

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	2025年3月14日まで（2010年4月16日設定）	
運用方針	ファンド・オブ・ファンズ方式により、安定したインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	世界投資適格債オープン（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（JPYクラス） マザーファンド
	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（JPYクラス）	日本を除く世界の投資適格格付け（BBB格相当以上）を有する社債*とソブリン債券 *社債にはCoCosを含みます。
	マネー・プールマザーファンド	わが国の公社債
運用方法	<ul style="list-style-type: none"> 米ドルやユーロなど複数通貨（以下、「原資産通貨」ということがあります。）建の日本を除く世界の投資適格格付けを有する社債とソブリン債券に投資し、安定したインカムゲインの確保と、債券の値上がり益の獲得を目指します。 実質的な外貨建資産に対して原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかりますが、完全な為替変動リスクを排除することはできません。 	
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> 投資信託証券、短期社債等およびコマースナル・ペーパー以外の有価証券への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 	
分配方針	毎月15日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して、分配金額を決定します。原則として、配当等収益や分配対象額の水準等を考慮し、安定した分配を継続することをめざします。（ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わない場合もあります。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。）	

運用報告書（全体版）

世界投資適格債オープン
（為替ヘッジあり）（毎月決算型）

第166期（決算日：2024年4月15日）
 第167期（決算日：2024年5月15日）
 第168期（決算日：2024年6月17日）
 第169期（決算日：2024年7月16日）
 第170期（決算日：2024年8月15日）
 第171期（決算日：2024年9月17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「世界投資適格債オープン（為替ヘッジあり）（毎月決算型）」は、去る9月17日に第171期の決算を行いましたので、法令に基づいて第166期～第171期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客さま専用
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）

お客さまのお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

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

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 分 配 金 騰 落 中 率			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		円	円	%				
142期(2022年4月15日)	8,059	10		△2.6	—	—	98.1	4,163
143期(2022年5月16日)	7,869	10		△2.2	—	—	98.9	4,041
144期(2022年6月15日)	7,552	10		△3.9	—	—	98.2	3,847
145期(2022年7月15日)	7,687	10		1.9	—	—	99.0	3,894
146期(2022年8月15日)	7,794	10		1.5	—	—	99.4	3,942
147期(2022年9月15日)	7,454	10		△4.2	—	—	98.2	3,850
148期(2022年10月17日)	7,087	10		△4.8	—	—	98.3	3,566
149期(2022年11月15日)	7,201	10		1.7	—	—	98.5	3,624
150期(2022年12月15日)	7,421	10		3.2	—	—	99.0	3,727
151期(2023年1月16日)	7,390	10		△0.3	—	—	98.4	3,682
152期(2023年2月15日)	7,287	10		△1.3	—	—	99.4	3,602
153期(2023年3月15日)	7,192	10		△1.2	—	—	98.2	3,543
154期(2023年4月17日)	7,238	10		0.8	—	—	99.1	3,541
155期(2023年5月15日)	7,218	10		△0.1	—	—	98.0	3,520
156期(2023年6月15日)	7,081	10		△1.8	—	—	99.2	3,420
157期(2023年7月18日)	7,082	10		0.2	—	—	98.0	3,316
158期(2023年8月15日)	6,947	10		△1.8	—	—	99.2	3,221
159期(2023年9月15日)	6,900	10		△0.5	—	—	98.5	3,173
160期(2023年10月16日)	6,751	10		△2.0	—	—	98.0	3,074
161期(2023年11月15日)	6,829	5		1.2	—	—	98.7	3,093
162期(2023年12月15日)	7,100	5		4.0	—	—	98.1	3,190
163期(2024年1月15日)	7,063	5		△0.5	—	—	98.3	3,171
164期(2024年2月15日)	6,939	5		△1.7	—	—	98.7	3,061
165期(2024年3月15日)	6,942	5		0.1	—	—	99.3	3,046
166期(2024年4月15日)	6,869	5		△1.0	0.0	—	98.1	2,950
167期(2024年5月15日)	6,866	5		0.0	0.0	—	98.4	2,900
168期(2024年6月17日)	6,908	5		0.7	0.0	—	99.1	2,901
169期(2024年7月16日)	6,920	5		0.2	0.0	—	98.0	2,850
170期(2024年8月15日)	7,004	5		1.3	0.0	—	98.8	2,866
171期(2024年9月17日)	7,053	5		0.8	0.0	—	98.2	2,861

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第166期	(期 首) 2024年 3月15日	円 6,942	% -	% -	% -	% -	% 99.3
	3月末	6,972	0.4	-	-	-	98.5
	(期 末) 2024年 4月15日	6,874	△1.0	0.0	-	-	98.1
第167期	(期 首) 2024年 4月15日	6,869	-	0.0	-	-	98.1
	4月末	6,804	△0.9	0.0	-	-	98.0
	(期 末) 2024年 5月15日	6,871	0.0	0.0	-	-	98.4
第168期	(期 首) 2024年 5月15日	6,866	-	0.0	-	-	98.4
	5月末	6,829	△0.5	0.0	-	-	98.9
	(期 末) 2024年 6月17日	6,913	0.7	0.0	-	-	99.1
第169期	(期 首) 2024年 6月17日	6,908	-	0.0	-	-	99.1
	6月末	6,865	△0.6	0.0	-	-	98.2
	(期 末) 2024年 7月16日	6,925	0.2	0.0	-	-	98.0
第170期	(期 首) 2024年 7月16日	6,920	-	0.0	-	-	98.0
	7月末	6,927	0.1	0.0	-	-	98.2
	(期 末) 2024年 8月15日	7,009	1.3	0.0	-	-	98.8
第171期	(期 首) 2024年 8月15日	7,004	-	0.0	-	-	98.8
	8月末	6,984	△0.3	0.0	-	-	98.0
	(期 末) 2024年 9月17日	7,058	0.8	0.0	-	-	98.2

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第166期～第171期：2024年3月16日～2024年9月17日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第166期首	6,942円
第171期末	7,053円
既払分配金	30円
騰落率	2.0%

(分配金再投資ベース)

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

※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2.0%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

> 基準価額の主な変動要因

上昇要因

米国やユーロ圏の利回りが低下したこと等を背景に投資適格債券市況が上昇したこと。
債券利子収入を享受したこと等。

第166期～第171期：2024年3月16日～2024年9月17日

▶ 投資環境について

▶ 投資適格債券市況

世界国債市場と投資適格社債市場は上昇しました。

世界国債市場について、米国とユーロ圏全体の利回りは低下しました。インフレ鈍化を受けた米欧中央銀行による利下げ観測が高まったこと等から、米国とユーロ圏全体の利回りは低下しました。世界国債市場全体で見ると、米国やユーロ圏全体の利回りが低下したこと等がプラスとなり上昇しました。

投資適格社債市場について、米国の景気後退懸念や地政学リスクの高まり等を背景に投資家心理が悪化したこと等からスプレッド（国債との利回り格差）が拡大したことがマイナスとなったものの、米国やユーロ圏全体の国債利回りが低下したことがプラスとなり、同市場は上昇しました。

▶ 国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は、日銀による利上げを受け、期間末にはプラス圏となりました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 世界投資適格債オープン（為替ヘッジあり）（毎月決算型）

当期間を通じて、円建の外国投資信託であるワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（JPYクラス）受益証券を高位に組み入れ、マネー・プール マザーファンド受益証券にも一部投資を行いました。

取引を行った実質米ドル建資産に対して、米ドル売り／円買いの為替ヘッジを行いました。

▶ マネー・プール マザーファンド

コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

▶ ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（JPYクラス）

米ドルやユーロなど、複数通貨建の日本を除く世界の投資適格格付けを有する社債とソブリン債券を中心に投資を行いました。

2024年8月末時点において、ソブリン債券22.5%、社債75.1%としました。基本投資比率は、ソブリン債券25%程度、社債75%程度です。投資環境、流動性などを勘案し、±25%程度の範囲で投資比率の変更を行うことがあります。

