

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	2026年9月4日まで（2016年11月16日設定）	
運用方針	新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界銀行が発行する新興国通貨建て債券に投資を行います。 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。 マザーファンドにおいて、債券等の運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーファンド	新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	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）

新興国通貨建て 世界銀行債券オープン

第18期（決算日：2021年6月7日）

第19期（決算日：2021年9月6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「新興国通貨建て世界銀行債券オープン」は、去る9月6日に第19期の決算を行いましたので、法令に基づいて第18期～第19期の運用状況をまとめて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。

○最近10期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	標準価額			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金 騰 落 中 率			
	円		円		%	%	百万円
10期(2019年6月6日)	9,139		150	△3.5	93.3	—	1,468
11期(2019年9月6日)	8,933		150	△0.6	94.0	—	1,407
12期(2019年12月6日)	9,110		150	3.7	93.2	—	1,366
13期(2020年3月6日)	8,532		150	△4.7	90.6	—	1,281
14期(2020年6月8日)	8,520		150	1.6	93.0	—	1,232
15期(2020年9月7日)	7,876		150	△5.8	92.8	—	1,114
16期(2020年12月7日)	7,940		150	2.7	92.9	—	1,108
17期(2021年3月8日)	7,871		150	1.0	91.5	—	1,085
18期(2021年6月7日)	8,037		150	4.0	94.2	—	1,083
19期(2021年9月6日)	7,948		150	0.8	91.6	—	1,067

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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、「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。

○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	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第18期	(期 首) 2021年3月8日	円 7,871		% —	% 91.5		% —
	3月末	7,906		0.4	91.0		—
	4月末	7,968		1.2	92.1		—
	5月末	8,148		3.5	92.4		—
	(期 末) 2021年6月7日	8,187		4.0	94.2		—
第19期	(期 首) 2021年6月7日	8,037		—	94.2		—
	6月末	8,066		0.4	91.6		—
	7月末	7,987		△0.6	90.4		—
	8月末	8,052		0.2	90.0		—
	(期 末) 2021年9月6日	8,098		0.8	91.6		—

(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

第18期～第19期：2021年3月9日～2021年9月6日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第18期首	7,871円
第19期末	7,948円
既払分配金	300円
騰落率	4.8%
	(分配金再投資ベース)

※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

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。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

債券の利子収入を獲得したことや、一部を除く多くの新興国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。

下落要因

一部の通貨が対円で下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。

第18期～第19期：2021年3月9日～2021年9月6日

投資環境について

▶ 債券市況

新興国債券市況を主要新興国の2年国債金利で見ると、まちまちな結果となりました。

ブラジルでは、同国中央銀行による複数回の利上げ等を背景に、金利が上昇しました。

インドネシアでは、発表された同国の経済指標が堅調だったこと等を背景に経済回復への期待が高まり、金利は低下しました。

▶ 為替市況

一部を除く多くの新興国通貨は対円で上昇しました。

資源国通貨であるロシアルーブルやメキシコペソは、原油価格の上昇等を背景に対円で上昇しました。

一方、トルコリラは同国での政治不安が嫌気されたこと等を背景に対円で下落しました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 新興国通貨建て世界銀行債券オープン

新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンドへの投資を通じて、世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。

▶ 新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド

世界銀行が発行する新興国通貨建て債券

を高位に組み入れる運用を行いました。通貨配分や銘柄選択にあたっては、利回り水準を重視しつつ、各国経済のファンダメンタルズ、通貨のバリュエーションなどを総合的に勘案して行いました。当作成期は利回り水準が高く、バリュエーション面等で魅力があると考えられるインドネシアルピア建てやメキシコペソ建て債券などの組入比率を高めとしました。

▶ 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18期 2021年3月9日～2021年6月7日	第19期 2021年6月8日～2021年9月6日
当期分配金（対基準価額比率）	150 (1.832%)	150 (1.852%)
当期の収益	126	104
当期の収益以外	23	45
翌期繰越分配対象額	690	644

(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 (作成対象期間末での見解です。)

▶ 新興国通貨建て世界銀行債券オープン

新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンドへの投資を通じて、世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を高位に組み入れ、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす運用を行います。

▶ 新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド

新型コロナウイルス感染拡大における、世界経済に与える影響については引き続き

き注意が必要なものの、ワクチン開発の進展や、世界的な中央銀行の金融緩和姿勢の継続等を背景に、今後の新興国債券市場は前向きに見ています。その中でも構造改革の進展やファンダメンタルズの改善が見込まれる国等に対して投資妙味があると考えます。

