

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／インデックス型
信託期間	無期限（2003年3月6日設定）
運用方針	米ドル建ての米国国債を主要投資対象とし、米ドル建ての米国国債市場の動きを概ね捉えることをめざして運用を行います。ベンチマークは、FTSE米国債インデックス（円ベース）とします。
主要運用対象	米ドル建ての米国国債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。
分配方針	毎月17日に決算（ただし、17日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い、利子・配当収益を中心に、基準価額水準、市況動向等を勘案したうえで安定した分配を継続することをめざします。ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ 米国債券オープン （毎月分配型）



第244期（決算日：2023年9月19日）
 第245期（決算日：2023年10月17日）
 第246期（決算日：2023年11月17日）
 第247期（決算日：2023年12月18日）
 第248期（決算日：2024年1月17日）
 第249期（決算日：2024年2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、お手持ちの「三菱UFJ 米国債券オープン（毎月分配型）」は、去る2月19日に第249期の決算を行いましたので、法令に基づいて第244期～第249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アセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9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30期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE米国債インデックス (円ベース)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配	み 期騰落 金額	騰 落 率	騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
220期(2021年9月17日)	7,958	15	0.5	409.6334	0.5	98.4	—	4,892
221期(2021年10月18日)	8,143	15	2.5	420.2733	2.6	98.1	—	4,980
222期(2021年11月17日)	8,137	15	0.1	421.0845	0.2	98.1	—	4,928
223期(2021年12月17日)	8,119	15	△0.0	422.0037	0.2	98.7	—	4,908
224期(2022年1月17日)	7,966	15	△1.7	413.7648	△2.0	98.5	—	4,808
225期(2022年2月17日)	7,856	15	△1.2	411.1339	△0.6	98.8	—	4,730
226期(2022年3月17日)	7,980	15	1.8	417.2554	1.5	98.9	—	4,783
227期(2022年4月18日)	8,190	15	2.8	429.1166	2.8	98.4	—	4,850
228期(2022年5月17日)	8,287	15	1.4	437.0187	1.8	98.2	—	4,858
229期(2022年6月17日)	8,318	15	0.6	438.2041	0.3	98.8	—	4,807
230期(2022年7月19日)	8,765	15	5.6	464.2984	6.0	98.1	—	5,088
231期(2022年8月17日)	8,543	15	△2.4	455.1793	△2.0	99.0	—	4,900
232期(2022年9月20日)	8,794	15	3.1	469.1973	3.1	98.2	—	5,080
233期(2022年10月17日)	8,837	15	0.7	471.7271	0.5	98.3	—	5,107
234期(2022年11月17日)	8,444	15	△4.3	451.9605	△4.2	98.3	—	4,867
235期(2022年12月19日)	8,382	15	△0.6	451.7240	△0.1	98.4	—	4,824
236期(2023年1月17日)	7,911	15	△5.4	426.0951	△5.7	98.4	—	4,539
237期(2023年2月17日)	8,096	15	2.5	436.4354	2.4	98.5	—	4,623
238期(2023年3月17日)	8,181	15	1.2	440.7921	1.0	98.3	—	4,705
239期(2023年4月17日)	8,232	15	0.8	445.1533	1.0	98.5	—	4,774
240期(2023年5月17日)	8,375	15	1.9	455.6676	2.4	97.9	—	4,886
241期(2023年6月19日)	8,588	15	2.7	466.8061	2.4	98.5	—	5,017
242期(2023年7月18日)	8,384	15	△2.2	459.1391	△1.6	98.4	—	4,839
243期(2023年8月17日)	8,629	15	3.1	470.8256	2.5	98.2	—	4,980
244期(2023年9月19日)	8,690	15	0.9	477.3142	1.4	98.4	—	4,990
245期(2023年10月17日)	8,623	15	△0.6	475.1728	△0.4	98.3	—	4,948
246期(2023年11月17日)	8,832	15	2.6	486.5411	2.4	98.0	—	5,005
247期(2023年12月18日)	8,626	15	△2.2	475.7380	△2.2	98.3	—	4,883
248期(2024年1月17日)	8,880	15	3.1	491.0069	3.2	98.5	—	4,994
249期(2024年2月19日)	8,917	15	0.6	496.4962	1.1	98.5	—	4,986

