

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	2026年1月14日まで（2016年1月29日設定）	
運用方針	<p>世界プレミア企業債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む先進国のプレミア企業およびその関連会社が発行する債券等に投資を行います。なお、プレミア企業とは、世界的に活躍し、広く認知された商品やサービスを持ち、財務体質が健全で、安定的な成長が期待できる企業をいい、関連会社とは、原則として資本関係を有し、プレミア企業の事業推進の一端を担うために設立された会社等のことをいいます。</p> <p>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。</p> <p>デュレーション調整等のため、先物取引等を利用する場合があります。</p> <p>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。</p> <p>債券等の運用にあたっては、F I Lインベストメンツ・インターナショナルに運用指図に関する権限を委託します。</p>	
主要運用対象	ベビーファンド	世界プレミア企業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	日本を含む先進国のプレミア企業およびその関連会社が発行する債券等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	<p>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。</p> <p>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。）</p>	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）」およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

世界プレミア企業債券ファンド
（為替ヘッジあり）

愛称：プレミア・コレクション

第7期（決算日：2023年1月16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「世界プレミア企業債券ファンド（為替ヘッジあり）」は、去る1月16日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況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）

お客様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)	標準価額			債組入比率	債券先物比率	純資産額
		税金	分配	騰落率			
3期(2019年1月15日)	円 10,077		0	△ 2.2	% 89.8	% —	百万円 17,371
4期(2020年1月14日)	10,753		10	6.8	94.0	—	13,613
5期(2021年1月14日)	11,203		10	4.3	91.9	—	12,666
6期(2022年1月14日)	10,932		10	△ 2.3	94.8	—	11,190
7期(2023年1月16日)	9,574		0	△12.4	92.0	—	9,953

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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	標準価額		債組入比率	債券先物比率	騰落率
		騰落	率			
(期首) 2022年1月14日	円 10,932		% —	% 94.8	% —	
1月末	10,821	△ 1.0	93.7	—		
2月末	10,569	△ 3.3	95.4	—		
3月末	10,354	△ 5.3	94.4	—		
4月末	10,131	△ 7.3	93.5	—		
5月末	10,057	△ 8.0	94.5	—		
6月末	9,705	△11.2	95.1	—		
7月末	10,024	△ 8.3	94.1	—		
8月末	9,735	△10.9	94.3	—		
9月末	9,311	△14.8	94.7	—		
10月末	9,267	△15.2	94.4	—		
11月末	9,484	△13.2	93.5	—		
12月末	9,426	△13.8	92.4	—		
(期末) 2023年1月16日	9,574	△12.4	92.0	—		

(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。

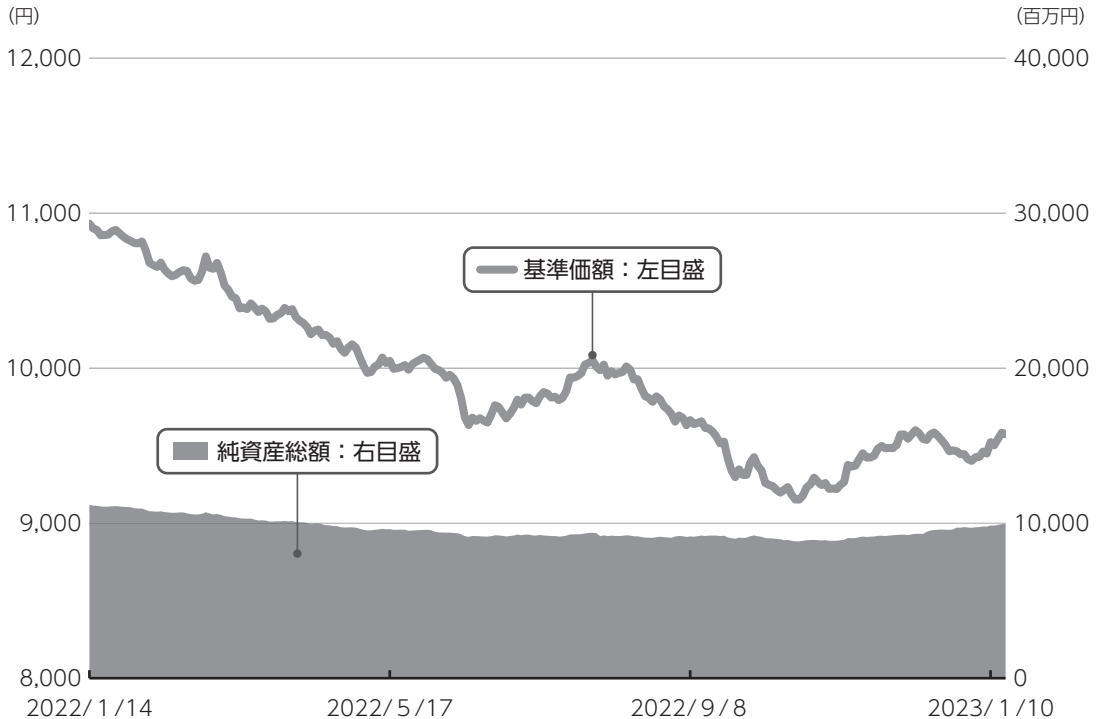
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第7期：2022年1月15日～2023年1月16日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第7期首	10,932円
第7期末	9,574円
既払分配金	0円
騰落率	-12.4%

