

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。

償還報告書（全体版）

[満期償還]

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）



信託終了日：2020年9月18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、「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、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国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取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 (分配落)	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 銭			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
2期(2018年9月18日)	11,878			0	△ 0.7	802
3期(2019年9月18日)	11,515			0	△ 3.1	687
(償還時)	(償還価額)					
4期(2020年9月18日)	11,500.30			—	△ 0.1	584

(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		新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首)	円 銭		%	%
2019年9月18日	11,515		—	90.4
9月末	11,529		0.1	96.7
10月末	11,795		2.4	93.6
11月末	11,826		2.7	97.2
12月末	11,928		3.6	96.7
2020年1月末	11,847		2.9	96.3
2月末	11,733		1.9	91.6
3月末	11,353		△1.4	87.3
4月末	11,207		△2.7	76.4
5月末	11,385		△1.1	72.1
6月末	11,483		△0.3	37.3
7月末	11,466		△0.4	15.6
8月末	11,508		△0.1	—
(償還時)	(償還価額)			
2020年9月18日	11,500.30		△0.1	—

(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、「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

第1期～第4期：2016年9月15日～2020年9月18日

設定来の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第1期首	10,000円
第4期末	11,500.30円
既払分配金	0円
騰落率	15.0%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみな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。

基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ15.0%の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

設定当初に買い付けたPREMIER OIL（英国の石油・ガス探鉱会社）やENTERPRISE FU（英国のパブ経営企業）等の銘柄を債券価格が買付価格を上回る水準で売却し、利益（債券の買付価格と売却価格の差）を確定したことが、基準価額の上昇要因となりました。

設定来で、米ドルやユーロが対円で上昇したこと等が、基準価額の上昇要因となりました。

転換社債（CB）利子収益を享受したことは基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

信託報酬等のコストや、連邦破産法第11章（以下、チャプター11）の適用を申請したWHITING PETROLEUM（米国の石油・ガス探鉱会社：チャプター11適用申請日は2020年4月1日）を債券価格が買付価格を下回る水準で売却し、損失（債券の買付価格と売却価格の差）を確定したことが、基準価額の下落要因となりました。

第1期～第4期：2016年9月15日～2020年9月18日

投資環境について

▶ グローバルCB市況 グローバルCB市況は、設定来で上昇しました。

債券市況は、2018年末にかけては、米金融当局による政策金利引き上げに伴い下落したものの、2019年以降、米中貿易摩擦問題への懸念や新型コロナウイルスの世界的感染拡大による経済の減速懸念等を受けた米国とドイツの金利低下等に伴い上昇し、設定来で上昇しました。

株式市況は、2020年に入り新型コロナウイルスの世界的感染拡大等を受けて大きく下落する局面もありましたが、トランプ政権の税制改革や2019年以降の世界的な金融緩和環境等を背景に、設定来で上昇しました。

このような環境下、グローバルCB市況は、債券市況や株式市況の上昇等がプラスとなり、設定来で上昇しました。

▶ 為替市況 米ドルやユーロは、設定来で対円で上昇しました。

2017年末にかけて、米金融当局による政策金利の引き上げや欧州金融当局による金融緩和縮小観測の高まり等から、米独の金利が上昇するなか、本邦との金利差拡大等を背景に、米ドルやユーロは対円で上昇しました。その後は、米ドルやユーロは対円で軟調に推移したものの、設定来では上昇しました。

▶ 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）

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。

第4期（2019年9月19日～信託終了日）は、上記の運用を維持し、信託終了日にかけてマザーファンドの償還金を受領しました。

▶ 世界好利回りCBマザーファンド 2016-09

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。

保有銘柄は原則継続保有しましたが、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売却をした場合等には、信用状況や価格水準、流動性等を勘案しつつ、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。

第4期（2019年9月19日～信託終了日）は、上記の運用を維持し、償還に向け2020年6月以降保有資産の売却を一部で開始するなど、安定運用に切り替えました。

▶ 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

信託期間中の収益の分配はありません。

▶ 償還価額

▶ 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）

償還価額は、11,500円30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。

2019年9月19日～2020年9月18日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	125	1.080	(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）	(83)	(0.716)	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）	(38)	(0.331)	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)	(0.033)	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	3	0.026	(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)	(0.017)	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)	(0.004)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	128	1.106	

