

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 | 外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびワールド・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 | ベビーファンド | 外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびワールド・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。 |
| | 外国債券インデックスマザーファンド | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。 |
| | ワールド・インカムマザーファンド | 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。 |
| | 外国債券インデックスマザーファンド | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |
| | ワールド・インカムマザーファンド | 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72期（決算日：2021年6月15日）

第73期（決算日：2021年9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9月15日に第73期の決算を行いましたので、法令に基づいて第72期～第73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。

○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) | 税金 | み騰落 | 中率 | 中率 | | | |
| | 円 | 円 | % | (除く日本、円ベース) | % | % | % | 百万円 |
| 64期(2019年6月17日) | 8,152 | 55 | △0.4 | 456.6167 | △0.1 | 98.1 | — | 3,284 |
| 65期(2019年9月17日) | 8,205 | 45 | 1.2 | 463.2907 | 1.5 | 97.4 | — | 3,259 |
| 66期(2019年12月16日) | 8,296 | 35 | 1.5 | 472.2174 | 1.9 | 97.9 | — | 3,235 |
| 67期(2020年3月16日) | 8,231 | 30 | △0.4 | 471.2654 | △0.2 | 97.6 | — | 3,071 |
| 68期(2020年6月15日) | 8,395 | 25 | 2.3 | 485.0698 | 2.9 | 97.6 | — | 3,085 |
| 69期(2020年9月15日) | 8,548 | 25 | 2.1 | 496.0173 | 2.3 | 97.7 | — | 3,065 |
| 70期(2020年12月15日) | 8,541 | 25 | 0.2 | 497.7819 | 0.4 | 97.6 | — | 2,967 |
| 71期(2021年3月15日) | 8,536 | 25 | 0.2 | 500.7871 | 0.6 | 97.5 | — | 2,861 |
| 72期(2021年6月15日) | 8,664 | 30 | 1.9 | 512.0090 | 2.2 | 97.7 | — | 2,854 |
| 73期(2021年9月15日) | 8,573 | 30 | △0.7 | 510.9640 | △0.2 | 97.7 | — | 2,765 |

(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72期 | (期 首) 2021年3月15日 | 円 8,536 | % - | 500.7871 | % - | % 97.5 | % - |
| | 3月末 | 8,557 | 0.2 | 501.1200 | 0.1 | 97.5 | - |
| | 4月末 | 8,545 | 0.1 | 502.9265 | 0.4 | 97.5 | - |
| | 5月末 | 8,652 | 1.4 | 510.4449 | 1.9 | 98.2 | - |
| | (期 末) 2021年6月15日 | 8,694 | 1.9 | 512.0090 | 2.2 | 97.7 | - |
| 第73期 | (期 首) 2021年6月15日 | 8,664 | - | 512.0090 | - | 97.7 | - |
| | 6月末 | 8,597 | △0.8 | 508.6618 | △0.7 | 97.7 | - |
| | 7月末 | 8,650 | △0.2 | 513.0811 | 0.2 | 97.6 | - |
| | 8月末 | 8,638 | △0.3 | 512.2887 | 0.1 | 97.8 | - |
| | (期 末) 2021年9月15日 | 8,603 | △0.7 | 510.9640 | △0.2 | 97.7 | - |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

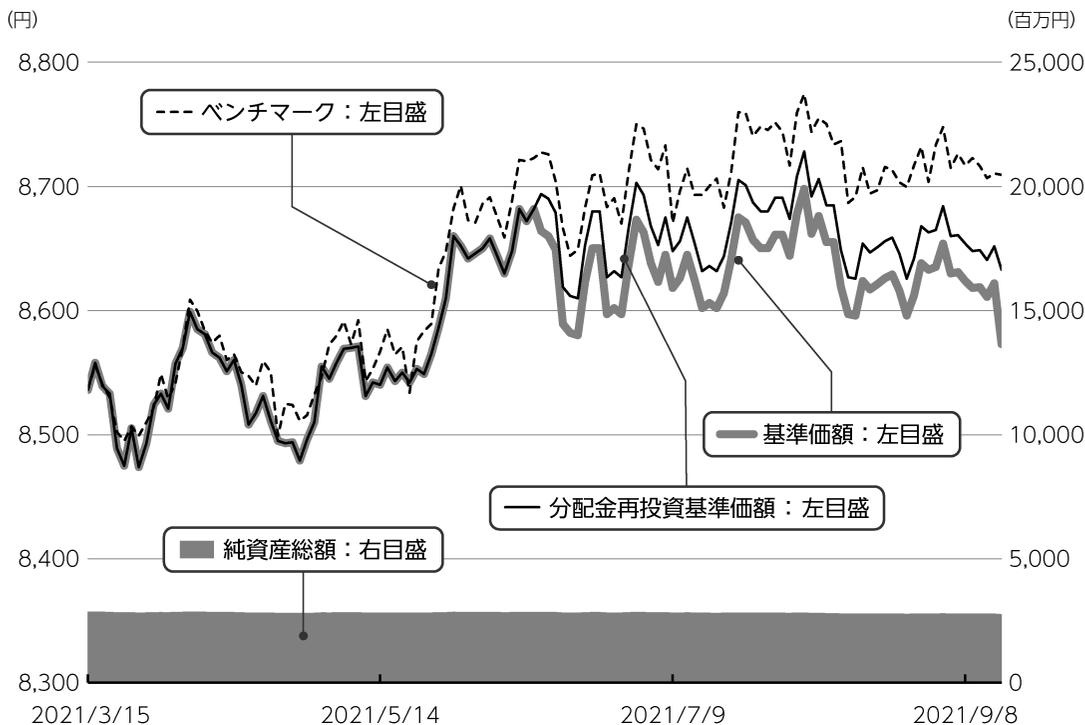
(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

