

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	2016年11月18日まで（2013年11月6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2013-11（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2013-11（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為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2013-11（円ヘッジ）（限定追加型）	UBSグローバル好利回りCBファンド2013-11（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2013-11（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。
主な組入制限	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。
		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。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ／UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11（円ヘッジ）（限定追加型）

第2期（決算日：2015年11月30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／UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11（円ヘッジ）（限定追加型）」は、去る11月30日に第2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2013-11(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
◇今後の運用方針	8
◇1万口当たりの費用明細	9
◇売買及び取引の状況	10
◇利害関係人との取引状況等	10
◇組入資産の明細	11
◇投資信託財産の構成	11
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	12
◇損益の状況	12
◇お知らせ	13

投資対象ファンドのご報告

◇UBSグローバル好利回りCBファンド2013-11(円ヘッジ)(適格機関投資家向け)	15
◇マネー・マーケット・マザーファンド	23

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
		税分配分	み達金	期騰落中率				
(設定日)	円	円	%	%	%	%	百万円	
2013年11月6日	10,000	—	—	—	—	—	13,021	
1期(2014年11月28日)	10,114	0	1.1	0.0	—	99.0	13,439	
2期(2015年11月30日)	10,292	0	1.8	0.0	—	99.0	10,305	

(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 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2014年11月28日	円	%	%	%	%
	10,114	—	0.0	—	99.0
12月末	10,013	△1.0	0.0	—	98.7
2015年1月末	10,056	△0.6	0.0	—	99.2
2月末	10,130	0.2	0.0	—	99.1
3月末	10,169	0.5	0.0	—	99.1
4月末	10,388	2.7	0.0	—	99.8
5月末	10,362	2.5	0.0	—	99.1
6月末	10,257	1.4	0.0	—	99.2
7月末	10,248	1.3	0.0	—	99.2
8月末	10,235	1.2	0.0	—	99.1
9月末	10,230	1.1	0.0	—	99.1
10月末	10,261	1.5	0.0	—	99.0
(期 末) 2015年11月30日	10,292	1.8	0.0	—	99.0

(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

当期中の基準価額等の推移について

(第2期：2014/11/29～2015/11/30)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.8%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	一部の組入銘柄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。
下落要因	世界の転換社債市況が下落したこと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2期：2014/11/29～2015/11/30）

◎転換社債市況

- ・期を通じて見ると、世界の転換社債市況は下落しました。
- ・期首から2015年5月中旬にかけては、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、転換社債市況は上昇しました。その後、期末にかけては、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転換社債市況は下落しました。

◎国内短期金融市場

- ・当期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30日のコール・レートは0.076%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2013-11（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2013-11（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を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。
- ・当期は、世界の転換社債市況は下落したものの、一部の組入銘柄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に寄与し、基準価額は上昇しました。

<UBSグローバル好利回りCBファンド2013-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）>

- ・基準価額は期首に比べ2.5%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、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。期を通じて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。
- ・一部の組入銘柄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。

- ・「UBSグローバル好利回りCBファンド2013-11 (円ヘッジ) (適格機関投資家向け)」の運用会社のユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社提供のデータを掲載しています。
- ・記載データの基準は、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)) の定義に基づきます。

(ご参考)

ポートフォリオの特性値

期首 (現地2014年11月27日)

最終利回り	3.3%
直接利回り	2.8%
平均残存年数	1.2年
デュレーション	1.3年
株価連動率 (デルタ)	7.5%

(注) 最終利回りはCBを満期まで保有した場合の利回りです。利回りは、計算日時点の評価に基づくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。また最終利回りは費用・ヘッジコスト等控除前のもので実際の投資成果とは異なります。

(注) 平均残存年数は、組入CBの残存年数を加重平均したものです。期限前償還請求権が付与された銘柄の場合、償還請求を行使したと仮定し算出しています。

(注) デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する価格の変動率を示します。

(注) 株価連動率 (デルタ) は、株価の変動に対する感応度を表す指標です。値が大きいくほど、一般的に株式の価格変動に連動しやすくなります。

(注) 上記は、投資信託の評価金額合計 (キャッシュ・先物等を含む) について、各組入有価証券を各特性値 (利回り、デルタ、デュレーション) 別に集計し、加重平均により算出しています。

期末 (現地2015年11月27日)

最終利回り	2.3%
直接利回り	2.0%
平均残存年数	0.8年
デュレーション	0.8年
株価連動率 (デルタ)	1.9%

(注) 最終利回りはCBを満期まで保有した場合の利回りです。利回りは、計算日時点の評価に基づくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。また最終利回りは費用・ヘッジコスト等控除前のもので実際の投資成果とは異なります。

