

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	2016年12月28日〔当初、2022年5月20日〕まで (2012年7月20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。	

※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。

償還報告書(全体版)

[繰上償還]

新興国債券インデックスオープン



信託終了日：2016年12月28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、「新興国債券インデックスオープン」は、約款の規定に基づき、先般ご案内申し上げました予定通り、12月28日に繰り上げて償還させていただきました。ここに謹んで運用経過と償還内容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
URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(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、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

新興国債券インデックスオープンのご報告

◇設定以来の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇1万口当たりの費用明細	8
◇売買及び取引の状況	8
◇利害関係人との取引状況等	9
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	9
◇組入資産の明細	9
◇投資信託財産の構成	10
◇資産、負債、元本及び償還価額の状況	10
◇損益の状況	10
◇投資信託財産運用総括表	11
◇償還金のお知らせ	11
◇お知らせ	11

マザーファンドのご報告

◇新興国債券インデックスマザーファンド	12
---------------------	----

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。

○設定以来の運用実績

決算期	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)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配	み 金 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率			
(設定日)	円 銭	円	%		%	%	%	百万円
2012年7月20日	10,000	—	—	23,416.48	—	—	—	1
1期(2013年5月20日)	14,015	0	40.2	33,402.45	42.6	95.3	—	114
2期(2014年5月20日)	12,776	0	△ 8.8	30,948.15	△ 7.3	95.8	—	85
3期(2015年5月20日)	13,301	0	4.1	32,636.87	5.5	95.0	—	4
4期(2016年5月20日)	11,064	0	△16.8	27,552.22	△15.6	95.5	—	1
(償還時)	(償還価額)							
5期(2016年12月28日)	11,662.02	—	5.4	29,950.62	8.7	—	—	1

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 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) 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G B I - E M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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○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
	円 銭	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率		
(期 首) 2016年5月20日	11,064	% —	27,552.22	% —	% 95.5	% —
5 月 末	11,123	0.5	27,810.88	0.9	93.9	—
6 月 末	10,881	△1.7	27,198.29	△1.3	94.9	—
7 月 末	11,001	△0.6	27,623.27	0.3	95.5	—
8 月 末	10,991	△0.7	27,617.06	0.2	95.1	—
9 月 末	10,934	△1.2	27,583.31	0.1	94.6	—
10 月 末	11,205	1.3	28,233.03	2.5	95.1	—
11 月 末	11,201	1.2	28,136.25	2.1	95.7	—
(償還時) 2016年12月28日	(償還価額) 11,662.02	5.4	29,950.62	8.7	—	—

(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。

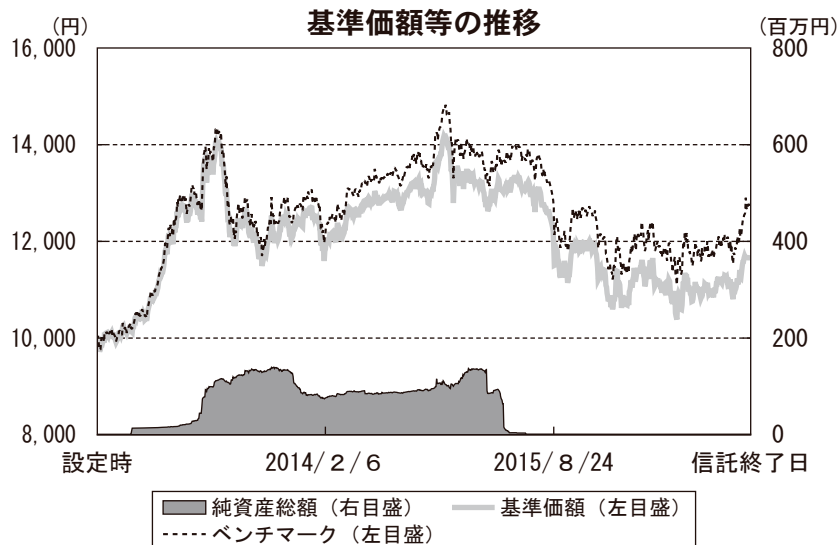
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

設定来の基準価額等の推移について

(第1期～第5期：2012/7/20～2016/12/28)

基準価額の動き	償還価額は設定時に比べ16.6%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(27.9%)を11.3%下回りました。