運用経過

第72期～第73期：2021年3月16日～2021年9月15日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------|-------------|
| 第72期首 | 8,536円 |
| 第73期末 | 8,573円 |
| 既払分配金 | 60円 |
| 騰落率 | 1.1% |
| | (分配金再投資ベース) |

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ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（2.0%）を0.9%下回りました。

▶ 基準価額の主な変動要因

上昇要因

ベンチマークに概ね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72期～第73期：2021年3月16日～2021年9月15日

▶ 投資環境について

▶ 債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

先進国の債券市況は、新型コロナウイルス感染再拡大による景気の先行き懸念を背景とした金利低下等により、当作成期

首との比較では上昇しました。

▶ 為替市況

当作成期首に比べて米ドルは対円で上昇、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

▶ ワールド・インカムオープン

資産のほぼ全額をワールド・インカムマザーファンドに投資したことにより、基準価額（分配金再投資ベース）はワールド・インカムマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

当期は、投資対象に追加した外国債券インデックスマザーファンドの投資はありません。

※マザーファンドの入替えのため、外国債券インデックスマザーファンド受益証券を2021年6月15日に投資対象に追加し、ワールド・インカムマザーファンド受益証券を2021年12月15日に削除する予定です。

▶ ワールド・インカムマザーファンド

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、F T S E 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。

第72期～第73期：2021/3/16～2021/9/15

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ **ワールド・インカムオープン**

ベンチマークとの乖離は△0.9%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△0.6%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△0.3%程度でした。

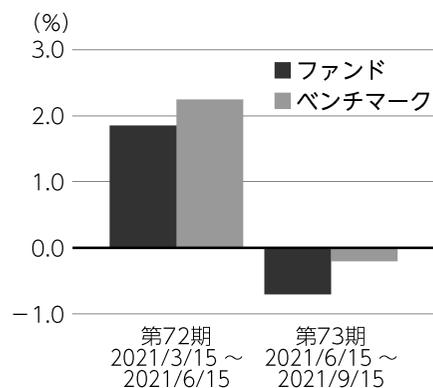
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ありません。

主なマイナス要因：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。

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。

▶ 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72期 2021年3月16日～2021年6月15日 | 第73期 2021年6月16日～2021年9月15日 |
|----------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 当期分配金（対基準価額比率） | 30 (0.345%) | 30 (0.349%) |
| 当期の収益 | 30 | 30 |
| 当期の収益以外 | - | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 196 | 197 |

(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

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

なお、マザーファンドの入替えに伴い、ベンチマークを2021年12月15日にF T S E世界国債インデックス（除く日本、

円換算ベース）に変更する予定です。

▶ 外国債券インデックスマザーファンド、ワールド・インカムマザーファンド

ベンチマークの動きに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

2021年3月16日～2021年9月15日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第72期～第73期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 50 | 0.582 | (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) | (24) | (0.277) | 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) | (24) | (0.277) | 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) | (0.028) | 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 | 0.026 | (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) | (0.026) | 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 | 52 | 0.608 | |

作成期中の平均基準価額は、8,597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。

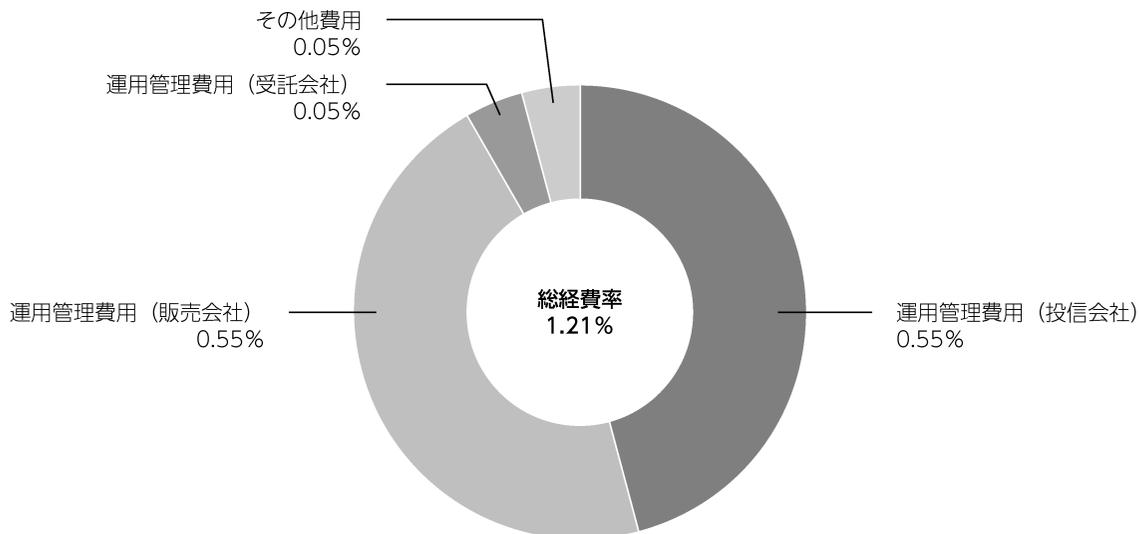
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.21%**です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

○売買及び取引の状況

(2021年3月16日～2021年9月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第72期～第73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 1,477 | 千円 2,893 | 千口 75,334 | 千円 147,933 |