(注) 平均残存年数は、組入CBの残存年数を加重平均したものです。期限前償還請求権が付与された銘柄の場合、償還請求を行使したと仮定し算出しています。

(注) デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する価格の変動率を示します。

(注) 株価連動率 (デルタ) は、株価の変動に対する感応度を表す指標です。値が大きいくほど、一般的に株式の価格変動に連動しやすくなります。

(注) 上記は、投資信託の評価金額合計 (キャッシュ・先物等を含む) について、各組入有価証券を各特性値 (利回り、デルタ、デュレーション) 別に集計し、加重平均により算出しています。

(ご参考)

格付分布

期首 (現地2014年11月27日)

格付種類	比率
AAA格	5.0%
AA格	20.7%
A格	13.2%
BBB格	39.4%
BB格	17.7%
B格	4.0%
CCC格以下	0.0%

(注) 比率は投資信託の評価金額合計 (キャッシュ・先物等を含む) に対する割合です。なお、各比率の合計は端数処理の関係上100%とならない場合があります。

(注) 格付は、S & P、Moody'sの格付のうち低い格付を採用しています。格付が付与されていない銘柄については、UBS AG、UBSグローバル・アセット・マネジメント (チューリッヒ) が独自に判断します。

(注) キャッシュはAAAに分類しています。

期末 (現地2015年11月27日)

格付種類	比率
AAA格	4.5%
AA格	61.0%
A格	3.8%
BBB格	22.6%
BB格	3.4%
B格	4.2%
CCC格以下	0.4%

(注) 比率は投資信託の評価金額合計 (キャッシュ・先物等を含む) に対する割合です。なお、各比率の合計は端数処理の関係上100%とならない場合があります。

(注) 格付は、S & P、Moody'sの格付のうち低い格付を採用しています。格付が付与されていない銘柄については、UBS AG、UBSアセット・マネジメント (チューリッヒ) が独自に判断します。

(注) キャッシュはAAAに分類しています。

<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0.01%の上昇となりました。
- ・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。

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

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2期
	2014年11月29日～2015年11月30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	291

(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／UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11（円ヘッジ）（限定追加型）>

◎今後の運用方針

- ・運用の基本方針にしたがって、引き続き投資信託証券への投資を通じて、世界各国の転換社債等に実質的な投資を行うとともに、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う方針です。

<UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）>

◎運用環境の見通し

- ・米国では、米国経済が中長期的に緩やかなペースで拡大していくとの見通しを維持しており、米国株式市況は堅調に推移すると見ているものの、国際商品市況の変動や米ドル高が企業業績に与える影響には注意が必要だと考えています。欧州では、ECBによる金融緩和策の継続やそれに伴うユーロ安などが欧州経済を下支えすると見えています。
- ・前述のような投資環境のなか、CB市況については、短期的には市場の変動性が高まる展開も予想されますが、下値抵抗力を維持しつつ、株価上昇の局面ではそのメリットを享受できると考えています。

◎今後の運用方針

- ・今後については、引き続き運用の基本方針に基づき、世界各国の転換社債等に投資を行う方針です。組入外貨建資産については、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、満期などにより現金化されたCB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す。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

◎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29日～2015年11月30日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 70	% 0.684	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(33)	(0.326)	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 ）	(33)	(0.326)	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 ）	(3)	(0.033)	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	70	0.687	
期中の平均基準価額は、10,205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30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 2013-11(円ヘッジ)(適格機関投資家向け)	千口 —	千円 —	千口 3,281,583	千円 3,386,480

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2014年11月29日～2015年11月30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2013-11 (円ヘッジ) (限定追加型) >

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	$\frac{D}{C}$	
投資信託証券	百万円 —	百万円 —	% —	百万円 3,386	百万円 3,386	% 100.0

<マネー・マーケット・マザーファンド>

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 20,299	百万円 46.9	% 46.9	百万円 3,800	百万円 15.5	% 15.5
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 0.0%

※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30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	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		千口	千口	千円	%
UBS グローバル好利回りCBファンド 2013-11 (円ヘッジ) (適格機関投資家向け)		13,054,447	9,772,863	10,203,846	99.0
合 計		13,054,447	9,772,863	10,203,846	99.0

(注) 比率は三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11 (円ヘッジ) (限定追加型) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
マネー・マーケット・マザーファンド		982	982	1,000

○投資信託財産の構成

(2015年11月30日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 10,203,846	% 98.5
マネー・マーケット・マザーファンド	1,000	0.0
コール・ローン等、その他	149,820	1.5
投資信託財産総額	10,354,666	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年11月30日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	10,354,666,232
コール・ローン等	115,368,623
投資信託受益証券(評価額)	10,203,846,737
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	1,000,687
未収入金	34,450,000
未収利息	185
(B) 負債	49,380,376
未払解約金	11,756,905
未払信託報酬	37,468,894
その他未払費用	154,577
(C) 純資産総額(A-B)	10,305,285,856
元本	10,013,096,265
次期繰越損益金	292,189,591
(D) 受益権総口数	10,013,096,265口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,292円