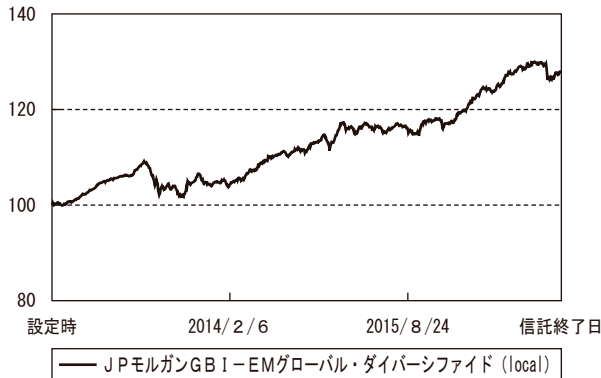
基準価額の主な変動要因

上昇要因	利金が相応に積み上がり、債券市況（JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（local））が上昇（利回りは低下）したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	新興国から資金が流出する動きが強まり一部の新興国通貨が対円で売られたことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第1期～第5期：2012/7/20～2016/12/28)

債券市況の推移 (設定時を100として指数化)

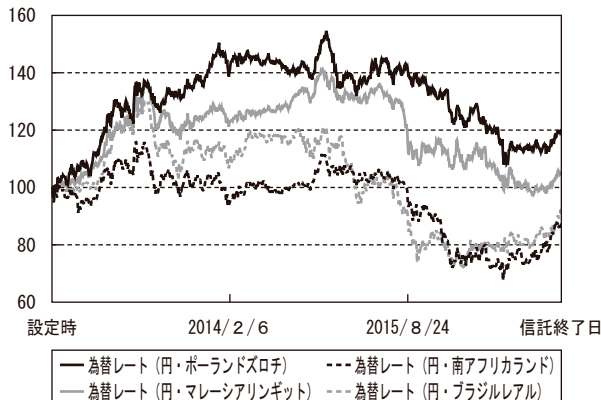


(注) JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

◎債券市況

・FRB（米連邦準備制度理事会）が2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどをを受けて、新興国から資金が流出する局面もありましたが、利金が相応に積みあがったことから、新興国の現地通貨建て債券市況は設定時に比べ上昇しました。

為替市況の推移 (設定時を100として指数化)



◎為替市況

・2012年後半から、日銀の追加金融緩和と政策への期待が高まったことなどを背景に、新興国通貨は全般的に対円で上昇しましたが、2014年以降、FRBが2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどをを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まったことが、新興国通貨が対円で売られる要因となりました。特に、政情不安などを背景にトルコリラ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

＜新興国債券インデックスオープン＞

- ・新興国債券インデックスマザーファンドを主要投資対象とし、これを通じて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。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。このため基準価額は、マザーファンドに組み入れられた資産の市況変動の影響を反映しました。

＜第1期：設定時～2013年5月20日＞

基準価額は設定時に比べ40.2%の上昇となりました。

＜第2期：2013年5月21日～2014年5月20日＞

基準価額は期首に比べ8.8%の下落となりました。

＜第3期：2014年5月21日～2015年5月20日＞

基準価額は期首に比べ4.1%の上昇となりました。

＜第4期：2015年5月21日～2016年5月20日＞

基準価額は期首に比べ16.8%の下落となりました。

＜第5期：2016年5月21日～信託終了日＞

償還価額は期首に比べ5.4%の上昇となりました。

＜新興国債券インデックスマザーファンド＞

基準価額は設定時に比べ24.3%の上昇となりました。

- ・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。
- ・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。

＜第1期：設定時～2013年5月20日＞

基準価額は設定時に比べ41.3%の上昇となりました。

＜第2期：2013年5月21日～2014年5月20日＞

基準価額は期首に比べ7.9%の下落となりました。

＜第3期：2014年5月21日～2015年5月20日＞
基準価額は期首に比べ5.2%の上昇となりました。

＜第4期：2015年5月21日～2016年5月20日＞
基準価額は期首に比べ16.0%の下落となりました。

＜第5期：2016年5月21日～信託終了日＞
基準価額は期首に比べ8.2%の上昇となりました。

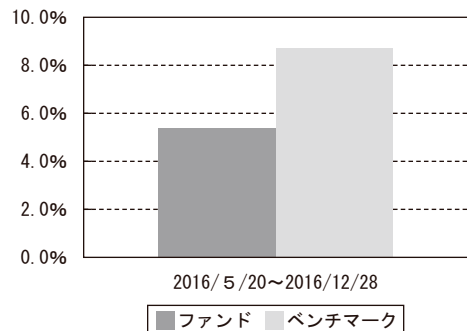
当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜新興国債券インデックスオープン＞

- ・右記のグラフは第5期を掲載しています。
- ・設定来のファンドの騰落率は、ベンチマークであるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバシファイド（円換算ベース）の騰落率（27.9%）を11.3%下回りました。これは、実質的な運用を行ったマザーファンドの運用成果がベンチマークを下回ったことや信託報酬等のコストによるものです。

（第5期：2016/5/21～信託終了日）

基準価額（ヘビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



＜第1期：設定時～2013年5月20日＞
ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（42.6%）を2.4%下回りました。

