

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	2015年11月16日まで（2010年11月10日設定）	
運用方針	<p>主として円建ての外国投資信託であるピムコバミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY) の投資信託証券への投資を通じて、米ドル建てのハイイールド債券等に実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。また、当該外国投資信託への投資を通じて、実質的な保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。投資信託証券への運用の指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。</p>	
主要運用対象	米国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)	ピムコ バミューダ U.S. ハイイールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY) およびマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
	ピムコバミューダ U.S. ハイイールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)	ピムコ バミューダ U.S. ハイイールド ボンド ファンド (M) への投資を通じて、米ドル建てハイイールド債券およびその派生商品等を主要投資対象とします。
	マネー・マーケット・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。外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。	
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。

償還報告書（全体版）

[満期償還]

米国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)

愛称：マイカレンシー

第54期（決算日：2015年6月15日）

第55期（決算日：2015年7月15日）

第56期（決算日：2015年8月17日）

第57期（決算日：2015年9月15日）

第58期（決算日：2015年10月15日）

信託終了日：2015年11月16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、「米国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）」は、この度、信託期間を満了し、償還の運びとなりました。ここに謹んで運用経過と償還内容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投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

MUFG

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

米国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)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
◇1 万口当たりの費用明細	10
◇売買及び取引の状況	11
◇利害関係人との取引状況等	11
◇組入資産の明細	12
◇投資信託財産の構成	12
◇資産、負債、元本及び基準（償還）価額の状況	13
◇損益の状況	14
◇投資信託財産運用総括表	15
◇分配金のお知らせ	17
◇償還金のお知らせ	17
◇お知らせ	17

投資対象ファンドのご報告

◇ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)	18
◇マネー・マーケット・マザーファンド	20

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決算期	基 (分配落)	準 価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分 配 金	期 騰 落				
	円 銭	円	%	%	%	%	百万円
30期(2013年6月17日)	10,389	40	△2.4	0.1	—	99.1	444
31期(2013年7月16日)	10,337	40	△0.1	0.1	—	99.0	458
32期(2013年8月15日)	10,298	40	0.0	0.1	—	99.2	418
33期(2013年9月17日)	10,260	40	0.0	0.1	—	99.4	406
34期(2013年10月15日)	10,325	40	1.0	0.1	—	99.3	402
35期(2013年11月15日)	10,381	40	0.9	0.1	—	97.4	384
36期(2013年12月16日)	10,411	40	0.7	0.1	—	99.1	321
37期(2014年1月15日)	10,449	40	0.7	0.1	—	99.2	318
38期(2014年2月17日)	10,464	40	0.5	0.1	—	98.9	300
39期(2014年3月17日)	10,491	40	0.6	0.1	—	98.9	287
40期(2014年4月15日)	10,509	40	0.6	0.1	—	98.7	293
41期(2014年5月15日)	10,545	40	0.7	0.1	—	99.3	293
42期(2014年6月16日)	10,579	40	0.7	0.1	—	99.0	257
43期(2014年7月15日)	10,522	40	△0.2	0.1	—	97.7	248
44期(2014年8月15日)	10,474	40	△0.1	0.1	—	98.5	244
45期(2014年9月16日)	10,369	40	△0.6	0.1	—	98.9	238
46期(2014年10月15日)	10,189	40	△1.4	0.1	—	99.1	225
47期(2014年11月17日)	10,355	40	2.0	0.1	—	98.7	222
48期(2014年12月15日)	9,996	40	△3.1	0.1	—	99.3	211
49期(2015年1月15日)	10,150	40	1.9	0.1	—	99.2	211
50期(2015年2月16日)	10,330	40	2.2	0.1	—	98.1	207
51期(2015年3月16日)	10,246	40	△0.4	0.1	—	97.7	189
52期(2015年4月15日)	10,354	40	1.4	0.1	—	98.5	186
53期(2015年5月15日)	10,269	40	△0.4	0.1	—	99.3	182
54期(2015年6月15日)	10,130	40	△1.0	0.1	—	98.5	172
55期(2015年7月15日)	10,083	40	△0.1	0.1	—	99.4	167
56期(2015年8月17日)	9,922	40	△1.2	0.1	—	99.2	163
57期(2015年9月15日)	9,903	40	0.2	0.1	—	98.5	159
58期(2015年10月15日)	9,534	40	△3.3	0.1	—	99.5	152
(償還時)	(償還価額)						
59期(2015年11月16日)	9,521.59	—	△0.1	—	—	—	152

(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) 米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ(マネーパールファンドを除く)は、米ドル建てのハイイールド債券等に実質的な投資を行うとともに、米ドル売り、各ファンドの対象通貨買いの為替取引を行うことで、信託財産の成長と収益の確保をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、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) 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」は買建比率ー売建比率。

