

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。	
	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。）	

※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2期（決算日：2023年3月27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27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 期 騰 落	中 期 騰 落	中 期 騰 落			
(設定日) 2021年4月16日	円 10,000	円 —	% —	33,348.63	% —	% —	% —	百万円 1
1期(2022年3月25日)	9,883	0	△1.2	33,191.09	△0.5	97.2	—	2,306
2期(2023年3月27日)	10,457	0	5.8	35,147.40	5.9	97.7	—	2,998

(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 率		
(期首) 2022年3月25日	円 9,883	% —	33,191.09	% —	% 97.2	% —
3月末	10,053	1.7	33,782.76	1.8	96.6	—
4月末	9,999	1.2	33,306.37	0.3	96.2	—
5月末	10,095	2.1	33,884.38	2.1	96.1	—
6月末	10,280	4.0	34,445.36	3.8	95.2	—
7月末	10,065	1.8	33,692.82	1.5	96.8	—
8月末	10,424	5.5	34,986.65	5.4	96.9	—
9月末	10,312	4.3	34,492.18	3.9	96.5	—
10月末	10,540	6.6	35,377.33	6.6	96.4	—
11月末	10,511	6.4	35,263.58	6.2	97.0	—
12月末	10,246	3.7	34,477.89	3.9	95.4	—
2023年1月末	10,529	6.5	35,423.91	6.7	96.7	—
2月末	10,663	7.9	35,809.02	7.9	96.7	—
(期末) 2023年3月27日	10,457	5.8	35,147.40	5.9	97.7	—

(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

第2期：2022年3月26日～2023年3月27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2期首	9,883円
第2期末	10,457円
既払分配金	0円
騰落率	5.8%

※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

基準価額は期間の初めに比べ5.8%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（5.9%）を0.1%下回りました。

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。

第2期：2022年3月26日～2023年3月27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上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により下落した後、もみ合いで推移しました。その後、欧米中銀による利上げペー

スの減速期待などが好感され、期間末にかけ上昇しました。

▶ 為替市況

期間の初めに比べてエジプトポンドや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

▶ 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△0.1%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0.1%程度でした。

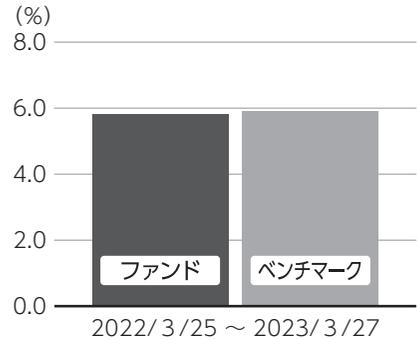
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

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：取引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2期 2022年3月26日～2023年3月27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	922

(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。

2022年3月26日～2023年3月27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	19	0.188	(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)	(16)	(0.155)	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)	(0.011)	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)	(0.022)	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	10	0.095	(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)	(8)	(0.080)	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)	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	29	0.283	

期中の平均基準価額は、10,330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。

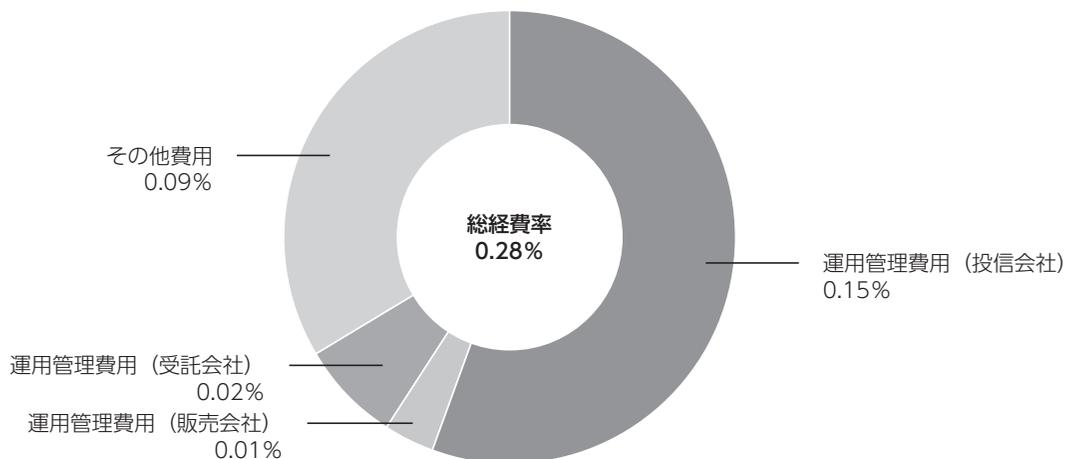
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.28%**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

(2022年3月26日～2023年3月27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 462,571	千円 672,493	千口 85,981	千円 124,020

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月26日～2023年3月27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	20,664	8,145	39.4	11,486	4,838	42.1

平均保有割合 4.4%

※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

(2023年3月27日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	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	千口 2,040,027	千円 2,998,228