＜第2期：2013年5月21日～2014年5月20日＞
ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-7.3%）を1.5%下回りました。

＜第3期：2014年5月21日～2015年5月20日＞
ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（5.5%）を1.4%下回りました。

＜第4期：2015年5月21日～2016年5月20日＞
ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-15.6%）を1.2%下回りました。

＜第5期：2016年5月21日～信託終了日＞
ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（8.7%）を3.3%下回りました。
なお、繰上償還決定後、当ファンドはマザーファンドを速やかに売却したため、マザーファンドの値動きとは一致せず乖離が生じています。

<新興国債券インデックスマザーファンド>

ベンチマークは設定時に比べ27.9%の上昇となったため、カイ離は Δ 3.6%程度となりました。

<第1期：設定時～2013年5月20日>

ベンチマークは42.6%の上昇となったため、カイ離は Δ 1.3%程度となりました。

<第2期：2013年5月21日～2014年5月20日>

ベンチマークは7.3%の下落となったため、カイ離は Δ 0.6%程度となりました。

<第3期：2014年5月21日～2015年5月20日>

ベンチマークは5.5%の上昇となったため、カイ離は Δ 0.3%程度となりました。

<第4期：2015年5月21日～2016年5月20日>

ベンチマークは15.6%の下落となったため、カイ離は Δ 0.4%程度となりました。

<第5期：2016年5月21日～信託終了日>

ベンチマークは8.7%の上昇となったため、カイ離は Δ 0.5%程度となりました。

分配金について

信託期間中の収益の分配はありません。

償還価額

<新興国債券インデックスオープン>

償還価額は11,662円02銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

○1万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2016年12月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(31)	(0.283)	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)	(0.289)	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)	(4)	(0.040)	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	7	0.060	(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)	(6)	(0.054)	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)	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	75	0.673	
期中の平均基準価額は、11,048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、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を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

(2016年5月21日～2016年12月28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 0.172	千円 0.204	千口 931	千円 1,172

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2016年12月28日)

利害関係人との取引状況

＜新興国債券インデックスオープン＞

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	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 2,229	百万円 813	% 36.5	百万円 1,415	百万円 327	% 23.1

平均保有割合 0.0%

※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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2016年12月28日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
新興国債券インデックスマザーファンド			千口 931

○投資信託財産の構成

(2016年12月28日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 1,167	% 100.0
投資信託財産総額	1,167	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2016年12月28日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	1,167,399
コール・ローン等	1,167,399
(B) 負債	1,197
未払信託報酬	1,196
未払利息	1
(C) 純資産総額(A-B)	1,166,202
元本	1,000,000
償還差益金	166,202
(D) 受益権総口数	1,000,000口
1万口当たり償還価額(C/D)	11,662円02銭

<注記事項>

期首元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 0円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.166202円です。

○損益の状況 (2016年5月21日～2016年12月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 10
支払利息	△ 10
(B) 有価証券売買損益	66,575
売買益	66,788
売買損	△ 213
(C) 信託報酬等	△ 6,770
(D) 当期損益金(A+B+C)	59,795
(E) 前期繰越損益金	△194,717
(F) 追加信託差損益金	301,124
(配当等相当額)	(337,439)
(売買損益相当額)	(△ 36,315)
償還差益金(D+E+F)	166,202

(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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2012年7月20日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年12月28日		資産総額	1,167,399円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	1,197円
				純資産総額	1,166,202円
受益権口数	1,000,000口	1,000,000口	一口	受益権口数	1,000,000口
元本額	1,000,000円	1,000,000円	ー円	1万円当たり償還金	11,662円02銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	81,686,200円	114,480,606円	14,015円	0円	0%
第2期	66,651,316	85,155,717	12,776	0	0
第3期	3,182,348	4,232,824	13,301	0	0
第4期	1,000,000	1,106,407	11,064	0	0

○償還金のお知らせ

1万円当たり償還金(税込み)	11,662円02銭
----------------	------------

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。)を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※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。

【お知らせ】

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年8月20日)
- ②全残存口数に対して受益者からの解約請求があり、約款第47条第1項に規定する「やむを得ない事情が発生」した場合に該当したため、繰上償還しました。
(2016年12月28日)
- ③2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%(法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。))の税率が適用されます。

新興国債券インデックスマザーファンド

《第6期》決算日2016年1月26日

[計算期間：2015年1月27日～2016年1月26日]

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第6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6期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	新興国の現地通貨建の公社債を主要投資対象とし、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。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
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
2期(2012年1月26日)	9,940	△ 1.5	22,308.16	△ 1.6	97.6	—	1,744
3期(2013年1月28日)	12,776	28.5	29,209.25	30.9	96.5	—	2,679
4期(2014年1月27日)	12,503	△ 2.1	28,701.99	△ 1.7	95.2	—	3,441
5期(2015年1月26日)	14,203	13.6	32,849.46	14.5	95.0	—	7,742
6期(2016年1月26日)	11,515	△18.9	26,826.64	△18.3	95.9	—	9,861

