

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／海外／債券	
信託期間	無期限（2000年8月11日設定）	
運用方針	三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、わが国を除く世界主要国の公社債への分散投資により、信託財産の長期的な成長をめざします。 （ファンドにおいてわが国を除く世界主要国の公社債とは、国債、政府保証債、政府機関債、国際機関債（複数国が協調して設立した国際的な組織が発行する債券）、社債等を指します。）実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。	
主要運用対象	ベビーマザーファンド	三菱UFJ 海外債券アクティブ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	わが国を除く世界主要国の公社債（国債、政府保証債、政府機関債、国際機関債、社債等）を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーマザーファンド	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に制限を設けません。
分配方針	毎年1回決算（原則として12月15日。ただし、12月15日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。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。
 ※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）

三菱UFJ 海外債券オープン

第22期（決算日：2021年12月15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「三菱UFJ 海外債券オープン」は、去る12月15日に第22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。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本・円ベース)		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込分配金	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	円	%	%	%	%	%	百万円	
18期(2017年12月15日)	23,065	100	3.5	462.75	5.4	97.3	—	10,529	
19期(2018年12月17日)	22,236	0	△3.6	453.56	△2.0	96.1	—	10,945	
20期(2019年12月16日)	23,052	100	4.1	472.22	4.1	95.4	—	12,384	
21期(2020年12月15日)	24,148	100	5.2	497.78	5.4	95.3	—	13,893	
22期(2021年12月15日)	24,514	100	1.9	515.51	3.6	95.8	—	14,870	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、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		F T S E 世界国債インデックス (除く日本・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年12月15日	円 24,148	% —	497.78	% —	% 95.3	% —
12月末	24,099	△0.2	497.33	△0.1	95.1	—
2021年1月末	24,037	△0.5	496.21	△0.3	94.1	—
2月末	23,766	△1.6	494.15	△0.7	94.8	—
3月末	24,273	0.5	501.12	0.7	94.4	—
4月末	24,227	0.3	502.93	1.0	94.2	—
5月末	24,513	1.5	510.44	2.5	95.9	—
6月末	24,393	1.0	508.66	2.2	96.0	—
7月末	24,477	1.4	513.08	3.1	96.2	—
8月末	24,462	1.3	512.29	2.9	97.0	—
9月末	24,305	0.7	508.95	2.2	96.1	—
10月末	24,801	2.7	518.32	4.1	97.5	—
11月末	24,507	1.5	512.77	3.0	95.7	—
(期 末) 2021年12月15日	24,614	1.9	515.51	3.6	95.8	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、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。

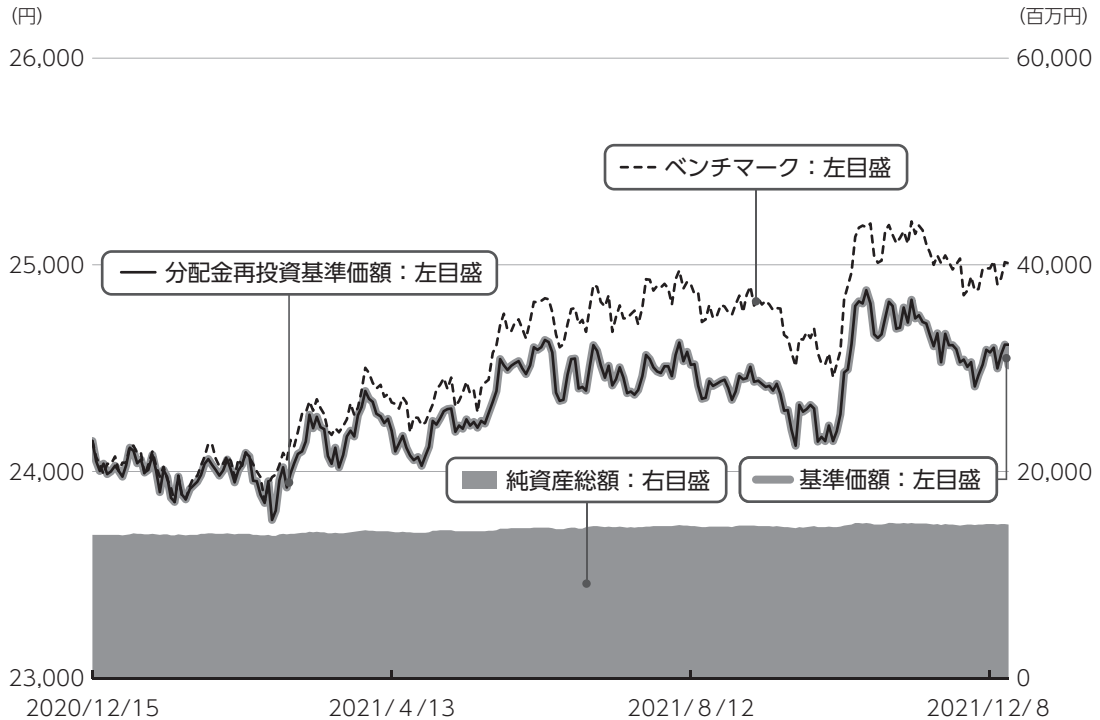
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第22期：2020年12月16日～2021年12月15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22期首	24,148円
第22期末	24,514円
既払分配金	100円
騰落率	1.9%
(分配金再投資ベース)	

