

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 追加型投信／海外／債券 | |
|--------|---|--|
| 信託期間 | 2027年6月15日まで（2012年7月20日設定） | |
| 運用方針 | MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界主要国（日本を除く）の公社債に実質的な投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行います。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。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。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。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、先進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 | 世界主要国の公社債（日本を除く）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割合には制限を設けません。 |
| 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。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ ヘッジ付外国債券オープン

第11期（決算日：2023年6月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、お手持ちの「三菱UFJ ヘッジ付外国債券オープン」は、去る6月15日に第11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

当期間の運用で主眼をおいたポイントをご説明させていただきます。

■投資環境

- ・主要国（米国・ドイツ・英国）の長期金利は上昇しました。

■運用のポイント

- ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行いました。
- ・クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、運用戦略を構築しました。
- ・カンントリーアロケーションは、期間を通じて、米国を中立からアンダーウェイトとした一方、ユーロ圏を2023年6月を除き中立からオーバーウェイトとしました。英国は2022年8月、12月、2023年3月を除き、中立からアンダーウェイトとしました。カナダは、期間を通じて、中立からアンダーウェイトとしました。豪州は、2022年9月から2023年1月までアンダーウェイトとし、その他の期間は中立からオーバーウェイトとしました。スウェーデンは、2023年3月を除き、中立からオーバーウェイトとしました。
- ・残存期間構成は、米国においては、2022年7月、10月、11月、2023年1月に長期・超長期ゾーンをアンダーウェイト、その他の期間では、長期・超長期ゾーンを中立からオーバーウェイトとしました。ユーロ圏においては、2022年7月、9月、10月、2023年1月に長期・超長期ゾーンをアンダーウェイト、その他の期間では、長期・超長期ゾーンを中立からオーバーウェイトとしました。英国については、期間を通じて機動的にコントロールしました。
- ・ユーロ圏内国別配分は、ドイツを、2023年3月、5月を除き、中立からオーバーウェイト、イタリアを、2023年6月を除き、中立からアンダー

ウェイトでコントロールしました。

- ・為替変動の影響を回避するため、為替はフルヘッジを行いました。
- ・前記の運用を行った結果、ファンドの騰落率は、5.4%の下落となり、ベンチマークの騰落率（-4.2%）を1.2%下回りました。
- ・カンントリーアロケーションで、期間を通じて、カナダを中立からアンダーウェイトとしたこと、残存期間構成で、2022年8月、12月に、米国・ユーロ圏・英国の長期・超長期ゾーンをオーバーウェイトとしたことなどがマイナス要因となりました。

■今後の運用方針

- ・世界主要国の公社債（日本を除く）を主要投資対象とし、ベンチマークを中長期的に上回ることを目標として、引き続き投資信託財産の成長をめざして運用を行います。
- ・運用にあたっては、クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、運用戦略を構築します。また、為替変動リスクを回避するため、原則として、フルヘッジを行う方針です。



債券運用部
ファンドマネージャー
金 永真

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|-------------|--------|------------------------------------|--------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年6月15日 | 円 10,328 | % — | 359.9596 | % — | % 83.6 | % — |
| 6月末 | 10,547 | 2.1 | 367.9142 | 2.2 | 98.4 | — |
| 7月末 | 10,817 | 4.7 | 378.9121 | 5.3 | 94.2 | — |
| 8月末 | 10,406 | 0.8 | 365.5744 | 1.6 | 100.5 | — |
| 9月末 | 9,977 | △3.4 | 350.2613 | △2.7 | 98.9 | — |
| 10月末 | 9,965 | △3.5 | 349.5936 | △2.9 | 97.8 | — |
| 11月末 | 10,109 | △2.1 | 354.6680 | △1.5 | 95.6 | — |
| 12月末 | 9,846 | △4.7 | 347.7360 | △3.4 | 96.7 | — |
| 2023年1月末 | 9,996 | △3.2 | 353.3616 | △1.8 | 98.6 | — |
| 2月末 | 9,761 | △5.5 | 344.9245 | △4.2 | 100.3 | — |
| 3月末 | 9,940 | △3.8 | 350.9628 | △2.5 | 100.5 | — |
| 4月末 | 9,905 | △4.1 | 349.5259 | △2.9 | 94.5 | — |
| 5月末 | 9,823 | △4.9 | 346.6209 | △3.7 | 96.9 | — |
| (期 末) 2023年6月15日 | 9,771 | △5.4 | 344.7950 | △4.2 | 98.1 | — |

(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。

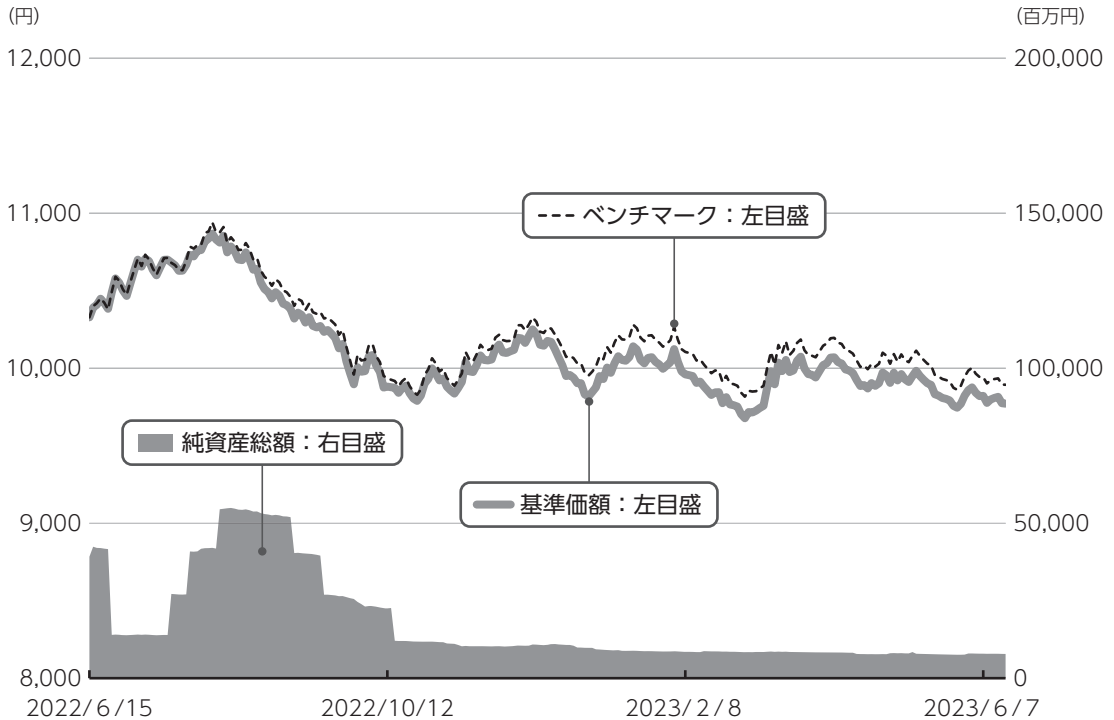
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第11期：2022年6月16日～2023年6月15日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------|---------|
| 第11期首 | 10,328円 |
| 第11期末 | 9,771円 |
| 既払分配金 | 0円 |
| 騰落率 | -5.4% |

※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5.4%の下落となりました。

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（-4.2%）を1.2%下回りました。

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などが基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

組入主要国の長期金利が上昇したことやヘッジコストなどが基準価額の下落要因となりました。

第11期：2022年6月16日～2023年6月15日

投資環境について

▶ 債券市況

米独長期金利は上昇しました。

グローバルなインフレ高止まりを背景に、米連邦準備制度理事会（FRB）や欧州

中央銀行（ECB）が利上げを含む金融引締めを実施したことなどが、米独長期金利の上昇要因となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ ヘッジ付外国債券オープン

