

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／国内／債券 | |
|--------|---|---|
| 信託期間 | 2018年10月11日まで（2013年10月15日設定） | |
| 運用方針 | マネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、利子等収益の確保を図ります。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | マネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の公社債等に直接投資することがあります。 |
| | マザーファンド | わが国の公社債等を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビーファンド | 外貨建資産への投資は行いません。 |
| | マザーファンド | 外貨建資産への投資は行いません。 |
| 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 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ ＜マネープールファンドA＞

愛称：スマートスター



第7期（決算日：2017年4月11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 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ＜マネープールファンドA＞」は、去る4月11日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況を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。

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5期の運用実績

| 決算期 | 基準 (分配落) | 価額 | | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|-------------|--------|--------|----------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 金 騰 落 中 率 | | | |
| | 円 | | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 3期(2015年4月13日) | 9,996 | | 0 | △0.0 | 94.4 | — | 0.999584 |
| 4期(2015年10月13日) | 9,997 | | 0 | 0.0 | 81.3 | — | 77 |
| 5期(2016年4月11日) | 9,983 | | 0 | △0.1 | 75.8 | — | 0.998344 |
| 6期(2016年10月11日) | 9,983 | | 0 | 0.0 | 20.9 | — | 6 |
| 7期(2017年4月11日) | 9,983 | | 0 | 0.0 | 6.1 | — | 8 |

(注) 当ファンドは、投資資金を一時的に待機させておくことを目的としたファンドであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|-------------|--------|--------|-----|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | | 騰 落 | 率 | | | |
| (期首) | 円 | | % | % | % | % |
| 2016年10月11日 | 9,983 | | — | 20.9 | — | — |
| 10月末 | 9,983 | | 0.0 | 21.0 | — | — |
| 11月末 | 9,983 | | 0.0 | 27.8 | — | — |
| 12月末 | 9,983 | | 0.0 | 11.8 | — | — |
| 2017年1月末 | 9,983 | | 0.0 | 11.6 | — | — |
| 2月末 | 9,983 | | 0.0 | 5.9 | — | — |
| 3月末 | 9,983 | | 0.0 | 6.2 | — | — |
| (期末) | | | | | | |
| 2017年4月11日 | 9,983 | | 0.0 | 6.1 | — | — |

(注) 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。

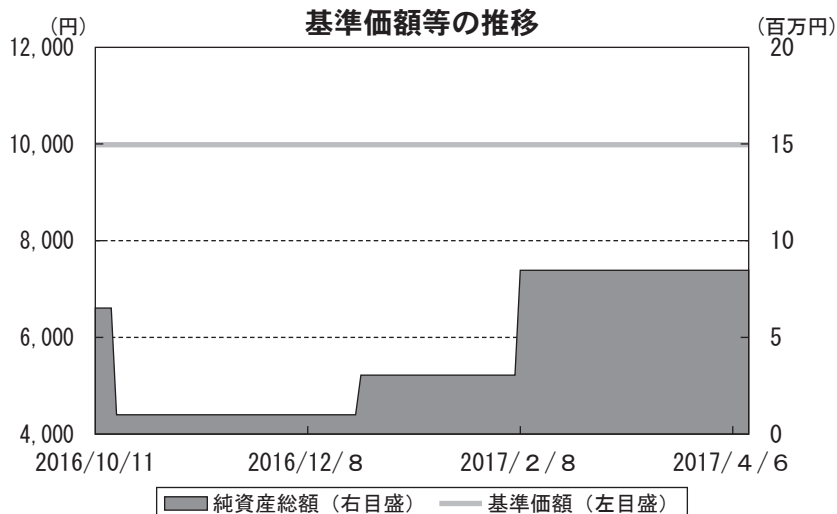
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第7期：2016/10/12～2017/4/11)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ横ばいとなりました。



第7期首：9,983円
 第7期末：9,983円
 (既払分配金 0円)
 騰落率：0.0%

基準価額の主な変動要因

| | |
|------|---|
| 上昇要因 | マネー・マーケット・マザーファンド受益証券を通じて、実質的に利子等収益が積みあがったことが基準価額にプラスに寄与しました。 |
| 下落要因 | 信託報酬等のコストなどが基準価額にマイナスに影響しました。 |

投資環境について

(第7期：2016/10/12～2017/4/11)

◎国内短期金融市場

- ・当期の短期金融市場を見ると、日本銀行は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）は、マイナス金利の適用以降であることから、マイナス圏で推移しました。2017年4月11日のコール・レートは-0.037%となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>>