※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

基準価額は期間の初めに比べ12.4%の下落となりました。

▶ 基準価額の主な変動要因

上昇要因

債券利子収入を享受したこと

下落要因

米国や欧州で金利が上昇したこと等を背景に、世界投資適格社債市況が下落したこと

第7期：2022年1月15日～2023年1月16日

投資環境について

債券市況

世界投資適格社債市況は下落しました。

米欧の中央銀行の積極的な金融引き締め姿勢やインフレ率の上昇等を背景に金利は上昇しました。また、ロシアのウクライナ侵攻等の地政学リスクへの懸念等を背景に、スプレッド（国債との利回り格差）は拡大しました。このような環境下、スプレッドの拡大や金利上昇がマイナスとなり、同市況は下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 世界プレミア企業債券ファンド （為替ヘッジあり）

世界プレミア企業債券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プレミア企業およびその関連会社が発行する債券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図る運用を行いました。

※プレミア企業とは、世界的に活躍し、広く認知された商品やサービスを持ち、財務体質が健全で、安定的な成長が期待できる企業をいい、関連会社とは、原則として資本関係を有し、プレミア企業の事業推進の一端を担うために設立された会社等のことをいいます。

▶ 世界プレミア企業債券マザーファンド

日本を含む先進国のプレミア企業およびその関連会社が発行する債券等を高位に組み入れる運用を行いました。

銘柄選択にあたっては、事業ファンダメンタルズが堅確でビジネスリスクの低い企業の社債を中心に配分し、事業・地域分散も図りながら安定的なリターンを獲得を目指しました。また、円ヘッジベースでみたバリュエーションにも注意を払った運用を行いました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。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

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額的水準等を勘案し、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7期
	2022年1月15日～2023年1月16日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,370

(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。）

▶ 世界プレミアム企業債券ファンド（為替ヘッジあり）

マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む先進国のプレミアム企業およびその関連会社が発行する債券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図る運用を行います。

▶ 世界プレミアム企業債券マザーファンド

米国では、堅調な労働市場を背景とした底堅い経済状況やインフレ高止まりを受け、今後の利上げが織り込まれているものの、インフレには鈍化の兆しがみられています。一方で継続的な利上げが景気減速につながるリスクが懸念されています。また、インフレ抑制が思うように進まないリスクやロシアのウクライナ侵攻等の地政学リスクの影響は不確実性要因となっており、今後の動向が金融市場を大きく左右する可能性が高いと想定されます。

ユーロ圏では、高インフレなどを背景に欧州中央銀行（ECB）がインフレ抑制を優先する姿勢を維持しています。英国では、中央銀行が継続的な利上げを行い、インフレ抑制姿勢を維持しています。このような環境下、投資適格社債市場は、高い信用力を背景に相対的な安定感を維持すると考えています。また、先進国の

