

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（2010年10月29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実質的な投資を行い、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）に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。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。実質的な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	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	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div>		

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド



第10期（決算日：2020年1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「三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド」は、去る1月27日に第10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5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			J P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)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額	
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落				中 率
	円		円		円	円	%	%	百万円	
6期(2016年1月26日)	10,923		0		△19.4	26,826.64	△18.3	95.9	—	1,651
7期(2017年1月26日)	11,927		0		9.2	29,442.31	9.8	96.1	—	2,768
8期(2018年1月26日)	13,562		0		13.7	34,033.56	15.6	96.7	—	4,497
9期(2019年1月28日)	12,356		0		△8.9	31,268.09	△8.1	96.7	—	5,893
10期(2020年1月27日)	13,371		0		8.2	34,193.00	9.4	97.4	—	10,457

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年 1 月 28 日	円 12,356	% —	31,268.09	% —	% 96.7	% —
1 月 末	12,397	0.3	31,235.67	△0.1	96.5	—
2 月 末	12,664	2.5	32,082.90	2.6	96.4	—
3 月 末	12,446	0.7	31,500.96	0.7	95.5	—
4 月 末	12,487	1.1	31,730.84	1.5	95.9	—
5 月 末	12,168	△1.5	31,075.08	△0.6	96.4	—
6 月 末	12,712	2.9	32,298.63	3.3	95.5	—
7 月 末	12,931	4.7	32,890.36	5.2	97.0	—
8 月 末	12,309	△0.4	31,345.95	0.2	97.4	—
9 月 末	12,638	2.3	32,274.60	3.2	97.3	—
10 月 末	13,117	6.2	33,390.89	6.8	97.1	—
11 月 末	12,923	4.6	32,946.41	5.4	97.0	—
12 月 末	13,416	8.6	34,229.09	9.5	96.7	—
(期 末) 2020年 1 月 27 日	13,371	8.2	34,193.00	9.4	97.4	—

(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。

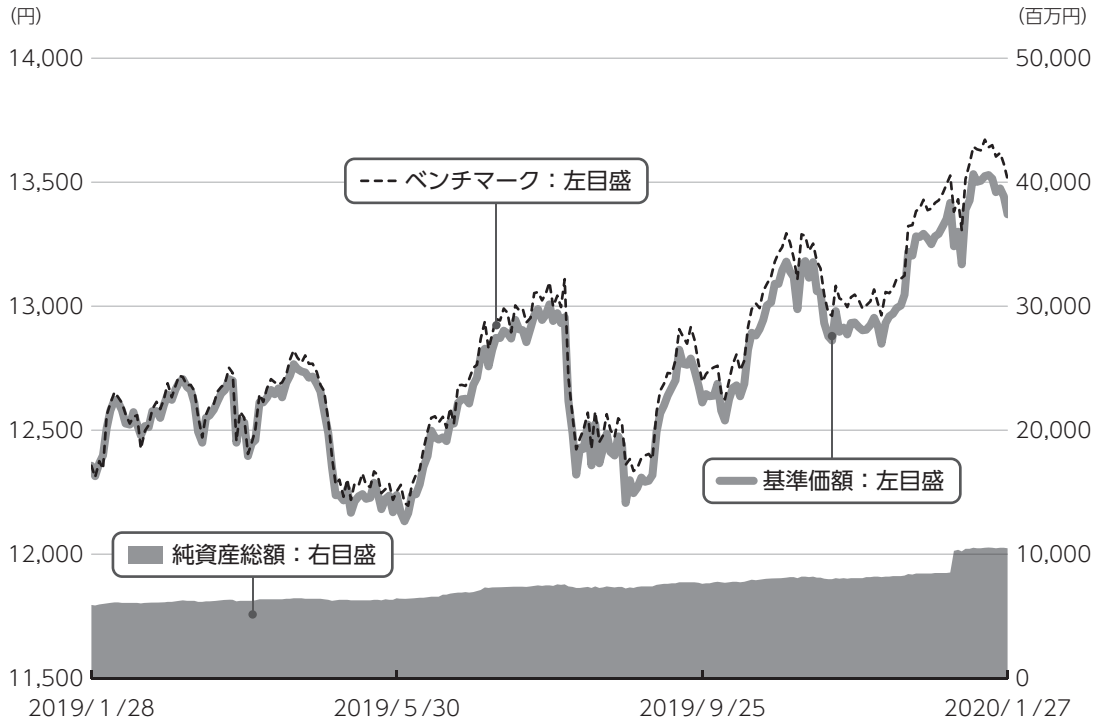
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第10期：2019年1月29日～2020年1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10期首	12,356円
第10期末	13,371円
既払分配金	0円
騰落率	8.2%

