

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	無期限（2022年1月27日設定）	
運用方針	先進国高格付国債マザーファンドⅡ受益証券への投資を通じて、主として日本を含む先進国の国債等に投資を行います。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。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。マザーファンドの債券等（為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。）の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント（UK）に運用の指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビードファンド	先進国高格付国債マザーファンドⅡ受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	日本を含む先進国の国債等を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビードファンド	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。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 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。） </div>	

※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）

ラップ向け 先進国高格付国債ファンドⅡ

第3期（決算日：2023年9月6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「ラップ向け先進国高格付国債ファンドⅡ」は、去る9月6日に第3期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) FTSE日本国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2022年1月27日	10,000	—	—	364.93	—	—	—	10
1期(2022年9月6日)	8,734	0	△12.7	352.98	△3.3	98.0	—	91
2期(2023年3月6日)	8,132	0	△6.9	343.51	△2.7	97.4	—	48
3期(2023年9月6日)	8,238	0	1.3	341.75	△0.5	98.8	—	74

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(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FTSE日本国債インデックス（円ベース）です。

FTSE日本国債インデックス（円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（円ベース）のサブインデックスです。FTSE世界国債インデックス（円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。同指数のデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○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) F T S E 日 本 国 債 イ ン デ ッ ク ス (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) 2023年3月6日	円 8,132	% —	343.51	% —	% 97.4	% —
3月末	8,312	2.2	351.51	2.3	99.4	—
4月末	8,287	1.9	352.72	2.7	97.9	—
5月末	8,315	2.3	352.24	2.5	97.7	—
6月末	8,330	2.4	353.31	2.9	98.0	—
7月末	8,255	1.5	345.67	0.6	98.1	—
8月末	8,241	1.3	341.23	△0.7	98.7	—
(期 末) 2023年9月6日	8,238	1.3	341.75	△0.5	98.8	—

(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。

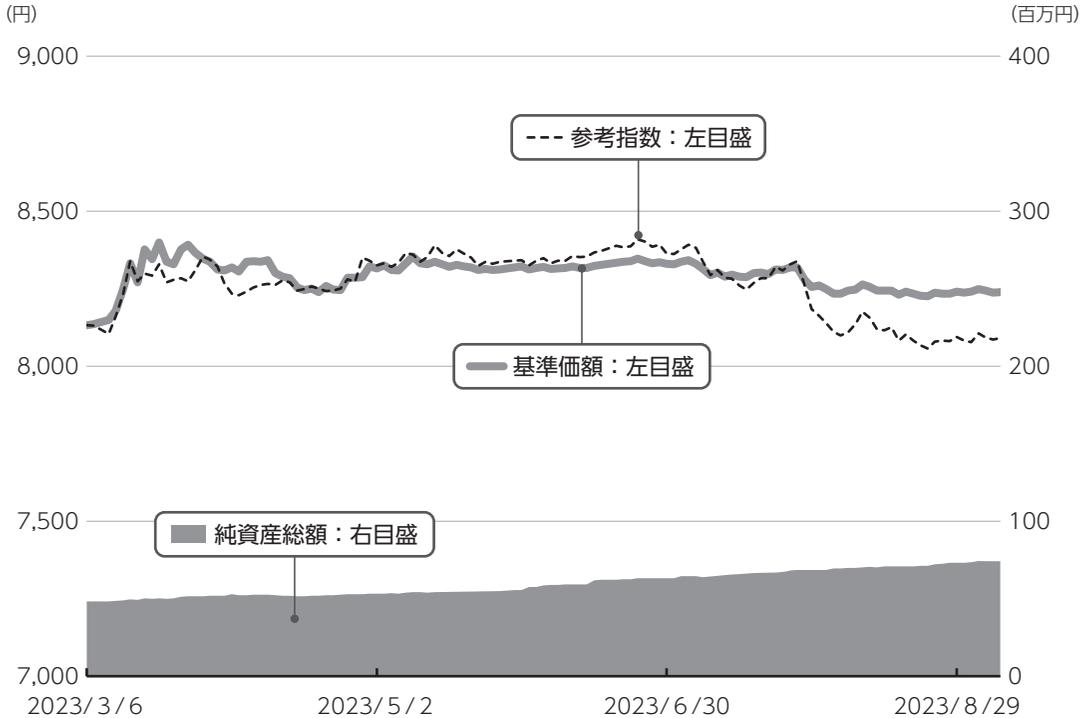
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第3期：2023年3月7日～2023年9月6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3期首	8,132円
第3期末	8,238円
既払分配金	0円
騰落率	1.3%