主要投資対象であるMUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド受益証券への投資を通じて世界主要国（日本を除く）の公社債を組み入れた運用を行いました。

ました。カナダは、期間を通じて、中立からアンダーウェイトとしました。豪州は、2022年9月から2023年1月までアンダーウェイトとし、その他の期間は中立からオーバーウェイトとしました。スウェーデンは、2023年3月を除き、中立からオーバーウェイトとしました。

▶ MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

世界主要国の公社債（日本を除く）を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を中長期的に上回る投資成果をめざしました。

クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、運用戦略を構築しました。

カンントリーアロケーションは、期間を通じて、米国を中立からアンダーウェイトとした一方、ユーロ圏を2023年6月を除き中立からオーバーウェイトとしました。英国は2022年8月、12月、2023年3月を除き、中立からアンダーウェイトとし

残存期間構成は、米国においては、2022年7月、10月、11月、2023年1月に長期・超長期ゾーンをアンダーウェイト、その他の期間では、長期・超長期ゾーンを中立からオーバーウェイトとしました。ユーロ圏においては、2022年7月、9月、10月、2023年1月に長期・超長期ゾーンをアンダーウェイト、その他の期間では、長期・超長期ゾーンを中立からオーバーウェイトとしました。英国については、期間を通じて機動的にコントロールしました。

ユーロ圏内国別配分は、ドイツを、2023年3月、5月を除き、中立からオーバーウェイト、イタリアを、2023年6月を除

き、中立からアンダーウェイトでコントロールしました。

為替変動の影響を回避するため、フルヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ 三菱UFJ ヘッジ付外国債券オープン

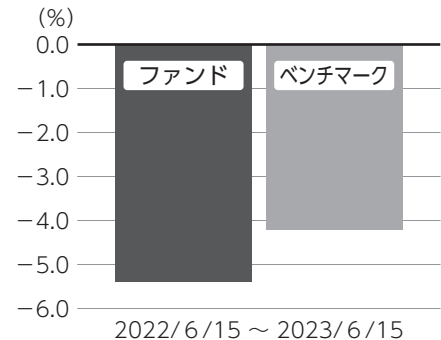
ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-4.2%）を1.2%下回りました。

（マイナス要因）

カントリーアロケーションにおいて、期間を通じて、カナダを中立からアンダーウェイトとしたこと。

残存期間構成において、2022年8月、12月に、米国・ユーロ圏・英国の長期・超長期ゾーンをオーバーウェイトとしたこと。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（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11期 2022年6月16日～2023年6月15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 | 2,551 |

(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 ヘッジ付外国債券オープン MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド** 受益証券の組入比率を高位とする方針です。

▶ **MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド** 世界主要国の公社債（日本を除く）を主要投資対象とし、ベンチマークを中長期

的に上回ることを目標として、引き続き投資信託財産の成長をめざして運用を行います。

運用にあたっては、クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、運用戦略を構築します。また、為替変動リスクを回避するため、原則として、フルヘッジを行う方針です。

2022年6月16日～2023年6月15日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-----------|--------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 39 | 0.385 | (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） | (30) | (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） | (4) | (0.044) | 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) その他費用 | 3 | 0.027 | (b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 |
| （保管費用） | (2) | (0.023) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| （監査費用） | (0) | (0.004) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| （その他） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計 | 42 | 0.412 | |

期中の平均基準価額は、10,113円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

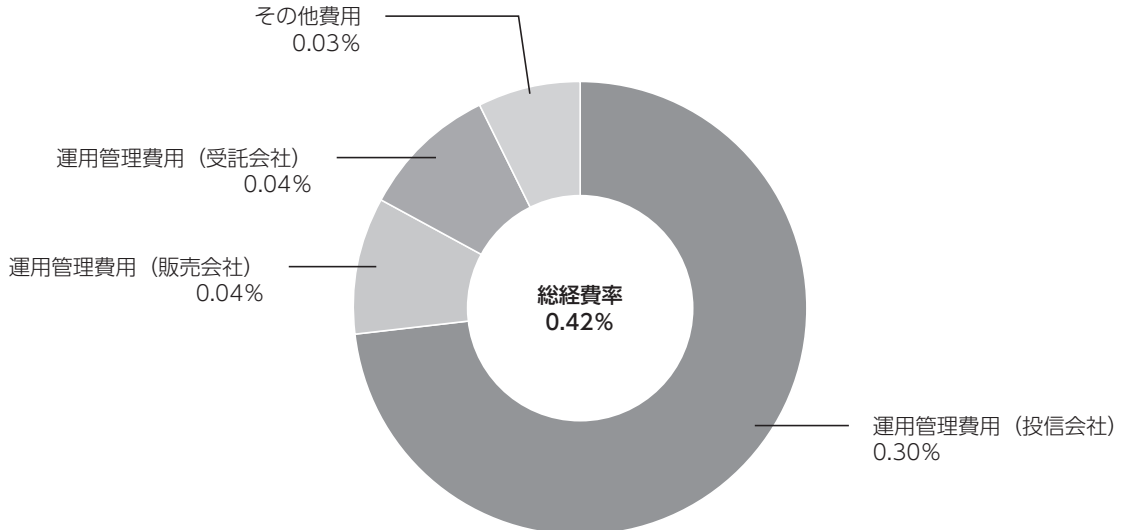
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.42%**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6月16日～2023年6月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド | 千口 29,225,241 | 千円 45,243,099 | 千口 49,899,993 | 千円 74,010,558 |

○利害関係人との取引状況等

(2022年6月16日～2023年6月15日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ ヘッジ付外国債券オープン>

該当事項はございません。

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替先物取引 | 1,059,199 | 124,657 | 11.8 | 1,031,026 | 111,221 | 10.8 |
| 為替直物取引 | 84,225 | 14,155 | 16.8 | 105,861 | 23,003 | 21.7 |

平均保有割合 24.7%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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

○組入資産の明細

(2023年6月15日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|------------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド | 千口 26,171,764 | 千口 5,497,013 | 千円 7,808,507 |

○投資信託財産の構成

(2023年6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド | 千円 7,808,507 | % 99.3 |
| コール・ローン等、その他 | 57,810 | 0.7 |
| 投資信託財産総額 | 7,866,317 | 100.0 |

(注) MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（55,988,908千円）の投資信託財産総額（57,164,246千円）に対する比率は97.9%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=140.39円 | 1 カナダドル=105.30円 | 1 ユーロ=152.15円 | 1 イギリスポンド=177.72円 |
| 1 スウェーデンクローネ=13.09円 | 1 ポーランドズロチ=34.1605円 | 1 オーストラリアドル=95.37円 | 1 中国元=19.5933円 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 7,866,317,589 |
| コール・ローン等 | 38,925,210 |
| MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド(評価額) | 7,808,507,263 |
| 未収入金 | 18,885,116 |
| (B) 負債 | 38,286,065 |
| 未払解約金 | 21,712,566 |
| 未払信託報酬 | 16,404,740 |
| 未払利息 | 87 |
| その他未払費用 | 168,672 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,828,031,524 |
| 元本 | 8,011,530,236 |
| 次期繰越損益金 | △ 183,498,712 |
| (D) 受益権総口数 | 8,011,530,236口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,771円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 37,953,355,515円
 期中追加設定元本額 44,498,735,740円
 期中一部解約元本額 74,440,561,019円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9771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183,498,712円です。

③分配金の計算過程

| 項 目 | 2022年6月16日～ 2023年6月15日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 57,944,627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 | 1,950,563,077円 |
| 分配準備積立金額 | 35,524,987円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 2,044,032,691円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 2,551円 |
| 1万口当たり分配金額 | -円 |
| 収益分配金金額 | -円 |

