

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／インデックス型	
信託期間	無期限（2021年4月16日設定）	
運用方針	新興国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として新興国の現地通貨建ての公社債に投資を行います。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。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。	
主要運用対象	ベビーフンド	新興国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、新興国の現地通貨建ての公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	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。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;">           分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）         </div>	

※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）

# ラップ向けインデックス f 新興国債券

第1期（決算日：2022年3月25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「ラップ向けインデックス f 新興国債券」は、去る3月25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  
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）

お客さまのお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	基準価額			J Pモルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	円			%		%	百万円
2021年4月16日	10,000	—			—	33,348.63	—	1
1期(2022年3月25日)	9,883	0		△1.2		33,191.09	△0.5	2,306

- (注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注) J Pモルガン G B I - E Mグローバル・ダイバーシファイドとは、J. P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ. P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。J Pモルガン G B I - E Mグローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース) とは、J. P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している J Pモルガン G B I - E Mグローバル・ダイバーシファイド (ドルベース) をもとに、委託会社が計算したものです。
- (注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
- (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		J Pモルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落	率	(円換算ベース)	騰 落		
(設定日)	円	%			%	%
2021年4月16日	10,000	—	33,348.63		—	—
4月末	10,097	1.0	33,694.42		1.0	97.2
5月末	10,331	3.3	34,537.40		3.6	97.1
6月末	10,325	3.3	34,491.41		3.4	96.6
7月末	10,177	1.8	34,039.21		2.1	97.2
8月末	10,214	2.1	34,154.94		2.4	96.9
9月末	10,092	0.9	33,770.38		1.3	96.6
10月末	10,150	1.5	34,001.56		2.0	96.3
11月末	9,808	△1.9	32,777.10		△1.7	96.3
12月末	10,081	0.8	33,749.85		1.2	96.4
2022年1月末	10,066	0.7	33,673.33		1.0	96.8
2月末	9,973	△0.3	33,817.05		1.4	97.2
(期 末)						
2022年3月25日	9,883	△1.2	33,191.09		△0.5	97.2

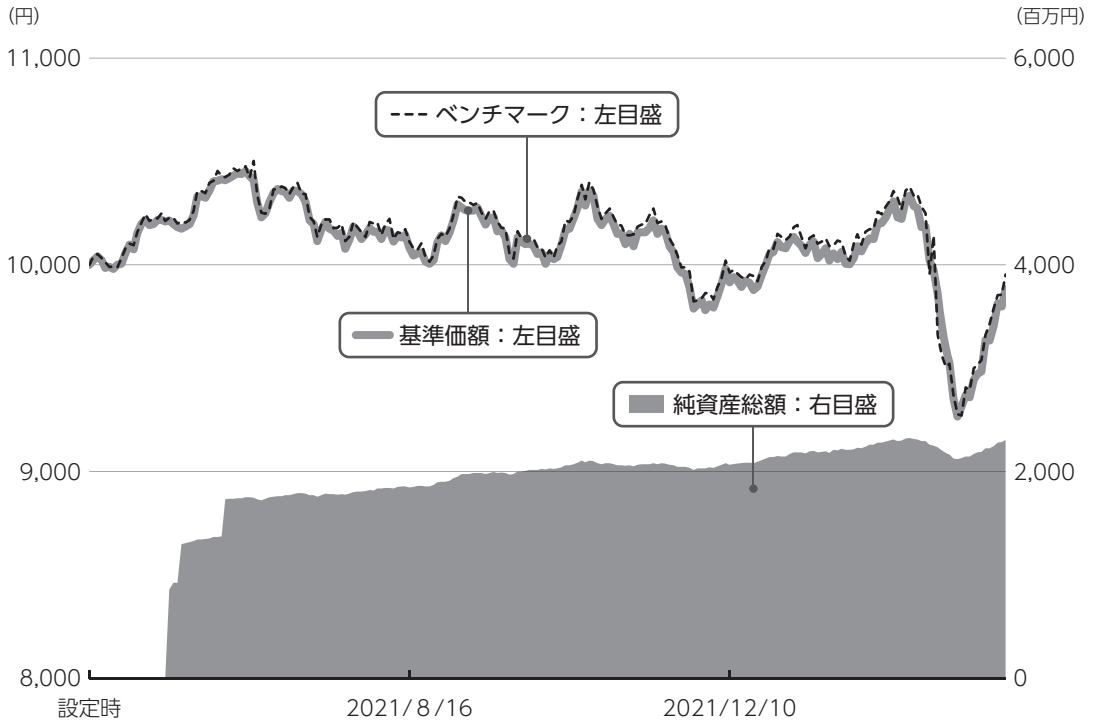
- (注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注) 騰落率は設定日比。
- (注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
- (注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

# 運用経過

第1期：2021年4月16日～2022年3月25日

## ▶ 当期中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1期末	9,883円
既払分配金	0円
騰落率	-1.2%

※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

基準価額は設定時に比べ1.2%の下落となりました。

### ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.5%）を0.7%下回りました。

## 基準価額の主な変動要因

### 下落要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第1期：2021年4月16日～2022年3月25日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**新興国の現地通貨建て債券市況は下落しました。**

新興国の現地通貨建て債券市況は、利金が相応に積みあがったことなどから上昇する局面もありましたが、期末にかけ、ロシアのウクライナ侵攻及び各国の経済制裁によりロシア国債が下落したことな

