

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	マッコーリー 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不可欠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、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・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	ベビーフンド	マッコーリー 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。

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。
 Macquarie Bank Limited（以下「MBL」といいます）を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社は何れも1959年銀行法（オーストラリア連邦）上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ／マッコーリー 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120期（決算日：2022年6月10日）
 第121期（決算日：2022年7月11日）
 第122期（決算日：2022年8月10日）
 第123期（決算日：2022年9月12日）
 第124期（決算日：2022年10月11日）
 第125期（決算日：2022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／マッコーリー 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125期の決算を行いましたので、法令に基づいて第120期～第125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てポイントをご説明させていただきます。

■運用のポイント

インフレの高止まり等を背景に米連邦準備制度理事会（FRB）が積極的な金融引き締め政策を行ったこと等から米金利は上昇しました。インフレや実質金利の上昇が景気へ悪影響が懸念されるなか、債券利回りは魅力的な水準であると考えております。そのため、当ファンドでは2022年8月頃からデュレーション（平均回収期間や金利感応度）を市場対比で長めの水準としています。今後もFRBの金融政策やインフレの動向については注視していきます。

世界的な景気後退懸念の高まり等を背景にスプレッド（国債との利回り格差）は小幅に拡大する可能性が高いとみています。個別銘柄選択においては、需要の低迷とインフレ圧力に対してより脆弱であると考えられる発行体に対して慎重な投資姿勢としています。

■運用環境の見通しと今後の運用方針

今後は景気後退リスクが高まる中で主要中央銀行による金融引き締め政策の動向に注視しています。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。



マコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッド
シニアポートフォリオマネージャー
ソニア・ベイラー

上記は、マコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドの資料を基に、三菱UFJ国際投信が作成したものです。

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) 合 成 イ ン デ ッ ク ス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 期 金 騰 落	中 率	(円換算ベース)			
	円	円	%		%	%	%	百万円
96期(2020年6月10日)	11,312	100	6.0	19,883	5.7	97.8	△1.1	56,189
97期(2020年7月10日)	11,430	100	1.9	20,275	2.0	97.4	△1.3	59,290
98期(2020年8月11日)	11,454	100	1.1	20,590	1.6	97.1	△0.7	61,568
99期(2020年9月10日)	11,072	100	△2.5	20,143	△2.2	97.7	△1.0	62,253
100期(2020年10月12日)	10,865	100	△1.0	19,934	△1.0	97.8	△0.7	64,219
101期(2020年11月10日)	10,766	100	0.0	19,976	0.2	97.9	△0.7	65,421
102期(2020年12月10日)	10,747	100	0.8	20,159	0.9	97.7	△1.6	68,299
103期(2021年1月12日)	10,529	100	△1.1	19,961	△1.0	97.8	△1.4	70,608
104期(2021年2月10日)	10,472	100	0.4	20,075	0.6	97.6	△5.5	72,563
105期(2021年3月10日)	10,335	100	△0.4	20,101	0.1	97.9	△5.9	73,154
106期(2021年4月12日)	10,450	100	2.1	20,512	2.0	97.6	△5.0	75,476
107期(2021年5月10日)	10,333	100	△0.2	20,539	0.1	97.5	△4.8	76,228
108期(2021年6月10日)	10,440	100	2.0	20,965	2.1	98.0	△5.8	78,849
109期(2021年7月12日)	10,556	100	2.1	21,417	2.2	97.8	△6.6	81,802
110期(2021年8月10日)	10,463	100	0.1	21,445	0.1	98.0	△6.4	83,250
111期(2021年9月10日)	10,385	100	0.2	21,568	0.6	97.9	△6.7	84,047
112期(2021年10月11日)	10,283	100	△0.0	21,521	△0.2	98.0	△7.2	85,192
113期(2021年11月10日)	10,511	100	3.2	22,244	3.4	98.1	△5.3	88,565
114期(2021年12月10日)	10,275	100	△1.3	22,005	△1.1	97.6	△5.5	88,349
115期(2022年1月11日)	10,109	100	△0.6	21,874	△0.6	97.8	△5.2	88,644
116期(2022年2月10日)	9,783	70	△2.5	21,307	△2.6	97.4	△3.6	86,753
117期(2022年3月10日)	9,403	70	△3.2	20,697	△2.9	97.8	△3.6	82,751
118期(2022年4月11日)	9,709	70	4.0	21,570	4.2	97.4	△0.9	85,348
119期(2022年5月10日)	9,475	70	△1.7	21,333	△1.1	97.4	△0.8	83,090
120期(2022年6月10日)	9,843	70	4.6	22,298	4.5	95.8	0.7	86,787
121期(2022年7月11日)	9,708	70	△0.7	22,220	△0.4	95.8	0.3	86,440
122期(2022年8月10日)	9,848	70	2.2	22,685	2.1	96.0	1.5	88,075
123期(2022年9月12日)	9,887	70	1.1	23,047	1.6	95.2	1.9	89,839
124期(2022年10月11日)	9,443	70	△3.8	22,381	△2.9	93.2	3.6	88,557
125期(2022年11月10日)	9,329	70	△0.5	22,146	△1.1	94.5	2.3	89,597

(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。)のサービスマークであり、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、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 券 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	合 成 イ ン	デ ッ ク ス		
第120期	(期 首) 2022年5月10日	円 9,475	% —	(円換算ベース) 21,333	% —	% 97.4	% △0.8
	5月末	9,639	1.7	21,664	1.6	94.9	△0.2
	(期 末) 2022年6月10日	9,913	4.6	22,298	4.5	95.8	0.7
第121期	(期 首) 2022年6月10日	9,843	—	22,298	—	95.8	0.7
	6月末	9,788	△0.6	22,204	△0.4	95.0	0.2
	(期 末) 2022年7月11日	9,778	△0.7	22,220	△0.4	95.8	0.3
第122期	(期 首) 2022年7月11日	9,708	—	22,220	—	95.8	0.3
	7月末	9,911	2.1	22,668	2.0	96.0	△0.2
	(期 末) 2022年8月10日	9,918	2.2	22,685	2.1	96.0	1.5
第123期	(期 首) 2022年8月10日	9,848	—	22,685	—	96.0	1.5
	8月末	9,862	0.1	22,782	0.4	94.9	2.1
	(期 末) 2022年9月12日	9,957	1.1	23,047	1.6	95.2	1.9
第124期	(期 首) 2022年9月12日	9,887	—	23,047	—	95.2	1.9
	9月末	9,496	△4.0	22,172	△3.8	92.2	3.4
	(期 末) 2022年10月11日	9,513	△3.8	22,381	△2.9	93.2	3.6
第125期	(期 首) 2022年10月11日	9,443	—	22,381	—	93.2	3.6
	10月末	9,555	1.2	22,507	0.6	93.4	2.9
	(期 末) 2022年11月10日	9,399	△0.5	22,146	△1.1	94.5	2.3