国・地域別配分では、米国を比較的高位の組み入れとしました。社債のセクター別配分については、銀行セクターを組み入れの中心としました。

米ドル以外の通貨建の資産に関しては、実質的に米ドル建となるように為替取引を行いました。米ドル建資産および為替

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

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、残存信託期間等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第166期 2024年3月16日～ 2024年4月15日	第167期 2024年4月16日～ 2024年5月15日	第168期 2024年5月16日～ 2024年6月17日	第169期 2024年6月18日～ 2024年7月16日	第170期 2024年7月17日～ 2024年8月15日	第171期 2024年8月16日～ 2024年9月17日
当期分配金 （対基準価額比率）	5 (0.073%)	5 (0.073%)	5 (0.072%)	5 (0.072%)	5 (0.071%)	5 (0.071%)
当期の収益	—	0	0	0	0	0
当期の収益以外	5	4	4	4	4	4
翌期繰越分配対象額	1,145	1,141	1,136	1,132	1,127	1,122

（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。）

▶ 世界投資適格債オープン（為替ヘッジあり）（毎月決算型）

引き続き、当ファンドが主要投資対象とする円建の外国投資信託であるワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（JPYクラス）受益証券に投資を行います。また、マネー・プール マザーファンド受益証券への投資も行います。

▶ ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（JPYクラス）

世界経済の先行きについては、景気の軟着陸を基本的なシナリオと予想しています。労働市場の動向や主要中央銀行の金融政策動向に注視しています。

社債については、既発債だけではなく、投資妙味があると判断した新発債にも投資を行います。

引き続き、米ドルやユーロ等、複数通貨建の日本を除く世界の投資適格格付けを有する社債とソブリン債券を中心に投資を行うとともに、米ドル以外の通貨建の資産に関しては、実質的に米ドル建となるように為替取引を行います。また、米ドル建資産および為替取引を行った実質米ドル建資産に対しては、原則として米ドル売り／円買いの為替ヘッジを行い、

為替変動リスクの低減をはかります。

国・地域別配分については、米国を中心に英国やユーロ圏等、幅広く投資を行う方針です。

社債のセクター別では、収益性が堅調に推移するとみられる銀行セクターの銘柄などをポジティブにみています。一方、消費に関する慎重な姿勢の強まりなどを考慮して一般消費財セクターについては慎重なスタンスとしています。

▶ マネー・プール マザーファンド

日銀による金融市場調節方針の下、短期金利は低位安定した推移を想定しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

2024年3月16日～2024年9月17日

1万口当たりの費用明細

項目	第166期～第171期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	36	0.521	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(16)	(0.224)	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）	(19)	(0.280)	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	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（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
合計	36	0.523	

作成期中の平均基準価額は、6,913円です。

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

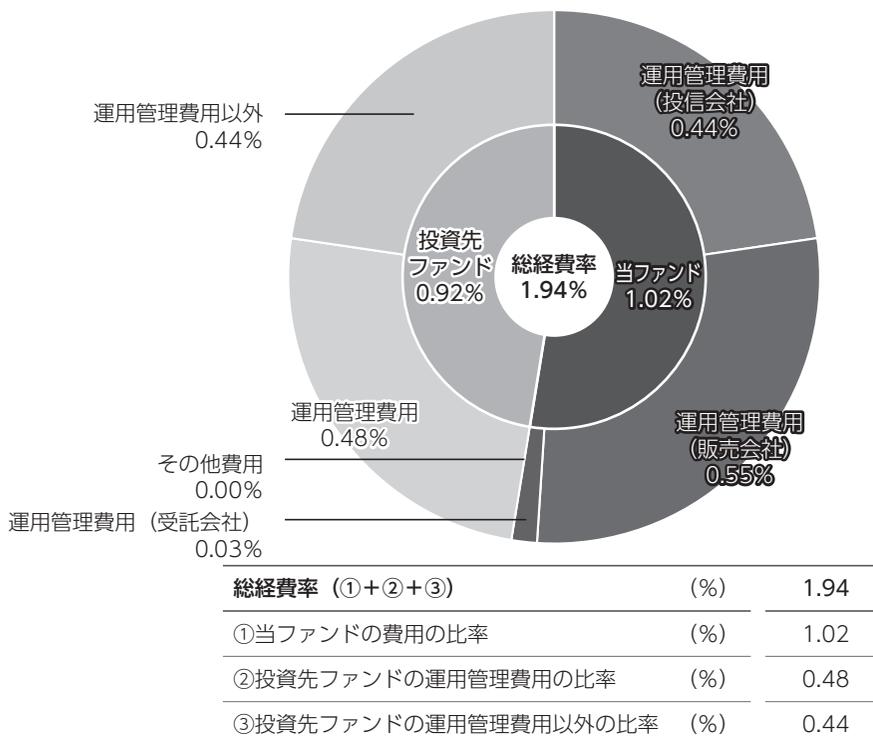
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.94%**です。



(注) ①の費用は、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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

(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

（2024年3月16日～2024年9月17日）

投資信託証券

銘柄		第166期～第171期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ワールド・インベストメント・グレード・ ボンド・ファンド（JPYクラス）	千口 1,171	千円 776	千口 429,923	千円 288,350

（注）金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2024年3月16日～2024年9月17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

（2024年9月17日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		第165期末	第171期末		
		口数	口数	評価額	比率
	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ ファンド（JPYクラス）	千口 4,510,078	千口 4,081,325	千円 2,809,584	% 98.2
合	計	4,510,078	4,081,325	2,809,584	98.2

（注）比率は世界投資適格債オープン（為替ヘッジあり）（毎月決算型）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄		第165期末	第171期末	
		口数	口数	評価額
マネー・プール	マザーファンド	千口 99	千口 99	千円 100

○投資信託財産の構成

（2024年9月17日現在）

項 目	第171期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 2,809,584	% 98.0
マネー・プール マザーファンド	100	0.0
コール・ローン等、その他	56,904	2.0
投資信託財産総額	2,866,588	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第166期末	第167期末	第168期末	第169期末	第170期末	第171期末
	2024年4月15日現在	2024年5月15日現在	2024年6月17日現在	2024年7月16日現在	2024年8月15日現在	2024年9月17日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	2,956,217,643	2,904,683,235	2,906,426,396	2,861,724,162	2,871,327,162	2,866,588,778
コール・ローン等	60,838,772	51,070,016	30,223,935	67,670,524	38,670,274	56,903,813
投資信託受益証券(評価額)	2,895,278,735	2,853,513,103	2,876,102,380	2,793,953,483	2,832,556,614	2,809,584,567
マネー・プール マザーファンド(評価額)	100,029	100,029	100,029	100,039	100,049	100,069
未収利息	107	87	52	116	225	329
(B) 負債	5,508,769	4,563,049	4,785,055	11,599,754	4,450,160	4,677,976
未払収益分配金	2,147,897	2,112,073	2,100,250	2,059,193	2,046,663	2,028,947
未払解約金	730,594	15	6	7,208,089	54	118
未払信託報酬	2,619,022	2,440,473	2,673,312	2,322,495	2,393,162	2,637,575
その他未払費用	11,256	10,488	11,487	9,977	10,281	11,336
(C) 純資産総額(A-B)	2,950,708,874	2,900,120,186	2,901,641,341	2,850,124,408	2,866,877,002	2,861,910,802
元本	4,295,794,983	4,224,146,765	4,200,501,165	4,118,386,289	4,093,327,947	4,057,895,716
次期繰越損益金	△1,345,086,109	△1,324,026,579	△1,298,859,824	△1,268,261,881	△1,226,450,945	△1,195,984,914
(D) 受益権総口数	4,295,794,983口	4,224,146,765口	4,200,501,165口	4,118,386,289口	4,093,327,947口	4,057,895,716口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,869円	6,866円	6,908円	6,920円	7,004円	7,053円