(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) 2015年 1 月 26 日	円 14,203	% —	32,849.46	% —	% 95.0	% —
1 月 末	14,191	△ 0.1	32,771.81	△ 0.2	94.3	—
2 月 末	14,020	△ 1.3	32,442.87	△ 1.2	95.2	—
3 月 末	13,688	△ 3.6	31,531.29	△ 4.0	94.5	—
4 月 末	14,016	△ 1.3	32,461.89	△ 1.2	95.0	—
5 月 末	14,132	△ 0.5	32,557.20	△ 0.9	95.2	—
6 月 末	13,755	△ 3.2	31,765.24	△ 3.3	93.9	—
7 月 末	13,571	△ 4.4	31,302.36	△ 4.7	94.9	—
8 月 末	12,618	△ 11.2	29,219.41	△ 11.1	95.1	—
9 月 末	11,947	△ 15.9	27,639.62	△ 15.9	93.5	—
10 月 末	12,612	△ 11.2	29,247.64	△ 11.0	95.0	—
11 月 末	12,615	△ 11.2	29,451.50	△ 10.3	96.0	—
12 月 末	12,193	△ 14.2	28,342.51	△ 13.7	95.1	—
(期 末) 2016年 1 月 26 日	11,515	△ 18.9	26,826.64	△ 18.3	95.9	—

(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

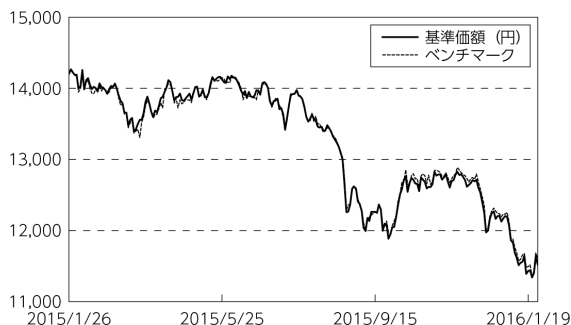
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ18.9%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(－18.3%)を0.6%下回りました。

基準価額の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎債券市況

・FRB（米連邦準備制度理事会）が2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどをを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まりましたが、新興国の現地通貨建て債券市況の代表的な指標であるJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（local）は期首に比べて上昇しました。

◎為替市況

・FRBが2008年12月から過去最低水準で維持してきた政策金利の引き上げに踏み切ったことや、原油を始めとした資源価格が低迷したことなどをを受けて、新興国から資金が流出する動きが強まったことから、新興国通貨は対円で下落しました。特に国内の政治的混乱なども伴ったブラジルレアルや南アフリカランドなどの通貨が対円で下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

・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18.3%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.6\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要因	管理コスト 等 要因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.4\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	0.0%程度	$\Delta 0.6\%$ 程度

（注）四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

・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。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

・カストディーフィー、取引コスト、税金等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は0.0%程度でした。

・為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎今後の運用方針

・今後の運用についても、運用方針を堅持します。

・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。

・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などが連動する債券に投資することがあります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 17	% 0.128	(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 ）	(16)	(0.122)	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)	(0.000)	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)	(0.006)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	17	0.128	
期中の平均基準価額は、13,279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

(2015年1月27日～2016年1月26日)

公社債

		買付額	売付額
外	メキシコ	千メキシコペソ 94,341	千メキシコペソ 39,995
	ブラジル	千ブラジルレアル 31,300	千ブラジルレアル 15,318
	コロンビア	千コロンビアペソ 10,180,946	千コロンビアペソ 4,311,268
	ペルー	千ペルーヌエボソル 2,107	千ペルーヌエボソル -
	トルコ	千トルコリラ 18,803	千トルコリラ 8,224
	ハンガリー	千ハンガリーフォリント 1,263,866	千ハンガリーフォリント 413,203
	ポーランド	千ポーランドズロチ 28,943	千ポーランドズロチ 12,676
	ロシア	千ロシアルーブル 157,481	千ロシアルーブル 42,906
	マレーシア	千マレーシアリンギット 20,406	千マレーシアリンギット 7,779
	タイ	千タイバーツ 160,830	千タイバーツ 35,006
国	フィリピン	千フィリピンペソ 11,625	千フィリピンペソ 5,125
	インドネシア	千インドネシアルピア 57,704,250	千インドネシアルピア 11,872,780
	南アフリカ	千南アフリカランド 79,794	千南アフリカランド 20,001
	ナイジェリア	千ナイジェリアナイラ 58,224	千ナイジェリアナイラ 239,795