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) FTSE米国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、米国債の総合収益率を指数化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		FTSE米国債インデックス (円ベース)		債組入比率	債券先物比率
		騰落率	騰落率				
第244期	(期首) 2023年8月17日	円 8,629	% —	470.8256	% —	% 98.2	% —
	8月末	8,691	0.7	475.3488	1.0	98.5	—
	(期末) 2023年9月19日	8,705	0.9	477.3142	1.4	98.4	—
第245期	(期首) 2023年9月19日	8,690	—	477.3142	—	98.4	—
	9月末	8,683	△0.1	476.6476	△0.1	98.3	—
	(期末) 2023年10月17日	8,638	△0.6	475.1728	△0.4	98.3	—
第246期	(期首) 2023年10月17日	8,623	—	475.1728	—	98.3	—
	10月末	8,572	△0.6	470.7502	△0.9	98.0	—
	(期末) 2023年11月17日	8,847	2.6	486.5411	2.4	98.0	—
第247期	(期首) 2023年11月17日	8,832	—	486.5411	—	98.0	—
	11月末	8,723	△1.2	482.8026	△0.8	97.9	—
	(期末) 2023年12月18日	8,641	△2.2	475.7380	△2.2	98.3	—
第248期	(期首) 2023年12月18日	8,626	—	475.7380	—	98.3	—
	12月末	8,646	0.2	475.3365	△0.1	98.5	—
	(期末) 2024年1月17日	8,895	3.1	491.0069	3.2	98.5	—
第249期	(期首) 2024年1月17日	8,880	—	491.0069	—	98.5	—
	1月末	8,896	0.2	494.6077	0.7	98.3	—
	(期末) 2024年2月19日	8,932	0.6	496.4962	1.1	98.5	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、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

第244期～第249期：2023年8月18日～2024年2月19日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第244期首	8,629円
第249期末	8,917円
既払分配金	90円
騰落率	4.4%
(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す。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ4.4%（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（5.5%）を1.1%下回りました。

▶ 基準価額の主な変動要因

上昇要因

ベンチマークに概ね連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第244期～第249期：2023年8月18日～2024年2月19日

投資環境について

▶ 債券市況

米国の債券市況は上昇しました。

米国の債券市況は、中銀による利上げの打ち止め観測などを背景に短期金利が低下したことなどから、期間の初めとの比

較では上昇しました。

▶ 為替市況

期間の初めに比べて米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

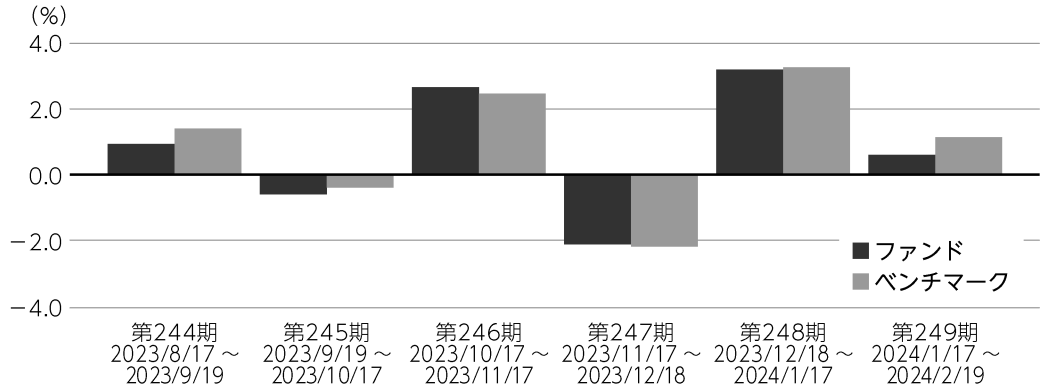
F T S E 米国債インデックス（円ベース）に採用されている国債等を主要投資対象とし、ベンチマークに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いました。

