

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	2020年9月18日まで（2016年9月15日設定）	
運用方針	世界好利回りCBマザーファンド2016-09受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の転換社債等に投資を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 マザーファンドの転換社債等の運用にあたっては、ロンバー・オディエ・アセット・マネジメント（ヨーロッパ）リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビード ファンド	世界好利回りCBマザーファンド2016-09受益証券を主要投資対象とします。
	マザー ファンド	日本を含む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	ベビード ファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザー ファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

世界好利回りCBファンド2016-09 （為替ヘッジなし）（限定追加型）

第1期（決算日：2017年9月19日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、お手持ちの「世界好利回りCBファンド2016-09（為替ヘッジなし）（限定追加型）」は、去る9月19日に第1期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)
お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	純資産額
		税分	込配	み金		
(設定日)	円			円	%	百万円
2016年9月15日	10,000			—	—	2,695
1期(2017年9月19日)	11,963			0	19.6	1,487

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率
		騰	落率	
(設定日)	円		%	%
2016年9月15日	10,000		—	—
9月末	9,933		△ 0.7	77.9
10月末	10,150		1.5	97.9
11月末	10,723		7.2	98.3
12月末	11,175		11.8	95.5
2017年1月末	11,127		11.3	97.0
2月末	11,140		11.4	97.2
3月末	11,206		12.1	97.3
4月末	11,349		13.5	97.7
5月末	11,433		14.3	98.0
6月末	11,708		17.1	97.9
7月末	11,650		16.5	97.8
8月末	11,638		16.4	96.9
(期末)				
2017年9月19日	11,963		19.6	97.2

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」は実質比率を記載しております。

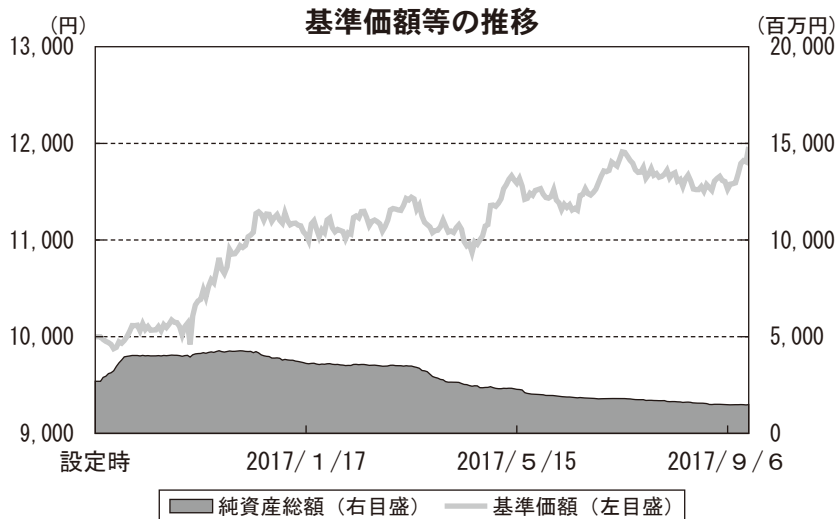
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第1期：2016/9/15～2017/9/19)

基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ19.6%の上昇となりました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因

グローバル転換社債 (CB) 市況が上昇したことやCBの利子収益を享受したこと、主要通貨が対円で上昇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：2016/9/15～2017/9/19）

◎グローバルCB市況

- ・グローバルCB市況は上昇しました。
- ・フランス大統領選挙が無難な結果となり欧州政治への懸念が後退したことや米国における好調な企業決算などを背景に、株式市況が世界的に堅調に推移したことなどから、グローバルCB市況は上昇する展開となりました。

為替市況の推移
（設定時を100として指数化）



◎為替市況

- ・米ドルやユーロなどの主要通貨は対円で上昇しました。
- ・米連邦準備制度理事会（FRB）によって緩やかながらも政策金利が引き上げられたことや欧州中央銀行（ECB）による資産購入縮小観測が高まったことなどを受けて米独国債金利が上昇するなか、本邦との金利差拡大などを背景に、米ドルやユーロは円に対して上昇する展開となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<世界好利回りCBファンド2016-09（為替ヘッジなし）（限定追加型）>

- ・当ファンドは、世界好利回りCBマザーファンド2016-09受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・当期の基準価額は、グローバルCB市況が上昇したことやCBの利子収益を享受したこと、主要通貨が対円で上昇したことなどから、上昇しました。