○投資信託財産の構成

(2023年3月27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 2,998,228	% 99.8
コール・ローン等、その他	6,126	0.2
投資信託財産総額	3,004,354	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(66,039,936千円)の投資信託財産総額(66,060,020千円)に対する比率は100.0%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。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=130.65円	1 アルゼンチンペソ=0.6348円	1 メキシコペソ=7.0887円	1 ブラジルリアル=24.8956円
100 チリペソ=16.1192円	100 コロンビアペソ=2.7621円	1 ペルーヌエボソル=34.6152円	1 ウルグアイペソ=3.3603円
1 ドミニカペソ=2.384円	1 ユーロ=140.67円	1 セルビアディナール=1.196683円	1 トルコリラ=6.8511円
1 チェココルナ=5.9427円	100 ハンガリーフォリント=36.5949円	1 ポーランドズロチ=30.0067円	1 ルーマニアレイ=28.5577円
1 マレーシアリンギット=29.4946円	1 タイバーツ=3.81円	1 フィリピンペソ=2.4051円	100 インドネシアルピア=0.87円
1 中国元=19.0178円	1 エジプトポンド=4.2274円	1 南アフリカランド=7.18円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年3月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,004,354,014
コール・ローン等	6,125,630
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,998,228,384
(B) 負債	5,801,920
未払解約金	3,089,663
未払信託報酬	2,656,062
未払利息	2
その他未払費用	56,193
(C) 純資産総額(A-B)	2,998,552,094
元本	2,867,625,289
次期繰越損益金	130,926,805
(D) 受益権総口数	2,867,625,289口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,457円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,333,408,205円
 期中追加設定元本額 953,208,321円
 期中一部解約元本額 418,991,237円
 また、1口当たり純資産額は、期末10,457円です。

②分配金の計算過程

項 目	2022年3月26日～ 2023年3月27日
費用控除後の配当等収益額	143,611,362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	45,554,829円
分配準備積立金額	75,248,658円
当ファンドの分配対象収益額	264,414,849円
1万口当たり収益分配対象額	922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。

○損益の状況 (2022年3月26日～2023年3月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,681
受取利息	18
支払利息	△ 1,699
(B) 有価証券売買損益	127,120,527
売買益	146,384,856
売買損	△ 19,264,329
(C) 信託報酬等	△ 5,090,532
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	122,028,314
(E) 前期繰越損益金	△ 59,431,369
(F) 追加信託差損益金	68,329,860
(配当等相当額)	(41,563,223)
(売買損益相当額)	(26,766,637)
(G) 計(D+E+F)	130,926,805
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	130,926,805
追加信託差損益金	68,329,860
(配当等相当額)	(45,554,829)
(売買損益相当額)	(22,775,031)
分配準備積立金	218,860,020
繰越損益金	△156,263,075

- (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。

新興国債券インデックスマザーファンド

《第13期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023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13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13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	(円換算ベース)	騰落率			
9期(2019年1月28日)	13,254	△8.4%	31,268.09	△8.1%	96.7%	—	百万円 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
13期(2023年1月26日)	14,770	5.3%	35,262.54	5.5%	97.1%	—	64,755

(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	騰 落 率	J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ デ ィ バ ー シ フ ァ イ ド		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			(円換算ベース)	騰 落 率		
(期 首) 2022年 1 月 26 日	円 14,025	% —	33,419.11	% —	% 97.5	% —
1 月 末	14,115	0.6	33,673.33	0.8	96.8	—
2 月 末	13,987	△0.3	33,817.05	1.2	97.2	—
3 月 末	14,101	0.5	33,782.76	1.1	96.6	—
4 月 末	14,028	0.0	33,306.37	△0.3	96.2	—
5 月 末	14,165	1.0	33,884.38	1.4	96.1	—
6 月 末	14,427	2.9	34,445.36	3.1	95.2	—
7 月 末	14,128	0.7	33,692.82	0.8	96.8	—
8 月 末	14,635	4.3	34,986.65	4.7	96.9	—
9 月 末	14,480	3.2	34,492.18	3.2	96.5	—
10 月 末	14,802	5.5	35,377.33	5.9	96.4	—
11 月 末	14,764	5.3	35,263.58	5.5	97.0	—
12 月 末	14,394	2.6	34,477.89	3.2	95.4	—
(期 末) 2023年 1 月 26 日	14,770	5.3	35,262.54	5.5	97.1	—

(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

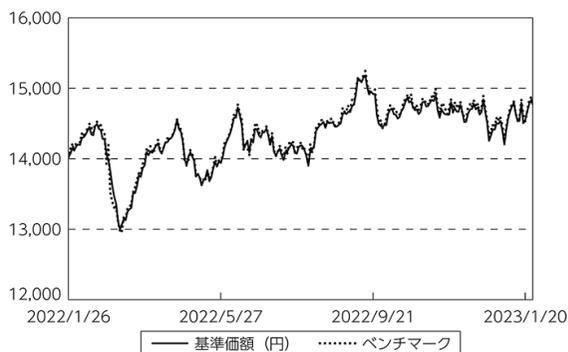
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ5.3%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(5.5%)を0.2%下回りました。

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、期間の初めにロシアのウクライナ侵攻及び各国の経済制裁によるロシア国債の値下がりなどを受けて下落した後、もみ合いで推移しました。その後、欧米中央銀行による利上げペースの減速期待などから市場参加者のリスク回避姿勢が後退したことで上昇しましたが、期間の初めとの比較では下落しました。