○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 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		円 銭	騰 落 率			
第54期	(期 首) 2015年 5月15日	10,269	—	0.1	—	99.3
	5月末	10,290	0.2	0.1	—	93.3
	(期 末) 2015年 6月15日	10,170	△1.0	0.1	—	98.5
第55期	(期 首) 2015年 6月15日	10,130	—	0.1	—	98.5
	6月末	10,067	△0.6	0.1	—	97.9
	(期 末) 2015年 7月15日	10,123	△0.1	0.1	—	99.4
第56期	(期 首) 2015年 7月15日	10,083	—	0.1	—	99.4
	7月末	10,064	△0.2	0.1	—	98.8
	(期 末) 2015年 8月17日	9,962	△1.2	0.1	—	99.2
第57期	(期 首) 2015年 8月17日	9,922	—	0.1	—	99.2
	8月末	9,915	△0.1	0.1	—	97.5
	(期 末) 2015年 9月15日	9,943	0.2	0.1	—	98.5
第58期	(期 首) 2015年 9月15日	9,903	—	0.1	—	98.5
	9月末	9,576	△3.3	0.1	—	98.4
	(期 末) 2015年10月15日	9,574	△3.3	0.1	—	99.5
第59期	(期 首) 2015年10月15日	9,534	—	0.1	—	99.5
	10月末	9,530	△0.0	0.1	—	99.5
	(償還時) 2015年11月16日	(償還価額) 9,521.59	△0.1	—	—	—

(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。

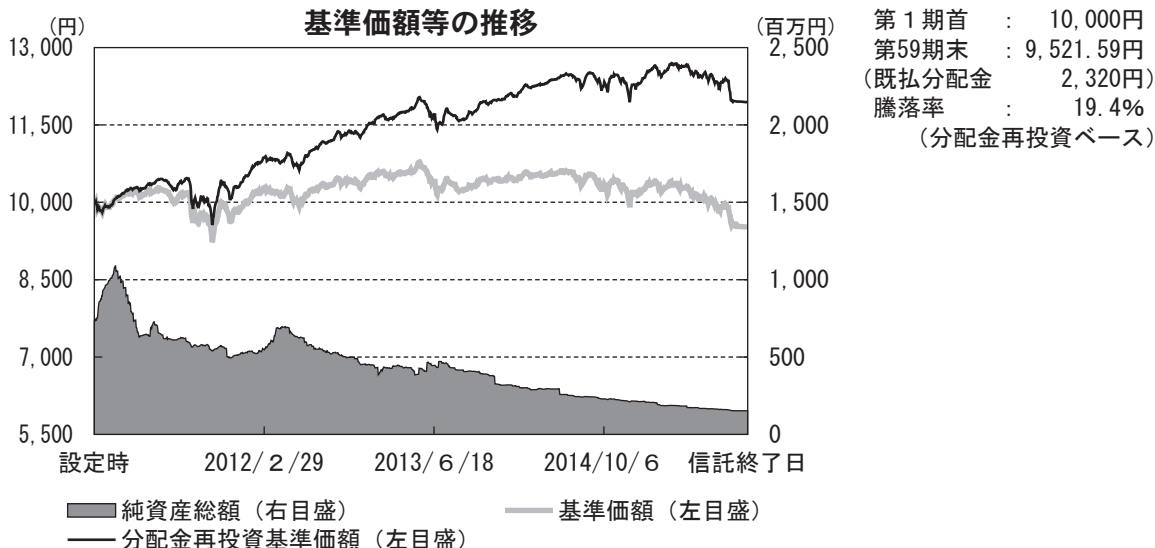
運用経過

設定来の基準価額等の推移について

(第1期～第59期：2010/11/10～2015/11/16)

基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ19.4% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。



- ・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。

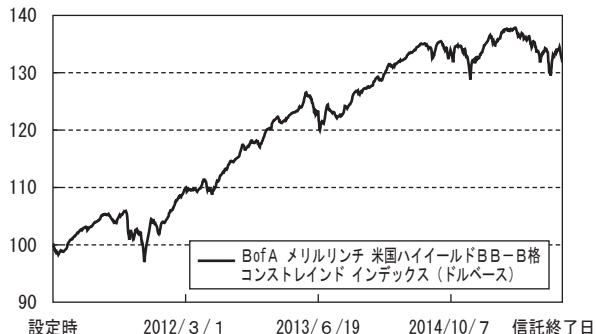
基準価額の主な変動要因

上昇要因	債券利子収入を享受したことに加え、米国ハイイールド債券市況が上昇したことなどが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	為替ヘッジによるコストなど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1期～第59期：2010/11/10～2015/11/16)

債券市況の推移
(設定時を100として指数化)