○利害関係人との取引状況等

(2021年3月16日～2021年9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72期～第73期 | | | | | |
|--------|--------------------|---------------|------------|--------------------|---------------|------------|
| | 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 60 | 百万円 60 | % 100.0 | 百万円 211 | 百万円 211 | % 100.0 |

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銀行、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

(2021年9月15日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第71期末 | | 第73期末 | |
|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-------|
| | 口 数 | | 口 数 | |
| | | | | 評 価 額 |
| ワールド・インカムマザーファンド | 千口 1,476,382 | 千口 1,402,524 | 千円 2,763,955 | |

○投資信託財産の構成

(2021年9月15日現在)

| 項 目 | 第73期末 | |
|------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| ワールド・インカムマザーファンド | 千円 2,763,955 | % 99.1 |
| コール・ローン等、その他 | 25,161 | 0.9 |
| 投資信託財産総額 | 2,789,116 | 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(2,760,681千円)の投資信託財産総額(2,780,324千円)に対する比率は99.3%です。

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

| | | | |
|----------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|
| 1 アメリカドル=109.65円 | 1 カナダドル=86.36円 | 1 メキシコペソ=5.5095円 | 1 ユーロ=129.47円 |
| 1 イギリスポンド=151.39円 | 1 スウェーデンクローネ=12.73円 | 1 ノルウェークローネ=12.67円 | 1 デンマーククローネ=17.41円 |
| 1 ポーランドズロチ=28.4054円 | 1 オーストラリアドル=80.20円 | 1 シンガポールドル=81.58円 | 1 マレーシアリンギット=26.3284円 |
| 1 イスラエルシェケル=34.1493円 | | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第72期末 | 第73期末 |
|-----------------------|-----------------|-----------------|
| | 2021年6月15日現在 | 2021年9月15日現在 |
| (A) 資産 | 2,872,591,450 円 | 2,789,116,212 円 |
| コール・ローン等 | 8,674,328 | 8,859,588 |
| ワールド・インカムマザーファンド(評価額) | 2,853,331,089 | 2,763,955,873 |
| 未収入金 | 10,586,033 | 16,300,751 |
| (B) 負債 | 18,158,073 | 24,066,462 |
| 未払収益分配金 | 9,883,630 | 9,675,723 |
| 未払解約金 | 1,402 | 6,187,972 |
| 未払信託報酬 | 8,273,040 | 8,202,758 |
| 未払利息 | 1 | 9 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,854,433,377 | 2,765,049,750 |
| 元本 | 3,294,543,468 | 3,225,241,224 |
| 次期繰越損益金 | △ 440,110,091 | △ 460,191,474 |
| (D) 受益権総口数 | 3,294,543,468口 | 3,225,241,224口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8,664円 | 8,573円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第72期 | | 第73期 | |
|------------------|---------------------------|----|---------------------------|-----|
| | 2021年3月16日～ 2021年6月15日 | | 2021年6月16日～ 2021年9月15日 | |
| | | 円 | | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ | 89 | △ | 237 |
| 受取利息 | | — | | 8 |
| 支払利息 | △ | 89 | △ | 245 |
| (B) 有価証券売買損益 | 60,274,012 | | △ 11,458,163 | |
| 売買益 | 60,942,982 | | 146,988 | |
| 売買損 | △ 668,970 | | △ 11,605,151 | |
| (C) 信託報酬等 | △ 8,273,040 | | △ 8,202,758 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 52,000,883 | | △ 19,661,158 | |
| (E) 前期繰越損益金 | △447,181,435 | | △396,367,691 | |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 35,045,909 | | △ 34,486,902 | |
| (配当等相当額) | (40,272,439) | | (39,437,556) | |
| (売買損益相当額) | (△ 75,318,348) | | (△ 73,924,458) | |
| (G) 計(D+E+F) | △430,226,461 | | △450,515,751 | |
| (H) 収益分配金 | △ 9,883,630 | | △ 9,675,723 | |
| 次期繰越損益金(G+H) | △440,110,091 | | △460,191,474 | |
| 追加信託差損益金 | △ 35,045,909 | | △ 34,486,902 | |
| (配当等相当額) | (40,274,127) | | (39,439,463) | |
| (売買損益相当額) | (△ 75,320,036) | | (△ 73,926,365) | |
| 分配準備積立金 | 24,485,603 | | 24,203,800 | |
| 繰越損益金 | △429,549,785 | | △449,908,372 | |

(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 3,352,171,088円
 作成期中追加設定元本額 2,704,517円
 作成期中一部解約元本額 129,634,381円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8573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460,191,474円です。

③ 分配金の計算過程

| 項 目 | 2021年3月16日～ 2021年6月15日 | 2021年6月16日～ 2021年9月15日 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 16,124,669円 | 9,919,610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 | 40,274,127円 | 39,439,463円 |
| 分配準備積立金額 | 18,244,564円 | 23,959,913円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 74,643,360円 | 73,318,986円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 226円 | 227円 |
| 1万口当たり分配金額 | 30円 | 30円 |
| 収益分配金金額 | 9,883,630円 | 9,675,723円 |

○分配金のお知らせ

| | 第72期 | 第73期 |
|-----------------|------|------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 30円 | 30円 |

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

[お 知 ら せ]

投資の対象とするマザーファンド(外国債券インデックスマザーファンド受益証券)の追加および付随する変更のため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年6月15日)

ワールド・インカムマザーファンド

《第19期》決算日2021年9月15日

[計算期間：2020年9月16日～2021年9月15日]

