,129,000	Scentre Management, Ltd. 1.50% due 07/16/20		1,244,410
EUR	800,000	Sydney Airport Finance Co. Pty, Ltd. 2.75% due 04/23/24		902,378
EUR	800,000	Transurban Finance Co. Pty, Ltd. 1.88% due 09/16/24		851,104
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		3,360,901
		GOVERNMENT BONDS (0.5%)		
AUD	1,090,000	Australia Government Bond 2.75% due 04/21/24		793,600
AUD	820,000	5.75% due 05/15/21		700,489
		TOTAL GOVERNMENT BONDS		1,494,089
		TOTAL AUSTRALIA (Cost \$5,679,951)		4,854,990
		BELGIUM (0.3%)		
		GOVERNMENT BOND (0.3%)		
EUR	545,000	Belgium Government Bond 4.25% due 03/28/41 (a)		867,906
		TOTAL GOVERNMENT BOND		867,906
		TOTAL BELGIUM (Cost \$984,745)		867,906
		CANADA (1.7%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (0.4%)		
USD	575,000	Air Canada 2015-2 Class AA Pass-Through Trust 3.75% due 12/15/27 (a)		576,437
USD	140,000	Barrick Gold Corp. 5.25% due 04/01/42		94,272
USD	170,000	Encana Corp. 5.15% due 11/15/41		113,571
USD	475,000	Xstrata Finance Canada, Ltd. 5.55% due 10/25/42 (a)		336,300
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		1,120,580
		GOVERNMENT BONDS (1.3%)		
CAD	2,680,000	Canadian Government Bond 2.50% due 06/01/24		2,119,286
CAD	560,000	3.50% due 12/01/45		525,770
CAD	720,000	5.00% due 06/01/37		776,343
CAD	410,000	5.75% due 06/01/33		458,265
		TOTAL GOVERNMENT BONDS		3,879,664
		TOTAL CANADA (Cost \$5,599,224)		5,000,244
		DENMARK (0.4%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (0.4%)		
EUR	970,000	Danske Bank AS 3.88% due 10/04/23 (b)		1,122,332
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		1,122,332
		TOTAL DENMARK (Cost \$1,347,197)		1,122,332
		FRANCE (6.0%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (4.7%)		
EUR	600,000	Arkema S.A. 1.50% due 01/20/25		626,446

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
		FRANCE (6.0%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (4.7%) (continued)		
		Banque Federative du Credit Mutuel S.A.		
USD	605,000	2.75% due 10/15/20 (a)	\$	607,471
		BPCE S.A.		
EUR	500,000	2.75% due 11/30/27 (b)		544,493
USD	565,000	4.00% due 04/15/24		580,483
USD	485,000	4.50% due 03/15/25 (a)		465,499
		Cie de Saint-Gobain		
GBP	450,000	5.63% due 11/15/24		763,977
		Credit Agricole S.A.		
USD	510,000	2.75% due 06/10/20 (a)		512,735
USD	895,000	3.88% due 04/15/24 (a)		919,422
		Engie S.A.		
EUR	500,000	1.50% due 03/13/35		480,261
		Imerys S.A.		
EUR	1,100,000	2.00% due 12/10/24		1,215,070
EUR	500,000	2.50% due 11/26/20		576,914
		Infra Foch SAS		
EUR	700,000	1.25% due 10/16/20		766,464
		Orange S.A.		
EUR	1,050,000	3.88% due 01/14/21		1,309,348
		Pernod Ricard S.A.		
EUR	500,000	2.00% due 06/22/20		567,883
		RCI Banque S.A.		
EUR	392,000	0.63% due 03/04/20		417,763
		Societe Des Autoroutes Paris-Rhin-Rhone		
EUR	500,000	1.13% due 01/15/21		545,889
EUR	600,000	5.00% due 01/12/17		683,562
		Societe Generale S.A.		
USD	425,000	5.63% due 11/24/45 (a)		406,875
		Unibail-Rodamco SE		
EUR	670,000	1.00% due 03/14/25		684,435
EUR	866,000	1.38% due 10/17/22		948,668
		Veolia Environnement S.A.		
GBP	350,000	6.13% due 10/29/37		655,438
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		14,279,096
		GOVERNMENT BONDS (1.3%)		
		France Government Bond OAT		
EUR	910,000	1.75% due 11/25/24		1,068,473
EUR	330,000	3.25% due 05/25/45		455,509
EUR	360,000	4.50% due 04/25/41		593,865
EUR	1,087,000	4.75% due 04/25/35		1,766,469
		TOTAL GOVERNMENT BONDS		3,884,316
		TOTAL FRANCE (Cost \$19,128,739)		18,163,412
		GERMANY (0.4%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (0.4%)		
		Allianz SE		
EUR	600,000	5.63% due 10/17/42 (b)		762,310
		Volkswagen Leasing GmbH		
EUR	317,000	2.63% due 01/15/24		354,307
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		1,116,617
		TOTAL GERMANY (Cost \$1,264,545)		1,116,617
		IRELAND (1.6%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (1.6%)		
		GE Capital European Funding		
EUR	279,000	0.80% due 01/21/22		299,233

(2015年12月31日現在)

元本金額	銘柄名	公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)	
	IRELAND (1.6%) (continued)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (1.6%) (continued)	
EUR 1,900,000	GE Capital European Funding 3.75% due 04/04/16	\$ 2,083,497
EUR 600,000	4.63% due 02/22/27	844,754
USD 1,292,000	GE Capital International Funding Co. 2.34% due 11/15/20 (a)	1,282,534
USD 200,000	Perrigo Finance PLC 3.50% due 12/15/21	194,500
USD 200,000	3.90% due 12/15/24	193,071
	TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	4,897,589
	TOTAL IRELAND (Cost \$5,404,801)	4,897,589
	ISRAEL (0.1%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.1%)	
USD 270,000	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 2.95% due 12/18/22	258,596
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	258,596
	TOTAL ISRAEL (Cost \$269,746)	258,596
	ITALY (4.2%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.5%)	
EUR 1,200,000	Snam SpA 3.38% due 01/29/21	1,456,589
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	1,456,589
	GOVERNMENT BONDS (3.7%)	
EUR 1,490,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.50% due 06/01/25	1,620,342
EUR 3,000,000	2.00% due 12/01/25	3,376,087
EUR 3,470,000	2.50% due 12/01/24	4,095,557
EUR 350,000	4.00% due 02/01/37	474,179
EUR 475,000	4.75% due 09/01/44 (a)	729,110
EUR 630,000	6.00% due 05/01/31	1,032,524
	TOTAL GOVERNMENT BONDS	11,327,799
	TOTAL ITALY (Cost \$12,958,349)	12,784,388
	LUXEMBOURG (0.5%)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (0.5%)	
USD 425,000	Actavis Funding SCS 3.00% due 03/12/20	424,661
USD 760,000	3.80% due 03/15/25	756,189
USD 380,000	4.75% due 03/15/45	370,446
	TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	1,551,296
	TOTAL LUXEMBOURG (Cost \$1,559,592)	1,551,296
	MEXICO (0.3%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.2%)	
USD 440,000	America Movil SAB de CV 3.13% due 07/16/22	432,330
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	432,330
	GOVERNMENT BONDS (0.1%)	
EUR 125,000	Mexico Government International Bond 1.63% due 03/06/24	129,808
EUR 247,000	United Mexican States 2.38% due 04/09/21	278,504
	TOTAL GOVERNMENT BONDS	408,312
	TOTAL MEXICO (Cost \$894,911)	840,642

