

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	2022年12月28日〔当初、2025年6月6日〕まで (2015年5月29日設定)	
運用方針	先進国高格付国債マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む先進国の国債等に実質的な投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。 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為替変動リスクの低減をはかります。 マザーファンドの債券等（為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。）の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント（UK）に運用の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	先進国高格付国債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	日本を含む先進国の国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。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※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]
先進国高格付国債ファンド
(ラップ向け)



信託終了日：2022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、「先進国高格付国債ファンド（ラップ向け）」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
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	
お客さま専用 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。	

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	騰 落 率		(参 考 指 数) FTSE日本国債インデックス (円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率			
	円 銭	円	%		%	%	%	百万円
12期(2021年6月7日)	10,358	0	△3.6	366.90	△0.4	97.2	—	130
13期(2021年12月6日)	10,227	0	△1.3	368.77	0.5	93.3	—	106
14期(2022年6月6日)	9,517	0	△6.9	357.11	△3.2	99.9	—	3
15期(2022年12月6日)	9,327	0	△2.0	346.07	△3.1	94.1	—	0.919369
(償還時)	(償還価額)							
16期(2022年12月28日)	9,344.82	—	0.2	341.15	△1.4	—	—	0.921126

(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FTSE日本国債インデックス（円ベース）です。

FTSE日本国債インデックス（円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（円ベース）のサブインデックスです。FTSE世界国債インデックス（円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数のデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額 (分配落)	騰 落 率		(参 考 指 数) FTSE日本国債インデックス (円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		期 首	期 末	期 首	期 末		
	円 銭	%	%		%	%	%
(期 首) 2022年12月6日	9,327	—		346.07	—	94.1	—
(償還時) 2022年12月28日	(償還価額) 9,344.82		0.2	341.15	△1.4	—	—

(注) 騰落率は期首比。

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

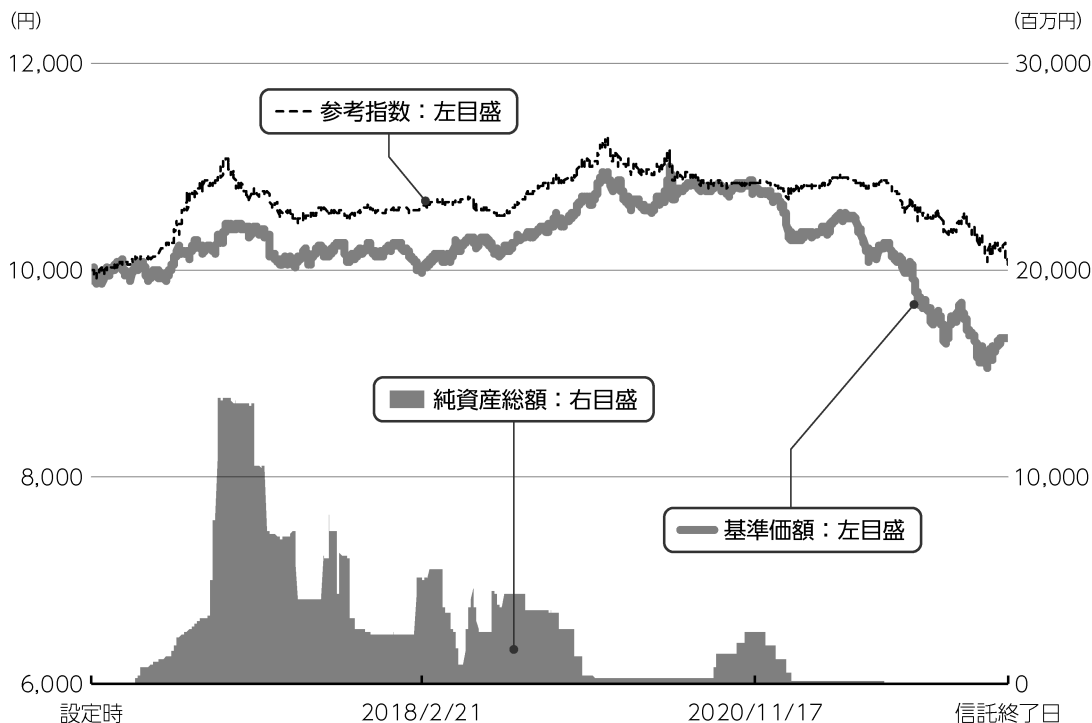
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第1期～第16期：2015年5月29日～2022年12月28日

▶ 設定来の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第1期首	10,000円
第16期末	9,344.82円
既払分配金	0円
騰落率	-6.6%