ベンチマークの動きを概ね捉えるべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

第244期～第249期：2023/8/18～2024/2/19

当該投資信託のベンチマークとの差異について

基準価額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。

ベンチマークは5.5%の上昇になったため、カイ離は△1.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

主なマイナス要因：評価時価差異要因*によるものです。

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

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244期 2023年8月18日～ 2023年9月19日	第245期 2023年9月20日～ 2023年10月17日	第246期 2023年10月18日～ 2023年11月17日	第247期 2023年11月18日～ 2023年12月18日	第248期 2023年12月19日～ 2024年1月17日	第249期 2024年1月18日～ 2024年2月19日
当期分配金 （対基準価額比率）	15 (0.172%)	15 (0.174%)	15 (0.170%)	15 (0.174%)	15 (0.169%)	15 (0.168%)
当期の収益	15	12	15	13	15	15
当期の収益以外	－	2	－	1	－	－
翌期繰越分配対象額	1,626	1,624	1,683	1,682	1,733	1,769

（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。）

ベンチマークの動きに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

2023年8月18日～2024年2月19日

1万口当たりの費用明細

項目	第244期～第249期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	37	0.419	(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）	(17)	(0.196)	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)	(0.196)	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)	(0.028)	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	0.011	(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)	(0.011)	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
合計	38	0.430	

作成期中の平均基準価額は、8,726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。

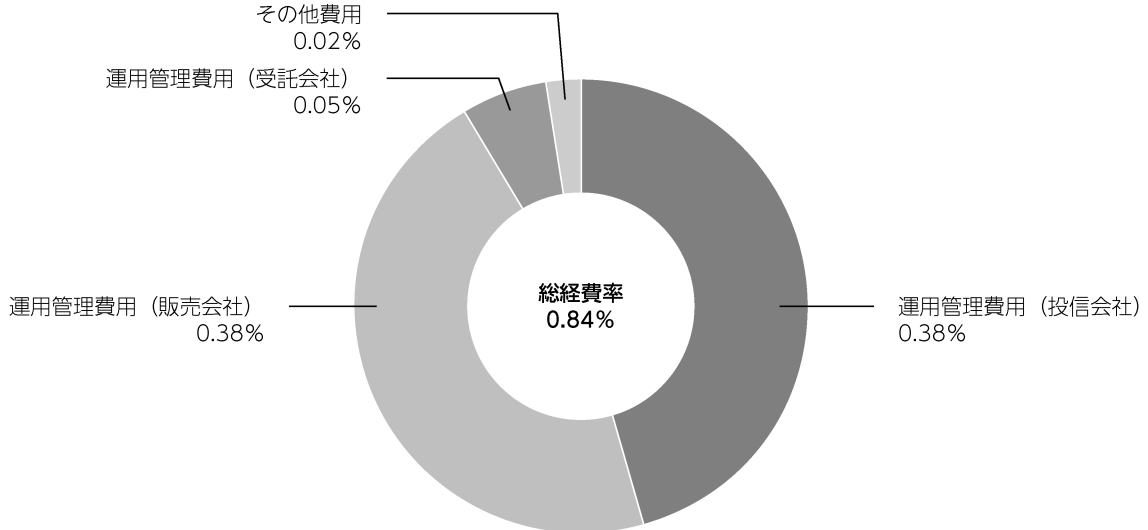
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.84%**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

(2023年8月18日～2024年2月19日)

公社債

			第244期～第249期	
			買付額	売付額
外国	アメリカ	千アメリカドル	千アメリカドル	
	国債証券	3,701	4,639	

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2023年8月18日～2024年2月19日)