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2015年1月27日～2016年1月26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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為替直物取引	百万円 6,731	百万円 135	% 2.0	百万円 2,613	百万円 20	% 0.8

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年1月26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 133,900	千メキシコペソ 147,967	千円 939,590	% 9.5	% —	% 5.8	% 2.5	% 1.2
ブラジル	千ブラジルレアル 43,750	千ブラジルレアル 32,329	933,998	9.5	—	2.0	4.9	2.5
チリ	千チリペソ 50,000	千チリペソ 51,222	8,395	0.1	—	—	0.1	—
コロンビア	千コロンビアペソ 16,380,000	千コロンビアペソ 15,416,285	536,486	5.4	—	3.8	1.6	—
ペルー	千ペルーヌエボソル 4,950	千ペルーヌエボソル 4,733	161,413	1.6	—	1.4	0.3	—
トルコ	千トルコリラ 25,400	千トルコリラ 23,355	913,211	9.3	—	4.1	4.5	0.7
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 1,542,300	千ハンガリーフォリント 1,742,539	715,486	7.3	7.3	2.6	3.9	0.8
ポーランド	千ポーランドズロチ 36,200	千ポーランドズロチ 38,443	1,099,489	11.1	—	4.3	5.0	1.9
ロシア	千ロシアルーブル 338,900	千ロシアルーブル 298,450	441,707	4.5	—	2.1	1.9	0.5
マレーシア	千マレーシアリンギット 35,120	千マレーシアリンギット 35,328	974,001	9.9	—	4.8	3.8	1.3
タイ	千タイバーツ 259,800	千タイバーツ 284,059	931,715	9.4	—	5.2	2.9	1.3
フィリピン	千フィリピンペソ 15,000	千フィリピンペソ 16,225	39,915	0.4	—	0.3	0.1	—
インドネシア	千インドネシアルピア 112,370,000	千インドネシアルピア 109,059,501	927,005	9.4	—	8.3	0.9	0.2
南アフリカ	千南アフリカランド 134,700	千南アフリカランド 117,380	838,099	8.5	—	6.8	1.2	0.5
合 計	—	—	9,460,517	95.9	7.3	51.3	33.8	10.8

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利率	当 額面金額	期 末 評 価 額		償還年月日
				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 MEXICAN BONOS 241205	10.0	14,300	18,185	115,476	2024/12/5
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	3,500	4,676	29,694	2036/11/20
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	10,700	10,775	68,424	2018/6/14
	5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	4,900	4,978	31,613	2017/6/15
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	5,500	5,475	34,768	2019/12/11
	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	1,200	1,155	7,334	2026/3/5
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	10,500	10,976	69,702	2021/6/10
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	6,800	7,072	44,911	2022/6/9
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	4,700	5,118	32,502	2027/6/3
	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	12,200	13,055	82,905	2017/12/14
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	7,500	8,215	52,166	2031/5/29
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	4,500	4,903	31,138	2034/11/23
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	8,200	8,920	56,642	2042/11/13
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	7,000	7,757	49,261	2020/6/11
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	5,900	6,644	42,193	2023/12/7
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	14,100	15,539	98,674	2018/12/13
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	6,400	7,476	47,478	2029/5/31
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	6,000	7,039	44,702	2038/11/18
小	計				939,590	
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 (IN)BRAZIL NTN 180101	10.0	900	828	23,933	2018/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 190101	10.0	1,700	1,484	42,875	2019/1/1
	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	10.0	4,850	3,468	100,217	2025/1/1
	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	10.0	7,400	5,966	172,367	2021/1/1
	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	10.0	4,650	3,507	101,321	2023/1/1
	BRAZIL-LTN 170701	—	3,600	2,937	84,863	2017/7/1
	BRAZIL-LTN 171001	—	2,600	2,037	58,858	2017/10/1
	BRAZIL-LTN 180101	—	3,750	2,831	81,816	2018/1/1
	BRAZIL-LTN 180701	—	4,500	3,137	90,628	2018/7/1
	BRAZIL-LTN 190101	—	6,100	3,927	113,458	2019/1/1
	BRAZIL-LTN 190701	—	3,700	2,203	63,657	2019/7/1
小	計				933,998	
チリ			千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券					
	5.5 CHILE (GL) 200805	5.5	50,000	51,222	8,395	2020/8/5
小	計				8,395	
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 TITULOS DE TES 240724	10.0	1,950,000	2,093,110	72,840	2024/7/24
	11 TITULOS DE TES 200724	11.0	600,000	661,878	23,033	2020/7/24
	4.375 COLOMBI (GL) 230321	4.375	1,680,000	1,382,640	48,115	2023/3/21
	5 TITULOS DE TESO 181121	5.0	3,700,000	3,472,228	120,833	2018/11/21
	6 TITULOS DE TESO 280428	6.0	1,550,000	1,171,707	40,775	2028/4/28
	7 TITULOS DE TESO 190911	7.0	550,000	533,841	18,577	2019/9/11
	7 TITULOS DE TESO 220504	7.0	1,400,000	1,290,394	44,905	2022/5/4
	7.5 TITULOS DE TE 260826	7.5	600,000	534,294	18,593	2026/8/26

