

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 | 無期限（2003年7月9日設定） | |
| 運用方針 | 主として、三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界主要国の債券に投資し、信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | 三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、世界主要国の債券に直接投資することがあります。 |
| | マザーファンド | 世界主要国の債券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に制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎月20日に決算（ただし、20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 グローバル・ボンド・オープン （毎月決算型）

愛称：花こよみ



第166期（決算日：2017年5月22日）
 第167期（決算日：2017年6月20日）
 第168期（決算日：2017年7月20日）
 第169期（決算日：2017年8月21日）
 第170期（決算日：2017年9月20日）
 第171期（決算日：2017年10月20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 グローバル・ボンド・オープン（毎月決算型）」は、去る10月20日に第171期の決算を行いましたので、法令に基づいて第166期～第171期の運用状況をまとめて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

お客様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)
 お客様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。

○最近30期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 (分配落) | 価 額 | | | (参 考 指 数) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|--------------|---------|-----------|-----------|--|-----------|-----------|----------------|---------|
| | | 税 分 | 込 配 金 | 期 騰 落 中 率 | シ ティ 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス (除 く 日 本 ・ 円 ベ ー ス) | 期 騰 落 中 率 | | | |
| 142期(2015年5月20日) | 円 8,203 | 円 65 | % △1.2 | 466.37 | % 0.5 | 98.3 | % - | 百万円 263,574 | |
| 143期(2015年6月22日) | 8,049 | 65 | △1.1 | 474.43 | 1.7 | 98.3 | - | 261,673 | |
| 144期(2015年7月21日) | 7,723 | 65 | △3.2 | 471.60 | △0.6 | 98.4 | - | 251,623 | |
| 145期(2015年8月20日) | 7,681 | 65 | 0.3 | 480.10 | 1.8 | 97.9 | - | 247,067 | |
| 146期(2015年9月24日) | 7,071 | 65 | △7.1 | 465.79 | △3.0 | 97.7 | - | 223,930 | |
| 147期(2015年10月20日) | 7,347 | 65 | 4.8 | 468.67 | 0.6 | 97.2 | - | 229,907 | |
| 148期(2015年11月20日) | 7,251 | 65 | △0.4 | 469.17 | 0.1 | 98.3 | - | 222,281 | |
| 149期(2015年12月21日) | 7,175 | 65 | △0.2 | 464.97 | △0.9 | 96.1 | - | 217,191 | |
| 150期(2016年1月20日) | 6,676 | 65 | △6.0 | 451.34 | △2.9 | 97.7 | - | 200,944 | |
| 151期(2016年2月22日) | 6,671 | 65 | 0.9 | 443.76 | △1.7 | 98.0 | - | 199,614 | |
| 152期(2016年3月22日) | 6,845 | 65 | 3.6 | 443.62 | △0.0 | 96.8 | - | 207,066 | |
| 153期(2016年4月20日) | 6,838 | 65 | 0.8 | 439.03 | △1.0 | 97.1 | - | 209,848 | |
| 154期(2016年5月20日) | 6,487 | 65 | △4.2 | 436.90 | △0.5 | 97.5 | - | 201,636 | |
| 155期(2016年6月20日) | 6,398 | 65 | △0.4 | 420.92 | △3.7 | 98.0 | - | 202,398 | |
| 156期(2016年7月20日) | 6,495 | 65 | 2.5 | 428.44 | 1.8 | 98.0 | - | 207,283 | |
| 157期(2016年8月22日) | 6,240 | 65 | △2.9 | 410.72 | △4.1 | 97.8 | - | 199,328 | |
| 158期(2016年9月20日) | 6,149 | 65 | △0.4 | 410.73 | 0.0 | 98.2 | - | 197,255 | |
| 159期(2016年10月20日) | 6,249 | 65 | 2.7 | 411.01 | 0.1 | 97.7 | - | 202,024 | |
| 160期(2016年11月21日) | 6,195 | 65 | 0.2 | 419.70 | 2.1 | 97.5 | - | 201,326 | |
| 161期(2016年12月20日) | 6,357 | 45 | 3.3 | 441.04 | 5.1 | 96.6 | - | 204,770 | |
| 162期(2017年1月20日) | 6,499 | 45 | 2.9 | 437.82 | △0.7 | 97.5 | - | 206,777 | |
| 163期(2017年2月20日) | 6,385 | 45 | △1.1 | 429.90 | △1.8 | 97.1 | - | 197,157 | |
| 164期(2017年3月21日) | 6,340 | 45 | 0.0 | 430.06 | 0.0 | 97.0 | - | 189,685 | |
| 165期(2017年4月20日) | 6,093 | 45 | △3.2 | 422.92 | △1.7 | 97.4 | - | 178,601 | |
| 166期(2017年5月22日) | 6,136 | 45 | 1.4 | 441.33 | 4.4 | 98.0 | - | 177,085 | |
| 167期(2017年6月20日) | 6,296 | 45 | 3.3 | 442.81 | 0.3 | 97.2 | - | 178,177 | |
| 168期(2017年7月20日) | 6,433 | 45 | 2.9 | 449.26 | 1.5 | 97.2 | - | 174,767 | |
| 169期(2017年8月21日) | 6,258 | 45 | △2.0 | 444.02 | △1.2 | 96.9 | - | 162,139 | |
| 170期(2017年9月20日) | 6,329 | 45 | 1.9 | 459.12 | 3.4 | 97.6 | - | 161,173 | |
| 171期(2017年10月20日) | 6,225 | 45 | △0.9 | 460.55 | 0.3 | 97.9 | - | 155,370 | |

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本・円ベース）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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。

(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。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基準 価 額 | | (参 考 指 数) | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|-------|-----------------------|------------|--------|----------------------------------|--------|-------------|-------------|
| | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | シテイ世界国債 インデックス (除く日本・円ベース) | 騰 落 率 | | |
| 第166期 | (期 首) 2017年 4 月20日 | 円 6,093 | % — | 422.92 | % — | % 97.4 | % — |
| | 4 月末 | 6,116 | 0.4 | 432.74 | 2.3 | 97.5 | — |
| | (期 末) 2017年 5 月22日 | 6,181 | 1.4 | 441.33 | 4.4 | 98.0 | — |
| 第167期 | (期 首) 2017年 5 月22日 | 6,136 | — | 441.33 | — | 98.0 | — |
| | 5 月末 | 6,193 | 0.9 | 439.83 | △0.3 | 97.8 | — |
| | (期 末) 2017年 6 月20日 | 6,341 | 3.3 | 442.81 | 0.3 | 97.2 | — |
| 第168期 | (期 首) 2017年 6 月20日 | 6,296 | — | 442.81 | — | 97.2 | — |
| | 6 月末 | 6,361 | 1.0 | 450.15 | 1.7 | 98.0 | — |
| | (期 末) 2017年 7 月20日 | 6,478 | 2.9 | 449.26 | 1.5 | 97.2 | — |
| 第169期 | (期 首) 2017年 7 月20日 | 6,433 | — | 449.26 | — | 97.2 | — |
| | 7 月末 | 6,405 | △0.4 | 450.10 | 0.2 | 97.2 | — |
| | (期 末) 2017年 8 月21日 | 6,303 | △2.0 | 444.02 | △1.2 | 96.9 | — |
| 第170期 | (期 首) 2017年 8 月21日 | 6,258 | — | 444.02 | — | 96.9 | — |
| | 8 月末 | 6,270 | 0.2 | 453.51 | 2.1 | 97.0 | — |
| | (期 末) 2017年 9 月20日 | 6,374 | 1.9 | 459.12 | 3.4 | 97.6 | — |
| 第171期 | (期 首) 2017年 9 月20日 | 6,329 | — | 459.12 | — | 97.6 | — |
| | 9 月末 | 6,280 | △0.8 | 459.05 | △0.0 | 96.4 | — |
| | (期 末) 2017年10月20日 | 6,270 | △0.9 | 460.55 | 0.3 | 97.9 | — |

