

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（2003年4月24日設定）	
運用方針	ワールド・インカムマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、日本を除く世界主要国の国債等からなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとします。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。	
主要運用対象	ベビード ファンド	ワールド・インカムマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界主要国の国債等（投資適格債）に直接投資することもできます。
	マザー ファンド	日本を除く世界主要国の国債等（投資適格債）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には制限を設けません。
分配方針	3、6、9、12月の各15日決算（ただし、15日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。 ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

※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）

ワールド・インカムオープン



第62期（決算日：2018年12月17日）

第63期（決算日：2019年3月15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「ワールド・インカムオープン」は、去る3月15日に第63期の決算を行いましたので、法令に基づいて第62期～第63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	基準価額			FTSE世界国債インデックス		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み	み騰落	中率	期騰落			
	円	円	%	(除く日本、円ベース)	%	%	%	百万円
54期(2016年12月15日)	8,753	55	6.8	438.8468	5.6	95.2	—	5,062
55期(2017年3月15日)	8,439	60	△2.9	433.2445	△1.3	94.9	—	4,652
56期(2017年6月15日)	8,457	60	0.9	436.7301	0.8	95.5	—	4,498
57期(2017年9月15日)	8,657	60	3.1	454.4485	4.1	95.7	—	4,458
58期(2017年12月15日)	8,737	60	1.6	462.7541	1.8	96.7	—	4,275
59期(2018年3月15日)	8,277	60	△4.6	442.5855	△4.4	96.9	—	3,928
60期(2018年6月15日)	8,229	60	0.1	444.5360	0.4	96.8	—	3,812
61期(2018年9月18日)	8,263	60	1.1	451.5850	1.6	97.1	—	3,733
62期(2018年12月17日)	8,248	55	0.5	453.5550	0.4	97.3	—	3,535
63期(2019年3月15日)	8,240	55	0.6	457.1926	0.8	97.2	—	3,429

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(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合わせるので、「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		F T S E インデ ックス (除く日本、円ベース)	世界国債 ス 騰 落 率	債券 組 入 比 率	債券 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率				
第62期	(期 首) 2018年9月18日	円 8,263	% —	451.5850	% —	% 97.1	% —
	9月末	8,359	1.2	455.6286	0.9	97.7	—
	10月末	8,200	△0.8	446.4447	△1.1	97.3	—
	11月末	8,266	0.0	451.1517	△0.1	97.6	—
	(期 末) 2018年12月17日	8,303	0.5	453.5550	0.4	97.3	—
第63期	(期 首) 2018年12月17日	8,248	—	453.5550	—	97.3	—
	12月末	8,153	△1.2	447.2109	△1.4	97.6	—
	2019年1月末	8,095	△1.9	447.5574	△1.3	97.4	—
	2月末	8,200	△0.6	452.7745	△0.2	97.6	—
	(期 末) 2019年3月15日	8,295	0.6	457.1926	0.8	97.2	—

(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

当作成期中の基準価額等の推移について (第62期～第63期：2018/9/19～2019/3/15)

基準価額の動き	基準価額は当作成期首に比べ1.1% (分配金再投資ベース) 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 (1.2%) を0.1%下回りました。



・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、ファンドの購入金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。

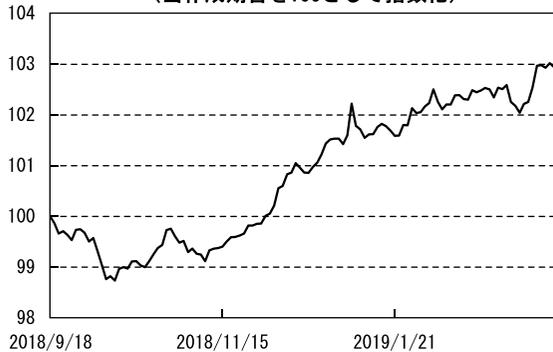
基準価額の変動要因

上昇要因	<ul style="list-style-type: none"> ・先進国の債券市況が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。 ・米国の堅調な景気認識や利上げなどから、米ドルが対円で買われたことが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	<ul style="list-style-type: none"> ・世界景気の減速懸念が高まったことなどから、ユーロが対円で売られたことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第62期～第63期：2018/9/19～2019/3/15)

債券市況の推移
(当作成期首を100として指数化)