金融引き締め継続は短期的には金利上昇圧力につながりやすいものの、中長期的には景気減速リスクにつながるものと見ています。

今後の投資戦略については、景気動向などを十分配慮し、流動性の確保と相対価値を重視した機動的な投資機会を探る方針です。

2022年1月15日～2023年1月16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	81	0.818	(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）	(56)	(0.564)	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）	(22)	(0.221)	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）	(3)	(0.033)	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	3	0.028	(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)	(0.024)	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	84	0.846	

期中の平均基準価額は、9,903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。

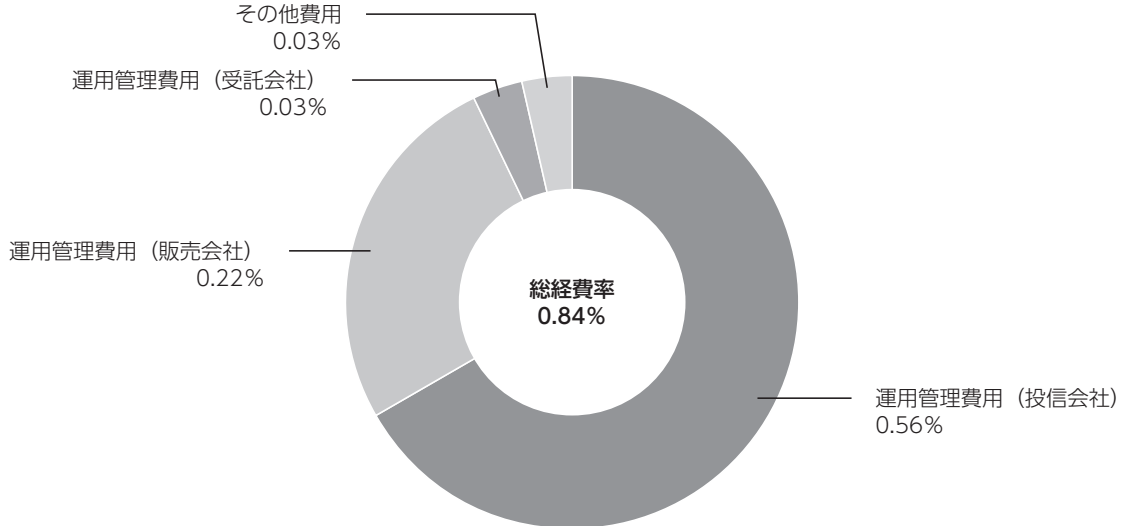
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（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0.84%**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1月15日～2023年1月16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
世界プレミアム企業債券マザーファンド	千口 1,743,485	千円 2,020,000	千口 2,731,160	千円 3,198,000

○利害関係人との取引状況等

(2022年1月15日～2023年1月16日)

利害関係人との取引状況

<世界プレミアム企業債券ファンド（為替ヘッジあり）>

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	$\frac{D}{C}$

<世界プレミアム企業債券マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 100.0%

※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。

利害関係人の発行する有価証券等

<世界プレミアム企業債券マザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
公社債	百万円 —	百万円 54	百万円 146

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、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年1月16日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
世界プレミアム企業債券マザーファンド	千口 9,514,432	千口 8,526,758	千円 9,617,330

○投資信託財産の構成

(2023年1月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
世界プレミアム企業債券マザーファンド	千円 9,617,330	% 96.2
コール・ローン等、その他	376,414	3.8
投資信託財産総額	9,993,744	100.0

(注) 世界プレミアム企業債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（9,136,031千円）の投資信託財産総額（10,343,337千円）に対する比率は88.3%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=127.92円	1ユーロ=138.64円	1イギリスポンド=156.60円
-----------------	--------------	------------------

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年1月16日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	19,135,266,539
コール・ローン等	166,846,810
世界プレミア企業債券マザーファンド(評価額)	9,617,330,631
未収入金	9,351,089,098
(B) 負債	9,181,374,945
未払金	9,141,522,009
未払解約金	1,392,567
未払信託報酬	38,274,065
未払利息	167
その他未払費用	186,137
(C) 純資産総額(A-B)	9,953,891,594
元本	10,396,292,383
次期繰越損益金	△ 442,400,789
(D) 受益権総口数	10,396,292,383口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,574円