(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。

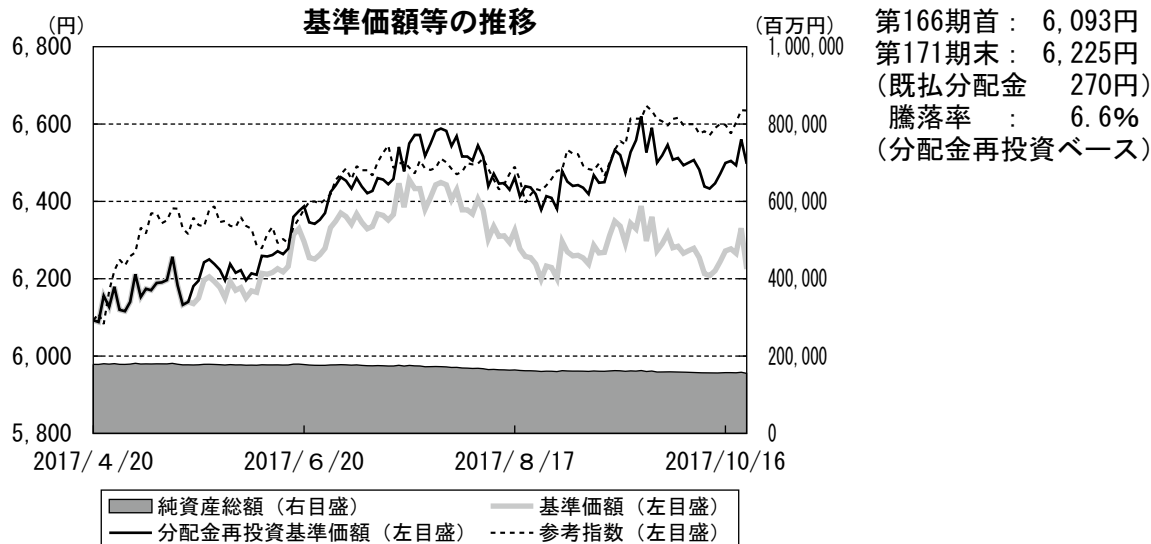
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について（第166期～第171期：2017/4/21～2017/10/20）

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ6.6%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。



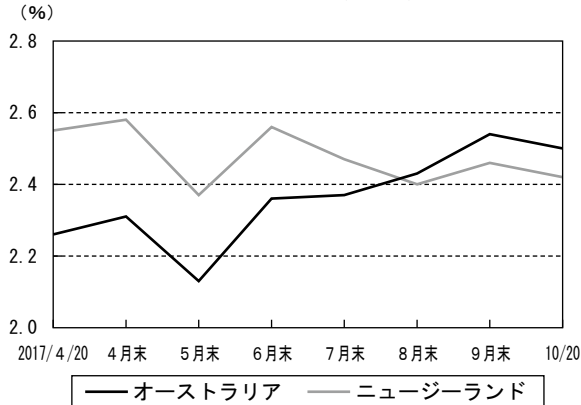
- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

| | |
|------|--|
| 上昇要因 | 豪ドルとニュージーランドドルが対円で上昇したことや債券の利子収益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 | オーストラリア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
金利の推移（月次）

（第166期～第171期：2017/4/21～2017/10/20）

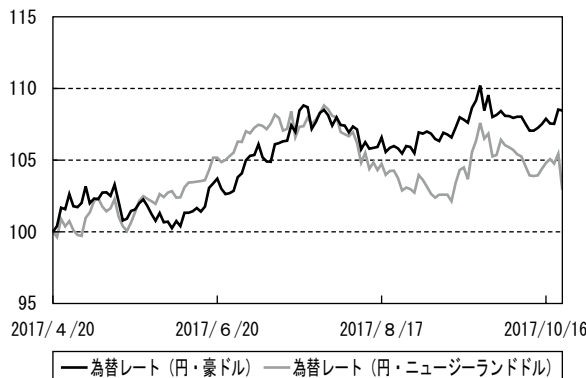


（注）シティ世界国債インデックスにおける各国の最終利回り。

◎債券市況

・オーストラリア金利は上昇した一方、ニュージーランド金利は短中期ゾーンを中心に低下しました。豪州連邦準備銀行（RBA）とニュージーランド準備銀行（RBNZ）が金融政策を据え置く中、欧米でのインフレ期待の低下などを背景に、オーストラリアやニュージーランドの金利も2017年6月上旬にかけて低下基調で推移しました。その後、世界的な超金融緩和策が解除されるとの見方からグローバルに金利は上昇し、両国の金利も7月上旬にかけて上昇したものの、ニュージーランドでは4～6月期の消費者物価指数（CPI）などが市場予想比下振れたことなどから、9月上旬にかけてニュージーランド金利は再び低下しました。作成期末にかけては、9月下旬の米連邦公開市場委員会（FOMC）で緩やかな利上げ方針が維持されたことなどが両国の金利の上昇要因となった結果、作成期を通じてみると、オーストラリア金利は上昇した一方、ニュージーランド金利は短中期ゾーンを中心に低下して終わりました。

為替市況の推移
（当作成期首を100として指数化）



◎為替市況

・2017年8月から9月上旬にかけて北朝鮮情勢への懸念の高まりなどから、豪ドルとニュージーランドドルが対円で下落する局面があったものの、グローバルな景気回復を背景とした投資家センチメントの改善などから、豪ドルとニュージーランドドルは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 グローバル・ボンド・オープン（毎月決算型）＞

- ・三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界の主要国のうち、信用力が高く、かつ、相対的に利回りが高いと判断した国の債券を高位に組み入れた運用を行いました。作成期を通じて、オーストラリア、ニュージーランドの2カ国で運用しました。

＜三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド＞

基準価額は当作成期首に比べ7.3%の上昇となりました。

（投資国）

- ・作成期を通じてオーストラリア、ニュージーランドの2カ国で運用しました。

（通貨）

- ・相対的に利回りが高いと判断した投資対象国（オーストラリア、ニュージーランド）の中で、債券市場の流動性などを考慮し、作成期を通じてオーストラリアへ重点配分しました。

（金利）

- ・残存期間毎に最終利回りが相対的に高い銘柄を中心に、流動性を考慮して銘柄選択を行い投資しました。

（組入比率）

- ・作成期を通じて、債券の組入比率は高位を維持しました。
- ・前記の運用の結果、オーストラリア金利が上昇したものの、豪ドルとニュージーランドドルが対円で上昇したことや債券の利子収益を享受したことなどから、基準価額は上昇しました。

（ご参考）

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

作成期首（2017年4月20日）

作成期末（2017年10月20日）

| | | | | |
|---------|------|---|---------|------|
| 最終利回り | 2.5% | → | 最終利回り | 2.6% |
| 直接利回り | 3.9% | | 直接利回り | 3.9% |
| デュレーション | 5.9年 | | デュレーション | 5.8年 |

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

（ご参考）

債券の格付分布

作成期首（2017年4月20日）

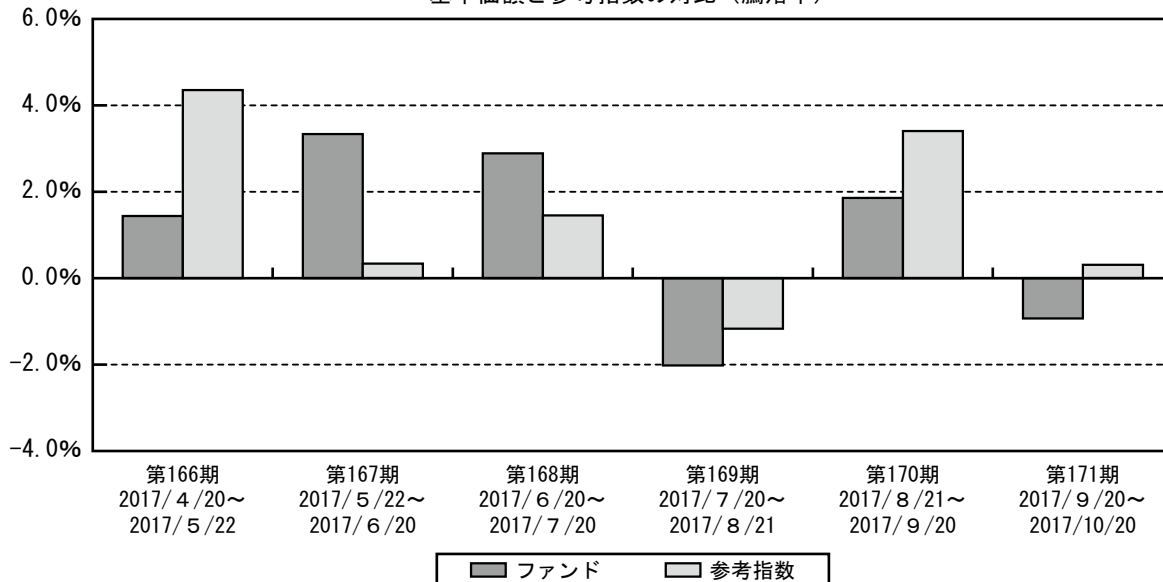
作成期末（2017年10月20日）

| 格付種類 | 比率 | 銘柄数 | → | 格付種類 | 比率 | 銘柄数 |
|-------|-------|-----|---|-------|-------|-----|
| AAA格 | 95.7% | 78 | | AAA格 | 92.6% | 77 |
| AA格 | 1.9% | 3 | | AA格 | 5.6% | 6 |
| A格 | 0.0% | 0 | | A格 | 0.0% | 0 |
| BBB格 | 0.0% | 0 | | BBB格 | 0.0% | 0 |
| BB格以下 | 0.0% | 0 | | BB格以下 | 0.0% | 0 |
| 無格付 | 0.0% | 0 | | 無格付 | 0.0% | 0 |

