

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   | 2032年5月10日まで（2018年1月22日設定）  |  |
| 運用方針   | マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に投資を行います。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいいます。<br>マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。<br>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。<br>マザーファンドの債券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 |  |
| 主要運用対象 | ベビーフンド  | マッコーリー グローバル・インフラ債券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   | 世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とします。        |
| 主な組入制限 | ベビーフンド  | 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。                    |
|        | マザーファンド   | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。                      |
| 分配方針   | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。   |  |
|        | 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）  |  |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。  
 ※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。

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。  
 Macquarie Bank Limited（以下「MBL」といいます）を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社は何れも1959年銀行法（オーストラリア連邦）上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ／マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド  
 <為替ヘッジあり>（年1回決算型）

愛称：世界のいしずえ



第6期（決算日：2023年5月10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／マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>（年1回決算型）」は、去る5月10日に第6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。

## ファンドマネージャーのコメント

当期間（過去1年）の運用で主眼においたポイントをご説明させていただきます。

### ■運用のポイント

インフレは徐々に抑制されてきている一方、市場の関心が経済成長の鈍化に移る中、米連邦準備制度理事会（FRB）による金融引き締め政策が本格化すれば、リスク回避の動きが強まる可能性があります。当ファンドではインフレ高が進んだ当期間前半はデュレーション（平均回収期間や金利感応度）を市場対比で概ね中立とし、利回りがピークとなった2022年8月頃からデュレーションを市場対比で長めの水準としました。今後もFRBの金融政策動向については注視していきます。世界的な景気後退懸念の高まり等を背景にスプレッド（国債との利回り格差）は小幅に拡大する可能性が高いとみています。そのような環境下、セクター配分では、エネルギーセクターについて、エネルギー価格の上昇や堅固なキャッシュフローが同セクター内の様々な業種から創出されていることから、市場対比多めの配分としています。また、公益セクターについては、2022年当初は大幅なアンダーウェイトポジションをとっていましたが、大きくアンダーウェイト幅を縮小しました。世界的な景気後退への懸念が高まるなか、需

要の低迷とインフレ圧力に対してより脆弱であると考えられる発行体へのエクスポージャーを厳しく評価し、エクスポージャーの売却を継続する一方で、この環境下を乗り切れる投資機会への乗り換えを行っていきます。

### ■運用環境の見通しと今後の運用方針

今後は景気後退リスクが高まる中で主要中央銀行による金融引き締め政策の動向に注視しています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。



マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッド  
シニア・ポートフォリオマネージャー  
アンドリウス・ヴォンセプ



シニア・ポートフォリオマネージャー  
ネイサン・ブーン

上記は、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドの資料を基に、三菱UFJ国際投信が作成したものです。

## 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   |                  |                  | (参考指数)<br>合成インデックス |        | 債<br>組<br>入<br>比<br>率 | 債<br>先<br>物<br>比<br>率 | 純<br>資<br>産<br>額 |
|----------------|--------|------------------|------------------|--------------------|--------|-----------------------|-----------------------|------------------|
|                | (分配落)  | 税<br>込<br>分<br>配 | み<br>金<br>騰<br>落 | 期<br>騰<br>落        | 中<br>率 |                       |                       |                  |
|                | 円      | 円                | %                |                    | %      | %                     | %                     | 百万円              |
| 2期(2019年5月10日) | 9,899  | 0                | 3.3              | 11,815             | 4.6    | 95.4                  | △3.3                  | 120              |
| 3期(2020年5月11日) | 10,142 | 10               | 2.6              | 12,321             | 4.3    | 97.3                  | △1.6                  | 842              |
| 4期(2021年5月10日) | 10,632 | 10               | 4.9              | 13,137             | 6.6    | 97.2                  | △4.8                  | 1,304            |
| 5期(2022年5月10日) | 9,049  | 0                | △14.9            | 11,289             | △14.1  | 95.7                  | △0.7                  | 1,003            |
| 6期(2023年5月10日) | 8,596  | 0                | △5.0             | 10,753             | △4.7   | 95.6                  | △0.2                  | 930              |

(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) 参考指数は、ブルームバーグ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの合成インデックス (円ヘッジベース) です。

ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社 (以下「ブルームバーグ」と総称します。) のサービスマークであり、三菱UFJ国際投信による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグの指数はブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信の関係会社ではなく、ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信が運用するファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグは、ブルームバーグの指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。合成インデックス (円ヘッジベース) は、ブルームバーグ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの各インデックス (円ヘッジベース) を委託会社が合成したものです。

(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 )<br>合 成 イ ン デ ッ ク ス<br>(円ヘッジベース) |        | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|----------------------|------------|--------|---|--------|-----------|-----------|
|                      | 騰 落 率      | 騰 落 率  | 騰 落 率                                       | 騰 落 率  |           |           |
| (期 首)<br>2022年 5月10日 | 円<br>9,049 | %<br>— | 11,289                                      | %<br>— | %<br>95.7 | %<br>△0.7 |
| 5月 末                 | 9,326      | 3.1    | 11,619                                      | 2.9    | 95.1      | △0.2      |
| 6月 末                 | 8,949      | △1.1   | 11,130                                      | △1.4   | 95.7      | 0.2       |
| 7月 末                 | 9,243      | 2.1    | 11,519                                      | 2.0    | 93.6      | △0.2      |
| 8月 末                 | 8,975      | △0.8   | 11,198                                      | △0.8   | 94.8      | 2.1       |
| 9月 末                 | 8,310      | △8.2   | 10,373                                      | △8.1   | 92.1      | 3.4       |
| 10月 末                | 8,203      | △9.3   | 10,253                                      | △9.2   | 93.5      | 2.9       |
| 11月 末                | 8,562      | △5.4   | 10,673                                      | △5.5   | 92.1      | 0.3       |
| 12月 末                | 8,538      | △5.6   | 10,667                                      | △5.5   | 93.5      | △0.2      |
| 2023年 1月 末           | 8,826      | △2.5   | 11,035                                      | △2.2   | 94.8      | △1.7      |
| 2月 末                 | 8,469      | △6.4   | 10,592                                      | △6.2   | 95.3      | △2.9      |
| 3月 末                 | 8,666      | △4.2   | 10,828                                      | △4.1   | 95.8      | △4.4      |
| 4月 末                 | 8,695      | △3.9   | 10,868                                      | △3.7   | 95.5      | 0.2       |
| (期 末)<br>2023年 5月10日 | 8,596      | △5.0   | 10,753                                      | △4.7   | 95.6      | △0.2      |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

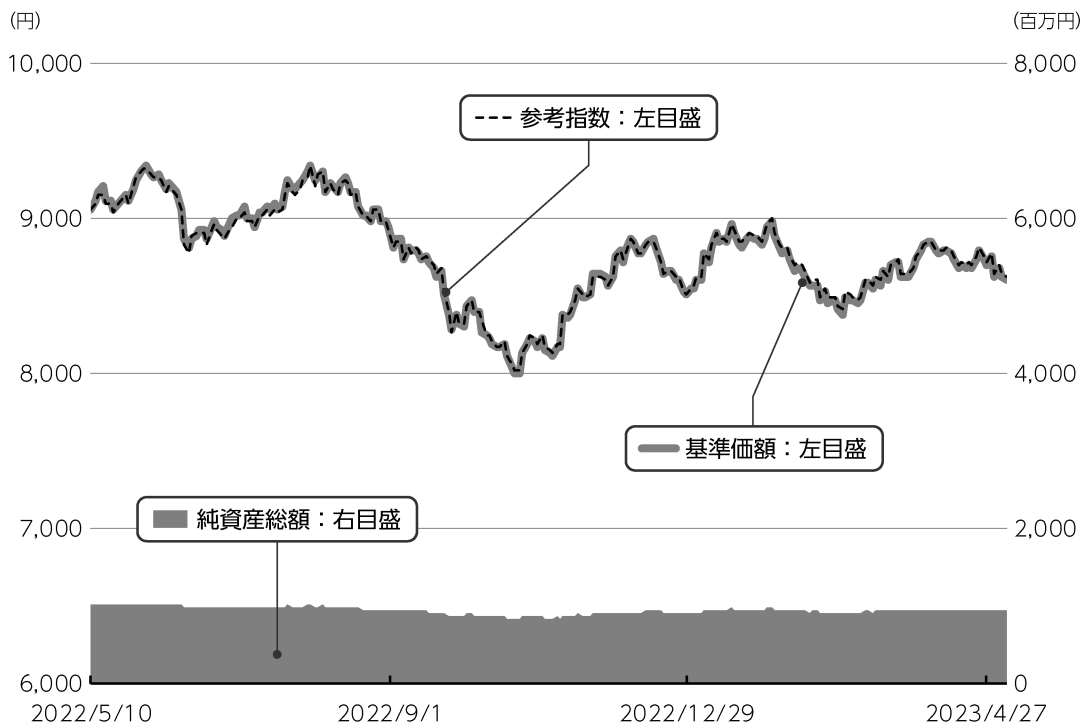
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第6期：2022年5月11日～2023年5月10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6期首  | 9,049円 |
| 第6期末  | 8,596円 |
| 既払分配金 | 0円     |
| 騰落率   | -5.0%  |

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

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

### 基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ5.0%の下落となりました。

### 基準価額の主な変動要因

#### 上昇要因

債券利子収入を享受したこと等からインフラ債券市況が上昇したこと等。

#### 下落要因

信託報酬や為替ヘッジによるコスト等。

第6期：2022年5月11日～2023年5月10日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

インフラ債券市況は小幅に上昇しました。米連邦準備制度理事会（FRB）による積極的な金融引き締め観測等を背景に金

利は上昇したものの、債券利子収入を享受したこと等からインフラ債券市況は小幅に上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ 三菱UFJ／マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>（年1回決算型）

マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れるとともに、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。

### ▶ マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

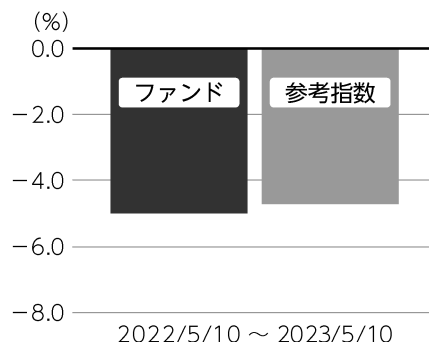
世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。