◎ 為替市況

期間の初めに比べてエジプトポンドや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5.5%の上昇になったため、乖離は $\Delta 0.2\%$ 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)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

(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

(2022年1月27日～2023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 14	% 0.096	(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)	(0.080)	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	14	0.096	
期中の平均基準価額は、14,347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

(2022年1月27日～2023年1月26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	$\frac{D}{C}$ %
為替先物取引	百万円 774	百万円 187	24.2	百万円 755	百万円 328	43.4
為替直物取引	22,409	8,104	36.2	12,777	4,606	36.0

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

(2023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 956,300	千メキシコペソ 909,660	千円 6,255,462	% 9.7	% —	% 4.8	% 2.9	% 2.0
ブラジル	千ブラジルレアル 292,270	千ブラジルレアル 248,628	6,326,402	9.8	9.8	1.4	3.5	4.8
チリ	千チリペソ 9,125,000	千チリペソ 9,041,994	1,455,571	2.2	—	1.4	0.8	—
コロンビア	千コロンビアペソ 109,090,000	千コロンビアペソ 85,159,228	2,425,930	3.7	—	2.3	1.1	0.3
ペルー	千ペルーヌエボソル 45,200	千ペルーヌエボソル 40,854	1,356,483	2.1	—	1.7	0.3	0.1
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 24,000	千ウルグアイペソ 21,907	72,436	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ	千ドミニカペソ 16,000	千ドミニカペソ 15,496	35,330	0.1	0.1	—	0.1	—
セルビア	千セルビアディナール 170,000	千セルビアディナール 156,622	188,196	0.3	0.3	0.2	0.1	—
トルコ	千トルコリラ 71,900	千トルコリラ 79,248	544,651	0.8	0.8	0.2	0.5	0.1
チェコ	千チェココルナ 669,700	千チェココルナ 590,150	3,502,186	5.4	—	2.6	1.8	1.0
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 7,175,000	千ハンガリーフォリント 5,568,772	2,033,331	3.1	—	1.4	1.3	0.5
ポーランド	千ポーランドズロチ 174,450	千ポーランドズロチ 151,273	4,526,255	7.0	—	2.2	3.3	1.5
ルーマニア	千ルーマニアレイ 78,560	千ルーマニアレイ 70,950	2,044,639	3.2	—	1.2	1.2	0.8
マレーシア	千マレーシアリンギット 209,130	千マレーシアリンギット 210,101	6,379,048	9.9	—	5.4	2.9	1.5
タイ	千タイバーツ 1,655,200	千タイバーツ 1,666,426	6,582,385	10.2	—	5.9	2.3	2.0
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 18,445	43,625	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 707,480,000	千インドネシアルピア 738,503,700	6,424,982	9.9	—	6.8	2.3	0.9
中国	千中国元 321,200	千中国元 325,313	6,185,552	9.6	—	4.5	3.7	1.3

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
エジプト	千エジプトポンド 146,000	千エジプトポンド 122,133	千円 527,799	% 0.8	% 0.8	% 0.1	% 0.5	% 0.2
南アフリカ	千南アフリカランド 921,500	千南アフリカランド 791,422	5,975,239	9.2	9.2	8.0	1.2	—
合 計	—	—	62,885,512	97.1	21.0	50.4	29.8	16.9

(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		千円	
				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			
	国債証券						
		10.0	73,700	74,082	509,441	2024/12/5	
		10.0	20,200	22,495	154,694	2036/11/20	
		5.0	49,000	44,555	306,392	2025/3/6	
		5.5	39,700	35,060	241,101	2027/3/4	
		5.75	118,200	107,496	739,220	2026/3/5	
		7.5	93,200	88,955	611,721	2027/6/3	
		7.75	119,800	113,963	783,691	2031/5/29	
		7.75	22,400	21,014	144,510	2034/11/23	
		7.75	72,600	65,996	453,836	2042/11/13	
		8.0	11,300	11,046	75,963	2023/12/7	
		8.0	103,000	99,627	685,108	2024/9/5	
		8.0	69,400	64,315	442,280	2047/11/7	
		8.0	22,400	20,785	142,934	2053/7/31	
		8.5	79,000	78,654	540,885	2029/5/31	
		8.5	62,400	61,610	423,677	2038/11/18	
小計					6,255,462		
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	36,270	33,676	856,900	2027/1/1	
		10.0	29,100	28,047	713,684	2025/1/1	
		10.0	12,100	10,526	267,847	2031/1/1	
		10.0	4,600	3,890	98,984	2033/1/1	
		10.0	24,700	22,115	562,720	2029/1/1	
		—	71,400	63,557	1,617,223	2024/1/1	
		—	37,200	31,241	794,946	2024/7/1	
		—	30,500	22,900	582,700	2025/7/1	
		—	46,400	32,674	831,396	2026/1/1	
小計					6,326,402		
チリ			千チリペソ	千チリペソ			
	国債証券						
		2.3	480,000	413,160	66,510	2028/10/1	
		2.5	1,940,000	1,812,445	291,765	2025/3/1	
		4.5	1,420,000	1,397,635	224,989	2026/3/1	
		4.7	1,520,000	1,489,676	239,806	2030/9/1	
		5.0	660,000	660,113	106,264	2028/10/1	
		5.0	1,440,000	1,430,740	230,319	2035/3/1	
		6.0	1,315,000	1,432,758	230,643	2043/1/1	
		7.0	350,000	405,465	65,271	2034/5/1	
小計					1,455,571		
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	7,523,936	214,334	2024/7/24	
		5.75	5,900,000	4,624,304	131,732	2027/11/3	
		6.0	11,980,000	9,301,441	264,970	2028/4/28	
		6.25	7,690,000	6,693,596	190,680	2025/11/26	
		6.25	5,500,000	3,419,517	97,411	2036/7/9	
		7.0	9,900,000	7,396,611	210,707	2031/3/26	