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

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

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ8.2%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（9.4%）を1.2%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10期：2019年1月29日～2020年1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、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首に比べて上昇しました。

▶ 為替市況

世界景気の減速懸念が高まったことなどから、多くの新興国通貨は対円で売られました。特にデフォルト懸念が再燃したアルゼンチンペソなどが対円で大きく下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド

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。

期を通じて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

▶ 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド

ベンチマークとの乖離は△1.2%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

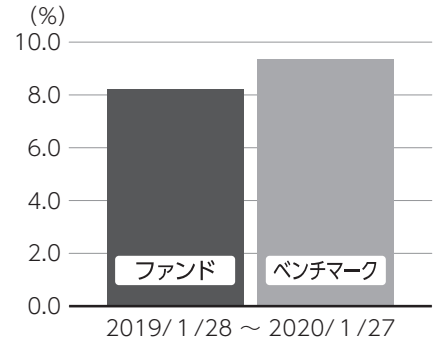
マザーファンド保有による影響は△0.6%程度でした。

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：ポートフォリオ要因によるものです。

基準価額 (ベビーファンド) と ベンチマークの対比 (騰落率)



分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第10期 2019年1月29日～2020年1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	6,732

(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。)

▶ 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド

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。

2019年1月29日～2020年1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	69	0.541	(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)	(32)	(0.250)	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)	(32)	(0.250)	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)	(5)	(0.041)	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	13	0.099	(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)	(12)	(0.091)	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)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	82	0.640	

期中の平均基準価額は、12,726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。

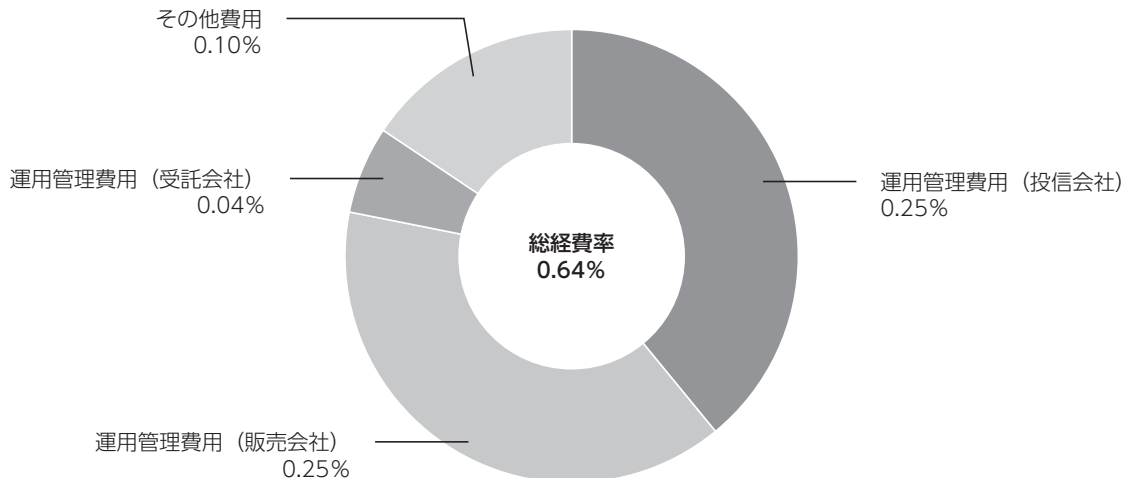
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.64%**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

(2019年1月29日～2020年1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 3,048,170	千円 4,261,215	千口 246,081	千円 335,827

○利害関係人との取引状況等

(2019年1月29日～2020年1月27日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド>

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			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 3,894	% 27.0	百万円 6,509	百万円 1,538	% 23.6	

平均保有割合 30.5%

※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

(2020年1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 4,445,715		千口 7,247,804	千円 10,454,233

○投資信託財産の構成

(2020年1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 10,454,233	% 99.4
コール・ローン等、その他	57,899	0.6
投資信託財産総額	10,512,132	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(30,487,031千円)の投資信託財産総額(30,590,151千円)に対する比率は99.7%です。