*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。

○損益の状況 (2022年6月16日～2023年6月15日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 19,711 |
| 受取利息 | 122 |
| 支払利息 | △ 19,833 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 485,515,754 |
| 売買益 | 1,137,615,157 |
| 売買損 | △1,623,130,911 |
| (C) 信託報酬等 | △ 67,649,537 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 553,185,002 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 82,445,826 |
| (F) 追加信託差損益金 | 452,132,116 |
| (配当等相当額) | (1,910,217,136) |
| (売買損益相当額) | (△1,458,085,020) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 183,498,712 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 183,498,712 |
| 追加信託差損益金 | 452,132,116 |
| (配当等相当額) | (1,950,563,077) |
| (売買損益相当額) | (△1,498,430,961) |
| 分配準備積立金 | 93,469,614 |
| 繰越損益金 | △ 729,100,442 |

- (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。

【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。

MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

《第23期》決算日2023年6月15日

[計算期間：2022年6月16日～2023年6月15日]

「MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド」は、6月15日に第23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23期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 世界主要国の公社債（日本を除く）を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行います。 運用にあたっては、クオントモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、債券の残存期間構成戦略を超過収益の源泉とします。また、為替変動リスクを回避するため、原則としてフルヘッジを行います。 |
| 主要運用対象 | 世界主要国の公社債（日本を除く）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は制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | FTSE世界国債インデックス | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純総資産額 |
|-----------------|--------|-------|------------------|-------|-------|--------|---------|
| | 期騰落 | 中率 | (除く日本、円ヘッジ・円ベース) | 期騰落 | | | |
| | 円 | % | | | % | % | 百万円 |
| 19期(2019年6月17日) | 16,785 | 5.8 | 399.8570 | 5.1 | 97.0 | — | 175,685 |
| 20期(2020年6月15日) | 17,713 | 5.5 | 424.3345 | 6.1 | 96.5 | — | 176,560 |
| 21期(2021年6月15日) | 17,468 | △1.4 | 416.2169 | △1.9 | 98.0 | — | 181,845 |
| 22期(2022年6月15日) | 14,940 | △14.5 | 359.9596 | △13.5 | 83.8 | — | 89,579 |
| 23期(2023年6月15日) | 14,205 | △4.9 | 344.7950 | △4.2 | 98.3 | — | 56,634 |

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基準 価 額 | | FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|---------------------|--------|-------|------------------------------------|-------|----------------|----------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年6月15日 | 円 | % | 359.9596 | % | % | % |
| 6 月 末 | 14,940 | — | 367.9142 | — | 83.8 | — |
| 7 月 末 | 15,265 | 2.2 | 378.9121 | 2.2 | 98.7 | — |
| 8 月 末 | 15,684 | 5.0 | 378.9121 | 5.3 | 94.5 | — |
| 9 月 末 | 15,082 | 1.0 | 365.5744 | 1.6 | 100.7 | — |
| 10 月 末 | 14,464 | △3.2 | 350.2613 | △2.7 | 99.1 | — |
| 11 月 末 | 14,450 | △3.3 | 349.5936 | △2.9 | 98.1 | — |
| 12 月 末 | 14,664 | △1.8 | 354.6680 | △1.5 | 95.9 | — |
| 2023年1 月 末 | 14,288 | △4.4 | 347.7360 | △3.4 | 97.0 | — |
| 2 月 末 | 14,512 | △2.9 | 353.3616 | △1.8 | 98.9 | — |
| 3 月 末 | 14,172 | △5.1 | 344.9245 | △4.2 | 100.5 | — |
| 4 月 末 | 14,438 | △3.4 | 350.9628 | △2.5 | 100.7 | — |
| 5 月 末 | 14,388 | △3.7 | 349.5259 | △2.9 | 99.0 | — |
| 6 月 末 | 14,276 | △4.4 | 346.6209 | △3.7 | 97.1 | — |
| (期 末) 2023年6月15日 | 14,205 | △4.9 | 344.7950 | △4.2 | 98.3 | — |

(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4.9%の下落となりました。

◎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(−4.2%)を0.7%下回りました。

●基準価額の変化要因

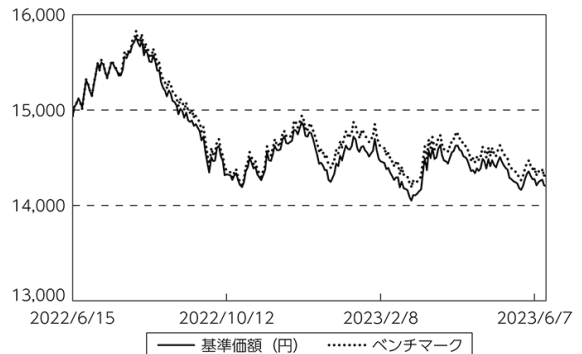
(上昇要因)

・債券利子収入を享受したことが基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

・組入主要国の長期金利が上昇したことやヘッジコストなどが基準価額の下落要因となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎債券市況

- ・米独長期金利は上昇しました。
- ・グローバルなインフレ高止まりを背景に、米連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）が利上げを含む金融引締めを実施したことなどが、米独長期金利の上昇要因となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・世界主要国の公社債（日本を除く）を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を中長期的に上回る投資成果をめざしました。
- ・クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、運用戦略を構築しました。
- ・カントリーアロケーションは、期間を通じて、米国を中立からアンダーウェイトとした一方、ユーロ圏を2023年6月を除き中立からオーバーウェイトとしました。英国は2022年8月、12月、2023年3月を除き、中立からアンダーウェイトとしました。カナダは、期間を通じて、中立からアンダーウェイトとしました。豪州は、2022年9月から2023年1月までアンダーウェイトとし、その他の期間は中立からオーバーウェイトとしました。スウェーデンは、2023年3月を除き、中立からオーバーウェイトとしました。
- ・残存期間構成は、米国においては、2022年7月、10月、11月、2023年1月に長期・超長期ゾーンをアンダーウェイト、その他の期間では、長期・超長期ゾーンを中立からオーバーウェイトとしました。ユーロ圏においては、2022年7月、9月、10月、2023年1月に長期・超長期ゾーンをアンダーウェイト、その他の期間では、長期・超長期ゾーンを中立からオーバーウェイトとしました。英国については、期間を通じて機動的にコントロールしました。

- ・ユーロ圏内国別配分は、ドイツを、2023年3月、5月を除き、中立からオーバーウェイト、イタリアを、2023年6月を除き、中立からアンダーウェイトでコントロールしました。
- ・為替変動の影響を回避するため、フルヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-4.2%）を0.7%下回りました。

（マイナス要因）

- ・カントリーアロケーションにおいて、期間を通じて、カナダを中立からアンダーウェイトとしたこと。
- ・残存期間構成において、2022年8月、12月に、米国・ユーロ圏・英国の長期・超長期ゾーンをオーバーウェイトとしたこと。

○今後の運用方針

- ・世界主要国の公社債（日本を除く）を主要投資対象とし、ベンチマークを中長期的に上回ることを目標として、引き続き投資信託財産の成長をめざして運用を行います。
- ・運用にあたっては、クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、運用戦略を構築します。また、為替変動リスクを回避するため、原則として、フルヘッジを行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年6月16日～2023年6月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 4 | % 0.024 | (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) | (0.024) | 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 | 0.024 | |
| 期中の平均基準価額は、14,672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6月16日～2023年6月15日)