「ワールド・インカムマザーファンド」は、9月15日に第19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19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 | | FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|------|-------------------------------|------|-------|--------|-------|
| | 期騰落 | 期中率 | 期騰落 | 期中率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 17期(2019年9月17日) | 17,948 | 3.0 | 463.2907 | 2.6 | 97.4 | — | 3,257 |
| 18期(2020年9月15日) | 19,177 | 6.8 | 496.0173 | 7.1 | 97.8 | — | 3,064 |
| 19期(2021年9月15日) | 19,707 | 2.8 | 510.9640 | 3.0 | 97.7 | — | 2,764 |

(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 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|---|-------|----------------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | |
| (期 首) 2020年9月15日 | 円 | % | 496.0173 | — | % | % |
| 9月末 | 19,177 | — | 494.8770 | △0.2 | 97.8 | — |
| 10月末 | 19,152 | △0.1 | 488.0379 | △1.6 | 98.2 | — |
| 11月末 | 18,867 | △1.6 | 493.2010 | △0.6 | 97.8 | — |
| 12月末 | 19,059 | △0.6 | 497.3313 | 0.3 | 97.9 | — |
| 2021年1月末 | 19,220 | 0.2 | 496.2129 | 0.0 | 97.5 | — |
| 2月末 | 19,193 | 0.1 | 494.1478 | △0.4 | 97.1 | — |
| 3月末 | 19,013 | △0.9 | 501.1200 | 1.0 | 97.3 | — |
| 4月末 | 19,429 | 1.3 | 502.9265 | 1.4 | 97.6 | — |
| 5月末 | 19,421 | 1.3 | 510.4449 | 2.9 | 97.5 | — |
| 6月末 | 19,684 | 2.6 | 508.6618 | 2.5 | 98.2 | — |
| 7月末 | 19,646 | 2.4 | 513.0811 | 3.4 | 97.7 | — |
| 8月末 | 19,784 | 3.2 | 512.2887 | 3.3 | 97.6 | — |
| (期 末) 2021年9月15日 | 19,777 | 3.1 | 510.9640 | 3.0 | 97.8 | — |
| | 19,707 | 2.8 | | | 97.7 | — |

(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2.8%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(3.0%)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)

ベンチマークに概ね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

- ・ 先進国の債券市況は下落しました。
- ・ 先進国の債券市況は、新型コロナウイルスのワクチン普及や経済正常化期待を背景とした金利上昇等により、期首との比較では下落しました。

◎ 為替市況

- ・ 期首に比べて米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 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：ありません。

主なマイナス要因：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。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに概ね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

(2020年9月16日～2021年9月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 9 | % 0.049 | (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 ） | (9) | (0.049) | 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 | 9 | 0.049 | |
| 期中の平均基準価額は、19,357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

(2020年9月16日～2021年9月15日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|---------|--------------------|--------------------|
| 外 | アメリカ | 千アメリカドル 5,706 | 千アメリカドル 6,242 |
| | カナダ | 千カナダドル 521 | 千カナダドル 574 |
| | メキシコ | 千メキシコペソ 878 | 千メキシコペソ 1,578 |
| | ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ドイツ | 国債証券 434 | 650 |
| | イタリア | 国債証券 297 | 333 |
| | フランス | 国債証券 486 | 812 |
| | オランダ | 国債証券 205 | 388 |
| | スペイン | 国債証券 187 | 435 |
| | ベルギー | 国債証券 118 | 201 |
| 国 | オーストリア | 国債証券 89 | 227 |
| | フィンランド | 国債証券 19 | 59 |
| | アイルランド | 国債証券 37 | 123 |
| | イギリス | 千イギリスポンド 234 | 千イギリスポンド 433 |
| | スウェーデン | 千スウェーデンクローネ 130 | 千スウェーデンクローネ 217 |
| | ノルウェー | 千ノルウェークローネ 109 | 千ノルウェークローネ 134 |
| | デンマーク | 千デンマーククローネ 78 | 千デンマーククローネ 138 |
| | ポーランド | 千ポーランドズロチ 108 | 千ポーランドズロチ 162 |
| | オーストラリア | 千オーストラリアドル 85 | 千オーストラリアドル 392 |
| | シンガポール | 千シンガポールドル 13 | 千シンガポールドル 23 |
| | マレーシア | 千マレーシアリングット - | 千マレーシアリングット 87 |
| | イスラエル | 千イスラエルシェケル 27 | 千イスラエルシェケル 22 |

(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

(2020年9月16日～2021年9月15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 102 | % 94.4 | 百万円 488 | 百万円 436 | % 89.3 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、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