どを受け、設定時との比較では下落しました。

### ▶ 為替市況

設定時に比べてトルコリラやロシアルーブルなど一部を除き、大半の新興国通貨が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

### ▶ ラップ向けインデックス f 新興国債券

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

### ▶ 新興国債券インデックスマザーファンド

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークである J P モ

ルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ **ラップ向けインデックス f 新興国債券**  
 ベンチマークとの乖離は△0.7%程度となりました。

**マザーファンド保有以外の要因**

ファンドの管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。

**マザーファンド保有による要因**

マザーファンド保有による影響は△0.5%程度でした。

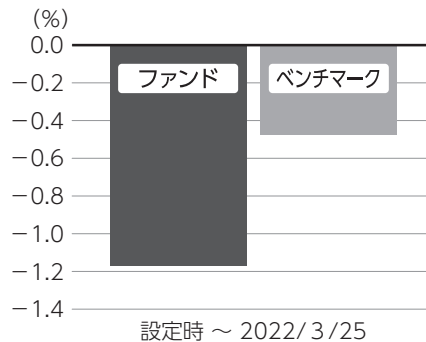
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**評価時価差異要因\*によるものです。

\*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

**主なマイナス要因：**ポートフォリオ要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）と  
 ベンチマークの対比（騰落率）



## 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 2021年4月16日～2022年3月25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	407

(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。）

▶ **ラップ向けインデックス f 新興国債券マザーファンド**の組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **新興国債券インデックスマザーファンド**  
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2021年4月16日～2022年3月25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	18	0.176	(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 )	(15)	(0.145)	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 )	( 1)	(0.010)	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 )	( 2)	(0.021)	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	10	0.100	(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 )	( 7)	(0.074)	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 )	( 2)	(0.022)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	28	0.276	

期中の平均基準価額は、10,098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。

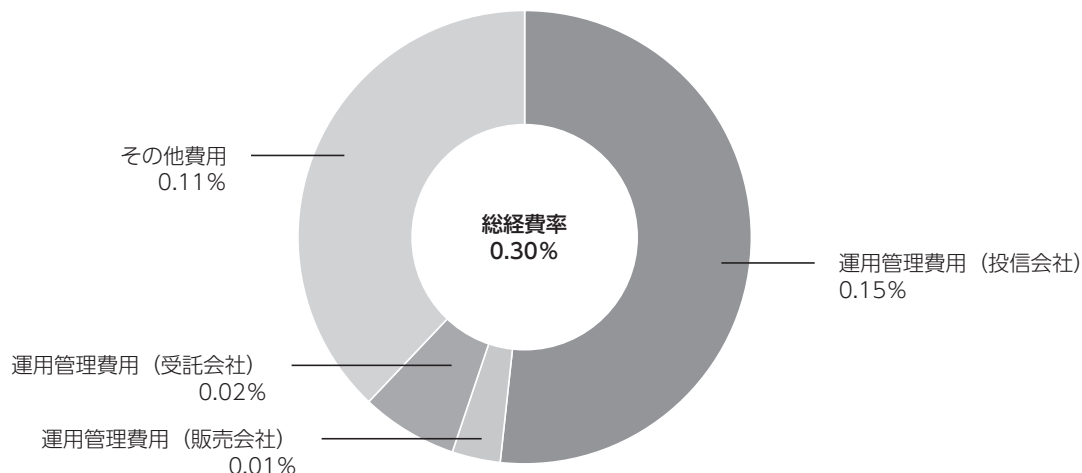
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## (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0.30%**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4月16日～2022年3月25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
新興国債券インデックスマザーファンド	千口 1,678,527	千円 2,397,067	千口 15,089	千円 21,352

○利害関係人との取引状況等

(2021年4月16日～2022年3月25日)

利害関係人との取引状況

<ラップ向けインデックス f 新興国債券>

該当事項はございません。

<新興国債券インデックスマザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	23,407	8,310	35.5	10,702	3,320	31.0

平均保有割合 3.8%

※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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年4月16日～2022年3月25日)

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 1	百万円 —	当初設定時における取得とその処分

○組入資産の明細

(2022年3月25日現在)

親投資信託残高

銘柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
新興国債券インデックスマザーファンド	千口 1,663,437	千円 2,305,856

○投資信託財産の構成

(2022年3月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新興国債券インデックスマザーファンド	千円 2,305,856	% 99.8
コール・ローン等、その他	4,658	0.2
投資信託財産総額	2,310,514	100.0

(注) 新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (53,224,963千円) の投資信託財産総額 (53,469,245千円) に対する比率は99.5%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=122.07円	1 アルゼンチンペソ=1.1078円	1 メキシコペソ=6.0785円	1 ブラジルリアル=25.2854円
100チリペソ=15.481円	100コロンビアペソ=3.2208円	1 ペルーヌエボソル=32.6888円	1 ウルグアイペソ=2.921円
1 ドミニカペソ=2.2217円	1セルビアディナール=1.141067円	1 トルコリラ=8.2325円	1 チェココロナ=5.4354円
100ハンガリーフォリント=35.8061円	1 ポーランドズロチ=28.1482円	1 ロシアルーブル=1.20円	1 ルーマニアレイ=27.1613円
1 マレーシアリングギット=28.9052円	1 タイバーツ=3.64円	1 フィリピンペソ=2.3329円	100インドネシアルピア=0.85円
1 中国元=19.1721円	1 エジプトポンド=6.6651円	1 南アフリカランド=8.41円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,310,514,844
コール・ローン等	4,658,027
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,305,856,817
(B) 負債	4,435,225
未払解約金	2,622,491
未払信託報酬	1,775,196
その他未払費用	37,538
(C) 純資産総額(A-B)	2,306,079,619
元本	2,333,408,205
次期繰越損益金	△ 27,328,586
(D) 受益権総口数	2,333,408,205口
1万口当たり基準価額(C/D)	9.883円