○損益の状況

項 目	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
	2024年3月16日～ 2024年4月15日	2024年4月16日～ 2024年5月15日	2024年5月16日～ 2024年6月17日	2024年6月18日～ 2024年7月16日	2024年7月17日～ 2024年8月15日	2024年8月16日～ 2024年9月17日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	2,698	213,987	300,146	270,187	5,589	9,182
受取配当金	—	210,775	298,036	268,121	—	—
受取利息	2,702	3,212	2,110	2,066	5,589	9,182
支払利息	△ 4	—	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	△ 26,523,601	2,976,289	22,238,973	9,329,611	38,529,865	24,515,782
売買益	131,505	24,547,842	22,291,908	54,622,528	38,607,776	34,304,148
売買損	△ 26,655,106	△ 21,571,553	△ 52,935	△ 45,292,917	△ 77,911	△ 9,788,366
(C) 信託報酬等	△ 2,630,278	△ 2,450,961	△ 2,684,799	△ 2,332,472	△ 2,403,443	△ 2,648,911
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	△ 29,151,181	739,315	19,854,320	7,267,326	36,132,011	21,876,053
(E) 前期繰越損益金	△ 997,478,315	△ 1,009,246,236	△ 1,002,632,180	△ 963,589,242	△ 950,193,053	△ 905,784,314
(F) 追加信託差損益金	△ 316,308,716	△ 313,407,585	△ 313,981,714	△ 309,880,772	△ 310,343,240	△ 310,047,706
(配当等相当額)	(494,401,664)	(484,043,562)	(479,282,970)	(468,113,471)	(463,421,916)	(457,386,932)
(売買損益相当額)	(△ 810,710,380)	(△ 797,451,147)	(△ 793,264,684)	(△ 777,994,243)	(△ 773,765,156)	(△ 767,434,638)
(G) 計 (D+E+F)	△ 1,342,938,212	△ 1,321,914,506	△ 1,296,759,574	△ 1,266,202,688	△ 1,224,404,282	△ 1,193,955,967
(H) 収益分配金	△ 2,147,897	△ 2,112,073	△ 2,100,250	△ 2,059,193	△ 2,046,663	△ 2,028,947
次期繰越損益金 (G+H)	△ 1,345,086,109	△ 1,324,026,579	△ 1,298,859,824	△ 1,268,261,881	△ 1,226,450,945	△ 1,195,984,914
追加信託差損益金	△ 318,456,613	△ 315,470,129	△ 315,817,524	△ 311,735,318	△ 312,384,548	△ 312,068,514
(配当等相当額)	(492,253,767)	(481,981,018)	(477,447,160)	(466,258,925)	(461,380,608)	(455,366,124)
(売買損益相当額)	(△ 810,710,380)	(△ 797,451,147)	(△ 793,264,684)	(△ 777,994,243)	(△ 773,765,156)	(△ 767,434,638)
繰越損益金	△ 1,026,629,496	△ 1,008,556,450	△ 983,042,300	△ 956,526,563	△ 914,066,397	△ 883,916,400

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

<注記事項>

①作成期首（前作成期末）元本額 4,389,349,718円

 作成期中追加設定元本額 9,692,474円

 作成期中一部解約元本額 341,146,476円

また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7053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1,195,984,914円です。

③分配金の計算過程

項 目	2024年3月16日～ 2024年4月15日	2024年4月16日～ 2024年5月15日	2024年5月16日～ 2024年6月17日	2024年6月18日～ 2024年7月16日	2024年7月17日～ 2024年8月15日	2024年8月16日～ 2024年9月17日
費用控除後の配当等収益額	—円	49,529円	264,440円	204,647円	5,355円	8,139円
費用控除後・繰越大損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	494,401,664円	484,043,562円	479,282,970円	468,113,471円	463,421,916円	457,386,932円
分配準備積立金額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
当ファンドの分配対象収益額	494,401,664円	484,093,091円	479,547,410円	468,318,118円	463,427,271円	457,395,071円
1万口当たり収益分配対象額	1,150円	1,146円	1,141円	1,137円	1,132円	1,127円
1万口当たり分配金額	5円	5円	5円	5円	5円	5円
収益分配金金額	2,147,897円	2,112,073円	2,100,250円	2,059,193円	2,046,663円	2,028,947円

○分配金のお知らせ

	第166期	第167期	第168期	第169期	第170期	第171期
1万口当たり分配金（税込み）	5円	5円	5円	5円	5円	5円

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

当ファンドは信託約款に基づき、2025年3月14日に信託期間を終了し満期償還となる予定です。

〈参考〉投資する投資信託証券およびその概要

当ファンドは、世界投資適格債オープン（為替ヘッジあり）（毎月決算型）が投資対象とする円建の外国投資信託証券です。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

投資信託証券	ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド（ＪＰＹクラス）
運用方針	<ol style="list-style-type: none"> 日本を除く世界の投資適格格付け（ＢＢＢ格相当以上）を有する社債とソブリン債券を中心に投資を行います。 当ファンドにおいて、米ドルやユーロなど複数通貨建の資産に投資しますが、組入れる外貨建資産に対して原則として以下の為替取引または為替ヘッジを行います。 <ol style="list-style-type: none"> 米ドル以外の通貨建の資産に関しては、実質的に米ドル建となるように為替取引を行います。 米ドル建資産および（１）で為替取引を行った実質米ドル建資産に対して、原則として対円で為替ヘッジを行います。 投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等の場合をいいます。）の発生を含む市況動向や資金動向、残存信託期間等の事情によっては、前記のような運用ができない場合があります。
投資顧問会社	ＪＰモルガン・アセット・マネジメント（ＵＫ）リミテッド※
信託期限	無期限
設定日	2010年4月16日
会計年度	毎年12月末
収益分配方針	原則として、毎月分配を行います。

※ＪＰモルガン・アセット・マネジメント（ＵＫ）リミテッド（所在地：英国ロンドン）は、1974年2月に英国において設立された運用会社であり、ＪＰモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の資産運用部門である「ＪＰモルガン・アセット・マネジメント」グループに所属しています。

ワールド・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド

損益計算書、純資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なFinancial Statementsから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

(2023年12月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

投資収益		
受取利息(源泉徴収税控除後)	\$	1,907,839
投資収益合計		1,907,839
費用		
投資顧問料		205,400
保管費用		161,294
専門家報酬		64,784
会計処理および管理手数料		46,215
名義書換事務代行手数料		5,135
登録費用		2,113
費用合計		484,941
投資純利益		1,422,898
実現および未実現損益：		
実現損益：		
投資有価証券		(2,410,072)
先物取引		43,787
外国通貨取引および為替予約取引		(4,660,739)
実現純損益		(7,027,024)
未実現評価損益の純変動：		
投資有価証券		5,012,936
先物取引		(162,690)
外国通貨取引および為替予約取引		1,114,573
未実現評価損益の純変動		5,964,819
実現および未実現損益 (純額)		(1,062,205)
運用による純資産の増減 (純額)	\$	360,693

(注) () 内の金額は、マイナスの金額です。

2. 純資産変動計算書

(2023年12月31日に終了する期間)

(米ドルで表示)

運用による純資産の増減額：

投資純利益	\$	1,422,898
実現純損益		(7,027,024)
未実現評価損益の純変動		5,964,819
運用による純資産の増減額		360,693

分配額		(1,583,144)
ファンドユニットの取引による純資産の増減額		(1,159,455)
純資産の増減額		(2,381,906)

純資産

期首		53,508,106
期末	\$	51,126,200

	JPYクラス	USD-hedged (F) クラス		
ファンドユニット取引				
ユニット数				
発行	–	808,582,280		
買戻し	10,315,411	204,934,682		
償還	(636,759,275)	(782,765,397)		
ユニット増減数	(626,443,864)	230,751,565		
金額				
発行	\$	–	\$	6,099,807
買戻し		53,060		1,530,084
償還		(3,024,704)		(5,817,702)
ファンドユニット取引による増減額	\$	(2,971,644)	\$	1,812,189

3. 投資明細表

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%)		
		AUSTRALIA (2.7%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (1.1%)		
		NBN Co., Ltd.		
USD	200,000	5.75% due 10/06/28 ^{(a),(b)}	\$	207,999
		Toyota Finance Australia, Ltd.		
EUR	100,000	0.44% due 01/13/28		99,702
		Westpac Banking Corp.		
EUR	150,000	3.11% due 11/23/27		166,457
		Woolworths Group, Ltd.		
EUR	100,000	0.38% due 11/15/28 ^(a)		94,814
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		568,972
		GOVERNMENT BONDS (1.6%)		
		Australia Government Bond		
AUD	780,000	3.00% due 11/21/33		489,900
AUD	452,000	4.75% due 06/21/54		331,650
		TOTAL GOVERNMENT BONDS		821,550
		TOTAL AUSTRALIA (Cost \$1,288,701)		1,390,522
		AUSTRIA (0.4%)		
		CORPORATE BOND & NOTE (0.4%)		
		Suzano Austria GmbH		
USD	200,000	5.00% due 01/15/30 ^(a)		193,372
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE		193,372
		TOTAL AUSTRIA (Cost \$218,940)		193,372
		BRAZIL (0.5%)		
		CORPORATE BOND & NOTE (0.5%)		
		Vale Overseas, Ltd.		
USD	250,000	3.75% due 07/08/30 ^(a)		230,104
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE		230,104
		TOTAL BRAZIL (Cost \$258,156)		230,104
		CANADA (3.2%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (1.3%)		
		Canadian Imperial Bank of Commerce		
USD	200,000	5.99% due 10/03/28 ^(a)		209,204
		Fortis, Inc.		
USD	168,000	3.06% due 10/04/26 ^(a)		159,476
		Rogers Communications, Inc.		
USD	150,000	3.80% due 03/15/32 ^(a)		138,033
		Toronto-Dominion Bank		
EUR	147,000	2.55% due 08/03/27		158,729
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		665,442
		GOVERNMENT BONDS (1.9%)		
		Canadian Government Bond		
CAD	940,000	0.50% due 12/01/30		595,767
CAD	100,000	3.25% due 12/01/33		76,433
CAD	350,000	3.50% due 12/01/45		281,910
		TOTAL GOVERNMENT BONDS		954,110
		TOTAL CANADA (Cost \$1,783,892)		1,619,552