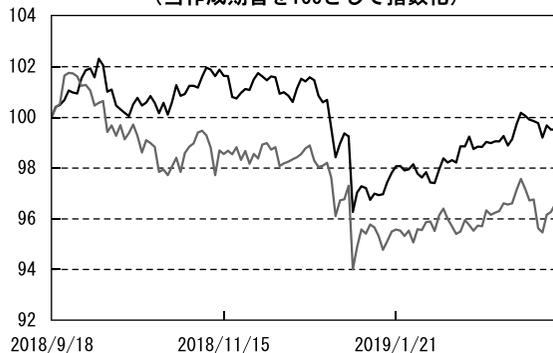


—FTSE世界国債インデックス(除く日本、Local)

◎債券市況

- ・先進国の債券市況は、米国の利上げ休止観測などが上昇要因となり、当作成期首との比較では上昇しました。

為替市況の推移
(当作成期首を100として指数化)



—為替レート(円・米ドル) —為替レート(円・ユーロ)

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、米国の堅調な景気認識や利上げなどから、当作成期首との比較では、米ドルは対円で上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、当作成期首との比較では、ユーロは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

i 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

<ワールド・インカムオープン>

- ・ワールド・インカムマザーファンドを主要投資対象とし、日本を除く世界主要国の国債等からなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。このため基準価額は、マザーファンドに組み入れられた資産の市況変動の影響を反映しています。

<ワールド・インカムマザーファンド>

基準価額は当作成期首に比べ1.6%の上昇となりました。

- ・日本を除く世界主要国の国債等を主要投資対象とし、これらからなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行いました。
- ・ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）とします。
- ・作成期を通じてベンチマークの動きを概ね捉えるべく、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。

(ご参考)

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

作成期首（2018年9月18日）

最終利回り	2.0%
直接利回り	2.9%
デュレーション	7.0年

作成期末（2019年3月15日）

最終利回り	1.7%
直接利回り	2.7%
デュレーション	7.1年



- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

(第62期～第63期：2018/9/19～2019/3/15)

i ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

<ワールド・インカムオープン>

ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

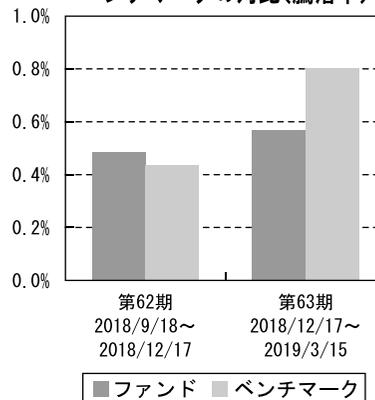
◎マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.6\%$ 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 0.4% 程度でした。

基準価額(ベビーファンド)とベンチマークの対比(騰落率)



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

<ワールド・インカムマザーファンド>

ベンチマークは 1.2% の上昇となったため、カイ離は 0.4% 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※

※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

分配金について

i 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

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62期	第63期
	2018年9月19日～2018年12月17日	2018年12月18日～2019年3月15日
当期分配金	55	55
（対基準価額比率）	0.662%	0.663%
当期の収益	36	36
当期の収益以外	18	19
翌期繰越分配対象額	164	145

（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。）

<ワールド・インカムオープン>

- ・ワールド・インカムマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、日本を除く世界主要国の国債等からなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行います。

<ワールド・インカムマザーファンド>

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・日本を除く世界主要国の国債等からなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2018年9月19日～2019年3月15日)

項 目	第62期～第63期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(22)	(0.263)	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)	(0.264)	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)	(0.026)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.021	(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)	(2)	(0.021)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	47	0.574	
作成期中の平均基準価額は、8,187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。

○売買及び取引の状況

(2018年9月19日～2019年3月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第62期～第63期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ワールド・インカムマザーファンド	千口 1,765	千円 3,076	千口 207,302	千円 361,505

○利害関係人との取引状況等

(2018年9月19日～2019年3月15日)

利害関係人との取引状況

<ワールド・インカムオープン>

該当事項はございません。

<ワールド・インカムマザーファンド>

区 分	第62期～第63期					
	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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	32	4	12.5	405	45	11.1

平均保有割合 100.0%

※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信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2019年3月15日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第61期末	第63期末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ワールド・インカムマザーファンド	2,142,111	1,936,575	3,428,512

○投資信託財産の構成

(2019年3月15日現在)

項 目	第63期末	
	評 価 額	比 率
ワールド・インカムマザーファンド	千円 3,428,512	% 99.0
コール・ローン等、その他	35,433	1.0
投資信託財産総額	3,463,945	100.0