<注記事項>

- ①設定元本額 1,000,000円  
 期中追加設定元本額 2,544,438,757円  
 期中一部解約元本額 212,030,552円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9883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27,328,586円です。

③分配金の計算過程

項 目	2021年4月16日～ 2022年3月25日
費用控除後の配当等収益額	88,783,511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
収益調整金額	6,267,446円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	95,050,957円
1万口当たり収益分配対象額	407円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

\*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。

[お知らせ]

対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年9月30日)

○損益の状況 (2021年4月16日～2022年3月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 471
受取利息	12
支払利息	△ 483
(B) 有価証券売買損益	△ 66,916,328
売買益	3,136,852
売買損	△ 70,053,180
(C) 信託報酬等	△ 3,204,403
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 70,121,202
(E) 追加信託差損益金	42,792,616
(配当等相当額)	(△ 94)
(売買損益相当額)	( 42,792,710)
(F) 計(D+E)	△ 27,328,586
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 27,328,586
追加信託差損益金	42,792,616
(配当等相当額)	( 6,267,446)
(売買損益相当額)	( 36,525,170)
分配準備積立金	88,783,511
繰越損益金	△158,904,713

- (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。

# 新興国債券インデックスマザーファンド

## 《第12期》決算日2022年1月26日

[計算期間：2021年1月27日～2022年1月26日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第12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12期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックス（JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建の公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用して公社債の投資比率が100%を超える場合があります。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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。
主要運用対象	新興国の現地通貨建での公社債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		JPモルガンGBI-EM グローバル・ダイバーシファイド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
8期(2018年1月26日)	14,464	14.4%	34,033.56	15.6%	96.7%	—	百万円 16,676
9期(2019年1月28日)	13,254	△ 8.4	31,268.09	△ 8.1	96.7%	—	20,421
10期(2020年1月27日)	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4%	—	30,520
11期(2021年1月26日)	13,819	△ 4.2	32,923.96	△ 3.7	97.6%	—	37,779
12期(2022年1月26日)	14,025	1.5	33,419.11	1.5	97.5%	—	51,888

(注) JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建でのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建でのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(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		J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 1 月 26 日	円	%		%	%	%
	13,819	—	32,923.96	—	97.6	—
1 月 末	13,922	0.7	33,168.88	0.7	97.3	—
2 月 末	13,909	0.7	33,279.87	1.1	97.7	—
3 月 末	13,862	0.3	33,051.70	0.4	96.3	—
4 月 末	14,137	2.3	33,694.42	2.3	97.2	—
5 月 末	14,467	4.7	34,537.40	4.9	97.1	—
6 月 末	14,461	4.6	34,491.41	4.8	96.6	—
7 月 末	14,256	3.2	34,039.21	3.4	97.2	—
8 月 末	14,311	3.6	34,154.94	3.7	96.9	—
9 月 末	14,142	2.3	33,770.38	2.6	96.6	—
10 月 末	14,226	2.9	34,001.56	3.3	96.3	—
11 月 末	13,749	△0.5	32,777.10	△0.4	96.3	—
12 月 末	14,133	2.3	33,749.85	2.5	96.4	—
(期 末) 2022年 1 月 26 日	14,025	1.5	33,419.11	1.5	97.5	—

(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

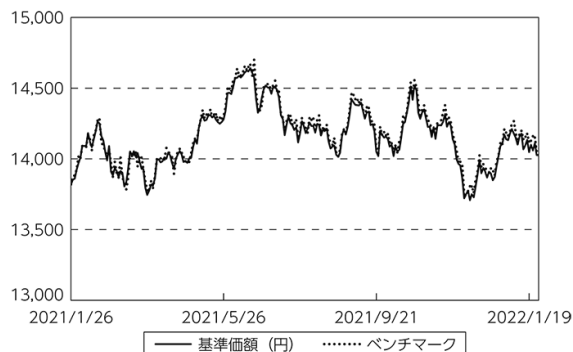
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.5%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(1.5%)と同程度となりました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

**● 基準価額の主な変動要因**

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

**● 投資環境について****◎ 債券市況**

新興国の現地通貨建て債券市況は下落しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、新型コロナウイルスの感染再拡大によるリスク回避的な動きが高まったことに加え、インフレ懸念や利上げによる金利上昇などを受け期首との比較では下落しました。

**◎ 為替市況**

期首に比べてトルコリラなど一部を除き、大半の新興国通貨が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**

- ・ 新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

**● 当該投資信託のベンチマークとの差異について**

ベンチマークは1.5%の上昇になったため、乖離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因<sup>※</sup>によるものです。

<sup>※</sup>ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ 取引要因によるものです。

**○ 今後の運用方針**

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月27日～2022年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 13	% 0.092	(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 ）	(11)	(0.075)	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 ）	( 2 )	(0.017)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	13	0.092	
期中の平均基準価額は、14,157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。





## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月27日～2022年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

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 22,403	百万円 8,639	% 38.6	百万円 8,800	百万円 3,004	% 34.1

