

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（転換社債）	
信託期間	2015年11月20日まで（2012年11月29日設定）	
運用方針	<p>主として証券投資信託であるUBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）の投資信託証券への投資を通じて、世界各国の転換社債等を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、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。UBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）への投資は高位を維持することを基本とします。実質的な組入外貨建資産については、原則として投資する証券投資信託において為替ヘッジを行い替変動リスクの低減をはかります。投資対象とする証券投資信託は、ユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社が運用を行います。なお、ユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社は運用の指図に関する権限を、UBS AG, UBSアセット・マネジメント（チューリッヒ）（旧名称：UBS AG, UBSグローバル・アセット・マネジメント（チューリッヒ））に委託します。</p>	
主要運用対象	三菱UFJ／UBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（限定追加型）	UBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）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。
	UBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）	世界各国の転換社債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]

三菱UFJ／UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（限定追加型）

信託終了日：2015年11月20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、「三菱UFJ／UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（限定追加型）」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

三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11 (円ヘッジ) (限定追加型)のご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当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	7
◇売買及び取引の状況	8
◇利害関係人との取引状況等	8
◇組入資産の明細	9
◇投資信託財産の構成	9
◇資産、負債、元本及び償還価額の状況	10
◇損益の状況	10
◇投資信託財産運用総括表	10
◇償還金のお知らせ	11
◇お知らせ	11

投資対象ファンドのご報告

◇マネー・マーケット・マザーファンド	12
--------------------	----

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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			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
		税金	分配	み騰落				
(設定日)	円 銭	円		中率	%	%	%	百万円
2012年11月29日	10,000	—		—	—	—	—	11,076
1期(2013年11月28日)	10,687	0		6.9	0.1	—	99.9	8,162
2期(2014年11月28日)	11,061	0		3.5	0.3	—	99.1	3,599
(償還時)	(償還価額)							
3期(2015年11月20日)	11,061.05	—		0.0	—	—	—	2,582

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドは、世界各国の転換社債等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しますが、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－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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	債 券 比 率			
		騰 落 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
(期 首) 2014年11月28日	円 銭 11,061	% —	% 0.3	% —	% 99.1
12月末	11,008	△0.5	0.3	—	98.4
2015年1月末	11,031	△0.3	0.3	—	99.4
2月末	11,072	0.1	0.3	—	99.1
3月末	11,092	0.3	0.3	—	99.2
4月末	11,137	0.7	0.4	—	99.0
5月末	11,132	0.6	0.4	—	99.1
6月末	11,108	0.4	0.4	—	99.0
7月末	11,098	0.3	0.4	—	99.1
8月末	11,091	0.3	0.4	—	99.1
9月末	11,078	0.2	0.2	—	99.1
10月末	11,066	0.0	0.4	—	59.9
(償還時) 2015年11月20日	(償還価額) 11,061.05	0.0	—	—	—

(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。

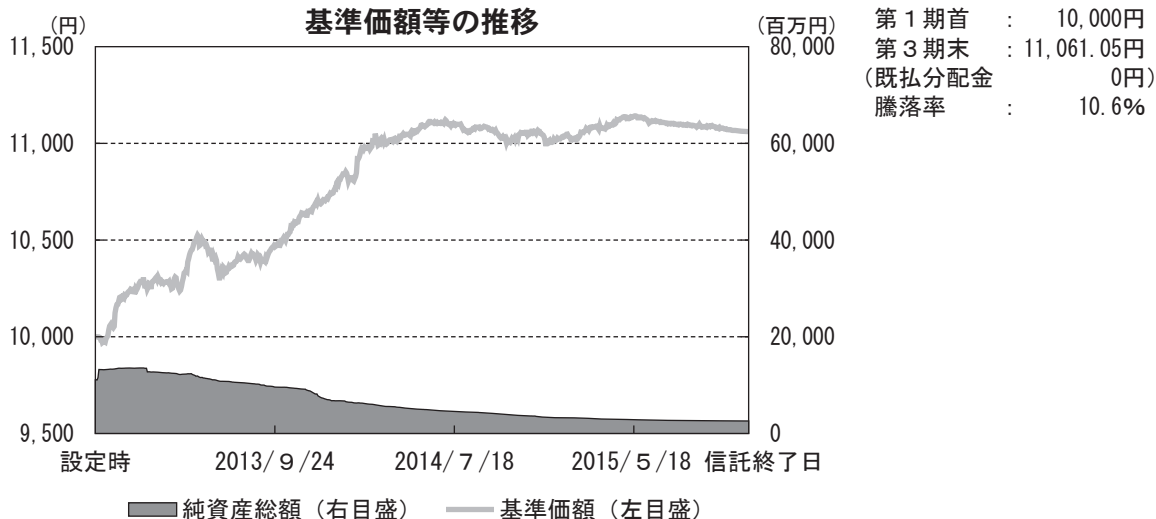
運用経過

設定来の基準価額等の推移について

（第1期～第3期：2012/11/29～2015/11/20）

基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ10.6%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因