公社債

| | | 買付額 | | 売付額 | |
|---|---------|------|------------------------|------------------------|--|
| 外 | アメリカ | 国債証券 | 千アメリカドル 472,569 | 千アメリカドル 572,587 | |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダドル 37,861 | 千カナダドル 44,355 | |
| | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ | |
| | ドイツ | 国債証券 | 91,322 | 101,658 | |
| | イタリア | 国債証券 | 79,945 | 94,876 | |
| | フランス | 国債証券 | 96,126 | 110,850 | |
| | オランダ | 国債証券 | 6,861 | 9,665 | |
| | スペイン | 国債証券 | 68,382 | 78,214 | |
| | ベルギー | 国債証券 | 11,097 | 11,094 | |
| | オーストリア | 国債証券 | 5,983 | 7,964 | |
| 国 | フィンランド | 国債証券 | 2,690 | 2,206 | |
| | アイルランド | 国債証券 | 7,484 | 9,034 | |
| | イギリス | 国債証券 | 千イギリスポンド 41,618 | 千イギリスポンド 44,094 | |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローネ 726,337 | 千スウェーデンクローネ 502,829 | |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランドズロチ 7,953 | 千ポーランドズロチ 11,993 | |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリアドル 54,282 | 千オーストラリアドル 54,094 | |
| | 中国 | 国債証券 | 千中国元 137,183 | 千中国元 54,559 | |

(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

(2022年6月16日～2023年6月15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 | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替先物取引 | 1,059,199 | 124,657 | 11.8 | 1,031,026 | 111,221 | 10.8 |
| 為替直物取引 | 84,225 | 14,155 | 16.8 | 105,861 | 23,003 | 21.7 |

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

○組入資産の明細

(2023年6月15日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|------------------------|------------------------|------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|----------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| アメリカ | 千アメリカドル 204,570 | 千アメリカドル 181,426 | 千円 25,470,455 | % 45.0 | % — | % 22.8 | % 17.2 | % 5.1 |
| カナダ | 千カナダドル 8,640 | 千カナダドル 8,152 | 858,492 | 1.5 | — | 1.1 | 0.4 | — |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 28,340 | 24,018 | 3,654,344 | 6.5 | — | 3.9 | 1.9 | 0.7 |
| イタリア | 31,050 | 25,915 | 3,942,993 | 7.0 | — | 6.0 | 0.8 | 0.2 |
| フランス | 37,500 | 30,906 | 4,702,363 | 8.3 | — | 4.5 | 2.9 | 0.9 |
| オランダ | 6,880 | 5,488 | 835,137 | 1.5 | — | 1.2 | 0.3 | — |
| スペイン | 19,330 | 15,820 | 2,407,143 | 4.3 | — | 3.2 | 0.9 | 0.2 |
| ベルギー | 9,840 | 8,469 | 1,288,597 | 2.3 | — | 1.3 | 0.8 | 0.2 |
| オーストリア | 7,110 | 5,742 | 873,723 | 1.5 | — | 0.9 | 0.3 | 0.3 |
| フィンランド | 3,310 | 2,789 | 424,462 | 0.7 | — | 0.4 | 0.2 | 0.1 |
| アイルランド | 4,450 | 3,749 | 570,448 | 1.0 | — | 0.8 | 0.2 | — |
| イギリス | 千イギリスポンド 23,980 | 千イギリスポンド 15,644 | 2,780,279 | 4.9 | — | 3.8 | 0.9 | 0.2 |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローネ 241,400 | 千スウェーデンクローネ 228,967 | 2,997,188 | 5.3 | — | 3.2 | — | 2.0 |
| ポーランド | 千ポーランドズロチ 9,390 | 千ポーランドズロチ 7,971 | 272,305 | 0.5 | — | 0.1 | 0.2 | 0.2 |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル 15,230 | 千オーストラリアドル 14,234 | 1,357,569 | 2.4 | — | 2.0 | 0.4 | — |
| 中国 | 千中国元 164,000 | 千中国元 165,920 | 3,250,938 | 5.7 | — | 4.7 | 0.6 | 0.5 |
| 合 計 | — | — | 55,686,445 | 98.3 | — | 59.8 | 28.0 | 10.6 |

