

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 追加型投信／内外／その他資産 | |
|--------|--|---|
| 信託期間 | 2020年2月19日まで（2015年2月27日設定） | |
| 運用方針 | ファンド・オブ・ファンズ方式により、高水準の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CoCosオープン為替ヘッジなしコース（毎月決算型） | ワールド・ココス・ファンドアンヘッジド・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・ココス・ファンドアンヘッジド・クラス | 世界各国の金融機関が発行するCoCos |
| | 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"> ・ 世界各国の金融機関が発行するCoCosを主要投資対象とします。 ・ 信用リスクに注視しつつ、リターンの獲得を目指します。 ・ 保有する外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行いません。 | |
| 主な組入制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・ 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・ 1発行体等あたりの株式等、債券等およびデリバティブ等の当ファンドの純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とします。 | |
| 分配方針 | 毎月19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、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」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CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（毎月決算型）

愛称：ココマスター



第5期（決算日：2015年9月24日）
 第6期（決算日：2015年10月19日）
 第7期（決算日：2015年11月19日）
 第8期（決算日：2015年12月21日）
 第9期（決算日：2016年1月19日）
 第10期（決算日：2016年2月19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CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（毎月決算型）（愛称：ココマスター）」は、去る2月19日に第10期の決算を行いましたので、法令に基づいて第5期～第10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CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（毎月決算型）のご報告

| | |
|---------------------------|----|
| ◇設定以来の運用実績 | 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 | 7 |
| ◇1万口当たりの費用明細 | 8 |
| ◇売買及び取引の状況 | 9 |
| ◇利害関係人との取引状況等 | 9 |
| ◇自社による当ファンドの設定・解約状況 | 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・ココス・ファンド アンヘッジド・クラス | 15 |
| ◇マネー・プール マザーファンド | 16 |

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。
- ・－印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 (分配落) | 税 込 分 配 金 | | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 比 | 純 資 産 総 額 | |
|---------------------|------------------|-----------|--------|---|-------------|-------------|---------------|--------------|-----------|
| | | 税 分 | 込 配 | 金 | | | | | 期 騰 落 中 率 |
| (設定日) 2015年2月27日 | 円 10,000 | | 円 － | | % － | % － | % － | 百万円 1,497 | |
| 1期(2015年5月19日) | 10,160 | | 25 | | 1.9 | 0.0 | － | 98.0 | 1,836 |
| 2期(2015年6月19日) | 10,225 | | 25 | | 0.9 | 0.0 | － | 98.0 | 1,960 |
| 3期(2015年7月21日) | 10,381 | | 25 | | 1.8 | 0.0 | － | 98.0 | 1,985 |
| 4期(2015年8月19日) | 10,361 | | 25 | | 0.0 | 0.0 | － | 98.0 | 1,967 |
| 5期(2015年9月24日) | 10,104 | | 25 | | △2.2 | 0.0 | － | 98.0 | 1,595 |
| 6期(2015年10月19日) | 9,912 | | 25 | | △1.7 | 0.0 | － | 98.0 | 1,379 |
| 7期(2015年11月19日) | 10,176 | | 25 | | 2.9 | 0.0 | － | 98.0 | 1,313 |
| 8期(2015年12月21日) | 9,994 | | 25 | | △1.5 | 0.0 | － | 98.0 | 1,117 |
| 9期(2016年1月19日) | 9,397 | | 25 | | △5.7 | 0.0 | － | 98.4 | 993 |
| 10期(2016年2月19日) | 8,725 | | 25 | | △6.9 | 0.0 | － | 98.0 | 890 |

(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) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