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		
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 TITULOS DE TESO 320630	7.0	11,700,000	8,475,600	241,444	2032/6/30
	7.25 TITULOS DE T 341018	7.25	10,000,000	6,962,632	198,344	2034/10/18
	7.25 TITULOS DE T 501026	7.25	6,800,000	4,167,924	118,731	2050/10/26
	7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	13,770,000	12,058,653	343,514	2026/8/26
	7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	9,460,000	7,498,829	213,619	2030/9/18
	9.25 TITULOS DE T 420528	9.25	7,400,000	5,859,996	166,933	2042/5/28
	9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,176,183	33,505	2027/6/28
小計					2,425,930	
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	3,250	2,404	79,839	2040/8/12
	5.4 PERU 340812	5.4	4,400	3,518	116,819	2034/8/12
	5.7 PERU 240812	5.7	2,050	2,007	66,646	2024/8/12
	5.94 PERU 290212	5.94	6,600	6,012	199,640	2029/2/12
	6.15 PERU 320812	6.15	7,400	6,477	215,083	2032/8/12
	6.35 PERU 280812	6.35	5,800	5,453	181,059	2028/8/12
	6.9 PERU 370812	6.9	5,400	4,824	160,184	2037/8/12
	6.95 PERU 310812	6.95	5,300	4,974	165,153	2031/8/12
	8.2 PERU 260812	8.2	5,000	5,181	172,056	2026/8/12
小計					1,356,483	
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	15,327	50,680	2031/5/21
	8.5 URUGUAY (GL) 280315	8.5	7,000	6,580	21,756	2028/3/15
小計					72,436	
ドミニカ			千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
国債証券	9.75 DOMINICAN 260605	9.75	16,000	15,496	35,330	2026/6/5
小計					35,330	
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	61,000	58,420	70,197	2026/1/11
	4.5 SERBIA TREASU 320820	4.5	59,000	49,215	59,136	2032/8/20
	5.875 SERBIA TREA 280208	5.875	50,000	48,987	58,862	2028/2/8
小計					188,196	
トルコ			千トルコリラ	千トルコリラ		
国債証券	10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	7,400	7,692	52,866	2027/8/11
	10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	9,600	10,008	68,781	2026/2/11
	11 TURKEY GOVT 270224	11.0	4,500	4,824	33,153	2027/2/24
	11.7 TURKEY GOVT 301113	11.7	14,100	18,012	123,796	2030/11/13
	12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	4,100	4,969	34,151	2028/3/8
	12.6 TURKEY GOVT 251001	12.6	16,600	18,272	125,581	2025/10/1
	8 TURKEY GOVT 250312	8.0	7,300	7,219	49,618	2025/3/12
	9 TURKEY GOVT 240724	9.0	8,300	8,250	56,701	2024/7/24
小計					544,651	
チェコ			千チェココルナ	千チェココルナ		
国債証券	0.05 CZECH REPUB 291129	0.05	58,000	43,015	255,268	2029/11/29
	0.25 CZECH REPUB 270210	0.25	143,500	120,186	713,232	2027/2/10
	0.45 CZECH REPUB 231025	0.45	34,500	33,002	195,850	2023/10/25