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	7.75 COLOMBI (GL) 210414	7.75	1,310,000	1,323,100	46,043	2021/4/14	
	7.75 TITULOS DE T 300918	7.75	1,750,000	1,504,422	52,353	2030/9/18	
	9.85 COLOMBI (GL) 270628	9.85	1,290,000	1,448,670	50,413	2027/6/28	
小 計					536,486		
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	5.2 PERU 230912	5.2	300	267	9,106	2023/9/12	
	5.7 PERU 240812	5.7	1,000	903	30,792	2024/8/12	
	6.9 PERU 370812	6.9	600	534	18,226	2037/8/12	
	6.95 PERU 310812	6.95	1,400	1,290	44,017	2031/8/12	
	7.84 PERU 200812	7.84	750	788	26,901	2020/8/12	
	8.2 PERU 260812	8.2	900	949	32,367	2026/8/12	
小 計					161,413		
トルコ				千トルコリラ	千トルコリラ		
国債証券	10.4 TURKEY GOVT 190327	10.4	1,100	1,086	42,479	2019/3/27	
	10.4 TURKEY GOVT 240320	10.4	1,000	974	38,118	2024/3/20	
	10.5 TURKEY GOVT 200115	10.5	1,400	1,390	54,352	2020/1/15	
	6.3 TURKEY GOVT 180214	6.3	1,400	1,284	50,217	2018/2/14	
	7.1 TURKEY GOVT 230308	7.1	2,000	1,635	63,939	2023/3/8	
	7.4 TURKEY GOVT 200205	7.4	1,600	1,425	55,718	2020/2/5	
	8 TURKEY GOVT 250312	8.0	2,200	1,848	72,267	2025/3/12	
	8.3 TURKEY GOVT 180620	8.3	1,600	1,514	59,214	2018/6/20	
	8.5 TURKEY GOVT 190710	8.5	2,000	1,865	72,944	2019/7/10	
	8.5 TURKEY GOVT 220914	8.5	1,400	1,249	48,868	2022/9/14	
	8.8 TURKEY GOVT 181114	8.8	1,600	1,520	59,462	2018/11/14	
	8.8 TURKEY GOVT 230927	8.8	1,800	1,611	62,999	2023/9/27	
	9 TURKEY GOVT 170308	9.0	1,700	1,665	65,122	2017/3/8	
	9 TURKEY GOVT 240724	9.0	1,700	1,538	60,141	2024/7/24	
	9.4 TURKEY GOVT 200708	9.4	1,400	1,331	52,069	2020/7/8	
9.5 TURKEY GOVT 220112	9.5	1,500	1,414	55,295	2022/1/12		
小 計					913,211		
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	2.5 HUNGARY 180622	2.5	109,000	110,679	45,445	2018/6/22	
	3.5 HUNGARY 200624	3.5	163,000	170,467	69,993	2020/6/24	
	4 HUNGARY 180425	4.0	149,000	156,403	64,219	2018/4/25	
	5.5 HUNGARY 181220	5.5	103,000	113,332	46,534	2018/12/20	
	5.5 HUNGARY 250624	5.5	157,000	183,313	75,268	2025/6/24	
	6 HUNGARY 231124	6.0	173,000	205,321	84,305	2023/11/24	
	6.5 HUNGARY 190624	6.5	184,800	210,705	86,515	2019/6/24	
	6.75 HUNGARY 170224	6.75	60,000	63,624	26,124	2017/2/24	
	6.75 HUNGARY 171124	6.75	110,000	120,167	49,340	2017/11/24	
	7 HUNGARY 220624	7.0	182,500	224,066	92,001	2022/6/24	
	7.5 HUNGARY 201112	7.5	151,000	184,458	75,738	2020/11/12	
小 計					715,486		
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	1.5 POLAND 200425	1.5	3,300	3,196	91,416	2020/4/25	