(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、価格情報会社よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当 | 期 | 末 | | 償還年月日 | | |
|------|---------------------|---------|---------|--------|-----------|------------|--------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | | 評 価 額 | |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | | |
| アメリカ | | | | | | | |
| 国債証券 | 0.25 T-NOTE 250731 | 0.25 | 5,650 | 5,155 | 723,751 | 2025/7/31 | |
| | 0.25 T-NOTE 250831 | 0.25 | 3,340 | 3,038 | 426,591 | 2025/8/31 | |
| | 0.25 T-NOTE 250930 | 0.25 | 6,290 | 5,712 | 802,008 | 2025/9/30 | |
| | 0.375 T-NOTE 240815 | 0.375 | 500 | 472 | 66,364 | 2024/8/15 | |
| | 0.375 T-NOTE 240915 | 0.375 | 7,650 | 7,209 | 1,012,082 | 2024/9/15 | |
| | 0.5 T-NOTE 260228 | 0.5 | 5,430 | 4,892 | 686,845 | 2026/2/28 | |
| | 0.5 T-NOTE 270531 | 0.5 | 150 | 130 | 18,257 | 2027/5/31 | |
| | 0.5 T-NOTE 271031 | 0.5 | 380 | 325 | 45,683 | 2027/10/31 | |
| | 0.625 T-NOTE 271231 | 0.625 | 4,710 | 4,038 | 566,971 | 2027/12/31 | |
| | 0.625 T-NOTE 300515 | 0.625 | 1,230 | 987 | 138,622 | 2030/5/15 | |
| | 0.75 T-NOTE 260531 | 0.75 | 240 | 216 | 30,351 | 2026/5/31 | |
| | 0.75 T-NOTE 260831 | 0.75 | 9,060 | 8,106 | 1,138,007 | 2026/8/31 | |
| | 0.875 T-NOTE 260630 | 0.875 | 240 | 216 | 30,453 | 2026/6/30 | |
| | 0.875 T-NOTE 301115 | 0.875 | 1,760 | 1,427 | 200,381 | 2030/11/15 | |
| | 1.125 T-NOTE 250115 | 1.125 | 7,220 | 6,799 | 954,639 | 2025/1/15 | |
| | 1.125 T-NOTE 310215 | 1.125 | 2,760 | 2,275 | 319,395 | 2031/2/15 | |
| | 1.25 T-BOND 500515 | 1.25 | 3,610 | 2,011 | 282,436 | 2050/5/15 | |
| | 1.25 T-NOTE 261130 | 1.25 | 2,230 | 2,016 | 283,132 | 2026/11/30 | |
| | 1.25 T-NOTE 280331 | 1.25 | 160 | 140 | 19,723 | 2028/3/31 | |
| | 1.25 T-NOTE 280531 | 1.25 | 8,040 | 7,033 | 987,489 | 2028/5/31 | |
| | 1.25 T-NOTE 310815 | 1.25 | 4,490 | 3,684 | 517,220 | 2031/8/15 | |
| | 1.375 T-BOND 401115 | 1.375 | 5,310 | 3,536 | 496,495 | 2040/11/15 | |
| | 1.375 T-NOTE 250131 | 1.375 | 350 | 330 | 46,425 | 2025/1/31 | |
| | 1.375 T-NOTE 311115 | 1.375 | 1,450 | 1,195 | 167,810 | 2031/11/15 | |
| | 1.5 T-NOTE 270131 | 1.5 | 3,980 | 3,619 | 508,137 | 2027/1/31 | |
| | 1.75 T-NOTE 291115 | 1.75 | 600 | 527 | 74,099 | 2029/11/15 | |
| | 1.875 T-BOND 511115 | 1.875 | 2,790 | 1,822 | 255,882 | 2051/11/15 | |
| | 1.875 T-NOTE 290228 | 1.875 | 3,000 | 2,675 | 375,630 | 2029/2/28 | |
| | 1.875 T-NOTE 320215 | 1.875 | 3,860 | 3,306 | 464,239 | 2032/2/15 | |
| | 2 T-BOND 411115 | 2.0 | 850 | 619 | 86,962 | 2041/11/15 | |
| | 2.25 T-BOND 520215 | 2.25 | 2,210 | 1,582 | 222,134 | 2052/2/15 | |
| | 2.375 T-BOND 420215 | 2.375 | 1,300 | 1,008 | 141,532 | 2042/2/15 | |
| | 2.5 T-BOND 460215 | 2.5 | 18,910 | 14,493 | 2,034,791 | 2046/2/15 | |
| | 2.5 T-NOTE 240531 | 2.5 | 1,700 | 1,655 | 232,464 | 2024/5/31 | |
| | 2.625 T-NOTE 290731 | 2.625 | 6,390 | 5,922 | 831,457 | 2029/7/31 | |
| | 2.75 T-NOTE 270430 | 2.75 | 3,190 | 3,026 | 424,927 | 2027/4/30 | |
| | 2.75 T-NOTE 320815 | 2.75 | 230 | 210 | 29,606 | 2032/8/15 | |
| | 2.875 T-BOND 520515 | 2.875 | 2,930 | 2,407 | 338,016 | 2052/5/15 | |
| | 2.875 T-NOTE 250615 | 2.875 | 4,180 | 4,034 | 566,463 | 2025/6/15 | |
| | 2.875 T-NOTE 290430 | 2.875 | 740 | 696 | 97,748 | 2029/4/30 | |
| | 2.875 T-NOTE 320515 | 2.875 | 2,140 | 1,984 | 278,635 | 2032/5/15 | |
| | 3 T-BOND 470515 | 3.0 | 3,860 | 3,238 | 454,671 | 2047/5/15 | |
| | 3 T-NOTE 240731 | 3.0 | 1,200 | 1,170 | 164,371 | 2024/7/31 | |
| | 3.125 T-NOTE 270831 | 3.125 | 3,550 | 3,410 | 478,848 | 2027/8/31 | |
| | 3.125 T-NOTE 281115 | 3.125 | 2,160 | 2,065 | 289,922 | 2028/11/15 | |
| | 3.25 T-BOND 420515 | 3.25 | 4,590 | 4,084 | 573,419 | 2042/5/15 | |
| | 3.375 T-BOND 481115 | 3.375 | 2,300 | 2,068 | 290,367 | 2048/11/15 | |
| | 3.5 T-NOTE 250915 | 3.5 | 1,100 | 1,074 | 150,878 | 2025/9/15 | |
| | 3.5 T-NOTE 330215 | 3.5 | 7,800 | 7,601 | 1,067,152 | 2033/2/15 | |
| | 3.625 T-BOND 530215 | 3.625 | 400 | 381 | 53,506 | 2053/2/15 | |
| | 3.625 T-BOND 530515 | 3.625 | 4,600 | 4,388 | 616,077 | 2053/5/15 | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|------|------------------------|-------|---------|---------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | | | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| | 国債証券 | 3.625 T-NOTE 280331 | 3.625 | 800 | 785 | 110,210 | 2028/3/31 |
| | | 3.75 T-NOTE 260415 | 3.75 | 1,200 | 1,179 | 165,592 | 2026/4/15 |
| | | 3.875 T-BOND 430515 | 3.875 | 4,500 | 4,375 | 614,332 | 2043/5/15 |
| | | 3.875 T-NOTE 250331 | 3.875 | 2,800 | 2,503 | 386,612 | 2025/3/31 |
| | | 3.875 T-NOTE 291130 | 3.875 | 8,750 | 8,703 | 1,221,910 | 2029/11/30 |
| | | 4 T-BOND 421115 | 4.0 | 2,540 | 2,516 | 353,247 | 2042/11/15 |
| | | 4 T-NOTE 251215 | 4.0 | 7,170 | 7,089 | 995,252 | 2025/12/15 |
| | | 4 T-NOTE 280229 | 4.0 | 4,000 | 3,990 | 560,210 | 2028/2/29 |
| 小 計 | | | | | | 25,470,455 | |
| カナダ | | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| | 国債証券 | 2.5 CAN GOVT 321201 | 2.5 | 6,300 | 5,834 | 614,377 | 2032/12/1 |
| | | 3.5 CAN GOVT 280301 | 3.5 | 2,340 | 2,318 | 244,114 | 2028/3/1 |
| 小 計 | | | | | | 858,492 | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ドイツ | 国債証券 | 0 BUND 271115 | — | 1,490 | 1,335 | 203,206 | 2027/11/15 |
| | | 0 BUND 281115 | — | 2,150 | 1,886 | 287,017 | 2028/11/15 |
| | | 0 BUND 290815 | — | 180 | 155 | 23,634 | 2029/8/15 |
| | | 0 BUND 300215 | — | 1,760 | 1,502 | 228,534 | 2030/2/15 |
| | | 0 BUND 300815 | — | 480 | 405 | 61,759 | 2030/8/15 |
| | | 0 BUND 310215 | — | 900 | 750 | 114,222 | 2031/2/15 |
| | | 0 BUND 350515 | — | 3,650 | 2,709 | 412,252 | 2035/5/15 |
| | | 0 BUND 360515 | — | 2,720 | 1,957 | 297,779 | 2036/5/15 |
| | | 0 BUND 500815 | — | 1,260 | 646 | 98,382 | 2050/8/15 |
| | | 0 BUND 520815 | — | 710 | 343 | 52,336 | 2052/8/15 |
| | | 0 OBL 250411 | — | 260 | 246 | 37,488 | 2025/4/11 |
| | | 0 OBL 251010 | — | 160 | 149 | 22,797 | 2025/10/10 |
| | | 0 OBL 251010 | — | 70 | 65 | 9,988 | 2025/10/10 |
| | | 0 OBL 260410 | — | 120 | 111 | 16,912 | 2026/4/10 |
| | | 0 OBL 261009 | — | 1,240 | 1,136 | 172,883 | 2026/10/9 |
| | | 0 OBL 270416 | — | 870 | 788 | 120,031 | 2027/4/16 |
| | | 0.2 SCHATS 240614 | 0.2 | 30 | 29 | 4,431 | 2024/6/14 |
| | | 0.4 SCHATS 240913 | 0.4 | 2,000 | 1,933 | 294,168 | 2024/9/13 |
| | | 0.5 BUND 250215 | 0.5 | 310 | 297 | 45,245 | 2025/2/15 |
| | | 0.5 BUND 270815 | 0.5 | 1,150 | 1,059 | 161,129 | 2027/8/15 |
| | | 0.5 BUND 280215 | 0.5 | 350 | 319 | 48,656 | 2028/2/15 |