2023年3月末時点において、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については市場対比で長めとしました。格付別では投資適格の中でも相対的に利回りが高いBBB格の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別ではエネルギーを市場対比多めの配分としました。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

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。右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。参考指数は合成インデックス（円ヘッジベース）です。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



## 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6期<br>2022年5月11日～2023年5月10日 |
|----------------|------------------------------|
| 当期分配金（対基準価額比率） | -（-%）                        |
| 当期の収益          | -                            |
| 当期の収益以外        | -                            |
| 翌期繰越分配対象額      | 1,125                        |

(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／マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>（年1回決算型）

マザーファンドへの投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れるとともに、為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図る運用を行います。

### ▶ マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

今後は景気後退リスクが高まる中で主要中央銀行による金融引き締め政策の動向に注視しています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。

2022年5月11日～2023年5月10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    | 116    | 1.320   | (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 ) | (64)   | (0.726) | 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 ) | (48)   | (0.550) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価                                  |
| ( 受 託 会 社 ) | (4)    | (0.044) | 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) 売買委託手数料 | 0      | 0.005   | (b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (先物・オプション)  | (0)    | (0.005) |   |
| (c) その他費用   | 1      | 0.014   | (c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数                                     |
| ( 保 管 費 用 ) | (1)    | (0.009) | 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)    | (0.004) | 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)    | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用  |
| 合 計         | 117    | 1.339   |   |

期中の平均基準価額は、8,760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。

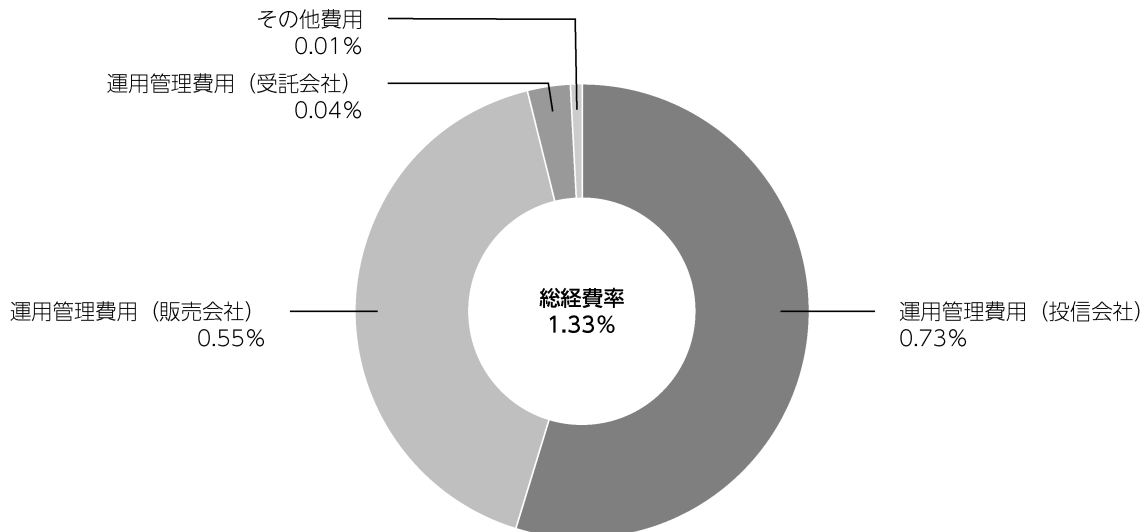
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.33%**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

(2022年5月11日～2023年5月10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            |
| マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド | 千口<br>116,704 | 千円<br>251,520 | 千口<br>167,709 | 千円<br>370,590 |

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年5月11日～2023年5月10日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;三菱UFJ/マコーリー グローバル・インフラ債券ファンド&lt;為替ヘッジあり&gt; (年1回決算型) &gt;

| 区分     | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B |          | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D |          |
|--------|---------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|----------|
|        |               |                    | B/A      |               |                    | D/C      |
| 為替先物取引 | 百万円<br>14,148 | 百万円<br>1,075       | %<br>7.6 | 百万円<br>13,981 | 百万円<br>1,150       | %<br>8.2 |

&lt;マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B |           | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況D |           |
|--------|---------------|--------------------|-----------|--------------|--------------------|-----------|
|        |               |                    | B/A       |              |                    | D/C       |
| 為替直物取引 | 百万円<br>23,628 | 百万円<br>7,764       | %<br>32.9 | 百万円<br>3,751 | 百万円<br>583         | %<br>15.5 |

平均保有割合 0.8%

※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UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2023年5月10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           |
| マコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド | 千口<br>465,332 | 千円<br>914,461 | 千口<br>414,327 | 千円<br>914,461 |

## ○投資信託財産の構成

(2023年5月10日現在)

| 項 目                        | 当 期 末         |           |
|----------------------------|---------------|-----------|
|                            | 評 価 額         | 比 率       |
| マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド | 千円<br>914,461 | %<br>96.9 |
| コール・ローン等、その他               | 29,373        | 3.1       |
| 投資信託財産総額                   | 943,834       | 100.0     |

(注) マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (125,041,909千円) の投資信託財産総額 (126,765,914千円) に対する比率は98.6%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=135.15円 |  |  |  |
|------------------|--|--|--|

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月10日現在)

| 項 目                           | 当 期 末          |
|-------------------------------|----------------|
|                               | 円              |
| (A) 資産                        | 1,839,842,876  |
| コール・ローン等                      | 29,373,209     |
| マッコーリーグローバルインフラ債券マザーファンド(詳細額) | 914,461,501    |
| 未収入金                          | 896,008,166    |
| (B) 負債                        | 909,652,053    |
| 未払金                           | 903,591,785    |
| 未払解約金                         | 45             |
| 未払信託報酬                        | 6,042,093      |
| 未払利息                          | 62             |
| その他未払費用                       | 18,068         |
| (C) 純資産総額(A-B)                | 930,190,823    |
| 元本                            | 1,082,069,231  |
| 次期繰越損益金                       | △ 151,878,408  |
| (D) 受益権総口数                    | 1,082,069,231口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)               | 8,596円         |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 1,108,545,995円  
 期中追加設定元本額 87,103,496円  
 期中一部解約元本額 113,580,260円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8596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151,878,408円です。

## ③分配金の計算過程

| 項 目                       | 2022年5月11日～<br>2023年5月10日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 28,258,391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                    | 47,284,099円               |
| 分配準備積立金額                  | 46,228,694円               |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 121,771,184円              |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 1,125円                    |
| 1万口当たり分配金額                | -円                        |
| 収益分配金総額                   | -円                        |

- ④「マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の33の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## ○損益の状況 (2022年5月11日～2023年5月10日)

| 項 目              | 当 期           |
|------------------|---------------|
|                  | 円             |
| (A) 配当等収益        | △ 11,290      |
| 受取利息             | 165           |
| 支払利息             | △ 11,455      |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 34,283,995  |
| 売買益              | 264,284,453   |
| 売買損              | △298,568,448  |
| (C) 信託報酬等        | △ 12,409,057  |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 46,704,342  |
| (E) 前期繰越損益金      | △159,968,143  |
| (F) 追加信託差損益金     | 54,794,077    |
| (配当等相当額)         | ( 47,135,076) |
| (売買損益相当額)        | ( 7,659,001)  |
| (G) 計(D+E+F)     | △151,878,408  |
| (H) 収益分配金        | 0             |
| 次期繰越損益金(G+H)     | △151,878,408  |
| 追加信託差損益金         | 54,794,077    |
| (配当等相当額)         | ( 47,284,099) |
| (売買損益相当額)        | ( 7,509,978)  |
| 分配準備積立金          | 74,487,085    |
| 繰越損益金            | △281,159,570  |

(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。

\*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 (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、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す。

## マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド

## 《第11期》決算日2023年5月10日

[計算期間：2022年5月11日～2023年5月10日]

「マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド」は、5月10日に第11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11期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | <p>世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要な不可欠なサービスを提供する企業をいいます。債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。</p> <p>組入公社債の格付けは、原則として取得時においてBBBー格相当以上の格付を有しているものに限ります。</p> <p>デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国公債等に投資する場合があります。</p> <p>債券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> |
| 主要運用対象 | 世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て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割合に制限を設けません。   |

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。Macquarie Bank Limited (以下「MBL」といいます)を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社は何れも1959年銀行法(オーストラリア連邦)上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。



## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |     | (参考指数)<br>合成インデックス<br>(円換算ベース) |     | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額    |
|-----------------|--------|-----|--------------------------------|-----|-------|--------|---------|
|                 | 騰落     | 率   | 騰落                             | 率   |       |        |         |
| 7期(2019年5月10日)  | 円      | %   |                                |     | %     | %      | 百万円     |
|                 | 17,973 | 7.5 | 18,035                         | 7.6 | 97.5  | △3.3   | 37,061  |
| 8期(2020年5月11日)  | 18,784 | 4.5 | 18,807                         | 4.3 | 98.5  | △1.6   | 64,266  |
| 9期(2021年5月10日)  | 20,440 | 8.8 | 20,539                         | 9.2 | 98.2  | △4.8   | 93,087  |
| 10期(2022年5月10日) | 21,114 | 3.3 | 21,333                         | 3.9 | 97.7  | △0.8   | 100,296 |
| 11期(2023年5月10日) | 22,071 | 4.5 | 22,226                         | 4.2 | 97.2  | △0.2   | 125,328 |

(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) 参考指数は、ブルームバーグ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの合成インデックス(円換算ベース)です。

ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)のサービスマークであり、三菱UFJ国際投信による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグの指数はブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信の関係会社ではなく、ブルームバーグは、三菱UFJ国際投信が運用するファンドを承認し、是認し、レビューしまたは推奨するものではありません。ブルームバーグは、ブルームバーグの指数に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。合成インデックス(円換算ベース)は、ブルームバーグ米国社債インデックスの公益、通信、エネルギー、運輸セクターの各インデックス(米ドルベース)を合成したものをもとに、委託会社が計算したものです。