銘柄	銘柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		債 還 年 月 日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ポーランド		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円		
	国債証券						
		2.0	1,100	1,070	30,629	2021/4/25	
		2.5	2,900	2,958	84,619	2018/7/25	
		3.25	3,300	3,440	98,410	2019/7/25	
		3.25	3,800	3,833	109,641	2025/7/25	
		3.75	1,800	1,885	53,912	2018/4/25	
		4.0	3,300	3,530	100,967	2023/10/25	
		4.75	1,700	1,768	50,591	2017/4/25	
		5.25	3,300	3,509	100,382	2017/10/25	
		5.25	2,600	2,935	83,952	2020/10/25	
		5.5	2,400	2,698	77,175	2019/10/25	
		5.75	2,200	2,567	73,424	2021/10/25	
		5.75	3,200	3,775	107,984	2022/9/23	
		—	1,300	1,272	36,380	2017/7/25	
小	計				1,099,489		
ロシア			千ロシアルーブル	千ロシアルーブル			
	国債証券						
		6.2	14,000	12,954	19,172	2018/1/31	
		6.4	22,000	18,965	28,069	2020/5/27	
		6.7	32,500	29,179	43,186	2019/5/15	
		6.8	18,000	15,963	23,625	2019/12/11	
		7.0	21,000	17,539	25,958	2023/1/25	
		7.0	36,600	30,266	44,794	2023/8/16	
		7.05	36,300	28,328	41,925	2028/1/19	
		7.4	17,000	16,435	24,325	2017/4/19	
		7.4	16,000	15,408	22,804	2017/6/14	
		7.5	4,000	3,783	5,599	2018/3/15	
		7.5	16,500	15,241	22,557	2019/2/27	
		7.6	23,000	20,444	30,257	2021/4/14	
		7.6	21,000	18,273	27,045	2022/7/20	
		7.85	35,000	33,302	49,287	2018/3/10	
		8.15	26,000	22,362	33,096	2027/2/3	
小	計				441,707		
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						
		3.26	1,400	1,401	38,639	2018/3/1	
		3.314	1,700	1,716	47,324	2017/10/31	
		3.394	1,200	1,209	33,349	2017/3/15	
		3.418	1,100	1,074	29,624	2022/8/15	
		3.48	1,500	1,459	40,227	2023/3/15	
		3.492	1,400	1,400	38,612	2020/3/31	
		3.58	1,600	1,614	44,522	2018/9/28	
		3.654	1,500	1,513	41,732	2019/10/31	
		3.659	1,600	1,621	44,692	2020/10/15	
		3.733	900	850	23,452	2028/6/15	
		3.795	1,300	1,304	35,960	2022/9/30	
		3.844	700	637	17,569	2033/4/15	
		3.889	1,200	1,218	33,595	2020/7/31	

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		
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	千円		
	国債証券	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	600	581	16,030	2027/3/15
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	2,000	1,992	54,924	2025/9/15
		4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,600	1,632	45,002	2017/9/15
		4.048 MALAYSIA 210930	4.048	2,420	2,461	67,854	2021/9/30
		4.127 MALAYSIA 320415	4.127	800	758	20,925	2032/4/15
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,400	1,432	39,493	2021/7/15
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	1,300	1,318	36,340	2024/7/15
		4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,500	1,532	42,238	2018/2/7
		4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	2,500	2,585	71,270	2019/11/29
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,300	1,314	36,242	2026/4/15
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	1,800	1,835	50,617	2030/4/15
		5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	800	861	23,758	2019/7/30
小	計					974,001	
タイ				千タイバーツ	千タイバーツ		
	国債証券	2.55 THAILAND 200626	2.55	17,400	17,964	58,922	2020/6/26
		2.8 THAILAND 171010	2.8	10,000	10,219	33,518	2017/10/10
		3.25 THAILAND 170616	3.25	28,900	29,640	97,221	2017/6/16
		3.45 THAILAND 190308	3.45	11,700	12,355	40,525	2019/3/8
		3.58 THAILAND 271217	3.58	9,500	10,415	34,161	2027/12/17
		3.625 THAILAND 230616	3.625	28,200	30,769	100,925	2023/6/16
		3.65 THAILAND 211217	3.65	45,900	49,935	163,787	2021/12/17
		3.85 THAILAND 251212	3.85	19,500	21,867	71,724	2025/12/12
		3.875 THAILAND 190613	3.875	40,900	43,985	144,271	2019/6/13
		4.75 THAILAND 241220	4.75	8,300	9,791	32,116	2024/12/20
		4.875 THAILAND 290622	4.875	27,100	33,780	110,801	2029/6/22
		5.125 THAILAND 180313	5.125	12,400	13,335	43,740	2018/3/13
小	計					931,715	
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	4.95 PHILIPPI(GL) 210115	4.95	5,000	5,133	12,629	2021/1/15
		6.25 PHILIPPI(GL) 360114	6.25	10,000	11,092	27,286	2036/1/14
小	計					39,915	
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 INDONESIA 170715	10.0	1,000,000	1,025,030	8,712	2017/7/15
		10.5 INDONESIA 300815	10.5	3,550,000	4,022,043	34,187	2030/8/15
		11 INDONESIA 201115	11.0	2,200,000	2,416,304	20,538	2020/11/15
		11 INDONESIA 250915	11.0	3,450,000	3,960,220	33,661	2025/9/15
		12.8 INDONESIA 210615	12.8	2,590,000	3,062,234	26,028	2021/6/15
		5.25 INDONESIA 180515	5.25	1,550,000	1,450,986	12,333	2018/5/15
		5.625 INDONESIA 230515	5.625	4,800,000	4,026,864	34,228	2023/5/15
		6.125 INDONESIA 280515	6.125	5,050,000	4,041,515	34,352	2028/5/15
		6.25 INDONESIA 170415	6.25	1,200,000	1,174,068	9,979	2017/4/15
		6.625 INDONESIA 330515	6.625	7,300,000	5,868,616	49,883	2033/5/15
		7 INDONESIA 220515	7.0	5,650,000	5,226,984	44,429	2022/5/15
		7 INDONESIA 270515	7.0	4,050,000	3,558,694	30,248	2027/5/15
		7.875 INDONESIA 190415	7.875	7,000,000	6,906,340	58,703	2019/4/15