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名	公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)	
		DENMARK (0.4%)	
		CORPORATE BOND & NOTE (0.4%)	
		Danske Bank AS	
USD	200,000	4.30% due 04/01/28 ^{(a),(b),(c)}	\$ 193,815
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	193,815
		TOTAL DENMARK (Cost \$188,961)	193,815
		FRANCE (8.7%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (6.5%)	
		Banque Federative du Credit Mutuel S.A.	
USD	200,000	5.79% due 07/13/28 ^(b)	206,483
		BNP Paribas S.A.	
USD	200,000	2.16% due 09/15/29 ^{(a),(b),(c)}	173,952
USD	200,000	5.34% due 06/12/29 ^{(a),(b),(c)}	202,867
		BPCE S.A.	
EUR	100,000	1.00% due 10/05/28	100,841
USD	250,000	1.65% due 10/06/26 ^{(a),(b),(c)}	232,664
EUR	300,000	4.38% due 07/13/28	342,321
		Cie de Saint-Gobain S.A.	
EUR	200,000	2.13% due 06/10/28 ^(a)	212,135
		Credit Agricole S.A.	
EUR	200,000	0.38% due 04/20/28	194,891
GBP	100,000	1.87% due 12/09/31 ^{(a),(c)}	113,597
EUR	200,000	4.25% due 07/11/29 ^{(a),(c)}	227,678
		Societe Generale S.A.	
USD	200,000	1.79% due 06/09/27 ^{(a),(b),(c)}	182,038
USD	250,000	2.80% due 01/19/28 ^{(a),(b),(c)}	230,235
		TotalEnergies SE	
EUR	584,000	1.75% due 04/04/24 ^{(a),(c),(d)}	637,819
EUR	150,000	2.00% due 06/04/30 ^{(a),(c),(d)}	139,756
EUR	100,000	3.37% due 10/06/26 ^{(a),(c),(d)}	107,458
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	3,304,735
		GOVERNMENT BONDS (2.2%)	
		French Republic Government Bond OAT	
EUR	490,000	2.50% due 05/25/43 ^(b)	503,201
EUR	600,000	3.00% due 05/25/54 ^(b)	650,521
		TOTAL GOVERNMENT BONDS	1,153,722
		TOTAL FRANCE (Cost \$4,369,517)	4,458,457
		GERMANY (0.7%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (0.7%)	
		Deutsche Bank AG	
EUR	200,000	1.75% due 11/19/30 ^{(a),(c)}	191,749
		Vonovia SE	
EUR	100,000	0.38% due 06/16/27 ^(a)	98,563
EUR	100,000	1.50% due 06/14/41 ^(a)	71,580
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	361,892
		TOTAL GERMANY (Cost \$376,739)	361,892

(2023年12月31日現在)

元本金額	銘柄名	公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)	
	INDONESIA (0.4%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.4%)	
USD	200,000 Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.45% due 05/21/28	\$ 203,250
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	203,250
	TOTAL INDONESIA (Cost \$224,209)	203,250
	IRELAND (1.7%)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (1.7%)	
USD	150,000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 2.45% due 10/29/26 ^(a)	138,888
USD	200,000 Avolon Holdings Funding, Ltd. 3.25% due 02/15/27 ^(a)	185,104
USD	200,000 4.25% due 04/15/26 ^{(a),(b)}	193,163
USD	400,000 Bank of Ireland Group PLC 2.03% due 09/30/27 ^{(a),(b),(c)}	364,722
	TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	881,877
	TOTAL IRELAND (Cost \$913,744)	881,877
	ITALY (4.5%)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (0.6%)	
EUR	100,000 Autostrade per l'Italia SpA 1.88% due 09/26/29 ^(a)	98,085
EUR	200,000 Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.75% due 07/24/32	179,885
	TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	277,970
	GOVERNMENT BOND (3.9%)	
EUR	1,750,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.00% due 11/15/30	2,014,212
	TOTAL GOVERNMENT BOND	2,014,212
	TOTAL ITALY (Cost \$2,112,700)	2,292,182
	LUXEMBOURG (0.9%)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (0.9%)	
EUR	100,000 CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 1.50% due 10/17/31 ^(a)	92,676
EUR	200,000 Holcim Finance Luxembourg S.A. 0.63% due 01/19/33 ^(a)	172,393
EUR	100,000 Medtronic Global Holdings SCA 1.50% due 07/02/39 ^(a)	84,205
EUR	100,000 SELP Finance sarl 1.50% due 11/20/25 ^(a)	106,118
	TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	455,392
	TOTAL LUXEMBOURG (Cost \$490,955)	455,392
	MALAYSIA (0.4%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.4%)	
USD	200,000 Gohl Capital, Ltd. 4.25% due 01/24/27	192,541
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	192,541
	TOTAL MALAYSIA (Cost \$206,267)	192,541

(2023年12月31日現在)

元本金額	銘柄名	公正価値
	FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)	
	MEXICO (0.2%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.2%)	
EUR	America Movil SAB de CV 2.13% due 03/10/28	\$ 116,106
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	116,106
	TOTAL MEXICO (Cost \$130,719)	116,106
	NETHERLANDS (5.1%)	
	CORPORATE BONDS & NOTES (5.1%)	
EUR	ABB Finance BV 3.38% due 01/16/31 ^(a)	395,886
USD	ABN AMRO Bank NV 1.54% due 06/16/27 ^{(a),(b),(c)}	181,470
EUR	American Medical Systems Europe BV 1.38% due 03/08/28 ^(a)	154,941
EUR	1.63% due 03/08/31 ^(a)	149,619
USD	Cooperatieve Rabobank UA 3.65% due 04/06/28 ^{(a),(b),(c)}	285,918
EUR	EDP Finance BV 1.50% due 11/22/27	104,219
USD	Enel Finance International NV 3.50% due 04/06/28 ^(b)	374,794
EUR	Iberdrola International BV 1.45% due 11/09/26 ^{(a),(c),(d)}	100,321
EUR	1.87% due 01/28/26 ^{(a),(c),(d)}	103,909
EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 0.80% due 10/18/30 ^(a)	95,782
EUR	1.63% due 10/18/41 ^(a)	166,451
EUR	2.00% due 10/18/51 ^(a)	118,344
EUR	Volkswagen International Finance NV 1.25% due 09/23/32	183,681
EUR	3.88% due 06/14/27 ^{(a),(c),(d)}	105,199
EUR	WPC Eurobond BV 1.35% due 04/15/28 ^(a)	100,823
	TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	2,621,357
	TOTAL NETHERLANDS (Cost \$2,681,926)	2,621,357
	NORWAY (0.3%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.3%)	
USD	Aker BP ASA 3.10% due 07/15/31 ^{(a),(b)}	171,058
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	171,058
	TOTAL NORWAY (Cost \$172,723)	171,058
	SINGAPORE (0.7%)	
	CORPORATE BOND & NOTE (0.7%)	
EUR	Temasek Financial I, Ltd. 3.50% due 02/15/33 ^(a)	339,867
	TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	339,867
	TOTAL SINGAPORE (Cost \$313,958)	339,867