<注記事項>

- ①期首元本額 13,288,308,958円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 3,275,212,693円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0292円です。

②分配金の計算過程

項目	2014年11月29日～ 2015年11月30日
費用控除後の配当等収益額	59,444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	170,004,828円
収益調整金額	-円
分配準備積立金額	122,125,319円
当ファンドの分配対象収益額	292,189,591円
1万口当たり収益分配対象額	291円
1万口当たり分配金額	-円
収益分配金額	-円

○損益の状況 (2014年11月29日～2015年11月30日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	83,716
受取利息	83,716
(B) 有価証券売買損益	251,358,504
売買益	296,686,540
売買損	△ 45,328,036
(C) 信託報酬等	△ 81,377,948
(D) 当期損益金(A+B+C)	170,064,272
(E) 前期繰越損益金	122,125,319
(F) 計(D+E)	292,189,591
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	292,189,591
分配準備積立金	292,189,591

- (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。

*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】

- 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。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2015年11月30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(13,519,251千円)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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	8,246,350 (8,000,000)	8,247,253 (8,000,725)	59.9 (58.1)	— (—)	— (—)	— (—)	59.9 (58.1)
合 計	8,246,350 (8,000,000)	8,247,253 (8,000,725)	59.9 (58.1)	— (—)	— (—)	— (—)	59.9 (58.1)

(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。

(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564回国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,093	2016/1/25
第566回国庫短期証券	—	3,000,000	3,000,234	2016/2/1
第567回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,081	2016/2/8
第568回国庫短期証券	—	2,500,000	2,500,317	2016/2/15
第340回利付国債(2年)	0.1	62,600	62,633	2016/5/15
第342回利付国債(2年)	0.1	100,000	100,074	2016/7/15
第343回利付国債(2年)	0.1	83,750	83,820	2016/8/15
合 計		8,246,350	8,247,253	

UBSグローバル好利回りCBファンド2013-11（円ヘッジ）（適格機関投資家向け）

《第2期》

[計算期間：2014年11月14日～2015年11月13日]

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	平成25年11月5日から平成28年11月11日まで
運用方針	世界各国の転換社債等 [※] を主要投資対象とし、信託期間を勘案しつつ相対的に利回りが高いと判断される銘柄に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。 ※「転換社債等」とは、一定の条件で株式に転換できる権利のついた社債や、これと同様の性質を有する証券、証書などの有価証券をいいます。（有価証券の種類にかかわらず、委託会社（運用指図権限の委託先を含む）が同様の投資効果を得られると判断するものを含みます。）以下、同じ。
主要運用対象	世界各国の転換社債等を主要投資対象とし、信託期間を勘案しつつ相対的に利回りが高いと判断される銘柄に投資を行います。
組入制限	①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ②投資信託証券（上場投資信託（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券）を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ③同一銘柄の転換社債等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④デリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的および流動性確保を目的とした場合に限るものとします。 ⑤外貨資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時（原則として毎年11月13日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、上記①の範囲内で、市況動向、残存信託期間等を勘案して委託会社が決定します。ただし、委託会社の判断で、分配を行わないことがあります。 ③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて元本部分と同一の運用を行います。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			株式組入比率	新株予約権付社債 (転換社債) 比率	債券組入比率	純資産 総額
	円	円	%				
(設定日) 2013年11月5日	10,000	—	—	—	—	—	百万円 0.1
1期(2014年11月13日)	10,208	0	2.1	—	77.0	19.0	13,427
2期(2015年11月13日)	10,411	0	2.0	—	38.5	54.1	10,298

(注) 基準価額および分配金は1万口当たり。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 当ファンドは原則として信託期間（約3年）内に満期を迎える転換社債に投資を行うため、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指数）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			株式組入比率	新株予約権付社債 (転換社債) 比率	債券組入比率
	円	騰落率	%			
(期首) 2014年11月13日	10,208	—	—	—	77.0	19.0
11月末	10,188	△0.2	—	—	75.0	19.7
12月末	10,092	△1.1	—	—	72.2	24.5
2015年1月末	10,141	△0.7	—	—	69.3	24.2
2月末	10,222	0.1	—	—	68.4	24.4
3月末	10,268	0.6	—	—	58.4	35.7
4月末	10,496	2.8	—	—	57.5	38.1
5月末	10,476	2.6	—	—	56.0	42.4
6月末	10,375	1.6	—	—	48.9	44.0
7月末	10,372	1.6	—	—	49.8	45.2
8月末	10,365	1.5	—	—	49.1	45.1
9月末	10,366	1.5	—	—	42.3	52.3
10月末	10,403	1.9	—	—	38.5	53.3
(期末) 2015年11月13日	10,411	2.0	—	—	38.5	54.1