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		
		%	千チェココルナ	千チェココルナ	千円		
チェコ	国債証券	1.5 CZECH REPUBLI 400424	1.5	15,500	9,993	59,306	2040/4/24
		1.75 CZECH REPUB 320623	1.75	121,200	97,081	576,118	2032/6/23
		3.5 CZECH REPUBLI 350530	3.5	83,500	76,861	456,128	2035/5/30
		5 CZECH REPUBLIC 300930	5.0	19,000	19,674	116,756	2030/9/30
		5.5 CZECH REPUBLI 281212	5.5	37,000	38,794	230,222	2028/12/12
		6 CZECH REPUBLIC 260226	6.0	71,500	73,672	437,200	2026/2/26
		CZECH REPUBLIC 241212	—	86,000	77,868	462,104	2024/12/12
		小 計					3,502,186
ハンガリー	国債証券	1 HUNGARY 251126	1.0	327,000	257,705	94,096	2025/11/26
		1.5 HUNGARY 260422	1.5	760,000	597,778	218,267	2026/4/22
		1.5 HUNGARY 260826	1.5	360,000	276,480	100,951	2026/8/26
		2 HUNGARY 290523	2.0	430,000	311,707	113,813	2029/5/23
		2.25 HUNGARY 330420	2.25	540,000	348,975	127,421	2033/4/20
		2.25 HUNGARY 340622	2.25	150,000	92,775	33,875	2034/6/22
		2.5 HUNGARY 241024	2.5	390,000	334,893	122,279	2024/10/24
		2.75 HUNGARY 261222	2.75	373,000	296,612	108,302	2026/12/22
		3 HUNGARY 240626	3.0	359,000	319,163	116,536	2024/6/26
		3 HUNGARY 271027	3.0	521,000	410,600	149,922	2027/10/27
		3 HUNGARY 300821	3.0	498,000	375,994	137,287	2030/8/21
		3 HUNGARY 381027	3.0	292,000	177,054	64,647	2038/10/27
		3 HUNGARY 410425	3.0	240,000	140,172	51,181	2041/4/25
		3.25 HUNGARY 311022	3.25	618,000	456,207	166,575	2031/10/22
		4.5 HUNGARY 280323	4.5	250,000	211,975	77,398	2028/3/23
		4.75 HUNGARY 321124	4.75	150,000	122,562	44,751	2032/11/24
		5.5 HUNGARY 250624	5.5	492,000	437,691	159,814	2025/6/24
6 HUNGARY 231124	6.0	243,000	229,114	83,656	2023/11/24		
6.75 HUNGARY 281022	6.75	182,000	171,310	62,550	2028/10/22		
小 計					2,033,331		
ポーランド	国債証券	0.25 POLAND 261025	0.25	14,200	11,565	346,051	2026/10/25
		0.75 POLAND 250425	0.75	12,500	11,205	335,284	2025/4/25
		1.25 POLAND 301025	1.25	13,900	9,998	299,163	2030/10/25
		1.75 POLAND 320425	1.75	13,600	9,667	289,264	2032/4/25
		2.25 POLAND 241025	2.25	13,500	12,693	379,814	2024/10/25
		2.5 POLAND 240425	2.5	10,100	9,693	290,027	2024/4/25
		2.5 POLAND 260725	2.5	15,500	13,852	414,475	2026/7/25
		2.5 POLAND 270725	2.5	10,900	9,500	284,279	2027/7/25
		2.75 POLAND 280425	2.75	13,250	11,421	341,756	2028/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	19,200	16,010	479,048	2029/10/25
		3.25 POLAND 250725	3.25	14,500	13,609	407,199	2025/7/25
		3.75 POLAND 270525	3.75	13,800	12,678	379,353	2027/5/25
		4 POLAND 231025	4.0	9,500	9,375	280,535	2023/10/25
小 計					4,526,255		

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		
ルーマニア		%	千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ	千円	
国債証券	2.5 ROMANIA GOVER 271025	2.5	3,000	2,441	70,371	2027/10/25
	3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	4,400	4,223	121,710	2024/4/29
	3.25 ROMANIA GOVE 260624	3.25	3,200	2,829	81,540	2026/6/24
	3.65 ROMANIA GOVE 250728	3.65	4,000	3,709	106,893	2025/7/28
	3.65 ROMANIA GOVE 310924	3.65	5,500	4,271	123,083	2031/9/24
	3.7 ROMANIA GOVER 241125	3.7	4,600	4,367	125,861	2024/11/25
	4.15 ROMANIA GOVE 280126	4.15	5,200	4,534	130,687	2028/1/26
	4.15 ROMANIA GOVE 301024	4.15	5,000	4,096	118,047	2030/10/24
	4.5 ROMANIA GOVER 240617	4.5	9,200	8,939	257,615	2024/6/17
	4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,900	6,611	190,516	2025/2/24
	4.75 ROMANIA GOVE 341011	4.75	4,200	3,358	96,770	2034/10/11
	4.85 ROMANIA GOVE 260422	4.85	4,900	4,570	131,714	2026/4/22
	4.85 ROMANIA GOVE 290725	4.85	3,700	3,220	92,804	2029/7/25
	5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	3,960	3,513	101,242	2029/2/12
	5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	6,800	6,422	185,078	2027/7/26
	6.7 ROMANIA GOVER 320225	6.7	4,000	3,841	110,698	2032/2/25
小計					2,044,639	
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	13,800	12,744	386,956	2031/4/15
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	14,600	14,612	443,661	2027/5/31
	3.582 MALAYSIAGOV 320715	3.582	8,700	8,591	260,840	2032/7/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	8,850	8,920	270,829	2028/6/15
	3.757 MALAYSIAGOV 400522	3.757	13,700	13,055	396,384	2040/5/22
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	4,700	4,722	143,383	2023/8/17
	3.828 MALAYSIAGOV 340705	3.828	11,570	11,479	348,525	2034/7/5
	3.882 MALAYSIAGOV 250314	3.882	1,200	1,213	36,850	2025/3/14
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	14,450	14,609	443,560	2029/8/15
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	11,500	11,705	355,410	2027/11/16
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	12,720	12,915	392,130	2026/11/30
	3.906 MALAYSIAGOV 260715	3.906	1,200	1,220	37,057	2026/7/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	20,500	20,799	631,516	2025/9/15
	4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	14,400	14,604	443,421	2024/9/30
	4.065 MALAYSIAGOV 500615	4.065	9,100	8,736	265,245	2050/6/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	12,450	12,636	383,650	2024/7/15
	4.254 MALAYSIAGOV 350531	4.254	9,550	9,852	299,123	2035/5/31
	4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	12,800	13,247	402,222	2028/10/31
	4.696 MALAYSIAGOV 421015	4.696	4,340	4,653	141,292	2042/10/15
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	9,000	9,781	296,983	2037/4/7
小計					6,379,048	
タイ			千タイバーツ	千タイバーツ		
国債証券	0.75 THAILAND 240617	0.75	88,800	87,861	347,053	2024/6/17
	0.75 THAILAND 240917	0.75	91,300	90,095	355,877	2024/9/17
	0.95 THAILAND 250617	0.95	91,400	89,888	355,060	2025/6/17
	1 THAILAND 270617	1.0	108,700	104,582	413,102	2027/6/17
	1.45 THAILAND 241217	1.45	87,600	87,286	344,780	2024/12/17