通貨配分や銘柄選択にあたっては、利回り水準を重視しつつ、各国経済のファンダメンタルズ、通貨のバリュエーション、流動性、分散効果等を総合的に勘案して行う方針です。

2021年3月9日～2021年9月6日

1万口当たりの費用明細

項目	第18期～第19期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	54	0.680	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(31)	(0.384)	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)	(22)	(0.274)	交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	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	1	0.009	(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
(保 管 費 用)	(1)	(0.007)	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)	(0.002)	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	55	0.689	

作成期中の平均基準価額は、7,992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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

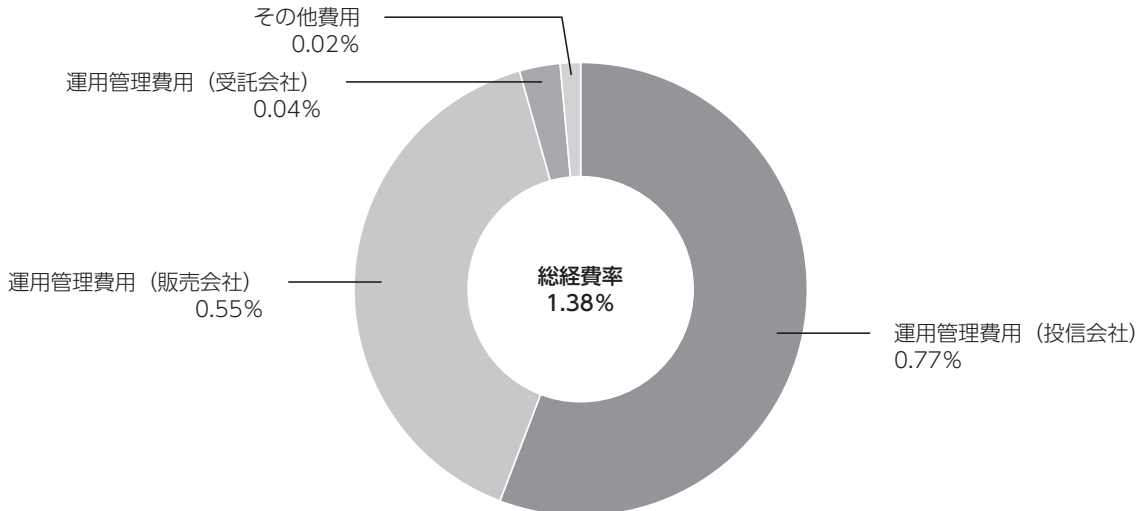
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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1.38%**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

(2021年3月9日～2021年9月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第18期～第19期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド		—	—	62,848	71,720

○利害関係人との取引状況等

(2021年3月9日～2021年9月6日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2021年9月6日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第17期末	第19期末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド		968,020	905,171	1,051,900

○投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項	目	第19期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド		1,051,900	96.3
コール・ローン等、その他		39,861	3.7
投資信託財産総額		1,091,761	100.0

(注) 新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（1,029,365千円）の投資信託財産総額（1,074,031千円）に対する比率は95.8%です。

(注) 外貨建資産は、作成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、作成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=109.83円	1 メキシコペソ=5.5136円	1 ブラジルレアル=21.1511円	1 トルコリラ=13.2204円
1 ロシアルーブル=1.51円	100 インドネシアルピア=0.77円	1 インドルピー=1.51円	1 南アフリカランド=7.67円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第18期末	第19期末
	2021年6月7日現在	2021年9月6日現在
	円	円
(A) 資産	1,107,222,855	1,091,761,800
コール・ローン等	27,039,004	17,741,451
新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド(評価額)	1,080,183,851	1,051,900,349
未収入金	—	22,120,000
(B) 負債	23,936,467	23,831,456
未払収益分配金	20,217,305	20,153,985
未払解約金	837	1,000
未払信託報酬	3,706,678	3,664,968
未払利息	19	6
その他未払費用	11,628	11,497
(C) 純資産総額(A-B)	1,083,286,388	1,067,930,344
元本	1,347,820,373	1,343,599,034
次期繰越損益金	△ 264,533,985	△ 275,668,690
(D) 受益権総口数	1,347,820,373口	1,343,599,034口
1万口当たり基準価額(C/D)	8.037円	7.948円

○損益の状況

項 目	第18期	第19期
	2021年3月9日～ 2021年6月7日	2021年6月8日～ 2021年9月6日
	円	円
(A) 配当等収益	△ 425	△ 1,079
受取利息	—	27
支払利息	△ 425	△ 1,106
(B) 有価証券売買損益	46,283,435	11,868,707
売買益	46,485,716	11,925,426
売買損	△ 202,281	△ 56,719
(C) 信託報酬等	△ 3,718,306	△ 3,676,465
(D) 当期損益金(A+B+C)	42,564,704	8,191,163
(E) 前期繰越損益金	△294,672,516	△270,438,887
(F) 追加信託差損益金	7,791,132	6,733,019
(配当等相当額)	(69,608,987)	(69,498,171)
(売買損益相当額)	(△ 61,817,855)	(△ 62,765,152)
(G) 計(D+E+F)	△244,316,680	△255,514,705
(H) 収益分配金	△ 20,217,305	△ 20,153,985
次期繰越損益金(G+H)	△264,533,985	△275,668,690
追加信託差損益金	7,791,132	6,733,019
(配当等相当額)	(69,627,361)	(69,515,530)
(売買損益相当額)	(△ 61,836,229)	(△ 62,782,511)
分配準備積立金	23,430,758	17,145,118
繰越損益金	△295,755,875	△299,546,827