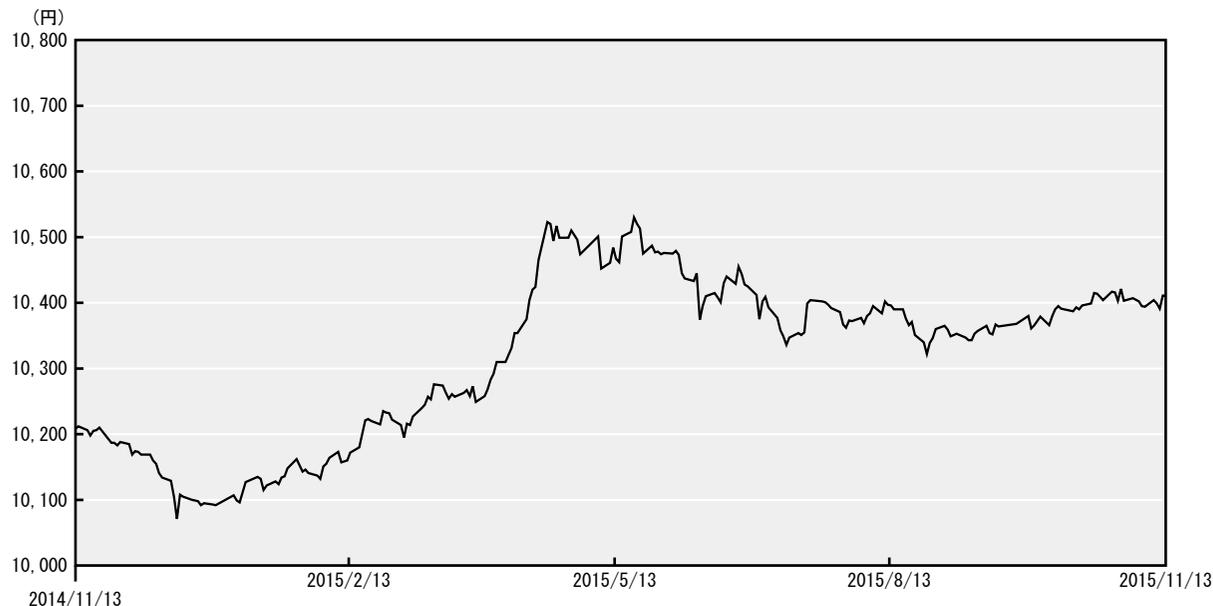
(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは原則として信託期間（約3年）内に満期を迎える転換社債に投資を行うため、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指数）はありません。

▶ 当期中の運用経過 ◀

◆ 基準価額の推移（2014. 11. 13～2015. 11. 13）



基準価額は期首比で203円値上がりしました。その結果、基準価額の騰落率は+2.0%となりました。

◆ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、主に、組入れられた転換社債（以下「CB」）等からの利子収入や発行企業の株価上昇などのプラス要因が、マイナス要因を上回ったため、上昇しました。CBの主な上昇要因は、期前半での株価上昇局面におけるCB発行企業の株価上昇に連動してCB価格が上昇したことです。

◆ 運用経過

当ファンドは、主としてファンドの信託期間（約3年）内に満期を迎え、相対的に利回りが高いと判断される銘柄のCB等に投資を行いました。なお、期中に満期等により現金化されたCBの一部については、当ファンドの信託期間内に満期を迎える米国債に投資を行いました。また、組入外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るために対円での為替ヘッジを行いました。

以下は2015年11月13日現在のポートフォリオの状況です。

【国別構成比】

国名	構成比
アメリカ	64.69%
バミューダ	6.10%
シンガポール	3.79%
フランス	3.53%
イギリス	3.27%
韓国	2.75%
ケイマン	2.73%
ドイツ	2.42%
オランダ	1.76%
ルクセンブルグ	1.11%
その他	0.45%
現金	7.40%

【通貨別構成比】

通貨	構成比
米ドル	79.30%
ユーロ	7.79%
中国元	2.53%
イギリス・ポンド	1.96%
シンガポール・ドル	1.26%
その他	7.15%

【格付別構成比】

格付	構成比
AAA格	7.40%
AA格	54.11%
A格	5.54%
BBB格	22.28%
BB格	6.05%
B格	4.13%
CCC格以下	0.50%