- ・比率は純資産総額に対する割合です。
- ・格付の振分基準は、以下の通りです。
 - ・AAA格（AA+、AA、AA-、Aa1、Aa2、Aa3）
 - ・A格（A+、A、A-、A1、A2、A3）
 - ・BBB格（BBB+、BBB、BBB-、Baa1、Baa2、Baa3）
 - ・BB格（BB+、BB、BB-、Ba1、Ba2、Ba3）
- ・原則として、個別銘柄格付を採用しておりますが、例外的に国債、地方債ならびに政府保証のある債券などについては、弊社の分類基準に基づいて、ソブリン格付（国の発行体格付）を採用しているものがあります。
- ・格付分布はR&I社、JCR社、S&P社、Moody's社のうち最も高い格付を表示しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について（第166期～第171期：2017/4/21～2017/10/20）

基準価額と参考指数の対比（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。

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。上記のグラフは当ファンド（ベビーファンド）の基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
- ・参考指数はシティ世界国債インデックス（除く日本・円ベース）です。

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166期 | 第167期 | 第168期 | 第169期 | 第170期 | 第171期 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|
| | 2017年4月21日～ 2017年5月22日 | 2017年5月23日～ 2017年6月20日 | 2017年6月21日～ 2017年7月20日 | 2017年7月21日～ 2017年8月21日 | 2017年8月22日～ 2017年9月20日 | 2017年9月21日～ 2017年10月20日 |
| 当期分配金 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 |
| （対基準価額比率） | 0.728% | 0.710% | 0.695% | 0.714% | 0.706% | 0.718% |
| 当期の収益 | 19 | 18 | 19 | 14 | 18 | 13 |
| 当期の収益以外 | 26 | 26 | 25 | 30 | 27 | 31 |
| 翌期繰越分配対象額 | 609 | 583 | 558 | 527 | 501 | 470 |

（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

<三菱UFJ グローバル・ボンド・オープン（毎月決算型）>

◎今後の運用方針

- ・三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持する方針です。

<三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・オーストラリア金利、ニュージーランド金利はもみ合う展開を想定します。オーストラリアでは、世界的な景気回復を受けた輸出の好調などを背景に景気の下振れリスクは後退しているものの、家計の債務比率が高水準にある中、RBAは当面金融政策を据え置き、景気動向・資産価格動向などを慎重に見極めていくものと考えます。ニュージーランドでは国内経済は堅調に推移しているものの、RBNZはインフレ率がインフレ目標に向かって緩やかに上昇していくか見極めるため、引き続き現状の緩和的な金融政策を維持するものと考えます。
- ・オーストラリア、ニュージーランドではRBAとRBNZが当面現状の金融政策を維持すると考えられますが、両国の経済が堅調なことに加え、FOMCが今後の政策金利引き上げを含む金融正常化を慎重に進める方針を示唆していることなどから、豪ドルとニュージーランドドルは対円で安定した推移になると考えます。

◎今後の運用方針

（投資国）

- ・世界の主要国のうち、信用力が高く、かつ、相対的に利回りが高い国の債券に投資する方針です。

（通貨）

- ・相対的に利回りが高いと判断される投資対象国を複数選定し、相対的に利回りが高いと判断される国に重点配分する方針です。

（金利）

- ・ポートフォリオの構築は国別に、残存期間毎に最終利回りの高い銘柄を中心に選択する方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年4月21日～2017年10月20日)

| 項 目 | 第166期～第171期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 | % | (a) 信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率× (作成期中の日数÷年間日数) |
| (投 信 会 社) | (19) | (0.297) | 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) | (17) | (0.270) | 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) | (2) | (0.027) | 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 | 1 | 0.012 | (b) その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (1) | (0.009) | 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) | (0.002) | 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 | 38 | 0.606 | |
| 作成期中の平均基準価額は、6,270円です。 | | | |

(注) 作成期間の費用（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）を作成期間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

(2017年4月21日～2017年10月20日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第166期～第171期 | | | |
|-------------------------|--------------|---------------|------------------|------------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド | 千口 71,511 | 千円 155,262 | 千口 15,954,263 | 千円 35,807,967 |

○利害関係人との取引状況等

(2017年4月21日～2017年10月20日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ グローバル・ボンド・オープン（毎月決算型）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド>

| 区 分 | 第166期～第171期 | | | | | |
|--------|-------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 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 — | 百万円 — | % — | 百万円 41,072 | 百万円 32,498 | % 79.1 |

平均保有割合 63.8%

※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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年10月20日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第165期末 | 第171期末 | |
|-------------------------|------------------|------------------|-------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド | 千口 83,813,916 | 千口 67,931,164 | 千円 154,991,745 |

○投資信託財産の構成

(2017年10月20日現在)

| 項 目 | 第171期末 | |
|-------------------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド | 千円 154,991,745 | % 98.6 |
| コール・ローン等、その他 | 2,177,277 | 1.4 |
| 投資信託財産総額 | 157,169,022 | 100.0 |

(注) 三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産 (249,356,440千円) の投資信託財産総額 (254,409,069千円) に対する比率は98.0%です。