利害関係人との取引状況

区分	第244期～第249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 226	百万円 199	% 88.1

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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2024年2月19日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	第249期末				残存期間別組入比率		
		評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 37,070	千アメリカドル 32,754	千円 4,914,095	% 98.5	% —	% 41.6	% 36.8	% 20.1
合計	37,070	32,754	4,914,095	98.5	—	41.6	36.8	20.1

(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	第249期末				
		利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.25 T-NOTE 250531	0.25	430	405	60,860	2025/5/31
	0.375 T-NOTE 251231	0.375	340	314	47,151	2025/12/31
	0.375 T-NOTE 260131	0.375	400	368	55,277	2026/1/31
	0.5 T-NOTE 270630	0.5	330	290	43,543	2027/6/30
	0.5 T-NOTE 271031	0.5	210	182	27,387	2027/10/31
	0.625 T-NOTE 271231	0.625	710	616	92,507	2027/12/31
	0.625 T-NOTE 300515	0.625	310	248	37,225	2030/5/15
	0.625 T-NOTE 300815	0.625	390	309	46,427	2030/8/15
	0.75 T-NOTE 260531	0.75	410	376	56,496	2026/5/31
	0.75 T-NOTE 280131	0.75	320	278	41,789	2028/1/31
	0.875 T-NOTE 301115	0.875	340	272	40,939	2030/11/15
	1.125 T-BOND 400515	1.125	60	36	5,487	2040/5/15
	1.125 T-BOND 400815	1.125	240	144	21,741	2040/8/15
	1.125 T-NOTE 261031	1.125	300	274	41,221	2026/10/31
	1.125 T-NOTE 280229	1.125	450	396	59,542	2028/2/29
	1.125 T-NOTE 280831	1.125	130	113	16,960	2028/8/31
	1.125 T-NOTE 310215	1.125	400	325	48,816	2031/2/15
	1.25 T-NOTE 261130	1.25	610	559	83,934	2026/11/30
	1.25 T-NOTE 280331	1.25	310	274	41,136	2028/3/31
	1.25 T-NOTE 280531	1.25	50	44	6,604	2028/5/31
	1.25 T-NOTE 280630	1.25	80	70	10,543	2028/6/30
	1.25 T-NOTE 280930	1.25	390	340	51,068	2028/9/30
	1.25 T-NOTE 310815	1.25	520	419	62,941	2031/8/15
	1.375 T-BOND 401115	1.375	180	113	16,962	2040/11/15
	1.375 T-BOND 500815	1.375	300	154	23,229	2050/8/15
	1.375 T-NOTE 281031	1.375	300	262	39,432	2028/10/31
	1.375 T-NOTE 311115	1.375	440	355	53,380	2031/11/15
	1.5 T-NOTE 260815	1.5	350	325	48,830	2026/8/15
	1.5 T-NOTE 281130	1.5	210	184	27,713	2028/11/30
	1.5 T-NOTE 300215	1.5	480	409	61,448	2030/2/15
	1.625 T-BOND 501115	1.625	270	149	22,375	2050/11/15
	1.625 T-NOTE 260215	1.625	370	349	52,366	2026/2/15
	1.625 T-NOTE 290815	1.625	150	130	19,646	2029/8/15
	1.625 T-NOTE 310515	1.625	270	225	33,842	2031/5/15
	1.75 T-BOND 410815	1.75	210	138	20,794	2041/8/15
	1.75 T-NOTE 250315	1.75	140	135	20,302	2025/3/15
	1.75 T-NOTE 290131	1.75	410	363	54,570	2029/1/31
	1.75 T-NOTE 291115	1.75	280	245	36,765	2029/11/15
	1.875 T-BOND 410215	1.875	180	122	18,423	2041/2/15
	1.875 T-BOND 510215	1.875	300	176	26,508	2051/2/15
	1.875 T-BOND 511115	1.875	380	222	33,381	2051/11/15
	1.875 T-NOTE 290228	1.875	200	178	26,742	2029/2/28
	1.875 T-NOTE 320215	1.875	460	384	57,750	2032/2/15
	2 T-BOND 411115	2.0	240	164	24,727	2041/11/15
	2 T-BOND 500215	2.0	220	134	20,247	2050/2/15
	2 T-BOND 510815	2.0	300	181	27,269	2051/8/15