※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はありません。

※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1.9%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（3.6%）を1.7%下回りました。

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や債券利子収入を享受したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

米国長期金利が上昇したことなどが基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

▶ 海外債券市況

米独長期金利は上昇しました。

米独長期金利は、新型コロナウイルスワクチンの接種進展による景気回復期待の高まりや、世界的なインフレ観測の高まりなどをを受けて、緩和的な金融政策の早期縮小を織り込む動きが強まったことなどから、2021年5月にかけて上昇しました。8月にかけては、新型コロナウイルスのデルタ変異株の感染拡大などをを受けて景気の先行き不透明感が高まったことなどから米独長期金利は低下しましたが、その後、主要国において早期利上げ期待が高まったことなどから米独長期金利は上昇しました。結果、期を通じてみると、米独長期金利は上昇しました。

▶ 為替市況

米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

米ドルは、早期利上げ期待の高まりなどを背景に米国長期金利が上昇したことなどから対円で上昇しました。ユーロは、景気回復期待の高まりなどから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

▶ 三菱UFJ 海外債券オープン

三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド受益証券を通じて、わが国を除く世界主要国の公社債に投資をしています。債券の実質組入比率は、運用の基本方針にしたがい高位を維持しました。

▶ 三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド

中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

わが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークを中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

債券デュレーション（平均回収期間や金利感応度）は、金融政策の織り込み具合等を注視しコントロールしました。米国の債券デュレーションは期首から2021年1月上旬にかけてベンチマーク比長めとし、その後は同中立から短めでコントロールしました。欧州の債券デュレーションは期首から5月中旬にかけて同中立から長めでコントロールし、5月下旬から6月中旬にかけては同短め、その後は同長めとしました。

欧州においては、緩和的な欧州中央銀行（ECB）の金融政策などを背景に国別配分をコントロールしました。期を通じてイタリア・スペインをベンチマーク比オーバーウェイトで維持した一方、ドイツ・フランスを同アンダーウェイトで維持しました。

カントリーアロケーション戦略（通貨配分）では、景気の相対感等に着目し通貨配分をコントロールしました。米ドルは期首から7月中旬にかけてベンチマーク比中立からアンダーウェイトでコントロールし、その後は同オーバーウェイトとしました。ユーロは期を通じて同中立からアンダーウェイトでコントロールしました。豪ドルは期首から7月中旬にかけて同オーバーウェイト、7月下旬から9月にかけては同アンダーウェイト、その後は同中立からオーバーウェイトでコントロールしました。英ポンド、カナダドル、シンガポールドル、ノルウェークローネ、メキシコペソ、ポーランドズロチは期を通じて同中立からオーバーウェイトでコントロールしました。中国元は11月に組入を開始し、同中立からオーバーウェイトでコントロールしました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ 三菱UFJ 海外債券オープン

ファンドの騰落率は、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）の騰落率（3.6%）を1.7%下回りました。

マザーファンド保有以外の要因

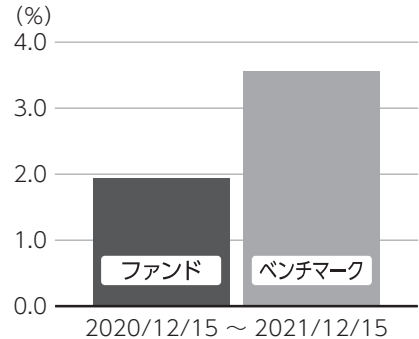
信託報酬等の費用がマイナスに影響しました。

マザーファンド保有による要因

マイナス要因

2021年6月から7月中旬にかけて豪ドル・ポーランドズロチをベンチマーク比オーバーウェイトとしていたことなどがマイナス要因となりました。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

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22期 2020年12月16日～2021年12月15日
当期分配金（対基準価額比率）	100 (0.406%)
当期の収益	100
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	18,248

(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。)