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

(2022年1月26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 859,200	千メキシコペソ 867,717	千円 4,791,620	% 9.2	% —	% 5.2	% 3.0	% 1.1
ブラジル	千ブラジルレアル 240,320	千ブラジルレアル 210,620	4,405,645	8.5	8.5	0.9	2.9	4.7
チリ	千チリペソ 7,820,000	千チリペソ 7,508,057	1,068,223	2.1	—	1.2	0.7	0.1
コロンビア	千コロンビアペソ 78,470,000	千コロンビアペソ 70,920,718	2,034,573	3.9	—	2.7	1.2	0.1
ペルー	千ペルーヌエボソル 37,100	千ペルーヌエボソル 37,605	1,112,641	2.1	—	1.8	0.4	—
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 24,000	千ウルグアイペソ 23,500	60,176	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ	千ドミニカペソ 24,000	千ドミニカペソ 25,863	50,883	0.1	0.1	—	0.1	0.0
セルビア	千セルビアディナール 128,000	千セルビアディナール 136,883	149,775	0.3	0.3	0.2	0.1	—
トルコ	千トルコリラ 85,100	千トルコリラ 65,452	552,645	1.1	1.1	0.3	0.5	0.3
チェコ	千チェココルナ 530,700	千チェココルナ 453,194	2,382,306	4.6	—	3.4	0.5	0.7
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 5,366,000	千ハンガリーフォリント 4,924,331	1,765,697	3.4	—	1.5	1.7	0.3
ポーランド	千ポーランドズロチ 136,850	千ポーランドズロチ 129,226	3,629,560	7.0	—	2.3	3.4	1.2
ロシア	千ロシアルーブル 2,527,900	千ロシアルーブル 2,242,692	3,251,904	6.3	—	3.5	2.2	0.5
ルーマニア	千ルーマニアレイ 58,660	千ルーマニアレイ 57,798	1,503,724	2.9	—	0.9	1.5	0.4
マレーシア	千マレーシアリンギット 159,090	千マレーシアリンギット 161,021	4,373,834	8.4	—	4.8	2.9	0.7
タイ	千タイバーツ 1,313,100	千タイバーツ 1,362,724	4,701,398	9.1	—	5.1	2.8	1.1
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 22,270	49,456	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 590,780,000	千インドネシアルピア 634,235,069	5,073,880	9.8	—	6.8	2.6	0.3

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
中国	千中国元 280,200	千中国元 287,235	千円 5,168,196	% 10.0	% —	% 5.0	% 4.1	% 0.9
南アフリカ	千南アフリカランド 668,300	千南アフリカランド 599,232	4,476,263	8.6	8.6	6.9	1.6	0.1
合 計	—	—	50,602,408	97.5	18.6	52.7	32.1	12.7

(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	銘柄	利率	当期末			償還年月日
			額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券					
		10.0	68,700	73,308	404,814	2024/12/5
		10.0	17,700	21,129	116,678	2036/11/20
		5.5	5,700	5,221	28,831	2027/3/4
		5.75	119,200	112,102	619,042	2026/3/5
		6.75	230,309	36,963	204,117	2023/3/9
		7.5	270,603	97,315	537,386	2027/6/3
		7.75	310,529	83,971	463,698	2031/5/29
		7.75	341,123	24,968	137,877	2034/11/23
		7.75	421,113	49,351	272,521	2042/11/13
		8.0	231,207	64,082	353,868	2023/12/7
		8.0	240,905	93,379	515,648	2024/9/5
		8.0	471,107	62,974	347,750	2047/11/7
		8.5	290,531	78,142	431,508	2029/5/31
		8.5	381,118	64,808	357,876	2038/11/18
小計					4,791,620	
ブラジル			千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
	国債証券					
		10.0	28,270	27,303	571,124	2027/1/1
		10.0	24,950	24,417	510,747	2025/1/1
		10.0	8,300	7,724	161,566	2031/1/1
		10.0	16,000	15,099	315,836	2029/1/1
		10.0	15,400	15,241	318,807	2023/1/1
		—	53,900	45,966	961,504	2023/7/1
		—	68,300	55,409	1,159,025	2024/1/1
		—	25,200	19,458	407,032	2024/7/1
小計					4,405,645	
チリ			千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券					
		2.3	280,000	229,866	32,704	2028/10/1
		2.5	1,640,000	1,506,750	214,375	2025/3/1
		4.0	490,000	488,456	69,496	2023/3/1
		4.5	1,200,000	1,171,260	166,643	2026/3/1
		4.7	1,280,000	1,225,664	174,383	2030/9/1
		5.0	660,000	645,353	91,818	2028/10/1
		5.0	1,290,000	1,235,276	175,751	2035/3/1
		6.0	980,000	1,005,431	143,049	2043/1/1
小計					1,068,223	
コロンビア			千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券					
		10.0	7,700,000	8,159,329	234,074	2024/7/24
		4.375	1,680,000	1,666,224	47,800	2023/3/21
		5.75	4,900,000	4,296,398	123,255	2027/11/3
		6.0	10,580,000	9,248,121	265,310	2028/4/28
		6.25	5,690,000	5,372,736	154,133	2025/11/26
		6.25	4,100,000	3,125,293	89,658	2036/7/9
		7.0	4,600,000	4,057,154	116,391	2031/3/26
		7.0	8,800,000	7,609,368	218,297	2032/6/30