(注) 外貨建資産は、作成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、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | |
|--------------------|---------------------|--|
| 1 オーストラリアドル=88.76円 | 1 ニュージーランドドル=78.98円 | |
|--------------------|---------------------|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第166期末 | 第167期末 | 第168期末 | 第169期末 | 第170期末 | 第171期末 |
|----------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 2017年5月22日現在 | 2017年6月20日現在 | 2017年7月20日現在 | 2017年8月21日現在 | 2017年9月20日現在 | 2017年10月20日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 179,243,598,235 | 180,317,924,577 | 177,146,655,218 | 163,924,773,114 | 163,111,410,304 | 157,169,022,313 |
| コール・ローン等 | 928,728,312 | 767,848,838 | 769,666,954 | 638,156,275 | 673,645,055 | 582,917,739 |
| 三菱UFJグローバル・ボンド・マザーファンド(調範) | 176,665,872,856 | 177,755,181,073 | 174,349,031,400 | 161,749,637,137 | 160,800,908,251 | 154,991,745,792 |
| 未収入金 | 1,648,997,067 | 1,794,894,666 | 2,027,956,864 | 1,536,979,702 | 1,636,856,998 | 1,594,358,782 |
| (B) 負債 | 2,158,429,028 | 2,140,764,864 | 2,379,026,381 | 1,785,464,724 | 1,937,577,272 | 1,799,014,502 |
| 未払収益分配金 | 1,298,720,018 | 1,273,409,278 | 1,222,604,363 | 1,165,884,832 | 1,145,991,290 | 1,123,122,101 |
| 未払解約金 | 672,004,462 | 698,973,329 | 983,763,214 | 443,204,122 | 633,583,898 | 520,667,040 |
| 未払信託報酬 | 186,989,060 | 167,740,404 | 172,000,742 | 175,703,913 | 157,399,842 | 154,634,076 |
| 未払利息 | 1,540 | 1,399 | 1,341 | 998 | 1,272 | 874 |
| その他未払費用 | 713,948 | 640,454 | 656,721 | 670,859 | 600,970 | 590,411 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 177,085,169,207 | 178,177,159,713 | 174,767,628,837 | 162,139,308,390 | 161,173,833,032 | 155,370,007,811 |
| 元本 | 288,604,448,665 | 282,979,839,584 | 271,689,858,575 | 259,085,518,441 | 254,664,731,300 | 249,582,689,181 |
| 次期繰越損益金 | △111,519,279,458 | △104,802,679,871 | △96,922,229,738 | △96,946,210,051 | △93,490,898,268 | △94,212,681,370 |
| (D) 受益権総口数 | 288,604,448,665口 | 282,979,839,584口 | 271,689,858,575口 | 259,085,518,441口 | 254,664,731,300口 | 249,582,689,181口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 6,136円 | 6,296円 | 6,433円 | 6,258円 | 6,329円 | 6,225円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第166期 | 第167期 | 第168期 | 第169期 | 第170期 | 第171期 |
|-----------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|
| | 2017年4月21日～ 2017年5月22日 | 2017年5月23日～ 2017年6月20日 | 2017年6月21日～ 2017年7月20日 | 2017年7月21日～ 2017年8月21日 | 2017年8月22日～ 2017年9月20日 | 2017年9月21日～ 2017年10月20日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 46,643 | △ 32,842 | △ 34,383 | △ 29,041 | △ 34,566 | △ 21,170 |
| 受取利息 | — | — | 871 | 320 | 556 | 1,235 |
| 支払利息 | △ 46,643 | △ 32,842 | △ 35,254 | △ 29,361 | △ 35,122 | △ 22,405 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,712,983,024 | 5,966,034,932 | 5,078,808,876 | △ 3,168,303,019 | 3,101,774,620 | △ 1,300,414,926 |
| 売買益 | 2,773,882,447 | 6,026,911,746 | 5,165,481,181 | 70,443,941 | 3,129,860,678 | 35,242,853 |
| 売買損 | △ 60,899,423 | △ 60,876,814 | △ 86,672,305 | △ 3,238,746,960 | △ 28,086,058 | △ 1,335,657,779 |
| (C) 信託報酬等 | △ 187,703,008 | △ 168,380,858 | △ 172,657,463 | △ 176,374,772 | △ 158,000,812 | △ 155,224,487 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 2,525,233,373 | 5,797,621,232 | 4,906,117,030 | △ 3,344,706,832 | 2,943,739,242 | △ 1,455,660,583 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 27,651,589,243 | △ 24,881,001,523 | △ 18,591,272,887 | △ 13,472,723,688 | △ 16,746,329,219 | △ 13,844,557,408 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 85,094,203,570 | △ 84,445,890,302 | △ 82,014,469,518 | △ 78,962,894,699 | △ 78,542,317,001 | △ 77,789,341,278 |
| (配当等相当額) | (18,307,955,618) | (17,220,981,165) | (15,830,962,344) | (14,452,547,006) | (13,444,026,399) | (12,504,663,901) |
| (売買損益相当額) | (△103,402,159,188) | (△101,666,871,467) | (△97,845,431,862) | (△93,415,441,705) | (△91,986,343,400) | (△90,294,005,179) |
| (G) 計 (D + E + F) | △ 110,220,559,440 | △ 103,529,270,593 | △ 95,699,625,375 | △ 95,780,325,219 | △ 92,344,906,978 | △ 93,089,559,269 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,298,720,018 | △ 1,273,409,278 | △ 1,222,604,363 | △ 1,165,884,832 | △ 1,145,991,290 | △ 1,123,122,101 |
| 次期繰越損益金 (G + H) | △ 111,519,279,458 | △ 104,802,679,871 | △ 96,922,229,738 | △ 96,946,210,051 | △ 93,490,898,268 | △ 94,212,681,370 |
| 追加信託差損益金 | △ 85,844,575,136 | △ 85,181,637,885 | △ 82,693,694,164 | △ 79,740,151,254 | △ 79,229,911,775 | △ 78,563,047,615 |
| (配当等相当額) | (17,562,972,520) | (16,488,596,790) | (15,155,573,845) | (13,677,385,089) | (12,759,066,845) | (11,733,381,024) |
| (売買損益相当額) | (△103,407,547,656) | (△101,670,234,675) | (△97,849,268,009) | (△93,417,536,343) | (△91,988,978,620) | (△90,296,428,639) |
| 分配準備積立金 | 25,923,910 | 16,430,487 | 11,632,943 | 1,417,432 | 23,591,909 | 8,336,504 |
| 繰越損益金 | △ 25,700,628,232 | △ 19,637,472,473 | △ 14,240,168,517 | △ 17,207,476,229 | △ 14,284,578,402 | △ 15,657,970,259 |

(注) (B) 有価証券売買損益は各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。

<注記事項>

- ① 作成期首（前作成期末）元本額 293,148,468,753円
 作成期中追加設定元本額 18,579,615,223円
 作成期中一部解約元本額 62,145,394,795円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.6225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94,212,681,370円です。

③ 分配金の計算過程

| 項 目 | 2017年4月21日～ 2017年5月22日 | 2017年5月23日～ 2017年6月20日 | 2017年6月21日～ 2017年7月20日 | 2017年7月21日～ 2017年8月21日 | 2017年8月22日～ 2017年9月20日 | 2017年9月21日～ 2017年10月20日 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 564,574,576円 | 528,969,677円 | 539,444,494円 | 379,030,703円 | 480,608,863円 | 334,849,258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 | —円 | —円 | —円 | —円 | —円 |
| 収益調整金額 | 18,313,344,086円 | 17,224,344,373円 | 15,834,798,491円 | 14,454,641,644円 | 13,446,661,619円 | 12,507,087,361円 |
| 分配準備積立金額 | 9,697,786円 | 25,122,505円 | 15,568,166円 | 11,015,006円 | 1,379,562円 | 22,903,010円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 18,887,616,448円 | 17,778,436,555円 | 16,389,811,151円 | 14,844,687,353円 | 13,928,650,044円 | 12,864,839,629円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 654円 | 628円 | 603円 | 572円 | 546円 | 515円 |
| 1万口当たり分配金額 | 45円 | 45円 | 45円 | 45円 | 45円 | 45円 |
| 収益分配金金額 | 1,298,720,018円 | 1,273,409,278円 | 1,222,604,363円 | 1,165,884,832円 | 1,145,991,290円 | 1,123,122,101円 |

○分配金のお知らせ

| | 第166期 | 第167期 | 第168期 | 第169期 | 第170期 | 第171期 |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 45円 | 45円 | 45円 | 45円 | 45円 | 45円 |

◆分配金は各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、各決算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。

※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（<http://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年10月20日現在）