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名	公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)	
		SLOVAKIA (0.4%)	
		CORPORATE BOND & NOTE (0.4%)	
EUR	200,000	Vseobecna Uverova Banka AS 3.88% due 09/05/28	\$ 227,394
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	227,394
		TOTAL SLOVAKIA (Cost \$216,317)	227,394
		SPAIN (2.7%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (0.8%)	
USD	200,000	Banco Santander S.A. 4.25% due 04/11/27	193,724
EUR	200,000	CaixaBank S.A. 5.00% due 07/19/29 ^{(a),(c)}	230,796
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	424,520
		GOVERNMENT BONDS (1.9%)	
EUR	300,000	Spain Government Bond 3.15% due 04/30/33 ^(b)	336,667
EUR	550,000	3.55% due 10/31/33 ^(b)	635,783
		TOTAL GOVERNMENT BONDS	972,450
		TOTAL SPAIN (Cost \$1,341,636)	1,396,970
		SUPRANATIONAL (1.6%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (0.6%)	
USD	200,000	African Export-Import Bank 4.13% due 06/20/24	198,000
EUR	100,000	Banque Ouest Africaine de Developpement 2.75% due 01/22/33 ^(a)	84,148
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	282,148
		GOVERNMENT BONDS (1.0%)	
EUR	78,000	European Union 0.40% due 02/04/37	63,715
EUR	120,109	0.45% due 07/04/41	86,913
EUR	370,000	1.00% due 07/06/32	359,670
		TOTAL GOVERNMENT BONDS	510,298
		TOTAL SUPRANATIONAL (Cost \$862,575)	792,446
		SWEDEN (0.3%)	
		CORPORATE BOND & NOTE (0.3%)	
EUR	138,000	Swedbank AB 4.25% due 07/11/28	156,446
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	156,446
		TOTAL SWEDEN (Cost \$146,227)	156,446
		SWITZERLAND (1.4%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (1.4%)	
USD	390,000	Credit Suisse AG 2.95% due 04/09/25	377,956
EUR	200,000	UBS Group AG 3.25% due 04/02/26 ^{(a),(c)}	218,709
GBP	100,000	7.00% due 09/30/27 ^{(a),(c)}	132,644
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	729,309
		TOTAL SWITZERLAND (Cost \$759,695)	729,309

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名	公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)	
		UNITED ARAB EMIRATES (0.4%)	
		CORPORATE BOND & NOTE (0.4%)	
USD	200,000	DP World Crescent, Ltd. 4.85% due 09/26/28	\$ 199,073
		TOTAL CORPORATE BOND & NOTE	199,073
		TOTAL UNITED ARAB EMIRATES (Cost \$220,733)	199,073
		UNITED KINGDOM (11.6%)	
		CORPORATE BONDS & NOTES (9.1%)	
EUR	150,000	AstraZeneca PLC 1.25% due 05/12/28 ^(a)	155,716
USD	150,000	1.38% due 08/06/30 ^(a)	124,699
USD	200,000	Barclays PLC 7.44% due 11/02/33 ^{(a),(c)}	223,945
EUR	300,000	BP Capital Markets PLC 3.63% due 03/22/29 ^{(a),(c),(d)}	309,824
GBP	100,000	DWR Cymru Financing UK PLC 2.38% due 03/31/34	95,357
GBP	150,000	Eversholt Funding PLC 6.36% due 12/02/25	196,099
GBP	153,300	Great Rolling Stock Co. PLC 6.50% due 04/05/31	205,750
EUR	200,000	Heathrow Funding, Ltd. 1.13% due 10/08/30 ^(a)	188,790
EUR	100,000	1.88% due 07/12/32	96,556
EUR	150,000	4.50% due 07/11/33 ^(a)	176,123
GBP	80,000	6.75% due 12/03/26	107,177
GBP	200,000	HSBC Holdings PLC 2.26% due 11/13/26 ^{(a),(c)}	241,484
USD	255,000	4.04% due 03/13/28 ^{(a),(c)}	245,645
USD	200,000	5.21% due 08/11/28 ^{(a),(c)}	199,824
USD	200,000	6.25% due 03/09/34 ^{(a),(c)}	212,581
GBP	100,000	Lloyds Banking Group PLC 1.99% due 12/15/31 ^{(a),(c)}	114,335
GBP	105,000	2.71% due 12/03/35 ^{(a),(c)}	107,679
GBP	100,000	National Grid Electricity Distribution South Wales PLC 5.75% due 03/23/40	135,569
EUR	250,000	NatWest Group PLC 0.67% due 09/14/29 ^{(a),(c)}	239,682
USD	200,000	1.64% due 06/14/27 ^{(a),(c)}	182,618
GBP	100,000	3.13% due 03/28/27 ^{(a),(c)}	121,087
GBP	100,000	Northern Gas Networks Finance PLC 4.88% due 06/30/27	128,649
USD	400,000	Santander UK Group Holdings PLC 1.67% due 06/14/27 ^{(a),(c)}	363,628
GBP	112,000	Tesco Corporate Treasury Services PLC 1.88% due 11/02/28 ^(a)	125,737
EUR	190,000	Thames Water Utilities Finance PLC 1.25% due 01/31/32 ^(a)	157,438
EUR	100,000	4.38% due 01/18/31 ^(a)	104,081
USD	90,000	Vodafone Group PLC 4.25% due 09/17/50	74,652
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES	4,634,725

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)		
		UNITED KINGDOM (11.6%) (continued)		
		GOVERNMENT BONDS (2.5%)		
		United Kingdom Gilt		
GBP	280,000	3.25% due 01/31/33	\$	349,080
GBP	690,000	4.50% due 12/07/42		927,354
		TOTAL GOVERNMENT BONDS		1,276,434
		TOTAL UNITED KINGDOM (Cost \$6,348,942)		5,911,159
		UNITED STATES (47.4%)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (42.2%)		
		AbbVie, Inc.		
USD	370,000	3.20% due 11/21/29 ^(a)		345,872
USD	110,000	4.25% due 11/21/49 ^(a)		98,027
USD	120,000	4.88% due 11/14/48 ^(a)		116,982
		Advanced Micro Devices, Inc.		
USD	350,000	3.92% due 06/01/32 ^(a)		338,497
USD	50,000	4.39% due 06/01/52 ^(a)		47,403
		Aetna, Inc.		
USD	68,000	3.88% due 08/15/47 ^(a)		53,165
USD	190,000	4.13% due 11/15/42 ^(a)		157,502
		Altria Group, Inc.		
USD	230,000	3.40% due 05/06/30 ^(a)		209,801
USD	60,000	3.40% due 02/04/41 ^(a)		43,933
		Amazon.com, Inc.		
USD	250,000	3.88% due 08/22/37 ^(a)		231,984
		Ameren Corp.		
USD	120,000	3.50% due 01/15/31 ^(a)		109,486
		American International Group, Inc.		
EUR	100,000	1.88% due 06/21/27 ^(a)		105,524
		American Tower Corp.		
USD	200,000	2.90% due 01/15/30 ^(a)		177,981
		Amgen, Inc.		
USD	150,000	2.80% due 08/15/41 ^(a)		109,066
USD	100,000	4.05% due 08/18/29 ^(a)		97,900
		Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.		
USD	120,000	4.70% due 02/01/36 ^(a)		119,608
		Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.		
USD	85,000	4.63% due 02/01/44		80,908
		Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.		
USD	240,000	4.38% due 04/15/38 ^(a)		227,598
		Apple, Inc.		
EUR	150,000	0.50% due 11/15/31 ^(a)		141,061
USD	100,000	2.65% due 05/11/50 ^(a)		68,834
		AT&T, Inc.		
USD	200,000	2.55% due 12/01/33 ^(a)		163,004
		Bank of America Corp.		
EUR	174,000	1.10% due 05/24/32 ^{(a),(c)}		159,941
GBP	100,000	1.67% due 06/02/29 ^{(a),(c)}		111,960
USD	240,000	2.50% due 02/13/31 ^{(a),(c)}		206,092
USD	150,000	5.20% due 04/25/29 ^{(a),(c)}		150,928
USD	150,000	5.29% due 04/25/34 ^{(a),(c)}		150,345