※各構成比は、純資産総額に対する比率です。なお、各構成比の合計は端数処理の関係100%とならない場合があります。
 ※国名は転換対象とする株式の情報に基づいて、通貨はCBの発行通貨情報に基づいて分類しています。
 ※格付については、S&P、ムーディーズの2社の格付機関による格付けのうち、低い格付けを採用しています。
 上記2社の格付けが付与されていない銘柄については、UBS AG、UBSアセット・マネジメント（チューリッヒ）の独自の判断とします。
 ※キャッシュはAAAに分類しています。

【組入上位10銘柄】

	銘柄名	利率	償還日	国	業種	通貨	構成比
1	US TREASURY N/B	1.000%	2016/10/31	アメリカ	国債	米ドル	54.11%
2	PROSPECT CAPITAL CORP	5.500%	2016/08/15	アメリカ	各種金融	米ドル	3.12%
3	GELLTRION INC	2.750%	2018/03/27	韓国	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	米ドル	2.75%
4	OLAM INTERNATIONAL LTD	6.000%	2016/10/15	シンガポール	食品・生活必需品小売	米ドル	2.54%
5	CHINA DAYE NON-FERROUS M	0.500%	2018/05/30	バミューダ	素材	中国元	2.53%
6	AXA SA	3.750%	2017/01/01	フランス	保険	ユーロ	2.51%
7	KLOECKNER & CO FINL SERV	2.500%	2017/12/22	ドイツ	資本財	ユーロ	2.42%
8	ARES CAPITAL CORP	4.875%	2017/03/15	アメリカ	各種金融	米ドル	2.38%
9	SHIP FINANCE INTL LTD	3.750%	2016/02/10	バミューダ	エネルギー	米ドル	1.83%
10	APOLLO INVESTMENT CORP	5.750%	2016/01/15	アメリカ	各種金融	米ドル	1.82%

■ 投資環境

当期の各国のCB市場は、期初、欧州中央銀行（ECB）による景気刺激策拡大への期待などから上昇したものの、2014年12月になると、原油価格急落による産油国経済への懸念の高まりや、ギリシャでの政局不安が浮上したことなどから市場のリスク回避姿勢が高まり、株式市場が軟調となったことを受けて下落しました。2015年に入ると、ECBによる量的金融緩和導入への期待が高まり、ウクライナの停戦合意やギリシャへの金融支援延長決定などが好感され、堅調に推移しました。その後も、米国での早期利上げ観測や米ドル高の進行などがマイナス材料となりつつも、中国の景気減速懸念が後退したことや資源価格が上昇に転じたことなどから、概ね上昇基調となりました。6月になると、ギリシャ債務交渉の先行き不透明感などに左右され上値の重い展開となり、7月以降は中国株式市場の急落、人民元の実質的な通貨切り下げや米国利上げ開始時期の不透明感などから投資家のリスク回避姿勢が高まり、世界的に株式市場が下落する展開となり、CB市場も大きく下落しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは原則として信託期間（約3年）内に満期を迎えるCBに投資を行うため、運用の目標となるベンチマークや投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数（参考指数）はありません。

収益分配金

当期は、市場動向等を勘案し収益分配は行いませんでした。なお、分配にあてなかった利益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税引前）

項目	第2期	
	2014年11月14日～2015年11月13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	462	

（注）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は、「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
（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

CB市場は、投資家からの需要も高く需給面でのバランスが良好であり、今後も安定的に推移すると考えられます。また、中小型銘柄などに割安感がみられます。

米国経済は、製造業で減速感がみられるものの、住宅関連指標などは概ね堅調に推移しています。連邦準備制度理事会（FRB）は年内利上げを示唆しており、市場では急速に12月利上げが意識されています。米国株式については、引き続き堅調に推移することが想定される一方で資源安や米ドル高による企業業績への影響には注意が必要だと考えられます。

欧州では、本格的な企業の業績改善には時間を要すると思われませんが、通貨安や資源価格の下落が業績回復の追い風となることが期待されています。欧州株式については、中国の景気減速やVW社の排ガス不正問題に伴う輸出減少など外需失速懸念がECBによる追加緩和期待により払拭されつつあり、堅調な展開が予想されます。更なる通貨安による輸出拡大や、雇用環境の改善による個人消費の回復などが、企業業績にプラスに働くと考えられます。

CBについては、年末にかけては大規模な償還が控えていることや新規起債が昨年と比べるとペースダウンしていることから需給の引き締まりが予想され、CB市場にプラスとなると考えられます。