※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

償還価額は設定時に比べ6.6%の下落となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

債券利子収入を獲得したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

先進国債券金利が上昇したことや、信託報酬等のコスト等が基準価額の下落要因となりました。

第1期～第16期：2015年5月29日～2022年12月28日

投資環境について

▶ 債券市況

設定来の先進国債券金利は上昇しました。
設定時から2016年6月頃にかけては、ギリシャの債務問題に対する懸念や中国経済の先行き不透明感の高まり等を背景に、米独長期金利は低下しました。その後2018年11月頃にかけては、米トランプ政権下の財政拡張政策のほか、米連邦準備制度理事会（F R B）による利上げや欧州中央銀行（E C B）による金融緩和策からの脱却示唆等を受けて米独長期金

利は上昇しました。2020年末頃にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大や世界的な景気減速懸念、各国中銀の金融緩和政策を受けて長期金利は低下したものの、信託終了日にかけては、新型コロナウイルスワクチン接種数増加による景気回復への期待や米バイデン政権による大型経済対策に加え、世界的なインフレ圧力の高まりやそれを受けた各国中銀の積極的な金融引き締め姿勢等を背景に、長期金利は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 先進国高格付国債ファンド（ラップ向け）

信託期間を通じ、先進国高格付国債マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界の先進国高格付国債を高位に組み入れたほか、実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。

第16期（2022年12月7日～信託終了日）は、前記の運用を維持し、信託終了日にかけてマザーファンドの組み入れを解消し、資金化をはかりました。

▶ 先進国高格付国債マザーファンド

投資対象である国債の各国／満期グループ（ユニバース）の中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよび為替ヘッジコスト／プレミアムを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れる運用を行いました。また、組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。

2022年12月7日から信託終了日までについては、前記の運用を維持し、信託終了日にかけて保有銘柄を売却し、資金化

をはかりました。

第16期（2022年12月7日～信託終了日）は、オーストラリアの7－10年、デ

ンマークの1－3年と7－10年、日本の5－7年と7－10年のグループを投資対象としました。

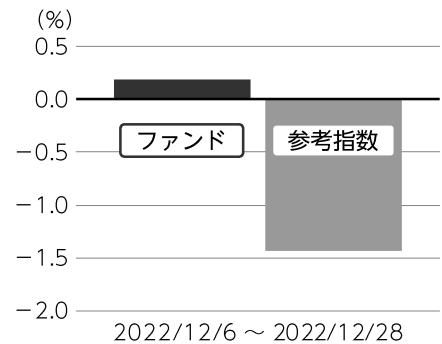
▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

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。右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F T S E 日本国債インデックス（円ベース）です。

なお、設定来の基準価額は6.6％の下落、参考指数は0.4％の上昇となりました。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



▶ 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

▶ 先進国高格付国債ファンド（ラップ向け）

償還価額は、9,344円82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。

2022年12月7日～2022年12月28日

1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	2	0.027	(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)	(2)	(0.021)	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)	(0)	(0.003)	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)	(0)	(0.002)	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
合 計	2	0.027	

期中の平均基準価額は、9,345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。

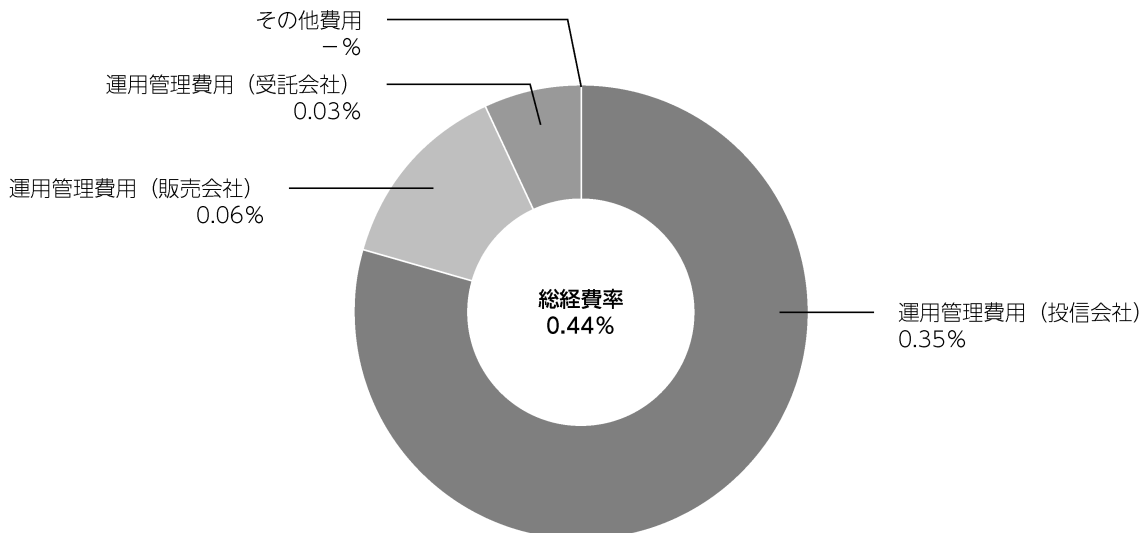
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