(注) 現地日付ベースで記載しております。

(注) BofA メリルリンチ 米国ハイイールドBB-B格 コンストレインド インデックスとは、BofA メリルリンチ社が算出する米国のハイイールド債券の値動きを示す指数です。

◎債券市況

- ・ 設定時から2014年6月末にかけては、米国債の格下げや欧州債務危機への懸念により市場心理が悪化し、米国ハイイールド債券市況は下落する局面もみられました。しかし、2011年10月に欧州債務問題の解決に向けた前進がみられたことで市場心理が改善し、相場は上昇に転じました。さらに、米国での好調な企業決算の発表、雇用や住宅市場の回復もプラス材料となり、2014年半ばにかけて相場は上昇基調を保ちました。
- ・ 6月末から信託終了日にかけては、中東やウクライナでの地政学的リスクの高まり、原油価格の急落、中国経済の減速への不安視といった市場心理を悪化させる要因がみられ相場の上値が抑えられる展開となりました。

◎国内短期金融市場

- ・ 設定時から2013年4月までは、日銀はコール・レート（無担保・翌日物）を0～0.1%前後で推移するように金融市場調節を行いました。
- ・ 2013年4月の金融政策決定会合で日銀は「量的・質的金融緩和」の導入を決定し、金融市場調節の操作目標をコール・レートからマネタリーベースに変更しました。さらに日銀は、2014年10月にマネタリーベース増加額および資産買入れ額の拡大などの「量的・質的金融緩和」の拡大を決定しました。
- ・ コール・レートは一時的な資金需給逼迫時を除いて設定以来安定的に推移し、2015年11月16日のコール・レートは0.078%となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<米国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) >

・当ファンドは、円建て外国投資信託であるピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY) への投資を通じて、米ドル建てのハイイールド債券を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす運用を行いました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

<第1作成期 (第1期～第5期：設定時～2011年5月16日) >

・基準価額は設定時に比べ4.4% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

<第2作成期 (第6期～第11期：2011年5月17日～2011年11月15日) >

・基準価額は当作成期首に比べ1.4% (分配金再投資ベース) の下落となりました。

<第3作成期 (第12期～第17期：2011年11月16日～2012年5月15日) >

・基準価額は当作成期首に比べ5.9% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

<第4作成期 (第18期～第23期：2012年5月16日～2012年11月15日) >

・基準価額は当作成期首に比べ3.7% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

<第5作成期 (第24期～第29期：2012年11月16日～2013年5月15日) >

・基準価額は当作成期首に比べ5.9% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

<第6作成期 (第30期～第35期：2013年5月16日～2013年11月15日) >

・基準価額は当作成期首に比べ0.6% (分配金再投資ベース) の下落となりました。

<第7作成期 (第36期～第41期：2013年11月16日～2014年5月15日) >

・基準価額は当作成期首に比べ3.9% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

<第8作成期 (第42期～第47期：2014年5月16日～2014年11月17日) >

・基準価額は当作成期首に比べ0.5% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

<第9作成期 (第48期～第53期：2014年11月18日～2015年5月15日) >

・基準価額は当作成期首に比べ1.5% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

<第10作成期 (第54期～第59期：2015年5月16日～信託終了日) >

・償還価額は当作成期首に比べ5.4% (分配金再投資ベース) の下落となりました。

・満期償還に向け2015年11月10日にピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY) の組入比率をゼロにしました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。2015年11月11日に組入比率をゼロにしました。

<ピムコ パミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)>

<第1作成期(第1期~第5期:設定時~2011年5月16日)>

- ・基準価額は設定時に比べ5.4%(分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、米国ハイイールド債券市況が上昇したことや債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第2作成期(第6期~第11期:2011年5月17日~2011年11月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.6%(分配金再投資ベース)の下落となりました。
- ・債券利子収入を享受したことはプラスとなったものの、米国ハイイールド債券市況が下落したことや為替ヘッジによるコストなどがマイナスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第3作成期(第12期~第17期:2011年11月16日~2012年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ6.8%(分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、米国ハイイールド債券市況が上昇したことや債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第4作成期(第18期~第23期:2012年5月16日~2012年11月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ4.6%(分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、米国ハイイールド債券市況が上昇したことや債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第5作成期(第24期~第29期:2012年11月16日~2013年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ6.8%(分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、米国ハイイールド債券市況が上昇したことや債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第6作成期(第30期～第35期:2013年5月16日～2013年11月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.2% (分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、主に債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第7作成期(第36期～第41期:2013年11月16日～2014年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ4.8% (分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、米国ハイイールド債券市況が上昇したことや債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第8作成期(第42期～第47期:2014年5月16日～2014年11月17日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ1.4% (分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、主に債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第9作成期(第48期～第53期:2014年11月18日～2015年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ2.4% (分配金再投資ベース)の上昇となりました。
- ・為替ヘッジによるコストなどが若干のマイナスとなる一方、米国ハイイールド債券市況が上昇したことや債券利子収入を享受したことなどがプラスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<第10作成期(第54期～第59期:2015年5月16日～信託終了日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ4.7% (分配金再投資ベース)の下落となりました。
- ・債券利子収入を享受したものの、米国ハイイールド債券市況が下落したことや為替ヘッジによるコスト、また償還に伴うコストなどがマイナスとなりました。
- ・保有外貨建て資産に対し、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い国債を中心に組み入れ、利子等収益の確保を図りました。