- ・期を通じて、マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資比率を高位に維持したことにより、実質的に利子等収益が積み上がったものの、信託報酬等のコストなどが影響し、基準価額は横ばいとなりました。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

基準価額は期首に比べ横ばいとなりました。

- ・残存期間の短い社債を組み入れつつ、コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益は積み上がったものの、運用資金に対するマイナス金利適用などの影響を受けて、基準価額は横ばいとなりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、投資資金を一時待機させておくことを目的としたファンドであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・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7期 | |
|-----------|------------------------|--|
| | 2016年10月12日～2017年4月11日 | |
| 当期分配金 | — | |
| (対基準価額比率) | —% | |
| 当期の収益 | — | |
| 当期の収益以外 | — | |
| 翌期繰越分配対象額 | 40 | |

(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

<三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>>

◎今後の運用方針

- ・マネー・マーケット・マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保ち、マザーファンドのポートフォリオの構成に近づけた状態を維持する方針です。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・原油価格の上昇などを背景に物価は緩やかに上昇していくと予想していますが、日本銀行の物価目標である2%には届かないと思われれます。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

- ・コール・ローンおよびCP現先取引などへの投資を通じて、安定した収益の確保や適的な流動性の保持をめざした運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年10月12日～2017年4月11日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|-----|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 | % | (a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数) |
| (投 信 会 社) | (0) | (0.001) | 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) | (0) | (0.002) | 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) | (0) | (0.002) | 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 |
| 合 計 | 0 | 0.004 | |
| 期中の平均基準価額は、9,983円です。 | | | |

(注) 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・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) 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10月12日～2017年4月11日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| マネー・マーケット・マザーファンド | 千口 7,317 | 千円 7,452 | 千口 5,404 | 千円 5,504 |

○利害関係人との取引状況等

(2016年10月12日～2017年4月11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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

| 期首残高(元本) | 当期設定元本 | 当期解約元本 | 期末残高(元本) | 取引の理由 |
|----------|----------|----------|----------|-------------|
| 百万円 1 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 1 | 当初設定時における取得 |

○組入資産の明細

(2017年4月11日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|-------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| マネー・マーケット・マザーファンド | 千口 6,382 | 千口 8,295 | 千円 8,448 |

○投資信託財産の構成

(2017年4月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------|-------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| マネー・マーケット・マザーファンド | 千円 8,448 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 21 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 8,469 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年4月11日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 8,469,401 |
| コール・ローン等 | 21,323 |
| マネー・マーケット・マザーファンド(評価額) | 8,448,076 |
| 未収入金 | 2 |
| (B) 負債 | 160 |
| 未払信託報酬 | 160 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 8,469,241 |
| 元本 | 8,483,815 |
| 次期繰越損益金 | △ 14,574 |
| (D) 受益権総口数 | 8,483,815口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,983円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 6,526,982円
 期中追加設定元本額 7,483,815円
 期中一部解約元本額 5,526,982円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9983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14,574円です。

③分配金の計算過程

| 項 目 | 2016年10月12日～ 2017年4月11日 |
|---------------------------|----------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 3,025円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | -円 |
| 収益調整金額 | 30,751円 |
| 分配準備積立金額 | 902円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 34,678円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 40円 |
| 1万口当たり分配金額 | -円 |
| 収益分配金金額 | -円 |

○損益の状況 (2016年10月12日～2017年4月11日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 14 |
| 支払利息 | △ 14 |
| (B) 有価証券売買損益 | 18 |
| 売買益 | 830 |
| 売買損 | △ 812 |
| (C) 信託報酬等 | △ 160 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 156 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 29 |
| (F) 追加信託差損益金 | △14,389 |
| (配当等相当額) | (30,705) |
| (売買損益相当額) | (△45,094) |
| (G) 計(D+E+F) | △14,574 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △14,574 |
| 追加信託差損益金 | △14,389 |
| (配当等相当額) | (30,751) |
| (売買損益相当額) | (△45,140) |
| 分配準備積立金 | 3,927 |
| 繰越損益金 | △ 4,112 |

- (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) (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。

*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

(2017年4月11日現在)

