

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／その他資産（転換社債）	
信託期間	2016年10月11日まで（2013年9月27日設定）	
運用方針	<p>世界各国の転換社債等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。</p> <p>銘柄選定にあたっては、利回りに加え、発行体リスク、流動性などを踏まえ、組入銘柄および組入比率を決定します。なお、信用格付けが投資適格未満（BBB-未満）の銘柄への投資も行います。</p> <p>主として信託期間内に償還を迎える銘柄に投資を行います。満期が信託期間を超える銘柄にも、一部投資を行います。</p> <p>転換社債の利子収益や償還金等については転換社債等への再投資を行わずに信託期間終了までマネー・マーケット・マザーファンドを通じて、短期公社債等で運用する場合があります。</p> <p>転換社債等の運用にあたっては、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用指図に関する権限を委託します。</p> <p>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為替変動リスクの低減をはかります。</p>	
主要運用対象	ベビーフンド	世界各国の転換社債等を主要投資対象とします。また、マネー・マーケット・マザーファンドに投資する場合があります。
	マザーファンド	わが国の公社債等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は行いません。
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）

[満期償還]

三菱UFJ グローバル 好利回りCBファンド2013-09 (円ヘッジ) (限定追加型)

信託終了日：2016年10月11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、「三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-09 (円ヘッジ) (限定追加型)」は、この度、信託期間を満了し、償還の運びとなりました。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

三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-09 (円ヘッジ) (限定追加型)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	1
◇運用経過	2
◇1万口当たりの費用明細	6
◇売買及び取引の状況	7
◇利害関係人との取引状況等	7
◇組入資産の明細	8
◇投資信託財産の構成	8
◇資産、負債、元本及び償還価額の状況	9
◇損益の状況	9
◇投資信託財産運用総括表	9
◇償還金のお知らせ	10
◇お知らせ	10

マザーファンドのご報告

◇マネー・マーケット・マザーファンド	11
--------------------	----

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 (分配落)	騰落率		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債組入比率	債券 優先物比率	純資産総額
		税金 分配	み 期 騰 落 率				
(設定日) 2013年9月27日	円 銭 10,000	—	—	% —	% —	% —	百万円 6,434
1期(2014年10月14日)	10,260	—	0	2.6	94.2	—	7,662
2期(2015年10月13日)	10,483	—	0	2.2	94.5	—	4,579
(償還時)	(償還価額)						
3期(2016年10月11日)	10,623.10	—	—	1.3	—	—	3,267

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 当ファンドは、世界各国の転換社債等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が、特定の指数を上回るまたは運動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(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	騰落率		新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債組入比率	債券 優先物比率
		騰落率	騰落率			
(期首) 2015年10月13日	円 銭 10,483	% —	% —	% 94.5	% —	% —
10月末	10,432	△0.5	—	96.1	—	—
11月末	10,532	0.5	—	93.4	—	—
12月末	10,453	△0.3	—	87.3	2.2	—
2016年1月末	10,496	0.1	—	91.1	4.7	—
2月末	10,515	0.3	—	88.4	2.5	—
3月末	10,536	0.5	—	89.1	3.5	—
4月末	10,597	1.1	—	91.4	3.5	—
5月末	10,603	1.1	—	84.4	2.0	—
6月末	10,540	0.5	—	76.1	5.4	—
7月末	10,599	1.1	—	67.7	6.3	—
8月末	10,648	1.6	—	59.0	4.8	—
9月末	10,627	1.4	—	—	6.0	—
(償還時) 2016年10月11日	(償還価額) 10,623.10	1.3	—	—	—	—

(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3期: 2013/9/27～2016/10/11)

基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ6.2%の上昇となりました。



第1期首: 10,000円
第3期末: 10,623.10円
(既払分配金 0円)
騰落率: 6.2%

基準価額の主な変動要因

上昇要因

世界の転換社債市況が上昇したこと、転換社債等の利子収益を獲得したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