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		
タイ		%	千タイバーツ	千タイバーツ	千円	
国債証券	1.585 THAILAND 351217	1.585	80,900	71,135	280,984	2035/12/17
	1.6 THAILAND 291217	1.6	74,500	71,803	283,624	2029/12/17
	1.6 THAILAND 350617	1.6	38,200	33,967	134,173	2035/6/17
	2 THAILAND 311217	2.0	127,100	123,481	487,751	2031/12/17
	2 THAILAND 420617	2.0	53,500	45,713	180,567	2042/6/17
	2.125 THAILAND 261217	2.125	87,300	88,256	348,614	2026/12/17
	2.35 THAILAND 260617	2.35	5,000	5,093	20,118	2026/6/17
	2.4 THAILAND 231217	2.4	58,900	59,546	235,207	2023/12/17
	2.65 THAILAND 280617	2.65	30,700	31,748	125,406	2028/6/17
	2.875 THAILAND 281217	2.875	84,400	88,276	348,692	2028/12/17
	2.875 THAILAND 460617	2.875	64,200	61,017	241,019	2046/6/17
	3.3 THAILAND 380617	3.3	96,000	100,724	397,863	2038/6/17
	3.39 THAILAND 370617	3.39	2,000	2,138	8,447	2037/6/17
	3.4 THAILAND 360617	3.4	68,000	72,603	286,784	2036/6/17
	3.65 THAILAND 310620	3.65	70,100	77,081	304,472	2031/6/20
	3.775 THAILAND 320625	3.775	88,600	98,620	389,551	2032/6/25
	3.85 THAILAND 251212	3.85	81,700	86,523	341,768	2025/12/12
	4.875 THAILAND 290622	4.875	76,300	88,977	351,461	2029/6/22
小計					6,582,385	
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	18,445	43,625	2036/1/14
小計					43,625	
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	8,635,560	75,129	2030/8/15
	11 INDONESIA 250915	11.0	5,250,000	5,853,619	50,926	2025/9/15
	5.125 INDONESIA 270415	5.125	28,800,000	27,755,712	241,474	2027/4/15
	5.5 INDONESIA 260415	5.5	29,900,000	29,373,760	255,551	2026/4/15
	6.125 INDONESIA 280515	6.125	29,000,000	28,499,750	247,947	2028/5/15
	6.25 INDONESIA 360615	6.25	6,000,000	5,685,000	49,459	2036/6/15
	6.375 INDONESIA 280815	6.375	5,000,000	5,011,300	43,598	2028/8/15
	6.375 INDONESIA 320415	6.375	37,600,000	37,035,248	322,206	2032/4/15
	6.375 INDONESIA 370715	6.375	4,000,000	3,858,780	33,571	2037/7/15
	6.5 INDONESIA 250615	6.5	41,900,000	42,302,240	368,029	2025/6/15
	6.5 INDONESIA 310215	6.5	35,900,000	35,505,100	308,894	2031/2/15
	6.625 INDONESIA 330515	6.625	20,400,000	20,285,760	176,486	2033/5/15
	7 INDONESIA 270515	7.0	23,450,000	24,098,861	209,660	2027/5/15
	7 INDONESIA 300915	7.0	46,700,000	47,563,950	413,806	2030/9/15
	7 INDONESIA 330215	7.0	8,600,000	8,844,928	76,950	2033/2/15
	7.125 INDONESIA 420615	7.125	24,600,000	25,060,020	218,022	2042/6/15
	7.125 INDONESIA 430615	7.125	4,000,000	4,120,240	35,846	2043/6/15
	7.5 INDONESIA 320815	7.5	5,400,000	5,700,780	49,596	2032/8/15
	7.5 INDONESIA 350615	7.5	32,300,000	34,233,155	297,828	2035/6/15
	7.5 INDONESIA 380515	7.5	23,200,000	24,360,000	211,932	2038/5/15
	7.5 INDONESIA 400415	7.5	11,300,000	11,903,420	103,559	2040/4/15
	8.125 INDONESIA 240515	8.125	27,600,000	28,383,840	246,939	2024/5/15

