

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	2022年7月26日まで（2017年7月27日設定）	
運用方針	世界好利回りCBマザーファンド2017-07受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の転換社債等に投資を行います。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。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。マザーファンドの転換社債等の運用にあたっては、ロンバー・オディエ・アセット・マネジメント（ヨーロッパ）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	ベビード ファンド	世界好利回りCBマザーファンド2017-07受益証券を主要投資対象とします。
	マザー ファンド	日本を含む世界各国の転換社債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビード 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。	
	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。
 ※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）

世界好利回りCBファンド2017-07 （為替ヘッジなし）（限定追加型）

第4期（決算日：2021年7月29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「世界好利回りCBファンド2017-07（為替ヘッジなし）（限定追加型）」は、去る7月29日に第4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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			新株予約権付社債 (転換社債) 組入比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税金	達配	み騰落				
	円	円	円	中率	%	%	%	百万円
(設定日) 2017年7月27日	10,000	—	—	—	—	—	—	6,417
1期(2018年7月30日)	10,100	0	0	1.0	88.8	8.7	—	5,463
2期(2019年7月29日)	10,235	0	0	1.3	89.6	7.3	—	2,947
3期(2020年7月29日)	9,976	0	0	△ 2.5	94.9	2.0	—	1,490
4期(2021年7月29日)	11,100	0	0	11.3	94.0	2.3	—	1,287

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(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、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「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	騰 落 率		新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2020年7月29日	円 9,976	% —	% —	% 94.9	% 2.0	% —
7月末	9,971	△ 0.1	95.1	2.0	—	
8月末	10,140	1.6	95.5	2.0	—	
9月末	10,082	1.1	93.4	2.0	—	
10月末	10,005	0.3	94.9	2.0	—	
11月末	10,111	1.4	94.2	2.0	—	
12月末	10,222	2.5	95.9	2.0	—	
2021年1月末	10,396	4.2	95.0	2.0	—	
2月末	10,750	7.8	95.8	2.0	—	
3月末	11,054	10.8	96.6	2.1	—	
4月末	11,113	11.4	95.6	2.2	—	
5月末	11,230	12.6	94.0	2.2	—	
6月末	11,218	12.4	91.1	2.2	—	
(期末) 2021年7月29日	11,100	11.3	94.0	2.3	—	

(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、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」、「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4期：2020年7月30日～2021年7月29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4期首	9,976円
第4期末	11,100円
既払分配金	0円
騰落率	11.3%

※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

基準価額は期首に比べ11.3%の上昇となりました。

▶ 基準価額の変動要因

上昇要因

グローバルCB市況の上昇や、米ドルが対円で上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

第4期：2020年7月30日～2021年7月29日

投資環境について

▶ グローバルCB市況

グローバルCB市況は上昇しました。

株式市場では、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展などを受けた景気回復期待等を背景に世界的に上昇しました。

債券市場では、景気回復期待や米国でインフレ懸念が一時的に高まったことなどを背景に米独金利はともに上昇しました。期を通じてみると、株式市場の上昇等を背景にグローバルCB市況は上昇しました。

▶ 為替市況

米ドル、ユーロともに対円で上昇しました。

新型コロナウイルスのワクチン接種の進展などを背景とした景気回復期待等を背景に、米ドル、ユーロともに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

▶ 世界好利回りCBファンド2017-07（為替ヘッジなし）（限定追加型）

当ファンドは、世界好利回りCBマザーファンド2017-07受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れる運用を行いました。

▶ 世界好利回りCBマザーファンド2017-07

主として、日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れる運用を行いました。保有銘柄は原則継続保有しましたが、値上がりした一部の銘柄等については売却を行い、信用状況や価格水準、流動性などを勘案しつつ、相対的に利回りが高いと判断した銘柄に再投資を行いました。

▶ 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4期
	2020年7月30日～2021年7月29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	1,105

