

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／内外／債券	
信託期間	2032年5月10日まで（2012年6月1日設定）	
運用方針	AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要なサービスを提供する企業をいいます。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。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。マザーファンドの債券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーファンド	AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券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。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

※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）

三菱UFJ／AMP グローバル・インフラ債券ファンド <為替ヘッジなし>（毎月決算型）

愛称：世界のいしずえ



第108期（決算日：2021年6月10日）
 第109期（決算日：2021年7月12日）
 第110期（決算日：2021年8月10日）
 第111期（決算日：2021年9月10日）
 第112期（決算日：2021年10月11日）
 第113期（決算日：2021年11月10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／AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）」は、去る11月10日に第113期の決算を行いましたので、法令に基づいて第108期～第113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。

ファンドマネージャーのコメント

当作成期（過去6ヶ月）の運用で主眼においたポイントをご説明させていただきます。

■運用のポイント

インフレ期待の上昇と新型コロナウイルスワクチンの普及による景気回復観測等を受けて、2021年2月以降は当ファンドのデュレーション（平均回収期間や金利感応度）を市場対比短めに変更しています。今後もインフレ懸念等により米金利上昇圧力は継続するとみており、引き続き金利市場を注視していきます。

良好な経済指標や企業業績等を背景にスプレッド（国債との利回り格差）はかなり縮小した水準で推移しています。そのような環境下、セクター配分では、コモディティ価格の上昇の恩恵を受けやすいエネルギーセクターや堅調な企業業績が期待できる通信セクターを市場対比多めの配分としています。また、公益セクターや運輸セクターについては、スプレッドの拡大局面で投資機会を探っていきます。

■運用環境の見通しと今後の運用方針

緩和的な金融環境の継続はインフラ債券市場にとってサポート要因になるとみているものの、インフレ観測の高まり等を受けて米金利のボラティリティが高まる可能性があることについては注視が必要だと考えています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。



AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド
ヘッド・オブ・クレジット
ソニア・ベイリー

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30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			(参 考 指 数)		債 券 債 券 純 資 産 組 入 比 率 先 物 比 率 総 額	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 期 騰 落 中 率	合 成 イ ン デ ッ ク ス (円換算ベース)	期 騰 落 中 率		
	円	円	%		%	%	百万円
84期(2019年6月10日)	11,561	100	0.7	18,187	0.8	97.4	29,516
85期(2019年7月10日)	11,761	100	2.6	18,652	2.6	97.0	31,992
86期(2019年8月13日)	11,623	100	△0.3	18,627	△0.1	97.1	33,901
87期(2019年9月10日)	11,789	100	2.3	19,055	2.3	97.6	35,795
88期(2019年10月10日)	11,698	100	0.1	19,074	0.1	96.8	38,653
89期(2019年11月11日)	11,635	100	0.3	19,146	0.4	97.6	41,072
90期(2019年12月10日)	11,675	100	1.2	19,400	1.3	97.4	44,523
91期(2020年1月10日)	11,742	100	1.4	19,688	1.5	97.7	48,410
92期(2020年2月10日)	11,939	100	2.5	20,190	2.6	97.0	52,786
93期(2020年3月10日)	11,248	100	△5.0	19,392	△4.0	97.4	53,581
94期(2020年4月10日)	10,811	100	△3.0	18,647	△3.8	98.0	52,282
95期(2020年5月11日)	10,761	100	0.5	18,807	0.9	97.8	52,347
96期(2020年6月10日)	11,312	100	6.0	19,883	5.7	97.8	56,189
97期(2020年7月10日)	11,430	100	1.9	20,275	2.0	97.4	59,290
98期(2020年8月11日)	11,454	100	1.1	20,590	1.6	97.1	61,568
99期(2020年9月10日)	11,072	100	△2.5	20,143	△2.2	97.7	62,253
100期(2020年10月12日)	10,865	100	△1.0	19,934	△1.0	97.8	64,219
101期(2020年11月10日)	10,766	100	0.0	19,976	0.2	97.9	65,421
102期(2020年12月10日)	10,747	100	0.8	20,159	0.9	97.7	68,299
103期(2021年1月12日)	10,529	100	△1.1	19,961	△1.0	97.8	70,608
104期(2021年2月10日)	10,472	100	0.4	20,075	0.6	97.6	72,563
105期(2021年3月10日)	10,335	100	△0.4	20,101	0.1	97.9	73,154
106期(2021年4月12日)	10,450	100	2.1	20,512	2.0	97.6	75,476
107期(2021年5月10日)	10,333	100	△0.2	20,539	0.1	97.5	76,228
108期(2021年6月10日)	10,440	100	2.0	20,965	2.1	98.0	78,849
109期(2021年7月12日)	10,556	100	2.1	21,417	2.2	97.8	81,802
110期(2021年8月10日)	10,463	100	0.1	21,445	0.1	98.0	83,250
111期(2021年9月10日)	10,385	100	0.2	21,568	0.6	97.9	84,047
112期(2021年10月11日)	10,283	100	△0.0	21,521	△0.2	98.0	85,192
113期(2021年11月10日)	10,511	100	3.2	22,244	3.4	98.1	88,565

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 参考指数は、ブルームバーグ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの合成インデックス(円換算ベース)です。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ビーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)のサブブランドであり、三菱UFJ国際投信による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグの指数はブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信の関係会社ではなく、ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信が運用するファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグは、ブルームバーグの指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。合成インデックス(円換算ベース)は、ブルームバーグ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの各インデックス(米ドルベース)を合成したものをとに、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		(参 考 指 数)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	合 成 イ ン	デ ッ ク ス		
第108期	(期 首) 2021年5月10日	円 10,333	% —	(円換算ベース) 20,539	% —	% 97.5	% △4.8
	5月末	10,437	1.0	20,778	1.2	97.1	△5.0
	(期 末) 2021年6月10日	10,540	2.0	20,965	2.1	98.0	△5.8
第109期	(期 首) 2021年6月10日	10,440	—	20,965	—	98.0	△5.8
	6月末	10,624	1.8	21,349	1.8	97.0	△6.0
	(期 末) 2021年7月12日	10,656	2.1	21,417	2.2	97.8	△6.6
第110期	(期 首) 2021年7月12日	10,556	—	21,417	—	97.8	△6.6
	7月末	10,566	0.1	21,467	0.2	97.1	△6.8
	(期 末) 2021年8月10日	10,563	0.1	21,445	0.1	98.0	△6.4
第111期	(期 首) 2021年8月10日	10,463	—	21,445	—	98.0	△6.4
	8月末	10,485	0.2	21,562	0.5	96.6	△7.0
	(期 末) 2021年9月10日	10,485	0.2	21,568	0.6	97.9	△6.7
第112期	(期 首) 2021年9月10日	10,385	—	21,568	—	97.9	△6.7
	9月末	10,450	0.6	21,687	0.6	96.4	△7.3
	(期 末) 2021年10月11日	10,383	△0.0	21,521	△0.2	98.0	△7.2
第113期	(期 首) 2021年10月11日	10,283	—	21,521	—	98.0	△7.2
	10月末	10,546	2.6	22,114	2.8	96.9	△5.4
	(期 末) 2021年11月10日	10,611	3.2	22,244	3.4	98.1	△5.3

(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108期～第113期：2021年5月11日～2021年11月10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108期首	10,333円
第113期末	10,511円
既払分配金	600円
騰落率	7.7%
	(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7.7%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

緩和的な金融環境の長期化等を背景に米金利が低下したこと等を受けてインフラ債券市況が上昇したこと。
米連邦準備制度理事会（FRB）による金融政策正常化観測等を背景に、米ドルが対円で上昇したこと等。