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
		NETHERLANDS (4.9%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (4.6%)		
USD	390,000	ABN AMRO Bank NV 6.25% due 04/27/22	\$	428,463
EUR	1,050,000	Airbus Group Finance BV 2.13% due 10/29/29		1,176,841
EUR	200,000	Allianz Finance II BV 5.75% due 07/08/41 (b)		251,400
EUR	555,000	BMW Finance NV 1.00% due 01/21/25		575,124
USD	595,000	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA 5.25% due 08/04/45		623,495
GBP	1,470,000	Deutsche Telekom International Finance BV 6.50% due 04/08/22		2,629,190
EUR	400,000	EDP Finance BV 2.00% due 04/22/25		396,772
EUR	1,400,000	Enel Finance International NV 4.88% due 04/17/23		1,885,795
GBP	500,000	Gas Natural Fenosa Finance BV 5.63% due 08/14/24		862,212
EUR	1,000,000	Iberdrola International BV 3.88% due 04/11/22		1,243,283
EUR	300,000	2.50% due 10/24/22		350,584
EUR	1,000,000	3.00% due 01/31/22		1,201,524
EUR	581,000	KBC Internationale Financieringsmaatschappij NV 4.50% due 03/27/17		664,613
USD	215,000	LYB International Finance BV 4.88% due 03/15/44		196,325
USD	165,000	Shell International Finance BV 4.55% due 08/12/43		160,379
USD	1,025,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 2.90% due 05/27/22 (a)		1,025,257
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		13,671,257
		GOVERNMENT BOND (0.3%)		
EUR	605,000	Netherlands Government Bond 4.00% due 01/15/37 (a)		963,816
		TOTAL GOVERNMENT BOND		963,816
		TOTAL NETHERLANDS (Cost \$15,575,293)		14,635,073
		SINGAPORE (0.1%)		
		CORPORATE BOND & NOTE (0.1%)		
USD	225,000	HPHT Finance 15 Ltd. 2.25% due 03/17/18 (a)		223,495
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE		223,495
		TOTAL SINGAPORE (Cost \$224,644)		223,495
		SPAIN (3.1%)		
		CORPORATE BOND & NOTE (0.9%)		
EUR	2,200,000	Telefonica Emisiones SAU 3.99% due 01/23/23		2,710,028
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE		2,710,028
		GOVERNMENT BONDS (2.2%)		
EUR	900,000	Spain Government Bond 1.40% due 01/31/20		1,011,636
EUR	1,600,000	2.15% due 10/31/25 (a)		1,797,161
EUR	2,405,000	2.75% due 10/31/24 (a)		2,851,605
EUR	210,000	5.15% due 10/31/44 (a)		323,243

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名	公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)	
		SPAIN (3.1%) (continued)	
		GOVERNMENT BONDS (2.2%) (continued)	
		Spain Government Bond	
EUR	410,000	5.75% due 07/30/32	\$ 646,034
		TOTAL GOVERNMENT BONDS	6,629,679
		TOTAL SPAIN (Cost \$9,811,141)	9,339,707
		SUPRANATIONAL (2.3%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (2.3%)	
		European Stability Mechanism	
EUR	2,844,045	2.13% due 11/20/23	3,458,166
		European Union	
EUR	2,770,000	2.75% due 09/21/21	3,439,704
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	6,897,870
		TOTAL SUPRANATIONAL (Cost \$7,373,828)	6,897,870
		SWEDEN (0.8%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (0.8%)	
		Skandinaviska Enskilda Banken AB	
USD	700,000	2.38% due 11/20/18 (a)	703,851
EUR	726,000	2.50% due 05/28/26 (b)	804,200
		Svenska Handelsbanken AB	
EUR	348,000	2.66% due 01/15/24 (b)	393,057
		Swedbank AB	
EUR	500,000	3.00% due 12/05/22 (b)	564,882
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	2,465,990
		TOTAL SWEDEN (Cost \$2,822,586)	2,465,990
		SWITZERLAND (1.4%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (1.4%)	
		Credit Suisse	
USD	570,000	3.00% due 10/29/21	568,033
USD	860,000	3.63% due 09/09/24	867,068
		UBS AG	
USD	1,985,000	1.80% due 03/26/18	1,981,800
USD	790,000	2.38% due 08/14/19	789,347
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	4,206,248
		TOTAL SWITZERLAND (Cost \$4,228,438)	4,206,248
		UNITED KINGDOM (15.1%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (9.4%)	
		Abbey National Treasury Services PLC	
EUR	213,000	1.13% due 01/14/22	228,611
EUR	762,000	2.00% due 01/14/19	860,944
		Aviva PLC	
EUR	1,034,000	6.13% due 07/05/43 (b)	1,314,728
		Barclays PLC	
USD	1,430,000	2.00% due 03/16/18	1,421,466
		BAT International Finance PLC	
USD	146,000	3.25% due 06/07/22 (a)	146,301
USD	390,000	3.50% due 06/15/22 (a)	400,025
GBP	285,000	4.00% due 09/04/26	441,024
		BP Capital Markets PLC	
USD	255,000	3.06% due 03/17/22	250,044
USD	560,000	3.54% due 11/04/24	544,672
		Eversholt Funding PLC	
GBP	650,000	6.36% due 12/02/25	1,183,759
		FCE Bank PLC	
EUR	1,200,000	1.88% due 06/24/21	1,325,307

(2015年12月31日現在)

元本金額	銘柄名		公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
	UNITED KINGDOM (15.1%) (continued)		
	CORPORATE BONDS & NOTES (9.4%) (continued)		
GBP 1,105,000	Gatwick Funding, Ltd. 5.25% due 01/23/24	\$	1,849,687
GBP 500,000	GlaxoSmithKline Capital PLC 4.25% due 12/18/45		787,341
GBP 393,600	Great Rolling Stock Co., Ltd. 6.50% due 04/05/31		729,337
EUR 1,155,000	Hammerson PLC 2.00% due 07/01/22		1,277,428
EUR 690,000	Heathrow Funding, Ltd. 1.50% due 02/11/30		665,520
GBP 700,000	6.00% due 03/20/20		1,156,522
GBP 430,000	6.75% due 12/03/26		824,736
USD 1,090,000	Imperial Tobacco Finance PLC 3.75% due 07/21/22 (a)		1,094,488
GBP 500,000	5.50% due 09/28/26		858,376
EUR 856,000	Lloyds Bank PLC 1.25% due 01/13/25		908,488
GBP 150,000	9.63% due 04/06/23		297,307
EUR 300,000	11.88% due 12/16/21 (b)		359,625
USD 1,075,000	Lloyds Banking Group PLC 4.50% due 11/04/24		1,091,392
GBP 350,000	National Express Group PLC 6.25% due 01/13/17		539,458
USD 595,000	Nationwide Building Society 2.35% due 01/21/20 (a)		590,998
EUR 800,000	4.13% due 03/20/23 (b)		921,985
GBP 700,000	Porterbrook Rail Finance, Ltd. 5.50% due 04/20/19		1,132,907
GBP 100,000	Prudential PLC 6.13% due 12/19/31		169,848
GBP 800,000	11.38% due 05/29/39 (b)		1,466,718
USD 645,000	Santander UK Group Holdings PLC 4.75% due 09/15/25 (a)		636,491
USD 340,000	Santander UK PLC 5.00% due 11/07/23 (a)		353,923
EUR 400,000	Sky PLC 1.50% due 09/15/21		436,222
GBP 423,000	Standard Life PLC 5.50% due 12/04/42 (b)		654,771
EUR 150,000	Wellcome Trust, Ltd. 1.13% due 01/21/27		154,871
GBP 400,000	Western Power Distribution South Wales PLC 5.75% due 03/23/40		741,840
GBP 250,000	Yorkshire Water Services Bradford Finance, Ltd. 6.38% due 08/19/39		500,892
	TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		28,318,052
	GOVERNMENT BONDS (5.7%)		
GBP 5,230,000	United Kingdom Gilt 2.00% due 09/07/25		7,751,083
GBP 367,753	4.25% due 12/07/40		700,395
GBP 130,000	4.25% due 12/07/55		275,780
GBP 1,765,000	4.75% due 12/07/30		3,412,779
GBP 2,625,000	5.00% due 03/07/25		4,904,142
	TOTAL GOVERNMENT BONDS		17,044,179
	TOTAL UNITED KINGDOM (Cost \$47,885,116)		45,362,231