<注記事項>

- ①期首元本額 10,237,027,541円
 期中追加設定元本額 2,164,857,501円
 期中一部解約元本額 2,005,592,659円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9574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442,400,789円です。

③分配金の計算過程

項 目	2022年1月15日～ 2023年1月16日
費用控除後の配当等収益額	184,118,416円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	518,045,898円
分配準備積立金額	722,718,162円
当ファンドの分配対象収益額	1,424,882,476円
1万口当たり収益分配対象額	1,370円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

④「世界プレミア企業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35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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに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。

○損益の状況（2022年1月15日～2023年1月16日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 92,717
受取利息	446
支払利息	△ 93,163
(B) 有価証券売買損益	△1,058,736,360
売買益	1,628,221,222
売買損	△2,686,957,582
(C) 信託報酬等	△ 79,438,171
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,138,267,248
(E) 前期繰越損益金	383,966,670
(F) 追加信託差損益金	311,899,789
(配当等相当額)	(513,277,637)
(売買損益相当額)	(△ 201,377,848)
(G) 計(D+E+F)	△ 442,400,789
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 442,400,789
追加信託差損益金	311,899,789
(配当等相当額)	(518,045,898)
(売買損益相当額)	(△ 206,146,109)
分配準備積立金	906,836,578
繰越損益金	△1,661,137,156

(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。

世界プレミアム企業債券マザーファンド

《第14期》決算日2023年1月16日

[計算期間：2022年7月15日～2023年1月16日]

「世界プレミアム企業債券マザーファンド」は、1月16日に第14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14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	<p>主として日本を含む先進国のプレミアム企業およびその関連会社が発行する債券等に投資を行います。なお、プレミアム企業とは、世界的に活躍し、広く認知された商品やサービスを持ち、財務体質が健全で、安定的な成長が期待できる企業をいい、関連会社とは、原則として資本関係を有し、プレミアム企業の事業推進の一端を担うために設立された会社等のことをいいます。</p> <p>債券等への投資にあたっては、金利見通しなどのマクロ分析、産業分析、個別発行体に対する定性・定量的な分析、債務構造分析、各債券ごとの流動性に関する分析などに基づき、銘柄選定を行います。</p> <p>組入債券等は、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。</p> <p>債券等の運用にあたっては、F I Lインベストメンツ・インターナショナルに運用指図に関する権限を委託します。</p> <p>債券等の組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>デュレーション調整等のため、先物取引等を利用する場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
主 要 運 用 対 象	日本を含む先進国のプレミアム企業およびその関連会社が発行する債券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		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
10期(2021年1月14日)	10,999		2.6	93.6	—	12,438
11期(2021年7月14日)	11,559		5.1	94.6	—	12,143
12期(2022年1月14日)	11,632		0.6	95.8	—	11,066
13期(2022年7月14日)	11,914		2.4	94.9	—	9,146
14期(2023年1月16日)	11,279		△5.3	95.2	—	9,617

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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		債組入比率	債券優先物比率	債券率
			円	騰落率			
	(期首)						
		2022年7月14日	11,914	—	94.9	—	—
		7月末	11,975	0.5	96.1	—	—
		8月末	11,876	△0.3	95.7	—	—
		9月末	11,752	△1.4	95.6	—	—
		10月末	12,085	1.4	95.1	—	—
		11月末	11,840	△0.6	95.5	—	—
		12月末	11,404	△4.3	95.1	—	—
	(期末)						
		2023年1月16日	11,279	△5.3	95.2	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

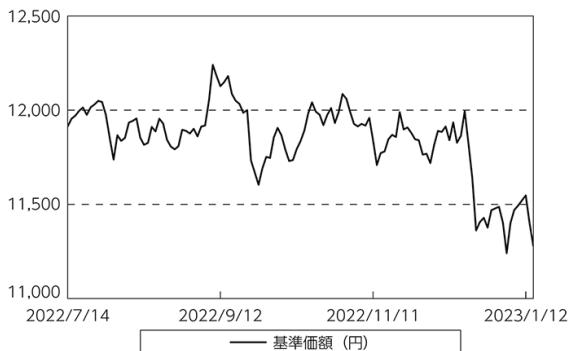
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ5.3%の下落となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