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

1 アメリカドル=109.06円	1 アルゼンチンペソ=1.81円	1 メキシコペソ=5.79円	1 ブラジルリアル=26.07円
100チリペソ=14.02円	100コロンビアペソ=3.24円	1ペルーヌエボソル=32.80円	1ウルグアイペソ=2.93円
1ドミニカペソ=2.05円	1トルコリラ=18.34円	1チェココルナ=4.78円	100ハンガリーフォリント=35.76円
1ポーランドズロチ=28.27円	1ロシアルーブル=1.75円	1ルーマニアレイ=25.16円	1マレーシアリングgit=26.87円
1タイバーツ=3.55円	1フィリピンペソ=2.15円	100インドネシアルピア=0.81円	1南アフリカランド=7.56円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,512,132,296
コール・ローン等	57,898,624
新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)	10,454,233,672
(B) 負債	54,845,253
未払解約金	33,111,583
未払信託報酬	21,572,270
未払利息	25
その他未払費用	161,375
(C) 純資産総額(A-B)	10,457,287,043
元本	7,820,777,870
次期繰越損益金	2,636,509,173
(D) 受益権総口数	7,820,777,870口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,371円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,770,258,027円
 期中追加設定元本額 4,158,509,207円
 期中一部解約元本額 1,107,989,364円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,371円です。

②分配金の計算過程

項 目	2019年1月29日～ 2020年1月27日
費用控除後の配当等収益額	402,320,239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	4,324,886,384円
分配準備積立金額	538,298,105円
当ファンドの分配対象収益額	5,265,504,728円
1万口当たり収益分配対象額	6,732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 (2019年1月29日～2020年1月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 10,691
受取利息	101
支払利息	△ 10,792
(B) 有価証券売買損益	600,212,231
売買益	648,879,335
売買損	△ 48,667,104
(C) 信託報酬等	△ 39,927,898
(D) 当期損益金(A+B+C)	560,273,642
(E) 前期繰越損益金	△ 2,515,680
(F) 追加信託差損益金	2,078,751,211
(配当等相当額)	(4,299,310,511)
(売買損益相当額)	(△2,220,559,300)
(G) 計(D+E+F)	2,636,509,173
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	2,636,509,173
追加信託差損益金	2,078,751,211
(配当等相当額)	(4,324,886,384)
(売買損益相当額)	(△2,246,135,173)
分配準備積立金	940,618,344
繰越損益金	△ 382,860,382

- (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。

【お知らせ】

信託報酬率の引き下げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2019年12月26日)

新興国債券インデックスマザーファンド

《第10期》決算日2020年1月27日

[計算期間：2019年1月29日～2020年1月27日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月27日に第10期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックス（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。
主要運用対象	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	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 百 万 円
	円	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %			
6期(2016年1月26日)	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	95.9	—	9,861
7期(2017年1月26日)	12,647	9.8	29,442.31	9.8	96.1	—	12,443
8期(2018年1月26日)	14,464	14.4	34,033.56	15.6	96.7	—	16,676
9期(2019年1月28日)	13,254	△8.4	31,268.09	△8.1	96.7	—	20,421
10期(2020年1月27日)	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4	—	30,520

(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。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		J P モ ル ガ ン G B I - E M グ ロー バ ル ・ ダ イ バ ー シ フ ァ イ ド (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2019年 1 月 28 日	円	%		%	%	%
	13,254	—	31,268.09	—	96.7	—
1 月 末	13,299	0.3	31,235.67	△0.1	96.5	—
2 月 末	13,591	2.5	32,082.90	2.6	96.4	—
3 月 末	13,363	0.8	31,500.96	0.7	95.5	—
4 月 末	13,413	1.2	31,730.84	1.5	95.9	—
5 月 末	13,078	△1.3	31,075.08	△0.6	96.4	—
6 月 末	13,669	3.1	32,298.63	3.3	95.5	—
7 月 末	13,911	5.0	32,890.36	5.2	97.0	—
8 月 末	13,249	△0.0	31,345.95	0.2	97.5	—
9 月 末	13,609	2.7	32,274.60	3.2	97.3	—
10 月 末	14,133	6.6	33,390.89	6.8	97.1	—
11 月 末	13,930	5.1	32,946.41	5.4	97.0	—
12 月 末	14,468	9.2	34,229.09	9.5	96.7	—
(期 末) 2020年 1 月 27 日	14,424	8.8	34,193.00	9.4	97.4	—

(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8.8%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(9.4%)を0.6%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上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、世界景気の減速懸念が高まったことなどから、期首に比べて上昇しました。

◎ 為替市況

世界景気の減速懸念が高まったことなどから、多くの新興国通貨は対円で売られました。特にデフォルト懸念が再燃したアルゼンチンペソなどが対円で大きく下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 新興国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。
- ・ 期を通じて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9.4%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.6\%$ 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)

- ・ ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ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

(2019年1月29日～2020年1月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 13	% 0.095	(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 ）	(12)	(0.090)	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 ）	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	13	0.095	
期中の平均基準価額は、13,689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