第108期～第113期：2021年5月11日～2021年11月10日

投資環境について

▶ 債券市況

インフラ債券市況は上昇しました。

当作成期首から2021年7月末にかけては、緩和的な金融環境の長期化観測等を背景に米金利が低下したこと等を受けてインフラ債券市況は上昇しました。その後、インフレ懸念等から米金利が上昇したこと等がマイナス要因となったものの、当

作成期を通じてみるとインフラ債券市況は上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇しました。

F R Bによる金融政策正常化観測等を背景に日米短期金利差は拡大し、米ドル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

▶ 三菱UFJ／AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）

AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。

▶ AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド

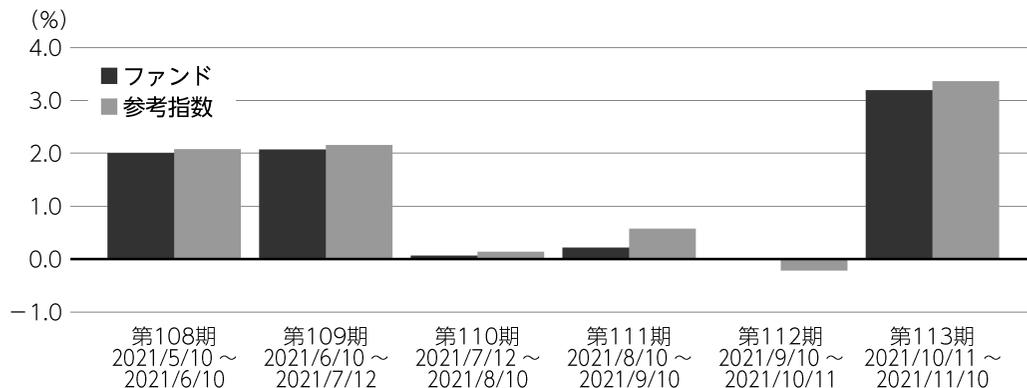
世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。

2021年10月末時点において、デュレーションについては市場対比で短めとしました。格付別では投資適格の中でも相対的に利回りが高いB B B格の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別では通信やエネルギーを市場対比多めの配分としました。

第108期～第113期：2021/5/11～2021/11/10

当該投資信託のベンチマークとの差異について

基準価額と参考指数の対比（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。

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。上記のグラフは当ファンド（ベビーファンド）の基準価額と参考指数の騰落率との対比です。

参考指数は合成インデックス（円換算ベース）です。

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108期 2021年5月11日～ 2021年6月10日	第109期 2021年6月11日～ 2021年7月12日	第110期 2021年7月13日～ 2021年8月10日	第111期 2021年8月11日～ 2021年9月10日	第112期 2021年9月11日～ 2021年10月11日	第113期 2021年10月12日～ 2021年11月10日
当期分配金 （対基準価額比率）	100 (0.949%)	100 (0.938%)	100 (0.947%)	100 (0.954%)	100 (0.963%)	100 (0.942%)
当期の収益	29	99	17	20	19	99
当期の収益以外	70	0	82	80	81	0
翌期繰越分配対象額	3,424	3,454	3,372	3,293	3,213	3,403

（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／AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）

マザーファンドへの投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行います。

▶ AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド

緩和的な金融環境の継続はインフラ債券

市況にとってサポート要因になるとみているものの、インフレ観測の高まり等を受けて米金利のボラティリティが高まる可能性があることについては注視が必要だと考えています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。

2021年5月11日～2021年11月10日

1万口当たりの費用明細

項目	第108期～第113期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	70	0.666	(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）	(38)	(0.366)	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）	(29)	(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)	(0.022)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.003	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.003)	
(c) その他費用	1	0.008	(c) 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）	(1)	(0.006)	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)	(0.002)	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）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	71	0.677	

作成期中の平均基準価額は、10,487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。

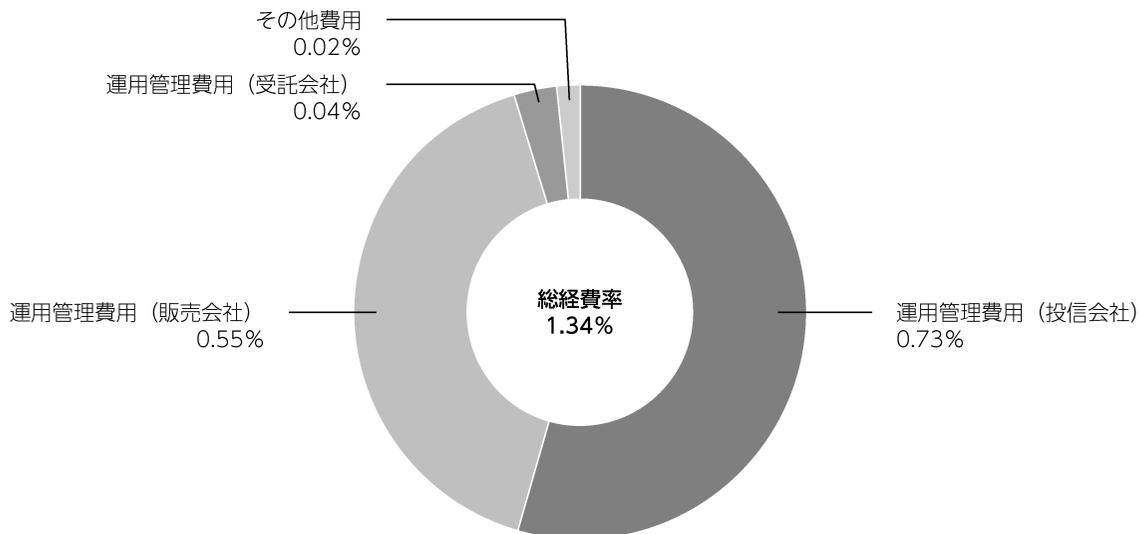
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（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1.34%**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5月11日～2021年11月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第108期～第113期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド	千口 2,831,880	千円 6,034,000	千口 -	千円 -

○利害関係人との取引状況等

(2021年5月11日～2021年11月10日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ/AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型) >

該当事項はございません。

<AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド>

区 分	第108期～第113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 7,696	百万円 1,745	% 22.7	百万円 729	百万円 -	% -

平均保有割合 81.0%

※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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2021年11月10日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第107期末		第113期末	
	口 数		口 数	
	千口		千口	
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド	37,005,916	39,837,796	88,368,200	千円

○投資信託財産の構成

(2021年11月10日現在)

項 目	第113期末	
	評 価 額	比 率
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド	千円 88,368,200	% 98.4
コール・ローン等、その他	1,416,569	1.6
投資信託財産総額	89,784,769	100.0