(2015年12月31日現在)

元本金額	銘柄名	公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)	
	UNITED STATES (50.6%)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (40.3%)	
USD 350,000	21st Century Fox America, Inc. 3.70% due 10/15/25 (a)	\$ 349,369
USD 160,000	4.95% due 10/15/45 (a)	157,586
USD 155,000	5.40% due 10/01/43 AbbVie, Inc.	161,328
USD 340,000	3.20% due 11/06/22	334,814
USD 735,000	3.60% due 05/14/25	725,491
USD 450,000	ACE INA Holdings, Inc. 2.88% due 11/03/22	446,859
USD 150,000	4.35% due 11/03/45	152,436
USD 560,000	Actavis, Inc. 3.25% due 10/01/22	550,838
USD 180,000	Aetna, Inc. 3.50% due 11/15/24	179,813
USD 810,000	Altria Group, Inc. 4.25% due 08/09/42	743,160
USD 320,000	Amazon.com, Inc. 4.95% due 12/05/44	340,933
USD 202,598	American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.00% due 07/15/25	204,624
USD 250,000	American Express Co. 3.63% due 12/05/24	244,668
USD 260,000	American International Group, Inc. 3.88% due 01/15/35	229,298
USD 235,000	4.50% due 07/16/44	217,339
USD 475,000	4.80% due 07/10/45	459,299
USD 160,000	American Tower Corp. 4.00% due 06/01/25	157,297
USD 785,000	Amgen, Inc. 3.63% due 05/22/24	785,101
USD 455,000	Anadarko Petroleum Corp. 6.38% due 09/15/17	477,114
USD 795,000	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 2.63% due 01/17/23	763,282
USD 119,000	3.70% due 02/01/24	121,464
USD 185,000	4.63% due 02/01/44	183,732
USD 165,000	Anthem, Inc. 2.30% due 07/15/18	164,724
USD 150,000	3.50% due 08/15/24	146,470
USD 475,000	5.10% due 01/15/44	476,480
USD 410,000	Apple, Inc. 2.50% due 02/09/25	392,320
USD 1,500,000	2.85% due 05/06/21	1,536,843
USD 240,000	3.85% due 05/04/43	221,130
USD 852,000	AT&T, Inc. 3.40% due 05/15/25	818,955
USD 590,000	3.90% due 03/11/24	602,745
USD 1,270,000	4.30% due 12/15/42	1,085,078
USD 415,000	4.80% due 06/15/44	380,197
USD 195,000	Atmos Energy Corp. 4.13% due 10/15/44	186,727
USD 705,000	Baltimore Gas & Electric Co. 2.80% due 08/15/22	698,578
USD 100,000	3.35% due 07/01/23	101,276
USD 580,000	Bank of America Corp. 2.00% due 01/11/18	579,314
USD 700,000	2.25% due 04/21/20	683,266

(2015年12月31日現在)

元本金額	銘柄名	公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)	
	UNITED STATES (50.6%) (continued)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (40.3%) (continued)	
	Bank of America Corp.	
USD 1,080,000	2.63% due 10/19/20	\$ 1,066,890
USD 760,000	2.65% due 04/01/19	761,682
USD 1,150,000	3.88% due 03/22/17	1,179,381
USD 245,000	3.95% due 04/21/25	238,596
USD 795,000	4.25% due 10/22/26	786,999
GBP 200,000	6.13% due 09/15/21	344,611
	Bank of America N.A.	
USD 1,245,000	1.75% due 06/05/18	1,238,001
	Baxalta, Inc.	
USD 265,000	3.60% due 06/23/22 (a)	265,071
USD 415,000	4.00% due 06/23/25 (a)	410,911
USD 175,000	5.25% due 06/23/45 (a)	175,548
	Berkshire Hathaway Energy Co.	
USD 1,485,000	3.50% due 02/01/25	1,472,712
	Berkshire Hathaway, Inc.	
USD 605,000	4.50% due 02/11/43	608,725
	Biogen, Inc.	
USD 600,000	2.90% due 09/15/20	598,683
USD 340,000	5.20% due 09/15/45	340,097
	Branch Banking & Trust Co.	
USD 600,000	3.63% due 09/16/25	605,941
	Burlington Northern Santa Fe LLC	
USD 690,000	4.55% due 09/01/44	666,439
USD 130,000	4.70% due 09/01/45	129,629
	Capital One Bank USA N.A.	
USD 1,125,000	3.38% due 02/15/23	1,101,411
	Capital One N.A.	
USD 335,000	1.65% due 02/05/18	331,677
USD 860,000	2.40% due 09/05/19	850,947
	CCO Safari II LLC	
USD 330,000	4.46% due 07/23/22 (a)	328,851
USD 275,000	6.48% due 10/23/45 (a)	275,098
	Celgene Corp.	
USD 365,000	2.88% due 08/15/20	362,391
USD 150,000	5.00% due 08/15/45	150,574
	CF Industries, Inc.	
USD 85,000	4.95% due 06/01/43	72,271
	Cigna Corp.	
USD 570,000	4.00% due 02/15/22	589,292
	Cisco Systems, Inc.	
USD 70,000	3.50% due 06/15/25	72,072
USD 240,000	3.63% due 03/04/24	250,564
USD 380,000	4.45% due 01/15/20	413,615
	Citigroup, Inc.	
USD 790,000	1.75% due 05/01/18	783,369
EUR 475,000	1.75% due 01/28/25	507,790
USD 755,000	2.65% due 10/26/20	749,517
USD 655,000	3.30% due 04/27/25	643,333
USD 400,000	4.30% due 11/20/26	398,280
USD 240,000	4.40% due 06/10/25	242,515
USD 505,000	4.45% due 09/29/27	501,994
	Columbia Pipeline Group, Inc.	
USD 160,000	2.45% due 06/01/18 (a)	156,452
	Comcast Corp.	
USD 505,000	4.60% due 08/15/45	511,274