（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。）

▶ 世界好利回りCBファンド2017-07 （為替ヘッジなし）（限定追加型）

マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れ、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

▶ 世界好利回りCBマザーファンド 2017-07

新型コロナウイルスワクチンのさらなる普及への期待が高まるなか、景気の回復度合いや、景気回復に伴うインフレ率、金利の動向等への注視が必要ではあるものの、相対的に利回り水準が高いCBに対する投資家の需要は根強いと見ています。

今後の運用につきましては、原則として償還または繰上償還請求可能日まで保有することを基本として、保有銘柄の信用状況等を継続的に注視していきます。なお、組入銘柄が償還となった場合や運用者の判断により銘柄売却をした場合等には、原則として、信託期間内に償還または繰上償還請求可能日を迎える銘柄に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行う方針です。

2020年7月30日～2021年7月29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	114	1.075	(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）	(75)	(0.713)	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）	(35)	(0.329)	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	2	0.023	(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)	(0.018)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	116	1.098	

期中の平均基準価額は、10,573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。

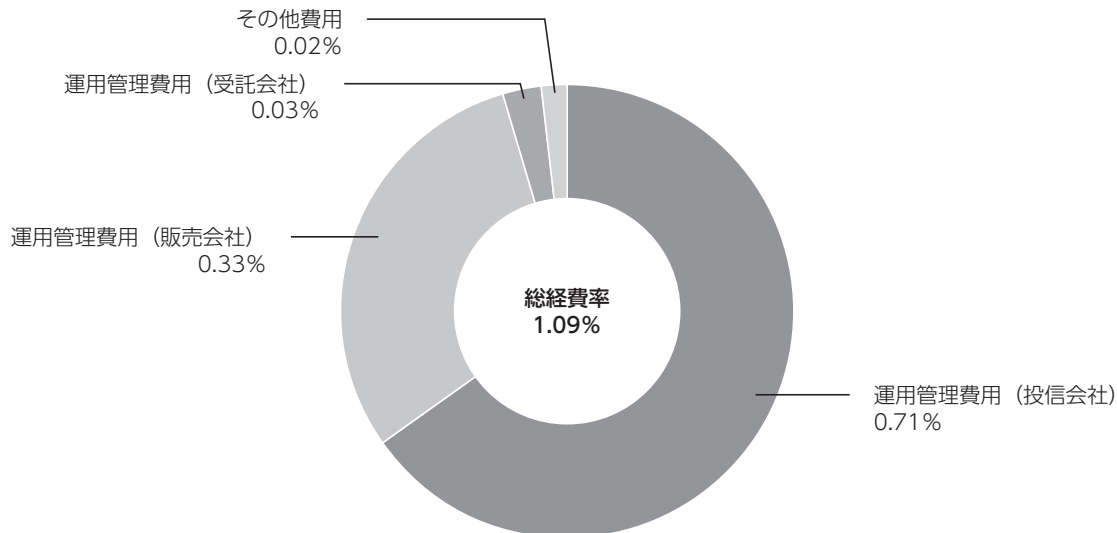
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.09%**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

(2020年7月30日～2021年7月29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
世界好利回りCBマザーファンド2017-07	千口 8,509	千円 10,000	千口 348,134	千円 386,000

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月30日～2021年7月29日)

利害関係人との取引状況

<世界好利回りCBファンド2017-07（為替ヘッジなし）（限定追加型）>
該当事項はございません。

<世界好利回りCBマザーファンド2017-07>

区 分	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 422	% 20.3	百万円 3,232	百万円 1,019	% 31.5	

平均保有割合 29.8%

※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MUF G証券です。

○組入資産の明細

(2021年7月29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
世界好利回りCBマザーファンド2017-07	千口 1,432,484		千口 1,092,860	千円 1,267,280

○投資信託財産の構成

（2021年7月29日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
世界好利回りCBマザーファンド2017-07	千円 1,267,280	% 97.5
コール・ローン等、その他	32,781	2.5
投資信託財産総額	1,300,061	100.0