▶ 三菱UFJ 海外債券オープン

三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド受益証券の組入比率を高位とする方針です。

▶ 三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド

金利戦略においては、各国の景気動向に加え、財政政策・金融政策を含む各種政策や市場の内部要因が長期金利へ与える影響を考慮し、デュレーションなどのコ

ントロールを行います。その中で、欧州では各国の財政状況や政策対応などを重視した銘柄選別に注力します。また、カントリーアロケーション戦略においては、各国のファンダメンタルズ状況や投資家のリスク選好度を重視し、環境見通しの変化に対応して調整を行う方針です。債券の組入比率は高位を維持し、信用力の高い国債中心の組み入れを維持する方針です。

2020年12月16日～2021年12月15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	267	1.100	(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)	(134)	(0.550)	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)	(120)	(0.495)	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)	(13)	(0.055)	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	6	0.026	(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)	(5)	(0.022)	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)	(1)	(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	273	1.126	

期中の平均基準価額は、24,321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。

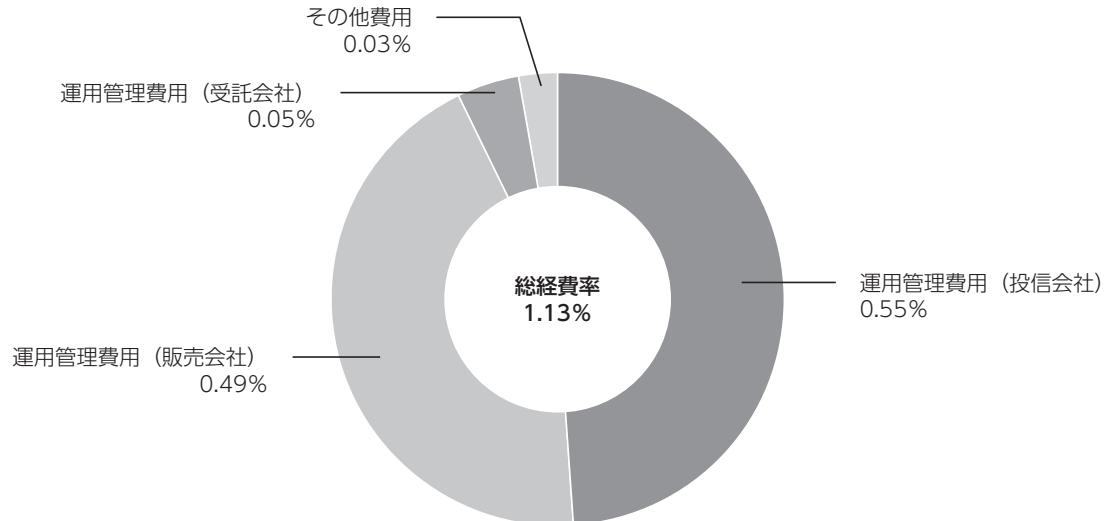
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.13%**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12月16日～2021年12月15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
三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	407,574	1,347,385	244,847	810,565

○利害関係人との取引状況等

(2020年12月16日～2021年12月15日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 海外債券オープン>

該当事項はございません。

<三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	26,601	5,707	21.5	26,476	6,430	24.3

平均保有割合 30.2%

※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、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

(2021年12月15日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	4,245,177	4,407,904	4,407,904	14,834,804

○投資信託財産の構成

(2021年12月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	千円 14,834,804	% 98.7
コール・ローン等、その他	193,864	1.3
投資信託財産総額	15,028,668	100.0

(注) 三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（48,050,658千円）の投資信託財産総額（48,230,880千円）に対する比率は99.6%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=113.80円	1 カナダドル=88.54円	1 メキシコペソ=5.3637円	1 ユーロ=128.23円
1 イギリスポンド=150.59円	1 スウェーデンクローネ=12.45円	1 ノルウェークローネ=12.50円	1 ポーランドズロチ=27.6885円
1 オーストラリアドル=80.92円	1 シンガポールドル=83.09円	1 マレーシアリングギット=26.8658円	1 中国元=17.8719円
1 イスラエルシケル=36.2789円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	15,028,668,871
コール・ローン等	130,843,480
三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド(評価額)	14,834,804,102
未収入金	63,021,289
(B) 負債	157,676,809
未払収益分配金	60,662,748
未払解約金	15,423,847
未払信託報酬	81,297,540
未払利息	67
その他未払費用	292,607
(C) 純資産総額(A-B)	14,870,992,062
元本	6,066,274,871
次期繰越損益金	8,804,717,191
(D) 受益権総口数	6,066,274,871口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,514円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,753,410,053円
 期中追加設定元本額 1,104,689,721円
 期中一部解約元本額 791,824,903円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,4514円です。

②分配金の計算過程

項 目	2020年12月16日～ 2021年12月15日
費用控除後の配当等収益額	168,408,204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	9,088,493,186円
分配準備積立金額	1,873,999,217円
当ファンドの分配対象収益額	11,130,900,607円
1万口当たり収益分配対象額	18,348円
1万口当たり分配金額	100円
収益分配金金額	60,662,748円