※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 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 比 | 信 託 券 率 |
|------|---------------------|-------------|--------|-----------|-----------|-------------|-----------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | |
| 第5期 | (期首) 2015年8月19日 | 円 10,361 | % — | 0.0 | % — | — | % 98.0 |
| | 8月末 | 10,104 | △2.5 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | (期末) 2015年9月24日 | 10,129 | △2.2 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| 第6期 | (期首) 2015年9月24日 | 10,104 | — | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | 9月末 | 9,726 | △3.7 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | (期末) 2015年10月19日 | 9,937 | △1.7 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| 第7期 | (期首) 2015年10月19日 | 9,912 | — | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | 10月末 | 10,068 | 1.6 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | (期末) 2015年11月19日 | 10,201 | 2.9 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| 第8期 | (期首) 2015年11月19日 | 10,176 | — | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | 11月末 | 10,073 | △1.0 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | (期末) 2015年12月21日 | 10,019 | △1.5 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| 第9期 | (期首) 2015年12月21日 | 9,994 | — | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | 12月末 | 9,928 | △0.7 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | (期末) 2016年1月19日 | 9,422 | △5.7 | 0.0 | — | — | 98.4 |
| 第10期 | (期首) 2016年1月19日 | 9,397 | — | 0.0 | — | — | 98.4 |
| | 1月末 | 9,511 | 1.2 | 0.0 | — | — | 98.0 |
| | (期末) 2016年2月19日 | 8,750 | △6.9 | 0.0 | — | — | 98.0 |

(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。

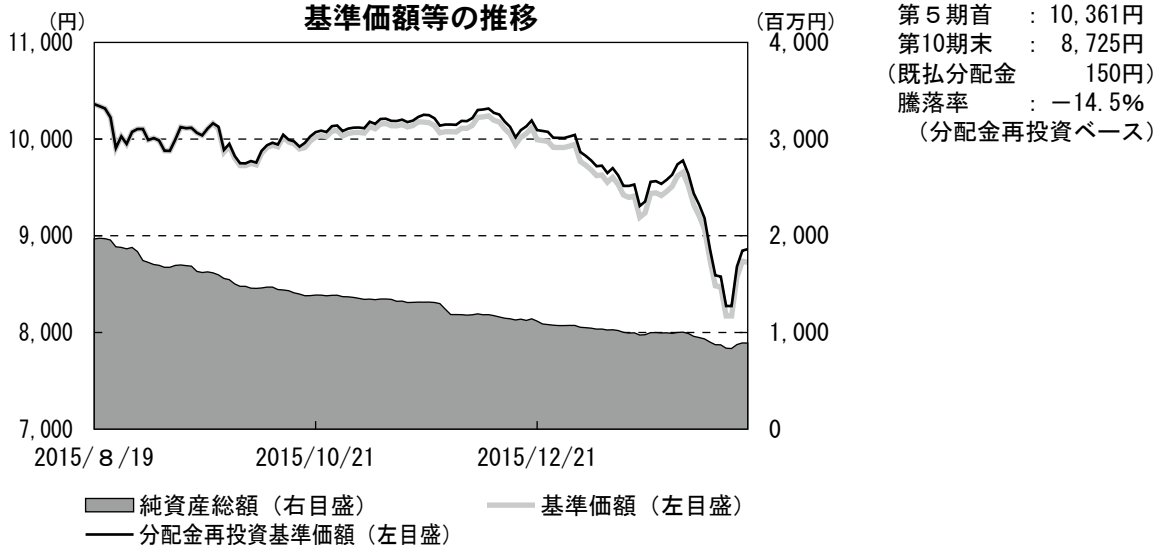
運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について

（第5期～第10期：2015/8/20～2016/2/19）

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ14.5%（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

下落要因

2016年2月のCoCos市場の急落を受け保有するCoCosの価格が下落したことや、保有する外貨建資産の各通貨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5期～第10期：2015/8/20～2016/2/19）

◎CoCos市況

- ・ 当作成期を通してみると、CoCos市場は下落しました。
- ・ CoCos市場は、中国の景気減速懸念や資源価格の下落などを背景に一時的に弱含む局面があったものの、2015年末までは概ね底堅く推移しました。2016年に入り、世界的にリスク回避の動きが強まるなかCoCos市場も下落基調となり、ドイツ銀行の赤字決算をきっかけに同行発行のCoCosのクーポン支払いに対する懸念が高まると、その他の欧州銀行のCoCosにも下落が波及し、CoCos市場は急落する展開となりました。