(注) 世界好利回りCBマザーファンド2017-07において、期末における外貨建純資産（4,273,955千円）の投資信託財産総額（4,304,863千円）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=109.73円	1 ユーロ=129.92円	1 香港ドル=14.11円	
------------------	---------------	---------------	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年7月29日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,300,061,421
コール・ローン等	32,780,788
世界好利回りCBマザーファンド2017-07(評価額)	1,267,280,633
(B) 負債	12,532,587
未払解約金	5,044,192
未払信託報酬	7,461,010
未払利息	36
その他未払費用	27,349
(C) 純資産総額(A-B)	1,287,528,834
元本	1,159,891,362
次期繰越損益金	127,637,472
(D) 受益権総口数	1,159,891,362口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,100円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,493,997,527円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 334,106,165円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1100円です。

②分配金の計算過程

項 目	2020年7月30日～ 2021年7月29日
費用控除後の配当等収益額	19,145,539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	61,049,485円
収益調整金額	176,408円
分配準備積立金額	47,809,421円
当ファンドの分配対象収益額	128,180,853円
1万口当たり収益分配対象額	1,105円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

- ③「世界好利回りCBマザーファンド2017-07」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。

*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。

○損益の状況（2020年7月30日～2021年7月29日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,999
受取利息	20
支払利息	△ 3,019
(B) 有価証券売買損益	145,036,493
売買益	167,458,004
売買損	△ 22,421,511
(C) 信託報酬等	△ 15,470,235
(D) 当期損益金(A+B+C)	129,563,259
(E) 前期繰越損益金	△ 1,558,814
(F) 追加信託差損益金	△ 366,973
(配当等相当額)	(176,408)
(売買損益相当額)	(△ 543,381)
(G) 計(D+E+F)	127,637,472
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	127,637,472
追加信託差損益金	△ 366,973
(配当等相当額)	(176,408)
(売買損益相当額)	(△ 543,381)
分配準備積立金	128,004,445

- (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をいいます。

世界好利回りCBマザーファンド2017-07

《第4期》決算日2021年7月29日

[計算期間：2020年7月30日～2021年7月29日]

「世界好利回りCBマザーファンド2017-07」は、7月29日に第4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4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世界各国の転換社債等に投資を行います。 銘柄選定にあたっては、投資対象地域の分散、信用リスク、価格水準、残存期間、流動性等を勘案しつつ、世界の転換社債市場において相対的に利回りが高いと判断される銘柄に投資を行うことを基本とします。なお、信用格付けが投資適格未満（BBB一格相当未満）の銘柄への投資も行います。</p> <p>原則として信託期間内に償還を迎える銘柄に投資を行い、償還まで保有することを基本とします。なお、運用者の判断により償還前に売却することがあります。</p> <p>転換社債の償還金等については、原則として信託期間内に償還を迎える転換社債に再投資を行います。ただし、市況動向や残存期間等によっては、信託期間内に償還を迎える普通社債や国債等に再投資することがあります。そのため、転換社債の組入比率が大幅に低下することがあります。</p> <p>転換社債等の運用にあたっては、ロンパー・オディエ・アセット・マネジメント（ヨーロッパ）リミテッド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ません。</p>
主 要 運 用 対 象	日本を含む世界各国の転換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割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 期 騰 落 中 率	新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額	
						純 資 産 額
(設定日) 2017年7月27日	円 10,000	% —	% —	% —	百万円 13,590	
1期(2018年7月30日)	10,206	2.1	89.3	8.8	—	12,250
2期(2019年7月29日)	10,453	2.4	90.2	7.4	—	7,780
3期(2020年7月29日)	10,300	△ 1.5	95.9	2.0	—	4,916
4期(2021年7月29日)	11,596	12.6	95.5	2.4	—	4,304

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(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。