<マネー・マーケット・マザーファンド>

下記は、マネー・マーケット・マザーファンド全体(1,597,383千口)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 | 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 |
| 普通社債券 | 千円 100,000 (100,000) | 千円 100,042 (100,042) | % 6.1 (6.1) | % — (—) | % — (—) | % — (—) | % 6.1 (6.1) |
| 合 計 | 100,000 (100,000) | 100,042 (100,042) | 6.1 (6.1) | — (—) | — (—) | — (—) | 6.1 (6.1) |

(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。

(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 |
| 普通社債券 第113回オリックス | % 2.19 | 千円 100,000 | 千円 100,042 | 2017/4/18 |
| 合 計 | | 100,000 | 100,042 | |

国内その他有価証券

| 区 分 | 当 期 | |
|-------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 1,399,999 | % 86.1 |

(注) 比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

マネー・マーケット・マザーファンド

《第24期》決算日2016年11月21日

[計算期間：2016年5月21日～2016年11月21日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月21日に第24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24期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。 |
| 主要運用対象 | わが国の公社債等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 | 純資産額 |
|------------------|--------|------|-------|--------|--------|
| | | | | | |
| 20期(2014年11月20日) | 10,183 | 0.0 | 84.3 | — | 2,373 |
| 21期(2015年5月20日) | 10,183 | 0.0 | 89.3 | — | 1,959 |
| 22期(2015年11月20日) | 10,185 | 0.0 | 91.2 | — | 27,834 |
| 23期(2016年5月20日) | 10,183 | △0.0 | 39.0 | — | 5,562 |
| 24期(2016年11月21日) | 10,184 | 0.0 | 24.4 | — | 4,420 |

(注) 当ファンドは主として短期債券、コール・ローンなどによる運用を行い、安定的な収益の確保をめざすファンドであり、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○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 |
|---------------------|--------|-----|-------|--------|
| | | | | |
| (期首) 2016年5月20日 | 10,183 | — | 39.0 | — |
| 5月末 | 10,184 | 0.0 | 37.2 | — |
| 6月末 | 10,185 | 0.0 | 29.1 | — |
| 7月末 | 10,184 | 0.0 | 27.4 | — |
| 8月末 | 10,183 | 0.0 | 17.7 | — |
| 9月末 | 10,184 | 0.0 | 17.0 | — |
| 10月末 | 10,184 | 0.0 | 21.1 | — |
| (期末) 2016年11月21日 | 10,184 | 0.0 | 24.4 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

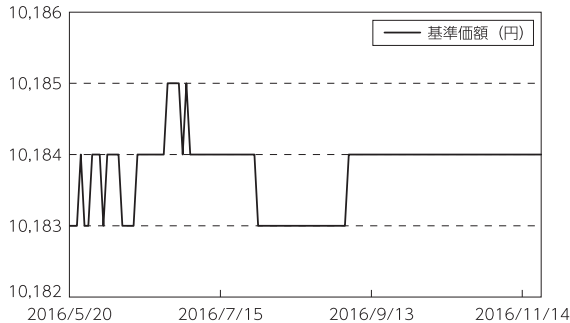
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.01%の上昇となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎国内短期金融市場

- ・当期の短期金融市場を見ると、日銀は2016年9月の金融政策決定会合で金融市場調整方針を、マネタリーベースの年間約80兆円に相当するペースでの増加から、長短金利の操作に変更する決定をしました。コール・レート（無担保・翌日物）は、2016年1月末に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」で決定した-0.1%金利の適用開始以降であることから、マイナス圏で推移しました。11月21日のコール・レートは-0.051%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・残存期間の短い国債や社債などを組み入れつつ、コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益が積み上がったことなどから、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

- ・足下の為替は円安方向に推移していますが、1年前と比較すると依然として円高水準であることから、物価を押し上げる効果はまだ期待できない状況です。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

- ・コール・ローン等短期金融商品や残存期間の短い社債などへの投資を通じて、安定した収益の確保をめざしていく方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2016年11月21日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年5月21日～2016年11月21日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|---------|----------------------|
| 国内 | 国債証券 | 千円 — | 千円 — (183,750) |
| | 特殊債券 | — | — (400,000) |
| | 社債券 | — | — (500,000) |

(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す。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)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 500,099,403 | 千円 499,999,414 |

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2016年11月21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11月21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 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 普通社債券 | 1,077,900 (1,077,900) | 1,079,434 (1,079,434) | 24.4 (24.4) | — (—) | — (—) | — (—) | 24.4 (24.4) |
| 合 計 | 1,077,900 (1,077,900) | 1,079,434 (1,079,434) | 24.4 (24.4) | — (—) | — (—) | — (—) | 24.4 (24.4) |