◎為替市況

- ・ 米ドルは、2016年1月末には日銀によるマイナス金利導入を受け円安・米ドル高が進んだものの、2月に入ると市場のリスク回避の動きから円が急伸し、作成期を通してみると円に対して下落しました。
- ・ ユーロは、2016年1月末に日銀がマイナス金利導入を決定すると円に対し強含む局面があったものの、市場のリスク回避の動きなどから概ね円高・ユーロ安基調となり、作成期を通してみると円に対して下落しました。
- ・ 英ポンドは、円に対し底堅く推移したものの、2015年12月に入り、一部の経済指標が下方修正されたことなどを受け下落基調となり、作成期を通してみると円に対して下落しました。

◎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。2016年2月18日以降の金利は、日銀のマイナス金利政策の決定などから0%を下回り、足元はマイナス0.01%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%以下で推移しました。2016年1月29日以降は、日銀のマイナス金利政策の決定などから利回りは一時的にマイナス0.2%程度まで急低下したものの、足元はマイナス0.1%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CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（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・ココス・ファンド アンヘッジド・クラスの受益証券を高位に組み入れ、マネー・プール マザーファンドの受益証券への投資も行いました。

<ワールド・ココス・ファンド アンヘッジド・クラス>

（当記載は、ワールド・ココス・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。）

- ・ 世界各国の金融機関が発行するCoCosに投資を行い、保有する外貨建資産について、為替ヘッジは行いませんでした。
- ・ ポートフォリオの構築にあたっては、経済や金利などのマクロ的な投資環境の予測を基にしたトップダウン・アプローチと、個々の発行体の債務返済能力等を調査・分析するボトムアップ・アプローチを統合的に活用し、クレジット・ファンダメンタルズ（財務状況の基礎的条件）を重視した銘柄選択を実施しました。主として相対的に高い利回りが期待されるCoCosに分散投資を行いました。
- ・ 経済環境が良好な国で事業を行っている発行体、かつ発行体の資本、流動性、リスクなどが改善傾向にあると考える銘柄を選好した結果、国別では、英国やスイス、スペインなどの組み入れが高位となりました。
- ・ 銘柄では、欧州で最も高水準の資本を有する銀行の1つであることに加え、バリュエーション（投資価値基準）が魅力的であると判断したインテサ・サンパオロを新規に組み入れました。また、バークレイズについて、発行体の事業ファンダメンタルズは評価する一方で、次回コール日（償還可能日）でのコール見送りによる価格下落リスクを考慮し、同一発行体での銘柄入れ替えを行いました。
- ・ 当作成期は、ウニクレディットの保有がプラスに寄与したものの、アライド・アイリッシュ・バンクスを筆頭に保有する大半のCoCosの価格が下落したことがマイナスに作用し、ポートフォリオのリターンはマイナスとなりました。

<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）現先取引およびコール・ローンへの投資を通じて、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、利子等収益が積み上がったことなどにより、基準価額は上昇しました。

（ご参考）

銘柄格付別組入比率（現地2016年1月末）

| 格付 | 比率 |
|-------|-------|
| AAA | — |
| AA | — |
| A | — |
| BBB | 9.4% |
| BB | 77.9% |
| B | 11.4% |
| CCC | — |
| CC以下 | — |
| 格付けなし | — |

通貨別組入比率（現地2016年1月末）

| 通貨 | 比率 |
|--------|--------|
| ユーロ | 44.6% |
| 米ドル | 32.4% |
| 英ポンド | 21.6% |
| キャッシュ等 | 1.4% |
| 合計 | 100.0% |

※比率はワールド・ココス・ファンドの純資産総額に対する割合です。

※キャッシュ等には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。

※保有している証券に係る格付けにおいて、S&P社、Moody's社およびFitch社により格付けが付与されている銘柄については、最も高い格付けをS&P社の表示方法で表記しています。（格付けのデータ出所：ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー）

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマーク等を設けておりません。そのため、記載すべき事項はありません。

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5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 |
|-----------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| | 2015年8月20日～ 2015年9月24日 | 2015年9月25日～ 2015年10月19日 | 2015年10月20日～ 2015年11月19日 | 2015年11月20日～ 2015年12月21日 | 2015年12月22日～ 2016年1月19日 | 2016年1月20日～ 2016年2月19日 |
| 当期分配金 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| （対基準価額比率） | 0.247% | 0.252% | 0.245% | 0.250% | 0.265% | 0.286% |
| 当期の収益 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 427 | 449 | 479 | 496 | 514 | 530 |