※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1.3%の上昇となりました。

▶ 基準価額の主な変動要因

上昇要因

投資対象国の長期金利が低下した局面で、一部組入債券の価格が上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

第3期：2023年3月7日～2023年9月6日

投資環境について

▶ 債券市況

米国の長期金利は上昇した一方、ドイツの長期金利は低下しました。

米国の長期金利は、堅調な経済指標の結果を受けて、米国経済の底堅さが意識されたことなどから上昇しました。

ドイツの長期金利は、期間の初めにスイスの金融大手クレディ・スイス・グループ

の株価急落などをめぐってリスク回避姿勢が強まったことや、期間中のユーロ圏消費者物価指数（CPI）の結果などから、域内のインフレ鈍化基調が確認されたことなどを背景に低下しました。

日本の長期金利は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決定したことなどをうけて上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ラップ向け先進国高格付国債ファンドⅡ

先進国高格付国債マザーファンドⅡ受益証券への投資を通じて、世界の先進国高格付国債を高位に組み入れたほか、実質組入外貨建資産については、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。

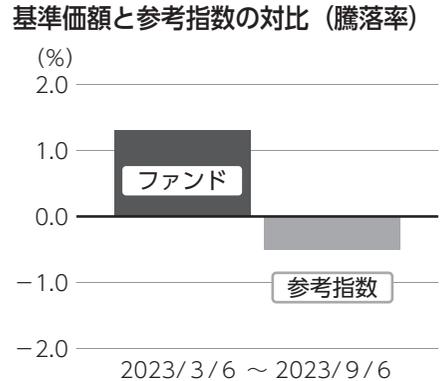
▶ 先進国高格付国債マザーファンドⅡ

投資対象である国債の各国／満期グループ（ユニバース）の中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよび為替ヘッジコスト／プレミアムを基に、

金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れました。組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。期間の初めには、ベルギーの9－11年、フランスの9－11年、日本の5－7年、7－9年、9－11年のグループを投資対象として選定しており、2023年5月の定期リバランス時には、ベルギーの9－11年とフランスの9－11年を日本の1－3年、3－5年へ入れ替えを実施しました。8月の定期リバランス時には組入グループの変更はありませんでした。

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F T S E 日本国債インデックス（円ベース）です。



分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第3期
	2023年3月7日～2023年9月6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	51

(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。)

▶ ラップ向け先進国高格付国債ファンドⅡ

マザーファンドへの投資を通じて、世界の先進国高格付国債を高位に組み入れ、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざすほか、実質組入外貨建資産については、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。

▶ 先進国高格付国債マザーファンドⅡ

投資対象である国債の各国／満期グループの中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよび為替ヘッジコスト／プレミアムを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れる運用を行う方針です。また、外貨建債券を組み入れる場合には、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

なお、今期間より当ファンドの投資ユニバースにアイルランドが追加されました。

2023年3月7日～2023年9月6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	9	0.111	(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)	(7)	(0.088)	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)	(0)	(0.006)	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)	(1)	(0.017)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	1	0.007	(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)	(0)	(0.005)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	10	0.118	

期中の平均基準価額は、8,294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。

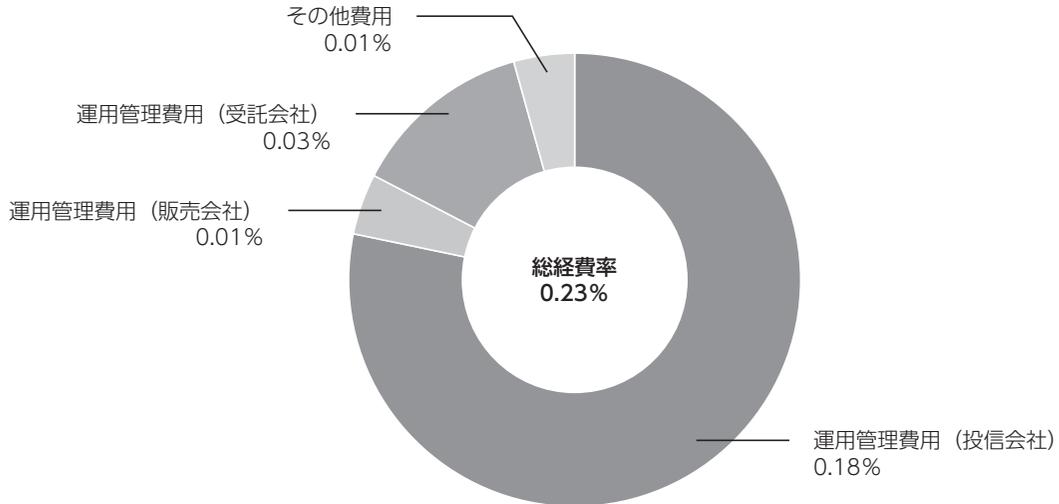
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.23%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年3月7日～2023年9月6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
先進国高格付国債マザーファンドⅡ	千口 33,521	千円 26,100	千口 1,025	千円 800