(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)<br>合成インデックス<br>(円換算ベース) |      | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|------|--------------------------------|------|-------|--------|
|                    | 騰落     | 率    | 騰落                             | 率    |       |        |
| (期首)<br>2022年5月10日 | 円      | %    |                                |      | %     | %      |
|                    | 21,114 | —    | 21,333                         | —    | 97.7  | △0.8   |
| 5月末                | 21,500 | 1.8  | 21,664                         | 1.6  | 95.8  | △0.2   |
| 6月末                | 22,019 | 4.3  | 22,204                         | 4.1  | 96.1  | 0.2    |
| 7月末                | 22,485 | 6.5  | 22,668                         | 6.3  | 96.5  | △0.2   |
| 8月末                | 22,561 | 6.9  | 22,782                         | 6.8  | 96.0  | 2.1    |
| 9月末                | 21,889 | 3.7  | 22,172                         | 3.9  | 93.1  | 3.4    |
| 10月末               | 22,218 | 5.2  | 22,507                         | 5.5  | 94.4  | 2.9    |
| 11月末               | 21,877 | 3.6  | 22,089                         | 3.5  | 94.8  | 0.3    |
| 12月末               | 20,977 | △0.6 | 21,183                         | △0.7 | 95.3  | △0.2   |
| 2023年1月末           | 21,476 | 1.7  | 21,641                         | 1.4  | 96.3  | △1.8   |
| 2月末                | 21,617 | 2.4  | 21,833                         | 2.3  | 96.7  | △2.9   |
| 3月末                | 21,824 | 3.4  | 21,977                         | 3.0  | 96.5  | △4.4   |
| 4月末                | 22,112 | 4.7  | 22,258                         | 4.3  | 96.3  | 0.2    |
| (期末)<br>2023年5月10日 | 22,071 | 4.5  | 22,226                         | 4.2  | 97.2  | △0.2   |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

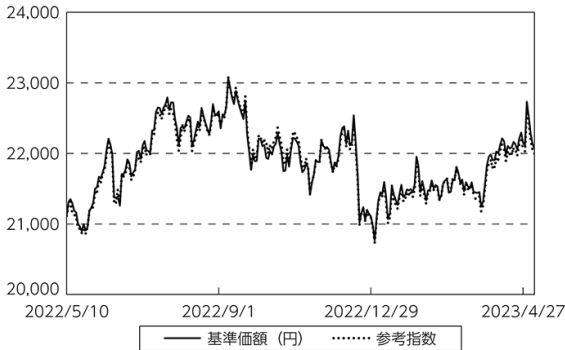
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ4.5%の上昇となりました。

基準価額等の推移



(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。

## ●基準価額の主な変動要因

## (上昇要因)

- ・債券利子収入を享受したこと等からインフラ債券市況が上昇したこと。
- ・米ドルが対円で上昇したこと。

## ●投資環境について

## ◎債券市況

- ・インフラ債券市況は小幅に上昇しました。
- ・米連邦準備制度理事会（FRB）による積極的な金融引き締め観測等を背景に金利は上昇したものの、債券利子収入を享受したこと等からインフラ債券市況は小幅に上昇しました。

## ◎為替市況

- ・米ドルは対円で上昇しました。
- ・FRBによる積極的な金融引き締め姿勢等を背景に日米短期金利差が拡大したこと等から、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

- ・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・2023年3月末時点において、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については市場対比で長めとしました。格付別では投資適格の中でも相対的に利回りが高いBBB格の組入比率を市場対比多めとしました。セクター別ではエネルギーを市場対比多めの配分としました。

## ○今後の運用方針

- ・今後は景気後退リスクが高まる中で主要中央銀行による金融引き締め政策の動向に注視しています。そのような環境下、銘柄選択については、格付け動向に注視しながらクオリティの高い銘柄を中心に投資を行う方針です。デュレーションについては、適宜債券先物を活用しつつ、状況に応じて機動的に対応します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2022年5月11日～2023年5月10日)

| 項 目                                       | 当 期             |                             | 項 目 の 概 要   |
|---|-----------------|-----------------------------|---|
|   | 金 額             | 比 率                         |   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>(先物・オプション)           | 円<br>1<br>(1)   | %<br>0.005<br>(0.005)       | (a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (b) そ の 他 費 用<br>( 保 管 費 用 )<br>( そ の 他 ) | 2<br>(2)<br>(0) | 0.009<br>(0.009)<br>(0.000) | (b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>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<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計                                       | 3               | 0.014                       |   |
| 期中の平均基準価額は、21,896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

(2022年5月11日～2023年5月10日)

## 公社債

|     |      |     | 買 付 額              | 売 付 額                        |
|-----|------|-----|--------------------|------------------------------|
| 外 国 | アメリカ | 社債券 | 千アメリカドル<br>372,706 | 千アメリカドル<br>198,608<br>( 390) |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 |        | 買 建           |               | 売 建           |               |
|-------|--------|---------------|---------------|---------------|---------------|
|       |        | 新規買付額         | 決 済 額         | 新規売付額         | 決 済 額         |
| 外 国   | 債券先物取引 | 百万円<br>86,313 | 百万円<br>89,206 | 百万円<br>73,269 | 百万円<br>77,102 |

(注) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年5月11日～2023年5月10日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$<br>% | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$<br>% |
|--------|---------------|--------------------|--------------------|--------------|--------------------|--------------------|
|        |               |                    |                    |              |                    |                    |
| 為替直物取引 | 百万円<br>23,628 | 百万円<br>7,764       | 32.9               | 百万円<br>3,751 | 百万円<br>583         | 15.5               |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2023年5月10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<br>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<br>1,003,814 | 千アメリカドル<br>901,741 | 千円<br>121,870,323 | %<br>97.2 | %<br>—          | %<br>81.3 | %<br>12.7 | %<br>3.2 |
| 合 計  | 1,003,814            | 901,741            | 121,870,323       | 97.2      | —               | 81.3      | 12.7      | 3.2      |

(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<br>額面金額 | 期 末     |           | 償還年月日      |
|------|--------------------------|-------|-----------|---------|-----------|------------|
|      |                          |       |           | 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        |            |
|      | 普通社債券                    |       |           |         |           |            |
|      | 0.95 NISOURCE INC 250815 | 0.95  | 2,000     | 1,831   | 247,513   | 2025/8/15  |
|      | 1.749 BP CAP MARK 300810 | 1.749 | 3,500     | 2,897   | 391,583   | 2030/8/10  |
|      | 1.75 XCEL ENERGY 270315  | 1.75  | 2,000     | 1,808   | 244,422   | 2027/3/15  |
|      | 2 KINDER MORGAN I 310215 | 2.0   | 1,800     | 1,439   | 194,481   | 2031/2/15  |
|      | 2.236 CHEVRON COR 300511 | 2.236 | 1,000     | 883     | 119,406   | 2030/5/11  |
|      | 2.25 AT&T INC 320201     | 2.25  | 5,500     | 4,424   | 597,963   | 2032/2/1   |
|      | 2.25 NEXTERA ENER 300601 | 2.25  | 3,000     | 2,517   | 340,198   | 2030/6/1   |
|      | 2.3 AMERICAN ELEC 300301 | 2.3   | 2,000     | 1,684   | 227,724   | 2030/3/1   |
|      | 2.3 AMERICAN TOWE 310915 | 2.3   | 1,000     | 801     | 108,278   | 2031/9/15  |
|      | 2.343 CHEVRON USA 500812 | 2.343 | 2,000     | 1,258   | 170,141   | 2050/8/12  |
|      | 2.4 CONOCOPHILLIP 250307 | 2.4   | 10,200    | 9,822   | 1,327,574 | 2025/3/7   |
|      | 2.4 VIRGINIA ELEC 320330 | 2.4   | 4,000     | 3,313   | 447,861   | 2032/3/30  |
|      | 2.45 COMCAST CORP 520815 | 2.45  | 1,000     | 597     | 80,739    | 2052/8/15  |
|      | 2.55 AT&T INC 331201     | 2.55  | 2,856     | 2,257   | 305,087   | 2033/12/1  |
|      | 2.55 T-MOBILE USA 310215 | 2.55  | 2,500     | 2,096   | 283,313   | 2031/2/15  |
|      | 2.6 CSX CORP 261101      | 2.6   | 3,000     | 2,827   | 382,168   | 2026/11/1  |
|      | 2.65 CENOVUS ENER 320115 | 2.65  | 1,500     | 1,224   | 165,542   | 2032/1/15  |
|      | 2.65 CENTERPOINT 310601  | 2.65  | 1,000     | 845     | 114,266   | 2031/6/1   |
|      | 2.65 VERIZON COMM 401120 | 2.65  | 6,000     | 4,162   | 562,508   | 2040/11/20 |
|      | 2.65 WALT DISNEY 310113  | 2.65  | 2,500     | 2,193   | 296,435   | 2031/1/13  |
|      | 2.75 AMERICAN TOW 270115 | 2.75  | 2,500     | 2,314   | 312,851   | 2027/1/15  |
|      | 2.75 NEXTERA ENER 291101 | 2.75  | 5,000     | 4,468   | 603,867   | 2029/11/1  |
|      | 2.75 SHELL INTERN 300406 | 2.75  | 6,000     | 5,436   | 734,692   | 2030/4/6   |
|      | 2.772 BP CAP MARK 501110 | 2.772 | 1,000     | 650     | 87,851    | 2050/11/10 |
|      | 2.8 CHARTER COMM 310401  | 2.8   | 3,500     | 2,805   | 379,163   | 2031/4/1   |
|      | 2.8 ENTERGY CORP 300615  | 2.8   | 8,200     | 7,127   | 963,231   | 2030/6/15  |
|      | 2.8 ENTERPRISE PR 300131 | 2.8   | 6,500     | 5,734   | 775,007   | 2030/1/31  |
|      | 2.8 VALERO ENERGY 311201 | 2.8   | 7,000     | 5,814   | 785,839   | 2031/12/1  |
|      | 2.85 BERKSHIRE HA 510515 | 2.85  | 1,000     | 665     | 89,877    | 2051/5/15  |
|      | 2.85 DOMINION ENE 260815 | 2.85  | 500       | 470     | 63,568    | 2026/8/15  |
|      | 2.85 SOUTHERN CAL 290801 | 2.85  | 1,000     | 901     | 121,803   | 2029/8/1   |
|      | 2.875 VERIZON COM 501120 | 2.875 | 2,000     | 1,280   | 173,050   | 2050/11/20 |
|      | 2.887 COMCAST COR 511101 | 2.887 | 7,656     | 5,011   | 677,255   | 2051/11/1  |
|      | 2.891 UNION PACIF 360406 | 2.891 | 4,000     | 3,264   | 441,137   | 2036/4/6   |
|      | 2.9 CENTERPOINT E 500701 | 2.9   | 2,500     | 1,699   | 229,716   | 2050/7/1   |
|      | 2.92 HALLIBURTON 300301  | 2.92  | 2,000     | 1,777   | 240,273   | 2030/3/1   |
|      | 2.937 COMCAST COR 561101 | 2.937 | 10,412    | 6,622   | 894,993   | 2056/11/1  |
|      | 2.95 CANADIAN NAT 300715 | 2.95  | 5,000     | 4,349   | 587,845   | 2030/7/15  |
|      | 2.95 CENTERPOINT 300301  | 2.95  | 1,000     | 879     | 118,886   | 2030/3/1   |
|      | 2.95 NATIONAL FUE 310301 | 2.95  | 3,000     | 2,412   | 326,044   | 2031/3/1   |
|      | 2.95 NISOURCE INC 290901 | 2.95  | 4,000     | 3,581   | 484,050   | 2029/9/1   |
|      | 2.973 UNION PACIF 620916 | 2.973 | 2,000     | 1,281   | 173,159   | 2062/9/16  |
|      | 2.992 EXXON MOBIL 250319 | 2.992 | 2,500     | 2,435   | 329,213   | 2025/3/19  |
|      | 3 NEXTERA ENERGY 520115  | 3.0   | 1,000     | 657     | 88,903    | 2052/1/15  |