○損益の状況 (2020年12月16日～2021年12月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 14,777
受取利息	187
支払利息	△ 14,964
(B) 有価証券売買損益	424,913,763
売買益	445,328,863
売買損	△ 20,415,100
(C) 信託報酬等	△ 159,159,348
(D) 当期損益金(A+B+C)	265,739,638
(E) 前期繰越損益金	1,631,538,282
(F) 追加信託差損益金	6,968,102,019
(配当等相当額)	(9,086,921,651)
(売買損益相当額)	(△2,118,819,632)
(G) 計(D+E+F)	8,865,379,939
(H) 収益分配金	△ 60,662,748
次期繰越損益金(G+H)	8,804,717,191
追加信託差損益金	6,968,102,019
(配当等相当額)	(9,088,493,186)
(売買損益相当額)	(△2,120,391,167)
分配準備積立金	1,981,744,673
繰越損益金	△ 145,129,501

- (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。

○分配金のお知らせ

1 万円当たり分配金 (税込)	100円
-----------------	------

◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2021年12月15日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※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。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*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。

[お 知 ら せ]

「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。

三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド

《第22期》決算日2021年12月15日

〔計算期間：2020年12月16日～2021年12月15日〕

「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」は、12月15日に第22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22期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果をめざします。</p> <p>運用にあたっては、各国のマクロ分析や金利予測に基づいて、カンントリーアロケーション、デュレーションおよび残存構成のコントロール、利回り較差に着目した銘柄選択でアクティブに超過収益の獲得をめざします。さらに、ポートフォリオとベンチマークを比較分析することにより、リスクのチェックとコントロールを行います。</p> <p>組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。ただし、エクスポージャーのコントロール等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。</p> <p>公社債の組入比率は高位（通常の状態では90%以上）を基本とします。</p> <p>（ファンドにおいてわが国を除く世界主要国の公社債とは、国債、政府保証債、政府機関債、国際機関債（複数国が協調して設立した国際的な組織が発行する債券）、社債等を指します。）</p>
主要運用対象	わが国を除く世界主要国の公社債（国債、政府保証債、政府機関債、国際機関債、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		FTSE世界国債インデックス (除く日本・円ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
18期(2017年12月15日)	29,913	4.6	462.75	5.4	97.5	—	44,779
19期(2018年12月17日)	29,150	△2.6	453.56	△2.0	96.4	—	45,158
20期(2019年12月16日)	30,690	5.3	472.22	4.1	95.6	—	44,475
21期(2020年12月15日)	32,650	6.4	497.78	5.4	95.5	—	46,828
22期(2021年12月15日)	33,655	3.1	515.51	3.6	96.0	—	48,104

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、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		FTSE世界国債インデックス (除く日本・円ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率			
(期 首) 2020年12月15日	円 32,650	% —	497.78	% —	% 95.5	—	% —
12月末	32,598	△0.2	497.33	△0.1	95.3	—	—
2021年1月末	32,543	△0.3	496.21	△0.3	94.3	—	—
2月末	32,203	△1.4	494.15	△0.7	95.1	—	—
3月末	32,926	0.8	501.12	0.7	94.6	—	—
4月末	32,894	0.7	502.93	1.0	94.4	—	—
5月末	33,316	2.0	510.44	2.5	96.2	—	—
6月末	33,182	1.6	508.66	2.2	96.3	—	—
7月末	33,326	2.1	513.08	3.1	96.5	—	—
8月末	33,338	2.1	512.29	2.9	97.3	—	—
9月末	33,154	1.5	508.95	2.2	96.3	—	—
10月末	33,863	3.7	518.32	4.1	97.8	—	—
11月末	33,492	2.6	512.77	3.0	95.9	—	—
(期 末) 2021年12月15日	33,655	3.1	515.51	3.6	96.0	—	—

(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

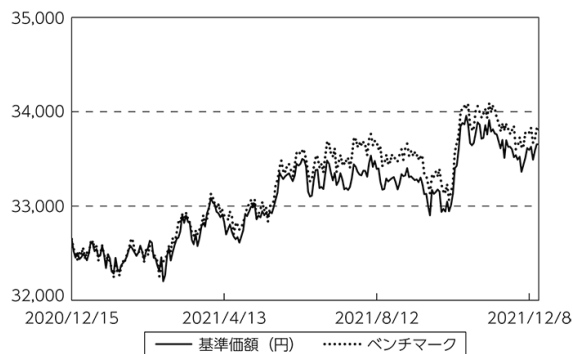
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ3.1%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(3.6%)を0.5%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマーク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**(上昇要因)**