(注) AMP グローバル・インフラ債券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 (108,129,614千円) の投資信託財産総額 (108,914,902千円) 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=112.86円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第108期末	第109期末	第110期末	第111期末	第112期末	第113期末
	2021年6月10日現在	2021年7月12日現在	2021年8月10日現在	2021年9月10日現在	2021年10月11日現在	2021年11月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	79,822,460,872	82,905,664,519	84,303,784,505	85,243,217,326	86,311,836,673	89,784,769,667
コール・ローン等	1,207,600,667	1,553,625,803	1,246,612,109	1,398,362,935	1,465,573,066	1,416,569,460
AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド(開示額)	78,614,860,205	81,352,038,716	83,057,172,396	83,844,854,391	84,846,263,607	88,368,200,207
(B) 負債	973,049,870	1,103,124,200	1,053,554,572	1,195,795,213	1,118,970,986	1,219,492,206
未払収益分配金	755,268,722	774,963,650	795,667,891	809,308,637	828,446,589	842,606,802
未払解約金	130,699,977	233,912,461	170,181,219	292,024,964	194,544,447	281,206,497
未払信託報酬	86,776,887	93,917,762	87,398,674	94,132,011	95,644,451	95,343,119
未払利息	576	1,626	904	151	753	2,099
その他未払費用	303,708	328,701	305,884	329,450	334,746	333,689
(C) 純資産総額(A-B)	78,849,411,002	81,802,540,319	83,250,229,933	84,047,422,113	85,192,865,687	88,565,277,461
元本	75,526,872,247	77,496,365,094	79,566,789,163	80,930,863,748	82,844,658,910	84,260,680,239
次期繰越損益金	3,322,538,755	4,306,175,225	3,683,440,770	3,116,558,365	2,348,206,777	4,304,597,222
(D) 受益権総口数	75,526,872,247口	77,496,365,094口	79,566,789,163口	80,930,863,748口	82,844,658,910口	84,260,680,239口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,440円	10,556円	10,463円	10,385円	10,283円	10,511円

○損益の状況

項 目	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
	2021年5月11日～ 2021年6月10日	2021年6月11日～ 2021年7月12日	2021年7月13日～ 2021年8月10日	2021年8月11日～ 2021年9月10日	2021年9月11日～ 2021年10月11日	2021年10月12日～ 2021年11月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 15,159	△ 23,167	△ 30,464	△ 21,914	△ 10,051	△ 27,667
受取利息	—	—	1,061	882	295	—
支払利息	△ 15,159	△ 23,167	△ 31,525	△ 22,796	△ 10,346	△ 27,667
(B) 有価証券売買損益	1,642,340,621	1,711,843,459	134,984,406	277,339,871	75,391,715	2,787,942,098
売買益	1,646,355,447	1,734,177,414	138,164,453	277,284,589	77,501,131	2,823,936,600
売買損	△ 4,014,826	△ 22,333,955	△ 3,180,047	55,282	△ 2,109,416	△ 35,994,502
(C) 信託報酬等	△ 87,080,595	△ 94,246,463	△ 87,704,558	△ 94,461,461	△ 95,979,197	△ 95,676,808
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,555,244,867	1,617,573,829	△ 47,249,384	182,856,496	△ 20,597,533	2,692,237,623
(E) 前期繰越損益金	△ 1,955,297,435	△ 615,531,087	224,613,912	△ 92,534,127	△ 70,611,308	△ 244,182,479
(F) 追加信託差損益金	4,477,860,045	4,079,096,133	4,207,245,365	3,835,544,633	3,267,862,207	2,699,148,880
(配当等相当額)	(26,385,582,914)	(26,536,146,758)	(27,259,701,918)	(27,294,898,595)	(27,282,600,438)	(27,071,948,709)
(売買損益相当額)	(△21,907,722,869)	(△22,457,050,625)	(△23,052,456,553)	(△23,459,353,962)	(△24,014,738,231)	(△24,372,799,829)
(G) 計(D+E+F)	4,077,807,477	5,081,138,875	4,479,108,661	3,925,867,002	3,176,653,366	5,147,204,024
(H) 収益分配金	△ 755,268,722	△ 774,963,650	△ 795,667,891	△ 809,308,637	△ 828,446,589	△ 842,606,802
次期繰越損益金(G+H)	3,322,538,755	4,306,175,225	3,683,440,770	3,116,558,365	2,348,206,777	2,840,597,222
追加信託差損益金	3,949,171,939	4,079,096,133	3,777,584,704	3,188,097,723	2,596,820,469	2,699,148,880
(配当等相当額)	(25,861,720,129)	(26,542,063,938)	(26,834,798,480)	(26,652,236,943)	(26,616,839,944)	(27,076,509,789)
(売買損益相当額)	(△21,912,548,190)	(△22,462,967,805)	(△23,057,213,776)	(△23,464,139,220)	(△24,020,019,475)	(△24,377,360,909)
分配準備積立金	901,194	227,079,092	1,625,580	3,076,337	4,534,365	1,605,448,342
繰越損益金	△ 627,534,378	—	△ 95,769,514	△ 74,615,695	△ 253,148,057	—

(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 73,770,164,696円
 作成期中追加設定元本額 17,580,034,853円
 作成期中一部解約元本額 7,089,519,310円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1.0511円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年5月11日～ 2021年6月10日	2021年6月11日～ 2021年7月12日	2021年7月13日～ 2021年8月10日	2021年8月11日～ 2021年9月10日	2021年9月11日～ 2021年10月11日	2021年10月12日～ 2021年11月10日
費用控除後の配当等収益額	226,157,721円	238,034,713円	143,018,898円	163,340,279円	158,902,786円	244,663,247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	763,122,803円	—円	—円	—円	2,198,938,353円
収益調整金額	26,390,408,235円	26,542,063,938円	27,264,459,141円	27,299,683,853円	27,287,881,682円	27,076,509,789円
分配準備積立金額	1,324,089円	885,226円	224,613,912円	1,597,785円	3,036,430円	4,453,544円
当ファンドの分配対象収益額	26,617,890,045円	27,544,106,680円	27,632,091,951円	27,464,621,917円	27,449,820,898円	29,524,564,933円
1万円当たり収益分配対象額	3,524円	3,554円	3,472円	3,393円	3,313円	3,503円
1万円当たり分配金額	100円	100円	100円	100円	100円	100円
収益分配金金額	755,268,722円	774,963,650円	795,667,891円	809,308,637円	828,446,589円	842,606,802円

- ③「AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の33の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○分配金のお知らせ

	第108期	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期
1万口当たり分配金 (税込み)	100円	100円	100円	100円	100円	100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、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。

AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド

《第9期》決算日2021年5月10日

[計算期間：2020年5月12日～2021年5月10日]

「AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド」は、5月10日に第9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9期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要なサービスを提供する企業をいいます。債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。 組入公社債の格付けは、原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付を有しているものに限り、デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国公債等に投資する場合があります。債券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主要運用対象	世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券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		(参考指数) 合成インデックス (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
5期(2017年5月10日)	円	%			%	%	百万円
	17,057	8.3	17,124	8.6	91.8	△0.4	17,267
6期(2018年5月10日)	16,713	△2.0	16,761	△2.1	97.4	△3.2	34,820
7期(2019年5月10日)	17,973	7.5	18,035	7.6	97.5	△3.3	37,061
8期(2020年5月11日)	18,784	4.5	18,807	4.3	98.5	△1.6	64,266
9期(2021年5月10日)	20,440	8.8	20,539	9.2	98.2	△4.8	93,087

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 参考指数は、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの合成インデックス（円換算ベース）です。

ブルームバーグ (BLOOMBERG) は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー (Bloomberg Finance L.P.) の商標およびサービスマークです。バークレイズ (BARCLAYS) は、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシー (Barclays Bank Plc) の商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックス (BLOOMBERG BARCLAYS INDICES) に対する一切の独占的権利を有しています。合成インデックス（円換算ベース）は、ブルームバーグ・バークレイズ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの各インデックス（米ドルベース）を合成したものをもとに、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		(参 考 指 数) 合 成 イ ン デ ッ ク ス (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) 2020年5月11日	円 18,784	% —	18,807	% —	% 98.5	% △1.6
5月末	19,514	3.9	19,502	3.7	98.2	△1.8
6月末	20,041	6.7	19,992	6.3	97.7	△2.7
7月末	20,262	7.9	20,218	7.5	97.8	△1.2
8月末	19,889	5.9	19,886	5.7	97.7	△1.4
9月末	20,024	6.6	20,019	6.4	98.3	△1.8
10月末	19,677	4.8	19,668	4.6	98.1	△1.0
11月末	20,167	7.4	20,159	7.2	98.3	△2.0
12月末	20,156	7.3	20,183	7.3	98.1	△1.9
2021年1月末	20,117	7.1	20,158	7.2	97.4	△1.7
2月末	19,721	5.0	19,746	5.0	98.0	△6.1
3月末	20,362	8.4	20,459	8.8	98.1	△6.0
4月末	20,329	8.2	20,409	8.5	98.1	△5.1
(期 末) 2021年5月10日	20,440	8.8	20,539	9.2	98.2	△4.8