（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CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（毎月決算型）>

◎今後の運用方針

- ・引き続き、円建の外国投資信託であるワールド・ココス・ファンド アンヘッジド・クラス
の受益証券を主要投資対象とします。また、マネー・プール マザーファンドの受益証券へ
も投資を行います。

<ワールド・ココス・ファンド アンヘッジド・クラス>

（当記載は、ワールド・ココス・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。）

◎運用環境の見直し

- ・足元のCoCos市場は、下落基調を強める局面を見せるものの、中長期的なファンダメン
タルズは底堅いと考えています。金融危機前と比べて規制当局が主導する銀行のレバレッジ
解消の動きにより、銀行の資本基盤は拡大しており、銀行セクターのリスクは大きく低下し
ています。加えて、銀行セクターは、数年かけて資本構造の強化を行っている途上にありま
す。またCoCosは、新しい資産クラスであることや構造が複雑であることから市場の理
解は十分に進んでいない面もあります。こうした銀行セクターやCoCosへの市場の理解
が進む過程において、CoCosへの需要は今後更に高まっていくとみています。こうした
見直しの下、スプレッド（国債との利回り差）はファンダメンタルズで想定される水準より
も高く、比較的高いインカム収入とスプレッド縮小の可能性から、CoCosには投資機会
があるとみています。

◎今後の運用方針

- ・世界各国の金融機関が発行するCoCosに投資を行い、保有する外貨建資産について、原
則として為替ヘッジは行わない方針です。
- ・資本、流動性、リスクなどの面で改善が続くことが見込まれる発行体について、クレジッ
ト・ファンダメンタルズに基づき投資を行う方針です。加えて、事業環境の改善が見込ま
れる国で事業を行っている発行体を重視した運用を継続します。また、足元のバリュエーショ
ンは引き続き魅力的な水準にあるとみており、市場動向を注視しつつ、投資機会を探ってい
く方針です。

<マネー・プール マザーファンド>

◎運用環境の見直し

- ・中国経済の減速などから原油価格が大幅に下落した結果、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、今後も金融緩和と政策が継続され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）現先取引およびコール・ローン等への
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

（2015年8月20日～2016年2月19日）

| 項目 | 第5期～第10期 | | 項目の概要 |
|--|-----------------------------|---|---|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社） | 55円 (19) (35) (2) | 0.559% (0.190) (0.353) (0.016) | (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） 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 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 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 （監査費用） | 0 (0) | 0.002 (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 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 | 55 | 0.561 | |
| 作成期中の平均基準価額は、9,901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）消費税は報告日の税率を採用しています。

（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

（2015年8月20日～2016年2月19日）

投資信託証券

| 銘 | | 柄 | | 第5期～第10期 | | | |
|-------------|---------------|------------|---------|--------------|----------|---------------|-----|
| | | | | 買 付 | | 売 付 | |
| | | | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国 (邦貨建) | ワールド・ココス・ファンド | アンヘッジド・クラス | 千口 7 | 千円 74,074 | 千口 93 | 千円 912,700 | |

（注）金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2015年8月20日～2016年2月19日）

利害関係人との取引状況

<世界CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（毎月決算型）>

該当事項はございません。

<マネー・プール マザーファンド>

| 区 分 | 第5期～第10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 | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 900 | 百万円 99 | % 11.0 | 百万円 - | 百万円 - | % - |

平均保有割合 0.0%

※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。

（注）公社債には現先などによるものを含まません。

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

| 作成期首残高(元本) | 当作成期設定元本 | 当作成期解約元本 | 作成期末残高(元本) | 取引の理由 |
|------------|----------|----------|------------|-----------------------|
| 百万円 1 | 百万円 - | 百万円 1 | 百万円 - | 商品性を適正に維持するための取得とその処分 |

○組入資産の明細

(2016年2月19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4期末 | | 第10期末 | | | |
|---------------|------------|------|-----------|-------|-----------|---------------|-----------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| ワールド・ココス・ファンド | アンヘッジド・クラス | | 千口 187 | | 千口 102 | 千円 872,337 | % 98.0 |
| 合 | 計 | | 187 | | 102 | 872,337 | 98.0 |