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)		
		UNITED STATES (47.4%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (42.2%) (continued)		
		BAT Capital Corp.		
USD	490,000	3.46% due 09/06/29 ^(a)	\$	451,376
USD	265,000	3.73% due 09/25/40 ^(a)		194,803
USD	70,000	4.54% due 08/15/47 ^(a)		53,741
		Berkshire Hathaway Finance Corp.		
USD	100,000	2.85% due 10/15/50 ^(a)		70,024
		Berkshire Hathaway, Inc.		
USD	65,000	4.50% due 02/11/43		63,136
		Boeing Co.		
USD	35,000	3.50% due 03/01/39 ^(a)		27,822
USD	105,000	5.71% due 05/01/40 ^(a)		108,563
		BP Capital Markets America, Inc.		
USD	350,000	2.72% due 01/12/32 ^(a)		304,936
USD	100,000	2.77% due 11/10/50 ^(a)		66,880
		Bristol-Myers Squibb Co.		
USD	175,000	4.25% due 10/26/49 ^(a)		151,860
		Broadcom Corp. / Broadcom Cayman Finance, Ltd.		
USD	145,000	3.88% due 01/15/27 ^(a)		141,506
		Broadcom, Inc.		
USD	165,000	2.60% due 02/15/33 ^{(a),(b)}		135,935
USD	200,000	3.42% due 04/15/33 ^{(a),(b)}		175,661
		Burlington Northern Santa Fe LLC		
USD	100,000	4.15% due 04/01/45 ^(a)		88,771
		Celanese US Holdings LLC		
EUR	100,000	4.78% due 07/19/26 ^(a)		112,174
EUR	100,000	5.34% due 01/19/29 ^(a)		115,545
		CF Industries, Inc.		
USD	250,000	5.15% due 03/15/34		247,320
		Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital		
USD	210,000	2.80% due 04/01/31 ^(a)		177,127
USD	100,000	3.50% due 06/01/41 ^(a)		70,681
USD	135,000	3.70% due 04/01/51 ^(a)		87,808
		Cheniere Energy Partners LP		
USD	150,000	4.50% due 10/01/29 ^(a)		143,470
		Citigroup, Inc.		
USD	275,000	2.57% due 06/03/31 ^{(a),(c)}		234,910
USD	300,000	2.98% due 11/05/30 ^{(a),(c)}		267,118
USD	400,000	3.67% due 07/24/28 ^{(a),(c)}		381,212
USD	250,000	3.89% due 01/10/28 ^{(a),(c)}		241,747
USD	150,000	4.41% due 03/31/31 ^{(a),(c)}		143,467
		Cleveland Electric Illuminating Co.		
USD	105,000	4.55% due 11/15/30 ^{(a),(b)}		99,509
		Comcast Corp.		
USD	800,000	3.20% due 07/15/36 ^(a)		672,500
USD	150,000	4.80% due 05/15/33 ^(a)		151,853
		Constellation Energy Generation LLC		
USD	150,000	5.80% due 03/01/33 ^(a)		157,661
USD	150,000	6.13% due 01/15/34 ^(a)		160,513
		Dell International LLC / EMC Corp.		
USD	150,000	5.75% due 02/01/33 ^(a)		158,025

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)		
		UNITED STATES (47.4%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (42.2%) (continued)		
		Discovery Communications LLC		
USD	100,000	4.95% due 05/15/42	\$	82,302
USD	60,000	5.30% due 05/15/49 ^(a)		51,514
		Duke Energy Corp.		
EUR	150,000	3.10% due 06/15/28 ^(a)		163,125
		Duke Energy Progress LLC		
USD	100,000	3.40% due 04/01/32 ^(a)		90,388
		Duquesne Light Holdings, Inc.		
USD	286,000	3.62% due 08/01/27 ^{(a),(b)}		267,189
		Emera US Finance LP		
USD	225,000	4.75% due 06/15/46 ^(a)		185,110
		Entergy Arkansas LLC		
USD	100,000	4.95% due 12/15/44 ^(a)		91,560
		Entergy Texas, Inc.		
USD	150,000	1.75% due 03/15/31 ^(a)		122,851
		Enterprise Products Operating LLC		
USD	140,000	5.35% due 01/31/33 ^(a)		146,519
		General Motors Financial Co., Inc.		
EUR	143,000	0.60% due 05/20/27 ^(a)		144,155
		Glencore Funding LLC		
USD	300,000	2.50% due 09/01/30 ^{(a),(b)}		257,387
USD	190,000	2.63% due 09/23/31 ^{(a),(b)}		161,218
		Global Payments, Inc.		
USD	350,000	3.20% due 08/15/29 ^(a)		317,202
		Goldman Sachs Group, Inc.		
GBP	163,000	1.00% due 12/16/25 ^{(a),(c)}		199,077
USD	40,000	1.43% due 03/09/27 ^{(a),(c)}		36,884
USD	420,000	2.62% due 04/22/32 ^{(a),(c)}		352,552
USD	200,000	2.64% due 02/24/28 ^{(a),(c)}		185,402
USD	320,000	3.50% due 11/16/26 ^(a)		308,126
USD	250,000	3.81% due 04/23/29 ^{(a),(c)}		237,342
GBP	200,000	4.25% due 01/29/26		252,377
		Gray Oak Pipeline LLC		
USD	80,000	2.60% due 10/15/25 ^{(a),(b)}		75,825
		HCA, Inc.		
USD	250,000	2.38% due 07/15/31 ^(a)		205,992
USD	240,000	4.50% due 02/15/27 ^(a)		237,172
USD	150,000	5.50% due 06/01/33 ^(a)		152,355
		Hyundai Capital America		
USD	200,000	1.30% due 01/08/26 ^(a)		184,646
USD	250,000	2.38% due 10/15/27 ^{(a),(b)}		225,162
		ITC Holdings Corp.		
USD	440,000	2.95% due 05/14/30 ^{(a),(b)}		386,616
USD	210,000	3.35% due 11/15/27 ^(a)		199,164
		Kinder Morgan, Inc.		
USD	50,000	3.60% due 02/15/51 ^(a)		35,727
		Kraft Heinz Foods Co.		
USD	150,000	4.88% due 10/01/49 ^(a)		142,127
		Lowe's Cos, Inc.		
USD	155,000	3.70% due 04/15/46 ^(a)		122,292
USD	65,000	4.05% due 05/03/47 ^(a)		53,483

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)		
		UNITED STATES (47.4%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (42.2%) (continued)		
USD	100,000	Merck & Co., Inc. 4.50% due 05/17/33 ^(a)	\$	100,739
USD	370,000	MetLife, Inc. 4.55% due 03/23/30 ^(a)		372,084
EUR	150,000	Morgan Stanley 0.41% due 10/29/27 ^{(a),(c)}		151,989
EUR	230,000	1.88% due 04/27/27		242,091
USD	220,000	2.48% due 09/16/36 ^{(a),(c)}		174,369
USD	250,000	2.51% due 10/20/32 ^{(a),(c)}		207,010
USD	250,000	3.62% due 04/01/31 ^{(a),(c)}		230,307
USD	60,000	5.12% due 02/01/29 ^{(a),(c)}		60,273
USD	150,000	Netflix, Inc. 5.38% due 11/15/29 ^(b)		154,968
USD	200,000	New York Life Insurance Co. 3.75% due 05/15/50 ^{(a),(b)}		159,931
USD	115,000	NiSource, Inc. 5.80% due 02/01/42 ^(a)		113,852
USD	150,000	Oracle Corp. 2.30% due 03/25/28 ^(a)		136,675
USD	145,000	3.60% due 04/01/50 ^(a)		107,402
USD	150,000	3.95% due 03/25/51 ^(a)		117,460
USD	190,000	O'Reilly Automotive, Inc. 1.75% due 03/15/31 ^(a)		153,956
USD	115,000	Philip Morris International, Inc. 4.13% due 03/04/43		97,207
USD	100,000	Phillips 66 Co. 3.15% due 12/15/29 ^(a)		91,477
USD	400,000	Roche Holdings, Inc. 2.08% due 12/13/31 ^{(a),(b)}		336,774
USD	200,000	2.61% due 12/13/51 ^{(a),(b)}		134,455
USD	120,000	Roper Technologies, Inc. 2.95% due 09/15/29 ^(a)		109,950
USD	120,000	RTX Corp. 4.13% due 11/16/28 ^(a)		117,237
USD	80,000	4.35% due 04/15/47 ^(a)		69,564
USD	85,000	4.45% due 11/16/38 ^(a)		78,166
USD	100,000	S&P Global, Inc. 2.90% due 03/01/32 ^(a)		89,258
USD	100,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 4.50% due 05/15/30 ^(a)		97,727
USD	70,000	SES GLOBAL Americas Holdings, Inc. 5.30% due 03/25/44 ^(b)		54,589
USD	41,000	Southern California Edison Co. 3.60% due 02/01/45 ^(a)		31,848
USD	100,000	Southern Power Co. 5.15% due 09/15/41		94,572
USD	60,000	Southwestern Electric Power Co. 3.90% due 04/01/45 ^(a)		46,155
USD	200,000	Stellantis Finance US, Inc. 1.71% due 01/29/27 ^{(a),(b)}		181,621
USD	100,000	Take-Two Interactive Software, Inc. 4.00% due 04/14/32 ^(a)		94,959