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
コロンビア		%	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	千円		
	国債証券	7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	8,200,000	7,022,096	201,449	2034/10/18
		7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	5,800,000	4,526,874	129,866	2050/10/26
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	7,770,000	7,544,092	216,424	2026/8/26
		7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	7,360,000	6,870,429	197,098	2030/9/18
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,422,599	40,811	2027/6/28
小	計					2,034,573	
ペルー				千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
	国債証券	5.35 PERU 400812	5.35	2,600	2,187	64,732	2040/8/12
		5.4 PERU 340812	5.4	3,600	3,253	96,269	2034/8/12
		5.7 PERU 240812	5.7	1,300	1,341	39,680	2024/8/12
		5.94 PERU 290212	5.94	4,700	4,774	141,250	2029/2/12
		6.15 PERU 320812	6.15	5,500	5,468	161,790	2032/8/12
		6.35 PERU 280812	6.35	4,900	5,119	151,464	2028/8/12
		6.9 PERU 370812	6.9	4,700	4,733	140,043	2037/8/12
		6.95 PERU 310812	6.95	5,300	5,631	166,632	2031/8/12
		8.2 PERU 260812	8.2	4,500	5,096	150,776	2026/8/12
小	計					1,112,641	
ウルグアイ				千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
	国債証券	8.25 URUGUAY 310521	8.25	17,000	16,547	42,372	2031/5/21
		8.5 URUGUAY (GL) 280315	8.5	7,000	6,953	17,804	2028/3/15
小	計					60,176	
ドミニカ				千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8.9	8,000	8,247	16,226	2023/2/15
		9.75 DOMINICAN 260605	9.75	16,000	17,616	34,657	2026/6/5
小	計					50,883	
セルビア				千セルビアディナール	千セルビアディナール		
	国債証券	4.5 SERBIA TREASU 260111	4.5	46,000	48,350	52,904	2026/1/11
		4.5 SERBIA TREASU 320820	4.5	47,000	49,292	53,935	2032/8/20
		5.875 SERBIA TREA 280208	5.875	35,000	39,239	42,935	2028/2/8
小	計					149,775	
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	2,400	1,960	16,556	2024/3/20
		10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	5,200	3,369	28,451	2027/8/11
		10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	9,600	6,979	58,928	2026/2/11
		10.7 TURKEY GOVT 220817	10.7	6,900	6,672	56,337	2022/8/17
		11 TURKEY GOVT 270224	11.0	4,500	3,032	25,605	2027/2/24
		11.7 TURKEY GOVT 301113	11.7	11,800	7,351	62,071	2030/11/13
		12.2 TURKEY GOVT 230118	12.2	5,600	5,294	44,706	2023/1/18
		12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	4,100	2,837	23,955	2028/3/8
		12.6 TURKEY GOVT 251001	12.6	8,600	6,794	57,365	2025/10/1
		16.2 TURKEY GOVT 230614	16.2	1,300	1,229	10,378	2023/6/14
		7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	3,400	2,988	25,234	2023/3/8
		8 TURKEY GOVT 250312	8.0	7,300	5,212	44,009	2025/3/12
		8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	3,400	3,216	27,157	2022/9/14

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
トルコ		%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円		
	国債証券 9 TURKEY GOVT 240724	9.0	11,000	8,514	71,887	2024/7/24	
小	計				552,645		
チェコ			千チェココロナ	千チェココロナ			
	国債証券 0.05 CZECH REPUB 291129	0.05	151,000	118,654	623,731	2029/11/29	
	0.25 CZECH REPUB 270210	0.25	147,500	127,061	667,922	2027/2/10	
	0.45 CZECH REPUB 231025	0.45	76,500	72,051	378,753	2023/10/25	
	1.5 CZECH REPUB 400424	1.5	15,500	11,721	61,614	2040/4/24	
	1.75 CZECH REPUB 320623	1.75	89,200	77,657	408,224	2032/6/23	
	CZECH REPUBLIC 241212	—	51,000	46,047	242,059	2024/12/12	
小	計				2,382,306		
ハンガリー			千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント			
	国債証券 1.5 HUNGARY 230823	1.5	50,000	48,345	17,334	2023/8/23	
	1.5 HUNGARY 260422	1.5	810,000	716,904	257,057	2026/4/22	
	1.5 HUNGARY 260826	1.5	160,000	140,221	50,278	2026/8/26	
	2.25 HUNGARY 330420	2.25	330,000	259,909	93,194	2033/4/20	
	2.5 HUNGARY 241024	2.5	390,000	373,049	133,763	2024/10/24	
	2.75 HUNGARY 261222	2.75	373,000	344,399	123,489	2026/12/22	
	3 HUNGARY 240626	3.0	359,000	349,648	125,371	2024/6/26	
	3 HUNGARY 271027	3.0	421,000	387,719	139,023	2027/10/27	
	3 HUNGARY 300821	3.0	498,000	438,990	157,406	2030/8/21	
	3 HUNGARY 381027	3.0	250,000	197,387	70,776	2038/10/27	
	3 HUNGARY 410425	3.0	130,000	98,202	35,211	2041/4/25	
	3.25 HUNGARY 311022	3.25	618,000	544,631	195,286	2031/10/22	
	5.5 HUNGARY 250624	5.5	492,000	508,088	182,183	2025/6/24	
	6 HUNGARY 231124	6.0	303,000	313,514	112,415	2023/11/24	
	6.75 HUNGARY 281022	6.75	182,000	203,321	72,904	2028/10/22	
小	計				1,765,697		
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
	国債証券 0.25 POLAND 261025	0.25	10,600	8,975	252,079	2026/10/25	
	0.75 POLAND 250425	0.75	8,500	7,805	219,244	2025/4/25	
	1.25 POLAND 301025	1.25	8,500	6,895	193,680	2030/10/25	
	2.25 POLAND 241025	2.25	11,000	10,712	300,891	2024/10/25	
	2.5 POLAND 230125	2.5	9,100	9,058	254,438	2023/1/25	
	2.5 POLAND 240425	2.5	10,100	9,955	279,620	2024/4/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	14,500	13,792	387,384	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	10,900	10,158	285,312	2027/7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	11,250	10,592	297,507	2028/4/25	
	2.75 POLAND 291025	2.75	16,700	15,474	434,621	2029/10/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	12,500	12,382	347,784	2025/7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	10,000	10,146	284,982	2023/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	3,200	3,276	92,012	2022/9/23	
小	計				3,629,560		
ロシア			千ロシアルーブル	千ロシアルーブル			
	国債証券 4.5 RUSSIA OFZ 250716	4.5	135,800	115,463	167,422	2025/7/16	
	5.7 RUSSIA OFZ 280517	5.7	167,000	136,146	197,412	2028/5/17	