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	
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	千円	
	国債証券	8.25	5,600,000	5,572,952	47,370	2021/7/15
		8.25	7,000,000	6,633,760	56,386	2032/6/15
		8.375	17,200,000	17,084,244	145,216	2024/3/15
		8.375	6,330,000	6,317,909	53,702	2026/9/15
		8.375	12,100,000	11,628,463	98,841	2034/3/15
		9.0	11,600,000	11,763,212	99,987	2029/3/15
		9.5	3,150,000	3,319,060	28,212	2031/7/15
小	計				927,005	
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	19,400	20,525	146,555	2026/12/21
		6.25	11,700	7,836	55,954	2036/3/31
		6.5	10,500	6,987	49,890	2041/2/28
		6.75	9,000	8,072	57,638	2021/3/31
		7.0	12,000	9,220	65,834	2031/2/28
		7.25	9,300	8,729	62,327	2020/1/15
		7.75	6,500	5,927	42,324	2023/2/28
		8.0	7,500	7,335	52,375	2018/12/21
		8.0	12,100	10,309	73,607	2030/1/31
		8.25	7,500	7,481	53,420	2017/9/15
		8.25	7,600	6,491	46,346	2032/3/31
		8.5	8,900	7,579	54,117	2037/1/31
		8.75	12,700	10,883	77,706	2048/2/28
小	計				838,099	
合	計				9,460,517	

(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

(2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	9,460,517	95.6
コール・ローン等、その他	435,917	4.4
投資信託財産総額	9,896,434	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (9,828,189千円) の投資信託財産総額 (9,896,434千円) 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=118.14円	1メキシコペソ=6.35円	1ブラジルリアル=28.89円	100チリペソ=16.39円
100コロンビアペソ=3.48円	1ベルヌエボソル=34.10円	1トルコリラ=39.10円	100ハンガリーフォリント=41.06円
1ポーランドズロチ=28.60円	1ロシアルーブル=1.48円	1マレーシアリングギット=27.57円	1タイバーツ=3.28円
1フィリピンペソ=2.46円	100インドネシアルピア=0.85円	1南アフリカランド=7.14円	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,930,850,855
コール・ローン等	281,171,834
公社債(評価額)	9,460,517,527
未収入金	34,416,000
未収利息	136,351,279
前払費用	18,394,215
(B) 負債	69,538,657
未払金	54,091,224
未払解約金	15,447,433
(C) 純資産総額(A-B)	9,861,312,198
元本	8,564,024,345
次期繰越損益金	1,297,287,853
(D) 受益権総口数	8,564,024,345口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,515円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,451,142,583円
 期中追加設定元本額 4,580,062,637円
 期中一部解約元本額 1,467,180,875円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1515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)

eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,730,806,829円
eMAXIS バランス(波乗り型)	365,846,277円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	198,944,668円
コアバランス	681,024円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,426,397,507円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	1,434,216,167円
新興国債券インデックスオープン	934,480円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	168,879,662円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,527,848円
三菱UFJ 新興国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	46,123,613円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	69,400,009円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	91,266,261円
合計	8,564,024,345円

[お知らせ]

2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2015年7月1日)

○損益の状況 (2015年1月27日~2016年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	547,728,067
受取利息	547,660,698
その他収益金	67,369
(B) 有価証券売買損益	△2,564,004,726
売買益	95,887,008
売買損	△2,659,891,734
(C) 保管費用等	△ 12,316,706
(D) 当期損益金(A+B+C)	△2,028,593,365
(E) 前期繰越損益金	2,291,224,547
(F) 追加信託差損益金	1,500,075,091
(G) 解約差損益金	△ 465,418,420
(H) 計(D+E+F+G)	1,297,287,853
次期繰越損益金(H)	1,297,287,853

- (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。