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		FIXED INCOME SECURITIES (96.6%) (continued)		
		UNITED STATES (47.4%) (continued)		
		CORPORATE BONDS & NOTES (42.2%) (continued)		
		Time Warner Cable LLC		
USD	210,000	5.50% due 09/01/41 ^(a)	\$	181,668
		T-Mobile USA, Inc.		
USD	200,000	2.63% due 02/15/29 ^(a)		180,055
USD	150,000	3.38% due 04/15/29 ^(a)		139,365
USD	435,000	3.88% due 04/15/30 ^(a)		412,511
USD	30,000	4.50% due 04/15/50 ^(a)		26,506
		UDR, Inc.		
USD	100,000	3.00% due 08/15/31 ^(a)		88,340
		Union Electric Co.		
USD	65,000	3.50% due 03/15/29 ^(a)		61,534
		United Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust		
USD	157,184	3.45% due 07/07/28		140,137
		United Airlines 2016-1 Class AA Pass Through Trust		
USD	167,434	3.10% due 07/07/28		152,635
		United Airlines 2018-1 Class AA Pass Through Trust		
USD	53,168	3.50% due 03/01/30		48,423
		UnitedHealth Group, Inc.		
USD	150,000	2.30% due 05/15/31 ^(a)		129,978
		Walt Disney Co.		
USD	200,000	2.65% due 01/13/31		177,949
		Warnermedia Holdings, Inc.		
USD	300,000	4.28% due 03/15/32 ^(a)		274,561
		Welltower OP LLC		
GBP	100,000	4.50% due 12/01/34 ^(a)		120,366
		Zoetis, Inc.		
USD	100,000	4.70% due 02/01/43 ^(a)		95,639
		TOTAL CORPORATE BONDS & NOTES		21,592,229
		GOVERNMENT BONDS (5.2%)		
		U.S. Treasury Bond		
USD	1,720,000	3.63% due 02/15/53		1,588,313
USD	180,000	4.75% due 11/15/53		201,853
		U.S. Treasury Note		
USD	810,000	4.50% due 11/15/33		850,373
		TOTAL GOVERNMENT BONDS		2,640,539
		TOTAL UNITED STATES (Cost \$25,880,886)		24,232,768
		TOTAL FIXED INCOME SECURITIES (Cost \$51,509,118)		49,366,909
		SHORT-TERM INVESTMENTS (1.4%)		
		CANADA (0.0%) ^(a)		
		TIME DEPOSIT (0.0%) ^(a)		
		Royal Bank of Canada		
CAD	8,475	3.79% due 01/02/24		6,396
		TOTAL TIME DEPOSIT (Cost \$6,396)		6,396
		TOTAL CANADA (Cost \$6,396)		6,396

(2023年12月31日現在)

	元本金額	銘柄名		公正価値
		SHORT-TERM INVESTMENTS (1.4%) (continued)		
		FRANCE (0.0%) ^(e)		
		TIME DEPOSITS (0.0%) ^(e)		
CHF	13	BNP Paribas S.A. 0.55% due 01/03/24	\$	16
AUD	22,443	2.77% due 01/02/24		15,294
		TOTAL TIME DEPOSITS (Cost \$15,310)		15,310
		TOTAL FRANCE (Cost \$15,310)		15,310
		JAPAN (0.0%) ^(e)		
		TIME DEPOSIT (0.0%) ^(e)		
JPY	145	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ, Ltd. (0.34)% due 01/04/24 ^(f)		1
		TOTAL TIME DEPOSIT (Cost \$1)		1
		TOTAL JAPAN (Cost \$1)		1
		NORWAY (0.0%) ^(e)		
		TIME DEPOSIT (0.0%) ^(e)		
EUR	11,224	DNB Bank ASA 2.71% due 01/02/24		12,391
		TOTAL TIME DEPOSIT (Cost \$12,391)		12,391
		TOTAL NORWAY (Cost \$12,391)		12,391
		UNITED KINGDOM (0.0%) ^(e)		
		TIME DEPOSIT (0.0%) ^(e)		
GBP	2,625	Barclays Bank PLC 4.16% due 01/02/24		3,345
		TOTAL TIME DEPOSIT (Cost \$3,345)		3,345
		TOTAL UNITED KINGDOM (Cost \$3,345)		3,345
		UNITED STATES (1.4%)		
		TIME DEPOSIT (1.4%)		
USD	681,732	JPMorgan Chase & Co. 4.58% due 01/02/24		681,732
		TOTAL TIME DEPOSIT (Cost \$681,732)		681,732
		TOTAL UNITED STATES (Cost \$681,732)		681,732
		TOTAL SHORT-TERM INVESTMENTS (Cost \$719,175)		719,175
		TOTAL INVESTMENTS (Cost \$52,228,293)	98.0%	\$ 50,086,084
		CASH AND OTHER ASSETS IN EXCESS OF LIABILITIES	2.0	1,040,116
		NET ASSETS	100.0%	\$ 51,126,200

^(a) Callable security.

^(b) 144A Security - Security exempt from registration under Rule 144A of the Securities Act of 1933. These securities may be resold in transactions exempt from registration, typically to qualified institutional buyers. Unless otherwise indicated, these securities are not considered illiquid.

^(c) Variable or floating rate security as of December 31, 2023.

^(d) Investment is perpetual and, thus, does not have a predetermined maturity date. The date shown reflects the next call date.

^(e) A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than 0.05%.

^(f) Due to deposit rate cuts by the central Bank of Japan, interest rates for Japanese Yen-denominated short-term investments may be less than zero percent.

(2023年12月31日現在)

先物取引

ポジション	銘柄	限月	想定元本	契約	未実現 評価損益
Short	Euro-Bobl Future	03/2024	\$ 520,678	(4)	\$ (6,039)
Short	Euro-Bund Future	03/2024	147,212	(1)	(4,272)
Short	Euro-Bux1 30 Year Bond Future	03/2024	1,010,777	(7)	(84,386)
Short	US 5 Year Note Future	03/2024	642,094	(6)	(10,547)
					\$ (105,244)

ファンド レベルでの為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
CAD	Royal Bank of Canada	202,682	01/03/2024	USD	148,030	\$ 4,931	\$ -	\$ 4,931
EUR	Royal Bank of Canada	198,293	01/03/2024	USD	216,373	2,533	-	2,533
EUR	Toronto Dominion Bank	32,319	01/03/2024	USD	34,853	826	-	826
EUR	Toronto Dominion Bank	173,163	01/03/2024	USD	187,660	3,503	-	3,503
EUR	Toronto Dominion Bank	413,266	01/03/2024	USD	445,877	10,348	-	10,348
EUR	Toronto Dominion Bank	217,056	01/03/2024	USD	234,254	5,365	-	5,365
GBP	Toronto Dominion Bank	19,555	01/03/2024	USD	24,581	345	-	345
JPY	Royal Bank of Canada	50,310,000	01/04/2024	USD	346,079	10,786	-	10,786
USD	Royal Bank of Canada	437,167	01/03/2024	GBP	346,199	-	(4,116)	(4,116)
USD	Toronto Dominion Bank	720,810	01/03/2024	AUD	1,089,953	-	(21,939)	(21,939)
USD	Toronto Dominion Bank	102,284	01/03/2024	EUR	93,007	-	(391)	(391)
USD	Toronto Dominion Bank	14,628,318	01/03/2024	EUR	13,363,725	-	(124,568)	(124,568)
USD	Toronto Dominion Bank	129,133	01/03/2024	EUR	118,632	-	(1,832)	(1,832)
USD	Toronto Dominion Bank	141,345	01/03/2024	EUR	130,867	-	(3,125)	(3,125)
USD	Toronto Dominion Bank	84,716	01/03/2024	EUR	76,962	-	(246)	(246)
USD	Toronto Dominion Bank	92,923	01/03/2024	EUR	84,658	-	(535)	(535)
USD	Toronto Dominion Bank	92,921	01/03/2024	EUR	84,976	-	(889)	(889)
USD	Toronto Dominion Bank	190,962	01/03/2024	GBP	151,757	-	(2,474)	(2,474)
USD	Toronto Dominion Bank	84,345	01/03/2024	GBP	66,591	-	(534)	(534)
USD	Toronto Dominion Bank	87,753	01/03/2024	GBP	69,822	-	(1,246)	(1,246)
USD	Toronto Dominion Bank	885,937	01/03/2024	CAD	1,204,793	-	(23,307)	(23,307)
USD	Toronto Dominion Bank	75,802	01/03/2024	CAD	102,635	-	(1,655)	(1,655)
USD	Toronto Dominion Bank	2,988,259	01/03/2024	GBP	2,361,662	-	(22,033)	(22,033)
USD	Royal Bank of Canada	346,658	01/04/2024	JPY	50,310,000	-	(10,207)	(10,207)
USD	Royal Bank of Canada	78,157	02/05/2024	AUD	114,487	51	-	51
USD	Royal Bank of Canada	742,163	02/05/2024	AUD	1,089,953	-	(1,434)	(1,434)
USD	Toronto Dominion Bank	3,790,677	02/05/2024	GBP	2,976,475	-	(4,018)	(4,018)
USD	Toronto Dominion Bank	14,325,372	02/05/2024	EUR	12,918,729	43,716	-	43,716
USD	Toronto Dominion Bank	84,210	02/05/2024	EUR	76,208	-	(39)	(39)
USD	Toronto Dominion Bank	834,198	02/05/2024	CAD	1,104,747	60	-	60
						\$ 82,464	\$ (224,588)	\$ (142,124)