三菱UFJ 米国債券オープン（毎月分配型）

銘柄	銘柄	第249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					
	2 T-NOTE 250215	2.0	260	252	37,875	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	500	480	72,037	2025/8/15
	2.125 T-NOTE 250515	2.125	670	648	97,231	2025/5/15
	2.25 T-BOND 410515	2.25	230	166	24,952	2041/5/15
	2.25 T-BOND 490815	2.25	330	215	32,344	2049/8/15
	2.25 T-BOND 520215	2.25	280	180	27,032	2052/2/15
	2.25 T-NOTE 251115	2.25	530	508	76,279	2025/11/15
	2.25 T-NOTE 270215	2.25	500	469	70,487	2027/2/15
	2.25 T-NOTE 270815	2.25	750	698	104,806	2027/8/15
	2.375 T-BOND 420215	2.375	130	94	14,219	2042/2/15
	2.375 T-BOND 510515	2.375	300	199	29,907	2051/5/15
	2.375 T-NOTE 270515	2.375	540	507	76,084	2027/5/15
	2.375 T-NOTE 290331	2.375	330	301	45,162	2029/3/31
	2.375 T-NOTE 290515	2.375	310	282	42,352	2029/5/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	130	93	14,000	2045/2/15
	2.5 T-BOND 460215	2.5	140	99	14,909	2046/2/15
	2.5 T-NOTE 270331	2.5	140	132	19,849	2027/3/31
	2.625 T-NOTE 250331	2.625	520	507	76,086	2025/3/31
	2.75 T-BOND 420815	2.75	200	154	23,137	2042/8/15
	2.75 T-BOND 421115	2.75	40	30	4,611	2042/11/15
	2.75 T-NOTE 270430	2.75	300	285	42,797	2027/4/30
	2.75 T-NOTE 320815	2.75	260	231	34,694	2032/8/15
	2.875 T-BOND 430515	2.875	180	140	21,074	2043/5/15
	2.875 T-BOND 450815	2.875	100	76	11,467	2045/8/15
	2.875 T-BOND 461115	2.875	80	60	9,083	2046/11/15
	2.875 T-BOND 520515	2.875	180	133	20,021	2052/5/15
	2.875 T-NOTE 280515	2.875	390	368	55,220	2028/5/15
	2.875 T-NOTE 280815	2.875	510	480	72,027	2028/8/15
	2.875 T-NOTE 320515	2.875	260	234	35,145	2032/5/15
	3 T-BOND 420515	3.0	30	24	3,618	2042/5/15
	3 T-BOND 450515	3.0	60	46	7,048	2045/5/15
	3 T-BOND 470215	3.0	140	108	16,233	2047/2/15
	3 T-BOND 470515	3.0	130	100	15,046	2047/5/15
	3 T-BOND 480215	3.0	320	245	36,891	2048/2/15
	3 T-BOND 480815	3.0	290	222	33,352	2048/8/15
	3 T-BOND 490215	3.0	320	244	36,741	2049/2/15
	3 T-BOND 520815	3.0	110	83	12,563	2052/8/15
	3 T-NOTE 250715	3.0	340	331	49,764	2025/7/15
	3 T-NOTE 250930	3.0	400	389	58,383	2025/9/30
	3.125 T-BOND 420215	3.125	120	98	14,805	2042/2/15
	3.125 T-BOND 440815	3.125	110	88	13,281	2044/8/15
	3.125 T-NOTE 281115	3.125	170	161	24,219	2028/11/15
	3.125 T-NOTE 290831	3.125	170	160	24,033	2029/8/31
	3.25 T-BOND 420515	3.25	160	133	20,032	2042/5/15
	3.25 T-NOTE 290630	3.25	270	256	38,471	2029/6/30
	3.375 T-BOND 420815	3.375	110	93	14,005	2042/8/15
	3.375 T-BOND 440515	3.375	50	41	6,293	2044/5/15