(2019年1月29日～2020年1月27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 14,430	百万円 3,894	% 27.0	百万円 6,509	百万円 1,538	% 23.6

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

(2020年1月27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 493,200	千メキシコペソ 524,481	千円 3,036,748	% 9.9	% —	% 5.1	% 3.6	% 1.2
ブラジル	千ブラジルレアル 110,170	千ブラジルレアル 112,940	2,944,361	9.6	9.6	2.3	5.2	2.2
チリ	千チリペソ 4,960,000	千チリペソ 5,784,730	811,019	2.7	—	2.2	—	0.4
コロンビア	千コロンビアペソ 51,580,000	千コロンビアペソ 56,093,000	1,817,413	6.0	—	4.0	1.9	0.1
ペルー	千ペルーヌエボソル 27,000	千ペルーヌエボソル 31,946	1,047,844	3.4	—	3.3	0.2	—
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 15,200	千ウルグアイペソ 14,368	42,099	0.1	—	0.1	0.1	—
ドミニカ	千ドミニカペソ 24,000	千ドミニカペソ 24,521	50,268	0.2	0.2	0.1	0.1	—
トルコ	千トルコリラ 62,500	千トルコリラ 63,367	1,162,157	3.8	3.8	1.4	1.8	0.6
チェコ	千チェココルナ 224,700	千チェココルナ 231,069	1,104,510	3.6	—	2.3	1.1	0.2
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 2,667,000	千ハンガリーフォリント 3,063,090	1,095,361	3.6	—	2.0	1.6	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 90,100	千ポーランドズロチ 93,290	2,637,316	8.6	—	3.3	3.9	1.5
ロシア	千ロシアルーブル 1,397,900	千ロシアルーブル 1,510,464	2,643,313	8.7	—	4.5	3.2	1.0
ルーマニア	千ルーマニアレイ 29,660	千ルーマニアレイ 30,646	771,059	2.5	—	1.0	1.1	0.4
マレーシア	千マレーシアリンギット 66,220	千マレーシアリンギット 69,614	1,870,544	6.1	—	3.6	1.8	0.8
タイ	千タイバーツ 698,400	千タイバーツ 792,182	2,812,249	9.2	—	6.1	2.6	0.5
フィリピン	千フィリピンペソ 20,000	千フィリピンペソ 24,460	52,591	0.2	—	0.2	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 362,770,000	千インドネシアルピア 389,142,879	3,152,057	10.3	—	7.3	2.4	0.6
南アフリカ	千南アフリカランド 388,300	千南アフリカランド 355,655	2,688,755	8.8	—	8.0	0.7	0.1
合 計	—	—	29,739,673	97.4	13.6	56.9	31.0	9.6

(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		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券						
		10.0	45,900	52,150	301,949	2024/12/5	
		10.0	14,700	19,082	110,485	2036/11/20	
		5.75	28,200	26,820	155,290	2026/3/5	
		6.5	26,900	26,821	155,294	2021/6/10	
		6.5	54,200	53,968	312,474	2022/6/9	
		7.25	38,000	38,391	222,288	2021/12/9	
		7.5	46,200	48,154	278,815	2027/6/3	
		7.75	24,300	26,007	150,582	2031/5/29	
		7.75	15,400	16,594	96,082	2034/11/23	
		7.75	31,900	34,279	198,479	2042/11/13	
		8.0	57,300	59,767	346,052	2023/12/7	
		8.0	21,000	22,070	127,789	2024/9/5	
		8.0	23,300	25,888	149,893	2047/11/7	
		8.5	40,200	44,901	259,981	2029/5/31	
		8.5	25,700	29,583	171,287	2038/11/18	
小計					3,036,748		
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	16,170	19,286	502,794	2027/1/1	
		10.0	13,100	15,224	396,894	2025/1/1	
		10.0	6,100	7,440	193,973	2029/1/1	
		10.0	20,100	22,575	588,546	2023/1/1	
		—	9,800	9,189	239,570	2021/7/1	
		—	17,800	16,209	422,570	2022/1/1	
		—	11,500	10,154	264,719	2022/7/1	
		—	15,600	12,861	335,292	2023/7/1	
小計					2,944,361		
チリ			千チリペソ	千チリペソ			
	国債証券						
		4.5	870,000	910,585	127,664	2021/3/1	
		4.5	1,200,000	1,329,932	186,456	2026/3/1	
		4.7	1,000,000	1,140,850	159,947	2030/9/1	
		5.0	1,000,000	1,193,185	167,284	2035/3/1	
		6.0	890,000	1,210,177	169,666	2043/1/1	
小計					811,019		
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	6,200,000	7,401,790	239,817	2024/7/24	
		4.375	1,680,000	1,646,884	53,359	2023/3/21	
		6.0	7,280,000	7,414,307	240,223	2028/4/28	
		6.25	5,190,000	5,408,641	175,239	2025/11/26	
		7.0	8,010,000	8,396,023	272,031	2022/5/4	
		7.0	6,000,000	6,484,364	210,093	2032/6/30	
		7.25	2,300,000	2,520,991	81,680	2034/10/18	
		7.5	7,770,000	8,619,619	279,275	2026/8/26	
		7.75	1,000,000	1,030,514	33,388	2021/4/14	
		7.75	4,860,000	5,536,317	179,376	2030/9/18	