○利害関係人との取引状況等

(2023年3月7日～2023年9月6日)

該当事項はございません。

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す。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2023年3月7日～2023年9月6日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 10	百万円 —	百万円 —	百万円 10	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2023年9月6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
先進国高格付国債マザーファンドⅡ	千口 63,014	千口 95,509	千円 73,848

○投資信託財産の構成

(2023年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
先進国高格付国債マザーファンドⅡ	千円 73,848	% 99.4
コール・ローン等、その他	442	0.6
投資信託財産総額	74,290	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	74,290,448
コール・ローン等	442,343
先進国高格付国債マザーファンドII(評価額)	73,848,105
(B) 負債	66,960
未払信託報酬	65,844
未払利息	1
その他未払費用	1,115
(C) 純資産総額(A-B)	74,223,488
元本	90,097,768
次期繰越損益金	△15,874,280
(D) 受益権総口数	90,097,768口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,238円

<注記事項>

- ①期首元本額 59,251,441円
 期中追加設定元本額 34,412,538円
 期中一部解約元本額 3,566,211円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8238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15,874,280円です。

③分配金の計算過程

項 目	2023年3月7日～ 2023年9月6日
費用控除後の配当等収益額	104,620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	224,739円
分配準備積立金額	136,054円
当ファンドの分配対象収益額	465,413円
1万口当たり収益分配対象額	51円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

④「先進国高格付国債マザーファンドII」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7.5以内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。

*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 (2023年3月7日～2023年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 65
支払利息	△ 65
(B) 有価証券売買損益	466,776
売買益	518,825
売買損	△ 52,049
(C) 信託報酬等	△ 66,959
(D) 当期損益金(A+B+C)	399,752
(E) 前期繰越損益金	△ 3,515,257
(F) 追加信託差損益金	△12,758,775
(配当等相当額)	(217,057)
(売買損益相当額)	(△12,975,832)
(G) 計(D+E+F)	△15,874,280
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△15,874,280
追加信託差損益金	△12,758,775
(配当等相当額)	(224,739)
(売買損益相当額)	(△12,983,514)
分配準備積立金	240,674
繰越損益金	△ 3,356,179

(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。

先進国高格付国債マザーファンドⅡ

《第4期》決算日2023年9月6日

〔計算期間：2022年9月7日～2023年9月6日〕

「先進国高格付国債マザーファンドⅡ」は、9月6日に第4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4期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主として日本を含む先進国の国債等に投資を行います。投資する国債等（日本国債を除きます。）は、原則として取得時においてAAマイナス格相当以上の格付けを取得しているものに限ります。銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。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。債券等（為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。）の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント（UK）に運用の指図に関する権限を委託します。
主 要 運 用 対 象	日本を含む先進国の国債等を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		（ 参 考 指 数 ） FTSE日本国債インデックス （円ベース）		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
（設定日） 2019年9月11日	円	%			%	%	百万円
	10,000	—	377.57	—	—	—	9,680
1期(2020年9月7日)	9,938	△ 0.6	366.96	△2.8	96.6	—	67,264
2期(2021年9月6日)	9,770	△ 1.7	368.84	0.5	97.9	—	101,288
3期(2022年9月6日)	8,180	△16.3	352.98	△4.3	98.2	—	74,885
4期(2023年9月6日)	7,732	△ 5.5	341.75	△3.2	99.3	—	46,528