| 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    |            |
|      |                          | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円        |            |
| アメリカ | 普通社債券                    |       |         |         |           |            |
|      | 3 T-MOBILE USA IN 410215 | 3.0   | 2,000   | 1,440   | 194,732   | 2041/2/15  |
|      | 3.001 BP CAP MARK 520317 | 3.001 | 2,500   | 1,682   | 227,365   | 2052/3/17  |
|      | 3.05 ALABAMA POWE 320315 | 3.05  | 2,000   | 1,763   | 238,388   | 2032/3/15  |
|      | 3.05 BURLINGTN NO 510215 | 3.05  | 1,000   | 705     | 95,283    | 2051/2/15  |
|      | 3.05 NORFOLK SOUT 500515 | 3.05  | 1,000   | 673     | 91,041    | 2050/5/15  |
|      | 3.06 BP CAP MARKE 410617 | 3.06  | 2,000   | 1,504   | 203,395   | 2041/6/17  |
|      | 3.095 EXXON MOBIL 490816 | 3.095 | 2,000   | 1,444   | 195,252   | 2049/8/16  |
|      | 3.125 ALABAMA POW 510715 | 3.125 | 2,000   | 1,363   | 184,288   | 2051/7/15  |
|      | 3.125 COMMONWEAL 510315  | 3.125 | 1,000   | 699     | 94,484    | 2051/3/15  |
|      | 3.125 ENBRIDGE IN 291115 | 3.125 | 1,000   | 904     | 122,195   | 2029/11/15 |
|      | 3.125 ENTERPRISE 290731  | 3.125 | 6,000   | 5,475   | 740,059   | 2029/7/31  |
|      | 3.15 COMMONWEALTH 320315 | 3.15  | 5,500   | 4,912   | 663,878   | 2032/3/15  |
|      | 3.15 FLORIDA POWE 491001 | 3.15  | 1,000   | 724     | 97,963    | 2049/10/1  |
|      | 3.15 PACIFIC GAS 260101  | 3.15  | 500     | 471     | 63,695    | 2026/1/1   |
|      | 3.15 SOUTHWESTERN 500501 | 3.15  | 1,000   | 699     | 94,508    | 2050/5/1   |
|      | 3.15 VERIZON COMM 300322 | 3.15  | 1,000   | 898     | 121,442   | 2030/3/22  |
|      | 3.2 CON EDISON CO 511201 | 3.2   | 5,000   | 3,460   | 467,685   | 2051/12/1  |
|      | 3.25 CHEVRON USA 291015  | 3.25  | 4,500   | 4,255   | 575,163   | 2029/10/15 |
|      | 3.25 CROWN CASTLE 510115 | 3.25  | 2,500   | 1,651   | 223,240   | 2051/1/15  |
|      | 3.25 DUKE ENERGY 491001  | 3.25  | 2,000   | 1,421   | 192,144   | 2049/10/1  |
|      | 3.25 FEDEX CORP 410515   | 3.25  | 2,000   | 1,494   | 201,976   | 2041/5/15  |
|      | 3.25 SHELL INTERN 500406 | 3.25  | 3,000   | 2,201   | 297,550   | 2050/4/6   |
|      | 3.3 AT&T INC 520201      | 3.3   | 1,000   | 689     | 93,238    | 2052/2/1   |
|      | 3.3 COMCAST CORP 270401  | 3.3   | 2,300   | 2,212   | 298,952   | 2027/4/1   |
|      | 3.3 CROWN CASTLE 300701  | 3.3   | 3,000   | 2,685   | 362,919   | 2030/7/1   |
|      | 3.3 DOMINION ENER 410415 | 3.3   | 2,000   | 1,499   | 202,674   | 2041/4/15  |
|      | 3.3 KENTUCKY UTIL 500601 | 3.3   | 1,000   | 708     | 95,747    | 2050/6/1   |
|      | 3.3 VIRGINIA ELEC 491201 | 3.3   | 1,000   | 718     | 97,067    | 2049/12/1  |
|      | 3.32 SAN DIEGO G 500415  | 3.32  | 2,000   | 1,442   | 194,943   | 2050/4/15  |
|      | 3.337 BAKER HUGHE 271215 | 3.337 | 4,500   | 4,254   | 575,037   | 2027/12/15 |
|      | 3.35 CSX CORP 251101     | 3.35  | 250     | 242     | 32,829    | 2025/11/1  |
|      | 3.35 ENTERGY ARKA 520615 | 3.35  | 3,000   | 2,153   | 291,022   | 2052/6/15  |
|      | 3.375 DOMINION EN 300401 | 3.375 | 6,000   | 5,415   | 731,945   | 2030/4/1   |
|      | 3.4 DTE ENERGY CO 290615 | 3.4   | 8,396   | 7,712   | 1,042,396 | 2029/6/15  |
|      | 3.4 DUKE ENERGY C 290615 | 3.4   | 4,000   | 3,703   | 500,525   | 2029/6/15  |
|      | 3.4 DUKE ENERGY F 461001 | 3.4   | 1,000   | 754     | 101,992   | 2046/10/1  |
|      | 3.4 NORTHERN STAT 420815 | 3.4   | 1,000   | 791     | 106,929   | 2042/8/15  |
|      | 3.4 XCEL ENERGY I 300601 | 3.4   | 1,000   | 912     | 123,318   | 2030/6/1   |
|      | 3.45 ALABAMA POWE 491001 | 3.45  | 2,000   | 1,462   | 197,603   | 2049/10/1  |
|      | 3.482 EXXON MOBIL 300319 | 3.482 | 2,000   | 1,903   | 257,287   | 2030/3/19  |
|      | 3.5 AT&T INC 410601      | 3.5   | 7,000   | 5,368   | 725,613   | 2041/6/1   |
|      | 3.5 AT&T INC 530915      | 3.5   | 9,416   | 6,510   | 879,868   | 2053/9/15  |
|      | 3.5 BERKSHIRE HAT 250201 | 3.5   | 500     | 489     | 66,125    | 2025/2/1   |
|      | 3.5 CANADIAN PACI 500501 | 3.5   | 2,000   | 1,508   | 203,874   | 2050/5/1   |
|      | 3.5 FOX CORP 300408      | 3.5   | 3,000   | 2,707   | 365,863   | 2030/4/8   |