投資環境について

（第1期～第3期：2013/9/27～2016/10/11）

◎転換社債市況

- ・信託期間を通じて見ると、世界の転換社債市況は上昇しました。
- ・設定時から2015年5月にかけては、IMF（国際通貨基金）による世界経済の成長率見通しが引き下げられたことにより、世界経済の先行きに対する不透明感が強まったことなどを背景に、世界の転換社債市況が下落する局面があったものの、米国経済が堅調に推移したこと、ECB（欧州中央銀行）や中国人民銀行が追加金融緩和を実施したことなどを背景に、世界の転換社債市況は上昇しました。その後、2016年2月にかけては、中国経済に対する先行き不透明感が高まったこと、国際商品市況が下落したことなどが材料視され、投資家のリスク回避的な姿勢が強まったことなどから世界の転換社債市況は下落しました。その後、国際商品市況が上昇したこと、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ観測がやや後退したことなどが材料視され、投資家のリスク回避的な姿勢が弱まったことなどから世界の転換社債市況は上昇しました。

◎国内短期金融市場

- ・設定時から2016年1月までは、日銀は「量的・質的金融緩和」に基づきマネタリーベースの増加を操作目標として、金融市場調整を行いました。途中、2014年10月には、「量的・質的金融緩和」の拡大を行い、また、2015年12月には「量的・質的金融緩和」を補完するための措置を導入しました。
- ・2016年1月の金融政策決定会合で日銀は「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定し、 -0.1% 金利の適用は2月16日からとしました。
- ・9月の金融政策決定会合で日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の導入を決定し、金融市場調整の操作目標を、マネタリーベースの増加から長短金利の操作に変更しました。
- ・コール・レート（無担保・翌日物）は、設定時から2016年2月中旬にかけて概ね 0.1% 弱近辺で安定的に推移しました。マイナス金利適用開始日である2016年2月16日以降は、 -0.1% にさや寄せする形でプラス圏から段階的に低下し、2016年10月11日のコール・レートは -0.028% となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-09（円ヘッジ）（限定追加型）>

- ・主要投資対象である世界各国の転換社債等を高位に組み入れるとともに、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかる運用を行いました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

<第1期：設定時～2014年10月14日>

- ・基準価額は設定時に比べ 2.6% の上昇となりました。

◎組入比率

- ・転換社債等の組入比率を概ね高水準で推移させました。

◎為替

- ・期を通じて高水準の為替ヘッジを行ったため、為替市況の変動が基準価額に与える影響は限定的となりました。

◎ポートフォリオ

- ・銘柄の償還期間、利回り、流動性、信用リスクなどを見極め、地域・セクター分散などを配慮しポートフォリオを構築し、個別銘柄については原則継続保有としました。
- ・前記の運用を行った結果、世界の転換社債市況が上昇したこと、転換社債等の利子収益を獲得したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

<第2期：2014年10月15日～2015年10月13日>

- ・基準価額は期首に比べ2.2%の上昇となりました。

◎組入比率

- ・転換社債等の組入比率を概ね高水準で推移させました。

◎為替

- ・期を通じて高水準の為替ヘッジを行ったため、為替市況の変動が基準価額に与える影響は限定的となりました。

◎ポートフォリオ

- ・組入銘柄については、原則継続保有としましたが、純資産が減少したことなどに伴い、期中に保有銘柄の一部売却などを行いました。
- ・前記の運用を行った結果、世界の転換社債市況が上昇したこと、転換社債等の利子収益を獲得したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

<第3期：2015年10月14日～信託終了日>

- ・償還価額は期首に比べ1.3%の上昇となりました。

◎組入比率

- ・転換社債等の組入比率を概ね高水準で推移させました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

◎為替

- ・期を通じて高水準の為替ヘッジを行ったため、為替市況の変動が基準価額に与える影響は限定的となりました。

◎ポートフォリオ

- ・組入銘柄については、原則継続保有としましたが、純資産が減少したことなどに伴い、期中に保有銘柄の一部売却などを行いました。
- ・前記の運用を行った結果、世界の転換社債市況が上昇したこと、転換社債等の利子収益を獲得したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い国債や社債などを組み入れ、利子等収益の確保を図りました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、世界各国の転換社債等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が、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
- ・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