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 9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,633,546	52,926	2027/6/28
小	計				1,817,413	
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 5.4 PERU 340812	5.4	2,600	2,780	91,188	2034/8/12
	5.7 PERU 240812	5.7	1,300	1,459	47,856	2024/8/12
	5.94 PERU 290212	5.94	3,700	4,212	138,180	2029/2/12
	6.15 PERU 320812	6.15	2,800	3,222	105,714	2032/8/12
	6.35 PERU 280812	6.35	3,900	4,558	149,531	2028/8/12
	6.9 PERU 370812	6.9	3,800	4,664	152,992	2037/8/12
	6.95 PERU 310812	6.95	5,700	6,966	228,495	2031/8/12
	8.2 PERU 260812	8.2	3,200	4,081	133,884	2026/8/12
小	計				1,047,844	
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 8.5 URUGUAY (GL) 280315	8.5	7,000	6,230	18,253	2028/3/15
	9.875 URUGUAY (GL) 220620	9.875	8,200	8,138	23,845	2022/6/20
小	計				42,099	
ドミニカ			千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
	国債証券 8.9 DOMINICAN 230215	8.9	8,000	8,029	16,460	2023/2/15
	9.75 DOMINICAN 260605	9.75	16,000	16,492	33,808	2026/6/5
小	計				50,268	
トルコ			千トルコリラ	千トルコリラ		
	国債証券 10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	2,400	2,428	44,544	2024/3/20
	10.5 TURKEY GOVT 270811	10.5	5,900	6,026	110,532	2027/8/11
	10.6 TURKEY GOVT 260211	10.6	6,200	6,336	116,209	2026/2/11
	10.7 TURKEY GOVT 210217	10.7	3,300	3,339	61,248	2021/2/17
	10.7 TURKEY GOVT 220817	10.7	3,800	3,879	71,155	2022/8/17
	11 TURKEY GOVT 220302	11.0	4,400	4,494	82,430	2022/3/2
	11 TURKEY GOVT 270224	11.0	3,300	3,438	63,063	2027/2/24
	12.2 TURKEY GOVT 230118	12.2	4,600	4,885	89,594	2023/1/18
	12.4 TURKEY GOVT 280308	12.4	3,100	3,489	63,989	2028/3/8
	16.2 TURKEY GOVT 230614	16.2	2,800	3,295	60,441	2023/6/14
	7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	4,900	4,534	83,170	2023/3/8
	8 TURKEY GOVT 250312	8.0	4,000	3,668	67,274	2025/3/12
	8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	4,200	4,086	74,948	2022/9/14
	9 TURKEY GOVT 240724	9.0	3,100	2,997	54,977	2024/7/24
	9.2 TURKEY GOVT 210922	9.2	4,200	4,176	76,604	2021/9/22
	9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	2,300	2,288	41,971	2022/1/12
小	計				1,162,157	
チェコ			千チェココルナ	千チェココルナ		
	国債証券 0.25 CZECH REPUB 270210	0.25	19,500	17,865	85,394	2027/2/10
	0.45 CZECH REPUB 231025	0.45	24,400	23,458	112,133	2023/10/25
	0.95 CZECH REPUB 300515	0.95	25,200	23,807	113,800	2030/5/15
	1 CZECH REPUBLIC 260626	1.0	25,300	24,574	117,466	2026/6/26
	2.4 CZECH REPUBLIC 250917	2.4	26,800	27,968	133,689	2025/9/17
	2.5 CZECH REPUBLIC 280825	2.5	28,000	30,106	143,906	2028/8/25