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

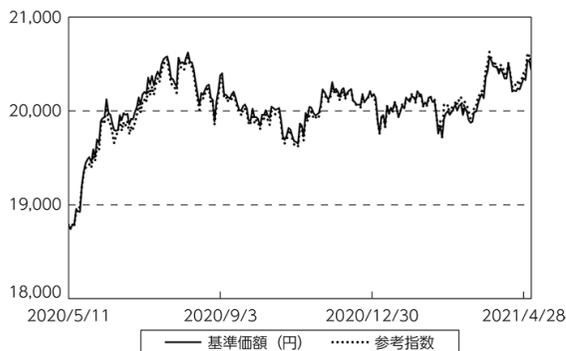
○運用経過

●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。

基準価額等の推移



(注) 参考指数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)

- ・新型コロナウイルスワクチンの開発期待等を背景にスプレッド（国債との利回り格差）が縮小したこと等から、インフラ債券市況が上昇したこと。
- ・日米金利差の拡大等を受けて米ドルが対円で上昇したこと等。

(下落要因)

- ・信託報酬等のコスト等。

●投資環境について

◎債券市況

- ・インフラ債券市況は上昇しました。
- ・期首から2020年末にかけては、新型コロナウイルスワクチンの開発期待等を受けて投資家心理が改善したこと等から、スプレッドが縮小し、インフラ債券市況は上昇しました。その後、新

型コロナウイルスワクチンの早期の普及観測や、米政権による大規模な追加経済対策等を受けて、米金利が上昇したこと等がマイナスとなったものの、期を通じてみるとインフラ債券市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドルは対円で上昇しました。
- ・米国における早期の新型コロナウイルスワクチンの普及観測等を受けて米金利が上昇したことから日米金利差は拡大し、米ドル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

- ・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・2021年4月末時点において、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については市場対比で短めとしました。格付別では投資適格の中でも相対的に利回りが高いBBB格の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別では公益や通信を市場対比多めの配分としました。

○今後の運用方針

- ・主要国の中央銀行による金融緩和政策の継続はインフラ債券市況にとってサポート要因になるとみているものの、インフレ観測の高まり等を受けて米金利のボラティリティが高まる可能性があることについては注視が必要だと考えています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。

○1万口当たりの費用明細

(2020年5月12日～2021年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 1 (1)	% 0.006 (0.006)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	2 (2) (0)	0.010 (0.010) (0.000)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は、20,060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5月12日～2021年5月10日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
			千アメリカドル	千アメリカドル
外 国	アメリカ	国債証券	34,601	42,844
		社債券	397,356	149,931
				(1,926)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債券先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		79,832	73,023	83,825	73,623

(注) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月12日～2021年5月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 23,488	百万円 5,755	% 24.5	百万円 771	百万円 463	% 60.1

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2021年5月10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 746,192	千アメリカドル 840,616	千円 91,433,862	% 98.2	% —	% 92.1	% 5.6	% 0.6
合 計	746,192	840,616	91,433,862	98.2	—	92.1	5.6	0.6