(注) 比率は世界CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（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4期末 | | 第10期末 | | |
|---------|---------|------|---------|-------|---------|----------|
| | | 口 | 数 | 口 | 数 | 評 価 額 |
| マネー・プール | マザーファンド | | 千口 9 | | 千口 9 | 千円 10 |

○投資信託財産の構成

(2016年2月19日現在)

| 項 | 目 | 第10期末 | |
|--------------|---------|---------------|-----------|
| | | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | | 千円 872,337 | % 97.6 |
| マネー・プール | マザーファンド | 10 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | | 21,250 | 2.4 |
| 投資信託財産総額 | | 893,597 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第5期末 | 第6期末 | 第7期末 | 第8期末 | 第9期末 | 第10期末 |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2015年9月24日現在 | 2015年10月19日現在 | 2015年11月19日現在 | 2015年12月21日現在 | 2016年1月19日現在 | 2016年2月19日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 1,636,634,298 | 1,428,159,007 | 1,320,127,644 | 1,157,274,563 | 1,009,236,717 | 893,597,031 |
| コール・ローン等 | 43,295,897 | 52,334,858 | 31,036,782 | 52,943,320 | 24,480,104 | 20,049,351 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 1,563,328,336 | 1,351,814,075 | 1,287,080,816 | 1,094,321,160 | 977,746,572 | 872,337,675 |
| マネー・ブール マザーファンド(評価額) | 10,001 | 10,001 | 10,001 | 10,002 | 10,002 | 10,005 |
| 未収入金 | 30,000,000 | 24,000,000 | 2,000,000 | 10,000,000 | 7,000,000 | 1,200,000 |
| 未収利息 | 64 | 73 | 45 | 81 | 39 | — |
| (B) 負債 | 41,220,283 | 48,471,475 | 6,955,660 | 40,186,824 | 15,776,246 | 3,443,636 |
| 未払金 | — | — | — | 9,000,000 | — | — |
| 未払収益分配金 | 3,947,488 | 3,479,958 | 3,226,219 | 2,794,404 | 2,643,108 | 2,550,482 |
| 未払解約金 | 35,343,197 | 43,870,241 | 2,449,955 | 27,221,535 | 12,199,250 | — |
| 未払信託報酬 | 1,922,147 | 1,116,947 | 1,274,548 | 1,166,367 | 930,283 | 889,710 |
| その他未払費用 | 7,451 | 4,329 | 4,938 | 4,518 | 3,605 | 3,444 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,595,414,015 | 1,379,687,532 | 1,313,171,984 | 1,117,087,739 | 993,460,471 | 890,153,395 |
| 元本 | 1,578,995,499 | 1,391,983,529 | 1,290,487,868 | 1,117,761,616 | 1,057,243,522 | 1,020,193,022 |
| 次期繰越損益金 | 16,418,516 | △ 12,295,997 | 22,684,116 | △ 673,877 | △ 63,783,051 | △ 130,039,627 |
| (D) 受益権総口数 | 1,578,995,499口 | 1,391,983,529口 | 1,290,487,868口 | 1,117,761,616口 | 1,057,243,522口 | 1,020,193,022口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,104円 | 9,912円 | 10,176円 | 9,994円 | 9,397円 | 8,725円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 |
|------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| | 2015年8月20日～ 2015年9月24日 | 2015年9月25日～ 2015年10月19日 | 2015年10月20日～ 2015年11月19日 | 2015年11月20日～ 2015年12月21日 | 2015年12月22日～ 2016年1月19日 | 2016年1月20日～ 2016年2月19日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 8,764,153 | 7,620,985 | 7,301,337 | 5,917,567 | 5,407,055 | 5,113,818 |
| 受取配当金 | 8,761,482 | 7,619,412 | 7,299,732 | 5,915,964 | 5,405,842 | 5,112,828 |
| 受取利息 | 2,671 | 1,573 | 1,605 | 1,603 | 1,213 | 990 |
| (B) 有価証券売買損益 | △43,372,825 | △29,415,261 | 31,254,550 | △22,160,779 | △64,969,410 | △70,162,038 |
| 売買益 | 9,454,426 | 4,913,577 | 32,723,036 | 1,655,334 | 1,090,259 | 1,221,545 |
| 売買損 | △52,827,251 | △34,328,838 | △1,468,486 | △23,816,113 | △66,059,669 | △71,383,583 |
| (C) 信託報酬等 | △1,929,598 | △1,121,276 | △1,279,486 | △1,170,885 | △933,888 | △893,154 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △36,538,270 | △22,915,552 | 37,276,401 | △17,414,097 | △60,496,243 | △65,941,374 |
| (E) 前期繰越損益金 | 52,305,247 | 10,304,765 | △14,869,505 | 16,455,732 | △3,542,739 | △64,265,272 |
| (F) 追加信託差損益金 | 4,599,027 | 3,794,748 | 3,503,439 | 3,078,892 | 2,899,039 | 2,717,501 |
| (配当等相当額) | (6,336,875) | (6,181,247) | (5,898,688) | (5,611,274) | (5,398,551) | (5,268,101) |
| (売買損益相当額) | (△ 1,737,848) | (△ 2,386,499) | (△ 2,395,249) | (△ 2,532,382) | (△ 2,499,512) | (△ 2,550,600) |
| (G) 計(D+E+F) | 20,366,004 | △8,816,039 | 25,910,335 | 2,120,527 | △61,139,943 | △127,489,145 |
| (H) 収益分配金 | △3,947,488 | △3,479,958 | △3,226,219 | △2,794,404 | △2,643,108 | △2,550,482 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 16,418,516 | △12,295,997 | 22,684,116 | △673,877 | △63,783,051 | △130,039,627 |
| 追加信託差損益金 | 4,599,027 | 3,794,748 | 3,503,439 | 3,078,892 | 2,899,039 | 2,717,501 |
| (配当等相当額) | (6,336,875) | (6,181,247) | (5,898,688) | (5,611,274) | (5,398,551) | (5,268,101) |
| (売買損益相当額) | (△ 1,737,848) | (△ 2,386,499) | (△ 2,395,249) | (△ 2,532,382) | (△ 2,499,512) | (△ 2,550,600) |
| 分配準備積立金 | 61,199,104 | 56,375,901 | 55,929,914 | 49,936,383 | 48,971,680 | 48,866,937 |
| 繰越損益金 | △49,379,615 | △72,466,646 | △36,749,237 | △53,689,152 | △115,653,770 | △181,624,065 |