世界の転換社債市況が上昇したことや転換社債等の利子収益を獲得したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

投資環境について

（第1期～第3期：2012/11/29～2015/11/20）

◎転換社債市況

- ・信託期間を通じて見ると、世界の転換社債市況は上昇しました。
- ・設定時から2015年5月にかけては、米国経済が堅調に推移したこと、ECB（欧州中央銀行）や中国人民銀行が追加金融緩和を実施したことなどを背景に、世界の転換社債市況は上昇しました。その後、ギリシャの債務問題への懸念が高まったこと、中国株式市況が下落したことなどが材料視され、投資家のリスク回避的な姿勢が強まったことなどから世界の転換社債市況は下落しました。

◎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20日のコール・レートは0.077%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／UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（限定追加型）>

- ・証券投資信託であるUBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）への投資を通じて、世界各国の転換社債等に実質的な投資を行いました。また、余裕資金を効率的に運用するため、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期：設定時～2013年11月28日>

- ・基準価額は設定時に比べ6.9%の上昇となりました。

<第2期：2013年11月29日～2014年11月28日>

- ・基準価額は期首に比べ3.5%の上昇となりました。

<第3期：2014年11月29日～信託終了日>

- ・償還価額は期首に比べほぼ横ばいとなりました。
- ・証券投資信託であるUBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）への投資を通じて、世界各国の転換社債等に実質的な投資を行いました。UBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）の満期償還を受けて、2015年11月13日に組入比率をゼロにしました。また、余裕資金を効率的に運用するため、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18日に組入比率をゼロにしました。

<UBSグローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）>

<第1期：設定時～2013年11月28日>

- ・基準価額は設定時に比べ7.5%の上昇となりました。
- ・銘柄の償還期間、利回り、流動性、信用リスクなどを見極め、地域・セクター分散などに配慮しながら、ポートフォリオを構築しました。また、保有する外貨建て資産に対して為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。高水準の為替ヘッジを行ったため、為替市況の変動が基準価額に与える影響は限定的となりました。
- ・世界の転換社債市況が上昇したことや転換社債等の利子収益を獲得したことなどがプラスとなりました。

<第2期：2013年11月29日～2014年11月28日>

- ・基準価額は期首に比べ4.1%の上昇となりました。
- ・銘柄の償還期間、利回り、流動性、信用リスクなどを見極め、地域・セクター分散などに配慮しながら、相対的に利回りが高いと判断される転換社債等に投資を行いました。また、保有する外貨建て資産に対して為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。高水準の為替ヘッジを行ったため、為替市況の変動が基準価額に与える影響は限定的となりました。なお、期中に満期などにより現金化された転換社債の一部については、ファンドの信託期間内に満期を迎える米国債などに投資を行いました。
- ・世界の転換社債市況が上昇したことや転換社債等の利子収益を獲得したことなどがプラスとなりました。

<第3期：2014年11月29日～信託終了日>

- ・償還価額は期首に比べ1.0%の上昇となりました。
- ・銘柄の償還期間、利回り、流動性、信用リスクなどを見極め、地域・セクター分散などに配慮しながら、相対的に利回りが高いと判断される転換社債等に投資を行いました。また、保有する外貨建て資産に対して為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。高水準の為替ヘッジを行ったため、為替市況の変動が基準価額に与える影響は限定的となりました。なお、期中に満期などにより現金化された転換社債の一部については、ファンドの信託期間内に満期を迎える米国債などに投資を行いました。
- ・転換社債等の利子収益を獲得したことなどがプラスとなりました。

<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期：設定時～2013年11月28日>

- ・基準価額は設定時に比べ0.08%の上昇となりました。

<第2期：2013年11月29日～2014年11月28日>

- ・基準価額は期首に比べ0.05%の上昇となりました。

<第3期：2014年11月29日～信託終了日>

- ・基準価額は期首に比べ0.02%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

- ・当ファンドは、世界各国の転換社債等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しますが、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

信託期間中の収益の分配はありません。

償還価額

<三菱UFJ／UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11（円ヘッジ）（限定追加型）>

償還価額は11,061円05銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

○ 1万口当たりの費用明細

(2014年11月29日～2015年11月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 62	% 0.560	(a) 信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(23)	(0.211)	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)	(35)	(0.317)	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)	(4)	(0.032)	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	0.003	(b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	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	62	0.563	
期中の平均基準価額は、11,081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) 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

(2014年11月29日～2015年11月20日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	UBSグローバル好利回りCBファンド 2012-11 (円ヘッジ) (適格機関投資家向け)	千口 —	千円 —	千口 1,810,424 (1,373,349)	千円 2,022,730 (1,553,259)