<第1作成期(第1期～第5期:設定時～2011年5月16日)>

- ・基準価額は設定時に比べ0.06%の上昇となりました。

<第2作成期(第6期～第11期:2011年5月17日～2011年11月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.04%の上昇となりました。

<第3作成期(第12期～第17期:2011年11月16日～2012年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.05%の上昇となりました。

<第4作成期(第18期～第23期:2012年5月16日～2012年11月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.05%の上昇となりました。

<第5作成期(第24期～第29期:2012年11月16日～2013年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.04%の上昇となりました。

<第6作成期(第30期～第35期:2013年5月16日～2013年11月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.05%の上昇となりました。

<第7作成期(第36期～第41期:2013年11月16日～2014年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.02%の上昇となりました。

<第8作成期(第42期～第47期:2014年5月16日～2014年11月17日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.03%の上昇となりました。

<第9作成期(第48期～第53期:2014年11月18日～2015年5月15日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ横ばいとなりました。

<第10作成期(第54期～第59期:2015年5月16日～信託終了日)>

- ・基準価額は当作成期首に比べ0.01%の上昇となりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・米国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を除く) は、米ドル建てのハイイールド債券等に実質的な投資を行うとともに、米ドル売り、各ファンドの対象通貨買いの為替取引を行うことで、信託財産の成長と収益の確保をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、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。
- ・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、第1期から第58期まで40円とさせていただきます。信託期間中、累計で2,320円の分配を行わせていただきました。

【分配原資の内訳】

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期
	2015年5月16日～ 2015年6月15日	2015年6月16日～ 2015年7月15日	2015年7月16日～ 2015年8月17日	2015年8月18日～ 2015年9月15日	2015年9月16日～ 2015年10月15日
当期分配金	40	40	40	40	40
(対基準価額比率)	0.393%	0.395%	0.402%	0.402%	0.418%
当期の収益	40	40	40	40	40
当期の収益以外	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,156	1,165	1,174	1,187	1,200

(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。

償還価額

<米国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) >
償還価額は9,521円59銭となりました。

信託期間中はお愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年5月16日～2015年11月16日)

項 目	第54期～第59期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 85	% 0.857	(a) 信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(50)	(0.508)	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)	(32)	(0.328)	分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	投資信託財産の保管・管理、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
合 計	85	0.859	
作成期中の平均基準価額は、9,907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5月16日～2015年11月16日)

投資信託証券

銘柄		第54期～第59期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)	千口 0.7842	千円 7,312	千口 19	千円 175,788

(注) 金額は受渡代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第54期～第59期			
		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 -	千円 -	千口 248	千円 252

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月16日～2015年11月16日)

利害関係人との取引状況

<米国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)>
該当事項はございません。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

区分	第54期～第59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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	36,756	17,599	47.9	3,500	2,100	60.0
現先取引(公社債)	95,010	11,003	11.6	95,010	11,003	11.6

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。

○組入資産の明細

(2015年11月16日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

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53期末	
		口	数
ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)			千口 18
合	計		18

親投資信託残高

銘	柄	第53期末	
		口	数
マネー・マーケット・マザーファンド			千口 248

○投資信託財産の構成

(2015年11月16日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 152,637	% 100.0
投資信託財産総額	152,637	100.0