（参考情報）

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.44%**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12月7日～2022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
	千口	千円	千口	千円
先進国高格付国債マザーファンド	—	—	882	907

○利害関係人との取引状況等

(2022年12月7日～2022年12月28日)

該当事項はございません。

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す。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年12月7日～2022年12月28日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	償還時残高(元本)	取引の理由
百万円 0.985708	百万円 —	百万円 —	百万円 0.985708	商品性を適正に維持するための取得

○組入資産の明細

(2022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
	千口
先進国高格付国債マザーファンド	882

○投資信託財産の構成

(2022年12月28日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	921	100.0
投資信託財産総額	921	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2022年12月28日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	921,369
コール・ローン等	921,369
(B) 負債	243
未払信託報酬	242
未払利息	1
(C) 純資産総額(A－B)	921,126
元本	985,708
償還差損金	△ 64,582
(D) 受益権総口数	985,708口
1万口当たり償還価額(C／D)	9,344円82銭

<注記事項>

- ①期首元本額 985,708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0.934482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64,582円です。

③「先進国高格付国債マザーファンド」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12.5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（2022年12月7日～2022年12月28日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 32
支払利息	△ 32
(B) 有価証券売買損益	2,031
売買益	2,031
(C) 信託報酬等	△ 242
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	1,757
(E) 前期繰越損益金	△137,363
(F) 追加信託差損益金	71,024
(配当等相当額)	(97,036)
(売買損益相当額)	(△ 26,012)
償還差損金(D＋E＋F)	△ 64,582

- (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	2015年5月29日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年12月28日		資産総額	921,369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	243円
				純資産総額	921,126円
受益権口数	10,000,000口	985,708口	△9,014,292口	受益権口数	985,708口
元本額	10,000,000円	985,708円	△9,014,292円	1万口当たり償還金	9,344円82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	1,084,781,943円	1,077,968,339円	9,937円	0円	0%
第2期	7,806,930,532	7,993,779,829	10,239	0	0
第3期	7,063,553,467	7,121,425,490	10,082	0	0
第4期	4,306,480,322	4,412,566,280	10,246	0	0
第5期	2,384,228,636	2,445,689,561	10,258	0	0
第6期	891,532,970	913,392,406	10,245	0	0
第7期	4,280,284,466	4,411,695,185	10,307	0	0
第8期	1,297,736,334	1,380,333,415	10,636	0	0
第9期	307,735,278	327,032,051	10,627	0	0
第10期	281,811,591	303,121,250	10,756	0	0
第11期	2,309,471,777	2,481,238,733	10,744	0	0
第12期	125,808,712	130,316,939	10,358	0	0
第13期	104,575,756	106,945,389	10,227	0	0
第14期	3,250,936	3,093,914	9,517	0	0
第15期	985,708	919,369	9,327	0	0

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	9,344円82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】

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46条第1項に規定する「やむを得ない事情が発生」した場合に該当するため、また、約款第46条第5項に規定する「真にやむを得ない事情が生じている場合」に該当するため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。

（2022年12月28日）

先進国高格付国債マザーファンド

《第10期》決算日2022年12月6日

[計算期間：2021年12月7日～2022年12月6日]

「先進国高格付国債マザーファンド」は、12月6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	日本を含む先進国の国債等に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。投資する国債等（日本国債を除きます。）は、原則として取得時において最上位格付けを取得しているものに限ります。銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。債券等（為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。）の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント（U.K）に運用の指図に関する権限を委託します。
主 要 運 用 対 象	日本を含む先進国の国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割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		(参 考 指 数) FTSE日本国債インデックス (円ベース)		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
6期(2018年12月6日)	11,135	0.8	361.70	0.7	96.5	—	162,865
7期(2019年12月6日)	11,533	3.6	371.49	2.7	98.9	—	142,125
8期(2020年12月7日)	11,712	1.6	368.32	△0.9	98.2	—	99,083
9期(2021年12月6日)	11,196	△4.4	368.77	0.1	93.8	—	97,667
10期(2022年12月6日)	10,254	△8.4	346.07	△6.2	95.6	—	85,001