<三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド>

下記は、三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド全体(109,389,804千円)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第171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 |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル 1,844,000 | 千オーストラリアドル 1,952,804 | 千円 173,330,933 | % 69.4 | % — | % 45.5 | % 19.2 | % 4.8 |
| ニュージーランド | 千ニュージーランドドル 858,600 | 千ニュージーランドドル 907,505 | 71,674,745 | 28.7 | — | 13.3 | 12.4 | 3.0 |
| 合 計 | — | — | 245,005,678 | 98.2 | — | 58.8 | 31.5 | 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、親投資信託の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 | 額面金額 | 第171期末 | | 償還年月日 |
|---------|--------------------------|------|------------|------------|-----------|------------|
| | | | | 評価額 | | |
| | | | | 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 | 2 AUST GOVT 211221 | 2.0 | 20,000 | 19,796 | 1,757,126 | 2021/12/21 |
| | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2.25 | 30,000 | 28,492 | 2,528,970 | 2028/5/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 191021 | 2.75 | 10,000 | 10,158 | 901,639 | 2019/10/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 240421 | 2.75 | 70,000 | 70,953 | 6,297,823 | 2024/4/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 281121 | 2.75 | 30,000 | 29,772 | 2,642,602 | 2028/11/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 40,000 | 37,647 | 3,341,547 | 2035/6/21 |
| | 3 AUST GOVT 470321 | 3.0 | 40,000 | 36,098 | 3,204,129 | 2047/3/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 50,000 | 51,935 | 4,609,803 | 2029/4/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25 | 20,000 | 19,683 | 1,747,125 | 2039/6/21 |
| | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 40,000 | 42,870 | 3,805,158 | 2037/4/21 |
| | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 60,000 | 67,161 | 5,961,284 | 2026/4/21 |
| | 4.5 AUST GOVT 330421 | 4.5 | 50,000 | 58,937 | 5,231,292 | 2033/4/21 |
| | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 40,000 | 46,768 | 4,151,170 | 2027/4/21 |
| | 5.5 AUST GOVT 230421 | 5.5 | 60,000 | 69,514 | 6,170,075 | 2023/4/21 |
| | 5.75 AUST GOVT 210515 | 5.75 | 10,000 | 11,223 | 996,237 | 2021/5/15 |
| | 5.75 AUST GOVT 220715 | 5.75 | 60,000 | 69,193 | 6,141,572 | 2022/7/15 |
| 特殊債券 | 2.5 EUROPEAN INVE 200430 | 2.5 | 15,000 | 15,102 | 1,340,504 | 2020/4/30 |
| | 2.5 IADB 270414 | 2.5 | 42,000 | 39,378 | 3,495,212 | 2027/4/14 |
| | 2.6 ASIAN DEV 200116 | 2.6 | 5,000 | 5,043 | 447,645 | 2020/1/16 |
| | 2.7 INTL FINAN 210205 | 2.7 | 5,000 | 5,043 | 447,621 | 2021/2/5 |
| | 2.7 NORDIC INVEST 200204 | 2.7 | 10,000 | 10,101 | 896,642 | 2020/2/4 |
| | 2.75 INTER-AMERIC 251030 | 2.75 | 7,000 | 6,811 | 604,545 | 2025/10/30 |
| | 2.75 QUEENSLAND 270820 | 2.75 | 30,000 | 28,728 | 2,549,910 | 2027/8/20 |
| | 2.75 WEST AUST TR 221020 | 2.75 | 20,000 | 20,063 | 1,780,804 | 2022/10/20 |
| | 2.8 IBRD 210113 | 2.8 | 10,000 | 10,116 | 897,922 | 2021/1/13 |
| | 2.8 INTL FINAN 220815 | 2.8 | 7,000 | 7,043 | 625,194 | 2022/8/15 |
| | 3 ASIAN DEV 261014 | 3.0 | 20,000 | 19,639 | 1,743,244 | 2026/10/14 |
| | 3 IBRD 261019 | 3.0 | 20,000 | 19,690 | 1,747,732 | 2026/10/19 |
| | 3 NEWSWALES 270520 | 3.0 | 15,000 | 14,903 | 1,322,812 | 2027/5/20 |
| | 3 NEWSWALES 290420 | 3.0 | 20,000 | 19,494 | 1,730,287 | 2029/4/20 |
| | 3 NEWSWALES 300220 | 3.0 | 20,000 | 19,247 | 1,708,422 | 2030/2/20 |
| | 3 SOUTH AUST GOVT 270920 | 3.0 | 15,000 | 14,611 | 1,296,936 | 2027/9/20 |
| | 3 VICTORIA 281020 | 3.0 | 25,000 | 24,495 | 2,174,205 | 2028/10/20 |
| | 3 WEST AUST TREAS 261021 | 3.0 | 20,000 | 19,578 | 1,737,768 | 2026/10/21 |
| | 3.3 EIB 280203 | 3.3 | 20,000 | 19,927 | 1,768,759 | 2028/2/3 |
| | 3.4 ASIAN DEV 270910 | 3.4 | 20,000 | 20,233 | 1,795,962 | 2027/9/10 |
| | 3.5 NEWSWALES 190320 | 3.5 | 40,000 | 40,879 | 3,628,448 | 2019/3/20 |
| | 3.5 QUEENSLAND 300821 | 3.5 | 20,000 | 19,844 | 1,761,353 | 2030/8/21 |
| | 3.75 ASIAN DEVELO 250312 | 3.75 | 15,000 | 15,709 | 1,394,360 | 2025/3/12 |
| | 3.75 INTER-AME 181009 | 3.75 | 20,000 | 20,357 | 1,806,965 | 2018/10/9 |
| | 3.75 INTER-AMERIC 220725 | 3.75 | 15,000 | 15,733 | 1,396,500 | 2022/7/25 |
| | 3.75 INTL BK RECO 190123 | 3.75 | 30,000 | 30,656 | 2,721,040 | 2019/1/23 |
| | 4 AFRICAN DEVELOP 250110 | 4.0 | 20,000 | 21,187 | 1,880,565 | 2025/1/10 |
| | 4 INTL FINANCE CO 250403 | 4.0 | 35,000 | 37,189 | 3,300,920 | 2025/4/3 |

三菱UFJ グローバル・ボンド・オープン（毎月決算型）

| 銘 | 柄 | 第171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 | |
| 特殊債券 | 4 NEWSWALES 210408 | 4.0 | 50,000 | 52,836 | 4,689,781 | 2021/4/8 |
| | 4 NEWSWALES 230420 | 4.0 | 100,000 | 107,274 | 9,521,702 | 2023/4/20 |
| | 4.25 INTL BK RECO 250624 | 4.25 | 10,000 | 10,836 | 961,837 | 2025/6/24 |
| | 4.25 INTL FINANCE 230821 | 4.25 | 15,000 | 16,164 | 1,434,768 | 2023/8/21 |
| | 4.25 QUEENSLAND 230721 | 4.25 | 50,000 | 54,122 | 4,803,953 | 2023/7/21 |
| | 4.25 VICTORIA 321220 | 4.25 | 5,000 | 5,413 | 480,511 | 2032/12/20 |
| | 4.75 EUROPEAN INV 240807 | 4.75 | 10,000 | 11,054 | 981,217 | 2024/8/7 |
| | 4.75 INTER-AMERIC 240827 | 4.75 | 10,000 | 11,093 | 984,682 | 2024/8/27 |
| | 4.75 NORDIC INVES 240228 | 4.75 | 20,000 | 22,060 | 1,958,114 | 2024/2/28 |
| | 5 ASIAN DEV BANK 220309 | 5.0 | 25,000 | 27,465 | 2,437,844 | 2022/3/9 |
| | 5 NORDIC INVES BK 220419 | 5.0 | 8,000 | 8,797 | 780,904 | 2022/4/19 |
| | 5.5 VICTORIA 241217 | 5.5 | 60,000 | 70,596 | 6,266,138 | 2024/12/17 |
| | 5.5 VICTORIA 261117 | 5.5 | 25,000 | 30,018 | 2,664,446 | 2026/11/17 |
| | 5.75 INTL BK RECO 191021 | 5.75 | 70,000 | 74,967 | 6,654,082 | 2019/10/21 |
| | 6 EUROPEAN INVEST 200806 | 6.0 | 18,000 | 19,774 | 1,755,179 | 2020/8/6 |
| | 6 VICTORIA 200615 | 6.0 | 60,000 | 65,914 | 5,850,592 | 2020/6/15 |
| | 6 VICTORIA 221017 | 6.0 | 60,000 | 69,849 | 6,199,882 | 2022/10/17 |
| | 6.25 ASIAN DEV BK 200305 | 6.25 | 37,000 | 40,421 | 3,587,773 | 2020/3/5 |
| | 6.5 EUROPEAN INVE 190807 | 6.5 | 20,000 | 21,535 | 1,911,459 | 2019/8/7 |
| | 6.5 INTER-AMERICA 190820 | 6.5 | 20,000 | 21,588 | 1,916,211 | 2019/8/20 |
| 小 | 計 | | | | 173,330,933 | |
| ニュージーランド | | | 千ニュージーランドドル | 千ニュージーランドドル | | |
| 国債証券 | 2.75 NZ GOVT 250415 | 2.75 | 100,000 | 99,831 | 7,884,715 | 2025/4/15 |
| | 2.75 NZ GOVT 370415 | 2.75 | 55,000 | 49,499 | 3,909,501 | 2037/4/15 |
| | 3 NZ GOVT 200415 | 3.0 | 100,000 | 102,234 | 8,074,512 | 2020/4/15 |
| | 3.5 NZ GOVT 330414 | 3.5 | 40,000 | 41,109 | 3,246,858 | 2033/4/14 |
| | 4.5 NZ GOVT 270415 | 4.5 | 55,000 | 62,076 | 4,902,799 | 2027/4/15 |
| | 5 NZ GOVT 190315 | 5.0 | 10,000 | 10,422 | 823,167 | 2019/3/15 |
| | 5.5 NZ GOVT 230415 | 5.5 | 120,000 | 138,289 | 10,922,099 | 2023/4/15 |
| | 6 NZ GOVT 210515 | 6.0 | 150,000 | 169,281 | 13,369,813 | 2021/5/15 |
| 特殊債券 | 3.5 ASIAN DEV 240530 | 3.5 | 10,000 | 10,080 | 796,140 | 2024/5/30 |
| | 3.5 IADB 240726 | 3.5 | 10,000 | 10,057 | 794,308 | 2024/7/26 |
| | 3.5 IBRD 210122 | 3.5 | 32,600 | 33,402 | 2,638,140 | 2021/1/22 |
| | 3.625 INTL FINAN 200520 | 3.625 | 50,000 | 51,329 | 4,054,039 | 2020/5/20 |
| | 3.75 INTL BK RECO 200210 | 3.75 | 24,000 | 24,666 | 1,948,126 | 2020/2/10 |
| | 3.75 INTL FINAN 270809 | 3.75 | 10,000 | 9,916 | 783,172 | 2027/8/9 |
| | 4.5 AFRICAN DEVEL 190827 | 4.5 | 10,000 | 10,365 | 818,664 | 2019/8/27 |
| | 4.625 ASIAN DEVEL 190306 | 4.625 | 45,000 | 46,424 | 3,666,644 | 2019/3/6 |
| | 4.625 IBRD 211006 | 4.625 | 10,000 | 10,662 | 842,126 | 2021/10/6 |
| | 4.625 INTL BK REC 190226 | 4.625 | 9,000 | 9,280 | 732,943 | 2019/2/26 |
| | 4.875 NORDIC INVE 190122 | 4.875 | 18,000 | 18,573 | 1,466,970 | 2019/1/22 |
| 小 | 計 | | | | 71,674,745 | |
| 合 | 計 | | | | 245,005,678 | |