(注) ワールド・インカム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 (3,414,742千円) の投資信託財産総額 (3,453,788千円) に対する比率は98.9%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=111.94円	1 カナダドル=83.98円	1 メキシコペソ=5.80円	1 ユーロ=126.50円
1 イギリスポンド=148.24円	1 スウェーデンクローネ=12.04円	1 ノルウェークローネ=13.05円	1 デンマーククローネ=16.95円
1 ポーランドズロチ=29.40円	1 オーストラリアドル=79.24円	1 シンガポールドル=82.58円	1 マレーシアリンギット=27.35円
1 南アフリカランド=7.70円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第62期末	第63期末
	2018年12月17日現在	2019年3月15日現在
(A) 資産	円 3,570,594,385	円 3,463,945,471
コール・ローン等	10,781,461	10,085,061
ワールド・インカムマザーファンド(評価額)	3,533,701,424	3,428,512,792
未収入金	26,111,500	25,347,618
(B) 負債	35,247,970	34,079,962
未払収益分配金	23,574,546	22,892,250
未払解約金	1,610,967	1,784,165
未払信託報酬	10,062,426	9,403,542
未払利息	19	5
その他未払費用	12	—
(C) 純資産総額(A-B)	3,535,346,415	3,429,865,509
元本	4,286,281,253	4,162,227,278
次期繰越損益金	△ 750,934,838	△ 732,361,769
(D) 受益権総口数	4,286,281,253口	4,162,227,278口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,248円	8,240円

○損益の状況

項 目	第62期		第63期	
	2018年9月19日～ 2018年12月17日		2018年12月18日～ 2019年3月15日	
	円		円	
(A) 配当等収益	△	826	△	575
受取利息		—		1
支払利息	△	826	△	576
(B) 有価証券売買損益		27,149,413		29,149,541
売買益		28,679,501		30,682,809
売買損	△	1,530,088	△	1,533,268
(C) 信託報酬等	△	10,062,451	△	9,403,554
(D) 当期損益金(A+B+C)		17,086,136		19,745,412
(E) 前期繰越損益金	△	727,547,820	△	704,847,184
(F) 追加信託差損益金	△	16,898,608	△	24,367,747
(配当等相当額)	(78,055,266)	(68,306,253)
(売買損益相当額)	(△	94,953,874)	(△	92,674,000)
(G) 計(D+E+F)	△	727,360,292	△	709,469,519
(H) 収益分配金	△	23,574,546	△	22,892,250
次期繰越損益金(G+H)	△	750,934,838	△	732,361,769
追加信託差損益金	△	24,613,914	△	32,275,979
(配当等相当額)	(70,342,008)	(60,400,660)
(売買損益相当額)	(△	94,955,922)	(△	92,676,639)
分配準備積立金		150,368		296,499
繰越損益金	△	726,471,292	△	700,382,289

(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 4,518,406,923円
 作成期中追加設定元本額 4,938,702円
 作成期中一部解約元本額 361,118,347円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8240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732,361,769円です。

③ 分配金の計算過程

項 目	2018年9月19日～ 2018年12月17日	2018年12月18日～ 2019年3月15日
費用控除後の配当等収益額	15,592,536円	15,134,595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	78,057,314円	68,308,892円
分配準備積立金額	417,072円	145,922円
当ファンドの分配対象収益額	94,066,922円	83,589,409円
1万口当たり収益分配対象額	219円	200円
1万口当たり分配金額	55円	55円
収益分配金金額	23,574,546円	22,892,250円

○分配金のお知らせ

	第62期	第63期
1 万口当たり分配金（税込み）	55円	55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。

※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。

【お知らせ】

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

ワールド・インカムマザーファンド

《第16期》決算日2018年9月18日

〔計算期間：2017年9月16日～2018年9月18日〕

「ワールド・インカムマザーファンド」は、9月18日に第16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16期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を除く世界主要国の国債等（投資適格債）を主要投資対象とし、日本を除く世界主要国の国債等からなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行います。ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）とします。運用の効率化を図るため、先物取引等を利用することができます。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	日本を除く世界主要国の国債等（投資適格債）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には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		F T S E 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス (除く日本、円ベース)		債 券 組 入 比 率 %	債 券 先 物 比 率 %	純 資 産 額 総
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%			百万円
12期(2014年9月16日)	16,700	13.8	431.4389	14.3	97.0	—	7,725
13期(2015年9月15日)	18,120	8.5	465.8262	8.0	96.2	—	6,589
14期(2016年9月15日)	16,072	△11.3	415.4638	△10.8	95.4	—	4,946
15期(2017年9月15日)	17,536	9.1	454.4485	9.4	95.7	—	4,457
16期(2018年9月18日)	17,421	△0.7	451.5850	△0.6	97.2	—	3,731