<世界好利回りCBマザーファンド2016-09>

基準価額は設定時に比べ21.0%の上昇となりました。

- ・主として、日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・当初ポートフォリオ構築にあたって、投資対象地域の分散、信用リスク、価格水準、残存期間、流動性等を勘案しつつ、世界のCB市場において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した。
- ・その後、保有銘柄は原則継続保有しましたが、値上がりした一部の銘柄などについては売却を行い、信用状況や価格水準、流動性等を勘案しつつ、世界のCB市場において相対的に利回りが高いと判断した銘柄に再投資を行いました。
- ・上記のような運用を行った結果、グローバルCB市況が上昇したことやCBの利子収益を享受したこと、主要通貨が対円で上昇したことなどがプラスとなり、基準価額は設定時に比べて上昇しました。

（ご参考）

ポートフォリオ特性

2017年8月末

最終利回り※	4.50%
平均残存年数※	1.92年
株価連動率※	9.53%

※最終利回り、平均残存年数、株価連動率は、運用委託先であるロンパー・オディエ・アセット・マネジメント（ヨーロッパ）リミテッドより提供されたものです。

- ・現物債券評価額（含むCB）に対する数値です。
- ・最終利回りは、個別銘柄ごとの複利利回りを加重平均したものです。
- ・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。
- ・平均残存年数は、個別銘柄ごとの残存年数を加重平均したものです。
- ・最終利回り、平均残存年数は、期限前償還請求権が付与されている銘柄については、償還請求権日を考慮して運用委託先が独自に算出したものです。
- ・株価連動率は、CBの価格が転換対象となる株式等の価格変動にどの程度連動するかを表す指標です。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。
- ・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1期
	2016年9月15日～2017年9月19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	1,988

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

<世界好利回りCBファンド2016-09（為替ヘッジなし）（限定追加型）>

◎今後の運用方針

- ・マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れ、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

<世界好利回りCBマザーファンド2016-09>

◎運用環境の見通し

- ・各国の中央銀行の金融政策や今後の政治イベントに対する思惑などにより、短期的にはCB市場が不安定な動きとなる展開も予想されますが、相対的に利回り水準が高いCBに対する投資家の需要は根強いと見ています。

◎今後の運用方針

- ・今後の運用につきましては、原則として償還または繰上償還請求可能日まで保有することを基本として、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす方針です。保有銘柄については信用状況などを継続的に注視していきます。なお、組入銘柄が償還となった場合や運用者の判断により銘柄を売却した場合などには、原則として信託期間内に償還または繰上償還請求可能日を迎える銘柄に再投資を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2016年9月15日～2017年9月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(77)	(0.696)	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)	(36)	(0.321)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0.032)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.018	(b) 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)	(2)	(0.014)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.004)	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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	119	1.068	
期中の平均基準価額は、11,102円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2016年9月15日～2017年9月19日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
世界好利回りCBマザーファンド2016-09	千口 3,961,875	千円 3,953,400	千口 2,742,679	千円 3,087,000

○利害関係人との取引状況等

（2016年9月15日～2017年9月19日）

利害関係人との取引状況

<世界好利回りCBファンド2016-09（為替ヘッジなし）（限定追加型）>

該当事項はございません。

<世界好利回りCBマザーファンド2016-09>

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	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 25,865	百万円 9,025	% 34.9	百万円 12,960	百万円 2,329	% 18.0

平均保有割合 12.8%

※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。

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

（2017年9月19日現在）

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
世界好利回りCBマザーファンド2016-09		千口 1,219,196	千円 1,475,592

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

（2017年9月19日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
世界好利回りCBマザーファンド2016-09	千円 1,475,592	% 96.9
コール・ローン等、その他	46,622	3.1
投資信託財産総額	1,522,214	100.0

(注) 世界好利回りCBマザーファンド2016-09において、期末における外貨建純資産（17,473,779千円）の投資信託財産総額（17,547,703千円）に対する比率は99.6%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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1アメリカドル=111.46円	1ユーロ=133.37円	1イギリスポンド=150.67円	1スウェーデンクローネ=14.01円
1シンガポールドル=82.78円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年9月19日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,522,214,968
コール・ローン等	46,622,013
世界好利回りCBマザーファンド2016-09（評価額）	1,475,592,955
(B) 負債	34,333,886
未払解約金	23,093,457
未払信託報酬	11,199,260
未払利息	91
その他未払費用	41,078
(C) 純資産総額（A－B）	1,487,881,082
元本	1,243,759,685
次期繰越損益金	244,121,397
(D) 受益権総口数	1,243,759,685口
1万口当たり基準価額（C／D）	11,963円