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
		UNITED STATES (50.6%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (40.3%) (continued)		
		Consolidated Edison Co. of New York, Inc.		
USD	280,000	4.63% due 12/01/54	\$	275,275
		CVS Health Corp.		
USD	275,000	3.88% due 07/20/25		280,705
USD	613,000	4.00% due 12/05/23		637,073
USD	365,000	5.13% due 07/20/45		384,503
		CVS Pass-Through Trust		
USD	146,933	4.70% due 01/10/36 (a)		148,456
		Daimler Finance North America LLC		
USD	205,000	1.38% due 08/01/17 (a)		203,155
USD	2,000,000	1.45% due 08/01/16 (a)		2,002,796
		Devon Energy Corp.		
USD	1,020,000	3.25% due 05/15/22		867,397
		DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Co., Inc.		
USD	1,180,000	4.45% due 04/01/24		1,212,067
		Discover Bank		
USD	955,000	2.00% due 02/21/18		948,688
USD	940,000	4.20% due 08/08/23		960,372
		Dominion Resources, Inc.		
USD	224,000	4.45% due 03/15/21		237,145
USD	795,000	4.70% due 12/01/44		774,331
		Dow Chemical Co.		
USD	155,000	4.63% due 10/01/44		141,786
		Duke Energy Corp.		
USD	540,000	3.05% due 08/15/22		532,458
USD	976,000	3.75% due 04/15/24		989,601
USD	885,000	5.05% due 09/15/19		963,026
		Duke Energy Progress, Inc.		
USD	115,000	4.15% due 12/01/44		112,313
		Duke Realty LP		
USD	460,000	3.63% due 04/15/23		449,497
		Energy Transfer Partners LP		
USD	510,000	4.75% due 01/15/26		438,961
		Entergy Corp.		
USD	435,000	4.00% due 07/15/22		443,828
		Enterprise Products Operating LLC		
USD	335,000	3.90% due 02/15/24		312,678
USD	175,000	4.90% due 05/15/46		142,971
		Exelon Generation Co. LLC		
USD	490,000	2.95% due 01/15/20		488,391
		Express Scripts Holding Co.		
USD	690,000	3.90% due 02/15/22		709,041
USD	265,000	4.75% due 11/15/21		284,197
		FirstEnergy Transmission LLC		
USD	120,000	5.45% due 07/15/44 (a)		120,815
		Ford Motor Credit Co. LLC		
USD	870,000	3.00% due 06/12/17		878,493
USD	1,075,000	3.66% due 09/08/24		1,046,151
		Freeport-McMoRan, Inc.		
USD	860,000	3.55% due 03/01/22		498,800
USD	260,000	4.55% due 11/14/24		148,850
USD	310,000	5.45% due 03/15/43		161,200
		General Electric Co.		
USD	230,000	4.13% due 10/09/42		224,661
USD	585,000	4.50% due 03/11/44		602,003
		General Motors Co.		
USD	300,000	5.20% due 04/01/45		282,429

(2015年12月31日現在)

元本金額	銘柄名	公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)	
	UNITED STATES (50.6%) (continued)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (40.3%) (continued)	
USD 1,790,000	General Motors Financial Co., Inc. 3.10% due 01/15/19	\$ 1,787,778
USD 730,000	3.45% due 04/10/22	700,671
USD 300,000	Gilead Sciences, Inc. 3.25% due 09/01/22	302,178
USD 570,000	4.50% due 02/01/45	557,791
USD 155,000	4.80% due 04/01/44	155,489
USD 395,000	Glencore Funding LLC 4.00% due 04/16/25 (a)	274,525
EUR 1,087,000	Goldman Sachs Group, Inc. 2.63% due 08/19/20	1,263,329
USD 2,571,000	3.50% due 01/23/25	2,528,774
USD 90,000	3.63% due 01/22/23	91,056
USD 650,000	3.85% due 07/08/24	663,646
USD 245,000	4.25% due 10/21/25	243,280
USD 245,000	5.15% due 05/22/45	237,823
USD 200,000	Harris Corp. 3.83% due 04/27/25	197,004
USD 385,000	5.05% due 04/27/45	376,956
USD 465,000	HCP, Inc. 3.88% due 08/15/24	450,686
USD 170,000	4.20% due 03/01/24	168,997
USD 165,000	Home Depot, Inc. 4.25% due 04/01/46	168,667
USD 695,000	HSBC USA, Inc. 2.35% due 03/05/20	687,123
USD 2,735,000	2.38% due 11/13/19	2,724,446
USD 895,000	2.75% due 08/07/20	895,472
USD 350,000	Intel Corp. 3.70% due 07/29/25	362,084
USD 340,000	4.90% due 07/29/45	359,413
USD 260,000	International Business Machines Corp. 3.38% due 08/01/23	264,112
USD 330,000	ITC Holdings Corp. 3.65% due 06/15/24	325,235
USD 425,000	Kimco Realty Corp. 3.20% due 05/01/21	425,504
USD 175,000	3.40% due 11/01/22	173,451
USD 350,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 3.50% due 03/01/21	313,363
USD 255,000	3.50% due 09/01/23	211,544
USD 65,000	5.00% due 08/15/42	47,961
USD 668,000	Kinder Morgan, Inc. 5.55% due 06/01/45	521,649
USD 515,000	Kohl's Corp. 5.55% due 07/17/45	479,337
USD 390,000	Kraft Heinz Foods Co. 5.20% due 07/15/45 (a)	407,235
USD 295,000	Liberty Property LP 4.40% due 02/15/24	299,039
USD 565,000	Lockheed Martin Corp. 3.55% due 01/15/26	567,901
USD 220,000	4.70% due 05/15/46	226,384
USD 830,000	LyondellBasell Industries NV 5.00% due 04/15/19	882,931
USD 280,000	Manufacturers & Traders Trust Co. 2.90% due 02/06/25	271,232

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
		UNITED STATES (50.6%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (40.3%) (continued)		
		McDonald's Corp.		
USD	270,000	4.60% due 05/26/45	\$	259,613
USD	215,000	4.88% due 12/09/45		216,158
		McKesson Corp.		
USD	420,000	2.28% due 03/15/19		418,376
USD	475,000	2.85% due 03/15/23		455,886
		Medtronic, Inc.		
USD	625,000	3.15% due 03/15/22		631,930
		MetLife, Inc.		
USD	1,205,000	3.05% due 12/15/22		1,203,262
USD	315,000	4.05% due 03/01/45		291,843
USD	185,000	4.72% due 12/15/44		188,932
		Metropolitan Life Global Funding I		
EUR	400,000	0.88% due 01/20/22		427,893
USD	494,000	3.00% due 01/10/23 (a)		491,558
		Microsoft Corp.		
USD	640,000	3.75% due 02/12/45		589,705
USD	470,000	4.45% due 11/03/45		484,708
		Mississippi Power Co.		
USD	316,000	4.25% due 03/15/42		241,582
		Mondelez International, Inc.		
EUR	264,000	2.38% due 03/06/35		248,419
		Morgan Stanley		
USD	395,000	2.50% due 01/24/19		397,242
USD	1,155,000	3.70% due 10/23/24		1,160,660
USD	36,000	3.75% due 02/25/23		36,897
USD	80,000	3.88% due 04/29/24		81,557
USD	365,000	3.95% due 04/23/27		354,413
USD	550,000	4.00% due 07/23/25		566,849
USD	80,000	4.30% due 01/27/45		76,278
EUR	750,000	5.38% due 08/10/20		973,292
USD	400,000	5.55% due 04/27/17		419,712
		MPLX LP		
USD	195,000	4.00% due 02/15/25		163,959
		MUFG Americas Holdings Corp.		
USD	375,000	2.25% due 02/10/20		368,868
USD	260,000	3.00% due 02/10/25		249,054
		Mylan, Inc.		
USD	110,000	2.60% due 06/24/18		109,166
		National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.		
USD	215,000	2.85% due 01/27/25		209,466
		NBCUniversal Enterprise, Inc.		
USD	820,000	1.66% due 04/15/18 (a)		820,197
		NBCUniversal Media LLC		
USD	475,000	4.45% due 01/15/43		465,059
		NiSource Finance Corp.		
USD	490,000	4.80% due 02/15/44		497,670
USD	115,000	5.80% due 02/01/42		130,676
		Noble Energy, Inc.		
USD	750,000	5.25% due 11/15/43		605,314
		Northrop Grumman Corp.		
USD	115,000	3.85% due 04/15/45		103,398
		Nucor Corp.		
USD	198,000	5.20% due 08/01/43		179,663
		Oglethorpe Power Corp.		
USD	180,000	4.55% due 06/01/44		170,583