(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		
				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	1.625 T-BOND 501115	1.625	2,300	1,976	215,000	2050/11/15
普通社債券	1.875 AMERICAN TO 301015	1.875	1,000	950	103,366	2030/10/15
	2 KINDER MORGAN I 310215	2.0	5,500	5,195	565,095	2031/2/15
	2.15 PHILLIPS 66 301215	2.15	5,000	4,807	522,897	2030/12/15
	2.236 CHEVRON COR 300511	2.236	1,000	1,013	110,260	2030/5/11
	2.25 AT&T INC 320201	2.25	3,000	2,862	311,338	2032/2/1
	2.25 NEXTERA ENER 300601	2.25	3,000	2,985	324,773	2030/6/1
	2.343 CHEVRON USA 500812	2.343	2,000	1,721	187,258	2050/8/12
	2.45 COMCAST CORP 520815	2.45	1,000	867	94,338	2052/8/15
	2.55 AT&T INC 331201	2.55	2,856	2,740	298,102	2033/12/1
	2.55 VERIZON COMM 310321	2.55	3,000	3,020	328,511	2031/3/21
	2.65 MPLX LP 300815	2.65	3,000	2,990	325,309	2030/8/15
	2.65 VERIZON COMM 401120	2.65	5,000	4,651	505,986	2040/11/20
	2.65 WALT DISNEY 310113	2.65	5,000	5,170	562,402	2031/1/13
	2.75 NEXTERA ENER 291101	2.75	2,000	2,090	227,350	2029/11/1
	2.75 SHELL INTERN 300406	2.75	1,500	1,576	171,427	2030/4/6
	2.772 BP CAP MARK 501110	2.772	1,000	894	97,249	2050/11/10
	2.8 CHARTER COMM 310401	2.8	9,500	9,443	1,027,182	2031/4/1
	2.8 COMCAST CORP 510115	2.8	1,000	931	101,272	2051/1/15
	2.8 ENTERGY CORP 300615	2.8	9,200	9,438	1,026,640	2030/6/15
	2.85 BERKSHIRE HA 510515	2.85	1,000	927	100,842	2051/5/15
	2.85 DOMINION ENE 260815	2.85	500	533	58,061	2026/8/15
	2.85 SOUTHERN CAL 290801	2.85	1,000	1,035	112,576	2029/8/1
	2.875 KANSAS CITY 291115	2.875	1,500	1,568	170,646	2029/11/15
	2.875 VERIZON COM 501120	2.875	2,000	1,827	198,787	2050/11/20
	2.891 UNION PACIF 360406	2.891	4,000	4,073	443,092	2036/4/6
	2.9 AMERICAN TOWE 300115	2.9	3,000	3,104	337,677	2030/1/15
	2.92 HALLIBURTON 300301	2.92	6,000	6,092	662,637	2030/3/1
	2.95 CANADIAN NAT 300715	2.95	3,000	3,063	333,247	2030/7/15
	2.95 NISOURCE INC 290901	2.95	6,000	6,287	683,899	2029/9/1
	2.954 CHEVRON COR 260516	2.954	2,000	2,173	236,441	2026/5/16
	2.973 UNION PACIF 620916	2.973	2,000	1,822	198,196	2062/9/16
	2.987 VERIZON COM 561030	2.987	921	836	90,940	2056/10/30
	3 T-MOBILE USA IN 410215	3.0	2,000	1,887	205,316	2041/2/15
	3.05 NORFOLK SOUT 500515	3.05	1,000	963	104,806	2050/5/15
	3.095 EXXON MOBIL 490816	3.095	2,000	1,966	213,895	2049/8/16
	3.125 ENBRIDGE IN 291115	3.125	2,000	2,117	230,303	2029/11/15
	3.125 ENTERPRISE 290731	3.125	7,000	7,462	811,688	2029/7/31
	3.15 FLORIDA POWE 491001	3.15	1,000	1,028	111,902	2049/10/1
	3.15 PACIFIC GAS 260101	3.15	1,500	1,567	170,536	2026/1/1
	3.15 SOUTHWESTERN 500501	3.15	1,000	1,010	109,863	2050/5/1
	3.15 VERIZON COMM 300322	3.15	1,000	1,065	115,924	2030/3/22
	3.2 FEDEX CORP 250201	3.2	750	816	88,864	2025/2/1
	3.25 BERKSHIRE HA 280415	3.25	3,500	3,809	414,337	2028/4/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	普通社債券					
	3.25 CHEVRON USA 291015	3.25	4,000	4,381	476,542	2029/10/15
	3.25 DUKE ENERGY 491001	3.25	2,000	2,033	221,219	2049/10/1
	3.25 MAGELLAN MID 300601	3.25	4,000	4,263	463,753	2030/6/1
	3.25 SHELL INTERN 500406	3.25	1,000	1,015	110,449	2050/4/6
	3.279 BP CAPITAL 270919	3.279	5,950	6,520	709,201	2027/9/19
	3.3 AT&T INC 520201	3.3	1,000	912	99,207	2052/2/1
	3.337 BAKER HUGHE 271215	3.337	4,000	4,350	473,167	2027/12/15
	3.35 CSX CORP 251101	3.35	250	274	29,848	2025/11/1
	3.35 CSX CORP 490915	3.35	1,000	1,007	109,630	2049/9/15
	3.375 DOMINION EN 300401	3.375	6,000	6,483	705,242	2030/4/1
	3.4 DTE ENERGY CO 290615	3.4	8,000	8,613	936,858	2029/6/15
	3.4 DUKE ENERGY C 290615	3.4	4,000	4,330	471,064	2029/6/15
	3.4 NORTHERN STAT 420815	3.4	1,000	1,080	117,486	2042/8/15
	3.4 XCEL ENERGY I 300601	3.4	1,000	1,086	118,222	2030/6/1
	3.482 EXXON MOBIL 300319	3.482	1,000	1,100	119,752	2030/3/19
	3.49 NISOURCE FIN 270515	3.49	5,700	6,253	680,163	2027/5/15
	3.5 AT&T INC 410601	3.5	2,000	1,989	216,442	2041/6/1
	3.5 AT&T INC 530915	3.5	4,416	4,099	445,887	2053/9/15
	3.5 BERKSHIRE HAT 250201	3.5	500	543	59,170	2025/2/1
	3.5 NEXTERA ENERG 290401	3.5	7,500	8,240	896,313	2029/4/1
	3.5 PIEDMONT NATU 290601	3.5	1,500	1,638	178,266	2029/6/1
	3.5 PPL CAPITAL F 221201	3.5	250	259	28,276	2022/12/1
	3.5 SPECTRA ENERG 250315	3.5	350	379	41,303	2025/3/15
	3.5 WALT DISNEY C 400513	3.5	6,000	6,441	700,662	2040/5/13
	3.5 XCEL ENERGY I 491201	3.5	1,000	1,030	112,046	2049/12/1
	3.55 AT&T INC 550915	3.55	4,183	3,869	420,887	2055/9/15
	3.55 NEXTERA EMER 270501	3.55	3,250	3,614	393,110	2027/5/1
	3.55 PLAINS ALL A 291215	3.55	2,000	2,079	226,135	2029/12/15
	3.6 WALT DISNEY C 510113	3.6	3,000	3,252	353,733	2051/1/13
	3.625 DISCOVERY C 300515	3.625	1,500	1,615	175,732	2030/5/15
	3.625 SYDNEY AIRP 260428	3.625	2,870	3,130	340,543	2026/4/28
	3.633 BP CAP MARK 300406	3.633	4,000	4,442	483,200	2030/4/6
	3.65 AT&T INC 510601	3.65	1,000	969	105,407	2051/6/1
	3.65 AT&T INC 590915	3.65	1,462	1,364	148,429	2059/9/15
	3.65 MIDAMERICAN 290415	3.65	2,500	2,811	305,823	2029/4/15
	3.65 SOUTHERN CAL 280301	3.65	3,000	3,289	357,824	2028/3/1
	3.65 WOODSIDE FI 250305	3.65	4,800	5,124	557,349	2025/3/5
	3.7 BERKSHIRE HAT 300715	3.7	2,000	2,242	243,919	2030/7/15
	3.7 CENTERPOINT E 490901	3.7	2,000	2,069	225,103	2049/9/1
	3.7 DTE ELECTRIC 450315	3.7	2,000	2,207	240,129	2045/3/15
	3.7 FLORIDA POWER 471201	3.7	1,000	1,127	122,635	2047/12/1
	3.7 GEORGIA POWER 500130	3.7	1,000	1,059	115,257	2050/1/30
	3.7 ONCOR ELECTRI 281115	3.7	1,000	1,127	122,667	2028/11/15
	3.7 ONCOR ELECTRI 500515	3.7	1,000	1,113	121,156	2050/5/15
	3.7 ROGERS COMMUN 491115	3.7	1,000	1,025	111,533	2049/11/15

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		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
普通社債券						
3.75 AEP TRANSMIS 471201	3.75	1,000	1,093	118,945	2047/12/1	
3.75 COMCAST CORP 400401	3.75	4,000	4,431	482,022	2040/4/1	
3.75 DUKE ENERGY 460901	3.75	5,500	5,694	619,415	2046/9/1	
3.75 ENERGY TRANS 300515	3.75	6,500	6,900	750,530	2030/5/15	
3.75 ENTERGY CORP 500615	3.75	2,000	2,100	228,438	2050/6/15	
3.75 ENTERPRISE P 250215	3.75	500	547	59,581	2025/2/15	
3.75 PACIFIC GAS 280701	3.75	3,500	3,699	402,387	2028/7/1	
3.75 SKY PLC 240916	3.75	1,000	1,101	119,768	2024/9/16	
3.75 T-MOBILE USA 270415	3.75	2,000	2,208	240,231	2027/4/15	
3.75 WILLIAMS COM 270615	3.75	4,500	4,990	542,774	2027/6/15	
3.8 AEP TRANSMISS 490615	3.8	1,500	1,665	181,200	2049/6/15	
3.8 AMERICAN TOWE 290815	3.8	5,000	5,520	600,412	2029/8/15	
3.8 CROWN CASTLE 280215	3.8	1,000	1,102	119,899	2028/2/15	
3.8 MARATHON PETR 280401	3.8	3,000	3,305	359,569	2028/4/1	
3.8 ONCOR ELECTRI 470930	3.8	1,000	1,121	121,976	2047/9/30	
3.8 PLAINS ALL AM 300915	3.8	3,000	3,155	343,225	2030/9/15	
3.8 SEMPRA ENERGY 380201	3.8	1,000	1,098	119,470	2038/2/1	
3.8 VIRGINIA ELEC 470915	3.8	1,500	1,667	181,372	2047/9/15	
3.8 WALT DISNEY C 300322	3.8	3,250	3,653	397,338	2030/3/22	
3.839 UNION PACIF 600320	3.839	2,050	2,226	242,212	2060/3/20	
3.85 CANADIAN NAT 270601	3.85	6,000	6,591	716,936	2027/6/1	
3.85 CHEVRON USA 280115	3.85	1,000	1,139	123,947	2028/1/15	
3.85 KANSAS CITY 231115	3.85	1,500	1,590	173,028	2023/11/15	
3.85 PHILLIPS 66 250409	3.85	1,000	1,102	119,922	2025/4/9	
3.85 SOUTHWESTERN 480201	3.85	1,000	1,061	115,436	2048/2/1	
3.875 SHELL INTER 281113	3.875	3,000	3,409	370,903	2028/11/13	
3.875 T-MOBILE US 300415	3.875	13,500	14,790	1,608,762	2030/4/15	
3.875 VIACOM INC 240401	3.875	2,050	2,218	241,345	2024/4/1	
3.9 BURLINGTN NOR 460801	3.9	1,000	1,126	122,557	2046/8/1	
3.9 FEDEX CORP 350201	3.9	500	562	61,136	2035/2/1	
3.95 CSX CORP 500501	3.95	1,000	1,123	122,173	2050/5/1	
3.95 DISCOVERY CO 280320	3.95	7,400	8,164	888,083	2028/3/20	
3.95 ENTERPRISE P 270215	3.95	1,500	1,684	183,200	2027/2/15	
3.95 FLORIDA POWE 480301	3.95	3,000	3,500	380,776	2048/3/1	
3.95 MISSISSIPPI 280330	3.95	2,000	2,241	243,781	2028/3/30	
3.95 NISOURCE INC 480330	3.95	3,000	3,282	357,001	2048/3/30	
3.95 PPL CAPITAL 240315	3.95	850	918	99,901	2024/3/15	
3.969 COMCAST COR 471101	3.969	1,402	1,595	173,566	2047/11/1	
3.999 COMCAST COR 491101	3.999	725	828	90,083	2049/11/1	
4 CANADIAN PACIFI 280601	4.0	1,000	1,123	122,201	2028/6/1	
4 ENBRIDGE INC 491115	4.0	1,000	1,046	113,792	2049/11/15	
4 HUSKY ENERGY IN 240415	4.0	2,200	2,363	257,113	2024/4/15	
4 MPLX LP 280315	4.0	1,500	1,667	181,403	2028/3/15	
4 PPL CAPITAL FUN 470915	4.0	2,500	2,760	300,262	2047/9/15	
4 SEMPRA ENERGY 480201	4.0	5,500	5,987	651,314	2048/2/1	