<注記事項>

- ①設定元本額 2,695,031,513円
 期中追加設定元本額 1,293,601,090円
 期中一部解約元本額 2,744,872,918円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1963円です。

○損益の状況（2016年9月15日～2017年9月19日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 13,779
受取利息	281
支払利息	△ 14,060
(B) 有価証券売買損益	278,012,025
売買益	475,074,488
売買損	△197,062,463
(C) 信託報酬等	△ 31,191,659
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	246,806,587
(E) 追加信託差損益金	△ 2,685,190
（配当等相当額）	（△ 46）
（売買損益相当額）	（△ 2,685,144）
(F) 計（D＋E）	244,121,397
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金（F＋G）	244,121,397
追加信託差損益金	△ 2,685,190
（配当等相当額）	（ 551,560）
（売買損益相当額）	（△ 3,236,750）
分配準備積立金	246,806,587

- （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）(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。

②分配金の計算過程

項 目	2016年9月15日～ 2017年9月19日
費用控除後の配当等収益額	24,295,365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	222,511,222円
収益調整金額	551,560円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	247,358,147円
1万口当たり収益分配対象額	1,988円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

- ③「世界好利回りCBマザーファンド2016-09」の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、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の40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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。）の税率が適用されます。

世界好利回りCBマザーファンド2016-09

《第1期》決算日2017年9月19日

[計算期間：2016年9月15日～2017年9月19日]

「世界好利回りCBマザーファンド2016-09」は、9月19日に第1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1期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	<p>主として日本を含む世界各国の転換社債等に投資を行います。 銘柄選定にあたっては、投資対象地域の分散、信用リスク、価格水準、残存期間、流動性等を勘案しつつ、世界の転換社債市場において相対的に利回りが高いと判断される銘柄に投資を行うことを基本とします。なお、信用等级付けが投資適格未満（BBB一格相当未満）の銘柄への投資もを行います。</p> <p>原則として信託期間内に償還を迎える銘柄に投資を行い、償還まで保有することを基本とします。なお、運用者の判断により償還前に売却することがあります。</p> <p>転換社債の償還金等については、原則として信託期間内に償還を迎える転換社債に再投資を行います。ただし、市況動向や残存期間等によっては、信託期間内に償還を迎える普通社債や国債等に再投資することがあります。そのため、転換社債の組入比率が大幅に低下することがあります。</p> <p>転換社債等の運用にあたっては、ロンパー・オディエ・アセット・マネジメント（ヨーロッパ）リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p>
主 要 運 用 対 象	日本を含む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	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	純 資 産 総 額
		期 騰 落	中 率		
(設定日)	円		%	%	百万円
2016年9月15日	10,000		—	—	15,300
1期(2017年9月19日)	12,103		21.0	98.0	17,445

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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		新株予約権付社債 (転 換 社 債) 組 入 比 率
				騰 落	率	
			円		%	%
	(設定日)	2016年9月15日	10,000		—	—
	9月末		9,935	△	0.7	78.3
	10月末		10,164		1.6	98.2
	11月末		10,748		7.5	98.7
	12月末		11,213		12.1	96.0
	2017年1月末		11,175		11.8	97.5
	2月末		11,197		12.0	97.8
	3月末		11,275		12.8	97.8
	4月末		11,429		14.3	98.1
	5月末		11,524		15.2	98.8
	6月末		11,814		18.1	98.9
	7月末		11,765		17.7	97.9
	8月末		11,765		17.7	97.9
	(期 末)	2017年9月19日	12,103		21.0	98.0

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

○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

基準価格は設定時に比べ21.0%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●投資環境について

◎グローバル転換社債 (CB) 市況

- ・グローバルCB市況は上昇しました。
- ・フランス大統領選挙が無難な結果となり欧州政治への懸念が後退したことや米国における好調な企業決算などを背景に、株式市況が世界的に堅調に推移したことなどから、グローバルCB市況は上昇する展開となりました。