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		債還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
ロシア		%	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル	千円		
国債証券	6 RUSSIA OFZ 271006	6.0	126,900	106,465	154,374	2027/10/6	
	6.1 RUSSIA OFZ 350718	6.1	132,000	99,133	143,743	2035/7/18	
	6.5 RUSSIA OFZ 240228	6.5	120,000	112,837	163,614	2024/2/28	
	6.9 RUSSIA OFZ 290523	6.9	118,200	101,415	147,052	2029/5/23	
	6.9 RUSSIA OFZ 310723	6.9	130,000	108,680	157,586	2031/7/23	
	7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	44,500	43,328	62,826	2023/1/25	
	7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	62,000	59,583	86,395	2023/8/16	
	7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	125,700	110,617	160,395	2028/1/19	
	7.1 RUSSIA OFZ 241016	7.1	121,400	114,145	165,510	2024/10/16	
	7.15 RUSSIA OFZ 251112	7.15	142,500	131,292	190,373	2025/11/12	
	7.25 RUSSIA OFZ 340510	7.25	123,300	103,147	149,564	2034/5/10	
	7.4 RUSSIA OFZ 221207	7.4	86,700	85,038	123,306	2022/12/7	
	7.4 RUSSIA OFZ 240717	7.4	118,000	112,247	162,758	2024/7/17	
	7.65 RUSSIA OFZ 300410	7.65	144,000	128,319	186,063	2030/4/10	
	7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	103,700	90,976	131,915	2033/3/23	
	7.7 RUSSIA OFZ 390316	7.7	100,800	86,081	124,817	2039/3/16	
	7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	125,600	116,818	169,386	2026/9/16	
	7.95 RUSSIA OFZ 261007	7.95	101,100	94,580	137,141	2026/10/7	
	8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	111,000	104,241	151,149	2027/2/3	
	8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	87,700	82,132	119,092	2031/9/17	
小計					3,251,904		
ルーマニア			千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ			
国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	4,400	4,280	111,358	2024/4/29	
	3.25 ROMANIA GOVE 260624	3.25	3,200	2,996	77,956	2026/6/24	
	3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	3,300	2,877	74,873	2031/9/24	
	3.7 ROMANIA GOVER 241125	3.7	2,600	2,536	65,981	2024/11/25	
	4.15 ROMANIA GOVE 301024	4.15	3,000	2,767	72,011	2030/10/24	
	4.25 ROMANIA GOVE 230628	4.25	4,200	4,194	109,128	2023/6/28	
	4.5 ROMANIA GOVER 240617	4.5	9,200	9,169	238,554	2024/6/17	
	4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,900	6,899	179,501	2025/2/24	
	4.75 ROMANIA GOVE 341011	4.75	1,700	1,596	41,527	2034/10/11	
	4.85 ROMANIA GOVE 260422	4.85	4,900	4,884	127,074	2026/4/22	
	5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	3,960	3,948	102,722	2029/2/12	
	5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	6,800	7,063	183,762	2027/7/26	
	5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	4,500	4,584	119,272	2023/4/26	
小計					1,503,724		
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2.632	9,800	9,001	244,511	2031/4/15	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	4,100	4,124	112,023	2027/5/31	
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	7,350	7,447	202,283	2028/6/15	
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	6,400	5,985	162,581	2040/5/22	
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	13,100	13,388	363,674	2023/8/17	
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	9,370	9,186	249,521	2034/7/5	
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	16,050	16,328	443,533	2029/8/15	
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	11,500	11,799	320,506	2027/11/16	