(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 1,379,572,010円

 作成期中追加設定元本額 10,442,810円

 作成期中一部解約元本額 46,415,786円

また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7948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275,668,690円です。

③分配金の計算過程

項 目	2021年3月9日～ 2021年6月7日	2021年6月8日～ 2021年9月6日
費用控除後の配当等収益額	17,068,923円	14,030,636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
収益調整金額	69,627,361円	69,515,530円
分配準備積立金額	26,579,140円	23,268,467円
当ファンドの分配対象収益額	113,275,424円	106,814,633円
1万口当たり収益分配対象額	840円	794円
1万口当たり分配金額	150円	150円
収益分配金金額	20,217,305円	20,153,985円

④「新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド」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35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。

○分配金のお知らせ

	第18期	第19期
1 万口当たり分配金（税込み）	150円	150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。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※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。

※NISAおよびジュニアNISA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。

*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 (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド

《第10期》決算日2021年9月6日

[計算期間：2021年3月9日～2021年9月6日]

「新興国通貨建て世界銀行債券マザーファンド」は、9月6日に第10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10期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主として世界銀行が発行する新興国通貨建て債券に投資を行います。 債券等への投資にあたっては、利回り水準を重視しつつ、各国経済のファンダメンタルズ、通貨のバリュエーション、流動性、分散効果等を総合的に勘案して選定を行います。 投資する債券の残存期間は3年未満とします。 債券等の運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用指図に関する権限を委託します。 債券等の組入比率は高位を維持することを基本とします。 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。
主 要 運 用 対 象	世界銀行が発行する新興国通貨建て債券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。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 総 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
6期(2019年9月6日)	10,976	△3.5		94.5	—	1,399
7期(2020年3月6日)	10,912	△0.6		91.3	—	1,272
8期(2020年9月7日)	10,524	△3.6		93.6	—	1,103
9期(2021年3月8日)	11,005	4.6		93.3	—	1,065
10期(2021年9月6日)	11,621	5.6		93.0	—	1,051

(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) 「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		債組入比率	債券優先物比率	債券率
			円	騰落率			
	(期首)						
	2021年	3月	11,005	—	93.3		—
		3月末	11,064	0.5	92.8		—
		4月末	11,165	1.5	93.5		—
		5月末	11,434	3.9	93.5		—
		6月末	11,544	4.9	92.6		—
		7月末	11,442	4.0	91.7		—
		8月末	11,551	5.0	91.2		—
	(期末)						
	2021年	9月	11,621	5.6	93.0		—

(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5.6%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の変化要因

(上昇要因)

債券の利子収入を獲得したことや、一部を除く多くの新興国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。

(下落要因)

一部の通貨が対円で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

◎債券市況

- ・新興国債券市況を主要新興国の2年国債金利で見ると、まちまちな結果となりました。
- ・ブラジルでは、同国中央銀行による複数回の利上げ等を背景に、金利が上昇しました。
- ・インドネシアでは、発表された同国の経済指標が堅調だったこと等を背景に経済回復への期待が高まり、金利は低下しました。

◎為替市況

- ・一部を除く多くの新興国通貨は対円で上昇しました。
- ・資源国通貨であるロシアルーブルやメキシコペ

ソは、原油価格の上昇等を背景に対円で上昇しました。

- ・一方、トルコリラは同国での政治不安が嫌気されたこと等を背景に対円で下落しました。
- 当該投資信託のポートフォリオについて
- ・世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・通貨配分や銘柄選択にあたっては、利回り水準を重視しつつ、各国経済のファンダメンタルズ、通貨のバリュエーションなどを総合的に勘案して行いました。
- ・当期は利回り水準が高く、バリュエーション面等で魅力があると考え、インドネシアルピア建てやメキシコペソ建て債券などの組入比率を高めとしました。

○今後の運用方針

- ・新型コロナウイルス感染拡大における、世界経済に与える影響については引き続き注意が必要なものの、ワクチン開発の進展や、世界的な中央銀行の金融緩和姿勢の継続等を背景に、今後の新興国債券市場は前向きに見ています。その中でも構造改革の進展やファンダメンタルズの改善が見込まれる国等に対して投資妙味があると考えます。
- ・通貨配分や銘柄選択にあたっては、利回り水準を重視しつつ、各国経済のファンダメンタルズ、通貨のバリュエーション、流動性、分散効果等を総合的に勘案して行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2021年3月9日～2021年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	円 1 (1)	% 0.007 (0.007)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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
合 計	1	0.007	
期中の平均基準価額は、11,326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