◎為替市況

- ・米ドルやユーロなどの主要通貨は対円で上昇しました。
- ・米連邦準備制度理事会 (FRB) によって緩やかながらも政策金利が引き上げられたことや欧州中央銀行 (ECB) による資産購入縮小観測が高まったことなどを受けて米独国債金利が上昇するなか、本邦との金利差拡大などを背景に、米ドルやユーロは円に対して上昇する展開とな

りました。

- 当該投資信託のポートフォリオについて
 - ・主として、日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れる運用を行いました。
 - ・当初ポートフォリオ構築にあたって、投資対象地域の分散、信用リスク、価格水準、残存期間、流動性等を勘案しつつ、世界のCB市場において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した。
 - ・その後、保有銘柄は原則継続保有しましたが、値上がりした一部の銘柄などについては売却を行い、信用状況や価格水準、流動性等を勘案しつつ、世界のCB市場において相対的に利回りが高いと判断した銘柄に再投資を行いました。
- ・上記のような運用を行った結果、グローバルCB市況が上昇したことやCBの利子収益を享受したこと、主要通貨が対円で上昇したことがプラスとなり、基準価額は設定時に比べて上昇しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・各国の中央銀行の金融政策や今後の政治イベントに対する思惑などにより、短期的にはCB市場が不安定な動きとなる展開も予想されますが、相対的に利回り水準が高いCBに対する投資家の需要は根強いと見ています。

◎今後の運用方針

- ・今後の運用につきましては、原則として償還または繰上償還請求可能日まで保有することを基本として、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす方針です。保有銘柄については信用状況などを継続的に注視していきます。なお、組入銘柄が償還となった場合や運用者の判断により銘柄を売却した場合などには、原則として信託期間内に償還または繰上償還請求可能日を迎える銘柄に再投資を行います。

○ 1万口当たりの費用明細

(2016年9月15日～2017年9月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.016	(a)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 ）	(2)	(0.016)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	2	0.016	
期中の平均基準価額は、11,167円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2016年9月15日～2017年9月19日)

新株予約権付社債（転換社債）

		買 付		売 付	
		額 面	金 額	額 面	金 額
外	アメリカ	千アメリカドル 156,450	千アメリカドル 149,755	千アメリカドル 68,250 (200)	千アメリカドル 68,159 (200)
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	イタリア	700	663	700	658
	フランス	6,607	6,448	4,606	4,880
	ルクセンブルク	16,000	14,804	1,000	968
	フィンランド	1,000	986	1,000	1,113
	オーストラリア	4,700	4,704	—	—
	アラブ首長国連邦	21,700	17,322	7,300	6,457
	南アフリカ	500	493	—	—
国	イギリス	千イギリスポンド 13,300	千イギリスポンド 12,544	千イギリスポンド 2,400	千イギリスポンド 2,014
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 89,000	千スウェーデンクローネ 82,017	千スウェーデンクローネ 36,000	千スウェーデンクローネ 37,442
	香港	千香港ドル 8,000	千香港ドル 7,938	千香港ドル 8,000	千香港ドル 7,929
	シンガポール	千シンガポールドル 8,500	千シンガポールドル 8,280	千シンガポールドル 2,250	千シンガポールドル 2,239
	中国	千中国元 130,000	千中国元 128,902	千中国元 130,000	千中国元 133,093

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年9月15日～2017年9月19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	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2017年9月19日現在)