| | | 1 BUND 250815 | 1.0 | 1,160 | 1,114 | 169,514 | 2025/8/15 |
| | | 1 BUND 380515 | 1.0 | 1,820 | 1,457 | 221,743 | 2038/5/15 |
| | | 1.3 OBL 271015 | 1.3 | 890 | 845 | 128,617 | 2027/10/15 |
| | | 1.7 BUND 320815 | 1.7 | 220 | 207 | 31,524 | 2032/8/15 |
| | | 2.5 BUND 440704 | 2.5 | 390 | 383 | 58,330 | 2044/7/4 |
| | | 3.25 BUND 420704 | 3.25 | 2,000 | 2,180 | 331,757 | 2042/7/4 |
| イタリア | 国債証券 | 0 ITALY GOVT 240815 | — | 500 | 480 | 73,091 | 2024/8/15 |
| | | 0 ITALY GOVT 241215 | — | 70 | 66 | 10,116 | 2024/12/15 |
| | | 0 ITALY GOVT 260401 | — | 970 | 880 | 134,014 | 2026/4/1 |
| | | 0 ITALY GOVT 260801 | — | 130 | 116 | 17,761 | 2026/8/1 |
| | | 0.25 ITALY GOVT 280315 | 0.25 | 480 | 411 | 62,630 | 2028/3/15 |
| | | 0.5 ITALY GOVT 260201 | 0.5 | 100 | 92 | 14,080 | 2026/2/1 |
| | | 0.6 ITALY GOVT 310801 | 0.6 | 170 | 132 | 20,086 | 2031/8/1 |
| | | 0.9 ITALY GOVT 310401 | 0.9 | 900 | 725 | 110,340 | 2031/4/1 |
| | | 0.95 ITALY GOVT 320601 | 0.95 | 410 | 319 | 48,660 | 2032/6/1 |
| | | 0.95 ITALY GOVT 370301 | 0.95 | 4,660 | 3,105 | 472,561 | 2037/3/1 |
| | | 1.35 ITALY GOVT 300401 | 1.35 | 4,320 | 3,707 | 564,026 | 2030/4/1 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-----------------------|------|------------------------|-------|---------|------------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | | | 邦貨換算金額 | | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| イタリア | 国債証券 | 1.45 ITALY GOVT 250515 | 1.45 | 300 | 288 | 43,970 | 2025/5/15 |
| | | 1.5 ITALY GOVT 450430 | 1.5 | 800 | 484 | 73,722 | 2045/4/30 |
| | | 1.65 ITALY GOVT 301201 | 1.65 | 420 | 361 | 55,054 | 2030/12/1 |
| | | 1.8 ITALY GOVT 410301 | 1.8 | 3,200 | 2,214 | 336,890 | 2041/3/1 |
| | | 1.85 ITALY GOVT 250701 | 1.85 | 280 | 271 | 41,262 | 2025/7/1 |
| | | 2 ITALY GOVT 251201 | 2.0 | 50 | 48 | 7,347 | 2025/12/1 |
| | | 2.1 ITALY GOVT 260715 | 2.1 | 830 | 797 | 121,263 | 2026/7/15 |
| | | 2.2 ITALY GOVT 270601 | 2.2 | 120 | 114 | 17,402 | 2027/6/1 |
| | | 2.5 ITALY GOVT 321201 | 2.5 | 4,910 | 4,359 | 663,318 | 2032/12/1 |
| | | 2.65 ITALY GOVT 271201 | 2.65 | 200 | 192 | 29,340 | 2027/12/1 |
| | | 2.8 ITALY GOVT 281201 | 2.8 | 2,340 | 2,248 | 342,135 | 2028/12/1 |
| | | 2.8 ITALY GOVT 290615 | 2.8 | 500 | 476 | 72,495 | 2029/6/15 |
| | | 3.1 ITALY GOVT 400301 | 3.1 | 2,190 | 1,869 | 284,480 | 2040/3/1 |
| | | 3.25 ITALY GOVT 380301 | 3.25 | 100 | 88 | 13,464 | 2038/3/1 |
| | | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25 | 610 | 512 | 77,948 | 2046/9/1 |
| 4.4 ITALY GOVT 330501 | 4.4 | 1,300 | 1,343 | 204,442 | 2033/5/1 | | |
| 5 ITALY GOVT 390801 | 5.0 | 190 | 204 | 31,083 | 2039/8/1 | | |
| フランス | 国債証券 | 0 O.A.T 250225 | — | 1,090 | 1,033 | 157,322 | 2025/2/25 |
| | | 0 O.A.T 250325 | — | 1,190 | 1,126 | 171,397 | 2025/3/25 |
| | | 0 O.A.T 260225 | — | 3,180 | 2,939 | 447,261 | 2026/2/25 |
| | | 0 O.A.T 270225 | — | 880 | 792 | 120,587 | 2027/2/25 |
| | | 0 O.A.T 291125 | — | 130 | 108 | 16,549 | 2029/11/25 |
| | | 0 O.A.T 301125 | — | 4,080 | 3,312 | 504,021 | 2030/11/25 |
| | | 0 O.A.T 311125 | — | 390 | 307 | 46,742 | 2031/11/25 |
| | | 0 O.A.T 320525 | — | 270 | 209 | 31,810 | 2032/5/25 |
| | | 0.5 O.A.T 250525 | 0.5 | 1,180 | 1,122 | 170,841 | 2025/5/25 |
| | | 0.5 O.A.T 260525 | 0.5 | 2,620 | 2,442 | 371,632 | 2026/5/25 |
| | | 0.5 O.A.T 290525 | 0.5 | 850 | 744 | 113,232 | 2029/5/25 |
| | | 0.5 O.A.T 400525 | 0.5 | 6,240 | 3,977 | 605,210 | 2040/5/25 |
| | | 0.5 O.A.T 440625 | 0.5 | 1,140 | 656 | 99,843 | 2044/6/25 |
| | | 0.5 O.A.T 720525 | 0.5 | 1,260 | 463 | 70,494 | 2072/5/25 |
| | | 0.75 O.A.T 280525 | 0.75 | 2,610 | 2,363 | 359,540 | 2028/5/25 |
| | | 1 O.A.T 251125 | 1.0 | 190 | 181 | 27,570 | 2025/11/25 |
| | | 1 O.A.T 270525 | 1.0 | 130 | 121 | 18,427 | 2027/5/25 |
| | | 1.25 O.A.T 340525 | 1.25 | 1,530 | 1,274 | 193,974 | 2034/5/25 |
| 1.25 O.A.T 380525 | 1.25 | 1,420 | 1,081 | 164,581 | 2038/5/25 | | |
| 1.5 O.A.T 500525 | 1.5 | 1,570 | 1,055 | 160,569 | 2050/5/25 | | |
| 2.75 O.A.T 271025 | 2.75 | 2,120 | 2,112 | 321,415 | 2027/10/25 | | |
| 2.75 O.A.T 290225 | 2.75 | 700 | 696 | 105,903 | 2029/2/25 | | |
| 3 O.A.T 540525 | 3.0 | 1,530 | 1,397 | 212,620 | 2054/5/25 | | |
| 4.5 O.A.T 410425 | 4.5 | 1,030 | 1,191 | 181,280 | 2041/4/25 | | |
| 5.5 O.A.T 290425 | 5.5 | 170 | 194 | 29,531 | 2029/4/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | 0 NETH GOVT 290115 | — | 1,120 | 964 | 146,707 | 2029/1/15 |
| | | 0 NETH GOVT 300715 | — | 730 | 605 | 92,095 | 2030/7/15 |
| | | 0 NETH GOVT 310715 | — | 270 | 217 | 33,156 | 2031/7/15 |
| | | 0 NETH GOVT 380115 | — | 170 | 111 | 17,002 | 2038/1/15 |
| | | 0 NETH GOVT 520115 | — | 1,170 | 541 | 82,429 | 2052/1/15 |
| | | 0.25 NETH GOVT 290715 | 0.25 | 100 | 86 | 13,158 | 2029/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 260715 | 0.5 | 1,170 | 1,090 | 165,908 | 2026/7/15 |
| | | 0.5 NETH GOVT 320715 | 0.5 | 1,300 | 1,069 | 162,772 | 2032/7/15 |
| | | 0.75 NETH GOVT 280715 | 0.75 | 480 | 435 | 66,336 | 2028/7/15 |
| | | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75 | 370 | 365 | 55,569 | 2047/1/15 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|------|--------------------------|-------|-----------------------|-------------|---------|-------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | | | 邦貨換算金額 | | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | 0 SPAIN GOVT 240531 | — | 380 | 367 | 55,990 | 2024/ 5 /31 |
| | | 0 SPAIN GOVT 250131 | — | 80 | 75 | 11,563 | 2025/ 1 /31 |
| | | 0 SPAIN GOVT 250531 | — | 310 | 291 | 44,302 | 2025/ 5 /31 |
| | | 0 SPAIN GOVT 280131 | — | 1,400 | 1,214 | 184,742 | 2028/ 1 /31 |
| | | 0.1 SPAIN GOVT 310430 | 0.1 | 1,200 | 941 | 143,271 | 2031/ 4 /30 |
| | | 0.5 SPAIN GOVT 300430 | 0.5 | 590 | 493 | 75,144 | 2030/ 4 /30 |
| | | 0.7 SPAIN GOVT 320430 | 0.7 | 230 | 184 | 28,066 | 2032/ 4 /30 |
| | | 0.8 SPAIN GOVT 270730 | 0.8 | 170 | 154 | 23,579 | 2027/ 7 /30 |
| | | 0.8 SPAIN GOVT 290730 | 0.8 | 540 | 469 | 71,420 | 2029/ 7 /30 |
| | | 0.85 SPAIN GOVT 370730 | 0.85 | 2,760 | 1,898 | 288,858 | 2037/ 7 /30 |
| | | 1.2 SPAIN GOVT 401031 | 1.2 | 810 | 542 | 82,495 | 2040/10/31 |
| | | 1.25 SPAIN GOVT 301031 | 1.25 | 2,190 | 1,910 | 290,691 | 2030/10/31 |
| | | 1.3 SPAIN GOVT 261031 | 1.3 | 120 | 113 | 17,220 | 2026/10/31 |
| | | 1.4 SPAIN GOVT 280430 | 1.4 | 250 | 230 | 35,139 | 2028/ 4 /30 |
| | | 1.4 SPAIN GOVT 280730 | 1.4 | 120 | 110 | 16,798 | 2028/ 7 /30 |
| | | 1.45 SPAIN GOVT 271031 | 1.45 | 1,300 | 1,212 | 184,475 | 2027/10/31 |