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	
チェコ			%	千チェココルナ	千チェココルナ	千円	
国債証券	2.75 CZECH REPUBL 290723	2.75	23,000	25,408	121,452	2029/7/23	
	3.85 CZECH REPUBL 210929	3.85	13,600	14,083	67,318	2021/9/29	
	4.7 CZECH REPUBLI 220912	4.7	20,400	22,033	105,317	2022/9/12	
	5.7 CZECH REPUBLI 240525	5.7	18,500	21,763	104,029	2024/5/25	
小 計					1,104,510		
ハンガリー				千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
国債証券	1.75 HUNGARY 221026	1.75	307,000	318,166	113,776	2022/10/26	
	2.5 HUNGARY 211027	2.5	40,000	41,692	14,909	2021/10/27	
	2.75 HUNGARY 261222	2.75	243,000	261,639	93,562	2026/12/22	
	3 HUNGARY 240626	3.0	329,000	359,695	128,627	2024/6/26	
	3 HUNGARY 271027	3.0	358,000	391,406	139,966	2027/10/27	
	3 HUNGARY 300821	3.0	155,000	168,713	60,332	2030/8/21	
	5.5 HUNGARY 250624	5.5	512,000	628,439	224,729	2025/6/24	
	6 HUNGARY 231124	6.0	333,000	400,192	143,108	2023/11/24	
	6.75 HUNGARY 281022	6.75	167,000	233,115	83,362	2028/10/22	
	7 HUNGARY 220624	7.0	223,000	260,029	92,986	2022/6/24	
小 計					1,095,361		
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	1.75 POLAND 210725	1.75	8,300	8,330	235,498	2021/7/25	
	2 POLAND 210425	2.0	3,800	3,828	108,227	2021/4/25	
	2.25 POLAND 220425	2.25	7,500	7,608	215,083	2022/4/25	
	2.25 POLAND 241025	2.25	5,000	5,075	143,494	2024/10/25	
	2.5 POLAND 230125	2.5	7,700	7,872	222,562	2023/1/25	
	2.5 POLAND 240425	2.5	7,800	8,007	226,368	2024/4/25	
	2.5 POLAND 260725	2.5	8,600	8,791	248,525	2026/7/25	
	2.5 POLAND 270725	2.5	8,000	8,158	230,642	2027/7/25	
	2.75 POLAND 280425	2.75	6,900	7,157	202,348	2028/4/25	
	2.75 POLAND 291025	2.75	4,400	4,592	129,842	2029/10/25	
	3.25 POLAND 250725	3.25	6,700	7,123	201,392	2025/7/25	
	4 POLAND 231025	4.0	6,400	6,907	195,286	2023/10/25	
	5.75 POLAND 211025	5.75	3,400	3,645	103,059	2021/10/25	
	5.75 POLAND 220923	5.75	5,600	6,189	174,985	2022/9/23	
小 計					2,637,316		
ロシア				千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
国債証券	6.5 RUSSIA OFZ 240228	6.5	90,000	92,857	162,499	2024/2/28	
	6.9 RUSSIA OFZ 290523	6.9	44,200	46,935	82,137	2029/5/23	
	7 RUSSIA GOVT 230125	7.0	36,500	38,014	66,525	2023/1/25	
	7 RUSSIA GOVT BON 230816	7.0	62,000	64,843	113,475	2023/8/16	
	7 RUSSIA OFZ 211215	7.0	72,500	74,453	130,294	2021/12/15	
	7.05 RUSSIA GOVT 280119	7.05	106,700	113,844	199,228	2028/1/19	
	7.1 RUSSIA OFZ 241016	7.1	122,400	129,258	226,201	2024/10/16	
	7.25 RUSSIA OFZ 340510	7.25	56,300	61,651	107,889	2034/5/10	
	7.4 RUSSIA OFZ 221207	7.4	76,700	80,548	140,960	2022/12/7	
	7.4 RUSSIA OFZ 240717	7.4	90,000	95,860	167,756	2024/7/17	
	7.5 RUSSIA OFZ 210818	7.5	61,900	63,757	111,574	2021/8/18	