(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 1,898,779,675円
 作成期中追加設定元本額 53,172,562円
 作成期中一部解約元本額 931,759,215円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8725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130,039,627円です。
- ③分配金の計算過程

| 項 目 | 2015年8月20日～ 2015年9月24日 | 2015年9月25日～ 2015年10月19日 | 2015年10月20日～ 2015年11月19日 | 2015年11月20日～ 2015年12月21日 | 2015年12月22日～ 2016年1月19日 | 2016年1月20日～ 2016年2月19日 |
|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 6,834,569円 | 6,499,709円 | 7,059,002円 | 4,746,683円 | 4,473,168円 | 4,220,667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 | －円 | －円 | －円 | －円 | －円 |
| 収益調整金額 | 6,336,875円 | 6,181,247円 | 5,898,688円 | 5,611,274円 | 5,398,551円 | 5,268,101円 |
| 分配準備積立金額 | 58,312,023円 | 53,356,150円 | 52,097,131円 | 47,984,104円 | 47,141,620円 | 47,196,752円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 71,483,467円 | 66,037,106円 | 65,054,821円 | 58,342,061円 | 57,013,339円 | 56,685,520円 |
| 1万円当たり収益分配対象額 | 452円 | 474円 | 504円 | 521円 | 539円 | 555円 |
| 1万円当たり分配金額 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 |
| 収益分配金金額 | 3,947,488円 | 3,479,958円 | 3,226,219円 | 2,794,404円 | 2,643,108円 | 2,550,482円 |

○分配金のお知らせ

| | 第5期 | 第6期 | 第7期 | 第8期 | 第9期 | 第10期 |
|----------------|-----|-----|-----|-----|-----|------|
| 1万円当たり分配金(税込み) | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25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。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」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 (<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ず。））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2月19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（552,934千口）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10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 396,500 | 千円 398,759 | % 71.7 | % — | % — | % — | % 71.7 |
| 合 計 | 396,500 | 398,759 | 71.7 | — | — | — | 71.7 |