| 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    |           |            |
|                          |       | %                        | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円        |           |            |
| アメリカ                     | 普通社債券 | 3.5 NEXTERA ENERG 290401 | 3.5     | 7,500   | 7,042     | 951,842   | 2029/4/1   |
|                          |       | 3.5 PIEDMONT NATU 290601 | 3.5     | 1,500   | 1,399     | 189,076   | 2029/6/1   |
|                          |       | 3.5 SPECTRA ENERG 250315 | 3.5     | 350     | 339       | 45,936    | 2025/3/15  |
|                          |       | 3.5 T-MOBILE USA 310415  | 3.5     | 10,500  | 9,373     | 1,266,872 | 2031/4/15  |
|                          |       | 3.5 WALT DISNEY C 400513 | 3.5     | 3,000   | 2,489     | 336,425   | 2040/5/13  |
|                          |       | 3.5 WILLIAMS COMP 301115 | 3.5     | 2,000   | 1,809     | 244,500   | 2030/11/15 |
|                          |       | 3.55 AT&T INC 550915     | 3.55    | 7,000   | 4,786     | 646,921   | 2055/9/15  |
|                          |       | 3.55 ENTERGY TEXA 490930 | 3.55    | 1,000   | 735       | 99,416    | 2049/9/30  |
|                          |       | 3.55 PLAINS ALL A 291215 | 3.55    | 3,000   | 2,698     | 364,696   | 2029/12/15 |
|                          |       | 3.6 NORTHERN STAT 470915 | 3.6     | 2,000   | 1,591     | 215,089   | 2047/9/15  |
|                          |       | 3.625 DISCOVERY C 300515 | 3.625   | 1,500   | 1,317     | 178,100   | 2030/5/15  |
|                          |       | 3.633 BP CAP MARK 300406 | 3.633   | 7,000   | 6,607     | 892,956   | 2030/4/6   |
|                          |       | 3.65 AT&T INC 510601     | 3.65    | 3,000   | 2,160     | 292,053   | 2051/6/1   |
|                          |       | 3.65 AT&T INC 590915     | 3.65    | 1,462   | 995       | 134,534   | 2059/9/15  |
|                          |       | 3.65 DTE ELECTRIC 520301 | 3.65    | 1,500   | 1,172     | 158,474   | 2052/3/1   |
|                          |       | 3.65 MIDAMERICAN 480801  | 3.65    | 2,000   | 1,599     | 216,234   | 2048/8/1   |
|                          |       | 3.65 SOUTHERN CAL 280301 | 3.65    | 3,000   | 2,870     | 388,010   | 2028/3/1   |
|                          |       | 3.65 WOODSIDE FI 250305  | 3.65    | 4,800   | 4,674     | 631,741   | 2025/3/5   |
|                          |       | 3.7 ALABAMA POWER 471201 | 3.7     | 1,000   | 776       | 104,894   | 2047/12/1  |
|                          |       | 3.7 CENTERPOINT E 490901 | 3.7     | 4,000   | 2,997     | 405,152   | 2049/9/1   |
|                          |       | 3.7 DTE ELECTRIC 450315  | 3.7     | 2,000   | 1,616     | 218,432   | 2045/3/15  |
|                          |       | 3.7 FLORIDA POWER 471201 | 3.7     | 1,000   | 811       | 109,635   | 2047/12/1  |
|                          |       | 3.7 GEORGIA POWER 500130 | 3.7     | 3,000   | 2,270     | 306,884   | 2050/1/30  |
|                          |       | 3.7 ONCOR ELECTRI 500515 | 3.7     | 1,000   | 801       | 108,286   | 2050/5/15  |
|                          |       | 3.7 SOUTHERN CO 300430   | 3.7     | 2,000   | 1,854     | 250,659   | 2030/4/30  |
|                          |       | 3.7 WALT DISNEY C 270323 | 3.7     | 3,000   | 2,948     | 398,551   | 2027/3/23  |
|                          |       | 3.75 AEP TRANSMIS 471201 | 3.75    | 1,000   | 799       | 108,082   | 2047/12/1  |
|                          |       | 3.75 COMCAST CORP 400401 | 3.75    | 6,000   | 5,046     | 681,973   | 2040/4/1   |
|                          |       | 3.75 DTE ELECTRIC 470815 | 3.75    | 1,000   | 796       | 107,693   | 2047/8/15  |
|                          |       | 3.75 DUKE ENERGY 460515  | 3.75    | 3,000   | 2,367     | 319,969   | 2046/5/15  |
|                          |       | 3.75 DUKE ENERGY 460901  | 3.75    | 5,500   | 4,197     | 567,230   | 2046/9/1   |
|                          |       | 3.75 ENERGY TRANS 300515 | 3.75    | 9,000   | 8,192     | 1,107,253 | 2030/5/15  |
|                          |       | 3.75 ENTERPRISE P 250215 | 3.75    | 500     | 492       | 66,628    | 2025/2/15  |
|                          |       | 3.75 PACIFIC GAS 280701  | 3.75    | 3,500   | 3,219     | 435,096   | 2028/7/1   |
|                          |       | 3.75 T-MOBILE USA 270415 | 3.75    | 4,500   | 4,314     | 583,106   | 2027/4/15  |
|                          |       | 3.758 CONOCOPHILL 420315 | 3.758   | 2,300   | 1,921     | 259,681   | 2042/3/15  |
|                          |       | 3.8 AEP TRANSMISS 490615 | 3.8     | 1,500   | 1,212     | 163,858   | 2049/6/15  |
|                          |       | 3.8 AMERICAN TOWE 290815 | 3.8     | 2,000   | 1,864     | 252,025   | 2029/8/15  |
|                          |       | 3.8 BERKSHIRE HAT 480715 | 3.8     | 1,000   | 792       | 107,166   | 2048/7/15  |
|                          |       | 3.8 CROWN CASTLE 280215  | 3.8     | 1,000   | 954       | 128,988   | 2028/2/15  |
| 3.8 ONCOR ELECTRI 470930 | 3.8   | 1,000                    | 805     | 108,919 | 2047/9/30 |           |            |
| 3.8 PLAINS ALL AM 300915 | 3.8   | 8,000                    | 7,118   | 961,999 | 2030/9/15 |           |            |
| 3.8 ROGERS COMMUN 320315 | 3.8   | 2,500                    | 2,222   | 300,378 | 2032/3/15 |           |            |
| 3.8 SEMPRA ENERGY 380201 | 3.8   | 1,000                    | 863     | 116,690 | 2038/2/1  |           |            |
| 3.8 VIRGINIA ELEC 470915 | 3.8   | 2,500                    | 1,939   | 262,102 | 2047/9/15 |           |            |

| 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    |            |
|      |                          | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円        |            |
| アメリカ | 普通社債券                    | 3.8   | 1,750   | 1,676   | 226,576   | 2030/3/22  |
|      | 3.839 UNION PACIF 600320 | 3.839 | 2,050   | 1,606   | 217,175   | 2060/3/20  |
|      | 3.85 CANADIAN NAT 270601 | 3.85  | 8,000   | 7,679   | 1,037,925 | 2027/6/1   |
|      | 3.85 CHEVRON USA 280115  | 3.85  | 1,000   | 997     | 134,775   | 2028/1/15  |
|      | 3.85 KANSAS CITY 231115  | 3.85  | 1,500   | 1,486   | 200,846   | 2023/11/15 |
|      | 3.85 META PLATFOR 320815 | 3.85  | 4,000   | 3,717   | 502,467   | 2032/8/15  |
|      | 3.85 SOUTHWESTERN 480201 | 3.85  | 1,000   | 756     | 102,200   | 2048/2/1   |
|      | 3.875 SHELL INTER 281113 | 3.875 | 3,000   | 2,957   | 399,732   | 2028/11/13 |
|      | 3.875 T-MOBILE US 300415 | 3.875 | 14,000  | 12,989  | 1,755,585 | 2030/4/15  |
|      | 3.9 BURLINGTN NOR 460801 | 3.9   | 2,000   | 1,664   | 224,893   | 2046/8/1   |
|      | 3.9 FEDEX CORP 350201    | 3.9   | 500     | 445     | 60,252    | 2035/2/1   |
|      | 3.9 WILLIAMS PART 250115 | 3.9   | 3,000   | 2,944   | 397,953   | 2025/1/15  |
|      | 3.942 NORFOLK SOU 471101 | 3.942 | 1,000   | 800     | 108,131   | 2047/11/1  |
|      | 3.95 AMERICAN TOW 290315 | 3.95  | 1,000   | 943     | 127,496   | 2029/3/15  |
|      | 3.95 CSX CORP 500501     | 3.95  | 1,000   | 803     | 108,620   | 2050/5/1   |
|      | 3.95 DISCOVERY CO 280320 | 3.95  | 9,900   | 9,210   | 1,244,854 | 2028/3/20  |
|      | 3.95 DUKE ENERGY 480315  | 3.95  | 2,000   | 1,637   | 221,291   | 2048/3/15  |
|      | 3.95 FLORIDA POWE 480301 | 3.95  | 3,000   | 2,520   | 340,603   | 2048/3/1   |
|      | 3.95 MISSISSIPPI 280330  | 3.95  | 2,000   | 1,929   | 260,837   | 2028/3/30  |
|      | 3.95 NISOURCE INC 480330 | 3.95  | 3,000   | 2,393   | 323,436   | 2048/3/30  |
|      | 3.969 COMCAST COR 471101 | 3.969 | 1,402   | 1,142   | 154,431   | 2047/11/1  |
|      | 3.999 COMCAST COR 491101 | 3.999 | 725     | 588     | 79,590    | 2049/11/1  |
|      | 4 CANADIAN PACIFI 280601 | 4.0   | 1,000   | 979     | 132,436   | 2028/6/1   |
|      | 4 DISCOVERY COMMU 550915 | 4.0   | 2,500   | 1,589   | 214,888   | 2055/9/15  |
|      | 4 ENBRIDGE INC 491115    | 4.0   | 1,000   | 753     | 101,903   | 2049/11/15 |
|      | 4 SEMPRA ENERGY 480201   | 4.0   | 5,500   | 4,312   | 582,795   | 2048/2/1   |
|      | 4 SOUTHERN CAL ED 470401 | 4.0   | 4,000   | 3,186   | 430,717   | 2047/4/1   |
|      | 4.025 CONOCOPHILL 620315 | 4.025 | 3,650   | 2,905   | 392,717   | 2062/3/15  |
|      | 4.05 AMERICAN TOW 320315 | 4.05  | 2,500   | 2,291   | 309,660   | 2032/3/15  |
|      | 4.05 UNION PACIFI 460301 | 4.05  | 2,000   | 1,692   | 228,741   | 2046/3/1   |
|      | 4.1 AT&T INC 280215      | 4.1   | 4,000   | 3,900   | 527,196   | 2028/2/15  |
|      | 4.1 CENTERPOINT E 470901 | 4.1   | 1,000   | 825     | 111,525   | 2047/9/1   |
|      | 4.1 CSX CORP 440315      | 4.1   | 150     | 129     | 17,540    | 2044/3/15  |
|      | 4.1 DUKE ENERGY P 420515 | 4.1   | 2,500   | 2,136   | 288,761   | 2042/5/15  |
|      | 4.1 PUBLIC SERVIC 320601 | 4.1   | 2,000   | 1,919   | 259,417   | 2032/6/1   |
|      | 4.114 EXXON MOBIL 460301 | 4.114 | 3,000   | 2,616   | 353,554   | 2046/3/1   |
|      | 4.125 CON EDISON 490515  | 4.125 | 2,000   | 1,634   | 220,876   | 2049/5/15  |
|      | 4.125 SOUTHERN CA 480301 | 4.125 | 1,000   | 811     | 109,678   | 2048/3/1   |
|      | 4.125 VERIZON COM 270316 | 4.125 | 3,000   | 2,965   | 400,823   | 2027/3/16  |
|      | 4.15 BURLINGTN NO 450401 | 4.15  | 4,000   | 3,500   | 473,076   | 2045/4/1   |
|      | 4.15 COMCAST CORP 281015 | 4.15  | 1,150   | 1,134   | 153,328   | 2028/10/15 |
|      | 4.15 ENABLE MIDST 290915 | 4.15  | 4,000   | 3,808   | 514,773   | 2029/9/15  |
|      | 4.15 NORFOLK SOUT 480228 | 4.15  | 2,500   | 2,060   | 278,447   | 2048/2/28  |
|      | 4.15 PPL ELECTRIC 480615 | 4.15  | 4,000   | 3,466   | 468,525   | 2048/6/15  |
|      | 4.2 CANADIAN PACI 691115 | 4.2   | 1,000   | 793     | 107,262   | 2069/11/15 |



