

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。

償還報告書（全体版）

[満期償還]

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）

信託終了日：2022年7月26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、「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、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
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。

○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
		税込分配金	期騰落	中落率				
(設定日)	円 銭	円		%	%	%	%	百万円
2017年7月27日	10,000	—	—	—	—	—	—	6,417
1期(2018年7月30日)	10,100	0	1.0	88.8	8.7	—	—	5,463
2期(2019年7月29日)	10,235	0	1.3	89.6	7.3	—	—	2,947
3期(2020年7月29日)	9,976	0	△ 2.5	94.9	2.0	—	—	1,490
4期(2021年7月29日)	11,100	0	11.3	94.0	2.3	—	—	1,287
(償還時)	(償還価額)							
5期(2022年7月26日)	12,201.49	—	9.9	—	—	—	—	1,121

(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 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率			
(期 首)	円 銭	%	%	%	%	%
2021年 7月29日	11,100	—	94.0	94.0	2.3	—
7月末	11,077	△ 0.2	94.0	94.0	2.3	—
8月末	11,061	△ 0.4	96.0	96.0	2.4	—
9月末	11,203	0.9	94.1	94.1	2.4	—
10月末	11,464	3.3	93.8	93.8	2.5	—
11月末	11,290	1.7	95.7	95.7	2.6	—
12月末	11,443	3.1	83.5	83.5	—	—
2022年 1月末	11,458	3.2	65.9	65.9	—	—
2月末	11,485	3.5	59.8	59.8	—	—
3月末	11,857	6.8	45.4	45.4	—	—
4月末	12,088	8.9	31.1	31.1	—	—
5月末	12,061	8.7	30.5	30.5	—	—
6月末	12,211	10.0	—	—	—	—
(償還時)	(償還価額)					
2022年 7月26日	12,201.49	9.9	—	—	—	—

(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。

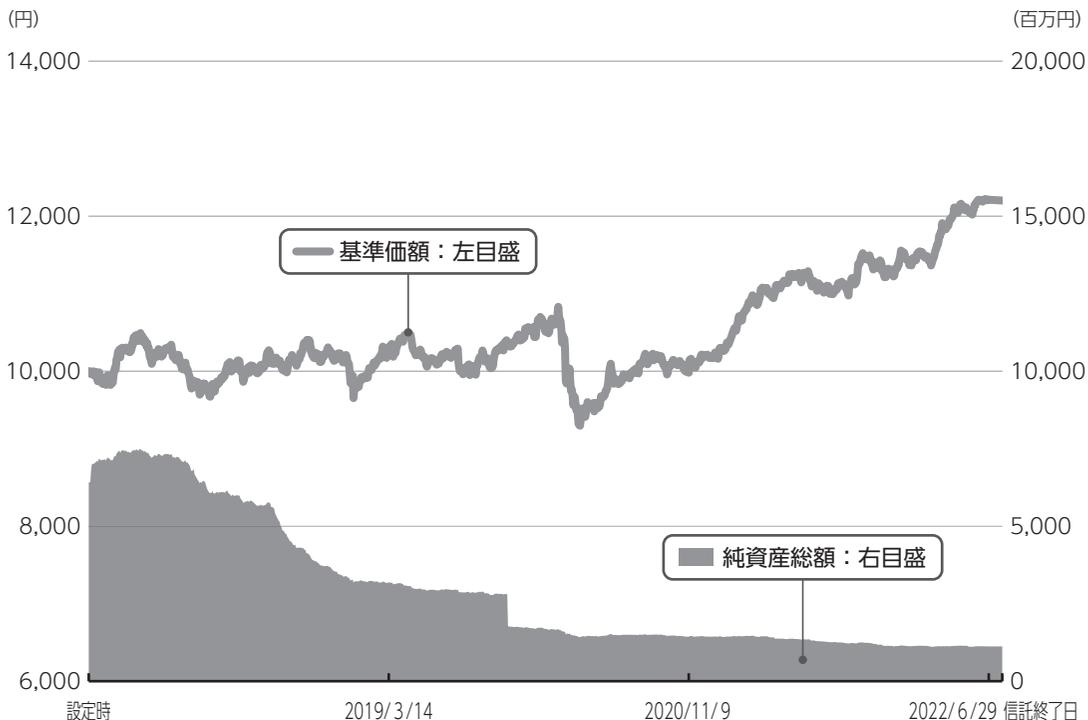
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第1期～第5期：2017年7月27日～2022年7月26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5期末	12,201.49円
既払分配金	0円
騰落率	22.0%