○資産、負債、元本及び基準(償還)価額の状況

項 目	第54期末	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	償 還 時
	2015年6月15日現在	2015年7月15日現在	2015年8月17日現在	2015年9月15日現在	2015年10月15日現在	2015年11月16日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	173,534,207	168,451,773	164,452,592	160,174,612	153,382,314	152,637,360
コール・ローン等	3,333,903	2,152,405	1,907,619	1,077,698	1,466,390	152,637,112
投資信託受益証券(評価額)	169,947,653	166,046,719	162,292,324	156,844,242	151,763,252	—
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	252,646	252,646	252,646	252,671	152,670	—
未収入金	—	—	—	2,000,000	—	—
未収利息	5	3	3	1	2	248
(B) 負債	939,118	1,367,667	913,947	861,383	857,326	227,125
未払収益分配金	681,509	662,803	659,296	643,474	639,912	—
未払解約金	—	466,957	—	—	—	—
未払信託報酬	257,125	237,465	254,179	217,501	217,009	226,703
その他未払費用	484	442	472	408	405	422
(C) 純資産総額(A-B)	172,595,089	167,084,106	163,538,645	159,313,229	152,524,988	152,410,235
元本	170,377,372	165,700,998	164,824,174	160,868,730	159,978,006	160,067,967
次期繰越損益金	2,217,717	1,383,108	△ 1,285,529	△ 1,555,501	△ 7,453,018	—
償還差損金	—	—	—	—	—	△ 7,657,732
(D) 受益権総口数	170,377,372口	165,700,998口	164,824,174口	160,868,730口	159,978,006口	160,067,967口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,130円	10,083円	9,922円	9,903円	9,534円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	9,521円59銭

○損益の状況

項 目	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期
	2015年5月16日～ 2015年6月15日	2015年6月16日～ 2015年7月15日	2015年7月16日～ 2015年8月17日	2015年8月18日～ 2015年9月15日	2015年9月16日～ 2015年10月15日	2015年10月16日～ 2015年11月16日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	1,051,962	1,048,655	1,062,180	1,076,924	1,070,645	1,282
受取配当金	1,051,822	1,048,532	1,062,100	1,076,846	1,070,551	—
受取利息	140	123	80	78	94	1,282
(B) 有価証券売買損益	△ 2,471,721	△ 921,642	△ 2,809,570	△ 516,360	△ 6,119,427	25,323
売買益	29,671	26,315	6,308	7,281	31,489	25,323
売買損	△ 2,501,392	△ 947,957	△ 2,815,878	△ 523,641	△ 6,150,916	—
(C) 信託報酬等	△ 257,609	△ 237,907	△ 254,651	△ 217,909	△ 217,414	△ 227,125
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,677,368	△ 110,894	△ 2,002,041	342,655	△ 5,266,196	△ 200,520
(E) 前期繰越損益金	856,416	△ 1,460,496	△ 2,221,138	△ 4,762,596	△ 5,032,543	△ 10,938,651
(F) 追加信託差損益金	3,720,178	3,617,301	3,596,946	3,507,914	3,485,633	3,481,439
(配当等相当額)	(8,229,762)	(8,009,431)	(7,973,281)	(7,788,262)	(7,751,472)	(7,762,276)
(売買損益相当額)	(△ 4,509,584)	(△ 4,392,130)	(△ 4,376,335)	(△ 4,280,348)	(△ 4,265,839)	(△ 4,280,837)
(G) 計(D+E+F)	2,899,226	2,045,911	△ 626,233	△ 912,027	△ 6,813,106	—
(H) 収益分配金	△ 681,509	△ 662,803	△ 659,296	△ 643,474	△ 639,912	—
次期繰越損益金(G+H)	2,217,717	1,383,108	△ 1,285,529	△ 1,555,501	△ 7,453,018	—
償還差損金(D+E+F+H)	—	—	—	—	—	△ 7,657,732
追加信託差損益金	3,720,178	3,617,301	3,596,946	3,507,914	3,485,633	—
(配当等相当額)	(8,229,762)	(8,009,431)	(7,973,281)	(7,788,262)	(7,751,472)	(—)
(売買損益相当額)	(△ 4,509,584)	(△ 4,392,130)	(△ 4,376,335)	(△ 4,280,348)	(△ 4,265,839)	(—)
分配準備積立金	11,471,752	11,299,274	11,381,481	11,317,572	11,461,887	—
繰越損益金	△ 12,974,213	△ 13,533,467	△ 16,263,956	△ 16,380,987	△ 22,400,538	—

(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 177,920,871円

 作成期中追加設定元本額 2,765,987円

 作成期中一部解約元本額 20,618,891円

 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.952159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7,657,732円です。

③ 分配金の計算過程

項 目	2015年5月16日～ 2015年6月15日	2015年6月16日～ 2015年7月15日	2015年7月16日～ 2015年8月17日	2015年8月18日～ 2015年9月15日	2015年9月16日～ 2015年10月15日
費用控除後の配当等収益額	794,353円	810,748円	807,529円	859,015円	853,231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
収益調整金額	8,229,762円	8,009,431円	7,973,281円	7,788,262円	7,751,472円
分配準備積立金額	11,358,908円	11,151,329円	11,233,248円	11,102,031円	11,248,568円
当ファンドの分配対象収益額	20,383,023円	19,971,508円	20,014,058円	19,749,308円	19,853,271円
1万円当たり収益分配対象額	1,196円	1,205円	1,214円	1,227円	1,240円
1万円当たり分配金額	40円	40円	40円	40円	40円
収益分配金金額	681,509円	662,803円	659,296円	643,474円	639,912円