銘柄	銘柄	第249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		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	3.375	370	343	51,579	2033/5/15
		3.5 T-NOTE 250915	3.5	510	500	75,041	2025/9/15
		3.5 T-NOTE 330215	3.5	300	281	42,298	2033/2/15
		3.625 T-BOND 430815	3.625	130	113	17,056	2043/8/15
		3.625 T-BOND 440215	3.625	120	104	15,709	2044/2/15
		3.625 T-BOND 530215	3.625	110	94	14,226	2053/2/15
		3.625 T-BOND 530515	3.625	220	189	28,473	2053/5/15
		3.625 T-NOTE 260515	3.625	400	392	58,821	2026/5/15
		3.625 T-NOTE 280531	3.625	420	408	61,276	2028/5/31
		3.75 T-BOND 410815	3.75	90	81	12,212	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	130	115	17,348	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 260415	3.75	420	412	61,938	2026/4/15
		3.75 T-NOTE 281231	3.75	140	136	20,502	2028/12/31
		3.75 T-NOTE 300630	3.75	130	125	18,891	2030/6/30
		3.875 T-BOND 430215	3.875	60	54	8,182	2043/2/15
		3.875 T-NOTE 271130	3.875	140	137	20,638	2027/11/30
		3.875 T-NOTE 290930	3.875	180	176	26,422	2029/9/30
		3.875 T-NOTE 330815	3.875	170	164	24,648	2033/8/15
		4 T-BOND 421115	4.0	100	92	13,900	2042/11/15
		4 T-BOND 521115	4.0	160	147	22,175	2052/11/15
		4 T-NOTE 251215	4.0	600	592	88,926	2025/12/15
		4 T-NOTE 270115	4.0	330	326	48,918	2027/1/15
		4 T-NOTE 300228	4.0	300	294	44,252	2030/2/28
		4 T-NOTE 300731	4.0	230	225	33,894	2030/7/31
		4.125 T-NOTE 250131	4.125	380	376	56,530	2025/1/31
		4.125 T-NOTE 280731	4.125	270	267	40,187	2028/7/31
		4.125 T-NOTE 321115	4.125	250	246	36,991	2032/11/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	60	58	8,722	2040/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	40	40	6,026	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	150	148	22,308	2039/11/15
		4.375 T-NOTE 260815	4.375	230	229	34,395	2026/8/15
		4.375 T-NOTE 301130	4.375	70	70	10,534	2030/11/30
		4.5 T-BOND 360215	4.5	20	20	3,085	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	10	10	1,522	2038/5/15
		4.5 T-NOTE 260715	4.5	200	199	29,986	2026/7/15
		4.5 T-NOTE 331115	4.5	150	152	22,845	2033/11/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	80	81	12,220	2040/2/15
		4.625 T-NOTE 250228	4.625	230	229	34,381	2025/2/28
		4.625 T-NOTE 260315	4.625	330	330	49,515	2026/3/15
		4.625 T-NOTE 260915	4.625	390	391	58,688	2026/9/15
		4.625 T-NOTE 261015	4.625	440	441	66,236	2026/10/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	100	102	15,428	2041/2/15
		4.75 T-BOND 531115	4.75	50	52	7,879	2053/11/15
		4.875 T-NOTE 301031	4.875	70	72	10,836	2030/10/31
		5 T-BOND 370515	5.0	30	32	4,825	2037/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	270	280	42,115	2028/11/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	130	139	20,858	2031/2/15