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

<三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-09（円ヘッジ）（限定追加型）>
償還価額は10,623円10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

(2015年10月14日～2016年10月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 122	% 1.157	(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)	(82)	(0.781)	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)	(34)	(0.323)	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)	(6)	(0.054)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.021	(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)	(2)	(0.017)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	124	1.178	
期中の平均基準価額は、10,548円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2015年10月14日～2016年10月11日)

新株予約権付社債 (転換社債)

		買 付		売 付	
		額 面	金 額	額 面	金 額
外	アメリカ	千アメリカドル 11,950	千アメリカドル 11,889	千アメリカドル 16,050 (25,189)	千アメリカドル 16,679 (25,485)
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	オランダ	—	—	(1,850)	(1,850)
	ジャージー	2,500	2,483	2,500	2,550
国	スイス	千スイスフラン —	千スイスフラン —	千スイスフラン — (2,300)	千スイスフラン — (2,300)
	スウェーデン	千スウェーデンクローネ 19,471	千スウェーデンクローネ 19,993	千スウェーデンクローネ 19,471	千スウェーデンクローネ 19,743
	香港	千香港ドル 36,000	千香港ドル 35,733	千香港ドル 45,000	千香港ドル 38,645
	シンガポール	千シンガポールドル 2,000	千シンガポールドル 2,007	千シンガポールドル 3,500	千シンガポールドル 3,498

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は予約権行使・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。

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
マネー・マーケット・マザーファンド	千口 1,129,275	千円 1,150,000	千口 1,129,275	千円 1,150,054

○利害関係人との取引状況等

(2015年10月14日～2016年10月11日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-09 (円ヘッジ) (限定追加型) >

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
為替先物取引	百万円 20,500	百万円 10,515	% 51.3	百万円 16,653	百万円 9,629	% 57.8
為替直物取引	1,483	320	21.6	5,450	1,226	22.5

<マネー・マーケット・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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	14,699	6,999	47.6	19,830	1,999	10.1
現先取引(公社債)	19,508	6,002	30.8	22,508	6,002	26.7

平均保有割合 7.5%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

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、三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2016年10月11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。

○投資信託財産の構成

(2016年10月11日現在)

項 目	債 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	3,296,176	100.0
投資信託財産総額	3,296,176	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2016年10月11日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	3,296,176,743
コール・ローン等	3,296,176,743
(B) 負債	28,569,817
未払解約金	8,266,993
未払信託報酬	20,232,567
未払利息	2,562
その他未払費用	67,695
(C) 純資産総額(A-B)	3,267,606,926
元本	3,075,944,251
償還差益金	191,662,675
(D) 受益権総口数	3,075,944,251口
1万口当たり償還価額(C/D)	10,623円10銭

<注記事項>

- ①期首元本額 4,368,672,814円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 1,292,728,563円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.062310円です。

- ②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、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の40以内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。

○損益の状況 (2015年10月14日～2016年10月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	86,406,954
受取利息	83,464,382
その他収益金	3,040,755
支払利息	△ 98,183
(B) 有価証券売買損益	△ 3,876,639
売買益	761,274,930
売買損	△765,151,569
(C) 信託報酬等	△ 45,511,673
(D) 当期損益金(A+B+C)	37,018,642
(E) 前期繰越損益金	155,818,578
(F) 追加信託差損益金	△ 1,174,545
(売買損益相当額)	(△ 1,174,545)
償還差益金(D+E+F)	191,662,675