④ 信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の65以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2010年11月10日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2015年11月16日		資産総額	152,637,360円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	227,125円
				純資産総額	152,410,235円
受益権口数	733,945,734口	160,067,967口	△573,877,767口	受益権口数	160,067,967口
元本額	733,945,734円	160,067,967円	△573,877,767円	1万円当たり償還金	9,521円59銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	1,047,362,859円	1,054,981,451円	10,073円	40円	0.4%
第2期	829,930,594	843,285,404	10,161	40	0.4
第3期	621,993,753	630,772,305	10,141	40	0.4
第4期	675,101,911	687,609,601	10,185	40	0.4
第5期	637,059,147	652,298,756	10,239	40	0.4
第6期	609,116,449	613,458,236	10,071	40	0.4
第7期	615,653,620	622,294,107	10,108	40	0.4
第8期	593,732,946	573,110,997	9,653	40	0.4
第9期	595,431,323	576,442,036	9,681	40	0.4
第10期	576,001,365	552,895,170	9,599	40	0.4
第11期	561,792,546	553,553,460	9,853	40	0.4
第12期	521,459,677	511,349,119	9,806	40	0.4
第13期	528,250,885	526,827,292	9,973	40	0.4
第14期	532,636,282	541,778,352	10,172	40	0.4
第15期	572,586,272	585,389,581	10,224	40	0.4
第16期	678,245,437	686,046,729	10,115	40	0.4
第17期	650,044,467	662,148,229	10,186	40	0.4
第18期	621,323,682	622,312,664	10,016	40	0.4
第19期	539,067,482	551,036,722	10,222	40	0.4
第20期	521,429,765	537,107,629	10,301	40	0.4
第21期	504,062,432	527,106,886	10,457	40	0.4
第22期	477,388,049	495,570,601	10,381	40	0.4
第23期	448,901,196	463,259,853	10,320	40	0.4
第24期	426,530,710	447,040,165	10,481	40	0.4
第25期	365,156,560	385,633,908	10,561	40	0.4
第26期	405,957,587	425,882,376	10,491	40	0.4
第27期	415,054,268	438,156,597	10,557	40	0.4
第28期	406,267,038	430,778,116	10,603	40	0.4
第29期	397,784,386	425,124,218	10,687	40	0.4
第30期	428,098,664	444,742,270	10,389	40	0.4
第31期	443,666,604	458,621,874	10,337	40	0.4

米国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)

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第32期	406,025,365円	418,125,454円	10,298円	40円	0.4%
第33期	396,473,677	406,764,812	10,260	40	0.4
第34期	390,223,677	402,920,620	10,325	40	0.4
第35期	370,455,289	384,576,643	10,381	40	0.4
第36期	308,629,646	321,307,596	10,411	40	0.4
第37期	305,129,063	318,835,849	10,449	40	0.4
第38期	287,350,763	300,676,147	10,464	40	0.4
第39期	274,383,341	287,843,694	10,491	40	0.4
第40期	279,328,471	293,532,774	10,509	40	0.4
第41期	278,115,147	293,268,503	10,545	40	0.4
第42期	243,056,081	257,132,448	10,579	40	0.4
第43期	235,881,520	248,186,724	10,522	40	0.4
第44期	233,287,477	244,351,320	10,474	40	0.4
第45期	229,828,895	238,313,175	10,369	40	0.4
第46期	221,683,615	225,876,854	10,189	40	0.4
第47期	214,959,066	222,587,892	10,355	40	0.4
第48期	211,854,062	211,770,107	9,996	40	0.4
第49期	208,254,436	211,377,108	10,150	40	0.4
第50期	200,728,085	207,343,568	10,330	40	0.4
第51期	184,705,081	189,241,547	10,246	40	0.4
第52期	180,241,484	186,622,543	10,354	40	0.4
第53期	177,920,871	182,709,673	10,269	40	0.4
第54期	170,377,372	172,595,089	10,130	40	0.4
第55期	165,700,998	167,084,106	10,083	40	0.4
第56期	164,824,174	163,538,645	9,922	40	0.4
第57期	160,868,730	159,313,229	9,903	40	0.4
第58期	159,978,006	152,524,988	9,534	40	0.4

○分配金のお知らせ

	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期
1万口当たり分配金 (税込み)	40円	40円	40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。

※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。

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金 (税込み)	9,521円59銭
-----------------	-----------

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。)を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※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。

[お知らせ]