(注) 金額は受渡代金。

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

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 —	千円 —	千口 10,816	千円 11,015

○利害関係人との取引状況等

(2014年11月29日～2015年11月20日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11 (円ヘッジ) (限定追加型)>

区分	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	$\frac{D}{C}$

<マネー・マーケット・マザーファンド>

区分	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	$\frac{D}{C}$
現先取引(公社債)	109,041	16,253	14.9	109,141	16,253	14.9

平均保有割合 0.2%

※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信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015年11月20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	期首(前期末)	
		口	数
UBS グローバル好利回りCBファンド 2012-11 (円ヘッジ) (適格機関投資家向け)			千口 3,183,773
合	計		3,183,773

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
マネー・マーケット・マザーファンド			千口 10,816

○投資信託財産の構成

(2015年11月20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 2,590,160	% 100.0
投資信託財産総額	2,590,160	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2015年11月20日現在)

項目	償還時	円
(A) 資産	2,590,160,458	
コール・ローン等	2,590,143,408	
未収利息	17,050	
(B) 負債	7,934,219	
未払解約金	537,904	
未払信託報酬	7,360,264	
その他未払費用	36,051	
(C) 純資産総額(A-B)	2,582,226,239	
元本	2,334,522,815	
償還差益金	247,703,424	
(D) 受益権総口数	2,334,522,815口	
1万口当たり償還価額(C/D)	11,061円05銭	

<注記事項>

期首元本額 3,254,108,974円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 919,586,159円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.106105円です。

○損益の状況 (2014年11月29日～2015年11月20日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	115,642	
受取利息	115,642	
(B) 有価証券売買損益	10,510,087	
売買益	16,224,930	
売買損	△ 5,714,843	
(C) 信託報酬等	△ 16,295,988	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 5,670,259	
(E) 前期繰越損益金	253,402,776	
(F) 追加信託差損益金	△ 29,093	
(配当等相当額)	(33)	
(売買損益相当額)	(△ 29,126)	
償還差益金(D+E+F)	247,703,424	

(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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2012年11月29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20日			資産総額	2,590,160,458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	7,934,219円	
受益権口数	11,076,479,245口	2,334,522,815口	△8,741,956,430口	純資産総額	2,582,226,239円	
元本額	11,076,479,245円	2,334,522,815円	△8,741,956,430円	受益権口数	2,334,522,815口	
				1万口当たり償還金	11,061円05銭	
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	7,637,693,620円	8,162,696,220円	10,687円	0円	0%	
第2期	3,254,108,974	3,599,262,995	11,061	0	0	

○償還金のお知らせ

1万円当たり償還金 (税込み)	11,061円05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]

- ①書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤2015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)
- ⑥投資対象とする証券投資信託の再委託先の名称が2015年10月5日付で従来の「UBS AG, UBSグローバル・アセット・マネジメント (チューリッヒ)」から「UBS AG, UBSアセット・マネジメント (チューリッヒ)」へ変更となりました。
- ⑦投資対象とする証券投資信託の運用先の商号が2015年12月1日付で従来の「ユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社」から「UBSアセット・マネジメント株式会社」へ変更となる予定です。
- ⑧2014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。

UBSグローバル好利回りCBファンド2012-11 (円ヘッジ) (適格機関投資家向け)

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。

マネー・マーケット・マザーファンド

《第22期》決算日2015年11月20日

〔計算期間：2015年5月21日～2015年11月20日〕

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月20日に第22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22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
		期騰	落中率			
	円		%	%	%	百万円
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
22期(2015年11月20日)	10,185		0.0	91.2	—	27,834

(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	債券率
		騰	落率			
(期首)	円		%	%	%	%
2015年5月20日	10,183		—	89.3	—	—
5月末	10,183		0.0	90.6	—	—
6月末	10,183		0.0	93.0	—	—
7月末	10,183		0.0	95.8	—	—
8月末	10,184		0.0	95.3	—	—
9月末	10,184		0.0	56.4	—	—
10月末	10,184		0.0	91.0	—	—
(期末)						
2015年11月20日	10,185		0.0	91.2	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

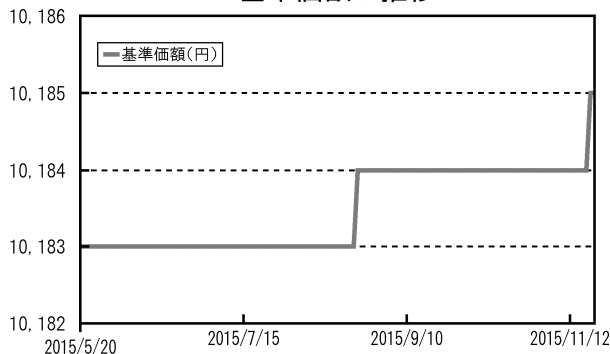
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.02%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