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		
ロシア		%	千ロシアルーブル	千ロシアルーブル	千円	
国債証券	7.6 RUSSIA GOVT 210414	7.6	30,400	31,190	54,583	2021/4/14
	7.6 RUSSIA GOVT 220720	7.6	55,000	57,657	100,900	2022/7/20
	7.7 RUSSIA OFZ 330323	7.7	95,700	108,421	189,738	2033/3/23
	7.75 RUSSIA OFZ 260916	7.75	149,600	164,709	288,241	2026/9/16
	7.95 RUSSIA OFZ 261007	7.95	25,800	28,644	50,127	2026/10/7
	8.15 RUSSIA GOVT 270203	8.15	111,000	124,929	218,627	2027/2/3
	8.5 RUSSIA OFZ 310917	8.5	111,200	132,886	232,550	2031/9/17
小計					2,643,313	
ルーマニア			千ルーマニアレイ	千ルーマニアレイ		
国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 210322	3.25	1,600	1,597	40,181	2021/3/22
	3.25 ROMANIA GOVE 240429	3.25	2,300	2,250	56,633	2024/4/29
	3.4 ROMANIA GOVER 220308	3.4	3,300	3,287	82,707	2022/3/8
	3.5 ROMANIA GOVER 221219	3.5	3,200	3,186	80,159	2022/12/19
	4.75 ROMANIA GOVE 250224	4.75	6,300	6,541	164,594	2025/2/24
	5 ROMANIA GOVERN 290212	5.0	2,760	2,916	73,390	2029/2/12
	5.8 ROMANIA GOV 270726	5.8	2,600	2,888	72,669	2027/7/26
	5.85 ROMANIA GOVE 230426	5.85	4,000	4,258	107,151	2023/4/26
	5.95 ROMANIA 210611	5.95	3,600	3,718	93,569	2021/6/11
小計					771,059	
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	3.62 MALAYSIAGOV 211130	3.62	4,400	4,466	120,006	2021/11/30
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	5,900	6,138	164,952	2028/6/15
	3.8 MALAYSIAGOV 230817	3.8	7,100	7,318	196,646	2023/8/17
	3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	3,300	3,495	93,933	2029/8/15
	3.899 MALAYSIAGOV 271116	3.899	5,000	5,261	141,368	2027/11/16
	3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	8,620	9,030	242,654	2026/11/30
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	8,800	9,213	247,569	2025/9/15
	4.059 MALAYSIAGOV 240930	4.059	6,700	7,016	188,524	2024/9/30
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	4,000	4,075	109,500	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	5,500	5,779	155,301	2024/7/15
	4.369 MALAYSIA IN 281031	4.369	3,400	3,699	99,406	2028/10/31
	4.762 MALAYSIAGOV 370407	4.762	3,500	4,119	110,680	2037/4/7
小計					1,870,544	
タイ			千タイバーツ	千タイバーツ		
国債証券	1.45 THAILAND 241217	1.45	44,000	44,517	158,035	2024/12/17
	1.875 THAILAND 220617	1.875	44,000	44,762	158,907	2022/6/17
	2 THAILAND 221217	2.0	39,100	40,040	142,144	2022/12/17
	2.125 THAILAND 261217	2.125	53,500	56,556	200,775	2026/12/17
	2.4 THAILAND 231217	2.4	48,100	50,311	178,605	2023/12/17
	2.875 THAILAND 281217	2.875	66,800	75,203	266,973	2028/12/17
	2.875 THAILAND 460617	2.875	42,200	50,113	177,903	2046/6/17
	3.3 THAILAND 380617	3.3	29,700	36,948	131,167	2038/6/17
	3.4 THAILAND 360617	3.4	43,300	54,067	191,940	2036/6/17
	3.625 THAILAND 230616	3.625	42,400	45,870	162,839	2023/6/16
	3.65 THAILAND 211217	3.65	43,700	45,767	162,476	2021/12/17

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		
タイ		%	千タイバーツ	千タイバーツ	千円		
	国債証券	3.65 THAILAND 310620	3.65	43,900	53,729	190,739	2031/6/20
		3.775 THAILAND 320625	3.775	58,500	72,878	258,718	2032/6/25
		3.85 THAILAND 251212	3.85	51,800	59,472	211,128	2025/12/12
		4.875 THAILAND 290622	4.875	47,400	61,941	219,893	2029/6/22
小	計					2,812,249	
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	24,460	52,591	2036/1/14
小	計					52,591	
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	8,947,494	72,474	2030/8/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	8,850,000	10,793,991	87,431	2025/9/15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	1,790,000	1,972,597	15,978	2021/6/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	28,400,000	28,343,200	229,579	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	27,300,000	26,518,947	214,803	2028/5/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	16,900,000	16,159,273	130,890	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	16,250,000	16,807,212	136,138	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	18,450,000	19,011,249	153,991	2027/5/15
		7.5 INDONESIA 320815	7.5	8,900,000	9,124,013	73,904	2032/8/15
		7.5 INDONESIA 380515	7.5	11,100,000	11,183,139	90,583	2038/5/15
		8.25 INDONESIA 210715	8.25	18,400,000	19,197,824	155,502	2021/7/15
		8.25 INDONESIA 290515	8.25	19,500,000	21,704,475	175,806	2029/5/15
		8.25 INDONESIA 320615	8.25	15,000,000	16,241,850	131,558	2032/6/15
		8.25 INDONESIA 360515	8.25	18,400,000	19,932,352	161,452	2036/5/15
		8.375 INDONESIA 240315	8.375	42,200,000	45,979,854	372,436	2024/3/15
		8.375 INDONESIA 260915	8.375	25,130,000	27,879,473	225,823	2026/9/15
		8.375 INDONESIA 340315	8.375	31,300,000	34,718,586	281,220	2034/3/15
		8.375 INDONESIA 390415	8.375	12,200,000	13,483,440	109,215	2039/4/15
		8.75 INDONESIA 310515	8.75	15,100,000	17,268,813	139,877	2031/5/15
		9 INDONESIA 290315	9.0	15,500,000	17,849,335	144,579	2029/3/15
		9.5 INDONESIA 310715	9.5	5,050,000	6,025,761	48,808	2031/7/15
小	計					3,152,057	
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	53,900	60,615	458,250	2026/12/21
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	24,400	17,432	131,788	2036/3/31
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	20,300	14,110	106,677	2041/2/28
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	4,500	4,510	34,098	2021/3/31
		7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	21,500	18,245	137,938	2031/2/28
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	25,900	26,544	200,679	2023/2/28
		8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	45,700	42,674	322,620	2030/1/31
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	25,000	22,917	173,256	2032/3/31
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	26,300	23,180	175,245	2037/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	37,000	32,382	244,810	2044/1/31
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	52,100	45,425	343,420	2048/2/28
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	29,600	27,517	208,032	2035/2/28