(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。

三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド

《第14期》決算日2017年4月20日

[計算期間：2016年4月21日～2017年4月20日]

「三菱UFJ グローバル・ボンド・マザーファンド」は、4月20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 | 信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。 世界の主要国のうち、信用力が高く、かつ、相対的に利回りが高い国の債券に投資することにより、利子収益の獲得をめざします。投資対象候補国は、国債の信用力、債券市場や外国為替市場の規模等を勘案して委託会社が決定します。投資対象候補国の中から、相対的に利回りが高いと判断される投資対象国を複数選定し、最も利回りが高いと判断される国に重点配分することを基本とします。判断の基準としては、シティ世界国債インデックスにおける各国の最終利回りとし、ポートフォリオの構築は国別に行うこととし、残存期間毎に最終利回りの高い銘柄を中心に選択します。投資対象とする債券の種類は、各国の国債、政府保証債のほか、オーストラリアの州政府債および各国通貨建ての国際機関債とします。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 | 世界主要国の債券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 | | (参考指数) シティ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 | 純 資 産 額 |
|-----------------|-------------|--------|--|--------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 10期(2013年4月22日) | 21,160 | 31.5 | 386.53 | 28.2 | 98.1 | — | 304,385 |
| 11期(2014年4月21日) | 20,722 | △ 2.1 | 414.30 | 7.2 | 97.7 | — | 285,882 |
| 12期(2015年4月20日) | 23,012 | 11.1 | 464.07 | 12.0 | 98.1 | — | 417,197 |
| 13期(2016年4月20日) | 21,186 | △ 7.9 | 439.03 | △ 5.4 | 97.3 | — | 320,502 |
| 14期(2017年4月20日) | 21,256 | 0.3 | 422.92 | △ 3.7 | 97.6 | — | 272,303 |

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) シティ世界国債インデックス(除く日本・円ベース)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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。

(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 | | (参 考 指 数) シティ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 |
|---------------------|---------|-------|---|-------|-----------|-----------|
| | 円 | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2016年4月20日 | 21,186 | — | 439.03 | — | 97.3 | — |
| 4月末 | 20,816 | △1.7 | 443.06 | 0.9 | 97.1 | — |
| 5月末 | 20,452 | △3.5 | 441.61 | 0.6 | 98.0 | — |
| 6月末 | 20,046 | △5.4 | 415.45 | △5.4 | 97.8 | — |
| 7月末 | 20,649 | △2.5 | 425.08 | △3.2 | 97.5 | — |
| 8月末 | 20,559 | △3.0 | 419.02 | △4.6 | 98.0 | — |
| 9月末 | 20,245 | △4.4 | 415.00 | △5.5 | 97.4 | — |
| 10月末 | 20,555 | △3.0 | 414.55 | △5.6 | 96.9 | — |
| 11月末 | 21,467 | 1.3 | 431.00 | △1.8 | 97.4 | — |
| 12月末 | 21,432 | 1.2 | 442.15 | 0.7 | 96.6 | — |
| 2017年1月末 | 21,978 | 3.7 | 432.60 | △1.5 | 98.4 | — |
| 2月末 | 22,000 | 3.8 | 429.60 | △2.1 | 97.2 | — |
| 3月末 | 21,827 | 3.0 | 428.19 | △2.5 | 97.2 | — |
| (期 末) 2017年4月20日 | 21,256 | 0.3 | 422.92 | △3.7 | 97.6 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

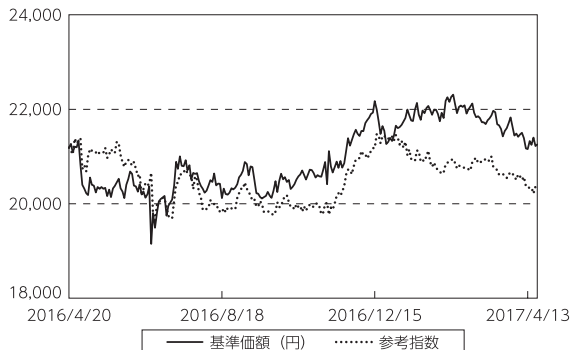
○運用経過

●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0.3%の上昇となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数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。

●投資環境について

◎債券市況

・オーストラリア金利は低下した一方、ニュージーランド金利は上昇しました。期首から2016年8月にかけて、オーストラリアおよびニュージーランドの消費者物価統計が低位で推移していることなどを背景に、両国の追加金融緩和観測が高まり、両国の金利は低下基調で推移しました。9月上旬以降は、日本や欧州の追加金融緩和観測の後退や11月の米大統領選の結果を受けた財政政策に対する期待などで米国の早期追加利上げ観測が高まったことなどから12月にかけて両国の金利は上昇しました。2017年に入ってから豪州連邦準備銀行（RBA）とニュージーランド準備銀行（RBNZ）が金融政策を据え置く中、米国の早期追加利上げに対する思惑などで3月中旬まではオーストラリア金利、ニュージーランド金利は上下する展開となりました。その後、期末にかけては、3月中旬の米

連邦公開市場委員会（FOMC）で利上げが実施されたものの、今後も引き続き緩やかなペースで利上げを行っていく方針が示されたことや、2月分のオーストラリアの雇用統計やニュージーランドの2016年10-12月期の国内総生産（GDP）が市場予想を下回ったことなどから、両国の金利は低下しましたが、期を通じてみると、オーストラリア金利は低下した一方、ニュージーランド金利は上昇して終わりました。

◎為替市況

- ・豪ドルは対円で下落した一方、ニュージーランドドルは対円でほぼ横ばいとなりました。期首から2016年8月にかけては、RBAが5月の定例会合で政策金利の引き下げを決定したうえで、追加金融緩和を示唆したことなどから、豪ドルは対円で下落した一方、ニュージーランドは対円でほぼ横ばいで推移しました。その後、両国の金利が上昇したことで両国と本邦との金利差が拡大したことなどから、2017年1月にかけて豪ドル、ニュージーランドドルは対円で上昇しました。その後、期末にかけて、両国と本邦との金利差が縮小し、豪ドル、ニュージーランドドルが対円で下落に転じ、期を通じてみると、豪ドルは対円で下落した一方、ニュージーランドドルは対円でほぼ横ばいで終わりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて （投資国）