※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22.0%の上昇となりました。

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。

Twitter（メディア・娯楽）等の個別銘柄の保有が基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

Whiting Petroleum（米国の石油・ガス探鉱会社）等の個別銘柄を、債券価格が大きく下落したところで売却し損失を確定したこと等が基準価額の下落要因となりました。

第1期～第5期：2017年7月27日～2022年7月26日

投資環境について

▶ グローバルC B市況

グローバルC B市況は設定時に比べて上昇しました。

株式市況は、設定時から2020年2月頃にかけて、米中貿易摩擦や英国の欧州連合（EU）離脱を巡る不透明感から下落する局面もあったものの、トランプ前大統領による減税政策等を背景とした景気回復期待等から堅調に推移しました。その後、新型コロナウイルスの世界的感染拡大等を背景に株式市況は大幅に下落したものの、同ウイルスのワクチン接種の進展等を受けた景気回復期待等を背景に、世界的に上昇する展開となりました。

債券市場では、米国金利は設定来で上昇しました。米連邦準備制度理事会（FRB）による金融緩和等を背景に低下する局面もあったものの、インフレ対応のための積極的な金融政策の引き締めを背景に米国金利は上昇しました。

設定来でみると、株式市況の上昇等を背景にグローバルC B市況は上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルは対円で上昇しました。

設定時から2020年頃までは、米中貿易摩擦や英国のEU離脱、新型コロナウイルスの世界的感染拡大等からリスク回避姿勢が進み、米ドルは円に対して下落基調となりました。その後、同ウイルスのワクチン接種の進展等を受けた景気回復期待等から米ドルは円に対して反転上昇し、米国で積極的な利上げ観測が高まるなか円安・米ドル高がさらに進行しました。

▶ 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。

第5期（2021年7月30日～信託終了日）は、上記の運用を維持し、信託終了日にかけてマザーファンドの償還金を受領しました。

▶ 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。第5期（2021年7月30日～信託終了日）は、上記の運用を維持し、結果的に再投資の難しい外貨につきましては、償還にむけて円資産へ転換するなど、安定運用に切り替えました。

▶ 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

信託期間中の収益の分配はありません。

▶ 償還価額

▶ 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）

償還価額は、12,201円49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。

2021年7月30日～2022年7月26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	124	1.069	(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)	(0.709)	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）	(38)	(0.327)	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)	(0.033)	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	0.020	(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)	(0.016)	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	126	1.089	

期中の平均基準価額は、11,588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。

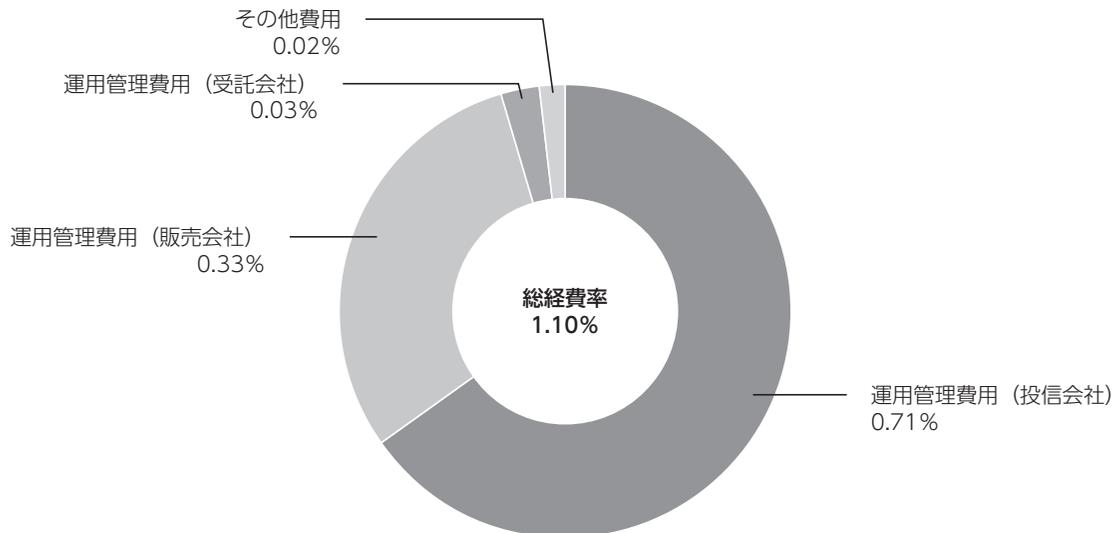
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.10%**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