(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 先 物 比 率	券 率
(期 首) 2020年7月29日	円 10,300	% —	% 95.9	% 2.0	% —
7 月 末	10,295	△ 0.0	95.8	2.0	—
8 月 末	10,481	1.8	95.9	2.0	—
9 月 末	10,431	1.3	94.4	2.0	—
10 月 末	10,360	0.6	95.4	2.0	—
11 月 末	10,480	1.7	94.9	2.0	—
12 月 末	10,605	3.0	96.2	2.0	—
2021年1 月 末	10,797	4.8	96.0	2.0	—
2 月 末	11,176	8.5	96.2	2.0	—
3 月 末	11,504	11.7	96.8	2.1	—
4 月 末	11,578	12.4	96.5	2.2	—
5 月 末	11,712	13.7	95.0	2.2	—
6 月 末	11,710	13.7	92.5	2.3	—
(期 末) 2021年7月29日	11,596	12.6	95.5	2.4	—

(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12.6%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

グローバルCB市況の上昇や、米ドルが対円で上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

◎グローバルCB市況

- ・グローバルCB市況は上昇しました。
- ・株式市場では、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展などを受けた景気回復期待等を背景に世界的に上昇しました。
- ・債券市場では、景気回復期待や米国でインフレ懸念が一時的に高まったことなどを背景に米独金利はともに上昇しました。
- ・期を通じてみると、株式市場の上昇等を背景にグローバルCB市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドル、ユーロともに対円で上昇しました。
 - ・新型コロナウイルスのワクチン接種の進展などを背景とした景気回復期待等を背景に、米ドル、ユーロともに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
- ・主として、日本を含む世界各国のCB等を高位に組み入れる運用を行いました。
 - ・保有銘柄は原則継続保有しましたが、値上がりした一部の銘柄等については売却を行い、信用状況や価格水準、流動性などを勘案しつつ、相対的に利回りが高いと判断した銘柄に再投資を行いました。

○今後の運用方針

- ・新型コロナウイルスワクチンのさらなる普及への期待が高まるなか、景気回復度合いや、景気回復に伴うインフレ率、金利の動向等への注視が必要ではあるものの、相対的に利回り水準が高いCBに対する投資家の需要は根強いと見えています。
- ・今後の運用につきましては、原則として償還または繰上償還請求可能日まで保有することを基本として、保有銘柄の信用状況等を継続的に注視していきます。なお、組入銘柄が償還となった場合や運用者の判断により銘柄売却をした場合等には、原則として、信託期間内に償還または繰上償還請求可能日を迎える銘柄に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2020年7月30日～2021年7月29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)	2	0.020	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)	(2)	(0.019)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、10,983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

(2020年7月30日～2021年7月29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 16,046	千アメリカドル 16,177	千アメリカドル 16,626 (3,000)	千アメリカドル 17,775 (3,000)
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	イタリア	5,000	4,969	3,200	3,267
	フランス	1,387	1,368	208	207
	オランダ	—	—	—	—
	スペイン	3,800	3,805	400	402
	ベルギー	—	—	—	—
国	イギリス	千イギリスポンド 800	千イギリスポンド 799	千イギリスポンド — (800)	千イギリスポンド — (800)
	香港	千香港ドル 8,000	千香港ドル 8,071	千香港ドル 59,000	千香港ドル 59,481
	シンガポール	千シンガポールドル 1,750	千シンガポールドル 1,794	千シンガポールドル 3,250	千シンガポールドル 3,379

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月30日～2021年7月29日)

利害関係人との取引状況

区 分	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 2,082	百万円 422	% 20.3	百万円 3,232	百万円 1,019	% 31.5

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

(2021年7月29日現在)