(注) ()内は非上場債で内書き。

(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。

(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 | |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | | |
| 第300回北陸電力 | 0.5 | 177,900 | 177,907 | 2016/11/30 | |
| 第459回東北電力 | 0.869 | 200,000 | 200,408 | 2017/2/24 | |
| 第282回四国電力 | 0.35 | 200,000 | 200,024 | 2016/12/22 | |
| 第3回コニカミノルタホールディングス | 0.61 | 200,000 | 200,020 | 2016/12/2 | |
| 第3回興銀リース | 0.267 | 100,000 | 100,000 | 2016/12/2 | |
| 第113回オリックス | 2.19 | 100,000 | 100,882 | 2017/4/18 | |
| 第156回オリックス | 1.14 | 100,000 | 100,193 | 2017/1/27 | |
| 合 計 | | 1,077,900 | 1,079,434 | | |

国内その他有価証券

| 区 分 | 当 期 | |
|-------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コマーシャル・ペーパー | 千円 3,099,994 | % 70.1 |

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2016年11月21日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 1,079,434 | 20.9 |
| その他有価証券 | 3,099,994 | 60.1 |
| コール・ローン等、その他 | 978,776 | 19.0 |
| 投資信託財産総額 | 5,158,204 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月21日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産 | 5,158,204,613 円 |
| コール・ローン等 | 976,375,992 |
| 公社債(評価額) | 1,079,434,116 |
| その他有価証券(評価額) | 3,099,994,388 |
| 未収利息 | 2,400,117 |
| (B) 負債 | 737,658,191 |
| 未払解約金 | 737,656,790 |
| 未払利息 | 1,401 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 4,420,546,422 |
| 元本 | 4,340,785,954 |
| 次期繰越損益金 | 79,760,468 |
| (D) 受益権総口数 | 4,340,785,954口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,184円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 5,462,308,836円
 期中追加設定元本額 1,301,104,721円
 期中一部解約元本額 2,422,627,603円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0184円で。

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 DC金利連動アロケーション型バランスファンド | 260,403,123円 |
| 三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型) | 5,226,135円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型) | 8,898,354円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型) | 1,628,029円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型) | 62,265円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型) | 47,179,877円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型) | 94,134,350円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型) | 233,263円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型) | 3,078,471円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド> | 309,607,834円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型) | 89,620円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型) | 1,033,322円 |
| ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド | 2,016,989円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型) | 212,322円 |
| PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型) | 26,506,400円 |
| PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型) | 2,272,200円 |
| PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型) | 15,211,722円 |
| PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>(毎月分配型) | 457,302円 |
| ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型) | 358,088円 |
| ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型) | 2,100,667円 |
| ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型) | 3,836,590円 |
| ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型) | 393,503円 |
| ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド> | 6,333,539円 |
| 三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型) | 13,745,897円 |
| 三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型) | 3,037,917円 |
| 三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型) | 1,970,066円 |
| 三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型) | 43,682,881円 |
| 三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型) | 217,654円 |

○損益の状況 (2016年5月21日~2016年11月21日)

| 項目 | 当期 |
|----------------|--------------|
| (A) 配当等収益 | 5,619,165 |
| 受取利息 | 5,706,293 |
| 支払利息 | △ 87,128 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 5,360,511 |
| 売買損 | △ 5,360,511 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 258,654 |
| (D) 前期繰越損益金 | 100,161,728 |
| (E) 追加信託差損益金 | 23,908,894 |
| (F) 解約差損益金 | △ 44,568,808 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 79,760,468 |
| 次期繰越損益金(G) | 79,760,468 |

- (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) (E)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) (F)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。