(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。

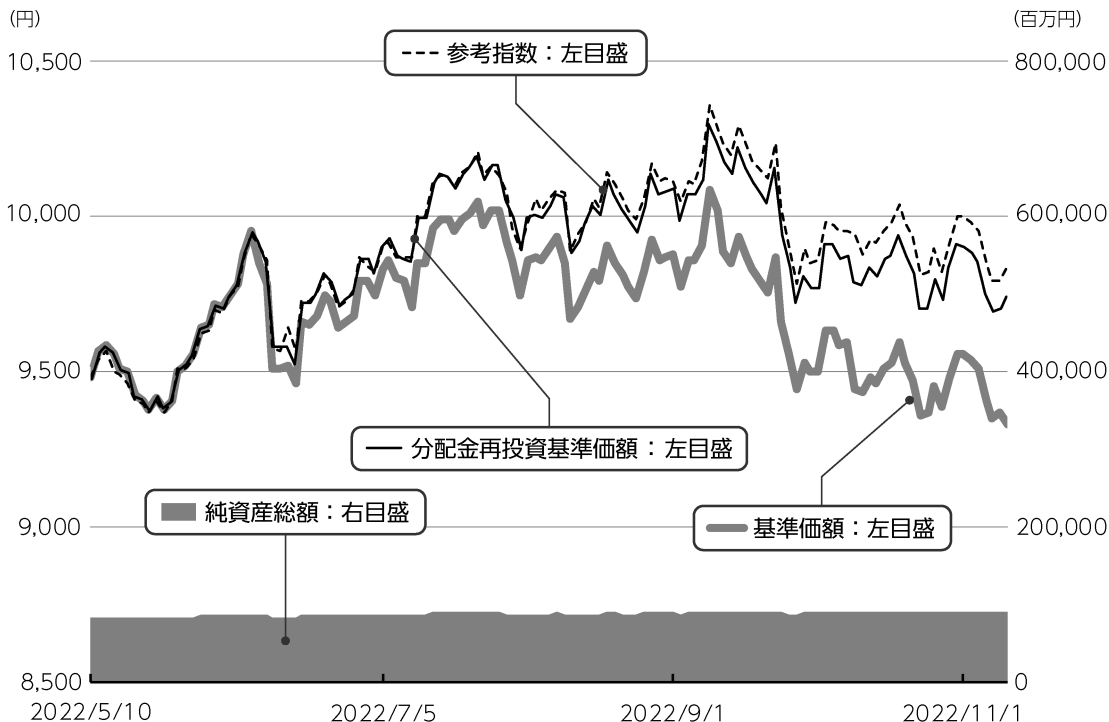
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第120期～第125期：2022年5月11日～2022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120期首	9,475円
第125期末	9,329円
既払分配金	420円
騰落率	2.8%
(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2.8%（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

日米金利差が拡大したこと等から米ドルが対円で上昇したこと等。

下落要因

F R Bによる積極的な金融引き締め観測の高まり等を背景に米金利が上昇したこと等を受けてインフラ債券市況が下落したこと等。

第120期～第125期：2022年5月11日～2022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下落しました。

インフレの長期化やFRBによる積極的な金融引き締め観測の高まり等から米金利が上昇したこと等を背景にインフラ債券市況は下落しました。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇しました。

FRBによる金融引き締め政策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／マッコーリー 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）

マッコーリー 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。

▶ マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

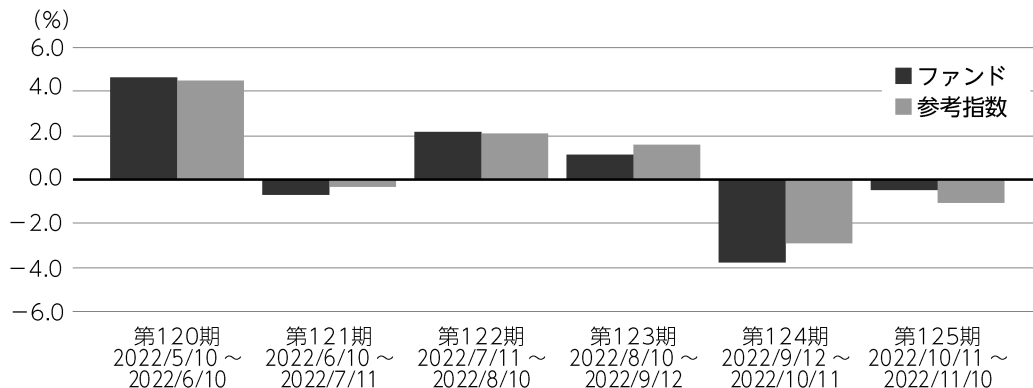
世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。

2022年9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長めとしました。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。セクター別ではエネルギーを市場対比多めの配分としました。

第120期～第125期：2022/5/11～2022/11/10

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120期 2022年5月11日~ 2022年6月10日	第121期 2022年6月11日~ 2022年7月11日	第122期 2022年7月12日~ 2022年8月10日	第123期 2022年8月11日~ 2022年9月12日	第124期 2022年9月13日~ 2022年10月11日	第125期 2022年10月12日~ 2022年11月10日
当期分配金 (対基準価額比率)	70 (0.706%)	70 (0.716%)	70 (0.706%)	70 (0.703%)	70 (0.736%)	70 (0.745%)
当期の収益	33	24	32	34	23	25
当期の収益以外	37	45	38	36	46	45
翌期繰越分配対象額	3,021	2,976	2,938	2,903	2,858	2,813

(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／マッコーリー 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。

▶ マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

今後は景気後退リスクが高まる中で主要中央銀行による金融引き締め政策の動向に注視しています。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。

2022年5月11日～2022年11月10日

1万口当たりの費用明細

項目	第120期～第125期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	65	0.665	(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)	(35)	(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)	(27)	(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	66	0.676	

作成期中の平均基準価額は、9,694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。

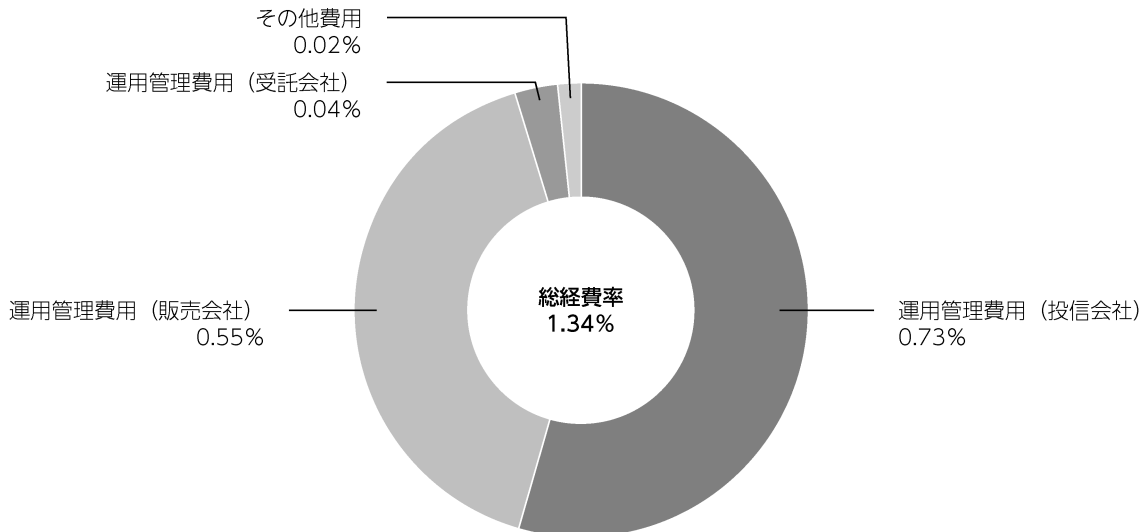
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2022年5月11日～2022年11月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第120期～第125期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド	1,710,982	3,780,000	196,191	410,000

○利害関係人との取引状況等

(2022年5月11日～2022年11月10日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ／マコーリー 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。

<マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド>

区 分	第120期～第125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 7,098	百万円 1,917	% 27.0	百万円 1,942	百万円 583	% 30.0

平均保有割合 81.6%

※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

(2022年11月10日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第119期末		第125期末	
	口 数		口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド	39,230,967		40,745,758	89,062,079