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額です。

（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FTSE日本国債インデックス（円ベース）です。

FTSE日本国債インデックス（円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（円ベース）のサブインデックスです。FTSE世界国債インデックス（円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。同指数のデータは、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。

（注）設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○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) FTSE日本国債インデックス (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9月6日	円	%		%	%	%
	8,180	—	352.98	—	98.2	—
9月末	7,748	△5.3	348.98	△1.1	97.2	—
10月末	7,875	△3.7	348.42	△1.3	98.1	—
11月末	8,008	△2.1	345.71	△2.1	96.0	—
12月末	7,630	△6.7	340.06	△3.7	95.8	—
2023年1月末	7,753	△5.2	338.57	△4.1	96.4	—
2月末	7,670	△6.2	344.25	△2.5	96.8	—
3月末	7,793	△4.7	351.51	△0.4	99.6	—
4月末	7,772	△5.0	352.72	△0.1	98.5	—
5月末	7,800	△4.6	352.24	△0.2	98.7	—
6月末	7,816	△4.4	353.31	0.1	99.0	—
7月末	7,746	△5.3	345.67	△2.1	98.9	—
8月末	7,734	△5.5	341.23	△3.3	99.3	—
(期 末) 2023年9月6日	7,732	△5.5	341.75	△3.2	99.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

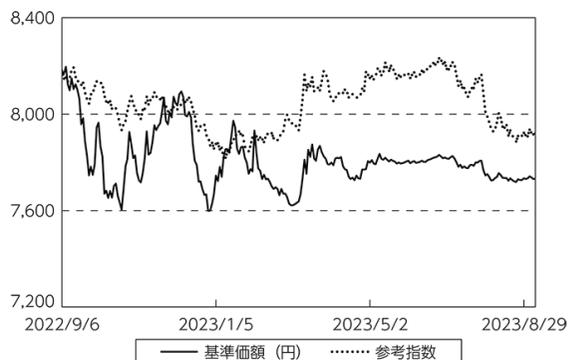
○運用経過

●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5.5%下落しました。

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

(下落要因)

- ・ 投資対象国の長期金利が上昇した局面で、一部保有債券の価格が下落したこと等が基準価額の下落要因となりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

- ・ 米国とドイツの長期金利はともに上昇しました。
- ・ 欧米の主要中央銀行が相次いで政策金利を引き上げたことが金利の上昇要因となり、急速な利上げによる世界景気の減速懸念などが金利の低下要因となりました。期間を通じてみると米国とドイツの長期金利は上昇しました。
- ・ 日本の長期金利は、2023年7月に日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決定したことなどをうけて上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 投資対象である国債の各国／満期グループ（ユニバース）の中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよび為替ヘッジコスト／プレミアムを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れました。組入外貨建資産については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。
- ・ 期間の初めには、オーストリアの9-11年、ベルギーの7-9年と9-11年、フランスの9-11年、フィンランドの9-11年のグループを投資対象として選定しており、2022年11月の定期リバランス時には、ベルギーの7-9年をオーストリアの7-9年へ入れ替えを実施しました。2023年2月の定期リバランス時には、フィンランドの9-11年とオーストリアの7-9年、9-11年を日本の5-7年、7-9年、9-11年へ入れ替えを実施しました。5月の定期リバランス時には、ベルギーの9-11年とフランスの9-11年を日本の1-3年、3-5年へ入れ替えを実施しました。8月の定期リバランス時には組入グループの変更はありませんでした。

○ 今後の運用方針

- ・ 投資対象である国債の各国／満期グループの中で、銘柄選定時点の最終利回り、ローリングイールドおよび為替ヘッジコスト／プレミアムを基に、金利中立的なシナリオの下で円建ての期待リターンが最も高い5つのグループから選択した銘柄を組み入れる運用を行う方針です。また、外貨建債券を組み入れる場合については、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

なお、今期間より当ファンドの投資ユニバースにアイルランドが追加されました。

○1万口当たりの費用明細

(2022年9月7日～2023年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保 管 費 用)	1	0.016	
(そ の 他)	(1)	(0.016)	
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、7,807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9月7日～2023年9月6日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
国内	国債証券		千円	千円
			54,780,993	8,601,729
外国	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	フランス	国債証券	—	96,296
	ベルギー	国債証券	22,087	222,558
	オーストリア	国債証券	78,172	180,355
	フィンランド	国債証券	71,432	173,396