| | | |
|-------|--|---------------|
| 三菱UFJ | 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース> (毎月分配型) | 407, 171円 |
| 三菱UFJ | 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド> | 25, 034, 575円 |
| 三菱UFJ | 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型) | 1, 364, 852円 |
| 三菱UFJ | 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型) | 945, 824円 |
| 三菱UFJ | 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型) | 2, 576, 702円 |
| 三菱UFJ | 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型) | 3, 148, 614円 |
| 三菱UFJ | 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型) | 67, 305円 |
| 三菱UFJ | 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド> | 3, 491, 685円 |
| 三菱UFJ | 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型) | 31, 208, 972円 |
| | 欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり) | 756, 099円 |
| | 欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし) | 684, 529円 |
| 三菱UFJ | 米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型) | 491, 836円 |
| 三菱UFJ | 米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型) | 98, 368円 |
| PIMCO | ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (毎月分配型) | 12, 561, 714円 |
| PIMCO | ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型) | 69, 931円 |
| PIMCO | ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型) | 158, 381円 |
| PIMCO | ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型) | 20, 660円 |
| PIMCO | ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型) | 40, 278円 |
| PIMCO | ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型) | 955, 887円 |
| 三菱UFJ | 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型) | 1, 559, 264円 |
| 三菱UFJ | 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型) | 442, 974円 |
| | ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型) | 19, 658円 |
| | ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型) | 19, 658円 |
| | ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型) | 19, 658円 |
| 三菱UFJ | 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型) | 491, 449円 |
| 三菱UFJ | 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型) | 9, 828, 976円 |
| PIMCO | ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型) | 12, 234, 366円 |
| PIMCO | ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型) | 554, 804円 |
| | バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型) | 1, 936, 118円 |
| | バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) | 9, 829円 |
| | バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型) | 9, 829円 |
| | バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型) | 9, 829円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型) | 9, 834, 580円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型) | 13, 128, 307円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型) | 3, 730, 759円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型) | 5, 059, 469円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型) | 1, 395, 312円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型) | 163, 666円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (毎月分配型) | 3, 908, 079円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型) | 3, 737, 703円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (年2回分配型) | 4, 117, 720円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (年2回分配型) | 686, 803円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (年2回分配型) | 961, 645円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (年2回分配型) | 608, 110円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型) | 27, 087円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (年2回分配型) | 365, 661円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA> | 977, 814円 |
| 三菱UFJ | 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドB> | 979, 545円 |
| 三菱UFJ | /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型) | 3, 730, 849円 |
| 三菱UFJ | /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) | 8, 859, 081円 |
| 三菱UFJ | /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型) | 1, 168, 184円 |
| 三菱UFJ | /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型) | 2, 065, 331円 |
| | ビムコ・エマーシング・ボンド・オープン Cコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型) | 983円 |
| | ビムコ・エマーシング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型) | 983円 |

| | |
|---|----------------|
| 米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型) | 2,827,156円 |
| 米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (毎月分配型) | 9,387,547円 |
| 三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド2014 | 256,356円 |
| 米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (毎月決算型) | 3,545,187円 |
| 米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型) | 8,124,755円 |
| 米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (年1回決算型) | 2,990,177円 |
| 米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (年1回決算型) | 3,377,211円 |
| PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (毎月分配型) | 1,084,126円 |
| PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型) | 168,922円 |
| PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型) | 3,874,252円 |
| PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型) | 658,018円 |
| PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型) | 9,991,470円 |
| PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型) | 1,616,484円 |
| 三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型) | 25,537,767円 |
| 三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型) | 42,906,570円 |
| 三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (年2回分配型) | 4,824,746円 |
| Navio インド債券ファンド | 885,966円 |
| Navio マネーボールファンド | 2,298,520円 |
| 三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型) | 39,351円 |
| バンクローンファンドUSA (為替ヘッジあり) 2014-08 | 11,276,260円 |
| マネーボールファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定) | 9,896,661円 |
| MUAMトピックスリスクコントロール (5%) インデックスファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定) | 6,999,249円 |
| ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース (為替ヘッジなし) | 10,766,608円 |
| ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース (為替ヘッジあり) | 21,620,196円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型) | 365,273,064円 |
| 三菱UFJ/AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型) | 11,293,333円 |
| 三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム> (毎月決算型) | 6,324,266円 |
| 三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型> (3ヵ月決算型) | 3,063,931円 |
| PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (毎月分配型) | 1,375,824円 |
| PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (年2回分配型) | 1,071,396円 |
| マルチストラテジー・ファンド (ラップ向け) | 491,015円 |
| PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型) | 564,702円 |
| PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型) | 89,371円 |
| PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型) | 10,804円 |
| PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型) | 40,262円 |
| 三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型) | 983円 |
| 三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型) | 983円 |
| 三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型) | 983円 |
| 三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) | 983円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型) | 2,559,476,016円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) | 42,678,508円 |
| MUAMトピックスリスクコントロール (10%) インデックスファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定) | 133,410,509円 |
| マクロ・トータル・リターン・ファンド | 9,820円 |
| 合計 | 4,340,785,954円 |