○投資信託財産の構成

(2022年11月10日現在)

項 目	第125期末	
	評 価 額	比 率
マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド	千円 89,062,079	% 98.5
コール・ローン等、その他	1,360,717	1.5
投資信託財産総額	90,422,796	100.0

(注) マコーリー 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 (108,884,497千円) の投資信託財産総額 (111,168,986千円) に対する比率は97.9%です。

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

1アメリカドル=146.41円			
-----------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第120期末	第121期末	第122期末	第123期末	第124期末	第125期末
	2022年6月10日現在	2022年7月11日現在	2022年8月10日現在	2022年9月12日現在	2022年10月11日現在	2022年11月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	87,649,780,822	87,321,729,537	88,835,804,481	90,738,740,967	89,372,836,948	90,422,796,744
コール・ローン等	1,277,530,350	1,421,799,863	968,522,060	1,468,743,959	1,448,356,938	1,360,717,092
マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド(信託)	86,372,250,472	85,899,929,674	87,867,282,421	89,269,997,008	87,924,480,010	89,062,079,652
(B) 負債	862,756,303	880,955,997	759,982,536	899,024,575	815,498,048	825,170,238
未払収益分配金	617,175,984	623,289,807	626,073,415	636,036,958	656,433,037	672,296,359
未払解約金	151,103,531	160,886,670	37,583,532	156,857,209	64,660,600	55,019,340
未払信託報酬	94,146,229	96,441,625	95,989,347	105,758,755	94,074,221	97,510,213
未払利息	1,057	360	288	1,508	939	3,049
その他未払費用	329,502	337,535	335,954	370,145	329,251	341,277
(C) 純資産総額(A-B)	86,787,024,519	86,440,773,540	88,075,821,945	89,839,716,392	88,557,338,900	89,597,626,506
元本	88,167,997,752	89,041,401,015	89,439,059,375	90,862,422,620	93,776,148,210	96,042,337,082
次期繰越損益金	△ 1,380,973,233	△ 2,600,627,475	△ 1,363,237,430	△ 1,022,706,228	△ 5,218,809,310	△ 6,444,710,576
(D) 受益権総口数	88,167,997,752口	89,041,401,015口	89,439,059,375口	90,862,422,620口	93,776,148,210口	96,042,337,082口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,843円	9,708円	9,848円	9,887円	9,443円	9,329円

○損益の状況

項 目	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期
	2022年5月11日～ 2022年6月10日	2022年6月11日～ 2022年7月11日	2022年7月12日～ 2022年8月10日	2022年8月11日～ 2022年9月12日	2022年9月13日～ 2022年10月11日	2022年10月12日～ 2022年11月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 16,632	△ 25,565	△ 7,576	△ 29,684	△ 55,312	△ 66,302
受取利息	—	683	—	—	340	—
支払利息	△ 16,632	△ 26,248	△ 7,576	△ 29,684	△ 55,652	△ 66,302
(B) 有価証券売買損益	3,944,528,813	△ 458,220,089	1,942,520,557	1,102,291,003	△ 3,346,428,522	△ 334,108,371
売買益	3,960,500,052	13,821,600	1,967,352,692	1,105,118,507	9,016,148	1,380,139
売買損	△ 15,971,239	△ 472,041,689	△ 24,832,135	△ 2,827,504	△ 3,355,444,670	△ 335,488,510
(C) 信託報酬等	△ 94,475,731	△ 96,779,160	△ 96,325,301	△ 106,128,900	△ 94,403,472	△ 97,851,490
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,850,036,450	△ 555,022,814	1,846,187,680	996,132,419	△ 3,440,887,306	△ 432,026,163
(E) 前期繰越損益金	△ 5,623,609,373	△ 2,042,442,878	△ 2,786,358,559	△ 1,214,250,287	△ 523,180,622	△ 4,154,842,888
(F) 追加信託差損益金	1,009,775,674	620,130,024	203,006,864	△ 168,551,402	△ 598,308,345	△ 1,185,545,166
(配当等相当額)	(26,955,856,436)	(26,897,256,883)	(26,618,663,902)	(26,699,675,189)	(27,223,429,034)	(27,446,728,636)
(売買損益相当額)	(△25,946,080,762)	(△26,277,126,859)	(△26,415,657,038)	(△26,868,226,591)	(△27,821,737,379)	(△28,632,273,802)
(G) 計(D+E+F)	△ 763,797,249	△ 1,977,337,668	△ 737,164,015	△ 386,669,270	△ 4,562,376,273	△ 5,772,414,217
(H) 収益分配金	△ 617,175,984	△ 623,289,807	△ 626,073,415	△ 636,036,958	△ 656,433,037	△ 672,296,359
次期繰越損益金(G+H)	△ 1,380,973,233	△ 2,600,627,475	△ 1,363,337,430	△ 1,022,706,228	△ 5,218,809,310	△ 6,444,710,576
追加信託差損益金	683,554,082	219,443,719	△ 136,861,561	△ 495,656,124	△ 1,029,678,627	△ 1,617,735,683
(配当等相当額)	(26,633,243,975)	(26,500,275,763)	(26,281,332,581)	(26,377,254,382)	(26,798,998,968)	(27,020,493,946)
(売買損益相当額)	(△25,949,689,893)	(△26,280,832,044)	(△26,418,194,142)	(△26,872,910,506)	(△27,828,677,595)	(△28,638,229,629)
分配準備積立金	8,774,395	2,353,467	3,762,728	8,356,845	3,212,868	5,732,315
繰越損益金	△ 2,073,301,710	△ 2,822,424,661	△ 1,230,138,597	△ 535,406,949	△ 4,192,343,551	△ 4,832,707,208

(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 87,696,490,684円
 作成期中追加設定元本額 14,125,620,976円
 作成期中一部解約元本額 5,779,774,578円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.9329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6,444,710,576円です。

③分配金の計算過程

項 目	2022年5月11日～ 2022年6月10日	2022年6月11日～ 2022年7月11日	2022年7月12日～ 2022年8月10日	2022年8月11日～ 2022年9月12日	2022年9月13日～ 2022年10月11日	2022年10月12日～ 2022年11月10日
費用控除後の配当等収益額	293,934,929円	216,276,436円	287,642,384円	313,563,555円	219,980,132円	242,651,584円
費用控除後・繰越火損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	26,959,465,567円	26,900,962,068円	26,621,201,006円	26,704,359,104円	27,230,369,250円	27,452,684,463円
分配準備積立金額	5,793,858円	8,680,533円	2,325,334円	3,725,526円	8,295,491円	3,186,573円
当ファンドの分配対象収益額	27,259,194,354円	27,125,919,037円	26,911,168,724円	27,021,648,185円	27,458,644,873円	27,698,522,620円
1万口当たり収益分配対象額	3,091円	3,046円	3,008円	2,973円	2,928円	2,883円
1万口当たり分配金額	70円	70円	70円	70円	70円	70円
収益分配金金額	617,175,984円	623,289,807円	626,073,415円	636,036,958円	656,433,037円	672,296,359円

④「マコーリー 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120期	第121期	第122期	第123期	第124期	第125期
1 万口当たり分配金 (税込み)	70円	70円	70円	70円	70円	70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。

マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド (旧ファンド名称「AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド」)

《第10期》決算日2022年5月10日

[計算期間：2021年5月11日～2022年5月10日]

「マッコーリー 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	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不可欠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ます。 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、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・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。

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。Macquarie Bank Limited (以下「MBL」といいます)を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社は何れも1959年銀行法(オーストラリア連邦)上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。