銘柄	銘柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円		
	国債証券	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	13,720	14,085	382,597	2026/11/30
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	20,500	21,160	574,792	2025/9/15
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	8,900	9,158	248,773	2024/9/30
		4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	7,100	6,794	184,545	2050/6/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	10,450	10,776	292,720	2024/7/15
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	6,050	6,166	167,503	2035/5/31
		4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	8,600	9,029	245,281	2028/10/31
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	6,100	6,589	178,983	2037/4/7
小	計					4,373,834	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	0.75 THAILAND 240617	0.75	100,800	100,752	347,596	2024/6/17
		0.95 THAILAND 250617	0.95	56,100	56,004	193,216	2025/6/17
		1 THAILAND 270617	1.0	38,900	37,866	130,639	2027/6/17
		1.45 THAILAND 241217	1.45	87,600	89,021	307,124	2024/12/17
		1.585 THAILAND 351217	1.585	48,600	43,262	149,256	2035/12/17
		1.6 THAILAND 291217	1.6	69,500	67,727	233,661	2029/12/17
		1.6 THAILAND 350617	1.6	30,500	27,588	95,179	2035/6/17
		2 THAILAND 221217	2.0	54,300	55,028	189,848	2022/12/17
		2 THAILAND 311217	2.0	36,000	35,670	123,062	2031/12/17
		2 THAILAND 420617	2.0	34,500	29,842	102,957	2042/6/17
		2.125 THAILAND 261217	2.125	84,300	87,098	300,490	2026/12/17
		2.4 THAILAND 231217	2.4	61,600	63,622	219,497	2023/12/17
		2.875 THAILAND 281217	2.875	67,400	71,943	248,205	2028/12/17
		2.875 THAILAND 460617	2.875	57,200	55,534	191,594	2046/6/17
		3.3 THAILAND 380617	3.3	80,100	85,921	296,427	2038/6/17
		3.4 THAILAND 360617	3.4	65,000	70,863	244,477	2036/6/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	47,900	49,895	172,139	2023/6/16
		3.65 THAILAND 310620	3.65	70,100	79,459	274,133	2031/6/20
		3.775 THAILAND 320625	3.775	73,700	84,599	291,869	2032/6/25
		3.85 THAILAND 251212	3.85	81,700	90,019	310,568	2025/12/12
		4.875 THAILAND 290622	4.875	67,300	80,999	279,449	2029/6/22
小	計					4,701,398	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	20,000	22,270	49,456	2036/1/14
小	計					49,456	
インドネシア				千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	10.5	7,050,000	8,844,225	70,753	2030/8/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	5,250,000	6,308,820	50,470	2025/9/15
		5.125 INDONESIA 270415	5.125	7,700,000	7,671,741	61,373	2027/4/15
		5.5 INDONESIA 260415	5.5	9,200,000	9,287,400	74,299	2026/4/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	21,700,000	22,285,900	178,287	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	29,000,000	29,232,000	233,856	2028/5/15
		6.25 INDONESIA 360615	6.25	2,000,000	1,977,000	15,816	2036/6/15
		6.5 INDONESIA 250615	6.5	52,400,000	54,967,600	439,740	2025/6/15
		6.5 INDONESIA 310215	6.5	35,900,000	35,846,150	286,769	2031/2/15

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		
インドネシア		%	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア	千円	
国債証券	6.625 INDONESIA 330515	6.625	29,400,000	29,400,000	235,200	2033/5/15
	7 INDONESIA 270515	7.0	23,450,000	24,892,175	199,137	2027/5/15
	7 INDONESIA 300915	7.0	29,700,000	30,516,750	244,134	2030/9/15
	7.125 INDONESIA 420615	7.125	10,800,000	10,987,434	87,899	2042/6/15
	7.5 INDONESIA 320815	7.5	10,900,000	11,510,400	92,083	2032/8/15
	7.5 INDONESIA 350615	7.5	15,300,000	16,057,350	128,458	2035/6/15
	7.5 INDONESIA 380515	7.5	28,200,000	29,454,900	235,639	2038/5/15
	7.5 INDONESIA 400415	7.5	1,500,000	1,566,750	12,534	2040/4/15
	8.125 INDONESIA 240515	8.125	24,600,000	26,611,050	212,888	2024/5/15
	8.25 INDONESIA 290515	8.25	24,500,000	27,164,375	217,315	2029/5/15
	8.25 INDONESIA 320615	8.25	19,000,000	21,127,074	169,016	2032/6/15
	8.25 INDONESIA 360515	8.25	29,200,000	32,368,200	258,945	2036/5/15
	8.375 INDONESIA 240315	8.375	37,100,000	40,123,650	320,989	2024/3/15
	8.375 INDONESIA 260915	8.375	29,930,000	33,581,460	268,651	2026/9/15
	8.375 INDONESIA 340315	8.375	32,700,000	36,673,050	293,384	2034/3/15
	8.375 INDONESIA 390415	8.375	23,200,000	26,158,000	209,264	2039/4/15
	8.75 INDONESIA 310515	8.75	15,400,000	17,663,800	141,310	2031/5/15
	9 INDONESIA 290315	9.0	15,500,000	17,801,750	142,414	2029/3/15
	9.5 INDONESIA 310715	9.5	20,200,000	24,156,064	193,248	2031/7/15
小計					5,073,880	
中国			千中国元	千中国元		
国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	24,000	23,737	427,109	2025/4/9
	2.36 CHINA GOVT 230702	2.36	5,000	5,015	90,249	2023/7/2
	2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	18,000	17,867	321,493	2030/5/21
	2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	10,000	10,126	182,203	2026/8/12
	2.84 CHINA GOVT 240408	2.84	2,000	2,028	36,501	2024/4/8
	2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	16,000	16,271	292,765	2027/6/4
	2.88 CHINA GOVT 231105	2.88	16,000	16,212	291,711	2023/11/5
	2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	16,000	16,276	292,865	2024/10/17
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	12,000	12,275	220,874	2028/5/13
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	3,000	3,068	55,209	2031/5/27
	3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	5,000	5,126	92,236	2026/3/11
	3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	5,000	5,151	92,687	2026/12/5
	3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	19,000	19,528	351,375	2029/11/21
	3.19 CHINA GOVT 240411	3.19	17,000	17,362	312,394	2024/4/11
	3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	22,000	22,671	407,924	2025/12/6
	3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	15,200	15,733	283,085	2026/6/6
	3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	10,000	10,364	186,495	2028/11/22
	3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	8,000	8,340	150,077	2030/11/19
	3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	15,000	15,608	280,850	2027/12/3
	3.29 CHINA GOVT 231018	3.29	4,000	4,079	73,408	2023/10/18
	3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	17,000	17,674	318,018	2029/5/23
	3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	1,000	1,048	18,868	2051/10/18
	3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	5,000	5,378	96,767	2051/4/12