(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FTSE日本国債インデックス（円ベース）です。

FTSE日本国債インデックス（円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（円ベース）のサブインデックスです。FTSE世界国債インデックス（円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数のデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(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) F T S E 日 本 国 債 イ ン デ ッ ク ス (円 ベ ー ス)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年12月 6 日	円 11,196	% —	% —	% 93.8	% —
12月末	11,233	0.3	△0.4	95.3	—
2022年1月末	11,055	△ 1.3	△1.4	94.7	—
2月末	10,939	△ 2.3	△2.1	96.2	—
3月末	10,666	△ 4.7	△2.4	97.0	—
4月末	10,571	△ 5.6	△2.9	95.3	—
5月末	10,522	△ 6.0	△3.1	98.1	—
6月末	10,305	△ 8.0	△4.4	97.2	—
7月末	10,589	△ 5.4	△3.6	96.2	—
8月末	10,290	△ 8.1	△3.9	98.9	—
9月末	10,010	△10.6	△5.4	95.1	—
10月末	10,130	△ 9.5	△5.5	98.1	—
11月末	10,221	△ 8.7	△6.3	95.9	—
(期 末) 2022年12月 6 日	10,254	△ 8.4	△6.2	95.6	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

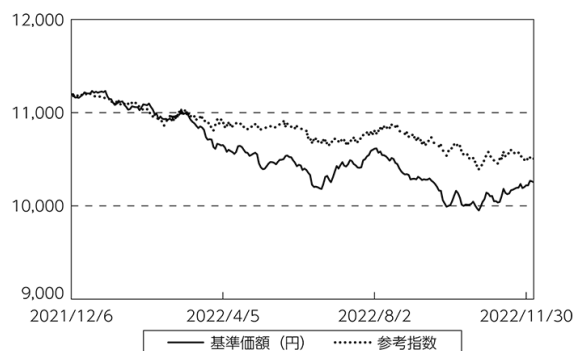
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ8.4%の下落となりました。

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

(下落要因)

- ・投資対象国の長期金利が上昇し、組入債券の価格が下落したこと等が基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎債券市況

- ・米国とドイツの長期金利はともに上昇しました。
- ・米国とドイツの長期金利は、ウクライナ情勢を巡る地政学リスクの高まりや、急速な利上げによる世界景気の減速懸念などから低下する局面もありましたが、市場予想を上回る物価指数の発表によってインフレ圧力の高まりが示され、米欧中銀が積極的な利上げ姿勢を継続するとの見方が強まったことなどから、期を通じてみると上昇基調で推移しました。

◎為替

- ・組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・投資対象である国債の各国／満期グループ（ユニバース）の中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよび為替ヘッジコスト／プレミアムを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れました。組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。
- ・期首にはオーストラリアの3－5年、5－7年、7－10年と、シンガポールの5－7年、7－10年のグループを投資対象として選定しており、2022年3月の定期リバランス時には、シンガポールの7－10年をオーストラリアの1－3年へ入れ替えを実施しました。6月の定期リバランス時には、オーストラリアの5－7年、7－10年とシンガポールの5－7年を、ノルウェーの1－3年とデンマークの5－7年、7－10年へ入れ替えを実施しました。9月の定期リバランス時には、オーストラリアの1－3年、3－5年とノルウェーの1－3年を、スウェーデンの1－3年、デンマークの3－5年、オーストラリアの7－10年へ入れ替えを実施しました。12月の定期リバランス時には、デンマークの3－5年、5－7年とスウェーデンの1－3年をデンマークの1－3年と日本の5－7年、7－10年へ入れ替えを実施しました。

○今後の運用方針

- ・投資対象である国債の各国／満期グループの中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよび為替ヘッジコスト／プレミアムを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れる運用を行う方針です。また、組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行います。なお、2022年11月より、投資ユニバースにニュージーランドが追加されました。

○1万口当たりの費用明細

(2021年12月7日～2022年12月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.026	(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)	(3)	(0.026)	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)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.026	
期中の平均基準価額は、10,553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12月7日～2022年12月6日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	カナダ	国債証券	千カナダドル —	千カナダドル 105,463
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 1,201,078	千スウェーデンクローネ —
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 1,249,684	千ノルウェークローネ 1,238,827
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 2,603,163	千デンマーククローネ —
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 495,174	千オーストラリアドル 827,801
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 109,770	千シンガポールドル 530,043