(2021年9月15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 10,190 | 千アメリカドル 11,392 | 千円 1,249,201 | % 45.2 | % — | % 23.6 | % 21.6 | % — |
| カナダ | 千カナダドル 540 | 千カナダドル 622 | 53,739 | 1.9 | — | 0.8 | 1.1 | — |
| メキシコ | 千メキシコペソ 3,180 | 千メキシコペソ 3,554 | 19,585 | 0.7 | — | 0.4 | 0.3 | — |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 1,090 | 1,357 | 175,762 | 6.4 | — | 4.1 | 2.3 | — |
| イタリア | 1,660 | 2,090 | 270,683 | 9.8 | — | 5.9 | 2.6 | 1.2 |
| フランス | 1,530 | 2,042 | 264,448 | 9.6 | — | 7.1 | 2.5 | — |
| オランダ | 230 | 338 | 43,857 | 1.6 | — | 1.6 | — | — |
| スペイン | 1,010 | 1,276 | 165,225 | 6.0 | — | 3.4 | 2.3 | 0.4 |
| ベルギー | 360 | 520 | 67,351 | 2.4 | — | 2.0 | 0.5 | — |
| オーストリア | 260 | 334 | 43,304 | 1.6 | — | 0.9 | 0.7 | — |
| フィンランド | 160 | 181 | 23,526 | 0.9 | — | 0.2 | 0.7 | — |
| アイルランド | 150 | 183 | 23,752 | 0.9 | — | 0.9 | — | — |
| イギリス | 千イギリスポンド 770 | 千イギリスポンド 1,119 | 169,494 | 6.1 | — | 5.3 | 0.6 | 0.2 |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローネ 520 | 千スウェーデンクローネ 622 | 7,923 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 510 | 千ノルウェークローネ 525 | 6,655 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 570 | 千デンマーククローネ 788 | 13,726 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | — |
| ポーランド | 千ポーランドズロチ 510 | 千ポーランドズロチ 558 | 15,871 | 0.6 | — | 0.3 | 0.2 | 0.1 |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル 520 | 千オーストラリアドル 615 | 49,398 | 1.8 | — | 1.5 | 0.3 | — |
| シンガポール | 千シンガポールドル 130 | 千シンガポールドル 148 | 12,083 | 0.4 | — | 0.4 | — | — |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 460 | 千マレーシアリンギット 491 | 12,944 | 0.5 | — | 0.2 | 0.2 | — |
| イスラエル | 千イスラエルシェケル 300 | 千イスラエルシェケル 373 | 12,763 | 0.5 | — | 0.4 | — | 0.1 |
| 合 計 | — | — | 2,701,299 | 97.7 | — | 59.4 | 36.3 | 2.0 |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 銘柄 | 利率 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|---------|---------|-----------|------------|-------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | | 債 | |
| | | | | 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 | | | | | | |
| | 1.125 T-BOND 400515 | 1.125 | 290 | 261 | 28,636 | 2040/5/15 | |
| | 2 T-NOTE 250215 | 2.0 | 410 | 430 | 47,209 | 2025/2/15 | |
| | 2 T-NOTE 250815 | 2.0 | 1,510 | 1,591 | 174,561 | 2025/8/15 | |
| | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125 | 600 | 633 | 69,513 | 2025/5/15 | |
| | 2.25 T-NOTE 270215 | 2.25 | 840 | 902 | 98,920 | 2027/2/15 | |
| | 2.5 T-BOND 460215 | 2.5 | 200 | 226 | 24,821 | 2046/2/15 | |
| | 2.625 T-NOTE 290215 | 2.625 | 660 | 731 | 80,227 | 2029/2/15 | |
| | 2.75 T-BOND 420815 | 2.75 | 370 | 433 | 47,489 | 2042/8/15 | |
| | 2.75 T-NOTE 231115 | 2.75 | 2,640 | 2,781 | 305,001 | 2023/11/15 | |
| | 2.875 T-NOTE 280815 | 2.875 | 400 | 448 | 49,222 | 2028/8/15 | |
| | 3 T-BOND 420515 | 3.0 | 250 | 303 | 33,331 | 2042/5/15 | |
| | 3 T-BOND 450515 | 3.0 | 300 | 368 | 40,412 | 2045/5/15 | |
| | 3 T-BOND 480215 | 3.0 | 160 | 199 | 21,851 | 2048/2/15 | |
| | 3.125 T-BOND 440815 | 3.125 | 90 | 112 | 12,314 | 2044/8/15 | |
| | 3.5 T-BOND 390215 | 3.5 | 220 | 284 | 31,162 | 2039/2/15 | |
| | 3.625 T-BOND 440215 | 3.625 | 340 | 455 | 49,940 | 2044/2/15 | |
| | 5 T-BOND 370515 | 5.0 | 70 | 104 | 11,474 | 2037/5/15 | |
| | 5.375 T-BOND 310215 | 5.375 | 340 | 466 | 51,171 | 2031/2/15 | |
| | 6.125 T-BOND 271115 | 6.125 | 500 | 656 | 71,940 | 2027/11/15 | |
| 小計 | | | | | 1,249,201 | | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | | |
| | 国債証券 | | | | | | |
| | 2 CAN GOVT 511201 | 2.0 | 50 | 53 | 4,584 | 2051/12/1 | |
| | 2.25 CAN GOVT 240301 | 2.25 | 350 | 365 | 31,530 | 2024/3/1 | |
| | 3.5 CAN GOVT 451201 | 3.5 | 30 | 40 | 3,530 | 2045/12/1 | |
| | 5 CAN GOVT 370601 | 5.0 | 40 | 59 | 5,168 | 2037/6/1 | |
| | 5.75 CAN GOVT 330601 | 5.75 | 70 | 103 | 8,925 | 2033/6/1 | |
| 小計 | | | | | 53,739 | | |
| 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 | 950 | 1,183 | 6,520 | 2036/11/20 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 231207 | 8.0 | 1,280 | 1,336 | 7,364 | 2023/12/7 | |
| | 8 MEXICAN BONOS 471107 | 8.0 | 100 | 104 | 574 | 2047/11/7 | |
| | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5 | 850 | 930 | 5,125 | 2029/5/31 | |
| 小計 | | | | | 19,585 | | |
| ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | | | | | | |
| | 0 BUND 260815 | — | 140 | 144 | 18,734 | 2026/8/15 | |
| | 0 BUND 300215 | — | 210 | 218 | 28,266 | 2030/2/15 | |
| | 0.5 BUND 250215 | 0.5 | 110 | 114 | 14,851 | 2025/2/15 | |
| | 0.5 BUND 260215 | 0.5 | 140 | 147 | 19,099 | 2026/2/15 | |
| | 1.25 BUND 480815 | 1.25 | 70 | 91 | 11,813 | 2048/8/15 | |
| | 1.75 BUND 240215 | 1.75 | 80 | 84 | 10,991 | 2024/2/15 | |
| | 2.5 BUND 440704 | 2.5 | 100 | 157 | 20,376 | 2044/7/4 | |
| | 4 BUND 370104 | 4.0 | 10 | 16 | 2,136 | 2037/1/4 | |
| | 4.75 BUND 340704 | 4.75 | 70 | 116 | 15,051 | 2034/7/4 | |
| | 4.75 BUND 400704 | 4.75 | 70 | 134 | 17,437 | 2040/7/4 | |
| | 5.5 BUND 310104 | 5.5 | 30 | 47 | 6,097 | 2031/1/4 | |
| | 5.625 BUND 280104 | 5.625 | 60 | 84 | 10,903 | 2028/1/4 | |
| イタリア | 国債証券 | | | | | | |
| | 1.35 ITALY GOVT 300401 | 1.35 | 130 | 139 | 18,054 | 2030/4/1 | |