○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	債券先物比率	純資産額
	騰落	率	騰落	率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
10期(2022年5月10日)	21,114	3.3	21,333	3.9	97.7	△0.8	100,296

(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・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。)のサービスマークであり、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	債券先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2021年5月10日	円	%		%	%	%
	20,440	—	20,539	—	98.2	△4.8
5月末	20,664	1.1	20,778	1.2	98.3	△5.0
6月末	21,264	4.0	21,349	3.9	98.3	△6.1
7月末	21,373	4.6	21,467	4.5	98.3	△6.8
8月末	21,438	4.9	21,562	5.0	98.0	△7.1
9月末	21,599	5.7	21,687	5.6	97.4	△7.3
10月末	22,034	7.8	22,114	7.7	98.1	△5.5
11月末	21,860	6.9	22,027	7.2	98.3	△5.9
12月末	22,100	8.1	22,196	8.1	98.2	△6.4
2022年1月末	21,501	5.2	21,591	5.1	97.7	△5.3
2月末	20,715	1.3	20,837	1.5	97.9	△4.4
3月末	21,681	6.1	21,768	6.0	97.7	△1.5
4月末	21,525	5.3	21,646	5.4	97.6	△0.8
(期末) 2022年5月10日						
	21,114	3.3	21,333	3.9	97.7	△0.8

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

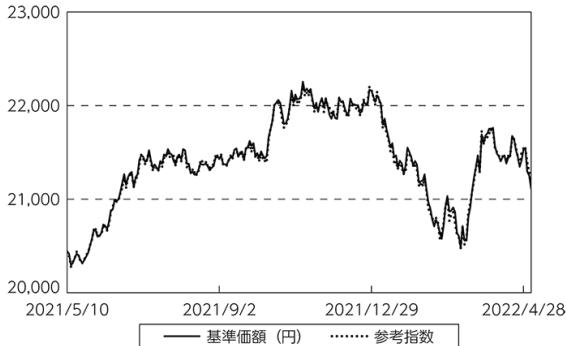
○運用経過

●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3.3%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)

- ・米金利の上昇を受けて日米金利差が拡大したこと等から米ドルが対円で上昇したこと等。

(下落要因)

- ・インフレの長期化等を背景に米金利が上昇したこと等を受けてインフラ債券市況が下落したこと等。

●投資環境について

◎債券市況

- ・インフラ債券市況は下落しました。
- ・インフレの長期化や米連邦準備制度理事会(FRB)による金融政策正常化等を背景に米金利が上昇したこと等を背景にインフラ債券市況は下落しました。

◎為替市況

- ・米ドルは対円で上昇しました。
- ・FRBによる金融政策正常化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

- ・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。
- ・2022年3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概ね中立としました。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。セクター別では通信やエネルギーを市場対比多めの配分としました。

○今後の運用方針

- ・今後は主要中央銀行による金融政策正常化の流れが強まるとみています。また、足元では地政学リスクやインフレの動向に注視しています。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

(2021年5月11日～2022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)	3 (3) (0)	0.012 (0.012) (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	4	0.018	
期中の平均基準価額は、21,414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

(2021年5月11日～2022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	12,082	13,905
		社債券	270,510	191,860
				(2,367)

(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
		91,221	95,195	101,546	109,747

(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

(2021年5月11日～2022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 10,358	百万円 1,975	19.1	百万円 6,042	百万円 1,912	31.6

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2022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 816,158	千アメリカドル 753,938	千円 98,034,590	% 97.7	% —	% 92.7	% 4.8	% 0.2
合 計	816,158	753,938	98,034,590	97.7	—	92.7	4.8	0.2

(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 額面金額	期 末		償還年月日
				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					
	1.749 BP CAP MARK 300810	1.749	3,500	2,893	376,181	2030/8/10
	1.875 AMERICAN TO 301015	1.875	1,000	783	101,896	2030/10/15
	2 KINDER MORGAN I 310215	2.0	7,800	6,335	823,813	2031/2/15
	2.15 PHILLIPS 66 301215	2.15	7,000	5,795	753,602	2030/12/15
	2.236 CHEVRON COR 300511	2.236	1,000	886	115,296	2030/5/11
	2.25 AT&T INC 320201	2.25	3,000	2,473	321,690	2032/2/1
	2.25 NEXTERA ENER 300601	2.25	3,000	2,536	329,814	2030/6/1
	2.3 AMERICAN ELEC 300301	2.3	2,000	1,708	222,167	2030/3/1
	2.3 AMERICAN TOWE 310915	2.3	1,000	795	103,388	2031/9/15
	2.343 CHEVRON USA 500812	2.343	2,000	1,390	180,752	2050/8/12
	2.355 VERIZON COM 320315	2.355	1,000	830	108,033	2032/3/15
	2.4 ENTERGY CORP 310615	2.4	3,000	2,485	323,130	2031/6/15
	2.45 COMCAST CORP 520815	2.45	1,000	659	85,705	2052/8/15
	2.55 AT&T INC 331201	2.55	2,856	2,333	303,481	2033/12/1
	2.55 T-MOBILE USA 310215	2.55	5,000	4,207	547,044	2031/2/15
	2.55 VERIZON COMM 310321	2.55	3,000	2,578	335,249	2031/3/21
	2.65 CENOVUS ENER 320115	2.65	4,000	3,379	439,460	2032/1/15
	2.65 CENTERPOINT 310601	2.65	1,000	865	112,557	2031/6/1
	2.65 VERIZON COMM 401120	2.65	6,000	4,399	572,077	2040/11/20
	2.65 WALT DISNEY 310113	2.65	3,000	2,651	344,794	2031/1/13
	2.75 NEXTERA ENER 291101	2.75	5,000	4,424	575,351	2029/11/1
	2.75 SHELL INTERN 300406	2.75	6,000	5,440	707,382	2030/4/6
	2.772 BP CAP MARK 501110	2.772	1,000	699	90,986	2050/11/10
	2.8 CHARTER COMM 310401	2.8	9,500	7,727	1,004,747	2031/4/1
	2.8 ENTERGY CORP 300615	2.8	8,200	7,162	931,339	2030/6/15
	2.8 ENTERPRISE PR 300131	2.8	1,500	1,345	174,997	2030/1/31
	2.8 VALERO ENERGY 311201	2.8	2,000	1,705	221,801	2031/12/1
	2.85 BERKSHIRE HA 510515	2.85	1,000	701	91,170	2051/5/15
	2.85 DOMINION ENE 260815	2.85	500	480	62,507	2026/8/15
	2.85 SOUTHERN CAL 290801	2.85	1,000	891	115,883	2029/8/1
	2.875 VERIZON COM 501120	2.875	2,000	1,409	183,294	2050/11/20
	2.887 COMCAST COR 511101	2.887	7,656	5,480	712,650	2051/11/1
	2.891 UNION PACIF 360406	2.891	4,000	3,342	434,689	2036/4/6
	2.9 AMERICAN TOWE 300115	2.9	4,000	3,457	449,599	2030/1/15
	2.9 CENTERPOINT E 500701	2.9	2,500	1,892	246,069	2050/7/1
	2.92 HALLIBURTON 300301	2.92	6,000	5,394	701,410	2030/3/1
	2.937 COMCAST COR 561101	2.937	7,912	5,479	712,496	2056/11/1
	2.95 CANADIAN NAT 300715	2.95	5,000	4,401	572,373	2030/7/15
	2.95 CENTERPOINT 300301	2.95	1,000	901	117,194	2030/3/1
	2.95 NATIONAL FUE 310301	2.95	1,000	844	109,834	2031/3/1
	2.95 NISOURCE INC 290901	2.95	4,000	3,580	465,547	2029/9/1
	2.973 UNION PACIF 620916	2.973	2,000	1,385	180,219	2062/9/16
	2.987 VERIZON COM 561030	2.987	921	632	82,212	2056/10/30
	3 NEXTERA ENERGY 520115	3.0	1,000	715	92,997	2052/1/15