銘柄	銘柄	当期末					償還年月日
		利率	額面金額	評価額		千円	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル			
	普通社債券						
	4 SOUTHERN CAL ED 470401	4.0	5,000	5,199	565,562	2047/4/1	
	4 WILLIAMS PARTNE 250915	4.0	1,950	2,171	236,206	2025/9/15	
	4.05 BERKSHIRE HA 250415	4.05	2,000	2,237	243,361	2025/4/15	
	4.05 SEMPRA ENERG 231201	4.05	1,000	1,077	117,194	2023/12/1	
	4.05 UNION PACIFI 460301	4.05	1,000	1,130	123,015	2046/3/1	
	4.1 CENTERPOINT E 470901	4.1	1,000	1,084	117,972	2047/9/1	
	4.1 CSX CORP 440315	4.1	150	167	18,269	2044/3/15	
	4.103 TELEFONICA 270308	4.103	1,000	1,128	122,777	2027/3/8	
	4.114 EXXON MOBIL 460301	4.114	3,000	3,434	373,608	2046/3/1	
	4.125 AT&T INC 260217	4.125	600	677	73,734	2026/2/17	
	4.125 DISCOVERY C 290515	4.125	1,000	1,109	120,650	2029/5/15	
	4.125 MPLX LP 270301	4.125	1,500	1,681	182,878	2027/3/1	
	4.125 PPL CAPITAL 300415	4.125	5,500	6,246	679,406	2030/4/15	
	4.125 SOUTHERN CA 480301	4.125	1,000	1,063	115,641	2048/3/1	
	4.125 VERIZON COM 270316	4.125	3,000	3,430	373,142	2027/3/16	
	4.15 BURLINGTN NO 450401	4.15	4,000	4,637	504,399	2045/4/1	
	4.15 COMCAST CORP 281015	4.15	5,150	5,950	647,238	2028/10/15	
	4.15 ENABLE MIDST 290915	4.15	3,000	3,241	352,626	2029/9/15	
	4.15 ENTERPRISE P 281016	4.15	3,500	3,976	432,487	2028/10/16	
	4.15 NORFOLK SOUT 480228	4.15	2,500	2,859	311,016	2048/2/28	
	4.2 CHARTER COMM 280315	4.2	1,000	1,115	121,298	2028/3/15	
	4.2 COMCAST CORP 340815	4.2	1,250	1,465	159,393	2034/8/15	
	4.2 DUKE ENERGY C 490615	4.2	1,000	1,110	120,815	2049/6/15	
	4.2 DUKE ENERGY F 480715	4.2	3,500	4,132	449,531	2048/7/15	
	4.2 ENTERPRISE PR 500131	4.2	1,000	1,086	118,179	2050/1/31	
	4.2 KANSAS CITY S 691115	4.2	2,000	2,221	241,614	2069/11/15	
	4.2 PPL CAPITAL 220615	4.2	950	979	106,538	2022/6/15	
	4.2 SOUTHERN CAL 290301	4.2	2,000	2,257	245,594	2029/3/1	
	4.2 VIACOMCBS INC 320519	4.2	3,000	3,366	366,214	2032/5/19	
	4.227 EXXON MOBIL 400319	4.227	2,000	2,320	252,390	2040/3/19	
	4.234 BP CAP MARK 281106	4.234	9,000	10,327	1,123,332	2028/11/6	
	4.25 BERKSHIRE HA 501015	4.25	1,000	1,178	128,137	2050/10/15	
	4.25 CENTERPOINT 281101	4.25	2,000	2,265	246,442	2028/11/1	
	4.25 COMCAST CORP 301015	4.25	5,000	5,821	633,220	2030/10/15	
	4.25 DOMINION ENE 280601	4.25	3,000	3,432	373,302	2028/6/1	
	4.25 ENTERPRISE P 480215	4.25	2,000	2,173	236,429	2048/2/15	
	4.25 FEDEX CORP 300515	4.25	3,000	3,451	375,406	2030/5/15	
	4.25 MISSISSIPPI 420315	4.25	2,000	2,295	249,643	2042/3/15	
	4.25 SOUTHERN CO 360701	4.25	3,450	3,959	430,725	2036/7/1	
	4.25 TRANSCANADA 280515	4.25	4,000	4,546	494,524	2028/5/15	
	4.25 VODAFONE GRO 500917	4.25	5,000	5,608	610,007	2050/9/17	
	4.3 AMERICAN ELEC 281201	4.3	8,000	9,125	992,601	2028/12/1	
	4.3 AT&T INC 300215	4.3	2,000	2,260	245,841	2030/2/15	
	4.3 CONOCOPHILLIP 441115	4.3	1,000	1,163	126,564	2044/11/15	
	4.3 CSX CORP 480301	4.3	1,000	1,156	125,825	2048/3/1	