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(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		F T S E 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス (除く日本、円ベース)	騰 落 率	債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
	騰 落 率	騰 落 率						
(期 首) 2017年9月15日	円	%						
	17,536	—	454.4485	—	95.7	—	—	—
9月末	17,751	1.2	459.0498	1.0	96.2	—	—	—
10月末	17,756	1.3	459.2160	1.0	96.5	—	—	—
11月末	17,771	1.3	458.9704	1.0	95.9	—	—	—
12月末	17,992	2.6	464.6154	2.2	96.8	—	—	—
2018年1月末	17,547	0.1	453.8055	△0.1	96.3	—	—	—
2月末	17,096	△2.5	443.2113	△2.5	96.4	—	—	—
3月末	17,214	△1.8	445.8746	△1.9	96.7	—	—	—
4月末	17,419	△0.7	450.7869	△0.8	97.1	—	—	—
5月末	16,974	△3.2	439.0315	△3.4	97.5	—	—	—
6月末	17,223	△1.8	444.9739	△2.1	97.3	—	—	—
7月末	17,352	△1.0	448.9124	△1.2	97.5	—	—	—
8月末	17,342	△1.1	449.7333	△1.0	97.7	—	—	—
(期 末) 2018年9月18日	17,421	△0.7	451.5850	△0.6	97.2	—	—	—

(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

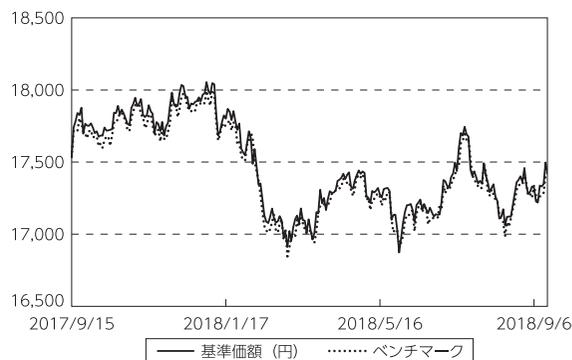
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.7%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(−0.6%)を0.1%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。

●投資環境について

◎債券市況

- ・先進国の債券市況は、イタリアの政局不安や米国の堅調な景気認識・利上げなどが下落要因となり、期首との比較では、下落しました。

◎為替市況

- ・円・米ドル相場は、米国の堅調な景気認識や利上げなどが上昇要因となり、期首との比較では、米ドルは対円で上昇しました。
- ・円・ユーロ相場は、イタリアの政局不安の高まりなどが下落要因となり、期首との比較では、ユーロは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

- ・日本を除く世界主要国の国債等を主要投資対象とし、これらからなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行いました。
- ・ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）とします。

- ・期を通じてベンチマークの動きを概ね捉えるべく、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[※]
※ 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)

- ・取引コスト要因

○今後の運用方針

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・日本を除く世界主要国の国債等からなる債券市場全体の動きを概ね捉えることをめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年9月16日～2018年9月18日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 7	% 0.041	(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 ）	(7)	(0.041)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	7	0.041	
期中の平均基準価額は、17,472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

(2017年9月16日～2018年9月18日)

公社債

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカドル 4,055	千アメリカドル 5,548
	カナダ	千カナダドル 50	千カナダドル 143
	メキシコ	千メキシコペソ 100	千メキシコペソ 620
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 332	729
	イタリア	国債証券 142	539
	フランス	国債証券 171	484
	オランダ	国債証券 10	173
	スペイン	国債証券 195	373
	ベルギー	国債証券 43	199
国	オーストリア	国債証券 78	152
	フィンランド	国債証券 —	12
	アイルランド	国債証券 58	139
	イギリス	千イギリスポンド 245	千イギリスポンド 592
	スイス	千スイスフラン —	千スイスフラン 42
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ —	千スウェーデンクローネ 400
	ノルウェー	千ノルウェークローネ —	千ノルウェークローネ 270
	デンマーク	千デンマーククローネ —	千デンマーククローネ 237
	ポーランド	千ポーランドズロチ 194	千ポーランドズロチ 318
	オーストラリア	千オーストラリアドル 42	千オーストラリアドル 161
	マレーシア	千マレーシアリングgit 48	千マレーシアリングgit 122
	南アフリカ	千南アフリカランド —	千南アフリカランド 187