| 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    |            |
|      |                          | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円        |            |
| アメリカ | 普通社債券                    |       |         |         |           |            |
|      | 4.2 DUKE ENERGY C 490615 | 4.2   | 3,000   | 2,397   | 323,971   | 2049/6/15  |
|      | 4.2 DUKE ENERGY F 480715 | 4.2   | 3,500   | 2,973   | 401,928   | 2048/7/15  |
|      | 4.2 PACIFIC GAS & 410601 | 4.2   | 3,000   | 2,282   | 308,413   | 2041/6/1   |
|      | 4.2 SABINE PASS L 280315 | 4.2   | 1,000   | 963     | 130,226   | 2028/3/15  |
|      | 4.2 SOUTHERN CAL 290301  | 4.2   | 2,000   | 1,950   | 263,591   | 2029/3/1   |
|      | 4.2 VIACOMCBS INC 320519 | 4.2   | 2,000   | 1,657   | 223,995   | 2032/5/19  |
|      | 4.227 EXXON MOBIL 400319 | 4.227 | 3,000   | 2,757   | 372,646   | 2040/3/19  |
|      | 4.25 CENTERPOINT 281101  | 4.25  | 592     | 567     | 76,727    | 2028/11/1  |
|      | 4.25 COMCAST CORP 301015 | 4.25  | 7,500   | 7,340   | 992,102   | 2030/10/15 |
|      | 4.25 INDIANA MICH 480815 | 4.25  | 2,500   | 2,102   | 284,121   | 2048/8/15  |
|      | 4.25 MISSISSIPPI 420315  | 4.25  | 2,000   | 1,683   | 227,491   | 2042/3/15  |
|      | 4.25 SOUTHERN CO 360701  | 4.25  | 3,450   | 3,148   | 425,573   | 2036/7/1   |
|      | 4.279 WARNERMEDIA 320315 | 4.279 | 2,000   | 1,760   | 237,967   | 2032/3/15  |
|      | 4.3 AMERICAN ELEC 281201 | 4.3   | 8,000   | 7,861   | 1,062,458 | 2028/12/1  |
|      | 4.3 AT&T INC 300215      | 4.3   | 2,000   | 1,923   | 259,893   | 2030/2/15  |
|      | 4.3 CONOCOPHILLIP 441115 | 4.3   | 1,000   | 882     | 119,224   | 2044/11/15 |
|      | 4.3 CSX CORP 480301      | 4.3   | 6,000   | 5,162   | 697,774   | 2048/3/1   |
|      | 4.3 KINDER MORGAN 280301 | 4.3   | 4,000   | 3,921   | 530,029   | 2028/3/1   |
|      | 4.35 AT&T INC 290301     | 4.35  | 13,000  | 12,706  | 1,717,247 | 2029/3/1   |
|      | 4.375 KENTUCKY UT 451001 | 4.375 | 1,000   | 857     | 115,894   | 2045/10/1  |
|      | 4.375 SHELL INTER 450511 | 4.375 | 2,950   | 2,657   | 359,140   | 2045/5/11  |
|      | 4.375 T-MOBILE US 400415 | 4.375 | 2,000   | 1,754   | 237,158   | 2040/4/15  |
|      | 4.4 ENERGY TRANSF 270315 | 4.4   | 2,000   | 1,938   | 261,954   | 2027/3/15  |
|      | 4.4 MARATHON OIL 270715  | 4.4   | 1,250   | 1,212   | 163,837   | 2027/7/15  |
|      | 4.4 SOUTHERN CO 460701   | 4.4   | 3,250   | 2,766   | 373,907   | 2046/7/1   |
|      | 4.45 BERKSHIRE HA 490115 | 4.45  | 1,000   | 875     | 118,307   | 2049/1/15  |
|      | 4.45 BURLINGTN NO 530115 | 4.45  | 1,000   | 907     | 122,611   | 2053/1/15  |
|      | 4.45 ENTERPRISE P 430215 | 4.45  | 1,000   | 865     | 116,921   | 2043/2/15  |
|      | 4.45 EXELON CORP 460415  | 4.45  | 3,100   | 2,649   | 358,118   | 2046/4/15  |
|      | 4.5 APPALACHIAN P 320801 | 4.5   | 2,000   | 1,917   | 259,108   | 2032/8/1   |
|      | 4.5 APPALACHIAN P 490301 | 4.5   | 1,000   | 843     | 114,040   | 2049/3/1   |
|      | 4.5 AT&T INC 350515      | 4.5   | 5,050   | 4,682   | 632,858   | 2035/5/15  |
|      | 4.5 AT&T INC 480309      | 4.5   | 3,386   | 2,830   | 382,572   | 2048/3/9   |
|      | 4.5 BERKSHIRE HAT 450201 | 4.5   | 1,250   | 1,113   | 150,480   | 2045/2/1   |
|      | 4.5 CON EDISON CO 580515 | 4.5   | 2,000   | 1,681   | 227,236   | 2058/5/15  |
|      | 4.5 ENTERGY TEXAS 390330 | 4.5   | 1,000   | 909     | 122,920   | 2039/3/30  |
|      | 4.5 PACIFIC GAS & 400701 | 4.5   | 3,500   | 2,758   | 372,831   | 2040/7/1   |
|      | 4.5 PUBLIC SERVIC 520601 | 4.5   | 2,000   | 1,792   | 242,266   | 2052/6/1   |
|      | 4.5 SABINE PASS L 300515 | 4.5   | 5,000   | 4,775   | 645,413   | 2030/5/15  |
|      | 4.5 TRANSURBAN QL 280419 | 4.5   | 3,300   | 3,171   | 428,688   | 2028/4/19  |
|      | 4.5 VERIZON COMMU 330810 | 4.5   | 2,500   | 2,378   | 321,515   | 2033/8/10  |
|      | 4.522 VERIZON COM 480915 | 4.522 | 3,424   | 2,982   | 403,045   | 2048/9/15  |
|      | 4.55 FEDEX CORP 460401   | 4.55  | 4,000   | 3,401   | 459,655   | 2046/4/1   |
|      | 4.55 NORFOLK SOUT 530601 | 4.55  | 2,000   | 1,753   | 236,946   | 2053/6/1   |
|      | 4.55 ONEOK INC 280715    | 4.55  | 6,000   | 5,859   | 791,853   | 2028/7/15  |

| 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    |            |
|      |                          | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円        |            |
| アメリカ | 普通社債券                    | 4.55  | 1,000   | 793     | 107,209   | 2052/3/15  |
|      | 4.6 BERKSHIRE HAT 530501 | 4.6   | 2,000   | 1,776   | 240,050   | 2053/5/1   |
|      | 4.6 PECO ENERGY C 520515 | 4.6   | 2,500   | 2,284   | 308,682   | 2052/5/15  |
|      | 4.6 XCEL ENERGY I 320601 | 4.6   | 4,500   | 4,357   | 588,863   | 2032/6/1   |
|      | 4.65 COMCAST CORP 330215 | 4.65  | 2,500   | 2,488   | 336,379   | 2033/2/15  |
|      | 4.65 DISCOVERY CO 500515 | 4.65  | 2,500   | 1,828   | 247,124   | 2050/5/15  |
|      | 4.65 PIEDMONT NAT 430801 | 4.65  | 1,500   | 1,327   | 179,379   | 2043/8/1   |
|      | 4.7 DOMINION ENER 441201 | 4.7   | 1,000   | 871     | 117,803   | 2044/12/1  |
|      | 4.7 EXELON CORP 500415   | 4.7   | 2,000   | 1,755   | 237,198   | 2050/4/15  |
|      | 4.7 GEORGIA POWER 320515 | 4.7   | 2,000   | 1,964   | 265,557   | 2032/5/15  |
|      | 4.7 MPLX LP 480415       | 4.7   | 1,000   | 802     | 108,488   | 2048/4/15  |
|      | 4.75 ENERGY TRANS 260115 | 4.75  | 1,500   | 1,487   | 200,973   | 2026/1/15  |
|      | 4.75 GEORGIA POWE 400901 | 4.75  | 2,500   | 2,291   | 309,712   | 2040/9/1   |
|      | 4.8 CANADIAN PACI 450801 | 4.8   | 2,000   | 1,908   | 257,907   | 2045/8/1   |
|      | 4.8 CHARTER COMM 500301  | 4.8   | 4,700   | 3,420   | 462,263   | 2050/3/1   |
|      | 4.8 CROWN CASTLE 280901  | 4.8   | 3,000   | 2,990   | 404,124   | 2028/9/1   |
|      | 4.8 MPLX LP 290215       | 4.8   | 2,000   | 1,975   | 267,028   | 2029/2/15  |
|      | 4.8 T-MOBILE USA 280715  | 4.8   | 1,500   | 1,496   | 202,299   | 2028/7/15  |
|      | 4.812 BP CAP MARK 330213 | 4.812 | 9,000   | 8,984   | 1,214,305 | 2033/2/13  |
|      | 4.85 ENTERPRISE P 420815 | 4.85  | 1,750   | 1,587   | 214,598   | 2042/8/15  |
|      | 4.85 ENTERPRISE P 440315 | 4.85  | 1,250   | 1,130   | 152,790   | 2044/3/15  |
|      | 4.85 HALLIBURTON 351115  | 4.85  | 1,800   | 1,717   | 232,176   | 2035/11/15 |
|      | 4.862 VERIZON COM 460821 | 4.862 | 5,110   | 4,702   | 635,478   | 2046/8/21  |
|      | 4.875 MPLX LP 250601     | 4.875 | 3,000   | 2,987   | 403,762   | 2025/6/1   |
|      | 4.875 TRANSCANADA 260115 | 4.875 | 4,000   | 3,986   | 538,829   | 2026/1/15  |
|      | 4.875 VODAFONE GR 490619 | 4.875 | 1,000   | 870     | 117,667   | 2049/6/19  |
|      | 4.893 BP CAP MARK 330911 | 4.893 | 3,000   | 2,999   | 405,441   | 2033/9/11  |
|      | 4.9 BURLINGTN NOR 440401 | 4.9   | 2,000   | 1,929   | 260,744   | 2044/4/1   |
|      | 4.9 DOMINION RESO 410801 | 4.9   | 200     | 179     | 24,301    | 2041/8/1   |
|      | 4.9 FEDEX CORP 340115    | 4.9   | 1,500   | 1,477   | 199,622   | 2034/1/15  |
|      | 4.9 VALERO ENERGY 450315 | 4.9   | 1,000   | 884     | 119,506   | 2045/3/15  |
|      | 4.908 CCO SAFARI 250723  | 4.908 | 6,380   | 6,315   | 853,535   | 2025/7/23  |
|      | 4.95 ENERGY TRANS 280615 | 4.95  | 4,000   | 3,951   | 534,082   | 2028/6/15  |
|      | 4.95 MPLX LP 320901      | 4.95  | 1,500   | 1,447   | 195,572   | 2032/9/1   |
|      | 4.95 ONCOR ELECTR 520915 | 4.95  | 1,000   | 952     | 128,694   | 2052/9/15  |
|      | 4.95 ONCOR ELECTR 520915 | 4.95  | 2,000   | 1,904   | 257,389   | 2052/9/15  |
|      | 4.95 PACIFIC GAS 500701  | 4.95  | 6,200   | 4,869   | 658,068   | 2050/7/1   |
|      | 4.95 PHILLIPS 66 271201  | 4.95  | 3,000   | 3,030   | 409,638   | 2027/12/1  |
|      | 5 CROWN CASTLE IN 280111 | 5.0   | 2,500   | 2,518   | 340,308   | 2028/1/11  |
|      | 5 DEVON ENERGY CO 450615 | 5.0   | 1,000   | 857     | 115,880   | 2045/6/15  |
|      | 5 DUKE ENERGY COR 251208 | 5.0   | 7,000   | 7,036   | 951,020   | 2025/12/8  |
|      | 5 HALLIBURTON CO 451115  | 5.0   | 3,000   | 2,668   | 360,621   | 2045/11/15 |
|      | 5 NEXTERA ENERGY 320715  | 5.0   | 1,000   | 997     | 134,789   | 2032/7/15  |
|      | 5 PPL ELECTRIC UT 330515 | 5.0   | 2,000   | 2,033   | 274,858   | 2033/5/15  |
|      | 5 SABINE PASS LIQ 270315 | 5.0   | 4,000   | 3,994   | 539,839   | 2027/3/15  |