- (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	2013年9月27日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2016年10月11日			資 産 総 額	3,296,176,743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	28,569,817円	
受益権口数	6,434,352,053口	3,075,944,251口	△3,358,407,802口	純 資 産 総 額	3,267,606,926円	
元 本 額	6,434,352,053円	3,075,944,251円	△3,358,407,802円	受 益 権 口 数	3,075,944,251口	
				1万口当たり償還金	10,623円10銭	
毎計算期末の状況						
計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金		
				金 額	分 配 率	
第1期	7,468,606,487円	7,662,876,886円	10,260円	0円	0%	
第2期	4,368,672,814	4,579,686,061	10,483	0	0	

○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金 (税込み)	10,623円10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]

2014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。

マネー・マーケット・マザーファンド

《第23期》決算日2016年5月20日

[計算期間：2015年11月21日～2016年5月20日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、5月20日に第23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23期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等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は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	純資産額
19期(2014年5月20日)	10,180	0.0	84.7	—	2,716
20期(2014年11月20日)	10,183	0.0	84.3	—	2,373
21期(2015年5月20日)	10,183	0.0	89.3	—	1,959
22期(2015年11月20日)	10,185	0.0	91.2	—	27,834
23期(2016年5月20日)	10,183	△0.0	39.0	—	5,562

(注) 当ファンドは主として短期債券、コール・ローンなどによる運用を行い、安定的な収益の確保をめざすファンドであり、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(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	騰落率	債組入比率	債券先物比率	債券率
(期首) 2015年11月20日	10,185	—	91.2	—	—
11月末	10,184	△0.0	59.9	—	—
12月末	10,183	△0.0	93.0	—	—
2016年1月末	10,183	△0.0	98.5	—	—
2月末	10,183	△0.0	50.5	—	—
3月末	10,182	△0.0	68.5	—	—
4月末	10,183	△0.0	67.0	—	—
(期末) 2016年5月20日	10,183	△0.0	39.0	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

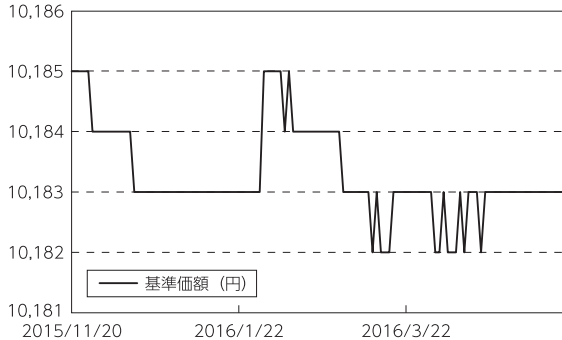
○運用経過

●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0.02%の下落となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎国内短期金融市場

- ・当期の短期金融市場を見ると、日銀はマネタリーベースを操作目標として金融市場調節を行いました。2016年1月末に日銀は「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定し、日銀当座預金のうち政策金利残高に適用する金利を-0.1%としました。コール・レート（無担保・翌日物）は、当該金利にさや寄せする形でプラス圏から段階的に低下し、5月20日のコール・レートは-0.053%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い国債や社債などを組み入れ、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益は獲得したものの、組入債券の一部が小幅に下落したことなどから基準価額は下落しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・国内景気は緩やかな回復局面に向かうものと思われませんが、デフレ脱却に向けて日銀は「マイナス金利付き量的・質的金融緩和策」を当面維持することが見込まれます。そうした環境下、短期金利は低位での推移になるものと予想しています。

◎今後の運用方針

- ・運用の基本方針および前述の見通しに基づき、短期金融商品を活用しつつ、残存期間の短い社債などに投資し安定した収益の確保をめざしていく方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2015年11月21日～2016年5月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,183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11月21日～2016年5月20日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 3,120,795	千円 20,330,370 (7,992,600)
	特殊債券	601,257	— (200,000)
	社債券	1,586,979	—

(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。

その他有価証券

		買 付 額	売 付 額
国 内	コマーシャル・ペーパー	千円 68,999,961	千円 65,999,968

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2015年11月21日～2016年5月20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
公社債	百万円 4,809	百万円 —	% —	百万円 19,830	百万円 1,999	% 10.1