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2017年9月16日～2018年9月18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 108	百万円 33	% 30.6	百万円 787	百万円 179	% 22.7

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、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2018年9月18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
アメリカ	千アメリカドル 14,760	千アメリカドル 14,590	千円 1,631,668	% 43.7	% —	% 17.0	% 19.7	% 7.1
カナダ	千カナダドル 750	千カナダドル 855	73,239	2.0	—	0.9	—	1.0
メキシコ	千メキシコペソ 4,880	千メキシコペソ 5,122	30,322	0.8	—	0.5	0.1	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	1,660	1,956	255,285	6.8	—	4.0	1.5	1.3
イタリア	2,260	2,613	341,023	9.1	—	5.5	2.6	1.0
フランス	2,330	2,949	384,918	10.3	—	6.8	2.0	1.6
オランダ	430	559	72,962	2.0	—	1.3	0.6	0.1
スペイン	1,360	1,653	215,793	5.8	—	4.0	1.7	—
ベルギー	520	666	86,957	2.3	—	2.0	0.3	—
オーストリア	320	435	56,856	1.5	—	1.5	—	—
フィンランド	140	175	22,879	0.6	—	0.6	—	—
アイルランド	200	231	30,149	0.8	—	0.4	0.4	—
イギリス	千イギリスポンド 1,200	千イギリスポンド 1,613	237,237	6.4	—	5.3	0.6	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 950	千スウェーデンクローネ 1,108	13,886	0.4	—	0.2	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 570	千ノルウェークローネ 591	8,082	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 960	千デンマーククローネ 1,241	21,711	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 660	千ポーランドズロチ 713	21,657	0.6	—	0.1	0.4	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 860	千オーストラリアドル 940	75,369	2.0	—	1.3	0.7	—
シンガポール	千シンガポールドル 150	千シンガポールドル 162	13,200	0.4	—	0.4	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 550	千マレーシアリンギット 551	14,878	0.4	—	0.4	0.0	0.0
南アフリカ	千南アフリカランド 3,150	千南アフリカランド 2,500	18,679	0.5	—	0.4	0.1	—
合計	—	—	3,626,760	97.2	—	53.1	31.3	12.8

(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	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		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 200331	1.125	200	195	21,828	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	300	292	32,697	2020/4/30
		1.25 T-NOTE 211031	1.25	150	142	15,975	2021/10/31
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	500	488	54,635	2020/5/31
		1.375 T-NOTE 200831	1.375	100	97	10,883	2020/8/31
		1.375 T-NOTE 210531	1.375	350	336	37,660	2021/5/31
		1.5 T-NOTE 200415	1.5	350	343	38,395	2020/4/15
		1.625 T-NOTE 191231	1.625	400	394	44,137	2019/12/31
		1.625 T-NOTE 220815	1.625	850	810	90,633	2022/8/15
		1.625 T-NOTE 221115	1.625	300	285	31,885	2022/11/15
		1.625 T-NOTE 230430	1.625	400	378	42,271	2023/4/30
		1.625 T-NOTE 230531	1.625	220	207	23,228	2023/5/31
		1.625 T-NOTE 260215	1.625	70	63	7,129	2026/2/15
		1.75 T-NOTE 201115	1.75	100	97	10,936	2020/11/15
		1.75 T-NOTE 230515	1.75	400	380	42,495	2023/5/15
		1.875 T-NOTE 220531	1.875	400	385	43,152	2022/5/31
		2 T-NOTE 200930	2.0	200	196	22,018	2020/9/30
		2 T-NOTE 210531	2.0	400	391	43,765	2021/5/31
		2 T-NOTE 210831	2.0	400	390	43,664	2021/8/31
		2 T-NOTE 211115	2.0	100	97	10,896	2021/11/15
		2 T-NOTE 220215	2.0	100	97	10,869	2022/2/15
		2 T-NOTE 230215	2.0	620	596	66,761	2023/2/15
		2 T-NOTE 250215	2.0	650	613	68,640	2025/2/15
		2 T-NOTE 261115	2.0	100	92	10,390	2026/11/15
		2.125 T-NOTE 210815	2.125	800	784	87,681	2021/8/15
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	150	142	15,929	2025/5/15
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	500	480	53,726	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 270215	2.25	520	491	54,980	2027/2/15
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	350	339	37,929	2024/8/15
		2.5 T-BOND 460215	2.5	290	255	28,622	2046/2/15
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	250	249	27,875	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	400	398	44,553	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	370	346	38,739	2042/8/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	200	198	22,196	2023/11/15
		3 T-BOND 420515	3.0	350	342	38,320	2042/5/15
		3 T-BOND 450515	3.0	280	273	30,539	2045/5/15
		3 T-BOND 480215	3.0	200	194	21,773	2048/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	100	99	11,161	2044/8/15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	300	302	33,826	2019/11/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	600	651	72,827	2044/2/15
3.625 T-NOTE 210215	3.625	400	407	45,556	2021/2/15		
3.75 T-BOND 410815	3.75	150	165	18,500	2041/8/15		
4.5 T-BOND 360215	4.5	60	71	8,033	2036/2/15		
5 T-BOND 370515	5.0	10	12	1,427	2037/5/15		
5.375 T-BOND 310215	5.375	70	86	9,726	2031/2/15		
6 T-BOND 260215	6.0	100	120	13,451	2026/2/15		
6.125 T-BOND 271115	6.125	350	437	48,934	2027/11/15		