- ・債券利子収入を享受したこと

(下落要因)

- ・米国や欧州で金利が上昇したこと等を背景に、世界投資適格社債市況が下落したこと
- ・日銀が金融緩和政策を修正したこと等を背景に、米ドル及び英ポンドが対円で下落したこと

●投資環境について

◎債券市況

- ・米欧の中央銀行による急速な金融引き締めやインフレ率の上昇等を背景に金利は上昇しました。また、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げペースが減速するとの観測が高まったこと等を背景に、スプレッド（国債との利回り格差）は縮小しました。このような環境下、スプレッドの縮小がプラスとなったものの、金利上昇がマイナスとなり、世界投資適格社債市況は小幅に下落しました。

◎為替市況

- ・米欧の中央銀行による利上げ等が米ドル・ユーロ・英ポンドの対円での上昇要因となった一方で、日銀のイールドカーブ・コントロールにおける長期金利の許容幅拡大等が下落要因となりました。結果、米ドルや英ポンドは対円で下落し、ユーロは対円で小幅に上昇する展開となりました。
- 当該投資信託のポートフォリオについて
 - ・日本を含む先進国のプレミアム企業およびその関連会社が発行する債券等を高位に組み入れる運用を行いました。
 - ・銘柄選択にあたっては、事業ファンダメンタルズが堅確でビジネスリスクの低い企業の社債を中心に配分し、事業・地域分散も図りながら安定的なリターンの獲得を目指しました。また、円ヘッジベースでみたバリュエーションにも注意を払った運用を行いました。

○今後の運用方針

- ・米国では、堅調な労働市場を背景とした底堅い経済状況やインフレ高止まりを受け、今後の利上げが織り込まれているものの、インフレには鈍化の兆しがみられています。一方で継続的な利上げが景気減速につながるリスクが懸念されています。また、インフレ抑制が思うように進まないリスクやロシアのウクライナ侵攻等の地政学リスクの影響は不確実性要因となっており、今後の動向が金融市場を大きく左右する可能性が高いと想定されます。
ユーロ圏では、高インフレなどを背景に欧州中央銀行（ECB）がインフレ抑制を優先する姿勢を維持しています。英国では、中央銀行が継続的な利上げを行い、インフレ抑制姿勢を維持しています。このような環境下、投資適格社債市場は、高い信用力を背景に相対的な安定感を維持すると考えています。また、先進国の金融引き締め継続は短期的には金利上昇圧力につながりやすいものの、中長期的には景気減速リスクにつながるものと見ています。
- ・今後の投資戦略については、景気動向などを十分配慮し、流動性の確保と相対価値を重視した機動的な投資機会を探る方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年7月15日～2023年1月16日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(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 ）	(1)	(0.010)	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	1	0.010	
期中の平均基準価額は、11,839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

(2022年7月15日～2023年1月16日)

公社債

		買付額		売付額	
外 国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 14,656	千アメリカドル 9,462	
		社債券	15,732	9,405	
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券	1,414	753	
		社債券	—	190	
	イタリア	社債券	242	262	
	フランス	特殊債券	468	—	
		社債券	697	918	
	オランダ	特殊債券	—	676	
		社債券	—	926	
	スペイン	社債券	—	335	
	ベルギー	社債券	—	192	
	アイルランド	社債券	—	881	
	ポルトガル	社債券	—	555	
	アメリカ	社債券	945	1,800	
	イギリス	社債券	1,447	1,619	
	スイス	社債券	253	—	
	スウェーデン	社債券	1,089	—	
	ノルウェー	社債券	413	—	
デンマーク	社債券	—	155		
イギリス	社債券	千イギリスポンド 2,356	千イギリスポンド 3,178		

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分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。

○利害関係人との取引状況等

(2022年7月15日～2023年1月16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	$\frac{D}{C}$ %