期中の平均基準価額は、11,571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。

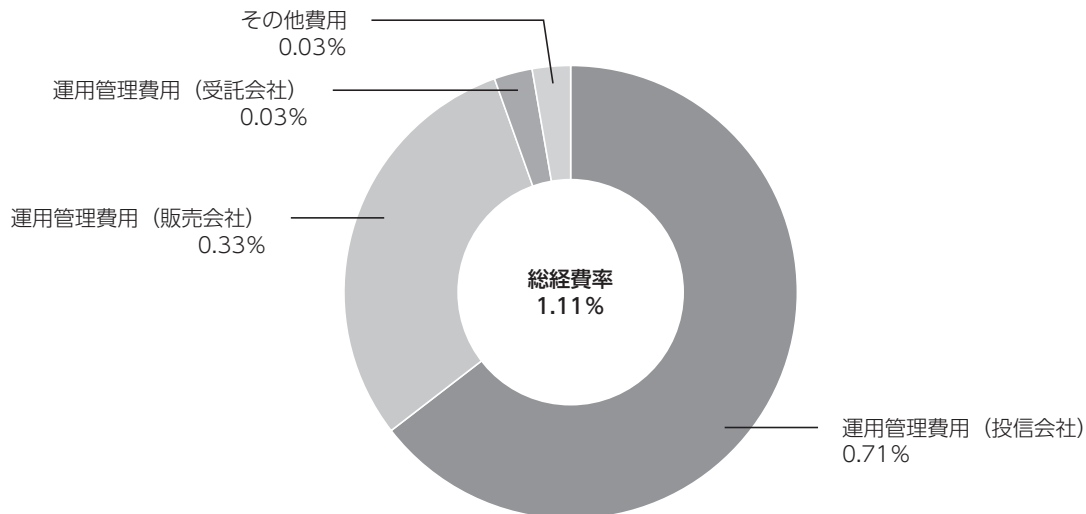
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（参考情報）

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.11%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年9月19日～2020年9月18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 —	千円 —	千口 572,019	千円 686,804

○利害関係人との取引状況等

(2019年9月19日～2020年9月18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 2,158	% 31.9	百万円 15,385	百万円 2,359	% 15.3	

平均保有割合 7.8%

※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UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2020年9月18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。

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	
	口数	
世界好利回りCBマザーファンド2016-09	千口 572,019	

○投資信託財産の構成

（2020年9月18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 587,612	% 100.0
投資信託財産総額	587,612	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2020年9月18日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	587,612,018
コール・ローン等	587,612,018
(B) 負債	3,342,192
未払信託報酬	3,327,953
未払利息	2,081
その他未払費用	12,158
(C) 純資産総額(A-B)	584,269,826
元本	508,047,545
償還差益金	76,222,281
(D) 受益権総口数	508,047,545口
1万口当たり償還価額(C/D)	11,500円30銭

○損益の状況（2019年9月19日～2020年9月18日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 4,309
受取利息	54
支払利息	△ 4,363
(B) 有価証券売買損益	5,603,469
売買益	6,573,932
売買損	△ 970,463
(C) 信託報酬等	△ 6,982,963
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,383,803
(E) 前期繰越損益金	78,702,930
(F) 追加信託差損益金	△ 1,096,846
(配当等相当額)	(225,300)
(売買損益相当額)	(△ 1,322,146)
償還差益金(D+E+F)	76,222,281

<注記事項>

- ①期首元本額 597,170,248円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 89,122,703円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.150030円です。

- ②「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。

- (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	2016年9月15日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2020年9月18日			資産総額	587,612,018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	3,342,192円	
				純資産総額	584,269,826円	
受益権口数	2,695,031,513口	508,047,545口	△2,186,983,968口	受益権口数	508,047,545口	
元本額	2,695,031,513円	508,047,545円	△2,186,983,968円	1万円当たり償還金	11,500円30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	1,243,759,685円	1,487,881,082円	11,963円	0円	0%	
第2期	675,679,862	802,573,330	11,878	0	0	
第3期	597,170,248	687,654,907	11,515	0	0	

○償還金のお知らせ

1万円当たり償還金（税込み）	11,500円30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。

世界好利回りCBマザーファンド2016-09

《繰上償還(第4期)》信託終了日2020年9月17日

[計算期間：2019年9月19日～2020年9月17日]

「世界好利回りCBマザーファンド2016-09」は、この度、約款の規定に基づき、9月17日に繰り上げて償還させていただきました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第4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。</p> <p>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、信用格付けが投資適格未満（BBB一格相当未満）の銘柄への投資も行います。</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 額
		期 騰 落	中 率		
(設定日)	円 銭		%	%	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
2期(2018年9月18日)	12,151		0.4	97.1	10,105
3期(2019年9月18日)	11,902		△ 2.0	91.3	8,681
(償還時)	(償還価額)				
4期(2020年9月17日)	12,020.24		1.0	—	7,761

(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	
	(期首)		円 銭		%	%
	2019年	9月18日	11,902		—	91.3
	9月末		11,921		0.2	97.6
	10月末		12,209		2.6	94.3
	11月末		12,252		2.9	98.1
	12月末		12,369		3.9	97.1
	2020年	1月末	12,296		3.3	96.4
	2月末		12,188		2.4	92.0
	3月末		11,805		△0.8	88.1
	4月末		11,662		△2.0	77.3
	5月末		11,859		△0.4	72.7
	6月末		11,973		0.6	37.6
	7月末		11,966		0.5	15.7
	8月末		12,021		1.0	—
	(償還時)		(償還価額)			
	2020年	9月17日	12,020.24		1.0	—

(注) 騰落率は期首比。

○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

償還価額は期首に比べ1.0%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

米金融当局の大規模な金融緩和策等を背景とした株式市況の上昇等を受けてグローバル転換社債(CB)市況が上昇したことや、欧州の追加金融緩和観測等を背景とした景気回復期待の高まり等を受けてユーロが対円で上昇したこと、CB利子収益を享受したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