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
		UNITED STATES (50.6%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (40.3%) (continued)		
USD	138,000	Oncor Electric Delivery Co. LLC 2.95% due 04/01/25	\$	129,667
USD	625,000	ONEOK Partners LP 4.90% due 03/15/25		526,626
USD	818,000	Oracle Corp. 4.50% due 07/08/44		823,067
USD	565,000	Pacific Gas & Electric Co. 4.30% due 03/15/45		557,652
USD	110,000	4.75% due 02/15/44		114,302
USD	215,000	PacifiCorp 2.95% due 02/01/22		216,711
USD	225,000	PepsiCo, Inc. 4.25% due 10/22/44		223,253
USD	325,000	Philip Morris International, Inc. 4.13% due 03/04/43		307,248
USD	615,000	Phillips 66 4.88% due 11/15/44		548,894
USD	405,000	PNC Bank N.A. 2.40% due 10/18/19		406,594
EUR	1,800,000	Praxair, Inc. 1.50% due 03/11/20		2,022,737
EUR	560,000	ProLogis LP 3.00% due 01/18/22		644,791
USD	240,000	Prudential Financial, Inc. 3.50% due 05/15/24		241,188
USD	795,000	5.10% due 08/15/43		828,267
USD	185,000	Puget Sound Energy, Inc. 4.30% due 05/20/45		187,323
USD	647,000	QUALCOMM, Inc. 4.80% due 05/20/45		575,127
USD	190,000	Reynolds American, Inc. 4.00% due 06/12/22		197,648
USD	580,000	4.45% due 06/12/25		606,922
USD	80,000	5.70% due 08/15/35		87,648
USD	205,000	5.85% due 08/15/45		227,757
USD	1,070,000	SABMiller Holdings, Inc. 2.45% due 01/15/17 (a)		1,078,228
USD	240,000	Samsung Electronics America, Inc. 1.75% due 04/10/17 (a)		239,452
USD	695,000	Sempra Energy 2.88% due 10/01/22		672,816
USD	365,000	Simon Property Group LP 3.50% due 09/01/25		369,796
USD	185,000	Southern California Edison Co. 3.60% due 02/01/45		167,641
USD	70,000	Southern Power Co. 5.15% due 09/15/41		64,772
USD	90,000	5.25% due 07/15/43		85,815
USD	455,000	Southwestern Electric Power Co. 3.90% due 04/01/45		398,141
USD	55,000	Spectra Energy Partners LP 2.95% due 09/25/18		54,047
USD	200,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.30% due 04/01/44		148,842
USD	810,000	5.35% due 05/15/45		601,404
USD	545,000	Synchrony Financial 2.70% due 02/03/20		534,754
USD	430,000	3.75% due 08/15/21		429,726

(2015年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
		UNITED STATES (50.6%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (40.3%) (continued)		
USD	460,000	Synchrony Financial 4.25% due 08/15/24	\$	453,826
USD	205,000	Textron, Inc. 3.88% due 03/01/25		201,160
USD	340,000	Time Warner Cable, Inc. 5.50% due 09/01/41		307,248
USD	845,000	Time Warner, Inc. 3.55% due 06/01/24		829,488
USD	595,000	3.60% due 07/15/25		579,481
USD	240,000	4.75% due 03/29/21		258,094
USD	55,000	4.85% due 07/15/45		52,340
USD	815,000	Trans-Allegheny Interstate Line Co. 3.85% due 06/01/25 (a)		815,137
USD	360,000	UDR, Inc. 4.00% due 10/01/25		363,514
USD	375,000	United Technologies Corp. 4.15% due 05/15/45		358,193
USD	400,000	UnitedHealth Group, Inc. 2.70% due 07/15/20		404,348
USD	335,000	3.75% due 07/15/25		345,659
USD	260,000	4.75% due 07/15/45		273,602
USD	21,000	Ventas Realty LP 4.38% due 02/01/45		19,235
USD	570,000	Ventas Realty LP / Ventas Capital Corp. 4.00% due 04/30/19		592,719
USD	288,000	Verizon Communications, Inc. 2.50% due 09/15/16		290,253
USD	655,000	3.50% due 11/01/24		647,263
USD	544,000	3.85% due 11/01/42		444,601
USD	1,317,000	4.27% due 01/15/36		1,188,732
USD	130,000	4.52% due 09/15/48		116,247
USD	838,000	4.86% due 08/21/46		792,805
USD	468,000	Viacom, Inc. 4.38% due 03/15/43		342,820
USD	620,000	Visa, Inc. 4.30% due 12/14/45		628,425
USD	1,095,000	Walgreens Boots Alliance, Inc. 3.80% due 11/18/24		1,063,167
USD	305,000	Wal-Mart Stores, Inc. 4.00% due 04/11/43		297,771
USD	460,000	4.30% due 04/22/44		469,016
USD	96,000	Weingarten Realty Investors 4.45% due 01/15/24		98,431
USD	1,165,000	Wells Fargo & Co. 2.15% due 01/30/20		1,155,202
USD	665,000	4.30% due 07/22/27		679,394
USD	305,000	4.65% due 11/04/44		296,747
USD	290,000	5.38% due 11/02/43		310,137
USD	975,000	Welltower, Inc. 4.00% due 06/01/25		959,230
USD	240,000	Western Gas Partners LP 3.95% due 06/01/25		201,590
USD	495,000	Williams Partners LP 3.60% due 03/15/22		389,483
USD	480,000	4.00% due 09/15/25		359,438
USD	93,000	5.10% due 09/15/45		61,193
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		121,016,013

(2015年12月31日現在)