CBは引き続き下値抵抗力を維持しつつ、株価上昇の局面ではそのメリットを享受できると考えていますが、短期的には市場の変動性が高まる展開も予想され、注意が必要と考えております。なお、今後も満期等により現金化されたCBの一部については信託期間内に満期を迎える米国債に投資を行い、組入外貨建資産については引き続き為替リスクの低減を図るため対円での為替ヘッジを行う方針です。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	58円	0.562%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額（月末値の平均）は10,313円です。
（投信会社）	(56)	(0.540)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(0)	(0.001)	運用報告書等各種書類の交付、口座内でのファンドに係る管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.021)	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
その他費用	2	0.018	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.012)	海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用
（監査費用）	(0)	(0.004)	監査法人等に支払うファンド監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.001)	受益権の管理事務に関連する費用等
合計	60	0.580	

（注）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって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）「金額」欄は項目ごと円未満四捨五入してあります。「比率」欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

【 売買および取引の状況 】（2014年11月14日～2015年11月13日）

新株予約権付社債（転換社債）については、取引単位で分類して2つの表に分けて表示しております。

(1-1) 新株予約権付社債（転換社債）

外国		買 付		売 付	
		額	面 金	額	面 金
			千米ドル		千米ドル
	ア メ リ カ	1,700	1,646	19,790 (19,324)	20,217 (19,683)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ド イ ツ	300	300	900	893
	オ ラ ン ダ	—	—	200	201
	オ ー ス ト リ ア	—	—	2,200	2,610
	イ ギ リ ス	—	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド 400	千イギリス・ポンド 423
	オ ー ス ト ラ リ ア	—	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル 2,400 (1,250)	千オーストラリア・ドル 2,581 (1,250)
	香 港	千香港ドル 8,000	千香港ドル 8,268	千香港ドル 2,000	千香港ドル 2,169
	シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポール・ドル 500	千シンガポール・ドル 499	千シンガポール・ドル 4,250	千シンガポール・ドル 4,500
	中 国	—	千中国元	千中国元 36,000	千中国元 41,439

(注) 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) () 内は予約権行使、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。

(1-2) 新株予約権付社債（転換社債）

外国		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
			証券		証券
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フ ラ ン ス	9,500	791	3,500 (10,600)	706 (904)

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) () 内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 公社債

外国		買 付 額	売 付 額
	アメリカ	千米ドル 23,580	千米ドル —
	国 債 証 券		

(注) 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) 単位未満は切り捨て。

(3) スワップ及び先渡取引状況

種 類	当 期 取 引 契 約 金 額
直 物 為 替 先 渡 取 引	百万円 18,644

(注) 金額は受渡し代金。

【 利害関係人等との取引状況等 】（2014年11月14日～2015年11月13日）

当期中の利害関係人等との取引はありません。

(注) 利害関係人等とは、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等です。

組入資産の明細 (2015年11月13日現在)

新株予約権付社債 (転換社債) については、取引単位で分類して2つの表に分けて表示しております。

(1-1) 外国新株予約権付社債 (転換社債)