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	
南アフリカ	%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
国債証券 9 SOUTH AFRICA 400131	9.0	22,100	20,097	151,936	2040/1/31
小 計				2,688,755	
合 計				29,739,673	

(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

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 29,739,673	% 97.2
コール・ローン等、その他	850,478	2.8
投資信託財産総額	30,590,151	100.0

(注) 期末における外貨建純資産（30,487,031千円）の投資信託財産総額（30,590,151千円）に対する比率は99.7%です。

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

1 アメリカドル=109.06円	1 アルゼンチンペソ=1.81円	1 メキシコペソ=5.79円	1 ブラジルリアル=26.07円
100チリペソ=14.02円	100コロンビアペソ=3.24円	1 ペルーヌエボソル=32.80円	1 ウルグアイペソ=2.93円
1 ドミニカペソ=2.05円	1 トルコリラ=18.34円	1 チェココルナ=4.78円	100ハンガリーフォリント=35.76円
1 ポーランドズロチ=28.27円	1 ロシアルーブル=1.75円	1 ルーマニアレイ=25.16円	1 マレーシアリンギット=26.87円
1 タイバーツ=3.55円	1 フィリピンペソ=2.15円	100インドネシアルピア=0.81円	1 南アフリカランド=7.56円

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	30,619,487,366
コール・ローン等	381,147,959
公社債(評価額)	29,739,673,089
未収入金	29,335,894
未収利息	407,037,600
前払費用	62,292,824
(B) 負債	99,286,158
未払金	82,121,385
未払解約金	17,164,752
未払利息	21
(C) 純資産総額(A-B)	30,520,201,208
元本	21,159,314,350
次期繰越損益金	9,360,886,858
(D) 受益権総口数	21,159,314,350口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,424円

<注記事項>

- ①期首元本額 15,407,521,844円
 期中追加設定元本額 7,011,221,547円
 期中一部解約元本額 1,259,429,041円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,424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)

三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	7,247,804,820円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,127,296,896円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	3,887,604,316円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,784,891,430円
つみたて8資産均等バランス	1,503,550,049円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	579,123,955円
eMAXIS バランス(波乗り型)	360,275,489円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	200,503,821円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	169,425,523円
海外債券セレクション(ラップ向け)	158,727,367円
eMAXIS 最適化バランス(マイストラライカー)	45,830,320円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	39,070,562円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	18,945,835円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	14,049,651円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	9,769,125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	1,871,095円
コアバランス	1,422,253円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,024,252円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	264,359円
合計	21,159,314,350円

○損益の状況 (2019年1月29日~2020年1月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,397,471,905
受取利息	1,397,481,057
その他収益金	60,968
支払利息	△ 70,120
(B) 有価証券売買損益	768,772,039
売買益	1,810,583,461
売買損	△1,041,811,422
(C) 保管費用等	△ 22,853,703
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,143,390,241
(E) 前期繰越損益金	5,013,583,488
(F) 追加信託差損益金	2,671,273,440
(G) 解約差損益金	△ 467,360,311
(H) 計(D+E+F+G)	9,360,886,858
次期繰越損益金(H)	9,360,886,858

- (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。