(2021年7月30日～2022年7月26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 —	千円 —	千口 1,092,860	千円 1,386,696

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月30日～2022年7月26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 —	% —	百万円 5,186	百万円 2,049	% 39.5	

平均保有割合 29.4%

※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MUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2022年7月26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	
世界好利回りCBマザーファンド2017-07	千口 1,092,860	

○投資信託財産の構成

（2022年7月26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 1,127,916	% 100.0
投資信託財産総額	1,127,916	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2022年7月26日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	1,127,916,044
コール・ローン等	1,127,916,044
(B) 負債	5,963,171
未払信託報酬	5,941,058
未払利息	350
その他未払費用	21,763
(C) 純資産総額(A-B)	1,121,952,873
元本	919,521,371
償還差益金	202,431,502
(D) 受益権総口数	919,521,371口
1万口当たり償還価額(C/D)	12,201円49銭

<注記事項>

- ①期首元本額 1,159,891,362円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 240,369,991円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.220149円です。

- ②「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。

○損益の状況（2021年7月30日～2022年7月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,856
受取利息	66
支払利息	△ 3,922
(B) 有価証券売買損益	112,468,554
売買益	120,078,963
売買損	△ 7,610,409
(C) 信託報酬等	△ 12,529,773
(D) 当期損益金(A+B+C)	99,934,925
(E) 前期繰越損益金	102,787,505
(F) 追加信託差損益金	△ 290,928
(配当等相当額)	(139,850)
(売買損益相当額)	(△ 430,778)
償還差益金(D+E+F)	202,431,502

- (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	2017年7月27日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年7月26日			資産総額	1,127,916,044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	5,963,171円	
				純資産総額	1,121,952,873円	
受益権口数	6,417,764,675口	919,521,371口	△5,498,243,304口	受益権口数	919,521,371口	
元本額	6,417,764,675円	919,521,371円	△5,498,243,304円	1万口当たり償還金	12,201円49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	5,409,597,337円	5,463,654,849円	10,100円	0円	0%	
第2期	2,879,907,179	2,947,717,530	10,235	0	0	
第3期	1,493,997,527	1,490,432,779	9,976	0	0	
第4期	1,159,891,362	1,287,528,834	11,100	0	0	

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	12,201円49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。

世界好利回りCBマザーファンド2017-07

《繰上償還(第5期)》信託終了日2022年7月25日

[計算期間：2021年7月30日～2022年7月25日]

「世界好利回りCBマザーファンド2017-07」は、この度、約款の規定に基づき、7月25日に繰り上げて償還させていただきました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第5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。</p> <p>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、信用等级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 期 騰 落	価 額		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
		中 率	率				
(設定日)	円 銭						百万円
2017年7月27日	10,000	—	—	—	—	—	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
(償還時)	(償還価額)						
5期(2022年7月25日)	12,904.62	11.3	—	—	—	—	3,709