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		
	%	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						
3 T-MOBILE USA IN 410215	3.0	2,000	1,488	193,562	2041/2/15	
3.05 BURLINGTN NO 510215	3.05	1,000	762	99,210	2051/2/15	
3.05 NORFOLK SOUT 500515	3.05	1,000	741	96,411	2050/5/15	
3.095 EXXON MOBIL 490816	3.095	2,000	1,552	201,906	2049/8/16	
3.1 CANADIAN PACI 511202	3.1	1,000	737	95,870	2051/12/2	
3.125 COMMONWEAL 510315	3.125	1,000	769	100,103	2051/3/15	
3.125 ENBRIDGE IN 291115	3.125	4,000	3,653	475,068	2029/11/15	
3.125 ENTERPRISE 290731	3.125	6,000	5,535	719,795	2029/7/31	
3.15 COMMONWEALTH 320315	3.15	2,000	1,830	238,019	2032/3/15	
3.15 FLORIDA POWE 491001	3.15	1,000	796	103,514	2049/10/1	
3.15 PACIFIC GAS 260101	3.15	1,500	1,410	183,358	2026/1/1	
3.15 SOUTHWESTERN 500501	3.15	1,000	767	99,752	2050/5/1	
3.15 VERIZON COMM 300322	3.15	1,000	910	118,368	2030/3/22	
3.25 CHEVRON USA 291015	3.25	4,000	3,825	497,491	2029/10/15	
3.25 DUKE ENERGY 491001	3.25	2,000	1,547	201,231	2049/10/1	
3.25 FEDEX CORP 410515	3.25	2,000	1,565	203,555	2041/5/15	
3.25 MAGELLAN MID 300601	3.25	4,000	3,635	472,772	2030/6/1	
3.25 SHELL INTERN 500406	3.25	3,000	2,383	309,869	2050/4/6	
3.279 BP CAPITAL 270919	3.279	950	919	119,612	2027/9/19	
3.3 AT&T INC 520201	3.3	1,000	740	96,223	2052/2/1	
3.3 DOMINION ENER 410415	3.3	2,000	1,598	207,826	2041/4/15	
3.3 KENTUCKY UTIL 500601	3.3	1,000	775	100,829	2050/6/1	
3.3 VIRGINIA ELEC 491201	3.3	1,000	794	103,339	2049/12/1	
3.32 SAN DIEGO G 500415	3.32	2,000	1,572	204,531	2050/4/15	
3.337 BAKER HUGHE 271215	3.337	4,000	3,834	498,651	2027/12/15	
3.35 CSX CORP 251101	3.35	250	248	32,293	2025/11/1	
3.375 DOMINION EN 300401	3.375	6,000	5,510	716,550	2030/4/1	
3.4 DTE ENERGY CO 290615	3.4	8,396	7,797	1,013,964	2029/6/15	
3.4 DUKE ENERGY C 290615	3.4	4,000	3,735	485,766	2029/6/15	
3.4 DUKE ENERGY F 461001	3.4	1,000	811	105,536	2046/10/1	
3.4 NORTHERN STAT 420815	3.4	1,000	835	108,697	2042/8/15	
3.4 XCEL ENERGY I 300601	3.4	1,000	921	119,859	2030/6/1	
3.45 ALABAMA POWE 491001	3.45	2,000	1,579	205,395	2049/10/1	
3.482 EXXON MOBIL 300319	3.482	2,000	1,928	250,787	2030/3/19	
3.49 NISOURCE FIN 270515	3.49	5,700	5,510	716,516	2027/5/15	
3.5 AT&T INC 410601	3.5	6,000	4,868	633,041	2041/6/1	
3.5 AT&T INC 530915	3.5	4,416	3,388	440,637	2053/9/15	
3.5 BERKSHIRE HAT 250201	3.5	500	501	65,225	2025/2/1	
3.5 KANSAS CITY S 500501	3.5	2,000	1,579	205,327	2050/5/1	
3.5 NEXTERA ENERG 290401	3.5	7,500	7,037	915,059	2029/4/1	
3.5 PIEDMONT NATU 290601	3.5	1,500	1,408	183,147	2029/6/1	
3.5 SPECTRA ENERG 250315	3.5	350	348	45,252	2025/3/15	
3.5 WALT DISNEY C 400513	3.5	3,000	2,556	332,451	2040/5/13	
3.5 WILLIAMS COMP 301115	3.5	3,500	3,210	417,475	2030/11/15	
3.55 AT&T INC 550915	3.55	4,183	3,167	411,872	2055/9/15	

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	3.55	ENTERGY TEXA 490930	3.55	1,000	806	104,861	2049/9/30
		3.55	NEXTERA ENER 270501	3.55	3,250	3,169	412,103	2027/5/1
		3.55	PLAINS ALL A 291215	3.55	3,000	2,719	353,621	2029/12/15
		3.6	WALT DISNEY C 510113	3.6	3,000	2,492	324,060	2051/1/13
		3.625	DISCOVERY C 300515	3.625	1,500	1,361	177,023	2030/5/15
		3.633	BP CAP MARK 300406	3.633	7,000	6,681	868,739	2030/4/6
		3.65	AT&T INC 510601	3.65	1,000	792	103,109	2051/6/1
		3.65	AT&T INC 590915	3.65	1,462	1,101	143,186	2059/9/15
		3.65	CANADIAN NAT 480203	3.65	1,000	861	112,058	2048/2/3
		3.65	MIDAMERICAN 480801	3.65	2,000	1,711	222,517	2048/8/1
		3.65	SOUTHERN CAL 280301	3.65	3,000	2,861	372,053	2028/3/1
		3.65	WOODSIDE FI 250305	3.65	4,800	4,762	619,281	2025/3/5
		3.7	ALABAMA POWER 471201	3.7	1,000	834	108,479	2047/12/1
		3.7	CENTERPOINT E 490901	3.7	4,000	3,207	417,045	2049/9/1
		3.7	DTE ELECTRIC 450315	3.7	2,000	1,692	220,021	2045/3/15
		3.7	FLORIDA POWER 471201	3.7	1,000	876	113,961	2047/12/1
		3.7	GEORGIA POWER 500130	3.7	1,000	795	103,465	2050/1/30
		3.7	ONCOR ELECTRI 281115	3.7	1,000	986	128,228	2028/11/15
		3.7	ONCOR ELECTRI 500515	3.7	1,000	865	112,588	2050/5/15
		3.7	ROGERS COMMUN 491115	3.7	1,000	773	100,545	2049/11/15
		3.7	SOUTHERN CO 300430	3.7	2,000	1,861	242,001	2030/4/30
		3.75	AEP TRANSMIS 471201	3.75	1,000	849	110,454	2047/12/1
		3.75	COMCAST CORP 400401	3.75	6,000	5,249	682,657	2040/4/1
		3.75	DTE ELECTRIC 470815	3.75	1,000	868	112,928	2047/8/15
		3.75	DUKE ENERGY 460515	3.75	3,000	2,538	330,100	2046/5/15
		3.75	DUKE ENERGY 460901	3.75	5,500	4,370	568,305	2046/9/1
		3.75	ENERGY TRANS 300515	3.75	9,000	8,272	1,075,702	2030/5/15
		3.75	ENTERGY CORP 500615	3.75	3,000	2,405	312,786	2050/6/15
		3.75	ENTERPRISE P 250215	3.75	500	502	65,346	2025/2/15
		3.75	PACIFIC GAS 280701	3.75	3,500	3,192	415,162	2028/7/1
		3.75	T-MOBILE USA 270415	3.75	4,500	4,371	568,370	2027/4/15
		3.75	WILLIAMS COM 270615	3.75	3,500	3,406	442,969	2027/6/15
		3.758	CONOCOPHILL 420315	3.758	2,300	2,068	268,925	2042/3/15
		3.8	AEP TRANSMISS 490615	3.8	1,500	1,275	165,864	2049/6/15
		3.8	AMERICAN TOWE 290815	3.8	5,000	4,633	602,478	2029/8/15
		3.8	BERKSHIRE HAT 480715	3.8	1,000	836	108,796	2048/7/15
		3.8	CROWN CASTLE 280215	3.8	1,000	959	124,786	2028/2/15
		3.8	MARATHON PETR 280401	3.8	1,000	958	124,638	2028/4/1
		3.8	ONCOR ELECTRI 470930	3.8	1,000	882	114,730	2047/9/30
		3.8	PLAINS ALL AM 300915	3.8	8,000	7,303	949,683	2030/9/15
		3.8	SEMPRA ENERGY 380201	3.8	1,000	873	113,529	2038/2/1
		3.8	VIRGINIA ELEC 470915	3.8	2,500	2,161	281,075	2047/9/15
		3.8	WALT DISNEY C 300320	3.8	1,750	1,697	220,754	2030/3/22
		3.839	UNION PACIF 600320	3.839	2,050	1,710	222,440	2060/3/20
		3.85	CANADIAN NAT 270601	3.85	8,000	7,824	1,017,461	2027/6/1

