

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信／内外／債券
信託期間	2017年1月19日まで（2013年7月22日設定）
運用方針	<p>グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券（劣後債および優先証券等）等を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保をめざします。ハイブリッド証券等への投資にあたっては、G-SIFIs(Global Systemically Important Financial Institutions)が発行する銘柄を中心に投資します。</p> <p>※G-SIFIsとは各国の金融監督当局等で構成される金融安定理事会(FSB)がグローバルな金融システムの維持・安定に欠かせない重要な金融機関として指定した金融機関です。G-SIFIsに指定されると、一般の金融機関よりも厳しい財務健全性が要求されることとなります。</p> <p>※ハイブリッド証券とは債券と株式の両方の特性を有しており、上場または非上場となっています。ハイブリッド証券は一般に利息(配当)が定められており、満期時や繰上償還時に額面で償還される等、債券に似た性質を有しています。同一発行体が発行している普通社債とハイブリッド証券を比べると、ハイブリッド証券の方が普通社債よりも利回りが高く、また期待リターンも高くなります。その一方で、リスクは普通社債に比べてハイブリッド証券の方が高くなり、また弁済順位は普通社債に比べて低いという特徴もあります。また一部のハイブリッド証券については償還時に株式に転換されるものもあります。</p> <p>主として信託期間内に償還またはコール可能日を迎える銘柄に投資を行います。ただし、信託期間内に組入債券が償還した場合等、ハイブリッド証券のほか、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、ハイブリッド証券の組入比率が低下することがあります。</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>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の運用にあたっては、プリンシパル・グローバル・インベスターズ・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。</p>
主要運用対象	<p>ベビードファンド グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>マザーファンド 日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とします。</p>
主な組入制限	<p>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。</p> <p>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。</p>
分配方針	元本超過額または経費等控除後の配当等収益のいずれか多い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]

グローバル金融機関 ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり) 2013-07

信託終了日：2017年1月19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、「グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)2013-07」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。

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 (分配額)	価 額				受 益 者 利	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	元 残 存 本 率
		税 込 分 配	み 金	期 騰 落 額	中 期 騰 落 率				
(設定日)	円 銭	円	円 銭	%	%	%	%	%	
2013年7月22日	10,000	—	—	—	—	—	—	100.0	
1期(2015年1月19日)	10,815	10	825	8.3	5.5	94.5	—	72.0	
2期(2016年1月19日)	10,883	10	78	0.7	3.6	80.3	—	51.7	
(償還時)	(償還価額)								
3期(2017年1月19日)	10,783.40	—	△ 99.60	△0.9	2.3	—	—	40.6	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

(注) 日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券（劣後債および優先証券等）等を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保をめざしますが、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。

(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		債 組	入 比	券 率	債 先	物 比	券 率
				騰 落	率						
	(期 首)		円 銭		%			%			%
	2016年	1月	19日	10,883	—			80.3			—
	1月	末		10,881	△0.0			88.1			—
	2月	末		10,803	△0.7			86.1			—
	3月	末		10,857	△0.2			88.1			—
	4月	末		10,854	△0.3			92.1			—
	5月	末		10,857	△0.2			94.8			—
	6月	末		10,805	△0.7			86.6			—
	7月	末		10,820	△0.6			89.7			—
	8月	末		10,819	△0.6			89.4			—
	9月	末		10,843	△0.4			70.6			—
	10月	末		10,836	△0.4			53.9			—
	11月	末		10,811	△0.7			27.9			—
	12月	末		10,794	△0.8			—			—
	(償還時)		(償還価額)								
	2017年	1月	19日	10,783.40	△0.9			—			—

(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、「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：2013/7/22～2017/1/19）

基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ8.0%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。



- ・分配金再投資基準価額は、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、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客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。
- ・単位型投資信託は実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

主にグローバル金融機関ハイブリッド証券（劣後債および優先証券等）市況が上昇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：2013/7/22～2017/1/19）

債券市況の推移
（設定時を100として指数化）



ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル・キャピタル・セキュリティズ・バンキング指数(ドルヘッジベース)

◎債券市況

- ・ 設定来のグローバル金融機関ハイブリッド証券市況は、債券利子収入を享受したことやドイツやイギリスの金利が低下したことなどから上昇しました。
- ・ 米国金利は米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを実施したことなどを背景に上昇したものの、欧州中央銀行（ECB）が金融緩和策を実施したことや英国の欧州連合（EU）離脱による影響が懸念されたことなどを背景にドイツやイギリスの金利は低下しました。

- ・ ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル・キャピタル・セキュリティズ・バンキング指数（旧名称：パークレイズ・グローバル・キャピタル・セキュリティズ・バンキング指数）とは、ブルームバーグ社が算出するグローバルベースのハイブリッド証券のうち、銀行セクターが発行する証券の値動きを示す代表的な指数です。