| 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 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| イタリア | 国債証券 | 1.6 ITALY GOVT 260601 | 1.6 | 60 | 64 | 8,371 | 2026/6/1 |
| | | 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2.45 | 10 | 11 | 1,529 | 2033/9/1 |
| | | 2.7 ITALY GOVT 470301 | 2.7 | 120 | 148 | 19,279 | 2047/3/1 |
| | | 2.8 ITALY GOVT 670301 | 2.8 | 30 | 36 | 4,736 | 2067/3/1 |
| | | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25 | 20 | 27 | 3,510 | 2046/9/1 |
| | | 3.75 ITALY GOVT 240901 | 3.75 | 180 | 201 | 26,111 | 2024/9/1 |
| | | 4 ITALY GOVT 370201 | 4.0 | 50 | 70 | 9,090 | 2037/2/1 |
| | | 4.75 ITALY GOVT 230801 | 4.75 | 130 | 142 | 18,490 | 2023/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 250301 | 5.0 | 150 | 177 | 22,964 | 2025/3/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 340801 | 5.0 | 80 | 119 | 15,485 | 2034/8/1 |
| | | 5 ITALY GOVT 400901 | 5.0 | 100 | 162 | 20,990 | 2040/9/1 |
| | | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25 | 100 | 138 | 17,992 | 2029/11/1 |
| | | 5.5 ITALY GOVT 221101 | 5.5 | 110 | 117 | 15,203 | 2022/11/1 |
| | | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75 | 40 | 61 | 7,992 | 2033/2/1 |
| 6 ITALY GOVT 310501 | 6.0 | 40 | 60 | 7,814 | 2031/5/1 | | |
| 6.5 ITALY GOVT 271101 | 6.5 | 110 | 152 | 19,736 | 2027/11/1 | | |
| 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25 | 100 | 137 | 17,778 | 2026/11/1 | | |
| 9 ITALY GOVT 231101 | 9.0 | 100 | 120 | 15,550 | 2023/11/1 | | |
| フランス | 国債証券 | 0 O. A. T 291125 | — | 60 | 61 | 7,901 | 2029/11/25 |
| | | 0.5 O. A. T 250525 | 0.5 | 70 | 72 | 9,439 | 2025/5/25 |
| | | 0.75 O. A. T 281125 | 0.75 | 30 | 32 | 4,186 | 2028/11/25 |
| | | 1.25 O. A. T 360525 | 1.25 | 60 | 68 | 8,869 | 2036/5/25 |
| | | 1.5 O. A. T 310525 | 1.5 | 80 | 92 | 11,956 | 2031/5/25 |
| | | 2.5 O. A. T 300525 | 2.5 | 120 | 148 | 19,207 | 2030/5/25 |
| | | 2.75 O. A. T 271025 | 2.75 | 220 | 263 | 34,118 | 2027/10/25 |
| | | 3.25 O. A. T 450525 | 3.25 | 110 | 175 | 22,754 | 2045/5/25 |
| | | 3.5 O. A. T 260425 | 3.5 | 170 | 202 | 26,165 | 2026/4/25 |
| | | 4 O. A. T 550425 | 4.0 | 90 | 175 | 22,721 | 2055/4/25 |
| | | 4.25 O. A. T 231025 | 4.25 | 130 | 143 | 18,602 | 2023/10/25 |
| | | 4.5 O. A. T 410425 | 4.5 | 110 | 194 | 25,149 | 2041/4/25 |
| | | 4.75 O. A. T 350425 | 4.75 | 40 | 64 | 8,399 | 2035/4/25 |
| | | 5.5 O. A. T 290425 | 5.5 | 70 | 101 | 13,117 | 2029/4/25 |
| 5.75 O. A. T 321025 | 5.75 | 80 | 131 | 17,009 | 2032/10/25 | | |
| 6 O. A. T 251025 | 6.0 | 90 | 114 | 14,848 | 2025/10/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | 0.25 NETH GOVT 290715 | 0.25 | 50 | 52 | 6,797 | 2029/7/15 |
| | | 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75 | 70 | 122 | 15,796 | 2042/1/15 |
| | | 4 NETH GOVT 370115 | 4.0 | 50 | 81 | 10,492 | 2037/1/15 |
| | | 5.5 NETH GOVT 280115 | 5.5 | 60 | 83 | 10,771 | 2028/1/15 |
| | | | | | | | |
| スペイン | 国債証券 | 1 SPAIN GOVT 501031 | 1.0 | 110 | 104 | 13,525 | 2050/10/31 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95 | 110 | 121 | 15,783 | 2026/4/30 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95 | 30 | 34 | 4,511 | 2030/7/30 |
| | | 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45 | 30 | 47 | 6,187 | 2066/7/30 |
| | | 3.8 SPAIN GOVT 240430 | 3.8 | 70 | 78 | 10,108 | 2024/4/30 |
| | | 4.2 SPAIN GOVT 370131 | 4.2 | 20 | 30 | 3,945 | 2037/1/31 |
| | | 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65 | 50 | 60 | 7,774 | 2025/7/30 |
| | | 4.8 SPAIN GOVT 240131 | 4.8 | 80 | 90 | 11,695 | 2024/1/31 |
| | | 4.9 SPAIN GOVT 400730 | 4.9 | 50 | 86 | 11,142 | 2040/7/30 |
| | | 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15 | 210 | 288 | 37,398 | 2028/10/31 |
| | | 5.4 SPAIN GOVT 230131 | 5.4 | 70 | 75 | 9,818 | 2023/1/31 |