新型コロナウイルスの世界的感染拡大等を背景に一部銘柄でデフォルト(債務不履行)が発生したことや、米国金利が低下するなか日米金利差の縮小等を背景に米ドルが対円で下落したこと等が基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について**◎グローバルCB市況**

- ・グローバルCB市況は上昇しました。
- ・新型コロナウイルスの世界的感染拡大等を受けて世界経済の停滞が懸念され、株式市況が大きく下落した局面では、グローバルCB市況も下落しました。一方、米金融当局の大規模な金融緩和策や新型コロナウイルス治療薬の開発進展観測等を背景に株式市況が世界的に上昇したことや、前述の大規模な金融緩和策等により米国の長期金利が低下し債券市況も上昇したこと等がプラス要因となり、期を通じてみると、グローバルCB市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドルは対円で下落、ユーロは対円で上昇しました。
- ・米金融当局による複数回の利下げ等を受けて米国金利が低下する中、日米金利差が縮小したこと等から米ドルは対円で下落しました。
- ・欧州金融当局による追加の金融緩和観測や欧州委員会の大規模な経済復興計画等を受けて、欧州の景気回復期待が高まったこと等から、ユーロは対円で上昇しました。

●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。
- ・保有銘柄は原則継続保有しましたが、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売却をした場合等には、信用状況や価格水準、流動性等を勘案しつつ、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。
- ・償還に向け2020年6月以降保有資産の売却を一部で開始するなど、安定運用に切り替えました。

●償還価額

償還価額は、12,020円24銭となりました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年9月19日～2020年9月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.023	(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)	(0.019)	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)	(0.004)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.023	
期中の平均基準価額は、12,027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

(2019年9月19日～2020年9月17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 国	アメリカ	千アメリカドル 32,850	千アメリカドル 32,627	千アメリカドル 39,550 (21,500)	千アメリカドル 39,123 (21,500)
	カナダ	千カナダドル 5,900	千カナダドル 5,933	千カナダドル — (5,900)	千カナダドル — (5,900)
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	7,900	7,850	6,200 (2,700)	6,170 (2,700)
	オランダ	2,800	2,773	5,700	5,692
	フィンランド	—	—	— (3,500)	— (3,500)
	ジャージー	—	—	— (1,600)	— (1,600)
	アラブ首長国連邦	—	—	6,800	6,647
	メキシコ	500	492	2,100 (3,000)	2,096 (3,000)
	中国	1,500	1,491	6,200	6,200
	イギリス	千イギリスポンド 2,100	千イギリスポンド 2,093	千イギリスポンド 500 (5,800)	千イギリスポンド 496 (5,800)
	香港	千香港ドル 14,000	千香港ドル 14,172	千香港ドル 70,000	千香港ドル 72,303
	シンガポール	千シンガポールドル 4,000	千シンガポールドル 3,976	千シンガポールドル 1,000 (9,500)	千シンガポールドル 998 (9,500)

(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。

公社債

		買 付 額		売 付 額	
外 国	アメリカ	社債券	千アメリカドル 5,869	千アメリカドル — (5,850)	
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	
	ルクセンブルク	社債券	3,532	— (3,500)	
	イギリス	社債券	6,007	— (6,000)	

(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す。

(注) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2019年9月19日～2020年9月17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	$\frac{D}{C}$ %
為替直物取引	百万円 6,756	百万円 2,158	31.9	百万円 15,385	百万円 2,359	15.3

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銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2020年9月17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。

○投資信託財産の構成

(2020年9月17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 7,761,031	% 100.0
投資信託財産総額	7,761,031	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2020年9月17日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	7,761,031,965
コール・ローン等	7,761,031,965
(B) 負債	6,266
未払利息	6,266
(C) 純資産総額(A-B)	7,761,025,699
元本	6,456,633,884
償還差益金	1,304,391,815
(D) 受益権総口数	6,456,633,884口
1万口当たり償還価額(C/D)	12,020円24銭

<注記事項>

- ①期首元本額 7,294,465,532円
 期中追加設定元本額 294,266,443円
 期中一部解約元本額 1,132,098,091円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.202024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)	5,975,442,113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)	481,191,771円
合計	6,456,633,884円

○損益の状況 (2019年9月19日～2020年9月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	79,620,949
受取利息	80,655,773
支払利息	△ 1,034,824
(B) 有価証券売買損益	17,872,841
売買益	353,329,045
売買損	△ 335,456,204
(C) 保管費用等	△ 1,906,943
(D) 当期損益金(A+B+C)	95,586,847
(E) 前期繰越損益金	1,387,373,320
(F) 追加信託差損益金	50,733,557
(G) 解約差損益金	△ 229,301,909
償還差益金(D+E+F+G)	1,304,391,815

- (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) (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) (G)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。

[お 知 ら せ]

当該投資信託を投資対象とする全ての投資信託が償還となるため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。
 (2020年9月17日)