銘柄	柄	期首(前期末)		当		期末	
		額	面金額	額	面金額	評価額	
						外貨	建金
		千米ドル	千米ドル	千米ドル	千円		
(アメリカ)							
TATA POWER CO 1.75%		1,300	—	—	—	—	—
TATA STEEL LTD 4.5%		1,250	—	—	—	—	—
TMK BONDS SA 5.25%		1,300	—	—	—	—	—
JAIPRAKASH POWER 7%		1,200	1,100	385	47,193	—	—
SALAMANDER 5%		1,300	—	—	—	—	—
ANNALY CAPITAL 5%		1,214	—	—	—	—	—
LUKOIL INTL FIN 2.625%		2,500	—	—	—	—	—
AU OPTRONICS 0%		1,800	—	—	—	—	—
HOME INNS 2%		2,030	1,480	1,465	179,702	—	—
APOLLO INV CORP 5.75%		1,910	1,520	1,526	187,059	—	—
SHIP FINANCE INT 3.75%		2,000	1,500	1,533	188,007	—	—
WEBMD HEALTH 2.25%		1,680	1,250	1,250	153,320	—	—
FIFTH ST FINANCE 5.375%		2,000	1,480	1,485	182,144	—	—
POLARCUS LTD 2.875%		1,000	—	—	—	—	—
NEWFORD CAPITAL 0%		1,800	1,300	1,435	175,966	—	—
HORIZON OIL LTD 5.5%		1,400	—	—	—	—	—
VEDANTA RESOURCE 5.5%		2,100	1,500	1,434	175,828	—	—
BGC PARTNERS INC 4.5%		1,850	—	—	—	—	—
PROSPECT CAPITAL 5.5%		3,400	2,600	2,622	321,499	—	—
OLAM INTL LTD 6%		2,800	2,100	2,134	261,601	—	—
AFRICAN MINERALS 8.5%		1,400	1,400	35	4,290	—	—
ARES CAPITAL COR 4.875%		3,350	1,950	2,000	245,245	—	—
ACER INC 0%		2,800	—	—	—	—	—
HOLDGROVE LTD 1%		3,000	—	—	—	—	—
TPK HOLDING CO 0%		3,750	—	—	—	—	—
CELLTRION INC 2.75%		3,250	2,000	2,307	282,809	—	—
PULAI CAPITAL 0%		3,200	—	—	—	—	—
SIEM INDUSTRIES 1%		—	1,000	934	114,604	—	—
DIGITAL RIVER 2%		3,010	—	—	—	—	—
小計	額・面金額・銘柄数<比率>	59,594	22,180	20,552	2,519,272		
		28	14	—	<24.5%>		
(ユーロ…ドイツ)							
KLOECKNER & CO 2.5%		千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	249,697	—	—
		2,500	1,900	1,885	—	—	—
小計	額・面金額・銘柄数<比率>	2,500	1,900	1,885	249,697		
		1	1	—	<2.4%>		
(ユーロ…オランダ)							
WERELDHAVE NV 2.875%		千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	181,042	—	—
		1,550	1,350	1,366	—	—	—
小計	額・面金額・銘柄数<比率>	1,550	1,350	1,366	181,042		
		1	1	—	<1.8%>		
(ユーロ…オーストリア)							
CONWERT IMMO INV 4.5%		千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	—	—	—
		2,200	—	—	—	—	—
小計	額・面金額・銘柄数<比率>	2,200	—	—	—		
		1	—	—	<—%>		
ユーロ計	額・面金額・銘柄数<比率>	6,250	3,250	3,252	430,739		
		3	2	—	<4.2%>		
(イギリス)							
SVG CAPITAL PLC 8.25%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	160,544	—	—
		1,200	800	860	—	—	—
小計	額・面金額・銘柄数<比率>	1,200	800	860	160,544		
		1	1	—	<1.6%>		
(オーストラリア)							
WESTERN AREAS NL 6.4%		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	—	—	—
		1,250	—	—	—	—	—
NOVION PROPERTY 5.75%		2,400	—	—	—	—	—
小計	額・面金額・銘柄数<比率>	3,650	—	—	—		
		2	—	—	<—%>		

銘柄	柄	期首(前期末)		当		期		末	
		額	面金額	額	面金額	評 価		額	
						外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額
(香港)			千香港ドル		千香港ドル		千香港ドル		千円
HENGAN INTL 0%			—		6,000		6,380		100,935
小計	額面金額 銘柄数 <比率>		—		6,000		6,380		100,935
(シンガポール)			千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル		—
CAPITALAND LTD 3.125%			3,500		—		—		—
SUNTEC REIT 1.4%			1,750		1,500		1,493		129,092
小計	額面金額 銘柄数 <比率>		5,250		1,500		1,493		129,092
(中国)			千中国元		千中国元		千中国元		—
CHAOWEI POWER 7.25%			18,000		—		—		—
CHINA DAYE NON-F 0.5%			21,000		14,000		13,517		260,202
FUFENG GROUP 3%			11,000		—		—		—
小計	額面金額 銘柄数 <比率>		50,000		14,000		13,517		260,202
合計	額面金額 銘柄数 <比率>		39		20		—		3,600,786
									<35.0%>

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
 (注) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(1-2) 外国新株予約権付社債(転換社債)

銘柄	柄	期首(前期末)		当		期		末	
		証	券数	証	券数	評 価		額	
						外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)			証券		証券		千ユーロ		千円
AXA SA 3.75% 17/01/01			9,100		7,000		1,953		258,674
NEOPOST SA 3.75% 15/02/01			12,000		—		—		—
TECHNIP 0.5% 16/01/01			—		9,500		792		104,916
合計	証券数 銘柄数 <比率>		21,100		16,500		2,745		363,591
			2		2		—		<3.5%>

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
 (注) <>内は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(2) 外国(外貨建)公社債

① 種類別開示

(2015年11月13日現在)

区分	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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 45,300	千米ドル 45,457	千円 5,572,231	54.1%	—%	—%	—%	54.1%
合計	45,300	45,457	5,572,231	54.1	—	—	—	54.1

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
 (注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
 (注) 単位未満は切り捨て。
 (注) 一印は組み入れなし。
 (注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社よりデータを入力しています。

② 個別銘柄開示

銘柄名	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券 US TREASURY N/B 1%	1.0	45,300	45,457	5,572,231	2016/10/31
合計	—	—	—	5,572,231	—

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
 (注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(3) スワップ及び先渡取引残高