| | | 1.45 SPAIN GOVT 711031 | 1.45 | 750 | 348 | 53,086 | 2071/10/31 |
| | | 1.85 SPAIN GOVT 350730 | 1.85 | 4,250 | 3,540 | 538,761 | 2035/ 7 /30 |
| | | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95 | 390 | 377 | 57,417 | 2026/ 4 /30 |
| | | 2.9 SPAIN GOVT 461031 | 2.9 | 580 | 492 | 74,880 | 2046/10/31 |
| 3.45 SPAIN GOVT 430730 | 3.45 | 910 | 849 | 129,237 | 2043/ 7 /30 | | |
| ベルギー | 国債証券 | 0 BEL GOVT 271022 | — | 1,340 | 1,186 | 180,492 | 2027/10/22 |
| | | 0 BEL GOVT 311022 | — | 280 | 219 | 33,323 | 2031/10/22 |
| | | 0.1 BEL GOVT 300622 | 0.1 | 1,000 | 826 | 125,676 | 2030/ 6 /22 |
| | | 0.35 BEL GOVT 320622 | 0.35 | 400 | 316 | 48,095 | 2032/ 6 /22 |
| | | 0.4 BEL GOVT 400622 | 0.4 | 820 | 501 | 76,288 | 2040/ 6 /22 |
| | | 0.5 BEL GOVT 241022 | 0.5 | 840 | 810 | 123,283 | 2024/10/22 |
| | | 0.8 BEL GOVT 250622 | 0.8 | 320 | 306 | 46,592 | 2025/ 6 /22 |
| | | 0.9 BEL GOVT 290622 | 0.9 | 2,690 | 2,408 | 366,498 | 2029/ 6 /22 |
| | | 1 BEL GOVT 260622 | 1.0 | 940 | 888 | 135,222 | 2026/ 6 /22 |
| | | 1.45 BEL GOVT 370622 | 1.45 | 300 | 237 | 36,157 | 2037/ 6 /22 |
| | | 1.6 BEL GOVT 470622 | 1.6 | 260 | 180 | 27,449 | 2047/ 6 /22 |
| | | 1.7 BEL GOVT 500622 | 1.7 | 250 | 171 | 26,163 | 2050/ 6 /22 |
| | | 4.5 BEL GOVT 260328 | 4.5 | 400 | 416 | 63,354 | 2026/ 3 /28 |
| | | オーストリア | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 240715 | — | 480 | 463 |
| 0 AUSTRIA GOVT 250420 | — | | | 840 | 794 | 120,866 | 2025/ 4 /20 |
| 0 AUSTRIA GOVT 310220 | — | | | 3,110 | 2,477 | 376,993 | 2031/ 2 /20 |
| 0 AUSTRIA GOVT 401020 | — | | | 640 | 366 | 55,747 | 2040/10/20 |
| 0.25 AUSTRIA GOVT 361020 | 0.25 | | | 170 | 115 | 17,581 | 2036/10/20 |
| 0.7 AUSTRIA GOVT 710420 | 0.7 | | | 410 | 175 | 26,775 | 2071/ 4 /20 |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75 | | | 1,260 | 1,174 | 178,690 | 2026/10/20 |
| 1.85 AUSTRIA GOVT 490523 | 1.85 | | | 100 | 75 | 11,556 | 2049/ 5 /23 |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15 | | | 100 | 98 | 14,933 | 2044/ 6 /20 |
| フィンランド | 国債証券 | 0 FINNISH GOVT 240915 | — | 330 | 317 | 48,270 | 2024/ 9 /15 |
| | | 0 FINNISH GOVT 260915 | — | 400 | 364 | 55,450 | 2026/ 9 /15 |
| | | 0 FINNISH GOVT 300915 | — | 750 | 608 | 92,611 | 2030/ 9 /15 |
| | | 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 0.25 | 710 | 432 | 65,787 | 2040/ 9 /15 |
| | | 0.5 FINNISH GOVT 280915 | 0.5 | 140 | 124 | 18,881 | 2028/ 9 /15 |
| | | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 560 | 534 | 81,342 | 2025/ 9 /15 |
| | | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 130 | 119 | 18,153 | 2042/ 7 / 4 |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75 | 290 | 288 | 43,964 | 2028/ 7 / 4 | | |
| アイルランド | 国債証券 | 0 IRISH GOVT 311018 | — | 550 | 438 | 66,700 | 2031/10/18 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|---------------|------|------------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | 外貨建金額 | | | 邦貨換算金額 | | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| アイルランド | 国債証券 | 0.2 IRISH GOVT 270515 | 0.2 | 40 | 36 | 5,508 | 2027/5/15 |
| | | 0.2 IRISH GOVT 301018 | 0.2 | 190 | 157 | 24,035 | 2030/10/18 |
| | | 0.4 IRISH GOVT 350515 | 0.4 | 520 | 387 | 59,004 | 2035/5/15 |
| | | 0.55 IRISH GOVT 410422 | 0.55 | 830 | 529 | 80,594 | 2041/4/22 |
| | | 0.9 IRISH GOVT 280515 | 0.9 | 810 | 741 | 112,757 | 2028/5/15 |
| | | 1.1 IRISH GOVT 290515 | 1.1 | 310 | 282 | 42,934 | 2029/5/15 |
| | | 2.4 IRISH GOVT 300515 | 2.4 | 1,200 | 1,175 | 178,912 | 2030/5/15 |
| 小 計 | | | | | | 18,699,215 | |
| イギリス | | | | 千イギリスポンド | 千イギリスポンド | | |
| | 国債証券 | 0.125 GILT 260130 | 0.125 | 270 | 239 | 42,593 | 2026/1/30 |
| | | 0.125 GILT 280131 | 0.125 | 280 | 228 | 40,650 | 2028/1/31 |
| | | 0.25 GILT 250131 | 0.25 | 770 | 712 | 126,601 | 2025/1/31 |
| | | 0.25 GILT 310731 | 0.25 | 500 | 360 | 64,045 | 2031/7/31 |
| | | 0.375 GILT 301022 | 0.375 | 1,570 | 1,179 | 209,572 | 2030/10/22 |
| | | 0.5 GILT 290131 | 0.5 | 640 | 512 | 91,078 | 2029/1/31 |
| | | 0.625 GILT 350731 | 0.625 | 650 | 417 | 74,163 | 2035/7/31 |
| | | 0.875 GILT 291022 | 0.875 | 290 | 233 | 41,565 | 2029/10/22 |
| | | 0.875 GILT 460131 | 0.875 | 6,150 | 2,961 | 526,323 | 2046/1/31 |
| | | 1 GILT 320131 | 1.0 | 640 | 486 | 86,426 | 2032/1/31 |
| | | 1.125 GILT 390131 | 1.125 | 6,740 | 4,158 | 739,047 | 2039/1/31 |
| | | 1.25 GILT 270722 | 1.25 | 750 | 656 | 116,728 | 2027/7/22 |
| | | 1.25 GILT 411022 | 1.25 | 2,460 | 1,451 | 257,901 | 2041/10/22 |
| | | 1.5 GILT 260722 | 1.5 | 1,090 | 989 | 175,936 | 2026/7/22 |
| | | 1.5 GILT 530731 | 1.5 | 180 | 90 | 16,152 | 2053/7/31 |
| | | 2 GILT 250907 | 2.0 | 800 | 750 | 133,452 | 2025/9/7 |
| 6 GILT 281207 | 6.0 | 200 | 214 | 38,037 | 2028/12/7 | | |
| 小 計 | | | | | | 2,780,279 | |
| スウェーデン | | | | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ | | |
| | 国債証券 | 0.75 SWD GOVT 291112 | 0.75 | 59,200 | 53,240 | 696,919 | 2029/11/12 |
| | | 1.75 SWD GOVT 331111 | 1.75 | 92,500 | 87,081 | 1,139,891 | 2033/11/11 |
| | | 2.5 SWD GOVT 250512 | 2.5 | 89,700 | 88,646 | 1,160,377 | 2025/5/12 |
| 小 計 | | | | | | 2,997,188 | |
| ポーランド | | | | 千ポーランドズロチ | 千ポーランドズロチ | | |
| | 国債証券 | 0.25 POLAND 261025 | 0.25 | 1,600 | 1,332 | 45,532 | 2026/10/25 |
| | | 0.75 POLAND 250425 | 0.75 | 2,880 | 2,626 | 89,714 | 2025/4/25 |
| | | 1.25 POLAND 301025 | 1.25 | 2,770 | 2,024 | 69,170 | 2030/10/25 |
| | | 3.75 POLAND 270525 | 3.75 | 2,140 | 1,987 | 67,887 | 2027/5/25 |
| 小 計 | | | | | | 272,305 | |
| 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 | | |
| | 国債証券 | 0.5 AUST GOVT 260921 | 0.5 | 2,530 | 2,268 | 216,340 | 2026/9/21 |
| | | 2.5 AUST GOVT 300521 | 2.5 | 7,180 | 6,568 | 626,437 | 2030/5/21 |
| | | 3.75 AUST GOVT 340521 | 3.75 | 5,520 | 5,397 | 514,790 | 2034/5/21 |
| 小 計 | | | | | | 1,357,569 | |
| 中国 | | | | 千中国元 | 千中国元 | | |
| | 国債証券 | 2.24 CHINA GOVT 250525 | 2.24 | 13,000 | 13,019 | 255,093 | 2025/5/25 |
| | | 2.67 CHINA GOVT 330525 | 2.67 | 15,000 | 15,044 | 294,780 | 2033/5/25 |
| | | 2.75 CHINA GOVT 290615 | 2.75 | 41,000 | 41,393 | 811,031 | 2029/6/15 |
| | | 2.76 CHINA GOVT 320515 | 2.76 | 15,000 | 15,079 | 295,453 | 2032/5/15 |
| | | 2.8 CHINA GOVT 290324 | 2.8 | 32,000 | 32,466 | 636,121 | 2029/3/24 |
| | | 2.8 CHINA GOVT 300325 | 2.8 | 3,000 | 3,038 | 59,527 | 2030/3/25 |
| | | 2.8 CHINA GOVT 321115 | 2.8 | 15,000 | 15,153 | 296,907 | 2032/11/15 |
| | | 2.91 CHINA GOVT 281014 | 2.91 | 10,000 | 10,206 | 199,975 | 2028/10/14 |