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	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	6.25 T-BOND 230815	6.25	150	172	19,335	2023/8/15	
	6.5 T-BOND 261115	6.5	150	188	21,065	2026/11/15	
小 計					1,631,668		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	450	449	38,458	2019/9/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	10	12	1,048	2045/12/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	110	141	12,088	2041/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	100	139	11,937	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	80	113	9,706	2033/6/1	
	小 計					73,239	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	1,330	1,568	9,283	2036/11/20	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	700	673	3,988	2021/6/10	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	1,000	1,001	5,928	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	900	902	5,340	2023/12/7	
	8 MEXICAN BONOS 471107	8.0	100	98	583	2047/11/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	850	878	5,198	2029/5/31	
	小 計					30,322	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 260815	—	140	137	17,958	2026/8/15
		0 OBL 200417	—	60	60	7,904	2020/4/17
		0.5 BUND 250215	0.5	110	113	14,781	2025/2/15
		0.5 BUND 260215	0.5	80	82	10,705	2026/2/15
		1.25 BUND 480815	1.25	10	10	1,353	2048/8/15
		1.5 BUND 220904	1.5	100	107	13,989	2022/9/4
		1.75 BUND 220704	1.75	50	53	7,043	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	100	109	14,355	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	260	280	36,625	2022/1/4
		2.25 BUND 200904	2.25	150	158	20,657	2020/9/4
		2.5 BUND 440704	2.5	120	159	20,879	2044/7/4
		3 BUND 200704	3.0	150	159	20,836	2020/7/4
		4 BUND 370104	4.0	30	46	6,027	2037/1/4
		4.75 BUND 280704	4.75	60	85	11,112	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	50	79	10,437	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	90	158	20,701	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	40	63	8,290	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	60	89	11,623	2028/1/4
		イタリア	国債証券	1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	50	49
1.6 ITALY GOVT 260601	1.6			60	56	7,374	2026/6/1
2.7 ITALY GOVT 470301	2.7			70	61	8,046	2047/3/1
2.8 ITALY GOVT 670301	2.8			30	25	3,312	2067/3/1
3.25 ITALY GOVT 460901	3.25			20	19	2,534	2046/9/1
3.75 ITALY GOVT 210801	3.75			410	437	57,162	2021/8/1
4 ITALY GOVT 370201	4.0			80	88	11,574	2037/2/1
4.5 ITALY GOVT 200201	4.5			270	284	37,141	2020/2/1
4.5 ITALY GOVT 260301	4.5			40	45	5,944	2026/3/1
4.75 ITALY GOVT 230801	4.75			50	56	7,370	2023/8/1
5 ITALY GOVT 250301	5.0			50	58	7,581	2025/3/1
5 ITALY GOVT 340801	5.0			110	135	17,663	2034/8/1