種 類	当 期 末 取 引 契 約 残 高
直 物 為 替 先 渡 取 引	百万円 259

投資信託財産の構成

2015年11月13日現在

項 目	当 期		末 率
	評 価	額 比	
新株予約権付社債(転換社債)	千円		%
公 社 債	3,964,377		37.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,572,231		53.0
投 資 信 託 財 産 総 額	972,879		9.2
	10,509,487		100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 当期末における外貨建資産(9,668,148千円)の投資信託財産総額(10,509,487千円)に対する比率は92.0%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=122.58円、1ユーロ=132.45円、1イギリス・ポンド=186.68円、1オーストラリア・ドル=87.47円、1香港ドル=15.82円、1シンガポール・ドル=86.44円、1中国元=19.25円です。

特定資産の価格等の調査

当ファンドにおいて行った取引のうち、「投資信託及び投資法人に関する法律」(以下「投信法」といいます。)により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、対象期間中(2014年11月14日から2015年11月13日まで)に直物為替先渡取引が39件あり、新日本有限責任監査法人にその調査を委託し、調査報告書を受領しております。

当該監査法人では、取引価格と比較可能な価格を入手し、当社が提示した根拠資料と照合するとともに両者を比較しており、当該直物為替先渡取引について、取引日、取引の相手方の名称、通貨ペア、数量、売買の別、受渡日、約定価格を当社が提示した関係書類と照合し、すべて的一致を確かめています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年11月13日現在

項 目	当 期	末
(A) 資 産	20,004,683,870円	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	908,923,380	
公 社 債(評価額)	9,536,609,407	
未 収 入 金	9,522,360,533	
未 収 利 息	36,238,157	
前 払 費 用	552,393	
(B) 負 債	9,706,381,655	
未 払 金	9,648,206,203	
未 払 解 約 金	27,100,000	
未 払 信 託 報 酬	30,739,871	
そ の 他 未 払 費 用	335,581	
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,298,302,215	
元 本	9,891,499,939	
次 期 繰 越 損 益 金	406,802,276	
(D) 受 益 権 総 口 数	9,891,499,939口	
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,411円	

【元本増減】

期元本額	13,154,273,848円
期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	3,262,773,909円
1口当たり純資産額	1.0411円

損益の状況

(2014年11月14日～2015年11月13日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	249,058,151円
受 取 利 息	248,083,816
そ の 他 収 益 金	974,335
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	26,732,224
売 買 損 益	2,733,753,120
売 買 損 益	△2,707,020,896
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△16,865,980
取 引 損 益	31,950,120
取 引 損 益	△48,816,100
(D) 信 託 報 酬 等	△68,877,507
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	190,046,888
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	216,849,747
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△94,359
(配 当 等 相 当 額)	(380)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△94,739)
(H) 計	406,802,276
(I) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(H+I)	406,802,276
追 加 信 託 差 損 益 金	△94,359
(配 当 等 相 当 額)	(380)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△94,739)
分 配 準 備 積 立 金	457,571,743
繰 越 損 益 金	△50,675,108

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(D)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) 損益の状況の中で(G)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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(182,804,877円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(380円)および分配準備積立金(274,766,866円)より分配対象収益は457,571,743円(10,000口当たり462円)ですが、分配を行っておりません。

【お知らせ】

平成26年12月1日の金融商品取引業等に関する内閣府令及び投資信託及び投資法人に関する法律等の改正(受益者書面決議制度の見直しに伴う変更、運用報告書の提供方法、並びにデリバティブ取引等に係る投資制限の管理方法等)に伴い、当ファンドの信託約款の該当する条項に所要の変更を行いました。(約款変更実施日:平成26年12月1日)

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。

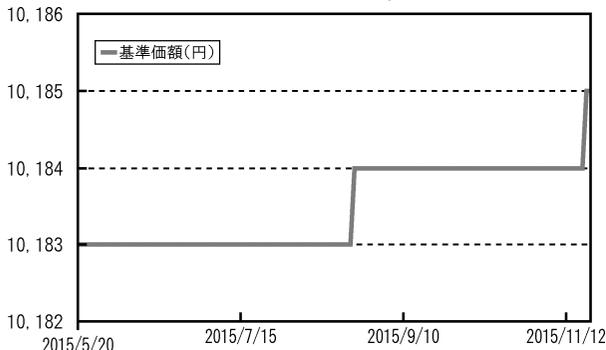
○運用経過

●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	
	%	千円	千円		
国債証券	—	3,110,000	3,110,000	2015/11/30	
第554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
	千円	%
公社債	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<ブラジルリアルコース> (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)	581,687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>	112,318,894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>	980,017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
Navi o インド債券ファンド	885,566円
Navi o マネープールファンド	1,883,381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UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	1,242,825,788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)	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)