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	3.85 CHEVRON USA 280115	3.85	1,000	1,003	130,449	2028/1/15
		3.85 KANSAS CITY 231115	3.85	1,500	1,505	195,817	2023/11/15
		3.85 PHILLIPS 66 250409	3.85	1,000	1,004	130,560	2025/4/9
		3.85 SOUTHWESTERN 480201	3.85	1,000	813	105,768	2048/2/1
		3.875 SHELL INTER 281113	3.875	3,000	2,980	387,578	2028/11/13
		3.875 T-MOBILE US 300415	3.875	16,500	15,420	2,005,166	2030/4/15
		3.9 BURLINGTN NOR 460801	3.9	2,000	1,782	231,742	2046/8/1
		3.9 FEDEX CORP 350201	3.9	500	450	58,513	2035/2/1
		3.95 AMERICAN TOW 290315	3.95	1,000	937	121,955	2029/3/15
		3.95 CSX CORP 500501	3.95	1,000	873	113,611	2050/5/1
		3.95 DISCOVERY CO 280320	3.95	8,400	8,064	1,048,602	2028/3/20
		3.95 DUKE ENERGY 480315	3.95	2,000	1,779	231,452	2048/3/15
		3.95 FLORIDA POWE 480301	3.95	3,000	2,732	355,298	2048/3/1
		3.95 MISSISSIPPI 280330	3.95	2,000	1,961	255,050	2028/3/30
		3.95 NISOURCE INC 480330	3.95	3,000	2,446	318,078	2048/3/30
		3.969 COMCAST COR 471101	3.969	1,402	1,225	159,394	2047/11/1
		3.999 COMCAST COR 491101	3.999	725	631	82,151	2049/11/1
		4 CANADIAN PACIFI 280601	4.0	1,000	1,003	130,495	2028/6/1
		4 ENBRIDGE INC 491115	4.0	1,000	840	109,319	2049/11/15
		4 SEMPRA ENERGY 480201	4.0	5,500	4,688	609,708	2048/2/1
		4 SOUTHERN CAL ED 470401	4.0	4,000	3,289	427,764	2047/4/1
		4.025 CONOCOPHILL 620315	4.025	3,650	3,145	409,026	2062/3/15
		4.05 UNION PACIFI 460301	4.05	2,000	1,816	236,158	2046/3/1
		4.1 CENTERPOINT E 470901	4.1	1,000	889	115,671	2047/9/1
		4.1 CSX CORP 440315	4.1	150	132	17,188	2044/3/15
		4.114 EXXON MOBIL 460301	4.114	3,000	2,780	361,518	2046/3/1
		4.125 SOUTHERN CA 480301	4.125	1,000	826	107,509	2048/3/1
4.125 VERIZON COM 270316	4.125	3,000	3,017	392,332	2027/3/16		
4.15 BURLINGTN NO 450401	4.15	4,000	3,655	475,331	2045/4/1		
4.15 COMCAST CORP 281015	4.15	1,150	1,155	150,261	2028/10/15		
4.15 ENABLE MIDST 290915	4.15	5,000	4,687	609,485	2029/9/15		
4.15 ENTERPRISE P 281016	4.15	3,500	3,480	452,586	2028/10/16		
4.15 NORFOLK SOUT 480228	4.15	2,500	2,244	291,825	2048/2/28		
4.2 CHARTER COMM 280315	4.2	1,000	958	124,634	2028/3/15		
4.2 DUKE ENERGY C 490615	4.2	1,000	842	109,571	2049/6/15		
4.2 DUKE ENERGY F 480715	4.2	3,500	3,221	418,850	2048/7/15		
4.2 ENTERPRISE PR 500131	4.2	1,000	845	109,922	2050/1/31		
4.2 KANSAS CITY S 691115	4.2	1,000	833	108,443	2069/11/15		
4.2 PACIFIC GAS & 410601	4.2	3,000	2,296	298,670	2041/6/1		
4.2 SABINE PASS L 280315	4.2	1,000	980	127,525	2028/3/15		
4.2 SOUTHERN CAL 290301	4.2	2,000	1,934	251,561	2029/3/1		
4.2 VIACOMCBS INC 320519	4.2	2,000	1,814	235,999	2032/5/19		
4.227 EXXON MOBIL 400319	4.227	3,000	2,874	373,765	2040/3/19		
4.234 BP CAP MARK 281106	4.234	9,000	9,033	1,174,685	2028/11/6		
4.25 BERKSHIRE HA 501015	4.25	1,000	901	117,266	2050/10/15		