(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。

(注) BB格以下組入比率の計算においては、Moody'sとS&Pの格付けのうち高いものを採用しています。

(B)国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | 第10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98回利付国債（5年） | 0.3 | 100,000 | 100,156 | 2016/6/20 |
| 第277回利付国債（10年） | 1.6 | 67,900 | 67,985 | 2016/3/20 |
| 第279回利付国債（10年） | 2.0 | 28,600 | 28,644 | 2016/3/20 |
| 第280回利付国債（10年） | 1.9 | 50,000 | 50,337 | 2016/6/20 |
| 第282回利付国債（10年） | 1.7 | 150,000 | 151,636 | 2016/9/20 |
| 合 計 | | 396,500 | 398,759 | |

〈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CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（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。

なお、世界CoCosオープン 為替ヘッジなしコース（毎月決算型）の第10期決算日（2016年2月19日）現在において、入手し得る直近の決算データが存在しないため、掲載していません。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-----------|--|
| 名 称 | ワールド・ココス・ファンド アンヘッジド・クラス |
| 運 用 方 針 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 世界各国の金融機関が発行するCoCosを主要投資対象とします。 2. 信用リスクに注視しつつ、リターンの獲得を目指します。 3. 保有する外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行いません。 4. 資金動向や市況動向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 | ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー |
| 信 託 期 限 | 無期限 |
| 設 定 日 | 2015年2月27日 |
| 会 計 年 度 末 | 毎年12月末 |
| 収 益 分 配 | 原則として、毎月分配を行います。 |

「ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー」について

ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーは、1928年に創業した米国最古の運用機関の一つであり、グローバルに事業を展開しています。また、CoCosが初めて発行された2009年からCoCosへの投資を行っています。

マネー・プール マザーファンド

《第13期》決算日2016年1月14日

[計算期間：2015年7月15日～2016年1月14日]

「マネー・プール マザーファンド」は、1月14日に第13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13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 |
| 9期(2014年1月14日) | 10,042 | | 0.0 | 90.4 | — | 1,437 |
| 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 |

(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 | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|-----|--------|-----------|--------|--------|
| | | 期騰 | 落率 | | | |
| (期首) 2015年7月14日 | 円 10,049 | | % — | % 85.2 | % — | % — |
| 7月末 | 10,049 | | 0.0 | 81.4 | — | — |
| 8月末 | 10,049 | | 0.0 | 73.7 | — | — |
| 9月末 | 10,049 | | 0.0 | 60.9 | — | — |
| 10月末 | 10,049 | | 0.0 | 55.9 | — | — |
| 11月末 | 10,049 | | 0.0 | 76.4 | — | — |
| 12月末 | 10,049 | | 0.0 | 76.4 | — | — |
| (期末) 2016年1月14日 | 10,049 | | 0.0 | 70.3 | — | — |

(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

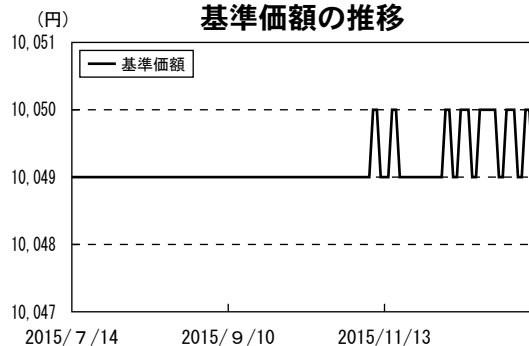
当期中の基準価額等の推移について

(第13期：2015/7/15～2016/1/14)

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。

基準価額の推移



基準価額の主な変動要因

| | |
|------|---|
| 上昇要因 | 残存期間が1年以内の国債、国庫短期証券を中心に投資を行い、利子等収益が積みあがったことが、基準価額のプラスに寄与しました。 |
| 下落要因 | 期末にかけての金利上昇により、保有債券の評価額が下落したことが、基準価額のマイナスに作用しました。 |

投資環境について

(第13期：2015/7/15～2016/1/14)