ブルームバーグ（BLOOMBERG）は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）の商標およびサービスマークです。パークレイズ（BARCLAYS）は、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシー（Barclays Bank Plc）の商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックス（BLOOMBERG BARCLAYS INDICES）に対する一切の独占的権利を有しています。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）2013-07＞

・当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を実質的な主要投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。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。

＜第1期：設定時～2015年1月19日＞

基準価額は設定時に比べ8.3%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第2期：2015年1月20日～2016年1月19日＞

基準価額は期首に比べ0.7%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

＜第3期：2016年1月20日～信託終了日＞

償還価額は期首に比べ0.9%の下落となりました。

＜グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07＞

償還価額は設定時に比べ28.9%の上昇となりました。

- ・日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象として、信託期間内に償還または繰上償還可能日を迎えるハイブリッド証券等に投資を行い、主として利子収益の確保をめざしました。
- ・バイ・アンド・ホールド戦略を基本とし、個別銘柄については原則継続保有としました。

＜第1期：設定時～2015年1月19日＞

基準価額は設定時に比べ31.4%の上昇となりました。

- ・グローバル金融機関ハイブリッド証券市況が上昇したことや米ドルが対円で上昇したことなどがプラスとなり、基準価額は上昇しました。

＜第2期：2015年1月20日～2016年1月19日＞

基準価額は期首に比べ3.3%の上昇となりました。

- ・グローバル金融機関ハイブリッド証券市況が上昇したことなどがプラスとなり、基準価額は上昇しました。

＜第3期：2016年1月20日～信託終了日＞

償還価額は期首に比べ5.1%の下落となりました。

- ・グローバル金融機関ハイブリッド証券市況が上昇したことなどがプラスとなったものの、米ドルが対円で下落したことなどがマイナスとなり、償還価額は下落しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券（劣後債および優先証券等）等を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保をめざしますが、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

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、第1期および第2期に10円ずつの分配とさせていただきます。
信託期間中、累計で20円の分配を行わせていただきました。

償還価額

<グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）2013-07>
償還価額は10,783円40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

(2016年 1 月20日～2017年 1 月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 192	% 1.768	(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)	(93)	(0.863)	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)	(93)	(0.863)	交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(5)	(0.043)	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	0.014	(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)	(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
(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	194	1.782	
期中の平均基準価額は、10,831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、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

(2016年 1 月20日～2017年 1 月19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
グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07	千口 292,108	千円 370,000	千口 10,754,547	千円 13,777,511

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月20日～2017年1月19日)

利害関係人との取引状況

<グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）2013-07>

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	$\frac{D}{C}$ %

<グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07>

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 87.8%

※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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2017年1月19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
グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07		千口 10,462,438

○投資信託財産の構成

(2017年1月19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 11,878,162	% 100.0
投資信託財産総額	11,878,162	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2017年1月19日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	11,878,162,925
コール・ローン等	11,878,162,925
(B) 負債	105,472,663
未払信託報酬	105,212,277
未払利息	17,130
その他未払費用	243,256
(C) 純資産総額(A-B)	11,772,690,262
元本	10,917,420,960
償還差益金	855,269,302
(D) 受益権総口数	10,917,420,960口
1万口当たり償還価額(C/D)	10,783円40銭

<注記事項>

- ①設定年月日 2013年7月22日
 設定元本額 26,835,443,368円
 期首元本額 13,885,097,398円
 元本残存率 40.6%

また、1口当たり純資産額は、期末1.078340円です。

- ②「グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07」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（2016年1月20日～2017年1月19日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 201,872
受取利息	41,169
支払利息	△ 243,041
(B) 有価証券売買損益	78,314,630
売買益	5,115,869,743
売買損	△5,037,555,113
(C) 信託報酬等	△ 234,191,805
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 156,079,047
(E) 前期繰越損益金	1,225,859,153
(F) 解約差損益金	△ 214,510,804
償還差益金(D+E+F)	855,269,302

- (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)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。

○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7月22日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2017年1月19日		資 産 総 額	11,878,162,925円
区 分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差異増減または追加信託	負 債 総 額	105,472,663円
受益権口数	26,835,443,368口	10,917,420,960口	△15,918,022,408口	純 資 産 総 額	11,772,690,262円
元 本 額	26,835,443,368円	10,917,420,960円	△15,918,022,408円	受 益 権 口 数	10,917,420,960口
				1万口当たり償還金	10,783円40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	19,326,411,135円	20,900,651,750円	10,815円	10円	0.1%
第2期	13,885,097,398	15,110,956,551	10,883	10	0.1
信託期間中1万口当たり総収益金及び年平均収益率				803円40銭	2.2963%

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	10,783円40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。

グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07

《繰上償還(第3期)》信託終了日2017年1月18日

[計算期間：2016年1月20日～2017年1月18日]