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

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モルガン・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2016年5月20日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	183,750	183,838	3.3	—	—	—	3.3
金融債券	400,000	400,320	7.2	—	—	—	7.2
	(400,000)	(400,320)	(7.2)	(—)	(—)	(—)	(7.2)
普通社債券	1,577,900	1,584,386	28.5	—	—	—	28.5
	(1,577,900)	(1,584,386)	(28.5)	(—)	(—)	(—)	(28.5)
合 計	2,161,650	2,168,544	39.0	—	—	—	39.0
	(1,977,900)	(1,984,706)	(35.7)	(—)	(—)	(—)	(35.7)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(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。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期		末		償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	比 率	
国債証券	%	千円	千円		
第342回利付国債(2年)	0.1	100,000	100,037		2016/7/15
第343回利付国債(2年)	0.1	83,750	83,801		2016/8/15
小 計		183,750	183,838		
金融債券					
い第735号商工債券	0.4	300,000	300,312		2016/8/26
い第732号農林債券	0.6	100,000	100,008		2016/5/27
小 計		400,000	400,320		
普通社債券					
第490回関西電力	0.718	100,000	100,049		2016/6/20
第355回中国電力	1.52	200,000	200,774		2016/8/25
第300回北陸電力	0.5	177,900	178,362		2016/11/30
第459回東北電力	0.869	200,000	201,192		2017/2/24
第282回四国電力	0.35	200,000	200,320		2016/12/22
第3回コニカミノルタホールディングス	0.61	200,000	200,640		2016/12/2
第17回ニコン	1.65	100,000	100,139		2016/6/23
第3回興銀リース	0.267	100,000	100,135		2016/12/2
第113回オリックス	2.19	100,000	101,906		2017/4/18
第156回オリックス	1.14	100,000	100,705		2017/1/27
第17回電源開発	2.07	100,000	100,164		2016/6/20
小 計		1,577,900	1,584,386		
合 計		2,161,650	2,168,544		

国内その他有価証券

区 分	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 2,999,995	% 53.9		

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2016年5月20日現在)

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公社債	千円 2,168,544	% 39.0		
その他有価証券	2,999,995	53.9		
コール・ローン等、その他	394,603	7.1		
投資信託財産総額	5,563,142	100.0		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	5,563,142,682
コール・ローン等	389,098,836
公社債(評価額)	2,168,544,627
その他有価証券(評価額)	2,999,995,107
未収利息	3,637,299
前払費用	1,866,813
(B) 負債	672,118
未払解約金	670,530
未払利息	633
その他未払費用	955
(C) 純資産総額(A-B)	5,562,470,564
元本	5,462,308,836
次期繰越損益金	100,161,728
(D) 受益権総口数	5,462,308,836口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,183円

<注記事項>

- ①期首元本額 27,329,169,583円
 期中追加設定元本額 1,544,863,883円
 期中一部解約元本額 23,411,724,630円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0183円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	249,380,519円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	5,226,135円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	8,898,354円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	1,628,029円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	101,543円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	47,179,877円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	94,134,350円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型)	233,263円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	4,757,576円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	334,011,007円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型)	89,620円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型)	1,033,322円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド	2,017,042円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	42,384,248円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	3,558,532円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	23,960,741円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	457,302円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	358,088円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	2,100,667円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,836,590円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	383,682円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	6,363,253円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	13,745,897円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	3,037,917円

○損益の状況 (2015年11月21日~2016年5月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	4,329,010
受取利息	4,361,071
支払利息	△ 32,061
(B) 有価証券売買損益	△ 5,334,236
売買益	191,600
売買損	△ 5,525,836
(C) 保管費用等	△ 955
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,006,181
(E) 前期繰越損益金	504,860,995
(F) 追加信託差損益金	28,297,685
(G) 解約差損益金	△431,990,771
(H) 計(D+E+F+G)	100,161,728
次期繰越損益金(H)	100,161,728