- ・期を通じてオーストラリア、ニュージーランドの2カ国で運用しました。

（通貨）

- ・相対的に利回りが高いと判断した投資対象国（オーストラリア、ニュージーランド）の中で、債券市場の流動性を考慮し、期を通じてオーストラリアへ重点配分しました。

（金利）

- ・残存期間毎に最終利回りが相対的に高い銘柄を中心に、流動性を考慮して銘柄選択を行い投資しました。

（組入比率）

- ・期を通じて、債券の組入比率は高位を維持しました。
- ・前記の運用の結果、豪ドルが対円で下落したことやニュージーランド金利が上昇したものの、債券の利子収益を享受したことなどから、基準価額は上昇しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・オーストラリア金利、ニュージーランド金利はもみ合う展開を想定します。オーストラリアでは、国内の物価動向がRBAのインフレーターゲット（年率2～3%）を継続的に下回っている一方、グローバルな景気回復期待を背景に、RBAは当面金融政策を据え置き、景気動向・資産価格動向などを慎重に見極めていくものと考えます。ニュージーランドでは国内経済は堅調に推移しているものの、RBNZはインフレ率がインフレ目標に向かって緩やかに上昇していくと予想していることなどから、引き続き現状の緩和的な金融政策を維持するものと考えます。
- ・オーストラリア、ニュージーランドではRBAとRBNZが当面現状の金融政策を維持すると考えられますが、両国の経済が堅調なことに加え、FOMCが今後の政策金利引き上げを含む金融正常化を慎重に進める方針を示唆していることなどから、豪ドルとニュージーランドドルは対円で安定した推移になると考えます。

◎今後の運用方針

（投資国）

- ・世界の主要国のうち、信用力が高く、かつ、相対的に利回りが高い国の債券に投資する方針です。

（通貨）

- ・相対的に利回りが高いと判断される投資対象国を複数選定し、相対的に利回りが高いと判断される国に重点配分する方針です。

（金利）

- ・ポートフォリオの構築は国別に、残存期間毎に最終利回りの高い銘柄を中心に選択する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年4月21日～2017年4月20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) | (4) | (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) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 4 | 0.018 | |
| 期中の平均基準価額は、21,002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4月21日～2017年4月20日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|----------|------|------------------------|------------------------|
| 外 国 | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリアドル 254,392 | 千オーストラリアドル 265,064 |
| | | 特殊債券 | 183,066 | 449,759 (10,000) |
| | ニュージーランド | 国債証券 | 千ニュージーランドドル 133,176 | 千ニュージーランドドル 264,068 |
| | | 特殊債券 | 55,372 | 69,185 |

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年4月21日～2017年4月20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 | 3,691 | — | — | 53,803 | 25,005 | 46.5 |

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年4月20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 |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル 2,088,000 | 千オーストラリアドル 2,269,583 | 千円 185,742,675 | % 68.2 | % — | % 46.1 | % 16.4 | % 5.7 |
| ニュージーランド | 千ニュージーランドドル 978,600 | 千ニュージーランドドル 1,044,281 | 80,138,146 | 29.4 | — | 12.7 | 13.5 | 3.3 |
| 合 計 | — | — | 265,880,822 | 97.6 | — | 58.8 | 29.9 | 9.0 |

(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 | |
| | | | | | | |
| 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 | 2 AUST GOVT 211221 | 2.0 | 50,000 | 50,016 | 4,093,317 | 2021/12/21 |
| | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2.25 | 35,000 | 33,966 | 2,779,785 | 2028/5/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 191021 | 2.75 | 10,000 | 10,262 | 839,890 | 2019/10/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 240421 | 2.75 | 80,000 | 82,541 | 6,755,211 | 2024/4/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 281121 | 2.75 | 30,000 | 30,491 | 2,495,398 | 2028/11/21 |
| | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75 | 40,000 | 38,396 | 3,142,364 | 2035/6/21 |
| | 3 AUST GOVT 470321 | 3.0 | 30,000 | 27,651 | 2,263,021 | 2047/3/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25 | 90,000 | 95,837 | 7,843,362 | 2029/4/21 |
| | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25 | 20,000 | 20,124 | 1,646,951 | 2039/6/21 |
| | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75 | 110,000 | 120,395 | 9,853,189 | 2037/4/21 |
| | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25 | 60,000 | 68,927 | 5,641,057 | 2026/4/21 |
| | 4.5 AUST GOVT 330421 | 4.5 | 50,000 | 60,441 | 4,946,561 | 2033/4/21 |
| | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75 | 70,000 | 84,161 | 6,887,776 | 2027/4/21 |
| | 5.5 AUST GOVT 230421 | 5.5 | 80,000 | 95,077 | 7,781,144 | 2023/4/21 |
| | 5.75 AUST GOVT 210515 | 5.75 | 30,000 | 34,500 | 2,823,526 | 2021/5/15 |
| | 5.75 AUST GOVT 220715 | 5.75 | 100,000 | 118,325 | 9,683,775 | 2022/7/15 |
| 特殊債券 | 2.5 EUROPEAN INVE 200430 | 2.5 | 15,000 | 15,102 | 1,236,020 | 2020/4/30 |
| | 2.5 IADB 270414 | 2.5 | 42,000 | 39,727 | 3,251,333 | 2027/4/14 |
| | 2.6 ASIAN DEV 200116 | 2.6 | 5,000 | 5,065 | 414,532 | 2020/1/16 |
| | 2.7 INTL FINAN 210205 | 2.7 | 5,000 | 5,070 | 414,972 | 2021/2/5 |
| | 2.7 NORDIC INVEST 200204 | 2.7 | 10,000 | 10,127 | 828,841 | 2020/2/4 |
| | 2.75 INTER-AMERIC 251030 | 2.75 | 7,000 | 6,881 | 563,179 | 2025/10/30 |
| | 2.75 QUEENSLAND 270820 | 2.75 | 30,000 | 29,269 | 2,395,455 | 2027/8/20 |
| | 2.75 WEST AUST TR 221020 | 2.75 | 20,000 | 20,199 | 1,653,164 | 2022/10/20 |
| | 2.8 IBRD 210113 | 2.8 | 10,000 | 10,175 | 832,766 | 2021/1/13 |
| | 3 ASIAN DEV 261014 | 3.0 | 20,000 | 19,883 | 1,627,296 | 2026/10/14 |
| | 3 IBRD 261019 | 3.0 | 20,000 | 19,913 | 1,629,748 | 2026/10/19 |
| | 3 NEWSWALES 270520 | 3.0 | 15,000 | 15,185 | 1,242,752 | 2027/5/20 |
| | 3 NEWSWALES 300220 | 3.0 | 20,000 | 19,752 | 1,616,508 | 2030/2/20 |
| | 3 SOUTH AUST GOVT 270920 | 3.0 | 15,000 | 14,941 | 1,222,812 | 2027/9/20 |
| | 3 VICTORIA 281020 | 3.0 | 20,000 | 20,093 | 1,644,458 | 2028/10/20 |
| | 3.5 INTER-AMER 170926 | 3.5 | 30,000 | 30,211 | 2,472,538 | 2017/9/26 |
| | 3.5 INTL FIN CORP 180606 | 3.5 | 40,000 | 40,711 | 3,331,860 | 2018/6/6 |
| | 3.5 NEWSWALES 190320 | 3.5 | 40,000 | 41,280 | 3,378,378 | 2019/3/20 |
| | 3.75 ASIAN DEVELO 250312 | 3.75 | 15,000 | 15,883 | 1,299,927 | 2025/3/12 |
| | 3.75 INTER-AME 181009 | 3.75 | 20,000 | 20,529 | 1,680,126 | 2018/10/9 |
| | 3.75 INTER-AMERIC 220725 | 3.75 | 15,000 | 15,897 | 1,301,035 | 2022/7/25 |
| | 3.75 INTL BK RECO 190123 | 3.75 | 30,000 | 30,930 | 2,531,321 | 2019/1/23 |
| | 4 AFRICAN DEVELOP 250110 | 4.0 | 10,000 | 10,659 | 872,377 | 2025/1/10 |
| | 4 INTL FINANCE CO 250403 | 4.0 | 35,000 | 37,683 | 3,084,030 | 2025/4/3 |
| | 4 NEWSWALES 210408 | 4.0 | 50,000 | 53,621 | 4,388,375 | 2021/4/8 |
| | 4 NEWSWALES 230420 | 4.0 | 100,000 | 109,165 | 8,934,063 | 2023/4/20 |
| | 4.25 INTL BK RECO 250624 | 4.25 | 10,000 | 11,008 | 900,920 | 2025/6/24 |
| | 4.25 INTL FINANCE 230821 | 4.25 | 15,000 | 16,346 | 1,337,821 | 2023/8/21 |