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 —	百万円 —	百万円 146

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、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

〇組入資産の明細

(2023年1月16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 46,121	千アメリカドル 43,328	千円 5,542,553	% 57.6	% —	% 28.7	% 25.0	% 3.9
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	1,060	945	131,134	1.4	—	1.4	—	—
イタリア	572	458	63,509	0.7	—	0.7	—	—
フランス	2,500	2,271	314,972	3.3	—	2.6	0.7	—
オランダ	813	656	91,013	0.9	—	0.6	0.4	—
スペイン	1,000	934	129,618	1.3	—	—	1.3	—
ルクセンブルク	5,908	4,875	675,904	7.0	—	7.0	—	—
日本	1,100	1,053	146,032	1.5	—	—	—	1.5
アメリカ	2,800	2,602	360,800	3.8	—	—	3.1	0.7
イギリス	3,412	3,268	453,138	4.7	—	2.0	2.7	—
スイス	300	258	35,790	0.4	—	—	0.4	—
ジャージー	1,000	914	126,828	1.3	—	—	1.3	—
スウェーデン	1,183	1,104	153,094	1.6	—	0.7	0.9	—
ノルウェー	1,389	1,181	163,825	1.7	—	1.7	—	—
イギリス	千イギリスポンド 5,436	千イギリスポンド 4,911	769,218	8.0	—	2.6	3.8	1.6
合 計	—	—	9,157,433	95.2	—	47.8	39.6	7.8

(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 期 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	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
		2.75	2,840	2,670	341,608	2032/8/15
		3.875	530	536	68,650	2027/11/30
		3.875	1,580	1,612	206,234	2029/12/31
		4.125	160	168	21,533	2032/11/15
	普通社債券					
		1.375	1,000	891	114,011	2026/4/6
		1.5	1,000	908	116,194	2026/2/15
		1.63	1,000	920	117,697	2025/8/17
		1.65	500	411	52,672	2030/10/1
		2.05	1,000	842	107,759	2030/3/31
		2.1	700	586	75,072	2030/5/1
		2.2	1,000	810	103,661	2030/9/2
		2.2	500	413	52,934	2032/1/15
		2.25	538	450	57,678	2031/1/30
		2.4	1,100	1,037	132,763	2026/8/8
		2.625	500	410	52,482	2031/8/1
		2.625	500	453	58,003	2029/7/29
		2.75	1,100	1,061	135,831	2025/2/10
		2.75	1,100	1,051	134,448	2026/6/3
		2.75	590	572	73,221	2024/6/26
		2.875	1,000	952	121,900	2026/5/10
		2.9	500	476	60,948	2027/9/12
		3.25	450	429	54,908	2027/12/1
		3.5	500	460	58,845	2027/10/23
		3.5	1,000	930	119,051	2026/7/26
		3.5	500	478	61,226	2027/8/15
		3.6	500	487	62,395	2027/8/12
		3.7	357	335	42,931	2029/3/23
		3.8	500	495	63,365	2024/12/5
		3.85	735	679	86,926	2032/8/15
		3.875	900	882	112,847	2024/3/28
		3.95	1,000	969	123,983	2025/6/15
		4.125	1,000	979	125,252	2028/11/16
		4.125	550	534	68,434	2026/4/15
		4.15	949	882	112,918	2030/11/15
		4.15	325	315	40,358	2033/3/15
		4.25	500	463	59,247	2029/7/16
		4.279	500	440	56,285	2032/3/15
		4.375	400	386	49,441	2028/12/15
		4.5	200	194	24,864	2029/6/20
		4.5	600	591	75,671	2026/12/1
		4.663	400	375	47,993	2030/2/15
		4.7	500	505	64,678	2025/12/5
		4.75	703	714	91,340	2028/1/20
		5.3	1,000	1,010	129,248	2029/10/1