(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 券 率	債 先 物 比 率	債 券 率
(期首) 2021年7月29日	円 銭 11,596	% —	% 95.5	% 2.4	% —	% —
7月末	11,572	△ 0.2	95.5	2.4	—	—
8月末	11,564	△ 0.3	96.3	2.4	—	—
9月末	11,726	1.1	95.4	2.5	—	—
10月末	12,013	3.6	95.2	2.5	—	—
11月末	11,839	2.1	95.9	2.6	—	—
12月末	12,015	3.6	84.7	—	—	—
2022年1月末	12,043	3.9	66.7	—	—	—
2月末	12,082	4.2	60.4	—	—	—
3月末	12,490	7.7	45.9	—	—	—
4月末	12,748	9.9	31.6	—	—	—
5月末	12,732	9.8	31.0	—	—	—
6月末	12,905	11.3	—	—	—	—
(償還時) 2022年7月25日	(償還価額) 12,904.62	11.3	—	—	—	—

(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

償還価額は期首に比べ11.3%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)

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。

(下落要因)

CB市況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

◎グローバルCB市況

- ・グローバルCB市況は下落しました。
- ・株式市場では、米連邦準備制度理事会（FRB）による金融引き締め等から、景気後退懸念が広がり株価は下落しました。
- ・債券市場では、FRBが積極的な金融引き締めを続けるとの見方が広がったこと等から、金利は上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドルは対円で上昇しました。
- ・米国で利上げ観測が高まる一方、日本では当面緩和的な金融政策が継続されるとの見方から、日米の金融政策の方向性の乖離等が意識されたこと等を背景に米ドルは円に対して上昇しました。

●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。結果的に再投資の難しい外貨につきましては、償還にむけて円資産へ転換するなど、安定運用に切り替えました。

●償還価額

償還価額は、12,904円62銭となりました。

○1万口当たりの費用明細

(2021年7月30日～2022年7月25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	0.018	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
(そ の 他)	(2)	(0.018)	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、12,178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7月30日～2022年7月25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 国	アメリカ	千アメリカドル 1,750	千アメリカドル 1,736	千アメリカドル 15,450 (6,100)	千アメリカドル 16,038 (6,100)
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	イタリア	—	—	800 (5,300)	800 (5,300)
	フランス	—	—	69 (2,497)	69 (2,497)
	スペイン	—	—	3,400 (1,800)	3,411 (1,800)
	アメリカ	200	200	— (200)	— (200)
香港	千香港ドル 40,000	千香港ドル 39,595	千香港ドル 26,000 (20,000)	千香港ドル 25,965 (20,000)	

(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。

公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	社債券	千アメリカドル —	千アメリカドル — (916)

(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す。

(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

(2021年7月30日～2022年7月25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 —	% —		百万円 2,049	% 39.5	

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

(2022年7月25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

(2022年7月25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 3,709,675	% 100.0
投資信託財産総額	3,709,675	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2022年7月25日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	3,709,675,587
コール・ローン等	3,709,675,587
(B) 負債	1,104
未払利息	1,104
(C) 純資産総額(A-B)	3,709,674,483
元本	2,874,686,831
償還差益金	834,987,652
(D) 受益権総口数	2,874,686,831口
1万口当たり償還価額(C/D)	12,904円62銭

<注記事項>

- ①期首元本額 3,712,515,707円
 期中追加設定元本額 69,650,672円
 期中一部解約元本額 907,479,548円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.290462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)	2,017,864,777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)	856,822,054円
合計	2,874,686,831円

[お 知 ら せ]

当該投資信託を投資対象とする全ての投資信託が償還となるため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。
 (2022年7月25日)

○損益の状況 (2021年7月30日～2022年7月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	34,918,707
受取利息	35,628,242
支払利息	△ 709,535
(B) 有価証券売買損益	374,604,128
売買益	401,159,530
売買損	△ 26,555,402
(C) 保管費用等	△ 711,676
(D) 当期損益金(A+B+C)	408,811,159
(E) 前期繰越損益金	592,347,617
(F) 追加信託差損益金	14,349,328
(G) 解約差損益金	△180,520,452
償還差益金(D+E+F+G)	834,987,652

- (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。