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	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					
	4.25 CENTERPOINT 281101	4.25	592	586	76,257	2028/11/1
	4.25 COMCAST CORP 301015	4.25	4,000	3,970	516,266	2030/10/15
	4.25 DOMINION ENE 280601	4.25	3,000	3,000	390,148	2028/6/1
	4.25 ENTERPRISE P 480215	4.25	2,000	1,711	222,516	2048/2/15
	4.25 FEDEX CORP 300515	4.25	3,000	2,937	381,991	2030/5/15
	4.25 MISSISSIPPI 420315	4.25	2,000	1,749	227,449	2042/3/15
	4.25 SOUTHERN CO 360701	4.25	3,450	3,199	416,059	2036/7/1
	4.25 TRANSCANADA 280515	4.25	4,000	3,979	517,452	2028/5/15
	4.279 MAGALLANES 320315	4.279	2,000	1,827	237,646	2032/3/15
	4.3 AMERICAN ELEC 281201	4.3	8,000	7,921	1,030,028	2028/12/1
	4.3 AT&T INC 300215	4.3	2,000	1,989	258,635	2030/2/15
	4.3 CONOCOPHILLIP 441115	4.3	1,000	940	122,357	2044/11/15
	4.3 CSX CORP 480301	4.3	2,000	1,835	238,692	2048/3/1
	4.3 KINDER MORGAN 280301	4.3	6,500	6,462	840,300	2028/3/1
	4.35 AT&T INC 290301	4.35	13,000	13,026	1,693,774	2029/3/1
	4.375 KENTUCKY UT 451001	4.375	1,000	905	117,719	2045/10/1
	4.375 SHELL INTER 450511	4.375	2,950	2,796	363,637	2045/5/11
	4.375 T-MOBILE US 400415	4.375	2,000	1,784	232,042	2040/4/15
	4.375 VODAFONE GR 280530	4.375	3,500	3,545	461,055	2028/5/30
	4.4 ENERGY TRANSF 270315	4.4	2,000	1,974	256,716	2027/3/15
	4.4 HUSKY ENERGY 290415	4.4	4,000	3,937	512,030	2029/4/15
	4.4 MARATHON OIL 270715	4.4	5,250	5,194	675,493	2027/7/15
	4.4 SOUTHERN CO 460701	4.4	3,250	2,867	372,823	2046/7/1
	4.4 VERIZON COMMU 341101	4.4	1,200	1,162	151,105	2034/11/1
	4.45 BERKSHIRE HA 490115	4.45	1,000	933	121,397	2049/1/15
	4.45 ENTERPRISE P 430215	4.45	1,000	888	115,506	2043/2/15
	4.45 EXELON CORP 460415	4.45	3,100	2,814	366,022	2046/4/15
	4.464 CCO SAFARI 220723	4.464	390	390	50,814	2022/7/23
	4.486 BAKER HUGHE 300501	4.486	2,000	2,004	260,580	2030/5/1
	4.5 APPALACHIAN P 490301	4.5	1,000	914	118,938	2049/3/1
	4.5 AT&T INC 350515	4.5	4,050	3,932	511,346	2035/5/15
	4.5 AT&T INC 480309	4.5	3,386	3,124	406,260	2048/3/9
	4.5 BERKSHIRE HAT 450201	4.5	1,250	1,140	148,313	2045/2/1
	4.5 ENTERGY TEXAS 390330	4.5	1,000	942	122,595	2039/3/30
	4.5 PACIFIC GAS & 400701	4.5	2,000	1,593	207,258	2040/7/1
	4.5 SABINE PASS L 300515	4.5	4,000	3,907	508,066	2030/5/15
	4.5 TRANSURBAN QL 280419	4.5	3,300	3,268	424,942	2028/4/19
	4.5 VERIZON COMMU 330810	4.5	4,000	3,928	510,818	2033/8/10
	4.522 VERIZON COM 480915	4.522	4,424	4,188	544,649	2048/9/15
	4.55 FEDEX CORP 460401	4.55	4,000	3,582	465,856	2046/4/1
	4.55 PACIFIC GAS 300701	4.55	4,000	3,657	475,607	2030/7/1
	4.6 BERKSHIRE HAT 530501	4.6	2,000	1,901	247,205	2053/5/1
	4.65 DISCOVERY CO 500515	4.65	2,500	2,059	267,817	2050/5/15
	4.65 PIEDMONT NAT 430801	4.65	1,500	1,405	182,768	2043/8/1
	4.7 DOMINION ENER 441201	4.7	1,000	931	121,183	2044/12/1

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					
	4.7 EXELON CORP 500415	4.7	2,000	1,874	243,766	2050/4/15
	4.7 MPLX LP 480415	4.7	1,000	861	112,062	2048/4/15
	4.709 FOX CORP 290125	4.709	1,000	998	129,885	2029/1/25
	4.75 ENERGY TRANS 260115	4.75	1,500	1,516	197,206	2026/1/15
	4.8 CANADIAN PACI 450801	4.8	2,000	1,960	254,973	2045/8/1
	4.8 MPLX LP 290215	4.8	2,000	2,010	261,366	2029/2/15
	4.85 ENTERPRISE P 420815	4.85	1,750	1,633	212,455	2042/8/15
	4.85 ENTERPRISE P 440315	4.85	1,250	1,161	151,056	2044/3/15
	4.862 VERIZON COM 460821	4.862	5,110	5,062	658,267	2046/8/21
	4.875 MPLX LP 250601	4.875	3,000	3,066	398,713	2025/6/1
	4.875 PHILLIPS 66 441115	4.875	2,000	1,942	252,526	2044/11/15
	4.875 TRANSCANADA 480515	4.875	2,000	1,941	252,455	2048/5/15
	4.875 VODAFONE GR 490619	4.875	1,000	928	120,740	2049/6/19
	4.9 BURLINGTN NOR 440401	4.9	2,000	2,010	261,443	2044/4/1
	4.9 DOMINION RESO 410801	4.9	200	192	25,038	2041/8/1
	4.9 FEDEX CORP 340115	4.9	1,500	1,499	194,995	2034/1/15
	4.908 CCO SAFARI 250723	4.908	6,380	6,493	844,329	2025/7/23
	4.95 ENERGY TRANS 280615	4.95	3,000	3,015	392,147	2028/6/15
	4.95 PACIFIC GAS 500701	4.95	1,000	808	105,065	2050/7/1
	4.95 VIACOMCBS IN 310115	4.95	5,000	4,886	635,344	2031/1/15
	5 DEVON ENERGY CO 450615	5.0	1,000	945	122,908	2045/6/15
	5 ROGERS COMMUNIC 440315	5.0	2,000	1,863	242,325	2044/3/15
	5 SABINE PASS LIQ 270315	5.0	2,000	2,043	265,703	2027/3/15
	5.012 VERIZON COM 490415	5.012	4,000	4,105	533,798	2049/4/15
	5.012 VERIZON COM 540821	5.012	2,250	2,280	296,583	2054/8/21
	5.05 CHARTER COMM 290330	5.05	6,750	6,595	857,622	2029/3/30
	5.1 EXELON CORP 450615	5.1	150	147	19,231	2045/6/15
	5.1 WILLIAMS COMP 450915	5.1	1,500	1,422	185,028	2045/9/15
	5.141 MAGALLANES 520315	5.141	5,000	4,342	564,682	2052/3/15
	5.15 AT&T INC 500215	5.15	4,000	4,077	530,261	2050/2/15
	5.15 PLAINS ALL A 420601	5.15	157	133	17,417	2042/6/1
	5.2 CROWN CASTLE 490215	5.2	1,000	968	125,885	2049/2/15
	5.2 DISCOVERY COM 470920	5.2	1,500	1,334	173,568	2047/9/20
	5.2 MPLX LP 470301	5.2	1,200	1,104	143,663	2047/3/1
	5.213 TELEFONICA 470308	5.213	1,300	1,196	155,572	2047/3/8
	5.25 DOMINION RES 330801	5.25	346	357	46,497	2033/8/1
	5.25 ENERGY TRANS 290415	5.25	8,000	8,093	1,052,452	2029/4/15
	5.25 FEDEX CORP 500515	5.25	1,000	989	128,680	2050/5/15
	5.25 VODAFONE GRO 480530	5.25	3,000	2,894	376,433	2048/5/30
	5.3 ENERGY TRANSF 470415	5.3	1,000	888	115,524	2047/4/15
	5.35 SUNOCO LOGIS 450515	5.35	500	442	57,585	2045/5/15
	5.375 CHARTER COM 470501	5.375	2,100	1,806	234,902	2047/5/1
	5.391 MAGALLANES 620315	5.391	2,000	1,717	223,325	2062/3/15
	5.476 FOX CORP 390125	5.476	1,250	1,245	161,890	2039/1/25
	5.5 ENBRIDGE ENER 400915	5.5	200	202	26,354	2040/9/15