①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

②2014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〉投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)	マネー・マーケット・マザーファンド
運用方針	ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド (M) への投資を通じて、米ドル建てハイイールド債券およびその派生商品等に実質的な投資を行い、信託財産の成長をめざします。	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	米ドル建てハイイールド債券およびその派生商品等	わが国の公社債等
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常、ファンドの80%以上をBBB格相当未満の格付けを取得している公社債に投資します。 ・ 投資する公社債は原則として取得時においてB一格相当以上の格付けを取得しているものに限りま す。 ・ 投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてB一格相当以上に維持します。 ・ ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として2年～6年の範囲で調整します。 ・ 同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、純資産総額の3%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。 ・ エマージング諸国の企業が発行する米ドル建てハイイールド債へ投資を行う場合があります。 ・ 投資を行う米ドル建てハイイールド債券は、主に米国／非米国の発行体が発行する米ドル建て社債ですが、米ドル建てハイイールド債券と同様の投資効果を持つデリバティブ取引を活用する場合があります。また、資金管理目的で、原則として取得時にBBB格相当以上の格付けを有する米ドル建ての公社債等にも一部投資を行います。 ・ 保有外貨建て資産に対し、原則として、米ドル売り、円買いの為替ヘッジを行います。 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 外貨建資産への投資は行いません。 ・ 有価証券先物取引等を行うことができます。 ・ スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・ 金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
決算日	原則として毎年6月30日	原則として毎年5月および11月の20日
分配方針	原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

(1) 運用計算書

(A) ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)
信託終了日現在、投資対象ファンドを保有していないため、掲載しておりません。

(B) マネー・マーケット・マザーファンド
24頁の損益の状況をご参照ください。

(2) 純資産変動計算書

ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)
信託終了日現在、投資対象ファンドを保有していないため、掲載しておりません。

(3) 投資有価証券明細表

(A) ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド A - クラス J (JPY)
信託終了日現在、投資対象ファンドを保有していないため、掲載しておりません。

(B) ピムコ バミューダ U.S. ハイ イールド ボンド ファンド (M)
信託終了日現在、投資対象ファンドを保有していないため、掲載しておりません。

(C) マネー・マーケット・マザーファンド
23頁の組入資産の明細をご参照ください。

マネー・マーケット・マザーファンド

《第21期》決算日2015年5月20日

〔計算期間：2014年11月21日～2015年5月20日〕

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、5月20日に第21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21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
		騰	落			
	円		%	%	%	百万円
17期(2013年5月20日)	10,174		0.0	84.0	—	2,855
18期(2013年11月20日)	10,178		0.0	87.7	—	2,850
19期(2014年5月20日)	10,180		0.0	84.7	—	2,716
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

(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
		騰	落		
(期首)	円		%	%	%
2014年11月20日	10,183		—	84.3	—
11月末	10,183		0.0	90.0	—
12月末	10,183		0.0	85.3	—
2015年1月末	10,183		0.0	92.4	—
2月末	10,183		0.0	82.7	—
3月末	10,183		0.0	93.7	—
4月末	10,183		0.0	94.2	—
(期末)					
2015年5月20日	10,183		0.0	89.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

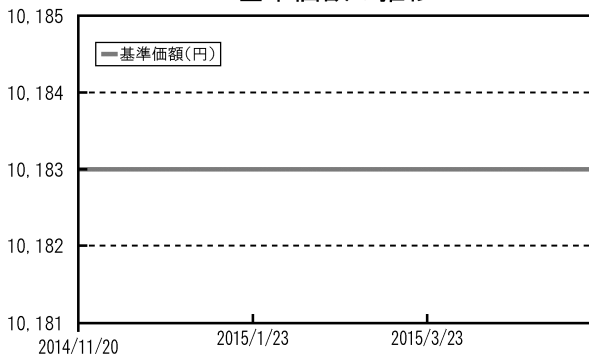
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎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



●投資環境について

◎国内短期金融市場

期中の短期金融市場を見ると、日銀は「量的・質的金融緩和」をめざし、マネタリーベースを操作目標として金融市場調節を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）は安定的に推移し、2015年5月20日のコール・レートは0.069%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

コール・ローン等短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い国債を中心に組み入れ、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益を獲得したものの、組入債券が小幅に下落したことなどから基準価額は横ばいとなりました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

・国内景気は緩やかな回復局面に向かうものと思われませんが、デフレ脱却に向けて日銀は「量的・質的金融緩和政策」を当面維持することが見込まれます。そうした環境下、短期金利は低位安定推移になると予想しています。

◎今後の運用方針

・運用の基本方針および前述の見通しに基づき、短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い国債を中心に投資し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

(2014年11月21日～2015年5月20日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2014年11月21日～2015年5月20日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 21,730,623	千円 20,430,686 (1,550,000)