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	普通社債券	4.3	2,300	2,575	280,187	2025/6/1
	4.3 KINDER MORGAN 250601	4.3	2,300	2,575	280,187	2025/6/1
	4.3 KINDER MORGAN 280301	4.3	6,500	7,369	801,539	2028/3/1
	4.35 AT&T INC 290301	4.35	13,000	14,812	1,611,163	2029/3/1
	4.375 SHELL INTER 450511	4.375	2,950	3,523	383,238	2045/5/11
	4.375 T-MOBILE US 400415	4.375	2,000	2,241	243,838	2040/4/15
	4.375 VIACOM INC 430315	4.375	1,000	1,090	118,658	2043/3/15
	4.375 VODAFONE GR 280530	4.375	1,500	1,732	188,480	2028/5/30
	4.4 HUSKY ENERGY 290415	4.4	1,000	1,103	120,033	2029/4/15
	4.4 MARATHON OIL 270715	4.4	1,000	1,122	122,060	2027/7/15
	4.4 SOUTHERN CO 460701	4.4	3,250	3,709	403,519	2046/7/1
	4.4 VERIZON COMMU 341101	4.4	1,200	1,411	153,492	2034/11/1
	4.45 BERKSHIRE HA 490115	4.45	1,000	1,212	131,853	2049/1/15
	4.45 EXELON CORP 460415	4.45	3,100	3,642	396,232	2046/4/15
	4.464 CCO SAFARI 220723	4.464	390	405	44,146	2022/7/23
	4.486 BAKER HUGHE 300501	4.486	2,000	2,320	252,396	2030/5/1
	4.5 APPALACHIAN P 490301	4.5	1,000	1,183	128,734	2049/3/1
	4.5 AT&T INC 350515	4.5	4,050	4,609	501,321	2035/5/15
	4.5 AT&T INC 480309	4.5	3,386	3,725	405,260	2048/3/9
	4.5 BERKSHIRE HAT 450201	4.5	1,250	1,482	161,207	2045/2/1
	4.5 COMCAST CORP 430115	4.5	1,000	1,225	133,340	2043/1/15
	4.5 ENERGY TEXAS 390330	4.5	1,000	1,165	126,779	2039/3/30
	4.5 MPLX LP 380415	4.5	1,000	1,114	121,256	2038/4/15
	4.5 PACIFIC GAS & 400701	4.5	2,000	2,013	218,978	2040/7/1
	4.5 PLAINS ALL AM 261215	4.5	1,500	1,673	182,036	2026/12/15
	4.5 SABINE PASS L 300515	4.5	4,000	4,545	494,426	2030/5/15
	4.5 SPECTRA ENERG 450315	4.5	1,120	1,261	137,209	2045/3/15
	4.5 TRANSURBAN QL 280419	4.5	3,300	3,645	396,485	2028/4/19
	4.5 VALERO ENERGY 280315	4.5	1,000	1,118	121,659	2028/3/15
	4.5 VERIZON COMMU 330810	4.5	4,000	4,743	515,899	2033/8/10
	4.522 VERIZON COM 480915	4.522	3,424	4,100	446,000	2048/9/15
	4.55 FEDEX CORP 460401	4.55	3,000	3,517	382,548	2046/4/1
	4.55 PACIFIC GAS 300701	4.55	7,000	7,549	821,108	2030/7/1
	4.6 COMCAST CORP 381015	4.6	4,400	5,373	584,425	2038/10/15
	4.65 PIEDMONT NAT 430801	4.65	1,500	1,812	197,114	2043/8/1
	4.7 COMCAST CORP 481015	4.7	8,750	11,062	1,203,262	2048/10/15
	4.7 DOMINION ENER 441201	4.7	1,000	1,211	131,728	2044/12/1
	4.7 EXELON CORP 500415	4.7	2,000	2,439	265,290	2050/4/15
	4.7 MARATHON PETR 250501	4.7	2,000	2,266	246,554	2025/5/1
	4.7 MPLX LP 480415	4.7	1,000	1,121	121,960	2048/4/15
4.7 PPL CAPITAL F 430601	4.7	2,000	2,400	261,127	2043/6/1	
4.709 FOX CORP 290125	4.709	1,000	1,162	126,478	2029/1/25	
4.75 ENERGY TRANS 260115	4.75	1,500	1,689	183,767	2026/1/15	
4.75 PACIFIC NATI 280322	4.75	4,000	4,271	464,570	2028/3/22	
4.8 CANADIAN PACI 450801	4.8	2,000	2,492	271,120	2045/8/1	
4.8 MPLX LP 290215	4.8	2,000	2,320	252,411	2029/2/15	

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日		
		利率	額面金額	評価額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円			
アメリカ	普通社債券	4.85	ENTERPRISE P 420815	4.85	1,750	2,084	226,698	2042/8/15
		4.85	ENTERPRISE P 440315	4.85	1,250	1,477	160,755	2044/3/15
		4.862	VERIZON COM 460821	4.862	5,110	6,379	693,949	2046/8/21
		4.875	MPLX LP 250601	4.875	3,000	3,399	369,763	2025/6/1
		4.875	PHILLIPS 66 441115	4.875	1,000	1,206	131,220	2044/11/15
		4.875	TRANSCANADA 480515	4.875	3,000	3,617	393,507	2048/5/15
		4.875	VODAFONE GR 490619	4.875	1,000	1,214	132,058	2049/6/19
		4.9	BURLINGTN NOR 440401	4.9	2,000	2,559	278,383	2044/4/1
		4.9	DOMINION RESO 410801	4.9	200	245	26,693	2041/8/1
		4.9	ENERGY TRANSF 240201	4.9	300	328	35,684	2024/2/1
		4.9	FEDEX CORP 340115	4.9	1,500	1,835	199,659	2034/1/15
		4.908	CCO SAFARI 250723	4.908	6,380	7,281	792,047	2025/7/23
		4.95	ENERGY TRANS 280615	4.95	3,000	3,435	373,656	2028/6/15
		4.95	PACIFIC GAS 500701	4.95	2,000	2,063	224,409	2050/7/1
		4.95	VIACOMCBS IN 310115	4.95	9,000	10,627	1,155,966	2031/1/15
		4.95	VIACOMCBS IN 500519	4.95	1,000	1,176	127,955	2050/5/19
		5.0	SABINE PASS LIQ 270315	5.0	4,000	4,623	502,951	2027/3/15
		5.012	VERIZON COM 490415	5.012	4,000	5,105	555,368	2049/4/15
		5.012	VERIZON COM 540821	5.012	2,250	2,932	318,919	2054/8/21
		5.05	CHARTER COMM 290330	5.05	6,750	7,878	856,901	2029/3/30
		5.1	EXELON CORP 450615	5.1	150	190	20,725	2045/6/15
		5.1	WILLIAMS COMP 450915	5.1	1,500	1,777	193,298	2045/9/15
		5.125	MARATHON PE 261215	5.125	2,000	2,380	258,873	2026/12/15
		5.15	AT&T INC 500215	5.15	2,000	2,417	262,957	2050/2/15
		5.15	PLAINS ALL A 420601	5.15	157	168	18,326	2042/6/1
		5.2	CROWN CASTLE 490215	5.2	1,000	1,254	136,425	2049/2/15
		5.2	MPLX LP 470301	5.2	1,200	1,419	154,347	2047/3/1
		5.213	TELEFONICA 470308	5.213	1,300	1,545	168,067	2047/3/8
		5.25	CHEVRON USA 431115	5.25	1,000	1,316	143,233	2043/11/15
		5.25	DOMINION RES 330801	5.25	346	431	46,955	2033/8/1
		5.25	ENERGY TRANS 290415	5.25	4,000	4,668	507,760	2029/4/15
		5.3	ENERGY TRANSF 470415	5.3	1,000	1,117	121,526	2047/4/15
		5.35	SUNOCO LOGIS 450515	5.35	500	560	60,919	2045/5/15
		5.375	CHARTER COM 470501	5.375	2,100	2,479	269,720	2047/5/1
		5.476	FOX CORP 390125	5.476	1,250	1,572	171,053	2039/1/25
		5.5	ENBRIDGE ENER 400915	5.5	200	247	26,884	2040/9/15
		5.5	ENERGY TRANSF 270601	5.5	2,500	2,942	320,001	2027/6/1
		5.5	MPLX LP 490215	5.5	1,000	1,243	135,251	2049/2/15
		5.5	SHELL INTERNA 400325	5.5	1,000	1,365	148,556	2040/3/25
		5.55	KINDER MORG 450601	5.55	3,050	3,789	412,155	2045/6/1
		5.625	EXELON CORP 350615	5.625	1,200	1,557	169,397	2035/6/15
		5.625	SABINE PASS 250301	5.625	500	574	62,516	2025/3/1
		5.75	BURLINGTN NO 400501	5.75	650	891	96,967	2040/5/1
		5.75	CANADIAN PAC 420115	5.75	1,100	1,478	160,811	2042/1/15
		5.75	MIDAMERIC 351101	5.75	100	136	14,867	2035/11/1