外国新株予約権付社債（転換社債）

銘柄		当 期 末		
		額 面 金 額	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
1 TWITTER INC 210915		800	804	88,277
3.75 ARES CAPITAL 220201		2,600	2,788	305,982
4.375 HERCULES CA 220201		2,950	3,160	346,783
0.875 FORTIVE COR 220215		2,000	2,011	220,667
4.625 TCP CAPITAL 220301		2,100	2,152	236,193
3.75 IQIYI INC 231201		3,700	3,596	394,592
0.5 CP FOODS CAPI 250618		3,600	3,643	399,837
1.625 FIREEYE INC 350601		2,050	2,042	224,106
小 計	額 面 ・ 金 額	19,800	20,199	2,216,440
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	—	<51.5%>
(ユーロ・・・イタリア)		千ユーロ	千ユーロ	
1.125 TELECOM ITA 220326		3,100	3,113	404,564
0 ENI SPA 220413		3,000	3,004	390,288
小 計	額 面 ・ 金 額	6,100	6,118	794,852
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	—	<18.5%>
(ユーロ・・・フランス)				
0 UNIBAIL-RODAMCO 220101		2,566	2,566	333,464
小 計	額 面 ・ 金 額	2,566	2,566	333,464
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<7.7%>
(ユーロ・・・スペイン)				
0.25 ALMIRALL SA 211214		1,800	1,802	234,144
1.25 INDRA SISTEM 231007		1,100	1,115	144,870
1 CORP ECONOMICA 231201		2,300	2,321	301,594
小 計	額 面 ・ 金 額	5,200	5,238	680,610
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	—	<15.8%>
ユ ー ロ 計	額 面 ・ 金 額	13,866	13,923	1,808,927
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	—	<42.0%>
(香港)		千香港ドル	千香港ドル	
1.6 LINK 2019 CB 240403		6,000	6,084	85,845
小 計	額 面 ・ 金 額	6,000	6,084	85,845
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<2.0%>
合 計	額 面 ・ 金 額	—	—	4,111,212
	銘 柄 数 < 比 率 >	15	—	<95.5%>

(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) < >内の比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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 890	千アメリカドル 931	千円 102,188	% 2.4	% 2.4	% —	% —	% 2.4
合 計	890	931	102,188	2.4	2.4	—	—	2.4

(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		
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	6.5	6.5 NAVIENT CORP 220615	890	931	102,188	2022/6/15
合 計			890	931	102,188	

(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

(2021年7月29日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新株予約権付社債(転換社債)	千円 4,111,212	% 95.5
公社債	102,188	2.4
コール・ローン等、その他	91,463	2.1
投資信託財産総額	4,304,863	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(4,273,955千円)の投資信託財産総額(4,304,863千円)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=109.73円	1 ユーロ=129.92円	1 香港ドル=14.11円	
------------------	---------------	---------------	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年7月29日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,304,863,358
コール・ローン等	66,683,635
公社債(評価額)	4,213,400,966
未収利息	23,832,584
前払費用	946,173
(B) 負債	34
未払利息	34
(C) 純資産総額(A-B)	4,304,863,324
元本	3,712,515,707
次期繰越損益金	592,347,617
(D) 受益権総口数	3,712,515,707口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,596円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,773,209,115円
 期中追加設定元本額 136,412,512円
 期中一部解約元本額 1,197,105,920円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1596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)

世界好利回りCBファンド2017-07(為替ヘッジあり)(限定追加型)	2,619,655,554円
世界好利回りCBファンド2017-07(為替ヘッジなし)(限定追加型)	1,092,860,153円
合計	3,712,515,707円

○損益の状況 (2020年7月30日～2021年7月29日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	85,472,406
受取利息	81,532,325
その他収益金	3,999,961
支払利息	△ 59,880
(B) 有価証券売買損益	478,957,628
売買益	518,109,854
売買損	△ 39,152,226
(C) 保管費用等	△ 931,621
(D) 当期損益金(A+B+C)	563,498,413
(E) 前期繰越損益金	143,155,796
(F) 追加信託差損益金	16,587,488
(G) 解約差損益金	△130,894,080
(H) 計(D+E+F+G)	592,347,617
次期繰越損益金(H)	592,347,617

- (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。