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	6.165 CELANESE US 270715	6.165	700	702	89,895	2027/7/15
		6.3 EDP FINANCE B 271011	6.3	588	616	78,877	2027/10/11
		6.375 HYUNDAI CAP 300408	6.375	875	907	116,107	2030/4/8
		7.83 UNICREDIT SP 231204	7.83	1,000	1,017	130,178	2023/12/4
		FRN BANK OF AM 260213	2.015	1,300	1,215	155,483	2026/2/13
		FRN CREDIT SUISSE 330812	6.537	376	351	44,941	2033/8/12
		FRN DEUTSCHE BANK 280107	2.552	1,300	1,135	145,217	2028/1/7
		FRN GOLDMAN SA 290501	4.223	300	285	36,491	2029/5/1
		FRN HSBC BANK 260418	1.645	1,400	1,276	163,299	2026/4/18
		FRN INTESA SAN 331121	8.248	571	613	78,508	2033/11/21
		FRN JP MORGAN 310422	2.522	500	420	53,810	2031/4/22
		FRN MACQUARIE B 281128	3.763	1,000	937	119,934	2028/11/28
		FRN MIZUHO FINANC 300913	2.869	704	602	77,088	2030/9/13
		FRN STANDARD C 250323	1.214	675	640	81,898	2025/3/23
		FRN UBS AG LON 300813	3.126	925	801	102,568	2030/8/13
		STEP CITIGROUP 281027	3.52	1,100	1,021	130,724	2028/10/27
小 計						5,542,553	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 BUND 290815	—	140	122	16,939	2029/8/15
		2.1 BUND 291115	2.1	520	518	71,941	2029/11/15
	普通社債券	0.625 VONOVIA SE 291214	0.625	400	304	42,253	2029/12/14
イタリア	普通社債券	0.875 ERG SPA 310915	0.875	272	210	29,246	2031/9/15
		2 AUTOSTRAD PER 300115	2.0	300	247	34,263	2030/1/15
フランス	特殊債券	1.5 SOCIETE NATIO 290202	1.5	500	459	63,714	2029/2/2
		0.75 LA BANQUE PO 310623	0.75	500	384	53,372	2031/6/23
		1.94 VEOLIA ENVIR 300107	1.94	800	731	101,473	2030/1/7
		3.125 SCHNEIDER E 291013	3.125	200	201	27,884	2029/10/13
	普通社債券	3.375 CREDIT MUTU 270919	3.375	500	494	68,526	2027/9/19
オランダ	普通社債券	0.25 LEASEPLAN CO 260907	0.25	309	269	37,343	2026/9/7
		1 HEIMSTADEN BOST 280413	1.0	504	387	53,669	2028/4/13
スペイン	普通社債券	1.375 SANTANDER 260105	1.375	1,000	934	129,618	2026/1/5
ルクセンブルク	普通社債券	0.375 REPSOL EURO 290706	0.375	700	579	80,306	2029/7/6
		0.45 DH EUROPE FI 280318	0.45	750	658	91,240	2028/3/18
		0.5 CBRE GI OPEN 280127	0.5	1,000	788	109,250	2028/1/27
		1 BEVCO LUX SARL 300116	1.0	714	554	76,860	2030/1/16
		1.125 CK HUTCHISO 281017	1.125	837	715	99,211	2028/10/17
		1.625 MEDTRONIC G 310307	1.625	1,000	890	123,477	2031/3/7
		1.75 BLACKSTONE P 290312	1.75	907	689	95,557	2029/3/12
日本	普通社債券	0.872 MITSUBISHI 240907	0.872	1,100	1,053	146,032	2024/9/7
アメリカ	普通社債券	0.25 PEPSICO INC 240506	0.25	500	482	66,928	2024/5/6
		1.349 MARSH & MCL 260921	1.349	450	413	57,286	2026/9/21
		1.8 INTL FLAVOR & 260925	1.8	350	326	45,270	2026/9/25
		2.2 ALTRIA GROUP 270615	2.2	1,000	915	126,931	2027/6/15
		STEP MORGAN STA 261023	1.342	500	464	64,383	2026/10/23
イギリス	普通社債券	0.875 DS SMITH PL 260912	0.875	200	180	25,035	2026/9/12