元本金額	銘柄名	純資産比率	公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (95.4%) (continued)		
	UNITED STATES (50.6%) (continued)		
	GOVERNMENT BONDS (10.3%)		
	U.S. Treasury Bonds		
USD 510,000	5.25% due 11/15/28	\$	666,423
USD 5,500,000	5.38% due 02/15/31		7,457,032
USD 5,210,000	6.25% due 05/15/30		7,554,318
	U.S. Treasury Notes		
USD 3,200,000	0.88% due 11/15/17		3,189,142
USD 700,000	1.50% due 10/31/19		697,946
USD 10,270,000	1.50% due 05/31/20		10,183,619
USD 1,350,000	1.75% due 09/30/19		1,359,411
	TOTAL GOVERNMENT BONDS		31,107,891
	TOTAL UNITED STATES (Cost \$157,008,862)		152,123,904
	TOTAL FIXED INCOME SECURITIES (Cost \$300,021,708)	\$	286,712,530
	SHORT-TERM INVESTMENTS (1.5%)		
	CANADA (0.0%)		
	TIME DEPOSIT (0.0%)		
	Royal Bank of Canada		
CAD 73,088	0.05% due 01/04/16		52,820
	TOTAL TIME DEPOSIT		52,820
	TOTAL CANADA (Cost \$52,820)		52,820
	FRANCE (0.2%)		
	TIME DEPOSITS (0.2%)		
	Societe Generale		
EUR 153,107	(0.63%) due 01/04/16 (c)		166,389
USD 239,584	0.09% due 01/04/16		239,584
	TOTAL TIME DEPOSITS		405,973
	TOTAL FRANCE (Cost \$405,973)		405,973
	GRAND CAYMAN (0.0%)		
	TIME DEPOSIT (0.0%)		
	Brown Brothers Harriman & Co.		
JPY 144	0.01% due 01/04/16		1
	TOTAL TIME DEPOSIT		1
	TOTAL GRAND CAYMAN (Cost \$1)		1
	UNITED KINGDOM (0.4%)		
	TIME DEPOSIT (0.4%)		
	ANZ Bank		
GBP 885,938	0.08% due 01/04/16		1,306,051
	TOTAL TIME DEPOSIT		1,306,051
	TOTAL UNITED KINGDOM (Cost \$1,313,932)		1,306,051
	UNITED STATES (0.9%)		
	TIME DEPOSIT (0.9%)		
	TD Bank Group		
USD 2,600,000	0.23% due 01/04/16		2,600,000
	TOTAL TIME DEPOSIT		2,600,000
	TOTAL UNITED STATES (Cost \$2,600,000)		2,600,000
	TOTAL SHORT-TERM INVESTMENTS (Cost \$4,372,726)		4,364,845
	TOTAL INVESTMENTS (Cost \$304,394,434)	96.9%	\$ 291,077,375
	CASH AND OTHER ASSETS IN EXCESS OF LIABILITIES	3.1	9,305,977
	NET ASSETS	100.0%	\$ 300,383,352

(a) 144A Security - Security exempt from registration under Rule 144A of the Securities Act of 1933. These securities may be resold in transactions exempt from registration, typically to qualified institutional buyers. Unless otherwise indicated, these securities are not considered illiquid.

(b) Variable rate security as of December 31, 2015.

(c) Due to the European Central Bank deposit rate cut, interest rates for euro denominated short-term instruments may be less than zero percent.

(2015年12月31日現在)

先物取引

ポジション	銘柄	限月	契約		未実現 評価損益
Short	Euro-Bund Future	03/2016	(34)	\$	76,116
Short	Euro-Buxl Future	03/2016	(11)		33,950
Short	Long Gilt Future	03/2016	(87)		56,845
Short	US 2 Year Note Future	03/2016	(26)		5,281
Short	US 5 Year Note Future	03/2016	(5)		1,094
Short	US 10 Year Note Future	03/2016	(33)		18,312
Short	US Ultra Bond Future	03/2016	(25)		20,469
					\$ 212,067

ファンド レベルでの為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
AUD	Royal Bank of Canada	6,973,083	01/27/2016	USD	5,002,016	\$ 73,636	\$ -	73,636
EUR	Royal Bank of Canada	547,769	01/27/2016	USD	603,852	-	(8,232)	(8,232)
EUR	Standard Chartered Bank	256,532	01/27/2016	USD	279,959	-	(1,018)	(1,018)
EUR	Standard Chartered Bank	139,379	01/27/2016	USD	152,804	-	(1,249)	(1,249)
EUR	Standard Chartered Bank	196,693	01/27/2016	USD	212,852	1,023	-	1,023
EUR	Westpac Banking Corp.	249,681	01/27/2016	USD	273,488	-	(1,996)	(1,996)
GBP	Royal Bank of Canada	411,147	01/27/2016	USD	623,330	-	(17,180)	(17,180)
GBP	Royal Bank of Canada	874,341	01/27/2016	USD	1,296,503	-	(7,469)	(7,469)
GBP	Standard Chartered Bank	267,804	01/27/2016	USD	403,680	-	(8,858)	(8,858)
GBP	Standard Chartered Bank	102,565	01/27/2016	USD	153,958	-	(2,747)	(2,747)
JPY	Citibank N.A.	100,000	01/05/2016	USD	830	2	-	2
JPY	Citibank N.A.	100,000	01/05/2016	USD	830	2	-	2
JPY	Citibank N.A.	2,400,000	01/06/2016	USD	19,910	58	-	58
JPY	Citibank N.A.	110,000,000	01/06/2016	USD	912,547	2,657	-	2,657
JPY	Citibank N.A.	4,000,000	01/06/2016	USD	33,184	97	-	97
USD	Citibank N.A.	497,883	01/05/2016	JPY	60,000,000	-	(1,306)	(1,306)
USD	Citibank N.A.	60,560	01/06/2016	JPY	7,300,000	-	(176)	(176)
USD	Citibank N.A.	6,637	01/06/2016	JPY	800,000	-	(19)	(19)
USD	Royal Bank of Canada	39,222,957	01/27/2016	GBP	25,886,665	1,058,472	-	1,058,472
USD	Societe Generale	79,639,051	01/27/2016	EUR	72,507,034	798,092	-	798,092
USD	Standard Chartered Bank	6,162,983	01/27/2016	AUD	8,553,141	-	(62,781)	(62,781)
USD	Standard Chartered Bank	3,686,373	01/27/2016	CAD	5,040,006	43,797	-	43,797
USD	Standard Chartered Bank	424,732	01/27/2016	EUR	389,081	1,663	-	1,663
USD	Westpac Banking Corp.	300,084	01/27/2016	GBP	200,000	5,226	-	5,226
USD	Westpac Banking Corp.	173,757	01/27/2016	EUR	160,000	-	(220)	(220)
						\$ 1,984,725	\$ (113,251)	\$ 1,871,474

AUDクラスにおける為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
AUD	Citibank N.A.	8,797,867	02/02/2016	USD	6,261,237	\$ 140,868	\$ -	140,868
						\$ 140,868	\$ -	140,868

(2015年12月31日現在)

BRLクラスにおける為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
BRL	Citibank N.A.	34,831,112	02/02/2016	USD	8,814,370	\$ -	\$ (100,718)	\$ (100,718)
						\$ -	\$ (100,718)	\$ (100,718)

CNYクラスにおける為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
CNY	Citibank N.A.	5,006,105	02/02/2016	USD	762,830	\$ 6,733	\$ -	\$ 6,733
						\$ 6,733	\$ -	\$ 6,733

IDRクラスにおける為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
IDR	Citibank N.A.	67,767,838,616	02/02/2016	USD	4,816,975	\$ 65,137	\$ -	\$ 65,137
						\$ 65,137	\$ -	\$ 65,137

JPYクラスにおける為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
JPY	Citibank N.A.	28,643,988,208	02/02/2016	USD	236,106,936	\$ 2,348,633	\$ -	\$ 2,348,633
						\$ 2,348,633	\$ -	\$ 2,348,633

通貨略称

AUD	-	Australian Dollar
BRL	-	Brazilian Real
CAD	-	Canadian Dollar
CNY	-	Chinese Yuan
EUR	-	Euro
GBP	-	Great British Pound
IDR	-	Indonesia Rupiah
JPY	-	Japanese Yen
USD	-	United States Dollar

デリバティブ取引の額

取引相手	デリバティブ 資産の額	デリバティブ 負債の額	受取担保金	差入担保金	純額*
店頭デリバティブ					
為替予約					
Standard Chartered Bank	\$ 46,483	\$ (76,653)	\$ -	\$ -	\$ (30,170)
マスターネットティング契約の対象と なるデリバティブ合計	\$ 46,483	\$ (76,653)	\$ -	\$ -	\$ (30,170)
Citibank N.A.	\$ 2,564,187	\$ (102,219)			
Royal Bank of Canada	1,132,108	(32,881)			
Societe Generale	798,092	-			
Westpac Banking Corp.	5,226	(2,216)			
マスターネットティング契約の対象と ならないデリバティブ合計	\$ 4,499,613	\$ (137,316)			
投資資産における 店頭デリバティブ合計	\$ 4,546,096	\$ (213,969)			

*Net represents the receivable/(payable) that would be due from/(to) the counterparty in an event of default. Netting is allowed across transactions traded under the same legal agreement with the same legal entity.