J P Yクラスにおける為替予約取引

取得	取引相手	契約額	決済日	売却	契約額	未実現 評価益	未実現 評価損	未実現 評価損益 (純額)
JPY	Citibank N.A.	3,027,291,600	01/04/2024	USD	20,457,739	\$ 1,015,797	\$ -	\$ 1,015,797
JPY	Citibank N.A.	70,996,776	01/04/2024	USD	480,912	22,690	-	22,690
JPY	Citibank N.A.	2,970,879,160	02/02/2024	USD	20,938,651	234,155	-	234,155
JPY	Citibank N.A.	167,456,217	02/02/2024	USD	1,183,973	9,451	-	9,451
USD	Citibank N.A.	20,938,651	01/04/2024	JPY	2,984,802,530	-	(233,497)	(233,497)
USD	Citibank N.A.	798,743	01/04/2024	JPY	113,485,846	-	(6,248)	(6,248)
						\$ 1,282,093	\$ (239,745)	\$ 1,042,348

(2023年12月31日現在)

デリバティブ取引の額

取引相手	デリバティブ 資産の額	デリバティブ 負債の額	受取担保金*	差入担保金*	純額**
店頭デリバティブ					
為替予約					
Citibank N.A.	\$ 1,282,093	\$ (239,745)	\$ -	\$ -	1,042,348
Royal Bank of Canada	18,301	(15,757)	-	-	2,544
Toronto Dominion Bank	64,163	(208,831)	-	-	(144,668)
マスターネットティング契約の対象 となるデリバティブ合計	<u>\$ 1,364,557</u>	<u>\$ (464,333)</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>900,224</u>
投資資産における 店頭デリバティブ合計	<u>\$ 1,364,557</u>	<u>\$ (464,333)</u>			

* Actual collateral received or pledged, if any, may be more than disclosed in the table above.

** Net represents the receivable/(payable) that would be due from/(to) the counterparty in an event of default. Netting is allowed across transactions traded under the same legal agreement with the same legal entity.

通貨略称

AUD	-	Australian Dollar
CAD	-	Canadian Dollar
CHF	-	Swiss Franc
EUR	-	Euro
GBP	-	British Pound
JPY	-	Japanese Yen
USD	-	United States Dollar

マネー・プール マザーファンド

《第30期》決算日2024年7月16日

[計算期間：2024年1月16日～2024年7月16日]

「マネー・プール マザーファンド」は、7月16日に第30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30期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の公社債に投資し、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		債組入比率	債券率	債先物比率	純総資産額
		期騰	落中率				
	円		%	%	%		百万円
26期(2022年7月14日)	10,039		△0.0	—	—		48
27期(2023年1月16日)	10,036		△0.0	—	—		47
28期(2023年7月14日)	10,035		△0.0	—	—		141
29期(2024年1月15日)	10,034		△0.0	—	—		52
30期(2024年7月16日)	10,038		0.0	73.4	—		27

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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	騰落率		債組入比率	債券率	債先物比率	債券率
		騰	落中率				
(期首)	円		%	%	%		%
2024年1月15日	10,034		—	—	—		—
1月末	10,034		0.0	—	—		—
2月末	10,034		0.0	—	—		—
3月末	10,034		0.0	—	—		—
4月末	10,037		0.0		76.2		—
5月末	10,037		0.0		80.3		—
6月末	10,038		0.0		73.4		—
(期末)							
2024年7月16日	10,038		0.0		73.4		—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

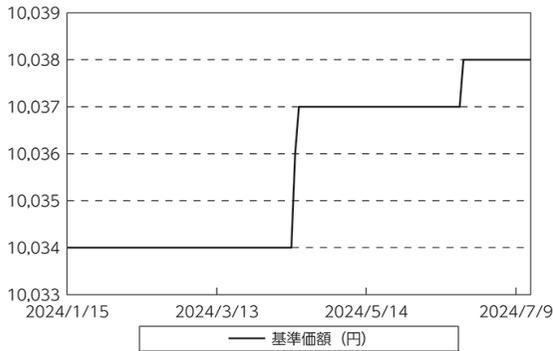
○運用経過

●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0.04%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

利子等収益が積み上がったことが基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

◎国内短期金融市場

無担保コール翌日物金利は0%を下回る水準で推移していたものの、2024年3月に日銀がマイナス金利政策を解除したことにより、期間末には0%を上回りました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。

○今後の運用方針

日銀による金融市場調節方針の下、短期金利は低位安定した推移を想定しています。以上の見通しにより、コール・ローン等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2024年1月16日～2024年7月16日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2024年1月16日～2024年7月16日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 1,259,772	千円 1,239,774

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 1,099,978	千円 1,099,980

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2024年1月16日～2024年7月16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

(2024年7月16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
国債証券	千円 20,000 (20,000)	千円 19,999 (19,999)	% 73.4 (73.4)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 73.4 (73.4)
合 計	20,000 (20,000)	19,999 (19,999)	73.4 (73.4)	— (—)	— (—)	— (—)	73.4 (73.4)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(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		末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第1227回国庫短期証券※	—	20,000	19,999	—
合 計		20,000	19,999	

(注) ※印は現先で保有している債券です。

○投資信託財産の構成

(2024年7月16日現在)

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公社債	千円 19,999	% 73.4	千円 19,999	% 73.4
コール・ローン等、その他	7,251	26.6	7,251	26.6
投資信託財産総額	27,250	100.0	27,250	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年7月16日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	27,250,592
コール・ローン等	7,250,780
公社債(評価額)	19,999,800
未収利息	12
(B) 負債	7
未払解約金	7
(C) 純資産総額(A-B)	27,250,585
元本	27,147,403
次期繰越損益金	103,182
(D) 受益権総口数	27,147,403口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,038円

<注記事項>

- ①期首元本額 52,747,529円
期中追加設定元本額 202,090,171円
期中一部解約元本額 227,690,297円
また、1口当たり純資産額は、期末1.0038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)

マナー・プール・ファンドVI	22,405,492円
トレンド・アロケーション・オープン	997,308円
米国エネルギーMLPオープン(毎月決算型) 為替ヘッジなし	996,215円
米国エネルギーMLPオープン(毎月決算型) 為替ヘッジあり	996,215円
米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月決算型)	769,078円
米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) ブラジル・リアルコース(毎月決算型)	220,146円
米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) 円コース(毎月決算型)	125,062円
米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) 米ドルコース(毎月決算型)	119,857円
世界投資適格債オープン(為替ヘッジあり)(毎月決算型)	99,661円
国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) 円コース(毎月決算型)	99,602円
国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) 為替ヘッジなしコース(毎月決算型)	99,602円
国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) インド・ルピーコース(毎月決算型)	99,602円
国際 アジア・リート・ファンド(通貨選択型) インドネシア・ルピアコース(毎月決算型)	99,602円
米国ハイ・イールド債オープン(通貨選択型) トルコ・リラコース(毎月決算型)	19,961円
合計	27,147,403円

○損益の状況 (2024年1月16日～2024年7月16日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	9,259
受取利息	10,003
支払利息	△ 744
(B) 当期損益金(A)	9,259
(C) 前期繰越損益金	180,435
(D) 追加信託差損益金	691,263
(E) 解約差損益金	△777,775
(F) 計(B+C+D+E)	103,182
次期繰越損益金(F)	103,182

(注) (D)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) (E)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。