銘	柄		利 率	当 期 末 額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イギリス	普通社債券	0.95 TRITAX EUROB 260602	0.95	508	419	58,164	2026/6/2
		2.949 NATIONAL GR 300330	2.949	700	662	91,850	2030/3/30
		3.53 NATIONAL GRI 280920	3.53	282	281	38,969	2028/9/20
		4 THAMES WATER UT 270418	4.0	500	501	69,577	2027/4/18
		FRN BARCLAYS B 250402	3.375	800	794	110,105	2025/4/2
		FRN LLOYDS BANKIN 290111	4.5	422	428	59,435	2029/1/11
スイス	普通社債券	0.25 CREDIT SUISS 260105	0.25	300	258	35,790	2026/1/5
ジャージー	普通社債券	1.5 GLENCORE FINA 261015	1.5	1,000	914	126,828	2026/10/15
スウェーデン	普通社債券	1.125 TELEFONAKTI 270208	1.125	675	590	81,827	2027/2/8
		4.25 SWEDBANK AB 280711	4.25	508	514	71,267	2028/7/11
ノルウェー	普通社債券	1.125 AKER BP ASA 290512	1.125	500	418	57,988	2029/5/12
		1.375 EQUINOR ASA 320522	1.375	889	763	105,836	2032/5/22
小	計					2,845,661	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
イギリス	普通社債券	1.5 SCOTTISH HYDR 280324	1.5	300	257	40,349	2028/3/24
		1.642 WESTFIELD S 310804	1.642	600	525	82,344	2031/8/4
		1.875 LOGICOR 201 261117	1.875	396	351	55,107	2026/11/17
		2.75 CPI PROPERTY 280122	2.75	400	276	43,270	2028/1/22
		3 ING GROEP NV 260218	3.0	300	283	44,471	2026/2/18
		3.375 CANARY WHAR 280423	3.375	757	529	82,958	2028/4/23
		4.565 RAC BOND CO 230506	4.565	500	497	77,849	2023/5/6
		4.87 RAC BOND CO 260506	4.87	400	370	58,091	2026/5/6
		5 ANGLIAN WATER O 230430	5.0	500	498	78,088	2023/4/30
		6.269 AA BOND CO 250731	6.269	288	276	43,345	2025/7/31
		6.375 NATWEST MAR 271108	6.375	495	519	81,302	2027/11/8
		6.64 SOUTHERN WAT 260331	6.64	500	523	82,038	2026/3/31
		小	計				
合	計					9,157,433	

(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

(2023年1月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	9,157,433	88.5
コール・ローン等、その他	1,185,904	11.5
投資信託財産総額	10,343,337	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (9,136,031千円) の投資信託財産総額 (10,343,337千円) に対する比率は88.3%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=127.92円	1 ユーロ=138.64円	1 イギリスポンド=156.60円
------------------	---------------	-------------------

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月16日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,465,595,738
コール・ローン等	603,429,115
公社債(評価額)	9,157,433,932
未収入金	614,983,425
未収利息	75,148,080
前払費用	14,601,186
(B) 負債	847,882,588
未払金	847,882,105
未払利息	483
(C) 純資産総額(A-B)	9,617,713,150
元本	8,526,758,251
次期繰越損益金	1,090,954,899
(D) 受益権総口数	8,526,758,251口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,279円

<注記事項>

- ①期首元本額 7,676,612,045円
 期中追加設定元本額 1,743,485,852円
 期中一部解約元本額 893,339,646円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,279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)
 世界プレミア企業債券ファンド(為替ヘッジあり) 8,526,758,251円

○損益の状況 (2022年7月15日~2023年1月16日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	127,236,572
受取利息	127,365,043
その他収益金	11,980
支払利息	△ 140,451
(B) 有価証券売買損益	△ 614,906,668
売買益	144,080,082
売買損	△ 758,986,750
(C) 保管費用等	△ 893,226
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 488,563,322
(E) 前期繰越損益金	1,469,664,427
(F) 追加信託差損益金	276,514,148
(G) 解約差損益金	△ 166,660,354
(H) 計(D+E+F+G)	1,090,954,899
次期繰越損益金(H)	1,090,954,899

- (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。