米ドルが対円で上昇したことや債券利子収入を享受したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

米国長期金利が上昇したことなどが基準価額の下落要因となりました。

● 投資環境について**◎ 海外債券市況**

- ・米独長期金利は上昇しました。
- ・米独長期金利は、新型コロナウイルスワクチンの接種進展による景気回復期待の高まりや、世界的なインフレ観測の高まりなどを受けて、緩和的な金融政策の早期縮小を織り込む動きが強まったことなどから、2021年5月にかけて上昇しました。8月にかけては、新型コロナウイルスのデルタ変異株の感染拡大などを受けて景気の先行き不透明感が高まったことなどから米独長期金利は低下しましたが、その後、主要国において早期利上げ期待が高まったことなどから米独長期金利は上昇しました。結果、期を通じてみると、米独長期金利は上昇しました。

◎ 為替市況

- ・米ドル、ユーロは対円で上昇しました。
- ・米ドルは、早期利上げ期待の高まりなどを背景に米国長期金利が上昇したことなどから対円で上昇しました。ユーロは、景気回復期待の高まりなどから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

- ・中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ・わが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークを中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。
- ・債券デュレーション（平均回収期間や金利感応度）は、金融政策の織り込み具合等を注視しコントロールしました。米国の債券デュレーションは期首から2021年1月上旬にかけてベンチマーク比長めとし、その後は同中立から短めでコントロールしました。欧州の債券デュレーションは期首から5月中旬にかけて同中立から長めでコントロールし、5月下旬から6月中旬にかけては同短め、その後は同長めとしました。
- ・欧州においては、緩和的な欧州中央銀行（ECB）の金融政策などを背景に国別配分をコントロールしました。期を通じてイタリア・スペインをベンチマーク比オーバーウェイトで維持した一方、ドイツ・フランスを同アンダーウェイトで維持しました。
- ・カントリーアロケーション戦略（通貨配分）では、景気の相対感等に着目し通貨配分をコントロールしました。米ドルは期首から7月中旬にかけてベンチマーク比中立からアンダーウェイトでコントロールし、その後は同オーバーウェイトとしました。ユーロは期を通じて同中立からアンダーウェイトでコントロールしました。豪ドルは期首から7月中旬にかけて同オーバーウェイト、7月下旬から9月にかけては同アンダーウェイト、その後は同中立からオーバーウェイトでコントロールしました。英ポンド、カナダドル、シンガポールドル、ノルウェークローネ、メキシコペソ、ポーランドズロチは期を通じて同中立からオーバーウェイトでコントロールしました。中国元は11月に組入を開始し、同中立からオーバーウェイトでコントロールしました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
(マイナス要因)

- ・2021年6月から7月中旬にかけて豪ドル、ポーランドズロチをベンチマーク比オーバーウェイトとしていたことなどがマイナス要因となりました。

○今後の運用方針

- ・金利戦略においては、各国の景気動向に加え、財政政策・金融政策を含む各種政策や市場の内部要因が長期金利へ与える影響を考慮し、デュレーションなどのコントロールを行います。その中で、欧州では各国の財政状況や政策対応などを重視した銘柄選別に注力します。また、カントリーアロケーション戦略においては、各国のファンダメンタルズ状況や投資家のリスク選好度を重視し、環境見通しの変化に対応して調整を行う方針です。債券の組入比率は高位を維持し、信用力の高い国債中心の組み入れを維持する方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年12月16日～2021年12月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 7	% 0.022	(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 ）	(7)	(0.022)	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	7	0.022	
期中の平均基準価額は、33,072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12月16日～2021年12月15日)

公社債

		買付額	売付額		
外	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 160,132	千アメリカドル 101,045	
		特殊債券	—	—	
				(5,000)	
	カナダ	国債証券	千カナダドル 18,996	千カナダドル 17,927	
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 147,175	千メキシコペソ 237,793	
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券	8,945	8,489	
	イタリア	国債証券	34,822	39,573	
	フランス	国債証券	17,158	31,035	
		社債券	—	—	
				(5,000)	
	オランダ	国債証券	3,266	3,056	
	スペイン	国債証券	6,200	19,057	
	ベルギー	国債証券	3,521	4,397	
	アイルランド	国債証券	404	—	
	国	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 9,087	千イギリスポンド 9,693
		スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローネ 2,937	千スウェーデンクローネ 8,455
		ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 171,418	千ノルウェークローネ 185,326
ポーランド		国債証券	千ポーランドズロチ 56,974	千ポーランドズロチ 53,785	
オーストラリア		国債証券	千オーストラリアドル 28,254	千オーストラリアドル 32,199	
		特殊債券	—	3,775	
シンガポール		国債証券	千シンガポールドル —	千シンガポールドル 11,200	
マレーシア		国債証券	千マレーシアリングット —	千マレーシアリングット 1,528	
中国		国債証券	千中国元 110,252	千中国元 —	
イスラエル		国債証券	千イスラエルシェケル —	千イスラエルシェケル 507	