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	
		%	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	5.5	1,000	955	124,181	2049/2/15
	5.5 MPLX LP 490215	5.5	1,000	1,083	140,865	2040/3/25
	5.55 SHELL INTERNA 400325	5.55	3,050	2,974	386,791	2045/6/1
	5.6 KINDER MORG 450601	5.6	1,000	1,015	132,077	2041/7/15
	5.6 DEVON ENERGY 410715	5.6	1,000	958	124,686	2042/6/15
	5.6 EXELON GENERA 420615	5.6	1,000	958	124,686	2042/6/15
	5.625 EXELON CORP 350615	5.625	1,200	1,245	161,978	2035/6/15
	5.625 SABINE PASS 250301	5.625	500	519	67,550	2025/3/1
	5.75 BURLINGTN NO 400501	5.75	650	716	93,188	2040/5/1
	5.75 CANADIAN PAC 420115	5.75	1,100	1,164	151,457	2042/1/15
	5.75 MIDAMERIC 351101	5.75	100	111	14,442	2035/11/1
	5.8 ENERGY TRANSF 380615	5.8	1,000	978	127,296	2038/6/15
	5.8 MIDAMERICAN 361015	5.8	1,400	1,558	202,590	2036/10/15
	5.875 ENBRIDGE EN 251015	5.875	1,580	1,679	218,338	2025/10/15
	5.875 TIME WARNER 401115	5.875	600	569	74,106	2040/11/15
	5.95 CANADIAN PAC 370515	5.95	700	786	102,212	2037/5/15
	5.95 DOMINION R 350615	5.95	2,150	2,290	297,883	2035/6/15
	5.95 SUNCOR ENERG 350515	5.95	1,000	1,061	137,983	2035/5/15
	6 AT&T INC 400815	6.0	2,000	2,186	284,351	2040/8/15
	6 SEMPRA ENERGY 391015	6.0	1,450	1,587	206,359	2039/10/15
	6.05 DUKE ENERGY 380415	6.05	1,125	1,257	163,509	2038/4/15
	6.1 TRANS-CANADA 400601	6.1	500	546	71,079	2040/6/1
	6.125 MIDAMERICAN 360401	6.125	4,194	4,715	613,201	2036/4/1
	6.15 BURLINGTN NO 370501	6.15	795	923	120,071	2037/5/1
	6.15 CSX CORP 370501	6.15	1,700	1,929	250,879	2037/5/1
	6.15 VODAFONE GRO 370227	6.15	2,000	2,166	281,666	2037/2/27
	6.25 EXELON GENER 391001	6.25	1,000	1,026	133,460	2039/10/1
	6.3 DOMINION RESO 330315	6.3	250	278	36,194	2033/3/15
	6.3 WILLIAMS PART 400415	6.3	1,200	1,292	168,073	2040/4/15
	6.35 DISCOVERY CO 400601	6.35	1,000	1,029	133,801	2040/6/1
	6.384 CHARTER COM 351023	6.384	8,000	8,159	1,060,982	2035/10/23
	6.45 ENTERPRISE 400901	6.45	250	275	35,779	2040/9/1
	6.484 CHARTER COM 451023	6.484	2,000	1,950	253,578	2045/10/23
	6.5 MARATHON PETR 410301	6.5	2,850	3,156	410,405	2041/3/1
	6.5 SUNCOR ENERGY 380615	6.5	2,000	2,243	291,759	2038/6/15
	6.55 TIME WARNER 370501	6.55	500	515	67,012	2037/5/1
	6.65 WALT DISNEY 371115	6.65	1,000	1,205	156,692	2037/11/15
	6.7 PLAINS ALL AM 360515	6.7	150	151	19,687	2036/5/15
	6.75 CONS EDISON 380401	6.75	750	888	115,536	2038/4/1
	6.85 SUNCOR ENERG 390601	6.85	2,000	2,297	298,724	2039/6/1
	6.875 VIACOM INC 360430	6.875	6,750	7,295	948,584	2036/4/30
	7.045 TELEFONICA 360620	7.045	1,000	1,127	146,664	2036/6/20
	7.05 COMCAST CORP 330315	7.05	500	602	78,348	2033/3/15
	7.3 KINDER MORGAN 330815	7.3	500	574	74,748	2033/8/15
	7.4 KINDER MORGAN 310315	7.4	500	575	74,892	2031/3/15
	7.5 ENBRIDGE ENER 380415	7.5	300	359	46,721	2038/4/15

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	7.5	500	555	72,173	2038/7/1
		7.875	400	466	60,626	2030/7/30
		7.875	3,000	3,619	470,698	2031/9/30
		8.375	3,800	4,542	590,603	2033/7/15
		8.75	8,800	11,151	1,449,964	2030/6/15
		9.0	700	910	118,423	2031/3/1
合	計				98,034,590	

(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	債券先物取引	NOTE5Y	6,263	—
		NOTE2Y	1,620	—
		NOTE10Y	753	—
国		T-BOND	2,813	—
		ULTR10Y 2206	—	14,442
		BOND30Y	2,234	—

(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

(2022年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	98,034,590	96.6
コール・ローン等、その他	3,466,011	3.4
投資信託財産総額	101,500,601	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (100,441,140千円) の投資信託財産総額 (101,500,601千円) に対する比率は99.0%です。

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

1 アメリカドル=130.03円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	100,861,966,087
コール・ローン等	409,807,777
公社債(評価額)	98,034,590,795
未収入金	1,122,030,814
未収利息	1,012,034,500
前払費用	18,731,780
差入委託証拠金	264,770,421
(B) 負債	564,983,926
未払金	221,043,860
未払解約金	343,940,000
未払利息	66
(C) 純資産総額(A-B)	100,296,982,161
元本	47,502,256,784
次期繰越損益金	52,794,725,377
(D) 受益権総口数	47,502,256,784口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,114円

<注記事項>

- ①期首元本額 45,542,148,746円
期中追加設定元本額 5,284,876,011円
期中一部解約元本額 3,324,767,973円
また、1口当たり純資産額は、期末2.1114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/マッコーリー 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)	39,230,967,755円
三菱UFJ/マッコーリー 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)	4,048,534,272円
マッコーリー 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)	2,503,132,629円
三菱UFJ/マッコーリー 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)	1,171,080,922円
三菱UFJ/マッコーリー 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)	465,332,332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)	73,024,855円
マッコーリー ヘッジ付グローバル・インフラ債券ファンド(ラップ向け)	10,184,019円
合計	47,502,256,784円

【お知らせ】

AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドのパブリック・マーケティング部門がマッコーリー・アセット・マネジメント・ホールディングス・ピーティーワイ・リミテッドに売却されることに伴い、運用指図権限の委託先の変更およびファンド名称の変更等をするため、信託約款に所要の変更を行いました。

ファンド名称の変更について

変更前：AMP グローバル・インフラ債券マザーファンド

変更後：マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

(2022年3月26日)

○損益の状況 (2021年5月11日～2022年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,326,243,323
受取利息	4,326,311,069
支払利息	△ 67,746
(B) 有価証券売買損益	△ 1,570,461,152
売買益	19,586,687,673
売買損	△21,157,148,825
(C) 先物取引等取引損益	275,616,266
取引益	3,595,167,204
取引損	△ 3,319,550,938
(D) 保管費用等	△ 13,657,726
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,017,740,711
(F) 前期繰越損益金	47,545,432,704
(G) 追加信託差損益金	6,001,693,989
(H) 解約差損益金	△ 3,770,142,027
(I) 計(E+F+G+H)	52,794,725,377
次期繰越損益金(I)	52,794,725,377

(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。