- (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。

三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	1,970,066円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	43,682,881円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	217,654円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース> (毎月分配型)	407,171円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネーベースファンド>	24,781,723円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	2,221,253円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	945,824円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	2,576,702円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	3,148,614円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	67,305円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーベースファンド>	3,491,872円
三菱UFJ	欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型)	47,026,508円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)		1,285,463円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)		1,147,224円
新興国ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)		1,068円
新興国ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)		10,884円
三菱UFJ	米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491,836円
三菱UFJ	米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98,368円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (毎月分配型)	20,181,510円
PIMCO	ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	109,209円
PIMCO	ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	158,381円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	20,660円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	40,278円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	955,887円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	1,559,264円
三菱UFJ	新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	442,974円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン	通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	19,658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン	通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	19,658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン	通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	19,658円
三菱UFJ	米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491,449円
三菱UFJ	米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,828,976円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	19,255,183円
PIMCO	ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	554,804円
バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)		1,936,118円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)		9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)		9,829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)		9,829円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	9,834,580円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	20,551,717円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	3,730,759円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	5,059,469円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	2,347,787円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	163,666円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (毎月分配型)	3,908,079円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型)	3,737,703円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (年2回分配型)	6,435,081円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (年2回分配型)	686,803円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	627,788円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (年2回分配型)	608,110円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	46,726円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (年2回分配型)	581,687円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーベースファンドA>	978,045円
三菱UFJ	米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーベースファンドB>	979,977円
三菱UFJ	/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)	1,423,307円

三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8, 859, 081円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型)	1, 168, 184円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	2, 065, 331円
ビムコ・エマーゼィング・ボンド・オープン C コース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	983円
ビムコ・エマーゼィング・ボンド・オープン D コース (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	983円
三菱UF J / UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11 (円ヘッジ) (限定追加型)	982, 608円
三菱UF J / ビムコ トータル・リターン・ファンド2014	256, 356円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	2, 827, 156円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (毎月分配型)	9, 387, 547円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3, 545, 187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8, 124, 755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (年1回決算型)	2, 990, 177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	3, 377, 211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (毎月分配型)	357, 495円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	168, 922円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	3, 874, 252円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	6, 588, 018円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	9, 991, 470円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	1, 616, 484円
三菱UF J / AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型)	25, 537, 767円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型)	42, 906, 470円
三菱UF J 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (年2回分配型)	8, 585, 548円
Navio インド債券ファンド	885, 566円
Navio マネーボールファンド	1, 561, 630円
三菱UF J インド債券オープン (毎月決算型)	39, 351円
バンクローンファンドUSA (為替ヘッジあり) 2014-08	11, 276, 260円
マネーボールファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	9, 898, 381円
MUAMトピックスリスクコントロール (5%) インデックスファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	8, 107, 178円
ビムコ・エマーゼィング・ボンド・オープン A コース (為替ヘッジなし)	10, 766, 608円
ビムコ・エマーゼィング・ボンド・オープン B コース (為替ヘッジあり)	21, 620, 196円
三菱UF J バランス・イノベーション (債券重視型)	365, 273, 064円
三菱UF J / AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	11, 293, 333円
三菱UF J Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	6, 324, 266円
三菱UF J Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型> (3ヵ月決算型)	3, 063, 931円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	1, 375, 824円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	1, 071, 396円
マルチストラテジー・ファンド (ラップ向け)	491, 015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	918, 198円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	138, 468円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	10, 804円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	10, 804円
三菱UF J 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	983円
三菱UF J 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	983円
三菱UF J 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	983円
三菱UF J 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	983円
三菱UF J バランス・イノベーション (株式抑制型)	3, 276, 286, 700円
三菱UF J DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	42, 678, 508円
MUAMトピックスリスクコントロール (10%) インデックスファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	255, 538, 832円
三菱UF J グローバル好利回りCBファンド2013-09 (円ヘッジ) (限定追加型)	196, 405, 776円
合計	5, 462, 308, 836円

【お 知 ら せ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため（分散型に分類）、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うための、所要の約款変更を行いました。

(2016年3月16日)