外国新株予約権付社債（転換社債）

銘柄		当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千アメリカドル	千アメリカドル	千円
0.75 SUNPOWER COR 180601		10,100	9,797	1,091,973
2.875 SPIRIT REAL 190515		3,700	3,700	412,404
1.75 BW GROUP LTD 190910		9,600	9,139	1,018,655
0.25 TWITTER INC 190915		4,000	3,807	424,383
4.75 PROSPECT 200415		14,800	14,855	1,655,794
3 DELTA INVESTMEN 200526		5,200	5,174	576,694
3.25 NRG YIELD 200601		5,000	5,003	557,648
0.5 COSMOS BO 200623		12,000	11,863	1,322,305
0 RESTORATION HAR 200715		6,200	5,324	593,440
1.5 GNC HOLDINGS 200815		4,000	2,967	330,757
0 CHINA OVERS 230105		6,400	6,896	768,628
3.875 JEFFERIES G 291101		7,000	7,026	783,145
小 計	額 面 ・ 金 額	88,000	85,553	9,535,831
	銘柄数<比率>	12	—	<54.7%>
(ユーロ・・・フランス)		千ユーロ	千ユーロ	
1 RALLYE SA 201002		2,001	2,133	284,494
小 計	額 面 ・ 金 額	2,001	2,133	284,494
	銘柄数<比率>	1	—	<1.6%>
(ユーロ・・・ルクセンブルク)				
4 OHL INVESTMENTS 180425		9,000	9,033	1,204,831
1.75 FF GROU 190703		6,000	5,775	770,211
小 計	額 面 ・ 金 額	15,000	14,808	1,975,042
	銘柄数<比率>	2	—	<11.3%>
(ユーロ・・・オーストラリア)				
2 CROMWELL SPV 200204		4,700	4,717	629,189
小 計	額 面 ・ 金 額	4,700	4,717	629,189
	銘柄数<比率>	1	—	<3.6%>
(ユーロ・・・アラブ首長国連邦)				
0.5 AABAR INV 200327		14,400	12,974	1,730,395
小 計	額 面 ・ 金 額	14,400	12,974	1,730,395
	銘柄数<比率>	1	—	<9.9%>

銘柄		当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ・・・南アフリカ)		千ユーロ	千ユーロ	千円
1.5 REDEFINE P 210916		500	486	64,851
小 計	額 面 ・ 金 額	500	486	64,851
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<0.4%>
ユ ー ロ 計	額 面 ・ 金 額	36,601	35,120	4,683,973
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	—	<26.8%>
(イギリス)		千イギリスポンド	千イギリスポンド	
2.875 ST MODWEN 190306		4,000	4,026	606,597
2.5 CARILLION F 191219		2,100	1,462	220,377
0 BRITISH LAND 200609		3,000	2,883	434,381
3.5 ENTERPRISE FU 200910		1,800	1,799	271,070
小 計	額 面 ・ 金 額	10,900	10,170	1,532,426
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	—	<8.8%>
(スウェーデン)		千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	
3.625 SAS AB 190401		53,000	58,565	820,495
小 計	額 面 ・ 金 額	53,000	58,565	820,495
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<4.7%>
(シンガポール)		千シンガポールドル	千シンガポールドル	
1.85 CAPITALAND 200619		4,750	4,763	394,286
1.75 SUNTEC REIT 210905		1,500	1,518	125,722
小 計	額 面 ・ 金 額	6,250	6,281	520,008
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	—	<3.0%>
合 計	額 面 ・ 金 額	—	—	17,092,736
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	—	<98.0%>

(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) < >内の比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2017年9月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
新株予約権付社債(転換社債)	17,092,736	97.4
コール・ローン等、その他	454,967	2.6
投資信託財産総額	17,547,703	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(17,473,779千円)の投資信託財産総額(17,547,703千円)に対する比率は99.6%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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=111.46円	1 ユーロ=133.37円	1 イギリスポンド=150.67円	1 スウェーデンクローネ=14.01円
1 シンガポールドル=82.78円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年9月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,701,270,425
コール・ローン等	242,890,458
公社債(評価額)	17,092,736,120
未収入金	253,009,555
未収利息	111,966,693
前払費用	667,599
(B) 負債	256,017,449
未払金	156,017,305
未払解約金	100,000,000
未払利息	144
(C) 純資産総額(A-B)	17,445,252,976
元本	14,413,814,744
次期繰越損益金	3,031,438,232
(D) 受益権総口数	14,413,814,744口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,103円

<注記事項>

- ①設定元本額 15,300,000,000円
 期中追加設定元本額 9,902,066,449円
 期中一部解約元本額 10,788,251,705円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2103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)

世界好利回りCBファンド2016-09(為替ヘッジあり)(限定追加型)	13,194,618,714円
世界好利回りCBファンド2016-09(為替ヘッジなし)(限定追加型)	1,219,196,030円
合計	14,413,814,744円

○損益の状況 (2016年9月15日～2017年9月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	461,734,290
受取利息	461,047,969
その他収益金	1,191,533
支払利息	△ 505,212
(B) 有価証券売買損益	3,951,212,201
売買益	4,189,175,032
売買損	△ 237,962,831
(C) 保管費用等	△ 3,593,515
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,409,352,976
(E) 追加信託差損益金	△ 63,566,449
(F) 解約差損益金	△ 1,314,348,295
(G) 計(D+E+F)	3,031,438,232
次期繰越損益金(G)	3,031,438,232

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。