「グローバル金融機関ハイブリッド証券マザーファンド2013-07」は、この度、約款の規定に基づき、1月18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3期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券(劣後債および優先証券等)等を主要投資対象とし、主として利子収益の確保をめざします。 ハイブリッド証券等への投資にあたっては、G-SIFIS (Global Systemically Important Financial Institutions) が発行する銘柄を中心に投資します。 主として信託期間内に償還またはコール可能日を迎える銘柄に投資を行います。ただし、信託期間内に組入債券が償還した場合等、ハイブリッド証券のほか、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、ハイブリッド証券の組入比率が低下することがあります。 債券等の運用にあたっては、プリンシパル・グローバル・インベスターズ・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。 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ません。
主 要 運 用 対 象	日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証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。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
		期 騰 落	中 額	期 騰 落				
(設定日)	円 銭		円 銭		%		%	
2013年7月22日	10,000		—		—		—	
1期(2015年1月19日)	13,143		3,143		31.4		97.9	
2期(2016年1月19日)	13,580		437		3.3		85.4	
(償還時)	(償還価額)							
3期(2017年1月18日)	12,891.51	△	688.49	△	5.1		—	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券(劣後債および優先証券等)等を主要投資対象とし、主として利子収益の確保をめざしますが、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。

(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 先 物 比 率	券 率	
							騰 落 率
	(期 首)		円 銭	%		%	
	2016年 1月19日		13,580	—		85.4	—
	1月末		13,958	2.8		90.3	—
	2月末		13,049	△ 3.9		91.0	—
	3月末		13,041	△ 4.0		90.8	—
	4月末		12,731	△ 6.3		95.2	—
	5月末		12,898	△ 5.0		96.8	—
	6月末		11,949	△12.0		93.1	—
	7月末		12,170	△10.4		93.1	—
	8月末		12,062	△11.2		92.7	—
	9月末		11,891	△12.4		74.7	—
	10月末		12,227	△10.0		55.2	—
	11月末		12,743	△ 6.2		28.5	—
	12月末		12,892	△ 5.1		—	—
	(償還時)		(償還価額)				
	2017年 1月18日		12,891.51	△ 5.1		—	—

(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5.1%の下落となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎債券市況

- ・当期のグローバル金融機関ハイブリッド証券市況は、債券利子収入を享受したことやドイツやイギリスの金利が低下したことなどから上昇しました。
- ・米国金利は米国大統領選挙で財政出動に積極的と見られるトランプ氏が勝利しインフレ期待が高まったことなどを背景に上昇したものの、欧州中央銀行（ECB）が追加金融緩和策を実施したことや英国の欧州連合（EU）離脱による影響が懸念されたことなどを背景にドイツやイギリスの金利は低下しました。

◎為替市況

- ・米ドルは、信託終了日にかけて日米金利差の拡大などを背景に対円で上昇する局面があったものの、期を通じて見ると対円で下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を含む世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象として、信託期間内に償還または繰上償還可能日を迎えるハイブリッド証券等に投資を行い、主として利子収益の確保をめざしました。
- ・バイ・アンド・ホールド戦略を基本とし、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、当期は主にグローバル金融機関ハイブリッド証券市況が上昇したことなどがプラスとなったものの、米ドルが対円で下落したことなどがマイナスとなり、期首に比べ下落しました。

● 償還価額

償還価額は12,891円51銭となりました。

○1万口当たりの費用明細

(2016年1月20日～2017年1月18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	0.011	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)	(1)	(0.011)	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、12,634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

(2016年1月20日～2017年1月18日)

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 76,302	千アメリカドル 32,443 (161,861)

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月20日～2017年1月18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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 169	百万円 169	% 100.0	百万円 15,810	百万円 6,593	% 41.7

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2017年1月18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

(2017年1月18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 12,538,281	% 100.0
投資信託財産総額	12,538,281	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2017年1月18日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	12,538,281,244
コール・ローン等	12,538,281,244
(B) 負債	18,288
未払利息	18,288
(C) 純資産総額(A-B)	12,538,262,956
元本	9,725,984,106
償還差益金	2,812,278,850
(D) 受益権総口数	9,725,984,106口
1万口当たり償還価額(C/D)	12,891円51銭

<注記事項>

- ①期首元本額 12,258,442,545円
 期中追加設定元本額 292,108,584円
 期中一部解約元本額 2,824,567,023円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.289151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)

グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり) 2013-07	8,657,256,622円
グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジなし) 2013-07	1,068,727,484円
合計	9,725,984,106円

○損益の状況 (2016年1月20日～2017年1月18日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	592,801,055
受取利息	593,881,628
支払利息	△ 1,080,573
(B) 有価証券売買損益	△1,537,518,897
売買益	4,067,617
売買損	△1,541,586,514
(C) 保管費用等	△ 1,657,083
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 946,374,925
(E) 前期繰越損益金	4,388,195,336
(F) 追加信託差損益金	77,891,416
(G) 解約差損益金	△ 707,432,977
償還差益金(D+E+F+G)	2,812,278,850

- (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。

【お 知 ら せ】

この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託が、その信託を終了させることとなったため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。

(2017年1月18日)