| 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 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75 | 80 | 126 | 16,397 | 2032/7/30 |
| | | 5.9 SPAIN GOVT 260730 | 5.9 | 100 | 130 | 16,936 | 2026/7/30 |
| ベルギー | 国債証券 | 1 BEL GOVT 260622 | 1.0 | 40 | 43 | 5,567 | 2026/6/22 |
| | | 2.25 BEL GOVT 570622 | 2.25 | 20 | 28 | 3,736 | 2057/6/22 |
| | | 2.6 BEL GOVT 240622 | 2.6 | 50 | 54 | 7,070 | 2024/6/22 |
| | | 4.25 BEL GOVT 410328 | 4.25 | 60 | 102 | 13,244 | 2041/3/28 |
| | | 5 BEL GOVT 350328 | 5.0 | 100 | 165 | 21,441 | 2035/3/28 |
| | | 5.5 BEL GOVT 280328 | 5.5 | 90 | 125 | 16,291 | 2028/3/28 |
| オーストリア | 国債証券 | 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1.75 | 60 | 63 | 8,181 | 2023/10/20 |
| | | 2.1 AUSTRIA GOVT 170920 | 2.1 | 20 | 34 | 4,471 | 2117/9/20 |
| | | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 2.4 | 50 | 64 | 8,408 | 2034/5/23 |
| | | 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85 | 70 | 87 | 11,349 | 2026/3/15 |
| | | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25 | 60 | 84 | 10,892 | 2027/7/15 |
| フィンランド | 国債証券 | 0.125 FINNISH GOV 360415 | 0.125 | 40 | 40 | 5,182 | 2036/4/15 |
| | | 4 FINNISH GOVT 250704 | 4.0 | 120 | 141 | 18,344 | 2025/7/4 |
| アイルランド | 国債証券 | 1.7 IRISH GOVT 370515 | 1.7 | 20 | 24 | 3,134 | 2037/5/15 |
| | | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4 | 130 | 159 | 20,618 | 2030/5/15 |
| 小 計 | | | | | | 1,077,912 | |
| 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 | 10 | 10 | 1,598 | 2026/7/22 |
| | | 1.625 GILT 281022 | 1.625 | 80 | 86 | 13,069 | 2028/10/22 |
| | | 1.75 GILT 220907 | 1.75 | 40 | 40 | 6,156 | 2022/9/7 |
| | | 1.75 GILT 490122 | 1.75 | 60 | 70 | 10,607 | 2049/1/22 |
| | | 2 GILT 250907 | 2.0 | 20 | 21 | 3,234 | 2025/9/7 |
| | | 4.25 GILT 271207 | 4.25 | 40 | 49 | 7,468 | 2027/12/7 |
| | | 4.25 GILT 320607 | 4.25 | 20 | 27 | 4,117 | 2032/6/7 |
| | | 4.25 GILT 461207 | 4.25 | 40 | 68 | 10,340 | 2046/12/7 |
| | | 4.25 GILT 551207 | 4.25 | 140 | 272 | 41,188 | 2055/12/7 |
| | | 4.5 GILT 340907 | 4.5 | 60 | 86 | 13,162 | 2034/9/7 |
| | | 4.5 GILT 421207 | 4.5 | 90 | 149 | 22,651 | 2042/12/7 |
| | | 4.75 GILT 301207 | 4.75 | 20 | 27 | 4,138 | 2030/12/7 |
| | | 4.75 GILT 381207 | 4.75 | 80 | 128 | 19,425 | 2038/12/7 |
| | | 5 GILT 250307 | 5.0 | 70 | 81 | 12,332 | 2025/3/7 |
| 小 計 | | | | | | 169,494 | |
| 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 | 105 | 1,343 | 2026/11/12 |
| | | 2.5 SWD GOVT 250512 | 2.5 | 280 | 307 | 3,918 | 2025/5/12 |
| | | 3.5 SWD GOVT 390330 | 3.5 | 140 | 209 | 2,661 | 2039/3/30 |
| 小 計 | | | | | | 7,923 | |
| 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 | 1.375 NORWE GOVT 300819 | 1.375 | 170 | 170 | 2,163 | 2030/8/19 |
| | | 1.75 NORWE GOVT 270217 | 1.75 | 120 | 123 | 1,567 | 2027/2/17 |
| | | 2 NORWE GOVT 230524 | 2.0 | 20 | 20 | 259 | 2023/5/24 |
| | | 3 NORWE GOVT 240314 | 3.0 | 200 | 210 | 2,665 | 2024/3/14 |
| 小 計 | | | | | | 6,655 | |
| 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 | 330 | 360 | 6,283 | 2025/11/15 |
| | | 4.5 DMK GOVT 391115 | 4.5 | 240 | 427 | 7,443 | 2039/11/15 |
| 小 計 | | | | | | 13,726 | |