(2021年3月9日～2021年9月6日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	メキシコ	特殊債券	千メキシコペソ 37,477	千メキシコペソ 24,912 (13,200)
	ブラジル	特殊債券	千ブラジルレアル 4,884	千ブラジルレアル 2,400 (3,950)
	インド	特殊債券	千インドルピー 120,946	千インドルピー 66,679 (54,550)

(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

(2021年3月9日～2021年9月6日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2021年9月6日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
メキシコ	千メキシコペソ 36,600	千メキシコペソ 37,381	千円 206,106	% 19.6	% —	% —	% —	% 19.6
ブラジル	千ブラジルリアル 5,000	千ブラジルリアル 5,012	106,029	10.1	—	—	—	10.1
トルコ	千トルコリラ 5,950	千トルコリラ 5,591	73,916	7.0	—	—	—	7.0
ロシア	千ロシアルーブル 116,100	千ロシアルーブル 116,564	176,012	16.7	—	—	—	16.7
インドネシア	千インドネシアルピア 24,600,000	千インドネシアルピア 24,726,690	190,395	18.1	—	—	—	18.1
インド	千インドルピー 120,800	千インドルピー 120,764	182,354	17.3	—	—	—	17.3
南アフリカ	千南アフリカランド 5,500	千南アフリカランド 5,685	43,608	4.1	—	—	—	4.1
合 計	—	—	978,422	93.0	—	—	—	93.0

(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) 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。

(B) 外国(外貨建)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
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ	特殊債券	7 IBRD 230124	7.0	千メキシコペソ 36,600	千メキシコペソ 37,381	千円 206,106	2023/1/24
小	計					206,106	
ブラジル	特殊債券	8 IBRD 220131	8.0	千ブラジルレアル 2,600	千ブラジルレアル 2,613	千円 55,276	2022/1/31
		8.25 IBRD 230622	8.25	2,400	2,399	50,752	2023/6/22
小	計					106,029	
トルコ	特殊債券	11 IBRD 220825	11.0	千トルコリラ 5,950	千トルコリラ 5,591	千円 73,916	2022/8/25
小	計					73,916	
ロシア	特殊債券	6.75 IBRD 221114	6.75	千ロシアルーブル 116,100	千ロシアルーブル 116,564	千円 176,012	2022/11/14
小	計					176,012	
インドネシア	特殊債券	8.4 IBRD 211012	8.4	千インドネシアルピア 24,600,000	千インドネシアルピア 24,726,690	千円 190,395	2021/10/12
小	計					190,395	
インド	特殊債券	5.02 IBRD 220707	5.02	千インドルピー 120,800	千インドルピー 120,764	千円 182,354	2022/7/7
小	計					182,354	
南アフリカ	特殊債券	7.5 IBRD 230517	7.5	千南アフリカランド 5,500	千南アフリカランド 5,685	千円 43,608	2023/5/17
小	計					43,608	
合	計					978,422	

(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。

○投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 978,422	% 91.1
コール・ローン等、その他	95,609	8.9
投資信託財産総額	1,074,031	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (1,029,365千円) の投資信託財産総額 (1,074,031千円) に対する比率は95.8%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=109.83円	1 メキシコペソ=5.5136円	1 ブラジルレアル=21.1511円	1 トルコリラ=13.2204円
1 ロシアルーブル=1.51円	100インドネシアルピア=0.77円	1 インドルピー=1.51円	1 南アフリカランド=7.67円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,074,031,154
コール・ローン等	56,676,843
公社債(評価額)	978,422,995
未収利息	31,208,730
前払費用	7,722,586
(B) 負債	22,120,016
未払解約金	22,120,000
未払利息	16
(C) 純資産総額(A-B)	1,051,911,138
元本	905,171,973
次期繰越損益金	146,739,165
(D) 受益権総口数	905,171,973口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,621円

<注記事項>

- ①期首元本額 968,020,249円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 62,848,276円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,621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)
 新興国通貨建て世界銀行債券オープン 905,171,973円

○損益の状況 (2021年3月9日～2021年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	36,767,818
受取利息	36,769,345
支払利息	△ 1,527
(B) 有価証券売買損益	21,621,318
売買益	51,971,130
売買損	△ 30,349,812
(C) 保管費用等	△ 70,804
(D) 当期損益金(A+B+C)	58,318,332
(E) 前期繰越損益金	97,292,557
(F) 解約差損益金	△ 8,871,724
(G) 計(D+E+F)	146,739,165
次期繰越損益金(G)	146,739,165

- (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)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。