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			
中国	%	千中国元	千中国元	千円			
国債証券	3.81	CHINA GOVT 500914	3.81	15,000	16,285	293,022	2050/9/14
小 計						5,168,196	
南アフリカ		千南アフリカランド	千南アフリカランド				
国債証券	10.5	SOUTH AFRICA 261221	10.5	99,200	109,906	821,004	2026/12/21
	6.25	SOUTH AFRICA 360331	6.25	31,400	22,132	165,326	2036/3/31
	6.5	SOUTH AFRICA 410228	6.5	27,400	18,427	137,656	2041/2/28
	7.0	SOUTH AFRICA 310228	7.0	39,500	33,363	249,226	2031/2/28
	7.75	SOUTH AFRICA 230228	7.75	9,600	9,849	73,572	2023/2/28
	8.0	SOUTH AFRICA 300131	8.0	87,200	80,649	602,451	2030/1/31
	8.25	SOUTH AFRICA 320331	8.25	63,900	57,728	431,232	2032/3/31
	8.5	SOUTH AFRICA 370131	8.5	61,500	52,514	392,280	2037/1/31
	8.75	SOUTH AFRICA 440131	8.75	52,800	44,704	333,940	2044/1/31
	8.75	SOUTH AFRICA 480228	8.75	93,700	78,941	589,690	2048/2/28
	8.875	SOUTH AFRIC 350228	8.875	58,700	52,910	395,243	2035/2/28
	9.0	SOUTH AFRICA 400131	9.0	43,400	38,104	284,638	2040/1/31
小 計						4,476,263	
合 計						50,602,408	

(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

(2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	50,602,408	97.2
コール・ローン等、その他	1,474,347	2.8
投資信託財産総額	52,076,755	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(51,911,783千円)の投資信託財産総額(52,076,755千円)に対する比率は99.7%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=113.84円	1 アルゼンチンペソ=1.0879円	1 メキシコペソ=5.5221円	1 ブラジルリアル=20.9175円
100 チリペソ=14.2277円	100 コロンビアペソ=2.8688円	1 ペルーヌエボソル=29.5872円	1 ウルグアイペソ=2.5606円
1 ドミニカペソ=1.9674円	1 セルビアディナール=1.094185円	1 トルコリラ=8.4435円	1 チェココロナ=5.2567円
100 ハンガリーフォリント=35.8566円	1 ポーランドズロチ=28.0868円	1 ロシアルーブル=1.45円	1 ルーマニアレイ=26.0166円
1 マレーシアリンギット=27.163円	1 タイバーツ=3.45円	1 フィリピンペソ=2.2207円	100 インドネシアルピア=0.80円
1 中国元=17.9929円	1 南アフリカランド=7.47円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	52,150,164,009
コール・ローン等	669,785,144
公社債(評価額)	50,602,408,982
未収入金	128,475,746
未収利息	672,001,052
前払費用	77,493,085
(B) 負債	261,574,810
前受収益	34,792
未払金	73,552,868
未払解約金	187,987,077
未払利息	73
(C) 純資産総額(A-B)	51,888,589,199
元本	36,997,686,845
次期繰越損益金	14,890,902,354
(D) 受益権総口数	36,997,686,845口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,025円

<注記事項>

- ①期首元本額 27,338,600,598円  
 期中追加設定元本額 12,240,836,359円  
 期中一部解約元本額 2,581,750,112円  
 また、1口当たり純資産額は、期末14,025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)

eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,575,703,212円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	9,428,740,516円
つみたて8資産均等バランス	5,168,677,961円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,422,421,214円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,149,104,721円
ラップ向けインデックスI 新興国債券	1,575,296,015円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	987,110,945円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	399,608,667円
eMAXIS バランス(波乗り型)	384,385,580円
海外債券セレクション(ラップ向け)	370,303,293円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	305,375,057円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	96,512,145円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	76,820,515円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	32,146,831円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	10,364,781円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	7,863,232円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,458,599円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,876,555円
コアバランス	1,292,481円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	1,055,823円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	568,702円
合計	36,997,686,845円

○損益の状況 (2021年1月27日~2022年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,344,343,562
受取利息	2,344,385,751
その他収益金	97,159
支払利息	△ 139,348
(B) 有価証券売買損益	△ 1,884,886,634
売買益	2,577,922,730
売買損	△ 4,462,809,364
(C) 保管費用等	△ 42,076,889
(D) 当期損益金(A+B+C)	417,380,039
(E) 前期繰越損益金	10,441,035,754
(F) 追加信託差損益金	5,113,599,274
(G) 解約差損益金	△ 1,081,112,713
(H) 計(D+E+F+G)	14,890,902,354
次期繰越損益金(H)	14,890,902,354

- (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】

対象インデックスとの連動性維持のために行う外国為替予約取引について明確化するため、外国為替予約取引にかかる記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年9月30日)