マネー・プール マザーファンド

《第14期》決算日2016年7月14日

[計算期間：2016年1月15日～2016年7月14日]

「マネー・プール マザーファンド」は、7月14日に第14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の公社債に投資し、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	わが国の公社債
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期騰	落率			
	円		%	%	%	百万円
10期(2014年7月14日)	10,045		0.0	93.4	—	1,284
11期(2015年1月14日)	10,047		0.0	84.8	—	1,179
12期(2015年7月14日)	10,049		0.0	85.2	—	821
13期(2016年1月14日)	10,049		0.0	70.3	—	852
14期(2016年7月14日)	10,050		0.0	62.2	—	241

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

※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		債組入比率	債券先物比率	債券率
		期騰	落率			
(期首) 2016年1月14日	円 10,049		% —	% 70.3	% —	% —
1月末	10,050		0.0	95.3	—	—
2月末	10,053		0.0	73.3	—	—
3月末	10,050		0.0	52.3	—	—
4月末	10,050		0.0	83.1	—	—
5月末	10,051		0.0	79.8	—	—
6月末	10,050		0.0	62.7	—	—
(期末) 2016年7月14日	10,050		0.0	62.2	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

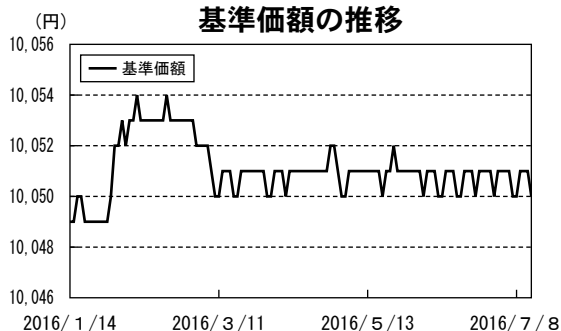
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第14期：2016/1/15～2016/7/14)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べて0.01%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

下落要因

保有債券の評価額の上昇が、基準価額のプラスに寄与しました。

投資環境について

(第14期：2016/1/15～2016/7/14)

◎国内短期金融市場

＜無担保コール翌日物金利の推移＞

- ・日銀による金融緩和政策の影響を受けて、無担保コール翌日物金利は0.1%を下回る水準で推移しました。日銀のマイナス金利の適用開始を受けて足元はマイナス0.05%程度で推移しました。

＜国庫短期証券（3ヵ月物）の利回りの推移＞

- ・日銀による短期国債の買入れや短期国債の需給の引き締めなどから、国庫短期証券（3ヵ月物）の利回りは0%を下回る水準で推移しました。2016年1月の日銀の金融政策決定会合でマイナス金利の導入が決定されると一時的にマイナス0.2%程度まで急低下したものの、急低下の反動からマイナス0.1%程度まで上昇しました。その後、再び低下傾向となり、足元ではマイナス0.3%程度で推移しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

- ・基準価額は期首に比べて上昇しました。
- ・わが国の国債や短期国債（国庫短期証券）現先取引、コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保や常時適正な流動性の保持を目指した運用を行いました。その結果、日銀のマイナス金利導入による金利低下を受けて保有債券の評価額が上昇したことなどにより、基準価額は上昇しました。

今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・中国経済の減速などから原油価格が下落したことや為替が円高に推移した結果、物価の伸びは日銀の目標を大幅に下回っています。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・引き続き、わが国の国債や短期国債（国庫短期証券）現先取引、コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保や常時適正な流動性の保持を目指した運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年1月15日～2016年7月14日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,050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

(2016年1月15日～2016年7月14日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 100,061	千円 220,269 (326,500)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は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。

その他有価証券

		買 付 額	売 付 額
国 内	コマーシャル・ペーパー	千円 699,999	千円 699,999

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月15日～2016年7月14日)

利害関係人との取引状況

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

(2016年7月14日現在)

国内公社債

(A)国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
国債証券	千円 150,000	千円 150,511	% 62.2	% —	% —	% —	% —	% 62.2
合 計	150,000	150,511	62.2	—	—	—	—	62.2

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第282回利付国債（10年）	1.7	150,000	150,511	2016/9/20
合 計		150,000	150,511	

○投資信託財産の構成

(2016年7月14日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 150,511	% 61.8
コール・ローン等、その他	93,070	38.2
投資信託財産総額	243,581	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年7月14日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	243,581,074
コール・ローン等	92,259,198
公社債(評価額)	150,511,500
未収利息	810,376
(B) 負債	1,767,210
未払解約金	1,767,071
未払利息	139
(C) 純資産総額(A-B)	241,813,864
元本	240,621,739
次期繰越損益金	1,192,125
(D) 受益権総口数	240,621,739口
1口当たり基準価額(C/D)	10,050円

<注記事項>

- ①期首元本額 847,818,437円
 期中追加設定元本額 640,661,743円
 期中一部解約元本額 1,247,858,441円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0050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)

世界好利回りCBファンド 2013-03 為替ヘッジあり	99,642円
世界好利回りCBファンド 2013-03 円高ヘッジ・円安追従型	99,642円
短期ハイ・イールド債ファンド(為替ヘッジあり) 2013-12	99,582円
短期ハイ・イールド債ファンド(為替ヘッジあり) 2014-02	99,572円
短期ハイ・イールド債ファンド(為替ヘッジあり) 2014-03	99,572円
短期ハイ・イールド債ファンド(為替ヘッジあり) 2014-04	99,562円
先進国高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり) 2014-09	99,553円
先進国高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり) 2014-12	99,533円
先進国高利回り社債ファンド(為替ヘッジなし・早期償還条項付) 2014-12	99,533円
先進国高利回り社債ファンド(為替ヘッジあり) 2015-03	99,523円
先進国高利回り社債ファンド(為替ヘッジなし) 2015-03	99,523円
先進国高利回り社債ファンド(為替ヘッジなし・早期償還条項付) 2015-03	99,523円
新興国公社債オープン(通貨選択型) 円コース(毎月決算型)	1,692,054円
新興国公社債オープン(通貨選択型) 米ドルコース(毎月決算型)	200,000円
新興国公社債オープン(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月決算型)	1,008,738円
新興国公社債オープン(通貨選択型) 南アフリカ・ランドコース(毎月決算型)	63,697円
新興国公社債オープン(通貨選択型) ブラジル・リアルコース(毎月決算型)	6,316,452円
新興国公社債オープン(通貨選択型) 中国元コース(毎月決算型)	19,989円
新興国公社債オープン(通貨選択型) マネー・プール・ファンド(年2回決算型)	7,372,283円
世界投資適格債オープン(通貨選択型) 円コース(毎月決算型)	5,154,901円
世界投資適格債オープン(通貨選択型) 米ドルコース(毎月決算型)	49,966円
世界投資適格債オープン(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月決算型)	995,161円
世界投資適格債オープン(通貨選択型) ブラジル・リアルコース(毎月決算型)	2,234,005円
世界投資適格債オープン(通貨選択型) 中国元コース(毎月決算型)	28,349円
世界投資適格債オープン(通貨選択型) インドネシア・ルピアコース(毎月決算型)	1,013,875円
世界投資適格債オープン(通貨選択型) マネー・プール・ファンドII(年2回決算型)	6,983,878円
マネー・プール・ファンドIV	977,506円
マネー・プール・ファンドVI	127,451,917円