銘柄	第249期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	6 T-BOND 260215	290	297	44,662	2026/2/15	
	6.125 T-BOND 271115	210	222	33,384	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 300515	100	110	16,578	2030/5/15	
合	計			4,914,095		

(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

(2024年2月19日現在)

項目	第249期末	
	評価額	比率
公社債	千円 4,914,095	% 98.3
コール・ローン等、その他	87,158	1.7
投資信託財産総額	5,001,253	100.0

(注) 作成期末における外貨建純資産（4,965,012千円）の投資信託財産総額（5,001,253千円）に対する比率は99.3%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 アメリカドル=150.03円			
------------------	--	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第244期末	第245期末	第246期末	第247期末	第248期末	第249期末
	2023年9月19日現在	2023年10月17日現在	2023年11月17日現在	2023年12月18日現在	2024年1月17日現在	2024年2月19日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	5,028,825,312	4,960,474,567	5,021,436,566	4,921,059,211	5,014,246,440	5,001,253,240
コール・ローン等	68,413,347	59,085,834	88,683,742	63,149,046	52,314,790	57,841,760
公社債(評価額)	4,909,120,066	4,865,067,976	4,905,855,125	4,800,514,129	4,919,718,164	4,914,095,506
未収入金	20,650,840	—	—	24,210,805	—	—
未収利息	27,551,935	32,832,764	23,420,386	28,749,653	37,283,704	25,221,942
前払費用	1,584,599	1,652,120	1,361,483	2,010,225	2,195,890	1,062,334
その他未収収益	1,504,525	1,835,873	2,115,830	2,425,353	2,733,892	3,031,698
(B) 負債	38,323,298	12,404,394	15,775,074	37,678,606	20,240,456	14,622,662
未払金	20,678,840	—	—	24,169,886	—	—
未払収益分配金	8,614,110	8,607,171	8,501,067	8,491,790	8,435,476	8,388,576
未払解約金	5,324,659	665,032	3,799,722	1,564,254	8,479,527	2,514,100
未払信託報酬	3,705,635	3,132,181	3,474,268	3,452,669	3,325,435	3,719,983
未払利息	54	10	17	7	18	3
(C) 純資産総額(A-B)	4,990,502,014	4,948,070,173	5,005,661,492	4,883,380,605	4,994,005,984	4,986,630,578
元本	5,742,740,007	5,738,114,332	5,667,378,359	5,661,193,727	5,623,651,203	5,592,384,509
次期繰越損益金	△ 752,237,993	△ 790,044,159	△ 661,716,867	△ 777,813,122	△ 629,645,219	△ 605,753,931
(D) 受益権総口数	5,742,740,007口	5,738,114,332口	5,667,378,359口	5,661,193,727口	5,623,651,203口	5,592,384,509口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,690円	8,623円	8,832円	8,626円	8,880円	8,917円