(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

(2020年12月16日～2021年12月15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 26,601	百万円 5,707	% 21.5	百万円 26,476	百万円 6,430	% 24.3

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

(2021年12月15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 190,700	千アメリカドル 199,633	千円 22,718,305	% 47.2	% —	% 15.0	% 12.8	% 19.4
カナダ	千カナダドル 10,700	千カナダドル 11,075	980,665	2.0	—	1.3	0.1	0.7
メキシコ	千メキシコペソ 175,000	千メキシコペソ 180,413	967,682	2.0	—	1.7	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	3,800	6,501	833,629	1.7	—	1.7	—	—
イタリア	41,300	45,386	5,819,852	12.1	—	6.4	5.7	—
フランス	10,800	11,836	1,517,737	3.2	—	3.2	—	—
オランダ	7,300	7,553	968,622	2.0	—	2.0	—	—
スペイン	19,900	22,730	2,914,737	6.1	—	4.7	1.3	—
ベルギー	6,900	7,439	954,021	2.0	—	2.0	—	—
アイルランド	2,900	3,072	393,953	0.8	—	0.8	—	—
イギリス	千イギリスポンド 15,200	千イギリスポンド 19,983	3,009,313	6.3	—	6.1	—	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 14,000	千スウェーデンクローネ 14,542	181,048	0.4	—	0.2	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 12,000	千ノルウェークローネ 12,070	150,885	0.3	—	0.0	0.3	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 10,700	千ポーランドズロチ 10,508	290,958	0.6	—	0.2	0.4	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 24,500	千オーストラリアドル 22,727	1,839,097	3.8	—	3.5	0.4	—
シンガポール	千シンガポールドル 2,100	千シンガポールドル 2,249	186,927	0.4	—	0.1	0.3	—
マレーシア	千マレーシアリンギット 11,100	千マレーシアリンギット 11,543	310,116	0.6	—	0.4	0.2	0.1
中国	千中国元 110,000	千中国元 110,479	1,974,477	4.1	—	2.0	1.4	0.7
イスラエル	千イスラエルシェケル 5,000	千イスラエルシェケル 5,052	183,288	0.4	—	0.3	—	0.1
合 計	—	—	46,195,322	96.0	—	51.6	23.2	21.3