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		
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ						
普通社債券						
5.8 MIDAMERICAN 361015	5.8	1,400	1,905	207,300	2036/10/15	
5.875 ENBRIDGE EN 251015	5.875	1,580	1,878	204,272	2025/10/15	
5.875 SABINE PASS 260630	5.875	1,250	1,485	161,591	2026/6/30	
5.875 TIME WARNER 401115	5.875	600	760	82,676	2040/11/15	
5.95 CANADIAN PAC 370515	5.95	700	963	104,836	2037/5/15	
5.95 DOMINION R 350615	5.95	2,150	2,881	313,391	2035/6/15	
5.95 NBCUNIVERSAL 410401	5.95	400	569	61,905	2041/4/1	
6 AT&T INC 400815	6.0	2,000	2,631	286,189	2040/8/15	
6 SEMPRA ENERGY 391015	6.0	1,450	1,963	213,579	2039/10/15	
6.05 DUKE ENERGY 380415	6.05	1,125	1,572	171,048	2038/4/15	
6.1 TRANS-CANADA 400601	6.1	500	674	73,315	2040/6/1	
6.125 MIDAMERICAN 360401	6.125	4,194	5,789	629,742	2036/4/1	
6.15 BURLINGTN NO 370501	6.15	795	1,117	121,557	2037/5/1	
6.15 CSX CORP 370501	6.15	1,700	2,353	255,943	2037/5/1	
6.15 VODAFONE GRO 370227	6.15	1,000	1,359	147,853	2037/2/27	
6.2 TRANSCANADA P 371015	6.2	1,000	1,338	145,552	2037/10/15	
6.25 EXELON GENER 391001	6.25	1,000	1,192	129,693	2039/10/1	
6.3 DOMINION RESO 330315	6.3	250	332	36,216	2033/3/15	
6.3 WILLIAMS PART 400415	6.3	1,200	1,592	173,214	2040/4/15	
6.35 DISCOVERY CO 400601	6.35	1,000	1,342	145,998	2040/6/1	
6.384 CHARTER COM 351023	6.384	1,000	1,309	142,383	2035/10/23	
6.45 ENTERPRISE 400901	6.45	250	347	37,801	2040/9/1	
6.484 CHARTER COM 451023	6.484	1,000	1,327	144,444	2045/10/23	
6.5 CONOCOPHILLIP 390201	6.5	3,650	5,268	573,078	2039/2/1	
6.5 MARATHON PETR 410301	6.5	2,850	3,871	421,113	2041/3/1	
6.5 SUNCOR ENERGY 380615	6.5	2,000	2,753	299,446	2038/6/15	
6.55 TIME WARNER 370501	6.55	500	665	72,407	2037/5/1	
6.65 WALT DISNEY 371115	6.65	1,000	1,479	160,965	2037/11/15	
6.7 PLAINS ALL AM 360515	6.7	150	179	19,508	2036/5/15	
6.75 CONS EDISON 380401	6.75	750	1,091	118,774	2038/4/1	
6.85 SUNCOR ENERG 390601	6.85	2,000	2,857	310,837	2039/6/1	
6.875 VIACOM INC 360430	6.875	1,750	2,444	265,925	2036/4/30	
6.95 CONOCO INC 290415	6.95	2,100	2,824	307,202	2029/4/15	
7.045 TELEFONICA 360620	7.045	1,000	1,413	153,757	2036/6/20	
7.05 COMCAST CORP 330315	7.05	500	721	78,489	2033/3/15	
7.3 KINDER MORGAN 330815	7.3	500	696	75,764	2033/8/15	
7.4 BURLINGTON RE 311201	7.4	200	290	31,549	2031/12/1	
7.4 KINDER MORGAN 310315	7.4	500	684	74,462	2031/3/15	
7.5 ENBRIDGE ENER 380415	7.5	300	431	46,888	2038/4/15	
7.5 ENERGY TRANSF 380701	7.5	500	680	74,009	2038/7/1	
7.875 CBS CORP 300730	7.875	400	563	61,258	2030/7/30	
7.875 DEVON ENERG 310930	7.875	1,000	1,363	148,283	2031/9/30	
8.375 TIME WARN 230315	8.375	2,900	3,306	359,623	2023/3/15	
8.375 TIME WARNER 330715	8.375	3,800	5,666	616,304	2033/7/15	
STEP BRITISH TEL 301215	9.625	700	1,096	119,231	2030/12/15	

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		
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
	普通社債券	STEP DEUTSCHE TEL 300615	8.75	6,800	10,177	1,106,962	2030/6/15
		STEP ORANGE SA 310301	9.0	700	1,096	119,261	2031/3/1
合	計					91,433,862	

(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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
			百万円	百万円
外 国	債券先物取引	NOTE5Y	8,010	—
		NOTE2Y	1,729	—
		NOTE10Y	—	4,490
		T-BOND	3,384	—
		ULTR10Y 2106	—	16,619
		BOND30Y	3,497	—

(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5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 91,433,862	% 97.8
コール・ローン等、その他	2,061,154	2.2
投資信託財産総額	93,495,016	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (92,886,185千円) の投資信託財産総額 (93,495,016千円) 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=108.77円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月10日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	93,328,220,999	
コール・ローン等	472,044,178	
公社債(評価額)	91,433,862,089	
未収入金	425,697,522	
未収利息	762,446,826	
前払費用	45,136,814	
差入委託証拠金	189,033,570	
(B) 負債	240,639,549	
未払金	240,639,485	
未払利息	64	
(C) 純資産総額(A-B)	93,087,581,450	
元本	45,542,148,746	
次期繰越損益金	47,545,432,704	
(D) 受益権総口数	45,542,148,746口	
1万口当たり基準価額(C/D)	20,440円	

<注記事項>

- ①期首元本額 34,212,749,501円
 期中追加設定元本額 11,899,203,397円
 期中一部解約元本額 569,804,152円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.0440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/AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	37,005,916,134円
三菱UFJ/AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	5,134,129,942円
AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)	1,468,924,248円
三菱UFJ/AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	1,261,605,893円
三菱UFJ/AMP グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(年1回決算型)	631,498,651円
外国債券アクティブファンドセレクション(ラップ専用)	25,752,831円
AMP ヘッジ付グローバル・インフラ債券ファンド(ラップ向け)	14,321,047円
合計	45,542,148,746円

○損益の状況 (2020年5月12日~2021年5月10日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	2,939,234,329	
受取利息	2,939,324,752	
支払利息	△ 90,423	
(B) 有価証券売買損益	3,057,091,482	
売買益	4,854,840,119	
売買損	△ 1,797,748,637	
(C) 先物取引等取引損益	43,829,325	
取引益	1,441,814,506	
取引損	△ 1,397,985,181	
(D) 保管費用等	△ 8,080,027	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	6,032,075,109	
(F) 前期繰越損益金	30,053,426,840	
(G) 追加信託差損益金	12,014,516,603	
(H) 解約差損益金	△ 554,585,848	
(I) 計(E+F+G+H)	47,545,432,704	
次期繰越損益金(I)	47,545,432,704	

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (G)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) (H)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。