| 銘柄 | 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 | | |
| 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 | | |
| | 特殊債券 | 4.25 VICTORIA 321220 | 4.25 | 5,000 | 5,608 | 458,978 | 2032/12/20 |
| | | 4.75 EUROPEAN INV 240807 | 4.75 | 10,000 | 11,183 | 915,232 | 2024/8/7 |
| | | 4.75 INTER-AMERIC 240827 | 4.75 | 10,000 | 11,272 | 922,524 | 2024/8/27 |
| | | 4.75 NORDIC INVES 240228 | 4.75 | 20,000 | 22,414 | 1,834,410 | 2024/2/28 |
| | | 5 ASIAN DEV BANK 220309 | 5.0 | 25,000 | 27,905 | 2,283,790 | 2022/3/9 |
| | | 5 NORDIC INVES BK 220419 | 5.0 | 8,000 | 8,922 | 730,177 | 2022/4/19 |
| | | 5.5 VICTORIA 241217 | 5.5 | 60,000 | 72,366 | 5,922,462 | 2024/12/17 |
| | | 5.5 VICTORIA 261117 | 5.5 | 25,000 | 30,908 | 2,529,590 | 2026/11/17 |
| | | 5.75 INTL BK RECO 191021 | 5.75 | 70,000 | 76,302 | 6,244,586 | 2019/10/21 |
| | | 6 ASIAN DEV BK 180222 | 6.0 | 26,000 | 26,896 | 2,201,197 | 2018/2/22 |
| | | 6 EUROPEAN INVEST 200806 | 6.0 | 18,000 | 20,123 | 1,646,892 | 2020/8/6 |
| | | 6 QUEENSLAND 210614 | 6.0 | 65,000 | 75,166 | 6,151,606 | 2021/6/14 |
| | | 6 VICTORIA 200615 | 6.0 | 60,000 | 67,365 | 5,513,195 | 2020/6/15 |
| | | 6 VICTORIA 221017 | 6.0 | 60,000 | 71,469 | 5,849,067 | 2022/10/17 |
| | | 6.25 ASIAN DEV BK 200305 | 6.25 | 37,000 | 41,252 | 3,376,139 | 2020/3/5 |
| | | 6.5 EUROPEAN INVE 190807 | 6.5 | 20,000 | 21,953 | 1,796,707 | 2019/8/7 |
| | | 6.5 INTER-AMERICA 190820 | 6.5 | 20,000 | 22,032 | 1,803,162 | 2019/8/20 |
| | 小 計 | | | | | 185,742,675 | |
| ニュージーランド | | | | 千ニュージーランドドル | 千ニュージーランドドル | | |
| | 国債証券 | 2.75 NZ GOVT 250415 | 2.75 | 90,000 | 89,361 | 6,857,570 | 2025/4/15 |
| | | 2.75 NZ GOVT 370415 | 2.75 | 55,000 | 49,436 | 3,793,784 | 2037/4/15 |
| | | 3 NZ GOVT 200415 | 3.0 | 140,000 | 143,135 | 10,984,213 | 2020/4/15 |
| | | 3.5 NZ GOVT 330414 | 3.5 | 40,000 | 41,491 | 3,184,089 | 2033/4/14 |
| | | 4.5 NZ GOVT 270415 | 4.5 | 90,000 | 102,320 | 7,852,106 | 2027/4/15 |
| | | 5 NZ GOVT 190315 | 5.0 | 10,000 | 10,538 | 808,759 | 2019/3/15 |
| | | 5.5 NZ GOVT 230415 | 5.5 | 145,000 | 168,031 | 12,894,715 | 2023/4/15 |
| | | 6 NZ GOVT 210515 | 6.0 | 170,000 | 194,070 | 14,892,941 | 2021/5/15 |
| | 特殊債券 | 3.375 IBRD 220125 | 3.375 | 10,000 | 10,087 | 774,108 | 2022/1/25 |
| | | 3.5 IBRD 210122 | 3.5 | 32,600 | 33,214 | 2,548,863 | 2021/1/22 |
| | | 3.5 NORDIC INVEST 180130 | 3.5 | 5,000 | 5,047 | 387,333 | 2018/1/30 |
| | | 3.625 INTL BK REC 180220 | 3.625 | 5,000 | 5,056 | 388,050 | 2018/2/20 |
| | | 3.625 INTL FINAN 200520 | 3.625 | 40,000 | 40,910 | 3,139,497 | 2020/5/20 |
| | | 3.75 INTL BK RECO 200210 | 3.75 | 24,000 | 24,636 | 1,890,572 | 2020/2/10 |
| | | 4.125 NORDIC INVE 200319 | 4.125 | 10,000 | 10,361 | 795,134 | 2020/3/19 |
| | | 4.5 AFRICAN DEVEL 190827 | 4.5 | 10,000 | 10,384 | 796,883 | 2019/8/27 |
| | | 4.625 ASIAN DEVEL 190306 | 4.625 | 45,000 | 46,708 | 3,584,425 | 2019/3/6 |
| | | 4.625 IBRD 211006 | 4.625 | 10,000 | 10,627 | 815,580 | 2021/10/6 |
| | | 4.625 INTL BK REC 190226 | 4.625 | 9,000 | 9,340 | 716,794 | 2019/2/26 |
| | | 4.875 NORDIC INVE 190122 | 4.875 | 38,000 | 39,519 | 3,032,721 | 2019/1/22 |
| | 小 計 | | | | | 80,138,146 | |
| | 合 計 | | | | | 265,880,822 | |

(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

(2017年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 265,880,822 | 96.7 |
| コール・ローン等、その他 | 9,074,548 | 3.3 |
| 投資信託財産総額 | 274,955,370 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (271,729,936千円) の投資信託財産総額 (274,955,370千円) に対する比率は98.8%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 オーストラリアドル=81.84円 | 1 ニュージーランドドル=76.74円 | |
|--------------------|---------------------|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年4月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 275,610,010,294 |
| コール・ローン等 | 6,467,711,248 |
| 公社債(評価額) | 265,880,822,207 |
| 未収入金 | 656,000,000 |
| 未収利息 | 2,525,294,099 |
| 前払費用 | 80,182,740 |
| (B) 負債 | 3,306,586,963 |
| 未払金 | 654,640,000 |
| 未払解約金 | 2,651,942,328 |
| 未払利息 | 4,635 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 272,303,423,331 |
| 元本 | 128,104,345,459 |
| 次期繰越損益金 | 144,199,077,872 |
| (D) 受益権総口数 | 128,104,345,459口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,256円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 151,277,665,133円
 期中追加設定元本額 8,639,638,158円
 期中一部解約元本額 31,812,957,832円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.1256円です。

②期末における元本の内訳(親級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 先進国高金利債券ファンド(毎月決算型) | 36,490,814,588円 |
| 三菱UFJ グローバル・ボンド・オープン(年1回決算型) | 5,050,297,584円 |
| 三菱UFJ 先進国高金利債券ファンド(年1回決算型) | 33,568,838円 |
| 三菱UFJ グローバル・ボンド・オープン(毎月決算型) | 83,813,916,811円 |
| MUAM グローバル・ボンド・ファンド(適格機関投資家転売制限付) | 2,715,747,638円 |
| 合計 | 128,104,345,459円 |

【お知らせ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2016年7月1日)

○損益の状況

(2016年4月21日～2017年4月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 11,972,398,093 |
| 受取利息 | 11,973,209,711 |
| 支払利息 | △ 811,618 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 10,378,642,528 |
| 売買益 | 2,178,873,617 |
| 売買損 | △ 12,557,516,145 |
| (C) 保管費用等 | △ 55,201,134 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,538,554,431 |
| (E) 前期繰越損益金 | 169,224,662,184 |
| (F) 追加信託差損益金 | 9,087,392,681 |
| (G) 解約差損益金 | △ 35,651,531,424 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 144,199,077,872 |
| 次期繰越損益金(H) | 144,199,077,872 |

- (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。