(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9月7日～2023年9月6日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2023年9月6日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	46,120,000	46,181,679	99.3	—	59.5	31.6	8.2
合 計	46,120,000	46,181,679	99.3	—	59.5	31.6	8.2

(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。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			償 還 年 月 日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
国債証券	%	千円	千円	
第142回利付国債 (5年)	0.1	3,800,000	3,807,790	2024/12/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	5,400,000	5,409,234	2025/12/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	3,900,000	3,903,159	2026/12/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	5,400,000	5,386,176	2027/12/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	3,800,000	3,769,258	2028/12/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	5,600,000	5,518,968	2029/12/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	3,760,000	3,671,038	2030/12/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	5,760,000	5,563,411	2031/12/20
第369回利付国債 (10年)	0.5	3,400,000	3,370,080	2032/12/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	5,300,000	5,782,565	2033/12/20
合 計		46,120,000	46,181,679	

○投資信託財産の構成

(2023年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 46,181,679	% 99.3
コール・ローン等、その他	347,095	0.7
投資信託財産総額	46,528,774	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年9月6日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	46,528,774,904	
コール・ローン等	317,347,040	
国債証券(評価額)	46,181,679,600	
未収利息	29,748,264	
(B) 負債	790	
未払利息	790	
(C) 純資産総額(A-B)	46,528,774,114	
元本	60,173,515,105	
次期繰越損益金	△13,644,740,991	
(D) 受益権総口数	60,173,515,105口	
1万口当たり基準価額(C/D)	7,732円	

<注記事項>

- ①期首元本額 91,552,040,253円
 期中追加設定元本額 2,399,015,765円
 期中一部解約元本額 33,777,540,913円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.7732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)

MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ(適格機関投資家転売制限付)	20,457,914,215円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-11(適格機関投資家転売制限付)	4,138,045,765円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-05(適格機関投資家転売制限付)	3,925,997,732円
MUKAM 3資産インカムバランスファンド(適格機関投資家転売制限付)	3,388,119,341円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-07(適格機関投資家転売制限付)	3,227,205,123円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-0901(適格機関投資家転売制限付)	2,832,248,095円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2019-09(適格機関投資家転売制限付)	2,595,961,328円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-06(適格機関投資家転売制限付)	2,592,594,486円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-08(適格機関投資家転売制限付)	2,500,968,328円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-03(適格機関投資家転売制限付)	2,075,410,844円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-05(適格機関投資家転売制限付)	1,955,344,128円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-10(適格機関投資家転売制限付)	1,680,592,917円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2019-12(適格機関投資家転売制限付)	1,670,785,982円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-01(適格機関投資家転売制限付)	1,539,198,842円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-09(適格機関投資家転売制限付)	1,071,857,458円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-04(適格機関投資家転売制限付)	828,238,299円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-02(適格機関投資家転売制限付)	817,421,065円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2019-10(適格機関投資家転売制限付)	679,980,778円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-01(適格機関投資家転売制限付)	489,040,142円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-10(適格機関投資家転売制限付)	487,161,716円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-0929(適格機関投資家転売制限付)	411,603,809円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2021-06(適格機関投資家転売制限付)	360,038,402円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2020-02(適格機関投資家転売制限付)	240,734,219円
MUKAM 先進国高格付国債ファンドⅡ2022-03(適格機関投資家転売制限付)	111,542,388円
ラップ向け先進国高格付国債ファンドⅡ	95,509,707円
合計	60,173,515,105円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は13,644,740,991円です。

○損益の状況 (2022年9月7日～2023年9月6日)

項 目	当 期	円
(A) 受取利息等収益	354,613,493	
受取利息	355,441,357	
その他収益金	309,923	
支払利息	△ 1,137,787	
(B) 有価証券売買損益	△ 4,186,944,649	
売買益	6,913,658,118	
売買損	△11,100,602,767	
(C) 保管費用等	△ 9,265,018	
(D) 当期利益(A+B+C)	△ 3,841,596,174	
(E) 前期繰越損益金	△16,666,131,968	
(F) 追加信託差損益金	△ 536,785,765	
(G) 解約差損益金	7,399,772,916	
(H) 計(D+E+F+G)	△13,644,740,991	
次期繰越損益金(H)	△13,644,740,991	

(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) (G) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

【お 知 ら せ】

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。