| 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 |       |           |           |
|      |       | %     | 千アメリカドル              | 千アメリカドル | 千円     |       |           |           |
| アメリカ | 普通社債券 | 5.012 | VERIZON COM 490415   | 5.012   | 4,000  | 3,731 | 504,294   | 2049/4/15 |
|      |       | 5.012 | VERIZON COM 540821   | 5.012   | 2,250  | 2,074 | 280,326   | 2054/8/21 |
|      |       | 5.05  | CHARTER COMM 290330  | 5.05    | 6,250  | 6,040 | 816,390   | 2029/3/30 |
|      |       | 5.05  | T-MOBILE USA 330715  | 5.05    | 1,500  | 1,476 | 199,519   | 2033/7/15 |
|      |       | 5.05  | UNITED PARCE 530303  | 5.05    | 2,000  | 1,998 | 270,101   | 2053/3/3  |
|      |       | 5.1   | EXELON CORP 450615   | 5.1     | 150    | 139   | 18,855    | 2045/6/15 |
|      |       | 5.1   | NORTHERN STAT 530515 | 5.1     | 1,500  | 1,461 | 197,548   | 2053/5/15 |
|      |       | 5.1   | TRANSCANADA P 490315 | 5.1     | 5,200  | 4,732 | 639,593   | 2049/3/15 |
|      |       | 5.1   | WILLIAMS COMP 450915 | 5.1     | 1,500  | 1,339 | 181,049   | 2045/9/15 |
|      |       | 5.141 | WARNERMEDIA 520315   | 5.141   | 4,500  | 3,503 | 473,536   | 2052/3/15 |
|      |       | 5.15  | ENTERGY ARKA 330115  | 5.15    | 1,000  | 1,018 | 137,587   | 2033/1/15 |
|      |       | 5.15  | PLAINS ALL A 420601  | 5.15    | 157    | 129   | 17,441    | 2042/6/1  |
|      |       | 5.2   | CROWN CASTLE 490215  | 5.2     | 1,000  | 904   | 122,219   | 2049/2/15 |
|      |       | 5.2   | DISCOVERY COM 470920 | 5.2     | 1,500  | 1,188 | 160,664   | 2047/9/20 |
|      |       | 5.2   | MARATHON OIL 450601  | 5.2     | 2,000  | 1,676 | 226,613   | 2045/6/1  |
|      |       | 5.2   | MPLX LP 470301       | 5.2     | 1,200  | 1,032 | 139,582   | 2047/3/1  |
|      |       | 5.2   | ONEOK INC 480715     | 5.2     | 3,000  | 2,539 | 343,238   | 2048/7/15 |
|      |       | 5.213 | TELEFONICA 470308    | 5.213   | 1,300  | 1,093 | 147,830   | 2047/3/8  |
|      |       | 5.25  | COMCAST CORP 251107  | 5.25    | 4,000  | 4,077 | 551,051   | 2025/11/7 |
|      |       | 5.25  | DOMINION RES 330801  | 5.25    | 346    | 347   | 46,909    | 2033/8/1  |
|      |       | 5.25  | DUKE ENERGY 330401   | 5.25    | 1,000  | 1,024 | 138,432   | 2033/4/1  |
|      |       | 5.25  | ENERGY TRANS 290415  | 5.25    | 8,000  | 7,985 | 1,079,196 | 2029/4/15 |
|      |       | 5.25  | FEDEX CORP 500515    | 5.25    | 1,000  | 945   | 127,801   | 2050/5/15 |
|      |       | 5.25  | NISOURCE INC 280330  | 5.25    | 2,500  | 2,545 | 343,992   | 2028/3/30 |
|      |       | 5.3   | COMMONWEALTH 530201  | 5.3     | 2,000  | 2,009 | 271,597   | 2053/2/1  |
|      |       | 5.3   | CONOCOPHILLIP 530515 | 5.3     | 2,000  | 1,987 | 268,616   | 2053/5/15 |
|      |       | 5.3   | ENERGY TRANSF 470415 | 5.3     | 5,500  | 4,642 | 627,482   | 2047/4/15 |
|      |       | 5.3   | EXELON CORP 330315   | 5.3     | 3,000  | 3,054 | 412,804   | 2033/3/15 |
|      |       | 5.3   | PHILLIPS 66 330630   | 5.3     | 3,000  | 2,991 | 404,254   | 2033/6/30 |
|      |       | 5.3   | SOUTHERN CAL 280301  | 5.3     | 2,500  | 2,567 | 346,946   | 2028/3/1  |
|      |       | 5.3   | WILLIAMS COMP 520815 | 5.3     | 1,500  | 1,357 | 183,400   | 2052/8/15 |
|      |       | 5.35  | ENTERPRISE P 330131  | 5.35    | 1,000  | 1,023 | 138,338   | 2033/1/31 |
|      |       | 5.35  | PACIFICORP 531201    | 5.35    | 2,500  | 2,495 | 337,305   | 2053/12/1 |
|      |       | 5.35  | SUNOCO LOGIS 450515  | 5.35    | 500    | 432   | 58,438    | 2045/5/15 |
|      |       | 5.375 | CHARTER COM 470501   | 5.375   | 2,100  | 1,676 | 226,530   | 2047/5/1  |
|      |       | 5.391 | WARNERMEDIA 620315   | 5.391   | 2,000  | 1,560 | 210,887   | 2062/3/15 |
|      |       | 5.4   | AEP TRANSMISS 530315 | 5.4     | 1,000  | 1,024 | 138,419   | 2053/3/15 |
|      |       | 5.4   | WILLIAMS COMP 260302 | 5.4     | 1,500  | 1,526 | 206,342   | 2026/3/2  |
|      |       | 5.45  | KINDER MORG 520801   | 5.45    | 2,500  | 2,221 | 300,298   | 2052/8/1  |
|      |       | 5.5   | COMCAST CORP 640515  | 5.5     | 1,500  | 1,485 | 200,705   | 2064/5/15 |
|      |       | 5.5   | ENBRIDGE ENER 400915 | 5.5     | 200    | 190   | 25,715    | 2040/9/15 |
|      |       | 5.5   | MPLX LP 490215       | 5.5     | 1,000  | 886   | 119,871   | 2049/2/15 |
|      |       | 5.5   | SHELL INTERNA 400325 | 5.5     | 1,000  | 1,047 | 141,607   | 2040/3/25 |
|      |       | 5.539 | AT&T INC 260220      | 5.539   | 3,500  | 3,492 | 471,958   | 2026/2/20 |
|      |       | 5.55  | KINDER MORG 450601   | 5.55    | 3,050  | 2,790 | 377,198   | 2045/6/1  |