◎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。

<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。

当該投資信託のポートフォリオについて

- ・わが国の国債や短期国債（国庫短期証券）現先取引およびコール・ローンへの投資を通じて、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、利子等収益は積みあがったものの、期末にかけて金利が上昇したことにより保有債券の評価額が下落したことなどの影響から、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

当ファンドは運用の目標となるベンチマーク等を設けておりません。そのため、記載すべき事項はありません。

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大幅に下落した結果、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され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）現先取引およびコール・ローンへの投資を通じて、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

(2015年7月15日～2016年1月14日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2015年7月15日～2016年1月14日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|------|------------|--------------------------|
| 国 | | 千円 | 千円 |
| 内 | 国債証券 | 19,053,657 | 18,253,598 (900,000) |

(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、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

(2015年7月15日～2016年1月14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 | $\frac{D}{C}$ | |
| 公社債 | 百万円 99 | % 6.6 | | 百万円 - | 百万円 - | % - |

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

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

○組入資産の明細

(2016年1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 | |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 596,500 (200,000) | 599,097 (200,000) | 70.3 (23.5) | — (—) | — (—) | — (—) | — (—) | 70.3 (23.5) |
| 合 計 | 596,500 (200,000) | 599,097 (200,000) | 70.3 (23.5) | — (—) | — (—) | — (—) | — (—) | 70.3 (23.5) |

(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。

(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。

(注) BB格以下組入比率の計算においては、Moody'sとS&Pの格付けのうち高いものを採用しています。

(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 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第566回国庫短期証券 | — | 200,000 | 200,000 | 2016/2/1 |
| 第98回利付国債(5年) | 0.3 | 100,000 | 100,143 | 2016/6/20 |
| 第277回利付国債(10年) | 1.6 | 67,900 | 68,088 | 2016/3/20 |
| 第279回利付国債(10年) | 2.0 | 28,600 | 28,698 | 2016/3/20 |
| 第280回利付国債(10年) | 1.9 | 50,000 | 50,408 | 2016/6/20 |
| 第282回利付国債(10年) | 1.7 | 150,000 | 151,759 | 2016/9/20 |
| 合 計 | | 596,500 | 599,097 | |

○投資信託財産の構成

(2016年1月14日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 599,097 | 69.3 |
| コール・ローン等、その他 | 265,754 | 30.7 |
| 投資信託財産総額 | 864,851 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年1月14日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 864,851,365 |
| コール・ローン等 | 264,330,720 |
| 公社債(評価額) | 599,097,253 |
| 未収利息 | 923,848 |
| 前払費用 | 499,544 |
| (B) 負債 | 12,845,587 |
| 未払解約金 | 12,845,587 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 852,005,778 |
| 元本 | 847,818,437 |
| 次期繰越損益金 | 4,187,341 |
| (D) 受益権総口数 | 847,818,437口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,049円 |

○損益の状況 (2015年7月15日～2016年1月14日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,166,843 |
| 受取利息 | 1,166,843 |
| (B) 有価証券売買損益 | △1,108,066 |
| 売買益 | 594 |
| 売買損 | △1,108,660 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 58,777 |
| (D) 前期繰越損益金 | 3,991,676 |
| (E) 追加信託差損益金 | 8,294,094 |
| (F) 解約差損益金 | △8,157,206 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 4,187,341 |
| 次期繰越損益金(G) | 4,187,341 |

<注記事項>

- ①期首元本額 817,500,936円
 期中追加設定元本額 1,688,467,883円
 期中一部解約元本額 1,658,150,382円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0049円です。

- (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) (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。

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・円安追随型 | 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) マナー・プール・ファンド (年2回決算型) | 15,830,391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) マナー・プール・ファンドII (年2回決算型) | 6,986,485円 |
| 日本株 2.5ブルベア・オープンII (マナー・プール・ファンドVIII) | 514,333,828円 |
| マナー・プール・ファンドIV | 977,929円 |
| マナー・プール・ファンドVI | 103,149,659円 |
| マナー・プール・ファンドVII (適格機関投資家専用) | 976,561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) マナー・プール・ファンドV (年2回決算型) | 137,774,158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 QTX-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 QTX-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 QTX-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 QTX-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) | 15,412,317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) | 3,319,231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 | | | 847,818,437円 |