| 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 | | |
| ポーランド | 国債証券 | 2.5 POLAND 260725 | 2.5 | 140 | 148 | 4,209 | 2026/7/25 |
| | | 2.5 POLAND 270725 | 2.5 | 180 | 190 | 5,415 | 2027/7/25 |
| | | 5.75 POLAND 220923 | 5.75 | 110 | 116 | 3,307 | 2022/9/23 |
| | | 5.75 POLAND 290425 | 5.75 | 80 | 103 | 2,939 | 2029/4/25 |
| | | 小 計 | | | | 15,871 | |
| オーストラリア | 国債証券 | 1.75 AUST GOVT 510621 | 1.75 | 20 | 18 | 1,472 | 2051/6/21 |
| | | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 30 | 34 | 2,777 | 2035/6/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 250421 | 3.25 | 60 | 66 | 5,315 | 2025/4/21 |
| | | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 210 | 244 | 19,642 | 2029/4/21 |
| | | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 70 | 90 | 7,225 | 2037/4/21 |
| | | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 40 | 46 | 3,749 | 2026/4/21 |
| | | 4.5 AUST GOVT 330421 | 4.5 | 40 | 53 | 4,311 | 2033/4/21 |
| | | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 50 | 61 | 4,902 | 2027/4/21 |
| 小 計 | | | | 49,398 | | | |
| シンガポール | 国債証券 | 2.75 SINGAPORGV 460301 | 2.75 | 20 | 23 | 1,898 | 2046/3/1 |
| | | 3.5 SINGAPORGV 270301 | 3.5 | 110 | 124 | 10,185 | 2027/3/1 |
| | | 小 計 | | | | 12,083 | |
| マレーシア | 国債証券 | 3.733 MALAYSIAGO 280615 | 3.733 | 20 | 20 | 547 | 2028/6/15 |
| | | 4.232MALAYSIAGOV 310630 | 4.232 | 190 | 202 | 5,331 | 2031/6/30 |
| | | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 4.392 | 220 | 236 | 6,220 | 2026/4/15 |
| | | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 4.736 | 30 | 32 | 844 | 2046/3/15 |
| | | 小 計 | | | | 12,944 | |
| イスラエル | 国債証券 | 1.5 ISRAEL FIXED 370531 | 1.5 | 20 | 19 | 659 | 2037/5/31 |
| | | 3.75 ISRAEL FIXED 470331 | 3.75 | 50 | 65 | 2,240 | 2047/3/31 |
| | | 4.25 ISRAEL FIXED 230331 | 4.25 | 80 | 86 | 2,962 | 2023/3/31 |
| | | 6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 6.25 | 150 | 202 | 6,901 | 2026/10/30 |
| | | 小 計 | | | | 12,763 | |
| 合 計 | | | | 2,701,299 | | | |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2021年9月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 2,701,299 | % 97.2 |
| コール・ローン等、その他 | 79,025 | 2.8 |
| 投資信託財産総額 | 2,780,324 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (2,760,681千円) の投資信託財産総額 (2,780,324千円) に対する比率は99.3%です。

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

| | | | |
|----------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|
| 1 アメリカドル=109.65円 | 1 カナダドル=86.36円 | 1 メキシコペソ=5.5095円 | 1 ユーロ=129.47円 |
| 1 イギリスポンド=151.39円 | 1 スウェーデンクローネ=12.73円 | 1 ノルウェークローネ=12.67円 | 1 デンマーククローネ=17.41円 |
| 1 ポーランドズロチ=28.4054円 | 1 オーストラリアドル=80.20円 | 1 シンガポールドル=81.58円 | 1 マレーシアリンギット=26.3284円 |
| 1 イスラエルシェケル=34.1493円 | | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年9月15日現在)

○損益の状況 (2020年9月16日~2021年9月15日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 2,786,903,035 |
| コール・ローン等 | 37,028,186 |
| 公社債(評価額) | 2,701,299,091 |
| 未収入金 | 27,168,409 |
| 未収利息 | 20,350,121 |
| 前払費用 | 1,057,228 |
| (B) 負債 | 22,879,693 |
| 未払金 | 6,578,922 |
| 未払解約金 | 16,300,751 |
| 未払利息 | 20 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,764,023,342 |
| 元本 | 1,402,524,927 |
| 次期繰越損益金 | 1,361,498,415 |
| (D) 受益権総口数 | 1,402,524,927口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 19,707円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 73,592,666 |
| 受取利息 | 73,600,851 |
| 支払利息 | △ 8,185 |
| (B) 有価証券売買損益 | 4,781,258 |
| 売買益 | 128,182,164 |
| 売買損 | △ 123,400,906 |
| (C) 保管費用等 | △ 1,415,991 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 76,957,933 |
| (E) 前期繰越損益金 | 1,466,677,120 |
| (F) 追加信託差損益金 | 2,140,051 |
| (G) 解約差損益金 | △ 184,276,689 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 1,361,498,415 |
| 次期繰越損益金(H) | 1,361,498,415 |

<注記事項>

①期首元本額 1,598,133,055円
 期中追加設定元本額 2,258,963円
 期中一部解約元本額 197,867,091円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9707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)

ワールド・インカムオープン 1,402,524,927円

[お知らせ]

信託契約を解約し、信託を終了させる場合を追加するため、信託約款に所要の変更を行いました。

(2021年4月3日)