銘柄	銘柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				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			
	国債証券						
	8.25 INDONESIA 290515	8.25	24,500,000	26,558,000	231,054	2029/5/15	
	8.25 INDONESIA 320615	8.25	19,000,000	20,930,563	182,095	2032/6/15	
	8.25 INDONESIA 360515	8.25	29,200,000	32,704,000	284,524	2036/5/15	
	8.375 INDONESIA 240315	8.375	35,600,000	36,632,400	318,701	2024/3/15	
	8.375 INDONESIA 260915	8.375	35,930,000	38,427,135	334,316	2026/9/15	
	8.375 INDONESIA 340315	8.375	35,700,000	39,998,280	347,985	2034/3/15	
	8.375 INDONESIA 390415	8.375	23,200,000	26,403,920	229,714	2039/4/15	
	8.75 INDONESIA 310515	8.75	15,400,000	17,428,180	151,625	2031/5/15	
	9 INDONESIA 290315	9.0	18,800,000	21,116,160	183,710	2029/3/15	
	9.5 INDONESIA 310715	9.5	12,200,000	14,234,037	123,836	2031/7/15	
小計					6,424,982		
中国			千中国元	千中国元			
	国債証券						
	1.99 CHINA GOVT 250409	1.99	14,000	13,868	263,704	2025/4/9	
	2.18 CHINA GOVT 250825	2.18	3,000	2,978	56,630	2025/8/25	
	2.24 CHINA GOVT 250525	2.24	3,000	2,986	56,781	2025/5/25	
	2.26 CHINA GOVT 250224	2.26	3,000	2,988	56,816	2025/2/24	
	2.37 CHINA GOVT 270120	2.37	5,000	4,939	93,929	2027/1/20	
	2.44 CHINA GOVT 271015	2.44	2,000	1,974	37,535	2027/10/15	
	2.47 CHINA GOVT 240902	2.47	3,000	3,002	57,099	2024/9/2	
	2.48 CHINA GOVT 270415	2.48	5,000	4,952	94,166	2027/4/15	
	2.5 CHINA GOVT 270725	2.5	7,000	6,930	131,770	2027/7/25	
	2.6 CHINA GOVT 320901	2.6	5,000	4,868	92,567	2032/9/1	
	2.62 CHINA GOVT 290925	2.62	2,000	1,968	37,429	2029/9/25	
	2.68 CHINA GOVT 300521	2.68	18,000	17,766	337,811	2030/5/21	
	2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	10,000	10,017	190,467	2026/8/12	
	2.69 CHINA GOVT 320815	2.69	8,000	7,835	148,989	2032/8/15	
	2.75 CHINA GOVT 290615	2.75	3,000	2,982	56,704	2029/6/15	
	2.75 CHINA GOVT 320217	2.75	4,000	3,935	74,830	2032/2/17	
	2.76 CHINA GOVT 320515	2.76	5,000	4,928	93,706	2032/5/15	
	2.8 CHINA GOVT 290324	2.8	2,000	1,997	37,979	2029/3/24	
	2.8 CHINA GOVT 321115	2.8	4,000	3,963	75,354	2032/11/15	
	2.84 CHINA GOVT 240408	2.84	2,000	2,015	38,319	2024/4/8	
	2.85 CHINA GOVT 270604	2.85	12,000	12,066	229,426	2027/6/4	
	2.88 CHINA GOVT 231105	2.88	7,000	7,044	133,941	2023/11/5	
	2.89 CHINA GOVT 311118	2.89	3,000	2,998	57,017	2031/11/18	
	2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	2,000	2,014	38,296	2028/10/14	
	2.94 CHINA GOVT 241017	2.94	16,000	16,171	307,484	2024/10/17	
	3.01 CHINA GOVT 280513	3.01	12,000	12,158	231,184	2028/5/13	
	3.02 CHINA GOVT 251022	3.02	15,000	15,219	289,388	2025/10/22	
	3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	7,000	7,082	134,674	2031/5/27	
	3.03 CHINA GOVT 260311	3.03	5,000	5,075	96,503	2026/3/11	
	3.12 CHINA GOVT 261205	3.12	7,000	7,133	135,633	2026/12/5	
	3.13 CHINA GOVT 291121	3.13	18,000	18,419	350,224	2029/11/21	
	3.19 CHINA GOVT 240411	3.19	17,000	17,211	327,263	2024/4/11	
	3.22 CHINA GOVT 251206	3.22	9,000	9,193	174,797	2025/12/6	