(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

(2014年11月21日～2015年5月20日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 7,299	百万円 2,999	% 41.1	百万円 5,999	百万円 700	% 11.7
現先取引(公社債)	14,430	5,350	37.1	14,430	5,350	37.1

(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、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2015年5月20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	1,750,000 (1,400,000)	1,750,095 (1,399,994)	89.3 (71.4)	— (—)	— (—)	— (—)	89.3 (71.4)
合 計	1,750,000 (1,400,000)	1,750,095 (1,399,994)	89.3 (71.4)	— (—)	— (—)	— (—)	89.3 (71.4)

(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。

(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522回国庫短期証券	—	300,000	300,000	2015/7/6	
第532回国庫短期証券	—	1,100,000	1,099,994	2015/8/17	
第331回利付国債(2年)	0.1	200,000	200,050	2015/8/15	
第332回利付国債(2年)	0.1	150,000	150,051	2015/9/15	
合 計		1,750,000	1,750,095		

○投資信託財産の構成

(2015年5月20日現在)

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%		
公社債	1,750,095	89.3		
コール・ローン等、その他	210,300	10.7		
投資信託財産総額	1,960,395	100.0		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月20日現在)

○損益の状況 (2014年11月21日～2015年5月20日)

項目	当期末 円
(A) 資産	1,960,395,399
コール・ローン等	210,220,805
公社債(評価額)	1,750,095,800
未収利息	78,794
(B) 負債	802,372
未払解約金	802,372
(C) 純資産総額(A-B)	1,959,593,027
元本	1,924,361,734
次期繰越損益金	35,231,293
(D) 受益権総口数	1,924,361,734口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,183円

項目	当期 円
(A) 配当等収益	414,231
受取利息	414,231
(B) 有価証券売買損益	△ 313,122
売買益	101,626
売買損	△ 414,748
(C) 当期損益金(A+B)	101,109
(D) 前期繰越損益金	42,568,332
(E) 追加信託差損益金	189,850,117
(F) 解約差損益金	△197,288,265
(G) 計(C+D+E+F)	35,231,293
次期繰越損益金(G)	35,231,293

＜注記事項＞

①期首元本額	2,330,826,446円
期中追加設定元本額	10,374,332,763円
期中一部解約元本額	10,780,797,475円

(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)

三菱UFJ D C金利連動アロケーション型バランスファンド	288,416,273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)	14,525,380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)	2,727,794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)	101,543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)	81,714,442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)	152,186,197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)	429,650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)	7,467,710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>	485,467,302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)	128,906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)	1,799,230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	2,017,437円
米国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)	248,106円
米国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)	712,999円
米国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)	862,076円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<新興国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	299,514円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	981,935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)	374,779円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	42,384,248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)	3,558,532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)	35,941,494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)	938,449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)	923,745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>	5,525,461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)	23,152,810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)	5,011,602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)	4,071,402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<ブラジルレアルコース>	(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)	389,070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<アジアバスケット通貨コース>	(毎月分配型)	780,306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>		29,100,616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)	2,221,253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)	1,784,459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<ブラジルレアルコース>	(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>		3,492,620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)	78,483,503円
	欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)			2,069,498円
	欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)			1,726,413円
	新興国ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)			1,068円
	新興国ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)			20,706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
三菱UFJ	UBS グローバル好利回C/Bファンド2012-11		(円ヘッジ) (限定追加型)	10,816,126円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<メキシコペソ>		(毎月分配型)	47,835,444円
PIMCO	ニューワールド円インカムファンド		(年2回分配型)	168,137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)	472,643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)	200,660円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<ブラジルレアルコース>		(年2回分配型)	20,637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)	2,438,810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)	4,073,259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)	688,506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)	19,255,183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)	15,049,666円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド	通貨選択シリーズ<米ドルコース>	(毎月分配型)	20,551,717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<ブラジルレアルコース>	(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)	5,119,741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)	252,058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)	6,618,213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)	6,435,081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<ブラジルレアルコース>	(年2回分配型)	627,788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)	46,726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)	895,906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>		36,583,200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>		980,075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)	1,423,307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)	3,270,787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・エマージング・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・エマージング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	983円
三菱UFJ/UBS グローバル好利回CBファンド2013-11 (円ヘッジ) (限定追加型)	982,608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
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)	151,268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)	1,674,507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)	8,585,548円
Navio インド債券ファンド	885,566円
Navio マネーボールファンド	1,412,300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 (FOFs用) (適格機関投資家限定)	116,474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 (FOFs用) (適格機関投資家限定)	132,261,881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)	16,982,851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)	34,396,392円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	22,527,760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)	348,621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)	59,905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)	10,804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)	0円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	0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 (FOFs用) (適格機関投資家限定)	0円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	0円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	0円
合計	1,924,361,734円

【お知らせ】

デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)