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			
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
イタリア	国債証券	5 ITALY GOVT 400901	5.0	160	196	25,650	2040/9/1		
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	100	122	15,940	2029/11/1		
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	180	206	26,917	2022/11/1		
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	60	78	10,252	2031/5/1		
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	200	261	34,075	2027/11/1		
		7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	140	188	24,563	2026/11/1		
		9 ITALY GOVT 231101	9.0	180	240	31,448	2023/11/1		
		フランス	国債証券	0 O. A. T 220525	—	20	20	2,630	2022/5/25
				0.5 O. A. T 250525	0.5	40	40	5,301	2025/5/25
1.25 O. A. T 360525	1.25			80	79	10,399	2036/5/25		
1.5 O. A. T 310525	1.5			20	21	2,772	2031/5/25		
1.75 O. A. T 230525	1.75			50	54	7,075	2023/5/25		
2.5 O. A. T 300525	2.5			130	153	20,014	2030/5/25		
2.75 O. A. T 271025	2.75			70	83	10,884	2027/10/25		
3 O. A. T 220425	3.0			150	167	21,861	2022/4/25		
3.25 O. A. T 211025	3.25			50	55	7,249	2021/10/25		
3.25 O. A. T 450525	3.25			60	82	10,739	2045/5/25		
3.5 O. A. T 200425	3.5			50	53	6,943	2020/4/25		
3.5 O. A. T 260425	3.5			180	222	29,033	2026/4/25		
3.75 O. A. T 210425	3.75			120	132	17,348	2021/4/25		
4 O. A. T 550425	4.0			100	160	20,992	2055/4/25		
4.25 O. A. T 231025	4.25			150	182	23,831	2023/10/25		
4.5 O. A. T 410425	4.5			150	239	31,292	2041/4/25		
4.75 O. A. T 350425	4.75			50	77	10,092	2035/4/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5			70	103	13,565	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	90	146	19,082	2032/10/25				
6 O. A. T 251025	6.0	240	336	43,909	2025/10/25				
8.5 O. A. T 191025	8.5	360	395	51,680	2019/10/25				
8.5 O. A. T 230425	8.5	100	139	18,215	2023/4/25				
オランダ	国債証券	0.5 NETH GOVT 260715	0.5	60	60	7,947	2026/7/15		
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	20	21	2,804	2020/7/15		
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	150	175	22,954	2023/1/15		
		4 NETH GOVT 370115	4.0	130	198	25,884	2037/1/15		
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	70	102	13,371	2028/1/15		
スペイン	国債証券	0.75 SPAIN GOVT 210730	0.75	90	91	11,998	2021/7/30		
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	200	212	27,718	2026/4/30		
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	40	41	5,359	2030/7/30		
		3.45 SPAIN GOVT 660730	3.45	30	34	4,493	2066/7/30		
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	120	140	18,343	2024/4/30		
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	60	79	10,332	2037/1/31		
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	80	97	12,741	2024/1/31		
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	130	143	18,752	2020/10/31		
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	140	202	26,491	2040/7/30		
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	70	94	12,270	2028/10/31		
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	90	109	14,320	2023/1/31		
		5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	50	57	7,467	2021/4/30		
		5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	70	103	13,559	2032/7/30		
		5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	80	95	12,457	2022/1/31		
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	110	149	19,487	2026/7/30		

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	1 BEL GOVT 260622	1.0	120	124	16,267	2026/6/22
		2.25 BEL GOVT 570622	2.25	50	54	7,123	2057/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	50	56	7,436	2024/6/22
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	10	10	1,416	2020/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	60	70	9,239	2022/9/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	140	218	28,491	2035/3/28
オーストリア	国債証券	5.5 BEL GOVT 280328	5.5	90	130	16,982	2028/3/28
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	80	87	11,370	2023/10/20
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	110	165	21,578	2037/3/15
		4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	70	93	12,198	2026/3/15
フィンランド	国債証券	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	60	89	11,709	2027/7/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	140	175	22,879	2025/7/4
アイルランド	国債証券	2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	90	102	13,365	2030/5/15
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	100	117	15,330	2023/3/20
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	10	11	1,453	2020/10/18
小計						1,466,825	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	1.5 GILT 260722	1.5	50	50	7,438	2026/7/22
		1.75 GILT 220907	1.75	100	102	15,118	2022/9/7
		2 GILT 200722	2.0	100	102	15,019	2020/7/22
		2 GILT 250907	2.0	50	52	7,714	2025/9/7
		3.75 GILT 210907	3.75	50	54	7,963	2021/9/7
		4.25 GILT 271207	4.25	30	37	5,499	2027/12/7
		4.25 GILT 320607	4.25	30	39	5,799	2032/6/7
		4.25 GILT 360307	4.25	50	68	10,052	2036/3/7
		4.25 GILT 461207	4.25	20	30	4,455	2046/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	230	382	56,210	2055/12/7
		4.5 GILT 340907	4.5	50	69	10,158	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	120	181	26,625	2042/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	40	53	7,932	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	170	253	37,290	2038/12/7
	5 GILT 250307	5.0	110	135	19,959	2025/3/7	
小計						237,237	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	100	104	1,310	2026/11/12
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	200	229	2,878	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	450	511	6,408	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	140	195	2,445	2039/3/30
		5 SWD GOVT 201201	5.0	60	67	842	2020/12/1
小計						13,886	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 270217	1.75	120	119	1,628	2027/2/17
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	200	204	2,793	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	200	214	2,932	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	50	53	728	2021/5/25
小計						8,082	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	1.75 DMK GOVT 251115	1.75	300	334	5,848	2025/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	150	166	2,907	2021/11/15