(注) 金額は受渡資金。(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

(2021年12月7日～2022年12月6日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2022年12月6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
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 1,200,000	千スウェーデンクローネ 1,198,441	千円 15,735,533	% 18.5	% —	% —	% 13.9	% 4.6
デンマーク	千デンマーククローネ 2,790,000	千デンマーククローネ 2,573,498	49,642,780	58.4	—	19.6	38.8	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 209,000	千オーストラリアドル 173,265	15,867,648	18.7	—	18.7	—	—
合 計	—	—	81,245,962	95.6	—	38.2	52.8	4.6

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			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	
スウェーデン			%	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ	千円	
	国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	300,000	297,020	3,899,879	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	900,000	901,420	11,835,654	2025/ 5 /12
小 計						15,735,533	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	0 DMK GOVT 311115	—	520,000	431,069	8,315,323	2031/11/15
		0.5 DMK GOVT 271115	0.5	960,000	889,723	17,162,757	2027/11/15
		0.5 DMK GOVT 291115	0.5	480,000	431,335	8,320,452	2029/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	830,000	821,371	15,844,247	2025/11/15
小 計						49,642,780	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	1 AUST GOVT 301221	1.0	103,000	86,346	7,907,617	2030/12/21
		1 AUST GOVT 311121	1.0	106,000	86,918	7,960,030	2031/11/21
小 計						15,867,648	
合 計						81,245,962	

(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12月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 81,245,962	% 95.4
コール・ローン等、その他	3,903,437	4.6
投資信託財産総額	85,149,399	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (81,506,168千円) の投資信託財産総額 (85,149,399千円) に対する比率は95.7%です。

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

1 スウェーデンクローネ=13.13円	1 デンマーククローネ=19.29円	1 オーストラリアドル=91.58円	
---------------------	--------------------	--------------------	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年12月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	172,114,649,460
コール・ローン等	2,498,561,656
公社債(評価額)	81,245,962,509
未収入金	88,109,972,569
未収利息	133,494,488
前払費用	126,658,238
(B) 負債	87,113,622,678
未払金	87,113,616,398
未払利息	6,280
(C) 純資産総額(A-B)	85,001,026,782
元本	82,893,400,489
次期繰越損益金	2,107,626,293
(D) 受益権総口数	82,893,400,489口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,254円

<注記事項>

- ①期首元本額 87,233,289,094円
 期中追加設定元本額 421,701,708円
 期中一部解約元本額 4,761,590,313円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0254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)

MUAM 先進国高格付国債ファンド(適格機関投資家転売制限付)	43,888,549,714円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-05(適格機関投資家転売制限付)	5,317,382,350円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-01(適格機関投資家転売制限付)	4,392,319,260円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-11(適格機関投資家転売制限付)	4,186,493,257円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-09(適格機関投資家転売制限付)	4,031,327,303円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-03(適格機関投資家転売制限付)	3,832,889,682円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-07(適格機関投資家転売制限付)	2,853,139,735円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-09(適格機関投資家転売制限付)	2,468,486,357円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-06(適格機関投資家転売制限付)	1,886,686,309円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-12(適格機関投資家転売制限付)	1,762,508,473円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-09(適格機関投資家転売制限付)	1,170,560,243円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-10(適格機関投資家転売制限付)	1,125,356,974円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-03(適格機関投資家転売制限付)	1,112,646,185円
国内債券セレクション(ラップ向け)	1,060,000,322円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2019-03(適格機関投資家転売制限付)	927,310,149円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-11(適格機関投資家転売制限付)	767,955,568円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-10(適格機関投資家転売制限付)	748,782,853円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-07(適格機関投資家転売制限付)	552,584,908円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-11(適格機関投資家転売制限付)	430,337,816円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-12(適格機関投資家転売制限付)	341,610,522円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	18,569,426円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	17,020,106円
先進国高格付国債ファンド(ラップ向け)	882,977円
合計	82,893,400,489円

○損益の状況 (2021年12月7日～2022年12月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,650,692,129
受取利息	1,651,989,747
その他収益金	27,762
支払利息	△ 1,325,380
(B) 有価証券売買損益	△ 9,700,727,113
売買益	20,363,962,749
売買損	△30,064,689,862
(C) 保管費用等	△ 23,024,350
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 8,073,059,334
(E) 前期繰越損益金	10,433,987,022
(F) 追加信託差損益金	18,978,292
(G) 解約差損益金	△ 272,279,687
(H) 計(D+E+F+G)	2,107,626,293
次期繰越損益金(H)	2,107,626,293

- (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。