(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				償還年月日
			利 率	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	
国債証券	0.125 T-NOTE 230915	0.125	6,000	5,949	677,065	2023/9/15	
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	8,000	7,811	888,991	2031/2/15	
	1.25 T-BOND 500515	1.25	500	434	49,396	2050/5/15	
	1.375 T-BOND 500815	1.375	1,000	895	101,913	2050/8/15	
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	19,000	19,336	2,200,545	2026/2/15	
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	31,000	31,548	3,590,225	2023/5/15	
	1.875 T-BOND 510215	1.875	5,500	5,556	632,305	2051/2/15	
	2 T-BOND 500215	2.0	500	518	59,011	2050/2/15	
	2 T-NOTE 221031	2.0	40,000	40,610	4,621,524	2022/10/31	
	2 T-NOTE 250815	2.0	19,000	19,608	2,231,457	2025/8/15	
	2.25 T-NOTE 271115	2.25	12,000	12,630	1,437,400	2027/11/15	
	2.75 T-NOTE 240215	2.75	13,500	14,090	1,603,453	2024/2/15	
	2.875 T-BOND 490515	2.875	200	245	27,945	2049/5/15	
	3.125 T-BOND 430215	3.125	7,500	9,156	1,042,003	2043/2/15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	3,000	3,694	420,428	2044/8/15	
3.875 T-BOND 400815	3.875	4,000	5,346	608,438	2040/8/15		
4.75 T-BOND 410215	4.75	5,000	7,445	847,254	2041/2/15		
特殊債券	0.875 IBRD 300514	0.875	10,000	9,524	1,083,942	2030/5/14	
普通社債券	3.875 COOPERATIEV 220208	3.875	4,000	4,020	457,519	2022/2/8	
	7 IBM CORP 251030	7.0	1,000	1,208	137,482	2025/10/30	
小 計					22,718,305		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 230201	0.25	3,700	3,679	325,805	2023/2/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	400	404	35,830	2026/6/1	
	2 CAN GOVT 280601	2.0	700	730	64,716	2028/6/1	
	2 CAN GOVT 511201	2.0	1,900	1,992	176,414	2051/12/1	
	2.25 CAN GOVT 290601	2.25	4,000	4,268	377,898	2029/6/1	
小 計					980,665		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	15,000	16,175	86,760	2024/12/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	10,000	10,010	53,693	2022/6/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	40,000	40,506	217,265	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	90,000	92,376	495,481	2031/5/29	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	20,000	21,343	114,481	2038/11/18	
小 計					967,682		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	1.25 BUND 480815	1.25	1,600	2,190	280,944	2048/8/15
		4.75 BUND 400704	4.75	2,200	4,310	552,684	2040/7/4
イタリア	国債証券	0 ITALY GOVT 260401	—	10,000	9,949	1,275,874	2026/4/1
		0.25 ITALY GOVT 280315	0.25	1,500	1,483	190,217	2028/3/15
		0.95 ITALY GOVT 300801	0.95	1,000	1,016	130,358	2030/8/1
		1.7 ITALY GOVT 510901	1.7	3,000	2,970	380,846	2051/9/1
		1.75 ITALY GOVT 240701	1.75	9,900	10,393	1,332,812	2024/7/1
		1.85 ITALY GOVT 240515	1.85	1,000	1,050	134,752	2024/5/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	2.45 ITALY GOVT 330901	2.45	2,000	2,305	295,674	2033/9/1
		2.45 ITALY GOVT 500901	2.45	7,600	8,803	1,128,892	2050/9/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	3,300	4,234	542,991	2028/9/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	2,000	3,177	407,433	2040/9/1
フランス	国債証券	0.75 O. A. T 520525	0.75	4,800	4,960	636,148	2052/5/25
		1.25 O. A. T 360525	1.25	6,000	6,875	881,589	2036/5/25
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 310715	—	3,000	3,067	393,386	2031/7/15
		0 NETH GOVT 520115	—	300	295	37,862	2052/1/15
		0.25 NETH GOVT 290715	0.25	4,000	4,190	537,374	2029/7/15
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 300430	0.5	4,500	4,638	594,755	2030/4/30
		1 SPAIN GOVT 501031	1.0	4,000	3,921	502,876	2050/10/31
		1.95 SPAIN GOVT 260430	1.95	1,000	1,098	140,899	2026/4/30
		2.35 SPAIN GOVT 330730	2.35	7,000	8,514	1,091,812	2033/7/30
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	400	691	88,695	2040/7/30
		5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	3,000	3,865	495,698	2026/7/30
ベルギー	国債証券	0 BEL GOVT 311022	—	3,000	3,008	385,782	2031/10/22
		0.9 BEL GOVT 290622	0.9	2,800	3,050	391,190	2029/6/22
		1.6 BEL GOVT 470622	1.6	700	868	111,430	2047/6/22
		1.7 BEL GOVT 500622	1.7	400	511	65,617	2050/6/22
アイルランド	国債証券	0.2 IRISH GOVT 301018	0.2	1,000	1,023	131,255	2030/10/18
		0.4 IRISH GOVT 350515	0.4	400	407	52,218	2035/5/15
		1.1 IRISH GOVT 290515	1.1	1,500	1,641	210,479	2029/5/15
小 計						13,402,555	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
	国債証券	0.125 GILT 230131	0.125	500	499	75,207	2023/1/31
		1.25 GILT 411022	1.25	4,800	5,056	761,480	2041/10/22
		1.75 GILT 490122	1.75	1,500	1,804	271,684	2049/1/22
		4.25 GILT 551207	4.25	1,900	3,815	574,601	2055/12/7
		4.75 GILT 301207	4.75	4,500	6,110	920,157	2030/12/7
		6 EIB 281207	6.0	2,000	2,697	406,181	2028/12/7
小 計						3,009,313	
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		
	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	0.125	3,000	2,997	37,317	2031/5/12
		0.75 SWD GOVT 280512	0.75	5,000	5,238	65,213	2028/5/12
		1 SWD GOVT 261112	1.0	6,000	6,306	78,517	2026/11/12
小 計						181,048	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	1.375	1,000	994	12,428	2030/8/19
		1.5 NORWE GOVT 260219	1.5	11,000	11,076	138,457	2026/2/19
小 計						150,885	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	2.5 POLAND 240425	2.5	7,200	7,127	197,353	2024/4/25
		2.75 POLAND 291025	2.75	3,500	3,380	93,605	2029/10/25
小 計						290,958	