○損益の状況 (2016年1月15日～2016年7月14日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,927,574
受取利息	1,936,538
支払利息	△1,877,964
(B) 有価証券売買損益	△1,877,353
売買損	△1,877,353
(C) 保管費用等	△58
(D) 当期損益金(A+B+C)	50,163
(E) 前期繰越損益金	4,187,341
(F) 追加信託差損益金	3,311,581
(G) 解約差損益金	△6,356,960
(H) 計(D+E+F+G)	1,192,125
次期繰越損益金(H)	1,192,125

(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せん。

(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。

マネー・プール・ファンドⅦ (適格機関投資家専用)	976,455円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) 円コース (毎月決算型)	4,314,823円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) 米ドルコース (毎月決算型)	119,857円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) 豪ドルコース (毎月決算型)	769,078円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) ブラジル・リアルコース (毎月決算型)	15,855,020円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) 中国元コース (毎月決算型)	19,977円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) インドネシア・ルピアコース (毎月決算型)	554,401円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) 資源国通貨バスケットコース (毎月決算型)	1,608,548円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) トルコ・リラコース (毎月決算型)	19,961円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) メキシコ・ペソコース (毎月決算型)	19,925円
米国ハイ・イールド債オープン (通貨選択型) マネー・プール・ファンドⅤ (年2回決算型)	32,862,095円
米国高利回り社債ファンド (毎月決算型)	999円
米国高利回り社債・円ファンド (毎月決算型)	999円
米国高利回り社債・ブラジル・リアルファンド (毎月決算型)	999円
トレンド・アロケーション・オープン	997,308円
国際オルタナティブ戦略 Q T X -ウィントン・アルファ・インベストメント・オープン (円ヘッジ) 成長型	99,562円
国際オルタナティブ戦略 Q T X -ウィントン・アルファ・インベストメント・オープン (円ヘッジ) 分配型	99,562円
国際オルタナティブ戦略 Q T X -ウィントン・アルファ・インベストメント・オープン (円ヘッジなし) 成長型	99,562円
国際オルタナティブ戦略 Q T X -ウィントン・アルファ・インベストメント・オープン (円ヘッジなし) 分配型	99,561円
エマージング社債オープン (毎月決算型) 為替ヘッジあり	99,682円
エマージング社債オープン (毎月決算型) 為替ヘッジなし	99,682円
国際オーストラリア債券オープン (毎月決算型)	997円
リスク・パリティαオープン	995円
欧州ハイ・イールド債券ファンド (毎月決算型) 為替ヘッジあり	9,963円
欧州ハイ・イールド債券ファンド (毎月決算型) 為替ヘッジなし	39,849円
米国エネルギーMLPオープン (毎月決算型) 為替ヘッジあり	996,215円
米国エネルギーMLPオープン (毎月決算型) 為替ヘッジなし	996,215円
国際 アジア・リート・ファンド (通貨選択型) 為替ヘッジなしコース (毎月決算型)	99,602円
国際 アジア・リート・ファンド (通貨選択型) 円コース (毎月決算型)	99,602円
国際 アジア・リート・ファンド (通貨選択型) インド・ルピーコース (毎月決算型)	99,602円
国際 アジア・リート・ファンド (通貨選択型) インドネシア・ルピアコース (毎月決算型)	99,602円
国際 アジア・リート・ファンド (通貨選択型) マレーシア・リンギコース (毎月決算型)	99,602円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 円コース (1年決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 円コース (毎月決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 米ドルコース (1年決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 米ドルコース (毎月決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ユーロコース (1年決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ユーロコース (毎月決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 豪ドルコース (1年決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 豪ドルコース (毎月決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ブラジル・リアルコース (1年決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ブラジル・リアルコース (毎月決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) メキシコ・ペソコース (1年決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) メキシコ・ペソコース (毎月決算型)	99,592円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) トルコ・リラコース (1年決算型)	9,960円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) トルコ・リラコース (毎月決算型)	9,960円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ロシア・ルーブルコース (1年決算型)	9,986円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) ロシア・ルーブルコース (毎月決算型)	9,986円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 中国元コース (1年決算型)	9,960円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 中国元コース (毎月決算型)	9,960円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 南アフリカ・ランドコース (1年決算型)	9,960円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) 南アフリカ・ランドコース (毎月決算型)	9,960円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) インドネシア・ルピアコース (1年決算型)	9,986円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) インドネシア・ルピアコース (毎月決算型)	99,592円

国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) マナー・プール・ファンドIX (1年決算型)	12,684,974円
国際・キャピタル 日本株式オープン (通貨選択型) マナー・プール・ファンドX (年2回決算型)	2,254,773円
欧州アクティブ株式オープン (為替ヘッジあり)	4,979円
欧州アクティブ株式オープン (為替ヘッジなし)	4,979円
US短期ハイ・イールド債オープン 為替プレミアムコース (毎月決算型)	99,562円
US短期ハイ・イールド債オープン 為替ヘッジありコース (毎月決算型)	9,957円
US短期ハイ・イールド債オープン 為替ヘッジありコース (年2回決算型)	9,957円
US短期ハイ・イールド債オープン 為替ヘッジなしコース (毎月決算型)	9,957円
US短期ハイ・イールド債オープン 為替ヘッジなしコース (年2回決算型)	9,957円
優先証券プラス・オープン 為替プレミアムコース (毎月決算型)	9,956円
優先証券プラス・オープン 為替ヘッジありコース (毎月決算型)	9,956円
優先証券プラス・オープン 為替ヘッジなしコース (毎月決算型)	9,956円
優先証券プラス・オープン 為替プレミアムコース (年2回決算型)	9,956円
優先証券プラス・オープン 為替ヘッジありコース (年2回決算型)	9,956円
優先証券プラス・オープン 為替ヘッジなしコース (年2回決算型)	9,956円
米国成長株オープン	996円
世界CoCosオープン 為替プレミアムコース (毎月決算型)	9,953円
世界CoCosオープン 為替ヘッジありコース (毎月決算型)	9,953円
世界CoCosオープン 為替ヘッジなしコース (毎月決算型)	9,953円
アジアリート戦略オープン (為替ヘッジあり) 毎月決算型	9,952円
アジアリート戦略オープン (為替ヘッジあり) 年2回決算型	9,952円
アジアリート戦略オープン (為替ヘッジなし) 毎月決算型	9,952円
アジアリート戦略オープン (為替ヘッジなし) 年2回決算型	9,952円
合計	240,621,739円

[お知らせ]

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。(2016年7月1日)