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		
中国		%	千中国元	千中国元	千円	
国債証券	3.25 CHINA GOVT 260606	3.25	15,200	15,543	295,547	2026/6/6
	3.25 CHINA GOVT 281122	3.25	10,000	10,291	195,679	2028/11/22
	3.27 CHINA GOVT 301119	3.27	8,000	8,291	157,648	2030/11/19
	3.28 CHINA GOVT 271203	3.28	11,000	11,330	215,445	2027/12/3
	3.29 CHINA GOVT 290523	3.29	15,000	15,530	295,291	2029/5/23
	3.32 CHINA GOVT 520415	3.32	4,000	4,034	76,716	2052/4/15
	3.53 CHINA GOVT 511018	3.53	3,000	3,123	59,394	2051/10/18
	3.72 CHINA GOVT 510412	3.72	5,000	5,377	102,241	2051/4/12
	3.81 CHINA GOVT 500914	3.81	12,000	13,103	249,156	2050/9/14
小 計					6,185,552	
エジプト			千エジプトポンド	千エジプトポンド		
国債証券	13.536 EGYPT GOVE 250114	13.536	7,000	6,052	26,157	2025/1/14
	14.06 EGYPT GOVER 260112	14.06	27,000	22,423	96,903	2026/1/12
	14.292 EGYPT GOVE 280105	14.292	10,000	8,040	34,748	2028/1/5
	14.369 EGYPT GOVE 251020	14.369	17,000	14,347	62,004	2025/10/20
	14.4 EGYPT GOVERN 290910	14.4	9,000	7,117	30,759	2029/9/10
	14.483 EGYPT GOVE 260406	14.483	23,000	19,139	82,711	2026/4/6
	14.531 EGYPT GOVE 240914	14.531	20,000	18,052	78,014	2024/9/14
	14.556 EGYPT GOVE 271013	14.556	15,000	12,183	52,650	2027/10/13
	14.563 EGYPT GOVE 260706	14.563	6,500	5,423	23,436	2026/7/6
	14.664 EGYPT GOVE 301006	14.664	7,000	5,520	23,854	2030/10/6
	16.1 EGYPT GOVERN 290507	16.1	4,500	3,831	16,557	2029/5/7
小 計					527,799	
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	97,500	105,042	793,067	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	36,800	25,128	189,723	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	37,300	24,097	181,937	2041/2/28
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	60,000	49,971	377,281	2031/2/28
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	132,000	121,143	914,629	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	99,400	87,640	661,689	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	90,000	73,975	558,515	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	79,600	63,819	481,835	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	127,900	102,486	773,771	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	96,000	83,764	632,424	2035/2/28
	9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	65,000	54,353	410,365	2040/1/31
小 計					5,975,239	
合 計					62,885,512	

(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

(2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 62,885,512	% 97.0
コール・ローン等、その他	1,917,175	3.0
投資信託財産総額	64,802,687	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (64,699,655千円) の投資信託財産総額 (64,802,687千円) に対する比率は99.8%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=129.27円	1 アルゼンチンペソ=0.6981円	1 メキシコペソ=6.8767円	1 ブラジルレアル=25.4452円
100チリペソ=16.0979円	100コロンビアペソ=2.8487円	1 ペルーヌエボソル=33.2031円	1 ウルグアイペソ=3.3064円
1 ドミニカペソ=2.28円	1 ユーロ=141.09円	1 セルビアディナール=1.201594円	1 トルコリラ=6.8727円
1 チェココルナ=5.9344円	100ハンガリーフォリント=36.5131円	1 ポーランドズロチ=29.9211円	1 ルーマニアレイ=28.818円
1 マレーシアリンギット=30.3617円	1 タイバーツ=3.95円	1 フィリピンペソ=2.3651円	100インドネシアルピア=0.87円
1 中国元=19.0141円	1 エジプトポンド=4.3215円	1 南アフリカランド=7.55円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	64,938,678,511
コール・ローン等	903,875,359
公社債(評価額)	62,885,512,860
未収入金	177,958,378
未収利息	889,586,096
前払費用	81,745,818
(B) 負債	183,188,863
前受収益	145,620
未払金	160,005,767
未払解約金	23,037,441
未払利息	35
(C) 純資産総額(A-B)	64,755,489,648
元本	43,842,059,667
次期繰越損益金	20,913,429,981
(D) 受益権総口数	43,842,059,667口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,770円

<注記事項>

- ①期首元本額 36,997,686,845円
 期中追加設定元本額 8,676,925,462円
 期中一部解約元本額 1,832,552,640円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,770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)	14,726,003,007円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	10,546,062,588円
つみたて8資産均等バランス	6,826,516,752円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,563,187,092円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,120,871,292円
ラップ向けインデックスI 新興国債券	1,960,403,585円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,126,420,368円
海外債券セレクション(ラップ向け)	520,244,134円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	475,504,903円
eMAXIS 最適化バランス(マイフオワード)	365,022,368円
eMAXIS バランス(波乗り型)	356,969,818円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	111,616,987円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	83,597,555円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	34,226,558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	3,622,812円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,612,745円
コアバランス	1,149,064円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	800,026円
合計	43,842,059,667円

○損益の状況 (2022年1月27日~2023年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,164,195,640
受取利息	3,164,146,209
その他収益金	158,821
支払利息	△ 109,390
(B) 有価証券売買損益	58,283,895
売買益	6,682,790,333
売買損	△ 6,624,506,438
(C) 保管費用等	△ 57,256,869
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,165,222,666
(E) 前期繰越損益金	14,890,902,354
(F) 追加信託差損益金	3,645,742,024
(G) 解約差損益金	△ 788,437,063
(H) 計(D+E+F+G)	20,913,429,981
次期繰越損益金(H)	20,913,429,981

- (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。