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		
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券	4 DMK GOVT 191115	200	210	3,687	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	310	529	9,268	2039/11/15
小	計				21,711	
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	2.5 POLAND 270725	180	170	5,176	2027/7/25
		5.75 POLAND 220923	480	542	16,480	2022/9/23
小	計				21,657	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	2.75 AUST GOVT 240421	50	51	4,099	2024/4/21
		3.25 AUST GOVT 250421	110	115	9,261	2025/4/21
		3.25 AUST GOVT 290421	180	190	15,247	2029/4/21
		3.75 AUST GOVT 370421	110	122	9,827	2037/4/21
		4.25 AUST GOVT 260421	80	89	7,185	2026/4/21
		4.75 AUST GOVT 270421	30	35	2,806	2027/4/21
		5.75 AUST GOVT 210515	100	109	8,775	2021/5/15
		5.75 AUST GOVT 220715	200	226	18,166	2022/7/15
小	計				75,369	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	3.5 SINGAPOREGOVT 270301	150	162	13,200	2027/3/1
小	計				13,200	
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	4.059 MALAYSIAGOV 240930	100	100	2,704	2024/9/30
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	30	30	821	2021/7/15
		4.232MALAYSIAGOV 310630	100	97	2,625	2031/6/30
		4.378MALAYSIAGOV 191129	20	20	544	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	300	303	8,182	2026/4/15
小	計				14,878	
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	6.5 SOUTH AFRICA 410228	1,300	887	6,628	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	550	532	3,980	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	800	645	4,821	2031/2/28
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	500	434	3,248	2048/2/28
小	計				18,679	
合	計				3,626,760	

(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

(2018年9月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	3,626,760	96.4
コール・ローン等、その他	134,435	3.6
投資信託財産総額	3,761,195	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (3,718,923千円) の投資信託財産総額 (3,761,195千円) に対する比率は98.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=111.83円	1 カナダドル=85.65円	1 メキシコペソ=5.92円	1 ユーロ=130.51円
1 イギリスポンド=147.00円	1 スウェーデンクローネ=12.53円	1 ノルウェークローネ=13.67円	1 デンマーククローネ=17.49円
1 ポーランドズロチ=30.36円	1 オーストラリアドル=80.10円	1 シンガポールドル=81.37円	1 マレーシアリングギット=26.97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 (2018年9月18日現在)

○損益の状況 (2017年9月16日～2018年9月18日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,761,195,566
コール・ローン等	67,719,615
公社債(評価額)	3,626,760,793
未収入金	30,459,422
未収利息	35,974,778
前払費用	280,958
(B) 負債	29,387,573
未払解約金	29,387,500
未払利息	73
(C) 純資産総額(A-B)	3,731,807,993
元本	2,142,111,897
次期繰越損益金	1,589,696,096
(D) 受益権総口数	2,142,111,897口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,421円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	120,771,332
受取利息	120,853,510
支払利息	△ 82,178
(B) 有価証券売買損益	△ 143,973,797
売買益	38,343,473
売買損	△ 182,317,270
(C) 保管費用等	△ 1,670,649
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 24,873,114
(E) 前期繰越損益金	1,915,409,555
(F) 追加信託差損益金	772,956
(G) 解約差損益金	△ 301,613,301
(H) 計(D+E+F+G)	1,589,696,096
次期繰越損益金(H)	1,589,696,096

<注記事項>

- ①期首元本額 2,541,746,152円
 期中追加設定元本額 1,002,544円
 期中一部解約元本額 400,636,799円
 また、1口当たり純資産額は、期末17,421円です。

- (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) (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。

- 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)
 ワールド・インカムオープン 2,142,111,897円

【お 知 ら せ】

- ①当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
(2018年1月1日)
- ②使用指数名称の変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2018年2月8日)
- ③本資料内における旧シティ債券インデックスは、ブランド変更に伴い、F T S E 債券インデックスの名称に変更しています。