| 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    |            |
|      |                          | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円        |            |
| アメリカ | 普通社債券                    |       |         |         |           |            |
|      | 5.6 DCP MIDSTREAM 440401 | 5.6   | 2,500   | 2,358   | 318,785   | 2044/4/1   |
|      | 5.6 DEVON ENERGY 410715  | 5.6   | 1,000   | 935     | 126,374   | 2041/7/15  |
|      | 5.6 EXELON GENERA 420615 | 5.6   | 1,000   | 969     | 130,979   | 2042/6/15  |
|      | 5.6 META PLATFORM 530515 | 5.6   | 2,000   | 1,976   | 267,144   | 2053/5/15  |
|      | 5.625 EXELON CORP 350615 | 5.625 | 1,200   | 1,245   | 168,389   | 2035/6/15  |
|      | 5.625 SABINE PASS 250301 | 5.625 | 2,500   | 2,509   | 339,182   | 2025/3/1   |
|      | 5.625 VODAFONE GR 530210 | 5.625 | 3,000   | 2,874   | 388,545   | 2053/2/10  |
|      | 5.65 AMERICAN TOW 330315 | 5.65  | 4,000   | 4,092   | 553,035   | 2033/3/15  |
|      | 5.65 DUKE ENERGY 530401  | 5.65  | 1,000   | 1,013   | 137,016   | 2053/4/1   |
|      | 5.65 MPLX LP 530301      | 5.65  | 1,000   | 917     | 123,946   | 2053/3/1   |
|      | 5.65 T-MOBILE USA 530115 | 5.65  | 5,800   | 5,762   | 778,765   | 2053/1/15  |
|      | 5.65 WILLIAMS COM 330315 | 5.65  | 1,000   | 1,019   | 137,799   | 2033/3/15  |
|      | 5.7 ENBRIDGE INC 330308  | 5.7   | 1,000   | 1,022   | 138,181   | 2033/3/8   |
|      | 5.75 BURLINGTN NO 400501 | 5.75  | 650     | 688     | 92,999    | 2040/5/1   |
|      | 5.75 CANADIAN PAC 420115 | 5.75  | 1,100   | 1,134   | 153,302   | 2042/1/15  |
|      | 5.75 ENERGY TRANS 330215 | 5.75  | 1,500   | 1,514   | 204,697   | 2033/2/15  |
|      | 5.75 MIDAMERIC 351101    | 5.75  | 100     | 107     | 14,463    | 2035/11/1  |
|      | 5.8 CONSTELLATION 330301 | 5.8   | 1,500   | 1,549   | 209,434   | 2033/3/1   |
|      | 5.8 ENERGY TRANSF 380615 | 5.8   | 1,000   | 973     | 131,502   | 2038/6/15  |
|      | 5.8 HESS CORP 470401     | 5.8   | 2,000   | 1,912   | 258,471   | 2047/4/1   |
|      | 5.8 MIDAMERICAN 361015   | 5.8   | 1,400   | 1,527   | 206,418   | 2036/10/15 |
|      | 5.875 ENBRIDGE EN 251015 | 5.875 | 1,580   | 1,610   | 217,612   | 2025/10/15 |
|      | 5.875 NETFLIX INC 250215 | 5.875 | 3,000   | 3,042   | 411,217   | 2025/2/15  |
|      | 5.875 TIME WARNER 401115 | 5.875 | 600     | 521     | 70,447    | 2040/11/15 |
|      | 5.9 SABINE PASS L 370915 | 5.9   | 2,000   | 2,043   | 276,191   | 2037/9/15  |
|      | 5.95 CANADIAN PAC 370515 | 5.95  | 700     | 750     | 101,453   | 2037/5/15  |
|      | 5.95 DOMINION R 350615   | 5.95  | 2,150   | 2,290   | 309,538   | 2035/6/15  |
|      | 5.95 SOUTHERN CAL 321101 | 5.95  | 2,500   | 2,681   | 362,384   | 2032/11/1  |
|      | 5.95 SUNCOR ENERG 341201 | 5.95  | 1,500   | 1,525   | 206,158   | 2034/12/1  |
|      | 6 SEMPRA ENERGY 391015   | 6.0   | 1,450   | 1,499   | 202,656   | 2039/10/15 |
|      | 6.05 DUKE ENERGY 380415  | 6.05  | 1,125   | 1,223   | 165,409   | 2038/4/15  |
|      | 6.051 NEXTERA ENE 250301 | 6.051 | 1,000   | 1,017   | 137,504   | 2025/3/1   |
|      | 6.125 MIDAMERICAN 360401 | 6.125 | 4,194   | 4,593   | 620,815   | 2036/4/1   |
|      | 6.15 BURLINGTN NO 370501 | 6.15  | 795     | 895     | 121,048   | 2037/5/1   |
|      | 6.15 CON EDISON C 521115 | 6.15  | 1,500   | 1,630   | 220,331   | 2052/11/15 |
|      | 6.15 CSX CORP 370501     | 6.15  | 1,700   | 1,868   | 252,531   | 2037/5/1   |
|      | 6.15 VODAFONE GRO 370227 | 6.15  | 2,000   | 2,113   | 285,658   | 2037/2/27  |
|      | 6.25 EXELON GENER 391001 | 6.25  | 1,000   | 1,046   | 141,464   | 2039/10/1  |
|      | 6.3 DOMINION RESO 330315 | 6.3   | 250     | 269     | 36,361    | 2033/3/15  |
|      | 6.3 WILLIAMS PART 400415 | 6.3   | 1,200   | 1,237   | 167,180   | 2040/4/15  |
|      | 6.35 DISCOVERY CO 400601 | 6.35  | 1,000   | 958     | 129,595   | 2040/6/1   |
|      | 6.384 CHARTER COM 351023 | 6.384 | 8,000   | 7,813   | 1,056,056 | 2035/10/23 |
|      | 6.412 WARNERMEDIA 260315 | 6.412 | 3,000   | 3,011   | 406,988   | 2026/3/15  |
|      | 6.45 ENTERPRISE 400901   | 6.45  | 250     | 267     | 36,134    | 2040/9/1   |
|      | 6.484 CHARTER COM 451023 | 6.484 | 6,000   | 5,504   | 743,914   | 2045/10/23 |

| 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      |            |
| アメリカ |                          | %     | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円          |            |
|      | 普通社債券                    |       |         |         |             |            |
|      | 6.5 MARATHON PETR 410301 | 6.5   | 2,850   | 2,956   | 399,514     | 2041/3/1   |
|      | 6.5 SUNCOR ENERGY 380615 | 6.5   | 2,000   | 2,102   | 284,126     | 2038/6/15  |
|      | 6.55 TIME WARNER 370501  | 6.55  | 500     | 482     | 65,195      | 2037/5/1   |
|      | 6.6 MARATHON OIL 371001  | 6.6   | 2,000   | 2,005   | 271,050     | 2037/10/1  |
|      | 6.65 WALT DISNEY 371115  | 6.65  | 1,000   | 1,165   | 157,541     | 2037/11/15 |
|      | 6.7 PLAINS ALL AM 360515 | 6.7   | 150     | 151     | 20,509      | 2036/5/15  |
|      | 6.75 CONS EDISON 380401  | 6.75  | 750     | 860     | 116,315     | 2038/4/1   |
|      | 6.85 SUNCOR ENER 390601  | 6.85  | 2,000   | 2,139   | 289,136     | 2039/6/1   |
|      | 6.875 SPRINT CAPI 281115 | 6.875 | 1,500   | 1,615   | 218,317     | 2028/11/15 |
|      | 6.875 VIACOM INC 360430  | 6.875 | 1,250   | 1,225   | 165,606     | 2036/4/30  |
|      | 7.045 TELEFONICA 360620  | 7.045 | 1,000   | 1,092   | 147,713     | 2036/6/20  |
|      | 7.05 COMCAST CORP 330315 | 7.05  | 500     | 586     | 79,327      | 2033/3/15  |
|      | 7.3 TIME WARNER 380701   | 7.3   | 1,000   | 1,027   | 138,912     | 2038/7/1   |
|      | 7.4 KINDER MORGAN 310315 | 7.4   | 500     | 546     | 73,862      | 2031/3/15  |
|      | 7.5 ENBRIDGE ENER 380415 | 7.5   | 300     | 345     | 46,696      | 2038/4/15  |
|      | 7.5 ENERGY TRANSF 380701 | 7.5   | 500     | 555     | 75,010      | 2038/7/1   |
|      | 7.625 SPRINT LLC 260301  | 7.625 | 2,500   | 2,630   | 355,454     | 2026/3/1   |
|      | 7.875 DEVON ENER 310930  | 7.875 | 3,000   | 3,463   | 468,048     | 2031/9/30  |
|      | 8.375 TIME WARNER 330715 | 8.375 | 3,800   | 4,245   | 573,748     | 2033/7/15  |
|      | STEP DEUTSCHE TEL 300615 | 8.75  | 8,300   | 10,076  | 1,361,815   | 2030/6/15  |
|      | STEP ORANGE SA 310301    | 9.0   | 3,900   | 4,861   | 657,025     | 2031/3/1   |
| 合    | 計                        |       |         |         | 121,870,323 |            |

(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。

### 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘      | 柄      | 別            | 当 期 末         |          |
|--------|--------|--------------|---------------|----------|
|        |        |              | 買 建 額         | 売 建 額    |
| 外<br>国 | 債券先物取引 | NOTE5Y       | 百万円<br>10,056 | 百万円<br>— |
|        |        | NOTE2Y       | —             | 10,511   |
|        |        | NOTE10Y      | 996           | —        |
|        |        | T-BOND       | 140           | —        |
|        |        | ULTR10Y 2306 | —             | 1,012    |
|        |        | BOND30Y      | 37            | —        |

(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

(2023年5月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>121,870,323 | %<br>96.1 |
| コール・ローン等、その他 | 4,895,591         | 3.9       |
| 投資信託財産総額     | 126,765,914       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産 (125,041,909千円) の投資信託財産総額 (126,765,914千円) に対する比率は98.6%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=135.15円 |  |  |
|------------------|--|--|

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末             |
|-----------------|-------------------|
| (A) 資産          | 126,733,364,278 円 |
| コール・ローン等        | 1,261,716,608     |
| 公社債(評価額)        | 121,870,323,805   |
| 未収入金            | 1,399,882,348     |
| 未収利息            | 1,240,491,534     |
| 前払費用            | 96,432,314        |
| 差入委託証拠金         | 864,517,669       |
| (B) 負債          | 1,405,084,204     |
| 未払金             | 1,405,083,593     |
| 未払利息            | 611               |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 125,328,280,074   |
| 元本              | 56,783,976,023    |
| 次期繰越損益金         | 68,544,304,051    |
| (D) 受益権総口数      | 56,783,976,023口   |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 22,071円           |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 47,502,256,784円  
期中追加設定元本額 11,695,747,333円  
期中一部解約元本額 2,414,028,094円  
また、1口当たり純資産額は、期末2,2071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/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)       | 45,939,794,613円 |
| 三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (毎月決算型)       | 5,630,103,709円  |
| マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 3,566,822,637円  |
| 三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)      | 1,175,335,364円  |
| 三菱UFJ/マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (年1回決算型)      | 414,327,172円    |
| 外国債券アクティブファンドセレクション (ラップ専用)                          | 57,592,528円     |
| 合計   | 56,783,976,023円 |

## ○損益の状況 (2022年5月11日~2023年5月10日)

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益          | 4,930,335,032 円 |
| 受取利息               | 4,930,100,480   |
| その他収益金             | 424,675         |
| 支払利息               | △ 190,123       |
| (B) 有価証券売買損益       | 394,049,257     |
| 売買益                | 4,595,985,576   |
| 売買損                | △ 4,201,936,319 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 369,101,664   |
| 取引益                | 1,549,931,251   |
| 取引損                | △ 1,919,032,915 |
| (D) 保管費用等          | △ 10,298,157    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 4,944,984,468   |
| (F) 前期繰越損益金        | 52,794,725,377  |
| (G) 追加信託差損益金       | 13,702,406,667  |
| (H) 解約差損益金         | △ 2,897,812,461 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 68,544,304,051  |
| 次期繰越損益金(I)         | 68,544,304,051  |

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (G)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) (H)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】

三菱UFJ国際投信株式会社は、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す。