○損益の状況

項 目	第244期	第245期	第246期	第247期	第248期	第249期
	2023年8月18日～ 2023年9月19日	2023年9月20日～ 2023年10月17日	2023年10月18日～ 2023年11月17日	2023年11月18日～ 2023年12月18日	2023年12月19日～ 2024年1月17日	2024年1月18日～ 2024年2月19日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	12,006,919	10,589,669	11,682,834	11,434,197	11,539,207	12,663,814
受取利息	11,750,809	10,279,139	11,573,963	11,164,950	11,293,438	12,446,473
その他収益金	257,821	311,431	145,143	270,268	246,093	217,487
支払利息	△ 1,711	△ 901	△ 272	△ 269	△ 324	△ 146
(B) 有価証券売買損益	35,530,473	△ 37,113,798	118,607,176	△ 115,792,216	143,013,937	19,776,469
売買益	43,938,799	64,318,466	119,363,147	166,422,797	187,947,852	87,197,942
売買損	△ 8,408,326	△ 101,432,264	△ 755,971	△ 282,215,013	△ 44,933,915	△ 67,421,473
(C) 信託報酬等	△ 3,828,575	△ 3,222,064	△ 3,560,524	△ 3,528,598	△ 3,393,066	△ 3,819,100
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	43,708,817	△ 29,746,193	126,729,486	△ 107,886,617	151,160,078	28,621,183
(E) 前期繰越損益金	320,398,944	353,954,911	308,647,218	422,903,675	302,838,273	438,084,649
(F) 追加信託差損益金	△1,107,731,644	△1,105,645,706	△1,088,592,504	△1,084,338,390	△1,075,208,094	△1,064,071,187
(配当等相当額)	(528,946,098)	(529,971,493)	(527,443,913)	(530,424,713)	(529,245,119)	(531,385,334)
(売買損益相当額)	(△1,636,677,742)	(△1,635,617,199)	(△1,616,036,417)	(△1,614,763,103)	(△1,604,453,213)	(△1,595,456,521)
(G) 計 (D+E+F)	△ 743,623,883	△ 781,436,988	△ 653,215,800	△ 769,321,332	△ 621,209,743	△ 597,365,355
(H) 収益分配金	△ 8,614,110	△ 8,607,171	△ 8,501,067	△ 8,491,790	△ 8,435,476	△ 8,388,576
次期繰越損益金 (G+H)	△ 752,237,993	△ 790,044,159	△ 661,716,867	△ 777,813,122	△ 629,645,219	△ 605,753,931
追加信託差損益金	△1,107,731,644	△1,105,645,706	△1,088,592,504	△1,084,338,390	△1,075,208,094	△1,064,071,187
(配当等相当額)	(528,946,098)	(529,971,493)	(527,443,913)	(530,424,713)	(529,245,119)	(531,385,334)
(売買損益相当額)	(△1,636,677,742)	(△1,635,617,199)	(△1,616,036,417)	(△1,614,763,103)	(△1,604,453,213)	(△1,595,456,521)
分配準備積立金	404,936,433	401,942,838	426,875,637	422,317,484	445,562,875	458,317,256
繰越損益金	△ 49,442,782	△ 86,341,291	—	△ 115,792,216	—	—

(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 5,771,464,828円

 作成期中追加設定元本額 252,028,952円

 作成期中一部解約元本額 431,109,271円

また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8917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605,753,931円です。

③分配金の計算過程

項 目	2023年8月18日～ 2023年9月19日	2023年9月20日～ 2023年10月17日	2023年10月18日～ 2023年11月17日	2023年11月18日～ 2023年12月18日	2023年12月19日～ 2024年1月17日	2024年1月18日～ 2024年2月19日
費用控除後の配当等収益額	11,039,821円	7,367,605円	11,363,455円	7,905,599円	11,285,745円	11,172,837円
費用控除後・繰越大損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	30,939,188円	—円	25,483,917円	17,448,346円
収益調整金額	528,946,098円	529,971,493円	527,443,913円	530,424,713円	529,245,119円	531,385,334円
分配準備積立金額	402,510,722円	403,182,404円	393,074,061円	422,903,675円	417,228,689円	438,084,649円
当ファンドの分配対象収益額	942,496,641円	940,521,502円	962,820,617円	961,233,987円	983,243,470円	998,091,166円
1万口当たり収益分配対象額	1,641円	1,639円	1,698円	1,697円	1,748円	1,784円
1万口当たり分配金額	15円	15円	15円	15円	15円	15円
収益分配金金額	8,614,110円	8,607,171円	8,501,067円	8,491,790円	8,435,476円	8,388,576円

○分配金のお知らせ

	第244期	第245期	第246期	第247期	第248期	第249期
1万口当たり分配金（税込み）	15円	15円	15円	15円	15円	15円

- ・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。

*三菱UFJアセットマネジメント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（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
(2023年10月1日)