・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11月20日のコール・レートは0.077%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こと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

・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

(2015年5月21日～2015年11月20日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2015年5月21日～2015年11月20日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 131,267,396	千円 98,511,004 (9,120,000)

(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5月21日～2015年11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 36,256	百万円 17,599	% 48.5	百万円 3,500	百万円 2,100	% 60.0
現先取引(公社債)	95,010	11,003	11.6	95,010	11,003	11.6

(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

(2015年11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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	25,386,350 (24,840,000)	25,387,817 (24,841,225)	91.2 (89.2)	— (—)	— (—)	— (—)	91.2 (89.2)
合 計	25,386,350 (24,840,000)	25,387,817 (24,841,225)	91.2 (89.2)	— (—)	— (—)	— (—)	91.2 (89.2)

(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554回国庫短期証券	—	3,110,000	3,110,000	2015/11/30
第555回国庫短期証券	—	3,500,000	3,500,000	2015/12/7
第557回国庫短期証券	—	3,640,000	3,640,000	2015/12/14
第561回国庫短期証券	—	90,000	90,004	2016/1/12
第563回国庫短期証券	—	5,000,000	5,000,280	2016/1/18
第564回国庫短期証券	—	3,000,000	3,000,210	2016/1/25
第566回国庫短期証券	—	3,000,000	3,000,261	2016/2/1
第567回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,090	2016/2/8
第568回国庫短期証券	—	2,500,000	2,500,380	2016/2/15
第336回利付国債(2年)	0.1	300,000	300,051	2016/1/15
第340回利付国債(2年)	0.1	62,600	62,636	2016/5/15
第342回利付国債(2年)	0.1	100,000	100,079	2016/7/15
第343回利付国債(2年)	0.1	83,750	83,825	2016/8/15
合 計		25,386,350	25,387,817	

○投資信託財産の構成

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	25,387,817	91.2
コール・ローン等、その他	2,446,214	8.8
投資信託財産総額	27,834,031	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	27,834,031,140
コール・ローン等	2,446,046,790
公社債(評価額)	25,387,817,093
未収利息	58,164
前払費用	109,093
(B) 負債	562
未払解約金	562
(C) 純資産総額(A-B)	27,834,030,578
元本	27,329,169,583
次期繰越損益金	504,860,995
(D) 受益権総口数	27,329,169,583口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,185円

＜注記事項＞

- ①期首元本額 1,924,361,734円
 期中追加設定元本額 26,414,042,501円
 期中一部解約元本額 1,009,234,652円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0185円です。

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

三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	297,790,994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)	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)	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)	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)	4,757,576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>	414,316,230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)	1,033,322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	2,017,196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)	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)	23,960,741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
ピクテ・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
ピクテ・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
ピクテ・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
ピクテ・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)	383,682円
ピクテ・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>	8,771,978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

○損益の状況 (2015年5月21日～2015年11月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	985,144
受取利息	985,144
(B) 有価証券売買損益	1,172,965
売買益	1,359,890
売買損	△ 186,925
(C) 当期損益金(A+B)	2,158,109
(D) 前期繰越損益金	35,231,293
(E) 追加信託差損益金	485,984,607
(F) 解約差損益金	△ 18,513,014
(G) 計(C+D+E+F)	504,860,995
次期繰越損益金(G)	504,860,995

(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。

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)	374,779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)	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>	38,911,455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>	3,492,263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)	1,285,463円
	欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	1,147,224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CBファンド2012-11 (円ヘッジ) (限定追加型)	0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)	31,229,335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)	276,237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)	89,380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)	1,554,984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)	2,668,957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
バリュウ・ボンド・ファンド	<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1,936,118円
バリュウ・ボンド・ファンド	<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,829円
バリュウ・ボンド・ファンド	<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9,829円
バリュウ・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)	3,653,886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)	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UF J 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UF J 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UF J 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)	627,788円
三菱UF J 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UF J 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UF J 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)	581,687円
三菱UF J 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>	112,318,894円
三菱UF J 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>	980,017円
三菱UF J / 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UF J / 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UF J / 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UF J / 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UF J / 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UF J / 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UF J / 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UF J 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UF J 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
N a v i o インド債券ファンド	885,566円
N a v i o マネープールファンド	1,883,381円
三菱UF J 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
マネープールファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	102,821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)	7,644,146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)	21,620,196円
三菱UF J バランス・イノベーション (債券重視型)	1,242,825,788円
三菱UF J / 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UF J 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UF J 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)	918,198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)	138,468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)	10,531,117,458円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	112,195,605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)	195,410,633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)	13,274,970,563円
三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-03 (円ヘッジ) (限定追加型)	343,676,356円
合計	27,329,169,583円

[お知らせ]

2015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)