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		
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	千円		
	国債証券	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	1,200	1,158	93,715	2026/9/21
		1.75 AUST GOVT 510621	1.75	18,800	16,786	1,358,358	2051/6/21
	特殊債券	1.7 EIB 241115	1.7	1,000	1,014	82,059	2024/11/15
		3.2 INTL FINAN 271018	3.2	3,500	3,768	304,963	2027/10/18
小	計					1,839,097	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	2.375 SINGAPOGOV 250601	2.375	1,500	1,564	129,994	2025/6/1
		2.75 SINGAPOGOV 460301	2.75	600	685	56,933	2046/3/1
小	計					186,927	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.882 MALAYSIAGOV 220310	3.882	1,500	1,506	40,480	2022/3/10
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3.885	4,000	4,091	109,929	2029/8/15
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	3.9	3,000	3,101	83,313	2026/11/30
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	2,600	2,843	76,392	2043/9/30
小	計					310,116	
中国				千中国元	千中国元		
	国債証券	2.56 CHINA GOVT 231021	2.56	20,000	20,032	358,022	2023/10/21
		2.69 CHINA GOVT 260812	2.69	37,000	37,003	661,316	2026/8/12
		2.91 CHINA GOVT 281014	2.91	20,000	20,044	358,238	2028/10/14
		3.02 CHINA GOVT 310527	3.02	33,000	33,398	596,900	2031/5/27
小	計					1,974,477	
イスラエル				千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
	国債証券	0.75 ISRAEL FIXED 220731	0.75	1,000	1,007	36,554	2022/7/31
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1.0	4,000	4,044	146,733	2030/3/31
小	計					183,288	
合	計					46,195,322	

(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12月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	46,195,322	95.8
コール・ローン等、その他	2,035,558	4.2
投資信託財産総額	48,230,880	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (48,050,658千円) の投資信託財産総額 (48,230,880千円) に対する比率は99.6%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=113.80円	1 カナダドル=88.54円	1 メキシコペソ=5.3637円	1 ユーロ=128.23円
1 イギリスポンド=150.59円	1 スウェーデンクローネ=12.45円	1 ノルウェークローネ=12.50円	1 ボーランドズロチ=27.6885円
1 オーストラリアドル=80.92円	1 シンガポールドル=83.09円	1 マレーシアリンギット=26.8658円	1 中国元=17.8719円
1 イスラエルシェケル=36.2789円			

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	49,140,552,506
コール・ローン等	1,203,688,692
公社債(評価額)	46,195,322,835
未収入金	1,520,372,836
未収利息	194,035,171
前払費用	27,132,972
(B) 負債	1,036,373,442
未払金	909,960,958
未払解約金	126,412,392
未払利息	92
(C) 純資産総額(A-B)	48,104,179,064
元本	14,293,258,082
次期繰越損益金	33,810,920,982
(D) 受益権総口数	14,293,258,082口
1万口当たり基準価額(C/D)	33,655円

<注記事項>

- ①期首元本額 14,342,494,401円
期中追加設定元本額 1,440,394,320円
期中一部解約元本額 1,489,630,639円
また、1口当たり純資産額は、期末33,655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)

三菱UFJ 海外債券オープン	4,407,904,948円
三菱UFJ 海外債券オープン(3ヵ月決算型)	3,591,685,232円
三菱UFJ バランスインカムオープン(毎月決算型)	3,360,686,872円
三菱UFJ 国際 海外債券オープン(適格機関投資家限定)	1,826,520,234円
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	580,848,266円
三菱UFJ 世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	158,435,812円
三菱UFJ ライフプラン50	59,012,764円
三菱UFJ 海外債券オープンVA(適格機関投資家限定)	56,752,042円
三菱UFJ 世界バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	42,546,298円
三菱UFJ ライフプラン25	27,213,588円
三菱UFJ グローバルバランス(積極型)	23,077,222円
三菱UFJ ライフプラン50VA(適格機関投資家限定)	19,188,450円
三菱UFJ ライフプラン75	16,556,503円
三菱UFJ グローバルバランス(安定型)	16,125,206円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス60型	14,845,827円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	13,398,089円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーフンド2030	11,240,568円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス40型	11,009,369円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーフンド2040	10,835,450円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	8,137,035円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	7,134,822円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	6,599,819円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス20型	5,987,550円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	4,844,087円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	3,917,855円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	2,979,349円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	2,593,632円
三菱UFJ グローバルバランスVA	1,145,334円
三菱UFJ ターゲット・イヤーフンド2030	1,080,877円
三菱UFJ ターゲット・イヤーフンド2040	954,982円
合計	14,293,258,082円

○損益の状況 (2020年12月16日~2021年12月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	904,453,216
受取利息	906,146,510
支払利息	△ 1,693,294
(B) 有価証券売買損益	563,185,948
売買益	3,049,947,179
売買損	△ 2,486,761,231
(C) 保管費用等	△ 10,602,324
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,457,036,840
(E) 前期繰越損益金	32,485,982,060
(F) 追加信託差損益金	3,298,679,238
(G) 解約差損益金	△ 3,430,777,156
(H) 計(D+E+F+G)	33,810,920,982
次期繰越損益金(H)	33,810,920,982

- (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】

「FTSE世界国債インデックス」について、2021年10月末より中国国債の組み入れに伴い、当該指数を参照等する当ファンドにおいて、新たに中国国債の組み入れを適宜開始します。