| 銘 | 柄 | 利 率 | 当 期 額面金額 | 末 評 価 額 | | 償還年月日 |
|-----|------|------------------------|----------|---------|------------|------------|
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 中国 | 国債証券 | 3.01 CHINA GOVT 280513 | 千中国元 | 千中国元 | 千円 | 2028/5/13 |
| | | 3.12 CHINA GOVT 521025 | 18,000 | 18,486 | 362,207 | 2052/10/25 |
| | | 3.12 | 2,000 | 2,033 | 39,839 | |
| 小 計 | | | | | 3,250,938 | |
| 合 計 | | | | | 55,686,445 | |

(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6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 55,686,445 | % 97.4 |
| コール・ローン等、その他 | 1,477,801 | 2.6 |
| 投資信託財産総額 | 57,164,246 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産（55,988,908千円）の投資信託財産総額（57,164,246千円）に対する比率は97.9%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=140.39円 | 1 カナダドル=105.30円 | 1 ユーロ=152.15円 | 1 イギリスポンド=177.72円 |
| 1 スウェーデンクローネ=13.09円 | 1 ポーランドズロチ=34.1605円 | 1 オーストラリアドル=95.37円 | 1 中国元=19.5933円 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 112,171,574,045 |
| コール・ローン等 | 1,161,821,227 |
| 公社債(評価額) | 55,686,445,295 |
| 未収入金 | 55,022,037,522 |
| 未収利息 | 205,126,577 |
| 前払費用 | 96,143,424 |
| (B) 負債 | 55,536,643,415 |
| 未払金 | 55,517,430,460 |
| 未払解約金 | 19,210,339 |
| 未払利息 | 2,616 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 56,634,930,630 |
| 元本 | 39,868,658,365 |
| 次期繰越損益金 | 16,766,272,265 |
| (D) 受益権総口数 | 39,868,658,365口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,205円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 59,959,242,987円
 期中追加設定元本額 33,836,689,112円
 期中一部解約元本額 53,927,273,734円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,205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 バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 21,963,493,624円 |
| 三菱UFJ ヘッジ付外国債券オープン | 5,497,013,209円 |
| MUAM ヘッジ付外国債券オープンII (適格機関投資家限定) | 4,651,984,312円 |
| 国内債券セレクトション(ラップ向け) | 3,718,545,728円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定) | 2,014,946,234円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定) | 820,996,871円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定) | 643,482,837円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 429,425,832円 |
| アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 72,209,237円 |
| アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 52,559,963円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定) | 4,000,518円 |
| 合計 | 39,868,658,365円 |

【お知らせ】

- ①ペーパーファンドの運用効率向上のため、追加信託・一部解約時の価額を、当日の基準価額から前営業日の基準価額に変更するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2023年3月10日)
- ②三菱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。

○損益の状況 (2022年6月16日～2023年6月15日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,047,199,120 |
| 受取利息 | 1,048,560,242 |
| その他収益金 | 18,854 |
| 支払利息 | △ 1,379,976 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 6,000,525,514 |
| 売買益 | 18,062,494,561 |
| 売買損 | △24,063,020,075 |
| (C) 保管費用等 | △ 15,902,765 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 4,969,229,159 |
| (E) 前期繰越損益金 | 29,619,830,335 |
| (F) 追加信託差損益金 | 18,121,733,144 |
| (G) 解約差損益金 | △26,006,062,055 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 16,766,272,265 |
| 次期繰越損益金(H) | 16,766,272,265 |

- (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。